

【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30年8月24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 岩本 信之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	高橋 慎 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】	03-5555-3431
【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】	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】

2018年8月25日から2019年2月21日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

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

委託会社の各営業日の午後3時までに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	年2回	日本		日経225
大型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	
中小型株	年6回 (隔月)	欧州		TOPIX
債券	年12回 (毎月)	アジア		
一般	日々	オセアニア		
公債	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ()
社債		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1月4日（基準時）の時価総額を100として1969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：

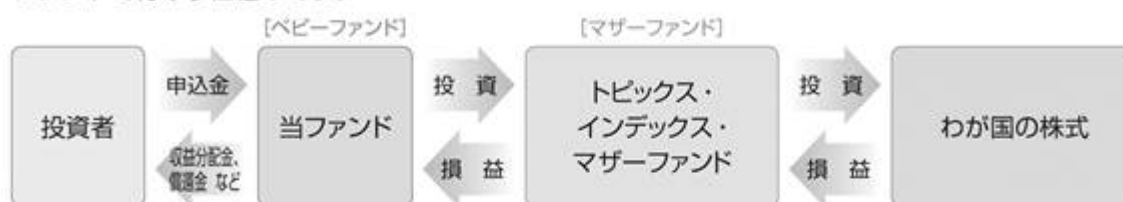
$$\text{修正後の基準時価総額} = \text{修正前日の基準時価総額} \times (\text{修正前日の時価総額} \pm \text{修正額}) \div \text{修正前日の時価総額}$$

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

(2) 【ファンドの沿革】

2006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（2018年6月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	設立登記
1960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
1960年 4月 1日	営業開始
1985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。
1995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。
1995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。
2007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せん。)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6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ．為替手形

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。

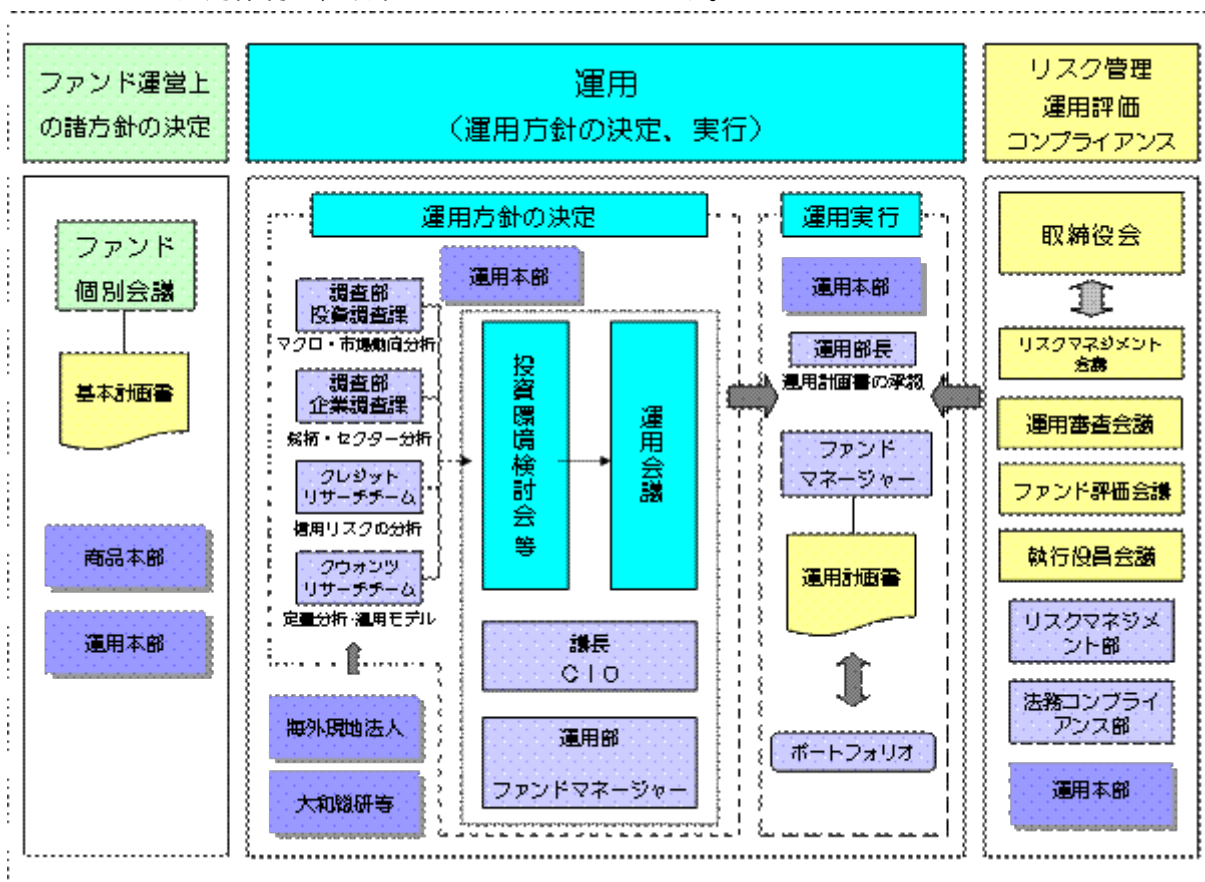
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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。

二．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（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

二．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2018年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等（信託約款）

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

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。先物を買建てている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します（売建てている場合は逆の結果となります。）。ファンドで行なっている株価指数先物取引について損失が発生した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

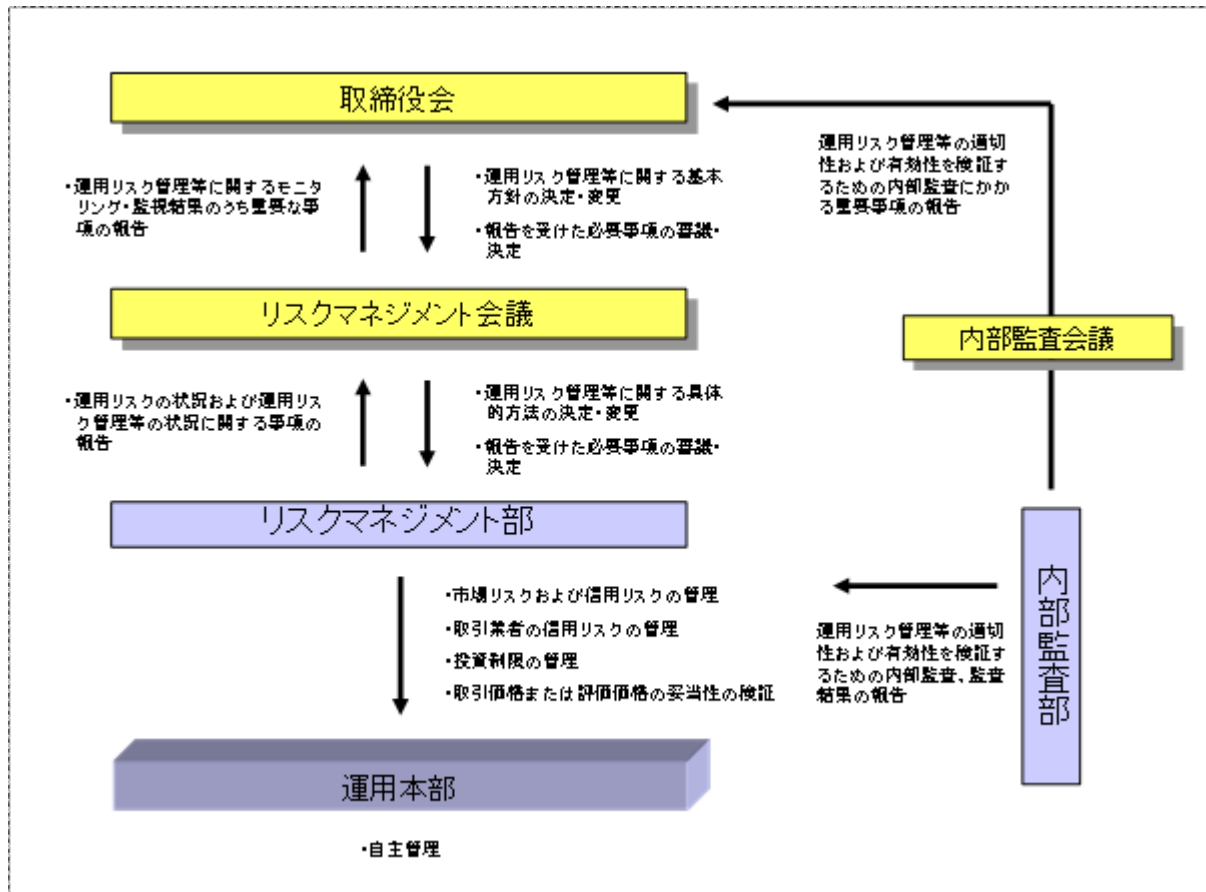
(3) その他の留意点

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

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。

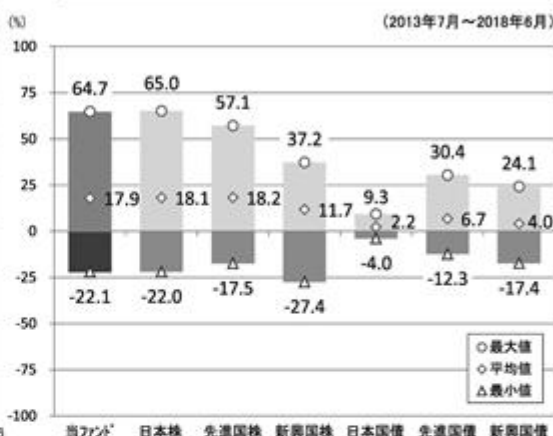
参 考 情 報

- 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年間における年間騰落率（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年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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、毎日計上され、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、2037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、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した

上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

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

<注1> 個別元本について

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、2018年6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30年6月29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	4,830,119,714	99.99
内 日本	4,830,119,714	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	312,510	0.01
純資産総額	4,830,432,224	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30年6月29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	4,436,593,841	1.1127 4,936,810,967	1.0887 4,830,119,714	99.99

(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	99.99%
合計	99.99%

(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
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
第9計算期間末 (平成27年11月30日)	3,284,114,505	3,284,114,505	1.1167	1.1167
第10計算期間末 (平成28年11月30日)	3,429,044,358	3,429,044,358	1.0586	1.0586
平成29年6月末日	3,899,286,243	-	1.1745	-
7月末日	3,944,469,743	-	1.1796	-
8月末日	3,954,257,608	-	1.1791	-
9月末日	4,154,295,435	-	1.2301	-
10月末日	4,387,532,082	-	1.2966	-
第11計算期間末 (平成29年11月30日)	4,489,487,993	4,489,487,993	1.3159	1.3159
12月末日	4,586,995,538	-	1.3358	-
平成30年1月末日	4,671,449,994	-	1.3497	-
2月末日	4,539,909,780	-	1.2998	-
3月末日	4,494,988,401	-	1.2732	-
4月末日	4,649,261,829	-	1.3185	-
5月末日	4,843,043,249	-	1.2968	-
6月末日	4,830,432,224	-	1.2858	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
平成29年12月1日～ 平成30年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第9計算期間	13.1
第10計算期間	5.2
第11計算期間	24.3
平成29年12月1日～ 平成30年5月31日	1.5

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第9計算期間	1,113,060,946	686,945,413
第10計算期間	592,567,249	294,482,357
第11計算期間	555,224,223	382,658,267
平成29年12月1日～ 平成30年5月31日	515,839,606	193,041,777

(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30年6月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	142,485,399,480	99.37
内 日本	142,485,399,480	99.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	897,453,694	0.63
純資産総額	143,382,853,174	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)	899,860,000	0.63
内 日本	899,860,000	0.63

(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30年6月29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	701,000	6,749.39 4,731,326,104	7,170.00 5,026,170,000	3.51
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	3,980,000	707.63 2,816,377,440	631.10 2,511,778,000	1.75
3	ソニー	日本	株式	電気機 器	386,300	4,349.05 1,680,039,769	5,664.00 2,188,003,200	1.53
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	256,500	8,882.16 2,278,274,673	7,973.00 2,045,074,500	1.43
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	405,800	5,131.25 2,082,261,731	5,036.00 2,043,608,800	1.43
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	430,100	4,296.06 1,847,736,002	4,306.00 1,852,010,600	1.29
7	キーエンス	日本	株式	電気機 器	28,300	60,368.12 1,708,417,813	62,560.00 1,770,448,000	1.23
8	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	518,200	3,306.71 1,713,540,615	3,253.00 1,685,704,600	1.18
9	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	498,300	2,977.01 1,483,444,654	3,031.00 1,510,347,300	1.05
10	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,720,700	195.67 1,510,785,424	186.50 1,439,910,550	1.00
11	リクルートホールディング ス	日本	株式	サービ ス業	426,100	2,495.55 1,063,356,267	3,066.00 1,306,422,600	0.91
12	任天堂	日本	株式	その他製 品	35,500	41,008.87 1,455,815,207	36,200.00 1,285,100,000	0.90
13	三菱商事	日本	株式	卸売業	398,500	2,638.97 1,051,633,166	3,078.00 1,226,583,000	0.86
14	ファナック	日本	株式	電気機 器	54,800	22,828.20 1,250,985,528	22,005.00 1,205,874,000	0.84
15	花王	日本	株式	化学	141,900	6,911.40 980,728,775	8,450.00 1,199,055,000	0.84
16	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	51,900	19,651.65 1,019,921,044	22,960.00 1,191,624,000	0.83
17	日本電産	日本	株式	電気機 器	69,500	13,866.03 963,689,662	16,625.00 1,155,437,500	0.81
18	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	237,900	4,421.55 1,051,887,601	4,831.00 1,149,294,900	0.80
19	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	405,500	2,593.72 1,051,755,529	2,822.50 1,144,523,750	0.80
20	村田製作所	日本	株式	電気機 器	60,500	17,172.06 1,038,909,976	18,620.00 1,126,510,000	0.79

21	キャノン	日本	株式	電気機器	309,200	3,837.96 1,186,699,826	3,631.00 1,122,705,200	0.78
22	東京海上HD	日本	株式	保険業	214,000	4,552.94 974,330,046	5,193.00 1,111,302,000	0.78
23	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	358,200	3,690.16 1,321,816,254	3,095.00 1,108,629,000	0.77
24	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	103,900	10,206.95 1,060,502,539	10,615.00 1,102,898,500	0.77
25	日立	日本	株式	電気機器	1,385,000	793.61 1,099,160,776	781.60 1,082,516,000	0.75
26	ダイキン工業	日本	株式	機械	78,800	11,396.10 898,013,426	13,270.00 1,045,676,000	0.73
27	武田薬品	日本	株式	医薬品	212,700	6,146.14 1,307,286,042	4,678.00 995,010,600	0.69
28	パナソニック	日本	株式	電気機器	658,400	1,647.12 1,084,470,328	1,493.50 983,320,400	0.69
29	信越化学	日本	株式	化学	99,500	10,178.31 1,012,742,556	9,873.00 982,363,500	0.69
30	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	567,300	1,471.65 834,868,755	1,689.00 958,169,700	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	99.37%
合計	99.37%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.12%
鉱業	0.29%
建設業	3.16%
食料品	4.47%
繊維製品	0.66%
パルプ・紙	0.26%
化学	7.38%
医薬品	4.72%
石油・石炭製品	0.77%

ゴム製品	0.81%
ガラス・土石製品	0.99%
鉄鋼	1.02%
非鉄金属	0.84%
金属製品	0.62%
機械	5.12%
電気機器	13.58%
輸送用機器	8.55%
精密機器	1.71%
その他製品	2.07%
電気・ガス業	1.75%
陸運業	4.34%
海運業	0.18%
空運業	0.57%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	7.44%
卸売業	4.72%
小売業	5.00%
銀行業	6.62%
証券、商品先物取引業	0.92%
保険業	2.25%
その他金融業	1.21%
不動産業	2.43%
サービス業	4.61%
合計	99.37%

(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 2018年9月	買建	52	929,268,080	899,860,000	0.63%

(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

●年金ダイワ日本株式インデックス

2018年6月29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	12,858円
純資産総額	48億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	-0.8%
3か月間	1.0%
6か月間	-3.7%
1年間	9.5%
3年間	12.4%
5年間	67.3%
設定来	28.6%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円											設定来分配金合計額: 0円
	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11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	15年11月	16年11月	17年11月	
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	

