

DCダイワ日本株式インデックス

追加型投信／国内／株式／インデックス型

※課税上は株式投資信託として取扱われます。

投資信託説明書(請求目論見書)

2017年2月22日

本文書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

本文書にかかる「DCダイワ日本株式インデックス」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により、有価証券届出書を平成29年2月21日に関東財務局長に提出しており、平成29年2月22日にその届出の効力が生じております。

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 岩本 信之
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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当ありません。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

第一部 証券情報

(1) ファンドの名称

DC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也没有。

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

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

(3) 発行（売出）価額の総額

5,000億円を上限とします。

(4) 発行（売出）価格

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせるにより知ることができます。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

① 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）

② 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。）が課されません。

③ 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29年2月22日から平成30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

- ① 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。
- ② 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します。
- ③ 委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。
- ④ 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。
- ⑤ 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。

⑥ 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、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なうことを基本とします。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 ()	
		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 ファンド	
中小型株	年4回	欧州		
債券	年6回 (隔月)	アジア		TOPIX
一般	年12回 (毎月)	オセアニア		
公債	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ()
社債	その他 ()	アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ()		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))				
資産複合 ()				
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。

<信託金の限度額>

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

<ファンドの特色>

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

- 東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。
 - (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^(注)を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるTOPIXへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。

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

■ 東証株価指数（TOPIX）について

◆ 東証株価指数（TOPIX）とは

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

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

◆ 東証株価指数（TOPIX）の特徴

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

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

（注1） TOPIXの算出方法：

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

（注2） 基準時の時価総額の修正方法：

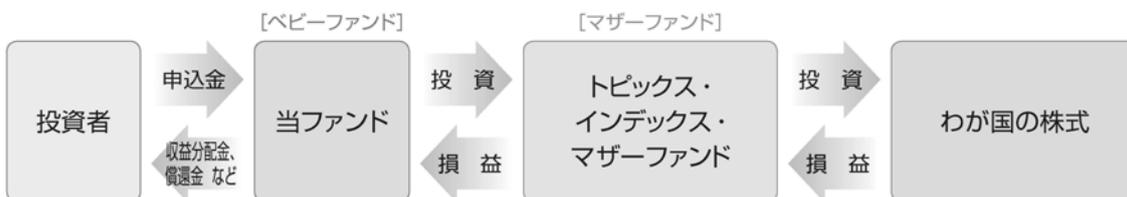
$$\text{修正後の基準時価総額} = \text{修正前日の基準時価総額} \times (\text{修正前日の時価総額} \pm \text{修正額}) \div \text{修正前日の時価総額}$$

- ① TOPIXの指数値および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」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用など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します。
- 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なうことができます。
- 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ありません。
- 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ありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 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ありません。
- 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いません。
- 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ありません。
- 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、責任を有しません。

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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



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

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

2

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

3

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

〈分配方針〉

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、配当等収益等を中心に分配します。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、東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行いません。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
- ・ 運用管理費用（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 15 年 1 月 27 日 信託契約締結、当初設定、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	<p>販売会社</p> <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>①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③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>
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）
委託会社	<p>大和証券投資信託委託株式会社</p> <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>①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など</p>
↓運用指図 ↑↓※2	損益↑↓信託金（※3）
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社</p> <p>信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など</p>
	損益↑↓投資
投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。） など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

（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経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

◎委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

< 委託会社の概況（平成 28 年 12 月末日現在） >

- ・ 資本金の額 151 億 7,427 万 2,500 円
- ・ 沿革
 - 昭和34年12月12日 設立登記
 - 昭和35年 2月17日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
 - 昭和35年 4月 1日 営業開始
 - 昭和60年11月 8日 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
 - 平成 7年 5月31日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
 - 平成 7年 9月14日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
 - 平成19年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第 29 条の登録を受けたものとみなされる。
(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第 352 号)
- ・ 大株主の状況

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

2 投資方針

(1) 投資方針

① 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。

② 投資態度

- イ. 投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
 - ロ. 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
 - ハ. 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ニ. 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、<ファンドの特色>をご参照下さい。

(2) 投資対象

- ① 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)②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6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

② 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マザーファンドの受益証券、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

③ 委託会社は、信託金を、前②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

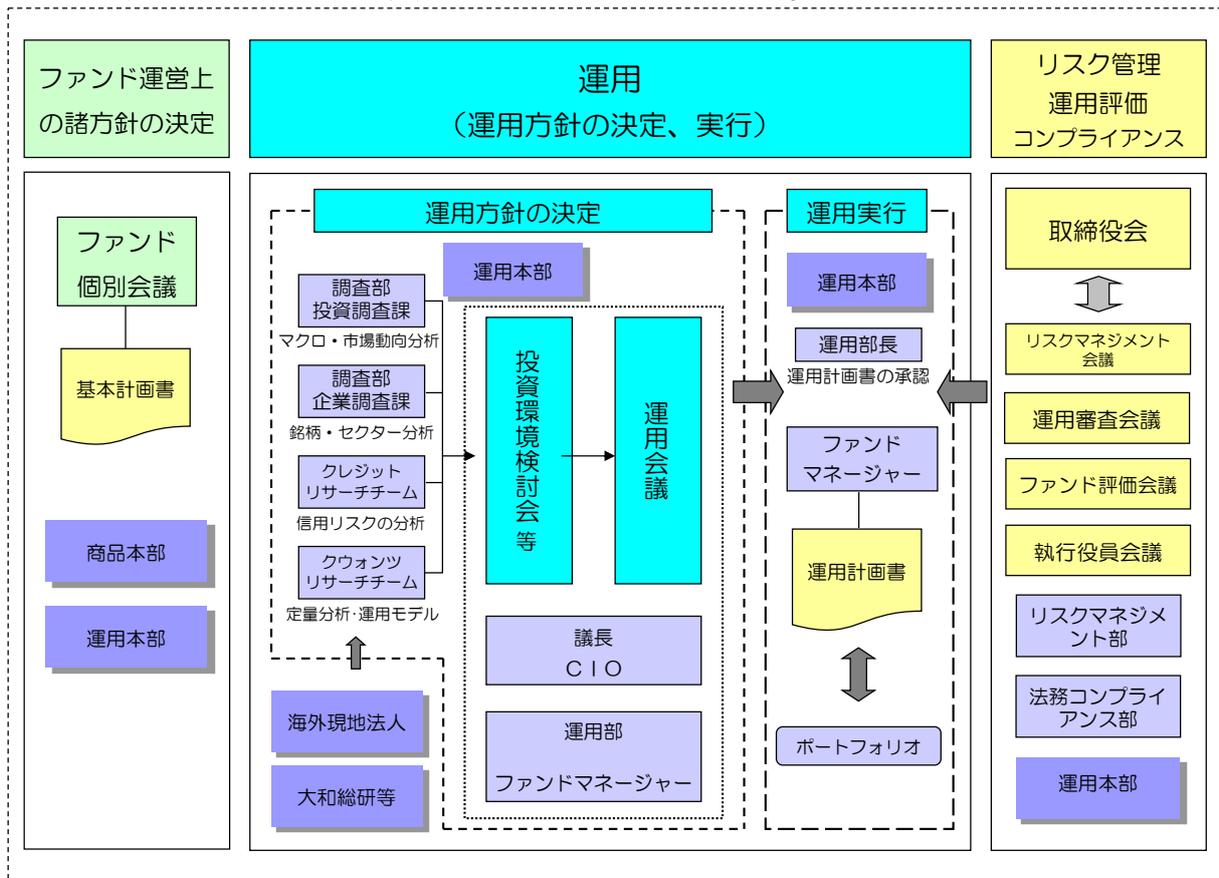
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(3) 運用体制

① 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。



② 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 CIO (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

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

ニ. 運用計画書の作成・承認

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

③ 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. CIO (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. Deputy-CIO (0~5名程度)
CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。
- ハ. インベストメント・オフィサー (0~5名程度)
CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。
- ニ. 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。
- ホ. 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。
- ④ ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議
次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。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30~40名程度です。
- イ. ファンド評価会議
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。
- ロ. 運用審査会議
経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。
- ハ. リスクマネジメント会議
経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。
- ニ. 執行役員会議
経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。
- ⑤ 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28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

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、配当等収益等を中心に分配します。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。
- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 投資制限

- ① 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。
- ② 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。)

③ デリバティブ取引等(信託約款)

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

④ 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。

⑤ 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より支弁します。

<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

① 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。

② 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す。

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す。

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

① 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。
 - ② 委託会社は、信託金を、前①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せん。）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
- ① 株式への投資には、制限を設けません。
 - ② 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。

① 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。

② 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。

③ その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

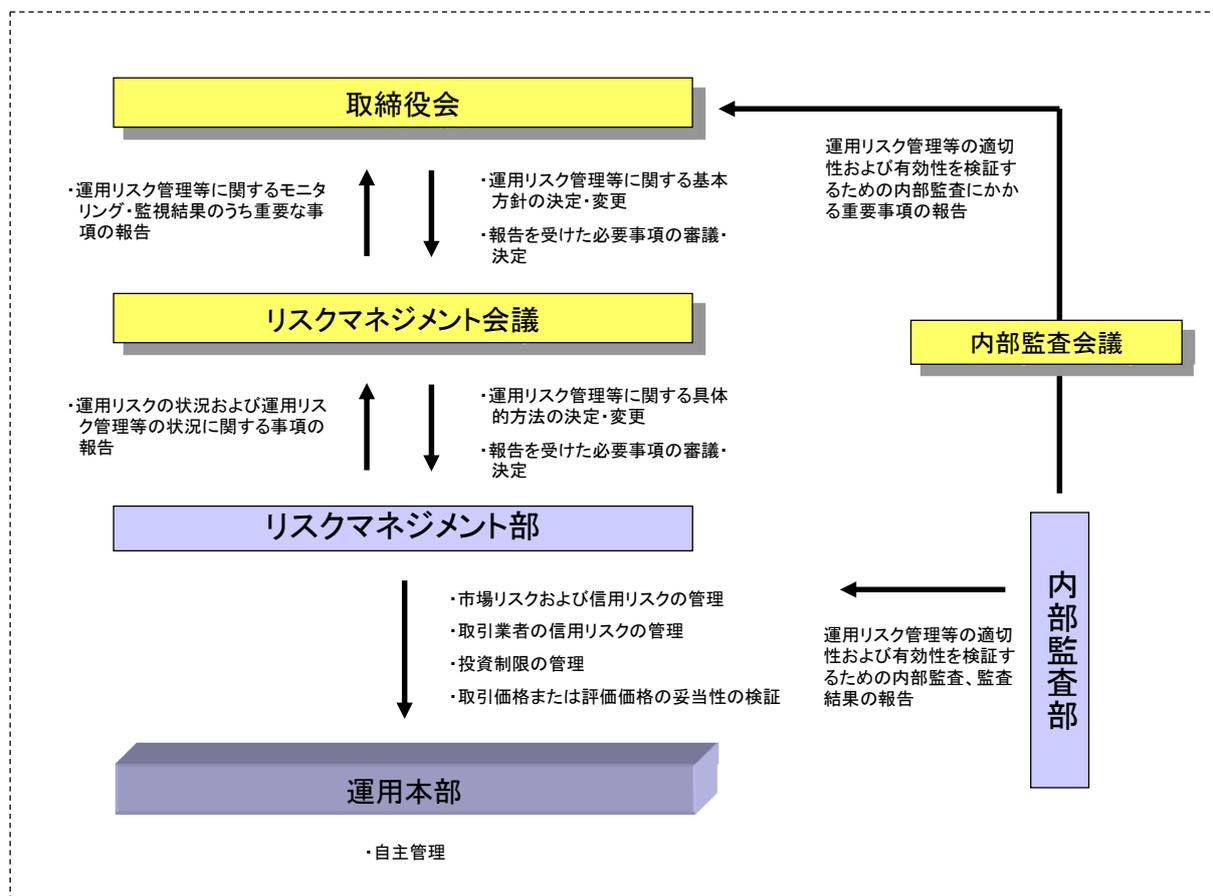
(3) その他の留意点

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

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映することができないことについては、＜ファンドの特色＞の「●基準価額の動きに関する留意点」をご参照下さい。

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



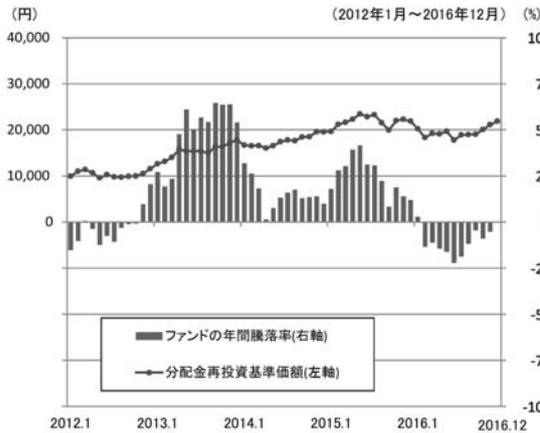
※ 流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

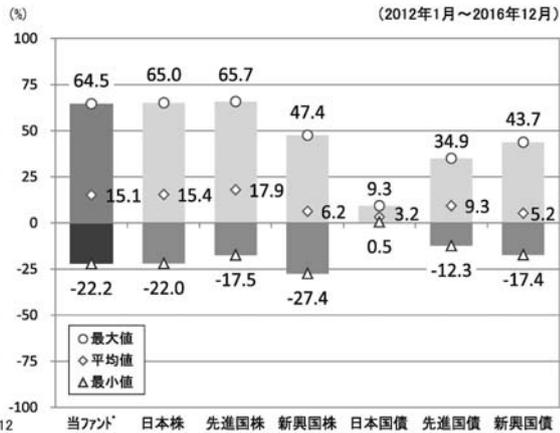
参 考 情 報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、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たものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
 日本国債：NOMURA-BPI国債
 先進国債：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 手数料等及び税金

(1) 申込手数料

- ① 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ことで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）

- ② 申込手数料には、消費税等が課されます。
- ③ 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

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3) 信託報酬等

- ① 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0.6696%（税抜0.62%）以内（有価証券届出書提出日現在、年率0.27%（税抜0.25%））を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。
- ② 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。
- ③ 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（有価証券届出書提出日現在）。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.09% （税抜）	年率0.12% （税抜）	年率0.04% （税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

- ④ 前③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。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) その他の手数料等

- ① 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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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および信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5) 課税上の取扱い

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ. 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税 15%および地方税 5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。ただし、平成 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、税率は 20.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%および地方税 5%）となります。

ロ. 解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税 15%および地方税 5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成 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、税率は 20.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%および地方税 5%）となります。

ハ. 損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差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および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後 3 年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。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および償還差損との相殺が可能となります。

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

<注1>個別元本について

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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

- ① 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。
- ② 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28年12月末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 28 年 12 月 30 日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	57,833,814,266	100.00
内 日本	57,833,814,266	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	572,129	0.00
純資産総額	57,834,386,395	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 28 年 12 月 30 日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファン ド	日本	親投資信 託受益証 券	62,536,563,870	0.8938 55,896,170,063	0.9248 57,833,814,266	100.00

(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	100.00%
合計	100.00%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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

① 純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第5計算期間末 (平成19年11月30日)	29,645,315,404	29,645,315,404	1.8739	1.8739
第6計算期間末 (平成20年12月1日)	18,874,822,660	18,874,822,660	1.0302	1.0302
第7計算期間末 (平成21年11月30日)	22,197,411,154	22,197,411,154	1.0622	1.0622
第8計算期間末 (平成22年11月30日)	25,555,883,098	25,555,883,098	1.1084	1.1084
第9計算期間末 (平成23年11月30日)	24,177,954,974	24,177,954,974	0.9573	0.9573
第10計算期間末 (平成24年11月30日)	28,164,446,865	28,164,446,865	1.0494	1.0494
第11計算期間末 (平成25年12月2日)	45,294,346,724	45,294,346,724	1.7181	1.7181
第12計算期間末 (平成26年12月1日)	50,829,621,260	50,829,621,260	1.9730	1.9730
第13計算期間末 (平成27年11月30日)	57,404,914,294	57,404,914,294	2.2302	2.2302
平成27年12月末日	56,993,960,673	—	2.1861	—
平成28年1月末日	53,714,453,489	—	2.0231	—
2月末日	48,829,277,813	—	1.8332	—
3月末日	51,639,987,750	—	1.9206	—
4月末日	50,972,431,109	—	1.9102	—
5月末日	52,875,489,282	—	1.9670	—
6月末日	48,018,976,432	—	1.7780	—
7月末日	51,042,996,755	—	1.8879	—
8月末日	51,536,106,815	—	1.8971	—
9月末日	51,870,992,248	—	1.9026	—
10月末日	54,687,040,303	—	2.0029	—
第14計算期間末 (平成28年11月30日)	57,003,477,005	57,003,477,005	2.1126	2.1126
12月末日	57,834,386,395	—	2.1856	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第5 計算期間	0.0000
第6 計算期間	0.0000
第7 計算期間	0.0000
第8 計算期間	0.0000
第9 計算期間	0.0000
第10 計算期間	0.0000
第11 計算期間	0.0000
第12 計算期間	0.0000
第13 計算期間	0.0000
第14 計算期間	0.0000

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第5 計算期間	△3.4
第6 計算期間	△45.0
第7 計算期間	3.1
第8 計算期間	4.3
第9 計算期間	△13.6
第10 計算期間	9.6
第11 計算期間	63.7
第12 計算期間	14.8
第13 計算期間	13.0
第14 計算期間	△5.3

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第5 計算期間	5,972,227,138	3,807,712,359
第6 計算期間	5,922,146,388	3,420,994,077
第7 計算期間	5,428,627,508	2,851,557,801
第8 計算期間	5,084,050,851	2,924,597,492
第9 計算期間	5,987,607,804	3,789,251,109
第10 計算期間	5,522,945,007	3,939,767,684
第11 計算期間	8,883,287,293	9,359,729,031
第12 計算期間	6,645,370,985	7,245,362,528
第13 計算期間	7,715,628,600	7,738,797,562
第14 計算期間	6,667,631,688	5,423,871,842

(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

(1) 投資状況 (平成 28 年 12 月 30 日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	125,687,468,790	99.35
内 日本	125,687,468,790	99.35
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	822,219,580	0.65
純資産総額	126,509,688,370	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)	728,640,000	0.58
内 日本	728,640,000	0.58

(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 28 年 12 月 30 日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	689,900	5,952.00 4,106,284,800	6,878.00 4,745,132,200	3.75
2	三菱 UFJ フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,246,500	515.40 2,188,646,100	720.20 3,058,329,300	2.42
3	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	449,400	4,615.81 2,074,345,603	4,912.00 2,207,452,800	1.74
4	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	448,500	3,438.06 1,541,971,484	4,460.00 2,000,310,000	1.58
5	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	252,200	6,477.00 1,633,499,400	7,765.00 1,958,333,000	1.55
6	本田技研	日本	株式	輸送用機器	510,600	2,963.92 1,513,381,548	3,415.00 1,743,699,000	1.38
7	KDDI	日本	株式	情報・通信業	554,100	3,067.86 1,699,906,080	2,959.50 1,639,858,950	1.30
8	みずほフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	7,597,700	174.20 1,323,519,340	209.80 1,593,997,460	1.26

