

【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12月13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】 ダイワ日本株式インデックス・ファンド - シフト11 Ver7 -

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 (1) 当初自己設定（平成28年3月1日）
100万円とします。
(2) 継続申込期間（平成28年3月1日から平成29年6月13日まで）
10兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年2月12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】

<更新後>

<略>

<ファンドの特色>

<略>

2 <略>

<略>

ファンドの仕組み

<略>

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、日経平均株価が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1および2の運用が行なわれないことがあります。



毎年9月19日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づき収益の分配を行ないます。



<分配方針>

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

主な投資制限

- マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- 株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への投資は、行ないません。

- 当ファンドは基準価額が11,000円を超えたため、安定運用に切り替えを行なっています。

基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、日経平均株価の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。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。

< 略 >

(b) 運用管理費用（信託報酬）、売買委託手数料等の費用負担

< 略 >

(2) 【ファンドの沿革】

< 更新後 >

平成28年3月1日 信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

< 更新後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成28年10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）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ . インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

< 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10月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

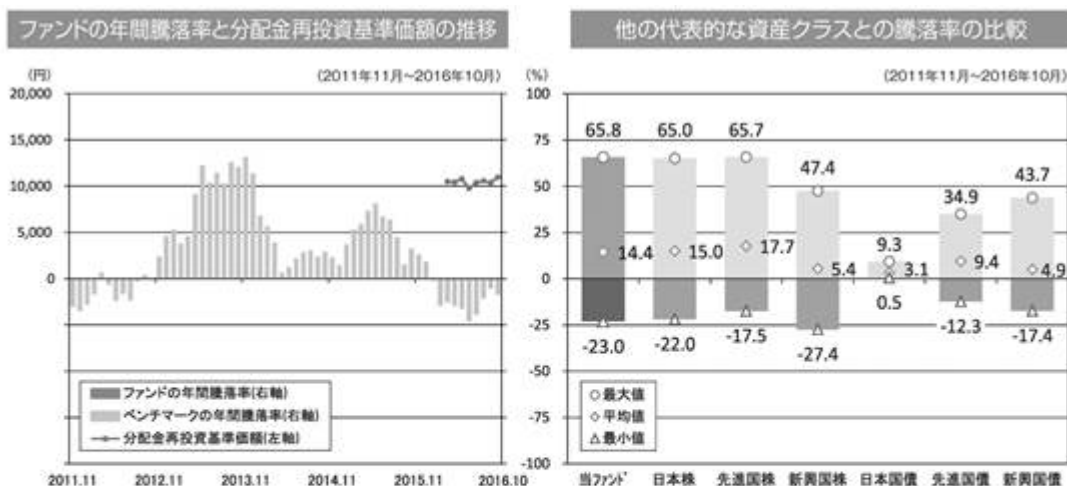
3 【投資リスク】

< 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年間に於ける年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。



- ※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
- ※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
 - ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
 - ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
 - ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

<更新後>

<略>

() 上記は、平成28年10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10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	2,271,110,400	95.20
内 日本	2,271,110,400	95.20
親投資信託受益証券	73,181,151	3.07
内 日本	73,181,151	3.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	41,333,730	1.73
純資産総額	2,385,625,281	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)	41,856,000	1.75
内 日本	41,856,000	1.75

(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10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	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	5,000	32,504.00 162,520,000	35,460.00 177,300,000	7.43
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	15,000	6,523.60 97,854,000	6,602.00 99,030,000	4.15
3	ファナック	日本	株式	電気機器	5,000	16,990.00 84,950,000	19,680.00 98,400,000	4.12
4	KDDI	日本	株式	情報・通信業	30,000	3,090.80 92,724,000	3,192.00 95,760,000	4.01
5	ストックインデックス225・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	-	35,360,046	1.9454 68,789,434	2.0696 73,181,151	3.07
6	京セラ	日本	株式	電気機器	10,000	4,961.60 49,616,000	5,110.00 51,100,000	2.14
7	ダイキン工業	日本	株式	機械	5,000	9,381.20 46,906,000	10,080.00 50,400,000	2.11

8	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	5,000	9,154.40 45,772,000	9,488.00 47,440,000	1.99
9	テルモ	日本	株式	精密機器	10,000	3,927.00 39,270,000	4,065.00 40,650,000	1.70
10	信越化学	日本	株式	化学	5,000	7,040.60 35,203,000	7,971.00 39,855,000	1.67
11	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	25,000	1,575.60 39,390,000	1,559.50 38,987,500	1.63
12	セコム	日本	株式	サービス業	5,000	7,595.80 37,979,000	7,583.00 37,915,000	1.59
13	日東電工	日本	株式	化学	5,000	6,621.00 33,105,000	7,326.00 36,630,000	1.54
14	T D K	日本	株式	電気機器	5,000	7,148.00 35,740,000	7,260.00 36,300,000	1.52
15	エーザイ	日本	株式	医薬品	5,000	6,389.80 31,949,000	6,698.00 33,490,000	1.40
16	ユニー・ファミリーマートHD	日本	株式	小売業	5,000	6,770.00 33,850,000	6,580.00 32,900,000	1.38
17	本田技研	日本	株式	輸送用機器	10,000	2,959.80 29,598,000	3,144.00 31,440,000	1.32
18	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	5,000	5,941.20 29,706,000	6,079.00 30,395,000	1.27
19	NTTデータ	日本	株式	情報・通信業	5,000	5,194.00 25,970,000	5,420.00 27,100,000	1.14
20	花王	日本	株式	化学	5,000	5,671.80 28,359,000	5,405.00 27,025,000	1.13
21	電通	日本	株式	サービス業	5,000	5,294.00 26,470,000	5,240.00 26,200,000	1.10
22	塩野義製薬	日本	株式	医薬品	5,000	5,035.60 25,178,000	5,178.00 25,890,000	1.09
23	武田薬品	日本	株式	医薬品	5,000	4,684.20 23,421,000	4,700.00 23,500,000	0.99
24	デンソー	日本	株式	輸送用機器	5,000	4,112.60 20,563,000	4,565.00 22,825,000	0.96
25	キャノン	日本	株式	電気機器	7,500	2,914.70 21,860,250	3,017.00 22,627,500	0.95
26	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	5,000	4,595.60 22,978,000	4,383.00 21,915,000	0.92
27	コナミホールディングス	日本	株式	情報・通信業	5,000	3,839.00 19,195,000	4,145.00 20,725,000	0.87
28	富士重工業	日本	株式	輸送用機器	5,000	3,823.40 19,117,000	4,094.00 20,470,000	0.86
29	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	5,000	3,997.80 19,989,000	3,994.00 19,970,000	0.84
30	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	5,000	3,803.00 19,015,000	3,975.00 19,875,000	0.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.20%

