

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成27年2月20日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 白川 真
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山部 努 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3111
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	年金ダイワ日本株式インデックス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続申込期間（平成27年2月21日から平成28年2月22日まで） 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

年金ダイワ日本株式インデックス

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(5) 【申込手数料】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

平成27年2月21日から平成28年2月22日まで（継続申込期間）
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

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

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

当ファンドは、積立投資専用です。

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

ロ．収益分配金は、自動的に再投資されます。

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

取得申込金額に利息は付きません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		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		TOPIX
債券	年6回 (隔月)	アジア		
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：

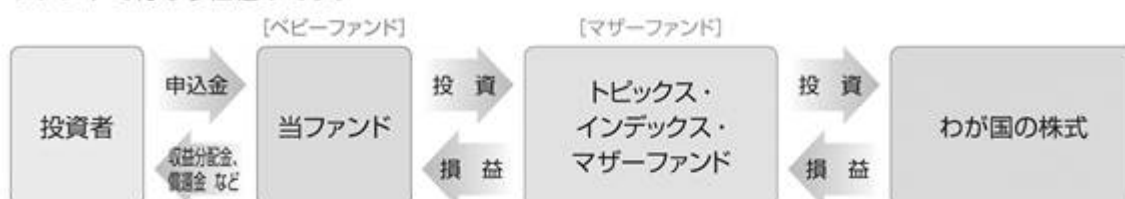
$$\text{修正後の基準時価総額} = \text{修正前日の基準時価総額} \times \\ (\text{修正前日の時価総額} \pm \text{修正額}) \div \text{修正前日の時価総額}$$

- 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ないます。

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



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

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

2

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

3

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

〈分配方針〉

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

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成18年10月27日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3 ）	
お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3 ）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 3 ）

受託会社	三井住友信託銀行 株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・ サービス信託銀行株 式会社	<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 style="text-align: center;">委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
------	--	--

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26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	%
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	2,608,525	100.00

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

投資態度

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

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】

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

1. 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)に定めるものに限ります。)
 - ハ．約束手形
 - ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

委託会社は、信託金を、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたトピックス・インデックス・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
3. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

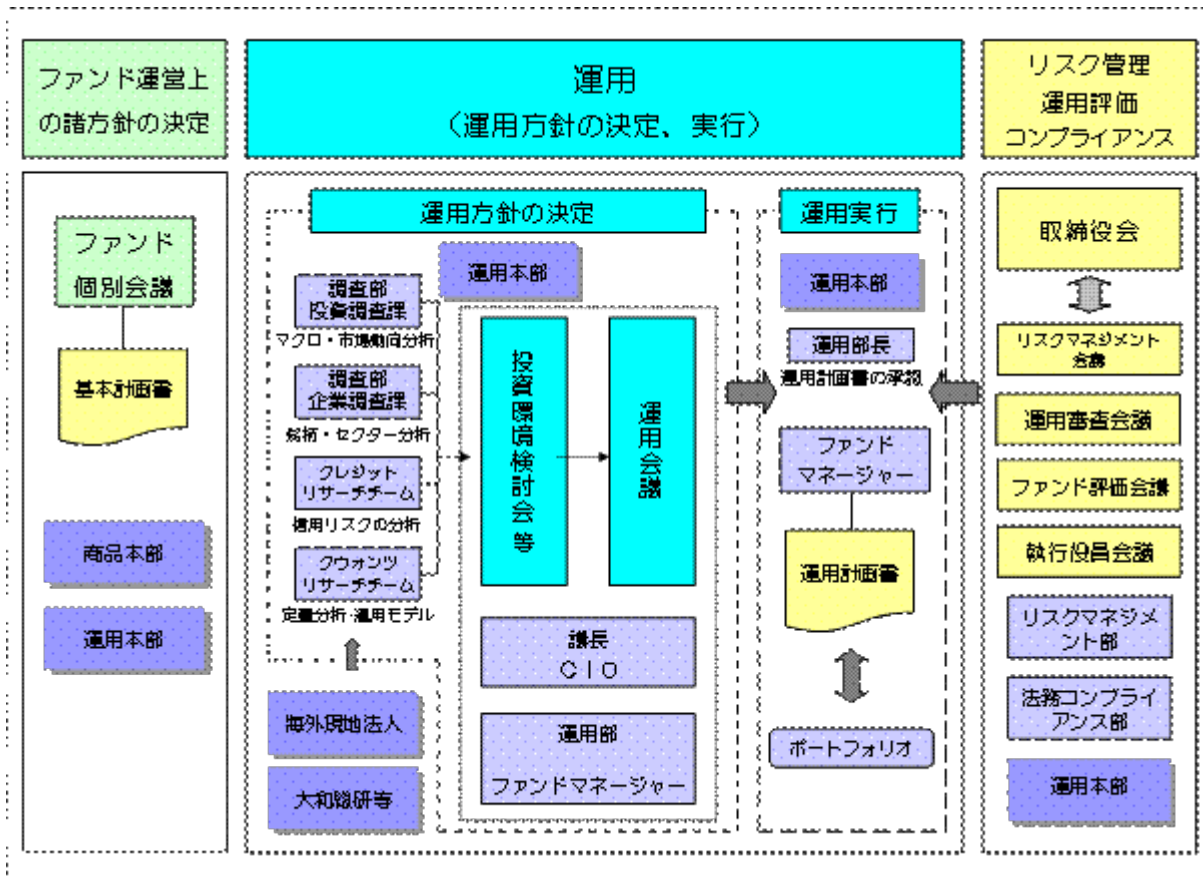
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者である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。

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（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（1～5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。

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25～35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。

八．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。

二．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。

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27年1月1日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等（信託約款）

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

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。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への投資は、行ないません。

資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目

的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

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

<参考> マザーファンド(トピックス・インデックス・マザーファンド)の概要

(1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式(上場予定を含みます。)を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

委託会社は、信託金を、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)で市場性のあるものに投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

3. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。
外貨建資産への投資は、行ないません。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

株価指数先物取引の利用に伴うリスク

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

その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

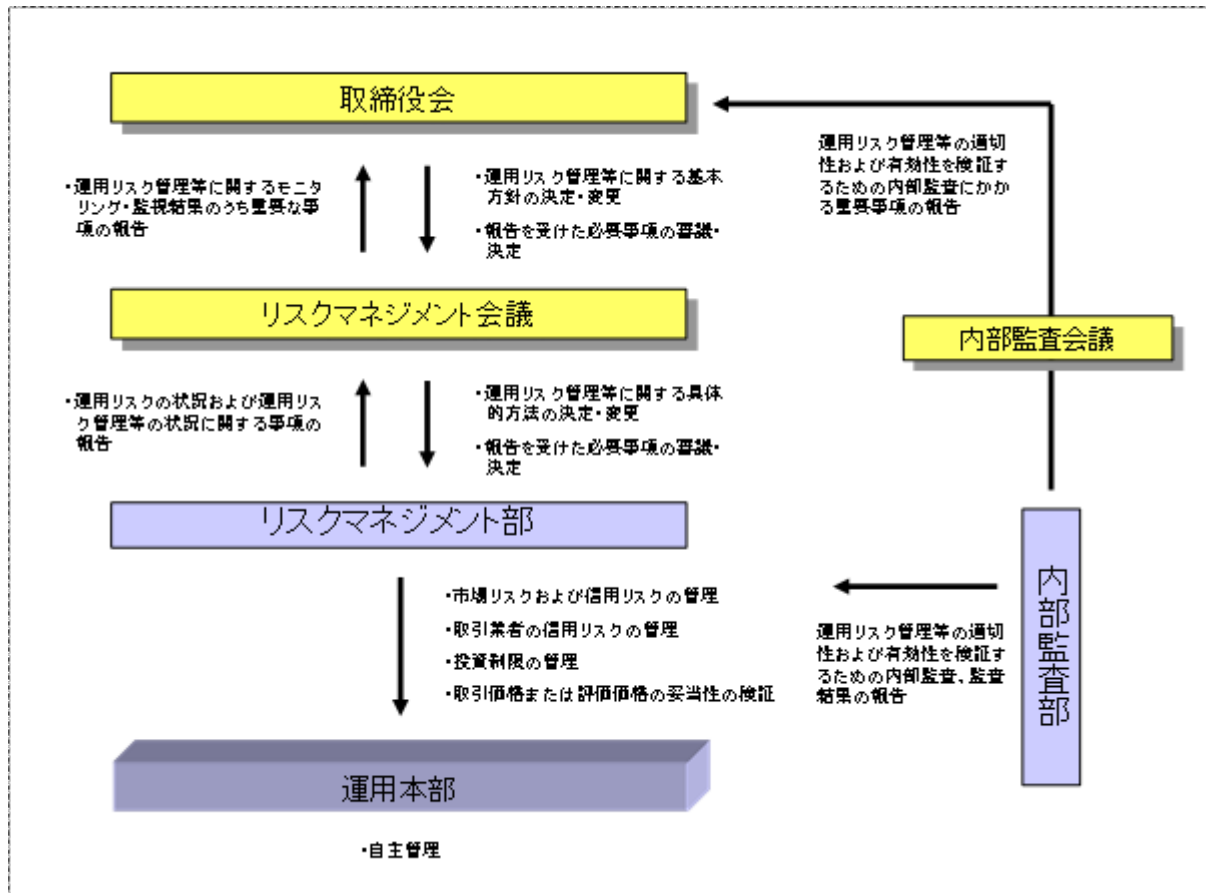
(3) その他の留意点

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

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。

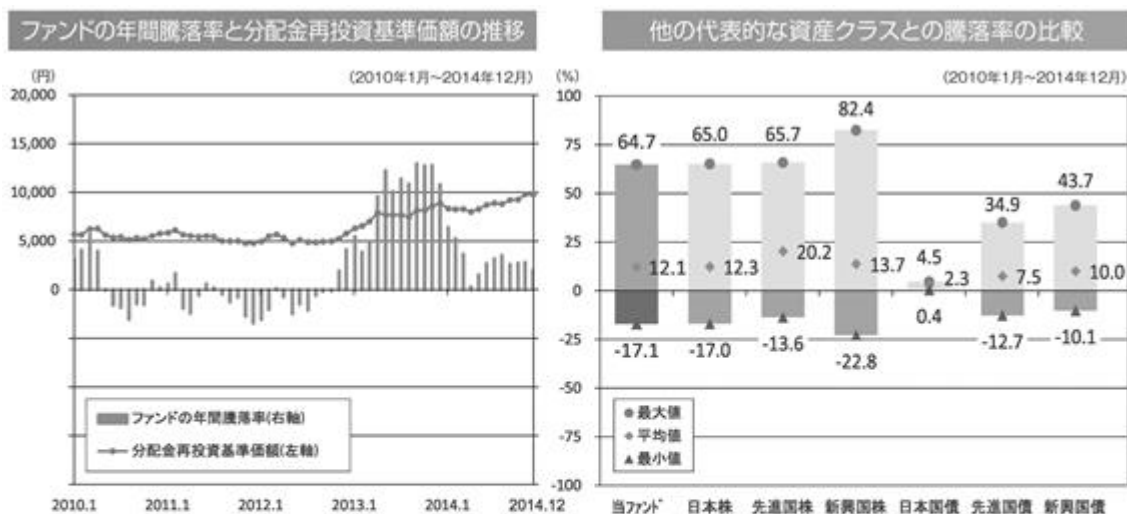


流動性リスクに対する管理体制

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。



- ※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、知的財産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、野村證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證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、知的財産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らず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 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.1836%（税抜0.17%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.08% （税抜）	年率0.06% （税抜）	年率0.03% （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。

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

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】

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

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

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

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

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

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

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

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

<注1> 個別元本について

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

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

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

投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

（ ）上記は、平成26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26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	2,501,345,455	99.98
内 日本	2,501,345,455	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	399,888	0.02
純資産総額	2,501,745,343	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26年12月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	3,040,410,181	0.8301 2,523,945,256	0.8227 2,501,345,455	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成19年11月30日)	81,855,912	81,855,912	0.9320	0.9320
第2計算期間末 (平成20年12月1日)	173,040,952	173,040,952	0.5128	0.5128
第3計算期間末 (平成21年11月30日)	361,629,918	361,629,918	0.5292	0.5292
第4計算期間末 (平成22年11月30日)	583,936,066	583,936,066	0.5526	0.5526
第5計算期間末 (平成23年11月30日)	701,141,147	701,141,147	0.4777	0.4777
第6計算期間末 (平成24年11月30日)	994,840,569	994,840,569	0.5241	0.5241
第7計算期間末 (平成25年12月2日)	1,802,195,101	1,802,195,101	0.8588	0.8588
平成25年12月末日	1,873,358,973	-	0.8888	-
平成26年1月末日	1,769,269,900	-	0.8328	-
2月末日	1,767,813,236	-	0.8270	-
3月末日	1,789,646,276	-	0.8288	-
4月末日	1,734,488,498	-	0.8008	-
5月末日	1,965,128,372	-	0.8280	-
6月末日	2,118,550,913	-	0.8707	-
7月末日	2,169,445,095	-	0.8892	-
8月末日	2,171,174,905	-	0.8813	-
9月末日	2,286,519,317	-	0.9207	-
10月末日	2,328,565,700	-	0.9260	-
11月末日	2,460,951,261	-	0.9791	-
第8計算期間末 (平成26年12月1日)	2,482,297,091	2,482,297,091	0.9870	0.9870
12月末日	2,501,745,343	-	0.9781	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.8
第2計算期間	45.0
第3計算期間	3.2
第4計算期間	4.4
第5計算期間	13.6
第6計算期間	9.7
第7計算期間	63.9
第8計算期間	14.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	88,134,563	1,304,551
第2計算期間	256,258,194	6,653,498
第3計算期間	366,384,982	20,413,545
第4計算期間	397,758,878	24,516,478
第5計算期間	464,858,243	53,854,727
第6計算期間	571,631,321	141,136,727
第7計算期間	474,197,635	273,895,816
第8計算期間	894,786,317	478,329,687

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(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

(1) 投資状況（平成26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		126,183,238,990	99.18
	内 日本	126,183,238,990	99.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,037,576,660	0.82
純資産総額		127,220,815,650	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)		928,950,000	0.73
	内 日本	928,950,000	0.73

(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26年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	845,800	6,494.00 5,492,625,200	7,558.00 6,392,556,400	5.02
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,850,500	628.45 3,048,326,670	664.50 3,223,157,250	2.53
3	ソフトバンク	日本	株式	情報・通 信業	320,400	8,686.17 2,783,049,790	7,210.00 2,310,084,000	1.82
4	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	456,400	4,463.00 2,036,913,200	4,375.00 1,996,750,000	1.57
5	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	550,700	3,756.00 2,068,429,200	3,526.00 1,941,768,200	1.53
6	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	8,331,000	200.44 1,669,929,388	202.50 1,687,027,500	1.33
7	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	205,100	6,663.09 1,366,600,444	7,637.00 1,566,348,700	1.23