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
9	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	352,300	3,966.41 1,397,369,231	3,844.00 1,354,241,200	1.07
10	ソニー	日本	株式	電気機器	400,600	3,319.85 1,329,934,030	3,275.00 1,311,965,000	1.04
11	ファナック	日本	株式	電気機器	57,500	16,950.87 974,675,134	19,815.00 1,139,362,500	0.90
12	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	418,500	2,559.68 1,071,227,864	2,663.00 1,114,465,500	0.88
13	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	109,800	9,004.05 988,645,030	10,100.00 1,108,980,000	0.88
14	東京海上HD	日本	株式	保険業	226,600	3,899.81 883,698,811	4,796.00 1,086,773,600	0.86
15	武田薬品	日本	株式	医薬品	222,600	4,644.00 1,033,754,400	4,835.00 1,076,271,000	0.85
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	421,000	2,125.91 895,011,534	2,490.00 1,048,290,000	0.83
17	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	234,400	4,545.31 1,065,421,837	4,453.00 1,043,783,200	0.83
18	キーエンス	日本	株式	電気機器	12,900	73,460.00 947,634,000	80,200.00 1,034,580,000	0.82
19	キヤノン	日本	株式	電気機器	304,500	2,904.21 884,331,947	3,295.00 1,003,327,500	0.79
20	三菱電機	日本	株式	電気機器	605,000	1,254.95 759,245,320	1,629.50 985,847,500	0.78
21	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	607,200	1,569.50 953,000,400	1,623.50 985,789,200	0.78
22	三菱地所	日本	株式	不動産業	417,000	1,875.65 782,146,550	2,327.50 970,567,500	0.77
23	信越化学	日本	株式	化学	106,700	7,037.67 750,920,156	9,067.00 967,448,900	0.76
24	村田製作所	日本	株式	電気機器	59,600	13,356.88 796,070,316	15,650.00 932,740,000	0.74
25	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	47,200	17,465.00 824,348,000	19,230.00 907,656,000	0.72
26	日立	日本	株式	電気機器	1,360,000	473.40 643,824,000	632.00 859,520,000	0.68
27	任天堂	日本	株式	その他製品	35,000	27,305.70 955,699,500	24,540.00 858,900,000	0.68
28	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	200,500	3,631.85 728,186,515	4,214.00 844,907,000	0.67
29	富士重工業	日本	株式	輸送用機器	176,300	3,818.70 673,238,420	4,772.00 841,303,600	0.67
30	花王	日本	株式	化学	151,300	5,658.51 856,133,705	5,541.00 838,353,300	0.66

(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	99.35%
合計	99.35%

(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	0.11%
鉱業	0.36%
建設業	3.03%
食料品	4.44%
繊維製品	0.71%
パルプ・紙	0.23%
化学	6.49%
医薬品	4.75%
石油・石炭製品	0.51%
ゴム製品	0.91%
ガラス・土石製品	0.95%
鉄鋼	1.27%
非鉄金属	0.90%
金属製品	0.69%
機械	4.96%
電気機器	12.25%
輸送用機器	9.71%
精密機器	1.55%
その他製品	1.79%
電気・ガス業	1.89%
陸運業	4.29%
海運業	0.22%
空運業	0.54%
倉庫・運輸関連業	0.21%
情報・通信業	7.66%
卸売業	4.34%
小売業	4.73%
銀行業	8.46%
証券、商品先物取引業	1.22%
保険業	2.60%
その他金融業	1.30%
不動産業	2.61%
サービス業	3.66%
合計	99.35%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX 先物 2017 年 3 月	買建	48	740,110,920	728,640,000	0.58%

(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。

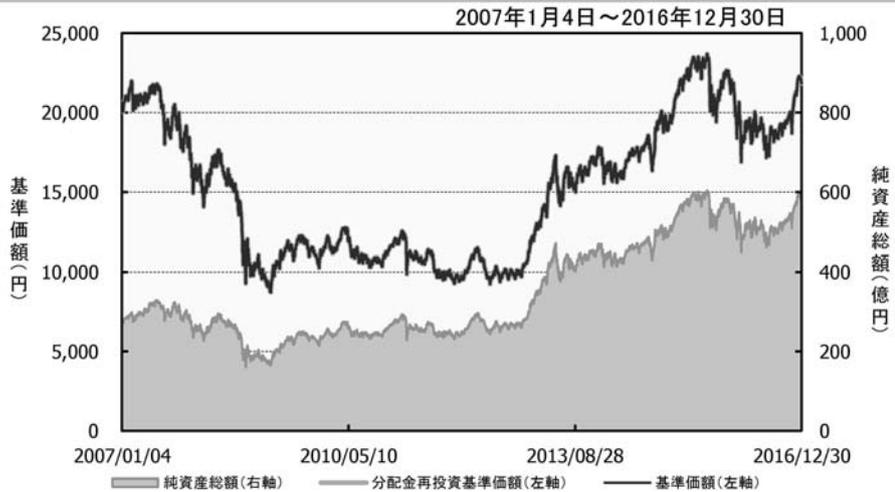
(参考情報) 運用実績

2016年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	21,856円
純資産総額	578億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.5%
3カ月間	14.9%
6カ月間	22.9%
1年間	-0.0%
3年間	22.9%
5年間	127.9%
設定来	118.6%



※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運用管理費用(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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円						設定来分配金合計額: 0円					
	第3期 05年11月	第4期 06年11月	第5期 07年11月	第6期 08年12月	第7期 09年11月	第8期 10年11月	第9期 11年11月	第10期 12年11月	第11期 13年12月	第12期 14年12月	第13期 15年11月	第14期 16年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	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。

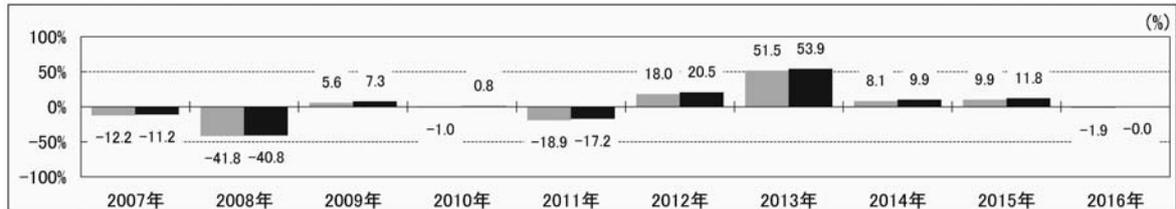
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,500	99.3%	電気機器	12.2%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.8%
国内株式先物	1	0.6%	輸送用機器	9.7%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.4%
不動産投資信託等	-	-	銀行業	8.5%	日本電信電話	情報・通信業	1.7%
コール・ローン、その他	-	0.7%	情報・通信業	7.7%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.6%
合計	1,501	-	化学	6.5%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.5%
株式市場・上場別構成		比率	機械	5.0%	本田技研	輸送用機器	1.4%
一部(東証・名証)		99.3%	医薬品	4.8%	KDDI	情報・通信業	1.3%
二部(東証・名証)		-	小売業	4.7%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.3%
新興市場他		-	食料品	4.4%	日本たばこ産業	食料品	1.1%
その他		-	その他	35.9%	ソニー	電気機器	1.0%
合計		99.3%	合計	99.3%	合計		17.1%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■ベンチマーク ■ファンド



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

・2016年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

第2 管理及び運営

1 申込（販売）手続等

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

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

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

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

2 換金（解約）手続等

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

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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。

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、

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により知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求

を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、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い合わせることにより知ることができます。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)①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。

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

① 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、②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。

② 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。

③ 反対者の買取請求権

前①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②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②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。

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、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。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤ 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。

⑥ 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。

① 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。

② 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ます。）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。

③ 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14期計算期間（平成27年12月1日から平成28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。

独立監査人の監査報告書

平成 29 年 1 月 13 日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士
業務執行社員

貞廣篤典 

指定有限責任社員 公認会計士
業務執行社員

小林 英之 

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 DC ダイワ日本株式インデックスの平成 27 年 12 月 1 日から平成 28 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、DC ダイワ日本株式インデックスの平成 28 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

1 財務諸表

DCダイワ日本株式インデックス

(1) 貸借対照表

	第13期	第14期
	平成27年11月30日現在	平成28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	176,478,415	334,925,860
親投資信託受益証券	57,404,352,143	57,002,913,152
未収入金	30,923,000	—
流動資産合計	57,611,753,558	57,337,839,012
資産合計	57,611,753,558	57,337,839,012
負債の部		
流動負債		
未払解約金	129,216,621	263,799,667
未払受託者報酬	12,246,826	11,113,826
未払委託者報酬	64,296,008	58,347,809
その他未払費用	1,079,809	1,100,705
流動負債合計	206,839,264	334,362,007
負債合計	206,839,264	334,362,007
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	25,739,339,340	26,983,099,186
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	31,665,574,954	30,020,377,819
(分配準備積立金)	15,563,345,881	12,708,101,427
元本等合計	57,404,914,294	57,003,477,005
純資産合計	57,404,914,294	57,003,477,005
負債純資産合計	57,611,753,558	57,337,839,012

(2) 損益及び剰余金計算書

	第13期	第14期
	自平成26年12月2日 至平成27年11月30日	自平成27年12月1日 至平成28年11月30日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	79,180	10,993
有価証券売買等損益	6,836,518,625	△2,704,208,991
営業収益合計	6,836,597,805	△2,704,197,998
営業費用		
支払利息	—	29,952
受託者報酬	23,860,670	22,347,703
委託者報酬	125,268,894	117,325,843
その他費用	2,153,246	2,157,653
営業費用合計	151,282,810	141,861,151
営業利益又は営業損失(△)	6,685,314,995	△2,846,059,149
経常利益又は経常損失(△)	6,685,314,995	△2,846,059,149
当期純利益又は当期純損失(△)	6,685,314,995	△2,846,059,149
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(△)	1,301,109,830	△1,396,623,674
期首剰余金又は期首欠損金(△)	25,067,112,958	31,665,574,954
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,902,464,716	6,282,603,810
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	8,902,464,716	6,282,603,810
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,688,207,885	6,478,365,470
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	7,688,207,885	6,478,365,470
分配金 ※1	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	31,665,574,954	30,020,377,819

(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 14 期	
	自 平成 27 年 12 月 1 日 至 平成 28 年 11 月 30 日	
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 13 期	第 14 期
	平成 27 年 11 月 30 日現在	平成 28 年 11 月 30 日現在
1. ※1 期首元本額	25,762,508,302 円	25,739,339,340 円
期中追加設定元本額	7,715,628,600 円	6,667,631,688 円
期中一部解約元本額	7,738,797,562 円	5,423,871,842 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	25,739,339,340 口	26,983,099,186 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 13 期	第 14 期
	自 平成 26 年 12 月 2 日 至 平成 27 年 11 月 30 日	自 平成 27 年 12 月 1 日 至 平成 28 年 11 月 30 日
※1 分配金の計算過程	<p>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 (73,631 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 (5,384,131,534 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (18,538,521,467 円) 及び分配準備積立金 (10,179,140,716 円) より分配対象額は 34,101,867,348 円 (1 万口当たり 13,248.93 円) であり、分配を行っておりません。</p>	<p>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 (23,041,604,868 円) 及び分配準備積立金 (12,708,101,427 円) より分配対象額は 35,749,706,295 円 (1 万口当たり 13,248.93 円) であり、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 14 期	
	自 平成 27 年 12 月 1 日 至 平成 28 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等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。	
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。	

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 14 期	
	平成 28 年 11 月 30 日現在	
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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 13 期	第 14 期
	平成 27 年 11 月 30 日現在	平成 28 年 11 月 30 日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	6,348,185,056	△2,155,261,411
合計	6,348,185,056	△2,155,261,411

(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13期 平成27年11月30日現在	第14期 平成28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14期 自 平成27年12月1日 至 平成28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13期 平成27年11月30日現在	第14期 平成28年11月30日現在
1口当たり純資産額	2,2302円	2,1126円
(1万口当たり純資産額)	(22,302円)	(21,126円)

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	63,783,051,530	57,002,913,152	
親投資信託受益証券	合計		57,002,913,152	
合計			57,002,913,152	

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。

「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27年11月30日現在	平成28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	3,147,726,099	3,916,751,366
株式 ※3※4	131,197,269,060	124,953,943,460
派生商品評価勘定	81,594,183	97,126,795
未収入金	300,304,490	167,906,640
未収配当金	660,850,866	712,518,080
未収利息	—	331,370
その他未収収益 ※5	14,767,385	14,507,257
流動資産合計	135,402,512,083	129,863,084,968
資産合計	135,402,512,083	129,863,084,968
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,715,396	—
前受金	85,705,000	90,505,000
未払金	—	129,912,360
未払解約金	180,292,000	254,683,100
未払利息	61,555	—
受入担保金	2,739,805,530	3,158,133,625
流動負債合計	3,009,579,481	3,633,234,085
負債合計	3,009,579,481	3,633,234,085
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	140,709,507,157	141,237,185,956
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△8,316,574,555	△15,007,335,073
元本等合計	132,392,932,602	126,229,850,883
純資産合計	132,392,932,602	126,229,850,883
負債純資産合計	135,402,512,083	129,863,084,968

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 27 年 12 月 1 日 至 平成 28 年 11 月 30 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成 27 年 11 月 30 日現在	平成 28 年 11 月 30 日現在
1. ※1 期首	平成 26 年 12 月 2 日	平成 27 年 12 月 1 日
期首元本額	156,429,196,684 円	140,709,507,157 円
期中追加設定元本額	11,811,404,364 円	15,352,397,205 円
期中一部解約元本額	27,531,093,891 円	14,824,718,406 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	1,617,325,422 円	1,610,341,359 円
トピックス・インデックスファンド	5,759,733,101 円	5,648,730,568 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	16,707,119,660 円	13,687,983,821 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	168,688,902 円	126,646,485 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	194,943,748 円	141,686,038 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	3,001,554,339 円	2,353,118,777 円
ダイワ国際分散バランスファ	130,280,454 円	109,845,953 円

ンド30VA(一般投資家私募)		
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	4,148,883,429円	3,368,030,339円
D-I's TOPIXインデックス	33,524,767円	33,491,212円
為替ヘッジ付米国債プラス日本株式ファンド	－円	27,594,657円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	－円	593,766円
iFree TOPIXインデックス	－円	111,764,976円
iFree 8資産バランス	－円	68,977,995円
DCダイワ日本株式インデックス	61,010,045,853円	63,783,051,530円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,858,797,670円	2,368,199,277円
ダイワ・ライフ・バランス50	2,014,704,231円	2,389,384,337円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,915,630,247円	2,140,568,498円
年金ダイワ日本株式インデックス	3,490,362,889円	3,836,869,470円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	22,797,202円	23,808,674円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	50,793,788円	61,017,840円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,007,790円	12,636,946円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	1,441,372円	448,097円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	3,254,423円	440,730円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)	5,937,998円	941,908円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	65,615,632円	63,672,333円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	361,268,786円	353,729,673円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA(国内株式型)	181,226,317円	196,965,786円
ダイワ世界バランスファンド40VA	1,558,534,214円	1,442,476,447円
ダイワ世界バランスファンド60VA	229,342,532円	229,813,057円
ダイワ・バランスファンド35VA	15,530,969,176円	14,465,411,230円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	409,871,701円	384,828,380円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	703,533,678円	659,950,624円

	ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	1,239,069,922 円	1,178,011,578 円
	ダイワ国内バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	197,613,241 円	182,365,011 円
	ダイワ国内バランスファンド30VA (適格機関投資家専用)	308,115,317 円	313,206,367 円
	ダイワ・ノーロード TOPIXファンド	—円	45,419,513 円
	ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	—円	1,350,529,038 円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	687,128,241 円	1,024,916,082 円
	ダイワライフスタイル25	190,099,286 円	206,988,834 円
	ダイワライフスタイル50	597,223,153 円	678,795,303 円
	ダイワライフスタイル75	465,107,454 円	513,159,508 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)	15,838,961,222 円	16,040,773,939 円
	計	140,709,507,157 円	141,237,185,956 円
2.	期末日における受益権の総数	140,709,507,157 口	141,237,185,956 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8,316,574,555 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15,007,335,073 円であります。
4.	※3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 2,594,940,450 円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 3,009,650,890 円
5.	※4 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 765,700,000 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。 株式 664,900,000 円
6.	※5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分14,105,650 円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分13,416,400 円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成 27 年 12 月 1 日 至 平成 28 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等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成 28 年 11 月 30 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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 27 年 11 月 30 日現在	平成 28 年 11 月 30 日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に 含まれた評価差額 (円)
株式	12,572,725,549	12,782,821,308
合計	12,572,725,549	12,782,821,308

(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 27 年 9 月 25 日から平成 27 年 11 月 30 日まで、及び平成 28 年 9 月 21 日から平成 28 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 27 年 11 月 30 日 現在				平成 28 年 11 月 30 日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,187,395,000	—	1,265,600,000	78,205,000	1,082,030,000	—	1,179,200,000	97,170,000
合計	1,187,395,000	—	1,265,600,000	78,205,000	1,082,030,000	—	1,179,200,000	97,170,000

(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 27 年 11 月 30 日現在	平成 28 年 11 月 30 日現在
1口当たり純資産額	0.9409 円	0.8937 円
(1万口当たり純資産額)	(9,409 円)	(8,937 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	3,200	2,703.00	8,649,600	
日本水産	85,500	514.00	43,947,000	
マルハニチロ	12,400	2,910.00	36,084,000	
カネコ種苗	3,900	1,464.00	5,709,600	
サカタのタネ	9,700	2,994.00	29,041,800	貸付株式数 2,700株
ホクト	6,600	2,009.00	13,259,400	
ショーボンドHD	6,800	5,130.00	34,884,000	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
ミライト・ホールディングス	20,300	1,095.00	22,228,500	
タマホーム	10,100	548.00	5,534,800	
日鉄鉱業	2,000	5,230.00	10,460,000	
三井松島	6,200	1,324.00	8,208,800	
国際石油開発帝石	344,700	1,085.00	373,999,500	
日本海洋掘削	2,600	2,375.00	6,175,000	貸付株式数 700株 (700株)
石油資源開発	10,000	2,327.00	23,270,000	
K&Oエナジーグループ	4,700	1,701.00	7,994,700	
安藤・間	47,400	803.00	38,062,200	
東急建設	23,700	938.00	22,230,600	
コムシスホールディングス	25,200	1,955.00	49,266,000	
ミサワホーム	8,900	1,009.00	8,980,100	
高松コンストラクションGP	4,900	2,539.00	12,441,100	
東建コーポレーション	2,700	7,920.00	21,384,000	貸付株式数 700株
大成建設	333,000	828.00	275,724,000	
大林組	196,300	1,088.00	213,574,400	
清水建設	201,000	1,054.00	211,854,000	貸付株式数 56,000株 (56,000株)
飛島建設	68,900	194.00	13,366,600	貸付株式数 15,900株 (15,900株)
長谷工コーポレーション	76,200	1,184.00	90,220,800	
松井建設	8,200	1,104.00	9,052,800	
鹿島建設	288,000	802.00	230,976,000	
不動テトラ	57,600	213.00	12,268,800	貸付株式数 14,700株
鉄建建設	43,000	351.00	15,093,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
西松建設	76,000	562.00	42,712,000	
三井住友建設	253,000	127.00	32,131,000	
大豊建設	25,000	574.00	14,350,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
前田建設	40,000	1,065.00	42,600,000	
奥村組	52,000	666.00	34,632,000	
東鉄工業	8,000	3,040.00	24,320,000	
浅沼組	25,000	341.00	8,525,000	

