

【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29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】 高橋 慎
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3431

**【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】** 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29年4月4日から平成30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29年4月3日付で提出した有価証券届出書（以下「原有有価証券届出書」）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>の記載事項は原有有価証券届出書の更新後の内容を示します。

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】

(3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

<略>

<委託会社の概況（平成29年7月末日現在）>

<略>

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

<更新後>

<略>

上記の運用体制は平成29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>

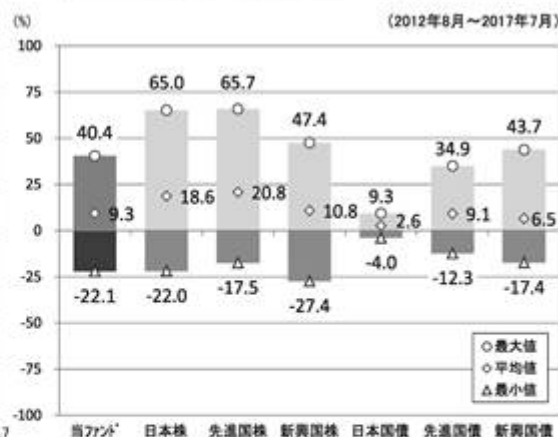
参考情報

- 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。

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、野村証券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的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29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29年7月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	134,771,755,340	99.64
内 日本	134,771,755,340	99.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	484,780,020	0.36
純資産総額	135,256,535,360	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)	481,294,000	0.36
内 日本	481,294,000	0.36

(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29年7月31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	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	3,342,600	748.36 2,501,490,428	700.00 2,339,820,000	1.73
2	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	551,400	4,369.39 2,409,282,402	4,195.00 2,313,123,000	1.71
3	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	10,417,200	204.40 2,129,280,948	196.40 2,045,938,080	1.51
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	221,400	8,936.79 1,978,606,883	8,958.00 1,983,301,200	1.47
5	本田技研	日本	株式	輸送用機器	627,200	3,103.56 1,946,556,040	3,108.00 1,949,337,600	1.44
6	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	312,200	6,188.11 1,931,929,655	6,234.00 1,946,254,800	1.44
7	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	349,100	5,232.86 1,826,794,065	5,390.00 1,881,649,000	1.39
8	キーエンス	日本	株式	電気機器	35,400	49,065.76 1,736,928,000	51,020.00 1,806,108,000	1.34

9	武田薬品	日本	株式	医薬品	306,700	5,693.33 1,746,144,567	5,832.00 1,788,674,400	1.32
10	ファナック	日本	株式	電気機器	79,200	22,077.27 1,748,520,283	22,565.00 1,787,148,000	1.32
11	キヤノン	日本	株式	電気機器	420,300	3,750.31 1,576,256,095	3,837.00 1,612,691,100	1.19
12	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	151,000	10,779.21 1,627,661,924	10,350.00 1,562,850,000	1.16
13	KDDI	日本	株式	情報・通信業	511,700	2,909.01 1,488,543,845	2,920.00 1,494,164,000	1.10
14	信越化学	日本	株式	化学	146,700	9,974.55 1,463,266,906	10,110.00 1,483,137,000	1.10
15	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	567,200	2,622.49 1,487,477,422	2,563.00 1,453,733,600	1.07
16	東京海上HD	日本	株式	保険業	310,300	4,773.89 1,481,338,440	4,645.00 1,441,343,500	1.07
17	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	322,300	4,533.91 1,461,281,340	4,445.00 1,432,623,500	1.06
18	三菱電機	日本	株式	電気機器	832,900	1,668.97 1,390,088,280	1,710.50 1,424,675,450	1.05
19	日立	日本	株式	電気機器	1,875,000	701.76 1,315,800,327	759.60 1,424,250,000	1.05
20	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	368,700	3,856.19 1,421,778,270	3,834.00 1,413,595,800	1.05
21	村田製作所	日本	株式	電気機器	81,900	16,915.98 1,385,419,500	17,180.00 1,407,042,000	1.04
22	三菱商事	日本	株式	卸売業	578,200	2,390.39 1,382,127,010	2,396.50 1,385,656,300	1.02
23	パナソニック	日本	株式	電気機器	892,000	1,492.53 1,331,338,682	1,521.00 1,356,732,000	1.00
24	花王	日本	株式	化学	192,000	6,703.21 1,287,018,322	6,714.00 1,289,088,000	0.95
25	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	276,000	4,857.62 1,340,703,705	4,657.00 1,285,332,000	0.95
26	ダイキン工業	日本	株式	機械	106,600	11,737.31 1,251,197,441	11,700.00 1,247,220,000	0.92
27	日本電産	日本	株式	電気機器	101,200	11,450.41 1,158,782,197	12,160.00 1,230,592,000	0.91
28	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	64,900	17,914.39 1,162,644,000	17,750.00 1,151,975,000	0.85
29	三菱地所	日本	株式	不動産業	573,200	2,037.78 1,168,056,330	2,006.00 1,149,839,200	0.85
30	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	802,500	1,384.75 1,111,269,780	1,408.00 1,129,920,000	0.84