8	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	236,800	6,836.00 1,618,764,800	6,211.00 1,470,764,800	1.16
9	キヤノン	日本	株式	電気機 器	354,900	3,591.00 1,274,445,900	3,840.50 1,362,993,450	1.07
10	日立	日本	株式	電気機 器	1,470,000	830.90 1,221,423,000	900.70 1,324,029,000	1.04
11	ファナック	日本	株式	電気機 器	63,800	19,320.00 1,232,616,000	19,945.00 1,272,491,000	1.00
12	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	378,000	3,614.50 1,366,281,000	3,328.00 1,257,984,000	0.99
13	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	730,800	1,600.50 1,169,645,400	1,686.50 1,232,494,200	0.97
14	武田薬品	日本	株式	医薬品	239,600	4,893.50 1,172,482,600	4,996.50 1,197,161,400	0.94
15	三菱地所	日本	株式	不動産 業	450,000	2,387.52 1,074,388,160	2,555.50 1,149,975,000	0.90
16	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	252,200	4,115.00 1,037,803,000	4,358.50 1,099,213,700	0.86
17	パナソニック	日本	株式	電気機 器	747,200	1,317.39 984,358,351	1,427.00 1,066,254,400	0.84
18	三井不動産	日本	株式	不動産 業	320,000	3,350.50 1,072,160,000	3,255.00 1,041,600,000	0.82
19	三菱商事	日本	株式	卸売業	461,300	2,312.50 1,066,756,250	2,217.00 1,022,702,100	0.80
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	111,700	8,109.00 905,775,300	9,123.00 1,019,039,100	0.80
21	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	54,800	14,535.00 796,518,000	18,140.00 994,072,000	0.78
22	東京海上HD	日本	株式	保険業	248,400	3,370.27 837,177,219	3,933.50 977,081,400	0.77
23	ソニー	日本	株式	電気機 器	394,800	1,937.64 764,980,552	2,472.50 976,143,000	0.77
24	日産自動車	日本	株式	輸送用 機器	859,200	1,076.50 924,928,800	1,057.00 908,174,400	0.71
25	信越化学	日本	株式	化学	115,000	7,150.00 822,250,000	7,866.00 904,590,000	0.71
26	富士重工業	日本	株式	輸送用 機器	208,900	3,371.00 704,201,900	4,300.00 898,270,000	0.71
27	三菱電機	日本	株式	電気機 器	612,000	1,430.50 875,466,000	1,446.00 884,952,000	0.70

28	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	497,600	1,909.50 950,167,200	1,768.00 879,756,800	0.69
29	野村ホールディングス	日本	株式	証券、商 品先物 取引業	1,235,900	689.00 851,535,100	690.20 853,018,180	0.67
30	デンソー	日本	株式	輸送用 機器	150,900	4,879.00 736,241,100	5,652.00 852,886,800	0.67

(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	99.18%
合計	99.18%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.44%
建設業	2.70%
食料品	3.92%
繊維製品	0.79%
パルプ・紙	0.23%
化学	6.00%
医薬品	4.43%
石油・石炭製品	0.49%
ゴム製品	0.91%
ガラス・土石製品	0.94%
鉄鋼	1.57%
非鉄金属	0.97%
金属製品	0.65%
機械	5.26%
電気機器	12.96%
輸送用機器	11.88%
精密機器	1.45%
その他製品	1.37%
電気・ガス業	2.07%
陸運業	4.01%

海運業	0.33%
空運業	0.61%
倉庫・運輸関連業	0.22%
情報・通信業	6.66%
卸売業	4.08%
小売業	4.11%
銀行業	8.97%
証券、商品先物取引業	1.41%
保険業	2.42%
その他金融業	1.23%
不動産業	3.04%
サービス業	2.94%
合計	99.18%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2015年3月	買建	66	917,027,467	928,950,000	0.73%

(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

2014年12月30日現在

※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・純資産の推移

基準価額	9,781円
純資産総額	25億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.1%
3カ月間	6.2%
6カ月間	12.3%
1年間	10.0%
3年間	104.4%
5年間	70.9%
設定来	-2.2%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期			
	07年11月	08年12月	09年11月	10年11月	11年11月	12年11月	13年12月	14年12月			
分配金	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。

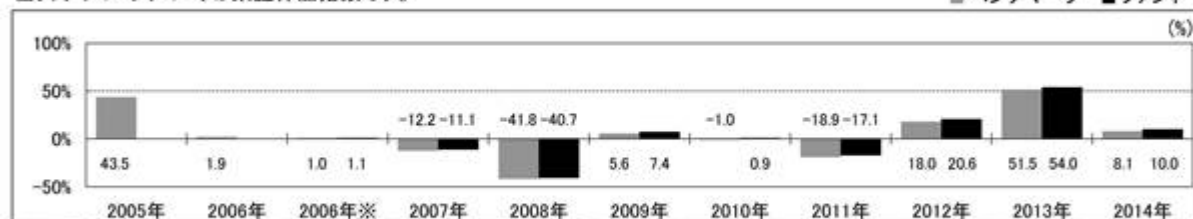
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,303	99.2%	電気機器	13.0%	トヨタ自動車	輸送用機器	5.0%
国内株式先物	1	0.7%	輸送用機器	11.9%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.5%
不動産投資信託等	-	-	銀行業	9.0%	ソフトバンク	情報・通信業	1.8%
コール・ローン、その他	-	0.8%	情報・通信業	6.7%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.6%
合計	1,304	-	化学	6.0%	本田技研	輸送用機器	1.5%
株式市場・上場別構成			機械	5.3%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.3%
一部(東証・名証)		99.2%	医薬品	4.4%	KDDI	情報・通信業	1.2%
二部(東証・名証)		-	小売業	4.1%	日本電信電話	情報・通信業	1.2%
新興市場他		-	卸売業	4.1%	キヤノン	電気機器	1.1%
その他		-	その他	34.8%	日立	電気機器	1.0%
合計		99.2%	合計	99.2%	合計		18.3%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■ベンチマーク ■ファンド



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。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。

・2006年※は設定日(10月27日)から年末、2014年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

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

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

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

2 【換金(解約)手続等】

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

<一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問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) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

信託の終了

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

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

信託約款の変更

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

反対者の買取請求権

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

運用報告書

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。

公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

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

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

償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとし、

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

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間（平成25年12月3日から平成26年12月1日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

年金ダイワ日本株式インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 平成25年12月2日現在	第8期 平成26年12月1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,022,766	5,004,963
親投資信託受益証券	1,802,084,035	2,481,901,133
未収入金	2,840,000	-
流動資産合計	1,806,946,801	2,486,906,096
資産合計	1,806,946,801	2,486,906,096
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,245,774	2,545,658
未払受託者報酬	258,137	353,702
未払委託者報酬	1,204,852	1,650,772
その他未払費用	42,937	58,873
流動負債合計	4,751,700	4,609,005
負債合計	4,751,700	4,609,005
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,098,448,474	1 2,514,905,104
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 296,253,373	2 32,608,013
（分配準備積立金）	532,243,186	759,822,352
元本等合計	1,802,195,101	2,482,297,091
純資産合計	1,802,195,101	2,482,297,091
負債純資産合計	1,806,946,801	2,486,906,096

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 至	平成24年12月1日 平成25年12月2日	自 至	平成25年12月3日 平成26年12月1日
営業収益				
受取利息		1,109		1,081
有価証券売買等損益		662,525,693		330,128,098
営業収益合計		662,526,802		330,129,179
営業費用				
受託者報酬		464,290		631,491
委託者報酬		2,167,100		2,947,293
その他費用		77,222		105,964
営業費用合計		2,708,612		3,684,748
営業利益		659,818,190		326,444,431
経常利益		659,818,190		326,444,431
当期純利益		659,818,190		326,444,431
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（ ）		53,806,460		6,183,920
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		903,306,086		296,253,373
剰余金増加額又は欠損金減少額		125,705,174		69,074,369
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		125,705,174		69,074,369
剰余金減少額又は欠損金増加額		124,664,191		138,057,360
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		124,664,191		138,057,360
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		296,253,373		32,608,013

(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8期	
	自 平成25年12月3日	至 平成26年12月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 平成25年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を平成25年12月2日としており、平成26年11月30日が休日のため、当計算期間末日を平成26年12月1日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第7期	第8期
	平成25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
1. 1 期首元本額	1,898,146,655円	2,098,448,474円
期中追加設定元本額	474,197,635円	894,786,317円
期中一部解約元本額	273,895,816円	478,329,687円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,098,448,474口	2,514,905,104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296,253,373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32,608,013円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第7期	第8期
	自 平成24年12月1日 至 平成25年12月2日	自 平成25年12月3日 至 平成26年12月1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（1,061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（532,241,523円）、投資信託約款に規定される収益調整金（609円）及び分配準備積立金（602円）より分配可能額は532,243,795円（1万口当たり2,536.37円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。</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（1,081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（332,627,270円）、投資信託約款に規定される収益調整金（210,680,670円）及び分配準備積立金（427,194,001円）より分配可能額は970,503,022円（1万口当たり3,859.00円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	第8期
	自 平成25年12月3日 至 平成26年12月1日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第8期 平成26年12月1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 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7期 平成25年12月2日現在	第8期 平成26年12月1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	631,629,485	337,113,668
合計	631,629,485	337,113,668

(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7期 平成25年12月2日現在	第8期 平成26年12月1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8期 自 平成25年12月3日 至 平成26年12月1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7期 平成25年12月2日現在	第8期 平成26年12月1日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8588円 (8,588円)	0.9870円 (9,870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	2,989,882,103	2,481,901,133	
親投資信託受益証券 合計			2,481,901,133	
合計			2,481,901,133	

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25年12月2日現在		平成26年12月1日現在	
	金額（円）		金額（円）	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		1,363,938,210		7,759,929,209
株式	3 4	123,025,728,030		128,429,278,710
派生商品評価勘定		25,111,446		72,039,299
未収入金		6,037,874		12,441,011
未収配当金		409,456,467		471,202,375
その他未収収益	5	-		11,002,355
流動資産合計		124,830,272,027		136,755,892,959
資産合計		124,830,272,027		136,755,892,959
負債の部				
流動負債				
前受金		34,160,000		61,605,000
未払金		-		309,731,152
未払解約金		233,274,000		170,291,500
未払利息		-		139,310
受入担保金		-		6,369,936,457
その他未払費用		-		49,744
流動負債合計		267,434,000		6,911,753,163
負債合計		267,434,000		6,911,753,163
純資産の部				
元本等				
元本	1	172,799,217,116		156,429,196,684
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	48,236,379,089		26,585,056,888
元本等合計		124,562,838,027		129,844,139,796
純資産合計		124,562,838,027		129,844,139,796
負債純資産合計		124,830,272,027		136,755,892,959

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25年12月3日 至 平成26年12月1日
-----	------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>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。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
1. 1 期首	平成24年12月1日	平成25年12月3日
期首元本額	202,871,820,683円	172,799,217,116円
期中追加設定元本額	11,731,736,996円	13,085,758,738円
期中一部解約元本額	41,804,340,563円	29,455,779,170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	1,686,119,625円	1,649,409,274円
トピックス・インデックス	7,975,314,119円	6,873,376,545円
ファンド		
ダイワ・トピックス・イン	24,067,136,706円	20,854,254,321円
デックスファンドVA		
適格機関投資家専用・ダイ	505,467,423円	281,828,838円
ワ・トピックスインデックス		
ファンドVA2		

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	287,060,542円	257,375,152円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	5,197,129,500円	4,407,636,350円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	245,653,219円	204,772,382円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	7,223,655,008円	6,079,456,236円
D-I's TOPIXイン デックス	- 円	26,531,872円
DCダイワ日本株式インデッ クス	62,825,615,407円	61,223,159,280円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,057,211,137円	1,980,050,202円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	1,852,566,774円	2,046,507,975円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,548,202,543円	1,750,405,350円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	2,499,769,782円	2,989,882,103円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	18,636,736円	22,554,312円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	31,761,839円	40,879,759円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	5,984,792円	7,231,848円
ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	319,467,877円	24,797,025円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	2,388,142,279円	80,684,863円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	1,314,872,463円	47,683,722円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	80,802,324円	71,973,936円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	561,017,283円	421,849,875円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA(国内株式型)	250,357,926円	222,221,290円

	ダイワ世界バランスファンド 40VA	2,697,967,975円	2,252,789,966円
	ダイワ世界バランスファンド 60VA	418,181,168円	329,991,054円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA	23,204,449,945円	20,413,387,713円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	1,117,607,513円	631,978,000円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	2,544,232,912円	1,382,469,239円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,911,577,263円	1,599,512,026円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	354,884,564円	315,436,365円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	432,432,404円	374,256,369円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,409,162円	395,865,319円
	ダイワライフスタイル25	177,349,520円	183,009,725円
	ダイワライフスタイル50	556,358,199円	607,535,054円
	ダイワライフスタイル75	444,915,034円	468,369,062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)	15,995,906,153円	15,910,074,282円
	計	172,799,217,116円	156,429,196,684円
2.	期末日における受益権の総数	172,799,217,116口	156,429,196,684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48,236,379,089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26,585,056,888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 6,226,031,650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 1,033,600,000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 742,900,000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10,071,900円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成25年12月3日 至 平成26年12月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26年12月1日現在
-----	--------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成25年12月2日現在	平成26年12月1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	4,252,782,618	8,243,384,272
合計	4,252,782,618	8,243,384,272

(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25年9月20日から平成25年12月2日まで、及び平成26年9月20日から平成26年12月1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25年12月2日 現在				平成26年12月1日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,424,185,000	-	1,449,575,000	25,390,000	1,137,140,000	-	1,209,550,000	72,410,000
合計	1,424,185,000	-	1,449,575,000	25,390,000	1,137,140,000	-	1,209,550,000	72,410,000

(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25年12月2日現在	平成26年12月1日現在
1口当たり純資産額	0.7209円	0.8301円
(1万口当たり純資産額)	(7,209円)	(8,301円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	42,000	272.00	11,424,000	
日本水産	89,900	412.00	37,038,800	
マルハニチロ	16,200	1,695.00	27,459,000	
サカタのタネ	11,000	1,749.00	19,239,000	
ホクト	8,700	1,989.00	17,304,300	
ショーボンドHD	6,200	4,415.00	27,373,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
ミライト・ホールディングス	22,000	1,338.00	29,436,000	
日鉄鉱業	24,000	436.00	10,464,000	
三井松島	66,000	128.00	8,448,000	
国際石油開発帝石	364,200	1,219.00	443,959,800	
日本海洋掘削	2,400	3,830.00	9,192,000	貸付株式数 500株 (500株)
石油資源開発	9,900	3,625.00	35,887,500	
K&Oエナジーグループ	6,000	1,428.00	8,568,000	
安藤・間	47,300	711.00	33,630,300	
東急建設	26,400	541.00	14,282,400	
コムシスホールディングス	31,600	1,755.00	55,458,000	

ミサワホーム	9,500	1,077.00	10,231,500	
高松コンストラクションG P	5,800	2,277.00	13,206,600	
東建コーポレーション	2,900	5,060.00	14,674,000	
大成建設	351,000	619.00	217,269,000	
大 林 組	209,000	740.00	154,660,000	
清水建設	213,000	808.00	172,104,000	貸付株式数 61,000株 (61,000株)
飛島建設	48,400	297.00	14,374,800	貸付株式数 14,300株 (14,300株)
長谷工コーポレーション	86,600	1,014.00	87,812,400	
松井建設	12,000	547.00	6,564,000	
鹿島建設	307,000	469.00	143,983,000	
不動テトラ	55,600	247.00	13,733,200	
鉄建建設	44,000	478.00	21,032,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
日鉄住金テックスエンジ	16,000	515.00	8,240,000	
西松建設	77,000	497.00	38,269,000	
三井住友建設	285,300	130.00	37,089,000	
大豊建設	21,000	486.00	10,206,000	貸付株式数 6,000株
前田建設	47,000	869.00	40,843,000	貸付株式数 13,000株 (4,000株)
奥 村 組	67,000	542.00	36,314,000	
東鉄工業	8,800	2,548.00	22,422,400	
戸田建設	88,000	491.00	43,208,000	貸付株式数 24,000株 (24,000株)
熊 谷 組	89,000	373.00	33,197,000	貸付株式数 22,000株
北野建設	21,000	387.00	8,127,000	
三井ホーム	17,000	480.00	8,160,000	
矢作建設	10,700	935.00	10,004,500	
東日本ハウス	14,400	472.00	6,796,800	
大東建託	26,100	13,600.00	354,960,000	
N I P P O	16,000	1,836.00	29,376,000	
東亜道路	17,000	458.00	7,786,000	
前田道路	22,000	1,671.00	36,762,000	
日本道路	23,000	583.00	13,409,000	
東亜建設	59,000	196.00	11,564,000	
若築建設	44,000	207.00	9,108,000	
東洋建設	21,000	483.00	10,143,000	
五洋建設	79,500	374.00	29,733,000	貸付株式数 23,100株 (23,100株)