※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。

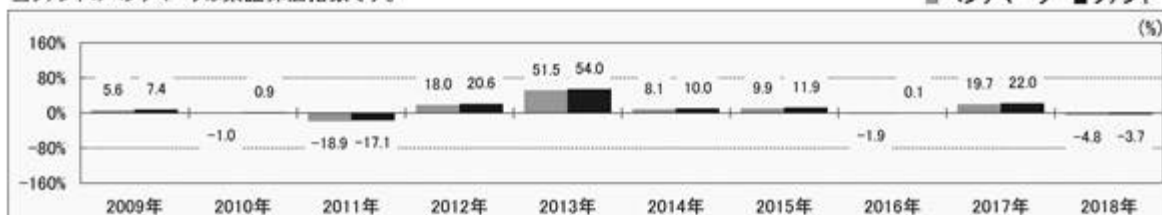
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,498	99.4%	電気機器	13.6%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.5%
国内株式先物	1	0.6%	輸送用機器	8.6%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.8%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	7.4%	ソニー	電気機器	1.5%
コール・ローン、その他	-	0.6%	化学	7.4%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.4%
合計	1,499	-	銀行業	6.6%	日本電信電話	情報・通信業	1.4%
株式市場・上場別構成			機械	5.1%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.3%
一部(東証・名証)		99.4%	小売業	5.0%	キーエンス	電気機器	1.2%
二部(東証・名証)		-	医薬品	4.7%	本田技研	輸送用機器	1.2%
新興市場他		-	卸売業	4.7%	KDDI	情報・通信業	1.1%
その他		-	その他	36.2%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.0%
合計		99.4%	合計	99.4%	合計		15.4%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■ベンチマーク ■ファンド



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。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。

※2018年は6月29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2006年10月27日から2007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11期計算期間(平成28年12月1日から平成29年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【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10期 平成28年11月30日現在	第11期 平成29年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,463,106	5,611,767
親投資信託受益証券	3,429,010,245	4,489,197,539
未収入金	4,628,000	782,000
流動資産合計	3,444,101,351	4,495,591,306
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,195,479	2,256,129
未払受託者報酬	490,520	659,497
未払委託者報酬	2,289,313	3,077,853
その他未払費用	81,681	109,834
流動負債合計	15,056,993	6,103,313
負債合計		
	15,056,993	6,103,313
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,239,105,529	1 3,411,671,485
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	189,938,829	1,077,816,508
（分配準備積立金）	757,184,416	1,396,061,537
元本等合計	3,429,044,358	4,489,487,993
純資産合計		
	3,429,044,358	4,489,487,993
負債純資産合計		
	3,444,101,351	4,495,591,306

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期		第11期	
	自	平成27年12月1日 至 平成28年11月30日	自	平成28年12月1日 至 平成29年11月30日
営業収益				
受取利息		256		-
有価証券売買等損益		138,326,197		862,865,294
営業収益合計		138,325,941		862,865,294
営業費用				
支払利息		675		1,741
受託者報酬		972,154		1,243,444
委託者報酬		4,537,080		5,803,057
その他費用		161,874		207,090
営業費用合計		5,671,783		7,255,332
営業利益又は営業損失（ ）		143,997,724		855,609,962
経常利益又は経常損失（ ）		143,997,724		855,609,962
当期純利益又は当期純損失（ ）		143,997,724		855,609,962
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（ ）		37,714,884		39,083,427
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		343,093,868		189,938,829
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		95,807,191
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		95,807,191
剰余金減少額又は欠損金増加額		46,872,199		24,456,047
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		30,479,911		24,456,047
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		16,392,288		-
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		189,938,829		1,077,816,508

(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11期	
	自 平成28年12月1日	至 平成29年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第10期	第11期
	平成28年11月30日現在	平成29年11月30日現在
1. 1 期首元本額	2,941,020,637円	3,239,105,529円
期中追加設定元本額	592,567,249円	555,224,223円
期中一部解約元本額	294,482,357円	382,658,267円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,239,105,529口	3,411,671,485口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第10期	第11期
	自 平成27年12月1日 至 平成28年11月30日	自 平成28年12月1日 至 平成29年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(768,912,391円)及び分配準備積立金(757,184,416円)より分配可能額は1,526,096,807円(1万口当たり4,711.48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(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(721,898,773円)、投資信託約款に規定される収益調整金(933,238,306円)及び分配準備積立金(674,162,764円)より分配可能額は2,329,299,843円(1万口当たり6,827.44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11期 自 平成28年12月1日 至 平成29年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<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等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</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	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第11期 平成29年11月30日現在
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第10期 平成28年11月30日現在	第11期 平成29年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	117,169,330	840,696,791
合計	117,169,330	840,696,791

（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10期 平成28年11月30日現在	第11期 平成29年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第11期 自 平成28年12月1日 至 平成29年11月30日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第10期 平成28年11月30日現在	第11期 平成29年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0586円 (10,586円)	1.3159円 (13,159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	4,033,420,970	4,489,197,539	
親投資信託受益証券 合計			4,489,197,539	
合計			4,489,197,539	

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28年11月30日現在		平成29年11月30日現在	
	金額（円）		金額（円）	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		3,916,751,366		5,276,595,266
株式	3 4	124,953,943,460		141,293,259,400
派生商品評価勘定		97,126,795		81,277,080
未収入金		167,906,640		-
未収配当金		712,518,080		779,613,672
未収利息		331,370		327,444
その他未収収益	5	14,507,257		9,771,083
流動資産合計		129,863,084,968		147,440,843,945
資産合計		129,863,084,968		147,440,843,945
負債の部				
流動負債				
派生商品評価勘定		-		1,080
前受金		90,505,000		69,750,000
未払金		129,912,360		452,160
未払解約金		254,683,100		254,453,100
受入担保金		3,158,133,625		3,958,464,457
流動負債合計		3,633,234,085		4,283,120,797
負債合計		3,633,234,085		4,283,120,797
純資産の部				
元本等				
元本	1	141,237,185,956		128,627,233,302
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	15,007,335,073		14,530,489,846
元本等合計		126,229,850,883		143,157,723,148
純資産合計		126,229,850,883		143,157,723,148
負債純資産合計		129,863,084,968		147,440,843,945

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28年12月1日 至 平成29年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年11月30日現在	平成29年11月30日現在
1. 1 期首	平成27年12月1日	平成28年12月1日
期首元本額	140,709,507,157円	141,237,185,956円
期中追加設定元本額	15,352,397,205円	15,344,235,430円
期中一部解約元本額	14,824,718,406円	27,954,188,084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	1,610,341,359円	- 円
トピックス・インデックス ファンド	5,648,730,568円	4,364,412,056円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	13,687,983,821円	11,109,078,226円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドVA2	126,646,485円	63,469,755円

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	141,686,038円	80,019,243円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	2,353,118,777円	1,411,218,462円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	109,845,953円	70,073,352円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	3,368,030,339円	1,949,560,771円
D-I's TOPIXイン デックス	33,491,212円	28,367,467円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	27,594,657円	25,160,362円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	593,766円	571,628円
iFree TOPIXイン デックス	111,764,976円	294,793,376円
iFree 8資産バランス DCダイワ日本株式インデッ クス	68,977,995円 63,783,051,530円	624,779,967円 60,695,276,446円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,368,199,277円	2,195,311,787円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,389,384,337円	2,320,693,161円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,140,568,498円	2,181,670,247円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	3,836,869,470円	4,033,420,970円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	23,808,674円	17,249,227円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	61,017,840円	51,964,735円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	12,636,946円	13,124,314円
ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	448,097円	364,602円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	440,730円	362,318円

ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	941,908円	690,983円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	63,672,333円	6,930,943円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	353,729,673円	19,322,872円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA(国内株式型)	196,965,786円	15,921,448円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,442,476,447円	359,581,980円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	229,813,057円	168,953,117円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	14,465,411,230円	11,001,597,589円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	384,828,380円	227,225,197円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	659,950,624円	239,347,643円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,178,011,578円	895,003,489円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	182,365,011円	144,200,065円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	313,206,367円	242,040,229円
ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	45,419,513円	70,307,122円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	1,350,529,038円	5,865,224,891円
ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	-円	4,249,531円
ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス	-円	1,175,567,763円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,024,916,082円	1,188,177,701円
ダイワライフスタイル25	206,988,834円	176,027,159円
ダイワライフスタイル50	678,795,303円	628,315,358円
ダイワライフスタイル75	513,159,508円	505,576,948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）	16,040,773,939円	14,162,028,802円
計		141,237,185,956円	128,627,233,302円
2.	期末日における受益権の総数	141,237,185,956口	128,627,233,302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15,007,335,073円であります。	
4.	3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 3,009,650,890円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 3,819,839,950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 664,900,000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 704,400,000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13,416,400円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分8,686,485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28年12月1日 至 平成29年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</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> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</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	<p>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。</p> <p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>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。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成28年11月30日現在	平成29年11月30日現在
--	---------------	---------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	12,782,821,308	9,624,573,051
合計	12,782,821,308	9,624,573,051

(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28年9月21日から平成28年11月30日まで、及び平成29年9月20日から平成29年11月30日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成28年11月30日 現在				平成29年11月30日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株値指数								
先物取引								
買 建	1,082,030,000	-	1,179,200,000	97,170,000	1,715,670,000	-	1,797,000,000	81,330,000
合計	1,082,030,000	-	1,179,200,000	97,170,000	1,715,670,000	-	1,797,000,000	81,330,000

(注) 1. 時価の算定方法

株値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. 株値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28年11月30日現在	平成29年11月30日現在
1口当たり純資産額	0.8937円	1.1130円
(1万口当たり純資産額)	(8,937円)	(11,130円)

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,800	3,850.00	14,630,000	貸付株式数 1,000株
日本水産	70,100	614.00	43,041,400	
マルハニチロ	11,700	3,230.00	37,791,000	
カネコ種苗	5,400	1,683.00	9,088,200	
サカタのタネ	9,300	3,715.00	34,549,500	
ホクト	6,500	2,018.00	13,117,000	貸付株式数 1,800株
ショーボンドHD	5,800	7,120.00	41,296,000	
ミライト・ホールディングス	18,900	1,503.00	28,406,700	
タマホーム	10,300	710.00	7,313,000	貸付株式数 2,900株
インベスターズクラウド	1,200	6,660.00	7,992,000	貸付株式数 300株
日鉄鉱業	1,800	7,670.00	13,806,000	
三井松島	5,000	1,393.00	6,965,000	
国際石油開発帝石	297,900	1,265.00	376,843,500	
日本海洋掘削	3,500	2,351.00	8,228,500	貸付株式数 900株 (700株)
石油資源開発	8,600	2,573.00	22,127,800	貸付株式数 2,400株
K&Oエナジーグループ	4,000	1,948.00	7,792,000	
安藤・間	47,900	887.00	42,487,300	貸付株式数 13,200株
東急建設	24,300	1,085.00	26,365,500	
コムシスホールディングス	21,300	3,135.00	66,775,500	
ミサワホーム	7,500	994.00	7,455,000	
高松コンストラクションGP	4,000	2,896.00	11,584,000	
東建コーポレーション	2,400	14,090.00	33,816,000	
ヤマウラ	8,300	877.00	7,279,100	
大成建設	63,100	5,900.00	372,290,000	
大林組	185,700	1,452.00	269,636,400	
清水建設	190,100	1,247.00	237,054,700	
飛鳥建設	74,800	162.00	12,117,600	
長谷工コーポレーション	72,000	1,743.00	125,496,000	
松井建設	8,700	952.00	8,282,400	貸付株式数 100株
鹿島建設	272,000	1,179.00	320,688,000	
不動産テトラ	55,000	184.00	10,120,000	
鉄建建設	3,900	3,360.00	13,104,000	

西松建設	14,000	3,255.00	45,570,000	
三井住友建設	45,200	640.00	28,928,000	
大豊建設	24,000	580.00	13,920,000	
前田建設	44,000	1,651.00	72,644,000	
奥村組	9,600	4,565.00	43,824,000	
東鉄工業	7,300	3,675.00	26,827,500	
浅沼組	26,000	397.00	10,322,000	
戸田建設	72,000	896.00	64,512,000	
熊谷組	9,700	3,125.00	30,312,500	
北野建設	19,000	411.00	7,809,000	
三井ホーム	11,000	683.00	7,513,000	
矢作建設	10,200	992.00	10,118,400	
ピーエス三菱	10,900	884.00	9,635,600	
日本ハウスHLDGS	15,100	623.00	9,407,300	貸付株式数 3,100株
大東建託	22,400	20,545.00	460,208,000	貸付株式数 6,200株
新日本建設	8,500	938.00	7,973,000	
NIPPO	13,000	2,657.00	34,541,000	
東亜道路	1,700	4,605.00	7,828,500	
前田道路	18,000	2,533.00	45,594,000	
日本道路	1,700	6,750.00	11,475,000	
東亜建設	5,400	3,060.00	16,524,000	
若築建設	4,700	1,752.00	8,234,400	
東洋建設	19,900	626.00	12,457,400	
五洋建設	72,600	837.00	60,766,200	
世紀東急	12,600	604.00	7,610,400	
福田組	2,300	6,870.00	15,801,000	
住友林業	39,100	1,930.00	75,463,000	
日本基礎技術	19,000	421.00	7,999,000	
日成ビルド工業	10,000	1,371.00	13,710,000	
巴コーポレーション	21,900	608.00	13,315,200	
大和ハウス	183,000	4,114.00	752,862,000	
ライト工業	11,800	1,248.00	14,726,400	
積水ハウス	200,500	2,094.50	419,947,250	
日特建設	10,300	673.00	6,931,900	
ユアテック	9,900	979.00	9,692,100	
中電工	7,700	3,225.00	24,832,500	
関電工	23,900	1,105.00	26,409,500	
きんでん	41,100	1,913.00	78,624,300	
東京エネシス	7,600	1,305.00	9,918,000	
トーエネック	1,900	3,250.00	6,175,000	

住友電設	5,000	2,432.00	12,160,000	
日本電設工業	9,400	2,342.00	22,014,800	
協和エクシオ	21,900	2,698.00	59,086,200	
日本工営	3,800	3,745.00	14,231,000	
九電工	12,200	5,320.00	64,904,000	
三機工業	13,100	1,386.00	18,156,600	
日 揮	52,800	1,951.00	103,012,800	貸付株式数 14,700株
中外炉工業	3,700	2,182.00	8,073,400	
太平電業	4,200	2,649.00	11,125,800	
高砂熱学	17,000	2,092.00	35,564,000	
N E C ネットズエスアイ	5,700	2,928.00	16,689,600	
明星工業	12,600	806.00	10,155,600	
大 気 社	7,900	3,770.00	29,783,000	
ダイダン	4,500	3,075.00	13,837,500	
日比谷総合設備	7,100	2,469.00	17,529,900	
東芝プラントシステム	13,300	2,127.00	28,289,100	
日本製粉	17,800	1,657.00	29,494,600	
日清製粉G本社	67,300	2,196.00	147,790,800	
昭和産業	5,100	2,879.00	14,682,900	
中部飼料	7,200	2,265.00	16,308,000	
フィード・ワン	42,900	286.00	12,269,400	
東洋精糖	8,600	1,206.00	10,371,600	
三井製糖	4,500	4,600.00	20,700,000	
塩水港精糖	32,100	266.00	8,538,600	
日新製糖	3,400	2,132.00	7,248,800	
L i f u l l	19,200	919.00	17,644,800	
ジェイエイシーリクルート メント	4,800	2,269.00	10,891,200	貸付株式数 1,300株
日本M & Aセンター	18,500	5,610.00	103,785,000	
タケエイ	7,000	1,307.00	9,149,000	貸付株式数 1,900株
トラスト・テック	2,800	3,870.00	10,836,000	
コシダカホールディングス	3,000	4,925.00	14,775,000	
パソナグループ	5,100	1,728.00	8,812,800	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
C D S	6,300	1,334.00	8,404,200	
リンクアンドモチベーショ ン	11,100	888.00	9,856,800	貸付株式数 2,900株 (2,800株)
G C A	7,200	1,118.00	8,049,600	貸付株式数 2,100株
エス・エム・エス	10,600	3,590.00	38,054,000	貸付株式数 2,900株
パーソルホールディングス	48,900	2,628.00	128,509,200	貸付株式数 13,600株

