

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成30年6月19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】	為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド（愛称：ぶち債・ちーと株）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	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。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド（愛称：ぶち債・ちーと株）

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、1.62%（税抜1.5%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

(7) 【申込期間】

2018年6月20日から2018年12月19日まで（継続申込期間）
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

受益権の取得申込者は、申込取扱場所において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

ニューヨークの銀行またはシカゴ商品取引所における米国債先物取引のいずれかの休業日と同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得および換金の申込みの受け付けは行ないません。

申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

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

（ ）前 の申込受付中止日を除きます。

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、米国国債とわが国の株式に投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	北米、日本
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジあり（フルヘッジ）

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「内外」...目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
- ・「資産複合」...目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」...組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」...目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年1回」...目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「北米」...目論見書等において、組入資産による投資収益が北米を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「日本」...目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」...目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの

- ・「為替ヘッジあり」...目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年1回	グローバル		
一般		日本		
大型株	年2回	北米		
中小型株	年4回	欧州	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)
債券	年6回 (隔月)	アジア		
一般	年12回 (毎月)	オセアニア		
公債	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
社債	その他 ()	アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ()		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券(資産複合資産) (配分固定型(株式、債券))				
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ(アドレス <http://www.toushin.or.jp/>)をご参照下さい。

< 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1 米国国債とわが国の株式に投資します。

◆米国国債とわが国の株式へ、以下の組入比率をめどに投資します。

米国国債・・・90%　わが国の株式・・・10%

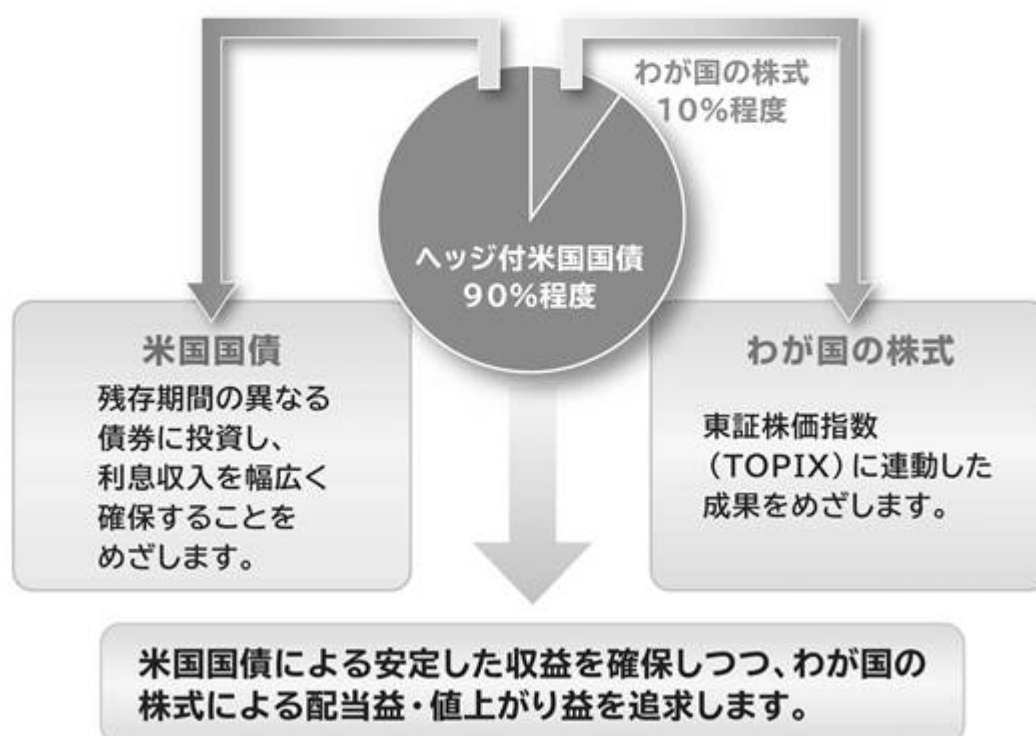
－上記の組入比率を基本とし、原則1か月ごとにリバランスを行なうものとします。

◆米国国債については為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

－為替ヘッジを行なっても、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。

－日本円の金利が米ドルの短期金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

当ファンドのイメージ

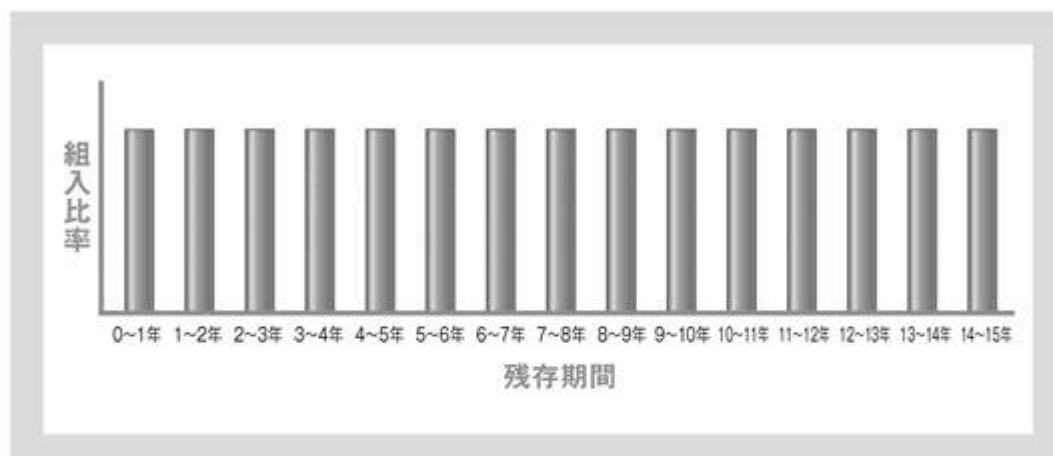


※上記はイメージであり、実際の組入比率が上記のとおりになるとは限りません。

2 米国国債への投資にあたってはラダー型運用を行いません。

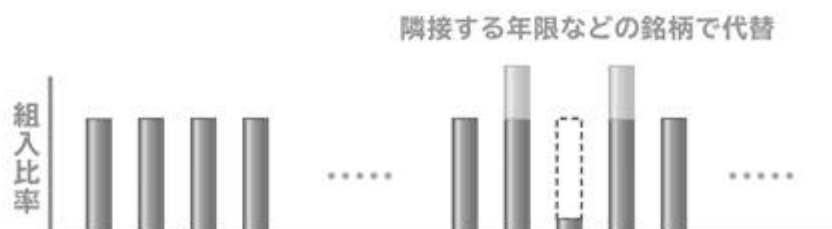
- ◆米国国債への投資にあたっては、残存期間が最長15年程度までの国債を、残存期間ごとの国債の投資金額がほぼ同程度となるように組入れることをめざします。このような運用手法をラダー型運用といいます。

残存期間ごとの組入イメージ



投資対象となる国債の発行額が少ないこと等で流動性が低い場合には、残存期間が隣接する銘柄等で代替することがあります。

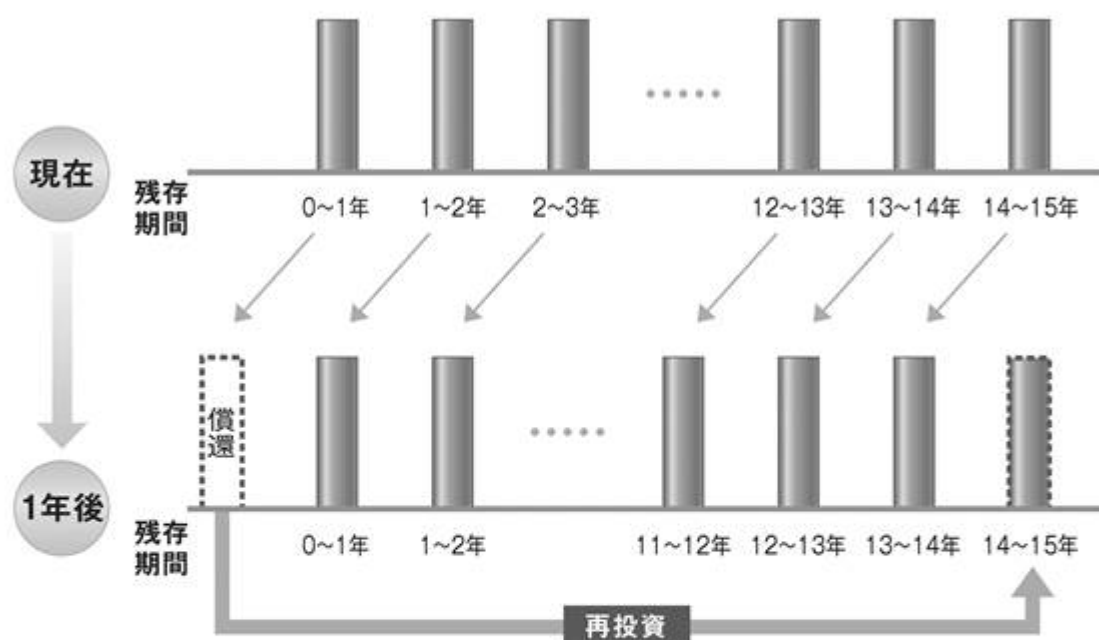
●投資対象の流動性が低い場合の組入イメージの例●



ストリップス債に投資することもあります。ストリップス債とは、債券の利金部分と元本部分を分離し、それぞれ別の債券としたものです。

- ◆国債の償還金または償還が見込まれる国債の売却代金を再投資するにあたっては、残存期間が15年程度までの国債のうち、期間が最長のものに投資します。

ラダー型運用のイメージ



ラダー型運用の主な特徴

◆金利変動リスクの分散

金利変動による債券価格への影響は、債券の残存期間により異なります。短期から長期までの残存期間の異なる債券に投資することにより、金利変動に対するリスクを分散できると考えられます。

◆安定した収益性

保有債券の償還が行なわれるつど、その償還金を、長期債に再投資します。一般に長期債は短期債と比較して利回りは高い傾向があります。

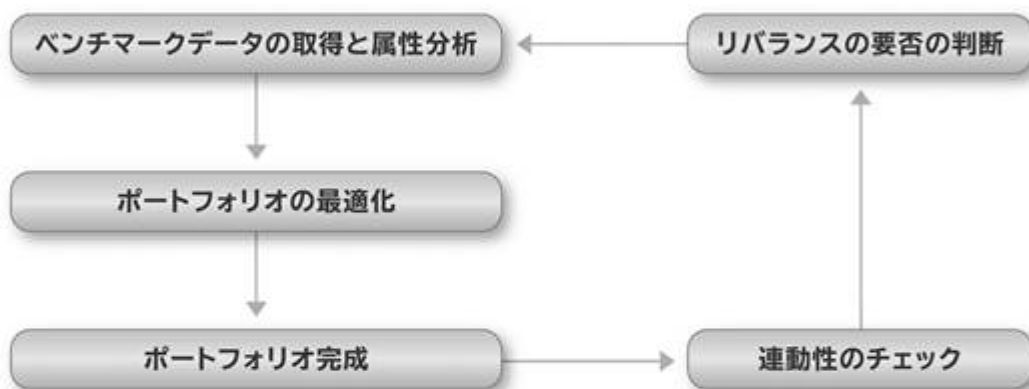
※上記は一般的な特徴を示したものです。また、元本の安全性および将来の成果を示唆・保証するものではありません。

3

わが国の株式への投資にあたっては、投資成果をTOPIXの動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

- ◆東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。
- (a) 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。
- (b) ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。
- (c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

運用プロセス



ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注)を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるTOPIXへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。

(注) ポートフォリオ理論に基づき、株価変動に影響を与える複数の要素からポートフォリオのリスクを分析するモデルです。このモデルを用いることにより、さまざまな制約条件下で指数に最も連動すると推定されるポートフォリオを構築することができます。

◆東証株価指数（TOPIX）について

TOPIXは、東京証券取引所の第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするものです。

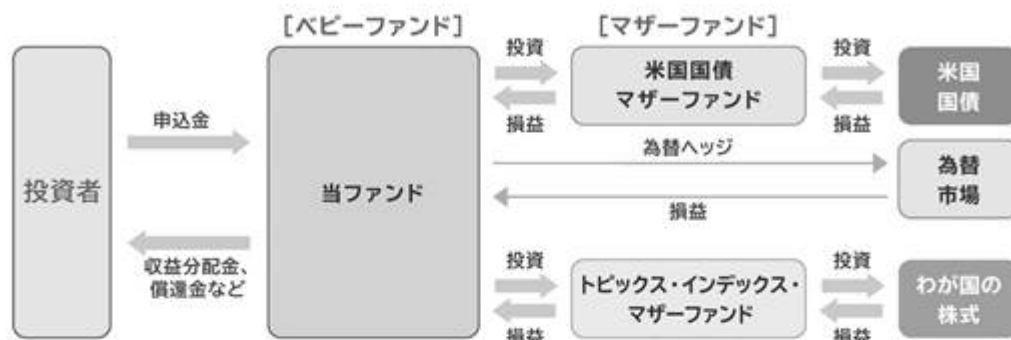
TOPIXは、1968年1月4日（基準時）の時価総額を100として1969年7月1日から株式会社東京証券取引所が算出・公表しております。

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

ファンドの仕組み

◆当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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



米国国債マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、米国国債の組入総額と債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、米国国債マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

トピックス・インデックス・マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、株価指数先物取引を利用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、トピックス・インデックス・マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～3.の運用が行なわれないことがあります。

4 毎年3月26日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行いません。

ただし、第1計算期間は、2017年3月26日（休業日の場合翌営業日）までとします。

〈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。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

(2) 【ファンドの沿革】

2016年4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】

受益者	お申込者	
収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）		
お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないません。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2）の委託者であり、次の業務を行ないません。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 3）
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社</p>	<p>信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行ないません。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
損益 投資		
投資対象	<p>米国国債および東京証券取引所一部上場株式（上場予定を含みます。）など （ファミリーファンド方式で運用を行ないません。）</p>	

(注)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から收受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

< 委託会社の概況（2018年4月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

1959年12月12日	設立登記
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号)

・ 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

次の各マザーファンド（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

1. 米国国債マザーファンドの受益証券
2. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

投資態度

イ. 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、米国国債と日本株式に投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

ロ. 各マザーファンドの受益証券への投資にあたっては、下記の組入比率をめどに行ないます。

米国国債マザーファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の90%
トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の10%

ハ. 上記の組入比率を基本とし、原則1か月ごとにリバランスを行なうものとします。

ニ．保有実質外貨建資産について、為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減をめざします。

保有実質外貨建資産とは、当ファンドが保有する外貨建資産およびマザーファンドが保有する外貨建資産のうち当ファンドに属するとみなした外貨建資産をいいます。

ホ．米国国債マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、米国国債の組入総額と債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、米国国債マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ヘ．トピックス・インデックス・マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、株価指数先物取引を利用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、トピックス・インデックス・マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

(2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)、および に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．および2．までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の3．から23．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．米国国債マザーファンドの受益証券

2．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

3．株券または新株引受権証書

4．国債証券

5．地方債証券

6．特別の法律により法人の発行する債券

7．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

8．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

9．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

10. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
11. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
12. コマーシャル・ペーパー
13. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
14. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3. から前13. までの証券または証書の性質を有するもの
15. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
16. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
22. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
23. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前21. の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前3. の証券または証書ならびに前14. および前19. の証券または証書のうち前3. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前4. から前8. までの証券ならびに前16. の証券のうち投資法人債券ならびに前14. および前19. の証券または証書のうち前4. から前8. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前15. の証券および前16. の証券(新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

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

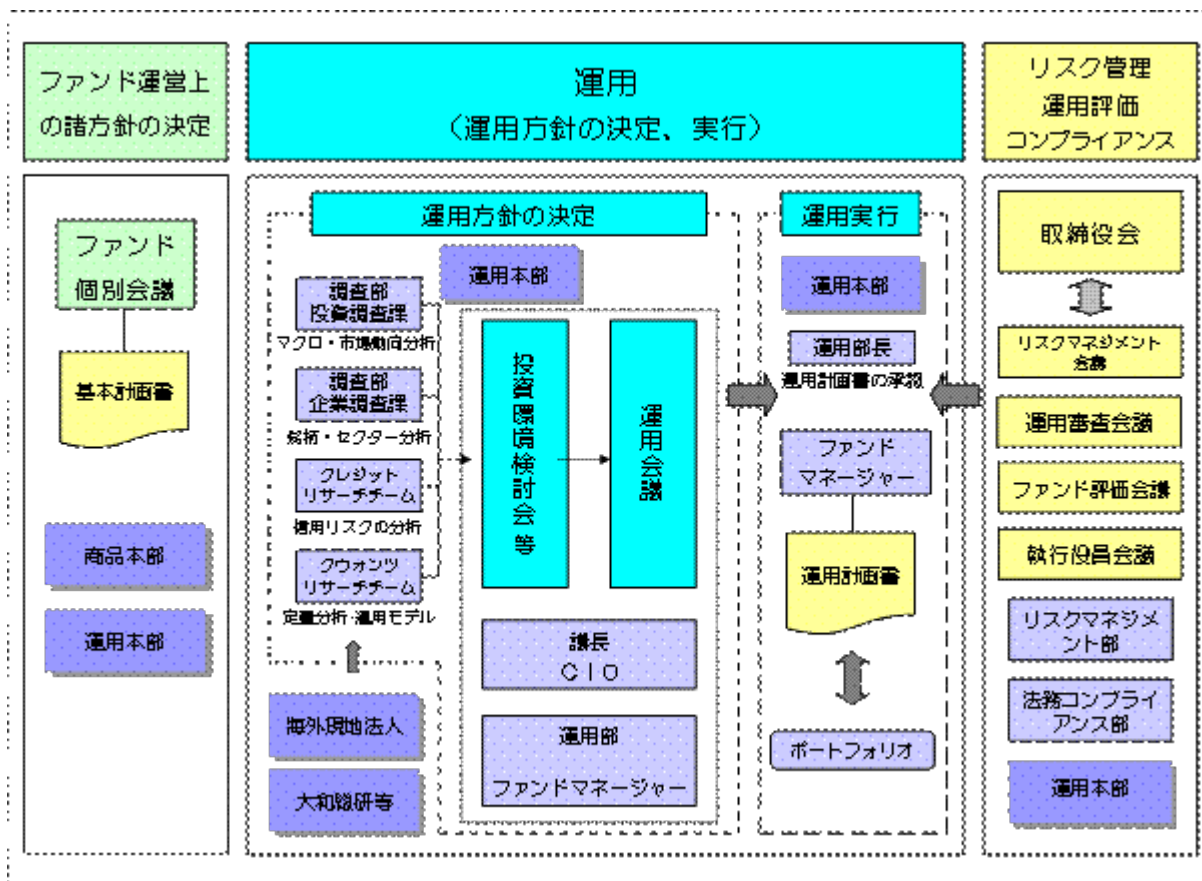
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5. の権利の性質を有するもの

前 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前 に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ．基本的な運用方針の決定

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営

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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ．ファンド評価会議

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

ロ．運用審査会議

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

ハ．リスクマネジメント会議

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

ニ．執行役員会議

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

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2018年4月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

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。

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、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

投資信託証券（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

投資する株式等の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ．前イ．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとし、

同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

信用取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができますものとし、

ロ．前イ．の信用取引の指図は、次の1.から6.までに掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1.から6.までに掲げる株券数の合計数を超えないものとし、

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等（信託約款）

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとし、（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八．において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純

資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前八．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

ヘ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引(信託約款)

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかる保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八．において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前八．においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本ホ．において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本ホ．において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額

が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

へ．前ホ．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ト．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

チ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

デリバティブ取引等（信託約款）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

有価証券の貸付け（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
3. 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

ロ．前イ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ．前イ．の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信

託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．前口．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ニ．前口．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしがたい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> マザーファンドの概要

1. 米国国債マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

米国国債を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主として、米国国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。

