

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 平成28年10月3日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 岩本 信之

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【事務連絡者氏名】 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

**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】** ダイワ上場投信 - J P X 日経400

**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】** 継続申込期間（平成28年4月2日から平成29年4月3日ま
で）
5兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 名 称 株式会社東京証券取引所
所在地 東京都中央区日本橋兜町2番1号

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年4月1日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、有価証券報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>の記載事項は原有価証券届出書の更新後の内容を示します。

第一部 【証券情報】

(6) 【申込単位】

<更新後>

<略>

(1) 所定の方法

1. 委託会社は、取得申込受付日の3営業日前までに、取得申込受付日に適用される「取得時のバスケット」を定めます。委託会社は、原則として、取得時のバスケットを、取得申込可能日の毎日、インターネット・サイト「<http://etf.daiwa-am.co.jp/>」に掲示します。

<略>

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

< 略 >

2

当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

< 略 >

●収益分配金は、名義登録受益者に対して支払われます。

- ・名義登録受益者とは、計算期間終了日において氏名または名称、住所および個人番号または法人番号（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所）が受託会社に登録されている者をいいます。

3

収益の分配は、計算期間ごとに、信託財産について生じる配当、受取利息その他これらに類する収益の額の合計額から支払利子、運用管理費用（信託報酬）その他これらに類する費用の額の合計額を控除した額の全額について行ないます。決算日は毎年1月10日および7月10日です。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

< 略 >

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「JPX日経インデックス400」の変動率に一致させることを目的として運用を行ないます。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

- ・指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れない場合があること
- ・運用管理費用（信託報酬）、売買委託手数料等の費用負担
- ・株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- ・指数の算出に使用する株価と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- ・株価指数先物取引*と指数の動きの不一致（株価指数先物取引を利用した場合）
- ・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
- ・追加設定時、および組入銘柄の配当金や権利処理等によって信託財産に現金が発生すること

*JPX日経インデックス400以外の指数先物取引を利用することがあります。

(3) 【ファンドの仕組み】

< 更新後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成28年7月末日現在） >

< 略 >

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

< 更新後 >

< 略 >

職務権限

< 略 >

ロ . Deputy-CIO（0～5名程度）

< 略 >

ハ . インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

< 略 >

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30～40名程度です。

< 略 >

上記の運用体制は平成28年7月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

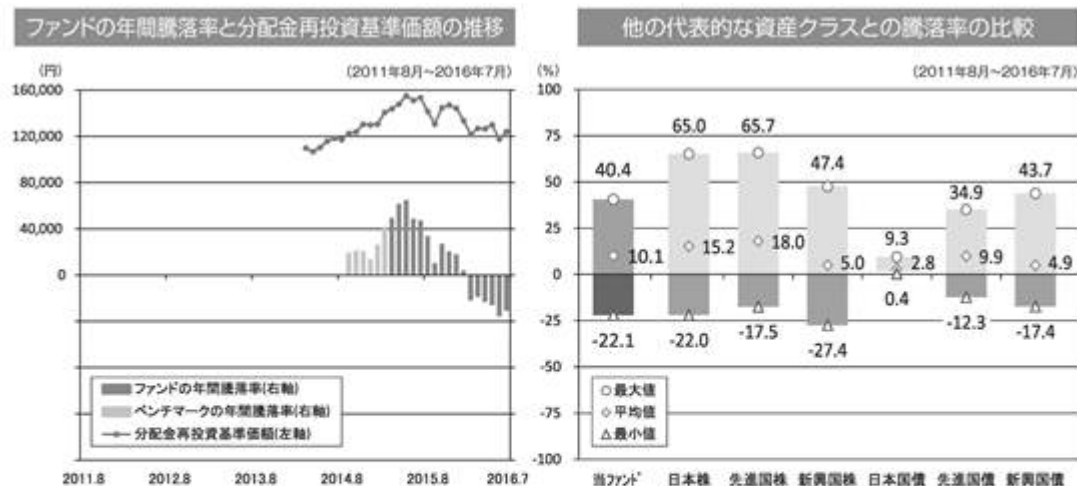
3 【投資リスク】

< 更新後 >

< 略 >

参考情報

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



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

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

< 更新後 >

< 略 >

() 上記は、平成28年7月末現在のものですので、税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。

< 略 >

5 【運用状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

(1) 【投資状況】（平成28年7月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		82,678,927,840	99.79
	内 日本	82,678,927,840	99.79
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		170,612,548	0.21
純資産総額		82,849,540,388	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)		169,477,000	0.20
	内 日本	169,477,000	0.20

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(2) 【投資資産】（平成28年7月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	数業種は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	341,700	4,829.09 1,650,100,892	4,881.00 1,667,837,700	2.01
2	KDDI	日本	株式	情報・通信業	505,700	3,134.04 1,584,887,522	3,145.00 1,590,426,500	1.92
3	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	351,800	4,288.99 1,508,867,071	4,025.00 1,415,995,000	1.71
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	228,000	5,399.22 1,231,022,518	5,703.00 1,300,284,000	1.57
5	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	424,900	2,795.00 1,187,599,480	2,749.50 1,168,262,550	1.41
6	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	655,100	1,603.50 1,050,454,389	1,721.50 1,127,754,650	1.36
7	武田薬品	日本	株式	医薬品	240,400	4,253.48 1,022,536,800	4,588.00 1,102,955,200	1.33
8	本田技研	日本	株式	輸送用機器	387,200	2,477.06 959,121,300	2,841.50 1,100,228,800	1.33