戸田建設	76,000	641.00	48,716,000	
熊谷組	104,000	294.00	30,576,000	
北野建設	27,000	312.00	8,424,000	
三井ホーム	12,000	466.00	5,592,000	
矢作建設	9,700	990.00	9,603,000	
ピーエス三菱	16,100	369.00	5,940,900	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
日本ハウスHLDGS	18,400	415.00	7,636,000	貸付株式数 3,100株
大東建託	24,000	17,775.00	426,600,000	
新日本建設	8,200	967.00	7,929,400	
NIPPPO	14,000	2,189.00	30,646,000	
東亜道路	25,000	317.00	7,925,000	
前田道路	20,000	1,968.00	39,360,000	
日本道路	21,000	441.00	9,261,000	
東亜建設	5,500	1,906.00	10,483,000	
若築建設	57,000	163.00	9,291,000	
東洋建設	21,100	413.00	8,714,300	
五洋建設	72,400	561.00	40,616,400	
大林道路	8,100	706.00	5,718,600	
世紀東急	14,300	510.00	7,293,000	
福田組	11,000	1,156.00	12,716,000	
住友林業	44,700	1,565.00	69,955,500	
日本基礎技術	13,700	336.00	4,603,200	
日成ビルド工業	21,000	538.00	11,298,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
パナホーム	24,000	812.00	19,488,000	
大和ハウス	193,100	3,252.00	627,961,200	
ライト工業	12,800	1,270.00	16,256,000	
積水ハウス	204,800	1,870.00	382,976,000	
ユアテック	11,000	776.00	8,536,000	
西部電気工業	3,200	2,066.00	6,611,200	
中電工	7,800	2,305.00	17,979,000	
関電工	26,000	1,065.00	27,690,000	
きんでん	43,000	1,443.00	62,049,000	
東京エネシス	7,000	953.00	6,671,000	
トーエネック	10,000	533.00	5,330,000	
住友電設	4,800	1,221.00	5,860,800	
日本電設工業	10,600	1,849.00	19,599,400	
協和エクシオ	25,400	1,618.00	41,097,200	
日本工営	22,000	498.00	10,956,000	
九電工	12,800	3,210.00	41,088,000	貸付株式数 3,400株 (3,400株)
三機工業	14,700	959.00	14,097,300	
日揮	60,600	1,888.00	114,412,800	
中外炉工業	30,000	208.00	6,240,000	
太平電業	9,000	1,109.00	9,981,000	
高砂熱学	17,900	1,525.00	27,297,500	
NECネットスエスアイ	6,100	2,069.00	12,620,900	
明星工業	13,500	549.00	7,411,500	
大気社	8,500	2,822.00	23,987,000	

ダイダン	10,000	940.00	9,400,000	
日比谷総合設備	7,600	1,642.00	12,479,200	
東芝プラントシステム	10,400	1,714.00	17,825,600	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
日本製粉	19,100	1,546.00	29,528,600	
日清製粉G本社	71,300	1,603.00	114,293,900	
昭和産業	26,000	588.00	15,288,000	
中部飼料	8,400	1,034.00	8,685,600	
フィード・ワン	48,300	152.00	7,341,600	
日本甜菜糖	4,100	2,225.00	9,122,500	
三井製糖	4,500	2,375.00	10,687,500	
塩水港精糖	22,700	242.00	5,493,400	
日新製糖	3,400	1,601.00	5,443,400	
ネクスト	15,900	801.00	12,735,900	貸付株式数 5,200株 (5,200株)
ジェイエイシーリクルートメント	4,300	1,315.00	5,654,500	
日本M&Aセンター	17,700	3,120.00	55,224,000	
アコーディア・ゴルフ	18,900	1,199.00	22,661,100	
タケエイ	6,800	897.00	6,099,600	貸付株式数 1,900株
トラスト・テック	3,300	1,505.00	4,966,500	
パソナグループ	6,100	772.00	4,709,200	貸付株式数 1,800株 (1,300株)
CDS	8,000	1,011.00	8,088,000	
リンクアンドモチベーション	17,300	393.00	6,798,900	
GCA	6,400	919.00	5,881,600	貸付株式数 1,800株
エス・エム・エス	8,500	2,858.00	24,293,000	
テンプホールディングス	47,400	1,762.00	83,518,800	
リニカル	4,100	1,309.00	5,366,900	
クックパッド	14,200	1,026.00	14,569,200	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
森永製菓	12,900	4,525.00	58,372,500	貸付株式数 3,400株 (3,400株)
中村屋	2,100	4,770.00	10,017,000	
江崎グリコ	16,400	5,350.00	87,740,000	
不二家	39,000	215.00	8,385,000	
山崎製パン	48,000	2,269.00	108,912,000	貸付株式数 13,500株 (8,200株)
モロゾフ	19,000	456.00	8,664,000	
亀田製菓	3,800	5,250.00	19,950,000	
寿スピリッツ	5,000	2,632.00	13,160,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
カルビー	26,700	3,565.00	95,185,500	貸付株式数 6,600株
森永乳業	59,000	784.00	46,256,000	
六甲バター	3,200	2,532.00	8,102,400	貸付株式数 800株
ヤクルト	35,100	5,020.00	176,202,000	貸付株式数 9,600株
明治ホールディングス	38,800	9,120.00	353,856,000	
雪印メグミルク	14,200	3,200.00	45,440,000	
プリマハム	42,000	398.00	16,716,000	
日本ハム	44,000	2,946.00	129,624,000	

丸大食品	32,000	472.00	15,104,000	
S F o o d s	3,700	2,703.00	10,001,100	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
伊藤ハム米久HLDGS	38,300	998.00	38,223,400	
スタジオアリス	2,900	2,302.00	6,675,800	
シミックホールディングス	4,000	1,501.00	6,004,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
システナ	5,100	1,620.00	8,262,000	
デジタルアーツ	2,900	2,443.00	7,084,700	
新日鉄住金SOL	9,700	2,173.00	21,078,100	
総合警備保障	22,200	4,655.00	103,341,000	
いちご	55,000	437.00	24,035,000	貸付株式数 17,000株 (17,000株)
日本駐車場開発	74,100	164.00	12,152,400	貸付株式数 21,800株 (21,700株)
カカクコム	44,100	1,795.00	79,159,500	貸付株式数 12,300株 (12,300株)
ルネサンス	4,700	1,430.00	6,721,000	
ディップ	8,100	2,403.00	19,464,300	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
SBSホールディングス	6,600	899.00	5,933,400	
オプトホールディング	7,700	713.00	5,490,100	
新日本科学	7,700	586.00	4,512,200	
ツクイ	16,000	717.00	11,472,000	貸付株式数 4,500株 (4,500株)
エムスリー	53,300	2,953.00	157,394,900	
アウトソーシング	3,300	3,625.00	11,962,500	貸付株式数 900株 (100株)
ウェルネット	5,400	1,301.00	7,025,400	貸付株式数 1,600株
ディー・エヌ・エー	27,500	3,485.00	95,837,500	
博報堂DYHLDGS	84,500	1,328.00	112,216,000	
ぐるなび	9,000	2,426.00	21,834,000	
エスアールジータカミヤ	8,500	656.00	5,576,000	
ジャパンベストレスキューS	20,300	258.00	5,237,400	
ファンコミュニケーションズ	15,800	751.00	11,865,800	貸付株式数 4,400株 (300株)
ティア	9,900	618.00	6,118,200	
インフォマート	13,500	1,164.00	15,714,000	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
サッポロホールディングス	21,100	3,010.00	63,511,000	
アサヒグループホールディン	122,600	3,722.00	456,317,200	
麒麟HD	281,700	1,863.50	524,947,950	
宝ホールディングス	46,900	1,041.00	48,822,900	
オエノンホールディングス	29,000	257.00	7,453,000	
コカ・コーラウエスト	22,100	3,240.00	71,604,000	
コカ・コーライーストジャパン	25,500	2,417.00	61,633,500	
サントリー食品インター	44,900	4,895.00	219,785,500	
ダイドードリンコ	2,900	5,650.00	16,385,000	
伊藤園	19,400	3,780.00	73,332,000	
キーコーヒー	6,300	2,088.00	13,154,400	

日清オイリオグループ	37,000	487.00	18,019,000		
不二製油グループ	17,400	2,158.00	37,549,200	貸付株式数	4,800株
J-オイルミルズ	3,100	3,730.00	11,563,000		
ローソン	20,000	7,920.00	158,400,000	貸付株式数	6,100株 (6,100株)
サンエー	4,400	5,510.00	24,244,000		
カワチ薬品	4,700	2,693.00	12,657,100		
エービーシー・マート	10,500	6,710.00	70,455,000	貸付株式数	2,100株
ハードオフコーポレーション	4,400	1,153.00	5,073,200		
アスクル	7,100	4,115.00	29,216,500	貸付株式数	400株 (400株)
ゲオホールディングス	9,400	1,238.00	11,637,200	貸付株式数	2,700株
アダストリア	8,900	3,230.00	28,747,000		
くらコーポレーション	3,800	4,900.00	18,620,000		
キャンドウ	4,300	1,779.00	7,649,700	貸付株式数	1,300株
エレマテック	2,600	1,847.00	4,802,200		
パルグループHLDGS	3,200	2,968.00	9,497,600	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
エディオン	21,300	1,099.00	23,408,700	貸付株式数	8,800株
あらた	2,900	2,414.00	7,000,600		
サーラコーポレーション	8,800	630.00	5,544,000		
ワッツ	6,900	1,046.00	7,217,400		
ハローズ	2,100	2,364.00	4,964,400		
J Pホールディングス	21,800	264.00	5,755,200	貸付株式数	6,100株 (2,000株)
あみやき亭	1,600	3,965.00	6,344,000		
ひらまつ	10,700	620.00	6,634,000	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
フィールズ	4,700	1,350.00	6,345,000		
双日	335,700	290.00	97,353,000		
ゲンキー	1,200	5,630.00	6,756,000	貸付株式数	300株 (100株)
アルフレッサホールディングス	67,800	1,823.00	123,599,400		
大黒天物産	1,500	4,910.00	7,365,000		
ハニーズ	6,000	1,188.00	7,128,000	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
キッコーマン	46,000	3,500.00	161,000,000	貸付株式数	12,000株
味の素	134,600	2,212.50	297,802,500		
キューピー	33,500	2,703.00	90,550,500		
ハウス食品G本社	23,900	2,294.00	54,826,600		
カゴメ	23,400	2,687.00	62,875,800	貸付株式数	6,400株 (6,400株)
アリアケジャパン	5,400	5,720.00	30,888,000		
ニチレイ	32,300	2,315.00	74,774,500		
横浜冷凍	14,700	1,040.00	15,288,000	貸付株式数	200株 (200株)
東洋水産	31,900	4,050.00	129,195,000		
日清食品HD	25,500	5,960.00	151,980,000		
永谷園ホールディングス	7,000	1,340.00	9,380,000		

フジッコ	6,600	2,342.00	15,457,200	
ロックフィールド	7,600	1,438.00	10,928,800	
日本たばこ産業	361,900	3,946.00	1,428,057,400	
ケンコーマヨネーズ	2,600	3,220.00	8,372,000	
わらべや日洋HD	4,100	2,404.00	9,856,400	
ユーグレナ	21,300	1,284.00	27,349,200	貸付株式数 5,900株 (5,800株)
片倉工業	8,100	1,279.00	10,359,900	
グンゼ	44,000	378.00	16,632,000	
ヒューリック	120,100	1,074.00	128,987,400	
山下医科器械	3,300	1,705.00	5,626,500	
アルペン	4,800	2,211.00	10,612,800	
クオール	6,900	1,464.00	10,101,600	
アルコニックス	5,200	1,594.00	8,288,800	
神戸物産	3,200	3,025.00	9,680,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
ジェイアイエヌ	4,000	4,795.00	19,180,000	貸付株式数 1,100株 (1,000株)
ビックカメラ	32,700	1,014.00	33,157,800	
DCMホールディングス	32,800	1,033.00	33,882,400	貸付株式数 7,800株 (7,800株)
MonotaRO	20,500	2,443.00	50,081,500	貸付株式数 5,700株
あいホールディングス	10,500	2,513.00	26,386,500	貸付株式数 2,900株
ディービーエックス	3,700	1,380.00	5,106,000	
アークランドサービスHD	2,100	2,903.00	6,096,300	貸付株式数 600株
J. フロントリテイリング	72,700	1,612.00	117,192,400	
ドトール・日レスHD	9,900	2,127.00	21,057,300	
マツモトキヨシHLDGS	10,800	5,460.00	58,968,000	
ブロンコビリー	3,300	3,045.00	10,048,500	貸付株式数 900株 (900株)
スタートトゥデイ	52,900	1,757.00	92,945,300	
物語コーポレーション	1,800	4,410.00	7,938,000	
ココカラファイン	6,100	4,190.00	25,559,000	
三越伊勢丹HD	114,300	1,261.00	144,132,300	
東洋紡	240,000	172.00	41,280,000	
ユニチカ	173,000	86.00	14,878,000	
富士紡ホールディングス	3,200	3,565.00	11,408,000	
日清紡ホールディングス	31,500	1,108.00	34,902,000	
倉敷紡績	61,000	231.00	14,091,000	
ダイワボウHD	49,000	301.00	14,749,000	
シキボウ	66,000	139.00	9,174,000	
日東紡績	50,000	445.00	22,250,000	
トヨタ紡織	20,500	2,601.00	53,320,500	
マクニカ・富士エレHLDGS	10,500	1,360.00	14,280,000	
ウエルシアHD	5,800	7,130.00	41,354,000	
クリエイトSDH	8,700	2,427.00	21,114,900	
バイタルKSKHD	10,600	963.00	10,207,800	
UKCホールディングス	4,200	2,094.00	8,794,800	
丸善CHI HD	13,100	371.00	4,860,100	

TOKAIホールディングス	25,200	754.00	19,000,800	貸付株式数	7,400株
三洋貿易	5,000	1,535.00	7,675,000		
チムニー	2,000	2,881.00	5,762,000		
ウイン・パートナーズ	3,000	1,851.00	5,553,000		
ジョイフル本田	9,200	3,215.00	29,578,000	貸付株式数	1,800株
鳥貴族	1,600	2,497.00	3,995,200		
すかいらく	24,600	1,600.00	39,360,000		
綿半ホールディングス	3,300	1,578.00	5,207,400		
日本毛織	16,800	800.00	13,440,000		
ダイドーリミテッド	18,800	404.00	7,595,200		
ユナイテッド・スーパーマーケ	18,800	938.00	17,634,400		
野村不動産HLDGS	37,600	1,852.00	69,635,200		
三重交通グループHD	12,000	393.00	4,716,000		
サムティ	5,600	1,065.00	5,964,000		
日本商業開発	3,600	1,925.00	6,930,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
プレサンスコーポレーション	9,500	1,427.00	13,556,500		
ユニゾホールディングス	4,900	3,265.00	15,998,500		
日本管理センター	4,700	1,379.00	6,481,300	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
フージャースHD	11,100	607.00	6,737,700		
オープンハウス	8,500	2,828.00	24,038,000		
東急不動産HD	137,100	655.00	89,800,500		
飯田GHD	47,800	2,218.00	106,020,400		
帝国繊維	6,600	1,637.00	10,804,200		
ブックオフコーポレーション	8,800	800.00	7,040,000		
日本コークス工業	66,900	100.00	6,690,000		
あさひ	4,900	1,259.00	6,169,100	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
日本調剤	2,100	4,435.00	9,313,500	貸付株式数	400株
コスモス薬品	2,900	20,930.00	60,697,000	貸付株式数	800株 (800株)
シップヘルスケアHD	10,900	2,987.00	32,558,300		
一六堂	22,400	371.00	8,310,400		
ソフトクリエイトHD	5,800	1,368.00	7,934,400		
セブン&アイ・HLDGS	240,900	4,435.00	1,068,391,500		
薬王堂	3,300	2,214.00	7,306,200		
クリエイト・レストランツ・ホール	15,600	1,007.00	15,709,200		
ツルハホールディングス	13,300	11,680.00	155,344,000		
サンマルクホールディングス	3,700	3,540.00	13,098,000		
トリドールホールディングス	7,200	2,475.00	17,820,000		
帝人	49,100	2,118.00	103,993,800		
東レ	442,000	929.40	410,794,800		
クラレ	101,300	1,618.00	163,903,400		
旭化成	381,000	1,017.50	387,667,500		
サカイオーベックス	2,800	1,775.00	4,970,000		
稲葉製作所	4,800	1,328.00	6,374,400		
宮地エンジニアリングG	32,000	204.00	6,528,000		
トーカロ	4,400	2,477.00	10,898,800		