(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	99.64%
合計	99.64%

(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
水産・農林業	0.05%
鉱業	0.37%
建設業	3.31%
食料品	4.24%
繊維製品	0.44%
パルプ・紙	0.17%
化学	7.64%
医薬品	5.61%
ゴム製品	1.21%
ガラス・土石製品	0.97%
鉄鋼	1.33%
非鉄金属	0.87%
金属製品	0.26%
機械	5.50%
電気機器	14.43%
輸送用機器	7.94%
精密機器	1.98%
その他製品	0.70%
電気・ガス業	1.34%
陸運業	4.80%
海運業	0.10%
空運業	0.77%
情報・通信業	6.84%
卸売業	4.68%
小売業	4.30%
銀行業	7.61%
証券、商品先物取引業	1.39%
保険業	3.30%
その他金融業	1.49%
不動産業	2.92%
サービス業	3.09%
合計	99.64%

(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 2017年9月	買建	334	481,085,552	481,294,000	0.36%

(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
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
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
平成28年7月末日	82,849,540,388	-	11,973.4	-	11,970
8月末日	84,631,314,778	-	12,059.0	-	12,060
9月末日	82,142,382,798	-	12,036.6	-	12,020
10月末日	96,498,688,174	-	12,685.5	-	12,690
11月末日	100,578,082,008	-	13,390.3	-	13,370
12月末日	113,566,830,182	-	13,845.2	-	13,830
第6計算期間末 (平成29年1月10日)	114,462,399,049	115,241,646,999	13,954.4	14,049.4	13,990
平成29年1月末日	111,684,971,681	-	13,777.5	-	13,790
2月末日	123,582,130,728	-	13,889.8	-	14,010
3月末日	126,695,671,278	-	13,779.8	-	13,770
4月末日	122,839,480,374	-	13,951.0	-	13,950
5月末日	129,695,808,671	-	14,248.5	-	14,220
6月末日	129,047,060,416	-	14,648.2	-	14,630
第7計算期間末 (平成29年7月10日)	129,536,957,561	130,846,543,664	14,540.4	14,687.4	14,510
7月末日	135,256,535,360	-	14,536.6	-	14,560

(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
第6計算期間	95.0
第7計算期間	147.0

【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
第6計算期間	28.0
第7計算期間	5.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第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
第6計算期間	2,854,815	1,768,295
第7計算期間	2,572,764	1,866,625

(注) 当初設定数量は474,282口です。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

<

2017年7月31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	145,366円
純資産総額	1,352億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.2%
3カ月間	5.3%
6カ月間	6.6%
1年間	23.5%
3年間	29.4%
5年間	-
設定来	45.6%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 2,420円 設定来分配金合計額: 7,020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				
	14年7月	15年1月	15年7月	16年1月	16年7月	17年1月	17年7月				
分配金	960円	460円	1,310円	890円	980円	950円	1,470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。

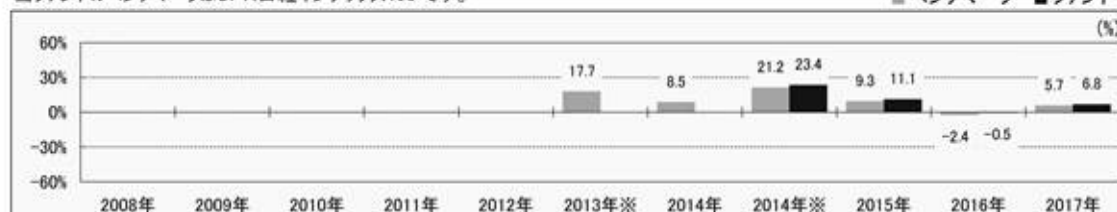
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	397	99.6%	電気機器	14.4%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.7%
国内株式先物	1	0.4%	輸送用機器	7.9%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.7%
不動産投資信託等	-	-	化学	7.6%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.5%
コール・ローン、その他		0.4%	銀行業	7.6%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.5%
合計	398	-	情報・通信業	6.8%	本田技研	輸送用機器	1.4%
株式市場・上場別構成			医薬品	5.6%	トヨタ自動車	輸送用機器	1.4%
一部(東証・名証)		99.4%	機械	5.5%	日本電信電話	情報・通信業	1.4%
二部(東証・名証)		0.1%	陸運業	4.8%	キーエンス	電気機器	1.3%
新興市場他		0.2%	卸売業	4.7%	武田薬品	医薬品	1.3%
その他		-	その他	34.6%	ファナック	電気機器	1.3%
合計		99.6%	合計	99.6%	合計		14.7%

※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、2017年は7月31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。

(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7期計算期間（平成29年1月11日から平成29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6期 平成29年1月10日現在		第7期 平成29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		1,083,800,778		1,827,381,981
株式	2 3	114,107,426,790		129,081,261,650
派生商品評価勘定		7,836,432		3,720,980
未収入金		29,432,100		13,829,115
未収配当金		158,873,300		169,011,310
未収利息		-		1,152
その他未収収益		-		10,954
差入委託証拠金		19,715,000		1,928,000
流動資産合計		115,407,084,400		131,097,145,142
資産合計		115,407,084,400		131,097,145,142
負債の部				
流動負債				
前受金		42,979,000		9,225,500
未払収益分配金		779,247,950		1,309,586,103
未払受託者報酬		25,385,894		33,337,873
未払委託者報酬		66,003,418		86,673,576
受入担保金		-		104,445,600
その他未払費用		31,069,089		16,918,929
流動負債合計		944,685,351		1,560,187,581
負債合計		944,685,351		1,560,187,581
純資産の部				
元本等				
元本	1	86,389,888,520		93,826,944,468
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		28,072,510,529		35,710,013,093
（分配準備積立金）		162,063,577		171,651,884
元本等合計		114,462,399,049		129,536,957,561
純資産合計		114,462,399,049		129,536,957,561
負債純資産合計		115,407,084,400		131,097,145,142

