

ダイワ・インデックスセレクト TOPIX

追加型投信／国内／株式／インデックス型

※課税上は株式投資信託として取扱われます。

投資信託説明書(請求目論見書)

2018年6月13日

本文書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

本文書にかかる「ダイワ・インデックスセレクト TOPIX」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により、有価証券届出書を2017年12月12日に関東財務局長に提出しており、2017年12月13日にその届出の効力が生じております。

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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当ありません。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

第一部 証券情報

(1) ファンドの名称

ダイワ・インデックスセレクト TOPIX

(2) 国内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お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。

- ・お電話によるお問い合わせ先（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

① 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、2.16%（税抜2.0%）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い合わせ下さい。

- ・お電話によるお問い合わせ先（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）

② 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。

③ 「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い合わせ下さい。

- ・お電話によるお問い合わせ先（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

2017年12月13日から2018年12月12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

- ① 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。
- ② 委託会社の各営業日の午後3時までに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。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。
- ③ 金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、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その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することができます。
- ④ 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。
- ⑤ 「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。）。
- ⑥ 取得申込金額に利息は付きません。
- ⑦ 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、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式 一般））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	投資形態	ファミリーファンド
	対象インデックス	TOPIX

(注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「国内」…目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「株式」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「インデックス型」…目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「株式 一般」…大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「年1回」…目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「日本」…目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの

商品分類表

単体型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単体型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般		日本		日経225
大型株	年2回	北米	ファミリー ファンド	
中小型株	年4回	欧州		TOPIX
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	その他 ()
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) (株式 一般)				
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

<信託金の限度額>

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、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>



わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

- ① 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。

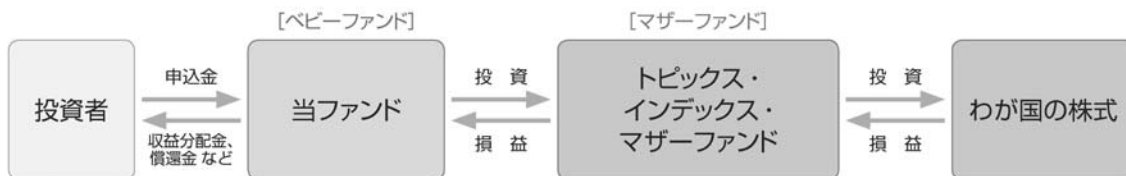
TOPIXは、1968年1月4日（基準時）の時価総額を100として1969年7月1日から株式会社東京証券取引所が算出・公表しております。

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。



・マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

・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」の運用が行なわれないことがあります。

分配方針

毎年9月19日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行いません。

【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。

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

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2) ファンドの沿革

2013年11月18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	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③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
↑↓※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	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など
↓運用指図↑↓※2	損益↑↓信託金（※3）	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 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	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
	損益↑↓投資	
投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。） など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）	

（注）「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経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

◎委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。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

① 主要投資対象

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

② 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、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

ロ. マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ハ. 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

ニ. 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。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、<ファンドの特色>をご参照下さい。

(2) 投資対象

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑧、⑨および⑩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
- ② 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マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
1. 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（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。）
 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. 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。）
 8. 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。）
 9. 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。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 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
 12. 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 11. までの証券または証書の性質を有するもの
 13. 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。）
 14. 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。）
 15. 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。）
 16. 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せん。）
 17. 預託証券（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。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 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。）
 20. 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。）
 21. 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 19. 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 12. および前 17. 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 14. の証券のうち投資法人債券ならびに前 12. および前 17. 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 13. の証券および前 14. 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。
- ③ 委託会社は、信託金を、前②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

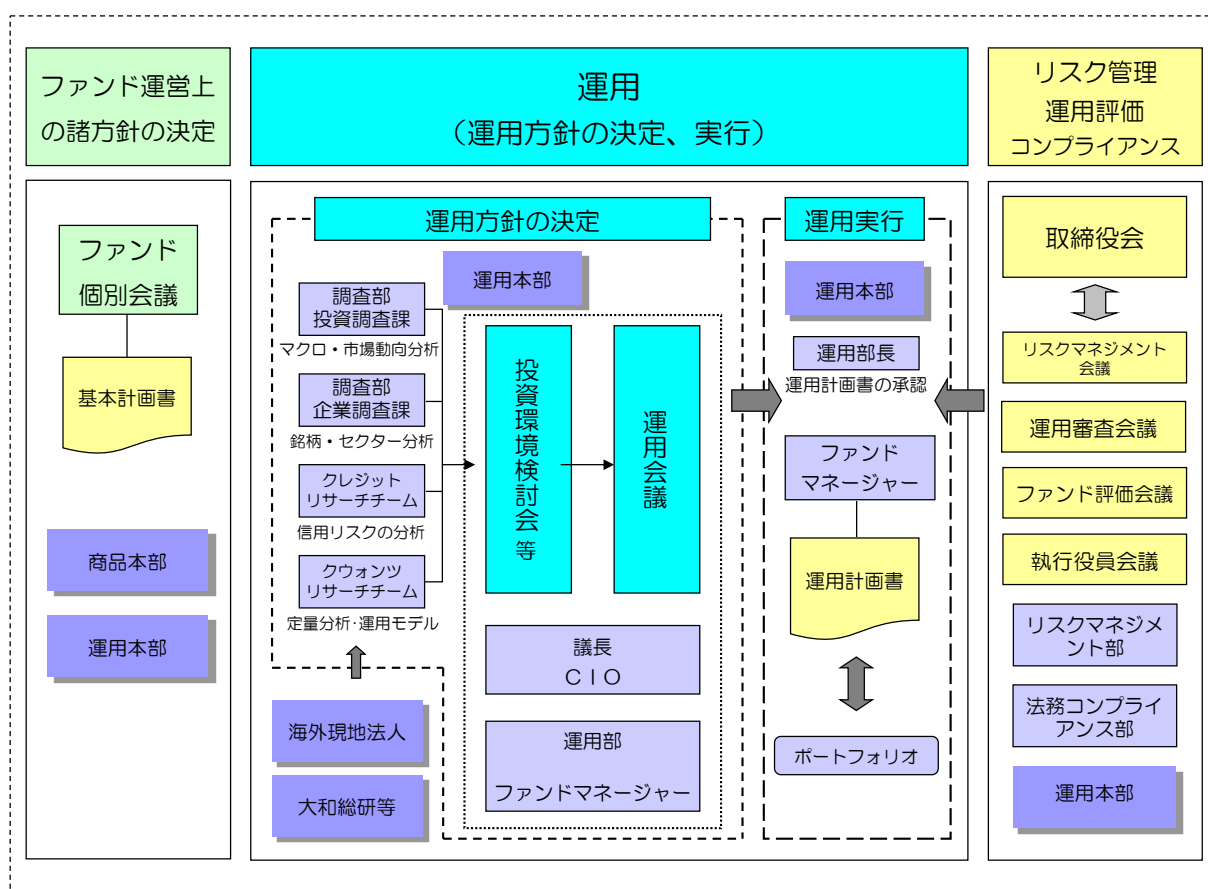
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5. の権利の性質を有するもの
- ④ 前②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前③に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(3) 運用体制

① 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。



② 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。

③ 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の的確な状況報告
- ・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。

④ 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。

⑤ 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

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、分配を行わないことがあります。

- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 投資制限

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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ます。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ます。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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、かつ次の 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ます。
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（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、）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
- ⑧ 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。
- ⑨ 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（以下本ハ. 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. 前ハ. 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。
- ⑩ 金利先渡取引（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（以下本ハ. 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、信託財産の純資産総額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。

といひます。)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)③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ひます。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(以下本ハ.において「保有金利商品の時価総額の合計額」といひます。)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. 前ハ.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ひます。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ひます。

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

ヘ. 委託会社は、金利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。

⑪ 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。

⑫ 同一銘柄の転換社債等(信託約款)

イ. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債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10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転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいひます。

⑬ 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。

⑭ 外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への投資は、行ないません。

⑮ 資金の借入れ(信託約款)

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

なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

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

<参 考> マザーファンド（トピックス・インデックス・マザーファンド）の概要

(1) 投資方針

① 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。

② 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す。

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す。

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

① 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。

② 委託会社は、信託金を、前①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

① 株式

株式への投資には、制限を設けません。

② 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。

③ 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合計額が、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. 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。

3 投資リスク

(1) 価額変動リスク

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

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 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。

② 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。

① 金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付け、ご

換金の申込みの受付を中止することがあります。

- ② ご換金の申込みの受付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付けたものとして取扱います。