大林道路	9,000	769.00	6,921,000	
世紀東急	12,300	600.00	7,380,000	
福田組	11,000	1,008.00	11,088,000	
住友林業	51,300	1,186.00	60,841,800	
日成ビルド工業	24,000	288.00	6,912,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
ヤマダ・エスバイエルホーム	52,000	104.00	5,408,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
巴コーポレーション	15,100	452.00	6,825,200	
パナホーム	27,000	763.00	20,601,000	
大和ハウス	202,600	2,282.50	462,434,500	貸付株式数 57,800株 (57,800株)
ライト工業	11,900	982.00	11,685,800	
積水ハウス	211,300	1,606.00	339,347,800	貸付株式数 50,000株 (50,000株)
日特建設	11,300	517.00	5,842,100	
ユアテック	13,000	666.00	8,658,000	
中電工	10,500	1,731.00	18,175,500	
関電工	33,000	623.00	20,559,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
きんでん	46,000	1,131.00	52,026,000	
トーエネック	14,000	573.00	8,022,000	
住友電設	6,500	1,323.00	8,599,500	
日本電設工業	12,300	1,490.00	18,327,000	
協和エクシオ	29,600	1,353.00	40,048,800	
日本工営	25,000	435.00	10,875,000	
九電工	14,000	1,308.00	18,312,000	
三機工業	17,000	734.00	12,478,000	
日揮	69,000	2,555.00	176,295,000	
中外炉工業	32,000	217.00	6,944,000	
太平電業	11,000	927.00	10,197,000	
高砂熱学	20,200	1,520.00	30,704,000	
NEC ネットズエスアイ	8,000	2,262.00	18,096,000	
明星工業	14,000	770.00	10,780,000	
大気社	10,300	2,487.00	25,616,100	
ダイダン	14,000	675.00	9,450,000	
日比谷総合設備	9,800	1,604.00	15,719,200	
東芝プラントシステム	11,000	1,816.00	19,976,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
日本製粉	44,000	533.00	23,452,000	

日清製粉G本社	76,800	1,180.00	90,624,000	
昭和産業	33,000	473.00	15,609,000	
フィード・ワンHLDGS	76,400	110.00	8,404,000	
日本甜菜糖	55,000	203.00	11,165,000	
三井製糖	31,000	423.00	13,113,000	
ネクスト	9,600	841.00	8,073,600	
日本M&Aセンター	10,400	3,640.00	37,856,000	
アコーディア・ゴルフ	25,700	1,063.00	27,319,100	
タケエイ	8,400	983.00	8,257,200	
GCAサヴィアン	6,500	1,153.00	7,494,500	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
エス・エム・エス	4,000	2,638.00	10,552,000	
テンプホールディングス	12,900	3,625.00	46,762,500	
クックパッド	3,500	3,810.00	13,335,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
森永製菓	72,000	277.00	19,944,000	
中村屋	27,000	445.00	12,015,000	
江崎グリコ	16,000	4,400.00	70,400,000	
不二家	48,000	207.00	9,936,000	
山崎製パン	50,000	1,536.00	76,800,000	
モロゾフ	24,000	361.00	8,664,000	
亀田製菓	4,200	3,660.00	15,372,000	
寿スピリッツ	2,700	2,161.00	5,834,700	
カルビー	25,600	4,260.00	109,056,000	
森永乳業	65,000	393.00	25,545,000	
ヤクルト	36,900	6,440.00	237,636,000	貸付株式数 10,500株 (10,500株)
明治ホールディングス	20,600	10,980.00	226,188,000	貸付株式数 5,800株 (5,800株)
雪印メグミルク	16,300	1,457.00	23,749,100	
プリマハム	45,000	261.00	11,745,000	
日本ハム	51,000	2,393.00	122,043,000	
伊藤ハム	39,000	614.00	23,946,000	
丸大食品	40,000	428.00	17,120,000	
S Foods	5,000	2,293.00	11,465,000	
スタジオアリス	4,800	1,603.00	7,694,400	貸付株式数 1,300株
シミックホールディングス	3,600	1,741.00	6,267,600	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
システナ	10,400	846.00	8,798,400	
新日鉄住金SOL	5,700	3,185.00	18,154,500	

総合警備保障	21,800	2,427.00	52,908,600	
日本駐車場開発	84,400	122.00	10,296,800	
カカクコム	43,400	1,837.00	79,725,800	
ディップ	1,800	4,330.00	7,794,000	
SBSホールディングス	5,900	1,083.00	6,389,700	
新日本科学	7,900	874.00	6,904,600	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ツクイ	9,100	941.00	8,563,100	
エムスリー	56,100	2,083.00	116,856,300	
ツカダ・グローバルHOLD	6,600	746.00	4,923,600	
ディー・エヌ・エー	32,100	1,458.00	46,801,800	貸付株式数 10,400株
博報堂DYHLDGS	89,600	1,159.00	103,846,400	
ぐるなび	8,600	1,822.00	15,669,200	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
一休	6,300	1,480.00	9,324,000	貸付株式数 1,500株
ファンコミュニケーションズ	12,100	1,442.00	17,448,200	
PGMホールディングス	11,300	1,121.00	12,667,300	
サッポロホールディングス	118,000	546.00	64,428,000	
アサヒグループホールディング	138,700	3,739.00	518,599,300	
麒麟HD	294,400	1,542.50	454,112,000	
宝ホールディングス	56,200	788.00	44,285,600	
オエノンホールディングス	35,000	231.00	8,085,000	
コカ・コーラウエスト	22,900	1,642.00	37,601,800	
コカ・コーライーストジャパン	21,100	1,900.00	40,090,000	
サントリー食品インター	39,800	4,225.00	168,155,000	
ダイトードリンク	3,600	4,790.00	17,244,000	
伊藤園	18,400	2,223.00	40,903,200	貸付株式数 5,500株 (5,500株)
キーコーヒー	7,100	1,630.00	11,573,000	
日清オイリオグループ	36,000	400.00	14,400,000	
不二製油	18,500	1,679.00	31,061,500	
J-オイルミルズ	35,000	375.00	13,125,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
ローソン	22,500	7,420.00	166,950,000	
サンエー	4,900	4,000.00	19,600,000	
カワチ薬品	5,600	1,772.00	9,923,200	
エービーシー・マート	8,600	5,890.00	50,654,000	貸付株式数 2,400株 (2,400株)

アスクル	6,600	2,044.00	13,490,400	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ゲオホールディングス	13,000	936.00	12,168,000	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
アダストリアホールディング	5,600	2,498.00	13,988,800	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
くらコーポレーション	4,000	3,010.00	12,040,000	
キャンドゥ	4,900	1,599.00	7,835,100	貸付株式数 1,200株
パル	3,800	3,305.00	12,559,000	
エディオン	29,200	779.00	22,746,800	貸付株式数 8,800株
あらた	21,000	318.00	6,678,000	
J Pホールディングス	21,100	365.00	7,701,500	貸付株式数 6,100株 (2,000株)
あみやき亭	1,400	3,860.00	5,404,000	
ひらまつ	11,800	642.00	7,575,600	
双日	423,000	169.00	71,487,000	
アルフレッサホールディング ス	71,900	1,373.00	98,718,700	
ハニーズ	6,400	1,005.00	6,432,000	
キッコーマン	57,000	2,922.00	166,554,000	
味の素	160,000	2,232.50	357,200,000	
キューピー	34,400	1,955.00	67,252,000	貸付株式数 9,900株 (9,900株)
ハウス食品G本社	24,800	2,102.00	52,129,600	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
カゴメ	25,500	1,780.00	45,390,000	貸付株式数 7,500株 (7,500株)
アリアケジャパン	6,700	2,809.00	18,820,300	
ニチレイ	80,000	513.00	41,040,000	
横浜冷凍	18,200	792.00	14,414,400	
東洋水産	35,800	4,095.00	146,601,000	
日清食品HD	28,700	5,990.00	171,913,000	貸付株式数 8,100株 (8,100株)
永谷園	9,000	1,062.00	9,558,000	
フジッコ	8,000	1,811.00	14,488,000	
ロックフィールド	5,700	1,924.00	10,966,800	
日本たばこ産業	382,300	3,798.00	1,451,975,400	
わらべや日洋	5,200	2,019.00	10,498,800	
片倉工業	9,700	1,245.00	12,076,500	
ゲンゼ	58,000	307.00	17,806,000	

ヒューリック	102,500	1,243.00	127,407,500	
アルペン	5,800	1,697.00	9,842,600	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
クオール	9,400	782.00	7,350,800	貸付株式数 2,200株
アルコニックス	4,700	1,945.00	9,141,500	
神戸物産	1,300	6,750.00	8,775,000	
ジェイアイエヌ	4,500	2,787.00	12,541,500	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
ビックカメラ	27,200	1,055.00	28,696,000	貸付株式数 8,100株
DCMホールディングス	30,100	759.00	22,845,900	
MonotaRO	12,200	2,813.00	34,318,600	貸付株式数 3,400株 (3,400株)
あいホールディングス	10,500	2,444.00	25,662,000	
J.フロントリテイリング	77,900	1,555.00	121,134,500	
ドトール・日レスHD	11,300	1,646.00	18,599,800	
マツモトキヨシHLDGS	13,600	3,330.00	45,288,000	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
スタートトゥデイ	19,100	2,600.00	49,660,000	
物語コーポレーション	1,800	3,540.00	6,372,000	
ココカラファイン	6,800	2,874.00	19,543,200	
三越伊勢丹HD	121,700	1,595.00	194,111,500	
東洋紡	273,000	167.00	45,591,000	
ユニチカ	239,000	62.00	14,818,000	
富士紡ホールディングス	36,000	320.00	11,520,000	
日清紡ホールディングス	43,000	1,214.00	52,202,000	
倉敷紡績	83,000	186.00	15,438,000	
ダイワボウHD	67,000	221.00	14,807,000	
シキボウ	69,000	129.00	8,901,000	
日東紡績	52,000	425.00	22,100,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
トヨタ紡織	22,100	1,520.00	33,592,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
ウエルシアHD	5,700	3,745.00	21,346,500	
クリエイトSDH	2,900	3,845.00	11,150,500	
バイタルKSKHD	13,800	874.00	12,061,200	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
UKCホールディングス	5,000	1,728.00	8,640,000	
TOKAIホールディングス	32,100	544.00	17,462,400	
三洋貿易	6,000	1,302.00	7,812,000	

ジョイフル本田	3,400	4,135.00	14,059,000	
すかいらーく	21,000	1,224.00	25,704,000	
日本毛織	22,000	769.00	16,918,000	
ダイドーリミテッド	15,600	502.00	7,831,200	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
野村不動産HLDGS	35,900	2,186.00	78,477,400	
プレサンスコーポレーション	2,600	3,755.00	9,763,000	
常和ホールディングス	2,600	3,635.00	9,451,000	貸付株式数 700株 (700株)
オープンハウス	4,200	2,323.00	9,756,600	
東急不動産HD	161,000	863.00	138,943,000	
飯田GHD	38,900	1,353.00	52,631,700	
帝国繊維	7,300	2,671.00	19,498,300	
日本コークス工業	82,900	114.00	9,450,600	
あさひ	5,100	1,186.00	6,048,600	貸付株式数 1,300株
コスモス薬品	3,500	16,370.00	57,295,000	貸付株式数 900株 (900株)
シップヘルスケアHD	11,500	2,795.00	32,142,500	
セブン&アイ・HLDGS	254,500	4,456.00	1,134,052,000	
クリエイト・レストランツ・ホール	5,200	1,622.00	8,434,400	
ツルハホールディングス	12,000	6,750.00	81,000,000	
サンマルクホールディングス	2,400	6,700.00	16,080,000	
トリドール	6,800	1,390.00	9,452,000	貸付株式数 1,800株
クスリのアオキ	2,900	6,000.00	17,400,000	
帝人	271,000	326.00	88,346,000	
東レ	499,000	933.00	465,567,000	貸付株式数 138,000株 (138,000株)
クラレ	109,900	1,472.00	161,772,800	
旭化成	403,000	1,038.50	418,515,500	貸付株式数 119,000株 (119,000株)
トーカロ	5,100	1,947.00	9,929,700	
SUMCO	45,800	1,503.00	68,837,400	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
川田テクノロジーズ	1,500	4,720.00	7,080,000	
住江織物	24,000	300.00	7,200,000	
日本バイリン	15,000	622.00	9,330,000	
アツギ	90,000	115.00	10,350,000	
セーレン	18,900	965.00	18,238,500	
小松精練	16,800	543.00	9,122,400	

ワコールホールディングス	38,000	1,226.00	46,588,000	
ホギメディカル	4,300	5,730.00	24,639,000	
T S Iホールディングス	30,800	696.00	21,436,800	
I Tホールディングス	21,100	1,889.00	39,857,900	
グリー	37,800	795.00	30,051,000	貸付株式数 10,600株 (10,000株)
コーエーテクモHD	14,500	1,751.00	25,389,500	
三菱総合研究所	3,300	2,733.00	9,018,900	
K L a b	7,000	1,415.00	9,905,000	貸付株式数 1,900株
ネクソン	57,700	1,138.00	65,662,600	
コロプラ	10,800	3,020.00	32,616,000	貸付株式数 2,900株
ブロードリーフ	6,300	1,638.00	10,319,400	
特種東海製紙	43,000	245.00	10,535,000	
ティーガイア	7,200	1,166.00	8,395,200	
GMOペイメントゲートウェイ	6,000	2,130.00	12,780,000	
インターネットイニシアティブ	10,500	2,603.00	27,331,500	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
朝日ネット	14,300	506.00	7,235,800	
王子ホールディングス	265,000	420.00	111,300,000	
日本製紙	31,500	1,721.00	54,211,500	
三菱製紙	122,000	87.00	10,614,000	
北越紀州製紙	45,100	492.00	22,189,200	
中越パルプ	38,000	190.00	7,220,000	
大王製紙	29,000	1,064.00	30,856,000	
レンゴー	55,000	486.00	26,730,000	
トーモク	27,000	277.00	7,479,000	
ザ・パックス	5,400	2,291.00	12,371,400	
昭和電工	441,000	165.00	72,765,000	
住友化学	476,000	467.00	222,292,000	
住友精化	15,000	812.00	12,180,000	
日産化学	43,900	2,214.00	97,194,600	
クレハ	47,000	568.00	26,696,000	貸付株式数 14,000株
テイカ	15,000	446.00	6,690,000	
石原産業	124,000	106.00	13,144,000	
日本曹達	44,000	617.00	27,148,000	
東ソー	163,000	565.00	92,095,000	
トクヤマ	109,000	264.00	28,776,000	
セントラル硝子	68,000	401.00	27,268,000	
東亜合成	81,000	491.00	39,771,000	

ダイソー	31,000	379.00	11,749,000	
関東電化	19,000	672.00	12,768,000	
電気化学	139,000	406.00	56,434,000	
イビデン	40,700	1,777.00	72,323,900	
信越化学	115,800	8,118.00	940,064,400	
日本カ - バイド	27,000	240.00	6,480,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
堺 化 学	31,000	370.00	11,470,000	
エア・ウォーター	56,000	1,932.00	108,192,000	
大陽日酸	82,000	1,397.00	114,554,000	
日本パ - カライジング	15,500	2,562.00	39,711,000	
高圧ガス	13,000	573.00	7,449,000	
四国化成	12,000	791.00	9,492,000	
戸田工業	16,000	482.00	7,712,000	貸付株式数 4,000株
ステラ ケミファ	4,900	1,370.00	6,713,000	
保土谷化学	31,000	197.00	6,107,000	
日本触媒	50,000	1,485.00	74,250,000	
大日精化	30,000	666.00	19,980,000	
カネカ	83,000	630.00	52,290,000	
協和発酵キリン	78,000	1,299.00	101,322,000	
三菱瓦斯化学	110,000	661.00	72,710,000	
三井化学	298,000	340.00	101,320,000	
J S R	63,000	2,107.00	132,741,000	貸付株式数 17,000株 (17,000株)
東京応化工業	13,600	3,500.00	47,600,000	
三菱ケミカルH L D G S	403,900	626.80	253,164,520	
日本合成化学	17,000	756.00	12,852,000	
ダイセル	91,000	1,376.00	125,216,000	
住友ベ - クライト	63,000	452.00	28,476,000	貸付株式数 17,000株 (17,000株)
積水化学	152,000	1,495.00	227,240,000	
日本ゼオン	55,000	1,154.00	63,470,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
アイカ工業	19,600	2,463.00	48,274,800	
宇部興産	338,000	172.00	58,136,000	
積水樹脂	11,200	1,567.00	17,550,400	
タキロン	17,000	488.00	8,296,000	
旭有機材	31,000	298.00	9,238,000	
日立化成	31,500	2,220.00	69,930,000	
リケンテクノス	12,800	442.00	5,657,600	