ロ．米国国債への投資にあたっては、残存期間が最長15年程度までの国債を、残存期間毎の国債の投資金額がほぼ同程度となるように組入れることをめざします（ストリップス債（ ）に投資することもあります。）。国債の償還金または償還が見込まれる国債の売却代金を再投資するにあたっては、残存期間が15年程度までの国債のうち、期間が最長のものに投資します（残存期間毎の国債の投資金額の平準化にも利用することがあります。）。なお、投資対象となる国債の発行額が少ないこと等で流動性が低い場合には、残存期間が隣接する銘柄等で代替することがあります。

ストリップス債とは債券の利金部分と元本部分を分離し、それぞれ別の債券としたものです。

ハ．外貨建資産の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ニ．外貨建資産については、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ホ．運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、米国国債の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下、会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
13. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
16. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
17. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前10.の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券

投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

2. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないません。

イ．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないません。

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への投資には、制限を設けません。

先物取引等

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとし、

ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとし、

ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとし、

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

保有実質外貨建資産については、為替ヘッジを行ないませんが、影響をすべて排除できるわけではありません。また、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となる場合があります。

その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

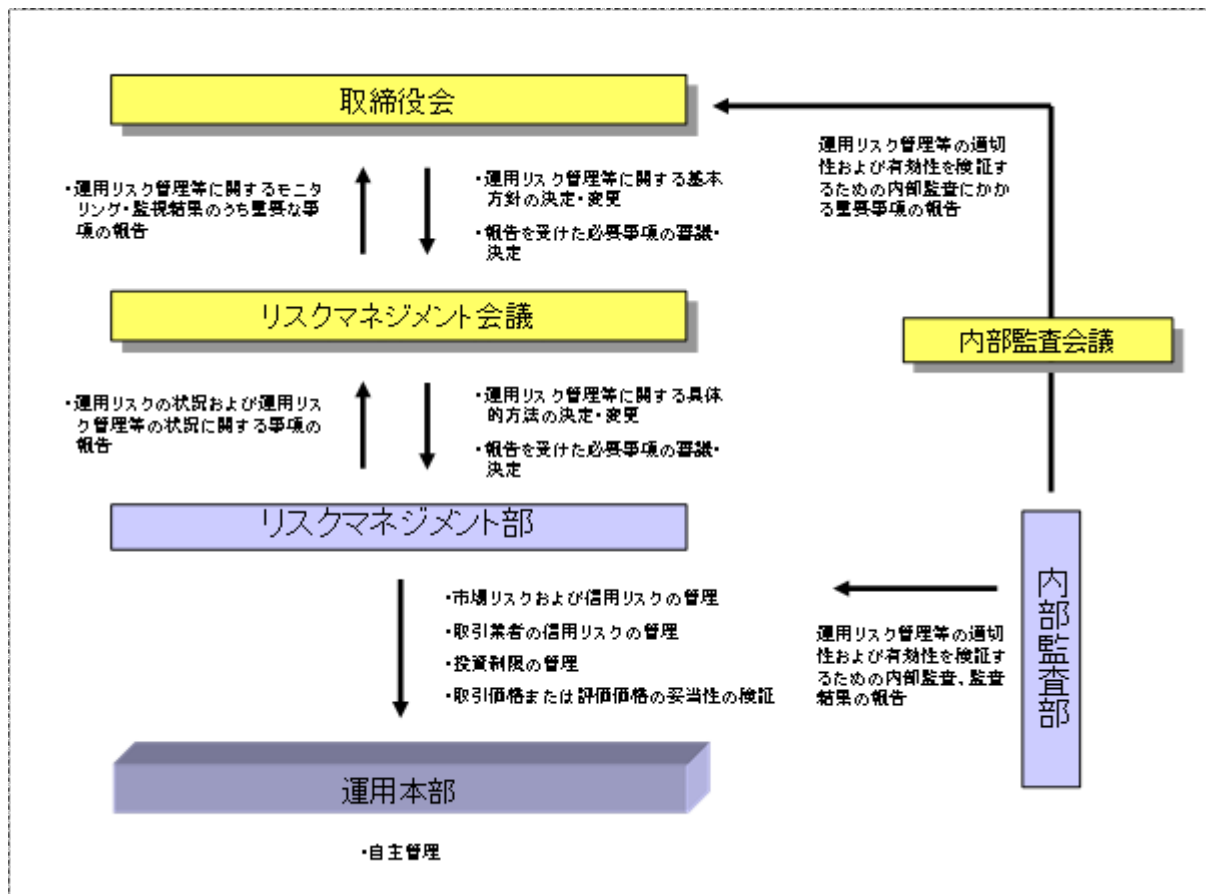
ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

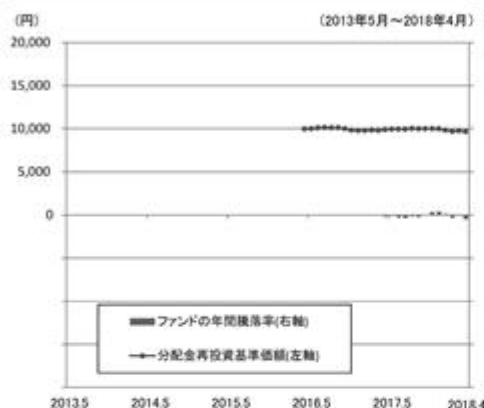
当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な

事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策(コンティンジェンシー・プラン)を定めています。

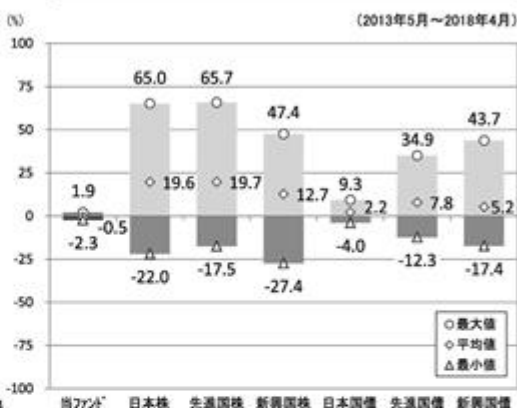
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、1.62%(税抜1.5%)となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問い合わせ下さい。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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

前 の信託報酬率は、每期、前計算期間終了日（第1計算期間については当初設定日の前営業日）における新発10年米国国債の利回り（原則として、ブルームバーグ社発表の米国国債ジェネリック10年の終値）に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。

（新発10年米国国債の利回りが）

イ．1%未満の場合 …年率0.3996%（税抜0.37%）

ロ．1%以上の場合 …年率0.594%（税抜0.55%）

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次の通りとします。

	委託会社	販売会社	受託会社
前 イの場合	年率0.16%	年率0.17%	年率0.04%
前 ロの場合	年率0.25%	年率0.26%	年率0.04%

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

各マザーファンドの投資対象等に応じて、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたNISAをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（ ）上記は、2018年4月末現在のもので、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。

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成30年4月27日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	253,101,890	99.00
内 日本	253,101,890	99.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,568,612	1.00
純資産総額	255,670,502	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(%)
為替予約取引(売建)	224,548,380	87.83
内 日本	224,548,380	87.83

(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) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 【投資資産】（平成30年4月27日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	米国国債マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	189,689,863	1.1629 220,603,710	1.2009 227,798,556	89.10
2	トピックス・インデックス・マザーファン ド	日本	親投資 信託受 益証券	22,673,239	1.0402 23,585,614	1.1160 25,303,334	9.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.00%
合計	99.00%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2018年5 月	売建	2,058,000	220,649,499	224,548,380	87.83%

(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) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(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)
第1計算期間末 (平成29年3月27日)	266,685,163	266,685,163	0.9814	0.9814
平成29年4月末日	267,932,343	-	0.9890	-
5月末日	271,607,457	-	0.9951	-
6月末日	271,051,697	-	0.9955	-
7月末日	273,612,722	-	0.9945	-
8月末日	276,529,578	-	1.0024	-
9月末日	278,693,043	-	0.9986	-
10月末日	281,335,210	-	0.9998	-
11月末日	281,217,876	-	0.9995	-
12月末日	282,271,149	-	0.9974	-
平成30年1月末日	266,026,489	-	0.9826	-
2月末日	262,582,544	-	0.9691	-
第2計算期間末 (平成30年3月26日)	258,640,721	258,640,721	0.9681	0.9681
3月末日	259,526,543	-	0.9762	-

4月末日	255,670,502	-	0.9660	-
------	-------------	---	--------	---

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.9
第2計算期間	1.4

(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	284,191,584	13,450,334
第2計算期間	48,543,123	53,132,295

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

米国国債マザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年4月27日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	13,970,238,537	98.59
内 アメリカ	13,970,238,537	98.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	200,002,090	1.41
純資産総額	14,170,240,627	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(%)
為替予約取引(売建)	76,524,000	0.54
内 日本	76,524,000	0.54

(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) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産(平成30年4月27日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Strip Coupon	アメリカ	国債証券	13,720,000	63.95 959,445,341	62.84 942,897,231	- 2033/02/15	6.65
2	United States Treasury Strip Coupon	アメリカ	国債証券	13,280,000	65.86 956,455,931	64.88 942,166,598	- 2032/02/15	6.65
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,851,000	127.00 951,481,640	124.97 936,236,298	5.375000 2031/02/15	6.61
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,475,000	131.77 933,035,518	129.84 919,370,321	6.125000 2029/08/15	6.49
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,024,000	122.07 670,621,330	120.30 660,897,403	5.250000 2028/11/15	4.66
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,207,000	100.32 461,544,366	99.31 456,870,406	2.750000 2024/02/15	3.22
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,209,000	98.82 454,823,151	98.21 452,052,421	2.125000 2021/08/15	3.19
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,013,000	100.83 442,472,545	100.62 441,546,631	4.000000 2018/08/15	3.12
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,989,000	100.61 438,871,038	100.17 436,977,942	2.625000 2020/08/15	3.08
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,044,000	96.89 428,476,313	96.19 425,385,256	1.750000 2022/05/15	3.00
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,270,000	90.21 421,212,591	89.15 416,291,207	1.500000 2026/08/15	2.94
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,613,000	101.08 399,356,332	100.84 398,412,087	3.125000 2019/05/15	2.81
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,740,000	95.20 389,350,757	94.03 384,557,640	2.250000 2027/08/15	2.71
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,655,000	95.26 380,749,674	94.18 376,441,185	2.000000 2025/02/15	2.66
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,657,000	127.81 371,348,755	126.07 366,287,497	6.125000 2027/11/15	2.58

16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,990,000	94.87 310,199,979	93.75 306,544,605	2.000000	2025/08/15	2.16
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,543,000	102.46 284,928,868	102.03 283,747,041	3.625000	2020/02/15	2.00
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,216,000	118.11 286,210,949	116.83 283,114,104	6.250000	2023/08/15	2.00
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,670,000	95.46 278,732,668	94.32 275,404,273	2.250000	2027/02/15	1.94
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,475,000	100.58 272,216,382	100.42 271,802,300	2.750000	2019/02/15	1.92
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,483,000	98.08 266,316,517	97.37 264,388,753	2.000000	2022/02/15	1.87
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,490,000	97.21 264,684,846	96.38 262,430,355	2.000000	2023/02/15	1.85
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,444,000	97.94 261,759,383	96.89 258,961,261	2.375000	2024/08/15	1.83
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,275,000	103.40 257,244,398	102.72 255,552,754	3.625000	2021/02/15	1.80
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,163,000	101.91 241,041,659	101.60 240,310,800	3.625000	2019/08/15	1.70
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,290,000	96.08 240,607,889	95.37 238,819,951	1.625000	2022/08/15	1.69
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,084,000	102.43 233,429,851	101.96 232,361,069	3.500000	2020/05/15	1.64
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	1,984,000	98.83 214,422,927	97.76 212,101,558	2.500000	2024/05/15	1.50
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	1,924,000	100.28 210,997,425	100.11 210,627,140	3.875000	2018/05/15	1.49
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	1,896,000	102.02 211,530,130	101.36 210,153,475	3.125000	2021/05/15	1.48

(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
国債証券	98.59%
合計	98.59%

(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

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2018年5 月	売建	700,000	76,582,450	76,524,000	0.54%

(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) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（平成30年4月27日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	143,768,968,480	98.48
内 日本	143,768,968,480	98.48
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,212,136,949	1.52
純資産総額	145,981,105,429	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)	2,170,990,000	1.49
内 日本	2,170,990,000	1.49

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

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

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

(2) 投資資産（平成30年4月27日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	688,100	6,737.54 4,636,107,891	7,181.00 4,941,246,100	3.38
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	3,911,800	709.33 2,774,764,760	733.20 2,868,131,760	1.96
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	251,400	8,902.18 2,238,010,533	8,501.00 2,137,151,400	1.46
4	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	397,100	5,132.45 2,038,097,953	5,205.00 2,066,905,500	1.42
5	ソニー	日本	株式	電気機 器	378,900	4,320.53 1,637,049,918	5,400.00 2,046,060,000	1.40
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	422,400	4,295.52 1,814,428,440	4,550.00 1,921,920,000	1.32
7	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	509,100	3,306.56 1,683,373,007	3,767.00 1,917,779,700	1.31
8	キーエンス	日本	株式	電気機 器	27,800	60,309.00 1,676,590,468	66,970.00 1,861,766,000	1.28
9	任天堂	日本	株式	その他製 品	34,900	41,107.33 1,434,646,014	46,170.00 1,611,333,000	1.10
10	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,582,300	195.86 1,485,089,365	198.40 1,504,328,320	1.03
11	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	497,500	2,976.25 1,480,687,154	2,937.00 1,461,157,500	1.00
12	ファナック	日本	株式	電気機 器	53,800	22,850.90 1,229,378,619	23,560.00 1,267,528,000	0.87
13	三菱商事	日本	株式	卸売業	391,600	2,628.13 1,029,179,064	3,027.00 1,185,373,200	0.81
14	日本電産	日本	株式	電気機 器	68,300	13,809.34 943,178,467	17,140.00 1,170,662,000	0.80
15	キャノン	日本	株式	電気機 器	304,000	3,843.58 1,168,450,274	3,790.00 1,152,160,000	0.79
16	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	398,600	2,587.44 1,031,357,557	2,835.00 1,130,031,000	0.77
17	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	233,900	4,410.02 1,031,505,470	4,805.00 1,123,889,500	0.77

18	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	50,800	19,543.03 992,786,073	21,970.00 1,116,076,000	0.76
19	花王	日本	株式	化学	139,500	6,872.68 958,739,566	7,855.00 1,095,772,500	0.75
20	東京海上HD	日本	株式	保険業	210,500	4,535.16 954,652,115	5,172.00 1,088,706,000	0.75
21	信越化学	日本	株式	化学	98,800	10,183.07 1,006,087,705	11,005.00 1,087,294,000	0.74
22	日立	日本	株式	電気機器	1,355,000	793.74 1,075,520,934	801.60 1,086,168,000	0.74
23	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	102,100	10,193.67 1,040,773,759	10,490.00 1,071,029,000	0.73
24	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	418,600	2,484.46 1,039,997,577	2,527.00 1,057,802,200	0.72
25	パナソニック	日本	株式	電気機器	647,200	1,650.52 1,068,222,527	1,632.00 1,056,230,400	0.72
26	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	352,000	3,704.89 1,304,123,221	2,936.50 1,033,648,000	0.71
27	小松製作所	日本	株式	機械	273,500	3,183.44 870,672,647	3,750.00 1,025,625,000	0.70
28	ダイキン工業	日本	株式	機械	77,400	11,348.24 878,353,833	12,805.00 991,107,000	0.68
29	武田薬品	日本	株式	医薬品	208,300	6,178.99 1,287,084,088	4,621.00 962,554,300	0.66
30	三菱電機	日本	株式	電気機器	566,100	1,755.38 993,722,707	1,680.50 951,331,050	0.65

(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	98.48%
合計	98.48%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.11%
鉱業	0.33%
建設業	3.18%

食料品	4.29%
繊維製品	0.69%
パルプ・紙	0.28%
化学	7.10%
医薬品	4.47%
石油・石炭製品	0.71%
ゴム製品	0.83%
ガラス・土石製品	0.97%
鉄鋼	1.06%
非鉄金属	0.89%
金属製品	0.66%
機械	5.29%
電気機器	13.44%
輸送用機器	8.67%
精密機器	1.63%
その他製品	2.19%
電気・ガス業	1.68%
陸運業	4.07%
海運業	0.20%
空運業	0.60%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	7.24%
卸売業	4.71%
小売業	4.84%
銀行業	7.01%
証券、商品先物取引業	0.98%
保険業	2.26%
その他金融業	1.22%
不動産業	2.44%
サービス業	4.22%
合計	98.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2018年6月	買建	122	2,080,210,880	2,170,990,000	1.49%

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

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(参考情報) 運用実績

● 為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド

2018年4月27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	9,660円
純資産総額	2.5億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.0%
3カ月間	-1.7%
6カ月間	-3.4%
1年間	-2.3%
3年間	-
5年間	-
設定来	-3.4%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において運用管理費用(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: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年3月	第2期 18年3月							
分配金	0円	0円							

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄(除く債券)	東証33業種名	比率
外国債券	42	87.8%	日本円	99.1%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	輸送用機器	0.3%
国内株式・先物	1,496	9.9%	米ドル	0.9%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	0.2%
					修正デュレーション	TOPIX先物 3006月	-	0.1%
					残存年数	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.1%
					債券格付別構成	日本電信電話	情報・通信業	0.1%
					AAA	ソニー	電気機器	0.1%
					AA	三井住友フィナンシャルG	銀行業	0.1%
					A	本田技研	輸送用機器	0.1%
					BBB	キーエンス	電気機器	0.1%
					BB	任天堂	その他製品	0.1%
コール・ローン、その他		2.4%						
合計	1,538	-	合計	100.0%	合計	合計		1.6%

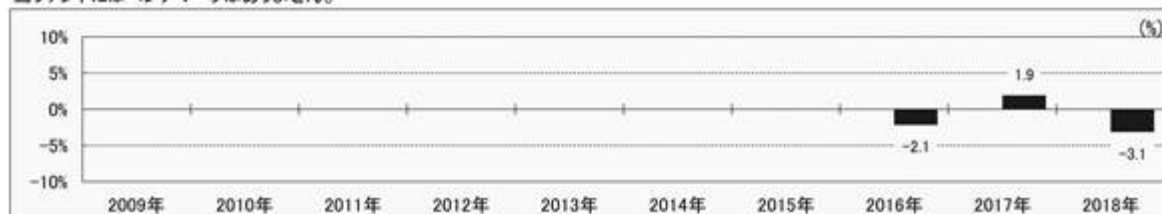
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※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

当ファンドにはベンチマークはありません。



※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。

※2016年は設定日(4月1日)から年末、2018年は4月27日までの騰落率を表しています。

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、ニューヨークの銀行またはシカゴ商品取引所における米国債先物取引のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行ないません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付を中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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

2 【換金(解約)手続等】

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

< 一部解約 >

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、ニューヨークの銀行またはシカゴ商品取引所における米国債先物取引のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・公社債等：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く。)
 2. 価格情報会社の提供する価額

なお、外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2016年4月1日から2021年3月26日までとします。ただし、(5)により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 【計算期間】

毎年3月27日から翌年3月26日までとします。ただし、第1計算期間は、2016年4月1日から2017年3月26日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、東証株価指数が改廃された場合、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとし、
2. 委託会社は、前1.の事項（前1.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容お

よびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・委託会社のホームページ
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2. の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。
<http://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

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

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとし、

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成29年3月28日から平成30年3月26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】

為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成29年3月27日現在	第2期 平成30年3月26日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	150,901
コール・ローン	5,677,374	2,139,157
親投資信託受益証券	256,128,181	252,333,227
派生商品評価勘定	1,859,112	-
未収入金	3,941,834	5,240,273
流動資産合計	267,606,501	259,863,558
資産合計	267,606,501	259,863,558
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	214,491
未払金	111,118	-
未払解約金	68,600	182,200
未払受託者報酬	52,404	58,473
未払委託者報酬	668,680	745,993
その他未払費用	20,536	21,680
流動負債合計	921,338	1,222,837
負債合計	921,338	1,222,837
純資産の部		
元本等		
元本	1 271,741,250	1 267,152,078
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 5,056,087	2 8,511,357
元本等合計	266,685,163	258,640,721
純資産合計	266,685,163	258,640,721
負債純資産合計	267,606,501	259,863,558