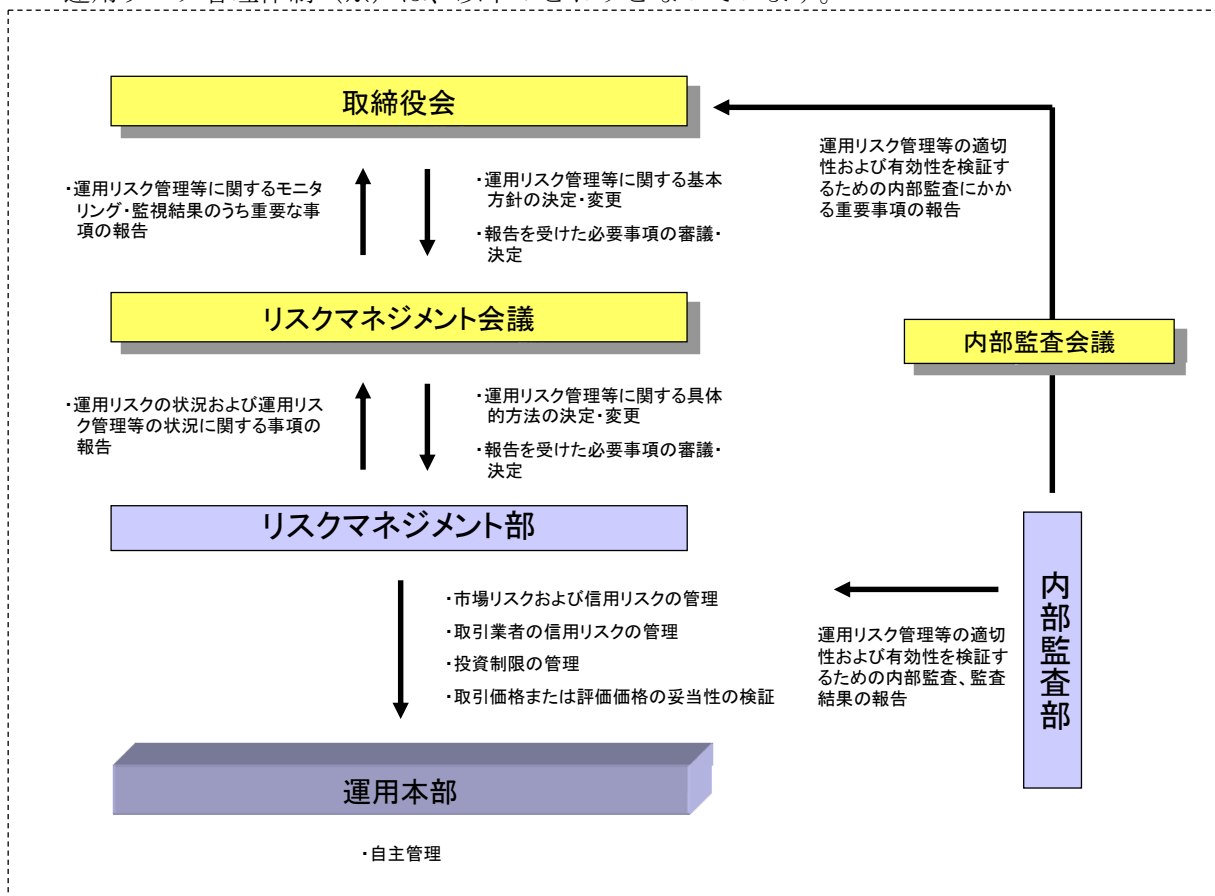
(3) その他の留意点

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



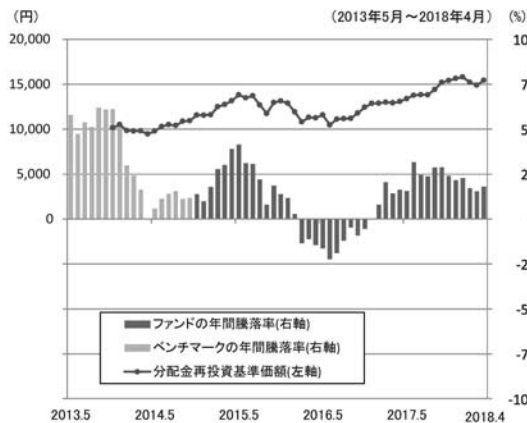
※ 流動性リスクに対する管理体制

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

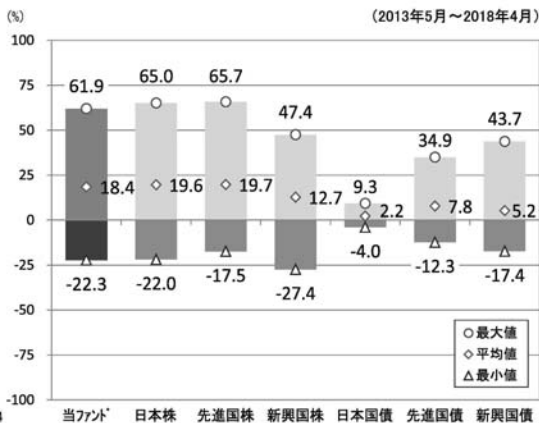
参考情報

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

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

- ① 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、2.16%（税抜 2.0%）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）

- ② 申込手数料には、消費税等が課されます。
- ③ 「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合わせ下さい。

(2) 換金（解約）手数料

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3) 信託報酬等

- ① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 0.432%（税抜 0.40%）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するものとします。
- ② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率 0.19%（税抜）	年率 0.18%（税抜）	年率 0.03%（税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

- ④ 前③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

- ① 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。
- ② 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。

- ③ 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。
- ④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5) 課税上の取扱い

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 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（配当控除の適用があります。）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。

② 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

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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

- ① 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。
- ② 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	1,484,162,587	99.99
内 日本	1,484,162,587	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	86,513	0.01
純資産総額	1,484,249,100	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成30年4月27日現在）

① 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)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,329,894,792	1.0389 1,381,683,150	1.1160 1,484,162,587	99.99

(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	99.99%
合計	99.99%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

① 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26年9月19日)	283,094,922	283,094,922	1.0844	1.0844
第2計算期間末 (平成27年9月24日)	565,381,843	565,381,843	1.1786	1.1786
第3計算期間末 (平成28年9月20日)	768,653,724	768,653,724	1.1060	1.1060
平成29年4月末日	1,090,637,594	—	1.3080	—
5月末日	1,117,768,985	—	1.3393	—
6月末日	1,138,879,001	—	1.3772	—
7月末日	1,156,813,634	—	1.3830	—
8月末日	1,192,198,066	—	1.3820	—
第4計算期間末 (平成29年9月19日)	1,238,210,941	1,238,210,941	1.4248	1.4248
9月末日	1,248,807,896	—	1.4416	—
10月末日	1,304,780,761	—	1.5191	—
11月末日	1,322,518,577	—	1.5414	—
12月末日	1,384,561,220	—	1.5644	—
平成30年1月末日	1,439,206,257	—	1.5803	—
2月末日	1,413,463,459	—	1.5217	—
3月末日	1,423,159,513	—	1.4901	—
4月末日	1,484,249,100	—	1.5429	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
平成29年9月20日～ 平成30年3月19日	—

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	8.4
第2計算期間	8.7
第3計算期間	△6.2
第4計算期間	28.8

	収益率(%)
平成 29 年 9 月 20 日～ 平成 30 年 3 月 19 日	3.9

(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	268,564,448	8,499,504
第 2 計算期間	328,876,234	110,220,711
第 3 計算期間	279,928,901	64,643,097
第 4 計算期間	380,769,976	206,745,534
平成 29 年 9 月 20 日～ 平成 30 年 3 月 19 日	182,584,420	108,978,590

(注) 当初設定数量は 1,000,000 口です。

(参考) マザーファンド
トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成 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)

① 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

	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 (%)
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	キヤノン	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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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

●ダイワ・インデックスセレクト TOPIX

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	15,429円
純資産総額	14億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.5%
3カ月間	-2.4%
6カ月間	1.6%
1年間	18.0%
3年間	17.3%
5年間	-
設定来	54.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円				設定来分配金合計額: 0円			
	第1期 14年9月	第2期 15年9月	第3期 16年9月	第4期 17年9月				
分配金	0円	0円	0円	0円				

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

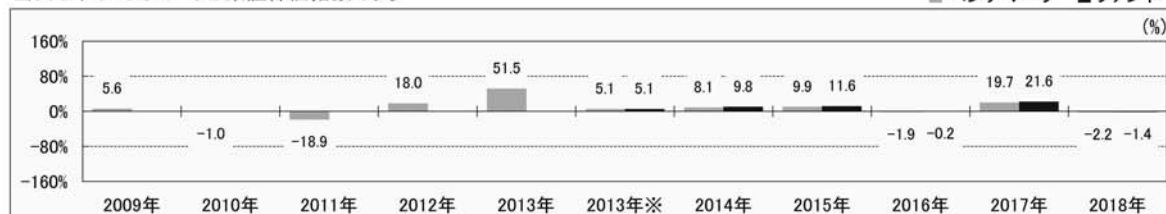
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,495	98.5%	電気機器	13.4%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.4%
国内株式先物	1	1.5%	輸送用機器	8.7%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.0%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	7.2%	TOPIX先物 3006月	-	1.5%
コール・ローン、その他	-	1.5%	化学	7.1%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.5%
合計	1,496	-	銀行業	7.0%	日本電信電話	情報・通信業	1.4%
株式市場・上場別構成		比率	機械	5.3%	ソニー	電気機器	1.4%
一部(東証・名証)		98.5%	小売業	4.8%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.3%
二部(東証・名証)		-	卸売業	4.7%	本田技研	輸送用機器	1.3%
新興市場他		-	医薬品	4.5%	キーエンス	電気機器	1.3%
その他		-	その他	35.7%	任天堂	その他製品	1.1%
合計		98.5%	合計	98.5%	合計		16.1%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■ベンチマーク ■ファンド



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

・2013年※は設定日(11月18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。

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

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

第2 管理及び運営

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った契約（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。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「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。

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。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受け付けを中止することができます。

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

2 換金（解約）手続等

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

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。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問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/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約請求の受付を中止することができます。一部解約請求の受付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請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の一部解約の価額は、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請求を受けたものとして、当該計算日の基準価額とします。

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

委託会社は、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。委託会社は、委託会社の指定する預金口座等の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。

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

3 資産管理等の概要

(1) 資産の評価

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

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

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問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

2013年11月18日から2028年9月19日までとします。ただし、(5)①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9月20日から翌年9月19日までとします。ただし、第1計算期間は、2013年11月18日から2014年9月19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

① 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。）を行いません。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いません。
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、②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。

② 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②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ます。

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、書面決議を行いません。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つても、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。
- ③ 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。
- ④ 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）の交付の請求があつた場合には、これを交付します。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。

① 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。）を持分に依り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ます。）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ます。）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ます。

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、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

② 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4期計算期間（平成28年9月21日から平成29年9月19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。

独立監査人の監査報告書


平成 29 年 10 月 20 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
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士
業務執行社員

貞廣篤典 
小林 英之 

当監査法人は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・インデックスセレクト TOP1X の平成 28 年 9 月 21 日から平成 29 年 9 月 19 日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・インデックスセレクト TOP1X の平成 29 年 9 月 19 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

1 財務諸表

ダイワ・インデックスセレクト TOPIX

(1) 貸借対照表

	第3期	第4期
	平成28年9月20日現在	平成29年9月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,579,044	3,385,526
親投資信託受益証券	768,646,378	1,238,199,653
未収入金	—	268,000
流動資産合計	770,225,422	1,241,853,179
資産合計	770,225,422	1,241,853,179
負債の部		
流動負債		
未払解約金	—	1,180,589
未払受託者報酬	116,396	182,311
未払委託者報酬	1,435,983	2,248,881
その他未払費用	19,319	30,457
流動負債合計	1,571,698	3,642,238
負債合計	1,571,698	3,642,238
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	695,006,271	869,030,713
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	73,647,453	369,180,228
(分配準備積立金)	14,489,685	190,872,388
元本等合計	768,653,724	1,238,210,941
純資産合計	768,653,724	1,238,210,941
負債純資産合計	770,225,422	1,241,853,179

(2) 損益及び剰余金計算書

	第3期	第4期
	自平成27年9月25日 至平成28年9月20日	自平成28年9月21日 至平成29年9月19日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	199	—
有価証券売買等損益	△40,788,773	251,742,275
営業収益合計	△40,788,574	251,742,275
営業費用		
支払利息	170	1,126
受託者報酬	219,824	333,966
委託者報酬	2,712,149	4,119,756
その他費用	36,472	55,491
営業費用合計	2,968,615	4,510,339
営業利益又は営業損失(△)	△43,757,189	247,231,936
経常利益又は経常損失(△)	△43,757,189	247,231,936
当期純利益又は当期純損失(△)	△43,757,189	247,231,936
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(△)	△1,074,124	34,696,148
期首剰余金又は期首欠損金(△)	85,661,376	73,647,453
剰余金増加額又は欠損金減少額	42,178,379	111,780,772
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	42,178,379	111,780,772
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,509,237	28,783,785
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	11,509,237	28,783,785
分配金 ※1	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	73,647,453	369,180,228