親投資信託受益証券	3.07%
合計	98.27%

(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	0.17%
鉱業	0.08%
建設業	2.70%
食料品	5.06%
繊維製品	0.34%
パルプ・紙	0.27%
化学	7.97%
医薬品	7.11%
石油・石炭製品	0.29%
ゴム製品	1.01%
ガラス・土石製品	1.43%
鉄鋼	0.19%
非鉄金属	1.24%
金属製品	0.43%
機械	5.02%
電気機器	16.32%
輸送用機器	6.46%
精密機器	2.95%
その他製品	1.21%
電気・ガス業	0.25%
陸運業	2.26%
海運業	0.15%
空運業	0.06%
倉庫・運輸関連業	0.30%
情報・通信業	11.31%
卸売業	1.96%
小売業	10.90%
銀行業	0.94%
証券、商品先物取引業	0.42%
保険業	0.96%
その他金融業	0.38%
不動産業	1.78%
サービス業	3.26%
合計	95.20%

(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	日経平均先物 2016年12月	買建	2	32,901,080	34,880,000	1.46%

	日経225mini先物 2016年 12月	買建	4	6,578,432	6,976,000	0.29%
--	--------------------------	----	---	-----------	-----------	-------

(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)
平成28年3月末日	415,442,461	-	1.0492	-
4月末日	411,959,289	-	1.0430	-
5月末日	743,185,250	-	1.0784	-
6月末日	3,786,614,523	-	0.9761	-
7月末日	2,231,025,922	-	1.0373	-
8月末日	1,992,445,672	-	1.0572	-
第1計算期間末 (平成28年9月20日)	2,143,810,709	2,145,890,090	1.0310	1.0320
9月末日	2,253,089,992	-	1.0355	-
10月末日	2,385,625,281	-	1.0964	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0010

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	3.2

(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	4,464,153,458	2,385,771,910

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ストックインデックス225・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成28年10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	157,129,305,240	98.04
内 日本	157,129,305,240	98.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,144,949,986	1.96
純資産総額	160,274,255,226	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)	3,139,200,000	1.96
内 日本	3,139,200,000	1.96

(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10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	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	346,000	32,512.76 11,249,417,920	35,460.00 12,269,160,000	7.66
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	1,038,000	6,478.04 6,724,211,040	6,602.00 6,852,876,000	4.28
3	ファナック	日本	株式	電気機器	346,000	16,917.09 5,853,313,280	19,680.00 6,809,280,000	4.25
4	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	2,076,000	3,067.19 6,367,490,880	3,192.00 6,626,592,000	4.13
5	京セラ	日本	株式	電気機器	692,000	4,986.10 3,450,382,400	5,110.00 3,536,120,000	2.21
6	ダイキン工業	日本	株式	機械	346,000	9,369.21 3,241,748,320	10,080.00 3,487,680,000	2.18
7	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	346,000	9,173.45 3,174,016,400	9,488.00 3,282,848,000	2.05
8	テルモ	日本	株式	精密機器	692,000	3,920.11 2,712,718,240	4,065.00 2,812,980,000	1.76
9	信越化学	日本	株式	化学	346,000	7,030.90 2,432,692,800	7,971.00 2,757,966,000	1.72
10	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	1,730,000	1,569.55 2,715,338,000	1,559.50 2,697,935,000	1.68
11	セコム	日本	株式	サービス業	346,000	7,596.34 2,628,335,280	7,583.00 2,623,718,000	1.64
12	日東電工	日本	株式	化学	346,000	6,622.64 2,291,436,880	7,326.00 2,534,796,000	1.58
13	T D K	日本	株式	電気機器	346,000	7,209.77 2,494,581,840	7,260.00 2,511,960,000	1.57
14	エーザイ	日本	株式	医薬品	346,000	6,377.84 2,206,733,280	6,698.00 2,317,508,000	1.45
15	ユニー・ファミリーマートHD	日本	株式	小売業	346,000	6,780.33 2,345,997,360	6,580.00 2,276,680,000	1.42
16	本田技研	日本	株式	輸送用機 器	692,000	2,961.67 2,049,477,280	3,144.00 2,175,648,000	1.36

17	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	346,000	5,953.08 2,059,767,360	6,079.00 2,103,334,000	1.31
18	NTTデータ	日本	株式	情報・通信業	346,000	5,209.83 1,802,601,360	5,420.00 1,875,320,000	1.17
19	花王	日本	株式	化学	346,000	5,660.94 1,958,688,480	5,405.00 1,870,130,000	1.17
20	電通	日本	株式	サービス業	346,000	5,310.67 1,837,494,640	5,240.00 1,813,040,000	1.13
21	塩野義製薬	日本	株式	医薬品	346,000	5,010.48 1,733,626,160	5,178.00 1,791,588,000	1.12
22	武田薬品	日本	株式	医薬品	346,000	4,644.67 1,607,058,640	4,700.00 1,626,200,000	1.01
23	デンソー	日本	株式	輸送用機器	346,000	4,137.76 1,431,667,920	4,565.00 1,579,490,000	0.99
24	キヤノン	日本	株式	電気機器	519,000	2,902.22 1,506,256,860	3,017.00 1,565,823,000	0.98
25	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	346,000	4,546.98 1,573,258,160	4,383.00 1,516,518,000	0.95
26	コナミホールディングス	日本	株式	情報・通信業	346,000	3,824.85 1,323,401,200	4,145.00 1,434,170,000	0.89
27	富士重工業	日本	株式	輸送用機器	346,000	3,815.79 1,320,265,680	4,094.00 1,416,524,000	0.88
28	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	346,000	3,966.46 1,372,396,320	3,994.00 1,381,924,000	0.86
29	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	346,000	3,812.42 1,319,098,640	3,975.00 1,375,350,000	0.86
30	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	346,000	3,628.33 1,255,403,360	3,915.00 1,354,590,000	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。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.04%
合計	98.04%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.17%
鉱業	0.09%
建設業	2.78%
食料品	5.21%
繊維製品	0.35%
パルプ・紙	0.28%
化学	8.21%
医薬品	7.32%
石油・石炭製品	0.30%
ゴム製品	1.04%
ガラス・土石製品	1.46%
鉄鋼	0.19%
非鉄金属	1.28%