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第6期	第7期
	自平成28年7月11日 至平成29年1月10日	自平成29年1月11日 至平成29年7月10日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	909,715,595	1,466,542,439
受取利息	-	1,152
有価証券売買等損益	22,383,937,794	5,146,624,356
派生商品取引等損益	151,750,584	71,056,599
その他収益	728,355	901,902
営業収益合計	23,446,132,328	6,685,126,448
営業費用		
支払利息	110,219	159,167
受託者報酬	25,385,894	33,337,873
委託者報酬	66,003,418	86,673,576
その他費用	21,415,009	28,100,467
営業費用合計	112,914,540	148,271,083
営業利益	23,333,217,788	6,536,855,365
経常利益	23,333,217,788	6,536,855,365
当期純利益	23,333,217,788	6,536,855,365
期首剰余金又は期首欠損金()	3,189,378,881	28,072,510,529
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,145,895,580	8,885,869,502
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	6,145,895,580	8,885,869,502
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,816,733,770	6,475,636,200
当期一部交換に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,816,733,770	6,475,636,200
分配金	1 779,247,950	1,309,586,103
期末剰余金又は期末欠損金()	28,072,510,529	35,710,013,093

(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7期	
	自 平成29年1月11日	至 平成29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6期	第7期
	平成29年1月10日現在	平成29年7月10日現在
1. 1 期首元本額	74,946,659,880円	86,389,888,520円
期中追加設定元本額	30,066,911,580円	27,096,350,448円
期中一部交換元本額	18,623,682,940円	19,659,294,500円
2. 計算期間末日における受益権の総数	8,202,610口	8,908,749口
3. 2 貸付有価証券		株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 100,253,000円
4. 3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 83,907,000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 83,959,000円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第6期	第7期
	自 平成28年7月11日 至 平成29年1月10日	自 平成29年1月11日 至 平成29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(910,333,731円)及び分配準備積立金(143,782,117円)の合計額から、経費(112,804,321円)を控除して計算される分配対象額は941,311,527円(10口当たり1,147円)であり、うち779,247,950円(10口当たり950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(1,467,286,326円)及び分配準備積立金(162,063,577円)の合計額から、経費(148,111,916円)を控除して計算される分配対象額は1,481,237,987円(10口当たり1,662円)であり、うち1,309,586,103円(10口当たり1,470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7期 自 平成29年1月11日 至 平成29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7期 平成29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6期 平成29年1月10日現在	第7期 平成29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	19,360,441,847	5,223,206,208
合計	19,360,441,847	5,223,206,208

（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6期 平成29年1月10日 現在				第7期 平成29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	332,109,000	-	339,972,000	7,863,000	449,845,000	-	453,600,000	3,755,000
合計	332,109,000	-	339,972,000	7,863,000	449,845,000	-	453,600,000	3,755,000

（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7期 自 平成29年1月11日 至 平成29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6期 平成29年1月10日現在	第7期 平成29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）	13,954.4円 (139,544円)	14,540.4円 (145,404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	
日本水産	108,600	638.00	69,286,800	
国際石油開発帝石	440,600	1,067.50	470,340,500	

安藤・間	60,100	724.00	43,512,400	
東急建設	29,700	903.00	26,819,100	
コムシスホールディングス	32,700	2,315.00	75,700,500	
大成建設	425,000	1,038.00	441,150,000	
大林組	250,800	1,322.00	331,557,600	
清水建設	256,000	1,198.00	306,688,000	
長谷工コーポレーション	97,600	1,384.00	135,078,400	
鹿島建設	367,000	967.00	354,889,000	
三井住友建設	320,500	123.00	39,421,500	
熊谷組	131,000	363.00	47,553,000	
大東建託	30,200	18,110.00	546,922,000	
NIPPO	19,000	2,257.00	42,883,000	
前田道路	26,000	2,310.00	60,060,000	
住友林業	57,500	1,732.00	99,590,000	
大和ハウス	247,100	3,850.00	951,335,000	
積水ハウス	256,100	1,977.00	506,309,700	
協和エクシオ	32,800	1,856.00	60,876,800	
九電工	16,400	4,245.00	69,618,000	
日揮	78,100	1,849.00	144,406,900	
ミクシィ	20,300	6,200.00	125,860,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
日本M&Aセンター	22,600	4,065.00	91,869,000	
パーソルホールディングス	60,400	2,090.00	126,236,000	
クックパッド	17,400	918.00	15,973,200	
江崎グリコ	20,900	6,050.00	126,445,000	
カルビー	34,100	4,295.00	146,459,500	
ヤクルト	44,800	7,580.00	339,584,000	
明治ホールディングス	49,600	8,940.00	443,424,000	
日本ハム	59,000	3,365.00	198,535,000	
総合警備保障	28,400	4,930.00	140,012,000	
いちご	70,100	339.00	23,763,900	
カカクコム	54,800	1,670.00	91,516,000	
ディップ	10,000	2,283.00	22,830,000	
エムスリー	67,600	3,040.00	205,504,000	
ディー・エヌ・エー	35,000	2,643.00	92,505,000	
博報堂DYHLDGS	108,000	1,452.00	156,816,000	
ぐるなび	11,300	1,848.00	20,882,400	
アサヒグループホールディン	156,900	4,378.00	686,908,200	
麒麟HD	360,200	2,344.00	844,308,800	
伊藤園	24,800	4,130.00	102,424,000	
ローソン	23,300	7,330.00	170,789,000	
エービーシー・マート	13,400	6,330.00	84,822,000	
ゲオホールディングス	12,300	1,183.00	14,550,900	
双日	435,100	280.00	121,828,000	
セリア	17,600	5,210.00	91,696,000	
アルフレッサホールディングス	87,200	2,126.00	185,387,200	
キッコーマン	58,600	3,565.00	208,909,000	
味の素	172,300	2,368.50	408,092,550	
キューピー	42,600	2,810.00	119,706,000	
ニチレイ	38,900	3,230.00	125,647,000	
東洋水産	41,200	4,195.00	172,834,000	
日清食品HD	32,700	6,950.00	227,265,000	
日本たばこ産業	352,500	3,857.00	1,359,592,500	
ヒューリック	153,600	1,131.00	173,721,600	

