

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成28年2月22日提出
【計算期間】	第9計算期間 (自 平成26年12月2日 至 平成27年11月30日)
【ファンド名】	年金ダイワ日本株式インデックス
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 白川 真
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山村 政
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3111
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【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（昭和43年）1月4日（基準時）の時価総額を100として1969年（昭和44年）7月1日から東京証券取引所が算出・公表しています（注1参照）。

◆ 東証株価指数（TOPIX）の特徴

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

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

（注1）TOPIXの算出方法：

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

（注2）基準時の時価総額の修正方法：

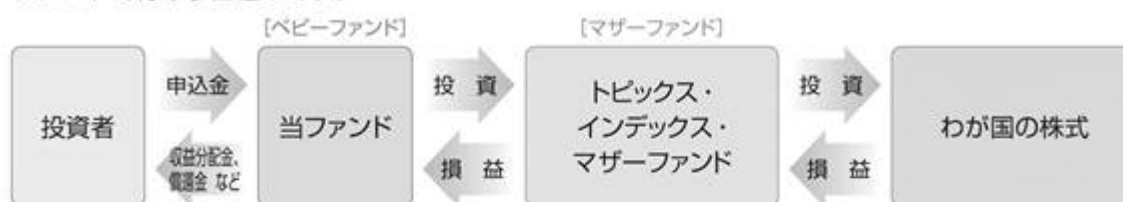
$$\text{修正後の基準時価総額} = \text{修正前日の基準時価総額} \times \\ (\text{修正前日の時価総額} \pm \text{修正額}) \div \text{修正前日の時価総額}$$

- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利、ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。
- ② (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ③ (株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 本件インデックスファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ (株)東京証券取引所は、本件インデックスファンドの購入者または公衆に対し、本件インデックスファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦ (株)東京証券取引所は、当社または本件インデックスファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は本件インデックスファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

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

2

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

3

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

〈分配方針〉

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

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成18年10月27日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）
お取扱窓口	<p>販売会社</p> <p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>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</p> <p style="text-align: right;">など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3）
委託会社	<p>大和証券投資信託委託株式会社</p> <p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>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</p> <p style="text-align: right;">など</p>
運用指図	損益 信託金（ 3）
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社</p> <p>信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>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</p> <p style="text-align: right;">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收受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

< 委託会社の概況（平成27年12月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

投資態度

- イ．投資成果を東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
- ロ．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として、信託財産総額の50%以下とします。
- 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

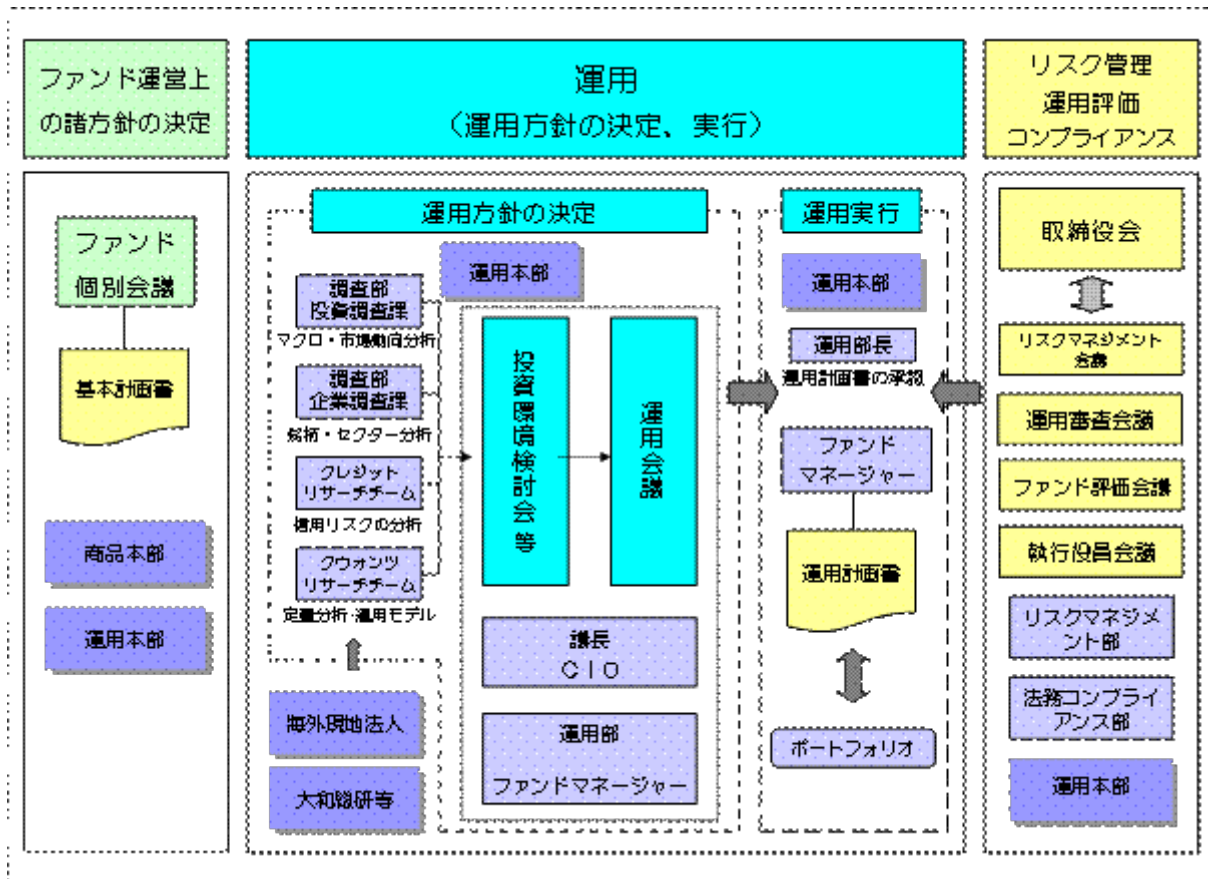
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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。

ニ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから

提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．CIO(Chief Investment Officer)(1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO(1~5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー(1~5名程度)

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

ニ．運用部長(各運用部に1名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25~35名程度です。

イ．ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

ロ．運用審査会議

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

ハ．リスクマネジメント会議

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

ニ．執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

上記の運用体制は平成27年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等（信託約款）

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

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、分散投資を行いません。

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

株価指数先物取引の利用に伴うリスク

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

その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

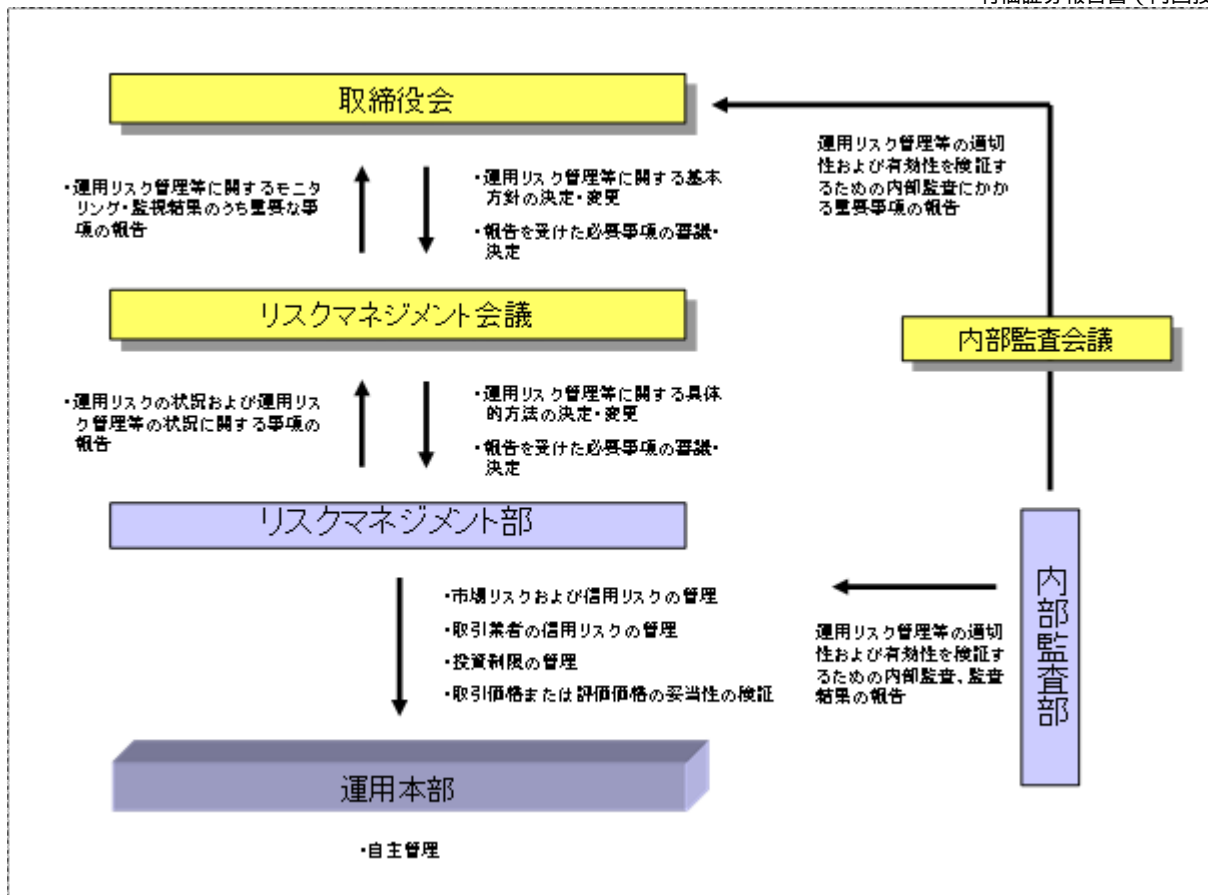
(3) その他の留意点

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

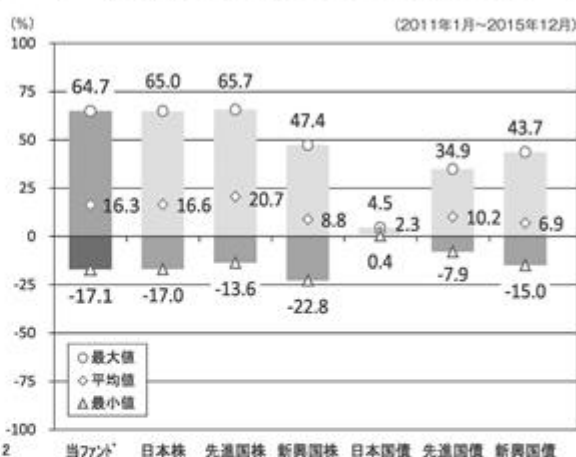
参 考 情 報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に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：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス— 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、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス— 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 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（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、平成28年1月1日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（ ）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成27年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,245,146,025	100.00
内 日本	3,245,146,025	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	32,332	0.00
純資産総額	3,245,178,357	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27年12月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	トピックス・インデックス・マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	3,517,773,469	0.9405 3,308,675,920	0.9225 3,245,146,025	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.00%
合計	100.00%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成19年11月30日)	81,855,912	81,855,912	0.9320	0.9320
第2計算期間末 (平成20年12月1日)	173,040,952	173,040,952	0.5128	0.5128
第3計算期間末 (平成21年11月30日)	361,629,918	361,629,918	0.5292	0.5292
第4計算期間末 (平成22年11月30日)	583,936,066	583,936,066	0.5526	0.5526
第5計算期間末 (平成23年11月30日)	701,141,147	701,141,147	0.4777	0.4777
第6計算期間末 (平成24年11月30日)	994,840,569	994,840,569	0.5241	0.5241
第7計算期間末 (平成25年12月2日)	1,802,195,101	1,802,195,101	0.8588	0.8588
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
平成26年12月末日	2,501,745,343	-	0.9781	-
平成27年1月末日	2,531,218,277	-	0.9834	-
2月末日	2,699,317,015	-	1.0592	-
3月末日	2,792,460,009	-	1.0809	-
4月末日	2,896,652,929	-	1.1158	-
5月末日	3,196,145,415	-	1.1730	-
6月末日	3,173,222,785	-	1.1436	-
7月末日	3,293,418,826	-	1.1637	-
8月末日	3,094,882,696	-	1.0780	-
9月末日	2,906,092,116	-	0.9972	-
10月末日	3,238,426,072	-	1.1009	-
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
12月末日	3,245,178,357	-	1.0947	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.8
第2計算期間	45.0
第3計算期間	3.2
第4計算期間	4.4
第5計算期間	13.6
第6計算期間	9.7
第7計算期間	63.9
第8計算期間	14.9
第9計算期間	13.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	88,134,563	1,304,551
第2計算期間	256,258,194	6,653,498
第3計算期間	366,384,982	20,413,545
第4計算期間	397,758,878	24,516,478
第5計算期間	464,858,243	53,854,727
第6計算期間	571,631,321	141,136,727
第7計算期間	474,197,635	273,895,816
第8計算期間	894,786,317	478,329,687
第9計算期間	1,113,060,946	686,945,413

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成27年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	128,833,561,970	98.72
内 日本	128,833,561,970	98.72
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,675,193,276	1.28
純資産総額	130,508,755,246	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,655,825,000	1.27
内 日本	1,655,825,000	1.27

(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27年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	700,700	7,100.64 4,975,424,432	7,488.00 5,246,841,600	4.02
2 三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,457,300	723.39 3,224,408,535	757.10 3,374,621,830	2.59
3 日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	429,800	4,328.51 1,860,397,153	4,836.00 2,078,512,800	1.59
4 三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	444,300	4,572.48 2,031,555,480	4,606.00 2,046,445,800	1.57
5 本田技研	日本	株式	輸送用 機器	506,600	3,686.80 1,867,733,600	3,910.00 1,980,806,000	1.52

6	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	315,400	5,935.69 1,872,117,198	6,139.00 1,936,240,600	1.48
7	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,816,900	228.21 1,783,922,409	243.50 1,903,415,150	1.46
8	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	564,900	2,724.31 1,538,966,662	3,154.00 1,781,694,600	1.37
9	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	372,800	3,990.76 1,487,757,632	4,471.00 1,666,788,800	1.28
10	武田薬品	日本	株式	医薬品	234,700	5,467.21 1,283,155,408	6,065.00 1,423,455,500	1.09
11	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	232,300	5,288.96 1,228,625,720	5,550.00 1,289,265,000	0.99
12	ファナック	日本	株式	電気機 器	57,600	19,633.52 1,130,891,288	21,080.00 1,214,208,000	0.93
13	ソニー	日本	株式	電気機 器	398,100	3,031.25 1,206,743,145	3,002.00 1,195,096,200	0.92
14	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	102,900	10,175.32 1,047,040,710	11,450.00 1,178,205,000	0.90
15	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	659,900	1,577.50 1,040,993,210	1,731.50 1,142,616,850	0.88
16	キヤノン	日本	株式	電気機 器	302,100	3,520.03 1,063,401,606	3,675.00 1,110,217,500	0.85
17	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	50,400	18,763.00 945,655,230	21,600.00 1,088,640,000	0.83
18	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	428,900	2,153.13 923,478,741	2,484.00 1,065,387,600	0.82
19	東京海上HD	日本	株式	保険業	224,200	4,318.48 968,204,632	4,712.00 1,056,430,400	0.81
20	三菱地所	日本	株式	不動産 業	413,000	2,392.31 988,027,870	2,523.50 1,042,205,500	0.80
21	村田製作所	日本	株式	電気機 器	59,100	16,121.42 952,775,950	17,570.00 1,038,387,000	0.80
22	日産自動車	日本	株式	輸送用 機器	790,900	1,111.80 879,323,790	1,279.50 1,011,956,550	0.78
23	日立	日本	株式	電気機 器	1,437,000	625.79 899,269,770	691.50 993,685,500	0.76
24	花王	日本	株式	化学	158,500	5,102.03 808,672,406	6,255.00 991,417,500	0.76
25	三井不動産	日本	株式	不動産 業	294,000	3,120.05 917,297,550	3,056.00 898,464,000	0.69