9	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	237,900	4,078.42 970,257,719	4,303.00 1,023,683,700	1.24
10	ファナック	日本	株式	電気機器	58,400	15,500.00 905,200,000	17,325.00 1,011,780,000	1.22
11	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	105,300	9,339.11 983,408,300	9,485.00 998,770,500	1.21
12	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	168,600	5,056.45 852,517,800	5,894.00 993,728,400	1.20
13	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	51,600	18,066.51 932,232,300	19,220.00 991,752,000	1.20
14	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	5,901,000	142.08 838,415,288	167.10 986,057,100	1.19
15	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	297,500	2,775.70 825,772,174	3,308.00 984,130,000	1.19
16	キーエンス	日本	株式	電気機器	13,100	70,731.58 926,583,700	72,920.00 955,252,000	1.15
17	東京海上HD	日本	株式	保険業	230,400	3,253.06 749,506,430	4,040.00 930,816,000	1.12
18	キヤノン	日本	株式	電気機器	310,200	2,802.67 869,391,163	2,935.00 910,437,000	1.10
19	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,743,400	428.82 747,609,078	522.00 910,054,800	1.10
20	花王	日本	株式	化学	153,300	5,827.00 893,279,100	5,553.00 851,274,900	1.03
21	三菱地所	日本	株式	不動産業	423,000	1,728.10 730,988,000	1,929.00 815,967,000	0.98
22	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	785,600	918.94 721,923,577	1,012.00 795,027,200	0.96
23	村田製作所	日本	株式	電気機器	60,500	10,482.95 634,219,062	12,825.00 775,912,500	0.94
24	信越化学	日本	株式	化学	108,200	5,903.00 638,705,100	7,064.00 764,324,800	0.92
25	三菱商事	日本	株式	卸売業	426,700	1,748.13 745,928,787	1,778.50 758,885,950	0.92
26	ダイキン工業	日本	株式	機械	83,900	8,030.12 673,727,900	9,012.00 756,106,800	0.91
27	三菱電機	日本	株式	電気機器	615,000	1,108.39 681,665,638	1,217.50 748,762,500	0.90
28	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	203,700	3,140.86 639,794,036	3,601.00 733,523,700	0.89
29	富士重工業	日本	株式	輸送用機器	182,100	3,289.17 598,959,000	4,015.00 731,131,500	0.88
30	日立	日本	株式	電気機器	1,470,000	403.38 592,980,400	476.50 700,455,000	0.85

(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。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.79%
合計	99.79%

(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。

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
鉱業	0.34%
建設業	3.32%
食料品	5.10%
繊維製品	0.50%
パルプ・紙	0.16%
化学	6.80%
医薬品	7.34%
石油・石炭製品	0.06%
ゴム製品	1.09%
ガラス・土石製品	0.92%
鉄鋼	1.13%
非鉄金属	0.90%
金属製品	0.29%
機械	5.09%
電気機器	12.63%
輸送用機器	8.30%
精密機器	1.65%
その他製品	0.63%
電気・ガス業	0.78%
陸運業	5.78%
海運業	0.11%
空運業	0.38%
倉庫・運輸関連業	0.02%
情報・通信業	8.73%
卸売業	4.22%
小売業	4.78%
銀行業	6.18%
証券、商品先物取引業	1.24%
保険業	3.20%
その他金融業	1.50%
不動産業	3.20%
サービス業	3.44%
合計	99.79%

(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	JPX日経インデックス400 先物 2016年9月	買建	142	154,851,000	169,477,000	0.20%

(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。

(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)	東京証券取 引所 市場相場
第1計算期間末 (平成26年7月10日)	5,440,571,281	5,486,102,353	11,471.2	11,567.2	11,560
第2計算期間末 (平成27年1月10日)	34,662,407,429	34,789,274,831	12,568.0	12,614.0	12,530
第3計算期間末 (平成27年7月10日)	45,479,016,029	45,893,092,619	14,388.0	14,519.0	14,430
平成27年7月末日	50,518,494,336	-	15,039.4	-	15,000
8月末日	48,011,816,170	-	13,884.3	-	13,860
9月末日	55,575,699,295	-	12,788.1	-	12,850
10月末日	67,161,175,724	-	14,175.6	-	14,180
11月末日	69,688,685,223	-	14,408.6	-	14,420
12月末日	69,790,413,045	-	14,140.8	-	14,130
第4計算期間末 (平成28年1月10日)	64,733,685,681	65,172,936,103	13,116.2	13,205.2	13,160
平成28年1月末日	65,476,597,892	-	13,002.6	-	13,080
2月末日	63,101,874,445	-	11,834.9	-	11,900
3月末日	70,743,552,133	-	12,352.6	-	12,400
4月末日	76,578,808,582	-	12,310.5	-	12,290
5月末日	83,668,699,652	-	12,646.3	-	12,630
6月末日	82,522,239,474	-	11,441.5	-	11,450
第5計算期間末 (平成28年7月10日)	78,136,038,761	78,833,415,581	10,980.2	11,078.2	11,000
7月末日	82,849,540,388	-	11,973.4	-	11,970