(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 4 期	
	自 平成 28 年 9 月 21 日	至 平成 29 年 9 月 19 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 平成 28 年 9 月 19 日が休日のため、前計算期間末日を平成 28 年 9 月 20 日としております。このため、当計算期間は 364 日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 3 期	第 4 期
	平成 28 年 9 月 20 日現在	平成 29 年 9 月 19 日現在
1. ※1 期首元本額	479,720,467 円	695,006,271 円
期中追加設定元本額	279,928,901 円	380,769,976 円
期中一部解約元本額	64,643,097 円	206,745,534 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	695,006,271 口	869,030,713 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 3 期	第 4 期
	自 平成 27 年 9 月 25 日 至 平成 28 年 9 月 20 日	自 平成 28 年 9 月 21 日 至 平成 29 年 9 月 19 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 (59,157,768 円) 及び分配準備積立金 (14,489,685 円) より分配対象額は 73,647,453 円 (1 万口当たり 1,059.67 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 (179,738,159 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (178,308,865 円) 及び分配準備積立金 (11,134,229 円) より分配対象額は 369,181,253 円 (1 万口当たり 4,248.20 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)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第4期	
	自 平成28年9月21日 至 平成29年9月19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、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 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。	
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。	

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期	
	平成29年9月19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	第3期	第4期
	平成28年9月20日現在	平成29年9月19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	△41,415,351	235,993,783
合計	△41,415,351	235,993,783

(デリバティブ取引に関する注記)
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第3期 平成28年9月20日現在	第4期 平成29年9月19日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第4期 自 平成28年9月21日 至 平成29年9月19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3期 平成28年9月20日現在	第4期 平成29年9月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1060円 (11,060円)	1,4248円 (14,248円)

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	1,204,591,549	1,238,199,653	
親投資信託受益証券 合計			1,238,199,653	
合計			1,238,199,653	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成28年9月20日現在	平成29年9月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,691,441,691	5,243,157,160
株式 ※3※4	113,492,368,988	135,585,875,410
派生商品評価勘定	—	41,667,600
未収入金	—	5,711,360
未収配当金	45,069,856	47,733,767
未収利息	244,714	275,624
前払金	8,040,000	—
その他未収収益 ※5	4,042,890	4,745,552
流動資産合計	118,241,208,139	140,929,166,473
資産合計	118,241,208,139	140,929,166,473
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,568,640	—
前受金	—	30,260,000
未払金	2,248,640	—
未払解約金	74,688,500	188,293,300
受入担保金	4,367,258,206	4,002,234,232
流動負債合計	4,448,763,986	4,220,787,532
負債合計	4,448,763,986	4,220,787,532
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	143,240,630,767	132,992,880,740
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△29,448,186,614	3,715,498,201
元本等合計	113,792,444,153	136,708,378,941
純資産合計	113,792,444,153	136,708,378,941
負債純資産合計	118,241,208,139	140,929,166,473

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成 28 年 9 月 21 日 至 平成 29 年 9 月 19 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成 28 年 9 月 20 日現在	平成 29 年 9 月 19 日現在
1. ※1 期首	平成 27 年 9 月 25 日	平成 28 年 9 月 21 日
期首元本額	142,153,807,198 円	143,240,630,767 円
期中追加設定元本額	14,010,676,969 円	15,781,466,537 円
期中一部解約元本額	12,923,853,400 円	26,029,216,564 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
適格機関投資家専用投信 1 号	1,611,697,194 円	— 円
トピックス・インデックスファンド	5,870,349,708 円	4,876,025,306 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	14,459,562,673 円	12,004,610,396 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VA2	123,973,859 円	63,814,361 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	155,132,020 円	98,324,013 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	2,622,187,560 円	1,596,875,323 円
ダイワ国際分散バランスファ	118,142,999 円	73,496,283 円

ンド30VA(一般投資家私募)		
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	3,671,223,973円	2,267,542,428円
D-I's TOPIXインデックス	33,397,291円	29,570,535円
為替ヘッジ付米国債プラス日本株式ファンド	24,801,250円	27,492,055円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	593,766円	571,628円
iFree TOPIXインデックス	14,707,636円	219,320,903円
iFree 8資産バランス	9,416,329円	560,747,176円
DCダイワ日本株式インデックス	64,175,618,880円	61,209,294,542円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,466,829,698円	2,305,738,742円
ダイワ・ライフ・バランス50	2,424,386,068円	2,363,094,190円
ダイワ・ライフ・バランス70	2,171,081,155円	2,234,782,816円
年金ダイワ日本株式インデックス	3,783,254,324円	3,968,008,120円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	26,357,149円	20,185,626円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	62,358,348円	59,526,245円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	12,485,710円	12,595,154円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	448,097円	404,752円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	440,730円	400,556円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)	941,908円	753,865円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	65,202,419円	11,529,912円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	369,460,228円	47,889,757円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA(国内株式型)	200,755,185円	27,538,772円
ダイワ世界バランスファンド40VA	1,628,116,331円	532,798,059円
ダイワ世界バランスファンド60VA	256,425,062円	191,358,243円
ダイワ・バランスファンド35VA	15,311,443,452円	11,883,395,819円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	432,461,659円	319,015,775円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	742,797,027円	481,942,796円

	ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	1,317,289,178 円	1,022,475,874 円
	ダイワ国内バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	203,482,755 円	148,071,718 円
	ダイワ国内バランスファンド30VA (適格機関投資家専用)	327,434,084 円	256,045,701 円
	ダイワ・ノーロード TOPIXファンド	26,401,434 円	58,249,473 円
	ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	—円	5,574,613,851 円
	ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	—円	4,252,692 円
	ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	—円	963,778,473 円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	967,581,041 円	1,204,591,549 円
	ダイワライフスタイル25	225,777,125 円	192,618,067 円
	ダイワライフスタイル50	688,315,084 円	643,116,079 円
	ダイワライフスタイル75	518,580,161 円	521,030,501 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)	16,119,720,217 円	14,915,392,614 円
	計	143,240,630,767 円	132,992,880,740 円
2.	期末日における受益権の総数	143,240,630,767 口	132,992,880,740 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29,448,186,614円です。	—
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 4,208,114,630 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 3,875,321,600 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 595,200,000 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 672,900,000 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3,321,500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4,045,175円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成 28 年 9 月 21 日 至 平成 29 年 9 月 19 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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成 29 年 9 月 19 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成28年9月20日現在	平成29年9月19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	△9,372,826,312	28,013,029,927
合計	△9,372,826,312	28,013,029,927

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間 (平成27年9月25日から平成28年9月20日まで、及び平成28年9月21日から平成29年9月19日まで) を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成28年9月20日 現在				平成29年9月19日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	212,960,000	—	208,400,000	△4,560,000	950,100,000	—	991,800,000	41,700,000
合計	212,960,000	—	208,400,000	△4,560,000	950,100,000	—	991,800,000	41,700,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成28年9月20日現在	平成29年9月19日現在
1口当たり純資産額	0.7944円	1.0279円
(1万口当たり純資産額)	(7,944円)	(10,279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	3,600	3,340.00	12,024,000	
日本水産	82,700	616.00	50,943,200	
マルハニチロ	12,000	3,315.00	39,780,000	

カネコ種苗	4,400	1,514.00	6,661,600		
サカタのタネ	9,700	3,170.00	30,749,000	貸付株式数	2,500株
ホクト	5,800	1,942.00	11,263,600	貸付株式数	1,800株
ショーボンHD	5,900	6,350.00	37,465,000	貸付株式数	1,600株
ミライト・ホールディングス	18,900	1,312.00	24,796,800		
タマホーム	10,500	717.00	7,528,500		
日鉄鉱業	1,900	8,100.00	15,390,000		
三井松島	6,100	1,465.00	8,936,500		
国際石油開発帝石	327,600	1,111.50	364,127,400		
日本海洋掘削	3,300	2,079.00	6,860,700	貸付株式数	900株 (700株)
石油資源開発	9,200	2,210.00	20,332,000		
K&Oエナジーグループ	4,100	1,855.00	7,605,500		
安藤・間	47,500	748.00	35,530,000		
東急建設	23,100	883.00	20,397,300		
コムシスホールディングス	23,800	2,542.00	60,499,600		
ミサワホーム	9,300	938.00	8,723,400		
高松コンストラクションGP	4,400	3,030.00	13,332,000		
東建コーポレーション	2,500	13,450.00	33,625,000		
大成建設	319,000	1,172.00	373,868,000		
大林組	188,900	1,300.00	245,570,000		
清水建設	193,600	1,199.00	232,126,400		
飛島建設	71,900	158.00	11,360,200	貸付株式数	9,300株
長谷工コーポレーション	73,100	1,411.00	103,144,100		
松井建設	8,300	967.00	8,026,100	貸付株式数	100株
鹿島建設	277,000	1,038.00	287,526,000		
不動テトラ	54,300	182.00	9,882,600		
鉄建建設	40,000	358.00	14,320,000		
西松建設	71,000	606.00	43,026,000		
三井住友建設	240,900	122.00	29,389,800		
大豊建設	25,000	510.00	12,750,000		
前田建設	42,000	1,302.00	54,684,000		
奥村組	48,000	827.00	39,696,000		
東鉄工業	7,800	3,635.00	28,353,000		
浅沼組	27,000	326.00	8,802,000		
戸田建設	74,000	834.00	61,716,000	貸付株式数	2,000株
熊谷組	103,000	337.00	34,711,000		
北野建設	20,000	442.00	8,840,000		
三井ホーム	11,000	715.00	7,865,000		
矢作建設	10,000	964.00	9,640,000		
ピーエス三菱	14,700	611.00	8,981,700		
日本ハウスHLDGS	17,900	569.00	10,185,100	貸付株式数	3,100株
大東建託	22,700	19,595.00	444,806,500		
新日本建設	8,600	846.00	7,275,600		
NIPPO	13,000	2,282.00	29,666,000		
東亜道路	17,000	417.00	7,089,000		
前田道路	19,000	2,274.00	43,206,000		
日本道路	20,000	614.00	12,280,000		
東亜建設	5,800	2,113.00	12,255,400		
若築建設	53,000	192.00	10,176,000		