金属製品	0.44%
機械	5.18%
電気機器	16.81%
輸送用機器	6.65%
精密機器	3.03%
その他製品	1.25%
電気・ガス業	0.26%
陸運業	2.33%
海運業	0.16%
空運業	0.06%
倉庫・運輸関連業	0.31%
情報・通信業	11.65%
卸売業	2.02%
小売業	11.22%
銀行業	0.97%
証券、商品先物取引業	0.43%
保険業	0.99%
その他金融業	0.39%
不動産業	1.83%
サービス業	3.36%
合計	98.04%

(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	日経平均先物 2016年12月	買建	180	3,025,447,200	3,139,200,000	1.96%

(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。

[次へ](#)

（参考情報）運用実績

2016年10月31日現在
基準価額・純資産の推移

※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	10,964円
純資産総額	23億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	5.9%
3カ月間	5.8%
6カ月間	5.2%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	9.7%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 10円 設定来分配金合計額: 10円

決算期	第1期 16年9月						
分配金	10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。

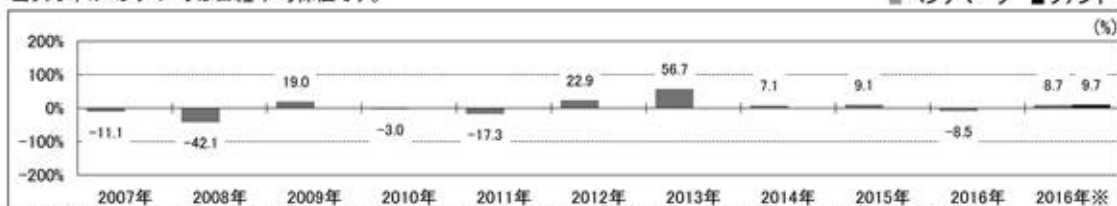
資産別構成		銘柄数	比率	株式東証33業種別構成		比率	組入上位10銘柄		業種名	比率
国内株式	225	98.2%	電気機器	16.8%	ファーストリテイリング	7.7%	小売業	7.7%		
国内株式先物	2	1.8%	情報・通信業	11.7%	ソフトバンクグループ	4.3%	情報・通信業	4.3%		
不動産投資信託等	-	-	小売業	11.2%	ファナック	4.3%	電気機器	4.3%		
コール・ローン、その他	-	1.8%	化学	8.2%	KDDI	4.1%	情報・通信業	4.1%		
合計	227	-	医薬品	7.3%	京セラ	2.2%	電気機器	2.2%		
株式 市場・上場別構成			輸送用機器	6.7%	ダイキン工業	2.2%	機械	2.2%		
一部(東証・名証)		98.2%	食料品	5.2%	東京エレクトロン	2.1%	電気機器	2.1%		
二部(東証・名証)		-	機械	5.2%	テルモ	1.8%	精密機器	1.8%		
新興市場他		-	サービス業	3.4%	信越化学	1.7%	化学	1.7%		
その他		-	その他	22.5%	アステラス製薬	1.7%	医薬品	1.7%		
合計		98.2%	合計	98.2%	合計	32.0%				

※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日経平均株価です。

■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。

・2016年は10月31日まで、2016年※は設定日(3月1日)から10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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（平成28年3月1日から平成28年9月20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】

ダイワ日本株式インデックス・ファンド - シフト11 Ver7 -

(1) 【貸借対照表】

	第1期 平成28年9月20日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		116,269,252
株式	2	1,715,711,000
親投資信託受益証券		314,086,252
派生商品評価勘定		296,760
未収入金		8,284
未収配当金		1,369,000
前払金		121,000
流動資産合計		2,147,861,548
資産合計		2,147,861,548
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		640,540
未払金		669,082
未払収益分配金		2,079,381
未払受託者報酬		47,867
未払委託者報酬		607,993
その他未払費用		5,976
流動負債合計		4,050,839
負債合計		4,050,839
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,079,381,548
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		64,429,161
（分配準備積立金）		73,958,919
元本等合計		2,143,810,709
純資産合計		2,143,810,709
負債純資産合計		2,147,861,548

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第1期	
	自 平成28年3月1日	至 平成28年9月20日
	金額(円)	
営業収益		
受取配当金		5,929,000
有価証券売買等損益		115,291,207
派生商品取引等損益		4,724,228
営業収益合計		116,495,979
営業費用		
支払利息		41,466
受託者報酬		324,448
委託者報酬		4,121,058
その他費用		40,767
営業費用合計		4,527,739
営業利益		111,968,240
経常利益		111,968,240
当期純利益		111,968,240
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		35,929,940
剰余金増加額又は欠損金減少額		28,458,585
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額		28,458,585
剰余金減少額又は欠損金増加額		37,988,343
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額		37,988,343
分配金	1	2,079,381
期末剰余金又は期末欠損金()		64,429,161