(注) 計算期間末日が休業日の場合は、前営業日の市場相場を記載しております。

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	96.0
第2計算期間	46.0
第3計算期間	131.0
第4計算期間	89.0
第5計算期間	98.0

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	9.8
第2計算期間	10.0
第3計算期間	15.5
第4計算期間	8.2
第5計算期間	15.5

(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	0	0
第2計算期間	2,283,705	0
第3計算期間	989,340	586,437
第4計算期間	1,873,153	98,645
第5計算期間	3,355,529	1,174,837

(注) 当初設定数量は474,282口です。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

2016年7月29日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	119,734円
純資産総額	828億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	5.6%
3カ月間	-1.9%
6カ月間	-7.1%
1年間	-19.1%
3年間	-
5年間	-
設定来	17.9%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 1,870円 設定来分配金合計額: 4,600円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期					
	14年7月	15年1月	15年7月	16年1月	16年7月					
分配金	960円	460円	1,310円	890円	980円					

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

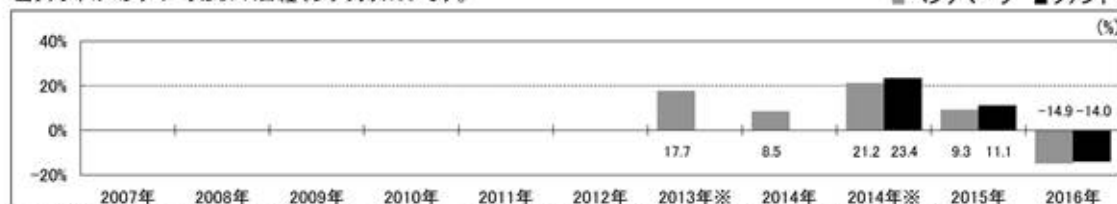
資産別構成		銘柄数		比率		株式東証33業種別構成		比率		組入上位10銘柄		業種名		比率	
国内株式	400	99.8%	電気機器	12.6%	日本電信電話	情報・通信業	2.0%								
国内株式先物	1	0.2%	情報・通信業	8.7%	KDDI	情報・通信業	1.9%								
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	8.3%	日本たばこ産業	食料品	1.7%								
コール・ローン、その他	-	0.2%	医薬品	7.3%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.6%								
合計	401	-	化学	6.8%	NTTドコモ	情報・通信業	1.4%								
株式市場・上場別構成	比率	銀行業	6.2%	アステラス製薬	医薬品	1.4%									
一部(東証・名証)	99.6%	陸運業	5.8%	武田薬品	医薬品	1.3%									
二部(東証・名証)	0.0%	食料品	5.1%	本田技研	輸送用機器	1.3%									
新興市場他	0.2%	機械	5.1%	セブン&アイ・HLDGS	小売業	1.2%									
その他	-	その他	33.8%	ファナック	電気機器	1.2%									
合計	99.8%	合計	99.8%	合計	15.1%										

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはJPX日経インデックス400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。

・2013年※はベンチマークの起算日(8月30日)から年末、2014年※は設定日(3月26日)から年末、2016年は7月29日までの騰落率を表しています。

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

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

第2 【管理及び運営】

4 【受益者の権利等】

<更新後>

<略>

収益分配金にかかる請求権

<略>

2. 受託会社は、計算期間終了日現在において、氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。

<略>

(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) 当ファンドの計算期間は6か月であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 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5期計算期間（平成28年1月11日から平成28年7月10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】

ダイワ上場投信 - J P X 日経400

(1) 【貸借対照表】

		第4期	第5期
		平成28年1月10日現在	平成28年7月10日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		214,443,371	391,009,514
株式	2	64,610,860,270	77,957,614,180
未収入金		333,212,415	432,190,817
未収配当金		94,327,890	138,180,900
未収利息		810	-
前払金		15,575,000	39,243,400
流動資産合計		65,268,419,756	78,958,238,811
資産合計		65,268,419,756	78,958,238,811
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,843,532	15,530,248
未払金		6,730,069	29,089,080
未払収益分配金		439,250,422	697,376,820
未払受託者報酬		16,377,544	19,305,264
未払委託者報酬		42,581,690	50,193,759
未払利息		-	1,170
その他未払費用		19,950,818	10,703,709
流動負債合計		534,734,075	822,200,050
負債合計		534,734,075	822,200,050
純資産の部			
元本等			
元本	1	51,979,611,736	74,946,659,880
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		12,754,073,945	3,189,378,881
(分配準備積立金)		94,443,242	143,782,117
元本等合計		64,733,685,681	78,136,038,761
純資産合計		64,733,685,681	78,136,038,761
負債純資産合計		65,268,419,756	78,958,238,811