大倉工業	21,000	346.00	7,266,000	
積水化成品	25,000	410.00	10,250,000	
群栄化学	21,000	340.00	7,140,000	
日本化薬	43,000	1,462.00	62,866,000	
イーピーエス	9,100	1,181.00	10,747,100	
パナソニック インフォシス	2,500	3,100.00	7,750,000	
プレステージ・インター	6,900	1,036.00	7,148,400	
アミューズ	2,400	3,385.00	8,124,000	
野村総合研究所	34,400	3,720.00	127,968,000	
ケネディクス	93,600	622.00	58,219,200	
電通	72,000	4,465.00	321,480,000	貸付株式数 18,200株 (18,200株)
インテージホールディングス	5,400	1,760.00	9,504,000	
日本精化	8,200	870.00	7,134,000	
A D E K A	29,900	1,432.00	42,816,800	
日油	54,000	750.00	40,500,000	
ミヨシ油脂	48,000	140.00	6,720,000	
花 王	177,700	4,440.00	788,988,000	
第一工業製薬	16,000	378.00	6,048,000	貸付株式数 4,000株
三洋化成	22,000	776.00	17,072,000	
武田薬品	241,700	5,015.00	1,212,125,500	
アステラス製薬	737,400	1,713.50	1,263,534,900	
大日本住友製薬	47,000	1,234.00	57,998,000	
塩野義製薬	101,400	3,050.00	309,270,000	
田辺三菱製薬	73,700	1,820.00	134,134,000	
あすか製薬	9,100	1,367.00	12,439,700	
日本新薬	15,000	3,505.00	52,575,000	
中外製薬	64,500	3,265.00	210,592,500	
科研製薬	23,000	2,539.00	58,397,000	
エーザイ	85,200	4,282.00	364,826,400	
ロート製薬	29,800	1,576.00	46,964,800	
小野薬品	29,400	10,190.00	299,586,000	
久光製薬	18,200	3,630.00	66,066,000	
持田製薬	4,900	6,540.00	32,046,000	
参天製薬	23,800	6,740.00	160,412,000	
扶桑薬品	32,000	304.00	9,728,000	
日本ケミファ	13,000	543.00	7,059,000	
ツムラ	20,400	2,682.00	54,712,800	貸付株式数 5,600株
日医工	15,500	1,852.00	28,706,000	
テ ル モ	94,900	2,708.00	256,989,200	

みらかホールディングス	16,900	4,580.00	77,402,000	
キッセイ薬品工業	12,500	3,095.00	38,687,500	
生化学工業	13,000	2,144.00	27,872,000	
栄研化学	6,700	1,868.00	12,515,600	
鳥居薬品	5,000	2,982.00	14,910,000	
JCRファーマ	5,700	2,467.00	14,061,900	
東和薬品	3,600	5,360.00	19,296,000	
沢井製薬	10,200	7,110.00	72,522,000	
ゼリア新薬工業	13,800	1,972.00	27,213,600	
第一三共	216,900	1,780.50	386,190,450	
キョーリン製薬HD	17,600	2,336.00	41,113,600	
大幸薬品	3,400	2,443.00	8,306,200	
ダイト	3,500	1,952.00	6,832,000	
大塚ホールディングス	127,700	3,785.50	483,408,350	
大正製薬HD	15,300	7,460.00	114,138,000	
大日本塗料	51,000	162.00	8,262,000	
日本ペイントHOLD	56,000	3,200.00	179,200,000	
関西ペイント	78,000	1,983.00	154,674,000	
中国塗料	20,000	998.00	19,960,000	
藤倉化成	13,400	568.00	7,611,200	
太陽ホールディングス	5,600	4,235.00	23,716,000	
DIC	259,000	272.00	70,448,000	
サカタインクス	14,100	1,344.00	18,950,400	
東洋インキSCホールディン	64,000	579.00	37,056,000	
T&K TOKA	3,000	2,359.00	7,077,000	
オリエンタルランド	17,400	26,190.00	455,706,000	
ダスキン	18,900	1,736.00	32,810,400	
パーク24	30,900	1,846.00	57,041,400	
明光ネットワークジャパン	8,500	1,217.00	10,344,500	貸付株式数 2,500株
ファルコホールディングス	5,200	1,248.00	6,489,600	
フジ・メディア・HD	63,600	1,519.00	96,608,400	
ラウンドワン	20,300	699.00	14,189,700	
リゾートトラスト	24,000	2,462.00	59,088,000	貸付株式数 6,800株
オービック	21,200	3,830.00	81,196,000	
ジャストシステム	10,300	816.00	8,404,800	
ヤフー	438,000	437.00	191,406,000	貸付株式数 126,100株
ビー・エム・エル	4,300	3,415.00	14,684,500	
トレンドマイクロ	32,900	3,640.00	119,756,000	
もしもしホットライン	13,600	1,139.00	15,490,400	
日本オラクル	9,700	4,535.00	43,989,500	

フューチャーアーキテクト	10,700	643.00	6,880,100	
CAC HOLDINGS	6,600	1,205.00	7,953,000	
ユー・エス・エス	78,100	1,722.00	134,488,200	
オービックビジネスC	4,300	3,470.00	14,921,000	
伊藤忠テクノソリュー	7,200	4,560.00	32,832,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
アイティフォー	14,800	423.00	6,260,400	
サイバーエージェント	12,000	4,710.00	56,520,000	
楽天	279,800	1,634.50	457,333,100	
大塚商会	16,400	4,105.00	67,322,000	
総合メディカル	1,900	5,780.00	10,982,000	
セントラルスポーツ	4,700	1,816.00	8,535,200	
電通国際情報S	5,800	1,230.00	7,134,000	
ウェザーニューズ	2,900	2,835.00	8,221,500	
WOWOW	1,800	5,120.00	9,216,000	貸付株式数 600株 (600株)
富士フイルムHLDGS	148,200	3,980.50	589,910,100	
コニカミノルタ	148,000	1,420.00	210,160,000	
資生堂	114,900	1,764.50	202,741,050	貸付株式数 32,700株
ライオン	75,000	663.00	49,725,000	貸付株式数 21,000株
高砂香料	23,000	556.00	12,788,000	
マンダム	6,900	3,850.00	26,565,000	
ミルボン	4,500	3,580.00	16,110,000	
ファンケル	16,100	1,554.00	25,019,400	
コーセー	10,400	4,300.00	44,720,000	
ドクターシーラボ	4,800	3,600.00	17,280,000	
ポーラ・オルビスHD	7,600	4,495.00	34,162,000	
ノエビアホールディングス	5,500	2,034.00	11,187,000	
エステー	8,700	1,020.00	8,874,000	
コニシ	5,800	1,869.00	10,840,200	
長谷川香料	9,100	1,661.00	15,115,100	
小林製薬	10,400	6,990.00	72,696,000	
荒川化学工業	6,800	1,227.00	8,343,600	
メック	6,400	1,113.00	7,123,200	
日本高純度化学	3,500	2,408.00	8,428,000	
JCU	2,000	6,200.00	12,400,000	
新田ゼラチン	6,700	806.00	5,400,200	
アース製薬	5,000	4,155.00	20,775,000	貸付株式数 1,400株
イハラケミカル	11,000	1,236.00	13,596,000	貸付株式数 3,000株
大成ラミック	3,500	2,716.00	9,506,000	

クミアイ化学	15,000	687.00	10,305,000	貸付株式数	4,000株
日本農薬	15,500	1,370.00	21,235,000		
昭和シエル石油	58,700	979.00	57,467,300		
コスモ石油	182,000	162.00	29,484,000		
ニチレキ	10,000	831.00	8,310,000		
東燃ゼネラル石油	93,000	1,000.00	93,000,000		
ユシロ化学	5,200	1,498.00	7,789,600		
富士石油	19,400	311.00	6,033,400		
出光興産	29,900	2,000.00	59,800,000		
JXホールディングス	712,200	437.10	311,302,620		
横浜ゴム	74,000	1,119.00	82,806,000		
東洋ゴム	29,600	2,519.00	74,562,400		
ブリヂストン	202,000	4,122.00	832,644,000	貸付株式数	59,800株 (59,800株)
住友ゴム	49,200	1,866.00	91,807,200		
藤倉ゴム	7,100	889.00	6,311,900		
オカモト	26,000	419.00	10,894,000		
アキレス	73,000	151.00	11,023,000		
ニッタ	6,900	2,674.00	18,450,600		
住友理工	12,300	989.00	12,164,700		
三ツ星ベルト	18,000	854.00	15,372,000		
バンドー化学	28,000	417.00	11,676,000		
鬼怒川ゴム	17,000	483.00	8,211,000	貸付株式数	4,000株 (4,000株)
旭硝子	318,000	580.00	184,440,000		
日本板硝子	330,000	119.00	39,270,000		
有沢製作所	12,300	915.00	11,254,500		
日本山村硝子	42,000	167.00	7,014,000		
日本電気硝子	127,000	546.00	69,342,000		
住友大阪セメント	124,000	343.00	42,532,000		
太平洋セメント	405,000	379.00	153,495,000		
日本ヒュ-ム	8,500	979.00	8,321,500		
日本コンクリ-ト	12,900	593.00	7,649,700	貸付株式数	3,800株 (3,800株)
ジャパンパイル	10,500	777.00	8,158,500		
東海カーボン	64,000	336.00	21,504,000		
日本カーボン	46,000	201.00	9,246,000		
東洋炭素	4,100	2,050.00	8,405,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
ノリタケ	44,000	266.00	11,704,000		

TOTO	96,000	1,419.00	136,224,000	
日本碍子	82,000	2,638.00	216,316,000	
日本特殊陶業	55,700	3,660.00	203,862,000	
MARUWA	2,200	3,395.00	7,469,000	貸付株式数 500株 (500株)
品川リフラクトリーズ	22,000	263.00	5,786,000	
フジミインコーポレーテッド	7,400	1,794.00	13,275,600	
ニチアス	32,000	667.00	21,344,000	
新日鐵住金	2,731,000	308.40	842,240,400	
神戸製鋼所	1,119,000	191.00	213,729,000	
合同製鐵	47,000	179.00	8,413,000	
JFEホールディングス	164,600	2,588.00	425,984,800	
日新製鋼	27,600	1,111.00	30,663,600	
東京製鐵	34,000	649.00	22,066,000	貸付株式数 10,100株
共英製鋼	7,500	2,015.00	15,112,500	
大和工業	14,600	3,320.00	48,472,000	
東京鐵鋼	16,000	518.00	8,288,000	
大阪製鐵	4,800	2,071.00	9,940,800	
淀川製鋼所	49,000	436.00	21,364,000	
東洋鋼鈑	17,000	616.00	10,472,000	
丸一鋼管	19,200	2,572.00	49,382,400	
大同特殊鋼	107,000	430.00	46,010,000	貸付株式数 31,000株 (31,000株)
日本冶金工	53,500	282.00	15,087,000	貸付株式数 15,600株 (15,600株)
山陽特殊製鋼	41,000	365.00	14,965,000	
愛知製鋼	40,000	407.00	16,280,000	
日立金属	65,000	2,067.00	134,355,000	
大平洋金属	46,000	343.00	15,778,000	
新日本電工	43,600	298.00	12,992,800	貸付株式数 8,900株 (8,900株)
栗本鉄工所	39,000	224.00	8,736,000	
日本製鋼所	97,000	418.00	40,546,000	貸付株式数 28,000株 (26,000株)
三菱製鋼	48,000	249.00	11,952,000	
日本軽金属HD	169,700	178.00	30,206,600	
三井金属	181,000	299.00	54,119,000	
東邦亜鉛	42,000	392.00	16,464,000	
三菱マテリアル	405,000	372.00	150,660,000	
住友鋁山	178,000	1,739.50	309,631,000	

DOWAホールディングス	79,000	976.00	77,104,000	
古河機金	112,000	216.00	24,192,000	
大阪チタニウム	6,900	2,094.00	14,448,600	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
東邦チタニウム	12,400	744.00	9,225,600	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
UACJ	75,000	342.00	25,650,000	
古河電工	199,000	200.00	39,800,000	
住友電工	243,300	1,579.00	384,170,700	
フジクラ	96,000	453.00	43,488,000	
昭和電線HLDGS	87,000	105.00	9,135,000	
タツタ電線	14,200	503.00	7,142,600	貸付株式数 3,200株 (3,200株)
リョービ	43,000	319.00	13,717,000	
アーレステイ	8,200	678.00	5,559,600	
アサヒHD	10,500	1,734.00	18,207,000	
東洋製罐グループHD	46,700	1,470.00	68,649,000	
ホッカンホールディングス	24,000	285.00	6,840,000	
横河ブリッジHLDGS	13,300	1,324.00	17,609,200	
三和ホールディングス	63,800	846.00	53,974,800	
文化シャツタ-	20,000	982.00	19,640,000	
三協立山	8,600	2,074.00	17,836,400	
LIXILグループ	95,700	2,577.00	246,618,900	
ノーリツ	13,200	1,921.00	25,357,200	
長府製作所	7,300	3,025.00	22,082,500	
リンナイ	12,000	9,070.00	108,840,000	
ユニプレス	12,200	2,097.00	25,583,400	
岡 部	14,300	1,181.00	16,888,300	
東 プ レ	13,000	1,555.00	20,215,000	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
高周波熱錬	13,100	802.00	10,506,200	
東京製綱	54,000	202.00	10,908,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
パイオラックス	3,600	4,915.00	17,694,000	
日本発条	56,200	1,036.00	58,223,200	
三浦工業	29,500	1,244.00	36,698,000	
タ ク マ	23,000	826.00	18,998,000	
リクルートホールディングス	72,000	3,875.00	279,000,000	
ツ ガ ミ	21,000	622.00	13,062,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)

オークマ	44,000	920.00	40,480,000	
東芝機械	38,000	467.00	17,746,000	
アマダ	97,400	1,070.00	104,218,000	
アイダエンジニア	15,300	1,077.00	16,478,100	
滝澤鉄工所	29,000	230.00	6,670,000	
富士機械製造	22,000	1,105.00	24,310,000	
牧野フライス	33,000	859.00	28,347,000	
オーエスジー	29,900	1,899.00	56,780,100	
旭ダイヤモンド	18,600	1,282.00	23,845,200	
D M G 森精機	41,300	1,435.00	59,265,500	
ディスコ	7,400	9,420.00	69,708,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
日東工器	4,700	2,244.00	10,546,800	
豊田自動織機	55,600	6,120.00	340,272,000	
島精機製作所	9,800	2,061.00	20,197,800	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
日阪製作所	10,300	960.00	9,888,000	
やまびこ	2,800	4,915.00	13,762,000	
ナブテスコ	39,300	2,896.00	113,812,800	
三井海洋開発	6,500	1,964.00	12,766,000	貸付株式数 1,900株
S M C	19,800	32,610.00	645,678,000	
ホソカワミクロン	15,000	677.00	10,155,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
ユニオンツール	4,000	2,795.00	11,180,000	
オイレス工業	8,500	2,002.00	17,017,000	
日精エーエスビー	2,700	2,749.00	7,422,300	
サト - ホールディングス	8,300	2,814.00	23,356,200	
日精樹脂工業	6,400	1,110.00	7,104,000	
小松製作所	320,400	2,789.00	893,595,600	貸付株式数 89,900株 (89,900株)
住友重機械	179,000	652.00	116,708,000	
日立建機	29,200	2,557.00	74,664,400	
巴工業	3,800	1,706.00	6,482,800	
井関農機	71,000	228.00	16,188,000	貸付株式数 20,000株
北川鉄工所	39,000	240.00	9,360,000	
クボタ	312,000	1,874.00	584,688,000	貸付株式数 89,000株 (89,000株)
東洋エンジニア	34,000	437.00	14,858,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
三菱化工機	24,000	478.00	11,472,000	貸付株式数 6,000株