26	富士重工業	日本	株式	輸送用 機器	177,700	4,244.19 754,192,617	5,027.00 893,297,900	0.68
27	キーエンス	日本	株式	電気機 器	12,700	52,900.00 671,830,000	67,080.00 851,916,000	0.65
28	三菱商事	日本	株式	卸売業	416,800	2,077.00 865,693,600	2,028.00 845,270,400	0.65
29	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	198,500	4,151.77 824,126,852	4,174.00 828,539,000	0.63
30	デンソー	日本	株式	輸送用 機器	138,500	5,342.48 739,934,796	5,818.00 805,793,000	0.62

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.72%
合計	98.72%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.11%
鉱業	0.35%
建設業	2.90%
食料品	4.52%
繊維製品	0.74%
パルプ・紙	0.23%
化学	6.01%
医薬品	5.31%
石油・石炭製品	0.47%
ゴム製品	0.87%
ガラス・土石製品	0.92%
鉄鋼	1.21%
非鉄金属	0.89%
金属製品	0.64%
機械	4.54%
電気機器	11.62%
輸送用機器	10.61%
精密機器	1.55%

その他製品	1.46%
電気・ガス業	2.09%
陸運業	4.39%
海運業	0.24%
空運業	0.63%
倉庫・運輸関連業	0.21%
情報・通信業	7.36%
卸売業	3.89%
小売業	4.72%
銀行業	9.02%
証券、商品先物取引業	1.16%
保険業	2.59%
その他金融業	1.33%
不動産業	2.69%
サービス業	3.44%
合計	98.72%

(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 2016年3月	買建	107	1,653,143,650	1,655,825,000	1.27%

(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

2015年12月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,947円
純資産総額	32億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-2.0%
3カ月間	9.8%
6カ月間	-4.3%
1年間	11.9%
3年間	89.7%
5年間	89.6%
設定来	9.5%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9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		
分配金	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。

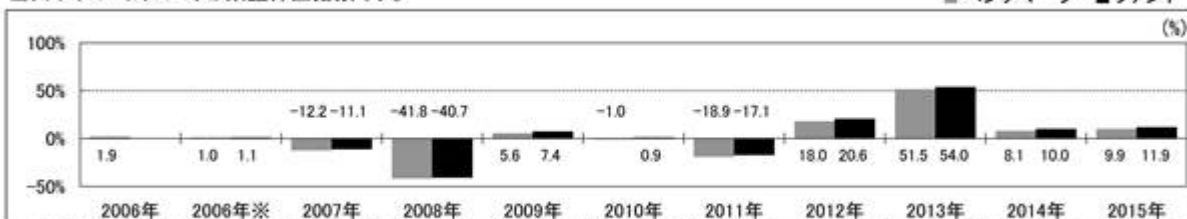
資産別構成			株式東証33業種別構成			組入上位10銘柄		
銘柄数	比率		銘柄数	比率		銘柄名	比率	
国内株式	1,399	98.7%	電気機器	11.6%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.0%	
国内株式先物	1	1.3%	輸送用機器	10.6%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.6%	
不動産投資信託等	-	-	銀行業	9.0%	日本電信電話	情報・通信業	1.6%	
コール・ローン、その他	-	1.3%	情報・通信業	7.4%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.6%	
合計	1,400	-	化学	6.0%	本田技研	輸送用機器	1.5%	
株式市場・上場別構成			医薬品	5.3%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.5%	
一部(東証・名証)		98.7%	小売業	4.7%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.5%	
二部(東証・名証)		-	機械	4.5%	KDDI	情報・通信業	1.4%	
新興市場他		-	食料品	4.5%	日本たばこ産業	食料品	1.3%	
その他		-	その他	35.0%	TOPIX先物 2803月	-	1.3%	
合計		98.7%	合計	98.7%	合計		18.1%	

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■ベンチマーク ■ファンド



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

・2006年※は設定日(10月27日)から年末、2015年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

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

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

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

2 【換金(解約)手続等】

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

<一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

信託の終了

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

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

信託約款の変更

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

反対者の買取請求権

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

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

公告

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

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

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

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

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

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

償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとし、

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

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間（平成26年12月2日から平成27年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

年金ダイワ日本株式インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 平成26年12月1日現在	第9期 平成27年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,004,963	6,350,980
親投資信託受益証券	2,481,901,133	3,284,082,442
流動資産合計	2,486,906,096	3,290,433,422
資産合計	2,486,906,096	3,290,433,422
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,545,658	3,340,341
未払受託者報酬	353,702	510,596
未払委託者報酬	1,650,772	2,382,957
その他未払費用	58,873	85,023
流動負債合計	4,609,005	6,318,917
負債合計	4,609,005	6,318,917
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 2,514,905,104	¹ 2,941,020,637
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 32,608,013	² 343,093,868
（分配準備積立金）	759,822,352	832,701,297
元本等合計	2,482,297,091	3,284,114,505
純資産合計	2,482,297,091	3,284,114,505
負債純資産合計	2,486,906,096	3,290,433,422

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自 至	平成25年12月3日 平成26年12月1日	自 至	平成26年12月2日 平成27年11月30日
営業収益				
受取利息		1,081		1,819
有価証券売買等損益		330,128,098		319,419,309
営業収益合計		330,129,179		319,421,128
営業費用				
受託者報酬		631,491		940,279
委託者報酬		2,947,293		4,388,214
その他費用		105,964		156,557
営業費用合計		3,684,748		5,485,050
営業利益		326,444,431		313,936,078
経常利益		326,444,431		313,936,078
当期純利益		326,444,431		313,936,078
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（ ）		6,183,920		63,219,165
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		296,253,373		32,608,013
剰余金増加額又は欠損金減少額		69,074,369		125,818,543
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		69,074,369		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		125,818,543
剰余金減少額又は欠損金増加額		138,057,360		833,575
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		833,575
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		138,057,360		-
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		32,608,013		343,093,868

(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9期	
	自 平成26年12月2日	至 平成27年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 平成26年11月30日が休日のため、前計算期間末日を平成26年12月1日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第8期	第9期
	平成26年12月1日現在	平成27年11月30日現在
1. 1 期首元本額	2,098,448,474円	2,514,905,104円
期中追加設定元本額	894,786,317円	1,113,060,946円
期中一部解約元本額	478,329,687円	686,945,413円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,514,905,104口	2,941,020,637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32,608,013円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第8期	第9期
	自 平成25年12月3日 至 平成26年12月1日	自 平成26年12月2日 至 平成27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(1,081円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(332,627,270円)、投資信託約款に規定される収益調整金(210,680,670円)及び分配準備積立金(427,194,001円)より分配可能額は970,503,022円(1万口当たり3,859.00円)であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,686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(250,715,227円)、投資信託約款に規定される収益調整金(552,954,690円)及び分配準備積立金(581,984,384円)より分配可能額は1,385,655,987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>
------------	---	---

(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9期 自 平成26年12月2日 至 平成27年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第9期 平成27年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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8期 平成26年12月1日現在	第9期 平成27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	337,113,668	270,522,050
合計	337,113,668	270,522,050

(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8期 平成26年12月1日現在	第9期 平成27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9期
自 平成26年12月2日
至 平成27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8期 平成26年12月1日現在	第9期 平成27年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9870円 (9,870円)	1.1167円 (11,167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	3,490,362,889	3,284,082,442	
親投資信託受益証券 合計			3,284,082,442	
合計			3,284,082,442	

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26年12月1日現在	平成27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	7,759,929,209	3,147,726,099
株式 3 4	128,429,278,710	131,197,269,060
派生商品評価勘定	72,039,299	81,594,183
未収入金	12,441,011	300,304,490
未収配当金	471,202,375	660,850,866
その他未収収益 5	11,002,355	14,767,385
流動資産合計	136,755,892,959	135,402,512,083
資産合計	136,755,892,959	135,402,512,083
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	3,715,396
前受金	61,605,000	85,705,000
未払金	309,731,152	-
未払解約金	170,291,500	180,292,000
未払利息	139,310	61,555
受入担保金	6,369,936,457	2,739,805,530
その他未払費用	49,744	-
流動負債合計	6,911,753,163	3,009,579,481
負債合計	6,911,753,163	3,009,579,481
純資産の部		
元本等		
元本 1	156,429,196,684	140,709,507,157
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金() 2	26,585,056,888	8,316,574,555
元本等合計	129,844,139,796	132,392,932,602
純資産合計	129,844,139,796	132,392,932,602
負債純資産合計	136,755,892,959	135,402,512,083

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26年12月2日 至 平成27年11月30日
----	-------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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られ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られ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26年12月1日現在	平成27年11月30日現在
1. 1 期首	平成25年12月3日	平成26年12月2日
期首元本額	172,799,217,116円	156,429,196,684円
期中追加設定元本額	13,085,758,738円	11,811,404,364円
期中一部解約元本額	29,455,779,170円	27,531,093,891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	1,649,409,274円	1,617,325,422円
トピックス・インデックス	6,873,376,545円	5,759,733,101円
ファンド		
ダイワ・トピックス・イン	20,854,254,321円	16,707,119,660円
デックスファンドVA		
適格機関投資家専用・ダイ	281,828,838円	168,688,902円
ワ・トピックスインデックス		
ファンドVA2		
ダイワ国内重視バランスファ	257,375,152円	194,943,748円
ンド30VA(一般投資家私		
募)		

ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	4,407,636,350円	3,001,554,339円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	204,772,382円	130,280,454円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	6,079,456,236円	4,148,883,429円
D-I's TOPIXイン デックス	26,531,872円	33,524,767円
DCダイワ日本株式インデッ クス	61,223,159,280円	61,010,045,853円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,980,050,202円	1,858,797,670円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,046,507,975円	2,014,704,231円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,750,405,350円	1,915,630,247円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	2,989,882,103円	3,490,362,889円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	22,554,312円	22,797,202円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	40,879,759円	50,793,788円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	7,231,848円	10,007,790円
ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	24,797,025円	1,441,372円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	80,684,863円	3,254,423円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	47,683,722円	5,937,998円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	71,973,936円	65,615,632円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	421,849,875円	361,268,786円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA(国内株式型)	222,221,290円	181,226,317円
ダイワ世界バランスファン ド40VA	2,252,789,966円	1,558,534,214円

	ダイワ世界バランスファンド 60VA	329,991,054円	229,342,532円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA	20,413,387,713円	15,530,969,176円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	631,978,000円	409,871,701円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	1,382,469,239円	703,533,678円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専 用）	1,599,512,026円	1,239,069,922円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA（適格機関投資家専 用）	315,436,365円	197,613,241円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA（適格機関投資家専 用）	374,256,369円	308,115,317円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	395,865,319円	687,128,241円
	ダイワライフスタイル25	183,009,725円	190,099,286円
	ダイワライフスタイル50	607,535,054円	597,223,153円
	ダイワライフスタイル75	468,369,062円	465,107,454円
	DC・ダイワ・トピックス・ インデックス（確定拠出年金 専用ファンド）	15,910,074,282円	15,838,961,222円
	計	156,429,196,684円	140,709,507,157円
2.	期末日における受益権の総数	156,429,196,684口	140,709,507,157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26,585,056,888円であ ります。	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は8,316,574,555円であり ます。
4.	3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 6,226,031,650円	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 2,594,940,450円

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 742,900,000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 765,700,000円
6.	5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分10,071,900円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分14,105,650円が含まれております。

(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26年12月2日 至 平成27年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成27年11月30日現在
-----	---------------

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成26年12月1日現在	平成27年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	8,243,384,272	12,572,725,549
合計	8,243,384,272	12,572,725,549

（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26年9月20日から平成26年12月1日まで、及び平成27年9月25日から平成27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26年12月1日 現在				平成27年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	1,137,140,000	-	1,209,550,000	72,410,000	1,187,395,000	-	1,265,600,000	78,205,000
合計	1,137,140,000	-	1,209,550,000	72,410,000	1,187,395,000	-	1,265,600,000	78,205,000

（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26年12月1日現在	平成27年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8301円 (8,301円)	0.9409円 (9,409円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	35,000	267.00	9,345,000	
日本水産	76,200	423.00	32,232,600	
マルハニチロ	14,000	1,959.00	27,426,000	
サカタのタネ	10,700	2,481.00	26,546,700	
ホクト	7,000	2,334.00	16,338,000	
ショーボンドHD	6,300	4,865.00	30,649,500	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
ミライト・ホールディングス	20,400	999.00	20,379,600	
日鉄鉱業	19,000	588.00	11,172,000	
三井松島	52,000	132.00	6,864,000	
国際石油開発帝石	332,200	1,222.50	406,114,500	
日本海洋掘削	2,500	2,970.00	7,425,000	貸付株式数 700株 (700株)
石油資源開発	10,100	3,415.00	34,491,500	
K&Oエナジーグループ	5,100	1,702.00	8,680,200	
安藤・間	42,800	691.00	29,574,800	
東急建設	20,800	831.00	17,284,800	
コムシスホールディングス	28,600	1,655.00	47,333,000	
ミサワホーム	8,600	941.00	8,092,600	
高松コンストラクショングP	5,300	2,640.00	13,992,000	
東建コーポレーション	2,500	9,670.00	24,175,000	貸付株式数 700株
大成建設	326,000	759.00	247,434,000	

大林組	190,000	1,137.00	216,030,000	
清水建設	194,000	1,033.00	200,402,000	
飛鳥建設	44,700	203.00	9,074,100	貸付株式数 13,200株 (13,200株)
長谷工コーポレーション	74,100	1,376.00	101,961,600	
松井建設	10,300	780.00	8,034,000	
銭高組	10,000	555.00	5,550,000	
鹿島建設	297,000	676.00	200,772,000	
不動産トラ	49,500	149.00	7,375,500	貸付株式数 14,700株
鉄建建設	41,000	315.00	12,915,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
西松建設	72,000	485.00	34,920,000	
三井住友建設	247,500	121.00	29,947,500	貸付株式数 75,200株
大豊建設	25,000	627.00	15,675,000	貸付株式数 6,000株
前田建設	40,000	743.00	29,720,000	
ナカノフドー建設	6,500	767.00	4,985,500	
奥村組	61,000	673.00	41,053,000	
東鉄工業	8,000	2,759.00	22,072,000	
浅沼組	23,000	298.00	6,854,000	
戸田建設	75,000	698.00	52,350,000	
熊谷組	92,000	345.00	31,740,000	
北野建設	20,000	341.00	6,820,000	
三井ホーム	13,000	583.00	7,579,000	
矢作建設	9,500	853.00	8,103,500	
ピーエス三菱	12,800	418.00	5,350,400	
日本ハウスHLDGS	14,300	469.00	6,706,700	貸付株式数 3,900株 (800株)
大東建託	23,300	12,790.00	298,007,000	
新日本建設	9,900	707.00	6,999,300	
NIPPO	15,000	2,088.00	31,320,000	
東亜道路	14,000	478.00	6,692,000	
前田道路	20,000	2,046.00	40,920,000	
日本道路	20,000	611.00	12,220,000	
東亜建設	58,000	327.00	18,966,000	
若築建設	44,000	152.00	6,688,000	貸付株式数 12,000株
東洋建設	20,700	534.00	11,053,800	
五洋建設	70,900	489.00	34,670,100	
大林道路	8,000	857.00	6,856,000	
世紀東急	11,300	633.00	7,152,900	
福田組	11,000	1,293.00	14,223,000	