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第4期	第5期
	自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日 金額(円)	自 平成28年1月11日 至 平成28年7月10日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	555,276,523	832,330,940
受取利息	72,807	20,696
有価証券売買等損益	4,886,247,497	12,553,513,287
派生商品取引等損益	19,262,479	72,721,879
その他収益	357,505	366,164
営業収益合計	4,311,278,183	11,793,517,366
営業費用		
支払利息	-	24,265
受託者報酬	16,377,544	19,305,264
委託者報酬	42,581,690	50,193,759
その他費用	14,209,436	16,478,817
営業費用合計	73,168,670	86,002,105
営業損失()	4,384,446,853	11,879,519,471
経常損失()	4,384,446,853	11,879,519,471
当期純損失()	4,384,446,853	11,879,519,471
期首剰余金又は期首欠損金()	12,188,522,549	12,754,073,945
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,636,139,271	4,791,055,763
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	5,636,139,271	4,791,055,763
剰余金減少額又は欠損金増加額	246,890,600	1,778,854,536
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	246,890,600	1,778,854,536
分配金	1	439,250,422
期末剰余金又は期末欠損金()	12,754,073,945	3,189,378,881

(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5期	
	自 平成28年1月11日	至 平成28年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第4期	第5期
	平成28年1月10日現在	平成28年7月10日現在
1. 1期首元本額	33,290,493,480円	51,979,611,736円
期中追加設定元本額	19,728,047,396円	35,340,431,428円
期中一部交換元本額	1,038,929,140円	12,373,383,284円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,935,398口	7,116,090口
3. 2 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 13,728,000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 79,845,000円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第4期	第5期
	自 平成27年7月11日 至 平成28年1月10日	自 平成28年1月11日 至 平成28年7月10日

1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及び その他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (555,706,835円)及び分配準備積立金(51,155,499円)の合計額から、経費(73,168,670円)を控除して計算される分配対象額は533,693,664円(10口当たり1,081円)であり、うち439,250,422円(10口当たり890円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及び その他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額 (832,693,535円)及び分配準備積立金(94,443,242円)の合計額から、経費(85,977,840円)を控除して計算される分配対象額は841,158,937円(10口当たり1,182円)であり、うち697,376,820円(10口当たり980円)を分配金額としております。
------------	--	--

(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	第5期 自 平成28年1月11日 至 平成28年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期 平成28年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第4期 平成28年1月10日現在	第5期 平成28年7月10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）
株式	4,612,634,262	11,437,709,860
合計	4,612,634,262	11,437,709,860

（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	第4期 平成28年1月10日 現在				第5期 平成28年7月10日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	132,321,600	-	122,529,000	9,792,600	185,631,400	-	170,118,000	15,513,400
合計	132,321,600	-	122,529,000	9,792,600	185,631,400	-	170,118,000	15,513,400

（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。

原則として計算期間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、計算期間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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 平成28年1月11日 至 平成28年7月10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4期 平成28年1月10日現在	第5期 平成28年7月10日現在
1口当たり純資産額 （10口当たり純資産額）	13,116.2円 (131,162円)	10,980.2円 (109,802円)

(4) 【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	
国際石油開発帝石	349,200	741.50	258,931,800	
安藤・間	44,200	547.00	24,177,400	

コムシスホールディングス	28,500	1,636.00	46,626,000
ミサワホーム	7,800	672.00	5,241,600
大成建設	344,000	811.00	278,984,000
大林組	198,800	1,045.00	207,746,000
清水建設	203,000	931.00	188,993,000
長谷工コーポレーション	77,400	928.00	71,827,200
鹿島建設	311,000	694.00	215,834,000
三井住友建設	254,000	84.00	21,336,000
大東建託	24,400	16,255.00	396,622,000
N I P P O	15,000	1,694.00	25,410,000
住友林業	45,600	1,420.00	64,752,000
大和ハウス	195,800	2,757.50	539,918,500
積水ハウス	221,600	1,653.00	366,304,800
協和エクシオ	26,000	1,284.00	33,384,000
日 揮	66,600	1,439.00	95,837,400
ミクシィ	12,400	4,185.00	51,894,000
日本M&Aセンター	9,600	6,610.00	63,456,000
テンプホールディングス	43,300	1,701.00	73,653,300
クックパッド	13,800	1,371.00	18,919,800
カルビー	24,600	4,300.00	105,780,000
ヤクルト	35,500	4,875.00	173,062,500
明治ホールディングス	39,300	10,560.00	415,008,000
日本ハム	49,000	2,517.00	123,333,000
総合警備保障	20,600	4,730.00	97,438,000
カカクコム	44,400	2,007.00	89,110,800
エムスリー	53,500	3,645.00	195,007,500
ディー・エヌ・エー	27,700	2,442.00	67,643,400
博報堂D Y H L D G S	85,700	1,136.00	97,355,200
アサヒグループホールディン	124,400	3,366.00	418,730,400
キリンHD	268,700	1,778.50	477,882,950
伊 藤 園	19,700	3,930.00	77,421,000
ローソン	22,100	8,040.00	177,684,000
エービーシー・マート	7,600	6,610.00	50,236,000
ゲオホールディングス	9,800	1,329.00	13,024,200
双日	367,900	238.00	87,560,200
セリア	6,300	8,080.00	50,904,000
アルフレッサホールディングス	73,400	2,119.00	155,534,600
キッコーマン	50,000	3,800.00	190,000,000
味の素	139,400	2,479.50	345,642,300
キューピー	33,700	3,350.00	112,895,000
ニチレイ	71,000	952.00	67,592,000
東洋水産	32,600	4,165.00	135,779,000
日清食品HD	28,100	5,520.00	155,112,000
日本たばこ産業	385,300	4,289.00	1,652,551,700
ヒューリック	121,700	978.00	119,022,600
Monotaro	20,600	3,135.00	64,581,000
J . フロント リテイリング	73,900	1,010.00	74,639,000
マツモトキヨシH L D G S	12,000	4,595.00	55,140,000
スタートトゥデイ	17,800	5,220.00	92,916,000
三越伊勢丹HD	116,100	891.00	103,445,100
トヨタ紡織	20,700	1,941.00	40,178,700
ウエルシアHD	6,700	6,930.00	46,431,000
野村不動産H L D G S	38,700	1,656.00	64,087,200
プレサンスコーポレーション	2,000	3,860.00	7,720,000
東急不動産HD	141,300	570.00	80,541,000