東洋建設	17,500	487.00	8,522,500	
五洋建設	69,400	648.00	44,971,200	
世紀東急	13,800	633.00	8,735,400	
福田組	2,200	6,080.00	13,376,000	
住友林業	42,100	1,678.00	70,643,800	
日本基礎技術	14,200	378.00	5,367,600	
日成ビルド工業	21,000	600.00	12,600,000	
大和ハウス	185,500	3,849.00	713,989,500	
ライト工業	12,100	1,106.00	13,382,600	
積水ハウス	189,800	1,865.50	354,071,900	
ユアテック	11,000	805.00	8,855,000	
西部電気工業	3,300	2,438.00	8,045,400	
中電工	6,300	3,065.00	19,309,500	
関電工	26,000	1,179.00	30,654,000	貸付株式数 7,000株
きんでん	42,400	1,750.00	74,200,000	
東京エネシス	6,700	1,174.00	7,865,800	貸付株式数 1,800株
トーエネック	9,000	647.00	5,823,000	
住友電設	4,800	2,017.00	9,681,600	
日本電設工業	9,500	2,264.00	21,508,000	
協和エクシオ	24,100	2,091.00	50,393,100	
日本工営	4,500	3,570.00	16,065,000	
九電工	12,600	4,375.00	55,125,000	貸付株式数 3,400株
三機工業	14,100	1,245.00	17,554,500	
日揮	58,400	1,732.00	101,148,800	
中外炉工業	32,000	219.00	7,008,000	
太平電業	9,000	1,426.00	12,834,000	
高砂熱学	17,300	1,874.00	32,420,200	
NECネッツエスアイ	5,800	2,690.00	15,602,000	
明星工業	13,300	752.00	10,001,600	
大気社	7,500	2,911.00	21,832,500	
ダイダン	10,000	1,353.00	13,530,000	
日比谷総合設備	6,300	2,385.00	15,025,500	
東芝プラントシステム	10,100	1,940.00	19,594,000	
日本製粉	17,400	1,764.00	30,693,600	
日清製粉G本社	67,200	1,959.00	131,644,800	
昭和産業	24,000	620.00	14,880,000	
中部飼料	7,700	2,037.00	15,684,900	
フィード・ワン	49,900	258.00	12,874,200	
日本甜菜糖	3,600	2,437.00	8,773,200	
三井製糖	4,600	3,800.00	17,480,000	
塩水港精糖	29,900	252.00	7,534,800	
日新製糖	3,100	2,005.00	6,215,500	
Lifull	16,400	949.00	15,563,600	
ジェイエイシーリクルートメント	4,900	1,671.00	8,187,900	貸付株式数 1,300株
日本M&Aセンター	17,200	5,410.00	93,052,000	
タケエイ	6,700	1,187.00	7,952,900	貸付株式数 1,900株
トラスト・テック	3,800	3,120.00	11,856,000	
パソナグループ	5,800	1,178.00	6,832,400	貸付株式数 1,400株 (1,400株)

CDS	6,300	1,257.00	7,919,100		
リンクアンドモチベーション	13,000	695.00	9,035,000	貸付株式数	3,500株
GCA	7,500	1,035.00	7,762,500	貸付株式数	2,100株
エス・エム・エス	8,800	3,665.00	32,252,000	貸付株式数	2,300株
パーソルホールディングス	46,100	2,408.00	111,008,800		
リニカル	4,100	1,519.00	6,227,900	貸付株式数	1,100株
クックパッド	17,900	775.00	13,872,500	貸付株式数	5,000株
森永製菓	12,700	6,500.00	82,550,000		
中村屋	1,900	5,070.00	9,633,000		
江崎グリコ	15,900	5,650.00	89,835,000		
不二家	4,400	2,465.00	10,846,000	貸付株式数	200株
山崎製パン	45,600	2,054.00	93,662,400	貸付株式数	12,700株
モロゾフ	1,400	7,780.00	10,892,000		
亀田製菓	3,600	4,870.00	17,532,000	貸付株式数	1,000株
寿スピリッツ	6,400	3,705.00	23,712,000	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
カルビー	25,800	3,910.00	100,878,000	貸付株式数	7,200株 (600株)
森永乳業	58,000	863.00	50,054,000		
六甲バター	3,500	2,401.00	8,403,500		
ヤクルト	34,000	8,100.00	275,400,000	貸付株式数	4,000株
明治ホールディングス	37,200	8,740.00	325,128,000		
雪印メグミルク	13,800	3,210.00	44,298,000		
プリマハム	44,000	777.00	34,188,000		
日本ハム	45,000	3,145.00	141,525,000		
丸大食品	29,000	545.00	15,805,000		
S Foods	3,900	4,260.00	16,614,000	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
伊藤ハム米久HLDGS	36,200	1,040.00	37,648,000	貸付株式数	10,300株
スタジオアリス	2,900	2,653.00	7,693,700		
シミックホールディングス	3,400	1,537.00	5,225,800		
システナ	5,300	2,831.00	15,004,300		
デジタルアーツ	2,900	4,635.00	13,441,500	貸付株式数	500株
新日鉄住金SOL	9,200	2,502.00	23,018,400		
総合警備保障	21,600	5,140.00	111,024,000		
いちご	53,600	376.00	20,153,600	貸付株式数	16,400株
日本駐車場開発	80,700	165.00	13,315,500	貸付株式数	21,800株 (21,700株)
カカクコム	42,300	1,363.00	57,654,900	貸付株式数	12,300株 (12,300株)
ルネサンス	5,200	1,776.00	9,235,200		
ディップ	8,400	2,550.00	21,420,000		
SBSホールディングス	6,800	786.00	5,344,800		
オプトホールディング	6,700	1,248.00	8,361,600	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
新日本科学	8,600	536.00	4,609,600	貸付株式数	2,100株
ツクイ	16,300	754.00	12,290,200	貸付株式数	400株
エムスリー	51,600	3,225.00	166,410,000	貸付株式数	14,500株
アウトソーシング	3,400	7,190.00	24,446,000	貸付株式数	900株 (100株)

ウェルネット	5,700	1,150.00	6,555,000	貸付株式数	1,600株
ディー・エヌ・エー	27,000	2,437.00	65,799,000		
博報堂DYHLDGS	81,500	1,464.00	119,316,000		
ぐるなび	8,700	1,641.00	14,276,700		
エスアールジータカミヤ	10,400	637.00	6,624,800	貸付株式数	2,800株
ジャパンベストレスキューS	16,500	429.00	7,078,500		
ファンコミュニケーションズ	16,300	1,216.00	19,820,800	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
ティア	10,100	868.00	8,766,800		
インフォマート	29,300	782.00	22,912,600	貸付株式数	7,900株
サッポロホールディングス	20,300	3,190.00	64,757,000		
アサヒグループホールディング	117,700	4,584.00	539,536,800		
麒麟HD	269,900	2,531.00	683,116,900		
宝ホールディングス	45,500	1,064.00	48,412,000		
オエノンホールディングス	32,600	283.00	9,225,800		
コカ・コーラボトラーズJ	39,500	3,770.00	148,915,000		
サントリー食品インター	43,000	5,200.00	223,600,000		
ダイドーグループHD	2,700	5,400.00	14,580,000		
伊藤園	18,600	3,835.00	71,331,000	貸付株式数	5,200株
キーコーヒー	5,600	2,222.00	12,443,200	貸付株式数	100株
日清オイリオグループ	36,000	745.00	26,820,000		
不二製油グループ	17,000	3,035.00	51,595,000		
J-オイルミルズ	2,600	4,045.00	10,517,000		
ローソン	17,200	7,270.00	125,044,000	貸付株式数	4,800株
サンエー	4,200	5,000.00	21,000,000		
カワチ薬品	4,600	2,700.00	12,420,000	貸付株式数	800株
エービーシー・マート	9,900	5,830.00	57,717,000	貸付株式数	2,700株
ハードオフコーポレーション	5,300	1,138.00	6,031,400		
アスクル	6,100	3,400.00	20,740,000	貸付株式数	1,700株 (100株)
ゲオホールディングス	8,800	1,542.00	13,569,600	貸付株式数	2,700株
アダストリア	8,800	2,416.00	21,260,800		
くらコーポレーション	3,300	5,020.00	16,566,000		
キャンドウ	4,500	1,750.00	7,875,000	貸付株式数	1,300株
エレマテック	2,300	2,084.00	4,793,200		
パルグループHLDGS	3,100	3,560.00	11,036,000		
エディオン	21,000	1,058.00	22,218,000	貸付株式数	8,800株
あらた	3,000	4,775.00	14,325,000		
サーラコーポレーション	11,300	889.00	10,045,700		
ワッツ	5,200	1,257.00	6,536,400		
ハローズ	2,100	2,411.00	5,063,100		
J Pホールディングス	23,700	383.00	9,077,100	貸付株式数	6,600株 (2,000株)
あみやき亭	1,800	4,755.00	8,559,000		
ひらまつ	14,700	614.00	9,025,800	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
フィールズ	4,400	1,130.00	4,972,000	貸付株式数	1,200株
双日	309,300	307.00	94,955,100		
ゲンキー	2,500	4,585.00	11,462,500	貸付株式数	600株 (200株)

アルフレッサホールディングス	64,300	2,050.00	131,815,000	貸付株式数	1,300株
大黒天物産	1,600	5,260.00	8,416,000		
ハニーズホールディングス	6,900	1,257.00	8,673,300	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
キッコーマン	43,100	3,515.00	151,496,500		
味の素	129,300	2,169.50	280,516,350		
キューピー	32,000	2,661.00	85,152,000		
ハウス食品G本社	23,000	3,515.00	80,845,000		
カゴメ	22,400	3,460.00	77,504,000	貸付株式数	6,400株
アリアケジャパン	5,300	8,220.00	43,566,000	貸付株式数	1,400株
ニチレイ	29,900	2,890.00	86,411,000		
横浜冷凍	12,800	1,091.00	13,964,800	貸付株式数	4,000株 (3,900株)
東洋水産	30,300	4,160.00	126,048,000		
日清食品HD	24,500	7,020.00	171,990,000	貸付株式数	3,400株
永谷園ホールディングス	8,000	1,313.00	10,504,000		
フジッコ	6,000	2,735.00	16,410,000		
ロックフィールド	7,000	2,068.00	14,476,000		
日本たばこ産業	347,100	3,720.00	1,291,212,000		
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,801.00	11,204,000		
わらべや日洋HD	4,100	2,803.00	11,492,300		
ユーグレナ	22,300	1,143.00	25,488,900	貸付株式数	6,200株 (5,800株)
片倉工業	7,500	1,333.00	9,997,500		
グンゼ	46,000	535.00	24,610,000		
ヒューリック	115,600	1,048.00	121,148,800		
山下医科器械	4,000	1,707.00	6,828,000		
アルペン	3,800	2,202.00	8,367,600		
クオール	6,900	1,923.00	13,268,700		
アルコニックス	8,600	1,829.00	15,729,400	貸付株式数	1,900株
神戸物産	3,900	5,130.00	20,007,000		
ジンズ	4,000	6,670.00	26,680,000	貸付株式数	1,000株
ビックカメラ	31,700	1,301.00	41,241,700	貸付株式数	8,900株 (8,900株)
DCMホールディングス	32,800	1,024.00	33,587,200	貸付株式数	9,100株 (9,100株)
MonotaRO	20,100	3,495.00	70,249,500	貸付株式数	5,600株
あいホールディングス	8,200	2,810.00	23,042,000	貸付株式数	2,200株
ディービーエックス	5,400	1,448.00	7,819,200		
アークランドサービスHD	5,600	2,243.00	12,560,800	貸付株式数	1,200株
J. フロントリテイリング	69,800	1,497.00	104,490,600		
ドトール・日レスHD	9,400	2,409.00	22,644,600		
マツモトキヨシHLDGS	10,500	7,860.00	82,530,000		
ブロンコビリー	3,500	2,748.00	9,618,000	貸付株式数	900株 (900株)
スタートトゥデイ	49,400	3,605.00	178,087,000		
物語コーポレーション	2,000	7,180.00	14,360,000	貸付株式数	500株
ココカラファイン	5,800	6,340.00	36,772,000		