住友林業	44,000	1,658.00	72,952,000	
日本基礎技術	9,000	513.00	4,617,000	
日成ビルド工業	20,000	368.00	7,360,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
パナホーム	25,000	921.00	23,025,000	
大和ハウス	187,000	3,429.00	641,223,000	
ライト工業	12,700	1,135.00	14,414,500	
積水ハウス	210,900	2,081.50	438,988,350	
日特建設	8,500	503.00	4,275,500	貸付株式数 3,000株
ユアテック	11,000	1,241.00	13,651,000	
中電工	9,500	2,650.00	25,175,000	
関電工	25,000	844.00	21,100,000	
きんでん	38,000	1,674.00	63,612,000	
東京エネシス	8,000	1,083.00	8,664,000	
トーエネック	10,000	884.00	8,840,000	
住友電設	5,800	1,679.00	9,738,200	
日本電設工業	10,700	2,334.00	24,973,800	
協和エクシオ	25,100	1,242.00	31,174,200	
日本工営	23,000	463.00	10,649,000	
九電工	12,000	2,241.00	26,892,000	貸付株式数 3,000株
三機工業	15,700	1,112.00	17,458,400	
日揮	63,000	2,092.00	131,796,000	
中外炉工業	28,000	222.00	6,216,000	
太平電業	9,000	1,157.00	10,413,000	
高砂熱学	19,200	1,739.00	33,388,800	
NEC ネットズエスアイ	7,200	2,207.00	15,890,400	
明星工業	13,800	537.00	7,410,600	
大気社	7,900	2,925.00	23,107,500	
ダイダン	10,000	908.00	9,080,000	
日比谷総合設備	8,700	1,699.00	14,781,300	
東芝プラントシステム	9,800	1,188.00	11,642,400	
日本製粉	43,000	839.00	36,077,000	
日清製粉G本社	69,500	1,934.00	134,413,000	
昭和産業	29,000	483.00	14,007,000	
中部飼料	7,300	1,098.00	8,015,400	
フィード・ワン	47,200	138.00	6,513,600	
日本甜菜糖	49,000	203.00	9,947,000	
三井製糖	27,000	547.00	14,769,000	
ネクスト	17,700	1,367.00	24,195,900	
日本M&Aセンター	9,300	5,500.00	51,150,000	

アコーディア・ゴルフ	16,300	1,107.00	18,044,100	
タケエイ	5,900	1,018.00	6,006,200	貸付株式数 1,600株
パソナグループ	5,800	905.00	5,249,000	
G C Aサヴィアン	5,900	1,277.00	7,534,300	
エス・エム・エス	7,800	2,400.00	18,720,000	
テンプホールディングス	41,500	1,988.00	82,502,000	
クックパッド	13,400	2,659.00	35,630,600	
森永製菓	59,000	639.00	37,701,000	
中村屋	23,000	477.00	10,971,000	
江崎グリコ	14,500	6,190.00	89,755,000	
不二家	51,000	203.00	10,353,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
山崎製パン	46,000	2,315.00	106,490,000	
第一屋製パン	44,000	119.00	5,236,000	
モロゾフ	21,000	439.00	9,219,000	
亀田製菓	3,900	4,530.00	17,667,000	
寿スピリッツ	1,900	5,080.00	9,652,000	
カルビー	23,300	5,090.00	118,597,000	
森永乳業	59,000	573.00	33,807,000	
六甲バター	3,800	1,856.00	7,052,800	
ヤクルト	33,700	6,080.00	204,896,000	貸付株式数 9,500株
明治ホールディングス	37,400	9,850.00	368,390,000	
雪印メグミルク	15,200	2,894.00	43,988,800	
プリマハム	44,000	329.00	14,476,000	
日本ハム	46,000	2,379.00	109,434,000	
伊藤ハム	32,000	628.00	20,096,000	
丸大食品	37,000	462.00	17,094,000	
米久	2,700	2,298.00	6,204,600	
S Foods	4,600	2,098.00	9,650,800	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
スタジオアリス	3,500	2,175.00	7,612,500	
シミックホールディングス	3,400	1,663.00	5,654,200	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
システナ	7,400	1,231.00	9,109,400	
デジタルアーツ	3,300	2,060.00	6,798,000	
新日鉄住金SOL	4,800	5,700.00	27,360,000	
総合警備保障	19,700	5,920.00	116,624,000	
日本駐車場開発	69,200	150.00	10,380,000	貸付株式数 19,500株 (1,800株)
カカクコム	42,900	2,348.00	100,729,200	

ディップ	6,800	2,804.00	19,067,200	貸付株式数 1,900株 (100株)
SBSホールディングス	6,100	1,186.00	7,234,600	
ツクイ	7,700	1,340.00	10,318,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
エムスリー	51,000	2,708.00	138,108,000	貸付株式数 14,400株 (14,400株)
ツカダ・グローバルHOLD	6,100	817.00	4,983,700	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
アウトソーシング	3,100	3,200.00	9,920,000	
ウェルネット	2,800	2,611.00	7,310,800	
ディー・エヌ・エー	26,700	1,938.00	51,744,600	貸付株式数 8,000株
博報堂DYHLDGS	81,700	1,322.00	108,007,400	
ぐるなび	7,200	2,533.00	18,237,600	
一休	4,600	2,430.00	11,178,000	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
ファンコミュニケーションズ	14,900	829.00	12,352,100	貸付株式数 3,100株
サッポロホールディングス	98,000	542.00	53,116,000	
アサヒグループホールディング	117,300	3,860.00	452,778,000	
麒麟HD	256,400	1,731.50	443,956,600	
宝ホールディングス	47,500	942.00	44,745,000	
オエノンホールディングス	36,000	227.00	8,172,000	
コカ・コーラウエスト	21,500	2,491.00	53,556,500	
コカ・コーライーストジャパン	22,300	1,814.00	40,452,200	
サントリー食品インター	42,800	4,805.00	205,654,000	
ダイドードリンコ	3,400	5,480.00	18,632,000	
伊藤園	18,900	2,814.00	53,184,600	貸付株式数 5,500株 (5,500株)
キーコーヒー	6,700	1,944.00	13,024,800	
日清オイリオグループ	36,000	477.00	17,172,000	
不二製油グループ	17,100	1,842.00	31,498,200	
J-オイルミルズ	32,000	349.00	11,168,000	
ローソン	20,700	9,350.00	193,545,000	
サンエー	4,000	5,380.00	21,520,000	
カワチ薬品	4,800	2,439.00	11,707,200	
エービーシー・マート	6,800	6,700.00	45,560,000	
ハードオフコーポレーション	3,800	1,482.00	5,631,600	
アスクル	5,800	5,330.00	30,914,000	貸付株式数 1,500株

ゲオホールディングス	11,000	1,954.00	21,494,000	貸付株式数 3,000株 (900株)
アダストリア	5,200	7,260.00	37,752,000	
くらコーポレーション	3,600	4,180.00	15,048,000	
キャンドウ	4,600	1,562.00	7,185,200	貸付株式数 1,300株 (100株)
パル	3,600	3,060.00	11,016,000	
JALUX	2,300	2,782.00	6,398,600	
エディオン	23,300	981.00	22,857,300	貸付株式数 8,800株
あらた	2,700	2,680.00	7,236,000	
J Pホールディングス	19,100	344.00	6,570,400	貸付株式数 6,100株 (2,000株)
あみやき亭	1,500	4,495.00	6,742,500	
ひらまつ	9,200	757.00	6,964,400	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
フィールズ	4,200	2,073.00	8,706,600	
双日	355,800	270.00	96,066,000	
ゲンキー	1,300	4,580.00	5,954,000	貸付株式数 200株
アルフレッサホールディングス	69,800	2,440.00	170,312,000	
ハニーズ	6,700	1,036.00	6,941,200	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
キッコーマン	48,000	4,055.00	194,640,000	
味の素	134,000	2,822.50	378,215,000	
キューピー	31,900	2,953.00	94,200,700	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ハウス食品G本社	21,200	2,169.00	45,982,800	
カゴメ	22,500	2,080.00	46,800,000	貸付株式数 7,500株 (7,500株)
アリアケジャパン	5,400	5,820.00	31,428,000	
ニチレイ	69,000	806.00	55,614,000	
横浜冷凍	15,200	979.00	14,880,800	貸付株式数 4,300株
東洋水産	30,500	4,400.00	134,200,000	
日清食品HD	26,000	6,250.00	162,500,000	
永谷園ホールディングス	8,000	1,112.00	8,896,000	
フジッコ	6,900	2,207.00	15,228,300	
ロックフィールド	4,200	3,055.00	12,831,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
日本たばこ産業	372,800	4,410.00	1,644,048,000	
わらべや日洋	4,100	2,373.00	9,729,300	

ユーグレナ	21,300	1,696.00	36,124,800	貸付株式数 5,400株 (5,200株)
片倉工業	8,800	1,329.00	11,695,200	
グ ン ゼ	51,000	371.00	18,921,000	
ヒューリック	115,900	1,130.00	130,967,000	
アルペン	5,500	2,071.00	11,390,500	
クオール	6,200	1,793.00	11,116,600	
アルコニックス	4,900	1,723.00	8,442,700	
神戸物産	3,700	4,600.00	17,020,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
ジェイアイエヌ	4,000	5,360.00	21,440,000	
ビックカメラ	29,000	1,132.00	32,828,000	貸付株式数 7,200株
D C Mホールディングス	27,900	844.00	23,547,600	
M o n o t a R O	19,700	3,530.00	69,541,000	
あい ホールディングス	9,200	3,120.00	28,704,000	
アークランドサービス	1,200	5,440.00	6,528,000	貸付株式数 300株 (300株)
J . フロント リテイリ ング	71,200	2,031.00	144,607,200	
ドトール・日レスHD	10,200	1,917.00	19,553,400	
マツモトキヨシH L D G S	11,500	6,320.00	72,680,000	
ブロンコビリー	2,700	2,440.00	6,588,000	貸付株式数 300株
スタートトゥデイ	17,300	4,275.00	73,957,500	
物語コーポレーション	1,900	5,040.00	9,576,000	
ココカラファイン	6,000	4,825.00	28,950,000	
三越伊勢丹HD	111,200	1,877.00	208,722,400	
東洋紡	240,000	180.00	43,200,000	
ユニチカ	197,000	59.00	11,623,000	
富士紡ホールディングス	37,000	229.00	8,473,000	
日清紡ホールディングス	32,100	1,456.00	46,737,600	
倉敷紡績	66,000	223.00	14,718,000	
ダイワボウHD	56,000	259.00	14,504,000	
シキボウ	48,000	124.00	5,952,000	
日東紡績	43,000	358.00	15,394,000	
トヨタ紡織	19,800	2,649.00	52,450,200	
マクニカ・富士エレH L D G S	10,300	1,645.00	16,943,500	
ウエルシアHD	4,900	6,790.00	33,271,000	
クリエイトSDH	2,900	8,020.00	23,258,000	
バイタルK S K HD	10,600	999.00	10,589,400	

U K C ホールディングス	3,900	2,659.00	10,370,100	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
T O K A I ホールディングス	29,300	539.00	15,792,700	
三洋貿易	5,200	1,484.00	7,716,800	
チムニー	1,700	3,310.00	5,627,000	
ジョイフル本田	8,500	2,468.00	20,978,000	貸付株式数 1,800株
すかいらく	17,000	1,680.00	28,560,000	貸付株式数 5,100株
日本毛織	20,000	934.00	18,680,000	
ダイドーリミテッド	14,700	503.00	7,394,100	
ユナイテッド・スーパーマー ケ	19,200	1,037.00	19,910,400	
野村不動産H L D G S	36,400	2,411.00	87,760,400	
三重交通グループHD	12,700	472.00	5,994,400	
プレサンスコーポレーション	2,000	4,250.00	8,500,000	
ユニゾホールディングス	3,600	5,060.00	18,216,000	
日本管理センター	4,400	1,445.00	6,358,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
オープンハウス	8,400	2,590.00	21,756,000	
東急不動産HD	135,200	829.00	112,080,800	
飯田GH D	51,600	2,394.00	123,530,400	
帝国繊維	7,000	1,736.00	12,152,000	
日本コークス工業	64,200	104.00	6,676,800	
あさひ	5,100	1,269.00	6,471,900	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
日本調剤	1,600	4,810.00	7,696,000	貸付株式数 400株
コスモス薬品	2,800	16,860.00	47,208,000	貸付株式数 800株 (800株)
シップヘルスケアHD	11,500	2,893.00	33,269,500	
セブン&アイ・H L D G S	232,300	5,520.00	1,282,296,000	
クリエイト・レストランツ・ ホール	5,200	3,365.00	17,498,000	貸付株式数 1,100株
ツルハホールディングス	11,900	11,000.00	130,900,000	
サンマルクホールディングス	4,800	3,525.00	16,920,000	
トリドール	7,200	1,943.00	13,989,600	
クスリのアオキ	4,500	6,520.00	29,340,000	
帝 人	244,000	438.00	106,872,000	
東 レ	427,000	1,119.00	477,813,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
ク ラ レ	92,500	1,567.00	144,947,500	
旭 化 成	368,000	842.10	309,892,800	

サカイ オーベックス	28,000	229.00	6,412,000	
稲葉製作所	4,500	1,314.00	5,913,000	
宮地エンジニアリングG	24,000	212.00	5,088,000	
トーカロ	4,800	2,638.00	12,662,400	
SUMCO	47,000	1,306.00	61,382,000	
川田テクノロジーズ	1,400	4,245.00	5,943,000	
住江織物	20,000	355.00	7,100,000	
芦森工業	25,000	214.00	5,350,000	
アツギ	89,000	119.00	10,591,000	
共和レザー	5,200	941.00	4,893,200	
セーレン	15,500	1,470.00	22,785,000	
小松精練	13,200	764.00	10,084,800	
ワコールホールディングス	35,000	1,503.00	52,605,000	
ホギメディカル	3,800	6,340.00	24,092,000	
T S Iホールディングス	27,400	871.00	23,865,400	
I Tホールディングス	18,700	2,983.00	55,782,100	
電算システム	2,600	2,000.00	5,200,000	貸付株式数 700株 (700株)
グリー	35,100	600.00	21,060,000	貸付株式数 9,700株
コーエーテクモHD	13,800	1,931.00	26,647,800	
三菱総合研究所	2,900	3,140.00	9,106,000	
K L a b	9,000	1,072.00	9,648,000	貸付株式数 2,600株 (400株)
ポルトゥウィン・ピットクル	4,800	1,115.00	5,352,000	貸付株式数 1,000株
ネクソン	53,400	1,953.00	104,290,200	
アイスタイル	5,300	1,564.00	8,289,200	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
エイチーム	2,400	2,042.00	4,900,800	貸付株式数 700株 (700株)
コロプラ	15,300	2,489.00	38,081,700	貸付株式数 4,400株 (500株)
ブロードリーフ	6,600	1,139.00	7,517,400	
特種東海製紙	37,000	381.00	14,097,000	
ティーガイア	6,200	1,495.00	9,269,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ガンホー・オンライン・エンター	98,300	380.00	37,354,000	貸付株式数 27,500株
GMOペイメントゲートウェイ	5,000	5,930.00	29,650,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)

インターネットイニシアティブ	9,600	2,324.00	22,310,400	貸付株式数 200株 (200株)
S R Aホールディングス	4,100	2,707.00	11,098,700	
朝日ネット	15,000	533.00	7,995,000	
王子ホールディングス	241,000	534.00	128,694,000	
日本製紙	30,200	1,982.00	59,856,400	
三菱製紙	103,000	89.00	9,167,000	
北越紀州製紙	38,600	811.00	31,304,600	貸付株式数 10,800株
中越パルプ	29,000	216.00	6,264,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
大王製紙	26,600	1,165.00	30,989,000	貸付株式数 7,500株 (500株)
g u m i	6,400	1,200.00	7,680,000	貸付株式数 1,800株 (200株)
レンゴー	47,000	546.00	25,662,000	
トーモク	23,000	286.00	6,578,000	
ザ・パック	4,700	3,040.00	14,288,000	
昭和電工	392,000	162.00	63,504,000	
住友化学	436,000	706.00	307,816,000	
住友精化	13,000	759.00	9,867,000	
日産化学	35,500	2,954.00	104,867,000	
ラサ工業	36,000	146.00	5,256,000	
クレハ	44,000	484.00	21,296,000	貸付株式数 12,000株 (1,000株)
テイカ	14,000	608.00	8,512,000	
石原産業	111,000	110.00	12,210,000	
日東エフシー	5,800	922.00	5,347,600	
日本曹達	40,000	745.00	29,800,000	
東ソー	159,000	690.00	109,710,000	
トクヤマ	106,000	263.00	27,878,000	貸付株式数 28,000株 (28,000株)
セントラル硝子	64,000	582.00	37,248,000	
東亜合成	37,200	1,057.00	39,320,400	
大阪ソーダ	28,000	433.00	12,124,000	
関東電化	15,000	911.00	13,665,000	
デンカ	125,000	544.00	68,000,000	
イビデン	37,000	1,930.00	71,410,000	貸付株式数 10,200株 (10,200株)
信越化学	105,500	6,963.00	734,596,500	
日本カ-パイド	28,000	182.00	5,096,000	