SUMCO	63,900	1,253.00	80,066,700	貸付株式数	17,900株 (13,600株)
川田テクノロジーズ	1,400	6,700.00	9,380,000	貸付株式数	300株 (300株)
住江織物	22,000	243.00	5,346,000		
アツギ	74,000	121.00	8,954,000		
コメダホールディングス	7,700	1,728.00	13,305,600		
ダイユー・リックHLDGS	9,500	671.00	6,374,500		
クスリのアオキHLDGS	5,300	4,865.00	25,784,500		
共和レザー	6,200	795.00	4,929,000		
セーレン	15,600	1,466.00	22,869,600		
ソトー	6,100	1,181.00	7,204,100		
東海染工	53,000	134.00	7,102,000		
小松精練	11,900	669.00	7,961,100		
ワコールホールディングス	35,000	1,327.00	46,445,000		
ホギメディカル	3,900	6,720.00	26,208,000		
T S Iホールディングス	24,800	657.00	16,293,600		
T I S	19,200	2,405.00	46,176,000		
電算システム	3,100	1,788.00	5,542,800	貸付株式数	700株 (700株)
グリーン	36,500	608.00	22,192,000		
コーエーテクモHD	13,800	1,915.00	26,427,000		
三菱総合研究所	2,500	3,240.00	8,100,000		
ファインデックス	4,800	902.00	4,329,600		
K L a b	12,200	643.00	7,844,600	貸付株式数	700株 (700株)
ポールトゥウィン・ピットクル	5,700	916.00	5,221,200	貸付株式数	1,000株
ネクソン	63,500	1,599.00	101,536,500		
アイスタイル	9,400	746.00	7,012,400	貸付株式数	2,600株 (2,600株)
エイチーム	3,700	2,414.00	8,931,800	貸付株式数	1,200株 (900株)
テクノスジャパン	2,500	2,697.00	6,742,500	貸付株式数	600株
コロプラ	16,400	967.00	15,858,800	貸付株式数	4,500株 (4,500株)
ブロードリーフ	7,900	1,363.00	10,767,700		
ハーツユナイテッドグループ	3,500	1,624.00	5,684,000	貸付株式数	900株
特種東海製紙	3,700	3,995.00	14,781,500		
ティーガイア	5,800	1,707.00	9,900,600	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
豆蔵ホールディングス	5,600	1,005.00	5,628,000		
テクマトリックス	2,500	1,884.00	4,710,000		
ガンホー・オンライン・エンター	122,500	254.00	31,115,000	貸付株式数	37,300株 (28,900株)
GMOペイメントゲートウェイ	4,800	4,710.00	22,608,000	貸付株式数	1,300株
インターネットイニシアティブ	8,800	1,640.00	14,432,000		
さくらインターネット	4,800	954.00	4,579,200	貸付株式数	1,300株
SRAホールディングス	3,500	2,329.00	8,151,500		

朝日ネット	18,500	460.00	8,510,000		
コムチュア	1,500	3,310.00	4,965,000	貸付株式数	400株
王子ホールディングス	232,000	469.00	108,808,000		
日本製紙	26,500	1,978.00	52,417,000		
三菱製紙	11,600	750.00	8,700,000		
北越紀州製紙	32,800	656.00	21,516,800		
中越パルプ	28,000	240.00	6,720,000	貸付株式数	10,000株 (10,000株)
巴川製紙	19,000	254.00	4,826,000		
大王製紙	24,000	1,258.00	30,192,000	貸付株式数	7,500株
gumi	6,700	724.00	4,850,800	貸付株式数	1,900株 (200株)
LINE	9,800	4,410.00	43,218,000	貸付株式数	2,700株 (2,600株)
レンゴー	58,300	677.00	39,469,100		
トーモク	24,000	320.00	7,680,000		
ザ・パックス	4,500	2,589.00	11,650,500		
昭和電工	40,000	1,544.00	61,760,000		
住友化学	447,000	523.00	233,781,000		
日本化成	49,000	150.00	7,350,000		
住友精化	2,600	4,310.00	11,206,000		
日産化学	33,300	3,805.00	126,706,500		
ラサ工業	62,000	131.00	8,122,000		
クレハ	4,500	4,670.00	21,015,000		
テイカ	11,000	617.00	6,787,000		
石原産業	11,800	958.00	11,304,400		
日東エフシー	5,900	889.00	5,245,100		
日本曹達	36,000	496.00	17,856,000		
東ソー	176,000	768.00	135,168,000		
トクヤマ	95,000	449.00	42,655,000		
セントラル硝子	62,000	452.00	28,024,000		
東亜合成	36,400	1,107.00	40,294,800		
大阪ソーダ	27,000	470.00	12,690,000		
関東電化	13,000	950.00	12,350,000	貸付株式数	3,000株
デンカ	124,000	505.00	62,620,000		
イビデン	40,200	1,554.00	62,470,800	貸付株式数	9,700株 (9,700株)
信越化学	109,500	8,460.00	926,370,000		
日本カーバイド	51,000	149.00	7,599,000		
堺化学	22,000	358.00	7,876,000		
エア・ウォーター	49,700	1,955.00	97,163,500		
大陽日酸	47,000	1,252.00	58,844,000		
日本化学工業	26,000	237.00	6,162,000		
日本パーカライジング	30,700	1,324.00	40,646,800		
高压ガス	10,400	714.00	7,425,600		
四国化成	9,000	1,001.00	9,009,000		
戸田工業	16,000	285.00	4,560,000		
ステラケミファ	3,000	3,000.00	9,000,000		
保土谷化学	2,400	2,821.00	6,770,400		
日本触媒	9,500	7,010.00	66,595,000		

大日精化	24,000	607.00	14,568,000	
カネカ	81,000	911.00	73,791,000	
協和発酵キリン	73,200	1,632.00	119,462,400	
三菱瓦斯化学	56,300	1,734.00	97,624,200	
三井化学	276,000	529.00	146,004,000	
J S R	60,400	1,646.00	99,418,400	
東京応化工業	11,500	3,825.00	43,987,500	
大阪有機化学	6,300	809.00	5,096,700	
三菱ケミカルHLDGS	407,000	719.50	292,836,500	
ダイセル	82,400	1,260.00	103,824,000	
住友ベークライト	52,000	617.00	32,084,000	
積水化学	138,200	1,732.00	239,362,400	
日本ゼオン	51,000	1,027.00	52,377,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
アイカ工業	19,000	3,010.00	57,190,000	
宇部興産	300,000	238.00	71,400,000	
積水樹脂	9,500	1,734.00	16,473,000	
タキロン	15,000	503.00	7,545,000	
旭有機材	33,000	217.00	7,161,000	
日立化成	33,500	2,510.00	84,085,000	
ニチバン	7,000	845.00	5,915,000	
リケンテクノス	14,200	549.00	7,795,800	貸付株式数 3,900株
大倉工業	19,000	511.00	9,709,000	
積水化成成品	9,000	801.00	7,209,000	
群栄化学	1,800	3,000.00	5,400,000	
タイガース ポリマー	6,400	671.00	4,294,400	
ダイキョーニシカワ	10,800	1,420.00	15,336,000	
日本化薬	39,000	1,328.00	51,792,000	貸付株式数 10,000株
カーリットホールディングス	13,300	534.00	7,102,200	
E P Sホールディングス	7,900	1,342.00	10,601,800	
プレステージ・インター	9,800	808.00	7,918,400	
アミューズ	3,800	1,636.00	6,216,800	
野村総合研究所	39,100	3,880.00	151,708,000	
ドリームインキュベータ	2,100	2,109.00	4,428,900	貸付株式数 600株 (400株)
クイック	4,400	944.00	4,153,600	
ケネディクス	82,000	422.00	34,604,000	
電通	67,900	5,230.00	355,117,000	
インテージホールディングス	3,700	1,877.00	6,944,900	
イオンファンタジー	1,900	3,155.00	5,994,500	貸付株式数 700株 (700株)
シーティーエス	4,900	1,258.00	6,164,200	
日本精化	8,400	819.00	6,879,600	
扶桑化学工業	4,400	2,542.00	11,184,800	
ADEKA	25,100	1,539.00	38,628,900	
日油	48,000	1,059.00	50,832,000	
ミヨシ油脂	56,000	141.00	7,896,000	
花王	155,300	5,267.00	817,965,100	
第一工業製薬	19,000	353.00	6,707,000	
三洋化成	3,500	4,830.00	16,905,000	

武田薬品	228,700	4,685.00	1,071,459,500	
アステラス製薬	623,600	1,579.50	984,976,200	
大日本住友製薬	42,900	1,869.00	80,180,100	
塩野義製薬	82,700	5,410.00	447,407,000	
田辺三菱製薬	71,000	2,151.00	152,721,000	
あすか製薬	7,100	1,697.00	12,048,700	
日本新薬	14,100	5,320.00	75,012,000	
中外製薬	61,000	3,215.00	196,115,000	
科研製薬	11,400	6,080.00	69,312,000	
エーザイ	75,100	6,609.00	496,335,900	
理研ビタミン	2,000	4,435.00	8,870,000	
ロート製薬	29,600	1,616.00	47,833,600	
小野薬品	139,100	2,533.50	352,409,850	
久光製薬	17,200	5,500.00	94,600,000	貸付株式数 4,800株
持田製薬	4,100	7,950.00	32,595,000	
参天製薬	112,100	1,396.00	156,491,600	
扶桑薬品	2,700	2,762.00	7,457,400	
日本ケミファ	1,300	5,350.00	6,955,000	
ツムラ	20,400	3,095.00	63,138,000	貸付株式数 5,700株
日医工	14,200	1,581.00	22,450,200	
テルモ	89,200	4,025.00	359,030,000	
みらかホールディングス	15,500	5,120.00	79,360,000	
キッセイ薬品工業	10,500	2,685.00	28,192,500	
生化学工業	11,400	1,637.00	18,661,800	
栄研化学	5,100	2,991.00	15,254,100	
日水製薬	4,500	1,200.00	5,400,000	
鳥居薬品	4,300	2,381.00	10,238,300	
JCRファーマ	4,900	2,860.00	14,014,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
東和薬品	2,900	4,125.00	11,962,500	
富士製薬工業	2,300	2,640.00	6,072,000	
沢井製薬	10,200	6,130.00	62,526,000	
ゼリア新薬工業	12,500	1,857.00	23,212,500	
第一三共	179,600	2,382.00	427,807,200	
キョーリン製薬HD	14,400	2,402.00	34,588,800	
大幸薬品	4,100	1,879.00	7,703,900	
ダイト	3,900	2,002.00	7,807,800	
大塚ホールディングス	131,300	4,647.00	610,151,100	
大正製薬HD	13,000	9,760.00	126,880,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
ペプチドリーム	10,400	5,700.00	59,280,000	貸付株式数 2,900株 (2,800株)
大日本塗料	37,000	217.00	8,029,000	
日本ペイントHOLD	47,200	3,610.00	170,392,000	貸付株式数 13,200株
関西ペイント	63,800	2,095.00	133,661,000	貸付株式数 17,900株
中国塗料	17,600	779.00	13,710,400	
日本特殊塗料	5,000	1,383.00	6,915,000	
藤倉化成	11,100	613.00	6,804,300	
太陽ホールディングス	4,800	4,430.00	21,264,000	
DIC	23,700	3,535.00	83,779,500	

サカティンクス	12,200	1,498.00	18,275,600	
東洋インキSCホールディング	55,000	520.00	28,600,000	
T&K TOKA	6,300	965.00	6,079,500	
アルプス技研	2,900	2,618.00	7,592,200	
オリエンタルランド	65,900	6,517.00	429,470,300	
ダスキン	15,100	2,299.00	34,714,900	
パーク24	29,100	3,250.00	94,575,000	
明光ネットワークジャパン	9,000	989.00	8,901,000	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
ファルコホールディングス	6,400	1,406.00	8,998,400	
フジ・メディア・HD	59,500	1,534.00	91,273,000	
ラウンドワン	19,700	797.00	15,700,900	
リゾートトラスト	23,600	2,215.00	52,274,000	
オービック	19,900	5,030.00	100,097,000	
ジャストシステム	10,100	1,084.00	10,948,400	
TDCソフトウェアエンジニア	4,700	1,123.00	5,278,100	
ヤフー	418,700	416.00	174,179,200	貸付株式数 116,500株 (113,900株)
ビー・エム・エル	8,100	2,634.00	21,335,400	
トレンドマイクロ	30,500	4,110.00	125,355,000	
りらいあコミュニケーション	10,300	1,101.00	11,340,300	
リソー教育	11,500	575.00	6,612,500	
日本オラクル	9,400	5,700.00	53,580,000	
フューチャー	10,200	727.00	7,415,400	
CAC HOLDINGS	6,700	901.00	6,036,700	
ソフトバンク・テクノ	1,600	2,735.00	4,376,000	
ユー・エス・エス	73,600	1,831.00	134,761,600	
オービックビジネスC	3,000	4,820.00	14,460,000	貸付株式数 800株 (800株)
伊藤忠テクノソリューション	13,200	3,080.00	40,656,000	
アイティフォー	11,100	636.00	7,059,600	
サイバーエージェント	32,300	2,781.00	89,826,300	
楽天	312,300	1,128.00	352,274,400	貸付株式数 87,000株
デー・オー・ダブリュー	8,000	646.00	5,168,000	
大塚商会	15,500	5,570.00	86,335,000	
総合メディカル	3,100	3,475.00	10,772,500	
サイボウズ	12,600	447.00	5,632,200	
ソフトブレーン	10,100	392.00	3,959,200	
セントラルスポーツ	3,100	2,698.00	8,363,800	
パラカ	2,700	2,029.00	5,478,300	
電通国際情報S	3,900	1,853.00	7,226,700	
デジタルガレージ	9,200	2,006.00	18,455,200	
ウェザーニューズ	2,200	3,360.00	7,392,000	貸付株式数 700株 (700株)
C I J	16,400	519.00	8,511,600	
WOWOW	3,100	2,994.00	9,281,400	貸付株式数 800株
フルキャストホールディングス	7,100	905.00	6,425,500	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
富士フイルムHLDGS	120,800	4,249.00	513,279,200	

コニカミノルタ	135,000	1,092.00	147,420,000	
資生堂	116,000	2,909.00	337,444,000	
ライオン	76,000	1,860.00	141,360,000	
高砂香料	4,100	3,090.00	12,669,000	
マダム	6,200	4,910.00	30,442,000	
ミルボン	3,500	4,640.00	16,240,000	
ファンケル	13,200	1,581.00	20,869,200	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
コーセー	10,000	9,170.00	91,700,000	
シーズ・ホールディングス	8,000	2,960.00	23,680,000	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
ポーラ・オルビスHD	6,300	8,870.00	55,881,000	
ノエビアホールディングス	3,900	3,580.00	13,962,000	
コニシ	9,900	1,277.00	12,642,300	
長谷川香料	7,600	1,944.00	14,774,400	
星光PMC	4,200	1,206.00	5,065,200	貸付株式数 1,100株 (100株)
小林製薬	17,100	5,010.00	85,671,000	
荒川化学工業	5,500	1,583.00	8,706,500	
メック	5,600	991.00	5,549,600	
日本高純度化学	3,800	2,526.00	9,598,800	貸付株式数 800株 (800株)
タカラバイオ	13,200	1,461.00	19,285,200	貸付株式数 3,600株
JCU	2,100	5,000.00	10,500,000	
新田ゼラチン	8,500	734.00	6,239,000	
デクセリアルズ	15,900	970.00	15,423,000	
アース製薬	4,500	4,750.00	21,375,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
イハラケミカル	9,200	1,037.00	9,540,400	
北興化学	15,000	371.00	5,565,000	
大成ラミック	3,400	2,971.00	10,101,400	
クミアイ化学	13,400	680.00	9,112,000	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
日本農薬	14,100	615.00	8,671,500	貸付株式数 100株 (100株)
昭和シェル石油	54,300	1,021.00	55,440,300	
ニチレキ	9,400	905.00	8,507,000	
東燃ゼネラル石油	98,000	1,089.00	106,722,000	
ユシロ化学	4,800	1,400.00	6,720,000	
富士石油	16,700	322.00	5,377,400	
MORESCO	3,800	1,630.00	6,194,000	
出光興産	28,700	2,588.00	74,275,600	
JXホールディングス	672,200	436.40	293,348,080	貸付株式数 189,100株 (189,100株)
コスモエネルギーHLDGS	18,400	1,450.00	26,680,000	貸付株式数 5,100株 (5,100株)
横浜ゴム	36,700	2,067.00	75,858,900	
東洋ゴム	32,400	1,397.00	45,262,800	
ブリヂストン	206,000	4,367.00	899,602,000	
住友ゴム	56,700	1,889.00	107,106,300	

藤倉ゴム	10,700	664.00	7,104,800	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
オカモト	19,000	1,069.00	20,311,000	貸付株式数	5,000株 (5,000株)
アキレス	5,900	1,597.00	9,422,300		
ニッタ	5,400	2,945.00	15,903,000		
住友理工	10,600	1,016.00	10,769,600		
三ツ星ベルト	15,000	1,010.00	15,150,000		
バンドー化学	11,400	1,016.00	11,582,400		
旭硝子	300,000	743.00	222,900,000		
日本板硝子	28,000	805.00	22,540,000		
有沢製作所	12,800	629.00	8,051,200		
日本山村硝子	34,000	192.00	6,528,000		
日本電気硝子	125,000	610.00	76,250,000		
住友大阪セメント	113,000	404.00	45,652,000		
太平洋セメント	369,000	358.00	132,102,000		
日本ヒューム	8,700	702.00	6,107,400		
日本コンクリート	17,500	343.00	6,002,500	貸付株式数	3,800株 (3,800株)
アジアパイルHD	11,100	508.00	5,638,800		
東海カーボン	56,000	381.00	21,336,000		
日本カーボン	36,000	248.00	8,928,000	貸付株式数	10,000株 (9,000株)
東洋炭素	4,000	1,687.00	6,748,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
ノリタケ	3,600	2,588.00	9,316,800		
TOTO	44,800	4,385.00	196,448,000		
日本碍子	77,100	2,186.00	168,540,600		
日本特殊陶業	52,700	2,346.00	123,634,200		
MARUWA	2,400	3,985.00	9,564,000		
品川リフラクトリーズ	25,000	253.00	6,325,000		
黒崎播磨	18,000	318.00	5,724,000		
フジインコーポレーテッド	5,600	1,978.00	11,076,800	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
ニチアス	32,000	1,107.00	35,424,000	貸付株式数	8,000株 (8,000株)
新日鐵住金	275,100	2,453.00	674,820,300		
神戸製鋼所	104,300	1,079.00	112,539,700		
中山製鋼所	7,800	708.00	5,522,400		
合同製鐵	3,700	2,172.00	8,036,400		
JFEホールディングス	166,400	1,670.00	277,888,000		
日新製鋼	27,400	1,465.00	40,141,000	貸付株式数	7,600株 (7,600株)
東京製鐵	30,600	825.00	25,245,000		
共英製鋼	6,600	2,074.00	13,688,400		
大和工業	12,200	3,250.00	39,650,000		
東京鐵鋼	16,000	468.00	7,488,000		
大阪製鐵	4,200	2,085.00	8,757,000		
淀川製鋼所	8,300	3,160.00	26,228,000		
東洋鋼鈑	15,800	376.00	5,940,800		