飯田GHD	54,100	2,019.00	109,227,900
コスモス薬品	2,900	19,690.00	57,101,000
シップヘルスケアHD	11,900	3,105.00	36,949,500
セブン&アイ・HLDGS	244,300	4,078.00	996,255,400
ツルハホールディングス	13,400	11,770.00	157,718,000
東レ	450,000	882.00	396,900,000
クラレ	97,800	1,201.00	117,457,800
旭化成	387,000	698.50	270,319,500
グリーン	35,400	576.00	20,390,400
ネクソン	56,100	1,477.00	82,859,700
ティーガイア	5,800	1,439.00	8,346,200
ガンホー・オンライン・エンター	136,000	283.00	38,488,000
王子ホールディングス	242,000	384.00	92,928,000
大王製紙	27,400	1,120.00	30,688,000
住友化学	456,000	396.00	180,576,000
日産化学	37,000	3,070.00	113,590,000
東ソー	167,000	438.00	73,146,000
デンカ	128,000	400.00	51,200,000
信越化学	111,100	5,901.00	655,601,100
エア・ウォーター	51,000	1,460.00	74,460,000
大陽日酸	47,700	863.00	41,165,100
日本パ - カライジング	31,700	1,093.00	34,648,100
協和発酵キリン	74,100	1,769.00	131,082,900
JSR	58,100	1,328.00	77,156,800
三菱ケミカルHLDGS	415,100	445.70	185,010,070
日本合成化学	14,000	499.00	6,986,000
ダイセル	83,600	983.00	82,178,800
積水化学	140,700	1,274.00	179,251,800
日本ゼオン	52,000	625.00	32,500,000
アイカ工業	18,600	2,273.00	42,277,800
宇部興産	332,000	163.00	54,116,000
日立化成	30,600	1,812.00	55,447,200
日本化薬	40,000	916.00	36,640,000
野村総合研究所	40,900	3,475.00	142,127,500
電通	68,900	4,435.00	305,571,500
日油	46,000	803.00	36,938,000
花王	166,700	5,827.00	971,360,900
武田薬品	246,800	4,253.00	1,049,640,400
アステラス製薬	693,900	1,603.50	1,112,668,650
塩野義製薬	90,300	5,539.00	500,171,700
田辺三菱製薬	72,200	1,834.00	132,414,800
中外製薬	61,700	3,680.00	227,056,000
科研製薬	10,700	6,900.00	73,830,000
エーザイ	76,300	5,509.00	420,336,700
ロート製薬	30,300	1,506.00	45,631,800
小野薬品	140,700	3,952.00	556,046,400
久光製薬	19,200	6,020.00	115,584,000
持田製薬	4,200	8,560.00	35,952,000
参天製薬	114,100	1,635.00	186,553,500
ツムラ	19,500	2,779.00	54,190,500
テルモ	90,700	4,495.00	407,696,500
みらかホールディングス	15,800	4,470.00	70,626,000
沢井製薬	10,500	7,920.00	83,160,000
第一三共	208,400	2,547.50	530,899,000
キョーリン製薬HD	16,500	2,050.00	33,825,000