月島機械	12,500	1,233.00	15,412,500	
帝国電機製作所	5,700	1,335.00	7,609,500	
新東工業	17,400	802.00	13,954,800	
渋谷工業	5,700	2,648.00	15,093,600	
アイチ コーポレーション	12,400	588.00	7,291,200	
小森コーポレーション	17,000	1,194.00	20,298,000	
鶴見製作所	5,500	1,988.00	10,934,000	
住友精密	15,000	470.00	7,050,000	
荏原製作所	137,000	507.00	69,459,000	
西島製作所	8,600	841.00	7,232,600	貸付株式数 2,400株
北越工業	6,000	1,235.00	7,410,000	
千代田化工建	50,000	1,021.00	51,050,000	
ダイキン工業	89,900	8,090.00	727,291,000	貸付株式数 25,200株 (25,200株)
オルガノ	17,000	479.00	8,143,000	
ト - ヨ - カネツ	44,000	253.00	11,132,000	
栗田工業	35,600	2,485.00	88,466,000	貸付株式数 10,900株 (10,900株)
椿本チエイン	33,000	992.00	32,736,000	
日本コンベヤ	25,000	265.00	6,625,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
日 機 装	21,200	1,161.00	24,613,200	貸付株式数 6,200株
新興プランテック	15,800	806.00	12,734,800	
アネスト岩田	12,200	802.00	9,784,400	
ダイフク	31,100	1,292.00	40,181,200	
加藤製作所	15,000	939.00	14,085,000	
タダノ	30,000	1,703.00	51,090,000	
フジテック	18,600	1,174.00	21,836,400	
C K D	18,300	1,035.00	18,940,500	
キトー	7,800	1,221.00	9,523,800	
平和	13,700	2,256.00	30,907,200	
理想科学工業	4,100	3,660.00	15,006,000	
SANKYO	18,700	3,845.00	71,901,500	
日本金銭機械	6,400	1,755.00	11,232,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
マースエンジニアリング	4,700	2,007.00	9,432,900	
福島工業	3,900	2,066.00	8,057,400	
ダイコク電機	3,500	1,740.00	6,090,000	
ア マ ノ	21,200	1,261.00	26,733,200	
JUKI	50,000	407.00	20,350,000	

サンデン	40,000	698.00	27,920,000	
蛇の目ミシン	69,000	160.00	11,040,000	貸付株式数 19,000株
ブラザー工業	79,800	2,251.00	179,629,800	
マックス	11,000	1,215.00	13,365,000	
モリタホールディングス	12,200	1,149.00	14,017,800	
グローリー	19,800	3,150.00	62,370,000	
新晃工業	5,600	1,012.00	5,667,200	
大和冷機工業	11,000	799.00	8,789,000	
セガサミーホールディングス	66,400	1,634.00	108,497,600	
日本ピストンリング	35,000	246.00	8,610,000	
リケン	31,000	458.00	14,198,000	
T P R	7,200	3,190.00	22,968,000	
ホシザキ電機	13,400	6,130.00	82,142,000	
大豊工業	7,600	1,188.00	9,028,800	
日本精工	128,000	1,515.00	193,920,000	貸付株式数 41,000株 (41,000株)
N T N	145,000	555.00	80,475,000	貸付株式数 28,000株 (28,000株)
ジェイテクト	66,300	1,974.00	130,876,200	貸付株式数 6,300株 (6,300株)
不二越	58,000	701.00	40,658,000	
ミネベア	93,000	1,499.00	139,407,000	
日本トムソン	24,000	588.00	14,112,000	
T H K	40,800	2,898.00	118,238,400	
ユーシン精機	3,400	2,417.00	8,217,800	
イーグル工業	9,100	2,231.00	20,302,100	
日本ピラ - 工業	9,000	853.00	7,677,000	
キッツ	30,300	496.00	15,028,800	
日立	1,483,000	920.10	1,364,508,300	
東芝	1,300,000	531.00	690,300,000	
三菱電機	618,000	1,438.50	888,993,000	
富士電機	173,000	524.00	90,652,000	
東洋電機製造	19,000	406.00	7,714,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
安川電機	73,500	1,550.00	113,925,000	
シンフォニアテクノロジー	53,000	175.00	9,275,000	
明電舎	62,000	389.00	24,118,000	
山洋電気	15,000	841.00	12,615,000	
デンヨー	6,400	1,664.00	10,649,600	
日立工機	18,300	992.00	18,153,600	

三桜工業	13,200	756.00	9,979,200	
マキタ	40,100	5,970.00	239,397,000	
東芝テック	45,000	848.00	38,160,000	
マブチモーター	9,400	9,490.00	89,206,000	
日本電産	66,500	7,949.00	528,608,500	貸付株式数 19,900株 (19,900株)
東光高岳	3,500	1,648.00	5,768,000	
ダイヘン	36,000	498.00	17,928,000	
JVCケンウッド	50,600	276.00	13,965,600	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
第一精工	3,000	2,655.00	7,965,000	
日新電機	16,000	642.00	10,272,000	
大崎電気	11,000	781.00	8,591,000	貸付株式数 3,000株
オムロン	69,600	5,440.00	378,624,000	
日東工業	10,200	2,312.00	23,582,400	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
I D E C	9,300	916.00	8,518,800	
ジーエス・ユアサ コーポ	123,000	569.00	69,987,000	
メルコホールディングス	4,400	1,841.00	8,100,400	
日本電気	803,000	379.00	304,337,000	
富士通	597,000	684.80	408,825,600	
沖電気	219,000	239.00	52,341,000	
電気興業	21,000	520.00	10,920,000	
サンケン電気	33,000	1,021.00	33,693,000	
アイホン	4,500	1,920.00	8,640,000	
ルネサスエレクトロニクス	32,900	847.00	27,866,300	貸付株式数 9,600株
セイコーエプソン	42,200	5,840.00	246,448,000	
ワコム	52,600	457.00	24,038,200	貸付株式数 15,100株 (15,100株)
アルバック	11,800	1,638.00	19,328,400	
アクセル	4,800	1,501.00	7,204,800	
E I Z O	6,200	2,210.00	13,702,000	
ジャパンディスプレイ	96,500	395.00	38,117,500	貸付株式数 30,800株 (30,800株)
日本信号	17,700	1,169.00	20,691,300	
京三製作所	20,000	367.00	7,340,000	
能美防災	8,700	1,630.00	14,181,000	
エレコム	2,500	2,623.00	6,557,500	
日本無線	17,000	347.00	5,899,000	
パナソニック	752,600	1,554.00	1,169,540,400	

シャープ	525,000	287.00	150,675,000	貸付株式数 150,000株 (132,000株)
アンリツ	39,400	827.00	32,583,800	
富士通ゼネラル	19,000	1,271.00	24,149,000	
日立国際電気	17,000	1,799.00	30,583,000	
ソ ニ ー	397,500	2,640.00	1,049,400,000	
T D K	37,400	7,200.00	269,280,000	
ミツミ電機	23,700	985.00	23,344,500	
タムラ製作所	28,000	458.00	12,824,000	
アルプス電気	49,200	2,411.00	118,621,200	
パイオニア	98,200	256.00	25,139,200	
日本電波工業	7,700	995.00	7,661,500	
ローランド ディー . ジー .	2,800	4,175.00	11,690,000	
フオスタ - 電機	6,900	2,140.00	14,766,000	
クラリオン	35,000	418.00	14,630,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
S M K	21,000	505.00	10,605,000	
東 光	19,000	327.00	6,213,000	貸付株式数 5,000株
ホシデン	21,800	746.00	16,262,800	
ヒロセ電機	9,800	14,980.00	146,804,000	
日本航空電子	18,000	2,674.00	48,132,000	
T O A	7,700	1,175.00	9,047,500	
日立マクセル	9,700	1,788.00	17,343,600	
古野電気	9,100	939.00	8,544,900	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
ユニデン	26,000	232.00	6,032,000	
アルパイン	15,300	1,939.00	29,666,700	
スミダコーポレーション	8,400	880.00	7,392,000	
アイコム	4,300	2,832.00	12,177,600	
船井電機	7,400	1,569.00	11,610,600	
横河電機	62,800	1,457.00	91,499,600	
新電元工業	25,000	751.00	18,775,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
アズビル	19,700	2,823.00	55,613,100	
日本光電工業	13,200	6,030.00	79,596,000	
堀場製作所	11,700	4,165.00	48,730,500	
アドバンテスト	43,900	1,421.00	62,381,900	
エスペック	9,100	1,113.00	10,128,300	
キーエンス	14,000	55,520.00	777,280,000	
日置電機	4,500	1,724.00	7,758,000	

シスメックス	47,900	5,250.00	251,475,000	
メガチップス	8,400	1,423.00	11,953,200	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
OBARA GROUP	4,300	4,990.00	21,457,000	
デンソー	152,200	5,683.00	864,952,600	
コーセル	10,100	1,319.00	13,321,900	貸付株式数 2,900株
オプテックス	4,900	1,982.00	9,711,800	
千代田インテグレ	3,400	1,975.00	6,715,000	
レーザーテック	7,700	1,242.00	9,563,400	
スタンレー電気	44,100	2,616.00	115,365,600	
岩崎電気	27,000	250.00	6,750,000	
ウシオ電機	37,400	1,224.00	45,777,600	貸付株式数 11,000株 (11,000株)
日本セラミック	4,400	1,757.00	7,730,800	貸付株式数 1,300株
日本デジタル研究所	6,600	1,695.00	11,187,000	
古河電池	6,000	1,139.00	6,834,000	
山一電機	8,300	809.00	6,714,700	
図研	6,700	1,048.00	7,021,600	
日本電子	29,000	591.00	17,139,000	
カシオ	62,700	1,814.00	113,737,800	貸付株式数 19,200株
ファナック	64,300	20,260.00	1,302,718,000	
日本シイエムケイ	22,800	298.00	6,794,400	
エンプラス	3,000	3,900.00	11,700,000	
大真空	17,000	319.00	5,423,000	
ローム	30,400	7,760.00	235,904,000	
浜松ホトニクス	25,600	6,170.00	157,952,000	
三井ハイテック	11,600	699.00	8,108,400	
新光電気工業	26,100	784.00	20,462,400	
京セラ	101,200	5,824.00	589,388,800	
太陽誘電	33,600	1,357.00	45,595,200	
村田製作所	64,800	12,980.00	841,104,000	貸付株式数 18,400株 (18,400株)
ユーシン	11,300	716.00	8,090,800	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
双葉電子工業	11,200	1,623.00	18,177,600	
日東電工	50,000	6,272.00	313,600,000	
北陸電気工業	39,000	183.00	7,137,000	
東海理化電機	16,700	2,450.00	40,915,000	貸付株式数 4,900株 (4,900株)
ニチコン	21,200	957.00	20,288,400	

日本ケミコン	53,000	346.00	18,338,000	
K O A	9,900	1,144.00	11,325,600	
三井造船	245,000	224.00	54,880,000	貸付株式数 73,000株 (73,000株)
日立造船	51,400	655.00	33,667,000	
三菱重工業	1,035,000	695.10	719,428,500	
川崎重工業	450,000	527.00	237,150,000	
I H I	447,000	608.00	271,776,000	
名村造船所	17,900	1,368.00	24,487,200	
日本車輛	26,000	355.00	9,230,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
ニチユ三菱フォークリフト	8,200	770.00	6,314,000	
F P G	6,400	1,472.00	9,420,800	貸付株式数 1,700株 (1,500株)
じもとホールディングス	49,600	231.00	11,457,600	貸付株式数 14,800株 (14,800株)
全国保証	16,300	3,590.00	58,517,000	
足利ホールディングス	37,900	476.00	18,040,400	
東京T YフィナンシャルG	8,100	3,325.00	26,932,500	
日産自動車	864,300	1,105.00	955,051,500	
いすゞ自動車	195,700	1,528.50	299,127,450	
トヨタ自動車	852,100	7,429.00	6,330,250,900	貸付株式数 243,100株 (243,100株)
日野自動車	88,500	1,606.00	142,131,000	
三菱自動車工業	227,000	1,236.00	280,572,000	
エフテック	6,000	1,220.00	7,320,000	
武蔵精密工業	7,300	2,315.00	16,899,500	
日産車体	27,900	1,494.00	41,682,600	
新明和工業	26,000	1,155.00	30,030,000	
極東開発工業	12,100	1,472.00	17,811,200	
日信工業	12,000	1,873.00	22,476,000	
トピー工業	61,000	221.00	13,481,000	
ティラド	33,000	254.00	8,382,000	
曙ブレーキ	30,700	429.00	13,170,300	貸付株式数 9,800株
タチエス	11,000	1,611.00	17,721,000	
N O K	30,000	3,065.00	91,950,000	
フタバ産業	22,000	618.00	13,596,000	
カヤバ工業	72,000	505.00	36,360,000	
大同メタル工業	10,000	1,351.00	13,510,000	
プレス工業	36,000	427.00	15,372,000	

カルソニックカンセイ	48,000	653.00	31,344,000	
太平洋工業	15,200	877.00	13,330,400	貸付株式数 4,300株
ケーヒン	14,900	1,681.00	25,046,900	
河西工業	9,300	945.00	8,788,500	
アイシン精機	55,600	4,475.00	248,810,000	
マ ッ ダ	184,400	3,147.00	580,306,800	
ダイハツ	71,600	1,642.00	117,567,200	
今仙電機製作所	6,100	1,577.00	9,619,700	貸付株式数 1,800株
本田技研	555,300	3,595.50	1,996,581,150	
スズキ	129,100	3,853.00	497,422,300	
富士重工業	210,500	4,381.00	922,200,500	
ヤマハ発動機	94,000	2,551.00	239,794,000	
ショーワ	15,900	1,183.00	18,809,700	
小糸製作所	37,100	3,805.00	141,165,500	
T B K	11,300	658.00	7,435,400	
エクセディ	8,600	2,976.00	25,593,600	
ミツバ	12,400	1,975.00	24,490,000	
豊田合成	19,900	2,355.00	46,864,500	
愛三工業	11,900	947.00	11,269,300	
ヨ ロ ズ	6,400	2,030.00	12,992,000	
エフ・シー・シー	9,800	1,990.00	19,502,000	貸付株式数 3,200株 (3,200株)
シマノ	26,700	16,530.00	441,351,000	
タカタ	3,300	1,297.00	4,280,100	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
テイ・エス テック	13,300	2,815.00	37,439,500	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
小 野 建	6,800	980.00	6,664,000	
カップ・クリエイトHD	11,700	1,060.00	12,402,000	貸付株式数 3,400株 (3,400株)
ナガイレーベン	9,700	1,957.00	18,982,900	
三菱食品	6,800	2,635.00	17,918,000	
良品計画	7,500	13,840.00	103,800,000	
松田産業	7,200	1,301.00	9,367,200	
メディパルHD	60,500	1,321.00	79,920,500	
アズワン	4,900	3,005.00	14,724,500	
シモジマ	7,200	1,005.00	7,236,000	
ドウシシャ	9,000	1,668.00	15,012,000	
コナカ	9,300	643.00	5,979,900	
コーナン商事	10,600	1,310.00	13,886,000	