リニカル	4,200	1,545.00	6,489,000	貸付株式数	1,100株
クックパッド	17,400	670.00	11,658,000	貸付株式数	5,000株
森永製菓	13,100	5,630.00	73,753,000		
江崎グリコ	15,500	5,550.00	86,025,000		
不二家	4,300	2,587.00	11,124,100		
山崎製パン	45,100	2,166.00	97,686,600	貸付株式数	12,400株
モロゾフ	1,500	7,470.00	11,205,000		
亀田製菓	3,600	5,350.00	19,260,000	貸付株式数	1,000株
寿スピリッツ	5,600	5,420.00	30,352,000	貸付株式数	1,500株
カルビー	25,300	3,925.00	99,302,500	貸付株式数	7,200株 (600株)
森永乳業	11,200	4,590.00	51,408,000		
六甲バター	3,400	2,720.00	9,248,000		
ヤクルト	33,300	8,760.00	291,708,000	貸付株式数	9,300株 (9,300株)
明治ホールディングス	36,700	9,780.00	358,926,000		
雪印メグミルク	13,500	3,120.00	42,120,000		
プリマハム	39,000	781.00	30,459,000		
日本ハム	48,000	2,757.00	132,336,000		
丸大食品	32,000	496.00	15,872,000	貸付株式数	2,000株
S Foods	3,900	4,830.00	18,837,000	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
伊藤ハム米久HLDGS	35,800	1,016.00	36,372,800		
スタジオアリス	3,200	2,622.00	8,390,400		
シミックホールディングス	4,800	1,690.00	8,112,000		
システナ	4,700	3,995.00	18,776,500	貸付株式数	1,300株
デジタルアーツ	2,900	4,865.00	14,108,500	貸付株式数	500株
新日鉄住金SOL	8,600	2,902.00	24,957,200		
総合警備保障	21,100	6,230.00	131,453,000		
キューブシステム	8,100	803.00	6,504,300		
いちご	77,900	416.00	32,406,400	貸付株式数	21,700株
日本駐車場開発	75,500	165.00	12,457,500		
コア	3,200	1,620.00	5,184,000		
カカコム	41,300	1,774.00	73,266,200	貸付株式数	11,400株
ディップ	7,800	2,916.00	22,744,800		
オプトホールディング	5,800	1,323.00	7,673,400	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ツクイ	14,300	919.00	13,141,700	貸付株式数	3,900株
エムスリー	55,900	3,690.00	206,271,000		
アウトソーシング	16,100	1,972.00	31,749,200	貸付株式数	4,400株

ウェルネット	5,700	1,210.00	6,897,000	貸付株式数	1,600株
ワールドホールディングス	2,000	2,904.00	5,808,000	貸付株式数	500株
ディー・エヌ・エー	28,700	2,545.00	73,041,500		
博報堂D Y H L D G S	73,400	1,509.00	110,760,600		
ぐるなび	8,800	1,368.00	12,038,400	貸付株式数	2,400株
ファンコミュニケーションズ	15,100	973.00	14,692,300	貸付株式数	1,200株
W D Bホールディングス	3,000	3,175.00	9,525,000		
ティア	10,300	988.00	10,176,400		
バリューコマース	7,600	770.00	5,852,000		
インフォマート	28,200	682.00	19,232,400	貸付株式数	7,900株
サッポロホールディングス	20,500	3,515.00	72,057,500		
アサヒグループホールディングン	116,700	5,707.00	666,006,900		
麒麟HD	266,700	2,629.50	701,287,650		
宝ホールディングス	45,500	1,257.00	57,193,500		
オエノンホールディングス	31,100	355.00	11,040,500		
コカ・コーラボトラーズJ	39,200	4,265.00	167,188,000		
サントリー食品インター	42,600	4,860.00	207,036,000		
ダイドーグループHD	2,900	5,790.00	16,791,000		
伊藤園	18,400	4,180.00	76,912,000	貸付株式数	5,200株
キーコーヒー	6,800	2,147.00	14,599,600		
日清オイリオグループ	6,600	3,455.00	22,803,000		
不二製油グループ	15,100	3,265.00	49,301,500		
J - オイルミルズ	3,200	4,030.00	12,896,000		
ローソン	13,700	7,740.00	106,038,000	貸付株式数	4,800株
サンエー	4,200	5,190.00	21,798,000		
カワチ薬品	4,500	2,800.00	12,600,000		
エービーシー・マート	9,700	6,160.00	59,752,000	貸付株式数	2,700株
ハードオフコーポレーション	6,500	1,269.00	8,248,500		
アスクル	5,800	3,130.00	18,154,000	貸付株式数	1,600株
ゲオホールディングス	10,400	2,277.00	23,680,800	貸付株式数	2,800株
アダストリア	8,400	2,485.00	20,874,000		
くらコーポレーション	3,300	5,240.00	17,292,000		
エレマテック	2,900	2,635.00	7,641,500		
バルグループH L D G S	3,000	3,465.00	10,395,000		
J A L U X	2,600	2,839.00	7,381,400		
エディオン	20,600	1,261.00	25,976,600	貸付株式数	8,800株
あらた	2,800	5,900.00	16,520,000		

サーラコーポレーション	10,800	691.00	7,462,800	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
ワッツ	5,800	1,180.00	6,844,000	
ハローズ	2,500	2,598.00	6,495,000	
J Pホールディングス	19,700	352.00	6,934,400	貸付株式数 6,100株 (2,000株)
あみやき亭	2,200	5,060.00	11,132,000	
東京エレクトロンデバイス	4,100	2,053.00	8,417,300	
ひらまつ	14,800	560.00	8,288,000	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
フィールズ	5,500	1,269.00	6,979,500	貸付株式数 1,500株
双日	315,000	324.00	102,060,000	
ゲンキー	2,500	4,185.00	10,462,500	貸付株式数 600株 (200株)
アルフレッサホールディングス	59,800	2,412.00	144,237,600	
大黒天物産	1,600	5,260.00	8,416,000	
ハニーズホールディングス	6,800	1,150.00	7,820,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
キッコーマン	43,600	4,400.00	191,840,000	
味の素	127,600	2,064.00	263,366,400	
キューピー	31,500	2,885.00	90,877,500	
ハウス食品G本社	21,400	3,660.00	78,324,000	
カゴメ	22,400	4,165.00	93,296,000	
アリアケジャパン	5,100	10,180.00	51,918,000	
ニチレイ	26,500	3,260.00	86,390,000	
横浜冷凍	13,800	1,119.00	15,442,200	貸付株式数 4,000株 (3,900株)
東洋水産	30,200	4,780.00	144,356,000	
日清食品HD	24,100	8,110.00	195,451,000	
永谷園ホールディングス	8,000	1,389.00	11,112,000	
フジッコ	6,200	2,539.00	15,741,800	
ロックフィールド	6,800	2,073.00	14,096,400	
日本たばこ産業	343,000	3,720.00	1,275,960,000	
ケンコーマヨネーズ	4,200	3,425.00	14,385,000	貸付株式数 100株
わらべや日洋HD	3,900	2,995.00	11,680,500	貸付株式数 1,100株
ユーグレナ	22,000	1,112.00	24,464,000	貸付株式数 6,200株 (6,100株)
片倉工業	7,900	1,305.00	10,309,500	
ゲンゼ	4,400	5,880.00	25,872,000	

ヒューリック	114,200	1,231.00	140,580,200	
山下医科器械	5,600	1,735.00	9,716,000	
アルペン	4,500	2,297.00	10,336,500	
クオール	5,900	2,149.00	12,679,100	
アルコニックス	6,500	2,150.00	13,975,000	貸付株式数 1,900株
神戸物産	3,600	5,100.00	18,360,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
ジンス	3,700	5,760.00	21,312,000	貸付株式数 1,000株
ビックカメラ	31,600	1,432.00	45,251,200	貸付株式数 8,900株 (8,900株)
D C Mホールディングス	27,900	1,085.00	30,271,500	貸付株式数 9,100株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	3,000	7,040.00	21,120,000	貸付株式数 800株 (800株)
MonotaRO	19,600	3,190.00	62,524,000	貸付株式数 5,600株
あいホールディングス	7,900	2,673.00	21,116,700	貸付株式数 2,200株
ディーブイエックス	4,700	1,376.00	6,467,200	
アークランドサービスHD	5,000	2,767.00	13,835,000	貸付株式数 1,200株
J. フロントリテイリング	65,100	1,895.00	123,364,500	
ドトール・日レスHD	9,900	2,684.00	26,571,600	
マツモトキヨシHLDS	11,400	9,280.00	105,792,000	
ブロンコビリー	3,500	3,175.00	11,112,500	貸付株式数 900株 (900株)
スタートトゥデイ	53,600	3,425.00	183,580,000	
物語コーポレーション	1,700	9,790.00	16,643,000	貸付株式数 500株
ココカラファイン	5,700	7,000.00	39,900,000	
三越伊勢丹HD	102,200	1,299.00	132,757,800	
東洋紡	21,200	2,047.00	43,396,400	
ユニチカ	17,800	836.00	14,880,800	
富士紡ホールディングス	3,500	3,485.00	12,197,500	
日清紡ホールディングス	33,700	1,572.00	52,976,400	
倉敷紡績	59,000	343.00	20,237,000	
ダイワボウHD	4,700	4,390.00	20,633,000	
シキボウ	5,500	1,412.00	7,766,000	
日東紡績	8,300	3,370.00	27,971,000	
トヨタ紡織	15,900	2,326.00	36,983,400	
マクニカ・富士エレHLDS	10,300	2,406.00	24,781,800	
ウエルシアHD	14,600	4,810.00	70,226,000	

クリエイトSDH	8,000	2,928.00	23,424,000	
バイタルKSKHD	10,300	944.00	9,723,200	
UKCホールディングス	4,400	1,930.00	8,492,000	貸付株式数 900株
TOKAIホールディングス	29,200	873.00	25,491,600	
三洋貿易	3,800	2,468.00	9,378,400	
ウイン・パートナーズ	5,200	1,261.00	6,557,200	
ジョイフル本田	8,900	3,205.00	28,524,500	貸付株式数 2,500株 (2,200株)
鳥貴族	2,400	3,135.00	7,524,000	貸付株式数 700株
ホットランド	4,400	1,491.00	6,560,400	貸付株式数 1,200株
すかいらーく	33,100	1,643.00	54,383,300	貸付株式数 9,400株 (2,800株)
綿半ホールディングス	3,200	2,590.00	8,288,000	
日本毛織	15,900	992.00	15,772,800	
ユナイテッド・スーパー マーケ	18,100	1,149.00	20,796,900	
三栄建築設計	2,700	2,406.00	6,496,200	
野村不動産HLDGS	36,300	2,588.00	93,944,400	
三重交通グループHD	14,600	476.00	6,949,600	
サムティ	5,200	1,658.00	8,621,600	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本商業開発	4,300	1,657.00	7,125,100	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
プレサンスコーポレーショ ン	7,400	1,394.00	10,315,600	
ユニゾホールディングス	6,400	3,015.00	19,296,000	
日本管理センター	4,800	1,519.00	7,291,200	貸付株式数 1,300株 (700株)
フージャースHD	8,100	1,178.00	9,541,800	
オープンハウス	8,900	5,540.00	49,306,000	
東急不動産HD	129,800	810.00	105,138,000	
飯田GHD	45,000	2,070.00	93,150,000	
帝国繊維	6,600	2,218.00	14,638,800	貸付株式数 1,600株
日本コークス工業	60,600	123.00	7,453,800	
あさひ	5,200	1,378.00	7,165,600	貸付株式数 1,300株
日本調剤	2,000	3,665.00	7,330,000	貸付株式数 500株 (100株)
コスモス薬品	2,700	25,270.00	68,229,000	貸付株式数 700株
シップヘルスケアHD	11,000	3,595.00	39,545,000	
ソフトクリエイトHD	5,400	1,571.00	8,483,400	

セブン&アイ・HLDGS	228,400	4,605.00	1,051,782,000	
薬王堂	2,700	3,420.00	9,234,000	貸付株式数 800株
クリエイト・レストランツ・ホール	15,500	1,228.00	19,034,000	貸付株式数 1,300株
ツルハホールディングス	11,000	15,520.00	170,720,000	
サンマルクホールディングス	4,100	3,085.00	12,648,500	
トリドールホールディングス	6,800	3,620.00	24,616,000	
帝人	46,500	2,420.00	112,530,000	
東レ	419,600	1,057.00	443,517,200	
クラレ	96,600	2,161.00	208,752,600	
旭化成	360,500	1,405.00	506,502,500	
サカイオーベックス	3,100	2,610.00	8,091,000	
TOKYO BASE	1,100	4,600.00	5,060,000	
宮地エンジニアリングG	2,200	2,622.00	5,768,400	
トーカロ	3,900	4,755.00	18,544,500	
アルファCO	2,600	2,299.00	5,977,400	
SUMCO	50,600	2,823.00	142,843,800	貸付株式数 14,000株
川田テクノロジーズ	1,200	6,240.00	7,488,000	貸付株式数 300株 (300株)
住江織物	2,100	3,075.00	6,457,500	
アツギ	8,300	1,286.00	10,673,800	
コメダホールディングス	10,400	1,945.00	20,228,000	貸付株式数 100株
ダイユー・リックHLDGS	9,100	1,081.00	9,837,100	
クスリのアオキHLDGS	4,300	6,840.00	29,412,000	貸付株式数 1,200株
ダイニック	7,100	1,189.00	8,441,900	貸付株式数 1,900株
共和レザー	7,300	988.00	7,212,400	
スシローグローバルHLDGS	5,100	3,880.00	19,788,000	
LIXILビバ	5,300	1,780.00	9,434,000	
セーレン	13,300	2,103.00	27,969,900	
ソトー	9,600	1,126.00	10,809,600	
東海染工	5,500	1,428.00	7,854,000	
小松精練	11,300	901.00	10,181,300	
ワコールホールディングス	15,500	3,480.00	53,940,000	
ホギメディカル	3,600	8,090.00	29,124,000	
T S Iホールディングス	22,300	852.00	18,999,600	
T I S	18,100	3,820.00	69,142,000	

電算システム	4,400	2,103.00	9,253,200	
グリー	34,500	731.00	25,219,500	
コーエーテクモHD	9,200	2,307.00	21,224,400	
三菱総合研究所	2,900	3,760.00	10,904,000	
K L a b	10,800	1,898.00	20,498,400	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
ポールトゥウィン・ピット クル	5,000	1,829.00	9,145,000	貸付株式数 1,300株
ネクソン	60,900	3,220.00	196,098,000	
アイスタイル	13,600	880.00	11,968,000	貸付株式数 3,800株
エイチーム	4,100	2,847.00	11,672,700	貸付株式数 1,100株
テクノスジャパン	6,400	959.00	6,137,600	貸付株式数 1,700株
コロプラ	17,600	1,156.00	20,345,600	貸付株式数 5,000株 (4,500株)
ブロードリーフ	14,500	1,154.00	16,733,000	
ハーツユナイテッドグルー プ	3,800	1,847.00	7,018,600	
メディアドゥHLDGS	2,400	2,422.00	5,812,800	貸付株式数 600株
特種東海製紙	3,400	4,020.00	13,668,000	
ティーガイア	5,500	2,452.00	13,486,000	
豆蔵ホールディングス	6,500	1,251.00	8,131,500	
ガンホー・オンライン・エ ンター	147,900	286.00	42,299,400	貸付株式数 41,400株
GMOペイメントゲート ウェイ	4,000	8,260.00	33,040,000	貸付株式数 1,300株
インターネットイニシア ティブ	9,600	2,188.00	21,004,800	貸付株式数 2,600株
さくらインターネット	7,400	833.00	6,164,200	貸付株式数 2,000株
S R Aホールディングス	3,400	3,490.00	11,866,000	
システムインテグレータ	7,500	859.00	6,442,500	
朝日ネット	17,200	525.00	9,030,000	
コムチュア	4,100	2,499.00	10,245,900	貸付株式数 900株
王子ホールディングス	238,000	683.00	162,554,000	
日本製紙	24,400	2,154.00	52,557,600	貸付株式数 6,800株
三菱製紙	13,100	708.00	9,274,800	貸付株式数 3,100株
北越紀州製紙	31,300	630.00	19,719,000	
中越パルプ	3,400	2,077.00	7,061,800	
大王製紙	22,900	1,501.00	34,372,900	貸付株式数 6,700株 (6,500株)
g u m i	7,100	1,070.00	7,597,000	貸付株式数 1,900株

アカツキ	1,100	7,700.00	8,470,000	貸付株式数	300株
LINE	15,600	4,790.00	74,724,000	貸付株式数	4,300株
レンゴー	53,200	729.00	38,782,800		
トーモク	4,200	2,108.00	8,853,600		
ザ・パック	4,200	3,770.00	15,834,000		
AOI TYO HOLDINGS	6,000	1,291.00	7,746,000		
マクロミル	7,400	2,913.00	21,556,200	貸付株式数	2,000株
昭和電工	38,600	4,165.00	160,769,000		
住友化学	425,000	782.00	332,350,000		
住友精化	2,400	6,470.00	15,528,000		
日産化学	33,500	4,500.00	150,750,000		
ラサ工業	4,000	2,302.00	9,208,000	貸付株式数	1,100株
クレハ	4,700	7,400.00	34,780,000		
テイカ	4,900	2,939.00	14,401,100		
石原産業	10,600	2,046.00	21,687,600		
日本曹達	39,000	746.00	29,094,000		
東ソー	83,500	2,479.00	206,996,500		
トクヤマ	16,800	3,435.00	57,708,000		
セントラル硝子	11,400	2,495.00	28,443,000		
東亜合成	32,700	1,443.00	47,186,100		
大阪ソーダ	5,300	2,861.00	15,163,300	貸付株式数	1,400株
関東電化	14,000	1,275.00	17,850,000	貸付株式数	200株
デンカ	21,000	4,130.00	86,730,000		
イビデン	33,600	1,787.00	60,043,200	貸付株式数	10,800株
信越化学	96,400	11,765.00	1,134,146,000		
日本カ-バイド	2,900	2,071.00	6,005,900		
堺化学	3,900	2,532.00	9,874,800		
エア・ウォーター	46,700	2,408.00	112,453,600		
大陽日酸	44,200	1,541.00	68,112,200		
日本化学工業	3,400	2,534.00	8,615,600		
日本パ-カラijing	28,700	1,861.00	53,410,700		
高圧ガス	10,600	947.00	10,038,200		
四国化成	8,900	1,841.00	16,384,900		
戸田工業	1,500	4,230.00	6,345,000	貸付株式数	400株
ステラケミファ	3,000	3,730.00	11,190,000	貸付株式数	800株
保土谷化学	1,900	6,610.00	12,559,000	貸付株式数	500株
日本触媒	9,000	7,830.00	70,470,000		
大日精化	4,400	5,380.00	23,672,000		
カネカ	76,000	992.00	75,392,000		