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成28年4月1日 至 平成29年3月27日	自	平成29年3月28日 至 平成30年3月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		7,905,503		8,765,954
為替差損益		12,257,136		6,726,232
営業収益合計		4,351,633		2,039,722
営業費用				
支払利息		1,764		2,790
受託者報酬		75,655		117,579
委託者報酬		965,743		1,500,102
その他費用		46,436		32,697
営業費用合計		1,089,598		1,653,168
営業損失（ ）		5,441,231		3,692,890
経常損失（ ）		5,441,231		3,692,890
当期純損失（ ）		5,441,231		3,692,890
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		184,620		315,252
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		5,056,087
剰余金増加額又は欠損金減少額		238,862		916,450
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		916,450
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		238,862		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		38,338		363,578
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		38,338		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		363,578
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,056,087		8,511,357

(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2期	
	自 平成29年3月28日	至 平成30年3月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 平成29年3月26日が休日のため、前計算期間末日を平成29年3月27日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	平成29年3月27日現在	平成30年3月26日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	271,741,250円
期中追加設定元本額	284,191,584円	48,543,123円
期中一部解約元本額	13,450,334円	53,132,295円
2. 計算期間末日における受益権の総数	271,741,250口	267,152,078口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,056,087円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は8,511,357円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第1期	第2期
	自 平成28年4月1日 至 平成29年3月27日	自 平成29年3月28日 至 平成30年3月26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（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は0円（1万口当たり0.00円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は0円（1万口当たり0.00円）であり、分配を行っておりません。

（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2期
	自 平成29年3月28日 至 平成30年3月26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、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約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2期 平成30年3月26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29年3月27日現在	第2期 平成30年3月26日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	6,678,231	10,968,221
合計	6,678,231	10,968,221

(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

通貨関連

種 類	第1期 平成29年3月27日 現在			第2期 平成30年3月26日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
	うち			うち		

		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	229,177,831	-	227,318,719	1,859,112	222,945,609	-	223,160,100	214,491
アメリカ・ドル	229,177,831	-	227,318,719	1,859,112	222,945,609	-	223,160,100	214,491
合計	229,177,831	-	227,318,719	1,859,112	222,945,609	-	223,160,100	214,491

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう

に評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

- (2) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 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2期	
自 平成29年3月28日	
至 平成30年3月26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29年3月27日現在	第2期 平成30年3月26日現在
1口当たり純資産額	0.9814円	0.9681円
(1万口当たり純資産額)	(9,814円)	(9,681円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	米国国債マザーファンド	196,055,473	227,934,092	
	トピックス・インデックス・マザー ファンド	23,469,734	24,399,135	
親投資信託受益証券 合計			252,333,227	
合計			252,333,227	

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

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

「米国国債マザーファンド」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29年3月27日現在	平成30年3月26日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		

流動資産		
預金	52,115,382	41,448,483
金銭信託	-	1,966,611
コール・ローン	46,007,088	27,878,543
国債証券	11,794,692,354	14,123,275,539
未収利息	67,567,475	66,944,801
前払費用	8,049,396	2,591,796
流動資産合計	11,968,431,695	14,264,105,773
資産合計	11,968,431,695	14,264,105,773
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	162,395	-
未払解約金	8,100,000	23,800,000
その他未払費用	-	74
流動負債合計	8,262,395	23,800,074
負債合計	8,262,395	23,800,074
純資産の部		
元本等		
元本	1 9,754,406,810	12,248,755,249
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,205,762,490	1,991,550,450
元本等合計	11,960,169,300	14,240,305,699
純資産合計	11,960,169,300	14,240,305,699
負債純資産合計	11,968,431,695	14,264,105,773

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成29年3月28日 至 平成30年3月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年3月27日現在	平成30年3月26日現在
1. 1 期首	平成28年4月1日	平成29年3月28日
期首元本額	3,671,575,969円	9,754,406,810円
期中追加設定元本額	10,001,310,879円	5,900,166,371円
期中一部解約元本額	3,918,480,038円	3,405,817,932円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
米回国債ファンド 為替ヘッ	2,580,555,397円	3,944,739,357円
ジあり（年1回決算型）		

米国国債ファンド 為替ヘッジなし(年1回決算型)	1,445,798,327円	1,776,683,872円
米国国債ファンド フレックスヘッジ(年1回決算型)	218,393,606円	199,246,519円
米国国債ファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	5,233,453,739円	6,042,807,183円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	188,153,372円	196,055,473円
米国国債ファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	88,052,369円	89,222,845円
計	9,754,406,810円	12,248,755,249円
2. 期末日における受益権の総数	9,754,406,810口	12,248,755,249口

(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29年3月28日 至 平成30年3月26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、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30年3月26日現在
-----	--------------

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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29年3月27日現在	平成30年3月26日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	473,614,147	318,465,109
合計	473,614,147	318,465,109

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成28年3月29日から平成29年3月27日まで、及び平成29年3月28日から平成30年3月26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

通貨関連

種 類	平成29年3月27日 現在				平成30年3月26日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	20,000,000	-	19,837,605	162,395	-	-	-	-
アメリカ・ドル	20,000,000	-	19,837,605	162,395	-	-	-	-
合計	20,000,000	-	19,837,605	162,395	-	-	-	-

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 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29年3月27日現在	平成30年3月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2261円 (12,261円)	1,1626円 (11,626円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	3.875% United States Treasury Note/Bond 20180515	2,224,000.000	2,230,427.360	
		4% United States Treasury Note/Bond 20180815	4,163,000.000	4,197,636.160	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20190215	2,475,000.000	2,489,404.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	3,873,000.000	3,914,905.860	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	2,313,000.000	2,357,178.300	

3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	2,543,000.000	2,605,659.520	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	2,304,000.000	2,360,056.320	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	4,139,000.000	4,164,372.070	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,275,000.000	2,352,486.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,176,000.000	2,220,107.520	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	4,359,000.000	4,307,563.800	
2% United States Treasury Note/Bond 20220215	2,483,000.000	2,435,450.550	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	4,304,000.000	4,170,317.760	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,440,000.000	2,344,474.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,490,000.000	2,420,529.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	355,000.000	340,022.550	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	1,845,000.000	1,831,439.250	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	4,207,000.000	4,220,798.960	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	2,244,000.000	2,217,857.400	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	2,216,000.000	2,617,384.080	
7.625% United States Treasury Note/Bond 20250215	654,000.000	855,458.160	
6.875% United States Treasury Note/Bond 20250815	1,612,000.000	2,057,814.720	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	739,000.000	908,046.250	
6.75% United States Treasury Note/Bond 20260815	491,000.000	637,072.500	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	2,657,000.000	3,395,964.840	

	5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	1,100,000.000	1,362,658.000	
	5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	5,024,000.000	6,132,796.800	
	5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	1,219,000.000	1,492,884.920	
	6.125% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,825,000.000	8,993,780.250	
	5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	7,011,000.000	8,904,460.770	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	2,444,000.000	2,393,775.800	
	2% United States Treasury Note/Bond 20250215	3,655,000.000	3,481,935.750	
	2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	1,541,000.000	1,477,063.910	
	2% United States Treasury Note/Bond 20250815	3,140,000.000	2,979,075.000	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	1,770,000.000	1,623,408.600	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	2,096,000.000	1,916,184.160	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	4,270,000.000	3,851,967.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	2,670,000.000	2,548,995.600	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	2,000,000.000	1,927,500.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	3,740,000.000	3,560,592.200	
	United States Treasury Strip Coupon 20320215	13,760,000.000	9,062,886.400	
	United States Treasury Strip Coupon 20330215	14,300,000.000	9,144,993.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 134,507,386.090 (14,123,275,539)	
国債証券	合計		14,123,275,539 [14,123,275,539]	
合計			14,123,275,539	

[14,123,275,539]

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 42銘柄	100%	100%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年3月27日現在		平成30年3月26日現在	
	金額(円)		金額(円)	
資産の部				
流動資産				
金銭信託		-		839,376,610
コール・ローン		6,347,583,869		11,898,947,937
株式	3 4	124,781,807,730		134,541,211,690
未収入金		64,563,000		-
未収配当金		172,841,308		158,321,350
未収利息		426,283		428,860
前払金		7,685,000		32,645,000
その他未収収益	5	4,722,317		6,060,204
流動資産合計		131,379,629,507		147,476,991,651
資産合計		131,379,629,507		147,476,991,651
負債の部				
流動負債				
派生商品評価勘定		28,765,620		26,495,780
未払金		-		1,068,240

未払解約金		119,097,700	117,755,500
受入担保金		5,072,174,089	11,801,415,202
その他未払費用		-	8,027
流動負債合計		5,220,037,409	11,946,742,749
負債合計		5,220,037,409	11,946,742,749
純資産の部			
元本等			
元本	1	135,803,715,077	130,371,388,477
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()	2	9,644,122,979	5,158,860,425
元本等合計		126,159,592,098	135,530,248,902
純資産合計		126,159,592,098	135,530,248,902
負債純資産合計		131,379,629,507	147,476,991,651

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年3月28日 至 平成30年3月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 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。</p> <p>(2)新株予約権証券</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成29年3月27日現在	平成30年3月26日現在
1. 1 期首	平成28年4月1日	平成29年3月28日
期首元本額	144,467,927,535円	135,803,715,077円
期中追加設定元本額	12,844,764,955円	16,795,623,456円
期中一部解約元本額	21,508,977,413円	22,227,950,056円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックス ファンド	5,272,946,984円	4,344,300,848円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	13,126,947,100円	10,144,312,936円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2	118,645,055円	61,617,006円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	111,165,587円	77,134,028円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,949,394,108円	1,282,417,660円

ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	85,742,086円	60,750,134円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	2,867,825,694円	1,764,892,302円
D-I's TOPIXイン デックス	32,272,718円	29,632,470円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	27,377,107円	23,469,734円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	576,797円	615,913円
iFree TOPIXイン デックス	198,305,763円	422,122,245円
iFree 8資産バランス	296,875,024円	792,154,062円
DCダイワ日本株式インデッ クス	61,786,838,665円	62,537,486,847円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,206,896,996円	2,214,432,874円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,289,313,616円	2,412,758,430円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,121,830,740円	2,346,940,901円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	3,856,473,716円	4,129,426,450円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	25,073,892円	16,623,307円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	61,600,737円	51,553,250円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	13,500,663円	14,437,491円
ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	404,752円	330,547円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	400,556円	362,318円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	839,912円	690,983円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	30,573,099円	2,857,428円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	164,447,261円	4,967,348円

ダイワ世界分散バランスファン ド30VA(国内株式型)	59,955,607円	10,530,833円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	1,323,241,557円	264,211,563円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	205,375,990円	168,062,338円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	13,131,983,656円	10,298,005,823円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	355,232,365円	133,716,617円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	596,688,907円	162,233,235円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,090,811,481円	874,973,797円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	162,313,951円	134,813,124円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	271,540,129円	230,374,774円
ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	52,623,916円	105,802,337円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	3,577,769,160円	7,169,889,658円
ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	1,056,102円	89,582,064円
ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス	241,627,443円	1,437,851,570円
ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,130,599,336円	1,314,382,361円
ダイワライフスタイル25	189,635,328円	175,089,091円
ダイワライフスタイル50	657,811,758円	612,401,594円
ダイワライフスタイル75	509,111,510円	517,314,102円
DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)	15,600,068,253円	13,935,866,084円
計	135,803,715,077円	130,371,388,477円
2. 期末日における受益権の総数	135,803,715,077口	130,371,388,477口

3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は9,644,122,979円であります。	
4.	3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 4,806,485,650円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 10,873,342,910円
5.	4 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 615,800,000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 664,200,000円
6.	5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分3,645,075円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分4,719,250円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年3月28日 至 平成30年3月26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30年3月26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29年3月27日現在	平成30年3月26日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	16,957,561,700	66,172,173
合計	16,957,561,700	66,172,173

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成28年9月21日から平成29年3月27日まで、及び平成29年9月20日から平成30年3月26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29年3月27日 現在			平成30年3月26日 現在			
	契約額等		時価	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)

市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,582,465,000	-	1,553,755,000	28,710,000	968,390,000	-	941,925,000	26,465,000
合計	1,582,465,000	-	1,553,755,000	28,710,000	968,390,000	-	941,925,000	26,465,000

(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29年3月27日現在	平成30年3月26日現在
1口当たり純資産額	0.9290円	1.0396円
(1万口当たり純資産額)	(9,290円)	(10,396円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極 洋	3,800	3,860.00	14,668,000	貸付株式数 1,000株
日本水産	70,700	529.00	37,400,300	貸付株式数 19,600株
マルハニチロ	12,100	3,275.00	39,627,500	貸付株式数 3,300株
カネコ種苗	5,400	1,550.00	8,370,000	
サカタのタネ	9,400	3,520.00	33,088,000	貸付株式数 2,600株
ホクト	6,500	2,021.00	13,136,500	
ショーボンドHD	6,000	7,410.00	44,460,000	貸付株式数 1,600株
ミライト・ホールディングス	18,900	1,631.00	30,825,900	貸付株式数 5,200株
タマホーム	10,300	1,252.00	12,895,600	
インベスターズクラウド	6,100	2,128.00	12,980,800	
日鉄鉱業	1,800	6,010.00	10,818,000	
三井松島	5,000	1,497.00	7,485,000	

国際石油開発帝石	303,000	1,300.00	393,900,000	
日本海洋掘削	3,500	1,986.00	6,951,000	貸付株式数 700株 (700株)
石油資源開発	8,700	2,458.00	21,384,600	
K & O エナジーグループ	4,000	1,647.00	6,588,000	
安藤・間	49,700	785.00	39,014,500	
東急建設	25,300	1,129.00	28,563,700	
コムシスホールディングス	21,700	2,733.00	59,306,100	貸付株式数 6,000株
ミサワホーム	7,500	877.00	6,577,500	
高松コンストラクショング P	4,200	2,990.00	12,558,000	
東建コーポレーション	2,400	10,150.00	24,360,000	
ヤマウラ	8,400	953.00	8,005,200	貸付株式数 2,300株
大成建設	63,100	5,160.00	325,596,000	
大林組	188,500	1,130.00	213,005,000	
清水建設	193,700	906.00	175,492,200	
飛島建設	74,800	172.00	12,865,600	
長谷工コーポレーション	73,800	1,558.00	114,980,400	貸付株式数 20,400株
松井建設	10,500	772.00	8,106,000	貸付株式数 100株
鹿島建設	278,000	945.00	262,710,000	
不動テトラ	55,000	185.00	10,175,000	貸付株式数 15,400株
鉄建建設	4,100	2,910.00	11,931,000	
西松建設	14,000	2,651.00	37,114,000	
三井住友建設	45,200	624.00	28,204,800	
大豊建設	25,000	585.00	14,625,000	
前田建設	45,400	1,190.00	54,026,000	
奥村組	9,800	4,440.00	43,512,000	貸付株式数 2,200株
東鉄工業	7,700	3,215.00	24,755,500	
浅沼組	27,000	416.00	11,232,000	
戸田建設	72,000	747.00	53,784,000	貸付株式数 2,000株
熊谷組	10,300	3,290.00	33,887,000	
北野建設	19,000	404.00	7,676,000	
三井ホーム	11,000	660.00	7,260,000	
矢作建設	10,800	771.00	8,326,800	貸付株式数 2,900株
ピーエス三菱	10,900	692.00	7,542,800	
日本ハウスHLDGS	16,300	544.00	8,867,200	貸付株式数 3,100株
大東建託	22,900	17,725.00	405,902,500	
新日本建設	8,600	1,085.00	9,331,000	
NIPPO	14,500	2,309.00	33,480,500	
東亜道路	1,700	3,985.00	6,774,500	
前田道路	18,000	2,118.00	38,124,000	

日本道路	1,800	5,170.00	9,306,000	
東亜建設	5,700	2,196.00	12,517,200	貸付株式数 1,000株
若築建設	5,000	1,620.00	8,100,000	
東洋建設	22,400	481.00	10,774,400	
五洋建設	74,100	739.00	54,759,900	
世紀東急	12,600	681.00	8,580,600	
福田組	2,300	6,360.00	14,628,000	
住友林業	39,100	1,671.00	65,336,100	
日本基礎技術	19,000	398.00	7,562,000	
日成ビルド工業	10,200	1,238.00	12,627,600	
巴コーポレーション	21,900	534.00	11,694,600	
大和ハウス	186,200	3,878.00	722,083,600	貸付株式数 51,800株
ライト工業	12,300	1,093.00	13,443,900	貸付株式数 3,400株
積水ハウス	203,800	1,849.50	376,928,100	
日特建設	10,300	620.00	6,386,000	
ユアテック	9,900	813.00	8,048,700	
中電工	7,900	2,831.00	22,364,900	
関電工	24,500	1,179.00	28,885,500	貸付株式数 6,700株
きんでん	41,100	1,709.00	70,239,900	
東京エネシス	8,100	1,162.00	9,412,200	
トーエネック	1,900	3,070.00	5,833,000	
住友電設	5,000	2,034.00	10,170,000	
日本電設工業	9,400	2,020.00	18,988,000	
協和エクシオ	22,400	2,650.00	59,360,000	
日本工営	4,100	3,015.00	12,361,500	貸付株式数 1,100株
九電工	12,500	4,725.00	59,062,500	
三機工業	13,900	1,143.00	15,887,700	貸付株式数 2,700株
日揮	53,800	2,234.00	120,189,200	
中外炉工業	3,700	2,906.00	10,752,200	
太平電業	4,500	2,603.00	11,713,500	
高砂熱学	17,000	1,861.00	31,637,000	
NEC ネットズエスアイ	5,800	2,708.00	15,706,400	
明星工業	12,600	730.00	9,198,000	
大気社	8,100	3,365.00	27,256,500	
ダイダン	5,000	2,173.00	10,865,000	
日比谷総合設備	7,600	1,912.00	14,531,200	
東芝プラントシステム	13,300	2,308.00	30,696,400	貸付株式数 3,700株
日本製粉	18,400	1,614.00	29,697,600	
日清製粉G本社	68,200	2,025.00	138,105,000	
昭和産業	5,200	2,777.00	14,440,400	貸付株式数 1,400株

中部飼料	7,600	2,067.00	15,709,200	
フィード・ワン	43,800	212.00	9,285,600	貸付株式数 12,100株
東洋精糖	8,600	1,213.00	10,431,800	
三井製糖	4,800	4,135.00	19,848,000	貸付株式数 1,300株
塩水港精糖	32,100	268.00	8,602,800	
日新製糖	3,800	2,089.00	7,938,200	
L I F U L L	19,600	892.00	17,483,200	貸付株式数 5,300株 (5,300株)
ジェイエイシーリクルートメント	4,800	2,194.00	10,531,200	貸付株式数 1,300株
日本M&Aセンター	18,900	7,040.00	133,056,000	
タケエイ	7,500	1,192.00	8,940,000	貸付株式数 1,900株
トラスト・テック	3,000	3,155.00	9,465,000	
コシダカホールディングス	3,000	7,040.00	21,120,000	
パソナグループ	5,600	2,227.00	12,471,200	貸付株式数 500株
C D S	6,600	1,304.00	8,606,400	
リンクアンドモチベーション	11,100	1,160.00	12,876,000	貸付株式数 2,900株
G C A	7,900	879.00	6,944,100	
エス・エム・エス	10,900	4,210.00	45,889,000	貸付株式数 2,900株
パーソルホールディングス	49,900	2,989.00	149,151,100	
リニカル	5,300	1,689.00	8,951,700	貸付株式数 1,400株
クックパッド	19,100	564.00	10,772,400	貸付株式数 5,200株
森永製菓	13,500	4,585.00	61,897,500	貸付株式数 3,700株
江崎グリコ	16,000	5,540.00	88,640,000	貸付株式数 4,400株
不二家	4,300	2,487.00	10,694,100	
山崎製パン	46,100	2,200.00	101,420,000	貸付株式数 4,400株
モロゾフ	1,700	6,280.00	10,676,000	
亀田製菓	3,800	5,050.00	19,190,000	
寿スピリッツ	5,600	5,380.00	30,128,000	
カルビー	25,900	3,670.00	95,053,000	貸付株式数 6,600株
森永乳業	11,500	4,240.00	48,760,000	貸付株式数 3,100株
六甲バター	3,900	2,153.00	8,396,700	
ヤクルト	33,800	7,800.00	263,640,000	貸付株式数 9,300株 (9,300株)
明治ホールディングス	37,600	7,950.00	298,920,000	
雪印メグミルク	13,800	2,804.00	38,695,200	
プリマハム	41,000	594.00	24,354,000	
日本ハム	49,000	2,183.00	106,967,000	
丸大食品	32,000	505.00	16,160,000	
S F o o d s	4,300	4,215.00	18,124,500	