黒田電気	11,000	1,502.00	16,522,000	
ネットワンシステムズ	27,100	680.00	18,428,000	貸付株式数 7,500株 (7,500株)
ワタミ	8,600	1,203.00	10,345,800	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	21,000	7,550.00	158,550,000	
西松屋チェーン	13,100	1,099.00	14,396,900	
ゼンショーホールディングス	31,200	955.00	29,796,000	貸付株式数 8,900株
ハピネット	4,400	1,644.00	7,233,600	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
幸楽苑	6,700	1,410.00	9,447,000	
サイゼリヤ	9,600	1,586.00	15,225,600	
ガリバーインターナショナル	19,900	937.00	18,646,300	
ユナイテッドアローズ	8,100	3,175.00	25,717,500	
ハイデイ日高	4,300	3,970.00	17,071,000	
シークス	4,600	2,131.00	9,802,600	
京都きもの友禅	9,200	1,001.00	9,209,200	
コロワイド	20,900	1,397.00	29,197,300	貸付株式数 6,200株
壱番屋	2,800	5,260.00	14,728,000	貸付株式数 700株
マクニカ	3,700	3,315.00	12,265,500	
スギホールディングス	10,900	4,965.00	54,118,500	
島津製作所	74,000	1,190.00	88,060,000	
J M S	24,000	289.00	6,936,000	
スター精密	12,800	1,733.00	22,182,400	
東京計器	30,000	263.00	7,890,000	
東京精密	12,000	2,346.00	28,152,000	
マニー	1,900	6,790.00	12,901,000	
ニコン	116,000	1,701.00	197,316,000	貸付株式数 33,400株
トプコン	19,000	2,686.00	51,034,000	
オリンパス	92,300	4,440.00	409,812,000	
理研計器	8,200	1,097.00	8,995,400	
S C R E E Nホールディング ス	61,000	798.00	48,678,000	
キヤノン電子	6,100	2,009.00	12,254,900	
タムロン	5,300	2,285.00	12,110,500	
HOYA	146,900	4,293.00	630,641,700	
ノーリツ鋼機	9,000	618.00	5,562,000	
キヤノン	357,400	3,906.00	1,396,004,400	
リコー	185,600	1,279.50	237,475,200	
シチズンホールディングス	78,300	951.00	74,463,300	

リズム時計	39,000	165.00	6,435,000	
大研医器	5,500	1,208.00	6,644,000	
パラマウントベッドHD	6,800	3,410.00	23,188,000	
前田工織	7,300	1,255.00	9,161,500	貸付株式数 2,000株 (400株)
永大産業	14,000	443.00	6,202,000	
アートネイチャー	5,600	1,348.00	7,548,800	
バンダイナムコHLDGS	68,200	2,633.00	179,570,600	
フランスベッドHLDGS	55,000	184.00	10,120,000	
マーベラス	11,100	1,790.00	19,869,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	5,600	6,140.00	34,384,000	
エイベックス・グループHD	12,800	1,718.00	21,990,400	貸付株式数 3,600株
トッパン・フォームズ	12,800	1,172.00	15,001,600	
フジシールインターナショナル	7,800	3,525.00	27,495,000	
タカラトミー	24,900	619.00	15,413,100	貸付株式数 7,100株 (7,100株)
大建工業	34,000	263.00	8,942,000	
凸版印刷	176,000	770.00	135,520,000	
大日本印刷	188,000	1,055.00	198,340,000	
図書印刷	15,000	341.00	5,115,000	
共同印刷	26,000	381.00	9,906,000	
日本写真印刷	11,100	1,831.00	20,324,100	貸付株式数 3,200株
藤森工業	5,800	3,440.00	19,952,000	
宝印刷	9,000	784.00	7,056,000	
前澤化成工業	7,500	1,173.00	8,797,500	
アシックス	61,500	3,080.00	189,420,000	
ツ ツ ミ	3,700	2,466.00	9,124,200	
ジェイ エス ピー	5,700	1,826.00	10,408,200	
ニ チ ハ	10,600	1,095.00	11,607,000	
エフピコ	5,800	3,560.00	20,648,000	貸付株式数 1,800株
小松ウオール工業	2,700	2,772.00	7,484,400	
ヤマハ	46,300	1,807.00	83,664,100	
河合楽器	3,400	2,497.00	8,489,800	
クリナップ	8,300	839.00	6,963,700	
ビジョン	11,800	7,460.00	88,028,000	
天馬	6,100	1,631.00	9,949,100	
リンテック	14,400	2,584.00	37,209,600	
信越ポリマー	16,000	514.00	8,224,000	

東リ	31,000	246.00	7,626,000	
イトーキ	15,400	565.00	8,701,000	
任天堂	38,000	14,130.00	536,940,000	
三菱鉛筆	5,500	3,880.00	21,340,000	
松風	4,800	1,440.00	6,912,000	
タカラスタンダ-ド	27,000	839.00	22,653,000	
コクヨ	33,300	894.00	29,770,200	
ニフコ	14,500	4,110.00	59,595,000	
岡村製作所	25,500	795.00	20,272,500	
日本バルカー	37,000	316.00	11,692,000	
MUTOHホールディングス	10,000	500.00	5,000,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
伊藤忠	507,600	1,370.50	695,665,800	
丸紅	529,500	745.70	394,848,150	
ヨンドシーホールディングス	5,400	2,050.00	11,070,000	
三陽商会	40,000	314.00	12,560,000	
長瀬産業	36,700	1,434.00	52,627,800	
蝶理	5,200	1,667.00	8,668,400	
豊田通商	67,800	2,836.00	192,280,800	
オンワ-ドホールディングス	47,000	732.00	34,404,000	
三共生興	19,000	445.00	8,455,000	
兼松	131,000	176.00	23,056,000	
美津濃	36,000	598.00	21,528,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
ファミリーマート	20,100	4,460.00	89,646,000	貸付株式数 5,700株 (5,700株)
三井物産	514,300	1,612.00	829,051,600	
日本紙パルプ	35,000	313.00	10,955,000	
東京エレクトロン	52,100	8,294.00	432,117,400	
日立ハイテクノロジーズ	21,100	3,520.00	74,272,000	
カメイ	10,300	790.00	8,137,000	
スターゼン	34,000	394.00	13,396,000	
セイコーHD	45,000	685.00	30,825,000	貸付株式数 12,000株
山善	25,300	822.00	20,796,600	
住友商事	358,000	1,260.50	451,259,000	
日本ユニシス	18,700	1,098.00	20,532,600	
内田洋行	20,000	374.00	7,480,000	
三菱商事	465,600	2,222.00	1,034,563,200	
第一実業	19,000	576.00	10,944,000	

キヤノンマーケティングJPN	17,600	2,170.00	38,192,000	
西華産業	29,000	274.00	7,946,000	
菱洋エレクトロ	9,800	1,192.00	11,681,600	
ユアサ商事	6,500	2,295.00	14,917,500	
神鋼商事	30,000	267.00	8,010,000	
阪和興業	66,000	426.00	28,116,000	
カナデン	11,000	793.00	8,723,000	
菱電商事	15,000	811.00	12,165,000	
ニプロ	40,200	1,050.00	42,210,000	貸付株式数 9,900株
岩谷産業	68,000	864.00	58,752,000	貸付株式数 19,000株
すてきナイスグループ	37,000	196.00	7,252,000	
昭光通商	48,000	183.00	8,784,000	
兼松エレクトロニクス	7,300	1,650.00	12,045,000	
三愛石油	18,000	733.00	13,194,000	
稲畑産業	16,700	1,033.00	17,251,100	
ゴ-ルドウイン	17,000	629.00	10,693,000	
ユニ・チャ-ム	130,200	2,762.00	359,612,400	
デサント	16,000	1,149.00	18,384,000	
ワキタ	14,000	1,150.00	16,100,000	貸付株式数 3,200株 (3,200株)
東邦ホールディングス	21,900	1,513.00	33,134,700	
サンゲツ	11,900	2,899.00	34,498,100	
ミツウロコグループ	14,200	534.00	7,582,800	
シナネン	21,000	431.00	9,051,000	
伊藤忠エネクス	15,500	770.00	11,935,000	
サンリオ	17,300	3,225.00	55,792,500	貸付株式数 4,900株 (4,600株)
サンワテクノス	5,600	1,152.00	6,451,200	
リョ-サン	11,300	2,536.00	28,656,800	
新光商事	9,200	1,164.00	10,708,800	
トーホ-	24,000	430.00	10,320,000	
三信電気	10,400	809.00	8,413,600	
東陽テクニカ	11,700	1,047.00	12,249,900	
モスフードサービス	8,600	2,108.00	18,128,800	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
加賀電子	6,700	1,477.00	9,895,900	
三益半導体	9,500	1,023.00	9,718,500	
木曽路	8,500	1,913.00	16,260,500	貸付株式数 2,400株

千趣会	13,800	866.00	11,950,800	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
ケーヨー	17,000	526.00	8,942,000	貸付株式数 3,200株
アデランス	9,200	1,186.00	10,911,200	
上新電機	15,000	909.00	13,635,000	
日本瓦斯	10,100	2,470.00	24,947,000	
マルエツ	19,000	549.00	10,431,000	
ロイヤルホールディングス	11,000	1,732.00	19,052,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
いなげや	8,600	1,177.00	10,122,200	
島忠	14,900	2,972.00	44,282,800	
チヨダ	7,600	2,120.00	16,112,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
ライフコーポレーション	4,600	1,694.00	7,792,400	
カスミ	14,200	1,048.00	14,881,600	
リンガーハット	7,100	1,733.00	12,304,300	貸付株式数 2,300株
AOKIホールディングス	14,700	1,181.00	17,360,700	
オークワ	12,000	949.00	11,388,000	
コメリ	10,500	2,596.00	27,258,000	
青山商事	15,200	2,566.00	39,003,200	
しまむら	6,900	9,970.00	68,793,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
高島屋	86,000	1,006.00	86,516,000	
松屋	13,100	1,803.00	23,619,300	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	28,800	1,877.00	54,057,600	
近鉄百貨店	28,000	312.00	8,736,000	貸付株式数 7,000株
ニッセンHD	17,900	355.00	6,354,500	
パルコ	8,300	975.00	8,092,500	
丸井グループ	75,200	1,041.00	78,283,200	
クレディセゾン	50,400	2,206.00	111,182,400	
アクシアルリテイリング	5,400	2,670.00	14,418,000	
ダイエー	81,400	136.00	11,070,400	
イオン	242,800	1,200.00	291,360,000	貸付株式数 72,000株
ユニグループ・HD	65,300	601.00	39,245,300	
イズミ	13,700	3,755.00	51,443,500	
東武ストア	28,000	289.00	8,092,000	
平和堂	12,900	2,185.00	28,186,500	
フジ	7,600	2,184.00	16,598,400	
ヤオコー	3,600	7,160.00	25,776,000	

ゼビオ	8,500	1,921.00	16,328,500	
ケースホールディングス	14,000	2,895.00	40,530,000	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
P a l t a c	10,600	1,340.00	14,204,000	
新生銀行	597,000	225.00	134,325,000	
あおぞら銀行	426,000	388.00	165,288,000	
三菱UFJフィナンシャルG	4,891,500	690.00	3,375,135,000	
りそなホールディングス	718,600	639.30	459,400,980	
三井住友トラストHD	1,351,000	494.00	667,394,000	
三井住友フィナンシャルG	460,800	4,477.50	2,063,232,000	
第四銀行	76,000	407.00	30,932,000	
北越銀行	73,000	222.00	16,206,000	
西日本シティ銀行	211,000	341.00	71,951,000	
千葉銀行	233,000	788.00	183,604,000	
横浜銀行	420,000	669.30	281,106,000	
常陽銀行	218,000	599.00	130,582,000	
群馬銀行	143,000	707.00	101,101,000	
武蔵野銀行	9,800	3,900.00	38,220,000	
千葉興業銀行	14,400	869.00	12,513,600	
筑波銀行	28,600	391.00	11,182,600	
七十七銀行	101,000	624.00	63,024,000	
青森銀行	52,000	349.00	18,148,000	
秋田銀行	45,000	340.00	15,300,000	
山形銀行	39,000	531.00	20,709,000	貸付株式数 11,000株
岩手銀行	4,300	5,270.00	22,661,000	
東邦銀行	55,000	415.00	22,825,000	
みちのく銀行	38,000	231.00	8,778,000	貸付株式数 10,000株
ふくおかフィナンシャルG	248,000	643.00	159,464,000	
静岡銀行	178,000	1,145.00	203,810,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
十六銀行	76,000	441.00	33,516,000	
スルガ銀行	63,800	2,270.00	144,826,000	
八十二銀行	108,000	726.00	78,408,000	
山梨中央銀行	40,000	499.00	19,960,000	
大垣共立銀行	77,000	355.00	27,335,000	
福井銀行	58,000	269.00	15,602,000	
北國銀行	68,000	377.00	25,636,000	
清水銀行	2,600	2,965.00	7,709,000	
滋賀銀行	60,000	635.00	38,100,000	
南都銀行	59,000	426.00	25,134,000	

百五銀行	58,000	491.00	28,478,000	
京都銀行	114,000	1,011.00	115,254,000	
紀陽銀行	24,200	1,520.00	36,784,000	
三重銀行	40,000	274.00	10,960,000	
ほくほくフィナンシャルG	402,000	243.00	97,686,000	
広島銀行	177,000	577.00	102,129,000	
山陰合同銀行	38,000	873.00	33,174,000	
中国銀行	42,400	1,664.00	70,553,600	
伊予銀行	63,700	1,229.00	78,287,300	
百十四銀行	67,000	393.00	26,331,000	
四国銀行	52,000	252.00	13,104,000	
阿波銀行	50,000	649.00	32,450,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
鹿児島銀行	42,000	761.00	31,962,000	
大分銀行	39,000	455.00	17,745,000	
宮崎銀行	44,000	368.00	16,192,000	
肥後銀行	50,000	650.00	32,500,000	
佐賀銀行	46,000	264.00	12,144,000	
十八銀行	42,000	346.00	14,532,000	
沖縄銀行	5,100	4,990.00	25,449,000	
琉球銀行	13,300	1,726.00	22,955,800	
セブン銀行	202,100	519.00	104,889,900	
みずほフィナンシャルG	8,407,300	204.30	1,717,611,390	
山口フィナンシャルG	58,000	1,186.00	68,788,000	
芙蓉総合リース	6,700	4,245.00	28,441,500	
興銀リース	12,300	2,348.00	28,880,400	
東京センチュリーリース	14,500	2,953.00	42,818,500	
SBIホールディングス	73,700	1,381.00	101,779,700	
日本証券金融	32,100	615.00	19,741,500	
アイフル	103,900	451.00	46,858,900	貸付株式数 33,200株 (33,200株)
名古屋銀行	58,000	454.00	26,332,000	
北洋銀行	90,700	471.00	42,719,700	
愛知銀行	2,500	5,810.00	14,525,000	
第三銀行	48,000	193.00	9,264,000	
東日本銀行	31,000	347.00	10,757,000	
大光銀行	34,000	223.00	7,582,000	
愛媛銀行	42,000	251.00	10,542,000	貸付株式数 14,000株
トマト銀行	46,000	179.00	8,234,000	
みなと銀行	59,000	226.00	13,334,000	