協和発酵キリン	69,200	2,129.00	147,326,800	
三菱瓦斯化学	49,400	3,140.00	155,116,000	
三井化学	52,000	3,625.00	188,500,000	
J S R	57,500	2,151.00	123,682,500	
東京応化工業	10,000	4,705.00	47,050,000	
大阪有機化学	4,900	1,321.00	6,472,900	
三菱ケミカルH L D G S	387,300	1,216.00	470,956,800	
K H ネオケム	8,900	2,684.00	23,887,600	
ダイセル	76,900	1,331.00	102,353,900	
住友ベークライト	46,000	916.00	42,136,000	
積水化学	119,700	2,171.00	259,868,700	
日本ゼオン	48,500	1,553.00	75,320,500	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
アイカ工業	15,800	3,935.00	62,173,000	
宇部興産	28,800	3,255.00	93,744,000	
積水樹脂	9,000	2,307.00	20,763,000	
タキロンシーアイ	14,000	814.00	11,396,000	
旭有機材	5,600	1,839.00	10,298,400	
日立化成	28,100	2,953.00	82,979,300	
ニチバン	3,400	2,963.00	10,074,200	
リケンテクノス	14,300	630.00	9,009,000	
大倉工業	15,000	679.00	10,185,000	
積水化成品	8,000	1,417.00	11,336,000	
群栄化学	2,100	3,745.00	7,864,500	
ダイキョーニシカワ	11,600	1,881.00	21,819,600	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
竹本容器	3,500	2,143.00	7,500,500	
日本化薬	36,900	1,702.00	62,803,800	
カーリットホールディングス	15,200	1,100.00	16,720,000	貸付株式数 4,000株
E P S ホールディングス	8,400	2,415.00	20,286,000	
プレステージ・インター	12,200	1,412.00	17,226,400	貸付株式数 3,200株
アミューズ	3,900	3,145.00	12,265,500	貸付株式数 100株
野村総合研究所	36,500	5,080.00	185,420,000	
ドリームインキュベータ	2,600	2,438.00	6,338,800	貸付株式数 200株
クイック	4,200	1,801.00	7,564,200	
T A C	23,500	371.00	8,718,500	
ケネディクス	74,000	766.00	56,684,000	貸付株式数 2,600株
電通	64,300	5,080.00	326,644,000	貸付株式数 18,800株 (18,800株)

インテージホールディングス	7,500	1,391.00	10,432,500		
びあ	2,000	6,700.00	13,400,000	貸付株式数	500株
イオンファンタジー	1,900	4,890.00	9,291,000	貸付株式数	500株
ネクシィーズグループ	2,500	1,845.00	4,612,500		
日本精化	9,200	1,125.00	10,350,000		
扶桑化学工業	4,200	3,360.00	14,112,000	貸付株式数	1,200株
A D E K A	23,800	1,896.00	45,124,800		
日油	22,000	3,090.00	67,980,000		
ハリマ化成グループ	6,600	869.00	5,735,400		
花王	135,900	7,438.00	1,010,824,200		
第一工業製薬	14,000	812.00	11,368,000	貸付株式数	3,000株
三洋化成	3,400	5,920.00	20,128,000		
武田薬品	203,400	6,184.00	1,257,825,600		
アステラス製薬	567,400	1,426.00	809,112,400		
大日本住友製薬	40,800	1,628.00	66,422,400	貸付株式数	11,700株
塩野義製薬	79,000	6,259.00	494,461,000		
田辺三菱製薬	67,100	2,427.00	162,851,700		
あすか製薬	6,700	2,044.00	13,694,800		
日本新薬	14,500	8,040.00	116,580,000		
中外製薬	58,000	5,810.00	336,980,000		
科研製薬	9,800	5,620.00	55,076,000		
エーザイ	66,200	6,371.00	421,760,200		
理研ビタミン	2,300	4,480.00	10,304,000		
ロート製薬	30,500	2,879.00	87,809,500		
小野薬品	141,700	2,559.00	362,610,300		
久光製薬	16,300	6,320.00	103,016,000		
持田製薬	3,800	8,120.00	30,856,000		
参天製薬	104,700	1,712.00	179,246,400		
扶桑薬品	3,700	2,822.00	10,441,400		
日本ケミファ	1,600	4,975.00	7,960,000		
ツムラ	19,800	3,880.00	76,824,000		
日医工	14,300	1,688.00	24,138,400	貸付株式数	3,900株
テルモ	84,600	5,380.00	455,148,000		
みらかホールディングス	15,300	4,875.00	74,587,500	貸付株式数	4,200株
キッセイ薬品工業	10,100	3,205.00	32,370,500		
生化学工業	11,000	1,627.00	17,897,000		
栄研化学	4,500	5,150.00	23,175,000		
鳥居薬品	3,700	2,963.00	10,963,100		
J C R ファーマ	4,100	4,660.00	19,106,000		

東和薬品	2,700	5,830.00	15,741,000	
富士製薬工業	2,100	4,345.00	9,124,500	
沢井製薬	9,600	5,490.00	52,704,000	貸付株式数 2,600株
ゼリア新薬工業	12,100	2,170.00	26,257,000	
第一三共	157,400	2,708.00	426,239,200	
キョーリン製薬HD	14,700	2,143.00	31,502,100	
大幸薬品	4,000	2,513.00	10,052,000	貸付株式数 1,100株
ダイト	3,900	3,105.00	12,109,500	
大塚ホールディングス	115,000	4,974.00	572,010,000	
大正製薬HD	12,300	8,920.00	109,716,000	貸付株式数 3,300株
ペプチドリーム	22,800	3,745.00	85,386,000	貸付株式数 6,300株
大日本塗料	6,900	1,881.00	12,978,900	
日本ペイントHOLD	44,700	3,450.00	154,215,000	貸付株式数 12,500株
関西ペイント	60,900	2,949.00	179,594,100	貸付株式数 17,000株
中国塗料	17,400	969.00	16,860,600	
日本特殊塗料	4,200	2,281.00	9,580,200	
藤倉化成	12,400	691.00	8,568,400	
太陽ホールディングス	4,400	5,140.00	22,616,000	
DIC	22,500	4,175.00	93,937,500	
サカタインクス	12,000	1,945.00	23,340,000	
東洋インキSCホールディングン	53,000	650.00	34,450,000	
T&K TOKA	5,500	1,346.00	7,403,000	
アルプス技研	2,800	3,775.00	10,570,000	
オリエンタルランド	62,600	9,991.00	625,436,600	
ダスキン	14,200	2,928.00	41,577,600	
パーク24	29,900	2,768.00	82,763,200	貸付株式数 8,500株
明光ネットワークジャパン	7,800	1,351.00	10,537,800	
ファルコホールディングス	7,100	1,725.00	12,247,500	
クレスコ	1,700	4,830.00	8,211,000	
フジ・メディア・HD	55,700	1,674.00	93,241,800	貸付株式数 16,100株
ラウンドワン	16,500	1,728.00	28,512,000	
リゾートトラスト	22,600	2,456.00	55,505,600	
オービック	17,300	7,790.00	134,767,000	
ジャストシステム	9,300	2,116.00	19,678,800	
ヤフー	395,700	513.00	202,994,100	貸付株式数 114,100株
ビー・エム・エル	7,200	2,706.00	19,483,200	
トレンドマイクロ	26,500	6,350.00	168,275,000	
りらいあコミュニケーション	8,900	1,268.00	11,285,200	
リソー教育	10,400	859.00	8,933,600	

日本オラクル	9,000	9,980.00	89,820,000	
フューチャー	9,700	1,237.00	11,998,900	
CAC HOLDINGS	7,600	1,051.00	7,987,600	
ユー・エス・エス	64,600	2,365.00	152,779,000	
オービックビジネスC	3,000	5,680.00	17,040,000	
伊藤忠テクノソリュー	12,500	4,725.00	59,062,500	
アイティフォー	14,000	771.00	10,794,000	
サイバーエージェント	35,100	3,830.00	134,433,000	
楽天	271,700	1,147.50	311,775,750	貸付株式数 1,700株
テー・オー・ダブリュー	9,600	968.00	9,292,800	
大塚商会	16,500	8,400.00	138,600,000	
総合メディカル	2,600	6,050.00	15,730,000	貸付株式数 700株
サイボウズ	15,200	502.00	7,630,400	
セントラルスポーツ	2,400	4,130.00	9,912,000	貸付株式数 700株
バラカ	2,900	2,377.00	6,893,300	貸付株式数 800株
電通国際情報S	3,800	2,414.00	9,173,200	
デジタルガレージ	10,200	2,891.00	29,488,200	貸付株式数 2,800株
イーエムシステムズ	3,100	2,499.00	7,746,900	
ウェザーニューズ	2,500	3,440.00	8,600,000	貸付株式数 700株 (700株)
C I J	13,800	710.00	9,798,000	
WOWOW	3,000	3,230.00	9,690,000	貸付株式数 800株
フルキャストホールディングス	5,200	2,174.00	11,304,800	
富士フイルムHLDGS	114,600	4,582.00	525,097,200	
コニカミノルタ	127,300	1,096.00	139,520,800	
資生堂	103,200	5,472.00	564,710,400	
ライオン	77,000	2,094.00	161,238,000	
高砂香料	3,500	3,545.00	12,407,500	
マンダム	10,500	3,795.00	39,847,500	
ミルボン	3,800	8,090.00	30,742,000	
ファンケル	13,700	3,215.00	44,045,500	
コーセー	9,400	17,220.00	161,868,000	
シーズ・ホールディングス	7,800	4,715.00	36,777,000	
ポーラ・オルビスHD	23,900	4,100.00	97,990,000	
ノエビアホールディングス	3,800	7,990.00	30,362,000	
エステー	4,700	2,995.00	14,076,500	
コニシ	9,300	2,033.00	18,906,900	
長谷川香料	7,600	2,286.00	17,373,600	
小林製薬	15,200	7,090.00	107,768,000	

荒川化学工業	5,400	2,454.00	13,251,600	
メック	4,500	2,414.00	10,863,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	4,100	2,657.00	10,893,700	
タカラバイオ	14,400	1,492.00	21,484,800	
J C U	3,500	5,720.00	20,020,000	
新田ゼラチン	10,300	772.00	7,951,600	貸付株式数 800株
デクセリアルズ	14,200	1,364.00	19,368,800	
アース製薬	4,200	5,790.00	24,318,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
北興化学	10,000	718.00	7,180,000	貸付株式数 2,600株
クミアイ化学	24,900	780.00	19,422,000	貸付株式数 7,300株 (3,700株)
日本農薬	15,000	693.00	10,395,000	貸付株式数 4,200株 (4,200株)
昭和シエル石油	50,900	1,432.00	72,888,800	
ニチレキ	7,900	1,358.00	10,728,200	
ユシロ化学	5,300	1,603.00	8,495,900	
ピーピー・カストロール	3,100	2,176.00	6,745,600	
富士石油	15,500	550.00	8,525,000	
M O R E S C O	3,700	2,082.00	7,703,400	
出光興産	46,000	3,770.00	173,420,000	
J X T Gホールディングス	876,000	630.00	551,880,000	
コスモエネルギーH L D G S	15,700	3,375.00	52,987,500	
横浜ゴム	31,700	2,516.00	79,757,200	
東洋ゴム	32,700	2,290.00	74,883,000	
ブリヂストン	195,300	5,095.00	995,053,500	
住友ゴム	53,600	2,040.00	109,344,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
藤倉ゴム	7,500	1,013.00	7,597,500	
オカモト	20,000	1,142.00	22,840,000	
アキレス	5,300	2,426.00	12,857,800	
ニッタ	5,700	4,395.00	25,051,500	
住友理工	10,200	1,181.00	12,046,200	
三ツ星ベルト	13,000	1,464.00	19,032,000	
バンドー化学	10,700	1,273.00	13,621,100	
旭硝子	56,200	4,680.00	263,016,000	
日本板硝子	27,300	993.00	27,108,900	
有沢製作所	11,200	1,260.00	14,112,000	

日本山村硝子	52,000	189.00	9,828,000	
日本電気硝子	23,800	4,360.00	103,768,000	
住友大阪セメント	107,000	526.00	56,282,000	
太平洋セメント	34,800	4,610.00	160,428,000	
日本ヒュ-ム	11,800	779.00	9,192,200	
日本コンクリ-ト	16,600	503.00	8,349,800	
アジアパイルHD	10,700	812.00	8,688,400	
東海カーボン	51,100	1,187.00	60,655,700	貸付株式数 14,000株
日本カーボン	3,100	4,385.00	13,593,500	貸付株式数 800株
東洋炭素	4,000	3,590.00	14,360,000	
ノリタケ	3,300	5,170.00	17,061,000	
TOTO	42,500	6,240.00	265,200,000	
日本碍子	66,400	2,145.00	142,428,000	
日本特殊陶業	47,000	2,586.00	121,542,000	
MARUWA	2,000	7,120.00	14,240,000	
品川リフラクトリーズ	2,000	3,390.00	6,780,000	
黒崎播磨	1,300	4,640.00	6,032,000	貸付株式数 300株
ニッカトー	11,700	947.00	11,079,900	
フジインコーポレーテッド	5,100	2,563.00	13,071,300	
ニチアス	30,000	1,445.00	43,350,000	
新日鐵住金	244,500	2,721.00	665,284,500	
神戸製鋼所	99,800	1,053.00	105,089,400	貸付株式数 28,200株
中山製鋼所	9,100	719.00	6,542,900	
合同製鐵	3,700	2,168.00	8,021,600	貸付株式数 1,000株
JFEホールディングス	147,600	2,642.00	389,959,200	
日新製鋼	15,100	1,730.00	26,123,000	
東京製鐵	29,400	974.00	28,635,600	
共英製鋼	6,300	2,004.00	12,625,200	貸付株式数 1,800株
大和工業	11,200	3,040.00	34,048,000	
東京鐵鋼	3,700	1,931.00	7,144,700	
大阪製鐵	3,900	2,361.00	9,207,900	
淀川製鋼所	8,000	3,340.00	26,720,000	
東洋鋼鈑	14,900	458.00	6,824,200	
丸一鋼管	19,000	3,170.00	60,230,000	
大同特殊鋼	9,600	6,790.00	65,184,000	
日本高周波	5,700	918.00	5,232,600	
日本冶金工	49,900	222.00	11,077,800	貸付株式数 13,800株
山陽特殊製鋼	6,300	2,850.00	17,955,000	
愛知製鋼	2,800	4,395.00	12,306,000	

日立金属	58,300	1,485.00	86,575,500	
日本金属	1,900	2,539.00	4,824,100	
大太平洋金属	3,700	2,937.00	10,866,900	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
新日本電工	34,200	444.00	15,184,800	貸付株式数 10,000株
栗本鉄工所	3,600	2,292.00	8,251,200	
日本製鋼所	18,100	3,600.00	65,160,000	
三菱製鋼	3,800	2,699.00	10,256,200	
日本精線	1,400	5,530.00	7,742,000	
大紀アルミニウム	10,400	795.00	8,268,000	
日本軽金属HD	156,100	300.00	46,830,000	
三井金属	14,700	6,340.00	93,198,000	
東邦亜鉛	3,200	5,780.00	18,496,000	
三菱マテリアル	35,800	3,750.00	134,250,000	貸付株式数 10,000株
住友鉱山	70,100	4,355.00	305,285,500	
DOWAホールディングス	13,800	4,270.00	58,926,000	
古河機金	9,000	2,262.00	20,358,000	
大阪チタニウム	6,300	1,860.00	11,718,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
東邦チタニウム	10,800	1,015.00	10,962,000	貸付株式数 3,100株 (200株)
UACJ	8,200	2,910.00	23,862,000	貸付株式数 2,200株
古河電工	18,200	5,940.00	108,108,000	貸付株式数 5,000株
住友電工	203,700	1,958.50	398,946,450	
フジクラ	64,800	1,047.00	67,845,600	
昭和電線HLDGS	8,500	998.00	8,483,000	
タツタ電線	11,500	852.00	9,798,000	
リョービ	6,700	2,906.00	19,470,200	
アーレステイ	8,600	921.00	7,920,600	
アサヒHD	9,300	1,981.00	18,423,300	
東洋製罐グループHD	36,400	1,851.00	67,376,400	
ホッカンホールディングス	18,000	458.00	8,244,000	
横河ブリッジHLDGS	10,200	2,375.00	24,225,000	
OSJBHD	31,300	329.00	10,297,700	貸付株式数 7,400株
駒井ハルテック	3,100	2,699.00	8,366,900	
三和ホールディングス	52,500	1,481.00	77,752,500	
文化シヤッタ-	17,600	1,165.00	20,504,000	
三協立山	8,200	1,586.00	13,005,200	
アルインコ	7,500	1,235.00	9,262,500	
LIXILグループ	80,700	2,955.00	238,468,500	