堺 化 学	28,000	422.00	11,816,000	
エア・ウォーター	48,000	1,998.00	95,904,000	
大陽日酸	45,900	1,177.00	54,024,300	
日本化学工業	25,000	264.00	6,600,000	
日本パ - カライジング	30,600	1,234.00	37,760,400	
高压ガス	12,000	672.00	8,064,000	
四国化成	10,000	1,123.00	11,230,000	
ステラ ケミファ	4,900	1,498.00	7,340,200	
保土谷化学	34,000	244.00	8,296,000	
日本触媒	8,500	9,220.00	78,370,000	
大日精化	24,000	585.00	14,040,000	
カネカ	80,000	1,214.00	97,120,000	
協和発酵キリン	71,000	2,169.00	153,999,000	
三菱瓦斯化学	100,000	667.00	66,700,000	
三井化学	252,000	513.00	129,276,000	
J S R	56,800	1,938.00	110,078,400	
東京応化工業	12,000	3,695.00	44,340,000	
三菱ケミカルH L D G S	396,700	806.70	320,017,890	
日本合成化学	14,000	920.00	12,880,000	
ダイセル	81,900	1,802.00	147,583,800	
住友ベ - クライト	55,000	516.00	28,380,000	
積水化学	136,000	1,467.00	199,512,000	
日本ゼオン	51,000	987.00	50,337,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
アイカ工業	17,800	2,469.00	43,948,200	
宇部興産	317,000	262.00	83,054,000	貸付株式数 88,000株 (88,000株)
積水樹脂	10,200	1,656.00	16,891,200	
タキロン	17,000	578.00	9,826,000	
旭有機材	32,000	230.00	7,360,000	
日立化成	29,200	2,050.00	59,860,000	
ニチバン	9,000	646.00	5,814,000	
リケンテクノス	13,500	436.00	5,886,000	
大倉工業	20,000	361.00	7,220,000	
積水化成品	18,000	388.00	6,984,000	
群栄化学	20,000	334.00	6,680,000	
ダイキョーニシカワ	1,900	8,340.00	15,846,000	
日本化薬	38,000	1,329.00	50,502,000	
カーリットホールディングス	10,200	540.00	5,508,000	
E P Sホールディングス	6,800	1,436.00	9,764,800	

プレステージ・インター	6,200	1,142.00	7,080,400	
アミューズ	1,800	6,050.00	10,890,000	
野村総合研究所	39,000	4,655.00	181,545,000	
ドリームインキュベータ	2,800	2,307.00	6,459,600	貸付株式数 500株
ケネディクス	79,700	484.00	38,574,800	貸付株式数 24,300株
電通	65,700	6,910.00	453,987,000	貸付株式数 18,500株 (18,500株)
インテージホールディングス	4,000	1,778.00	7,112,000	
イオンファンタジー	2,800	2,161.00	6,050,800	貸付株式数 700株 (700株)
メディカルシステムネット ワーク	7,600	709.00	5,388,400	
日本精化	7,900	945.00	7,465,500	
A D E K A	29,100	1,820.00	52,962,000	
日油	45,000	949.00	42,705,000	
ミヨシ油脂	38,000	142.00	5,396,000	
花 王	158,500	6,311.00	1,000,293,500	
第一工業製薬	18,000	389.00	7,002,000	貸付株式数 4,000株
三洋化成	20,000	975.00	19,500,000	
武田薬品	234,700	5,983.00	1,404,210,100	
アステラス製薬	659,900	1,733.50	1,143,936,650	
大日本住友製薬	42,500	1,481.00	62,942,500	貸付株式数 12,200株
塩野義製薬	86,100	5,426.00	467,178,600	
田辺三菱製薬	67,600	2,151.00	145,407,600	
あすか製薬	8,500	1,541.00	13,098,500	
日本新薬	14,000	5,080.00	71,120,000	
中外製薬	58,500	4,300.00	251,550,000	
科研製薬	10,200	8,680.00	88,536,000	
エーザイ	72,600	7,997.00	580,582,200	
ロート製薬	28,900	2,373.00	68,579,700	
小野薬品	26,800	19,710.00	528,228,000	
久光製薬	18,400	5,250.00	96,600,000	
持田製薬	4,200	7,700.00	32,340,000	
参天製薬	108,200	1,952.00	211,206,400	
扶桑薬品	28,000	285.00	7,980,000	
日本ケミファ	11,000	674.00	7,414,000	
ツムラ	18,600	3,385.00	62,961,000	貸付株式数 5,200株
日医工	13,900	3,105.00	43,159,500	
テ ル モ	86,400	3,930.00	339,552,000	
みらかホールディングス	15,000	5,470.00	82,050,000	

キッセイ薬品工業	10,700	3,105.00	33,223,500	
生化学工業	12,000	1,697.00	20,364,000	
栄研化学	5,700	2,285.00	13,024,500	
鳥居薬品	4,700	2,759.00	12,967,300	
J C R ファーマ	5,000	2,810.00	14,050,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
東和薬品	2,800	7,630.00	21,364,000	
富士製薬工業	2,500	2,215.00	5,537,500	
沢井製薬	9,900	7,060.00	69,894,000	
ゼリア新薬工業	12,800	1,710.00	21,888,000	
第一三共	198,900	2,537.00	504,609,300	
キョーリン製薬HD	16,100	2,324.00	37,416,400	
大幸薬品	3,400	1,941.00	6,599,400	貸付株式数 800株 (800株)
ダイト	3,100	3,345.00	10,369,500	
大塚ホールディングス	126,200	4,078.00	514,643,600	
大正製薬HD	14,000	8,340.00	116,760,000	貸付株式数 3,900株
大日本塗料	43,000	234.00	10,062,000	
日本ペイントHOLD	45,500	3,085.00	140,367,500	貸付株式数 12,800株 (12,800株)
関西ペイント	66,200	1,942.00	128,560,400	
中国塗料	18,000	867.00	15,606,000	
日本特殊塗料	5,700	1,176.00	6,703,200	
藤倉化成	12,100	563.00	6,812,300	
太陽ホールディングス	4,500	4,675.00	21,037,500	
D I C	233,000	355.00	82,715,000	
サカティンクス	12,600	1,266.00	15,951,600	
東洋インキSCホールディン	57,000	512.00	29,184,000	
T & K TOKA	3,100	2,347.00	7,275,700	
アルプス技研	2,900	2,270.00	6,583,000	
オリエンタルランド	63,300	6,997.00	442,910,100	
ダスキン	17,300	2,258.00	39,063,400	
パーク24	28,200	2,500.00	70,500,000	貸付株式数 4,500株 (4,500株)
明光ネットワークジャパン	8,100	1,399.00	11,331,900	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
ファルコホールディングス	4,000	1,541.00	6,164,000	
フジ・メディア・HD	57,700	1,467.00	84,645,900	貸付株式数 16,000株
ラウンドワン	20,800	535.00	11,128,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)

リゾートトラスト	24,600	3,285.00	80,811,000	
オービック	19,300	6,550.00	126,415,000	
ジャストシステム	11,500	997.00	11,465,500	
ヤフー	400,200	507.00	202,901,400	
ビー・エム・エル	4,000	3,940.00	15,760,000	
トレンドマイクロ	27,400	5,020.00	137,548,000	
りらいあコミュニケーション	10,900	1,141.00	12,436,900	
日本オラクル	8,900	6,000.00	53,400,000	
フューチャーアーキテクト	10,200	722.00	7,364,400	
CAC HOLDINGS	6,500	1,009.00	6,558,500	
ユー・エス・エス	71,200	1,957.00	139,338,400	
オービックビジネスC	3,000	7,030.00	21,090,000	
伊藤忠テクノソリュー	12,800	2,543.00	32,550,400	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
アイティフォー	14,200	566.00	8,037,200	
サイバーエージェント	14,500	5,190.00	75,255,000	
楽天	275,500	1,552.00	427,576,000	
大塚商会	15,000	6,170.00	92,550,000	
総合メディカル	3,000	4,435.00	13,305,000	
サイボウズ	18,300	326.00	5,965,800	
セントラルスポーツ	3,000	2,318.00	6,954,000	
電通国際情報S	4,400	2,150.00	9,460,000	
ウェザーニューズ	2,200	4,400.00	9,680,000	
C I J	10,400	514.00	5,345,600	
WOWOW	3,200	3,335.00	10,672,000	貸付株式数 800株 (800株)
フルキャストホールディングス	6,600	775.00	5,115,000	
富士フイルムHLDGS	134,700	4,986.00	671,614,200	
コニカミノルタ	141,300	1,294.00	182,842,200	
資生堂	112,000	2,945.50	329,896,000	貸付株式数 32,700株
ライオン	68,000	1,286.00	87,448,000	貸付株式数 21,000株
高砂香料	4,200	2,971.00	12,478,200	
マンダム	5,700	4,945.00	28,186,500	
ミルボン	3,800	4,730.00	17,974,000	
ファンケル	14,000	1,779.00	24,906,000	
コーセー	9,500	12,880.00	122,360,000	
ドクターシーラボ	8,400	2,451.00	20,588,400	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
ポーラ・オルビスHD	6,000	8,640.00	51,840,000	

ノエビアホールディングス	3,700	3,400.00	12,580,000	
コニシ	5,200	2,644.00	13,748,800	
長谷川香料	7,900	1,570.00	12,403,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
星光PMC	3,600	1,264.00	4,550,400	
小林製薬	8,800	10,030.00	88,264,000	
荒川化学工業	6,100	1,188.00	7,246,800	
日本高純度化学	3,100	2,370.00	7,347,000	
JCU	2,000	4,825.00	9,650,000	
新田ゼラチン	5,900	734.00	4,330,600	
デクセリアルズ	13,500	1,341.00	18,103,500	
アース製薬	4,000	5,170.00	20,680,000	
イハラケミカル	9,700	1,670.00	16,199,000	
大成ラミック	2,800	3,020.00	8,456,000	
クミアイ化学	12,900	1,067.00	13,764,300	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
日本農薬	14,400	814.00	11,721,600	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
昭和シエル石油	59,700	1,085.00	64,774,500	
ニチレキ	9,000	997.00	8,973,000	
東燃ゼネラル石油	86,000	1,188.00	102,168,000	
ユシロ化学	4,800	1,472.00	7,065,600	
ピーピー・カストロール	4,300	1,341.00	5,766,300	
富士石油	16,800	372.00	6,249,600	
出光興産	29,500	2,038.00	60,121,000	
JXホールディングス	695,700	499.30	347,363,010	
コスモエネルギーHLDGS	17,600	1,618.00	28,476,800	
横浜ゴム	36,100	2,117.00	76,423,700	
東洋ゴム	26,500	2,662.00	70,543,000	
ブリヂストン	198,500	4,380.00	869,430,000	
住友ゴム	54,400	1,662.00	90,412,800	
オカモト	19,000	1,103.00	20,957,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
アキレス	63,000	159.00	10,017,000	
ニッタ	6,700	3,500.00	23,450,000	
住友理工	13,000	1,058.00	13,754,000	
三ツ星ベルト	16,000	1,010.00	16,160,000	
バンドー化学	24,000	542.00	13,008,000	
鬼怒川ゴム	15,000	743.00	11,145,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)

旭硝子	312,000	724.00	225,888,000	
日本板硝子	289,000	106.00	30,634,000	
有沢製作所	10,100	787.00	7,948,700	
日本山村硝子	30,000	186.00	5,580,000	
日本電気硝子	122,000	683.00	83,326,000	
住友大阪セメント	119,000	474.00	56,406,000	
太平洋セメント	369,000	380.00	140,220,000	
日本ヒュ-ム	7,600	753.00	5,722,800	
日本コンクリ-ト	15,800	350.00	5,530,000	貸付株式数 4,300株 (3,800株)
アジアパイルHD	8,700	600.00	5,220,000	
東海カーボン	56,000	374.00	20,944,000	
日本カーボン	33,000	344.00	11,352,000	
東洋炭素	4,100	1,802.00	7,388,200	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
ノリタケ	37,000	288.00	10,656,000	
TOTO	43,600	4,250.00	185,300,000	
日本碍子	75,000	2,855.00	214,125,000	
日本特殊陶業	50,600	3,355.00	169,763,000	
MARUWA	2,500	3,020.00	7,550,000	
品川リフラクトリーズ	18,000	270.00	4,860,000	
フジミインコーポレーテッド	5,600	1,588.00	8,892,800	
ニチアス	31,000	806.00	24,986,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
新日鐵住金	265,500	2,472.50	656,448,750	
神戸製鋼所	1,090,000	144.00	156,960,000	
合同製鐵	36,000	239.00	8,604,000	
JFEホールディングス	161,900	1,942.00	314,409,800	
日新製鋼	26,700	1,347.00	35,964,900	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
東京製鐵	32,700	759.00	24,819,300	
共英製鋼	6,700	2,162.00	14,485,400	
大和工業	13,100	3,170.00	41,527,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
東京鐵鋼	15,000	574.00	8,610,000	
大阪製鐵	4,200	2,235.00	9,387,000	
淀川製鋼所	9,100	2,509.00	22,831,900	
東洋鋼鈑	16,700	426.00	7,114,200	
丸一鋼管	19,200	3,410.00	65,472,000	貸付株式数 5,400株 (5,400株)

大同特殊鋼	100,000	520.00	52,000,000	
日本高周波	46,000	102.00	4,692,000	
日本冶金工	50,800	162.00	8,229,600	貸付株式数 15,600株 (15,600株)
山陽特殊製鋼	36,000	576.00	20,736,000	
愛知製鋼	37,000	547.00	20,239,000	
日立金属	67,300	1,596.00	107,410,800	貸付株式数 18,800株 (18,800株)
大太平洋金属	41,000	323.00	13,243,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
新日本電工	40,100	227.00	9,102,700	
栗本鉄工所	35,000	225.00	7,875,000	
日本製鋼所	99,000	472.00	46,728,000	貸付株式数 28,000株 (28,000株)
三菱製鋼	47,000	250.00	11,750,000	
日本軽金属HD	139,600	220.00	30,712,000	貸付株式数 39,000株
三井金属	155,000	237.00	36,735,000	
東邦亜鉛	36,000	311.00	11,196,000	
三菱マテリアル	370,000	435.00	160,950,000	
住友鉱山	163,000	1,388.00	226,244,000	
DOWAホールディングス	77,000	947.00	72,919,000	
古河機金	98,000	245.00	24,010,000	
大阪チタニウム	5,800	3,000.00	17,400,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
東邦チタニウム	10,200	1,240.00	12,648,000	貸付株式数 2,900株
UACJ	86,000	296.00	25,456,000	
古河電工	189,000	267.00	50,463,000	
住友電工	235,800	1,752.00	413,121,600	
フジクラ	85,000	697.00	59,245,000	
昭和電線HLDGS	98,000	78.00	7,644,000	貸付株式数 24,000株
タツタ電線	15,700	479.00	7,520,300	
リョービ	38,000	457.00	17,366,000	
アーレステイ	8,200	852.00	6,986,400	
アサヒHD	9,200	1,943.00	17,875,600	
東洋製罐グループHD	42,100	2,423.00	102,008,300	
ホッカンホールディングス	20,000	329.00	6,580,000	
横河ブリッジHLDGS	12,300	1,354.00	16,654,200	
三和ホールディングス	60,600	1,032.00	62,539,200	
文化シヤッタ -	17,600	1,071.00	18,849,600	
三協立山	8,000	1,725.00	13,800,000	