伊藤ハム米久HLDGS	36,000	930.00	33,480,000	
スタジオアリス	3,300	2,517.00	8,306,100	
シミックホールディングス	4,800	2,708.00	12,998,400	
システナ	4,800	4,130.00	19,824,000	
デジタルアーツ	3,100	3,985.00	12,353,500	貸付株式数 800株 (800株)
新日鉄住金SOL	8,700	2,866.00	24,934,200	
総合警備保障	21,500	4,860.00	104,490,000	貸付株式数 5,900株
キューブシステム	8,500	792.00	6,732,000	
いちご	78,900	444.00	35,031,600	貸付株式数 16,400株
日本駐車場開発	80,200	167.00	13,393,400	
コア	4,600	1,292.00	5,943,200	
カカクコム	41,300	1,818.00	75,083,400	
ディップ	7,900	3,090.00	24,411,000	
オプトホールディング	5,800	1,549.00	8,984,200	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ツクイ	14,600	790.00	11,534,000	貸付株式数 3,700株
エムスリー	57,100	4,495.00	256,664,500	
アウトソーシング	16,900	1,752.00	29,608,800	貸付株式数 4,500株
ウェルネット	7,500	1,086.00	8,145,000	貸付株式数 1,600株
ワールドホールディングス	2,100	4,330.00	9,093,000	
ディー・エヌ・エー	29,200	1,909.00	55,742,800	
博報堂DYHLDGS	74,600	1,410.00	105,186,000	貸付株式数 18,300株
ぐるなび	9,100	1,393.00	12,676,300	
ファンコミュニケーションズ	17,800	677.00	12,050,600	貸付株式数 1,200株
WDBホールディングス	3,000	3,735.00	11,205,000	貸付株式数 700株
ティア	10,300	979.00	10,083,700	
バリューコマース	7,600	1,334.00	10,138,400	
インフォマート	28,600	1,027.00	29,372,200	貸付株式数 7,900株
サッポロホールディングス	20,700	2,978.00	61,644,600	
アサヒグループホールディング	118,700	5,450.00	646,915,000	貸付株式数 33,000株
麒麟HD	272,100	2,792.00	759,703,200	
宝ホールディングス	45,500	1,172.00	53,326,000	貸付株式数 11,700株
オエノンホールディングス	31,100	451.00	14,026,100	
コカ・コーラボトラーズJHD	40,000	4,160.00	166,400,000	貸付株式数 11,000株
サントリー食品インター	43,400	5,050.00	219,170,000	貸付株式数 12,000株
ダイドーグループHD	3,100	6,580.00	20,398,000	貸付株式数 800株
伊藤園	18,900	4,070.00	76,923,000	貸付株式数 5,200株
キーコーヒー	7,000	2,139.00	14,973,000	
日清オイリオグループ	6,600	2,920.00	19,272,000	

不二製油グループ	15,400	3,195.00	49,203,000	貸付株式数	4,300株
J - オイルミルズ	3,200	3,620.00	11,584,000		
ローソン	13,900	7,010.00	97,439,000	貸付株式数	4,800株
サンエー	4,300	5,940.00	25,542,000		
カワチ薬品	4,800	2,519.00	12,091,200	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
エービーシー・マート	10,000	6,790.00	67,900,000	貸付株式数	2,700株
ハードオフコーポレーション	6,500	1,108.00	7,202,000		
アスクル	5,800	3,455.00	20,039,000	貸付株式数	1,600株
ゲオホールディングス	10,800	1,704.00	18,403,200	貸付株式数	2,900株
アダストリア	8,700	2,144.00	18,652,800		
くらコーポレーション	3,400	7,050.00	23,970,000		
エレマテック	2,900	2,530.00	7,337,000		
パルグループHLDGS	3,100	2,829.00	8,769,900		
JALUX	2,600	3,140.00	8,164,000		
エディオン	21,100	1,201.00	25,341,100	貸付株式数	8,800株
あらた	3,100	5,620.00	17,422,000		
サーラコーポレーション	11,600	624.00	7,238,400		
ワッツ	6,700	1,043.00	6,988,100		
ハローズ	2,900	2,427.00	7,038,300		
J Pホールディングス	21,400	297.00	6,355,800	貸付株式数	6,100株 (2,000株)
あみやき亭	2,200	5,840.00	12,848,000	貸付株式数	100株
東京エレクトロデバイス	4,100	1,936.00	7,937,600		
ひらまつ	15,800	491.00	7,757,800	貸付株式数	4,200株
フィールズ	5,500	1,167.00	6,418,500	貸付株式数	1,500株
双日	320,200	328.00	105,025,600		
アルフレッサホールディングス	60,300	2,232.00	134,589,600	貸付株式数	16,800株
大黒天物産	1,700	5,280.00	8,976,000		
ハニーズホールディングス	7,100	999.00	7,092,900		
キッコーマン	43,900	4,115.00	180,648,500	貸付株式数	12,200株
味の素	129,400	1,900.50	245,924,700	貸付株式数	36,000株
キューピー	31,700	2,811.00	89,108,700		
ハウス食品G本社	22,100	3,420.00	75,582,000		
カゴメ	22,900	3,585.00	82,096,500	貸付株式数	6,300株
アリアケジャパン	5,300	8,210.00	43,513,000	貸付株式数	1,400株
ニチレイ	26,900	2,722.00	73,221,800	貸付株式数	7,400株
横浜冷凍	15,400	999.00	15,384,600	貸付株式数	100株
東洋水産	30,500	4,095.00	124,897,500		
日清食品HD	24,700	7,210.00	178,087,000		

永谷園ホールディングス	8,000	1,461.00	11,688,000	
フジッコ	6,400	2,367.00	15,148,800	貸付株式数 1,600株
ロックフィールド	6,800	2,099.00	14,273,200	
日本たばこ産業	350,000	2,909.50	1,018,325,000	
ケンコーマヨネーズ	4,300	3,315.00	14,254,500	貸付株式数 1,100株 (1,000株)
わらべや日洋HD	4,100	2,470.00	10,127,000	
ユーグレナ	23,200	977.00	22,666,400	貸付株式数 6,400株 (5,800株)
片倉工業	8,100	1,358.00	10,999,800	
グ ン ゼ	4,700	5,870.00	27,589,000	
ヒューリック	117,200	1,096.00	128,451,200	貸付株式数 10,500株
アルペン	4,500	2,278.00	10,251,000	
クオール	6,400	1,998.00	12,787,200	
アルコニックス	6,500	2,049.00	13,318,500	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
神戸物産	3,800	4,650.00	17,670,000	
ジンス	3,900	5,590.00	21,801,000	貸付株式数 1,000株
ビックカメラ	33,000	1,596.00	52,668,000	貸付株式数 8,900株 (8,900株)
DCMホールディングス	27,900	1,042.00	29,071,800	貸付株式数 9,100株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	3,100	4,665.00	14,461,500	貸付株式数 800株
MonotaRO	20,100	3,675.00	73,867,500	貸付株式数 5,600株
あい ホールディングス	9,300	2,801.00	26,049,300	貸付株式数 800株
ディービーエックス	4,800	1,227.00	5,889,600	
アークランドサービスHD	5,200	2,278.00	11,845,600	貸付株式数 1,200株
J. フロント リテイリング	66,200	1,731.00	114,592,200	
ドトール・日レスHD	9,900	2,480.00	24,552,000	
マツモトキヨシHLDGS	23,100	4,220.00	97,482,000	
ブロンコビリー	3,500	3,355.00	11,742,500	
スタートトゥデイ	54,900	2,656.00	145,814,400	
物語コーポレーション	1,800	10,100.00	18,180,000	貸付株式数 500株
ココカラファイン	5,900	6,950.00	41,005,000	
三越伊勢丹HD	103,300	1,134.00	117,142,200	貸付株式数 10,000株
東洋紡	21,700	2,090.00	45,353,000	貸付株式数 4,000株
ユニチカ	18,600	633.00	11,773,800	貸付株式数 5,200株
富士紡ホールディングス	3,500	3,775.00	13,212,500	
日清紡ホールディングス	34,200	1,397.00	47,777,400	
倉敷紡績	59,000	327.00	19,293,000	

ダイワボウHD	4,900	4,305.00	21,094,500	
シキボウ	6,200	1,290.00	7,998,000	
日東紡績	8,700	2,251.00	19,583,700	貸付株式数 1,100株
トヨタ紡織	16,300	2,111.00	34,409,300	
マクニカ・富士エレHLDGS	11,000	1,839.00	20,229,000	貸付株式数 2,800株
ウエルシアHD	14,900	4,450.00	66,305,000	
クリエイトSDH	8,400	2,567.00	21,562,800	貸付株式数 1,600株
バイタルKSKHD	10,300	1,029.00	10,598,700	貸付株式数 1,700株
UKCホールディングス	4,500	2,139.00	9,625,500	
TOKAIホールディングス	29,900	1,033.00	30,886,700	貸付株式数 4,100株
三洋貿易	4,100	1,960.00	8,036,000	
ウイン・パートナーズ	5,200	1,533.00	7,971,600	
ジョイフル本田	8,900	3,675.00	32,707,500	
鳥貴族	2,600	2,921.00	7,594,600	貸付株式数 700株
ホットランド	5,300	1,225.00	6,492,500	貸付株式数 1,400株 (200株)
すかいらーく	35,000	1,492.00	52,220,000	貸付株式数 9,300株 (2,800株)
綿半ホールディングス	3,200	3,895.00	12,464,000	
日本毛織	16,300	1,032.00	16,821,600	
ユニテッド・スーパーマーケ	18,100	1,090.00	19,729,000	貸付株式数 5,000株
三栄建築設計	3,000	2,213.00	6,639,000	貸付株式数 700株
野村不動産HLDGS	37,200	2,475.00	92,070,000	
三重交通グループHD	14,600	512.00	7,475,200	貸付株式数 3,800株
サムティ	5,800	1,743.00	10,109,400	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本商業開発	4,500	1,746.00	7,857,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
プレサンスコーポレーション	8,400	1,526.00	12,818,400	貸付株式数 2,100株
ユニゾホールディングス	6,600	2,510.00	16,566,000	貸付株式数 1,700株
日本管理センター	5,300	1,485.00	7,870,500	貸付株式数 600株
フージャースHD	17,100	733.00	12,534,300	貸付株式数 2,500株
オープンハウス	9,300	6,410.00	59,613,000	貸付株式数 2,500株
東急不動産HD	133,300	743.00	99,041,900	
飯田GHD	46,000	1,970.00	90,620,000	
帝国繊維	6,900	2,046.00	14,117,400	
日本コークス工業	60,600	109.00	6,605,400	貸付株式数 16,900株
あさひ	5,400	1,263.00	6,820,200	
日本調剤	2,100	3,315.00	6,961,500	貸付株式数 500株 (100株)

コスモス薬品	2,900	20,890.00	60,581,000	貸付株式数	700株
シップヘルスケアHD	11,200	3,700.00	41,440,000		
ソフトクリエイトHD	5,500	1,415.00	7,782,500		
セブン&アイ・HLDGS	232,600	4,373.00	1,017,159,800	貸付株式数	64,000株
薬王堂	2,700	3,850.00	10,395,000	貸付株式数	800株
クリエイト・レストランツ・ホール	16,000	1,197.00	19,152,000	貸付株式数	2,500株
ツルハホールディングス	12,200	14,670.00	178,974,000		
サンマルクホールディングス	4,100	3,115.00	12,771,500		
トリドールホールディングス	7,000	3,855.00	26,985,000	貸付株式数	1,900株
帝人	46,600	1,987.00	92,594,200		
東レ	428,800	990.90	424,897,920		
クラレ	96,900	1,712.00	165,892,800		
旭化成	367,200	1,382.50	507,654,000	貸付株式数	102,100株
サカイオーベックス	3,200	2,382.00	7,622,400		
TOKYO BASE	4,500	1,356.00	6,102,000		
宮地エンジニアリングG	2,500	1,980.00	4,950,000		
トーカロ	16,200	1,274.00	20,638,800		
アルファCO	2,900	1,714.00	4,970,600		
SUMCO	52,000	2,902.00	150,904,000		
川田テクノロジーズ	1,400	5,180.00	7,252,000	貸付株式数	300株
住江織物	2,100	2,714.00	5,699,400		
アツギ	8,300	1,203.00	9,984,900		
コメダホールディングス	10,600	1,937.00	20,532,200		
ダイユー・リックHLDGS	9,100	1,065.00	9,691,500		
クスリのアオキHLDGS	4,500	7,330.00	32,985,000	貸付株式数	1,200株
ダイニック	7,400	1,037.00	7,673,800		
共和レザー	7,800	943.00	7,355,400		
スシローグローバルHLDGS	5,600	5,180.00	29,008,000		
LIXILビバ	5,600	2,065.00	11,564,000		
セーレン	13,800	1,817.00	25,074,600		
ソトー	9,600	1,063.00	10,204,800	貸付株式数	500株
東海染工	5,500	1,444.00	7,942,000		
小松精練	11,300	1,107.00	12,509,100		
ワコールホールディングス	15,700	3,090.00	48,513,000		
ホギメディカル	3,700	8,300.00	30,710,000		
TSIホールディングス	22,300	735.00	16,390,500		
TIS	18,500	4,015.00	74,277,500		
電算システム	5,500	1,884.00	10,362,000	貸付株式数	1,200株
グリー	34,500	610.00	21,045,000		

コーエーテクモHD	9,200	2,047.00	18,832,400	
三菱総合研究所	2,900	3,270.00	9,483,000	
K L a b	11,100	1,606.00	17,826,600	貸付株式数 3,000株 (700株)
ポルトゥウィン・ピットクル	5,100	1,898.00	9,679,800	
ネクソン	62,100	3,560.00	221,076,000	
アイスタイル	14,600	1,354.00	19,768,400	貸付株式数 4,000株
エイチーム	4,400	2,447.00	10,766,800	貸付株式数 1,100株
テクノスジャパン	7,400	888.00	6,571,200	貸付株式数 1,900株
コロプラ	18,700	936.00	17,503,200	貸付株式数 5,100株 (4,600株)
ブロードリーフ	15,000	1,033.00	15,495,000	
ハーツユニテッドグループ	4,500	1,629.00	7,330,500	貸付株式数 1,200株
メディアドゥHDGS	2,800	1,691.00	4,734,800	貸付株式数 600株
特種東海製紙	3,400	4,085.00	13,889,000	
ティーガイア	5,600	2,872.00	16,083,200	
豆蔵ホールディングス	7,100	1,153.00	8,186,300	
ガンホー・オンライン・エンター	151,800	356.00	54,040,800	貸付株式数 41,400株
GMOペイメントゲートウェイ	4,000	9,910.00	39,640,000	貸付株式数 1,300株
インターネットイニシアティブ	9,600	2,224.00	21,350,400	
さくらインターネット	9,100	731.00	6,652,100	貸付株式数 2,400株
S R Aホールディングス	3,400	2,972.00	10,104,800	
システムインテグレータ	7,500	980.00	7,350,000	
朝日ネット	17,200	500.00	8,600,000	
コムチュア	4,100	3,445.00	14,124,500	貸付株式数 900株
王子ホールディングス	243,000	674.00	163,782,000	貸付株式数 67,000株
日本製紙	24,400	1,980.00	48,312,000	貸付株式数 6,600株
三菱製紙	13,700	642.00	8,795,400	
北越紀州製紙	31,300	668.00	20,908,400	
中越パルプ	4,000	1,816.00	7,264,000	
大王製紙	23,000	1,470.00	33,810,000	貸付株式数 6,400株
g u m i	7,300	1,043.00	7,613,900	貸付株式数 2,000株
アカツキ	1,200	4,925.00	5,910,000	貸付株式数 300株
L I N E	17,200	4,010.00	68,972,000	
レンゴー	55,700	918.00	51,132,600	貸付株式数 15,400株
トーモク	4,200	2,083.00	8,748,600	
ザ・パック	4,400	3,805.00	16,742,000	
A O I T Y O H O L D I N G S	6,400	1,393.00	8,915,200	

マクロミル	7,400	3,190.00	23,606,000	貸付株式数	2,000株
昭和電工	39,400	4,230.00	166,662,000		
住友化学	431,000	589.00	253,859,000		
住友精化	2,400	4,900.00	11,760,000	貸付株式数	600株
日産化学	34,000	4,170.00	141,780,000		
ラサ工業	4,000	2,040.00	8,160,000	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,000	6,740.00	33,700,000		
テイカ	5,100	2,712.00	13,831,200		
石原産業	11,800	1,280.00	15,104,000	貸付株式数	3,200株
日本曹達	40,000	587.00	23,480,000		
東ソー	84,800	2,043.00	173,246,400		
トクヤマ	17,200	3,120.00	53,664,000	貸付株式数	4,700株
セントラル硝子	11,600	2,347.00	27,225,200	貸付株式数	3,200株
東亜合成	33,600	1,217.00	40,891,200		
大阪ソーダ	5,900	2,700.00	15,930,000	貸付株式数	1,600株
関東電化	14,700	1,075.00	15,802,500	貸付株式数	200株
デンカ	21,300	3,530.00	75,189,000		
イビデン	34,000	1,584.00	53,856,000		
信越化学	98,300	10,710.00	1,052,793,000	貸付株式数	27,300株
日本カ-パイド	3,100	2,013.00	6,240,300		
堺化学	4,300	2,684.00	11,541,200		
エア・ウォーター	47,600	1,953.00	92,962,800		
大陽日酸	45,200	1,532.00	69,246,400	貸付株式数	12,500株
日本化学工業	3,400	3,235.00	10,999,000		
日本パ-カラジニング	29,600	1,736.00	51,385,600		
高压ガス	11,100	850.00	9,435,000		
四国化成	9,200	1,465.00	13,478,000		
戸田工業	1,900	3,785.00	7,191,500		
ステラ ケミファ	3,500	3,210.00	11,235,000	貸付株式数	900株
保土谷化学	2,100	4,555.00	9,565,500		
日本触媒	9,000	7,100.00	63,900,000	貸付株式数	2,500株
大日精化	4,500	4,190.00	18,855,000		
カネカ	79,000	992.00	78,368,000	貸付株式数	21,000株
協和発酵キリン	70,400	2,171.00	152,838,400	貸付株式数	19,600株
三菱瓦斯化学	49,500	2,468.00	122,166,000		
三井化学	53,000	3,265.00	173,045,000	貸付株式数	14,700株
J S R	59,200	2,322.00	137,462,400	貸付株式数	16,400株
東京応化工業	10,300	3,655.00	37,646,500	貸付株式数	2,800株
大阪有機化学	5,300	1,351.00	7,160,300		
三菱ケミカルH L D G S	392,900	982.70	386,102,830	貸付株式数	109,300株