日本ファイルコン	11,700	747.00	8,739,900	
ノーリツ	12,200	2,173.00	26,510,600	
長府製作所	6,600	2,693.00	17,773,800	
リンナイ	9,700	10,070.00	97,679,000	
ユニプレス	10,400	2,972.00	30,908,800	
岡 部	11,700	1,053.00	12,320,100	
ジーテクト	6,200	2,366.00	14,669,200	
東 プ レ	9,800	3,220.00	31,556,000	
高周波熱錬	11,200	1,170.00	13,104,000	
東京製綱	5,000	1,606.00	8,030,000	貸付株式数 1,300株
パイオラックス	8,400	3,430.00	28,812,000	
エイチワン	4,000	1,595.00	6,380,000	
日本発条	53,000	1,250.00	66,250,000	
三浦工業	23,700	2,872.00	68,066,400	
タ ク マ	18,700	1,631.00	30,499,700	
テクノプロ・ホールディング グ	9,500	5,630.00	53,485,000	
イー・ガーディアン	3,300	2,310.00	7,623,000	貸付株式数 900株
ジャパンマテリアル	5,100	3,330.00	16,983,000	貸付株式数 1,400株 (600株)
ベクトル	7,000	1,566.00	10,962,000	貸付株式数 1,800株
アサンテ	4,300	1,948.00	8,376,400	
N・フィールド	3,700	1,480.00	5,476,000	貸付株式数 1,200株
M&Aキャピタルパート ナー	1,200	7,040.00	8,448,000	
エスクローAJ	8,500	602.00	5,117,000	
日本ビューホテル	5,300	1,391.00	7,372,300	
リクルートホールディング ス	408,300	2,647.00	1,080,770,100	貸付株式数 107,500株
ツ ガ ミ	15,000	1,169.00	17,535,000	貸付株式数 4,000株
オークマ	6,200	7,160.00	44,392,000	
東芝機械	31,000	793.00	24,583,000	
アマダホールディングス	82,900	1,491.00	123,603,900	
アイダエンジニア	13,600	1,365.00	18,564,000	
滝澤鉄工所	4,700	2,125.00	9,987,500	
富士機械製造	16,100	2,187.00	35,210,700	貸付株式数 4,900株
牧野フライス	25,000	1,113.00	27,825,000	貸付株式数 6,000株
オーエスジー	23,900	2,296.00	54,874,400	貸付株式数 7,600株 (7,600株)
旭ダイヤモンド	16,700	1,211.00	20,223,700	

D M G 森精機	29,800	2,247.00	66,960,600	
ソディック	12,200	1,482.00	18,080,400	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
ディスコ	7,400	24,860.00	183,964,000	
日東工器	4,000	2,836.00	11,344,000	
パンチ工業	3,200	2,446.00	7,827,200	
日本郵政	298,000	1,292.00	385,016,000	
ベルシステム24HLDGS	9,200	1,392.00	12,806,400	貸付株式数 2,800株
ソラスト	3,700	2,687.00	9,941,900	貸付株式数 900株
豊田自動織機	44,700	6,970.00	311,559,000	
豊和工業	3,500	1,550.00	5,425,000	貸付株式数 900株 (900株)
OKK	5,100	1,259.00	6,420,900	
石川製作所	1,700	2,930.00	4,981,000	貸付株式数 400株
東洋機械金属	7,000	864.00	6,048,000	
島精機製作所	7,000	7,220.00	50,540,000	
ヤマシンフィルタ	8,500	1,375.00	11,687,500	
日阪製作所	10,300	1,181.00	12,164,300	
やまびこ	10,600	1,694.00	17,956,400	
平田機工	1,600	12,370.00	19,792,000	貸付株式数 400株 (400株)
ナプテスコ	29,800	4,385.00	130,673,000	
三井海洋開発	5,500	2,690.00	14,795,000	
レオン自動機	5,400	1,699.00	9,174,600	
S M C	17,300	45,470.00	786,631,000	
ホソカワミクロン	2,100	7,350.00	15,435,000	
ユニオンツール	2,700	4,205.00	11,353,500	
オイレス工業	7,100	2,373.00	16,848,300	
日精エーエスピー	2,000	6,470.00	12,940,000	貸付株式数 500株 (500株)
サト - ホールディングス	7,400	3,150.00	23,310,000	
技研製作所	3,000	3,100.00	9,300,000	
日精樹脂工業	5,700	1,711.00	9,752,700	
小松製作所	267,100	3,480.00	929,508,000	
住友重機械	31,200	4,565.00	142,428,000	
日立建機	25,800	3,715.00	95,847,000	
巴工業	4,500	2,166.00	9,747,000	
井関農機	5,500	2,743.00	15,086,500	
T O W A	4,700	2,241.00	10,532,700	

丸山製作所	5,000	2,096.00	10,480,000	
北川鉄工所	3,400	2,903.00	9,870,200	
シンニッタン	9,700	758.00	7,352,600	
ローツェ	3,000	2,681.00	8,043,000	貸付株式数 800株 (200株)
クボタ	297,800	2,120.00	631,336,000	
東洋エンジニア	7,700	1,272.00	9,794,400	貸付株式数 2,100株
三菱化工機	3,200	2,298.00	7,353,600	貸付株式数 100株
月島機械	11,300	1,250.00	14,125,000	貸付株式数 1,400株
帝国電機製作所	6,300	1,443.00	9,090,900	
新東工業	13,400	1,375.00	18,425,000	
渋谷工業	5,000	4,125.00	20,625,000	
アイチ コーポレーション	9,600	797.00	7,651,200	貸付株式数 2,600株
小森コーポレーション	13,800	1,573.00	21,707,400	
鶴見製作所	4,900	1,820.00	8,918,000	
住友精密	27,000	375.00	10,125,000	
酒井重工業	1,800	4,305.00	7,749,000	
荏原製作所	22,500	4,385.00	98,662,500	
西島製作所	6,900	1,136.00	7,838,400	
北越工業	7,700	1,191.00	9,170,700	
千代田化工建	38,900	736.00	28,630,400	貸付株式数 12,200株
ダイキン工業	75,600	12,920.00	976,752,000	
オルガノ	2,800	2,931.00	8,206,800	
ト - ヨ - カネツ	2,500	4,190.00	10,475,000	貸付株式数 700株 (700株)
栗田工業	30,000	3,515.00	105,450,000	
椿本チエイン	31,000	891.00	27,621,000	
日 機 装	19,100	1,107.00	21,143,700	貸付株式数 1,000株
新興プランテック	13,000	1,137.00	14,781,000	
アネスト岩田	10,300	1,223.00	12,596,900	
ダイフク	27,500	6,120.00	168,300,000	貸付株式数 7,700株
加藤製作所	2,800	3,095.00	8,666,000	
油研工業	3,500	2,795.00	9,782,500	
タダノ	25,800	1,706.00	44,014,800	
フジテック	17,200	1,699.00	29,222,800	
C K D	15,500	2,439.00	37,804,500	
キトー	5,300	1,712.00	9,073,600	貸付株式数 2,200株
平和	16,800	1,938.00	32,558,400	貸付株式数 4,700株 (4,700株)
理想科学工業	5,700	2,143.00	12,215,100	

SANKYO	13,400	3,625.00	48,575,000	
日本金銭機械	6,500	1,129.00	7,338,500	貸付株式数 1,800株
マースエンジニアリング	4,100	2,356.00	9,659,600	
福島工業	3,600	5,250.00	18,900,000	
ダイコク電機	4,200	1,844.00	7,744,800	
竹内製作所	9,100	2,365.00	21,521,500	
アマノ	17,000	2,932.00	49,844,000	
JUKI	8,500	1,953.00	16,600,500	
サンデンホールディングス	7,100	2,123.00	15,073,300	
ブラザー工業	67,300	2,776.00	186,824,800	
マックス	8,800	1,573.00	13,842,400	
モリタホールディングス	9,200	2,090.00	19,228,000	
グローリー	16,400	3,990.00	65,436,000	
新晃工業	6,100	2,203.00	13,438,300	
大和冷機工業	10,000	1,251.00	12,510,000	
セガサミーホールディングス	54,700	1,358.00	74,282,600	
日本ピストンリング	3,600	2,246.00	8,085,600	
リケン	2,700	6,040.00	16,308,000	
TPR	6,200	3,835.00	23,777,000	
ツバキ・ナカシマ	5,600	2,498.00	13,988,800	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,500	10,690.00	187,075,000	貸付株式数 1,500株
大豊工業	5,100	1,730.00	8,823,000	
日本精工	113,000	1,691.00	191,083,000	貸付株式数 33,100株 (33,100株)
NTN	123,100	551.00	67,828,100	
ジェイテクト	57,200	1,929.00	110,338,800	
不二越	49,000	706.00	34,594,000	
ミネベアミツミ	102,500	2,215.00	227,037,500	
日本トムソン	19,100	734.00	14,019,400	
THK	34,200	4,105.00	140,391,000	
ユーシン精機	2,900	3,340.00	9,686,000	貸付株式数 800株 (800株)
イーグル工業	6,800	2,027.00	13,783,600	
日本ピラ - 工業	6,300	1,554.00	9,790,200	
キッツ	24,900	829.00	20,642,100	
日立	1,324,000	834.20	1,104,480,800	
三菱電機	552,800	1,852.50	1,024,062,000	
富士電機	165,000	792.00	130,680,000	

東洋電機製造	3,500	1,854.00	6,489,000	貸付株式数	900株
安川電機	64,100	4,950.00	317,295,000	貸付株式数	18,200株
シンフォニア テクノロ ジー	37,000	433.00	16,021,000		
明 電 舎	47,000	464.00	21,808,000	貸付株式数	14,000株
オリジン電気	4,000	1,731.00	6,924,000		
山洋電気	2,800	8,150.00	22,820,000		
デンヨー	5,400	1,936.00	10,454,400		
三菱工業	9,700	842.00	8,167,400		
マキタ	71,800	4,640.00	333,152,000		
東芝テック	39,000	708.00	27,612,000	貸付株式数	10,000株
マブチモーター	15,200	5,980.00	90,896,000		
日本電産	66,500	15,270.00	1,015,455,000		
東光高岳	3,300	1,841.00	6,075,300		
ダブル・スコープ	8,100	2,226.00	18,030,600	貸付株式数	2,300株 (100株)
ダイヘン	30,000	1,004.00	30,120,000		
ヤーマン	7,400	2,037.00	15,073,800	貸付株式数	2,000株
JVCケンウッド	43,600	345.00	15,042,000		
第一精工	2,900	2,991.00	8,673,900		
日新電機	13,000	1,352.00	17,576,000		
大崎電気	12,800	794.00	10,163,200		
オムロン	58,700	6,630.00	389,181,000	貸付株式数	100株 (100株)
日東工業	8,900	1,849.00	16,456,100		
I D E C	7,400	2,854.00	21,119,600		
ジーエス・ユアサ コーポ	97,000	580.00	56,260,000	貸付株式数	27,000株
メルコホールディングス	2,700	3,695.00	9,976,500	貸付株式数	1,000株
日本電気	71,100	3,000.00	213,300,000		
富 士 通	569,000	834.90	475,058,100		
沖 電 気	22,100	1,617.00	35,735,700		
電気興業	3,800	2,890.00	10,982,000		
サンケン電気	33,000	671.00	22,143,000		
アイホン	4,900	1,917.00	9,393,300		
ルネサスエレクトロニクス	29,900	1,373.00	41,052,700		
セイコーエプソン	82,100	2,720.00	223,312,000		
ワコム	43,900	607.00	26,647,300	貸付株式数	15,100株 (15,100株)
アルバック	9,300	7,530.00	70,029,000		
E I Z O	5,100	4,785.00	24,403,500		

ジャパンディスプレイ	115,700	199.00	23,024,300	貸付株式数 32,000株 (31,700株)
日本信号	15,200	1,208.00	18,361,600	
京三製作所	17,000	624.00	10,608,000	
能美防災	7,600	2,084.00	15,838,400	
ホーチキ	4,600	2,555.00	11,753,000	
エレコム	4,900	2,553.00	12,509,700	
パナソニック	630,400	1,668.00	1,051,507,200	
アンリツ	40,400	1,070.00	43,228,000	
富士通ゼネラル	17,100	2,381.00	40,715,100	
日立国際電気	10,900	3,190.00	34,771,000	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
ソニー	368,700	5,201.00	1,917,608,700	
T D K	28,600	9,170.00	262,262,000	
帝国通信工業	7,100	1,273.00	9,038,300	
タムラ製作所	22,800	809.00	18,445,200	
アルプス電気	47,400	3,575.00	169,455,000	
池上通信機	40,000	181.00	7,240,000	
パイオニア	92,200	218.00	20,099,600	貸付株式数 25,600株
日本電波工業	8,100	784.00	6,350,400	貸付株式数 2,000株
日本トリム	1,400	5,540.00	7,756,000	貸付株式数 400株 (200株)
ローランド ディー . ジー .	3,300	3,180.00	10,494,000	
フオスタ - 電機	6,800	2,935.00	19,958,000	
クラリオン	30,000	436.00	13,080,000	
S M K	16,000	514.00	8,224,000	
ヨコオ	4,700	1,434.00	6,739,800	貸付株式数 1,500株
ホシデン	14,100	1,769.00	24,942,900	貸付株式数 3,800株
ヒロセ電機	8,800	16,740.00	147,312,000	
日本航空電子	14,000	2,015.00	28,210,000	
T O A	7,100	1,383.00	9,819,300	
マクセルホールディングス	11,100	2,290.00	25,419,000	
古野電気	9,600	819.00	7,862,400	
ユニデンホールディングス	22,000	303.00	6,666,000	
アルパイン	13,300	2,591.00	34,460,300	
スミダコーポレーション	5,900	1,982.00	11,693,800	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
アイコム	3,600	2,524.00	9,086,400	貸付株式数 1,000株 (1,000株)

リオン	3,600	2,377.00	8,557,200	
本多通信工業	6,200	1,163.00	7,210,600	
船井電機	7,200	863.00	6,213,600	貸付株式数 1,900株 (1,800株)
横河電機	54,700	2,070.00	113,229,000	
新電元工業	2,100	7,770.00	16,317,000	
アズビル	16,300	4,860.00	79,218,000	
日本光電工業	23,000	2,575.00	59,225,000	
共和電業	19,500	456.00	8,892,000	
堀場製作所	10,800	7,000.00	75,600,000	
アドバンテスト	31,000	2,235.00	69,285,000	貸付株式数 8,500株
エスペック	5,100	2,755.00	14,050,500	
キーエンス	27,100	64,910.00	1,759,061,000	
日置電機	3,600	2,564.00	9,230,400	
シスメックス	43,100	8,520.00	367,212,000	
日本マイクロニクス	10,600	1,088.00	11,532,800	貸付株式数 3,100株
メガチップス	4,500	3,415.00	15,367,500	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
O B A R A G R O U P	3,300	7,880.00	26,004,000	
デンソー	122,800	6,305.00	774,254,000	
コーセル	8,200	1,555.00	12,751,000	
イリソ電子工業	4,700	6,670.00	31,349,000	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
オブテックスグループ	4,700	4,815.00	22,630,500	
千代田インテグレ	3,000	2,699.00	8,097,000	
レーザーテック	12,400	2,730.00	33,852,000	
スタンレー電気	42,100	4,485.00	188,818,500	
岩崎電気	3,800	1,685.00	6,403,000	
ウシオ電機	32,900	1,618.00	53,232,200	
ヘリオステクノH	8,700	1,100.00	9,570,000	
日本セラミック	5,700	3,045.00	17,356,500	
古河電池	5,300	1,063.00	5,633,900	貸付株式数 1,400株 (1,000株)
山一電機	4,400	2,130.00	9,372,000	貸付株式数 1,600株
図 研	4,700	1,835.00	8,624,500	
日本電子	21,000	656.00	13,776,000	貸付株式数 2,000株
カ シ オ	44,000	1,642.00	72,248,000	
ファナック	52,500	27,945.00	1,467,112,500	
日本シイエムケイ	10,100	1,061.00	10,716,100	貸付株式数 2,700株
エンプラス	2,600	4,635.00	12,051,000	