アルインコ	4,200	1,166.00	4,897,200	
L I X I Lグループ	82,100	2,878.00	236,283,800	
ノーリツ	12,400	1,819.00	22,555,600	
長府製作所	6,900	2,746.00	18,947,400	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
リンナイ	10,900	11,020.00	120,118,000	
ユニプレス	11,900	2,934.00	34,914,600	
岡 部	13,400	944.00	12,649,600	
ジーテクト	6,700	1,780.00	11,926,000	
東 プ レ	11,700	2,725.00	31,882,500	
高周波熱錬	12,800	953.00	12,198,400	
東京製綱	45,000	188.00	8,460,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
パイオラックス	3,200	6,760.00	21,632,000	
日本発条	55,600	1,265.00	70,334,000	
三浦工業	25,700	1,655.00	42,533,500	
タ ク マ	22,000	1,034.00	22,748,000	
テクノプロ・ホールディング	8,600	3,510.00	30,186,000	
ジャパンマテリアル	3,000	2,554.00	7,662,000	貸付株式数 800株 (400株)
ベクトル	2,600	2,036.00	5,293,600	貸付株式数 700株 (700株)
リクルートホールディングス	118,000	3,845.00	453,710,000	
ツ ガ ミ	18,000	560.00	10,080,000	貸付株式数 5,000株
オークマ	39,000	1,119.00	43,641,000	
東芝機械	35,000	430.00	15,050,000	
アマダホールディングス	88,300	1,212.00	107,019,600	
アイダエンジニア	16,500	1,318.00	21,747,000	
滝澤鉄工所	31,000	173.00	5,363,000	
富士機械製造	20,100	1,223.00	24,582,300	
牧野フライス	30,000	1,006.00	30,180,000	
オーエスジー	26,800	2,432.00	65,177,600	貸付株式数 7,600株
旭ダイヤモンド	16,900	1,447.00	24,454,300	
D M G 森精機	32,900	1,675.00	55,107,500	
ソディック	12,100	1,009.00	12,208,900	
ディスコ	7,500	11,860.00	88,950,000	
日東工器	4,000	2,712.00	10,848,000	
豊田自動織機	51,200	6,530.00	334,336,000	
OKK	36,000	150.00	5,400,000	

島精機製作所	8,700	1,812.00	15,764,400	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
日阪製作所	9,400	1,005.00	9,447,000	
やまびこ	11,600	1,187.00	13,769,200	
ナプテスコ	31,200	2,577.00	80,402,400	
三井海洋開発	6,800	1,822.00	12,389,600	貸付株式数 1,900株
S M C	17,600	32,620.00	574,112,000	
新川	7,200	600.00	4,320,000	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
ホソカワミクロン	12,000	637.00	7,644,000	
ユニオンツール	3,000	3,480.00	10,440,000	貸付株式数 800株 (800株)
オイレス工業	8,100	2,079.00	16,839,900	
日精エーエスビー	2,400	2,204.00	5,289,600	貸付株式数 700株
サト - ホールディングス	8,200	2,750.00	22,550,000	
日精樹脂工業	5,500	1,033.00	5,681,500	
小松製作所	288,900	2,036.00	588,200,400	貸付株式数 89,900株 (89,900株)
住友重機械	173,000	584.00	101,032,000	貸付株式数 47,000株 (47,000株)
日立建機	26,800	1,932.00	51,777,600	
巴工業	3,800	1,564.00	5,943,200	
井関農機	66,000	204.00	13,464,000	貸付株式数 18,000株 (18,000株)
T O W A	6,700	843.00	5,648,100	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
丸山製作所	27,000	217.00	5,859,000	
北川鉄工所	31,000	283.00	8,773,000	
クボタ	283,000	2,053.50	581,140,500	貸付株式数 89,000株 (89,000株)
東洋エンジニア	34,000	344.00	11,696,000	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
三菱化工機	24,000	299.00	7,176,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
月島機械	11,800	1,183.00	13,959,400	
帝国電機製作所	6,200	825.00	5,115,000	
新東工業	14,600	1,070.00	15,622,000	
渋谷工業	5,500	1,819.00	10,004,500	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
アイチ コーポレーション	10,000	879.00	8,790,000	
小森コーポレーション	14,800	1,566.00	23,176,800	

鶴見製作所	5,100	2,050.00	10,455,000	
住友精密	13,000	476.00	6,188,000	
荏原製作所	132,000	607.00	80,124,000	貸付株式数 34,000株
西島製作所	7,700	1,005.00	7,738,500	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
北越工業	7,400	883.00	6,534,200	
千代田化工建	44,000	1,045.00	45,980,000	
ダイキン工業	82,000	8,650.00	709,300,000	
オルガノ	14,000	483.00	6,762,000	
ト - ヨ - カネツ	38,000	257.00	9,766,000	
栗田工業	34,300	2,657.00	91,135,100	貸付株式数 6,600株 (6,600株)
椿本チエイン	34,000	958.00	32,572,000	
日本コンベヤ	24,000	183.00	4,392,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
日 機 装	22,400	978.00	21,907,200	
新興プランテック	13,500	1,012.00	13,662,000	
アネスト岩田	11,300	989.00	11,175,700	
ダイフク	28,100	2,001.00	56,228,100	貸付株式数 8,200株 (8,200株)
加藤製作所	15,000	594.00	8,910,000	
油研工業	21,000	260.00	5,460,000	
タダノ	27,000	1,591.00	42,957,000	
フジテック	16,900	1,322.00	22,341,800	
C K D	16,600	1,323.00	21,961,800	
キトー	8,200	1,056.00	8,659,200	貸付株式数 2,100株
平和	17,100	2,308.00	39,466,800	
理想科学工業	6,600	2,000.00	13,200,000	
SANKYO	15,300	4,870.00	74,511,000	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
日本金銭機械	6,400	1,369.00	8,761,600	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
マースエンジニアリング	3,900	2,112.00	8,236,800	
福島工業	3,900	2,560.00	9,984,000	
ダイコク電機	3,200	1,538.00	4,921,600	
竹内製作所	8,500	2,636.00	22,406,000	
ア マ ノ	17,900	1,674.00	29,964,600	
JUKI	8,600	1,178.00	10,130,800	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
サンデンホールディングス	37,000	396.00	14,652,000	

蛇の目ミシン	6,700	821.00	5,500,700	
ブラザー工業	72,800	1,473.00	107,234,400	
マックス	10,000	1,272.00	12,720,000	
モリタホールディングス	11,000	1,279.00	14,069,000	
グローリー	19,300	3,470.00	66,971,000	
新晃工業	4,800	1,433.00	6,878,400	
大和冷機工業	10,800	938.00	10,130,400	
セガサミーホールディングス	60,800	1,330.00	80,864,000	
日本ピストンリング	3,500	2,071.00	7,248,500	
リケン	31,000	453.00	14,043,000	
T P R	7,300	3,355.00	24,491,500	
ホシザキ電機	12,200	8,650.00	105,530,000	
大豊工業	6,000	1,407.00	8,442,000	
日本精工	116,300	1,549.00	180,148,700	貸付株式数 32,300株 (32,300株)
N T N	142,000	579.00	82,218,000	
ジェイテクト	60,500	2,276.00	137,698,000	
不二越	54,000	578.00	31,212,000	
ミネベア	91,000	1,351.00	122,941,000	
日本トムソン	21,000	560.00	11,760,000	
T H K	37,300	2,454.00	91,534,200	
ユーシン精機	2,900	2,311.00	6,701,900	貸付株式数 800株 (800株)
イーグル工業	7,500	2,478.00	18,585,000	
日本ピラ - 工業	7,500	1,020.00	7,650,000	
キッツ	29,200	569.00	16,614,800	
日立	1,437,000	726.60	1,044,124,200	
東芝	1,188,000	300.90	357,469,200	
三菱電機	600,000	1,363.00	817,800,000	
富士電機	172,000	567.00	97,524,000	
東洋電機製造	15,000	441.00	6,615,000	
安川電機	70,200	1,625.00	114,075,000	
シンフォニアテクノロジー	44,000	211.00	9,284,000	
明電舎	56,000	490.00	27,440,000	
山洋電気	16,000	788.00	12,608,000	
デンヨー	5,700	2,066.00	11,776,200	
日立工機	16,600	927.00	15,388,200	
三桜工業	9,900	758.00	7,504,200	
マキタ	36,500	6,990.00	255,135,000	
東芝テック	43,000	369.00	15,867,000	

マブチモーター	16,200	7,090.00	114,858,000	
日本電産	67,600	9,518.00	643,416,800	
東光高岳	3,300	1,505.00	4,966,500	
ダイヘン	35,000	554.00	19,390,000	
田淵電機	7,300	854.00	6,234,200	貸付株式数 1,000株
JVCケンウッド	42,900	351.00	15,057,900	
第一精工	3,000	1,723.00	5,169,000	貸付株式数 300株 (300株)
日新電機	14,400	889.00	12,801,600	
大崎電気	12,000	674.00	8,088,000	貸付株式数 3,000株
オムロン	64,300	4,525.00	290,957,500	
日東工業	9,400	2,134.00	20,059,600	
I D E C	9,300	1,093.00	10,164,900	
ジーエス・ユアサ コーポ	110,000	466.00	51,260,000	
メルコホールディングス	4,200	2,141.00	8,992,200	
日本電気	776,000	412.00	319,712,000	
富士通	545,000	621.60	338,772,000	
沖電気	256,000	160.00	40,960,000	
電気興業	19,000	559.00	10,621,000	
サンケン電気	32,000	477.00	15,264,000	
アイホン	4,100	1,985.00	8,138,500	
ルネサスエレクトロニクス	28,900	814.00	23,524,600	貸付株式数 8,000株
セイコーエプソン	83,800	1,939.00	162,488,200	
ワコム	46,900	451.00	21,151,900	貸付株式数 15,100株 (15,100株)
アルバック	9,800	3,115.00	30,527,000	
アクセル	4,900	1,407.00	6,894,300	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
E I Z O	6,100	2,890.00	17,629,000	
ジャパンディスプレイ	105,100	375.00	39,412,500	貸付株式数 30,800株 (30,800株)
日本信号	16,000	1,374.00	21,984,000	
京三製作所	19,000	377.00	7,163,000	
能美防災	7,100	1,559.00	11,068,900	
ホーチキ	5,200	1,147.00	5,964,400	
エレコム	5,900	1,636.00	9,652,400	
日本無線	19,000	396.00	7,524,000	
パナソニック	643,400	1,397.50	899,151,500	
シャープ	474,000	126.00	59,724,000	貸付株式数 146,000株 (132,000株)

アンリツ	34,600	825.00	28,545,000	
富士通ゼネラル	17,000	1,632.00	27,744,000	
日立国際電気	13,000	1,818.00	23,634,000	
ソ ニ ー	398,100	3,177.00	1,264,763,700	
T D K	34,100	8,850.00	301,785,000	
帝国通信工業	36,000	204.00	7,344,000	
ミツミ電機	23,000	672.00	15,456,000	貸付株式数 5,900株
タムラ製作所	25,000	394.00	9,850,000	
アルプス電気	47,500	3,870.00	183,825,000	
パイオニア	91,900	383.00	35,197,700	貸付株式数 26,300株
日本電波工業	6,300	823.00	5,184,900	貸付株式数 2,100株
日本トリム	1,700	4,415.00	7,505,500	貸付株式数 300株 (100株)
ローランド ディー . ジー .	3,300	2,903.00	9,579,900	
フオスタ - 電機	7,300	2,916.00	21,286,800	
クラリオン	31,000	449.00	13,919,000	貸付株式数 8,000株
S M K	18,000	686.00	12,348,000	
ヨコオ	8,100	617.00	4,997,700	
東 光	16,000	404.00	6,464,000	貸付株式数 5,000株
ホシデン	18,600	696.00	12,945,600	
ヒロセ電機	9,000	14,980.00	134,820,000	
日本航空電子	16,000	2,151.00	34,416,000	
T O A	7,600	1,242.00	9,439,200	
日立マクセル	9,600	2,031.00	19,497,600	
古野電気	9,100	911.00	8,290,100	
ユニデンホールディングス	30,000	172.00	5,160,000	
アルパイン	14,100	1,729.00	24,378,900	
アイコム	4,200	2,505.00	10,521,000	
船井電機	6,300	972.00	6,123,600	貸付株式数 1,600株
横河電機	56,800	1,470.00	83,496,000	
新電元工業	22,000	499.00	10,978,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
アズビル	18,000	3,105.00	55,890,000	
日本光電工業	23,600	2,563.00	60,486,800	
共和電業	13,700	462.00	6,329,400	
堀場製作所	10,500	4,585.00	48,142,500	
アドバンテスト	39,600	1,118.00	44,272,800	貸付株式数 11,500株
エスベック	7,100	1,439.00	10,216,900	
パナソニックデバイス	8,300	721.00	5,984,300	
キーエンス	12,700	66,720.00	847,344,000	

日置電機	3,800	2,270.00	8,626,000	
シスメックス	43,700	7,690.00	336,053,000	
メガチップス	6,800	1,164.00	7,915,200	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
O B A R A G R O U P	3,800	4,440.00	16,872,000	
デンソー	138,500	5,873.00	813,410,500	
コーセル	9,400	1,163.00	10,932,200	
オプテックス	4,700	2,697.00	12,675,900	
千代田インテグレ	3,400	2,980.00	10,132,000	
レーザーテック	6,700	1,333.00	8,931,100	
スタンレー電気	40,200	2,725.00	109,545,000	
岩崎電気	22,000	272.00	5,984,000	
ウシオ電機	34,400	1,808.00	62,195,200	
日本セラミック	3,900	1,949.00	7,601,100	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
日本デジタル研究所	5,800	1,589.00	9,216,200	
山一電機	5,700	853.00	4,862,100	
図 研	5,900	1,190.00	7,021,000	
日本電子	23,000	827.00	19,021,000	
カ シ オ	56,600	2,715.00	153,669,000	貸付株式数 19,200株
ファナック	57,600	21,920.00	1,262,592,000	
エンプラス	3,100	4,820.00	14,942,000	
ロ ム	27,600	6,620.00	182,712,000	
浜松ホトニクス	43,800	3,085.00	135,123,000	
三井ハイテック	10,500	726.00	7,623,000	
新光電気工業	22,000	847.00	18,634,000	
京 セ ラ	92,200	5,707.00	526,185,400	
太陽誘電	27,600	2,009.00	55,448,400	
村田製作所	59,100	19,100.00	1,128,810,000	
ユーシン	8,200	750.00	6,150,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
双葉電子工業	9,900	1,712.00	16,948,800	
日東電工	45,500	8,296.00	377,468,000	
北陸電気工業	35,000	198.00	6,930,000	
東海理化電機	16,500	2,843.00	46,909,500	
ニチコン	18,700	1,024.00	19,148,800	
日本ケミコン	50,000	262.00	13,100,000	
K O A	8,900	1,079.00	9,603,100	
三井造船	223,000	202.00	45,046,000	貸付株式数 41,000株 (41,000株)