(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1期	
	自	平成28年3月1日 至 平成28年9月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 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) 親投資信託受益証券	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 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。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 計算期間	当ファンドの第1期計算期間は、平成28年3月1日から平成28年9月20日までとなっております。
	(2) 計算期間末日	平成28年9月19日が休日のため、当計算期間末日を平成28年9月20日としております。このため、当計算期間は204日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	
	平成28年9月20日現在	
1. 1 期首元本額		1,000,000円
期中追加設定元本額		4,464,153,458円
期中一部解約元本額		2,385,771,910円
2. 計算期間末日における受益権の総数		2,079,381,548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	70,343,000円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第1期 自 平成28年3月1日 至 平成28年9月20日
1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,654,517円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（69,383,783円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,857,747円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は79,896,047円（1万口当たり384.23円）であり、うち2,079,381円（1万口当たり10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1期 自 平成28年3月1日 至 平成28年9月20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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 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1期 平成28年9月20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1期 平成28年9月20日現在	
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	
株式		65,633,487
親投資信託受益証券		2,481,025
合計		63,152,462

（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1期 平成28年9月20日 現在			
	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	114,580,000	-	114,240,000	340,000
合計	114,580,000	-	114,240,000	340,000

（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1期 自 平成28年3月1日 至 平成28年9月20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1期 平成28年9月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0310円 (10,310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	4,000	443.00	1,772,000	
マル八二チロ	400	2,478.00	991,200	
国際石油開発帝石	1,600	826.70	1,322,720	
コムシスホールディングス	4,000	1,839.00	7,356,000	
大成建設	4,000	760.00	3,040,000	
大林組	4,000	986.00	3,944,000	
清水建設	4,000	890.00	3,560,000	
長谷工コーポレーション	800	937.00	749,600	
鹿島建設	4,000	698.00	2,792,000	
大和ハウス	4,000	2,659.50	10,638,000	
積水ハウス	4,000	1,672.50	6,690,000	
日揮	4,000	1,689.00	6,756,000	
日清製粉G本社	4,000	1,512.00	6,048,000	
明治ホールディングス	800	9,560.00	7,648,000	
日本ハム	4,000	2,425.00	9,700,000	
ディー・エヌ・エー	1,200	3,820.00	4,584,000	
サッポロホールディングス	800	2,742.00	2,193,600	
アサヒグループホールディング	4,000	3,557.00	14,228,000	
麒麟HD	4,000	1,629.50	6,518,000	
宝ホールディングス	4,000	932.00	3,728,000	
双日	400	253.00	101,200	
キッコーマン	4,000	3,200.00	12,800,000	
味の素	4,000	2,224.00	8,896,000	
ニチレイ	4,000	1,061.00	4,244,000	
日本たばこ産業	4,000	3,966.00	15,864,000	
J. フロント リテイリング	2,000	1,276.00	2,552,000	
三越伊勢丹HD	4,000	1,030.00	4,120,000	
東洋紡	4,000	164.00	656,000	
ユニチカ	4,000	56.00	224,000	
日清紡ホールディングス	4,000	1,022.00	4,088,000	
東急不動産HD	4,000	542.00	2,168,000	
セブン&アイ・HLDS	4,000	4,546.00	18,184,000	
帝人	4,000	394.00	1,576,000	
東レ	4,000	962.70	3,850,800	
クラレ	4,000	1,423.00	5,692,000	
旭化成	4,000	799.40	3,197,600	
SUMCO	400	823.00	329,200	
王子ホールディングス	4,000	404.00	1,616,000	
日本製紙	400	1,855.00	742,000	
北越紀州製紙	4,000	623.00	2,492,000	
昭和電工	400	1,253.00	501,200	
住友化学	4,000	458.00	1,832,000	
日産化学	4,000	3,095.00	12,380,000	
日本曹達	4,000	422.00	1,688,000	
東ソー	4,000	615.00	2,460,000	
トクヤマ	4,000	346.00	1,384,000	
デンカ	4,000	451.00	1,804,000	
信越化学	4,000	7,030.00	28,120,000	
協和発酵キリン	4,000	1,577.00	6,308,000	
三井化学	4,000	466.00	1,864,000	
三菱ケミカルHLDS	2,000	606.60	1,213,200	
宇部興産	4,000	191.00	764,000	
日本化薬	4,000	1,062.00	4,248,000	

電通	4,000	5,310.00	21,240,000
花 王	4,000	5,660.00	22,640,000
武田薬品	4,000	4,644.00	18,576,000
アステラス製薬	20,000	1,569.50	31,390,000
大日本住友製薬	4,000	1,791.00	7,164,000
塩野義製薬	4,000	5,010.00	20,040,000
中外製薬	4,000	3,485.00	13,940,000
エーザイ	4,000	6,377.00	25,508,000
テ ル モ	8,000	3,920.00	31,360,000
第一三共	4,000	2,416.50	9,666,000
ヤフー	1,600	409.00	654,400
トレンドマイクロ	4,000	3,535.00	14,140,000
富士フイルムHLDGS	4,000	3,812.00	15,248,000
コニカミノルタ	4,000	866.00	3,464,000
資 生 堂	4,000	2,697.50	10,790,000
昭和シェル石油	4,000	887.00	3,548,000
JXホールディングス	4,000	392.90	1,571,600
横浜ゴム	2,000	1,633.00	3,266,000
ブリヂストン	4,000	3,628.00	14,512,000
旭 硝 子	4,000	646.00	2,584,000
日本板硝子	4,000	82.00	328,000
日本電気硝子	6,000	518.00	3,108,000
住友大阪セメント	4,000	462.00	1,848,000
太平洋セメント	4,000	292.00	1,168,000
東海カーボン	4,000	278.00	1,112,000
TOTO	2,000	3,795.00	7,590,000
日本碍子	4,000	2,113.00	8,452,000
新日鐵住金	400	1,965.00	786,000
神戸製鋼所	4,000	90.00	360,000
JFEホールディングス	400	1,443.00	577,200
日新製鋼	400	1,309.00	523,600
大平洋金属	4,000	285.00	1,140,000
日本製鋼所	4,000	466.00	1,864,000
日本軽金属HD	4,000	216.00	864,000
三井金属	4,000	207.00	828,000
東邦亜鉛	4,000	313.00	1,252,000
三菱マテリアル	4,000	284.00	1,136,000
住友鉱山	4,000	1,300.00	5,200,000
DOWAホールディングス	4,000	687.00	2,748,000
古河機金	4,000	157.00	628,000
古河電工	4,000	258.00	1,032,000
住友電工	4,000	1,439.50	5,758,000
フジクラ	4,000	558.00	2,232,000
東洋製罐グループHD	4,000	1,840.00	7,360,000
オークマ	4,000	756.00	3,024,000
アマダホールディングス	4,000	1,068.00	4,272,000
小松製作所	4,000	2,288.50	9,154,000
住友重機械	4,000	504.00	2,016,000
日立建機	4,000	1,979.00	7,916,000
クボタ	4,000	1,466.00	5,864,000
荏原製作所	4,000	554.00	2,216,000
千代田化工建	4,000	798.00	3,192,000
ダイキン工業	4,000	9,368.00	37,472,000
日本精工	4,000	1,048.00	4,192,000
N T N	4,000	357.00	1,428,000