Monotaro	26,100	3,555.00	92,785,500	
J. フロント リテイリング	93,200	1,642.00	153,034,400	
マツモトキヨシHLDGS	14,000	6,310.00	88,340,000	
スタートトゥデイ	67,300	2,725.00	183,392,500	
ウエルシアHD	19,400	4,015.00	77,891,000	
クリエイトSDH	10,800	2,514.00	27,151,200	
野村不動産HLDGS	49,000	2,199.00	107,751,000	
プレサンスコーポレーション	11,400	1,541.00	17,567,400	
東急不動産HD	178,200	662.00	117,968,400	
飯田GHD	61,400	1,849.00	113,528,600	
コスモス薬品	3,700	22,000.00	81,400,000	
シップヘルスケアHD	14,200	3,380.00	47,996,000	
セブン&アイ・HLDGS	308,200	4,535.00	1,397,687,000	
ツルハホールディングス	14,800	11,570.00	171,236,000	
東レ	567,200	956.10	542,299,920	
クラレ	131,600	2,135.00	280,966,000	
旭化成	487,000	1,210.50	589,513,500	
クスリのアオキHLDGS	5,900	5,630.00	33,217,000	
グリーン	44,800	934.00	41,843,200	
ネクソン	81,300	2,161.00	175,689,300	
コロプラ	23,700	1,143.00	27,089,100	貸付株式数 11,000株 (11,000株)
ティーガイア	7,300	2,105.00	15,366,500	
ガンホー・オンライン・エンター	154,400	294.00	45,393,600	
王子ホールディングス	305,000	579.00	176,595,000	
大王製紙	31,200	1,475.00	46,020,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
住友化学	575,000	647.00	372,025,000	
日産化学	42,300	3,840.00	162,432,000	
東ソー	226,000	1,219.00	275,494,000	
デンカ	154,000	594.00	91,476,000	
信越化学	140,200	9,965.00	1,397,093,000	
エア・ウォーター	64,400	2,053.00	132,213,200	
大陽日酸	60,200	1,245.00	74,949,000	
日本パ - カライジング	39,900	1,614.00	64,398,600	
協和発酵キリン	93,600	1,980.00	185,328,000	
三菱瓦斯化学	72,800	2,457.00	178,869,600	
JSR	78,600	1,956.00	153,741,600	
三菱ケミカルHLDGS	523,700	954.90	500,081,130	
ダイセル	105,400	1,422.00	149,878,800	
積水化学	174,000	2,000.00	348,000,000	
日本ゼオン	66,000	1,239.00	81,774,000	
アイカ工業	25,100	3,355.00	84,210,500	
宇部興産	393,000	293.00	115,149,000	
日立化成	43,500	3,310.00	143,985,000	
日本化薬	51,000	1,601.00	81,651,000	
野村総合研究所	55,000	4,295.00	236,225,000	
電通	86,900	5,130.00	445,797,000	
日油	61,000	1,477.00	90,097,000	
花王	195,000	6,702.00	1,306,890,000	
武田薬品	293,200	5,694.00	1,669,480,800	
アステラス製薬	767,100	1,385.50	1,062,817,050	
塩野義製薬	99,100	6,004.00	594,996,400	