丸一鋼管	20,200	3,685.00	74,437,000	
大同特殊鋼	101,000	469.00	47,369,000	
日本高周波	89,000	89.00	7,921,000	
日本冶金工	61,300	196.00	12,014,800	貸付株式数 17,300株 (17,300株)
山陽特殊製鋼	36,000	573.00	20,628,000	
愛知製鋼	3,500	5,280.00	18,480,000	
日立金属	61,800	1,495.00	92,391,000	
大平洋金属	39,000	382.00	14,898,000	
新日本電工	41,200	228.00	9,393,600	
栗本鉄工所	3,300	2,375.00	7,837,500	
日本鑄鉄管	25,000	189.00	4,725,000	
日本製鋼所	20,400	2,033.00	41,473,200	
三菱製鋼	45,000	227.00	10,215,000	
大紀アルミニウム	15,000	501.00	7,515,000	
日本軽金属HD	133,600	255.00	34,068,000	
三井金属	165,000	266.00	43,890,000	
東邦亜鉛	36,000	439.00	15,804,000	
三菱マテリアル	37,800	3,385.00	127,953,000	
住友鋁山	158,000	1,528.00	241,424,000	
DOWAホールディングス	68,000	878.00	59,704,000	
古河機金	98,000	207.00	20,286,000	貸付株式数 27,000株 (27,000株)
大阪チタニウム	7,100	1,610.00	11,431,000	貸付株式数 1,900株 (1,800株)
東邦チタニウム	11,000	760.00	8,360,000	貸付株式数 3,200株 (3,200株)
UACJ	78,000	330.00	25,740,000	
古河電工	20,200	3,535.00	71,407,000	
住友電工	229,800	1,602.50	368,254,500	
フジクラ	78,900	617.00	48,681,300	
昭和電線HLDGS	104,000	85.00	8,840,000	
タツタ電線	13,600	463.00	6,296,800	
リョービ	38,000	457.00	17,366,000	
アーレステイ	7,800	1,047.00	8,166,600	
アサヒHD	9,200	2,018.00	18,565,600	
東洋製罐グループHD	42,600	2,154.00	91,760,400	
ホッカンホールディングス	21,000	407.00	8,547,000	
横河ブリッジHLDGS	11,100	1,311.00	14,552,100	
OSJB HD	24,200	239.00	5,783,800	貸付株式数 6,500株 (6,500株)
駒井ハルテック	2,800	2,097.00	5,871,600	
三和ホールディングス	60,500	1,130.00	68,365,000	
文化シヤッター	17,600	869.00	15,294,400	
三協立山	8,100	1,562.00	12,652,200	
アルインコ	6,500	1,003.00	6,519,500	
LIXILグループ	85,100	2,544.00	216,494,400	貸付株式数 23,800株 (23,800株)
ノーリツ	11,800	2,034.00	24,001,200	
長府製作所	6,800	2,661.00	18,094,800	

リンナイ	10,400	9,730.00	101,192,000	
ユニプレス	11,200	2,191.00	24,539,200	
岡 部	13,400	1,010.00	13,534,000	
ジーテクト	6,400	2,117.00	13,548,800	
東 プ レ	11,700	2,704.00	31,636,800	
高周波熱錬	12,000	908.00	10,896,000	
東京製綱	4,600	2,108.00	9,696,800	貸付株式数 1,300 株
パイオラックス	3,100	6,870.00	21,297,000	
日本発条	56,000	1,072.00	60,032,000	貸付株式数 14,900 株
三浦工業	25,100	1,726.00	43,322,600	
タ ク マ	20,000	960.00	19,200,000	
テクノプロ・ホールディング	9,900	3,635.00	35,986,500	
ジャパンマテリアル	2,400	3,715.00	8,916,000	貸付株式数 700 株 (300 株)
ベクトル	5,600	1,206.00	6,753,600	
アサンテ	3,600	1,699.00	6,116,400	
N・フィールド	3,800	1,326.00	5,038,800	貸付株式数 1,000 株
リクルートホールディングス	133,100	4,365.00	580,981,500	
ツ ガ ミ	18,000	630.00	11,340,000	貸付株式数 5,000 株 (5,000 株)
オークマ	39,000	1,001.00	39,039,000	貸付株式数 11,000 株 (11,000 株)
東芝機械	37,000	430.00	15,910,000	
アマダホールディングス	81,300	1,273.00	103,494,900	
アイダエンジニア	17,600	1,049.00	18,462,400	
滝澤鉄工所	54,000	153.00	8,262,000	
富士機械製造	18,200	1,298.00	23,623,600	貸付株式数 5,600 株
牧野フライス	30,000	808.00	24,240,000	
オーエスジー	27,400	2,261.00	61,951,400	貸付株式数 7,600 株 (7,600 株)
旭ダイヤモンド	17,800	844.00	15,023,200	
DMG森精機	36,000	1,322.00	47,592,000	貸付株式数 9,400 株 (9,400 株)
ソデイツク	16,000	880.00	14,080,000	
ディスコ	7,100	13,560.00	96,276,000	
日東工器	3,900	2,451.00	9,558,900	
日本郵政	159,400	1,417.00	225,869,800	
ベルシステム24HLDGS	9,700	933.00	9,050,100	
豊田自動織機	53,000	5,360.00	284,080,000	
OKK	67,000	117.00	7,839,000	
島精機製作所	8,000	3,460.00	27,680,000	
フリーー	1,400	3,350.00	4,690,000	
日阪製作所	10,000	815.00	8,150,000	
やまびこ	11,700	1,340.00	15,678,000	
ペガサスミシン製造	8,400	653.00	5,485,200	
ナブテスコ	31,600	2,908.00	91,892,800	
三井海洋開発	6,000	1,740.00	10,440,000	貸付株式数 1,600 株
レオン自動機	6,600	894.00	5,900,400	
SMC	18,300	32,520.00	595,116,000	
新川	7,200	679.00	4,888,800	

ホソカワミクロン	13,000	686.00	8,918,000	
ユニオンツール	2,700	2,826.00	7,630,200	貸付株式数 800株 (800株)
オイレス工業	7,700	2,066.00	15,908,200	
サトーホールディングス	7,700	2,258.00	17,386,600	
日精樹脂工業	6,200	1,039.00	6,441,800	
小松製作所	281,700	2,633.50	741,856,950	貸付株式数 83,600株 (83,600株)
住友重機械	177,000	689.00	121,953,000	
日立建機	27,000	2,354.00	63,558,000	
巴工業	4,900	1,519.00	7,443,100	
井関農機	63,000	227.00	14,301,000	貸付株式数 18,000株 (18,000株)
TOWA	5,700	1,341.00	7,643,700	
丸山製作所	43,000	193.00	8,299,000	
北川鉄工所	3,900	2,279.00	8,888,100	
シンニッタン	11,400	605.00	6,897,000	
ローゼ	2,400	1,658.00	3,979,200	貸付株式数 600株
クボタ	293,000	1,727.50	506,157,500	貸付株式数 81,300株 (81,300株)
東洋エンジニア	38,000	320.00	12,160,000	
三菱化工機	34,000	207.00	7,038,000	
月島機械	11,900	1,250.00	14,875,000	
帝国電機製作所	6,800	869.00	5,909,200	
新東工業	14,600	922.00	13,461,200	
渋谷工業	5,300	2,220.00	11,766,000	
アイチ コーポレーション	9,900	849.00	8,405,100	
小森コーポレーション	14,600	1,462.00	21,345,200	
鶴見製作所	5,200	1,721.00	8,949,200	
住友精密	18,000	348.00	6,264,000	
荏原製作所	25,100	2,974.00	74,647,400	
西島製作所	7,700	1,083.00	8,339,100	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
北越工業	10,000	776.00	7,760,000	
千代田化工建	46,000	821.00	37,766,000	
ダイキン工業	79,500	10,715.00	851,842,500	
オルガノ	16,000	472.00	7,552,000	
トーヨーカネツ	34,000	354.00	12,036,000	
栗田工業	33,700	2,378.00	80,138,600	
椿本チエイン	34,000	900.00	30,600,000	
日機装	20,000	1,038.00	20,760,000	
新興プランテック	14,800	807.00	11,943,600	
アネスト岩田	11,500	1,136.00	13,064,000	
ダイフク	29,400	2,210.00	64,974,000	
加藤製作所	3,800	2,936.00	11,156,800	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
油研工業	38,000	202.00	7,676,000	
タダノ	30,300	1,218.00	36,905,400	
フジテック	17,100	1,255.00	21,460,500	
CKD	17,500	1,376.00	24,080,000	

キトー	8,500	1,118.00	9,503,000	
平和	17,700	2,461.00	43,559,700	
理想科学工業	6,000	1,979.00	11,874,000	
SANKYO	15,800	3,615.00	57,117,000	
日本金銭機械	5,900	1,556.00	9,180,400	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
マースエンジニアリング	3,500	2,055.00	7,192,500	
福島工業	3,800	3,300.00	12,540,000	
ダイコク電機	3,300	1,706.00	5,629,800	貸付株式数 900株 (900株)
竹内製作所	10,800	2,438.00	26,330,400	
ア マ ノ	17,900	1,919.00	34,350,100	
JUKI	10,200	973.00	9,924,600	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
サンデンホールディングス	37,000	365.00	13,505,000	貸付株式数 10,000株
蛇の目ミシン	7,300	796.00	5,810,800	
ブラザー工業	75,500	1,956.00	147,678,000	
マックス	9,000	1,346.00	12,114,000	
モリタホールディングス	11,000	1,638.00	18,018,000	
グローリー	18,500	3,735.00	69,097,500	
新晃工業	4,800	1,322.00	6,345,600	
大和冷機工業	9,900	897.00	8,880,300	
セガサミーホールディングス	57,700	1,710.00	98,667,000	
日本ピストンリング	4,700	1,870.00	8,789,000	
リ ケ ン	3,000	4,180.00	12,540,000	
T P R	6,500	3,200.00	20,800,000	
ツバキ・ナカシマ	6,700	1,678.00	11,242,600	
ホシザキ	12,800	9,690.00	124,032,000	
大豊工業	5,200	1,600.00	8,320,000	
日本精工	119,800	1,246.00	149,270,800	
N T N	133,000	429.00	57,057,000	
ジェイテクト	61,700	1,830.00	112,911,000	
不 二 越	57,000	439.00	25,023,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
ミネベア	93,900	1,134.00	106,482,600	
日本トムソン	20,500	430.00	8,815,000	
T H K	40,900	2,461.00	100,654,900	
ユースン精機	2,900	2,643.00	7,664,700	貸付株式数 800株 (800株)
イーグル工業	6,500	1,525.00	9,912,500	
日本ピラー工業	7,300	1,219.00	8,898,700	
キッツ	27,700	659.00	18,254,300	
日 立	1,397,000	609.30	851,192,100	
東 芝	1,304,000	425.20	554,460,800	
三菱電機	621,700	1,576.50	980,110,050	
富士電機	174,000	562.00	97,788,000	
東洋電機製造	3,600	1,558.00	5,608,800	
安川電機	67,100	1,755.00	117,760,500	
シンフォニア テクノロジー	44,000	244.00	10,736,000	
明 電 舎	53,000	365.00	19,345,000	

山洋電気	16,000	736.00	11,776,000	
デンヨー	5,700	1,454.00	8,287,800	
日立工機	14,900	1,046.00	15,585,400	
三桜工業	10,200	731.00	7,456,200	
マキタ	38,000	7,750.00	294,500,000	
東芝テック	36,000	565.00	20,340,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
芝浦メカトロニクス	18,000	264.00	4,752,000	
マブチモーター	16,500	6,370.00	105,105,000	
日本電産	75,600	10,240.00	774,144,000	
東光高岳	3,400	1,993.00	6,776,200	
ダブル・スコープ	5,800	1,898.00	11,008,400	貸付株式数 1,500株
ダイヘン	32,000	716.00	22,912,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
田淵電機	12,200	366.00	4,465,200	貸付株式数 1,000株
JVCケンウッド	43,800	318.00	13,928,400	
日新電機	11,900	1,303.00	15,505,700	
大崎電気	12,000	1,151.00	13,812,000	貸付株式数 3,000株
オムロン	61,900	4,220.00	261,218,000	
日東工業	8,200	1,609.00	13,193,800	
I D E C	8,200	1,020.00	8,364,000	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
ジーエス・ユアサ コーポ	111,000	461.00	51,171,000	
サクサホールディングス	20,000	219.00	4,380,000	
メルコホールディングス	3,400	2,925.00	9,945,000	貸付株式数 1,000株
日本電気	800,000	298.00	238,400,000	
富士通	562,000	674.80	379,237,600	
沖電気	25,000	1,542.00	38,550,000	
電気興業	18,000	581.00	10,458,000	
サンケン電気	35,000	485.00	16,975,000	
アイホン	4,100	1,848.00	7,576,800	
ルネサスエレクトロニクス	32,100	856.00	27,477,600	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
セイコーエプソン	86,600	2,293.00	198,573,800	
ワコム	46,500	307.00	14,275,500	貸付株式数 15,100株 (15,100株)
アルバック	10,700	3,435.00	36,754,500	
アクセル	5,200	850.00	4,420,000	
E I Z O	5,700	3,370.00	19,209,000	
ジャパンディスプレイ	108,700	265.00	28,805,500	貸付株式数 30,400株 (30,400株)
日本信号	16,100	918.00	14,779,800	
京三製作所	19,000	384.00	7,296,000	
能美防災	6,900	1,799.00	12,413,100	
ホーチキ	5,100	1,376.00	7,017,600	
エレコム	5,400	1,961.00	10,589,400	
日本無線	4,000	1,407.00	5,628,000	
パナソニック	665,500	1,164.00	774,642,000	
アンリツ	41,300	579.00	23,912,700	
富士通ゼネラル	20,000	2,252.00	45,040,000	

日立国際電気	15,400	2,283.00	35,158,200	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
ソニー	411,300	3,288.00	1,352,354,400		
T D K	32,800	7,690.00	252,232,000		
帝国通信工業	32,000	169.00	5,408,000		
ミツミ電機	21,200	666.00	14,119,200		
タムラ製作所	24,000	441.00	10,584,000		
アルプス電気	53,900	2,873.00	154,854,700		
パイオニア	88,300	236.00	20,838,800		
日本電波工業	7,700	839.00	6,460,300		
日本トリム	1,500	4,270.00	6,405,000	貸付株式数	200株 (200株)
ローランド ディー. ジー.	3,400	2,877.00	9,781,800	貸付株式数	900株 (900株)
フオスター電機	7,000	2,108.00	14,756,000		
クラリオン	31,000	372.00	11,532,000		
S M K	17,000	429.00	7,293,000		
ヨコオ	7,100	798.00	5,665,800		
ホシデン	18,500	935.00	17,297,500		
ヒロセ電機	9,400	13,690.00	128,686,000		
日本航空電子	18,000	1,540.00	27,720,000	貸付株式数	5,000株 (5,000株)
T O A	8,000	957.00	7,656,000		
日立マクセル	8,500	2,005.00	17,042,500		
古野電気	8,700	797.00	6,933,900		
ユニデンホールディングス	40,000	157.00	6,280,000		
アルパイン	14,000	1,475.00	20,650,000		
スミダコーポレーション	5,300	1,030.00	5,459,000		
アイコム	4,000	1,960.00	7,840,000		
リオン	3,400	1,513.00	5,144,200		
船井電機	7,200	944.00	6,796,800	貸付株式数	1,800株 (1,700株)
横河電機	62,500	1,585.00	99,062,500		
新電元工業	23,000	433.00	9,959,000		
アズビル	17,300	3,100.00	53,630,000		
日本光電工業	24,200	2,566.00	62,097,200	貸付株式数	6,800株
共和電業	15,500	400.00	6,200,000		
堀場製作所	11,400	5,090.00	58,026,000		
アドバンテスト	39,500	1,551.00	61,264,500		
エスベック	5,900	1,253.00	7,392,700		
キーエンス	13,200	78,230.00	1,032,636,000		
日置電機	3,500	2,067.00	7,234,500	貸付株式数	1,000株
シスメックス	45,300	6,890.00	312,117,000		
日本マイクロニクス	11,300	1,007.00	11,379,100		
メガチップス	5,800	2,709.00	15,712,200	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,500	5,280.00	18,480,000	貸付株式数	900株 (900株)
デンソー	143,800	4,980.00	716,124,000		
コーセル	8,700	1,162.00	10,109,400		

イリソ電子工業	1,900	6,730.00	12,787,000	
オブテックス	4,500	2,864.00	12,888,000	
千代田インテグレ	3,400	2,294.00	7,799,600	
レーザーテック	7,100	2,091.00	14,846,100	
スタンレー電気	41,500	3,155.00	130,932,500	
岩崎電気	38,000	174.00	6,612,000	
ウシオ電機	35,400	1,379.00	48,816,600	
日本セラミック	5,100	2,107.00	10,745,700	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
遠藤照明	6,400	853.00	5,459,200	
日本デジタル研究所	6,100	2,412.00	14,713,200	
古河電池	6,000	809.00	4,854,000	
山一電機	6,800	1,079.00	7,337,200	
図研	5,300	1,106.00	5,861,800	
日本電子	22,000	451.00	9,922,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
カシオ	48,700	1,495.00	72,806,500	貸付株式数 13,700株
ファナック	59,100	19,305.00	1,140,925,500	
日本シイエムケイ	13,800	600.00	8,280,000	
エンプラス	2,700	3,295.00	8,896,500	
ローム	28,200	6,250.00	176,250,000	
浜松ホトニクス	45,400	3,035.00	137,789,000	貸付株式数 12,500株
三井ハイテック	8,800	680.00	5,984,000	
新光電気工業	20,600	703.00	14,481,800	
京セラ	95,600	5,436.00	519,681,600	
太陽誘電	27,500	1,245.00	34,237,500	貸付株式数 8,000株
村田製作所	61,200	15,425.00	944,010,000	
ユーシン	10,000	734.00	7,340,000	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
双葉電子工業	9,700	1,782.00	17,285,400	
日東電工	44,000	7,896.00	347,424,000	
北陸電気工業	45,000	128.00	5,760,000	
東海理化電機	15,300	2,243.00	34,317,900	
ニチコン	18,100	993.00	17,973,300	
日本ケミコン	56,000	232.00	12,992,000	
K O A	8,800	1,059.00	9,319,200	
三井造船	203,000	164.00	33,292,000	
日立造船	44,300	607.00	26,890,100	
三菱重工業	976,000	506.80	494,636,800	
川崎重工業	453,000	361.00	163,533,000	
I H I	448,000	317.00	142,016,000	貸付株式数 124,000株 (124,000株)
名村造船所	18,100	714.00	12,923,400	
日本車輛	26,000	284.00	7,384,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
F P G	21,200	913.00	19,355,600	貸付株式数 5,800株
じもとホールディングス	52,500	191.00	10,027,500	
全国保証	16,400	3,875.00	63,550,000	
めぶきフィナンシャルG	276,400	416.00	114,982,400	
東京TYフィナンシャルG	8,400	3,775.00	31,710,000	