大塚ホールディングス	133,200	4,835.00	644,022,000
大正製薬HD	14,900	10,730.00	159,877,000
日本ペイントHOLD	47,800	2,320.00	110,896,000
関西ペイント	70,100	1,927.00	135,082,700
DIC	24,500	2,078.00	50,911,000
オリエンタルランド	66,800	6,359.00	424,781,200
パーク24	29,500	3,355.00	98,972,500
フジ・メディア・HD	60,800	1,110.00	67,488,000
リゾートトラスト	25,900	2,095.00	54,260,500
オービック	20,100	5,550.00	111,555,000
ヤフー	418,500	452.00	189,162,000
トレンドマイクロ	28,400	3,630.00	103,092,000
日本オラクル	9,400	5,580.00	52,452,000
ユー・エス・エス	74,800	1,589.00	118,857,200
伊藤忠テクノソリューションズ	13,200	2,188.00	28,881,600
サイバーエージェント	16,300	6,200.00	101,060,000
楽天	289,300	1,050.00	303,765,000
大塚商会	15,700	4,765.00	74,810,500
USEN	26,600	287.00	7,634,200
富士フイルムHLDGS	141,800	3,724.00	528,063,200
コニカミノルタ	147,800	715.00	105,677,000
資生堂	117,600	2,885.50	339,334,800
コーセー	10,000	8,590.00	85,900,000
シーズ・ホールディングス	7,800	2,281.00	17,791,800
小林製薬	18,700	4,430.00	82,841,000
昭和シェル石油	62,300	889.00	55,384,700
横浜ゴム	37,400	1,237.00	46,263,800
東洋ゴム	28,000	1,048.00	29,344,000
ブリヂストン	209,100	3,140.00	656,574,000
住友ゴム	58,000	1,300.00	75,400,000
旭硝子	327,000	490.00	160,230,000
太平洋セメント	387,000	248.00	95,976,000
TOTO	45,500	3,900.00	177,450,000
日本碍子	78,200	1,918.00	149,987,600
日本特殊陶業	53,400	1,393.00	74,386,200
新日鐵住金	279,300	1,864.00	520,615,200
神戸製鋼所	1,138,000	82.00	93,316,000
JFEホールディングス	169,300	1,242.50	210,355,250
日立金属	70,900	954.00	67,638,600
三井金属	158,000	173.00	27,334,000
三菱マテリアル	387,000	241.00	93,267,000
住友鉱山	171,000	1,031.00	176,301,000
DOWAホールディングス	80,000	526.00	42,080,000
住友電工	248,000	1,244.00	308,512,000
アサヒHD	9,300	1,541.00	14,331,300
三和ホールディングス	61,500	908.00	55,842,000
三協立山	8,100	1,450.00	11,745,000
リンナイ	11,500	8,990.00	103,385,000
ユニプレス	12,300	1,478.00	18,179,400
日本発条	58,300	780.00	45,474,000
オーエスジー	28,200	1,552.00	43,766,400
ディスコ	7,900	8,750.00	69,125,000
豊田自動織機	53,900	3,750.00	202,125,000
ニューフレアテクノロジー	1,100	4,775.00	5,252,500
ナブテスコ	32,200	2,419.00	77,891,800

日東電工	47,900	6,173.00	295,686,700
東海理化電機	17,300	1,360.00	23,528,000
三井造船	229,000	133.00	30,457,000
三菱重工業	1,054,000	413.60	435,934,400
川崎重工業	460,000	260.00	119,600,000
I H I	455,000	274.00	124,670,000
名村造船所	17,800	497.00	8,846,600
コンコルディア・フィナンシャル	391,700	379.00	148,454,300
日産自動車	825,700	918.90	758,735,730
いすゞ自動車	171,500	1,232.00	211,288,000
トヨタ自動車	173,100	5,055.00	875,020,500
日野自動車	84,400	916.00	77,310,400
三菱自動車工業	234,900	442.00	103,825,800
N O K	28,600	1,581.00	45,216,600
カルソニックカンセイ	45,000	742.00	33,390,000
アイシン精機	59,500	3,760.00	223,720,000
マ ッ ダ	187,300	1,211.50	226,913,950
ダイハツ	70,600	1,314.00	92,768,400
本田技研	397,600	2,476.50	984,656,400
スズキ	108,200	2,691.00	291,166,200
富士重工業	187,000	3,288.00	614,856,000
ヤマハ発動機	83,600	1,426.00	119,213,600
小糸製作所	35,400	4,340.00	153,636,000
エクセディ	8,000	2,024.00	16,192,000
ミツバ	10,000	973.00	9,730,000
豊田合成	21,500	1,708.00	36,722,000
日本精機	16,000	1,474.00	23,584,000
シマノ	23,800	13,740.00	327,012,000
テイ・エス テック	13,700	2,371.00	32,482,700
良品計画	6,700	22,070.00	147,869,000
第一興商	13,800	4,295.00	59,271,000
メディバルHD	58,400	1,543.00	90,111,200
ドンキホーテホールディング	37,800	3,565.00	134,757,000
V Tホールディングス	26,300	442.00	11,624,600
ユナイテッドアローズ	8,300	3,070.00	25,481,000
スギホールディングス	10,500	4,930.00	51,765,000
ニコン	110,500	1,366.00	150,943,000
トプコン	19,900	922.00	18,347,800
オリンパス	88,100	3,425.00	301,742,500
HOYA	133,800	3,527.00	471,912,600
キヤノン	318,500	2,802.50	892,596,250
リ コ ー	191,600	823.00	157,686,800
バンダイナムコHLDGS	61,200	2,639.00	161,506,800
パイロットコーポレーション	10,300	4,135.00	42,590,500
エイベックス・グループHD	10,700	1,115.00	11,930,500
アシックス	55,100	1,584.00	87,278,400
ヤマハ	43,500	2,589.00	112,621,500
ピジョン	33,500	2,816.00	94,336,000
ニ フ コ	11,900	5,190.00	61,761,000
伊 藤 忠	458,200	1,226.00	561,753,200
丸 紅	574,700	459.00	263,787,300
豊田通商	65,000	2,177.00	141,505,000
兼 松	124,000	158.00	19,592,000
ファミリーマート	17,900	6,200.00	110,980,000
三井物産	528,100	1,188.00	627,382,800