田辺三菱製薬	91,100	2,610.00	237,771,000
中外製薬	77,800	4,085.00	317,813,000
科研製薬	14,600	5,990.00	87,454,000
エーザイ	96,200	6,088.00	585,665,600
小野薬品	177,500	2,468.50	438,158,750
久光製薬	22,000	5,230.00	115,060,000
参天製薬	141,200	1,563.00	220,695,600
ツムラ	26,200	4,420.00	115,804,000
テルモ	114,400	4,345.00	497,068,000
沢井製薬	13,200	6,140.00	81,048,000
第一三共	230,100	2,512.00	578,011,200
キョーリン製薬HD	19,100	2,448.00	46,756,800
大塚ホールディングス	168,100	4,745.00	797,634,500
大正製薬HD	16,700	8,450.00	141,115,000
日本ペイントHOLD	60,400	4,160.00	251,264,000
関西ペイント	82,100	2,531.00	207,795,100
DIC	30,800	4,235.00	130,438,000
オリエンタルランド	84,200	7,511.00	632,426,200
パーク24	37,400	2,909.00	108,796,600
リゾートトラスト	30,100	2,056.00	61,885,600
オービック	25,400	6,860.00	174,244,000
ヤフー	528,000	491.00	259,248,000
トレンドマイクロ	39,000	5,770.00	225,030,000
日本オラクル	11,800	7,300.00	86,140,000
ユー・エス・エス	94,400	2,205.00	208,152,000
伊藤忠テクノソリューションズ	16,700	3,935.00	65,714,500
サイバーエージェント	46,900	3,565.00	167,198,500
楽天	398,700	1,317.50	525,287,250
大塚商会	19,800	6,920.00	137,016,000
USEN	19,200	459.00	8,812,800
富士フイルムHLDGS	155,000	4,086.00	633,330,000
コニカミノルタ	174,800	946.00	165,360,800
資生堂	148,400	3,887.00	576,830,800
コーセー	12,600	12,020.00	151,452,000
シーズ・ホールディングス	10,100	4,105.00	41,460,500
小林製薬	20,900	6,660.00	139,194,000
横浜ゴム	47,100	2,314.00	108,989,400
東洋ゴム	41,300	2,376.00	98,128,800
ブリヂストン	263,900	4,858.00	1,282,026,200
住友ゴム	73,100	2,012.00	147,077,200
旭硝子	76,300	4,845.00	369,673,500
住友大阪セメント	145,000	544.00	78,880,000
太平洋セメント	471,000	419.00	197,349,000
TOTO	57,400	4,210.00	241,654,000
日本碍子	98,700	2,252.00	222,272,400
日本特殊陶業	67,400	2,361.00	159,131,400
新日鐵住金	352,400	2,649.00	933,507,600
神戸製鋼所	135,100	1,232.00	166,443,200
JFEホールディングス	213,600	2,034.00	434,462,400
日立金属	79,500	1,630.00	129,585,000
三菱マテリアル	48,700	3,425.00	166,797,500
住友鉱山	202,000	1,507.00	304,414,000
DOWAホールディングス	86,000	876.00	75,336,000
住友電工	294,400	1,793.50	528,006,400
三和ホールディングス	77,600	1,175.00	91,180,000

三協立山	10,200	1,747.00	17,819,400
リンナイ	13,300	10,200.00	135,660,000
日本発条	73,500	1,230.00	90,405,000
オーエスジー	35,600	2,349.00	83,624,400
D M G 森精機	45,000	1,834.00	82,530,000
ディスコ	9,100	18,700.00	170,170,000
豊田自動織機	68,000	6,230.00	423,640,000
ニューフレアテクノロジー	1,600	6,450.00	10,320,000
ナプテスコ	40,600	3,275.00	132,965,000
S M C	23,500	35,070.00	824,145,000
小松製作所	360,500	2,894.00	1,043,287,000
住友重機械	228,000	776.00	176,928,000
日立建機	34,900	2,872.00	100,232,800
クボタ	373,900	1,939.00	724,992,100
荏原製作所	35,400	3,260.00	115,404,000
ダイキン工業	101,900	11,735.00	1,195,796,500
椿本チエイン	44,000	1,004.00	44,176,000
ダイフク	37,200	3,310.00	123,132,000
タダノ	39,000	1,364.00	53,196,000
平和	23,200	2,499.00	57,976,800
竹内製作所	13,700	2,070.00	28,359,000
ブラザー工業	91,100	2,691.00	245,150,100
T P R	8,400	3,655.00	30,702,000
ホシザキ	21,800	10,120.00	220,616,000
日本精工	153,300	1,472.00	225,657,600
ジェイテクト	79,600	1,703.00	135,558,800
不二越	75,000	624.00	46,800,000
ミネベアミツミ	120,300	1,789.00	215,216,700
T H K	52,700	3,245.00	171,011,500
イーグル工業	8,100	1,914.00	15,503,400
日立	1,792,000	701.00	1,256,192,000
三菱電機	796,300	1,669.50	1,329,422,850
富士電機	225,000	608.00	136,800,000
安川電機	86,600	2,415.00	209,139,000
マキタ	97,300	4,200.00	408,660,000
日本電産	96,700	11,445.00	1,106,731,500
オムロン	79,300	5,020.00	398,086,000
日本電気	1,027,000	295.00	302,965,000
富士通	720,000	820.90	591,048,000
沖電気	32,400	1,648.00	53,395,200
ルネサスエレクトロニクス	38,600	993.00	38,329,800
セイコーエプソン	111,200	2,565.00	285,228,000
エレコム	6,500	2,221.00	14,436,500
パナソニック	852,800	1,491.50	1,271,951,200
富士通ゼネラル	25,300	2,642.00	66,842,600
日立国際電気	19,500	2,659.00	51,850,500
T D K	42,100	7,520.00	316,592,000
アルプス電気	68,900	3,240.00	223,236,000
ヒロセ電機	12,000	15,840.00	190,080,000
日本航空電子	21,000	1,647.00	34,587,000
横河電機	80,900	1,796.00	145,296,400
日本光電工業	31,200	2,566.00	80,059,200
堀場製作所	14,800	6,820.00	100,936,000
キーエンス	33,800	49,020.00	1,656,876,000
シスメックス	58,100	6,360.00	369,516,000