京葉銀行	49,000	659.00	32,291,000	
関西アーバン銀行	7,500	1,325.00	9,937,500	
栃木銀行	33,000	529.00	17,457,000	
北日本銀行	2,800	2,832.00	7,929,600	
東和銀行	93,000	106.00	9,858,000	
福島銀行	105,000	96.00	10,080,000	
大東銀行	56,000	150.00	8,400,000	
リコーリース	5,700	3,180.00	18,126,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
イオンフィナンシャルサービス	40,000	2,567.00	102,680,000	貸付株式数 11,400株 (11,400株)
アコム	124,600	353.00	43,983,800	貸付株式数 36,500株 (36,500株)
ジャックス	36,000	588.00	21,168,000	
オリコ	144,100	210.00	30,261,000	
日立キャピタル	12,400	2,665.00	33,046,000	
オリックス	430,000	1,565.50	673,165,000	
三菱UFJリース	155,200	557.00	86,446,400	
ジャフコ	8,700	4,650.00	40,455,000	
トモニホールディングス	48,500	516.00	25,026,000	
大和証券G本社	569,000	959.30	545,841,700	
野村ホールディングス	1,245,500	718.80	895,265,400	
岡三証券グループ	53,000	956.00	50,668,000	
丸三証券	22,100	827.00	18,276,700	
東洋証券	32,000	358.00	11,456,000	
東海東京HD	70,700	857.00	60,589,900	
水戸証券	24,800	425.00	10,540,000	
いちよし証券	14,500	1,298.00	18,821,000	
松井証券	33,800	1,118.00	37,788,400	
損保ジャパン興亜HD	135,700	3,027.50	410,831,750	
日本取引所グループ	89,900	3,010.00	270,599,000	
マネックスG	75,400	287.00	21,639,800	
カブドットコム証券	28,900	592.00	17,108,800	
極東証券	9,400	1,955.00	18,377,000	
岩井コスモホールディング	7,700	1,234.00	9,501,800	
フィデアホール	40,900	242.00	9,897,800	貸付株式数 11,600株
池田泉州HD	47,900	573.00	27,446,700	
MS&AD	194,000	2,830.00	549,020,000	
SONY FH	59,500	1,828.00	108,766,000	
第一生命	390,600	1,744.00	681,206,400	

東京海上HD	250,600	3,970.50	995,007,300	
NECキャピタルソリューション	3,600	2,014.00	7,250,400	
T&Dホールディングス	223,400	1,458.00	325,717,200	
三井不動産	323,000	3,430.00	1,107,890,000	貸付株式数 95,000株 (95,000株)
三菱地所	454,000	2,685.00	1,218,990,000	
平和不動産	13,400	1,843.00	24,696,200	
東京建物	134,000	963.00	129,042,000	
ダイビル	16,600	1,263.00	20,965,800	
京阪神ビルディング	16,100	645.00	10,384,500	
住友不動産	146,000	4,156.50	606,849,000	
大京	100,000	207.00	20,700,000	
テーオーシー	22,700	728.00	16,525,600	
東京楽天地	18,000	512.00	9,216,000	
レオパレス21	67,600	706.00	47,725,600	
スターツコーポレーション	7,900	1,604.00	12,671,600	
フジ住宅	13,000	656.00	8,528,000	貸付株式数 3,200株
空港施設	10,900	733.00	7,989,700	
住友不動産販売	4,600	2,693.00	12,387,800	
ゴールドクレスト	6,100	2,176.00	13,273,600	
リロ・ホールディング	2,300	7,880.00	18,124,000	
タカラレーベン	29,500	530.00	15,635,000	貸付株式数 6,800株 (6,800株)
サンヨーハウジ 名古屋	5,900	1,175.00	6,932,500	
イオンモール	39,000	2,027.00	79,053,000	
トーセイ	10,500	727.00	7,633,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	38,200	1,238.00	47,291,600	
サンフロンティア不動産	7,800	1,236.00	9,640,800	貸付株式数 2,200株
東武鉄道	333,000	532.00	177,156,000	
相鉄ホールディングス	108,000	469.00	50,652,000	
東京急行	337,000	717.00	241,629,000	
京浜急行	168,000	911.00	153,048,000	
小田急電鉄	199,000	1,090.00	216,910,000	
京王電鉄	174,000	873.00	151,902,000	
京成電鉄	94,000	1,382.00	129,908,000	
富士急行	18,000	1,097.00	19,746,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
新京成電鉄	23,000	387.00	8,901,000	
東日本旅客鉄道	112,900	8,954.00	1,010,906,600	

西日本旅客鉄道	59,500	5,712.00	339,864,000	
東海旅客鉄道	55,300	17,515.00	968,579,500	
西武ホールディングス	48,900	2,275.00	111,247,500	貸付株式数 14,600株
鴻池運輸	4,100	2,287.00	9,376,700	
西日本鉄道	82,000	496.00	40,672,000	
ハマキョウレックス	2,400	3,895.00	9,348,000	
サカイ引越センター	1,500	3,455.00	5,182,500	
近畿日本鉄道	616,000	399.00	245,784,000	貸付株式数 181,000株
阪急阪神HLDGS	411,000	658.00	270,438,000	
南海電鉄	130,000	552.00	71,760,000	
京阪電鉄	140,000	597.00	83,580,000	
神戸電鉄	28,000	358.00	10,024,000	
名古屋鉄道	221,000	461.00	101,881,000	貸付株式数 63,000株 (63,000株)
山陽電鉄	30,000	443.00	13,290,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
トランコム	2,100	5,010.00	10,521,000	
日本通運	244,000	576.00	140,544,000	
ヤマトホールディングス	113,400	2,588.00	293,479,200	
山九	76,000	490.00	37,240,000	
日新	33,000	277.00	9,141,000	
丸全昭和運輸	27,000	352.00	9,504,000	
センコー	27,000	553.00	14,931,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
日本梱包運輸	20,200	1,861.00	37,592,200	
福山通運	36,000	630.00	22,680,000	貸付株式数 10,000株
セイノーホールディングス	48,000	1,143.00	54,864,000	
神奈川中央交通	18,000	575.00	10,350,000	
日立物流	12,300	1,503.00	18,486,900	
日本郵船	522,000	341.00	178,002,000	
商船三井	325,000	376.00	122,200,000	貸付株式数 103,000株
川崎汽船	274,000	312.00	85,488,000	
NSユニテッド海運	31,000	343.00	10,633,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
飯野海運	34,300	698.00	23,941,400	
日本航空	116,500	3,635.00	423,477,500	
ANAホールディングス	1,215,000	303.80	369,117,000	
三菱倉庫	41,000	1,871.00	76,711,000	
三井倉庫HOLD	41,000	448.00	18,368,000	
住友倉庫	46,000	676.00	31,096,000	

渋沢倉庫	21,000	357.00	7,497,000	
ヤマタネ	49,000	182.00	8,918,000	
東陽倉庫	27,000	302.00	8,154,000	
日本トランスシティ	21,000	374.00	7,854,000	
安田倉庫	7,300	1,071.00	7,818,300	
東洋埠頭	33,000	212.00	6,996,000	
上組	72,000	1,095.00	78,840,000	
郵船ロジスティクス	6,900	1,316.00	9,080,400	
近鉄エクスプレス	5,500	4,260.00	23,430,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
東京放送HD	37,400	1,430.00	53,482,000	貸付株式数 10,100株 (10,100株)
日本テレビHLDS	55,600	1,761.00	97,911,600	
テレビ朝日HD	17,100	1,945.00	33,259,500	
スカパーJSATHD	49,900	714.00	35,628,600	
テレビ東京HD	5,600	2,387.00	13,367,200	
コネクシオ	6,700	1,115.00	7,470,500	
日本電信電話	238,700	6,230.00	1,487,101,000	
KDDI	206,800	7,544.00	1,560,099,200	
光通信	5,500	7,770.00	42,735,000	貸付株式数 1,600株
NTTドコモ	502,100	1,866.00	936,918,600	
GMOインターネット	21,200	1,107.00	23,468,400	
KADOKAWA・DWANGO	16,400	2,040.00	33,456,000	貸付株式数 4,700株
学研ホールディングス	32,000	258.00	8,256,000	
ゼンリン	9,800	1,374.00	13,465,200	
東京電力	525,000	433.00	227,325,000	
中部電力	188,800	1,416.00	267,340,800	
関西電力	252,500	1,209.50	305,398,750	
中国電力	84,400	1,536.00	129,638,400	
北陸電力	60,100	1,522.00	91,472,200	
東北電力	154,100	1,397.00	215,277,700	
四国電力	55,700	1,498.00	83,438,600	
九州電力	136,100	1,238.00	168,491,800	
北海道電力	58,000	983.00	57,014,000	
沖縄電力	4,400	3,730.00	16,412,000	
電源開発	41,300	4,150.00	171,395,000	
東京瓦斯	749,000	649.70	486,625,300	
大阪瓦斯	636,000	455.90	289,952,400	
東邦瓦斯	156,000	623.00	97,188,000	

北海道瓦斯	28,000	289.00	8,092,000	貸付株式数 7,000株 (2,000株)
西部瓦斯	74,000	270.00	19,980,000	
静岡瓦斯	19,500	756.00	14,742,000	
松竹	41,000	1,064.00	43,624,000	
東宝	44,000	2,662.00	117,128,000	
エイチ・アイ・エス	10,700	2,873.00	30,741,100	
東映	25,000	621.00	15,525,000	
NTTデータ	38,000	4,575.00	173,850,000	
共立メンテナンス	3,600	5,160.00	18,576,000	貸付株式数 1,000株
イチネンホールディングス	10,200	958.00	9,771,600	貸付株式数 2,900株 (2,900株)
建設技術研究所	4,800	1,645.00	7,896,000	貸付株式数 1,300株
インファーマシーズ	7,200	3,280.00	23,616,000	
東京テアトル	47,000	147.00	6,909,000	
よみうりランド	17,000	512.00	8,704,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
東京都競馬	49,000	320.00	15,680,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
常磐興産	46,000	153.00	7,038,000	
カナモト	9,200	3,790.00	34,868,000	
東京ドーム	50,000	478.00	23,900,000	
D T S	7,500	2,407.00	18,052,500	
スクウェア・エニックス・H D	22,600	2,400.00	54,240,000	貸付株式数 6,600株 (6,600株)
シーイーシー	6,200	1,036.00	6,423,200	
カプコン	16,400	1,740.00	28,536,000	貸付株式数 4,800株 (4,800株)
西尾レントオール	5,400	4,005.00	21,627,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本空港ビルデング	21,200	4,850.00	102,820,000	
トランス・コスモス	9,500	2,101.00	19,959,500	
乃村工藝社	14,100	998.00	14,071,800	
ジャステック	8,700	819.00	7,125,300	貸付株式数 2,400株
S C S K	14,800	3,015.00	44,622,000	
藤田観光	31,000	356.00	11,036,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
KNT - CTホールディング ス	38,000	169.00	6,422,000	
日本管財	4,000	2,778.00	11,112,000	

トーカイ	3,400	3,545.00	12,053,000	
セコム	62,600	6,873.00	430,249,800	
アイネス	11,200	900.00	10,080,000	
丹青社	8,500	964.00	8,194,000	
メイテック	9,200	3,390.00	31,188,000	
T K C	6,400	1,977.00	12,652,800	
アサツー ディ・ケイ	12,700	3,120.00	39,624,000	
富士ソフト	9,400	2,527.00	23,753,800	
応用地質	7,600	1,811.00	13,763,600	
船井総研ホールディング	11,300	1,002.00	11,322,600	
N S D	14,800	1,686.00	24,952,800	
コナミ	25,700	2,253.00	57,902,100	
ベネッセホールディングス	23,400	3,655.00	85,527,000	貸付株式数 6,300株 (6,300株)
イオンディライト	6,800	2,696.00	18,332,800	
ナック	5,700	1,047.00	5,967,900	
ニチイ学館	14,900	911.00	13,573,900	貸付株式数 4,800株 (4,800株)
ダイセキ	11,300	2,029.00	22,927,700	
日鉄住金物産	41,000	426.00	17,466,000	
トラスコ中山	8,100	3,355.00	27,175,500	
ヤマダ電機	239,600	393.00	94,162,800	貸付株式数 71,100株 (71,100株)
オートバックスセブン	22,400	1,669.00	37,385,600	貸付株式数 6,200株 (6,200株)
アークランドサカモト	5,000	2,474.00	12,370,000	
ニトリホールディングス	26,200	6,580.00	172,396,000	
吉野家ホールディングス	18,000	1,309.00	23,562,000	
加藤産業	9,200	2,273.00	20,911,600	
イエローハット	6,300	2,308.00	14,540,400	
富士エレクトロニクス	5,900	1,371.00	8,088,900	
松屋フーズ	4,000	2,091.00	8,364,000	
J B C Cホールディングス	10,400	754.00	7,841,600	
サガミチェーン	10,000	1,055.00	10,550,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
日 伝	3,100	2,400.00	7,440,000	
因幡電機産業	9,000	3,970.00	35,730,000	
王将フードサービス	4,800	4,230.00	20,304,000	貸付株式数 1,300株
ブレナス	7,400	2,034.00	15,051,600	
ミニストップ	6,200	1,573.00	9,752,600	

アークス	10,900	2,461.00	26,824,900	
バロ	13,800	2,050.00	28,290,000	
ミスミグループ本社	22,700	3,855.00	87,508,500	
江守グループHD	3,800	1,083.00	4,115,400	
ベルク	3,200	3,670.00	11,744,000	
ファーストリテイリング	12,200	43,425.00	529,785,000	貸付株式数 3,500株
ソフトバンク	322,900	7,966.00	2,572,221,400	
スズケン	25,100	3,095.00	77,684,500	
サンドラッグ	12,800	4,830.00	61,824,000	
サクスパーホールディング	5,300	1,576.00	8,352,800	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ジェコス	4,900	1,818.00	8,908,200	
ベルーナ	18,000	490.00	8,820,000	
合計			128,429,278,710	

(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26年12月30日

資産総額	2,505,816,931円
負債総額	4,071,588円
純資産総額(-)	2,501,745,343円
発行済数量	2,557,780,183口
1単位当たり純資産額(/)	0.9781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26年12月30日

資産総額	134,422,933,430円
負債総額	7,202,117,780円
純資産総額(-)	127,220,815,650円
発行済数量	154,630,316,965口
1単位当たり純資産額(/)	0.8227円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にし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26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年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者である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26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	21	184,914
追加型株式投資信託	538	11,205,522
株式投資信託 合計	559	11,390,437
単位型公社債投資信託	1	9,185
追加型公社債投資信託	17	3,265,047
公社債投資信託 合計	18	3,274,233
総合計	577	14,664,670

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55期事業年度（平成25年4月1日から平成26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56期事業年度に係る中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	14,380,327	15,186,222
有価証券	9,427,636	15,003,765
前払金	207	453
前払費用	142,919	157,453
未収入金	521,825	-
未収委託者報酬	7,183,011	8,265,950
未収収益	106,914	103,432
貯蔵品	9,551	14,492
繰延税金資産	491,727	674,141
その他	8,445	597
流動資産計	32,272,567	39,406,511
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物（純額）	254,258	252,417
器具備品（純額）	26,257	23,555
リース資産（純額）	222,274	224,362
リース資産（純額）	5,726	4,499
無形固定資産	3,194,512	2,991,462
ソフトウェア	3,132,238	2,910,918

ソフトウェア仮勘定		50,423		68,693
電話加入権		11,850		11,850
投資その他の資産		15,113,434		15,077,046
投資有価証券		8,342,934		8,338,733
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		136,315		129,405
従業員に対する長期貸付金		92,527		68,396
差入保証金		1,000,820		997,594
長期前払費用		7,376		6,484
投資不動産（純額）	1	402,340	1	398,402
貸倒引当金		9,950		3,040
固定資産計		18,562,205		18,320,926
資産合計		50,834,773		57,727,438

(単位:千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
リース債務	1,227	1,227
預り金	56,491	53,677
未払金	6,795,899	8,998,456
未払収益分配金	10,333	7,931
未払償還金	113,002	77,698
未払手数料	3,764,501	4,277,412
その他未払金	2	4,635,414
未払費用	3,383,551	3,463,796
未払法人税等	588,040	1,530,565
未払消費税等	189,139	530,831
賞与引当金	841,300	955,600
流動負債計	11,855,648	15,534,154
固定負債		
リース債務	4,494	3,272
退職給付引当金	1,935,442	1,959,451
役員退職慰労引当金	67,410	80,280
繰延税金負債	1,740,407	1,789,543
固定負債計	3,747,753	3,832,547
負債合計	15,603,402	19,366,702
純資産の部		
株主資本		