ジェイテクト	4,000	1,481.00	5,924,000
ミネベア	4,000	947.00	3,788,000
日立	4,000	473.40	1,893,600
東芝	4,000	316.00	1,264,000
三菱電機	4,000	1,253.50	5,014,000
富士電機	4,000	456.00	1,824,000
安川電機	4,000	1,493.00	5,972,000
明電舎	4,000	329.00	1,316,000
ジーエス・ユアサコーポ	4,000	414.00	1,656,000
日本電気	4,000	257.00	1,028,000
富士通	4,000	536.20	2,144,800
沖電気	4,000	138.00	552,000
パナソニック	4,000	1,018.00	4,072,000
ソニー	4,000	3,320.00	13,280,000
T D K	4,000	7,210.00	28,840,000
ミツミ電機	4,000	577.00	2,308,000
アルプス電気	4,000	2,465.00	9,860,000
パイオニア	4,000	222.00	888,000
横河電機	4,000	1,323.00	5,292,000
アドバンテスト	8,000	1,345.00	10,760,000
デンソー	4,000	4,137.00	16,548,000
カシオ	4,000	1,407.00	5,628,000
ファナック	4,000	16,915.00	67,660,000
京セラ	8,000	4,986.00	39,888,000
太陽誘電	4,000	1,030.00	4,120,000
日東電工	4,000	6,622.00	26,488,000
三井造船	4,000	141.00	564,000
日立造船	800	514.00	411,200
三菱重工業	4,000	434.40	1,737,600
川崎重工業	4,000	310.00	1,240,000
I H I	4,000	283.00	1,132,000
コンコルディア・フィナンシャル	4,000	485.70	1,942,800
日産自動車	4,000	1,009.00	4,036,000
いすゞ自動車	2,000	1,224.00	2,448,000
トヨタ自動車	4,000	5,952.00	23,808,000
日野自動車	4,000	1,090.00	4,360,000
三菱自動車工業	400	460.00	184,000
マツダ	800	1,581.00	1,264,800
本田技研	8,000	2,961.00	23,688,000
スズキ	4,000	3,355.00	13,420,000
富士重工業	4,000	3,815.00	15,260,000
ヤマハ発動機	4,000	1,964.00	7,856,000
ニコン	4,000	1,494.00	5,976,000
オリンパス	4,000	3,595.00	14,380,000
S C R E E Nホールディングス	4,000	1,254.00	5,016,000
キヤノン	6,000	2,902.00	17,412,000
リコー	4,000	924.00	3,696,000
シチズンホールディングス	4,000	536.00	2,144,000
凸版印刷	4,000	929.00	3,716,000
大日本印刷	4,000	1,022.00	4,088,000
ヤマハ	4,000	3,185.00	12,740,000
伊藤忠	4,000	1,238.00	4,952,000
丸紅	4,000	509.00	2,036,000
豊田通商	4,000	2,373.00	9,492,000
ユニー・ファミリーマートHD	4,000	6,780.00	27,120,000

三井物産	4,000	1,343.50	5,374,000
東京エレクトロン	4,000	9,174.00	36,696,000
住友商事	4,000	1,114.00	4,456,000
三菱商事	4,000	2,124.00	8,496,000
高島屋	4,000	819.00	3,276,000
丸井グループ	4,000	1,411.00	5,644,000
クレディセゾン	4,000	1,730.00	6,920,000
イオン	4,000	1,490.00	5,960,000
新生銀行	4,000	153.00	612,000
あおぞら銀行	4,000	355.00	1,420,000
三菱UFJフィナンシャルG	4,000	515.40	2,061,600
りそなホールディングス	400	434.00	173,600
三井住友トラストHD	4,000	342.50	1,370,000
三井住友フィナンシャルG	400	3,437.00	1,374,800
千葉銀行	4,000	589.00	2,356,000
ふくおかフィナンシャルG	4,000	417.00	1,668,000
静岡銀行	4,000	827.00	3,308,000
みずほフィナンシャルG	4,000	174.20	696,800
大和証券G本社	4,000	574.30	2,297,200
野村ホールディングス	4,000	461.20	1,844,800
松井証券	4,000	915.00	3,660,000
損保ジャパン興亜HD	1,000	3,160.00	3,160,000
MS&AD	1,200	2,909.50	3,491,400
SONY FH	800	1,483.00	1,186,400
第一生命	400	1,438.50	575,400
東京海上HD	2,000	3,897.00	7,794,000
T&Dホールディングス	800	1,222.00	977,600
三井不動産	4,000	2,076.50	8,306,000
三菱地所	4,000	1,873.00	7,492,000
東京建物	2,000	1,214.00	2,428,000
住友不動産	4,000	2,605.50	10,422,000
東武鉄道	4,000	513.00	2,052,000
東京急行	4,000	781.00	3,124,000
小田急電鉄	4,000	1,129.00	4,516,000
京王電鉄	4,000	887.00	3,548,000
京成電鉄	4,000	1,281.00	5,124,000
東日本旅客鉄道	400	8,974.00	3,589,600
西日本旅客鉄道	400	6,228.00	2,491,200
東海旅客鉄道	400	17,465.00	6,986,000
日本通運	4,000	504.00	2,016,000
ヤマトホールディングス	4,000	2,432.50	9,730,000
日本郵船	4,000	186.00	744,000
商船三井	4,000	233.00	932,000
川崎汽船	4,000	256.00	1,024,000
ANAホールディングス	4,000	284.00	1,136,000
三菱倉庫	4,000	1,523.00	6,092,000
スカパーJSAHD	400	474.00	189,600
日本電信電話	800	4,614.00	3,691,200
KDDI	24,000	3,067.00	73,608,000
NTTドコモ	400	2,559.00	1,023,600
東京電力HD	400	419.00	167,600
中部電力	400	1,503.50	601,400
関西電力	400	921.20	368,480
東京瓦斯	4,000	470.90	1,883,600
大阪瓦斯	4,000	427.30	1,709,200