日立造船	44,600	680.00	30,328,000	
三菱重工業	1,003,000	630.10	631,990,300	
川崎重工業	441,000	489.00	215,649,000	
I H I	436,000	322.00	140,392,000	
名村造船所	17,200	1,133.00	19,487,600	
日本車輛	30,000	294.00	8,820,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
近畿車輛	13,000	407.00	5,291,000	
F P G	17,500	841.00	14,717,500	貸付株式数 4,400株
じもとホールディングス	45,000	205.00	9,225,000	
全国保証	14,800	4,035.00	59,718,000	
足利ホールディングス	36,600	478.00	17,494,800	
東京ＴＹフィナンシャルＧ	7,800	4,050.00	31,590,000	
九州フィナンシャルＧ	84,600	936.00	79,185,600	
日産自動車	790,900	1,314.50	1,039,638,050	
いすゞ自動車	163,500	1,385.00	226,447,500	
トヨタ自動車	716,700	7,657.00	5,487,771,900	
日野自動車	80,400	1,495.00	120,198,000	
三菱自動車工業	223,300	1,096.00	244,736,800	
エフテック	4,900	1,190.00	5,831,000	貸付株式数 1,600株
武蔵精密工業	6,500	2,638.00	17,147,000	
日産車体	27,400	1,405.00	38,497,000	貸付株式数 7,200株 (7,200株)
新明和工業	25,000	1,191.00	29,775,000	
極東開発工業	12,300	1,470.00	18,081,000	
日信工業	12,900	1,915.00	24,703,500	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
トピー工業	51,000	294.00	14,994,000	
ティラド	35,000	193.00	6,755,000	
曙ブレーキ	31,300	314.00	9,828,200	貸付株式数 8,500株
タチエス	9,900	2,080.00	20,592,000	
N O K	27,300	3,320.00	90,636,000	
フタバ産業	20,400	525.00	10,710,000	
K Y B	66,000	388.00	25,608,000	
シロキ工業	19,000	365.00	6,935,000	
大同メタル工業	9,200	1,051.00	9,669,200	
プレス工業	32,500	568.00	18,460,000	
カルソニックカンセイ	42,000	1,071.00	44,982,000	
太平洋工業	13,300	1,333.00	17,728,900	貸付株式数 4,100株
ケーヒン	13,300	2,016.00	26,812,800	

河西工業	7,800	1,861.00	14,515,800	
アイシン精機	56,600	4,930.00	279,038,000	
富士機工	10,300	496.00	5,108,800	
マツダ	178,500	2,557.50	456,513,750	
ダイハツ	65,400	1,598.00	104,509,200	
今仙電機製作所	7,400	1,337.00	9,893,800	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
本田技研	506,600	4,002.00	2,027,413,200	
スズキ	117,100	3,785.00	443,223,500	
富士重工業	177,700	5,088.00	904,137,600	
ヤマハ発動機	79,600	3,005.00	239,198,000	
ショーワ	15,900	1,190.00	18,921,000	
小糸製作所	33,700	5,000.00	168,500,000	
T B K	11,500	475.00	5,462,500	
エクセディ	7,900	2,962.00	23,399,800	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
ミツバ	10,000	2,139.00	21,390,000	
豊田合成	20,500	2,927.00	60,003,500	
愛三工業	10,900	1,331.00	14,507,900	
ヨロズ	5,700	2,427.00	13,833,900	
エフ・シー・シー	9,500	2,582.00	24,529,000	
シマノ	22,600	18,270.00	412,902,000	
テイ・エス テック	13,200	3,455.00	45,606,000	
ジャムコ	2,600	4,360.00	11,336,000	貸付株式数 700株 (700株)
小野建	6,300	1,091.00	6,873,300	
佐鳥電機	6,700	817.00	5,473,900	
カップ・クリエイト	9,400	1,245.00	11,703,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
ライトオン	5,400	1,481.00	7,997,400	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	9,300	2,162.00	20,106,600	
三菱食品	6,300	3,050.00	19,215,000	
良品計画	6,400	26,560.00	169,984,000	
松田産業	5,900	1,481.00	8,737,900	
メディパルHD	55,700	2,157.00	120,144,900	
アルビス	2,300	2,235.00	5,140,500	
アズワン	4,800	4,665.00	22,392,000	
シモジマ	6,300	1,147.00	7,226,100	
ドウシシャ	6,500	2,614.00	16,991,000	

コナカ	8,400	686.00	5,762,400	
コーナン商事	7,600	1,768.00	13,436,800	
黒田電気	10,600	2,350.00	24,910,000	
ネットワンシステムズ	26,600	729.00	19,391,400	
ワタミ	8,500	881.00	7,488,500	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	35,900	4,875.00	175,012,500	
丸文	5,900	937.00	5,528,300	
西松屋チェーン	12,000	1,121.00	13,452,000	
ゼンショーホールディングス	28,300	1,503.00	42,534,900	貸付株式数 8,000株
ハピネット	6,100	1,273.00	7,765,300	
幸楽苑ホールディングス	5,600	1,573.00	8,808,800	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
サイゼリヤ	9,200	2,922.00	26,882,400	
エクセル	3,300	1,699.00	5,606,700	
V Tホールディングス	20,200	745.00	15,049,000	
ガリバーインターナショナル	15,300	1,150.00	17,595,000	貸付株式数 5,100株 (5,100株)
ユナイテッドアローズ	8,000	5,430.00	43,440,000	
進和	4,300	1,779.00	7,649,700	
ハイデイ日高	4,700	3,265.00	15,345,500	
シークス	3,700	3,900.00	14,430,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
京都きもの友禅	8,500	983.00	8,355,500	貸付株式数 2,500株
コロワイド	18,700	1,812.00	33,884,400	貸付株式数 5,700株 (5,700株)
壱番屋	2,700	5,710.00	15,417,000	
スギホールディングス	10,000	6,500.00	65,000,000	
島津製作所	73,000	1,992.00	145,416,000	
J M S	20,000	323.00	6,460,000	
ブイ・テクノロジー	1,600	4,975.00	7,960,000	
スター精密	11,400	1,668.00	19,015,200	
東京計器	27,000	247.00	6,669,000	
東京精密	11,200	2,758.00	30,889,600	
マニー	5,700	2,350.00	13,395,000	
ニコン	104,800	1,652.00	173,129,600	貸付株式数 33,400株
トプコン	19,200	2,165.00	41,568,000	貸付株式数 4,800株 (4,800株)
オリンパス	83,900	4,910.00	411,949,000	
理研計器	5,800	1,568.00	9,094,400	

S C R E E Nホールディングス	59,000	924.00	54,516,000	
キヤノン電子	6,000	2,148.00	12,888,000	
タムロン	5,000	2,385.00	11,925,000	
HOYA	131,000	4,990.00	653,690,000	
ノーリツ鋼機	8,000	627.00	5,016,000	
キヤノン	302,100	3,716.00	1,122,603,600	
リコー	182,500	1,262.00	230,315,000	
シチズンホールディングス	70,000	910.00	63,700,000	
リズム時計	33,000	170.00	5,610,000	
大研医器	6,300	1,048.00	6,602,400	貸付株式数 1,700株 (300株)
メニコン	3,100	2,952.00	9,151,200	
パラマウントベッドHD	6,100	4,100.00	25,010,000	
前田工織	8,000	1,100.00	8,800,000	貸付株式数 1,900株 (300株)
永大産業	14,000	430.00	6,020,000	
アートネイチャー	5,800	1,166.00	6,762,800	
バンダイナムコHLDGS	58,100	2,741.00	159,252,100	
共立印刷	15,700	311.00	4,882,700	
フランスベッドHLDGS	9,400	972.00	9,136,800	
マーベラス	10,200	1,003.00	10,230,600	貸付株式数 2,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,000	5,530.00	55,300,000	
エイベックス・グループHD	10,900	1,471.00	16,033,900	
トッパン・フォームズ	10,800	1,595.00	17,226,000	
フジシールインターナショナル	7,100	3,865.00	27,441,500	
タカラトミー	18,500	656.00	12,136,000	貸付株式数 6,000株
大建工業	26,000	366.00	9,516,000	
凸版印刷	160,000	1,080.00	172,800,000	
大日本印刷	167,000	1,203.00	200,901,000	
図書印刷	14,000	537.00	7,518,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
共同印刷	24,000	350.00	8,400,000	
日本写真印刷	9,800	2,579.00	25,274,200	
藤森工業	5,500	3,320.00	18,260,000	
宝印刷	4,900	1,329.00	6,512,100	
前澤化成工業	7,400	1,101.00	8,147,400	
アシックス	52,600	2,812.00	147,911,200	

ツ ツ ミ	3,500	2,551.00	8,928,500	
ジェイ エス ピー	4,300	2,556.00	10,990,800	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
ニ チ ハ	8,500	1,743.00	14,815,500	
エフピコ	5,200	4,675.00	24,310,000	
小松ウオール工業	2,500	2,221.00	5,552,500	
ヤマハ	41,800	3,100.00	129,580,000	
河合楽器	2,600	2,315.00	6,019,000	
クリナップ	9,100	736.00	6,697,600	
ビジョン	32,100	3,530.00	113,313,000	
天馬	5,000	2,329.00	11,645,000	
キングジム	6,800	837.00	5,691,600	
リンテック	13,400	2,661.00	35,657,400	
信越ポリマー	14,300	671.00	9,595,300	
東 リ	21,000	353.00	7,413,000	
イトーキ	12,600	944.00	11,894,400	
任 天 堂	34,700	18,905.00	656,003,500	
三菱鉛筆	4,300	5,810.00	24,983,000	
松 風	4,000	1,512.00	6,048,000	
タカラスタンダ - ド	25,000	937.00	23,425,000	
コ ク ヨ	29,900	1,418.00	42,398,200	
ナカバヤシ	17,000	340.00	5,780,000	
ニ フ コ	11,300	5,240.00	59,212,000	
グローブライド	3,300	1,680.00	5,544,000	
岡村製作所	19,900	1,210.00	24,079,000	
日本バルカー	33,000	308.00	10,164,000	
伊 藤 忠	437,000	1,502.00	656,374,000	
丸 紅	547,400	682.00	373,326,800	
スクロール	11,000	445.00	4,895,000	
高 島	17,000	245.00	4,165,000	
ヨンドシーホールディングス	4,700	2,794.00	13,131,800	
三陽商会	37,000	308.00	11,396,000	
長瀬産業	33,100	1,565.00	51,801,500	
蝶 理	4,700	1,779.00	8,361,300	
豊田通商	62,300	2,888.00	179,922,400	
オンワ - ドホールディングス	39,000	765.00	29,835,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
三共生興	13,200	483.00	6,375,600	
兼 松	126,000	206.00	25,956,000	
美 津 濃	31,000	598.00	18,538,000	

ファミリーマート	16,700	5,490.00	91,683,000	貸付株式数	5,500株
三井物産	501,500	1,510.00	757,265,000		
日本紙パルプ	25,000	339.00	8,475,000		
東京エレクトロン	50,600	8,198.00	414,818,800		
日立ハイテクノロジーズ	19,300	3,395.00	65,523,500	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
カメイ	8,000	1,344.00	10,752,000		
東都水産	28,000	193.00	5,404,000		
スターゼン	2,500	3,640.00	9,100,000		
セイコーHD	35,000	818.00	28,630,000		
山 善	22,100	1,120.00	24,752,000		
住友商事	349,500	1,307.50	456,971,250		
日本ユニシス	15,900	1,368.00	21,751,200	貸付株式数	4,900株
内田洋行	17,000	474.00	8,058,000		
三菱商事	416,800	2,072.00	863,609,600		
第一実業	18,000	517.00	9,306,000		
キヤノンマーケティングJPN	16,000	1,947.00	31,152,000		
西華産業	22,000	302.00	6,644,000		
菱洋エレクトロ	7,300	1,410.00	10,293,000		
ユアサ商事	6,000	3,045.00	18,270,000		
神鋼商事	30,000	261.00	7,830,000		
阪和興業	59,000	548.00	32,332,000		
カナデン	10,100	989.00	9,988,900		
菱電商事	13,000	841.00	10,933,000		
ニプロ	41,500	1,351.00	56,066,500		
岩谷産業	65,000	682.00	44,330,000	貸付株式数	16,000株 (16,000株)
すてきナイスグループ	35,000	175.00	6,125,000		
兼松エレクトロニクス	5,200	2,044.00	10,628,800		
三愛石油	15,000	986.00	14,790,000		
稲畑産業	15,200	1,318.00	20,033,600		
ゴ - ルドウィン	2,600	5,760.00	14,976,000	貸付株式数	700株 (700株)
ユニ・チャ - ム	119,000	2,596.00	308,924,000		
デサント	14,100	1,498.00	21,121,800		
ワ キ タ	12,800	1,057.00	13,529,600		
東邦ホールディングス	18,000	3,055.00	54,990,000	貸付株式数	5,000株
サンゲツ	20,800	2,362.00	49,129,600		
ミツウロコグループ	12,300	618.00	7,601,400		

シナネンホールディングス	16,000	481.00	7,696,000	
伊藤忠エネクス	15,200	1,001.00	15,215,200	
サンリオ	17,300	2,940.00	50,862,000	貸付株式数 4,600株 (4,600株)
サンワ テクノス	5,000	997.00	4,985,000	
リョーサン	9,000	3,250.00	29,250,000	
新光商事	7,100	1,271.00	9,024,100	
トーホー	3,600	2,413.00	8,686,800	
三信電気	8,600	1,338.00	11,506,800	
東陽テクニカ	10,400	1,039.00	10,805,600	
モスフード サービス	7,700	3,140.00	24,178,000	
加賀電子	5,600	1,848.00	10,348,800	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
三益半導体	5,500	1,164.00	6,402,000	
木曾路	7,900	2,085.00	16,471,500	貸付株式数 2,400株
サトレストランシステムズ	9,500	901.00	8,559,500	
千趣会	14,200	818.00	11,615,600	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
ケーヨー	13,200	507.00	6,692,400	貸付株式数 1,500株
アデランス	10,900	905.00	9,864,500	
上新電機	15,000	1,163.00	17,445,000	
日本瓦斯	6,500	3,175.00	20,637,500	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
ロイヤルホールディングス	10,000	2,364.00	23,640,000	
いなげや	7,600	1,378.00	10,472,800	
島忠	14,600	2,867.00	41,858,200	
チヨダ	6,800	4,120.00	28,016,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
ライフコーポレーション	3,800	3,110.00	11,818,000	貸付株式数 1,000株
リンガーハット	5,600	2,677.00	14,991,200	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
AOKIホールディングス	13,100	1,603.00	20,999,300	
オークワ	10,000	1,258.00	12,580,000	
コメリ	8,700	2,735.00	23,794,500	
青山商事	10,800	4,570.00	49,356,000	
しまむら	6,400	15,010.00	96,064,000	
高島屋	82,000	1,122.00	92,004,000	
松屋	12,000	1,478.00	17,736,000	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	28,500	2,572.00	73,302,000	

近鉄百貨店	27,000	335.00	9,045,000	
パルコ	6,300	1,198.00	7,547,400	
丸井グループ	69,400	1,826.00	126,724,400	
クレディセゾン	42,600	2,324.00	99,002,400	
アクシアルリテイリング	4,600	4,520.00	20,792,000	
イオン	229,500	1,910.00	438,345,000	
ユニグループ・HD	54,000	749.00	40,446,000	
イズミ	10,900	4,810.00	52,429,000	
東武ストア	17,000	315.00	5,355,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
平和堂	11,300	2,971.00	33,572,300	
フジ	6,500	2,797.00	18,180,500	
ヤオコー	6,400	5,550.00	35,520,000	
ゼビオホールディングス	8,000	2,345.00	18,760,000	
ケースホールディングス	11,800	4,485.00	52,923,000	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
PALTAC	9,200	2,438.00	22,429,600	
新生銀行	492,000	234.00	115,128,000	
あおぞら銀行	366,000	434.00	158,844,000	
三菱UFJフィナンシャルG	4,457,300	790.00	3,521,267,000	
りそなホールディングス	654,000	600.80	392,923,200	
三井住友トラストHD	1,165,000	470.00	547,550,000	
三井住友フィナンシャルG	444,300	4,697.00	2,086,877,100	
第四銀行	70,000	547.00	38,290,000	
北越銀行	63,000	262.00	16,506,000	
西日本シティ銀行	178,000	326.00	58,028,000	
千葉銀行	213,000	849.00	180,837,000	
横浜銀行	371,000	724.50	268,789,500	
常陽銀行	195,000	571.00	111,345,000	
群馬銀行	121,000	739.00	89,419,000	
武蔵野銀行	8,800	4,590.00	40,392,000	
千葉興業銀行	16,200	754.00	12,214,800	
筑波銀行	26,000	409.00	10,634,000	
七十七銀行	85,000	629.00	53,465,000	
青森銀行	43,000	399.00	17,157,000	
秋田銀行	39,000	437.00	17,043,000	
山形銀行	34,000	481.00	16,354,000	
岩手銀行	4,100	5,350.00	21,935,000	
東邦銀行	50,000	445.00	22,250,000	
東北銀行	54,000	160.00	8,640,000	