資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	7,722,723	10,821,849
利益剰余金合計	8,097,020	11,196,146
株主資本合計	34,767,020	37,866,146
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	464,350	494,589
評価・換算差額等合計	464,350	494,589
純資産合計	35,231,371	38,360,735
負債・純資産合計	50,834,773	57,727,438

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	73,498,726	84,771,977
その他営業収益	526,465	788,473
営業収益計	74,025,191	85,560,451
営業費用		
支払手数料	41,213,272	47,520,063
広告宣伝費	604,864	668,841
公告費	949	533
受益証券発行費	-	25
調査費	8,116,701	8,246,807
調査費	824,915	741,792
委託調査費	7,291,786	7,505,015
委託計算費	807,090	735,588
営業雑経費	1,280,599	1,322,711
通信費	206,564	249,081
印刷費	404,023	477,092
協会費	53,643	54,190
諸会費	11,281	11,711
その他営業雑経費	605,086	530,634
営業費用計	52,023,478	58,494,570
一般管理費		

給料	5,264,128	5,708,541
役員報酬	249,180	243,000
給料・手当	3,782,533	3,785,717
賞与	391,114	724,223
賞与引当金繰入額	841,300	955,600
福利厚生費	809,254	793,740
交際費	55,806	37,951
寄付金	636	-
旅費交通費	196,147	191,623
租税公課	206,178	222,767
不動産賃借料	887,968	1,182,703
退職給付費用	469,713	373,920
役員退職慰労引当金繰入額	38,970	33,750
固定資産減価償却費	1,181,438	963,183
諸経費	1,094,627	1,354,169
一般管理費計	10,204,869	10,862,351
営業利益	11,796,843	16,203,530

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	257,704	1	144,660
有価証券利息		11,102		13,966
受取利息		10,598		9,117
時効成立分配金・償還金		21,305		44,877
投資有価証券売却益		279,443		64,122
有価証券償還益		101,052		63,228
その他		44,912		34,445
営業外収益計		726,118		374,418
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		19,392		16,985
投資有価証券売却損		36,469		3,171
有価証券償還損		33,338		18,848
投資不動産管理費用		16,271		16,864
貯蔵品廃棄損		9,990		9,503
その他		13,120		9,343
営業外費用計		128,584		74,716
経常利益		12,394,377		16,503,232
特別利益				

投資有価証券売却益		39,827		-
固定資産売却益		31		-
その他		16,466		-
特別利益計		56,325		-
特別損失				
固定資産除却損	2	129,816	2	888
本社移転関連費用		1,099,913		-
その他		14,428		-
特別損失計		1,244,158		888
税引前当期純利益		11,206,544		16,502,343
法人税、住民税及び事業税		4,286,691		6,525,874
法人税等調整額		109,902		150,022
法人税等合計		4,176,789		6,375,851
当期純利益		7,029,755		10,126,492

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		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	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,715,116	8,089,414	34,759,414
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,022,149	△7,022,149	△7,022,149
当期純利益	-	-	-	7,029,755	7,029,755	7,029,755
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	7,606	7,606	7,606
当期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,722,723	8,097,020	34,767,020

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	33,879	53,783	87,663	34,847,077
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△7,022,149
当期純利益	-	-	-	7,029,755
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	430,470	△53,783	376,686	376,686
当期変動額合計	430,470	△53,783	376,686	384,293
当期末残高	464,350	-	464,350	35,231,371

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		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	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,722,723	8,097,020	34,767,020
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027,366	△7,027,366	△7,027,366
当期純利益	-	-	-	10,126,492	10,126,492	10,126,492
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,099,125	3,099,125	3,099,125
当期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	10,821,849	11,196,146	37,866,146

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	464,350	-	464,350	35,231,371
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△7,027,366
当期純利益	-	-	-	10,126,492
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	30,238	-	30,238	30,238
当期変動額合計	30,238	-	30,238	3,129,364
当期末残高	494,589	-	494,589	38,360,735

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) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産(リース資産を除く)

定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 8～47年

器具備品 4～20年

（会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、当事業年度より有形固定資産（投資不動産を含む）の減価償却方法を定率法から定額法に変更いたしました。

この変更は、本社移転を契機に当社の有形固定資産の使用実態を見直した結果、当社において使用する有形固定資産は安定的に使用されており、その投資効果は、耐用年数の期間中に平均的・安定的に発現するものであるため、定額法が当社の企業活動をより適切に反映した減価償却方法であると判断したためであります。

この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微です。

（２）無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

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

（３）長期前払費用

定額法によっております。

（４）リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

３．引当金の計上基準

（１）貸倒引当金

債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

（２）賞与引当金

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。

（３）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。

また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（４）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

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処理によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「貯蔵品廃棄損」は重要性が増したため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた23,111千円は、「貯蔵品廃棄損」9,990千円、「その他」13,120千円として組替えております。

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
建物	15,528千円	18,230千円
器具備品	250,072千円	249,761千円
リース資産	409千円	1,636千円
投資建物	724,130千円	729,348千円
投資器具備品	23,691千円	24,180千円

2 関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
未払金	2,883,398千円	4,508,988千円

3 保証債務

前事業年度（平成25年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore) Ltd. の債務1,591,590千円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成26年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore) Ltd. の債務1,719,900千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)
受取配当金	185,280千円	-

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)
建物	546千円	-
器具備品	128,892千円	888千円
無形固定資産(その他)	377千円	-
計	129,816千円	888千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(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24年 6月25日 定時株主総会	普通株式	7,022	2,692	平成24年 3月31日	平成24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25年 6月24日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	7,027百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	2,694円
基準日	平成25年 3月31日
効力発生日	平成25年 6月25日

当事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26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25年6月24日 定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年 3月31日	平成25年 6月25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26年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	10,126百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,882円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月26日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

(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、「証券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

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、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財務会議において報告を行っております。

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。

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25年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	14,380,327	14,380,327	-
(2) 未収委託者報酬	7,183,011	7,183,011	-
(3) 未収入金	521,825	521,825	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	16,711,401	16,711,401	-
資産計	38,796,567	38,796,567	-
(1) 未払手数料	3,764,501	3,764,501	-
(2) その他未払金	2,908,061	2,908,061	-
(3) 未払費用(*)	2,782,587	2,782,587	-
負債計	9,455,149	9,455,149	-

(*) 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26年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	15,186,222	15,186,222	-
(2) 未収委託者報酬	8,265,950	8,265,950	-
(3) 未収入金	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	22,283,329	22,283,329	-
資産計	45,735,503	45,735,503	-
(1) 未払手数料	4,277,412	4,277,412	-
(2) その他未払金	4,635,414	4,635,414	-
(3) 未払費用(*)	2,678,610	2,678,610	-
負債計	11,591,437	11,591,437	-

(*) 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、(2) 未収委託者報酬、並びに(3) 未収入金

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。

- (4) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

- (1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,059,169	1,059,169
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069	5,141,069
(3) 差入保証金	1,000,820	997,594

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25年3月31日現在）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,380,327	-	-	-
未収委託者報酬	7,183,011	-	-	-
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	-	1,434,397	4,840,276	-
合計	21,563,339	1,434,397	4,840,276	-

当事業年度（平成26年3月31日現在）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	15,186,222	-	-	-
未収委託者報酬	8,265,950	-	-	-
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	-	1,498,464	3,978,251	97,038
合計	23,452,173	1,498,464	3,978,251	97,038

(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25年3月31日現在)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141,069千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成26年3月31日現在)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141,069千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(平成25年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	93,459	55,101	38,357
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	6,224,312	5,440,857	783,455
小計	6,317,771	5,495,959	821,812
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	10,393,629	10,493,953	100,323
小計	10,393,629	10,493,953	100,323
合計	16,711,401	15,989,912	721,489

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,059,169千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(平成26年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	113,247	55,101	58,145
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	5,625,179	4,873,552	751,626
小計	5,738,426	4,928,653	809,772

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	16,544,903	16,586,202	41,299
小計	16,544,903	16,586,202	41,299
合計	22,283,329	21,514,856	768,472

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,059,169千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1) 株式	141,128	39,827	-
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	28,114,625	279,443	36,469
合計	28,255,753	319,271	36,469

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他			
証券投資信託の受益証券	24,501,921	64,122	3,171
合計	24,501,921	64,122	3,171

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、その他有価証券（非上場株式）について3,220千円の減損処理を行っております。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

退職給付債務	1,935,442千円
退職給付引当金	1,935,442千円

3. 退職給付費用に関する事項

勤務費用	301,777千円
その他	167,935千円
退職給付費用	469,713千円

(注) 「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

期首における退職給付債務	1,935,442千円
勤務費用	201,327千円
退職給付の支払額	177,317千円
期末における退職給付債務	1,959,451千円

(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

積立型制度の退職給付債務	-
年金資産	-
非積立型制度の退職給付債務	1,959,451千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,959,451千円
退職給付引当金	1,959,451千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,959,451千円

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	201,327千円
確定給付制度に係る退職給付費用	201,327千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172,593千円でありました。

(表示方法の変更)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を当事業年度より適用し（ただし、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めを除く。）、（退職給付関係）注記の表示方法を変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、（退職給付関係）の注記の組替えは行っておりません。

(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的主要原因別内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	837,121	833,243
退職給付引当金	693,199	698,348
未払事業税	154,219	335,386
賞与引当金	280,855	287,721
連結法人間取引(譲渡損)	264,269	141,925
投資有価証券評価損	128,953	128,953
繰延資産	157,330	121,437
出資金評価損	114,425	116,888
未払社会保険料	43,411	38,787
器具備品	33,316	33,316
役員退職慰労引当金	24,920	28,611
その他	29,627	24,709
繰延税金資産小計	2,761,651	2,789,330
評価性引当額	1,323,069	1,200,725
繰延税金資産合計	1,438,582	1,588,604
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428,233	2,428,233
その他有価証券評価差額金	257,138	273,883
その他	1,888	1,888
繰延税金負債合計	2,687,261	2,704,006
繰延税金負債の純額	1,248,679	1,115,401

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

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

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26年法律第10号)が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について前事業年度の38.01%から35.64%に変更されております。

この変更による影響は軽微であります。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,591,590	-	-

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25年4月1日 至 平成26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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,719,900	-	-

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24年4月1日 至 平成25年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	20,510,864	未払手数料	2,758,584
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,205,721	未払費用	82,519
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	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	1,194,567	長期差入保証金	971,157
									未収入金	511,559

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

(2) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(3) 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25年4月1日 至 平成26年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,994,992	未払手数料	3,216,077
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	678,054	未払費用	393,881

同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	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	978,984	長期差入保証金	971,157
-------------	------------	--------	-----	--------	---	---------	---------	---------	---------	---------

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- (2) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。
- (3) 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)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24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
1株当たり純資産額	13,506.24円	1株当たり純資産額	14,705.91円
1株当たり当期純利益	2,694.91円	1株当たり当期純利益	3,882.07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いません。

(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24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益(千円)	7,029,755	10,126,492
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。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

当中間会計期間
(平成26年9月30日)

資産の部

流動資産		
現金・預金		20,257,586
有価証券		5,207,068
未収委託者報酬		9,365,956
貯蔵品		15,509
繰延税金資産		495,241
その他		296,277
流動資産計		35,637,638
固定資産		
有形固定資産	1	283,555
無形固定資産		
ソフトウェア		2,634,889
その他		90,103
無形固定資産合計		2,724,992
投資その他の資産		
投資有価証券		6,866,175
関係会社株式		5,129,895
その他	1	1,589,226
投資その他の資産合計		13,585,297
固定資産計		16,593,845
資産合計		52,231,483

(単位:千円)

当中間会計期間
(平成26年9月30日)

負債の部

流動負債		
リース債務		1,227
未払金		6,923,613
未払費用		3,196,727
未払法人税等		1,144,931
賞与引当金		796,000
その他	3	848,229
流動負債計		12,910,729
固定負債		
リース債務		2,658

退職給付引当金	1,996,246
役員退職慰労引当金	92,730
繰延税金負債	1,845,611
固定負債計	3,937,247
負債合計	16,847,976
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	374,297
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,668,191
利益剰余金合計	8,042,489
株主資本合計	34,712,489
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	671,018
評価・換算差額等合計	671,018
純資産合計	35,383,507
負債・純資産合計	52,231,483

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間	
	(自 平成26年4月1日	
	至 平成26年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		44,022,288
その他営業収益		472,415
営業収益計		44,494,704
営業費用		
支払手数料		24,490,036
その他営業費用		5,489,326
営業費用計		29,979,363
一般管理費	1	5,507,021
営業利益		9,008,319
営業外収益	2	1,299,244

営業外費用	1, 3	34,669
経常利益		10,272,894
特別利益		-
特別損失	4	12,947
税引前中間純利益		10,259,946
法人税、住民税及び事業税		3,150,039
法人税等調整額		137,269
中間純利益		6,972,636

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

（単位：千円）

	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	15,174,272	11,495,727	374,297	10,821,849	11,196,146	37,866,146
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,126,294	△ 10,126,294	△ 10,126,294
中間純利益	-	-	-	6,972,636	6,972,636	6,972,636
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	-	-	-	△ 3,153,657	△ 3,153,657	△ 3,153,657
当中間期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,668,191	8,042,489	34,712,489

	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	494,589	494,589	38,360,735
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,126,294
中間純利益	-	-	6,972,636
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	176,428	176,428	176,428
当中間期変動額合計	176,428	176,428	△ 2,977,228
当中間期末残高	671,018	671,018	35,383,507

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) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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) 有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く）

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	5～47年
器具備品	3～20年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

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

(3) 長期前払費用

定額法によっております。

(4) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

(2) 賞与引当金

役員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。

(3) 退職給付引当金

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

(4) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間未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26年9月30日現在)
有形固定資産	279,523千円
投資その他の資産	756,255千円

2 保証債務

当中間会計期間(平成26年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,805,580千円に対して保証を行っております。

3 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
有形固定資産	16,065千円
無形固定資産	490,092千円
投資その他の資産	2,726千円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
受取配当金	1,177,840千円
投資有価証券売却益	73,930千円
時効成立分配金・償還金	14,749千円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
時効成立後支払分配金・償還金	12,351千円
貯蔵品廃棄損	7,356千円
投資不動産管理費用	6,818千円

4 特別損失の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
関係会社株式評価損	11,174千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成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

(金融商品関係)

当中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26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：千円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	20,257,586	20,257,586	-
(2) 未収委託者報酬	9,365,956	9,365,956	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	11,047,833	11,047,833	-
資産計	40,671,376	40,671,376	-
(1) 未払金	6,923,613	6,923,613	-
(2) 未払費用(*)	2,760,751	2,760,751	-
負債計	9,684,365	9,684,365	-

(*) 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、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：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	1,025,409
子会社株式	5,129,895
差入保証金	997,068

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(自 平成26年4月1日 至 平成26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 5,129,895千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当中間会計期間において、子会社株式について11,174千円減損処理を行っております。

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	105,492	55,101	50,390
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	5,646,254	4,624,425	1,021,828
小計	5,751,746	4,679,527	1,072,219
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	5,296,087	5,325,705	29,618
小計	5,296,087	5,325,705	29,618
合計	11,047,833	10,005,232	1,042,601

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額 1,025,409千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,564.56円
1株当たり中間純利益金額	2,673.01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26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
中間純利益(千円)	6,972,636
普通株式に係る中間純利益(千円)	6,972,636
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼ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。

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成26年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 （平成26年3月 末日現在）	事業の内容
日本生命保険相互会社	1,250,000	（注1）
三井住友信託銀行株式会社	342,037	（注2）

（注1）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成26年3月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
 - ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
- 使用開始日を記載することがあります。

届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
 - ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
- 次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
 - ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
 - ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
- 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
- ファンドの形態等を記載することがあります。
- 図案を採用することがあります。
- ファンドの管理番号等を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成26年 5月26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	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第55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26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

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成27年1月9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 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金ダイワ日本株式インデックスの平成25年12月3日から平成26年12月1日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金ダイワ日本株式インデックスの平成26年12月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年11月25日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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26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26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。