大真空	3,700	1,676.00	6,201,200	
ローム	24,800	11,500.00	285,200,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
浜松ホトニクス	39,500	3,850.00	152,075,000	
三井ハイテック	7,500	2,342.00	17,565,000	貸付株式数 2,100株
新光電気工業	21,500	860.00	18,490,000	
京セラ	90,500	7,901.00	715,040,500	
太陽誘電	24,200	1,876.00	45,399,200	
村田製作所	57,900	15,165.00	878,053,500	
ユーシン	13,200	768.00	10,137,600	貸付株式数 3,900株 (3,500株)
双葉電子工業	8,700	2,337.00	20,331,900	
日東電工	41,700	11,030.00	459,951,000	
北陸電気工業	4,500	1,823.00	8,203,500	
東海理化電機	14,000	2,333.00	32,662,000	
ニチコン	17,000	1,486.00	25,262,000	
日本ケミコン	4,600	3,745.00	17,227,000	
K O A	8,100	2,271.00	18,395,100	
三井造船	17,900	1,627.00	29,123,300	貸付株式数 5,000株
日立造船	41,800	582.00	24,327,600	
三菱重工業	92,100	4,150.00	382,215,000	
川崎重工業	42,300	3,710.00	156,933,000	
I H I	42,300	3,465.00	146,569,500	
名村造船所	18,200	687.00	12,503,400	
日本車輛	25,000	350.00	8,750,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
三菱ロジスネクスト	7,200	944.00	6,796,800	
F P G	19,800	1,383.00	27,383,400	貸付株式数 5,400株
じもとホールディングス	54,500	189.00	10,300,500	
全国保証	15,500	4,835.00	74,942,500	
めぶきフィナンシャルG	281,100	471.00	132,398,100	
東京TYフィナンシャルG	7,400	3,000.00	22,200,000	
九州フィナンシャルG	88,100	664.00	58,498,400	
かんぽ生命保険	20,600	2,446.00	50,387,600	
ゆうちょ銀行	155,400	1,427.00	221,755,800	
富山第一銀行	19,100	508.00	9,702,800	
コンコルディア・フィナンシャル	329,700	615.00	202,765,500	
西日本フィナンシャルHD	36,000	1,257.00	45,252,000	
日産自動車	649,900	1,088.00	707,091,200	

いすゞ自動車	160,400	1,771.00	284,068,400	
トヨタ自動車	671,400	7,044.00	4,729,341,600	
日野自動車	79,000	1,374.00	108,546,000	
三菱自動車工業	204,800	785.00	160,768,000	
エフテック	4,600	1,852.00	8,519,200	
武蔵精密工業	6,000	3,375.00	20,250,000	貸付株式数 1,600株
日産車体	21,600	1,147.00	24,775,200	
新明和工業	23,500	1,077.00	25,309,500	
極東開発工業	10,300	1,933.00	19,909,900	
日信工業	11,200	2,193.00	24,561,600	
トピー工業	4,700	3,405.00	16,003,500	
ティラド	2,300	3,870.00	8,901,000	
曙ブレーキ	27,200	342.00	9,302,400	貸付株式数 7,500株
タチエス	9,500	2,103.00	19,978,500	
N O K	29,400	2,732.00	80,320,800	
フタバ産業	17,200	1,048.00	18,025,600	
K Y B	5,800	6,620.00	38,396,000	
市光工業	9,400	1,090.00	10,246,000	
大同メタル工業	8,000	1,004.00	8,032,000	
プレス工業	29,800	669.00	19,936,200	
太平洋工業	11,700	1,613.00	18,872,100	
ケーヒン	12,600	2,204.00	27,770,400	
河西工業	7,100	1,957.00	13,894,700	
アイシン精機	45,500	6,010.00	273,455,000	
マ ッ ダ	172,300	1,503.00	258,966,900	
今仙電機製作所	7,300	1,336.00	9,752,800	
本田技研	496,500	3,744.00	1,858,896,000	
スズキ	109,600	6,040.00	661,984,000	
S U B A R U	171,400	3,669.00	628,866,600	
安永	2,800	2,662.00	7,453,600	貸付株式数 700株
ヤマハ発動機	77,800	3,520.00	273,856,000	
ショーワ	14,700	1,363.00	20,036,100	貸付株式数 4,000株
小糸製作所	33,200	7,750.00	257,300,000	貸付株式数 9,400株
T B K	22,400	532.00	11,916,800	
エクセディ	6,200	3,345.00	20,739,000	
ミツバ	10,500	1,532.00	16,086,000	
豊田合成	19,600	2,807.00	55,017,200	貸付株式数 4,500株
愛三工業	10,000	1,279.00	12,790,000	
ヨ ロ ズ	5,700	2,484.00	14,158,800	
エフ・シー・シー	8,900	2,837.00	25,249,300	

シマノ	22,400	15,520.00	347,648,000	
テイ・エス テック	12,800	4,595.00	58,816,000	
ジャムコ	2,900	2,890.00	8,381,000	貸付株式数 900株 (900株)
小野建	5,300	2,035.00	10,785,500	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ノジマ	9,900	2,576.00	25,502,400	
佐鳥電機	8,700	992.00	8,630,400	
伯東	3,900	1,916.00	7,472,400	
コンドーテック	8,000	1,096.00	8,768,000	
ライトオン	6,400	910.00	5,824,000	貸付株式数 1,700株 (1,400株)
ナガイレーベン	7,200	2,687.00	19,346,400	
三菱食品	5,900	3,420.00	20,178,000	
良品計画	7,200	35,050.00	252,360,000	
松田産業	5,800	1,870.00	10,846,000	
第一興商	8,000	5,380.00	43,040,000	
メディパルHD	54,400	2,179.00	118,537,600	
アドヴァン	6,600	1,037.00	6,844,200	貸付株式数 600株 (600株)
萩原電気	2,500	3,425.00	8,562,500	
アルビス	1,600	4,300.00	6,880,000	貸付株式数 400株 (100株)
アズワン	4,300	6,440.00	27,692,000	
ドウシシャ	6,000	2,305.00	13,830,000	
小津産業	4,900	2,186.00	10,711,400	
コジマ	16,900	365.00	6,168,500	
コーナン商事	7,900	2,340.00	18,486,000	
黒田電気	6,600	2,713.00	17,905,800	
ネットワンシステムズ	22,900	1,610.00	36,869,000	
ワタミ	7,300	1,575.00	11,497,500	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	35,500	5,370.00	190,635,000	
丸文	7,300	1,036.00	7,562,800	
西松屋チェーン	12,200	1,358.00	16,567,600	貸付株式数 3,400株
ゼンショーホールディング	28,400	1,900.00	53,960,000	貸付株式数 8,000株
ハピネット	4,300	1,988.00	8,548,400	

幸楽苑ホールディングス	7,300	1,771.00	12,928,300	貸付株式数 1,900株 (1,600株)
日本ライフライン	7,800	4,980.00	38,844,000	貸付株式数 2,100株 (100株)
サイゼリヤ	8,300	3,510.00	29,133,000	
エクセル	3,100	2,488.00	7,712,800	貸付株式数 900株
V Tホールディングス	19,300	552.00	10,653,600	貸付株式数 5,400株
マルカキカイ	3,400	2,159.00	7,340,600	貸付株式数 900株
アルゴグラフィックス	3,200	3,535.00	11,312,000	
I D O M	17,700	836.00	14,797,200	貸付株式数 4,700株 (100株)
ポプラ	11,600	718.00	8,328,800	
ユナイテッドアローズ	6,700	4,240.00	28,408,000	
進和	4,700	2,564.00	12,050,800	
ダイترون	3,800	2,297.00	8,728,600	
ハイデイ日高	6,100	3,385.00	20,648,500	
シークス	3,300	4,750.00	15,675,000	貸付株式数 900株
コロワイド	18,200	2,157.00	39,257,400	貸付株式数 5,100株
ピーシーデポコーポ	8,900	926.00	8,241,400	貸付株式数 1,900株
壱番屋	3,800	4,405.00	16,739,000	貸付株式数 900株
スギホールディングス	11,800	6,020.00	71,036,000	
島津製作所	65,500	2,677.00	175,343,500	
長野計器	7,500	1,349.00	10,117,500	
ブイ・テクノロジー	1,300	18,730.00	24,349,000	貸付株式数 300株
スター精密	8,600	1,839.00	15,815,400	貸付株式数 2,700株
東京計器	4,800	1,390.00	6,672,000	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
東京精密	9,800	4,655.00	45,619,000	
マニー	6,900	3,220.00	22,218,000	
ニコン	96,100	2,227.00	214,014,700	
トプコン	29,700	2,491.00	73,982,700	
オリンパス	82,300	4,610.00	379,403,000	貸付株式数 25,300株 (25,300株)
理研計器	5,900	2,525.00	14,897,500	
S C R E E Nホールディングス	10,500	10,060.00	105,630,000	
キヤノン電子	5,600	2,480.00	13,888,000	
タムロン	4,600	2,433.00	11,191,800	貸付株式数 100株
H O Y A	113,600	5,448.00	618,892,800	
ノーリツ鋼機	6,100	2,132.00	13,005,200	貸付株式数 1,600株

エー・アンド・デイ	13,400	764.00	10,237,600	
キヤノン	297,200	4,298.00	1,277,365,600	
リコー	165,700	996.00	165,037,200	
シチズン時計	63,700	815.00	51,915,500	
リズム時計	4,000	2,360.00	9,440,000	
メニコン	4,000	5,850.00	23,400,000	
パラマウントベッドHD	5,800	5,330.00	30,914,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
SHOBI	13,300	423.00	5,625,900	貸付株式数 3,000株
ニホンフラッシュ	4,400	2,378.00	10,463,200	貸付株式数 1,200株
前田工織	6,500	1,994.00	12,961,000	
アートネイチャー	9,000	807.00	7,263,000	
ダンロップスポーツ	4,400	1,589.00	6,991,600	
バンダイナムコHLDGS	57,200	3,650.00	208,780,000	
SHOEI	2,800	4,270.00	11,956,000	
マーベラス	9,900	1,032.00	10,216,800	貸付株式数 2,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	9,600	5,410.00	51,936,000	
萩原工業	4,500	1,975.00	8,887,500	貸付株式数 1,200株
エイベックス	10,200	1,549.00	15,799,800	
トッパン・フォームズ	12,200	1,220.00	14,884,000	
フジシールインターナショナル	12,300	3,820.00	46,986,000	
タカラトミー	23,600	1,599.00	37,736,400	
レック	3,600	2,724.00	9,806,400	貸付株式数 1,100株
大建工業	4,700	2,878.00	13,526,600	
凸版印刷	153,000	1,046.00	160,038,000	
大日本印刷	71,600	2,455.00	175,778,000	
共同印刷	2,300	3,580.00	8,234,000	
NISSHA	11,100	3,615.00	40,126,500	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
藤森工業	4,800	3,955.00	18,984,000	
ヴィア・ホールディングス	10,600	753.00	7,981,800	貸付株式数 2,900株
宝印刷	6,900	1,742.00	12,019,800	
アシックス	54,600	1,656.00	90,417,600	貸付株式数 15,200株
ジェイエスピー	3,500	3,785.00	13,247,500	
ニチハ	8,500	4,360.00	37,060,000	
エフピコ	4,600	6,230.00	28,658,000	貸付株式数 1,400株
ヤマハ	37,400	4,130.00	154,462,000	

河合楽器	3,800	2,529.00	9,610,200	
クリナップ	8,300	858.00	7,121,400	
ピジョン	33,400	4,295.00	143,453,000	
天馬	4,500	2,105.00	9,472,500	
キングジム	10,100	1,001.00	10,110,100	
リンテック	12,300	3,090.00	38,007,000	
信越ポリマー	11,400	1,184.00	13,497,600	
東リ	22,300	406.00	9,053,800	
イトーキ	13,300	836.00	11,118,800	貸付株式数 1,300株
任天堂	34,000	45,200.00	1,536,800,000	
三菱鉛筆	9,000	2,433.00	21,897,000	
タカラスタンダード	11,300	1,787.00	20,193,100	
コクヨ	26,200	2,130.00	55,806,000	貸付株式数 2,500株
ナカバヤシ	12,800	708.00	9,062,400	
ニフコ	10,000	7,530.00	75,300,000	
立川ブラインド	5,200	1,387.00	7,212,400	
グローブライド	4,100	1,996.00	8,183,600	
岡村製作所	18,900	1,472.00	27,820,800	
日本バルカー	4,900	2,649.00	12,980,100	
伊藤忠	399,200	1,946.00	776,843,200	
丸紅	444,300	745.80	331,358,940	
スクロール	16,500	485.00	8,002,500	
高島	3,300	2,192.00	7,233,600	
ヨンドシーホールディングス	5,600	3,045.00	17,052,000	貸付株式数 1,500株
三陽商会	4,900	2,113.00	10,353,700	貸付株式数 1,200株
長瀬産業	31,400	2,053.00	64,464,200	
蝶理	4,100	2,081.00	8,532,100	
豊田通商	60,600	4,220.00	255,732,000	
オンワードホールディングス	35,000	916.00	32,060,000	
兼松	23,300	1,346.00	31,361,800	
美津濃	5,700	3,335.00	19,009,500	
ツカモトコーポレーション	6,800	1,265.00	8,602,000	
ユニー・ファミリーマートHD	17,600	7,570.00	133,232,000	貸付株式数 6,800株
三井物産	460,800	1,705.00	785,664,000	
日本紙パルプ	2,800	4,295.00	12,026,000	
東京エレクトロン	36,900	20,760.00	766,044,000	
日立ハイテクノロジーズ	18,900	4,645.00	87,790,500	

カメイ	7,200	1,810.00	13,032,000	
スターゼン	2,400	5,410.00	12,984,000	
セイコーHD	8,100	3,045.00	24,664,500	貸付株式数 2,200株
山 善	20,900	1,277.00	26,689,300	
住友商事	341,300	1,743.50	595,056,550	
日本ユニシス	15,000	2,203.00	33,045,000	
内田洋行	3,100	3,210.00	9,951,000	
三菱商事	381,800	2,813.00	1,074,003,400	
第一実業	3,100	3,395.00	10,524,500	
キヤノンマーケティングJ PN	15,800	2,870.00	45,346,000	
西華産業	3,700	2,724.00	10,078,800	
菱洋エレクトロ	5,600	1,920.00	10,752,000	
ユアサ商事	5,100	3,940.00	20,094,000	
神鋼商事	2,000	3,040.00	6,080,000	
阪和興業	10,100	4,525.00	45,702,500	
正栄食品	3,200	4,750.00	15,200,000	貸付株式数 800株
カナデン	8,400	1,387.00	11,650,800	
菱電商事	5,000	1,737.00	8,685,000	
ニプロ	38,000	1,624.00	61,712,000	
岩谷産業	11,500	3,390.00	38,985,000	
すてきナイスグループ	6,100	1,543.00	9,412,300	
極東貿易	20,000	445.00	8,900,000	
イ ワ キ	14,000	489.00	6,846,000	
兼松エレクトロニクス	3,700	3,295.00	12,191,500	
三愛石油	14,400	1,608.00	23,155,200	
稲畑産業	12,900	1,739.00	22,433,100	
ゴ-ルドウイン	1,800	8,200.00	14,760,000	貸付株式数 700株 (700株)
ユニ・チャ-ム	117,000	2,943.00	344,331,000	
デサント	13,000	1,656.00	21,528,000	貸付株式数 3,500株
ワ キ タ	12,300	1,328.00	16,334,400	
東邦ホールディングス	15,400	2,333.00	35,928,200	貸付株式数 4,700株
サンゲツ	17,900	2,049.00	36,677,100	
ミツウロコグループ	8,900	822.00	7,315,800	
シナネンホールディングス	3,200	2,510.00	8,032,000	
伊藤忠エネクス	11,300	1,125.00	12,712,500	
サンリオ	15,100	1,865.00	28,161,500	貸付株式数 4,600株
サンワ テクノス	4,200	2,035.00	8,547,000	
リョ-サン	6,700	4,345.00	29,111,500	