みちのく銀行	30,000	199.00	5,970,000	貸付株式数	10,000株
ふくおかフィナンシャルG	241,000	597.00	143,877,000		
静岡銀行	162,000	1,203.00	194,886,000		
十六銀行	69,000	493.00	34,017,000		
スルガ銀行	57,700	2,492.00	143,788,400		
八十二銀行	100,000	745.00	74,500,000		
山梨中央銀行	36,000	641.00	23,076,000		
大垣共立銀行	75,000	507.00	38,025,000		
福井銀行	51,000	252.00	12,852,000		
北國銀行	61,000	408.00	24,888,000		
清水銀行	2,600	3,020.00	7,852,000		
滋賀銀行	50,000	619.00	30,950,000	貸付株式数	14,000株 (14,000株)
南都銀行	52,000	397.00	20,644,000		
百五銀行	49,000	603.00	29,547,000		
京都銀行	105,000	1,147.00	120,435,000		
紀陽銀行	21,300	1,856.00	39,532,800		
三重銀行	28,000	275.00	7,700,000		
ほくほくフィナンシャルG	369,000	261.00	96,309,000		
広島銀行	162,000	700.00	113,400,000		
山陰合同銀行	34,000	995.00	33,830,000		
中国銀行	37,800	1,707.00	64,524,600		
鳥取銀行	34,000	222.00	7,548,000		
伊予銀行	58,300	1,227.00	71,534,100		
百十四銀行	60,000	450.00	27,000,000		
四国銀行	46,000	294.00	13,524,000		
阿波銀行	45,000	724.00	32,580,000		
大分銀行	32,000	504.00	16,128,000	貸付株式数	11,000株
宮崎銀行	39,000	407.00	15,873,000		
佐賀銀行	38,000	271.00	10,298,000		
十八銀行	36,000	373.00	13,428,000	貸付株式数	10,000株 (10,000株)
沖縄銀行	4,600	4,720.00	21,712,000		
琉球銀行	11,500	1,688.00	19,412,000		
セブン銀行	206,800	539.00	111,465,200		
みずほフィナンシャルG	7,816,900	248.50	1,942,499,650		
高知銀行	35,000	148.00	5,180,000		
山口フィナンシャルG	51,000	1,428.00	72,828,000	貸付株式数	15,000株 (15,000株)
芙蓉総合リース	6,600	5,940.00	39,204,000		

興銀リース	11,100	2,718.00	30,169,800	
東京センチュリーリース	13,300	4,240.00	56,392,000	
SBIホールディングス	67,000	1,395.00	93,465,000	
日本証券金融	27,900	646.00	18,023,400	貸付株式数 7,300株 (7,300株)
アイフル	91,200	412.00	37,574,400	貸付株式数 26,500株
ポケットカード	8,600	584.00	5,022,400	
長野銀行	31,000	211.00	6,541,000	
名古屋銀行	48,000	452.00	21,696,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
北洋銀行	81,700	458.00	37,418,600	
愛知銀行	2,000	6,800.00	13,600,000	
第三銀行	39,000	185.00	7,215,000	
中京銀行	27,000	233.00	6,291,000	
東日本銀行	29,000	397.00	11,513,000	
大光銀行	27,000	244.00	6,588,000	
愛媛銀行	31,000	257.00	7,967,000	
トマト銀行	40,000	174.00	6,960,000	
みなと銀行	57,000	206.00	11,742,000	
京葉銀行	44,000	589.00	25,916,000	
関西アーバン銀行	6,400	1,373.00	8,787,200	
栃木銀行	31,000	745.00	23,095,000	
北日本銀行	2,400	3,350.00	8,040,000	
東和銀行	86,000	116.00	9,976,000	
福島銀行	85,000	97.00	8,245,000	
大東銀行	51,000	216.00	11,016,000	
リコーリース	4,900	3,725.00	18,252,500	
イオンフィナンシャルサービ ス	36,800	2,836.00	104,364,800	
アコム	111,300	611.00	68,004,300	貸付株式数 36,500株 (36,500株)
ジャックス	33,000	473.00	15,609,000	
オリコ	239,600	238.00	57,024,800	貸付株式数 35,800株
日立キャピタル	13,200	3,445.00	45,474,000	
オリックス	392,800	1,776.50	697,809,200	
三菱UFJリース	141,100	647.00	91,291,700	
ジャフコ	9,600	4,890.00	46,944,000	貸付株式数 2,600株 (2,600株)
トモニホールディングス	45,200	465.00	21,018,000	
大和証券G本社	518,000	796.30	412,483,400	

野村ホールディングス	1,068,300	730.20	780,072,660	
岡三証券グループ	48,000	746.00	35,808,000	
丸三証券	17,600	1,235.00	21,736,000	
東洋証券	29,000	395.00	11,455,000	
東海東京HD	62,300	743.00	46,288,900	
光世証券	32,000	181.00	5,792,000	
水戸証券	25,400	423.00	10,744,200	
いちよし証券	13,600	1,163.00	15,816,800	
松井証券	23,800	1,135.00	27,013,000	
損保ジャパン興亜HD	123,600	3,795.00	469,062,000	
日本取引所グループ	163,200	1,930.00	314,976,000	
マネックスG	65,400	332.00	21,712,800	貸付株式数 18,300株 (18,300株)
カブドットコム証券	48,400	399.00	19,311,600	
極東証券	9,200	1,648.00	15,161,600	
岩井コスモホールディング	7,200	1,472.00	10,598,400	
藍澤証券	10,800	748.00	8,078,400	
フィデアホール	35,000	284.00	9,940,000	
池田泉州HD	49,600	507.00	25,147,200	
アニコムホールディングス	4,400	2,796.00	12,302,400	貸付株式数 1,200株 (500株)
MS & AD	166,100	3,472.00	576,699,200	
マネースクウェアHD	2,700	1,507.00	4,068,900	
SONY FH	53,600	2,268.00	121,564,800	
第一生命	355,800	2,130.00	757,854,000	
東京海上HD	224,200	4,540.00	1,017,868,000	
イー・ギャランティ	2,600	2,750.00	7,150,000	貸付株式数 600株 (600株)
NECキャピタルソリューション	3,400	1,711.00	5,817,400	貸付株式数 800株 (800株)
T & Dホールディングス	203,300	1,725.00	350,692,500	
三井不動産	294,000	3,104.00	912,576,000	
三菱地所	413,000	2,589.50	1,069,463,500	
平和不動産	12,200	1,512.00	18,446,400	
東京建物	61,700	1,479.00	91,254,300	
ダイビル	14,800	1,015.00	15,022,000	
京阪神ビルディング	10,400	707.00	7,352,800	
住友不動産	134,000	3,742.00	501,428,000	
大京	107,000	202.00	21,614,000	
テーオーシー	23,000	1,027.00	23,621,000	

東京楽天地	19,000	513.00	9,747,000	
レオパレス21	66,100	720.00	47,592,000	
スターツコーポレーション	6,800	2,264.00	15,395,200	
フジ住宅	7,300	775.00	5,657,500	貸付株式数 3,600株
空港施設	12,100	616.00	7,453,600	
住友不動産販売	4,600	2,913.00	13,399,800	
ゴールドクレスト	4,900	2,407.00	11,794,300	
リロ・ホールディング	2,300	13,330.00	30,659,000	
タカラレーベン	25,800	681.00	17,569,800	
サンヨーハウジング名古屋	5,900	1,152.00	6,796,800	
イオンモール	35,700	2,115.00	75,505,500	
東祥	2,200	3,435.00	7,557,000	
トーセイ	9,700	757.00	7,342,900	
エヌ・ティ・ティ都市開発	33,000	1,200.00	39,600,000	
サンフロンティア不動産	7,800	901.00	7,027,800	
エフ・ジェー・ネクスト	8,400	516.00	4,334,400	
東武鉄道	304,000	600.00	182,400,000	
相鉄ホールディングス	96,000	688.00	66,048,000	
東京急行	329,000	957.00	314,853,000	
京浜急行	153,000	997.00	152,541,000	
小田急電鉄	182,000	1,252.00	227,864,000	
京王電鉄	158,000	1,011.00	159,738,000	
京成電鉄	85,000	1,478.00	125,630,000	貸付株式数 24,000株 (24,000株)
富士急行	17,000	1,175.00	19,975,000	
新京成電鉄	25,000	465.00	11,625,000	
東日本旅客鉄道	102,900	11,620.00	1,195,698,000	
西日本旅客鉄道	54,400	7,775.00	422,960,000	
東海旅客鉄道	50,400	21,985.00	1,108,044,000	
西武ホールディングス	44,800	2,598.00	116,390,400	
鴻池運輸	8,700	1,552.00	13,502,400	
西日本鉄道	72,000	670.00	48,240,000	
ハマキョウレックス	5,100	2,379.00	12,132,900	
サカイ引越センター	1,300	7,010.00	9,113,000	
近鉄グループHLDGS	561,000	472.00	264,792,000	
阪急阪神HLDGS	376,000	788.00	296,288,000	
南海電鉄	126,000	639.00	80,514,000	
京阪電鉄	125,000	821.00	102,625,000	
神戸電鉄	27,000	355.00	9,585,000	
名古屋鉄道	201,000	496.00	99,696,000	

山陽電鉄	27,000	465.00	12,555,000	
トランコム	1,900	6,570.00	12,483,000	
日本通運	220,000	556.00	122,320,000	
ヤマトホールディングス	103,500	2,354.00	243,639,000	
山 九	74,000	614.00	45,436,000	
日 新	29,000	394.00	11,426,000	
丸全昭和運輸	24,000	447.00	10,728,000	
センコー	26,000	790.00	20,540,000	
トナミホールディングス	15,000	365.00	5,475,000	
ニッコンホールディングス	18,700	2,338.00	43,720,600	
福山通運	34,000	591.00	20,094,000	貸付株式数 9,000株 (5,000株)
セイノーホールディングス	40,200	1,248.00	50,169,600	
神奈川中央交通	12,000	701.00	8,412,000	
日立物流	12,100	2,037.00	24,647,700	
日本郵船	506,000	320.00	161,920,000	
商船三井	277,000	321.00	88,917,000	
川崎汽船	245,000	253.00	61,985,000	
N S ユナイテッド海運	29,000	231.00	6,699,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
飯野海運	29,800	513.00	15,287,400	
日本航空	106,300	4,210.00	447,523,000	
A N A ホールディングス	1,040,000	346.50	360,360,000	
三菱倉庫	41,000	1,721.00	70,561,000	貸付株式数 11,000株
三井倉庫H O L D	35,000	361.00	12,635,000	
住友倉庫	43,000	655.00	28,165,000	
渋沢倉庫	22,000	318.00	6,996,000	
ヤマタネ	33,000	200.00	6,600,000	
東陽倉庫	25,000	268.00	6,700,000	
日本トランスシティ	17,000	479.00	8,143,000	
安田倉庫	7,100	943.00	6,695,300	
東洋埠頭	37,000	195.00	7,215,000	
上 組	65,000	1,085.00	70,525,000	
キューソー流通システム	2,200	2,584.00	5,684,800	
郵船ロジスティクス	6,200	1,483.00	9,194,600	
近鉄エクスプレス	10,400	2,350.00	24,440,000	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
東京放送H D	33,800	1,855.00	62,699,000	貸付株式数 9,400株
日本テレビH L D S	51,100	2,269.00	115,945,900	

テレビ朝日HD	15,700	2,129.00	33,425,300	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
スカパーJSAHD	45,500	623.00	28,346,500	
テレビ東京HD	5,800	2,322.00	13,467,600	貸付株式数 1,600株 (200株)
コネクシオ	6,800	1,156.00	7,860,800	
日本通信	32,600	341.00	11,116,600	貸付株式数 9,200株
日本電信電話	429,800	4,565.00	1,962,037,000	
KDDI	564,900	3,058.00	1,727,464,200	
光通信	6,700	8,860.00	59,362,000	
NTTドコモ	428,900	2,328.00	998,479,200	
エムティーアイ	8,500	699.00	5,941,500	
GMOインターネット	21,000	1,894.00	39,774,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
カドカワ	18,100	1,920.00	34,752,000	
学研ホールディングス	28,000	265.00	7,420,000	
ゼンリン	8,400	2,250.00	18,900,000	
東京電力	478,100	754.00	360,487,400	
中部電力	172,900	1,698.50	293,670,650	
関西電力	230,600	1,380.00	318,228,000	
中国電力	77,200	1,577.00	121,744,400	
北陸電力	55,000	1,683.00	92,565,000	
東北電力	140,700	1,446.00	203,452,200	
四国電力	50,900	1,763.00	89,736,700	
九州電力	124,400	1,291.00	160,600,400	
北海道電力	53,100	1,109.00	58,887,900	
沖縄電力	6,200	2,854.00	17,694,800	
電源開発	47,500	3,935.00	186,912,500	
東京瓦斯	624,000	588.10	366,974,400	
大阪瓦斯	578,000	457.10	264,203,800	
東邦瓦斯	140,000	765.00	107,100,000	
北海道瓦斯	21,000	279.00	5,859,000	貸付株式数 7,000株 (2,000株)
広島ガス	14,700	471.00	6,923,700	
西部瓦斯	66,000	277.00	18,282,000	
静岡ガス	18,000	834.00	15,012,000	
メタウォーター	3,700	2,970.00	10,989,000	
松竹	38,000	1,167.00	44,346,000	
東宝	40,000	3,275.00	131,000,000	
エイチ・アイ・エス	9,800	3,995.00	39,151,000	

東映	22,000	1,254.00	27,588,000	
N T Tデータ	34,600	6,000.00	207,600,000	
共立メンテナンス	4,500	9,910.00	44,595,000	貸付株式数 1,000株
イチネンホールディングス	6,800	1,107.00	7,527,600	
建設技術研究所	4,800	1,311.00	6,292,800	
アインホールディングス	6,900	5,790.00	39,951,000	
東京テアトル	56,000	138.00	7,728,000	貸付株式数 13,000株
よみうりランド	16,000	422.00	6,752,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
東京都競馬	45,000	286.00	12,870,000	
常磐興産	35,000	156.00	5,460,000	
カナモト	8,600	2,846.00	24,475,600	貸付株式数 2,300株
東京ドーム	50,000	581.00	29,050,000	
D T S	6,800	2,914.00	19,815,200	
スクウェア・エニックス・H D	23,500	2,799.00	65,776,500	
シーイーシー	5,800	1,146.00	6,646,800	
カプコン	14,600	2,711.00	39,580,600	
西尾レントオール	5,100	3,400.00	17,340,000	
日本空港ビルデング	17,800	6,210.00	110,538,000	貸付株式数 5,600株 (5,600株)
トランス・コスモス	7,200	3,055.00	21,996,000	
乃村工藝社	13,500	1,863.00	25,150,500	
ジャステック	6,500	1,070.00	6,955,000	
S C S K	13,400	4,780.00	64,052,000	
藤田観光	24,000	591.00	14,184,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
K N T - C Tホールディング ス	31,000	247.00	7,657,000	
日本管財	5,800	1,999.00	11,594,200	
トーカイ	3,100	3,855.00	11,950,500	
セコム	61,200	8,437.00	516,344,400	
アイネス	9,100	1,153.00	10,492,300	
丹青社	12,200	923.00	11,260,600	貸付株式数 3,500株
メイテック	7,600	4,105.00	31,198,000	
T K C	5,700	3,065.00	17,470,500	
アサツー ディ・ケイ	10,500	2,974.00	31,227,000	
富士ソフト	9,000	2,745.00	24,705,000	
応用地質	7,400	1,450.00	10,730,000	
船井総研ホールディン	7,800	1,963.00	15,311,400	