KHネオケム	9,300	2,893.00	26,904,900	
ダイセル	78,100	1,135.00	88,643,500	貸付株式数 21,600株
住友ベークライト	47,000	897.00	42,159,000	
積水化学	121,600	1,844.00	224,230,400	貸付株式数 33,700株
日本ゼオン	49,200	1,487.00	73,160,400	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
アイカ工業	15,900	3,800.00	60,420,000	
宇部興産	29,600	3,050.00	90,280,000	
積水樹脂	9,300	2,231.00	20,748,300	
タキロンシーアイ	14,300	685.00	9,795,500	
旭有機材	5,600	1,720.00	9,632,000	
日立化成	28,400	2,349.00	66,711,600	貸付株式数 7,800株
ニチバン	3,400	3,235.00	10,999,000	
リケンテクノス	15,400	495.00	7,623,000	
大倉工業	16,000	546.00	8,736,000	
積水化成成品	9,200	1,134.00	10,432,800	貸付株式数 2,500株
群栄化学	2,200	3,430.00	7,546,000	
ダイキョーニシカワ	11,800	1,648.00	19,446,400	
竹本容器	3,500	2,405.00	8,417,500	
日本化薬	36,900	1,285.00	47,416,500	
カーリットホールディングス	15,200	1,055.00	16,036,000	貸付株式数 4,000株
E P Sホールディングス	8,800	2,070.00	18,216,000	
プレステージ・インター	12,300	1,214.00	14,932,200	貸付株式数 2,500株
アミューズ	3,900	2,973.00	11,594,700	貸付株式数 1,000株
野村総合研究所	36,500	4,745.00	173,192,500	
ドリームインキュベータ	2,600	2,676.00	6,957,600	貸付株式数 200株
クイック	4,300	1,812.00	7,791,600	
T A C	23,500	325.00	7,637,500	
ケネディクス	74,300	658.00	48,889,400	
電通	65,800	4,410.00	290,178,000	貸付株式数 18,000株
インテージホールディングス	8,500	1,149.00	9,766,500	貸付株式数 2,300株
ぴあ	2,100	5,080.00	10,668,000	貸付株式数 500株
イオンファンタジー	2,000	5,120.00	10,240,000	貸付株式数 500株
ネクシィーズグループ	2,800	1,533.00	4,292,400	
日本精化	9,200	1,183.00	10,883,600	
扶桑化学工業	4,500	2,660.00	11,970,000	貸付株式数 1,200株
A D E K A	24,500	1,802.00	44,149,000	
日油	22,600	3,025.00	68,365,000	
ハリマ化成グループ	6,700	802.00	5,373,400	
花王	138,700	7,458.00	1,034,424,600	貸付株式数 38,500株

第一工業製薬	14,000	736.00	10,304,000	
三洋化成	3,600	4,845.00	17,442,000	貸付株式数 300株
武田薬品	206,900	5,550.00	1,148,295,000	
アステラス製薬	577,100	1,590.00	917,589,000	
大日本住友製薬	41,100	1,682.00	69,130,200	貸付株式数 11,700株
塩野義製薬	79,700	5,357.00	426,952,900	
田辺三菱製薬	67,300	2,196.00	147,790,800	
あすか製薬	6,700	1,675.00	11,222,500	
日本新薬	14,800	7,190.00	106,412,000	
中外製薬	58,700	5,310.00	311,697,000	貸付株式数 16,200株
科研製薬	10,000	6,070.00	60,700,000	
エーザイ	67,600	6,686.00	451,973,600	貸付株式数 18,800株
理研ビタミン	2,300	4,085.00	9,395,500	
ロート製薬	30,700	2,796.00	85,837,200	
小野薬品	141,700	3,181.00	450,747,700	貸付株式数 37,000株
久光製薬	16,600	7,720.00	128,152,000	
持田製薬	3,800	7,110.00	27,018,000	貸付株式数 1,000株
参天製薬	106,300	1,660.00	176,458,000	
扶桑薬品	3,700	2,792.00	10,330,400	
日本ケミファ	1,700	4,660.00	7,922,000	
ツムラ	19,900	3,575.00	71,142,500	貸付株式数 5,500株
日医工	14,300	1,584.00	22,651,200	貸付株式数 3,900株
テルモ	86,500	5,300.00	458,450,000	
みらかホールディングス	15,500	4,150.00	64,325,000	
キッセイ薬品工業	10,100	2,715.00	27,421,500	
生化学工業	11,800	1,905.00	22,479,000	
栄研化学	4,600	5,120.00	23,552,000	
鳥居薬品	3,700	2,700.00	9,990,000	
JCRファーマ	4,100	5,040.00	20,664,000	
東和薬品	2,700	6,600.00	17,820,000	貸付株式数 500株
富士製薬工業	2,200	4,410.00	9,702,000	
沢井製薬	11,200	4,635.00	51,912,000	貸付株式数 3,100株
ゼリア新薬工業	12,200	2,019.00	24,631,800	貸付株式数 1,100株
第一三共	161,300	3,521.00	567,937,300	
キョーリン製薬HD	14,700	1,993.00	29,297,100	貸付株式数 4,100株
大幸薬品	4,200	2,017.00	8,471,400	
ダイト	3,900	3,600.00	14,040,000	
大塚ホールディングス	117,200	5,128.00	601,001,600	
大正製薬HD	12,400	10,270.00	127,348,000	貸付株式数 700株
ペプチドリーム	25,900	5,250.00	135,975,000	貸付株式数 7,200株

大日本塗料	8,100	1,481.00	11,996,100	
日本ペイントHOLD	45,700	3,735.00	170,689,500	貸付株式数 12,600株
関西ペイント	62,000	2,458.00	152,396,000	貸付株式数 17,200株
中国塗料	17,500	1,051.00	18,392,500	貸付株式数 4,800株
日本特殊塗料	4,600	1,960.00	9,016,000	貸付株式数 1,200株
藤倉化成	12,400	650.00	8,060,000	
太陽ホールディングス	4,400	4,460.00	19,624,000	
DIC	22,800	3,460.00	78,888,000	貸付株式数 6,300株
サカティンクス	13,700	1,476.00	20,221,200	
東洋インキSCホールディング	53,000	629.00	33,337,000	
T&K TOKA	5,700	1,269.00	7,233,300	
アルプス技研	5,600	2,356.00	13,193,600	
オリエンタルランド	63,800	10,330.00	659,054,000	
ダスキン	14,200	2,592.00	36,806,400	
パーク24	30,800	2,842.00	87,533,600	貸付株式数 8,400株
明光ネットワークジャパン	7,800	1,254.00	9,781,200	貸付株式数 400株
ファルコホールディングス	7,100	1,793.00	12,730,300	貸付株式数 400株
クレスコ	1,800	3,400.00	6,120,000	
フジ・メディア・HD	57,800	1,805.00	104,329,000	
ラウンドワン	17,400	1,658.00	28,849,200	
リゾートトラスト	22,600	2,220.00	50,172,000	貸付株式数 6,200株
オービック	17,600	8,700.00	153,120,000	貸付株式数 4,400株
ジャストシステム	9,600	2,363.00	22,684,800	
ヤフー	402,800	505.00	203,414,000	貸付株式数 112,000株 (1,300株)
ビー・エム・エル	7,400	2,597.00	19,217,800	
トレンドマイクロ	27,100	5,920.00	160,432,000	貸付株式数 7,400株
りらいあコミュニケーション	9,600	1,236.00	11,865,600	貸付株式数 2,600株
リソー教育	10,500	739.00	7,759,500	
日本オラクル	9,200	8,640.00	79,488,000	貸付株式数 2,500株
フューチャー	9,700	1,315.00	12,755,500	
CAC HOLDINGS	7,600	1,041.00	7,911,600	貸付株式数 800株
ユー・エス・エス	65,600	2,090.00	137,104,000	
オービックビジネスC	3,000	6,760.00	20,280,000	
伊藤忠テクノソリューション	12,800	4,270.00	54,656,000	
アイティフォー	14,000	894.00	12,516,000	
サイバーエージェント	35,600	5,320.00	189,392,000	
楽天	277,600	880.30	244,371,280	
テー・オー・ダブリュー	10,200	873.00	8,904,600	
大塚商会	16,800	10,370.00	174,216,000	

総合メディカル	2,600	5,730.00	14,898,000	
サイボウズ	15,400	548.00	8,439,200	
セントラルスポーツ	2,400	3,655.00	8,772,000	貸付株式数 600株
パラカ	3,000	2,239.00	6,717,000	貸付株式数 800株
電通国際情報S	4,100	2,759.00	11,311,900	
デジタルガレージ	10,400	3,405.00	35,412,000	貸付株式数 2,800株
イーエムシステムズ	6,400	1,325.00	8,480,000	
ウェザーニューズ	2,600	3,260.00	8,476,000	貸付株式数 700株 (700株)
C I J	13,800	678.00	9,356,400	
WOWOW	3,000	3,335.00	10,005,000	貸付株式数 800株
フルキャストホールディングス	5,400	2,432.00	13,132,800	
富士フィルムHLDGS	117,200	4,122.00	483,098,400	
コニカミノルタ	130,300	907.00	118,182,100	
資生堂	105,300	6,322.00	665,706,600	
ライオン	78,800	2,079.00	163,825,200	
高砂香料	3,500	3,080.00	10,780,000	
マンダム	10,600	3,515.00	37,259,000	
ミルボン	7,700	4,455.00	34,303,500	貸付株式数 1,700株
ファンケル	13,800	3,565.00	49,197,000	
コーセー	9,600	20,090.00	192,864,000	
シーズ・ホールディングス	7,900	4,995.00	39,460,500	貸付株式数 2,100株
ポーラ・オルビスHD	24,200	4,270.00	103,334,000	
ノエビアホールディングス	3,800	7,310.00	27,778,000	
エステー	4,700	2,149.00	10,100,300	貸付株式数 1,300株
コニシ	9,800	1,663.00	16,297,400	
長谷川香料	7,800	1,972.00	15,381,600	
小林製薬	15,600	7,030.00	109,668,000	
荒川化学工業	6,000	1,818.00	10,908,000	貸付株式数 1,600株
メック	4,900	1,706.00	8,359,400	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	4,100	2,543.00	10,426,300	
タカラバイオ	14,700	2,035.00	29,914,500	
JCU	3,600	4,680.00	16,848,000	
新田ゼラチン	10,300	780.00	8,034,000	
デクセリアルズ	14,600	1,060.00	15,476,000	
アース製薬	4,300	5,420.00	23,306,000	貸付株式数 200株
北興化学	10,100	686.00	6,928,600	貸付株式数 2,800株
クミアイ化学	26,600	592.00	15,747,200	貸付株式数 4,000株 (3,700株)

日本農薬	15,000	598.00	8,970,000	貸付株式数 4,200株 (4,100株)
昭和シエル石油	52,400	1,376.00	72,102,400	
ニチレキ	7,900	1,194.00	9,432,600	
ユシロ化学	5,300	1,718.00	9,105,400	
ビーピー・カストロール	3,200	1,564.00	5,004,800	
富士石油	16,300	403.00	6,568,900	貸付株式数 4,400株
MORESCO	4,300	1,699.00	7,305,700	
出光興産	47,100	3,870.00	182,277,000	
JXTGホールディングス	894,800	628.60	562,471,280	
コスモエネルギーHLDGS	16,400	3,355.00	55,022,000	
横浜ゴム	32,100	2,355.00	75,595,500	
東洋ゴム	33,500	1,736.00	58,156,000	
ブリヂストン	186,700	4,490.00	838,283,000	貸付株式数 51,800株
住友ゴム	57,500	1,875.00	107,812,500	貸付株式数 15,900株
藤倉ゴム	8,600	720.00	6,192,000	
オカモト	20,000	1,042.00	20,840,000	
アキレス	5,300	2,124.00	11,257,200	
ニッタ	5,700	3,780.00	21,546,000	
住友理工	10,200	1,018.00	10,383,600	
三ツ星ベルト	14,000	1,125.00	15,750,000	
バンドー化学	11,100	1,166.00	12,942,600	
旭硝子	56,900	4,135.00	235,281,500	
日本板硝子	27,600	802.00	22,135,200	貸付株式数 6,300株
有沢製作所	11,200	917.00	10,270,400	
日本山村硝子	52,000	186.00	9,672,000	
日本電気硝子	24,200	3,000.00	72,600,000	
住友大阪セメント	108,000	452.00	48,816,000	貸付株式数 30,000株
太平洋セメント	35,500	3,690.00	130,995,000	
日本ヒユ-ム	11,800	763.00	9,003,400	
日本コンクリ-ト	16,700	423.00	7,064,100	
アジアパイルHD	10,700	605.00	6,473,500	
東海カーボン	52,100	1,509.00	78,618,900	
日本カーボン	3,100	5,070.00	15,717,000	貸付株式数 800株
東洋炭素	4,000	3,180.00	12,720,000	
ノリタケ	3,400	4,610.00	15,674,000	
TOTO	43,500	5,300.00	230,550,000	
日本碍子	67,100	1,797.00	120,578,700	貸付株式数 18,700株
日本特殊陶業	47,300	2,450.00	115,885,000	貸付株式数 13,100株
MARUWA	2,100	8,170.00	17,157,000	

品川リフラクトリーズ	2,100	2,773.00	5,823,300	
黒崎播磨	1,300	5,110.00	6,643,000	
ニッカトー	11,700	959.00	11,220,300	
フジインコーポレーテッド	5,400	2,240.00	12,096,000	
ニチアス	31,000	1,278.00	39,618,000	
新日鐵住金	248,500	2,269.00	563,846,500	
神戸製鋼所	102,200	1,005.00	102,711,000	
中山製鋼所	9,100	694.00	6,315,400	
合同製鐵	3,700	2,044.00	7,562,800	貸付株式数 1,000株
J F E ホールディングス	149,700	2,108.00	315,567,600	
日新製鋼	16,100	1,243.00	20,012,300	
東京製鐵	30,700	820.00	25,174,000	貸付株式数 8,400株
共英製鋼	6,400	1,802.00	11,532,800	貸付株式数 1,800株
大和工業	11,600	2,816.00	32,665,600	貸付株式数 3,100株
東京鐵鋼	4,300	1,530.00	6,579,000	
大阪製鐵	4,200	2,077.00	8,723,400	
淀川製鋼所	8,000	2,751.00	22,008,000	
東洋鋼鈹	14,900	713.00	10,623,700	
丸一鋼管	19,300	3,140.00	60,602,000	貸付株式数 3,200株
大同特殊鋼	9,600	5,310.00	50,976,000	
日本高周波	7,300	758.00	5,533,400	
日本冶金工	49,900	286.00	14,271,400	
山陽特殊製鋼	6,700	2,639.00	17,681,300	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
愛知製鋼	2,800	4,285.00	11,998,000	
日立金属	59,200	1,222.00	72,342,400	
日本金属	2,200	2,299.00	5,057,800	
大平洋金属	3,800	2,913.00	11,069,400	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
新日本電工	35,900	318.00	11,416,200	貸付株式数 9,800株
栗本鉄工所	3,800	1,969.00	7,482,200	
日本製鋼所	18,500	3,275.00	60,587,500	
三菱製鋼	3,800	2,350.00	8,930,000	貸付株式数 100株
日本精線	1,400	4,810.00	6,734,000	
大紀アルミニウム	11,100	721.00	8,003,100	
日本軽金属HD	158,600	269.00	42,663,400	貸付株式数 43,700株
三井金属	15,100	4,555.00	68,780,500	
東邦亜鉛	3,200	4,830.00	15,456,000	
三菱マテリアル	36,400	3,145.00	114,478,000	
住友鉱山	71,400	4,357.00	311,089,800	

DOWAホールディングス	13,800	3,725.00	51,405,000	貸付株式数	3,800株
古河機金	9,000	1,959.00	17,631,000		
大阪チタニウム	6,500	2,021.00	13,136,500	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
東邦チタニウム	11,200	1,105.00	12,376,000	貸付株式数	2,900株
UACJ	8,300	2,659.00	22,069,700	貸付株式数	2,300株
古河電工	18,600	5,560.00	103,416,000		
住友電工	206,200	1,582.50	326,311,500	貸付株式数	57,000株
フジクラ	66,700	702.00	46,823,400	貸付株式数	18,500株
昭和電線HLDGS	8,900	913.00	8,125,700		
タツタ電線	12,300	641.00	7,884,300		
リョービ	6,900	2,668.00	18,409,200	貸付株式数	1,800株
アーレステイ	8,600	910.00	7,826,000		
アサヒHD	10,100	1,928.00	19,472,800		
東洋製罐グループHD	36,600	1,536.00	56,217,600		
ホッカンホールディングス	19,000	372.00	7,068,000		
横河ブリッジHLDGS	10,800	2,205.00	23,814,000		
OSJBHD	32,400	279.00	9,039,600		
駒井ハルテック	3,100	2,488.00	7,712,800		
三和ホールディングス	52,500	1,323.00	69,457,500		
文化シヤツタ-	17,600	1,011.00	17,793,600		
三協立山	8,200	1,480.00	12,136,000		
アルインコ	8,000	1,068.00	8,544,000	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
LIXILグループ	81,600	2,329.00	190,046,400		
日本ファイルコン	11,700	637.00	7,452,900		
ノーリツ	12,600	1,818.00	22,906,800		
長府製作所	6,600	2,486.00	16,407,600		
リンナイ	9,800	9,860.00	96,628,000	貸付株式数	1,300株
ユニプレス	10,800	2,323.00	25,088,400		
岡部	12,300	926.00	11,389,800		
ジーテクト	6,800	2,049.00	13,933,200		
東プレ	10,200	2,987.00	30,467,400		
高周波熱錬	11,200	1,075.00	12,040,000		
東京製綱	5,000	2,160.00	10,800,000	貸付株式数	1,300株
パイオラックス	8,400	2,703.00	22,705,200		
エイチワン	4,900	1,390.00	6,811,000		
日本発条	53,000	1,092.00	57,876,000	貸付株式数	14,800株
三浦工業	24,200	3,190.00	77,198,000		
タクマ	19,500	1,140.00	22,230,000		

テクノプロ・ホールディング	9,800	6,220.00	60,956,000	
イー・ガーディアン	3,300	3,915.00	12,919,500	
ジャパンマテリアル	16,000	1,305.00	20,880,000	貸付株式数 4,200株 (1,800株)
ベクトル	7,100	2,234.00	15,861,400	貸付株式数 1,900株
アサンテ	4,300	2,006.00	8,625,800	
N・フィールド	3,800	1,855.00	7,049,000	貸付株式数 1,200株
M&Aキャピタルパートナー	1,300	8,180.00	10,634,000	
エスクローAJ	11,100	428.00	4,750,800	
日本ビューホテル	5,600	1,479.00	8,282,400	貸付株式数 100株
リクルートホールディングス	416,100	2,543.50	1,058,350,350	
ツガミ	15,000	1,309.00	19,635,000	
オークマ	6,200	5,950.00	36,890,000	
東芝機械	31,000	718.00	22,258,000	
アマダホールディングス	83,500	1,253.00	104,625,500	
アイダエンジニア	13,600	1,269.00	17,258,400	
滝澤鉄工所	4,700	1,922.00	9,033,400	
富士機械製造	16,400	1,992.00	32,668,800	貸付株式数 2,100株
牧野フライス	27,000	971.00	26,217,000	
オーエスジー	25,100	2,334.00	58,583,400	貸付株式数 7,600株 (7,600株)
旭ダイヤモンド	17,200	1,084.00	18,644,800	
DMG森精機	29,900	1,889.00	56,481,100	
ソディック	12,700	1,349.00	17,132,300	貸付株式数 3,400株 (3,300株)
ディスコ	7,700	22,620.00	174,174,000	貸付株式数 2,000株
日東工器	4,000	2,990.00	11,960,000	
パンチ工業	6,400	1,113.00	7,123,200	
日本郵政	304,100	1,296.00	394,113,600	
ベルシステム24HLDGS	9,700	1,447.00	14,035,900	
ソラスト	3,800	2,682.00	10,191,600	
豊田自動織機	45,200	6,100.00	275,720,000	貸付株式数 12,500株
豊和工業	4,200	1,216.00	5,107,200	貸付株式数 900株 (900株)
OKK	5,300	1,074.00	5,692,200	
石川製作所	2,000	2,150.00	4,300,000	貸付株式数 400株
東洋機械金属	7,500	823.00	6,172,500	
島精機製作所	7,100	7,060.00	50,126,000	貸付株式数 1,900株
ヤマシンフィルタ	9,000	1,265.00	11,385,000	貸付株式数 2,400株
日阪製作所	10,300	1,010.00	10,403,000	