東宝	400	3,320.00	1,328,000	
NTTデータ	4,000	5,210.00	20,840,000	
東京ドーム	2,000	980.00	1,960,000	
セコム	4,000	7,596.00	30,384,000	
コナミホールディングス	4,000	3,825.00	15,300,000	
ファーストリテイリング	4,000	32,510.00	130,040,000	
ソフトバンクグループ	12,000	6,477.00	77,724,000	
合計			1,715,711,000	

(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。

KDDI	6,000株	ファーストリテイリング	1,000株
ソフトバンクグループ	3,000株		

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ストックインデックス225・マザーファンド	161,450,731	314,086,252	
親投資信託受益証券	合計		314,086,252	
合計			314,086,252	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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。

(参考)

当ファンドは、「ストックインデックス225・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの計算期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

「ストックインデックス225・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		平成28年9月20日現在
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,833,918,286
株式	2	150,982,568,000
派生商品評価勘定		5,737,360
未収入金		1,706,470,625
未収配当金		120,841,000
前払金		48,740,000
流動資産合計		154,698,275,271
資産合計		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		6,819,180
未払金		53,596,120
未払解約金		1,486,985,000
流動負債合計		1,547,400,300
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	1	78,725,801,897
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		74,425,073,074
元本等合計		153,150,874,971
純資産合計		
負債純資産合計		
		154,698,275,271

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成28年3月1日 至 平成28年9月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成28年9月20日現在
1. 1 期首	平成28年3月1日
期首元本額	79,895,886,289円
期中追加設定元本額	7,297,489,477円
期中一部解約元本額	8,467,573,869円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ストック インデックス ファ ンド225	47,890,676,041円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・ストックインデックス ファンド225VA	1,255,730,658円
大和 スtock インデックス 225 ファンド	16,540,987,869円
D-I's 日経225イン デックス	109,267,543円
iFree 日経225イン デックス	7,865,503円
DC・ダイワ・ストックイン デックス225（確定拠出年 金専用ファンド）	5,598,873,889円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト11 Ver6	121,798,935円
-	
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト11 Ver7	161,450,731円
-	
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト12 Ver2	221,928,436円
-	
ダイワ・ノーロード 日経22 5ファンド	217,691,365円
ダイワ・インデックスセレク ト 日経225	6,599,530,927円
計	78,725,801,897円
2. 期末日における受益権の総数	78,725,801,897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 1,714,950,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年3月1日 至 平成28年9月20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	平成28年9月20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	平成28年9月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
株式	8,518,986,759	
合計	8,518,986,759	

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成27年9月25日から平成28年9月20日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成28年9月20日 現在			
	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	2,171,570,000	-	2,170,560,000	1,010,000

合計	2,171,570,000	-	2,170,560,000	1,010,000
----	---------------	---	---------------	-----------

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成28年9月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		1.9454円 (19,454円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本水産	352,000	443.00	155,936,000	
マル八ニチロ	35,200	2,478.00	87,225,600	
国際石油開発帝石	140,800	826.70	116,399,360	
コムシスホールディングス	352,000	1,839.00	647,328,000	
大成建設	352,000	760.00	267,520,000	
大林組	352,000	986.00	347,072,000	
清水建設	352,000	890.00	313,280,000	
長谷工コーポレーション	70,400	937.00	65,964,800	
鹿島建設	352,000	698.00	245,696,000	
大和ハウス	352,000	2,659.50	936,144,000	
積水ハウス	352,000	1,672.50	588,720,000	
日揮	352,000	1,689.00	594,528,000	
日清製粉G本社	352,000	1,512.00	532,224,000	
明治ホールディングス	70,400	9,560.00	673,024,000	
日本ハム	352,000	2,425.00	853,600,000	
ディー・エヌ・エー	105,600	3,820.00	403,392,000	
サッポロホールディングス	70,400	2,742.00	193,036,800	
アサヒグループホールディング	352,000	3,557.00	1,252,064,000	
麒麟HD	352,000	1,629.50	573,584,000	
宝ホールディングス	352,000	932.00	328,064,000	
双日	35,200	253.00	8,905,600	
キッコーマン	352,000	3,200.00	1,126,400,000	
味の素	352,000	2,224.00	782,848,000	
ニチレイ	352,000	1,061.00	373,472,000	
日本たばこ産業	352,000	3,966.00	1,396,032,000	
J. フロント リテイリング	176,000	1,276.00	224,576,000	
三越伊勢丹HD	352,000	1,030.00	362,560,000	
東洋紡	352,000	164.00	57,728,000	
ユニチカ	352,000	56.00	19,712,000	
日清紡ホールディングス	352,000	1,022.00	359,744,000	
東急不動産HD	352,000	542.00	190,784,000	
セブン&アイ・HLDGS	352,000	4,546.00	1,600,192,000	
帝人	352,000	394.00	138,688,000	