東京エレクトロン	48,600	8,490.00	412,614,000
日立ハイテクノロジーズ	20,200	2,700.00	54,540,000
セイコーHD	38,000	292.00	11,096,000
住友商事	367,600	1,015.00	373,114,000
三菱商事	438,200	1,748.00	765,973,600
岩谷産業	69,000	573.00	39,537,000
ユニ・チャーム	125,500	2,060.50	258,592,750
東邦ホールディングス	18,700	2,328.00	43,533,600
サンリオ	18,000	1,720.00	30,960,000
日本瓦斯	8,900	2,244.00	19,971,600
AOKIホールディングス	13,300	1,045.00	13,898,500
しまむら	6,800	15,140.00	102,952,000
高島屋	85,000	697.00	59,245,000
クレディセゾン	44,300	1,598.00	70,791,400
イオン	240,300	1,444.50	347,113,350
イズミ	11,600	3,810.00	44,196,000
ヤオコー	6,600	4,340.00	28,644,000
ケースホールディングス	24,700	2,026.00	50,042,200
新生銀行	505,000	134.00	67,670,000
あおぞら銀行	369,000	339.00	125,091,000
三菱UFJフィナンシャルG	1,790,100	428.70	767,415,870
りそなホールディングス	683,200	358.00	244,585,600
三井住友トラストHD	1,219,000	289.80	353,266,200
三井住友フィナンシャルG	305,500	2,775.00	847,762,500
西日本シティ銀行	190,000	167.00	31,730,000
千葉銀行	225,000	445.00	100,125,000
常陽銀行	211,000	353.00	74,483,000
群馬銀行	130,000	346.00	44,980,000
ふくおかフィナンシャルG	253,000	319.00	80,707,000
静岡銀行	171,000	657.00	112,347,000
十六銀行	98,000	251.00	24,598,000
スルガ銀行	55,400	2,085.00	115,509,000
八十二銀行	140,800	419.00	58,995,200
ほくほくフィナンシャルG	397,000	111.00	44,067,000
広島銀行	172,000	315.00	54,180,000
中国銀行	55,200	973.00	53,709,600
伊予銀行	83,300	570.00	47,481,000
セブン銀行	218,800	293.00	64,108,400
みずほフィナンシャルG	6,040,900	142.00	857,807,800
山口フィナンシャルG	73,000	907.00	66,211,000
芙蓉総合リース	6,700	4,025.00	26,967,500
興銀リース	11,000	1,681.00	18,491,000
東京センチュリーリース	13,700	3,175.00	43,497,500
SBIホールディングス	70,100	952.00	66,735,200
北洋銀行	88,000	257.00	22,616,000
京葉銀行	63,000	364.00	22,932,000
イオンフィナンシャルサービス	38,300	2,140.00	81,962,000
アコム	117,300	467.00	54,779,100
日立キャピタル	13,800	1,731.00	23,887,800
オリックス	413,500	1,251.00	517,288,500
三菱UFJリース	148,100	351.00	51,983,100
ジャフコ	9,800	2,369.00	23,216,200
大和証券G本社	546,000	513.90	280,589,400
野村ホールディングス	1,123,600	352.60	396,181,360
岡三証券グループ	50,000	436.00	21,800,000

東海東京HD	67,000	414.00	27,738,000
松井証券	28,600	829.00	23,709,400
損保ジャパン興亜HD	129,700	2,600.00	337,220,000
日本取引所グループ	171,500	1,155.00	198,082,500
カブドットコム証券	49,800	304.00	15,139,200
MS & AD	174,500	2,429.00	423,860,500
SONY FH	55,900	1,050.00	58,695,000
第一生命	374,200	1,011.50	378,503,300
東京海上HD	236,600	3,252.00	769,423,200
T & Dホールディングス	212,800	813.00	173,006,400
三井不動産	310,000	2,039.00	632,090,000
三菱地所	434,000	1,727.50	749,735,000
東京建物	63,800	1,143.00	72,923,400
住友不動産	140,000	2,453.50	343,490,000
大京	108,000	142.00	15,336,000
レオパレス21	68,800	688.00	47,334,400
スターツコーポレーション	8,900	1,881.00	16,740,900
住友不動産販売	4,200	1,980.00	8,316,000
リログループ	3,100	16,780.00	52,018,000
タカラレーベン	25,500	779.00	19,864,500
イオンモール	37,700	1,212.00	45,692,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	36,300	1,014.00	36,808,200
東武鉄道	316,000	563.00	177,908,000
相鉄ホールディングス	135,000	553.00	74,655,000
東京急行	344,000	861.00	296,184,000
小田急電鉄	190,000	1,197.00	227,430,000
京王電鉄	165,000	956.00	157,740,000
京成電鉄	89,000	1,294.00	115,166,000
東日本旅客鉄道	108,200	9,339.00	1,010,479,800
西日本旅客鉄道	56,900	6,486.00	369,053,400
東海旅客鉄道	53,000	18,065.00	957,445,000
西日本鉄道	102,000	509.00	51,918,000
近鉄グループHDGS	595,000	432.00	257,040,000
阪急阪神HDGS	397,000	756.00	300,132,000
南海電鉄	177,000	574.00	101,598,000
京阪ホールディングス	177,000	711.00	125,847,000
名古屋鉄道	287,000	588.00	168,756,000
日本通運	229,000	469.00	107,401,000
ヤマトホールディングス	105,800	2,546.00	269,366,800
山九	78,000	527.00	41,106,000
日本郵船	531,000	169.00	89,739,000
ANAホールディングス	1,098,000	276.70	303,816,600
近鉄エクスプレス	10,600	1,213.00	12,857,800
日本テレビHD S	53,300	1,654.00	88,158,200
日本電信電話	350,900	4,829.00	1,694,496,100
KDDI	519,200	3,134.00	1,627,172,800
光通信	7,000	8,580.00	60,060,000
NTTドコモ	436,300	2,795.00	1,219,458,500
GMOインターネット	21,300	1,025.00	21,832,500
電源開発	50,400	2,392.00	120,556,800
東京瓦斯	660,000	414.60	273,636,000
大阪瓦斯	612,000	390.50	238,986,000
東宝	41,700	2,696.00	112,423,200
エイチ・アイ・エス	10,100	3,085.00	31,158,500
NTTデータ	36,100	4,725.00	170,572,500