新光商事	6,600	1,972.00	13,015,200	
トーホー	4,100	2,742.00	11,242,200	
三信電気	5,200	1,695.00	8,814,000	
東陽テクニカ	10,000	958.00	9,580,000	
モスフード サービス	7,300	3,445.00	25,148,500	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
加賀電子	5,000	3,145.00	15,725,000	
三益半導体	5,400	2,070.00	11,178,000	
木曽路	7,500	2,721.00	20,407,500	
千趣会	15,200	676.00	10,275,200	貸付株式数 2,600株
タカキユー	33,400	231.00	7,715,400	
ケーヨー	13,700	713.00	9,768,100	
上新電機	6,500	4,385.00	28,502,500	
日本瓦斯	10,100	3,970.00	40,097,000	
ロイヤルホールディングス	9,900	3,085.00	30,541,500	貸付株式数 1,000株
いなげや	6,900	1,842.00	12,709,800	
島忠	14,000	3,230.00	45,220,000	貸付株式数 3,600株
チヨダ	6,300	2,925.00	18,427,500	
ライフコーポレーション	4,300	3,005.00	12,921,500	
リンガーハット	7,100	2,580.00	18,318,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
MrMaxHD	9,700	850.00	8,245,000	
AOKIホールディングス	10,500	1,640.00	17,220,000	
オークワ	9,000	1,134.00	10,206,000	
コメリ	8,100	3,200.00	25,920,000	
青山商事	10,200	4,280.00	43,656,000	貸付株式数 3,000株
しまむら	6,300	13,530.00	85,239,000	
高島屋	85,000	1,107.00	94,095,000	
松屋	12,500	1,331.00	16,637,500	貸付株式数 3,400株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	25,700	2,188.00	56,231,600	
丸井グループ	52,300	1,986.00	103,867,800	
クレディセゾン	41,000	2,159.00	88,519,000	
アクシアル リテイリング	4,700	4,230.00	19,881,000	
イオン	209,400	1,824.00	381,945,600	貸付株式数 48,000株
イズミ	10,000	6,590.00	65,900,000	
平和堂	10,900	2,422.00	26,399,800	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
フジ	6,300	2,466.00	15,535,800	
ヤオコー	6,400	5,290.00	33,856,000	

ゼビオホールディングス	7,200	2,067.00	14,882,400	
ケースホールディングス	22,800	2,896.00	66,028,800	貸付株式数 6,600株 (3,000株)
PALTAC	7,600	4,980.00	37,848,000	
新生銀行	47,000	1,793.00	84,271,000	
あおぞら銀行	32,000	4,355.00	139,360,000	
三菱UFJフィナンシャルG	3,848,600	792.10	3,048,476,060	
りそなホールディングス	597,800	595.90	356,229,020	
三井住友トラストHD	107,000	4,164.00	445,548,000	
三井住友フィナンシャルG	412,100	4,547.00	1,873,818,700	
第四銀行	6,500	4,905.00	31,882,500	
北越銀行	5,900	2,496.00	14,726,400	
千葉銀行	194,000	859.00	166,646,000	
群馬銀行	106,900	666.00	71,195,400	
武蔵野銀行	8,400	3,570.00	29,988,000	
千葉興業銀行	19,100	597.00	11,402,700	
筑波銀行	33,000	386.00	12,738,000	
七十七銀行	16,300	2,648.00	43,162,400	
青森銀行	4,200	3,585.00	15,057,000	
秋田銀行	3,500	3,045.00	10,657,500	
山形銀行	6,000	2,471.00	14,826,000	
岩手銀行	3,600	4,485.00	16,146,000	貸付株式数 600株
東邦銀行	45,900	398.00	18,268,200	
東北銀行	8,300	1,507.00	12,508,100	
ふくおかフィナンシャルG	218,000	582.00	126,876,000	
静岡銀行	141,000	1,108.00	156,228,000	
十六銀行	6,700	3,330.00	22,311,000	
スルガ銀行	55,700	2,411.00	134,292,700	
八十二銀行	93,800	640.00	60,032,000	
山梨中央銀行	34,000	478.00	16,252,000	
大垣共立銀行	8,300	2,881.00	23,912,300	
福井銀行	4,900	2,733.00	13,391,700	
北國銀行	6,000	4,355.00	26,130,000	
清水銀行	2,700	3,225.00	8,707,500	
滋賀銀行	46,000	580.00	26,680,000	
南都銀行	6,300	3,035.00	19,120,500	
百五銀行	49,500	518.00	25,641,000	
京都銀行	20,500	5,720.00	117,260,000	
紀陽銀行	19,800	1,877.00	37,164,600	

三重銀行	3,800	2,534.00	9,629,200	
ほくほくフィナンシャルG	34,700	1,675.00	58,122,500	
広島銀行	78,100	883.00	68,962,300	貸付株式数 21,600株
山陰合同銀行	31,200	1,014.00	31,636,800	
中国銀行	36,700	1,463.00	53,692,100	貸付株式数 10,200株
伊予銀行	76,000	877.00	66,652,000	貸付株式数 15,700株
百十四銀行	58,000	370.00	21,460,000	
四国銀行	8,400	1,583.00	13,297,200	
阿波銀行	41,000	691.00	28,331,000	
大分銀行	2,900	4,450.00	12,905,000	貸付株式数 800株
宮崎銀行	3,600	3,585.00	12,906,000	
佐賀銀行	3,800	2,550.00	9,690,000	
十八銀行	38,000	293.00	11,134,000	
沖縄銀行	5,100	4,395.00	22,414,500	貸付株式数 100株
琉球銀行	10,800	1,622.00	17,517,600	
セブン銀行	203,400	376.00	76,478,400	貸付株式数 58,500株
みずほフィナンシャルG	7,394,200	203.90	1,507,677,380	
高知銀行	8,600	1,281.00	11,016,600	
山口フィナンシャルG	48,000	1,341.00	64,368,000	
芙蓉総合リース	6,200	7,450.00	46,190,000	
興銀リース	10,000	2,867.00	28,670,000	
東京センチュリー	10,900	5,090.00	55,481,000	
SBIホールディングス	60,800	1,995.00	121,296,000	
日本証券金融	23,700	610.00	14,457,000	
アイフル	94,500	384.00	36,288,000	貸付株式数 27,400株 (300株)
名古屋銀行	4,100	4,300.00	17,630,000	貸付株式数 1,200株
北洋銀行	78,200	360.00	28,152,000	
愛知銀行	1,900	6,310.00	11,989,000	
第三銀行	5,100	1,825.00	9,307,500	
中京銀行	3,100	2,330.00	7,223,000	
大光銀行	3,200	2,494.00	7,980,800	
愛媛銀行	7,700	1,415.00	10,895,500	貸付株式数 1,900株
トマト銀行	8,300	1,543.00	12,806,900	
みなと銀行	5,200	2,071.00	10,769,200	
京葉銀行	45,000	511.00	22,995,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
関西アーバン銀行	7,300	1,411.00	10,300,300	
栃木銀行	27,800	480.00	13,344,000	
北日本銀行	3,400	3,005.00	10,217,000	

東和銀行	10,400	1,311.00	13,634,400	
福島銀行	10,900	910.00	9,919,000	
大東銀行	5,400	1,670.00	9,018,000	
リコーリース	4,300	3,855.00	16,576,500	
イオンフィナンシャルサー ビス	38,600	2,491.00	96,152,600	
アコム	114,800	467.00	53,611,600	貸付株式数 32,900株
ジャックス	6,900	2,589.00	17,864,100	
オリコ	116,900	184.00	21,509,600	貸付株式数 35,700株
日立キャピタル	14,800	2,766.00	40,936,800	
アプラスフィナンシャル	58,100	110.00	6,391,000	
オリックス	363,300	1,934.00	702,622,200	
三菱UFJリース	136,200	639.00	87,031,800	
ジャフコ	7,700	5,890.00	45,353,000	
トモニホールディングス	43,900	544.00	23,881,600	
大和証券G本社	464,000	698.00	323,872,000	
野村ホールディングス	980,600	670.50	657,492,300	
岡三証券グループ	45,000	686.00	30,870,000	
丸三証券	19,400	1,051.00	20,389,400	貸付株式数 4,500株
東洋証券	32,000	324.00	10,368,000	貸付株式数 8,000株
東海東京HD	58,700	726.00	42,616,200	
水戸証券	26,200	429.00	11,239,800	
いちよし証券	13,600	1,280.00	17,408,000	
松井証券	24,500	983.00	24,083,500	
SOMPOホールディング ス	106,600	4,532.00	483,111,200	
日本取引所グループ	160,700	2,062.00	331,363,400	
マネックスG	58,800	327.00	19,227,600	貸付株式数 16,200株
カブドットコム証券	35,600	342.00	12,175,200	
極東証券	8,200	1,645.00	13,489,000	
岩井コスモホールディング	7,900	1,441.00	11,383,900	
藍澤証券	14,100	752.00	10,603,200	
フィデアホール	63,500	204.00	12,954,000	
池田泉州HD	50,500	404.00	20,402,000	
アニコムホールディング ス	4,000	3,230.00	12,920,000	貸付株式数 1,100株
MS&AD	142,100	3,655.00	519,375,500	
SONY FH	44,100	1,898.00	83,701,800	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	307,700	2,296.00	706,479,200	
東京海上HD	205,200	4,960.00	1,017,792,000	

イー・ギャランティ	2,400	3,300.00	7,920,000	貸付株式数 700株 (700株)
NECキャピタルソリューション	3,300	2,317.00	7,646,100	
T&Dホールディングス	167,700	1,845.50	309,490,350	
アドバンスクリエイト	3,600	1,961.00	7,059,600	
三井不動産	273,000	2,536.00	692,328,000	
三菱地所	406,600	2,002.50	814,216,500	
平和不動産	9,900	2,098.00	20,770,200	
東京建物	58,300	1,556.00	90,714,800	
ダイビル	14,300	1,259.00	18,003,700	
京阪神ビルディング	12,200	833.00	10,162,600	
住友不動産	131,000	3,696.00	484,176,000	
大京	8,700	2,187.00	19,026,900	
テーオーシー	18,500	940.00	17,390,000	
レオパレス21	67,500	900.00	60,750,000	
スターツコーポレーション	7,400	2,741.00	20,283,400	
フジ住宅	10,900	840.00	9,156,000	
空港施設	11,100	653.00	7,248,300	
ゴールドクレスト	4,300	2,309.00	9,928,700	
リログループ	29,200	2,988.00	87,249,600	
日本エスリード	3,400	2,340.00	7,956,000	
日神不動産	9,100	836.00	7,607,600	
日本エスコン	11,800	627.00	7,398,600	貸付株式数 3,100株
タカラレーベン	25,900	509.00	13,183,100	貸付株式数 7,200株
サンヨーハウジング名古屋	8,000	1,197.00	9,576,000	
イオンモール	34,500	2,054.00	70,863,000	
東祥	3,700	3,460.00	12,802,000	貸付株式数 1,000株
トーセイ	8,300	1,095.00	9,088,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	33,700	1,235.00	41,619,500	
サンフロンティア不動産	6,500	1,502.00	9,763,000	貸付株式数 1,700株 (100株)
エフ・ジェー・ネクスト	6,200	994.00	6,162,800	
グランディハウス	19,200	530.00	10,176,000	
東武鉄道	58,900	3,575.00	210,567,500	
相鉄ホールディングス	17,400	2,923.00	50,860,200	
東京急行	150,300	1,791.00	269,187,300	
京浜急行	76,200	2,167.00	165,125,400	貸付株式数 21,200株
小田急電鉄	82,300	2,385.00	196,285,500	
京王電鉄	30,800	4,960.00	152,768,000	

京成電鉄	38,500	3,600.00	138,600,000	
富士急行	7,700	3,070.00	23,639,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
東日本旅客鉄道	99,400	10,865.00	1,079,981,000	
西日本旅客鉄道	49,900	8,257.00	412,024,300	
東海旅客鉄道	49,600	20,775.00	1,030,440,000	
西武ホールディングス	70,200	2,029.00	142,435,800	
鴻池運輸	8,000	1,855.00	14,840,000	
西日本鉄道	15,200	2,920.00	44,384,000	
ハマキョウレックス	4,200	3,125.00	13,125,000	
サカイ引越センター	3,100	5,670.00	17,577,000	貸付株式数 800株 (200株)
近鉄グループHLDGS	52,200	4,395.00	229,419,000	
阪急阪神HLDGS	70,000	4,350.00	304,500,000	
南海電鉄	25,000	2,803.00	70,075,000	
京阪ホールディングス	23,100	3,325.00	76,807,500	
名古屋鉄道	40,200	2,741.00	110,188,200	
山陽電鉄	4,900	2,868.00	14,053,200	
トランコム	1,700	7,320.00	12,444,000	
日本通運	20,400	7,130.00	145,452,000	
ヤマトホールディングス	91,900	2,275.50	209,118,450	
山 九	13,300	4,780.00	63,574,000	
日 新	4,900	3,095.00	15,165,500	
丸全昭和運輸	22,000	500.00	11,000,000	
センコーグループHLDGS	31,700	802.00	25,423,400	
トナミホールディングス	1,500	4,795.00	7,192,500	
ニッコンホールディングス	19,500	3,025.00	58,987,500	
福山通運	7,500	4,040.00	30,300,000	
セイノーホールディングス	38,700	1,773.00	68,615,100	貸付株式数 10,600株
日立物流	11,700	2,793.00	32,678,100	
丸和運輸機関	3,200	3,060.00	9,792,000	貸付株式数 900株 (900株)
日本郵船	43,200	2,618.00	113,097,600	貸付株式数 13,000株
商船三井	32,600	3,600.00	117,360,000	
川崎汽船	24,000	2,894.00	69,456,000	貸付株式数 6,700株
NSユニテッド海運	2,600	2,663.00	6,923,800	
飯野海運	27,800	620.00	17,236,000	
九州旅客鉄道	43,900	3,470.00	152,333,000	
日本航空	96,700	4,116.00	398,017,200	

A N Aホールディングス	102,500	4,480.00	459,200,000	
三菱倉庫	17,700	3,000.00	53,100,000	
三井倉庫H O L D	37,000	360.00	13,320,000	
住友倉庫	36,000	796.00	28,656,000	
渋沢倉庫	6,700	1,916.00	12,837,200	
ヤマタネ	5,600	2,186.00	12,241,600	
東陽倉庫	29,200	327.00	9,548,400	
日本トランスシティ	19,000	459.00	8,721,000	
東洋埠頭	6,200	1,832.00	11,358,400	
上 組	33,000	2,474.00	81,642,000	
キューソー流通システム	2,200	3,190.00	7,018,000	貸付株式数 600株
郵船ロジスティクス	6,400	1,497.00	9,580,800	
近鉄エクスプレス	10,100	2,223.00	22,452,300	
内外トランスライン	5,500	1,848.00	10,164,000	貸付株式数 1,500株
東京放送H D	32,800	2,753.00	90,298,400	貸付株式数 9,200株
日本テレビH L D S	49,500	2,031.00	100,534,500	貸付株式数 13,800株
テレビ朝日H D	14,900	2,388.00	35,581,200	
スカパーJ S A T H D	40,700	500.00	20,350,000	
テレビ東京H D	4,900	2,446.00	11,985,400	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本B S 放送	5,500	1,278.00	7,029,000	
ワイヤレスゲート	4,600	1,289.00	5,929,400	貸付株式数 1,300株 (800株)
コネクシオ	4,000	2,185.00	8,740,000	
日本通信	64,700	121.00	7,828,700	貸付株式数 17,100株
日本電信電話	388,900	5,879.00	2,286,343,100	
K D D I	487,600	3,215.00	1,567,634,000	
光通信	6,600	16,180.00	106,788,000	
N T T ドコモ	401,300	2,907.50	1,166,779,750	
エムティーアイ	10,000	652.00	6,520,000	貸付株式数 100株
G M O インターネット	20,600	1,879.00	38,707,400	貸付株式数 5,800株
カドカワ	16,200	1,287.00	20,849,400	貸付株式数 4,400株
ゼンリン	6,800	3,795.00	25,806,000	
東京電力H D	438,500	450.00	197,325,000	
中部電力	168,600	1,419.00	239,243,400	
関西電力	225,600	1,484.00	334,790,400	
中国電力	74,800	1,240.00	92,752,000	貸付株式数 21,600株
北陸電力	53,900	990.00	53,361,000	貸付株式数 14,900株
東北電力	128,900	1,482.00	191,029,800	
四国電力	49,500	1,508.00	74,646,000	