N S D	13,100	1,780.00	23,318,000	
コナミホールディングス	25,300	2,881.00	72,889,300	
ベネッセホールディングス	19,500	3,120.00	60,840,000	
イオンディライト	6,000	3,815.00	22,890,000	
ニチイ学館	11,400	837.00	9,541,800	貸付株式数 4,800株 (4,800株)
ダイセキ	12,000	2,023.00	24,276,000	
日鉄住金物産	36,000	423.00	15,228,000	
トラスコ中山	6,300	4,640.00	29,232,000	
ヤマダ電機	168,400	554.00	93,293,600	貸付株式数 50,600株 (50,600株)
オートバックスセブン	21,500	2,230.00	47,945,000	
アークランドサカモト	5,200	2,807.00	14,596,400	
ニトリホールディングス	23,900	10,140.00	242,346,000	
吉野家ホールディングス	20,800	1,528.00	31,782,400	
加藤産業	9,200	2,861.00	26,321,200	
イノテック	10,800	548.00	5,918,400	
イエローハット	5,600	2,652.00	14,851,200	
松屋フーズ	3,600	2,776.00	9,993,600	
J B C Cホールディングス	7,900	793.00	6,264,700	
サガミチェーン	9,500	1,344.00	12,768,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
日 伝	2,900	3,015.00	8,743,500	
ミロク情報サービス	6,300	858.00	5,405,400	
因幡電機産業	7,900	3,945.00	31,165,500	
王将フードサービス	4,300	4,180.00	17,974,000	貸付株式数 1,300株
プレナス	6,700	2,016.00	13,507,200	
ミニストップ	4,500	2,284.00	10,278,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
アークス	10,500	2,606.00	27,363,000	
パローホールディングス	12,100	2,889.00	34,956,900	
ミスミグループ本社	62,400	1,671.00	104,270,400	
ベ ル ク	3,000	4,575.00	13,725,000	
ファーストリテイリング	11,100	49,780.00	552,558,000	貸付株式数 3,100株
ソフトバンクグループ	315,400	6,537.00	2,061,769,800	
スズケン	25,300	4,805.00	121,566,500	
サンドラッグ	11,800	7,930.00	93,574,000	
サクスパーホールディング	5,900	2,033.00	11,994,700	
ジェコス	4,900	1,061.00	5,198,900	
ベルーナ	15,500	699.00	10,834,500	

合計			131,197,269,060	
----	--	--	-----------------	--

(注) 1. 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

トヨタ自動車 100,000株

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

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成27年12月30日

資産総額	3,250,588,295円
負債総額	5,409,938円
純資産総額（ - ）	3,245,178,357円
発行済数量	2,964,575,233口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.0947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27年12月30日

資産総額	134,183,539,945円
負債総額	3,674,784,699円
純資産総額（ - ）	130,508,755,246円
発行済数量	141,468,780,289口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9225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。

第二部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成27年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に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。

平成27年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	31	154,128
追加型株式投資信託	603	11,974,562
株式投資信託 合計	634	12,128,690
単位型公社債投資信託	3	29,316
追加型公社債投資信託	17	3,006,014
公社債投資信託 合計	20	3,035,330
総合計	654	15,164,021

3 【委託会社等の経理状況】

1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第57期事業年度に係る中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	15,186	31,438
有価証券	15,003	4,878
前払費用	157	139
未収委託者報酬	8,265	10,295
未収収益	103	110
繰延税金資産	674	585
その他	15	153
流動資産計	39,406	47,600
固定資産		
有形固定資産	1	255
建物	23	21
器具備品	228	234
無形固定資産	2,991	2,759
ソフトウェア	2,910	2,758
ソフトウェア仮勘定	68	1
電話加入権	11	-

投資その他の資産	15,077		12,979
投資有価証券	8,338		6,667
関係会社株式	5,141		5,129
出資金	129		124
長期差入保証金	997		996
投資不動産	1	398	1
その他		74	
貸倒引当金		3	
固定資産計		18,320	
資産合計		57,727	
			63,596

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	53	64
未払金	8,998	9,172
未払収益分配金	7	5
未払償還金	77	72
未払手数料	4,277	4,965
その他未払金	2	4,127
未払費用	3,463	4,162
未払法人税等	1,530	1,133
未払消費税等	530	1,429
賞与引当金	955	1,092
その他	1	747
流動負債計	15,534	17,801
固定負債		
退職給付引当金	1,959	2,072
役員退職慰労引当金	80	101
繰延税金負債	1,789	1,745
その他	3	2
固定負債計	3,832	3,920
負債合計	19,366	21,722
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	10,821	14,126
利益剰余金合計	11,196	14,501
株主資本合計	37,866	41,171
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	494	702
評価・換算差額等合計	494	702
純資産合計	38,360	41,873
負債・純資産合計	57,727	63,596

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	84,771	90,924
その他営業収益	788	933
営業収益計	85,560	91,858
営業費用		
支払手数料	47,520	49,978
広告宣伝費	668	670
調査費	8,246	9,013
調査費	741	867
委託調査費	7,505	8,146
委託計算費	735	756
営業雑経費	1,323	1,289
通信費	249	252
印刷費	477	481
協会費	54	53
諸会費	11	13
その他営業雑経費	531	488
営業費用計	58,494	61,709
一般管理費		
給料	5,708	5,881
役員報酬	243	289
給料・手当	3,785	3,803
賞与	724	695
賞与引当金繰入額	955	1,092

福利厚生費	793	831
交際費	37	45
旅費交通費	191	176
租税公課	222	259
不動産賃借料	1,182	1,180
退職給付費用	373	383
役員退職慰労引当金繰入額	33	38
固定資産減価償却費	963	1,032
諸経費	1,354	1,372
一般管理費計	10,862	11,201
営業利益	16,203	18,948

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	144	1	1,226
受取利息		9		20
その他		220		372
営業外収益計		374		1,620
営業外費用				
投資有価証券売却損		3		84
その他		71		67
営業外費用計		74		152
経常利益		16,503		20,416
特別利益				
固定資産売却益		-		7
特別利益計		-		7
特別損失				
外国税関連費用		-		746
その他		0		26
特別損失計		0		772
税引前当期純利益		16,502		19,651
法人税、住民税及び事業税		6,525		6,238
法人税等調整額		150		17
法人税等合計		6,375		6,220
当期純利益		10,126		13,431

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	7,722	8,097	34,767
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027	△7,027	△7,027
当期純利益	-	-	-	10,126	10,126	10,126
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,099	3,099	3,099
当期末残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866

	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	464	464	35,231
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△7,027
当期純利益	-	-	10,126
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	30	30	30
当期変動額合計	30	30	3,129
当期末残高	494	494	38,360

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

	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	10,821	11,196	37,866
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,126	△10,126	△10,126
当期純利益	-	-	-	13,431	13,431	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,304	3,304	3,304
当期末残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171

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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

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	8～47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) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

(4) 役員退職慰労引当金

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

4. 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)

(貸借対照表)

前事業年度において、「流動資産」に独立掲記しておりました「貯蔵品」、「前払金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動資産」の「その他」として表示しております。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、「流動資産」に表示していた「貯蔵品」14百万円、「前払金」0百万円、「その他」0百万円は、「その他」15百万円として組替えております。

前事業年度において、「有形固定資産」に独立掲記しておりました「リース資産」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「有形固定資産」の「器具備品」として表示しております。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、「有形固定資産」に表示していた「リース資産」4百万円、「器具備品」224百万円は、「器具備品」228百万円として組替えております。

前事業年度において、「投資その他の資産」に独立掲記しておりました「従業員に対する長期貸付金」、「長期前払費用」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」として表示しております。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、「投資その他の資産」に表示していた「従業員に対する長期貸付金」68百万円、「長期前払費用」6百万円は、「その他」74百万円として組替えております。

前事業年度において、「流動負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動負債」の「その他」として表示しております。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、「流動負債」に表示していた「リース債務」1百万円は、「その他」1百万円として組替えております。

前事業年度において、「固定負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「固定負債」の「その他」として表示しております。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、「固定負債」に表示していた「リース債務」3百万円は、「その他」3百万円として組替えております。

（損益計算書）

前事業年度において、「営業費用」に独立掲記しておりました「公告費」、「受益証券発行費」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業費用」の「その他営業雑経費」として表示しております。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、「営業費用」に表示していた「公告費」0百万円、「受益証券発行費」0百万円、「その他営業雑経費」530百万円は、「その他営業雑経費」531百万円として組替えております。

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「有価証券利息」、「投資有価証券売却益」、「有価証券償還益」、「時効成立分配金・償還金」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「有価証券利息」13百万円、「投資有価証券売却益」64百万円、「有価証券償還益」63百万円、「時効成立分配金・償還金」44百万円、「その他」34百万円は、「その他」220百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」に独立掲記しておりました「有価証券償還損」、「時効成立後支払分配金・償還金」、「投資不動産管理費用」、「貯蔵品廃棄損」は、金額的重要性が乏し

いため、当事業年度より「営業外費用」の「その他」として表示しております。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、「営業外費用」に表示していた「有価証券償還損」18百万円、「時効成立後支払分配金・償還金」16百万円、「投資不動産管理費用」16百万円、「貯蔵品廃棄損」9百万円、「その他」9百万円は、「その他」71百万円として組替えております。

前事業年度において、「特別損失」に独立掲記しておりました「固定資産除却損」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「特別損失」の「その他」として表示しております。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、「特別損失」に表示していた「固定資産除却損」0百万円は、「その他」0百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	18百万円	20百万円
器具備品	251百万円	275百万円
投資建物	729百万円	-
投資器具備品	24百万円	-

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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
未払金	4,508百万円	4,084百万円

3 保証債務

前事業年度(平成26年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(平成27年3月31日)

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

(損益計算書関係)

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)	当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)
受取配当金	-	1,065百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年 6月24日 定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

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

平成26年 6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

当事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日

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

平成27年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し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26年3月31日）

（単位：百万円）

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

(*) 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27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) 其他有価証券 非上場株式	1,059	1,025
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,141	5,129
(3) 長期差入保証金	997	996

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26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	15,186	-	-	-
未収委託者報酬	8,265	-	-	-
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	-	1,498	3,978	97
合計	23,452	1,498	3,978	97

当事業年度 (平成27年3月31日)

(単位 : 百万円)

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

(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26年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成26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	113	55	58
(2) その他 証券投資信託	5,625	4,873	751
小計	5,738	4,928	809
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	16,544	16,586	41
小計	16,544	16,586	41
合計	22,283	21,514	768

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,059百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

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

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,025百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
その他 証券投資信託	24,501	64	3
合計	24,501	64	3

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,935百万円	1,959百万円
勤務費用	201	212
退職給付の支払額	217	118
その他	39	18
退職給付債務の期末残高	1,959	2,072

(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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,959百万円	2,072百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072
退職給付引当金	1,959	2,072
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072

(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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
勤務費用	201百万円	212百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	201	212

3. 確定拠出制度

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

(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	当事業年度
	(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)
繰延税金資産		
減損損失	833	-
退職給付引当金	698	670
賞与引当金	287	305
外国税関連費用	-	241
未払事業税	335	231
連結法人間取引(譲渡損)	141	128
投資有価証券評価損	128	105
出資金評価損	116	103
その他	246	206
繰延税金資産小計	2,789	1,992
評価性引当額	1,200	613
繰延税金資産合計	1,588	1,379
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428	2,203

その他有価証券評価差額金	273	335
その他	1	-
繰延税金負債合計	2,704	2,539
繰延税金負債の純額	1,115	1,159

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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率	-	35.64%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	1.14%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	2.02%
評価性引当額の増減額	-	2.67%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	0.51%
その他	-	0.07%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	31.65%

(注) 前事業年度においては、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため記載を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が44百万円、繰延税金負債（長期）が180百万円、法人税等調整額が100百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が34百万円増加しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

[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25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (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)	1,719	-	-

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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,834	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	--------------	------	---------	-------	---	---

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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25年4月1日 至 平成26年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,994	未払手数料	3,216
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	678	未払費用	393
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,705.91円	1株当たり純資産額	16,052.69円
1株当たり当期純利益	3,882.07円	1株当たり当期純利益	5,148.94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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,126	13,431
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位:百万円)

当中間会計期間
(平成27年9月30日)

資産の部

流動資産

現金・預金

22,998

有価証券		4,461
未収委託者報酬		10,719
繰延税金資産		504
その他		334
流動資産合計		39,018
固定資産		
有形固定資産	1	247
無形固定資産		
ソフトウェア		2,432
その他		135
無形固定資産合計		2,568
投資その他の資産		
投資有価証券		5,468
関係会社株式		5,129
その他		1,231
投資その他の資産合計		11,830
固定資産合計		14,646
資産合計		53,664

(単位:百万円)

当中間会計期間
(平成27年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		7,124
未払費用		4,744
未払法人税等		1,085
賞与引当金		903
その他	3	643

流動負債合計 14,500

固定負債

退職給付引当金		2,142
役員退職慰労引当金		111
繰延税金負債		1,497
その他		2

固定負債合計 3,754

負債合計	18,255
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	8,096
利益剰余金合計	8,471
株主資本合計	35,141
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	267
評価・換算差額等合計	267
純資産合計	35,409
負債・純資産合計	53,664

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間	
	(自 平成27年4月1日	
	至 平成27年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		46,714
その他営業収益		435
営業収益合計		47,150
営業費用		
支払手数料		24,499
その他営業費用		6,487
営業費用合計		30,987
一般管理費	1	5,812
営業利益		10,350
営業外収益	2	378
営業外費用	3	29
経常利益		10,699
税引前中間純利益		10,699
法人税、住民税及び事業税		3,260
法人税等調整額		39
中間純利益		7,398

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,428	△ 13,428	△ 13,428
中間純利益	-	-	-	7,398	7,398	7,398
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 6,029	△ 6,029	△ 6,029
当中間期末残高	15,174	11,495	374	8,096	8,471	35,141

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	702	702	41,873
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,428
中間純利益	-	-	7,398
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 434	△ 434	△ 434
当中間期変動額合計	△ 434	△ 434	△ 6,464
当中間期末残高	267	267	35,409

注記事項

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成27年9月30日現在)
有形固定資産	239百万円

2 保証債務

当中間会計期間（平成27年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,765百万円に対して保証を行っております。

3 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
有形固定資産	15百万円
無形固定資産	532百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
外国税関連費用引当金戻入益	171百万円
投資有価証券売却益	99百万円
受取配当金	69百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
為替差損	13百万円
貯蔵品廃棄損	5百万円
投資有価証券売却損	2百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,428	5,148	平成27 年 3月 31日	平成27年 6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成27年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,998	22,998	-
(2) 未収委託者報酬	10,719	10,719	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	8,908	8,908	-
資産合計	42,626	42,626	-
(1) 未払金	7,124	7,124	-
(2) 未払費用(*)	3,702	3,702	-
負債合計	10,827	10,827	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払金及び(2) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	1,021
子会社株式	5,129
差入保証金	1,052

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成27年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	161	55	106
(2) その他 証券投資信託	3,455	3,002	453
小計	3,617	3,058	559
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	5,290	5,453	163
小計	5,290	5,453	163
合計	8,908	8,511	396

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額 1,021百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

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

[関連情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
--

1株当たり純資産額	13,574.37円
1株当たり中間純利益金額	2,836.44円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注) 2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
中間純利益(百万円)	7,398
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,398
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

平成27年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 代表取締役の人数の変更（4名以内に変更）

平成27年6月26日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 取締役（業務執行取締役等であるものを除く。）の責任を法令の定める限度に制限する契約を締結できる旨の規定の新設

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成27年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 （平成27年3月 末日現在）	事業の内容
日本生命保険相互会社	1,250,000	（注1）
三井住友信託銀行株式会社	342,037	（注2）

（注1）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成27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 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

(提出年月日)	(書類名)
平成27年2月20日	有価証券届出書、有価証券報告書(第8期)
平成27年8月25日	半期報告書(第9期中)、有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成27年 5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 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、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27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28年1月8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26年12月2日から平成27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27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27年11月25日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。