アインホールディングス	7,000	6,920.00	48,440,000	
カナモト	8,600	1,841.00	15,832,600	
S C S K	13,900	3,675.00	51,082,500	
セコム	64,300	7,443.00	478,584,900	
ベネッセホールディングス	20,700	2,376.00	49,183,200	
イオンディライト	6,000	2,828.00	16,968,000	
日鉄住金物産	51,000	327.00	16,677,000	
ニトリホールディングス	25,200	13,120.00	330,624,000	
パローホールディングス	12,600	2,656.00	33,465,600	
ミスミグループ本社	65,600	1,686.00	110,601,600	
ファーストリテイリング	9,700	25,445.00	246,816,500	
ソフトバンクグループ	234,100	5,399.00	1,263,905,900	
サンドラッグ	12,300	9,060.00	111,438,000	
合計			77,957,614,180	

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

日本たばこ産業	5,000株	トヨタ自動車	2,000株
日本電信電話	10,000株		

- (2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

2 【ファンドの現況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

【純資産額計算書】

平成28年7月29日

資産総額	83,794,540,202円
負債総額	944,999,814円
純資産総額（ - ）	82,849,540,388円
発行済数量	6,919,480口
1単位当たり純資産額（ / ）	11,973.4円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

<更新後>

<略>

(2) 名義登録と収益分配金の支払い

受託会社は、計算期間終了日現在において、氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。

<略>

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況 および2 事業の内容及び営業の概況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成28年7月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

取締役会は、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28年7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	51	191,367
追加型株式投資信託	640	11,528,035
株式投資信託 合計	691	11,719,403
単位型公社債投資信託	10	84,783
追加型公社債投資信託	15	2,172,804
公社債投資信託 合計	25	2,257,587
総合計	716	13,976,989

3 【委託会社等の経理状況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

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

繰越利益剰余金	14,126	13,960
利益剰余金合計	14,501	14,334
株主資本合計	41,171	41,004
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	702	280
評価・換算差額等合計	702	280
純資産合計	41,873	41,284
負債・純資産合計	63,596	60,720

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	90,924	88,850
その他営業収益	933	799
営業収益計	91,858	89,650
営業費用		
支払手数料	49,978	46,165
広告宣伝費	670	646
調査費	9,013	10,116
調査費	867	925
委託調査費	8,146	9,191
委託計算費	756	761
営業雑経費	1,289	1,346
通信費	252	249
印刷費	481	515
協会費	53	53
諸会費	13	14
その他営業雑経費	488	513
営業費用計	61,709	59,036
一般管理費		
給料	5,881	5,797
役員報酬	289	354
給料・手当	3,803	3,850
賞与	695	654
賞与引当金繰入額	1,092	937
福利厚生費	831	837

交際費	45	70
旅費交通費	176	211
租税公課	259	325
不動産賃借料	1,180	1,258
退職給付費用	383	394
役員退職慰労引当金繰入額	38	37
固定資産減価償却費	1,032	1,110
諸経費	1,372	1,486
一般管理費計	11,201	11,531
営業利益	18,948	19,082

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28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 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
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,428	△13,428	△13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△166	△166	△166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「投資有価証券売却益」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた372百万円は、「投資有価証券売却益」145百万円、「その他」226百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,749百万円に対して保証を行っております。

(損益計算書関係)

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日

平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日
----------------------	------	--------	-------	----------------	----------------

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

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

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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

平成28年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

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

その他 証券投資信託	5,779	5,793	14
小計	5,779	5,793	14
合計	10,520	9,482	1,038

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,834	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,749	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(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 (注2)	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(注3)	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(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(注4)	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（％）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,028	長期差入保証金	1,027

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

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

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

(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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,431	13,262
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 4 利害関係人との取引制限および5 その他」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

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28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28年3月 末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。
S M B C 日興証券会社	10,000	
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	4,500	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616	
J P モルガン証券株式会社	73,272	
シティグループ証券株式会社	96,307	
ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	(1) 30,765	
ドイツ証券株式会社	72,728	
東海東京証券株式会社	6,000	
野村証券株式会社	10,000	
B N P パリバ証券株式会社	102,025	
みずほ証券株式会社	125,167	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	
メリルリンチ日本証券株式会社	119,440	
モルガン・スタンレーM U F G証券株式会社	62,149	
U B S 証券株式会社	46,450	

(1) 資本金の額は、平成28年5月1日現在のものです。

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ないます。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務等を行ないます。

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28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。

独立監査人の監査報告書

平成28年8月5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 飯田 浩司 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」に掲げられているダイワ上場投信 - J P X日経400の平成28年1月11日から平成28年7月10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、ダイワ上場投信 - J P X日経400の平成28年7月10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。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成28年 5月27日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	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順が実施される。監査手順は、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順を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(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。

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