東レ	352,000	962.70	338,870,400
クラレ	352,000	1,423.00	500,896,000
旭化成	352,000	799.40	281,388,800
SUMCO	35,200	823.00	28,969,600
王子ホールディングス	352,000	404.00	142,208,000
日本製紙	35,200	1,855.00	65,296,000
北越紀州製紙	352,000	623.00	219,296,000
昭和電工	35,200	1,253.00	44,105,600
住友化学	352,000	458.00	161,216,000
日産化学	352,000	3,095.00	1,089,440,000
日本曹達	352,000	422.00	148,544,000
東ソー	352,000	615.00	216,480,000
トクヤマ	352,000	346.00	121,792,000
デンカ	352,000	451.00	158,752,000
信越化学	352,000	7,030.00	2,474,560,000
協和発酵キリン	352,000	1,577.00	555,104,000
三井化学	352,000	466.00	164,032,000
三菱ケミカルHLDGS	176,000	606.60	106,761,600
宇部興産	352,000	191.00	67,232,000
日本化薬	352,000	1,062.00	373,824,000
電通	352,000	5,310.00	1,869,120,000
花王	352,000	5,660.00	1,992,320,000
武田薬品	352,000	4,644.00	1,634,688,000
アステラス製薬	1,760,000	1,569.50	2,762,320,000
大日本住友製薬	352,000	1,791.00	630,432,000
塩野義製薬	352,000	5,010.00	1,763,520,000
中外製薬	352,000	3,485.00	1,226,720,000
エーザイ	352,000	6,377.00	2,244,704,000
テルモ	704,000	3,920.00	2,759,680,000
第一三共	352,000	2,416.50	850,608,000
ヤフー	140,800	409.00	57,587,200
トレンドマイクロ	352,000	3,535.00	1,244,320,000
富士フイルムHLDGS	352,000	3,812.00	1,341,824,000
コニカミノルタ	352,000	866.00	304,832,000
資生堂	352,000	2,697.50	949,520,000
昭和シェル石油	352,000	887.00	312,224,000
JXホールディングス	352,000	392.90	138,300,800
横浜ゴム	176,000	1,633.00	287,408,000
ブリヂストン	352,000	3,628.00	1,277,056,000
旭硝子	352,000	646.00	227,392,000
日本板硝子	352,000	82.00	28,864,000
日本電気硝子	528,000	518.00	273,504,000
住友大阪セメント	352,000	462.00	162,624,000
太平洋セメント	352,000	292.00	102,784,000
東海カーボン	352,000	278.00	97,856,000
TOTO	176,000	3,795.00	667,920,000
日本碍子	352,000	2,113.00	743,776,000
新日鐵住金	35,200	1,965.00	69,168,000
神戸製鋼所	352,000	90.00	31,680,000
JFEホールディングス	35,200	1,443.00	50,793,600
日新製鋼	35,200	1,309.00	46,076,800
大平洋金属	352,000	285.00	100,320,000
日本製鋼所	352,000	466.00	164,032,000
日本軽金属HD	352,000	216.00	76,032,000
三井金属	352,000	207.00	72,864,000

東邦亜鉛	352,000	313.00	110,176,000
三菱マテリアル	352,000	284.00	99,968,000
住友鉱山	352,000	1,300.00	457,600,000
DOWAホールディングス	352,000	687.00	241,824,000
古河機金	352,000	157.00	55,264,000
古河電工	352,000	258.00	90,816,000
住友電工	352,000	1,439.50	506,704,000
フジクラ	352,000	558.00	196,416,000
東洋製罐グループHD	352,000	1,840.00	647,680,000
オークマ	352,000	756.00	266,112,000
アマダホールディングス	352,000	1,068.00	375,936,000
小松製作所	352,000	2,288.50	805,552,000
住友重機械	352,000	504.00	177,408,000
日立建機	352,000	1,979.00	696,608,000
クボタ	352,000	1,466.00	516,032,000
荏原製作所	352,000	554.00	195,008,000
千代田化工建	352,000	798.00	280,896,000
ダイキン工業	352,000	9,368.00	3,297,536,000
日本精工	352,000	1,048.00	368,896,000
N T N	352,000	357.00	125,664,000
ジェイテクト	352,000	1,481.00	521,312,000
ミネベア	352,000	947.00	333,344,000
日立	352,000	473.40	166,636,800
東芝	352,000	316.00	111,232,000
三菱電機	352,000	1,253.50	441,232,000
富士電機	352,000	456.00	160,512,000
安川電機	352,000	1,493.00	525,536,000
明電舎	352,000	329.00	115,808,000
ジーエス・ユアサ コーポ	352,000	414.00	145,728,000
日本電気	352,000	257.00	90,464,000
富士通	352,000	536.20	188,742,400
沖電気	352,000	138.00	48,576,000
パナソニック	352,000	1,018.00	358,336,000
ソニー	352,000	3,320.00	1,168,640,000
T D K	352,000	7,210.00	2,537,920,000
ミツミ電機	352,000	577.00	203,104,000
アルプス電気	352,000	2,465.00	867,680,000
パイオニア	352,000	222.00	78,144,000
横河電機	352,000	1,323.00	465,696,000
アドバンテスト	704,000	1,345.00	946,880,000
デンソー	352,000	4,137.00	1,456,224,000
カシオ	352,000	1,407.00	495,264,000
ファナック	352,000	16,915.00	5,954,080,000
京セラ	704,000	4,986.00	3,510,144,000
太陽誘電	352,000	1,030.00	362,560,000
日東電工	352,000	6,622.00	2,330,944,000
三井造船	352,000	141.00	49,632,000
日立造船	70,400	514.00	36,185,600
三菱重工業	352,000	434.40	152,908,800
川崎重工業	352,000	310.00	109,120,000
I H I	352,000	283.00	99,616,000
コンコルディア・フィナンシャル	352,000	485.70	170,966,400
日産自動車	352,000	1,009.00	355,168,000
いすゞ自動車	176,000	1,224.00	215,424,000
トヨタ自動車	352,000	5,952.00	2,095,104,000