やまびこ	10,800	1,358.00	14,666,400	
平田機工	1,600	9,420.00	15,072,000	貸付株式数 400株 (400株)
ナブテスコ	30,500	3,990.00	121,695,000	貸付株式数 4,900株
三井海洋開発	5,800	2,631.00	15,259,800	
レオン自動機	5,600	2,031.00	11,373,600	貸付株式数 500株
S M C	17,700	42,560.00	753,312,000	貸付株式数 4,900株
ホソカワミクロン	2,300	7,160.00	16,468,000	
ユニオンツール	3,000	3,640.00	10,920,000	
オイレス工業	7,100	2,209.00	15,683,900	貸付株式数 100株
日精エーエスビー	2,000	7,160.00	14,320,000	貸付株式数 500株 (500株)
サト - ホールディングス	7,700	3,280.00	25,256,000	
技研製作所	3,200	2,906.00	9,299,200	
日精樹脂工業	5,900	1,439.00	8,490,100	
小松製作所	271,900	3,395.00	923,100,500	
住友重機械	31,700	3,860.00	122,362,000	
日立建機	26,200	3,990.00	104,538,000	
巴工業	4,500	2,006.00	9,027,000	
井関農機	5,900	2,037.00	12,018,300	
T O W A	5,400	1,379.00	7,446,600	
丸山製作所	5,000	1,812.00	9,060,000	
北川鉄工所	3,400	2,689.00	9,142,600	
シンニッタン	9,700	871.00	8,448,700	
ローツェ	3,200	2,297.00	7,350,400	貸付株式数 800株 (200株)
クボタ	302,000	1,772.50	535,295,000	貸付株式数 800株
東洋エンジニア	10,500	995.00	10,447,500	貸付株式数 2,800株 (700株)
三菱化工機	3,400	2,156.00	7,330,400	貸付株式数 100株
月島機械	11,800	1,463.00	17,263,400	
帝国電機製作所	6,300	1,560.00	9,828,000	
新東工業	13,400	1,083.00	14,512,200	
渋谷工業	5,100	3,540.00	18,054,000	
アイチ コーポレーション	9,600	707.00	6,787,200	貸付株式数 2,600株
小森コーポレーション	13,800	1,325.00	18,285,000	
鶴見製作所	4,900	1,976.00	9,682,400	
住友精密	27,000	376.00	10,152,000	
酒井重工業	1,800	4,905.00	8,829,000	貸付株式数 300株
荏原製作所	23,000	3,595.00	82,685,000	

西島製作所	8,000	958.00	7,664,000	
北越工業	7,700	1,152.00	8,870,400	
千代田化工建	41,700	978.00	40,782,600	貸付株式数 11,000株
ダイキン工業	76,900	11,500.00	884,350,000	
オルガノ	2,800	3,145.00	8,806,000	
ト - ヨ - カネツ	2,700	3,050.00	8,235,000	
栗田工業	30,000	3,310.00	99,300,000	
椿本チエイン	31,000	832.00	25,792,000	貸付株式数 8,000株
日 機 装	19,800	1,071.00	21,205,800	
新興プランテック	13,000	975.00	12,675,000	
アネスト岩田	10,300	1,110.00	11,433,000	
ダイフク	28,800	5,990.00	172,512,000	貸付株式数 7,900株
加藤製作所	3,200	2,376.00	7,603,200	貸付株式数 800株
油研工業	3,500	2,791.00	9,768,500	
タダノ	27,000	1,535.00	41,445,000	貸付株式数 7,500株
フジテック	17,300	1,395.00	24,133,500	貸付株式数 3,600株
C K D	15,900	2,252.00	35,806,800	貸付株式数 4,300株
キトー	5,300	1,862.00	9,868,600	
平和	17,500	2,168.00	37,940,000	貸付株式数 4,700株 (4,700株)
理想科学工業	6,000	1,960.00	11,760,000	
S A N K Y O	13,400	3,815.00	51,121,000	
日本金銭機械	6,800	1,069.00	7,269,200	
マースエンジニアリング	4,100	2,437.00	9,991,700	
福島工業	3,600	4,410.00	15,876,000	貸付株式数 1,000株
ダイコク電機	4,200	1,682.00	7,064,400	
竹内製作所	9,300	2,151.00	20,004,300	
ア マ ノ	17,600	2,689.00	47,326,400	
J U K I	8,600	1,377.00	11,842,200	
サンデンホールディングス	7,800	1,465.00	11,427,000	貸付株式数 2,100株
ブラザー工業	68,700	2,389.00	164,124,300	
マックス	8,800	1,352.00	11,897,600	
モリタホールディングス	9,200	1,961.00	18,041,200	貸付株式数 300株
グローリー	16,700	3,635.00	60,704,500	
新晃工業	6,300	1,707.00	10,754,100	
大和冷機工業	10,100	1,242.00	12,544,200	
セガサミーホールディングス	55,800	1,667.00	93,018,600	
日本ピストンリング	3,800	2,245.00	8,531,000	
リ ケ ン	2,700	5,790.00	15,633,000	
T P R	6,200	2,840.00	17,608,000	貸付株式数 500株

ツバキ・ナカシマ	5,900	2,643.00	15,593,700	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,800	9,370.00	166,786,000	
大豊工業	5,100	1,520.00	7,752,000	
日本精工	115,100	1,374.00	158,147,400	貸付株式数 33,100株 (33,100株)
N T N	124,300	437.00	54,319,100	
ジェイテクト	58,000	1,511.00	87,638,000	貸付株式数 16,100株
不二越	50,000	605.00	30,250,000	
ミネベアミツミ	104,500	2,226.00	232,617,000	
日本トムソン	19,300	818.00	15,787,400	
T H K	35,000	4,365.00	152,775,000	貸付株式数 9,700株
ユーシン精機	2,900	3,355.00	9,729,500	貸付株式数 800株 (800株)
イーグル工業	7,000	1,786.00	12,502,000	貸付株式数 100株
日本ピラ - 工業	7,200	1,592.00	11,462,400	
キッツ	25,200	874.00	22,024,800	
日立	1,348,000	756.10	1,019,222,800	
三菱電機	563,700	1,661.00	936,305,700	
富士電機	169,000	701.00	118,469,000	
東洋電機製造	3,500	1,676.00	5,866,000	貸付株式数 900株
安川電機	65,500	4,660.00	305,230,000	貸付株式数 18,100株
シンフォニア テクノロジー	40,000	351.00	14,040,000	貸付株式数 10,000株
明電舎	48,000	390.00	18,720,000	
オリジン電気	4,000	1,676.00	6,704,000	
山洋電気	2,800	7,830.00	21,924,000	
デンヨー	5,500	1,896.00	10,428,000	
三桜工業	9,700	725.00	7,032,500	
マキタ	73,400	4,975.00	365,165,000	
東芝テック	40,000	621.00	24,840,000	
マブチモーター	15,500	5,080.00	78,740,000	貸付株式数 4,300株
日本電産	67,900	15,860.00	1,076,894,000	貸付株式数 18,800株
東光高岳	3,900	1,642.00	6,403,800	貸付株式数 900株
ダブル・スコープ	8,900	1,392.00	12,388,800	貸付株式数 2,400株 (100株)
ダイヘン	31,000	778.00	24,118,000	
ヤーマン	8,600	2,160.00	18,576,000	
JVCケンウッド	46,800	347.00	16,239,600	
第一精工	3,200	2,154.00	6,892,800	
日新電機	13,600	1,012.00	13,763,200	

大崎電気	13,500	748.00	10,098,000	
オムロン	59,800	6,130.00	366,574,000	貸付株式数 100株 (100株)
日東工業	9,900	1,587.00	15,711,300	
I D E C	7,500	2,519.00	18,892,500	
ジーエス・ユアサ コーポ	101,000	558.00	56,358,000	貸付株式数 27,000株
メルコホールディングス	3,000	3,485.00	10,455,000	貸付株式数 1,000株
日本電気	72,500	3,045.00	220,762,500	
富士通	582,000	623.50	362,877,000	
沖電気	22,200	1,384.00	30,724,800	貸付株式数 6,100株
電気興業	3,800	3,015.00	11,457,000	
サンケン電気	34,000	766.00	26,044,000	
アイホン	4,900	1,754.00	8,594,600	
ルネサスエレクトロニクス	31,500	1,066.00	33,579,000	貸付株式数 8,300株
セイコーエプソン	84,300	1,857.00	156,545,100	
ワコム	45,100	497.00	22,414,700	
アルバック	13,000	5,660.00	73,580,000	
E I Z O	5,400	4,890.00	26,406,000	貸付株式数 1,400株
ジャパンディスプレイ	118,600	196.00	23,245,600	貸付株式数 32,400株 (31,900株)
日本信号	15,900	956.00	15,200,400	貸付株式数 1,300株
京三製作所	17,000	643.00	10,931,000	
能美防災	8,000	2,195.00	17,560,000	
ホーチキ	5,100	1,864.00	9,506,400	
エレコム	5,300	2,368.00	12,550,400	
パナソニック	643,600	1,570.50	1,010,773,800	貸付株式数 100,000株
シャープ	39,700	3,230.00	128,231,000	貸付株式数 10,900株
アンリツ	41,200	1,262.00	51,994,400	貸付株式数 11,400株
富士通ゼネラル	17,700	1,870.00	33,099,000	貸付株式数 4,800株
ソニー	376,800	5,079.00	1,913,767,200	
T D K	29,300	9,280.00	271,904,000	貸付株式数 8,100株
帝国通信工業	7,100	1,283.00	9,109,300	
タムラ製作所	22,800	742.00	16,917,600	
アルプス電気	48,300	2,565.00	123,889,500	
池上通信機	40,000	159.00	6,360,000	
パイオニア	99,100	171.00	16,946,100	貸付株式数 27,100株
日本電波工業	8,100	624.00	5,054,400	貸付株式数 2,200株
日本トリム	1,500	5,270.00	7,905,000	貸付株式数 400株 (200株)
ローランド ディー . ジー .	3,500	2,339.00	8,186,500	

フオスタ - 電機	6,800	2,584.00	17,571,200	
クラリオン	32,000	306.00	9,792,000	貸付株式数 8,000株
S M K	18,000	418.00	7,524,000	
ヨコオ	4,700	1,980.00	9,306,000	貸付株式数 100株
ホシデン	14,300	1,308.00	18,704,400	
ヒロセ電機	8,900	14,890.00	132,521,000	
日本航空電子	14,000	1,504.00	21,056,000	貸付株式数 3,000株
T O A	7,200	1,326.00	9,547,200	
マクセルホールディングス	11,100	2,009.00	22,299,900	
古野電気	9,600	693.00	6,652,800	
ユニデンホールディングス	24,000	262.00	6,288,000	貸付株式数 6,000株
アルパイン	13,400	2,004.00	26,853,600	
スミダコーポレーション	6,400	1,353.00	8,659,200	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
アイコム	3,700	2,685.00	9,934,500	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
リオン	3,600	2,717.00	9,781,200	
本多通信工業	6,200	984.00	6,100,800	
船井電機	7,600	765.00	5,814,000	貸付株式数 2,000株 (1,800株)
横河電機	55,900	2,041.00	114,091,900	貸付株式数 15,400株
新電元工業	2,100	6,880.00	14,448,000	貸付株式数 500株
アズビル	16,600	4,850.00	80,510,000	
日本光電工業	24,100	2,884.00	69,504,400	
共和電業	19,500	406.00	7,917,000	
堀場製作所	11,200	7,810.00	87,472,000	貸付株式数 3,000株
アドバンテスト	31,900	2,235.00	71,296,500	貸付株式数 8,600株
エスペック	5,400	2,402.00	12,970,800	
キーエンス	27,700	63,520.00	1,759,504,000	貸付株式数 2,700株
日置電機	3,600	3,225.00	11,610,000	
シスメックス	43,800	9,060.00	396,828,000	
日本マイクロニクス	11,900	997.00	11,864,300	貸付株式数 3,100株
メガチップス	4,900	3,540.00	17,346,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
O B A R A G R O U P	3,300	6,180.00	20,394,000	貸付株式数 900株
デンソー	125,000	5,695.00	711,875,000	貸付株式数 34,600株
コーセル	8,600	1,414.00	12,160,400	
イリソ電子工業	4,800	6,090.00	29,232,000	貸付株式数 600株
オプテックスグループ	4,800	5,050.00	24,240,000	
千代田インテグレ	3,000	2,343.00	7,029,000	

レーザーテック	12,400	3,735.00	46,314,000	貸付株式数	3,200株
スタンレー電気	42,800	3,865.00	165,422,000		
岩崎電気	3,800	1,675.00	6,365,000		
ウシオ電機	32,900	1,426.00	46,915,400	貸付株式数	9,100株
ヘリオステクノH	8,700	914.00	7,951,800	貸付株式数	1,900株
日本セラミック	5,800	2,721.00	15,781,800	貸付株式数	900株
古河電池	6,200	933.00	5,784,600	貸付株式数	1,400株 (1,000株)
山一電機	4,600	1,753.00	8,063,800	貸付株式数	1,600株
図 研	4,900	1,490.00	7,301,000		
日本電子	21,000	917.00	19,257,000		
カ シ オ	45,300	1,566.00	70,939,800	貸付株式数	12,400株
ファナック	53,500	26,265.00	1,405,177,500	貸付株式数	14,800株
日本シイエムケイ	11,700	813.00	9,512,100	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
エンプラス	2,800	3,415.00	9,562,000		
大真空	3,700	1,310.00	4,847,000		
ロ - ム	25,300	9,990.00	252,747,000		
浜松ホトニクス	40,800	3,995.00	162,996,000		
三井ハイテック	8,200	1,492.00	12,234,400	貸付株式数	2,100株 (100株)
新光電気工業	22,000	768.00	16,896,000		
京 セ ラ	92,200	5,782.00	533,100,400		
太陽誘電	24,600	1,720.00	42,312,000	貸付株式数	6,800株
村田製作所	59,100	13,995.00	827,104,500		
ユーシン	13,800	741.00	10,225,800	貸付株式数	3,900株 (3,500株)
双葉電子工業	8,800	2,216.00	19,500,800		
日東電工	42,400	7,763.00	329,151,200	貸付株式数	11,700株
北陸電気工業	4,800	1,453.00	6,974,400		
東海理化電機	14,000	2,120.00	29,680,000		
ニチコン	17,100	1,171.00	20,024,100		
日本ケミコン	4,700	2,415.00	11,350,500		
K O A	8,100	2,107.00	17,066,700	貸付株式数	2,200株
三井造船	19,600	1,701.00	33,339,600		
日立造船	42,500	531.00	22,567,500		
三菱重工業	93,900	3,965.00	372,313,500		
川崎重工業	43,300	3,290.00	142,457,000	貸付株式数	8,000株
I H I	43,000	3,205.00	137,815,000		
名村造船所	18,200	569.00	10,355,800	貸付株式数	5,000株

日本車輛	25,000	294.00	7,350,000	
三菱ロジスネクスト	7,200	866.00	6,235,200	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
F P G	20,400	1,306.00	26,642,400	貸付株式数 5,400株
じもとホールディングス	55,200	187.00	10,322,400	
全国保証	15,800	4,560.00	72,048,000	
めぶきフィナンシャルG	285,200	404.00	115,220,800	貸付株式数 79,200株
東京T YフィナンシャルG	7,400	2,443.00	18,078,200	貸付株式数 2,000株
九州フィナンシャルG	88,800	522.00	46,353,600	貸付株式数 24,600株
かんぼ生命保険	21,200	2,506.00	53,127,200	
ゆうちょ銀行	157,500	1,435.00	226,012,500	
富山第一銀行	19,100	491.00	9,378,100	
コンコルディア・フィナンシャル	333,900	572.00	190,990,800	
西日本フィナンシャルH D	36,000	1,233.00	44,388,000	
日産自動車	663,100	1,105.00	732,725,500	
いすゞ自動車	163,500	1,569.00	256,531,500	貸付株式数 45,100株
トヨタ自動車	684,600	6,642.00	4,547,113,200	
日野自動車	80,700	1,343.00	108,380,100	貸付株式数 22,100株
三菱自動車工業	209,000	755.00	157,795,000	貸付株式数 57,900株
エフテック	5,200	1,285.00	6,682,000	
武蔵精密工業	6,300	3,510.00	22,113,000	貸付株式数 1,700株
日産車体	22,100	1,069.00	23,624,900	
新明和工業	24,000	847.00	20,328,000	貸付株式数 6,600株
極東開発工業	10,300	1,530.00	15,759,000	
日信工業	11,600	1,757.00	20,381,200	貸付株式数 3,100株
トピー工業	4,800	3,040.00	14,592,000	
ティラド	2,400	3,920.00	9,408,000	
曙ブレーキ	29,900	257.00	7,684,300	
タチエス	9,600	1,815.00	17,424,000	
N O K	29,400	2,027.00	59,593,800	貸付株式数 5,400株
フタバ産業	17,800	849.00	15,112,200	貸付株式数 1,300株
K Y B	5,900	4,820.00	28,438,000	
市光工業	9,400	1,069.00	10,048,600	貸付株式数 2,400株
大同メタル工業	8,000	1,191.00	9,528,000	貸付株式数 100株
プレス工業	30,000	617.00	18,510,000	
太平洋工業	13,000	1,325.00	17,225,000	
ケーヒン	12,800	2,034.00	26,035,200	
河西工業	8,100	1,319.00	10,683,900	貸付株式数 2,100株
アイシン精機	46,400	5,580.00	258,912,000	

マ ッ ダ	176,100	1,386.00	244,074,600	貸付株式数 48,600株 (48,200株)
今仙電機製作所	7,400	1,172.00	8,672,800	
本田技研	506,700	3,487.00	1,766,862,900	
スズキ	111,900	5,567.00	622,947,300	貸付株式数 31,000株
S U B A R U	175,300	3,482.00	610,394,600	
安永	3,100	2,159.00	6,692,900	貸付株式数 800株
ヤマハ発動機	79,300	2,990.00	237,107,000	貸付株式数 22,000株
ショーワ	15,100	1,737.00	26,228,700	
小糸製作所	34,000	6,980.00	237,320,000	貸付株式数 9,400株
T B K	22,400	510.00	11,424,000	
エクセディ	6,600	3,235.00	21,351,000	
ミツバ	10,900	1,315.00	14,333,500	貸付株式数 2,900株
豊田合成	19,600	2,344.00	45,942,400	貸付株式数 5,400株
愛三工業	10,500	1,102.00	11,571,000	
ヨ ロ ズ	6,600	1,705.00	11,253,000	貸付株式数 1,700株
エフ・シー・シー	9,300	2,800.00	26,040,000	
シマノ	22,800	14,760.00	336,528,000	貸付株式数 6,300株
テイ・エス テック	13,100	4,020.00	52,662,000	
ジャムコ	3,000	2,100.00	6,300,000	貸付株式数 900株 (900株)
小 野 建	5,400	1,841.00	9,941,400	貸付株式数 1,500株 (1,400株)
ノ ジ マ	10,100	2,450.00	24,745,000	
佐鳥電機	8,700	1,065.00	9,265,500	
伯東	4,100	1,519.00	6,227,900	
コンドーテック	8,200	937.00	7,683,400	
ライトオン	6,900	912.00	6,292,800	貸付株式数 1,800株 (1,500株)
ナガイレーベン	7,600	2,879.00	21,880,400	
三菱食品	6,000	2,937.00	17,622,000	貸付株式数 1,400株
良品計画	7,400	35,850.00	265,290,000	
松田産業	5,800	1,838.00	10,660,400	
第一興商	8,100	5,490.00	44,469,000	
メディパルHD	54,400	2,089.00	113,641,600	
アドヴァン	6,600	988.00	6,520,800	貸付株式数 600株 (600株)
萩原電気	2,800	3,120.00	8,736,000	
アルピス	1,900	3,195.00	6,070,500	貸付株式数 400株 (100株)