三越伊勢丹HD	110,400	1,150.00	126,960,000		
東洋紡	231,000	199.00	45,969,000		
ユニチカ	186,000	83.00	15,438,000		
富士紡ホールディングス	3,300	3,760.00	12,408,000		
日清紡ホールディングス	28,100	1,327.00	37,288,700		
倉敷紡績	60,000	293.00	17,580,000		
ダイワボウHD	52,000	445.00	23,140,000		
シキボウ	69,000	160.00	11,040,000		
日東紡績	48,000	653.00	31,344,000		
トヨタ紡織	19,200	2,303.00	44,217,600		
マクニカ・富士エレHLDGS	10,300	2,029.00	20,898,700		
ウエルシアHD	15,300	4,515.00	69,079,500		
クリエイトSDH	8,100	3,005.00	24,340,500		
バイタルKSKHD	9,500	941.00	8,939,500		
UKCホールディングス	4,600	1,933.00	8,891,800		
丸善CHI HD	16,700	352.00	5,878,400		
TOKAIホールディングス	25,100	847.00	21,259,700	貸付株式数	6,800株
三洋貿易	4,700	2,623.00	12,328,100		
チムニー	1,300	2,913.00	3,786,900	貸付株式数	500株
ウイン・パートナーズ	6,300	1,479.00	9,317,700		
ジョイフル本田	9,200	2,929.00	26,946,800	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
鳥貴族	3,000	3,270.00	9,810,000	貸付株式数	700株
すかいらく	34,000	1,628.00	55,352,000	貸付株式数	2,800株
綿半ホールディングス	3,600	2,464.00	8,870,400	貸付株式数	900株 (900株)
日本毛織	15,500	992.00	15,376,000		
ダイドーリミテッド	20,800	440.00	9,152,000		
ユナイテッド・スーパーマ ーケ	18,900	1,079.00	20,393,100	貸付株式数	5,100株
野村不動産HLDGS	39,300	2,237.00	87,914,100		
三重交通グループHD	9,900	446.00	4,415,400		
サムティ	6,200	1,683.00	10,434,600	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本商業開発	4,700	1,760.00	8,272,000	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
プレサンスコーポレーション	9,700	1,539.00	14,928,300		
ユニゾホールディングス	5,500	2,599.00	14,294,500		
日本管理センター	4,600	1,500.00	6,900,000	貸付株式数	1,200株 (700株)
フージャースHD	10,900	1,149.00	12,524,100		
オープンハウス	9,400	3,535.00	33,229,000	貸付株式数	100株
東急不動産HD	129,300	657.00	84,950,100		
飯田GHD	45,400	1,944.00	88,257,600	貸付株式数	12,800株
帝国繊維	6,600	2,321.00	15,318,600	貸付株式数	1,600株
ブックオフコーポレーション	11,700	805.00	9,418,500	貸付株式数	2,400株
日本コークス工業	65,300	112.00	7,313,600		
あさひ	4,900	1,276.00	6,252,400	貸付株式数	1,300株
日本調剤	2,100	3,625.00	7,612,500	貸付株式数	500株

				(100株)
コスモス薬品	2,800	26,190.00	73,332,000	
シップヘルスケアHD	10,200	3,585.00	36,567,000	
一六堂	17,100	414.00	7,079,400	
ソフトクリエイトHD	5,300	1,495.00	7,923,500	
セブン&アイ・HLDGS	231,000	4,407.00	1,018,017,000	
薬王堂	3,600	2,972.00	10,699,200	貸付株式数 800株
クリエイト・レストランツ・ホール	17,000	1,193.00	20,281,000	貸付株式数 4,300株
ツルハホールディングス	11,200	13,560.00	151,872,000	
サンマルクホールディングス	3,600	3,310.00	11,916,000	
トリドールホールディングス	7,200	3,535.00	25,452,000	
帝人	46,800	2,291.00	107,218,800	
東レ	423,500	1,085.50	459,709,250	
クラレ	98,000	2,128.00	208,544,000	
旭化成	365,000	1,399.00	510,635,000	
サカイオーベックス	3,800	2,365.00	8,987,000	
稲葉製作所	4,300	1,403.00	6,032,900	貸付株式数 1,200株
宮地エンジニアリングG	24,000	312.00	7,488,000	
トーカロ	4,300	4,330.00	18,619,000	
SUMCO	52,000	1,708.00	88,816,000	貸付株式数 17,200株
川田テクノロジーズ	1,400	6,050.00	8,470,000	貸付株式数 300株 (300株)
住江織物	22,000	345.00	7,590,000	
アツギ	76,000	127.00	9,652,000	
コマダホールディングス	10,400	1,879.00	19,541,600	貸付株式数 2,800株
ダイユー・リックHLDGS	9,400	859.00	8,074,600	
クスリのアオキHLDGS	4,600	6,810.00	31,326,000	
共和レザー	6,200	941.00	5,834,200	
セーレン	15,500	2,043.00	31,666,500	
ソトー	6,800	1,158.00	7,874,400	
東海染工	51,000	141.00	7,191,000	
小松精練	10,600	896.00	9,497,600	
ワコールホールディングス	33,000	1,622.00	53,526,000	
ホギメディカル	3,600	8,200.00	29,520,000	貸付株式数 1,000株
T S Iホールディングス	25,400	826.00	20,980,400	
T I S	18,500	3,165.00	58,552,500	
電算システム	3,300	1,940.00	6,402,000	
グリー	38,100	767.00	29,222,700	
コーエーテクモHD	13,100	2,267.00	29,697,700	
三菱総合研究所	2,600	3,250.00	8,450,000	
ファインデックス	5,600	838.00	4,692,800	貸付株式数 1,700株
KL a b	11,100	1,750.00	19,425,000	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
ポールトゥウィン・ピットクル	5,800	1,542.00	8,943,600	
ネクソン	61,300	2,943.00	180,405,900	
アイスタイル	14,500	655.00	9,497,500	貸付株式数 1,300株
エイチーム	5,000	3,065.00	15,325,000	貸付株式数 300株
テクノスジャパン	6,100	1,058.00	6,453,800	貸付株式数 1,300株

コロプラ	17,900	1,273.00	22,786,700	貸付株式数	4,500株 (4,500株)
ブロードリーフ	15,300	874.00	13,372,200		
ハーツユニテッドグループ	4,200	1,475.00	6,195,000	貸付株式数	1,100株
特種東海製紙	3,100	4,580.00	14,198,000		
ティーガイア	5,700	2,105.00	11,998,500	貸付株式数	1,500株
豆蔵ホールディングス	7,200	1,123.00	8,085,600		
テクマトリックス	4,600	1,551.00	7,134,600	貸付株式数	1,200株
ガンホー・オンライン・エンター	150,500	302.00	45,451,000	貸付株式数	42,200株
GMOペイメントゲートウェイ	4,200	7,170.00	30,114,000	貸付株式数	1,300株
インターネットイニシアティブ	9,100	2,130.00	19,383,000		
さくらインターネット	6,000	869.00	5,214,000	貸付株式数	1,300株
SRAホールディングス	3,500	2,929.00	10,251,500		
朝日ネット	17,600	532.00	9,363,200		
コムチュア	1,700	5,800.00	9,860,000	貸付株式数	300株
王子ホールディングス	223,000	595.00	132,685,000		
日本製紙	25,600	2,078.00	53,196,800	貸付株式数	7,100株
三菱製紙	11,200	747.00	8,366,400		
北越紀州製紙	32,900	692.00	22,766,800	貸付株式数	8,900株
中越パルプ	26,000	227.00	5,902,000		
巴川製紙	24,000	345.00	8,280,000		
大王製紙	23,000	1,330.00	30,590,000	貸付株式数	6,700株 (6,500株)
gumi	7,000	1,091.00	7,637,000	貸付株式数	1,900株
LINE	15,800	3,950.00	62,410,000	貸付株式数	4,400株
レンゴー	53,400	640.00	34,176,000		
トーモク	19,000	392.00	7,448,000		
ザ・パック	4,400	4,010.00	17,644,000		
昭和電工	39,800	3,365.00	133,927,000		
住友化学	430,000	707.00	304,010,000		
住友精化	2,600	5,230.00	13,598,000		
日産化学	31,700	4,080.00	129,336,000		
ラサ工業	57,000	211.00	12,027,000		
クレハ	4,300	5,750.00	24,725,000	貸付株式数	1,200株
テイカ	11,000	1,028.00	11,308,000		
石原産業	11,600	1,550.00	17,980,000		
日東エフシー	6,000	878.00	5,268,000		
日本曹達	35,000	672.00	23,520,000		
東ソー	171,000	1,296.00	221,616,000		
トクヤマ	94,000	519.00	48,786,000		
セントラル硝子	57,000	506.00	28,842,000		
東亜合成	33,200	1,456.00	48,339,200		
大阪ソーダ	25,000	573.00	14,325,000		
関東電化	12,600	1,138.00	14,338,800	貸付株式数	3,400株
デンカ	111,000	733.00	81,363,000		
イビデン	39,100	1,815.00	70,966,500		
信越化学	105,300	10,160.00	1,069,848,000		