デンソー	184,100	4,817.00	886,809,700	
スタンレー電気	53,100	3,630.00	192,753,000	
カシオ	60,100	1,749.00	105,114,900	
ファナック	75,700	22,060.00	1,669,942,000	
エンプラス	3,300	3,555.00	11,731,500	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
浜松ホトニクス	54,300	3,470.00	188,421,000	
京セラ	122,500	6,508.00	797,230,000	
村田製作所	78,300	16,915.00	1,324,444,500	
日東電工	56,300	9,712.00	546,785,600	
三菱重工業	1,251,000	460.00	575,460,000	
川崎重工業	581,000	339.00	196,959,000	
I H I	573,000	381.00	218,313,000	
名村造船所	22,400	678.00	15,187,200	
F P G	26,300	1,182.00	31,086,600	
全国保証	20,700	4,750.00	98,325,000	
東京ＴＹフィナンシャルＧ	10,600	3,115.00	33,019,000	
九州フィナンシャルＧ	161,100	729.00	117,441,900	
コンコルディア・フィナンシャル	477,500	575.50	274,801,250	
日産自動車	880,400	1,152.00	1,014,220,800	
いすゞ自動車	216,300	1,411.50	305,307,450	
トヨタ自動車	298,500	6,187.00	1,846,819,500	
日野自動車	106,500	1,272.00	135,468,000	
日信工業	16,700	1,845.00	30,811,500	
N O K	36,100	2,423.00	87,470,300	
アイシン精機	68,300	5,960.00	407,068,000	
マツダ	236,400	1,620.00	382,968,000	
本田技研	599,600	3,104.00	1,861,158,400	
スズキ	148,000	5,353.00	792,244,000	
S U B A R U	231,700	4,118.00	954,140,600	
ヤマハ発動機	105,400	2,944.00	310,297,600	
小糸製作所	44,700	5,810.00	259,707,000	
ミツバ	13,800	2,103.00	29,021,400	
豊田合成	24,100	2,757.00	66,443,700	
シマノ	30,000	17,910.00	537,300,000	
テイ・エス テック	17,300	3,350.00	57,955,000	
ノジマ	11,500	1,722.00	19,803,000	
良品計画	9,800	27,350.00	268,030,000	
第一興商	16,000	5,220.00	83,520,000	
メディパルHD	73,600	2,049.00	150,806,400	
ドンキホーテホールディング	47,600	4,090.00	194,684,000	
V Tホールディングス	33,200	572.00	18,990,400	
ユナイテッドアローズ	9,800	3,445.00	33,761,000	
スギホールディングス	16,200	5,400.00	87,480,000	
島津製作所	96,100	2,209.00	212,284,900	
ニコン	130,100	1,876.00	244,067,600	
トプコン	37,600	2,012.00	75,651,200	
オリンパス	119,100	4,140.00	493,074,000	
S C R E E Nホールディングス	15,300	7,860.00	120,258,000	
HOYA	153,500	5,708.00	876,178,000	
朝日インテック	17,900	4,840.00	86,636,000	
キヤノン	401,800	3,748.00	1,505,946,400	
リコー	224,400	969.00	217,443,600	

バンダイナムコHLDGS	82,300	4,080.00	335,784,000
パイロットコーポレーション	13,000	4,735.00	61,555,000
アシックス	74,100	2,017.00	149,459,700
ヤマハ	50,300	3,985.00	200,445,500
ピジョン	45,100	4,075.00	183,782,500
ニフコ	13,700	6,260.00	85,762,000
伊藤忠	539,600	1,726.50	931,619,400
丸紅	725,100	739.70	536,356,470
豊田通商	82,000	3,390.00	277,980,000
兼松	157,000	238.00	37,366,000
ユニー・ファミリーマートHD	22,600	6,300.00	142,380,000
三井物産	666,200	1,603.00	1,067,918,600
東京エレクトロン	49,800	15,580.00	775,884,000
日立ハイテクノロジーズ	25,600	4,425.00	113,280,000
セイコーHD	53,000	480.00	25,440,000
住友商事	463,700	1,489.00	690,449,300
三菱商事	552,800	2,390.50	1,321,468,400
阪和興業	74,000	844.00	62,456,000
岩谷産業	82,000	704.00	57,728,000
ユニ・チャーム	158,300	2,828.50	447,751,550
東邦ホールディングス	23,600	2,155.00	50,858,000
サンリオ	22,800	2,181.00	49,726,800
日本瓦斯	13,600	3,550.00	48,280,000
しまむら	8,600	13,650.00	117,390,000
高島屋	123,000	1,029.00	126,567,000
イオン	303,100	1,718.00	520,725,800
イズミ	13,200	6,130.00	80,916,000
ヤオコー	8,400	4,675.00	39,270,000
ケーズホールディングス	31,200	2,160.00	67,392,000
新生銀行	701,000	193.00	135,293,000
あおぞら銀行	466,000	436.00	203,176,000
三菱UFJフィナンシャルG	3,195,600	749.30	2,394,463,080
りそなホールディングス	861,800	605.30	521,647,540
三井住友トラストHD	153,800	4,039.00	621,198,200
三井住友フィナンシャルG	527,100	4,373.00	2,305,008,300
千葉銀行	284,000	825.00	234,300,000
群馬銀行	163,700	669.00	109,515,300
ふくおかフィナンシャルG	299,000	547.00	163,553,000
静岡銀行	194,000	1,031.00	200,014,000
スルガ銀行	75,300	2,785.00	209,710,500
八十二銀行	189,500	730.00	138,335,000
ほくほくフィナンシャルG	49,100	1,835.00	90,098,500
広島銀行	217,000	484.00	105,028,000
中国銀行	69,600	1,714.00	119,294,400
セブン銀行	276,100	415.00	114,581,500
みずほフィナンシャルG	9,958,800	204.60	2,037,570,480
山口フィナンシャルG	92,000	1,352.00	124,384,000
芙蓉総合リース	8,400	6,480.00	54,432,000
興銀リース	13,900	2,680.00	37,252,000
東京センチュリー	14,900	4,725.00	70,402,500
SBIホールディングス	83,200	1,547.00	128,710,400
北洋銀行	120,300	391.00	47,037,300
イオンフィナンシャルサービス	47,000	2,391.00	112,377,000