九州フィナンシャルG	93,900	753.00	70,706,700	
かんぽ生命保険	21,700	2,309.00	50,105,300	貸付株式数 6,100株
ゆうちょ銀行	163,300	1,349.00	220,291,700	
富山第一銀行	15,900	523.00	8,315,700	
コンコルディア・フィナンシャル	374,900	525.50	197,009,950	
西日本フィナンシャルHD	38,200	1,075.00	41,065,000	
日産自動車	697,200	1,056.50	736,591,800	
いすゞ自動車	169,100	1,349.00	228,115,900	
トヨタ自動車 ※	724,800	6,649.00	4,819,195,200	
日野自動車	83,000	1,161.00	96,363,000	
三菱自動車工業	214,600	529.00	113,523,400	
エフテック	4,400	1,286.00	5,658,400	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
武蔵精密工業	6,700	2,836.00	19,001,200	
日産車体	25,600	1,129.00	28,902,400	
新明和工業	23,000	962.00	22,126,000	
極東開発工業	11,900	1,480.00	17,612,000	
日信工業	12,300	1,680.00	20,664,000	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
トピー工業	4,900	2,884.00	14,131,600	
ティラド	28,000	245.00	6,860,000	
曙ブレーキ	29,800	307.00	9,148,600	貸付株式数 10,100株 (10,100株)
タチエス	10,300	1,700.00	17,510,000	
N O K	28,100	2,275.00	63,927,500	
フタバ産業	19,200	692.00	13,286,400	
K Y B	65,000	520.00	33,800,000	
市光工業	16,000	377.00	6,032,000	
大同メタル工業	8,000	1,090.00	8,720,000	
プレス工業	31,500	499.00	15,718,500	
カルソニックカンセイ	40,000	1,754.00	70,160,000	
太平洋工業	12,200	1,430.00	17,446,000	貸付株式数 3,800株
ケーヒン	12,900	1,870.00	24,123,000	
河西工業	8,300	1,260.00	10,458,000	
アイシン精機	53,300	4,890.00	260,637,000	
マ ツ ダ	184,200	1,834.00	337,822,800	
今仙電機製作所	7,300	932.00	6,803,600	貸付株式数 1,900株
本田技研	524,500	3,332.00	1,747,634,000	
スズキ	115,800	3,680.00	426,144,000	
富士重工業	181,000	4,645.00	840,745,000	
ヤマハ発動機	82,400	2,631.00	216,794,400	貸付株式数 22,700株
ショーワ	16,100	684.00	11,012,400	
小糸製作所	35,000	5,960.00	208,600,000	
T B K	17,100	476.00	8,139,600	
エクセディ	7,500	3,145.00	23,587,500	
ミツバ	10,900	1,628.00	17,745,200	
豊田合成	18,400	2,470.00	45,448,000	
愛三工業	9,900	929.00	9,197,100	
ヨ ロ ズ	5,700	1,608.00	9,165,600	

エフ・シー・シー	9,600	1,978.00	18,988,800	
シマノ	23,500	18,790.00	441,565,000	
テイ・エス テック	13,400	3,015.00	40,401,000	
ジャムコ	3,700	2,260.00	8,362,000	貸付株式数 1,100株 (900株)
小野建	5,800	1,223.00	7,093,400	
ノジマ	6,900	1,337.00	9,225,300	
佐島電機	8,900	712.00	6,336,800	
カップ・クリエイト	8,800	1,236.00	10,876,800	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
伯東	5,500	1,004.00	5,522,000	
コンドーテック	8,300	809.00	6,714,700	
ライトオン	5,100	1,012.00	5,161,200	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,600	2,372.00	20,399,200	
三菱食品	6,200	3,295.00	20,429,000	
良品計画	7,600	22,430.00	170,468,000	貸付株式数 1,800株
松田産業	4,800	1,461.00	7,012,800	
第一興商	9,300	4,465.00	41,524,500	
メディパルHD	57,400	1,637.00	93,963,800	
アドヴァン	6,800	1,113.00	7,568,400	
萩原電気	3,300	2,087.00	6,887,100	
アルビス	2,400	2,941.00	7,058,400	
アズワン	4,500	4,875.00	21,937,500	
シモジマ	6,200	1,093.00	6,776,600	
ドウシシャ	7,100	2,064.00	14,654,400	
小津産業	2,600	2,096.00	5,449,600	
コナカ	12,500	544.00	6,800,000	
コーナン商事	8,100	2,163.00	17,520,300	
黒田電気	7,800	2,298.00	17,924,400	
ネットワンシステムズ	25,300	772.00	19,531,600	
ワタミ	7,200	1,094.00	7,876,800	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	37,300	4,375.00	163,187,500	
丸文	8,200	684.00	5,608,800	
西松屋チェーン	10,300	1,480.00	15,244,000	
ゼンショーホールディングス	29,800	1,956.00	58,288,800	
ハピネット	5,800	1,319.00	7,650,200	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
幸楽苑ホールディングス	5,700	1,582.00	9,017,400	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
日本ライフライン	5,000	2,585.00	12,925,000	
サイゼリヤ	9,400	2,765.00	25,991,000	
エクセル	3,400	1,437.00	4,885,800	
VTホールディングス	20,400	558.00	11,383,200	
マルカキカイ	3,500	1,414.00	4,949,000	
アルゴグラフィックス	3,700	2,175.00	8,047,500	
IDOM	16,600	568.00	9,428,800	貸付株式数 4,600株
ポプラ	11,400	505.00	5,757,000	
ユナイテッドアローズ	7,800	2,881.00	22,471,800	

進和	4,500	1,673.00	7,528,500		
ハイデイ日高	5,400	2,701.00	14,585,400	貸付株式数	1,500株
シークス	4,100	3,830.00	15,703,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
京都きもの友禅	10,700	948.00	10,143,600		
コロワイド	18,800	1,896.00	35,644,800	貸付株式数	5,700株 (5,700株)
老番屋	5,200	3,750.00	19,500,000	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
スギホールディングス	12,600	5,340.00	67,284,000		
島津製作所	75,000	1,743.00	130,725,000		
J M S	24,000	286.00	6,864,000		
ブイ・テクノロジー	1,200	11,990.00	14,388,000	貸付株式数	400株 (400株)
スター精密	10,000	1,556.00	15,560,000		
東京計器	32,000	215.00	6,880,000		
東京精密	11,100	3,220.00	35,742,000		
マニー	7,800	2,430.00	18,954,000		
ニコン	100,500	1,680.00	168,840,000	貸付株式数	30,000株
トプコン	29,500	1,699.00	50,120,500	貸付株式数	5,600株
オリンパス	92,800	4,020.00	373,056,000		
理研計器	5,700	1,482.00	8,447,400		
SCREENホールディングス	12,000	6,820.00	81,840,000		
キヤノン電子	5,000	1,708.00	8,540,000		
タムロン	5,200	1,919.00	9,978,800	貸付株式数	1,500株
HOYA	122,200	4,499.00	549,777,800		
ノーリツ鋼機	6,900	785.00	5,416,500		
エー・アンド・デイ	12,700	459.00	5,829,300		
キヤノン	312,800	3,261.00	1,020,040,800		
リコー	174,100	921.00	160,346,100		
シチズン時計	64,000	699.00	44,736,000	貸付株式数	17,900株 (17,900株)
リズム時計	39,000	185.00	7,215,000		
大研医器	6,900	833.00	5,747,700	貸付株式数	1,900株 (500株)
メニコン	4,100	2,901.00	11,894,100		
パラマウントベッドHD	5,600	4,190.00	23,464,000	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ニホンフラッシュ	3,800	1,192.00	4,529,600		
前田工織	7,000	1,228.00	8,596,000	貸付株式数	1,600株
永大産業	13,000	491.00	6,383,000		
アートネイチャー	8,500	621.00	5,278,500		
ダンロップスポーツ	4,500	1,050.00	4,725,000		
バンダイナムコHLDGS	64,300	3,265.00	209,939,500		
共立印刷	27,200	313.00	8,513,600		
SHOE I	3,200	2,029.00	6,492,800		
フランスベッドHLDGS	7,800	911.00	7,105,800		
マーベラス	10,300	775.00	7,982,500	貸付株式数	3,000株 (2,800株)

パイロットコーポレーション	10,300	4,735.00	48,770,500	
萩原工業	2,500	2,428.00	6,070,000	
エイベックス・グループHD	10,600	1,581.00	16,758,600	
トッパン・フォームズ	9,400	1,090.00	10,246,000	
フジシールインターナショナル	6,600	4,630.00	30,558,000	
タカラトミー	23,000	1,163.00	26,749,000	
レック	2,600	3,340.00	8,684,000	
大建工業	4,500	2,006.00	9,027,000	
きもと	20,300	247.00	5,014,100	
凸版印刷	161,000	1,037.00	166,957,000	
大日本印刷	167,000	1,082.00	180,694,000	
共同印刷	21,000	382.00	8,022,000	
日本写真印刷	9,900	2,423.00	23,987,700	貸付株式数 2,800株 (2,700株)
光村印刷	25,000	213.00	5,325,000	
藤森工業	4,700	2,763.00	12,986,100	
宝印刷	4,800	1,405.00	6,744,000	
前澤化成工業	8,500	1,174.00	9,979,000	
アシックス	57,900	2,408.00	139,423,200	
ツツミ	2,700	1,814.00	4,897,800	
ジェイエスピー	2,800	2,848.00	7,974,400	
ニチハ	8,300	2,876.00	23,870,800	
エフピコ	5,500	5,690.00	31,295,000	
ヤマハ	39,200	3,485.00	136,612,000	
河合楽器	3,200	2,144.00	6,860,800	
クリナップ	8,100	946.00	7,662,600	
ピジョン	35,400	2,883.00	102,058,200	
天馬	4,200	1,857.00	7,799,400	
キングジム	7,800	848.00	6,614,400	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
リンテック	13,100	2,425.00	31,767,500	
信越ポリマー	13,100	763.00	9,995,300	
東リ	22,200	380.00	8,436,000	
イトーキ	12,900	745.00	9,610,500	
任天堂	35,900	27,775.00	997,122,500	
三菱鉛筆	4,900	5,950.00	29,155,000	
松風	4,100	1,350.00	5,535,000	
タカラスタンダード	12,100	1,892.00	22,893,200	
コクヨ	30,300	1,335.00	40,450,500	
ナカバヤシ	21,000	250.00	5,250,000	
ニフコ	10,500	6,280.00	65,940,000	
グローブライド	3,500	1,798.00	6,293,000	
岡村製作所	19,800	973.00	19,265,400	
日本バルカー	5,800	1,492.00	8,653,600	
伊藤忠	421,500	1,562.00	658,383,000	
丸紅	564,900	626.30	353,796,870	
スクロール	12,100	353.00	4,271,300	
高島	37,000	190.00	7,030,000	
ヨンドシーホールディングス	4,500	2,627.00	11,821,500	

三陽商会	40,000	158.00	6,320,000	貸付株式数	11,000株
長瀬産業	32,000	1,434.00	45,888,000		
蝶理	4,300	1,709.00	7,348,700		
豊田通商	63,600	2,859.00	181,832,400		
オンワードホールディングス	38,000	751.00	28,538,000	貸付株式数	9,000株 (9,000株)
兼松	121,000	189.00	22,869,000		
美津濃	31,000	556.00	17,236,000		
ユニ・ファミリーマートHD	25,300	7,150.00	180,895,000	貸付株式数	7,100株
三井物産	521,200	1,541.50	803,429,800		
日本紙パルプ	28,000	348.00	9,744,000		
東京エレクトロン	38,900	10,475.00	407,477,500		
日立ハイテクノロジーズ	19,900	4,510.00	89,749,000		
カメイ	7,800	1,044.00	8,143,200		
OUGホールディングス	28,000	259.00	7,252,000		
スターゼン	2,400	4,740.00	11,376,000		
セイコーHD	40,000	403.00	16,120,000	貸付株式数	11,000株
山善	22,200	897.00	19,913,400		
住友商事	361,500	1,365.00	493,447,500		
日本ユニシス	16,300	1,412.00	23,015,600		
内田洋行	19,000	458.00	8,702,000		
三菱商事	432,400	2,471.50	1,068,676,600		
第一実業	16,000	671.00	10,736,000		
キヤノンマーケティングJPN	16,200	1,802.00	29,192,400		
西華産業	23,000	328.00	7,544,000		
菱洋エレクトロ	6,200	1,376.00	8,531,200		
ユアサ商事	5,400	2,813.00	15,190,200		
神鋼商事	3,300	2,201.00	7,263,300		
阪和興業	57,000	743.00	42,351,000		
カナデン	7,600	1,014.00	7,706,400		
菱電商事	11,000	742.00	8,162,000		
ニプロ	39,300	1,258.00	49,439,400		
岩谷産業	62,000	619.00	38,378,000		
すてきナイスグループ	45,000	152.00	6,840,000		
兼松エレクトロニクス	3,800	2,469.00	9,382,200		
三愛石油	16,200	787.00	12,749,400		
稲畑産業	13,600	1,209.00	16,442,400		
ゴールドウイン	2,700	4,960.00	13,392,000	貸付株式数	700株 (700株)
ユニ・チャーム	123,900	2,434.50	301,634,550	貸付株式数	34,600株
デサント	14,100	1,253.00	17,667,300		
ワキタ	12,700	939.00	11,925,300		
東邦ホールディングス	18,200	2,216.00	40,331,200		
サンゲツ	19,600	1,997.00	39,141,200		
ミツウロコグループ	9,600	704.00	6,758,400		
シナネンホールディングス	3,000	1,991.00	5,973,000		
伊藤忠エネクス	12,600	864.00	10,886,400		
サンリオ	17,300	2,014.00	34,842,200		
リョーサン	8,400	3,440.00	28,896,000		

新光商事	7,800	1,212.00	9,453,600	
トーホー	3,500	2,493.00	8,725,500	
三信電気	7,500	939.00	7,042,500	
東陽テクニカ	8,300	955.00	7,926,500	
モスフード サービス	7,400	3,405.00	25,197,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
加賀電子	5,700	1,893.00	10,790,100	
三益半導体	5,300	1,371.00	7,266,300	
木曽路	7,100	2,283.00	16,209,300	貸付株式数 2,400株
サトレストランシステムズ	9,400	817.00	7,679,800	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
千趣会	11,400	751.00	8,561,400	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
ケーヨー	12,100	542.00	6,558,200	貸付株式数 3,600株 (2,100株)
上新電機	14,000	952.00	13,328,000	
日本瓦斯	10,600	3,290.00	34,874,000	
ロイヤルホールディングス	9,300	1,935.00	17,995,500	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
いなげや	6,600	1,425.00	9,405,000	
島忠	14,600	2,951.00	43,084,600	
チョダ	6,800	2,652.00	18,033,600	
ライフコーポレーション	4,500	3,245.00	14,602,500	
リンガーハット	5,800	2,091.00	12,127,800	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
AOKIホールディングス	11,100	1,339.00	14,862,900	
オークワ	8,000	1,169.00	9,352,000	
コメリ	8,900	2,708.00	24,101,200	
青山商事	11,800	3,885.00	45,843,000	
しまむら	6,700	13,620.00	91,254,000	
高島屋	95,000	949.00	90,155,000	貸付株式数 23,000株
松屋	13,400	1,016.00	13,614,400	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
エイチ・ツー・オーリテイリング	29,000	1,711.00	49,619,000	
近鉄百貨店	23,000	353.00	8,119,000	貸付株式数 7,000株
丸井グループ	60,700	1,576.00	95,663,200	
クレディセゾン	43,200	2,051.00	88,603,200	
アクシアル リテイリング	4,600	3,880.00	17,848,000	
イオン	236,500	1,576.00	372,724,000	貸付株式数 66,200株
イズミ	11,500	5,010.00	57,615,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
平和堂	11,600	2,263.00	26,250,800	
フジ	6,500	2,224.00	14,456,000	
ヤオコー	6,600	4,350.00	28,710,000	
ゼビオホールディングス	7,600	1,760.00	13,376,000	
ケーズホールディングス	26,100	2,112.00	55,123,200	
PALTAC	9,300	2,547.00	23,687,100	
新生銀行	545,000	183.00	99,735,000	
あおぞら銀行	360,000	393.00	141,480,000	

三菱UF JフィナンシャルG	4,360,300	669.80	2,920,528,940	
りそなホールディングス	672,200	550.10	369,777,220	
三井住友トラストHD	120,200	4,150.00	498,830,000	
三井住友フィナンシャルG	460,500	4,206.00	1,936,863,000	
第四銀行	69,000	480.00	33,120,000	
北越銀行	6,300	2,549.00	16,058,700	
千葉銀行	220,000	678.00	149,160,000	
群馬銀行	124,700	581.00	72,450,700	
武蔵野銀行	8,700	3,065.00	26,665,500	
千葉興業銀行	19,300	523.00	10,093,900	
筑波銀行	30,200	336.00	10,147,200	
七十七銀行	86,000	539.00	46,354,000	
青森銀行	45,000	376.00	16,920,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
秋田銀行	37,000	369.00	13,653,000	
山形銀行	33,000	470.00	15,510,000	貸付株式数 9,000株
岩手銀行	3,600	4,610.00	16,596,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
東邦銀行	50,000	412.00	20,600,000	
東北銀行	64,000	148.00	9,472,000	
みちのく銀行	33,000	218.00	7,194,000	
ふくおかフィナンシャルG	232,000	495.00	114,840,000	
静岡銀行	155,000	925.00	143,375,000	
十六銀行	74,000	367.00	27,158,000	
スルガ銀行	58,800	2,577.00	151,527,600	貸付株式数 15,100株 (15,100株)
八十二銀行	108,200	613.00	66,326,600	
山梨中央銀行	35,000	506.00	17,710,000	
大垣共立銀行	76,000	411.00	31,236,000	貸付株式数 21,000株 (21,000株)
福井銀行	51,000	279.00	14,229,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
北國銀行	58,000	397.00	23,026,000	
清水銀行	2,500	3,365.00	8,412,500	
滋賀銀行	49,000	596.00	29,204,000	貸付株式数 7,000株
南都銀行	5,400	4,155.00	22,437,000	
百五銀行	49,000	436.00	21,364,000	
京都銀行	102,000	793.00	80,886,000	
紀陽銀行	22,000	1,740.00	38,280,000	
三重銀行	3,800	2,246.00	8,534,800	
ほくほくフィナンシャルG	37,100	1,854.00	68,783,400	
広島銀行	168,000	504.00	84,672,000	
山陰合同銀行	34,300	873.00	29,943,900	
中国銀行	39,800	1,546.00	61,530,800	
鳥取銀行	4,200	1,774.00	7,450,800	
伊予銀行	59,200	734.00	43,452,800	貸付株式数 16,400株
百十四銀行	61,000	381.00	23,241,000	
四国銀行	44,000	294.00	12,936,000	
阿波銀行	47,000	674.00	31,678,000	
大分銀行	34,000	408.00	13,872,000	貸付株式数 9,000株