日本カーバイド	36,000	239.00	8,604,000	
堺化学	20,000	551.00	11,020,000	
エア・ウォーター	46,800	2,060.00	96,408,000	
大陽日酸	44,500	1,284.00	57,138,000	
日本化学工業	31,000	268.00	8,308,000	
日本パーカライジング	29,600	1,750.00	51,800,000	
高压ガス	9,200	844.00	7,764,800	
四国化成	9,000	1,635.00	14,715,000	
戸田工業	17,000	523.00	8,891,000	
ステラ ケミフア	3,100	5,050.00	15,655,000	
保土谷化学	2,300	8,630.00	19,849,000	貸付株式数 600株 (600株)
日本触媒	9,100	8,190.00	74,529,000	
大日精化	24,000	1,094.00	26,256,000	
カネカ	76,000	869.00	66,044,000	貸付株式数 21,000株
協和発酵キリン	70,000	1,864.00	130,480,000	
三菱瓦斯化学	54,900	2,740.00	150,426,000	
三井化学	265,000	695.00	184,175,000	
JSR	58,400	2,163.00	126,319,200	
東京応化工業	10,900	4,150.00	45,235,000	
大阪有機化学	6,600	1,404.00	9,266,400	
三菱ケミカルHLDGS	395,100	1,081.50	427,300,650	
ダイセル	78,800	1,382.00	108,901,600	
住友ベークライト	51,000	835.00	42,585,000	
積水化学	129,300	2,199.00	284,330,700	
日本ゼオン	50,000	1,450.00	72,500,000	貸付株式数 14,000株 (14,000株)
アイカ工業	18,200	3,685.00	67,067,000	
宇部興産	295,000	333.00	98,235,000	
積水樹脂	8,400	2,116.00	17,774,400	貸付株式数 700株
タキロンシーアイ	13,000	681.00	8,853,000	
旭有機材	31,000	293.00	9,083,000	
日立化成	32,400	3,240.00	104,976,000	
ニチバン	7,000	1,151.00	8,057,000	
リケンテクノス	13,600	653.00	8,880,800	貸付株式数 3,800株
大倉工業	18,000	805.00	14,490,000	
積水化成成品	8,900	1,282.00	11,409,800	
群栄化学	1,900	3,710.00	7,049,000	
タイガース ポリマー	6,200	788.00	4,885,600	
ダイキョーニシカワ	10,400	1,738.00	18,075,200	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
日本化薬	37,000	1,816.00	67,192,000	
カーリットホールディングス	16,100	741.00	11,930,100	
EPSホールディングス	8,300	2,107.00	17,488,100	
プレステージ・インター	13,200	1,136.00	14,995,200	
アミューズ	3,900	2,784.00	10,857,600	貸付株式数 100株
野村総合研究所	41,500	4,215.00	174,922,500	
ドリームインキュベータ	2,700	2,171.00	5,861,700	貸付株式数 200株
クイック	5,100	1,838.00	9,373,800	
ケネディクス	76,400	570.00	43,548,000	貸付株式数 21,300株

電通	65,100	4,715.00	306,946,500	貸付株式数	18,800株 (18,800株)
インテージホールディングス	3,900	2,852.00	11,122,800		
イオンファンタジー	2,100	3,785.00	7,948,500		
シーティーエス	9,800	753.00	7,379,400		
日本精化	8,300	946.00	7,851,800		
扶桑化学工業	4,800	3,530.00	16,944,000		
ADEKA	22,800	1,958.00	44,642,400		
日油	45,000	1,627.00	73,215,000		
ミヨシ油脂	6,700	1,443.00	9,668,100		
花王	137,600	6,844.00	941,734,400		
第一工業製薬	19,000	682.00	12,958,000		
三洋化成	3,200	6,370.00	20,384,000		
武田薬品	219,700	6,191.00	1,360,162,700		
アステラス製薬	572,700	1,466.00	839,578,200		
大日本住友製薬	40,300	1,479.00	59,603,700	貸付株式数	11,700株
塩野義製薬	74,300	5,959.00	442,753,700		
田辺三菱製薬	68,500	2,707.00	185,429,500		
あすか製薬	6,700	1,730.00	11,591,000		
日本新薬	13,700	7,950.00	108,915,000		
中外製薬	59,000	4,660.00	274,940,000		
科研製薬	10,900	5,830.00	63,547,000		
エーザイ	72,200	5,869.00	423,741,800		
理研ビタミン	1,900	4,345.00	8,255,500		
ロート製薬	28,900	2,630.00	76,007,000		
小野薬品	133,400	2,430.00	324,162,000		
久光製薬	16,400	5,350.00	87,740,000	貸付株式数	4,500株
持田製薬	3,600	8,400.00	30,240,000		
参天製薬	105,800	1,803.00	190,757,400		
扶桑薬品	2,700	2,773.00	7,487,100		
日本ケミファ	1,600	5,090.00	8,144,000		
ツムラ	20,100	4,015.00	80,701,500		
日医工	13,600	1,695.00	23,052,000	貸付株式数	3,900株
テルモ	85,300	4,525.00	385,982,500		
みらかホールディングス	14,600	5,100.00	74,460,000		
キッセイ薬品工業	10,200	2,874.00	29,314,800		
生化学工業	10,900	1,959.00	21,353,100		
栄研化学	5,200	4,150.00	21,580,000	貸付株式数	1,300株
日水製薬	4,200	1,419.00	5,959,800		
鳥居薬品	3,900	2,960.00	11,544,000		
JCRファーマ	4,800	3,060.00	14,688,000	貸付株式数	1,300株
東和薬品	2,800	5,240.00	14,672,000		
富士製薬工業	2,700	3,925.00	10,597,500		
沢井製薬	9,600	6,180.00	59,328,000	貸付株式数	2,200株
ゼリア新薬工業	12,500	2,023.00	25,287,500		
第一三共	171,800	2,610.00	448,398,000		
キョーリン製薬HD	13,600	2,243.00	30,504,800		
大幸薬品	4,500	2,276.00	10,242,000		
ダイト	3,900	2,877.00	11,220,300		
大塚ホールディングス	116,300	4,378.00	509,161,400		

大正製薬HD	12,100	8,690.00	105,149,000	
ペプチドリーム	22,500	3,525.00	79,312,500	貸付株式数 5,600株
大日本塗料	37,000	346.00	12,802,000	
日本ペイントHOLD	45,700	3,910.00	178,687,000	貸付株式数 12,700株
関西ペイント	61,600	2,822.00	173,835,200	
中国塗料	15,800	930.00	14,694,000	
日本特殊塗料	5,000	1,924.00	9,620,000	貸付株式数 400株
藤倉化成	9,800	659.00	6,458,200	
太陽ホールディングス	4,800	5,380.00	25,824,000	
D I C	23,000	4,000.00	92,000,000	
サカタインクス	12,400	2,042.00	25,320,800	
東洋インキSCホールディン	47,000	638.00	29,986,000	
T&K TOKA	5,300	1,282.00	6,794,600	
アルプス技研	3,100	3,650.00	11,315,000	貸付株式数 200株
オリエンタルランド	63,300	8,501.00	538,113,300	貸付株式数 17,600株
ダスキン	14,400	3,100.00	44,640,000	
パーク24	30,900	2,717.00	83,955,300	貸付株式数 8,500株
明光ネットワークジャパン	7,900	1,497.00	11,826,300	
ファルコホールディングス	6,600	1,640.00	10,824,000	
フジ・メディア・HD	56,400	1,571.00	88,604,400	貸付株式数 16,100株
ラウンドワン	19,500	1,293.00	25,213,500	
リゾートトラスト	22,700	2,013.00	45,695,100	
オービック	19,200	6,940.00	133,248,000	
ジャストシステム	10,100	2,380.00	24,038,000	
TDCソフトウェアエンジニア	5,400	1,148.00	6,199,200	
ヤフー	405,400	506.00	205,132,400	貸付株式数 114,100株
ビー・エム・エル	7,500	2,399.00	17,992,500	
トレンドマイクロ	27,000	5,610.00	151,470,000	
りらいあコミュニケーション	10,700	1,319.00	14,113,300	貸付株式数 2,800株
リソー教育	12,900	837.00	10,797,300	
日本オラクル	8,900	8,200.00	72,980,000	
フューチャー	10,300	944.00	9,723,200	
CAC HOLDINGS	6,000	1,048.00	6,288,000	貸付株式数 1,200株
ソフトバンク・テクノ	4,000	1,801.00	7,204,000	貸付株式数 1,000株 (600株)
ユー・エス・エス	70,800	2,240.00	158,592,000	
オービックビジネスC	2,900	5,630.00	16,327,000	貸付株式数 100株
伊藤忠テクノソリューション	12,900	4,060.00	52,374,000	
アイティフォー	14,200	619.00	8,789,800	
サイバーエージェント	36,000	3,350.00	120,600,000	
楽天	276,300	1,250.00	345,375,000	貸付株式数 2,100株
テー・オー・ダブリュー	8,900	825.00	7,342,500	
大塚商会	16,800	7,080.00	118,944,000	
総合メディカル	3,000	5,320.00	15,960,000	
サイボウズ	14,200	513.00	7,284,600	
ソフトブレーン	8,000	413.00	3,304,000	貸付株式数 2,400株
セントラルスポーツ	3,200	4,085.00	13,072,000	
パラカ	3,500	2,474.00	8,659,000	貸付株式数 700株
電通国際情報S	4,200	2,517.00	10,571,400	

デジタルガレージ	11,300	2,215.00	25,029,500	
ウェザーニューズ	2,600	3,530.00	9,178,000	貸付株式数 700株 (700株)
C I J	16,400	633.00	10,381,200	
WOWOW	3,400	3,720.00	12,648,000	貸付株式数 900株
フルキャストホールディングス	6,000	1,933.00	11,598,000	
富士フイルムHLDGS	114,800	4,383.00	503,168,400	
コニカミノルタ	129,200	930.00	120,156,000	
資生堂	105,100	4,590.00	482,409,000	
ライオン	78,900	2,168.00	171,055,200	貸付株式数 5,200株
高砂香料	4,000	3,840.00	15,360,000	貸付株式数 600株
マンダム	5,800	6,360.00	36,888,000	
ミルボン	4,100	6,700.00	27,470,000	
ファンケル	13,200	2,431.00	32,089,200	
コーセー	9,600	13,670.00	131,232,000	
シーズ・ホールディングス	8,100	3,850.00	31,185,000	
ポーラ・オルビスHD	24,800	3,505.00	86,924,000	貸付株式数 6,700株
ノエビアホールディングス	4,200	6,390.00	26,838,000	
コニシ	9,500	1,997.00	18,971,500	
長谷川香料	7,300	2,163.00	15,789,900	
星光PMC	4,400	1,209.00	5,319,600	貸付株式数 1,200株 (200株)
小林製薬	15,900	6,630.00	105,417,000	
荒川化学工業	5,600	2,748.00	15,388,800	
メック	6,300	1,848.00	11,642,400	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	4,300	2,749.00	11,820,700	
タカラバイオ	17,100	1,527.00	26,111,700	貸付株式数 4,400株
JCU	4,300	4,915.00	21,134,500	
新田ゼラチン	8,200	756.00	6,199,200	貸付株式数 800株
デクセリアルズ	16,000	1,479.00	23,664,000	
アース製薬	4,300	5,130.00	22,059,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
北興化学	12,900	697.00	8,991,300	
大成ラミック	3,300	2,965.00	9,784,500	
クミアイ化学	26,300	781.00	20,540,300	貸付株式数 7,300株 (3,700株)
日本農薬	15,600	651.00	10,155,600	貸付株式数 4,200株 (100株)
昭和シェル石油	51,500	1,221.00	62,881,500	
ニチレキ	9,200	1,369.00	12,594,800	貸付株式数 300株
ユシロ化学	4,700	1,633.00	7,675,100	
富士石油	18,900	420.00	7,938,000	
MORESCO	4,200	2,153.00	9,042,600	
出光興産	36,500	2,875.00	104,937,500	
JXTGホールディングス	889,300	565.70	503,077,010	
コスモエネルギーHLDGS	17,700	2,399.00	42,462,300	貸付株式数 4,800株
横浜ゴム	32,500	2,245.00	72,962,500	
東洋ゴム	33,800	2,393.00	80,883,400	