九州電力	121,700	1,283.00	156,141,100	
北海道電力	54,900	807.00	44,304,300	
沖縄電力	9,100	2,931.00	26,672,100	
電源開発	43,800	3,120.00	136,656,000	
イーレックス	9,200	1,100.00	10,120,000	貸付株式数 2,200株
東京瓦斯	118,100	2,635.00	311,193,500	
大阪瓦斯	107,000	2,157.00	230,799,000	
東邦瓦斯	27,300	3,190.00	87,087,000	貸付株式数 7,500株
北海道瓦斯	33,000	289.00	9,537,000	貸付株式数 5,000株
西部瓦斯	7,500	2,657.00	19,927,500	
静岡ガス	16,300	974.00	15,876,200	
メタウォーター	3,200	2,857.00	9,142,400	貸付株式数 800株 (800株)
松竹	3,600	18,420.00	66,312,000	
東宝	35,500	3,795.00	134,722,500	
エイチ・アイ・エス	8,400	4,225.00	35,490,000	貸付株式数 2,300株
東映	2,000	11,660.00	23,320,000	
N T Tデータ	170,300	1,321.00	224,966,300	
共立メンテナンス	9,500	4,040.00	38,380,000	貸付株式数 2,600株
イチネンホールディングス	7,300	1,598.00	11,665,400	
建設技術研究所	7,900	1,134.00	8,958,600	
アインホールディングス	7,800	7,650.00	59,670,000	
スバル興業	1,100	7,980.00	8,778,000	
東京テアトル	5,400	1,500.00	8,100,000	
よみうりランド	1,600	4,945.00	7,912,000	
東京都競馬	4,200	3,880.00	16,296,000	
常磐興産	6,500	1,856.00	12,064,000	
カナモト	8,200	3,875.00	31,775,000	
東京ドーム	21,500	1,110.00	23,865,000	
D T S	6,200	3,715.00	23,033,000	貸付株式数 2,000株
スクウェア・エニックス・HD	25,400	5,110.00	129,794,000	
シーイーシー	3,700	2,549.00	9,431,300	
カプコン	11,700	3,200.00	37,440,000	
西尾レントオール	4,600	3,835.00	17,641,000	
日本空港ビルデング	16,000	4,190.00	67,040,000	貸付株式数 4,400株
トランス・コスモス	5,900	2,741.00	16,171,900	
乃村工藝社	12,500	2,566.00	32,075,000	
ジャステック	6,000	1,260.00	7,560,000	
S C S K	13,300	4,915.00	65,369,500	

藤田観光	2,300	3,675.00	8,452,500	
KNT - CTホールディングス	3,800	1,708.00	6,490,400	
日本管財	6,100	2,035.00	12,413,500	
トーカイ	2,700	4,685.00	12,649,500	
セコム	56,000	8,414.00	471,184,000	
セントラル警備保障	3,500	2,041.00	7,143,500	貸付株式数 900株 (100株)
アイネス	10,800	1,086.00	11,728,800	
丹青社	11,300	1,430.00	16,159,000	
メイテック	6,000	5,900.00	35,400,000	
TKC	5,300	3,855.00	20,431,500	
アサツー ディ・ケイ	10,000	3,660.00	36,600,000	
富士ソフト	7,500	3,465.00	25,987,500	
応用地質	6,700	1,520.00	10,184,000	
船井総研ホールディング	7,600	3,735.00	28,386,000	
NSD	9,100	2,309.00	21,011,900	
オオバ	18,800	511.00	9,606,800	
コナミホールディングス	22,300	5,930.00	132,239,000	
学 究 社	5,500	1,604.00	8,822,000	
ベネッセホールディングス	19,200	3,960.00	76,032,000	
イオンディライト	6,400	4,250.00	27,200,000	
ニチイ学館	10,500	1,380.00	14,490,000	
ダイセキ	9,400	2,965.00	27,871,000	
日鉄住金物産	3,900	5,920.00	23,088,000	
元気寿司	3,500	4,470.00	15,645,000	貸付株式数 800株 (100株)
トラスコ中山	11,500	3,140.00	36,110,000	貸付株式数 2,500株
ヤマダ電機	179,200	610.00	109,312,000	貸付株式数 50,300株
オートバックスセブン	21,100	2,152.00	45,407,200	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
アークランドサカモト	9,500	1,871.00	17,774,500	
ニトリホールディングス	21,700	18,335.00	397,869,500	
吉野家ホールディングス	18,000	1,863.00	33,534,000	貸付株式数 5,700株
加藤産業	8,500	4,045.00	34,382,500	
イノテック	7,200	1,010.00	7,272,000	
イエローハット	5,300	3,275.00	17,357,500	
松屋フーズ	2,900	4,115.00	11,933,500	
JBCホールディングス	10,400	1,031.00	10,722,400	

サガミチェーン	10,900	1,394.00	15,194,600	貸付株式数 3,000株 (2,300株)
日 伝	5,300	2,324.00	12,317,200	
関西スーパーマーケット	5,300	1,262.00	6,688,600	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ミロク情報サービス	5,100	2,936.00	14,973,600	
北沢産業	33,100	287.00	9,499,700	
因幡電機産業	6,800	5,260.00	35,768,000	
王将フードサービス	3,900	4,980.00	19,422,000	
プレナス	6,200	2,346.00	14,545,200	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,600	2,334.00	10,736,400	
アークス	9,900	2,594.00	25,680,600	
パローホールディングス	12,500	2,617.00	32,712,500	
バイテックホールディングス	3,700	1,713.00	6,338,100	
ミスミグループ本社	63,000	3,275.00	206,325,000	
ベ ル ク	2,700	6,290.00	16,983,000	
ファーストリテイリング	9,100	43,510.00	395,941,000	貸付株式数 2,500株
ソフトバンクグループ	245,400	9,485.00	2,327,619,000	
スズケン	24,600	4,440.00	109,224,000	
サンドラッグ	23,200	5,170.00	119,944,000	
サックスパーホールディング	6,000	1,398.00	8,388,000	貸付株式数 1,800株
ジェコス	5,100	1,406.00	7,170,600	
ベルーナ	14,200	1,227.00	17,423,400	
合計			141,293,259,400	

(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。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成29年12月1日から平成30年5月31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。

【中間財務諸表】

年金ダイワ日本株式インデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 平成30年5月31日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託		2,462,384
コール・ローン		4,281,428
親投資信託受益証券		4,842,730,739
未収入金		2,784,000
流動資産合計		4,852,258,551
資産合計		4,852,258,551
負債の部		
流動負債		
未払解約金		4,902,855
未払受託者報酬		739,265
未払委託者報酬		3,449,988
その他未払費用		123,194
流動負債合計		9,215,302
負債合計		9,215,302
純資産の部		
元本等		
元本		1 3,734,469,314
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,108,573,935
（分配準備積立金）		1,320,861,697
元本等合計		4,843,043,249
純資産合計		4,843,043,249
負債純資産合計		4,852,258,551

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 平成29年12月1日 至 平成30年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	66,922,800
営業収益合計	66,922,800
営業費用	
支払利息	1,417
受託者報酬	739,265
委託者報酬	3,449,988
その他費用	123,225
営業費用合計	4,313,895
営業利益又は営業損失（ ）	71,236,695
経常利益又は経常損失（ ）	71,236,695
中間純利益又は中間純損失（ ）	71,236,695
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,362,585
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,077,816,508
剰余金増加額又は欠損金減少額	160,672,672
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	160,672,672
剰余金減少額又は欠損金増加額	61,041,135
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	61,041,135
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,108,573,935

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 平成29年12月1日 至 平成30年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成30年5月31日現在
1. 1 期首元本額	3,411,671,485円
期中追加設定元本額	515,839,606円
期中一部解約元本額	193,041,777円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,734,469,314口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成29年12月1日 至 平成30年5月31日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成30年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

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

（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

当中間計算期間末 平成30年5月31日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 平成30年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2968円 (12,968円)

（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、中間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、当ファンドの中間計算期間末日（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30年5月31日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,867,374,623
コール・ローン	6,724,333,158
株式 2 3	140,746,928,475
派生商品評価勘定	19,258,540
未収入金	987,840

未収配当金		1,183,162,340
未収利息		808,079
前払金		17,720,000
その他未収収益	4	23,217,075
流動資産合計		152,583,790,130
資産合計		152,583,790,130
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		25,924,140
未払解約金		70,061,700
受入担保金		9,275,763,000
その他未払費用		140,676
流動負債合計		9,371,889,516
負債合計		9,371,889,516
純資産の部		
元本等		
元本	1	130,441,146,325
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,770,754,289
元本等合計		143,211,900,614
純資産合計		143,211,900,614
負債純資産合計		152,583,790,130

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29年12月1日 至 平成30年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	<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。</p> <p>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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</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。</p> <p>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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</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。</p> <p>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30年5月31日現在
1. 1 期首	平成29年12月1日
期首元本額	128,627,233,302円
期中追加設定元本額	9,288,196,086円
期中一部解約元本額	7,474,283,063円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックス	4,170,198,428円
ファンド	

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	9,721,390,107円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドVA2	61,538,898円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	71,040,156円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,200,533,489円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	58,786,280円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,626,420,956円
D-I's TOPIXイン デックス	27,081,953円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	21,745,004円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	637,974円
iFree TOPIXイン デックス	495,697,500円
iFree 8資産バランス	862,959,379円
DCダイワ日本株式インデッ クス	62,863,383,161円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,327,234,529円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,510,039,076円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,427,828,638円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,410,903,306円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	15,008,044円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	49,058,874円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	14,593,445円

ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	330,547円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	338,072円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	676,615円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	2,160,411円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	4,779,668円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA(国内株式型)	10,239,884円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	234,954,399円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	162,509,645円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,996,448,139円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	58,004,356円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	66,229,447円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	859,818,096円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	129,181,252円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	225,110,840円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	99,439,448円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	7,492,469,208円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	89,525,125円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	1,694,473,668円
ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,351,697,654円

	ダイワライフスタイル25	174,970,735円
	ダイワライフスタイル50	616,175,702円
	ダイワライフスタイル75	522,270,600円
	DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)	13,713,263,617円
計		130,441,146,325円
2.	期末日における受益権の総数	130,441,146,325口
3.	2 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 8,796,093,500円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。
		株式 692,100,000円
5.	4 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21,447,362円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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

	平成30年5月31日 現在
--	---------------

種 類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	2,448,890,000	-	2,442,300,000	6,590,000
合計	2,448,890,000	-	2,442,300,000	6,590,000

(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30年5月31日現在
1口当たり純資産額	1.0979円
(1万口当たり純資産額)	(10,979円)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成30年6月29日

資産総額	4,833,515,709円
負債総額	3,083,485円
純資産総額（ - ）	4,830,432,224円
発行済数量	3,756,782,132口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.2858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30年6月29日

資産総額	155,156,224,427円
負債総額	11,773,371,253円
純資産総額（ - ）	143,382,853,174円
発行済数量	131,699,076,824口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.0887円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2018年6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年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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

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。

2018年6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	81	186,533
追加型株式投資信託	708	15,390,018
株式投資信託 合計	789	15,576,552
単位型公社債投資信託	25	99,407
追加型公社債投資信託	14	1,494,843
公社債投資信託 合計	39	1,594,250
総合計	828	17,170,801

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。
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、当事業年度（平成29年4月1日から平成30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。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,260	28,709
有価証券	110	0
前払費用	190	201
未収委託者報酬	10,453	12,368
未収収益	72	82
繰延税金資産	439	552
その他	34	47
流動資産計	42,560	41,962
固定資産		
有形固定資産	1	213
建物	15	12
器具備品	214	200
無形固定資産	2,650	2,614
ソフトウェア	2,323	2,456
ソフトウェア仮勘定	327	158
投資その他の資産	12,353	15,066
投資有価証券	5,920	8,600
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	185	183
長期差入保証金	1,050	1,072
繰延税金資産	31	45
その他	37	34
固定資産計	15,234	17,894
資産合計	57,795	59,856

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	79	65
未払金	9,466	9,747
未払収益分配金	7	8
未払償還金	59	59
未払手数料	4,453	5,202
その他未払金	2 4,946	2 4,476
未払費用	4,077	4,148
未払法人税等	980	850
未払消費税等	223	583
賞与引当金	945	1,012
その他	3	335
流動負債計	15,776	16,744
固定負債		
退職給付引当金	2,318	2,350
役員退職慰労引当金	151	125
その他	7	5
固定負債計	2,477	2,481
負債合計	18,254	19,225
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	12,231	13,370
利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	79,747	82,510
その他営業収益	727	733
営業収益計	80,474	83,244
営業費用		
支払手数料	40,110	40,392
広告宣伝費	549	673
調査費	9,436	9,816
調査費	904	955
委託調査費	8,531	8,860
委託計算費	793	839
営業雑経費	1,375	1,579
通信費	251	249
印刷費	501	500
協会費	50	53
諸会費	13	13
その他営業雑経費	557	762
営業費用計	52,265	53,300
一般管理費		
給料	5,833	5,840
役員報酬	416	377
給料・手当	3,940	3,973
賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195
租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316

役員退職慰労引当金繰入額	60	46
固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31 日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	92	75
投資有価証券売却益	224	210
有価証券償還益	94	17
その他	69	55
営業外収益計	481	359
営業外費用		
投資有価証券売却損	24	0
その他	75	29
営業外費用計	100	29
経常利益	16,935	18,741
特別損失		
MMF等償還関連費用	305	-
関係会社整理損失	-	333
特別損失計	305	333
税引前当期純利益	16,629	18,407
法人税、住民税及び事業税	6,501	5,843
法人税等調整額	1,405	106
法人税等合計	5,096	5,737
当期純利益	11,533	12,670

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	13,261	13,261	13,261
当期純利益	-	-	-	11,533	11,533	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,728	1,728	1,728
当期末残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	280	280	41,284
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	13,261
当期純利益	-	-	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	15	15	15
当期変動額合計	15	15	1,743
当期末残高	264	264	39,540

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414

	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	264	264	39,540
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	40,631

注記事項

(重要な会計方針)

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
----	--------

器具備品 4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取利息」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取利息」12百万円、「その他」56百万円は、「その他」69百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	26百万円	29百万円
器具備品	264百万円	235百万円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
未払金	4,877百万円	4,406百万円

3 保証債務

前事業年度(平成29年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,685百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(平成30年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29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28年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 3月31日	平成28年 6月24日

(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29年6月26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	11,532百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,421円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月27日

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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29年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 3月31日	平成29年 6月27日

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

平成30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	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30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、「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代行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リスクマネジメント会議において報告を行っております。

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	31,260	31,260	-
(2) 未収委託者報酬	10,453	10,453	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	5,060	5,060	-
資産計	46,774	46,774	-
(1) 未払手数料	(4,453)	(4,453)	-
(2) その他未払金	(4,946)	(4,946)	-
(3) 未払費用(*2)	(3,409)	(3,409)	-
負債計	(12,809)	(12,809)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 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30年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	28,709	28,709	-
(2) 未収委託者報酬	12,368	12,368	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,631	7,631	-
資産計	48,709	48,709	-
(1) 未払手数料	(5,202)	(5,202)	-
(2) その他未払金	(4,476)	(4,476)	-

(3) 未払費用(*2)	(3,286)	(3,286)	-
負債計	(12,965)	(12,965)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	970
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	1,050	1,072

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29年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,260	-	-	-
未収委託者報酬	10,453	-	-	-
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	110	2,876	1,139	110
合計	41,824	2,876	1,139	110

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

(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29年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,129百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

当事業年度(平成30年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,129百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

2. 其他有価証券

前事業年度(平成29年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	122	55	67
(2) その他			
証券投資信託	3,107	2,697	410
小計	3,230	2,752	478
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	1,829	1,926	96
小計	1,829	1,926	96
合計	5,060	4,679	381

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「其他有価証券」には含めていません。

当事業年度(平成30年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			

(1) 株式	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他 証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	50	-	1
(2) その他 証券投資信託	4,371	224	23
合計	4,421	224	24

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

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)

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いません。

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首 残高	2,209百万円	2,318百万円
勤務費用	202	159
退職給付の支払額	122	166
その他	29	38
退職給付債務の期末 残高	2,318	2,350

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,318百万円	2,350百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350
退職給付引当金	2,318	2,350
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
勤務費用	202百万円	159百万円
その他	87	24
確定給付制度に係る退職給付費用	289	184

3. 確定拠出制度

社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度173百万円、当事業年度171百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		719
	709	
賞与引当金	224	244
未払事業税	169	162
出資金評価損	98	94
投資有価証券評価損	65	68
連結法人間取引（譲渡損）	5	5
その他	185	308
繰延税金資産小計	1,458	1,602
評価性引当額	201	200
繰延税金資産合計	1,257	1,402
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	639	639
その他有価証券評価差額金	146	164
繰延税金負債合計	786	804
繰延税金資産の純額	470	598

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

前事業年度（平成29年3月31日）

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。

当事業年度（平成30年3月31日）

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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,685	-	-

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29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,701	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	-------------	------	---------	-------	---	---

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28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,238	未払手数料	3,298
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	768	未払費用	218
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,036	長期差入保証金	1,028

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

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

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

前事業年度 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）		当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	
1株当たり純資産額	15,158.25円	1株当たり純資産額	15,576.40円
1株当たり当期純利益	4,421.51円	1株当たり当期純利益	4,857.40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28年4月1日 至 平成29年3月31日）	当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
当期純利益（百万円）	11,533	12,670
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。

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（2018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 (2018年3月 末日現在)	事業の内容
日本生命保険相互会社	1,350,000	(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（2018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。
委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

UD FONT マークおよび説明文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30年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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29年4月1日から平成30年3月31日までの第59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30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29年12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 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28年12月1日から平成29年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金ダイワ日本株式インデックスの平成29年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . 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30年7月6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29年12月1日から平成30年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、年金ダイワ日本株式インデックスの平成30年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年12月1日から平成30年5月31日まで）の損益の状況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

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。