アズワン	4,300	6,680.00	28,724,000	
ドウシシャ	6,300	2,329.00	14,672,700	
小津産業	4,900	2,225.00	10,902,500	
コジマ	16,900	326.00	5,509,400	
コーナン商事	7,900	2,453.00	19,378,700	
ネットワンシステムズ	23,000	1,539.00	35,397,000	
ワタミ	8,500	1,393.00	11,840,500	貸付株式数 2,200株
ドンキホーテホールディング	36,100	5,800.00	209,380,000	
丸文	7,300	955.00	6,971,500	
西松屋チェーン	12,500	1,158.00	14,475,000	貸付株式数 3,400株
ゼンショーホールディングス	29,100	2,419.00	70,392,900	貸付株式数 8,000株
ハピネット	4,300	1,530.00	6,579,000	
幸楽苑ホールディングス	7,300	1,934.00	14,118,200	貸付株式数 1,900株 (1,600株)
日本ライフライン	16,100	2,979.00	47,961,900	貸付株式数 4,400株
サイゼリヤ	8,500	2,981.00	25,338,500	
エクセル	3,200	2,696.00	8,627,200	貸付株式数 800株
V Tホールディングス	19,800	545.00	10,791,000	
マルカキカイ	3,400	1,867.00	6,347,800	
アルゴグラフィックス	3,200	3,180.00	10,176,000	
I D O M	17,900	690.00	12,351,000	貸付株式数 100株 (100株)
ポプラ	11,600	868.00	10,068,800	貸付株式数 3,200株
ユナイテッドアローズ	6,900	3,965.00	27,358,500	
進和	4,700	2,082.00	9,785,400	貸付株式数 1,300株
ダイトロン	4,100	1,956.00	8,019,600	
ハイデイ日高	7,500	2,599.00	19,492,500	
シークス	3,400	4,500.00	15,300,000	貸付株式数 900株 (900株)
コロワイド	18,700	2,456.00	45,927,200	貸付株式数 5,100株
ピーシーデポコーポ	9,300	693.00	6,444,900	貸付株式数 2,400株 (500株)
壱番屋	3,900	4,140.00	16,146,000	
スギホールディングス	12,000	5,780.00	69,360,000	
島津製作所	67,100	2,793.00	187,410,300	
長野計器	7,500	1,161.00	8,707,500	
ブイ・テクノロジー	1,300	30,300.00	39,390,000	貸付株式数 300株 (300株)
スター精密	9,200	1,932.00	17,774,400	貸付株式数 2,700株

東京計器	5,300	1,110.00	5,883,000	貸付株式数 1,400株 (1,300株)
東京精密	10,200	4,165.00	42,483,000	
マニー	6,900	3,920.00	27,048,000	
ニコン	97,900	1,884.00	184,443,600	
トプコン	30,100	1,990.00	59,899,000	
オリンパス	83,800	4,005.00	335,619,000	貸付株式数 25,300株 (25,300株)
理研計器	5,900	2,155.00	12,714,500	
S C R E E Nホールディングス	10,800	9,580.00	103,464,000	貸付株式数 2,900株
キヤノン電子	5,600	2,273.00	12,728,800	
タムロン	4,600	2,166.00	9,963,600	貸付株式数 100株
H O Y A	113,900	5,323.00	606,289,700	
ノーリツ鋼機	6,100	2,259.00	13,779,900	貸付株式数 1,600株
エー・アンド・デイ	13,400	620.00	8,308,000	
キヤノン	302,600	3,806.00	1,151,695,600	貸付株式数 83,400株
リ コ ー	170,400	1,043.00	177,727,200	
シチズン時計	65,600	729.00	47,822,400	貸付株式数 18,100株
リズム時計	4,000	2,313.00	9,252,000	
メニコン	8,400	2,584.00	21,705,600	貸付株式数 2,200株
パラマウントベッドHD	5,900	5,490.00	32,391,000	
S H O B I	13,700	404.00	5,534,800	貸付株式数 3,700株
ニホンフラッシュ	4,400	2,298.00	10,111,200	
前田工織	6,900	1,644.00	11,343,600	
アートネイチャー	9,000	718.00	6,462,000	
バンダイナムコHLDGS	58,300	3,425.00	199,677,500	
S H O E I	2,800	3,905.00	10,934,000	貸付株式数 700株
マーベラス	9,900	924.00	9,147,600	貸付株式数 2,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	9,800	5,670.00	55,566,000	
萩原工業	5,100	1,688.00	8,608,800	貸付株式数 1,200株
エイベックス	10,200	1,528.00	15,585,600	貸付株式数 2,300株
トッパン・フォームズ	12,200	1,139.00	13,895,800	
フジシールインターナショナル	12,300	3,700.00	45,510,000	貸付株式数 1,800株
タカラトミー	24,800	1,051.00	26,064,800	貸付株式数 6,700株
レック	3,600	3,540.00	12,744,000	貸付株式数 900株 (900株)
大建工業	5,100	2,449.00	12,489,900	貸付株式数 1,400株
凸版印刷	153,000	858.00	131,274,000	
大日本印刷	72,100	2,177.00	156,961,700	

共同印刷	2,500	3,135.00	7,837,500	
N I S S H A	11,800	2,638.00	31,128,400	貸付株式数 3,200株 (2,700株)
藤森工業	4,800	3,585.00	17,208,000	
ヴィア・ホールディングス	11,600	748.00	8,676,800	貸付株式数 3,200株
宝印刷	6,900	1,827.00	12,606,300	
アシックス	55,800	1,868.00	104,234,400	貸付株式数 15,400株
ジェイ エス ピー	3,500	3,180.00	11,130,000	貸付株式数 900株
ニ チ ハ	8,700	3,840.00	33,408,000	貸付株式数 2,400株
エフピコ	4,800	6,570.00	31,536,000	貸付株式数 1,400株
ヤマハ	38,100	4,495.00	171,259,500	
河合楽器	3,800	3,460.00	13,148,000	貸付株式数 700株
クリナップ	8,300	788.00	6,540,400	
ピジヨン	34,000	4,425.00	150,450,000	
天馬	4,700	2,071.00	9,733,700	貸付株式数 900株
キングジム	10,100	1,000.00	10,100,000	
リンテック	12,500	2,953.00	36,912,500	
信越ポリマー	11,800	1,089.00	12,850,200	
東 リ	22,300	369.00	8,228,700	
イトーキ	14,200	650.00	9,230,000	
任 天 堂	34,700	47,390.00	1,644,433,000	
三菱鉛筆	9,300	2,269.00	21,101,700	
タカラスタンダ - ド	11,700	1,749.00	20,463,300	
コ ク ヨ	26,800	1,937.00	51,911,600	
ナカバヤシ	13,300	609.00	8,099,700	
ニ フ コ	10,200	7,160.00	73,032,000	
立川ブラインド	5,200	1,463.00	7,607,600	
グローブライド	4,100	2,428.00	9,954,800	
岡村製作所	19,600	1,387.00	27,185,200	
日本バルカー	4,900	2,895.00	14,185,500	
伊 藤 忠	407,400	1,988.50	810,114,900	
丸 紅	453,500	750.00	340,125,000	
スクロール	18,200	406.00	7,389,200	
高 島	3,300	2,208.00	7,286,400	
ヨンドシーホールディングス	6,000	2,644.00	15,864,000	貸付株式数 1,200株
三陽商会	4,900	2,299.00	11,265,100	貸付株式数 1,200株
長瀬産業	31,800	1,758.00	55,904,400	貸付株式数 1,600株
蝶 理	4,100	1,924.00	7,888,400	
豊田通商	61,000	3,470.00	211,670,000	
オンワ - ドホールディングス	35,000	897.00	31,395,000	

兼 松	23,300	1,338.00	31,175,400	
美 津 濃	5,700	3,145.00	17,926,500	貸付株式数 400株
ツカモトコーポレーション	6,800	1,294.00	8,799,200	
ユニー・ファミリーマートHD	17,800	8,330.00	148,274,000	貸付株式数 4,800株
三井物産	470,500	1,790.00	842,195,000	
日本紙パルプ	2,900	4,305.00	12,484,500	
東京エレクトロン	37,700	19,925.00	751,172,500	貸付株式数 10,400株
日立ハイテクノロジーズ	19,200	4,845.00	93,024,000	貸付株式数 5,300株
カメイ	7,200	1,425.00	10,260,000	
スターゼン	2,500	5,260.00	13,150,000	貸付株式数 700株 (700株)
セイコーHD	8,500	2,465.00	20,952,500	貸付株式数 2,300株
山 善	20,900	1,051.00	21,965,900	
住友商事	349,200	1,731.00	604,465,200	
日本ユニシス	15,700	2,209.00	34,681,300	
内田洋行	3,500	2,766.00	9,681,000	
三菱商事	389,700	2,809.00	1,094,667,300	
第一実業	3,100	3,020.00	9,362,000	
キヤノンマーケティングJPN	15,900	2,771.00	44,058,900	
西華産業	4,000	2,529.00	10,116,000	
菱洋エレクトロ	6,500	1,696.00	11,024,000	貸付株式数 1,600株
ユアサ商事	5,100	3,420.00	17,442,000	
神鋼商事	2,000	3,595.00	7,190,000	
阪和興業	10,200	4,300.00	43,860,000	貸付株式数 2,800株
正栄食品	3,400	3,750.00	12,750,000	貸付株式数 900株
カナデン	8,400	1,451.00	12,188,400	
菱電商事	5,000	1,766.00	8,830,000	
ニプロ	38,700	1,534.00	59,365,800	
岩谷産業	12,000	3,885.00	46,620,000	
すてきナイスグループ	6,100	1,385.00	8,448,500	
極東貿易	20,000	454.00	9,080,000	
イ ワ キ	14,000	399.00	5,586,000	
兼松エレクトロニクス	3,700	2,990.00	11,063,000	
三愛石油	14,600	1,519.00	22,177,400	
稲畑産業	12,900	1,520.00	19,608,000	
ゴ・ルドウイン	1,800	11,380.00	20,484,000	貸付株式数 700株 (700株)
ユニ・チャーム	119,500	2,990.00	357,305,000	
デサント	14,000	1,608.00	22,512,000	貸付株式数 3,800株
ワ キ タ	12,300	1,194.00	14,686,200	貸付株式数 3,400株

東邦ホールディングス	15,400	2,427.00	37,375,800	貸付株式数	4,300株
サンゲツ	17,900	2,118.00	37,912,200	貸付株式数	1,200株
ミツウロコグループ	9,300	781.00	7,263,300		
シナネンホールディングス	3,200	2,612.00	8,358,400		
伊藤忠エネクス	11,600	973.00	11,286,800		
サンリオ	15,500	1,878.00	29,109,000	貸付株式数	4,600株
サンワ テクノス	4,400	1,827.00	8,038,800		
リョーサン	7,000	3,750.00	26,250,000		
新光商事	6,800	1,770.00	12,036,000		
トーホー	4,300	2,189.00	9,412,700	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
三信電気	5,400	2,048.00	11,059,200		
東陽テクニカ	10,000	945.00	9,450,000	貸付株式数	1,100株
モスフード サービス	7,400	3,150.00	23,310,000	貸付株式数	2,000株
加賀電子	5,000	2,572.00	12,860,000		
三益半導体	5,500	1,835.00	10,092,500		
木曽路	7,500	2,733.00	20,497,500	貸付株式数	2,100株
千趣会	15,200	530.00	8,056,000		
タカキュー	33,400	204.00	6,813,600	貸付株式数	8,000株
ケーヨー	14,400	531.00	7,646,400		
上新電機	6,700	3,740.00	25,058,000	貸付株式数	800株
日本瓦斯	10,600	4,545.00	48,177,000		
ロイヤルホールディングス	10,000	2,730.00	27,300,000		
いなげや	6,900	1,784.00	12,309,600		
島忠	14,000	3,315.00	46,410,000		
チヨダ	6,600	2,569.00	16,955,400		
ライフコーポレーション	4,300	2,842.00	12,220,600		
リンガーハット	7,200	2,376.00	17,107,200	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
Mr Max HD	9,700	650.00	6,305,000		
AOKIホールディングス	10,600	1,597.00	16,928,200		
オークワ	9,000	1,064.00	9,576,000		
コメリ	8,300	2,810.00	23,323,000	貸付株式数	200株
青山商事	10,400	4,185.00	43,524,000		
しまむら	6,400	13,180.00	84,352,000		
高島屋	86,000	974.00	83,764,000	貸付株式数	23,000株
松屋	12,500	1,367.00	17,087,500	貸付株式数	3,300株
エイチ・ツー・オーリテイリング	25,700	1,868.00	48,007,600	貸付株式数	7,100株
丸井グループ	53,700	1,978.00	106,218,600	貸付株式数	14,700株

クレディセゾン	41,300	1,714.00	70,788,200	貸付株式数	11,400株
アクシアル リテイリング	5,200	3,985.00	20,722,000		
イオン	212,800	1,811.50	385,487,200	貸付株式数	58,800株
イズミ	10,100	6,680.00	67,468,000		
平和堂	10,900	2,450.00	26,705,000	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
フジ	6,700	2,140.00	14,338,000		
ヤオコー	6,400	5,650.00	36,160,000		
ゼビオホールディングス	7,500	2,053.00	15,397,500		
ケーズホールディングス	23,100	2,932.00	67,729,200		
PALTA C	7,900	5,200.00	41,080,000		
新生銀行	48,700	1,589.00	77,384,300	貸付株式数	13,300株
あおぞら銀行	33,000	4,225.00	139,425,000		
三菱UFJフィナンシャルG	3,891,200	687.90	2,676,756,480		
りそなホールディングス	609,800	564.50	344,232,100		
三井住友トラストHD	109,000	4,242.00	462,378,000		
三井住友フィナンシャルG	420,300	4,442.00	1,866,972,600		
第四銀行	6,500	4,580.00	29,770,000		
北越銀行	5,900	2,286.00	13,487,400		
千葉銀行	195,000	834.00	162,630,000	貸付株式数	36,000株
群馬銀行	107,500	601.00	64,607,500	貸付株式数	10,300株
武蔵野銀行	8,400	3,295.00	27,678,000		
千葉興業銀行	21,900	449.00	9,833,100		
筑波銀行	33,700	341.00	11,491,700		
七十七銀行	16,300	2,468.00	40,228,400		
青森銀行	4,600	3,290.00	15,134,000	貸付株式数	1,200株
秋田銀行	3,700	2,774.00	10,263,800		
山形銀行	6,000	2,305.00	13,830,000	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
岩手銀行	3,600	4,120.00	14,832,000	貸付株式数	900株
東邦銀行	47,200	396.00	18,691,200	貸付株式数	4,100株
東北銀行	8,600	1,424.00	12,246,400		
ふくおかフィナンシャルG	222,000	544.00	120,768,000	貸付株式数	61,000株
静岡銀行	143,000	980.00	140,140,000		
十六銀行	6,700	2,744.00	18,384,800		
スルガ銀行	57,700	1,521.00	87,761,700		
八十二銀行	93,800	567.00	53,184,600	貸付株式数	26,100株
山梨中央銀行	34,000	420.00	14,280,000		
大垣共立銀行	8,300	2,665.00	22,119,500		
福井銀行	5,000	2,270.00	11,350,000		

北國銀行	6,100	4,015.00	24,491,500	
清水銀行	2,900	2,806.00	8,137,400	貸付株式数 100株
滋賀銀行	46,000	536.00	24,656,000	
南都銀行	6,300	2,838.00	17,879,400	
百五銀行	50,000	489.00	24,450,000	
京都銀行	20,900	5,640.00	117,876,000	
紀陽銀行	19,800	1,653.00	32,729,400	
三重銀行	3,900	2,328.00	9,079,200	
ほくほくフィナンシャルG	34,700	1,450.00	50,315,000	
広島銀行	78,300	781.00	61,152,300	
山陰合同銀行	31,200	926.00	28,891,200	
中国銀行	36,700	1,219.00	44,737,300	
伊予銀行	76,000	783.00	59,508,000	貸付株式数 9,100株
百十四銀行	58,000	351.00	20,358,000	
四国銀行	8,900	1,473.00	13,109,700	貸付株式数 700株
阿波銀行	42,000	662.00	27,804,000	貸付株式数 11,000株
大分銀行	3,300	3,920.00	12,936,000	貸付株式数 800株
宮崎銀行	3,800	3,250.00	12,350,000	
佐賀銀行	3,800	2,324.00	8,831,200	
十八銀行	38,000	260.00	9,880,000	
沖縄銀行	5,200	4,450.00	23,140,000	貸付株式数 600株
琉球銀行	10,800	1,591.00	17,182,800	貸付株式数 3,000株
セブン銀行	207,600	335.00	69,546,000	貸付株式数 51,100株
みずほフィナンシャルG	7,537,200	191.00	1,439,605,200	
高知銀行	8,600	1,279.00	10,999,400	
山口フィナンシャルG	49,000	1,278.00	62,622,000	貸付株式数 13,000株
芙蓉総合リース	6,400	6,910.00	44,224,000	
興銀リース	10,100	2,988.00	30,178,800	
東京センチュリー	11,300	6,340.00	71,642,000	
SBIホールディングス	63,700	2,570.00	163,709,000	貸付株式数 17,600株
日本証券金融	23,700	646.00	15,310,200	
アイフル	97,500	339.00	33,052,500	貸付株式数 27,400株 (300株)
名古屋銀行	4,100	3,890.00	15,949,000	貸付株式数 1,200株
北洋銀行	78,200	342.00	26,744,400	
愛知銀行	1,900	5,220.00	9,918,000	
第三銀行	5,200	1,650.00	8,580,000	
中京銀行	3,100	2,330.00	7,223,000	
大光銀行	3,700	2,254.00	8,339,800	
愛媛銀行	9,100	1,236.00	11,247,600	

トマト銀行	8,300	1,523.00	12,640,900	
みなと銀行	5,400	2,094.00	11,307,600	
京葉銀行	45,000	462.00	20,790,000	貸付株式数 12,000株 (12,000株)
関西アーバン銀行	8,600	1,440.00	12,384,000	
栃木銀行	29,000	392.00	11,368,000	
北日本銀行	3,400	2,976.00	10,118,400	
東和銀行	10,700	1,404.00	15,022,800	
福島銀行	12,400	744.00	9,225,600	
大東銀行	8,300	1,228.00	10,192,400	
リコーリース	4,300	3,565.00	15,329,500	貸付株式数 1,200株
イオンフィナンシャルサービス	39,200	2,313.00	90,669,600	
アコム	116,000	468.00	54,288,000	貸付株式数 32,900株
ジャックス	7,000	2,302.00	16,114,000	貸付株式数 1,900株
オリコ	123,900	169.00	20,939,100	貸付株式数 24,600株
日立キャピタル	15,000	2,604.00	39,060,000	
アプラスフィナンシャル	66,600	108.00	7,192,800	貸付株式数 16,300株
オリックス	370,000	1,834.00	678,580,000	
三菱UFJリース	138,100	607.00	83,826,700	貸付株式数 38,200株
ジャフコ	7,900	4,800.00	37,920,000	
トモニホールディングス	45,400	455.00	20,657,000	
大和証券G本社	464,000	672.20	311,900,800	
野村ホールディングス	985,300	603.50	594,628,550	
岡三証券グループ	45,000	648.00	29,160,000	
丸三証券	19,400	1,065.00	20,661,000	
東洋証券	32,000	291.00	9,312,000	
東海東京HD	58,700	733.00	43,027,100	
水戸証券	26,200	418.00	10,951,600	
いちよし証券	13,600	1,248.00	16,972,800	
松井証券	24,500	950.00	23,275,000	
SOMPOホールディングス	108,800	4,106.00	446,732,800	
日本取引所グループ	161,500	1,898.00	306,527,000	
マネックスG	58,800	329.00	19,345,200	
カブドットコム証券	35,600	371.00	13,207,600	
極東証券	8,200	1,560.00	12,792,000	貸付株式数 600株
岩井コスモホールディング	7,900	1,423.00	11,241,700	
藍澤証券	14,100	725.00	10,222,500	
フィデアホール	63,500	190.00	12,065,000	
池田泉州HD	51,800	403.00	20,875,400	貸付株式数 6,300株
アニコムホールディングス	4,100	3,785.00	15,518,500	貸付株式数 700株