ブリヂストン	197,700	5,025.00	993,442,500	
住友ゴム	54,400	1,985.00	107,984,000	貸付株式数 15,200株 (15,000株)
藤倉ゴム	10,700	942.00	10,079,400	
オカモト	19,000	1,173.00	22,287,000	
アキレス	5,100	2,263.00	11,541,300	
ニッタ	5,000	4,035.00	20,175,000	
住友理工	9,400	1,098.00	10,321,200	
三ツ星ベルト	14,000	1,345.00	18,830,000	
バンドー化学	9,200	1,198.00	11,021,600	
旭硝子	57,100	4,165.00	237,821,500	
日本板硝子	25,900	850.00	22,015,000	貸付株式数 7,200株
有沢製作所	12,700	1,032.00	13,106,400	
日本山村硝子	41,000	198.00	8,118,000	
日本電気硝子	24,300	4,250.00	103,275,000	
住友大阪セメント	109,000	500.00	54,500,000	
太平洋セメント	356,000	439.00	156,284,000	
日本ヒューム	10,300	679.00	6,993,700	
日本コンクリート	17,500	443.00	7,752,500	
アジアパイルHD	10,800	591.00	6,382,800	
東海カーボン	53,000	900.00	47,700,000	
日本カーボン	3,300	4,200.00	13,860,000	貸付株式数 300株
東洋炭素	4,000	2,686.00	10,744,000	
ノリタケ	3,600	5,580.00	20,088,000	
TOTO	42,900	4,415.00	189,403,500	
日本碍子	73,100	2,124.00	155,264,400	
日本特殊陶業	50,200	2,225.00	111,695,000	
MARUWA	2,400	6,340.00	15,216,000	
品川リフラクトリーズ	16,000	369.00	5,904,000	
黒崎播磨	16,000	541.00	8,656,000	
フジインコーポレーテッド	5,400	2,690.00	14,526,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ニチアス	32,000	1,330.00	42,560,000	
新日鐵住金	263,100	2,712.00	713,527,200	
神戸製鋼所	101,100	1,343.00	135,777,300	貸付株式数 10,000株
中山製鋼所	6,400	741.00	4,742,400	
合同製鐵	3,900	2,129.00	8,303,100	
JFEホールディングス	159,800	2,235.50	357,232,900	
日新製鋼	18,200	1,421.00	25,862,200	
東京製鐵	31,700	978.00	31,002,600	
共英製鋼	6,600	1,679.00	11,081,400	貸付株式数 1,800株
大和工業	11,300	3,185.00	35,990,500	
東京鐵鋼	18,000	435.00	7,830,000	
大阪製鐵	3,600	2,496.00	8,985,600	
淀川製鋼所	7,600	3,085.00	23,446,000	
東洋鋼板	16,000	545.00	8,720,000	
丸一鋼管	18,700	3,295.00	61,616,500	
大同特殊鋼	99,000	655.00	64,845,000	
日本高周波	64,000	115.00	7,360,000	
日本冶金工	56,800	226.00	12,836,800	

山陽特殊製鋼	36,000	575.00	20,700,000	
愛知製鋼	3,000	4,430.00	13,290,000	
日立金属	59,800	1,548.00	92,570,400	
大太平洋金属	43,000	312.00	13,416,000	
新日本電工	37,500	472.00	17,700,000	貸付株式数 10,000株
栗本鉄工所	3,100	2,333.00	7,232,300	
日本鑄鉄管	25,000	181.00	4,525,000	
日本製鋼所	19,000	2,615.00	49,685,000	
三菱製鋼	46,000	291.00	13,386,000	
大紀アルミニウム	15,000	818.00	12,270,000	
日本軽金属HD	146,200	331.00	48,392,200	
三井金属	163,000	596.00	97,148,000	
東邦亜鉛	37,000	490.00	18,130,000	
三菱マテリアル	36,400	3,970.00	144,508,000	
住友鋁山	152,000	1,956.00	297,312,000	
DOWAホールディングス	64,000	823.00	52,672,000	
古河機金	92,000	195.00	17,940,000	
大阪チタニウム	7,400	1,600.00	11,840,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
東邦チタニウム	11,500	812.00	9,338,000	貸付株式数 3,100株 (200株)
UACJ	83,000	323.00	26,809,000	
古河電工	19,900	6,290.00	125,171,000	
住友電工	219,600	1,775.00	389,790,000	
フジクラ	78,000	925.00	72,150,000	
昭和電線HLDGS	96,000	105.00	10,080,000	
タツタ電線	15,000	857.00	12,855,000	
リョービ	34,000	602.00	20,468,000	
アーレステイ	8,000	914.00	7,312,000	
アサヒHD	8,700	2,318.00	20,166,600	
東洋製罐グループHD	39,300	1,909.00	75,023,700	
ホッカンホールディングス	18,000	422.00	7,596,000	
横河ブリッジHLDGS	10,500	2,107.00	22,123,500	
OSJB HD	27,800	324.00	9,007,200	貸付株式数 7,600株
駒井ハルテック	2,500	2,339.00	5,847,500	
三和ホールディングス	57,500	1,277.00	73,427,500	
文化シヤッター	15,900	900.00	14,310,000	
三協立山	8,400	1,548.00	13,003,200	
アルインコ	6,400	1,286.00	8,230,400	
LIXILグループ	82,000	3,055.00	250,510,000	
ノーリツ	11,900	1,965.00	23,383,500	貸付株式数 1,000株
長府製作所	5,700	2,700.00	15,390,000	
リンナイ	10,000	9,700.00	97,000,000	
ユニプレス	10,500	2,904.00	30,492,000	
岡部	11,600	1,026.00	11,901,600	貸付株式数 600株
ジーテクト	6,100	2,221.00	13,548,100	
東プレ	10,900	3,345.00	36,460,500	
高周波熱錬	11,200	1,120.00	12,544,000	
東京製鋼	4,800	1,664.00	7,987,200	貸付株式数 1,300株
パイオラックス	9,500	2,895.00	27,502,500	

日本発条	52,900	1,185.00	62,686,500	貸付株式数	14,900株
三浦工業	23,900	2,622.00	62,665,800		
タクマ	19,700	1,362.00	26,831,400		
テクノプロ・ホールディング	10,000	5,280.00	52,800,000		
ジャパンマテリアル	4,500	2,941.00	13,234,500	貸付株式数	1,400株 (600株)
ベクトル	6,200	1,530.00	9,486,000	貸付株式数	1,500株
アサンテ	4,200	1,870.00	7,854,000		
N・フィールド	4,500	1,645.00	7,402,500	貸付株式数	1,200株
リクルートホールディングス	385,700	2,460.00	948,822,000		
ツガミ	18,000	1,018.00	18,324,000		
オークマ	38,000	1,126.00	42,788,000		
東芝機械	31,000	604.00	18,724,000		
アマダホールディングス	77,200	1,242.00	95,882,400		
アイダエンジニア	16,100	1,300.00	20,930,000		
滝澤鉄工所	56,000	201.00	11,256,000		
富士機械製造	18,500	2,083.00	38,535,500	貸付株式数	4,900株
牧野フライス	30,000	965.00	28,950,000	貸付株式数	8,000株 (8,000株)
オーエスジー	24,400	2,495.00	60,878,000	貸付株式数	7,600株 (7,600株)
旭ダイヤモンド	16,700	1,132.00	18,904,400		
DMG森精機	30,900	1,940.00	59,946,000		
ソデイツク	16,600	1,409.00	23,389,400		
ディスコ	7,000	23,200.00	162,400,000		
日東工器	3,400	2,736.00	9,302,400		
日本郵政	149,800	1,420.00	212,716,000	貸付株式数	41,900株
ベルシステム24HLDGS	10,100	1,184.00	11,958,400	貸付株式数	2,800株
豊田自動織機	51,000	6,280.00	320,280,000		
OKK	59,000	132.00	7,788,000		
島精機製作所	8,000	5,400.00	43,200,000	貸付株式数	2,100株
フリー	4,500	1,085.00	4,882,500		
日阪製作所	9,300	984.00	9,151,200		
やまびこ	11,300	1,438.00	16,249,400		
ペガサスミシン製造	9,600	754.00	7,238,400		
ナブテスコ	30,000	4,300.00	129,000,000	貸付株式数	8,400株
三井海洋開発	6,100	2,526.00	15,408,600	貸付株式数	1,600株
レオン自動機	6,900	1,418.00	9,784,200	貸付株式数	1,600株
SMC	17,600	40,100.00	705,760,000	貸付株式数	1,800株
新川	8,200	770.00	6,314,000		
ホソカワミクロン	2,600	6,120.00	15,912,000		
ユニオンツール	2,900	3,570.00	10,353,000	貸付株式数	800株
オイレス工業	6,600	2,042.00	13,477,200	貸付株式数	600株
サトーホールディングス	7,700	2,685.00	20,674,500	貸付株式数	2,100株
日精樹脂工業	6,500	1,429.00	9,288,500		
小松製作所	270,600	3,168.00	857,260,800		
住友重機械	170,000	893.00	151,810,000		
日立建機	26,200	3,235.00	84,757,000		
巴工業	4,800	1,919.00	9,211,200		
井関農機	5,500	2,442.00	13,431,000		