オ リ コ	159,300	193.00	30,744,900
日立キャピタル	17,400	2,761.00	48,041,400
オリックス	521,700	1,784.00	930,712,800
三菱UFJリース	186,900	622.00	116,251,800
ジャフコ	12,300	4,585.00	56,395,500
大和証券G本社	670,000	675.90	452,853,000
野村ホールディングス	1,489,100	664.30	989,209,130
岡三証券グループ	63,000	743.00	46,809,000
東海東京HD	84,600	640.00	54,144,000
松井証券	42,100	935.00	39,363,500
SOMPOホールディングス	154,000	4,412.00	679,448,000
日本取引所グループ	229,100	2,010.00	460,491,000
カブドットコム証券	54,900	383.00	21,026,700
MS&AD	220,200	3,859.00	849,751,800
SONY FH	70,600	2,042.00	144,165,200
第一生命HLDGS	444,200	2,075.00	921,715,000
東京海上HD	296,600	4,774.00	1,415,968,400
T&Dホールディングス	268,500	1,755.00	471,217,500
三井不動産	390,600	2,608.50	1,018,880,100
三菱地所	548,000	2,038.00	1,116,824,000
東京建物	85,500	1,457.00	124,573,500
住友不動産	177,000	3,426.00	606,402,000
大京	137,000	234.00	32,058,000
レオパレス21	92,900	731.00	67,909,900
スターツコーポレーション	10,000	2,647.00	26,470,000
リログループ	39,000	2,138.00	83,382,000
タカラレーベン	31,700	494.00	15,659,800
イオンモール	47,400	2,088.00	98,971,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	45,800	1,078.00	49,372,400
東武鉄道	398,000	604.00	240,392,000
相鉄ホールディングス	159,000	551.00	87,609,000
東京急行	406,000	844.00	342,664,000
小田急電鉄	119,500	2,210.00	264,095,000
京王電鉄	208,000	926.00	192,608,000
京成電鉄	55,900	2,957.00	165,296,300
東日本旅客鉄道	144,400	10,785.00	1,557,354,000
西日本旅客鉄道	71,800	7,960.00	571,528,000
東海旅客鉄道	62,100	17,920.00	1,112,832,000
西日本鉄道	119,000	496.00	59,024,000
近鉄グループHLDGS	751,000	426.00	319,926,000
阪急阪神HLDGS	94,300	4,015.00	378,614,500
南海電鉄	210,000	567.00	119,070,000
京阪ホールディングス	223,000	702.00	156,546,000
名古屋鉄道	362,000	515.00	186,430,000
日本通運	277,000	711.00	196,947,000
ヤマトホールディングス	133,500	2,265.50	302,444,250
山 九	98,000	753.00	73,794,000
日本郵船	630,000	221.00	139,230,000
日本航空	131,200	3,508.00	460,249,600
ANAホールディングス	1,386,000	384.80	533,332,800
日本テレビHLD S	67,300	1,804.00	121,409,200
日本電信電話	333,800	5,230.00	1,745,774,000
KDDI	489,200	2,909.00	1,423,082,800
光通信	8,900	11,450.00	101,905,000
NTTドコモ	542,300	2,622.50	1,422,181,750

GMOインターネット	26,900	1,419.00	38,171,100
中部電力	246,000	1,451.00	356,946,000
東北電力	186,500	1,510.00	281,615,000
電源開発	59,400	2,721.00	161,627,400
東京瓦斯	801,000	576.30	461,616,300
大阪瓦斯	724,000	444.10	321,528,400
東邦瓦斯	186,000	786.00	146,196,000
東宝	48,100	3,390.00	163,059,000
エイチ・アイ・エス	12,700	3,455.00	43,878,500
NTTデータ	227,600	1,239.00	281,996,400
アインホールディングス	9,600	7,890.00	75,744,000
カナモト	10,900	3,765.00	41,038,500
SCSK	20,000	4,850.00	97,000,000
セコム	81,100	8,580.00	695,838,000
イオンディライト	8,800	3,615.00	31,812,000
日鉄住金物産	6,500	5,620.00	36,530,000
ニトリホールディングス	31,900	15,000.00	478,500,000
パローホールディングス	15,900	2,481.00	39,447,900
ミスミグループ本社	83,900	2,598.00	217,972,200
ファーストリテイリング	12,300	37,180.00	457,314,000
ソフトバンクグループ	211,700	8,928.00	1,890,057,600
サンドラッグ	28,000	4,045.00	113,260,000
合計			129,081,261,650

(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せん。

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. 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】

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29年7月31日

資産総額	137,422,937,747円
負債総額	2,166,402,387円
純資産総額（ - ）	135,256,535,360円
発行済数量	9,304,571口
1 単位当たり純資産額（ / ）	14,536.6円

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29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29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	77	206,007
追加型株式投資信託	692	13,838,117
株式投資信託 合計	769	14,044,124
単位型公社債投資信託	23	126,932
追加型公社債投資信託	14	2,074,451
公社債投資信託 合計	37	2,201,383
総合計	806	16,245,506