				(9,000株)
宮崎銀行	40,000	362.00	14,480,000	
佐賀銀行	36,000	277.00	9,972,000	
十八銀行	37,000	341.00	12,617,000	
沖縄銀行	5,600	4,275.00	23,940,000	
琉球銀行	12,400	1,476.00	18,302,400	
セブン銀行	214,700	326.00	69,992,200	貸付株式数 60,300株
みずほフィナンシャルG	7,801,500	202.60	1,580,583,900	
高知銀行	68,000	125.00	8,500,000	
山口フィナンシャルG	52,000	1,190.00	61,880,000	
芙蓉総合リース	6,500	5,400.00	35,100,000	
興銀リース	10,600	2,413.00	25,577,800	
東京センチュリー	11,500	3,695.00	42,492,500	
SBIホールディングス	64,800	1,432.00	92,793,600	
日本証券金融	25,900	545.00	14,115,500	
アイフル	97,400	353.00	34,382,200	貸付株式数 27,400株 (300株)
長野銀行	3,200	2,009.00	6,428,800	
名古屋銀行	4,700	3,835.00	18,024,500	貸付株式数 1,300株 (100株)
北洋銀行	90,000	448.00	40,320,000	
愛知銀行	2,000	6,450.00	12,900,000	
第三銀行	4,400	1,825.00	8,030,000	
中京銀行	2,800	2,357.00	6,599,600	
大光銀行	31,000	262.00	8,122,000	
愛媛銀行	5,200	1,365.00	7,098,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
トマト銀行	5,000	1,622.00	8,110,000	
みなと銀行	5,200	1,948.00	10,129,600	
京葉銀行	43,000	488.00	20,984,000	
関西アーバン銀行	7,500	1,292.00	9,690,000	
栃木銀行	32,300	497.00	16,053,100	
北日本銀行	2,500	3,075.00	7,687,500	
東和銀行	118,000	108.00	12,744,000	
福島銀行	91,000	93.00	8,463,000	
大東銀行	43,000	169.00	7,267,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
リコーリース	4,500	3,500.00	15,750,000	貸付株式数 1,300株
イオンフィナンシャルサービ ス	36,700	1,904.00	69,876,800	
アコム	118,200	547.00	64,655,400	
ジャックス	33,000	531.00	17,523,000	
オリコ	127,500	202.00	25,755,000	
日立キャピタル	13,700	2,802.00	38,387,400	
オリックス	407,900	1,781.50	726,673,850	
三菱UFJリース	145,600	527.00	76,731,200	
ジャフコ	9,600	3,950.00	37,920,000	
トモニホールディングス	47,000	590.00	27,730,000	
大和証券G本社	535,000	687.40	367,759,000	
野村ホールディングス	1,176,000	614.00	722,064,000	

岡三証券グループ	46,000	657.00	30,222,000	
丸三証券	18,300	930.00	17,019,000	
東洋証券	36,000	236.00	8,496,000	
東海東京HD	63,300	591.00	37,410,300	
光世証券	52,000	161.00	8,372,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
水戸証券	31,900	293.00	9,346,700	
いちよし証券	13,600	820.00	11,152,000	
松井証券	29,900	880.00	26,312,000	
SOMPOホールディングス	119,800	3,728.00	446,614,400	
日本取引所グループ	179,300	1,694.00	303,734,200	
マネックスG	60,900	270.00	16,443,000	貸付株式数 19,000株 (19,000株)
カブドットコム証券	39,800	366.00	14,566,800	
極東証券	7,600	1,662.00	12,631,200	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
岩井コスモホールディング	8,000	972.00	7,776,000	
藍澤証券	12,900	630.00	8,127,000	
フィデアホール	58,800	192.00	11,289,600	
池田泉州HD	57,200	494.00	28,256,800	
アニコムホールディングス	4,100	2,700.00	11,070,000	貸付株式数 1,300株 (600株)
MS&AD	171,500	3,549.00	608,653,500	
SONY FH	54,700	1,650.00	90,255,000	
マネーパートナーズGP	8,600	480.00	4,128,000	
第一生命HLDGS	346,900	1,833.50	636,041,150	
東京海上HD	232,800	4,899.00	1,140,487,200	
イー・ギャランティ	2,400	2,495.00	5,988,000	貸付株式数 700株 (700株)
NECキャピタルソリューション	2,900	1,710.00	4,959,000	
T&Dホールディングス	209,100	1,429.00	298,803,900	
アドバンスクリエイト	3,000	1,787.00	5,361,000	
三井不動産	305,000	2,690.50	820,602,500	
三菱地所	428,000	2,305.50	986,754,000	
平和不動産	11,000	1,634.00	17,974,000	
東京建物	66,100	1,476.00	97,563,600	
ダイビル	14,900	1,019.00	15,183,100	
京阪神ビルディング	11,500	585.00	6,727,500	
住友不動産	138,000	3,159.00	435,942,000	
大京	104,000	242.00	25,168,000	
テーオーシー	22,700	989.00	22,450,300	
東京楽天地	13,000	506.00	6,578,000	
レオパレス21	71,600	621.00	44,463,600	
スターツコーポレーション	6,100	2,086.00	12,724,600	
フジ住宅	9,200	724.00	6,660,800	
空港施設	9,800	576.00	5,644,800	
住友不動産販売	4,900	2,788.00	13,661,200	
ゴールドクレスト	5,400	2,169.00	11,712,600	
リログループ	2,300	15,700.00	36,110,000	

日神不動産	12,600	518.00	6,526,800	
タカラレーベン	25,500	675.00	17,212,500	貸付株式数 7,100株
サンヨーハウジ 名古屋	6,600	991.00	6,540,600	
イオンモール	36,600	1,650.00	60,390,000	
ファースト住建	3,500	1,511.00	5,288,500	
東祥	1,500	5,030.00	7,545,000	貸付株式数 600株 (600株)
トーセイ	9,300	831.00	7,728,300	
エヌ・ティ・ティ都市開発	34,800	986.00	34,312,800	
サンフロンティア不動産	6,900	983.00	6,782,700	
エフ・ジェー・ネクスト	8,200	708.00	5,805,600	
グランディハウス	13,200	380.00	5,016,000	
東武鉄道	308,000	548.00	168,784,000	
相鉄ホールディングス	93,000	561.00	52,173,000	
東京急行	316,000	854.00	269,864,000	
京浜急行	159,000	1,229.00	195,411,000	
小田急電鉄	93,400	2,237.00	208,935,800	
京王電鉄	162,000	912.00	147,744,000	
京成電鉄	43,500	2,714.00	118,059,000	
富士急行	17,000	1,062.00	18,054,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
新京成電鉄	13,000	409.00	5,317,000	
東日本旅客鉄道	112,800	9,766.00	1,101,604,800	
西日本旅客鉄道	56,000	6,957.00	389,592,000	
東海旅客鉄道	48,500	18,680.00	905,980,000	
西武ホールディングス	80,400	2,051.00	164,900,400	
鴻池運輸	8,400	1,553.00	13,045,200	
西日本鉄道	69,000	508.00	35,052,000	
ハマキョウレックス	4,300	2,052.00	8,823,600	
サカイ引越センター	2,400	2,407.00	5,776,800	貸付株式数 700株 (100株)
近鉄グループHLDGS	585,000	442.00	258,570,000	
阪急阪神HLDGS	73,300	3,615.00	264,979,500	
南海電鉄	122,000	523.00	63,806,000	
京阪ホールディングス	130,000	728.00	94,640,000	
神戸電鉄	18,000	368.00	6,624,000	
名古屋鉄道	212,000	561.00	118,932,000	貸付株式数 57,000株 (57,000株)
山陽電鉄	23,000	588.00	13,524,000	
トランコム	1,800	5,570.00	10,026,000	
日本通運	225,000	591.00	132,975,000	貸付株式数 61,000株 (61,000株)
ヤマトホールディングス	104,400	2,291.50	239,232,600	
山 九	76,000	665.00	50,540,000	
日 新	26,000	339.00	8,814,000	
丸全昭和運輸	22,000	442.00	9,724,000	
センコー	26,100	808.00	21,088,800	
トナミホールディングス	16,000	346.00	5,536,000	
ニッコンホールディングス	19,400	2,392.00	46,404,800	
福山通運	34,000	625.00	21,250,000	貸付株式数 9,000株

				(5,000株)
セイノーホールディングス	40,700	1,271.00	51,729,700	
神奈川中央交通	8,000	730.00	5,840,000	
日立物流	12,100	2,339.00	28,301,900	
丸和運輸機関	1,800	2,960.00	5,328,000	
日本郵船	487,000	212.00	103,244,000	
商船三井	303,000	294.00	89,082,000	貸付株式数 84,000株 (79,000株)
川崎汽船	218,000	251.00	54,718,000	貸付株式数 71,000株 (71,000株)
NSユニテッド海運	32,000	207.00	6,624,000	
飯野海運	30,900	420.00	12,978,000	
九州旅客鉄道	43,100	2,962.00	127,662,200	
日本航空	104,600	3,385.00	354,071,000	
ANAホールディングス	1,077,000	317.30	341,732,100	
三菱倉庫	38,000	1,547.00	58,786,000	
三井倉庫HOLD	36,000	334.00	12,024,000	
住友倉庫	41,000	587.00	24,067,000	
渋沢倉庫	28,000	338.00	9,464,000	
ヤマタネ	6,100	1,485.00	9,058,500	
東陽倉庫	28,100	283.00	7,952,300	
日本トランスシティ	19,000	399.00	7,581,000	
東洋埠頭	43,000	188.00	8,084,000	
上組	68,000	1,050.00	71,400,000	
キューソー流通システム	2,300	2,312.00	5,317,600	貸付株式数 500株 (500株)
郵船ロジスティクス	6,000	1,114.00	6,684,000	
近鉄エクスプレス	10,600	1,623.00	17,203,800	
東海運	8,700	478.00	4,158,600	貸付株式数 3,600株
内外トランスライン	4,900	1,131.00	5,541,900	
東京放送HD	38,100	1,789.00	68,160,900	
日本テレビHLDS	52,600	1,946.00	102,359,600	
テレビ朝日HD	15,900	2,148.00	34,153,200	
スカパーJ SATHD	37,700	546.00	20,584,200	
テレビ東京HD	5,000	2,225.00	11,125,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ワイヤレスゲート	2,700	1,690.00	4,563,000	
コネクシオ	5,300	1,400.00	7,420,000	
日本通信	52,400	155.00	8,122,000	貸付株式数 12,800株 (12,800株)
日本電信電話	461,500	4,625.00	2,134,437,500	
KDDI	569,200	2,999.00	1,707,030,800	
光通信	6,900	10,200.00	70,380,000	
NTTドコモ	429,800	2,624.00	1,127,795,200	
エムティーアイ	10,000	749.00	7,490,000	
GMOインターネット	21,600	1,569.00	33,890,400	
カドカワ	16,900	1,559.00	26,347,100	
学研ホールディングス	24,000	330.00	7,920,000	
ゼンリン	8,000	1,703.00	13,624,000	
東京電力HD	494,400	425.00	210,120,000	

中部電力	191,900	1,605.50	308,095,450	
関西電力	238,100	1,128.00	268,576,800	
中国電力	79,600	1,302.00	103,639,200	
北陸電力	56,000	1,238.00	69,328,000	
東北電力	145,100	1,333.00	193,418,300	
四国電力	52,400	1,091.00	57,168,400	貸付株式数 14,700株 (13,800株)
九州電力	129,100	1,125.00	145,237,500	
北海道電力	54,800	830.00	45,484,000	
沖縄電力	8,500	2,324.00	19,754,000	
電源開発	46,200	2,509.00	115,915,800	
イーレックス	2,500	2,932.00	7,330,000	貸付株式数 700株
東京瓦斯	625,000	498.70	311,687,500	
大阪瓦斯	564,000	432.60	243,986,400	
東邦瓦斯	147,000	906.00	133,182,000	
北海道瓦斯	21,000	271.00	5,691,000	貸付株式数 5,000株
広島ガス	15,500	344.00	5,332,000	
西部瓦斯	67,000	246.00	16,482,000	
静岡ガス	18,200	788.00	14,341,600	
メタウォーター	3,400	2,864.00	9,737,600	貸付株式数 1,000株 (600株)
松竹	37,000	1,236.00	45,732,000	
東宝	37,500	3,285.00	123,187,500	
エイチ・アイ・エス	10,000	3,150.00	31,500,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
東映	22,000	921.00	20,262,000	
NTTデータ	35,600	5,690.00	202,564,000	
共立メンテナンス	5,000	6,930.00	34,650,000	貸付株式数 1,300株
イチネンホールディングス	8,700	1,087.00	9,456,900	
建設技術研究所	6,200	1,015.00	6,293,000	
アインホールディングス	7,000	7,990.00	55,930,000	
東京テアトル	84,000	184.00	15,456,000	貸付株式数 23,000株
タナベ経営	3,700	1,298.00	4,802,600	
ナガワ	1,200	4,290.00	5,148,000	
よみうりランド	15,000	469.00	7,035,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
東京都競馬	43,000	279.00	11,997,000	
常磐興産	5,200	1,536.00	7,987,200	
カナモト	8,500	2,610.00	22,185,000	
東京ドーム	24,400	1,177.00	28,718,800	
DTS	6,300	2,532.00	15,951,600	貸付株式数 2,000株
スクウェア・エニックス・HD	22,200	2,883.00	64,002,600	
シーイーシー	3,900	1,894.00	7,386,600	
カブコン	13,600	2,498.00	33,972,800	
西尾レントオール	5,000	3,060.00	15,300,000	
日本空港ビルディング	18,400	4,255.00	78,292,000	貸付株式数 5,100株 (5,100株)
トランス・コスモス	7,300	2,781.00	20,301,300	
乃村工藝社	13,200	1,674.00	22,096,800	
ジャステック	5,900	1,028.00	6,065,200	貸付株式数 1,600株

				(1,600株)
SCSK	15,800	3,975.00	62,805,000	
藤田観光	22,000	329.00	7,238,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
KNT-CTホールディングス	42,000	147.00	6,174,000	
日本管財	5,500	1,631.00	8,970,500	
トーカイ	2,900	3,650.00	10,585,000	
セコム	63,100	8,319.00	524,928,900	
セントラル警備保障	3,300	2,184.00	7,207,200	
アイネス	8,600	1,184.00	10,182,400	
丹青社	11,600	754.00	8,746,400	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
メイテック	7,300	4,295.00	31,353,500	
TKC	5,600	3,090.00	17,304,000	
アサツー ディ・ケイ	9,800	3,025.00	29,645,000	
富士ソフト	8,700	2,653.00	23,081,100	
応用地質	6,300	1,340.00	8,442,000	
船井総研ホールディング	8,300	1,778.00	14,757,400	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
NSD	12,700	1,755.00	22,288,500	
丸紅建材リース	28,000	204.00	5,712,000	
コナミホールディングス	26,000	3,870.00	100,620,000	
学 究 社	4,700	1,362.00	6,401,400	
ベネッセホールディングス	20,400	3,035.00	61,914,000	貸付株式数 5,600株
イオンディライト	6,700	3,140.00	21,038,000	
福井コンピュータHLDS	2,000	2,569.00	5,138,000	
ニチイ学館	11,200	876.00	9,811,200	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
ダイセキ	10,600	2,181.00	23,118,600	
日鉄住金物産	4,700	4,420.00	20,774,000	
元気寿司	2,600	2,067.00	5,374,200	
トラスコ中山	6,700	5,180.00	34,706,000	
ヤマダ電機	191,300	611.00	116,884,300	
オートバックスセブン	20,600	1,660.00	34,196,000	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
アークランドサカモト	10,100	1,328.00	13,412,800	
ニトリホールディングス	25,000	11,940.00	298,500,000	
吉野家ホールディングス	19,300	1,557.00	30,050,100	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
加藤産業	8,800	2,521.00	22,184,800	
イノテック	10,700	526.00	5,628,200	
イエローハット	5,600	2,337.00	13,087,200	
松屋フーズ	2,800	3,480.00	9,744,000	
JBCホールディングス	15,000	689.00	10,335,000	
サガミチェーン	8,500	1,268.00	10,778,000	
日 伝	2,500	3,140.00	7,850,000	
関西スーパーマーケット	5,700	1,490.00	8,493,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ミロク情報サービス	4,700	1,901.00	8,934,700	

因幡電機産業	7,500	3,875.00	29,062,500	
王将フードサービス	4,200	4,150.00	17,430,000	
プレナス	6,300	2,232.00	14,061,600	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,100	1,906.00	7,814,600	
アークス	10,800	2,592.00	27,993,600	
バローホールディングス	12,400	2,732.00	33,876,800	
ミスミグループ本社	64,700	2,046.00	132,376,200	貸付株式数 17,900株
ベルク	2,700	4,115.00	11,110,500	
大庄	4,400	1,544.00	6,793,600	
ファーストリテイリング	9,600	39,570.00	379,872,000	
ソフトバンクグループ	258,500	6,712.00	1,735,052,000	
スズケン	25,900	3,420.00	88,578,000	
サンドラッグ	11,000	7,960.00	87,560,000	
サクスパーホールディング	6,300	1,214.00	7,648,200	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
ジェコス	5,000	994.00	4,970,000	
ベルーナ	15,500	640.00	9,920,000	
合計			124,953,943,460	

(注) 1. ※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

2. 貸付株式数のうち(括弧書)の数字は、委託者の利害関係人である大和証券株式会社に対する貸付であります。

(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 28 年 12 月 30 日

I 資産総額	58,131,087,916 円
II 負債総額	296,701,521 円
III 純資産総額 (I - II)	57,834,386,395 円
IV 発行済数量	26,461,745,358 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	2.1856 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 28 年 12 月 30 日

I 資産総額	130,959,851,885 円
II 負債総額	4,450,163,515 円
III 純資産総額 (I - II)	126,509,688,370 円
IV 発行済数量	136,803,293,151 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	0.9248 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
 - ① 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。
 - ② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。
 - ③ 上記①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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
- (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ます。）に支払います。
- (9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部 委託会社等の情報

第1 委託会社等の概況

1 委託会社等の概況

a. 資本金の額

平成28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

① 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、4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。

② 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CIO（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

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・ファンド評価会議

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。

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、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 28 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	68	219,503
追加型株式投資信託	664	12,714,360
株式投資信託 合計	732	12,933,863
単位型公社債投資信託	14	97,869
追加型公社債投資信託	14	2,167,293
公社債投資信託 合計	28	2,265,162
総合計	760	15,199,024

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8月6日内閣府令第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57期事業年度（平成27年4月1日から平成28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58期事業年度に係る中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

独立監査人の監査報告書

平成 28 年 5 月 27 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

高波博之 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

貞廣篤典 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

内田和男 

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27年4月1日から平成28年3月31日までの第57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28年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績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

(1) 貸借対照表

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,438	31,715
有価証券	4,878	1,137
前払費用	139	159
未収委託者報酬	10,295	9,896
未収収益	110	87
繰延税金資産	585	468
その他	153	83
流動資産計	47,600	43,547
固定資産		
有形固定資産	※1	※1
建物	255	243
器具備品	21	18
無形固定資産	234	224
ソフトウェア	2,759	2,706
ソフトウェア仮勘定	2,758	2,385
投資その他の資産	1	321
投資有価証券	12,979	14,223
関係会社株式	6,667	7,872
出資金	5,129	5,129
長期差入保証金	124	123
その他	996	1,049
固定資産計	60	47
資産合計	15,995	17,173
	63,596	60,720