日野自動車	352,000	1,090.00	383,680,000
三菱自動車工業	35,200	460.00	16,192,000
マツダ	70,400	1,581.00	111,302,400
本田技研	704,000	2,961.00	2,084,544,000
スズキ	352,000	3,355.00	1,180,960,000
富士重工業	352,000	3,815.00	1,342,880,000
ヤマハ発動機	352,000	1,964.00	691,328,000
ニコン	352,000	1,494.00	525,888,000
オリンパス	352,000	3,595.00	1,265,440,000
SCREENホールディングス	352,000	1,254.00	441,408,000
キヤノン	528,000	2,902.00	1,532,256,000
リコー	352,000	924.00	325,248,000
シチズンホールディングス	352,000	536.00	188,672,000
凸版印刷	352,000	929.00	327,008,000
大日本印刷	352,000	1,022.00	359,744,000
ヤマハ	352,000	3,185.00	1,121,120,000
伊藤忠	352,000	1,238.00	435,776,000
丸紅	352,000	509.00	179,168,000
豊田通商	352,000	2,373.00	835,296,000
ユニー・ファミリーマートHD	352,000	6,780.00	2,386,560,000
三井物産	352,000	1,343.50	472,912,000
東京エレクトロン	352,000	9,174.00	3,229,248,000
住友商事	352,000	1,114.00	392,128,000
三菱商事	352,000	2,124.00	747,648,000
高島屋	352,000	819.00	288,288,000
丸井グループ	352,000	1,411.00	496,672,000
クレディセゾン	352,000	1,730.00	608,960,000
イオン	352,000	1,490.00	524,480,000
新生銀行	352,000	153.00	53,856,000
あおぞら銀行	352,000	355.00	124,960,000
三菱UFJフィナンシャルG	352,000	515.40	181,420,800
りそなホールディングス	35,200	434.00	15,276,800
三井住友トラストHD	352,000	342.50	120,560,000
三井住友フィナンシャルG	35,200	3,437.00	120,982,400
千葉銀行	352,000	589.00	207,328,000
ふくおかフィナンシャルG	352,000	417.00	146,784,000
静岡銀行	352,000	827.00	291,104,000
みずほフィナンシャルG	352,000	174.20	61,318,400
大和証券G本社	352,000	574.30	202,153,600
野村ホールディングス	352,000	461.20	162,342,400
松井証券	352,000	915.00	322,080,000
損保ジャパン興亜HD	88,000	3,160.00	278,080,000
MS&AD	105,600	2,909.50	307,243,200
SONY FH	70,400	1,483.00	104,403,200
第一生命	35,200	1,438.50	50,635,200
東京海上HD	176,000	3,897.00	685,872,000
T&Dホールディングス	70,400	1,222.00	86,028,800
三井不動産	352,000	2,076.50	730,928,000
三菱地所	352,000	1,873.00	659,296,000
東京建物	176,000	1,214.00	213,664,000
住友不動産	352,000	2,605.50	917,136,000
東武鉄道	352,000	513.00	180,576,000
東京急行	352,000	781.00	274,912,000
小田急電鉄	352,000	1,129.00	397,408,000
京王電鉄	352,000	887.00	312,224,000

京成電鉄	352,000	1,281.00	450,912,000
東日本旅客鉄道	35,200	8,974.00	315,884,800
西日本旅客鉄道	35,200	6,228.00	219,225,600
東海旅客鉄道	35,200	17,465.00	614,768,000
日本通運	352,000	504.00	177,408,000
ヤマトホールディングス	352,000	2,432.50	856,240,000
日本郵船	352,000	186.00	65,472,000
商船三井	352,000	233.00	82,016,000
川崎汽船	352,000	256.00	90,112,000
A N Aホールディングス	352,000	284.00	99,968,000
三菱倉庫	352,000	1,523.00	536,096,000
スカパーJ S A T H D	35,200	474.00	16,684,800
日本電信電話	70,400	4,614.00	324,825,600
K D D I	2,112,000	3,067.00	6,477,504,000
N T Tドコモ	35,200	2,559.00	90,076,800
東京電力H D	35,200	419.00	14,748,800
中部電力	35,200	1,503.50	52,923,200
関西電力	35,200	921.20	32,426,240
東京瓦斯	352,000	470.90	165,756,800
大阪瓦斯	352,000	427.30	150,409,600
東宝	35,200	3,320.00	116,864,000
N T Tデータ	352,000	5,210.00	1,833,920,000
東京ドーム	176,000	980.00	172,480,000
セコム	352,000	7,596.00	2,673,792,000
コナミホールディングス	352,000	3,825.00	1,346,400,000
ファーストリテイリング	352,000	32,510.00	11,443,520,000
ソフトバンクグループ	1,056,000	6,477.00	6,839,712,000
合計			150,982,568,000

(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。

武田薬品	50,000株	ファナック	30,000株
ファーストリテイリング	30,000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10月31日

資産総額	2,389,587,523円
負債総額	3,962,242円
純資産総額（ - ）	2,385,625,281円
発行済数量	2,175,860,082口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0964円

(参考) ストックインデックス225・マザーファンド

純資産額計算書

平成28年10月31日

資産総額	161,028,655,346円
負債総額	754,400,120円
純資産総額（ - ）	160,274,255,226円
発行済数量	77,442,014,923口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.0696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28年10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28年10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	62	214,891
追加型株式投資信託	674	11,827,581
株式投資信託 合計	736	12,042,472
単位型公社債投資信託	12	90,053
追加型公社債投資信託	14	1,870,095
公社債投資信託 合計	26	1,960,147
総合計	762	14,002,619

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

その他	60	47
固定資産計	15,995	17,173
資産合計	63,596	60,720

(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)
負債の部		
流動負債		
預り金	64	61
未払金	9,172	8,789
未払収益分配金	5	5
未払償還金	72	63
未払手数料	4,965	4,330
その他未払金	2	2
未払費用	4,162	4,215
未払法人税等	1,133	1,155
未払消費税等	1,429	538
賞与引当金	1,092	937
その他	747	22
流動負債計	17,801	15,720
固定負債		
退職給付引当金	2,072	2,209
役員退職慰労引当金	101	93
繰延税金負債	1,745	1,410
その他	2	-
固定負債計	3,920	3,714
負債合計	21,722	19,435
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	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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
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%

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が24百万円、繰延税金負債（長期）が74百万円、法人税等調整額が50百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が6百万円増加しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（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。

[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(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。

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。）。

通常の実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 みずほ信託銀行株式会社

資本金の額 247,369百万円（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 大和証券株式会社

資本金の額 100,000百万円（平成28年3月末日現在）

事業の内容

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。

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

該当事項はありません。

< 再信託受託会社の概要 >

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社

資本金の額：50,000百万円（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10月14日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本株式インデックス・ファンド - シフト11 Ver7 - の平成28年3月1日から平成28年9月20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、ダイワ日本株式インデックス・ファンド - シフト11 Ver7 - の平成28年9月20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。