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28年4月1日から平成29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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,715	31,260
有価証券	1,137	110
前払費用	159	190
未収委託者報酬	9,896	10,453
未収収益	87	72
繰延税金資産	468	439
その他	83	34
流動資産計	43,547	42,560
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	243	229
器具備品	18	15
器具備品	224	214
無形固定資産	2,706	2,650
ソフトウェア	2,385	2,323
ソフトウェア仮勘定	321	327
投資その他の資産	14,223	12,353
投資有価証券	7,872	5,920
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	123	185

長期差入保証金	1,049	1,050
繰延税金資産	-	31
その他	47	37
固定資産計	17,173	15,234
資産合計	60,720	57,795

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	61	79
未払金	8,789	9,466
未払収益分配金	5	7
未払償還金	63	59
未払手数料	4,330	4,453
その他未払金	2	2
未払費用	4,215	4,077
未払法人税等	1,155	980
未払消費税等	538	223
賞与引当金	937	945
その他	22	3
流動負債計	15,720	15,776
固定負債		
退職給付引当金	2,209	2,318
役員退職慰労引当金	93	151
繰延税金負債	1,410	-
その他	-	7
固定負債計	3,714	2,477
負債合計	19,435	18,254
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	13,960	12,231
利益剰余金合計	14,334	12,606
株主資本合計	41,004	39,276
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	280	264
評価・換算差額等合計	280	264
純資産合計	41,284	39,540
負債・純資産合計	60,720	57,795

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	88,850	79,747
その他営業収益	799	727
営業収益計	89,650	80,474
営業費用		
支払手数料	46,165	40,110
広告宣伝費	646	549
調査費	10,116	9,436
調査費	925	904
委託調査費	9,191	8,531
委託計算費	761	793
営業雑経費	1,346	1,375
通信費	249	251
印刷費	515	501
協会費	53	50
諸会費	14	13
その他営業雑経費	513	557
営業費用計	59,036	52,265
一般管理費		
給料	5,797	5,833
役員報酬	354	416
給料・手当	3,850	3,940
賞与	654	531

賞与引当金繰入額	937	945
福利厚生費	837	807
交際費	70	60
旅費交通費	211	178
租税公課	325	531
不動産賃借料	1,258	1,273
退職給付費用	394	463
役員退職慰労引当金繰入額	37	60
固定資産減価償却費	1,110	1,045
諸経費	1,486	1,400
一般管理費計	11,531	11,655
営業利益	19,082	16,554

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	109	92
受取利息	25	12
投資有価証券売却益	115	224
有価証券償還益	0	94
外国税関連費用引当金戻入益	171	-
その他	72	56
営業外収益計	496	481
営業外費用		
投資有価証券売却損	14	24
その他	94	75
営業外費用計	108	100
経常利益	19,471	16,935
特別損失		
MMF等償還関連費用	-	305
特別損失計	-	305
税引前当期純利益	19,471	16,629
法人税、住民税及び事業税	6,215	6,501
法人税等調整額	6	1,405
法人税等合計	6,209	5,096
当期純利益	13,262	11,533

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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「有価証券償還益」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73百万円は、「有価証券償還益」0百万円、「その他」72百万円として組替えております。

(追加情報)

「繰延税金資産の回収可能性に関する摘要指針(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)」を当期から適用しております。

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
建物	23百万円	26百万円
器具備品	232百万円	264百万円

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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
未払金	4,320百万円	4,877百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(平成29年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

平成29年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

（３）金融商品に係るリスク管理体制

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。

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

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

(*) 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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,021	970
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	1,049	1,050

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

当事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,260	-	-	-
未収委託者報酬	10,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	110	2,876	1,139	110
合計	41,824	2,876	1,139	110

（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。

当事業年度（平成29年3月31日）

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

2．その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度(平成29年3月31日)

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

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。
当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,072百万円	2,209百万円
勤務費用	222	202
退職給付の支払額	120	122
その他	35	29
退職給付債務の期末残高	2,209	2,318

(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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,209百万円	2,318百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,209	2,318
退職給付引当金	2,209	2,318
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,209	2,318

(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27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
勤務費用	222百万円	202百万円
その他	-	87
確定給付制度に係る退職給付費用	222	289

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173百万円であります。

(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28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	676	709
賞与引当金	225	224
未払事業税	224	169
連結法人間取引(譲渡損)	121	5
出資金評価損	98	98
投資有価証券評価損	95	65
その他	173	185
繰延税金資産小計	1,615	1,458
評価性引当額	347	201
繰延税金資産合計	1,268	1,257
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,086	639
その他有価証券評価差額金	124	146
繰延税金負債合計	2,210	786
繰延税金資産の純額	941	470

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28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
--	------------------------	------------------------

法定実効税率 (調整)	33.06%	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.77%	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.02%	
評価性引当額の増減額	1.29%	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.19%	
その他	0.43%	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.89%	

(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、記載を省略していません。

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、記載を省略していません。

(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、記載を省略していません。

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27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

[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。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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(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)	27,062	未払手数料	3,188
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)	593	未払費用	252

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)	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。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(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)	23,238	未払手数料	3,298
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)	768	未払費用	218
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)	1,036	長期差入保証金	1,028

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,826.85円	1株当たり純資産額	15,158.25円
1株当たり当期純利益	5,084.10円	1株当たり当期純利益	4,421.51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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,262	11,533
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。）。

通常の実行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29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29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	5,500	
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	36,765	
ドイツ証券株式会社	72,728	
東海東京証券株式会社	6,000	
野村證券株式会社	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	61,450	

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。

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29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29年8月4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29年1月11日から平成29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29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29年 5月26日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の財務諸表、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29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。