MS & A D	144,500	3,221.00	465,434,500	
SONY F H	45,300	1,881.00	85,209,300	貸付株式数 12,500株
第一生命H L D G S	314,200	1,921.50	603,735,300	
東京海上H D	209,100	4,780.00	999,498,000	
イー・ギャランティ	4,800	1,969.00	9,451,200	
NECキャピタルソリューション	3,300	2,107.00	6,953,100	
T & Dホールディングス	170,700	1,652.00	281,996,400	
アドバンスクリエイト	4,300	1,964.00	8,445,200	
三井不動産	278,300	2,442.00	679,608,600	
三菱地所	413,700	1,720.00	711,564,000	
平和不動産	10,100	1,986.00	20,058,600	
東京建物	60,400	1,539.00	92,955,600	
ダイビル	14,600	1,220.00	17,812,000	
京阪神ビルディング	12,200	885.00	10,797,000	
住友不動産	134,000	3,791.00	507,994,000	貸付株式数 37,000株
大京	8,800	2,119.00	18,647,200	
テーオーシー	20,600	845.00	17,407,000	
レオパレス21	67,500	818.00	55,215,000	
スターツコーポレーション	7,700	2,723.00	20,967,100	
フジ住宅	11,700	878.00	10,272,600	
空港施設	11,100	606.00	6,726,600	
ゴールドクレスト	5,000	2,182.00	10,910,000	
リログループ	30,000	2,854.00	85,620,000	貸付株式数 8,200株
日本エスリード	3,400	2,194.00	7,459,600	
日神不動産	9,600	757.00	7,267,200	
日本エスコ	11,800	928.00	10,950,400	
タカラレーベン	27,700	451.00	12,492,700	
サンヨーハウジ 名古屋	8,000	1,213.00	9,704,000	
イオンモール	35,900	2,136.00	76,682,400	貸付株式数 7,600株
東祥	3,700	3,850.00	14,245,000	貸付株式数 1,000株
トーセイ	8,300	1,243.00	10,316,900	
エヌ・ティ・ティ都市開発	34,700	1,249.00	43,340,300	
サンフロンティア不動産	8,900	1,152.00	10,252,800	貸付株式数 1,600株
エフ・ジェー・ネクスト	7,600	814.00	6,186,400	
グランディハウス	19,200	457.00	8,774,400	
東武鉄道	59,700	3,155.00	188,353,500	
相鉄ホールディングス	17,500	2,786.00	48,755,000	貸付株式数 4,900株
東京急行	153,600	1,668.00	256,204,800	貸付株式数 42,600株
京浜急行	77,900	1,819.00	141,700,100	

小田急電鉄	84,100	2,105.00	177,030,500	貸付株式数	23,300株
京王電鉄	31,400	4,445.00	139,573,000	貸付株式数	8,700株
京成電鉄	39,100	3,140.00	122,774,000	貸付株式数	5,000株
富士急行	8,200	2,651.00	21,738,200	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
東日本旅客鉄道	101,600	9,633.00	978,712,800		
西日本旅客鉄道	50,900	7,242.00	368,617,800		
東海旅客鉄道	50,600	19,410.00	982,146,000		
西武ホールディングス	71,100	1,849.00	131,463,900		
鴻池運輸	8,200	1,787.00	14,653,400		
西日本鉄道	15,300	2,712.00	41,493,600	貸付株式数	4,200株
ハマキョウレックス	4,500	3,420.00	15,390,000	貸付株式数	1,200株
サカイ引越センター	3,100	5,280.00	16,368,000	貸付株式数	800株 (200株)
近鉄グループHLDGS	52,400	4,105.00	215,102,000		
阪急阪神HLDGS	71,000	3,865.00	274,415,000		
南海電鉄	25,000	2,611.00	65,275,000	貸付株式数	5,200株
京阪ホールディングス	23,600	3,225.00	76,110,000	貸付株式数	5,500株
名古屋鉄道	42,000	2,650.00	111,300,000	貸付株式数	11,600株
山陽電鉄	5,000	2,593.00	12,965,000		
トランコム	1,700	7,230.00	12,291,000		
日本通運	20,700	7,000.00	144,900,000		
ヤマトホールディングス	94,100	2,576.00	242,401,600		
山 九	13,700	5,120.00	70,144,000		
日 新	4,900	2,679.00	13,127,100		
丸全昭和運輸	22,000	500.00	11,000,000		
センコーグループHLDGS	32,400	816.00	26,438,400		
トナミホールディングス	1,600	5,870.00	9,392,000		
ニッコンホールディングス	19,500	2,698.00	52,611,000		
福山通運	8,000	4,450.00	35,600,000		
セイノーホールディングス	39,500	1,901.00	75,089,500		
日立物流	11,700	2,915.00	34,105,500		
丸和運輸機関	3,200	3,120.00	9,984,000	貸付株式数	900株 (900株)
日本郵船	44,100	2,049.00	90,360,900		
商船三井	33,000	2,958.00	97,614,000		
川崎汽船	24,300	2,425.00	58,927,500	貸付株式数	6,700株
NSユニテッド海運	2,600	2,110.00	5,486,000		
飯野海運	28,900	485.00	14,016,500		
九州旅客鉄道	44,700	3,270.00	146,169,000		

S Gホールディングス	38,500	2,274.00	87,549,000	
日本航空	98,800	4,204.00	415,355,200	
ANAホールディングス	104,700	4,049.00	423,930,300	
ヤマシタヘルスケアHLDGS	5,700	1,459.00	8,316,300	
GENKY DRUGSTORES	2,500	3,600.00	9,000,000	貸付株式数 600株
三菱倉庫	17,700	2,179.00	38,568,300	
三井倉庫HOLD	37,000	328.00	12,136,000	
住友倉庫	36,000	706.00	25,416,000	
渋沢倉庫	6,700	1,794.00	12,019,800	
ヤマタネ	5,600	1,861.00	10,421,600	
東陽倉庫	29,200	355.00	10,366,000	
日本トランスシティ	19,000	455.00	8,645,000	
東洋埠頭	6,500	1,668.00	10,842,000	
上組	33,000	2,289.00	75,537,000	
キューソー流通システム	2,700	2,578.00	6,960,600	
近鉄エクスプレス	10,100	1,910.00	19,291,000	貸付株式数 2,800株
内外トランスライン	5,500	1,789.00	9,839,500	貸付株式数 1,500株
東京放送HD	33,000	2,180.00	71,940,000	
日本テレビHLD S	50,200	1,846.00	92,669,200	貸付株式数 13,900株 (100株)
テレビ朝日HD	15,100	2,204.00	33,280,400	貸付株式数 4,200株 (100株)
スカパーJSATHD	40,700	472.00	19,210,400	貸付株式数 10,900株
テレビ東京HD	4,900	2,773.00	13,587,700	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本BS放送	5,500	1,249.00	6,869,500	
ワイヤレスゲート	4,900	1,384.00	6,781,600	貸付株式数 1,300株 (800株)
コネクシオ	4,300	2,187.00	9,404,100	
日本通信	79,200	112.00	8,870,400	貸付株式数 18,100株 (1,000株)
日本電信電話	396,500	4,883.00	1,936,109,500	
KDDI	497,500	2,675.50	1,331,061,250	貸付株式数 138,300株
光通信	6,800	16,310.00	110,908,000	
NTTドコモ	408,900	2,684.00	1,097,487,600	
エムティーアイ	10,200	619.00	6,313,800	貸付株式数 2,100株
GMOインターネット	20,600	2,239.00	46,123,400	
カドカワ	16,400	1,077.00	17,662,800	
ゼンリン	6,800	3,250.00	22,100,000	

東京電力HD	449,300	383.00	172,081,900	
中部電力	172,900	1,428.50	246,987,650	
関西電力	229,900	1,268.00	291,513,200	貸付株式数 20,000株
中国電力	74,800	1,267.00	94,771,600	
北陸電力	54,600	874.00	47,720,400	貸付株式数 15,000株
東北電力	131,100	1,369.00	179,475,900	
四国電力	50,400	1,226.00	61,790,400	
九州電力	123,500	1,236.00	152,646,000	貸付株式数 34,300株
北海道電力	56,500	663.00	37,459,500	
沖縄電力	9,500	2,873.00	27,293,500	
電源開発	44,500	2,686.00	119,527,000	
イーレックス	10,700	732.00	7,832,400	貸付株式数 2,400株
東京瓦斯	120,300	2,674.00	321,682,200	貸付株式数 33,300株
大阪瓦斯	108,600	2,034.00	220,892,400	貸付株式数 30,100株
東邦瓦斯	28,000	3,150.00	88,200,000	
北海道瓦斯	39,000	299.00	11,661,000	貸付株式数 5,000株
西部瓦斯	7,500	2,659.00	19,942,500	貸付株式数 800株
静岡ガス	16,600	908.00	15,072,800	
メタウォーター	3,200	3,155.00	10,096,000	貸付株式数 800株 (800株)
松竹	3,600	14,180.00	51,048,000	貸付株式数 1,000株
東宝	36,100	3,380.00	122,018,000	
エイチ・アイ・エス	8,400	3,625.00	30,450,000	
東映	2,000	10,890.00	21,780,000	
NTTデータ	173,400	1,072.00	185,884,800	貸付株式数 48,000株
共立メンテナンス	9,700	4,695.00	45,541,500	貸付株式数 2,600株
イチネンホールディングス	7,700	1,440.00	11,088,000	貸付株式数 200株
建設技術研究所	7,900	1,392.00	10,996,800	
アインホールディングス	7,800	7,780.00	60,684,000	貸付株式数 2,000株
スバル興業	1,100	6,370.00	7,007,000	
東京テアトル	5,600	1,408.00	7,884,800	
よみうりランド	1,600	4,440.00	7,104,000	貸付株式数 400株
東京都競馬	4,400	3,585.00	15,774,000	
常磐興産	6,500	1,925.00	12,512,500	
カナモト	8,200	3,450.00	28,290,000	
東京ドーム	22,400	967.00	21,660,800	
DTS	6,200	3,620.00	22,444,000	
スクウェア・エニックス・HD	25,800	4,745.00	122,421,000	
シーイーシー	3,800	3,345.00	12,711,000	
カプコン	11,900	4,950.00	58,905,000	

西尾レントオール	5,200	3,180.00	16,536,000	
日本空港ビルデング	16,100	3,850.00	61,985,000	
トランス・コスモス	6,500	2,703.00	17,569,500	
乃村工藝社	13,000	2,144.00	27,872,000	貸付株式数 3,500株
ジャステック	6,800	1,278.00	8,690,400	
S C S K	13,300	4,360.00	57,988,000	貸付株式数 3,600株
藤田観光	2,800	3,015.00	8,442,000	貸付株式数 600株
K N T - C Tホールディングス	4,100	1,678.00	6,879,800	
日本管財	6,100	2,050.00	12,505,000	貸付株式数 1,700株
トーカイ	5,400	2,325.00	12,555,000	
セコム	57,000	7,534.00	429,438,000	
セントラル警備保障	3,500	2,771.00	9,698,500	貸付株式数 900株
アイネス	10,800	1,090.00	11,772,000	
丹青社	12,100	1,198.00	14,495,800	
メイテック	6,300	5,800.00	36,540,000	
T K C	5,500	4,190.00	23,045,000	
富士ソフト	7,900	3,970.00	31,363,000	
応用地質	6,900	1,464.00	10,101,600	
船井総研ホールディン	11,900	2,116.00	25,180,400	貸付株式数 3,200株
N S D	9,300	2,105.00	19,576,500	
オ オ バ	18,800	617.00	11,599,600	
コナミホールディングス	22,600	5,230.00	118,198,000	貸付株式数 6,200株
学 究 社	5,500	1,710.00	9,405,000	
ベネッセホールディングス	19,400	3,740.00	72,556,000	
イオンディライト	6,800	3,700.00	25,160,000	
ニチイ学館	11,700	1,105.00	12,928,500	貸付株式数 2,900株
ダイセキ	9,400	2,847.00	26,761,800	
日鉄住金物産	4,100	5,590.00	22,919,000	
元気寿司	3,500	2,765.00	9,677,500	貸付株式数 800株 (100株)
トラスコ中山	11,800	2,493.00	29,417,400	
ヤマダ電機	184,700	651.00	120,239,700	貸付株式数 51,000株 (700株)
オートバックスセブン	21,100	1,952.00	41,187,200	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
アークランドサカモト	9,500	1,707.00	16,216,500	
ニトリホールディングス	22,200	17,995.00	399,489,000	
吉野家ホールディングス	18,200	2,060.00	37,492,000	貸付株式数 5,700株
加藤産業	8,500	3,565.00	30,302,500	
イノテック	7,200	1,260.00	9,072,000	

イエローハット	5,300	3,045.00	16,138,500	
松屋フーズ	2,900	3,890.00	11,281,000	貸付株式数 100株
J B C Cホールディングス	10,600	1,041.00	11,034,600	
サガミチェーン	10,900	1,367.00	14,900,300	貸付株式数 3,000株 (2,300株)
日 伝	5,300	2,083.00	11,039,900	
関西スーパーマーケット	5,500	1,095.00	6,022,500	
ミロク情報サービス	5,300	2,897.00	15,354,100	
北沢産業	33,100	314.00	10,393,400	
因幡電機産業	6,800	4,675.00	31,790,000	
王将フードサービス	3,900	5,180.00	20,202,000	貸付株式数 900株
ブレナス	6,200	2,007.00	12,443,400	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,600	2,102.00	9,669,200	
アークス	9,900	2,478.00	24,532,200	
パローホールディングス	12,900	2,790.00	35,991,000	
バイテックホールディングス	3,800	2,013.00	7,649,400	
ミスミグループ本社	64,600	2,755.00	177,973,000	
ベ ル ク	2,700	5,880.00	15,876,000	
ファーストリテイリング	9,300	40,170.00	373,581,000	
ソフトバンクグループ	250,500	8,080.00	2,024,040,000	
スズケン	24,700	4,235.00	104,604,500	貸付株式数 6,800株
サンドラッグ	23,700	4,765.00	112,930,500	貸付株式数 6,500株
サクスパーホールディング	6,700	1,099.00	7,363,300	貸付株式数 1,800株
ジェコス	5,100	1,085.00	5,533,500	
ベルーナ	14,200	1,210.00	17,182,000	
合計			134,541,211,690	

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

トヨタ自動車 100,000株

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

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成30年4月27日

資産総額	260,741,362円
負債総額	5,070,860円
純資産総額（ - ）	255,670,502円
発行済数量	264,660,805口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9660円

(参考) 米国国債マザーファンド

純資産額計算書

平成30年4月27日

資産総額	14,201,820,125円
負債総額	31,579,498円
純資産総額（ - ）	14,170,240,627円
発行済数量	11,799,738,384口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2009円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成30年4月27日

資産総額	155,565,704,945円
負債総額	9,584,599,516円
純資産総額（ - ）	145,981,105,429円
発行済数量	130,804,029,010口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1160円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された

受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2018年4月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者であるCIO (Chief Investment Officer) が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ. 運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

2018年4月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	81	192,189
追加型株式投資信託	703	15,293,945
株式投資信託 合計	784	15,486,134
単位型公社債投資信託	25	103,908
追加型公社債投資信託	14	1,482,732
公社債投資信託 合計	39	1,586,639
総合計	823	17,072,774

3 【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第58期事業年度（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。

また、第59期事業年度に係る中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成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	1 243	1 229
建物	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 4,390	2 4,946
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 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	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	利益剰余金		合計
				剰余金			
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） 其他有価証券

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 その他有価証券	5,060	5,060	-
資産計	46,774	46,774	-
(1) 未払手数料	4,453	4,453	-
(2) その他未払金	4,946	4,946	-
(3) 未払費用(*)	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いません。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(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	当事業年度
	(平成28年3月31日)	(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	当事業年度
	(平成28年3月31日)	(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。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

当中間会計期間 (平成29年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	22,206
有価証券	98
未収委託者報酬	11,259
繰延税金資産	391
その他	278
流動資産合計	34,233
固定資産	
有形固定資産	1 231
無形固定資産	
ソフトウェア	2,066
その他	446
無形固定資産合計	2,512
投資その他の資産	
投資有価証券	6,874
関係会社株式	5,129
その他	1,262

投資その他の資産合計	13,266
固定資産合計	16,010
資産合計	50,244

(単位:百万円)

当中間会計期間
(平成29年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	7,070
未払費用	3,973
未払法人税等	916
賞与引当金	692
その他	2 606
流動負債合計	13,260
固定負債	
退職給付引当金	2,324
役員退職慰労引当金	134
繰延税金負債	21
その他	6
固定負債合計	2,487
負債合計	15,747
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,116
利益剰余金合計	7,490
株主資本合計	34,160
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	336

評価・換算差額等合計	336
純資産合計	34,496
負債・純資産合計	50,244

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

当中間会計期間	
(自 平成29年 4月 1日	
至 平成29年 9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	40,996
その他営業収益	364
営業収益合計	41,360
営業費用	
支払手数料	20,216
その他営業費用	6,325
営業費用合計	26,542
一般管理費	1 5,665
営業利益	9,152
営業外収益	2 222
営業外費用	9
経常利益	9,365
特別利益	-
特別損失	-
税引前中間純利益	9,365
法人税、住民税及び事業税	2,879
法人税等調整額	69
中間純利益	6,416

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成29年 4月 1日 至 平成29年 9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
中間純利益	-	-	-	6,416	6,416	6,416
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	5,115	5,115	5,115
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,116	7,490	34,160

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
中間純利益	-	-	6,416
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	72	72	72
当中間期変動額合計	72	72	5,043
当中間期末残高	336	336	34,496

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

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) 其他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、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、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成29年9月30日現在)
有形固定資産	307百万円

2 消費税等の取扱い

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

3 保証債務

当中間会計期間（平成29年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,744百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	471百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
受取配当金	49百万円
投資有価証券売却益	134百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				

普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成29年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 3月31日	平成29年 6月27日

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成29年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,206	22,206	-
(2) 未収委託者報酬	11,259	11,259	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,002	6,002	-
資産合計	39,467	39,467	-
(1) 未払金(*)	7,002	7,002	-
(2) 未払費用(*)	3,424	3,424	-
負債合計	10,427	10,427	-

(*) 金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払金及び(2) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	970
子会社株式	5,129
差入保証金	1,044

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

(有価証券関係)

当中間会計期間（平成29年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	124	55	69
(2) その他			
証券投資信託	4,458	3,979	479
小計	4,582	4,034	548
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	1,419	1,482	63
小計	1,419	1,482	63
合計	6,002	5,517	485

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額 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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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

[関連情報]

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
--

1株当たり純資産額	13,224.69円
1株当たり中間純利益金額	2,459.79円

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

(注2) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
中間純利益(百万円)	6,416
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,416
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2017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 (2017年3月 末日現在)	事業の内容
株式会社西京銀行	17,940	(注1)

(注1) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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：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（2017年3月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
- ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
使用開始日を記載することがあります。

届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成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。

独立監査人の監査報告書

平成30年4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 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」に掲げられている為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンドの平成29年3月28日から平成30年3月26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、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンドの平成30年3月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。