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	64	61
未払金	9,172	8,789
未払収益分配金	5	5
未払償還金	72	63
未払手数料	4,965	4,330
その他未払金	※2 4,127	※2 4,390
未払費用	4,162	4,215
未払法人税等	1,133	1,155
未払消費税等	1,429	538
賞与引当金	1,092	937
その他	747	22
流動負債計	17,801	15,720
固定負債		
退職給付引当金	2,072	2,209
役員退職慰労引当金	101	93
繰延税金負債	1,745	1,410
その他	2	-
固定負債計	3,920	3,714
負債合計	21,722	19,435
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	14,126	13,960
利益剰余金合計	14,501	14,334
株主資本合計	41,171	41,004
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	702	280
評価・換算差額等合計	702	280
純資産合計	41,873	41,284
負債・純資産合計	63,596	60,720

(2) 損益計算書

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	90,924	88,850
その他営業収益	933	799
営業収益計	91,858	89,650
営業費用		
支払手数料	49,978	46,165
広告宣伝費	670	646
調査費	9,013	10,116
調査費	867	925
委託調査費	8,146	9,191
委託計算費	756	761
営業雑経費	1,289	1,346
通信費	252	249
印刷費	481	515
協会費	53	53
諸会費	13	14
その他営業雑経費	488	513
営業費用計	61,709	59,036
一般管理費		
給料	5,881	5,797
役員報酬	289	354
給料・手当	3,803	3,850
賞与	695	654
賞与引当金繰入額	1,092	937
福利厚生費	831	837
交際費	45	70
旅費交通費	176	211
租税公課	259	325
不動産賃借料	1,180	1,258
退職給付費用	383	394
役員退職慰労引当金繰入額	38	37
固定資産減価償却費	1,032	1,110
諸経費	1,372	1,486
一般管理費計	11,201	11,531
営業利益	18,948	19,082

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	※1	1,226	※1	109
受取利息		20		25
投資有価証券売却益		145		115
外国税関連費用引当金戻入益		-		171
その他		226		73
営業外収益計		1,620		496
営業外費用				
投資有価証券売却損		84		14
その他		67		94
営業外費用計		152		108
経常利益		20,416		19,471
特別利益				
固定資産売却益		7		-
特別利益計		7		-
特別損失				
外国税関連費用		746		-
その他		26		-
特別損失計		772		-
税引前当期純利益		19,651		19,471
法人税、住民税及び事業税		6,238		6,215
法人税等調整額		△17		△6
法人税等合計		6,220		6,209
当期純利益		13,431		13,262

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成 26 年 4 月 1 日 至 平成 27 年 3 月 31 日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金		
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,126	△10,126	△10,126
当期純利益	-	-	-	13,431	13,431	13,431
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,304	3,304	3,304
当期末残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	494	494	38,360
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,126
当期純利益	-	-	13,431
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	208	208	208
当期変動額合計	208	208	3,513
当期末残高	702	702	41,873

当事業年度（自 平成 27 年 4 月 1 日 至 平成 28 年 3 月 31 日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,428	△13,428	△13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△166	△166	△166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	702	702	41,873
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△13,428
当期純利益	-	-	13,262
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	△422	△422	△422
当期変動額合計	△422	△422	△589
当期末残高	280	280	41,284

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

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. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額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	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度毎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。

(3) 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。

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 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)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「投資有価証券売却益」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。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、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた372百万円は、「投資有価証券売却益」145百万円、「その他」226百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成 27 年 3 月 31 日)	当事業年度 (平成 28 年 3 月 31 日)
建物	20 百万円	23 百万円
器具備品	275 百万円	232 百万円

※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 (平成 27 年 3 月 31 日)	当事業年度 (平成 28 年 3 月 31 日)
未払金	4,084 百万円	4,320 百万円

3 保証債務

前事業年度 (平成 27 年 3 月 31 日)

子会社である Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. の債務 1,834 百万円に対して保証を行っております。

当事業年度 (平成 28 年 3 月 31 日)

子会社である Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. の債務 1,749 百万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次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
受取配当金	1,065百万円	—

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	—	—	2,608
合計	2,608	—	—	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26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27年6月23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とおり提案しております。

- ① 剰余金の配当の総額 13,428百万円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 5,148円
- ④ 基準日 平成27年3月31日
- ⑤ 効力発生日 平成27年6月24日

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	—	—	2,608
合 計	2,608	—	—	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成27年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,428	5,148	平成27年 3月31日	平成27年 6月24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28年6月23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とおり提案しております。

- ① 剰余金の配当の総額 13,262百万円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 5,084円
- ④ 基準日 平成28年3月31日
- ⑤ 効力発生日 平成28年6月24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。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券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。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

(i) 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。

(ii) 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、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、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

②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リスクマネジメント会議において報告を行っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、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27年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	31,438	31,438	—
(2) 未収委託者報酬	10,295	10,295	—
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	10,520	10,520	—
資産計	52,254	52,254	—
(1) 未払手数料	4,965	4,965	—
(2) その他未払金	4,127	4,127	—
(3) 未払費用(*)	3,366	3,366	—
負債計	12,460	12,460	—

(*) 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。

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	31,715	31,715	—
(2) 未収委託者報酬	9,896	9,896	—
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,987	7,987	—
資産計	49,599	49,599	—
(1) 未払手数料	4,330	4,330	—
(2) その他未払金	4,390	4,390	—
(3) 未払費用(*)	3,420	3,420	—
負債計	12,141	12,141	—

(*) 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。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(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、証券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。

(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：百万円）

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,025	1,021
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	996	1,049

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27年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,438	-	-	-
未収委託者報酬	10,295	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	6	1,591	3,790	84
合計	41,740	1,591	3,790	84

当事業年度 (平成28年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,715	-	-	-
未収委託者報酬	9,896	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	1,115	4,570	1,712	141
合計	42,727	4,570	1,712	141

(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27年3月31日)

子会社株式 (貸借対照表計上額 5,129百万円) 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28年3月31日)

子会社株式 (貸借対照表計上額 5,129百万円) 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27年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	164	55	109
（2）その他 証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	5,779	5,793	△14
小計	5,779	5,793	△14
合計	10,520	9,482	1,038

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,025百万円）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28年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	141	55	86
（2）その他 証券投資信託	3,875	3,408	466
小計	4,016	3,463	553
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,970	4,119	△148
小計	3,970	4,119	△148
合計	7,987	7,583	404

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,021百万円）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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	32	-	1
(2) その他 証券投資信託	34,371	145	84
合計	34,404	145	85

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	3	-	0
(2) その他 証券投資信託	19,069	115	13
合計	19,072	115	14

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、証券投資信託について4百万円の減損処理を行っております。

(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、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,959百万円	2,072百万円
勤務費用	212	222
退職給付の支払額	△118	△120
その他	18	35
退職給付債務の期末残高	2,072	2,209

(2)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,072 百万円	2,209 百万円
貸借対照表に計上された負債 と資産の純額	2,072	2,209
退職給付引当金	2,072	2,209
貸借対照表に計上された負債 と資産の純額	2,072	2,209

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用	212 百万円	222 百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	212	222

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度170百万円、当事業年度172百万円であります。

(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：百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	670	676
賞与引当金	305	225
外国税関連費用	241	-
未払事業税	231	224
連結法人間取引（譲渡損）	128	121
投資有価証券評価損	105	95
出資金評価損	103	98
その他	206	173
繰延税金資産小計	1,992	1,615
評価性引当額	△ 613	△ 347
繰延税金資産合計	1,379	1,268
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	2,203	2,086
その他有価証券評価差額金	335	124
繰延税金負債合計	2,539	2,210
繰延税金負債の純額	1,159	941

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.64%	33.06%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.14%	0.77%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△2.02%	△0.02%
評価性引当額の増減額	△2.67%	△1.29%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	△0.51%	△0.19%
その他	0.07%	△0.43%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.65%	31.89%

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

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成 28 年法律第 15 号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成 28 年法律第 13 号）が平成 28 年 3 月 29 日に国会で成立し、平成 28 年 4 月 1 日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等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 32.34%から平成 28 年 4 月 1 日に開始する事業年度及び平成 29 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 30.86%に、平成 30 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 30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が 24 百万円、繰延税金負債（長期）が 74 百万円、法人税等調整額が 50 百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が 6 百万円増加しております。

（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

内国籍証券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26年 4 月 1 日 至 平成27年 3 月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年 4 月 1 日 至 平成28年 3 月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの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 26 年 4 月 1 日 至 平成 27 年 3 月 31 日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
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 (注)	1,834	—	—

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。

当事業年度 (自 平成 27 年 4 月 1 日 至 平成 28 年 3 月 31 日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
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 (注)	1,749	—	—

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 26 年 4 月 1 日 至 平成 27 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 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
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 (注2)	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	㈱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 (注3)	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	—	本社ビルの管理	不動産の賃借料 (注4)	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注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。

(注4) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度 (自 平成 27 年 4 月 1 日 至 平成 28 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 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
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 (注2)	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	㈱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 (注3)	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	—	本社ビルの管理	不動産の賃借料 (注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注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。

(注4) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,052.69円	1株当たり純資産額	15,826.85円
1株当たり当期純利益	5,148.94円	1株当たり当期純利益	5,084.10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 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,431	13,262
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。

独立監査人の中間監査報告書

平成 28 年 11 月 24 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

高波 博之 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

貞廣 篤典 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

内田 和男 

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28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (平成28年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		22,153
有価証券		529
未収委託者報酬		9,521
繰延税金資産		428
その他		351
流動資産合計		32,984
固定資産		
有形固定資産	※1	241
無形固定資産		
ソフトウェア		2,212
その他		252
無形固定資産合計		2,465
投資その他の資産		
投資有価証券		7,003
関係会社株式		5,129
その他		1,296
投資その他の資産合計		13,430
固定資産合計		16,137
資産合計		49,121

(単位:百万円)

当中間会計期間
(平成28年9月30日)

負債の部		
流動負債		
未払金		7,144
未払費用		3,762
未払法人税等		1,205
賞与引当金		733
その他	※3	434
流動負債合計		13,279
固定負債		
退職給付引当金		2,301
役員退職慰労引当金		122
その他		9
固定負債合計		2,432
負債合計		15,712
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,184
利益剰余金合計		6,559
株主資本合計		33,229
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		179
評価・換算差額等合計		179
純資産合計		33,408
負債・純資産合計		49,121

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		39,705
その他営業収益		356
営業収益合計		40,062
営業費用		
支払手数料		20,125
その他営業費用		5,997
営業費用合計		26,122
一般管理費	※ 1	5,754
営業利益		8,184
営業外収益	※ 2	165
営業外費用	※ 3	59
経常利益		8,290
特別利益		—
特別損失	※ 4	260
税引前中間純利益		8,029
法人税、住民税及び事業税		3,936
法人税等調整額		△1,393
中間純利益		5,486

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成 28 年 4 月 1 日 至 平成 28 年 9 月 30 日）

(単位：百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,261	△ 13,261	△ 13,261
中間純利益	-	-	-	5,486	5,486	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 7,775	△ 7,775	△ 7,775
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,184	6,559	33,229

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	280	280	41,284
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,261
中間純利益	-	-	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 100	△ 100	△ 100
当中間期変動額合計	△ 100	△ 100	△ 7,875
当中間期末残高	179	179	33,408

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社

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

中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、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年間）に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

4. 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方式によっております。

(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。

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成28年9月30日現在)
有形固定資産	273百万円

2 保証債務

当中間会計期間（平成28年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd. の債務1,554百万円に対して保証を行っております。

※3 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	528百万円

※2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
受取配当金	62百万円
投資有価証券売却益	53百万円

※3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
為替差損	23百万円
投資有価証券売却損	16百万円

※4 特別損失の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成 28 年 4 月 1 日 至 平成 28 年 9 月 30 日)
MMF等償還関連費用	260百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成 28 年 4 月 1 日 至 平成 28 年 9 月 30 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 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成 28 年 6 月 23 日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成 28 年 3 月 31 日	平成 28 年 6 月 24 日

(金融商品関係)

当中間会計期間 (平成 28 年 9 月 30 日)

金融商品の時価等に関する事項

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：百万円)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,153	22,153	—
(2) 未収委託者報酬	9,521	9,521	—
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,511	6,511	—
資産合計	38,186	38,186	—
(1) 未払金	7,144	7,144	—
(2) 未払費用 (*)	3,762	3,762	—
負債合計	10,906	10,906	—

(*) 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。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

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、証券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。

(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：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	1,021
子会社株式	5,129
差入保証金	1,051

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。

(有価証券関係)

当中間会計期間 (平成28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 5,129 百万円) は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
(1) 株式	111	55	56
(2) その他			
証券投資信託	3,994	3,627	366
小計	4,105	3,682	422
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	2,406	2,569	△163
小計	2,406	2,569	△163
合計	6,511	6,252	259

(注) 非上場株式 (中間貸借対照表計上額 1,021 百万円) 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。

(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28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
1株当たり純資産額	12,807.54円
1株当たり中間純利益金額	2,103.26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いません。

(注2) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,486
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,486
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—
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。

- ① 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。）。
- ② 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。）。
- ③ 通常の見積り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④⑤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。
- ④ 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。
- ⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 その他

- a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項
提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。
- b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実
訴訟事件その他委託会社に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。

追加型証券投資信託

(DCダイワ日本株式インデックス)

約 款

大和証券投資信託委託株式会社

運用の基本方針

約款第18条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。

2. 運用方法

(1) 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。

(2) 投資態度

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。

(3) 投資制限

- ① マザーファンドの受益証券への投資制限
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。
- ② 外貨建資産への投資制限
外貨建資産への投資は、行ないません。

3. 収益分配方針

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、配当等収益等を中心に分配します。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。
- ③ 留保益は、上記「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

追加型証券投資信託
(DCダイワ日本株式インデックス)
約 款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

③ 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行なうものとします。

(信託の目的および金額)

第2条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けま

す。

(信託金の限度額)

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、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。

② 追加信託が行なわれたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第39条第1項、第40条第1項、第41条第1項および第43条第2項の規定による信託終了日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

第5条 この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

(当初の受益者)

第6条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により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。

(受益権の分割および再分割)

第7条 委託者は、第2条の規定による受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところに従い、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。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第8条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受け、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」と

います。) 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。)

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- ③ 委託者は、第7条の規定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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在のすべての受益権(受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含まず)を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する第一種金融商品取引業者(委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。)および登録金融機関(委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。)(以下総称して「指定販売会社」といいます。)に当該申請の手続を委任することができます。

(受益権の設定にかかる受託者の通知)

第11条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

(受益権の申込単位および価額)

第12条 委託者は、第7条第1項の規定により分割される受益権の取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込に応じることができます。

- ② 指定販売会社は、第7条第1項の規定により分割される受益権を別に定める積立投資約款に従って契約(以下「積立投資契約」といいます。)を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込に応じることができます。
- ③ 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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、指定販売会社は、当該取得申込の代金(第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。)の支払いと引き換えに、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。
- ④ 第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑤ 前項の規定にかかわらず、受益者が積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第29条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

(受益権の譲渡にかかる記載または記録)

第12条の2 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。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。)に社振法の規定に従い、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。

- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第12条の3 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

第13条 (削 除)

第14条 (削 除)

第15条 (削 除)

(投資の対象とする資産の種類)

第16条 この信託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、約款第19条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6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

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第17条 委託者は、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
- ② 委託者は、信託金を、前項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

(受託者の自己または利害関係人等との取引)

第17条の2 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第20条において同じ。）、第20条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条ならびに第17条第1項および第2項に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行なうことができます。

- ② 前項の取扱いは、第19条、第24条から第26条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

(運用の基本方針)

第18条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行

ないます。

(先物取引等の運用指図)

第19条 委託者は、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。）。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第19条の2 委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(信託業務の委託等)

第20条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限り、）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第21条 (削 除)

(混蔵寄託)

第22条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行されたコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第23条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(一部解約の請求および有価証券の売却等の指図)

第24条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第25条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第26条 委託者は、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。

② 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または解約代金入金日までの間もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

③ 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。

④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第27条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(信託終了時における受託者による資金の立替え)

第28条 信託終了日までに金額を見積ることのできる未収入金があるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

② 前項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第29条 この信託の計算期間は、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15年1月27日から平成15年11月30日までとします。

② 前項の規定にかかわらず、前項の規定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。

(信託財産に関する報告)

第30条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第31条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者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(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

② 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。

(信託報酬等の額および支弁の方法)

第32条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第29条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の62以内の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6カ月終了日(6カ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。

③ 第1項の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。

(収益の分配方式)

第33条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(収益分配金の再投資)

第34条 収益分配金（委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金を除きます。）は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、指定販売会社に支払われます。

- ② 指定販売会社は、積立投資契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとします。当該取得申込により増加した受益権は、第10条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金の支払いは、委託者において行なうものとします。
- ④ 収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

(償還金および一部解約金の支払い)

第35条 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。）は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、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指定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支払います。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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、社振法の規定に従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。

- ② 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、4営業日目から受益者に支払います。
- ③ 前2項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとします。
- ④ 償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第36条 受託者は、収益分配金については第34条に規定する交付開始前に、償還金については前条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第2項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(償還金の時効)

第37条 受益者が、信託終了による償還金について第35条第1項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(信託契約の一部解約)

第38条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、1口単位をもって、委託者に一部解約請求をすることができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約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この信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、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、社振法の規定に従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 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の基準価額とします。
- ④ 平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約にかかる一部解約の実行の請求を受益者がするとき、委託者または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約請求で、平成19年1月4日前行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとし、
- ⑤ 委託者は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約請求の受付を中止することができます。
- ⑥ 前項により一部解約請求の受付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請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第38条の2 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、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第39条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に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 前項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者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 前項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を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨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この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、この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 第3項から前項までの規定は、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、第3項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。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第40条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第44条の規定に従います。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第41条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第44条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第42条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第43条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第44条の規定に従い、新受託者を選任します。

② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第44条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、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け出ます。

② 委託者は、前項の変更事項のうち、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この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、この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 前項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者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 前項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を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、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この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、この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。

(反対者の買取請求権)

第45条 第39条の規定に従い信託契約の解約を行なう場合または前条の規定に従い信託約款の変更を行なう場合において、第39条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、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。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第45条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第46条 委託者が受益者に対してする公告は、平成20年6月30日までは日本経済新聞に掲載し、平成20年7月1日以降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 平成20年7月1日以降において、前項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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第47条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付 則)

第 1条 この約款において「積立投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「積立投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、この場合、「積立投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2条 第34条第4項および第35条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第 3条 平成18年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条(受益証券の再交付)から第15条(受

益証券の再交付の費用)の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

平成15年 1月27日

委託者 大和証券投資信託委託株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社