TOWA	5,600	1,764.00	9,878,400	貸付株式数	100株
丸山製作所	4,600	1,805.00	8,303,000		
北川鉄工所	3,400	2,636.00	8,962,400		
シンニッタン	8,800	741.00	6,520,800		
ローツェ	3,300	2,351.00	7,758,300	貸付株式数	800株 (200株)
クボタ	301,600	2,014.00	607,422,400	貸付株式数	78,100株
東洋エンジニア	37,000	284.00	10,508,000		
三菱化工機	36,000	262.00	9,432,000		
月島機械	10,800	1,412.00	15,249,600		
帝国電機製作所	6,600	1,188.00	7,840,800		
新東工業	14,200	1,234.00	17,522,800		
渋谷工業	5,300	3,605.00	19,106,500		
アイチ コーポレーション	9,700	766.00	7,430,200	貸付株式数	2,500株
小森コーポレーション	14,300	1,396.00	19,962,800		
鶴見製作所	4,900	2,064.00	10,113,600		
住友精密	19,000	351.00	6,669,000		
荏原製作所	26,100	3,655.00	95,395,500		
西島製作所	6,400	1,190.00	7,616,000		
北越工業	10,000	1,085.00	10,850,000		
千代田化工建	44,000	612.00	26,928,000	貸付株式数	12,000株
ダイキン工業	76,300	11,315.00	863,334,500		
オルガノ	16,000	590.00	9,440,000		
トーヨーカネツ	31,000	390.00	12,090,000		
栗田工業	31,300	3,250.00	101,725,000		
椿本チエイン	31,000	896.00	27,776,000		
日 機 装	20,000	1,028.00	20,560,000	貸付株式数	1,000株
新興プランテック	13,800	978.00	13,496,400		
アネスト岩田	10,800	1,054.00	11,383,200		
ダイフク	28,300	5,580.00	157,914,000		
加藤製作所	3,600	3,320.00	11,952,000		
油研工業	36,000	255.00	9,180,000		
タダノ	29,800	1,335.00	39,783,000		
フジテック	16,200	1,574.00	25,498,800	貸付株式数	4,600株
CKD	17,400	2,177.00	37,879,800		
キトー	8,100	1,289.00	10,440,900		
平和	17,100	2,157.00	36,884,700	貸付株式数	4,800株
理想科学工業	5,500	2,057.00	11,313,500		
SANKYO	14,300	3,505.00	50,121,500		
日本金銭機械	6,500	1,148.00	7,462,000	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
マースエンジニアリング	3,500	2,311.00	8,088,500		
福島工業	3,700	4,220.00	15,614,000		
ダイコク電機	3,300	1,672.00	5,517,600		
竹内製作所	10,700	2,294.00	24,545,800	貸付株式数	2,700株
ア マ ノ	17,100	2,647.00	45,263,700		
JUKI	8,900	1,581.00	14,070,900		
サンデンホールディングス	41,000	430.00	17,630,000		
蛇の目ミシン	7,500	765.00	5,737,500		
ブラザー工業	68,800	2,634.00	181,219,200		

マックス	10,000	1,540.00	15,400,000		
モリタホールディングス	10,400	1,749.00	18,189,600	貸付株式数	1,700株
グローリー	17,100	3,980.00	68,058,000		
新晃工業	6,200	1,769.00	10,967,800		
大和冷機工業	10,200	1,234.00	12,586,800		
セガサミーホールディングス	55,300	1,507.00	83,337,100		
日本ピストンリング	4,000	2,366.00	9,464,000		
リケン	2,800	5,590.00	15,652,000		
T P R	6,400	3,590.00	22,976,000		
ツバキ・ナカシマ	6,300	2,569.00	16,184,700	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,700	10,140.00	179,478,000	貸付株式数	4,900株
大豊工業	5,200	1,693.00	8,803,600		
日本精工	115,600	1,462.00	169,007,200	貸付株式数	33,100株 (33,100株)
N T N	129,000	470.00	60,630,000		
ジェイテクト	57,600	1,531.00	88,185,600		
不二越	53,000	628.00	33,284,000	貸付株式数	14,000株
ミネベアミツミ	103,300	1,899.00	196,166,700		
日本トムソン	20,100	634.00	12,743,400		
T H K	39,600	3,875.00	153,450,000		
ユーシン精機	3,300	3,045.00	10,048,500	貸付株式数	900株 (800株)
イーグル工業	6,300	2,063.00	12,996,900		
日本ピラー工業	7,000	1,627.00	11,389,000		
キッツ	28,800	888.00	25,574,400		
日立	1,342,000	793.10	1,064,340,200		
三菱電機	595,000	1,755.00	1,044,225,000		
富士電機	167,000	628.00	104,876,000		
東洋電機製造	3,800	2,365.00	8,987,000	貸付株式数	1,300株
安川電機	65,200	3,610.00	235,372,000	貸付株式数	18,200株
シンフォニアテクノロジー	42,000	507.00	21,294,000		
明電舎	51,000	403.00	20,553,000	貸付株式数	14,000株
山洋電気	16,000	1,346.00	21,536,000		
デンヨー	5,600	2,035.00	11,396,000		
三桜工業	10,300	905.00	9,321,500		
マキタ	73,100	4,625.00	338,087,500		
東芝テック	35,000	625.00	21,875,000		
芝浦メカトロニクス	19,000	351.00	6,669,000		
マブチモーター	15,400	5,500.00	84,700,000		
日本電産	72,600	13,740.00	997,524,000		
東光高岳	3,800	2,011.00	7,641,800		
ダブル・スコープ	8,400	2,433.00	20,437,200	貸付株式数	2,300株 (100株)
ダイヘン	32,000	986.00	31,552,000		
田淵電機	16,000	287.00	4,592,000	貸付株式数	5,700株 (600株)
JVCケンウッド	43,900	318.00	13,960,200		
日新電機	11,400	1,388.00	15,823,200		
大崎電気	12,000	836.00	10,032,000		

オムロン	59,400	5,870.00	348,678,000	貸付株式数	100株 (100株)
日東工業	7,600	2,017.00	15,329,200		
I D E C	9,600	2,341.00	22,473,600		
ジーエス・ユアサ コーポ	106,000	582.00	61,692,000		
サクサホールディングス	28,000	213.00	5,964,000		
メルコホールディングス	3,300	3,685.00	12,160,500	貸付株式数	1,000株
日本電気	762,000	299.00	227,838,000		
富士通	541,000	846.10	457,740,100		
沖電気	23,900	1,504.00	35,945,600		
電気興業	17,000	580.00	9,860,000		
サンケン電気	34,000	582.00	19,788,000		
アイホン	4,200	1,813.00	7,614,600	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
ルネサスエレクトロニクス	31,000	1,290.00	39,990,000	貸付株式数	8,700株
セイコーエプソン	83,700	2,823.00	236,285,100	貸付株式数	200株
ワコム	44,700	521.00	23,288,700	貸付株式数	15,100株 (15,100株)
アルバック	9,700	6,670.00	64,699,000		
アクセル	4,900	766.00	3,753,400		
E I Z O	5,800	4,505.00	26,129,000		
ジャパンディスプレイ	108,200	198.00	21,423,600	貸付株式数	32,000株 (31,700株)
日本信号	15,400	1,232.00	18,972,800	貸付株式数	4,600株
京三製作所	20,000	560.00	11,200,000	貸付株式数	5,000株
能美防災	6,500	1,697.00	11,030,500		
ホーチキ	5,100	2,118.00	10,801,800		
エレコム	5,200	2,245.00	11,674,000	貸付株式数	1,400株
日本無線	3,500	1,671.00	5,848,500		
パナソニック	642,100	1,651.50	1,060,428,150		
アンリツ	42,100	889.00	37,426,900		
富士通ゼネラル	19,500	2,275.00	44,362,500		
日立国際電気	14,700	2,974.00	43,717,800	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
ソニー	395,200	4,294.00	1,696,988,800		
T D K	31,100	7,520.00	233,872,000		
帝国通信工業	30,000	230.00	6,900,000		
タムラ製作所	25,000	632.00	15,800,000		
アルプス電気	51,800	3,035.00	157,213,000		
パイオニア	83,300	206.00	17,159,800	貸付株式数	24,000株
日本電波工業	7,400	848.00	6,275,200		
日本トリム	1,400	4,665.00	6,531,000	貸付株式数	400株 (200株)
ローランド ディー. ジー.	3,500	2,774.00	9,709,000		
フオスター電機	6,900	2,329.00	16,070,100	貸付株式数	1,800株
クラリオン	31,000	438.00	13,578,000		
S M K	17,000	490.00	8,330,000		
ヨコオ	6,300	1,449.00	9,128,700	貸付株式数	1,500株
ホシデン	17,200	1,825.00	31,390,000		
ヒロセ電機	9,000	16,030.00	144,270,000		

日本航空電子	16,000	1,823.00	29,168,000	
T O A	7,000	1,210.00	8,470,000	
日立マクセル	8,500	2,538.00	21,573,000	
古野電気	8,800	694.00	6,107,200	
ユニデンホールディングス	30,000	287.00	8,610,000	貸付株式数 4,000株
アルパイン	14,100	2,080.00	29,328,000	
スミダコーポレーション	6,400	2,109.00	13,497,600	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
アイコム	3,500	2,697.00	9,439,500	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
リオン	3,400	2,295.00	7,803,000	
船井電機	6,300	856.00	5,392,800	貸付株式数 1,800株 (1,700株)
横河電機	60,300	1,887.00	113,786,100	
新電元工業	25,000	694.00	17,350,000	
アズビル	16,600	4,870.00	80,842,000	
日本光電工業	23,000	2,500.00	57,500,000	貸付株式数 100株
共和電業	16,800	424.00	7,123,200	
堀場製作所	10,800	6,470.00	69,876,000	
アドバンテスト	38,600	2,117.00	81,716,200	貸付株式数 10,800株
エスペック	5,600	2,224.00	12,454,400	
キーエンス	25,400	60,000.00	1,524,000,000	
日置電機	3,200	2,365.00	7,568,000	
シスメックス	43,500	7,130.00	310,155,000	貸付株式数 100株
日本マイクロニクス	10,700	1,035.00	11,074,500	貸付株式数 3,100株
メガチップス	5,600	3,765.00	21,084,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,500	6,070.00	21,245,000	
デンソー	137,600	5,502.00	757,075,200	
コーセル	8,600	1,481.00	12,736,600	
イリソ電子工業	4,800	6,060.00	29,088,000	
オプテックスグループ	4,800	4,285.00	20,568,000	
千代田インテグレ	2,900	2,532.00	7,342,800	
レーザーテック	13,400	2,263.00	30,324,200	
スタンレー電気	39,700	3,870.00	153,639,000	
岩崎電気	33,000	198.00	6,534,000	
ウシオ電機	32,700	1,505.00	49,213,500	
日本セラミック	6,200	3,085.00	19,127,000	貸付株式数 100株
遠藤照明	4,200	1,384.00	5,812,800	
古河電池	8,000	1,127.00	9,016,000	
山一電機	6,300	1,978.00	12,461,400	貸付株式数 1,600株
図研	5,600	1,666.00	9,329,600	
日本電子	21,000	544.00	11,424,000	貸付株式数 4,000株
カシオ	44,500	1,577.00	70,176,500	貸付株式数 6,800株
ファナック	56,700	22,755.00	1,290,208,500	
日本シイエムケイ	13,500	1,068.00	14,418,000	貸付株式数 3,700株 (3,600株)
エンプラス	2,600	4,720.00	12,272,000	貸付株式数 700株 (700株)
ローム	27,200	9,400.00	255,680,000	

浜松ホトニクス	39,800	3,590.00	142,882,000	
三井ハイテック	8,600	2,564.00	22,050,400	貸付株式数 2,100株
新光電気工業	22,400	758.00	16,979,200	
京セラ	91,300	6,983.00	637,547,900	
太陽誘電	27,000	1,742.00	47,034,000	
村田製作所	58,700	17,205.00	1,009,933,500	
ユーシン	13,500	804.00	10,854,000	貸付株式数 3,900株 (3,500株)
双葉電子工業	8,400	2,123.00	17,833,200	
日東電工	42,200	9,765.00	412,083,000	
北陸電気工業	45,000	158.00	7,110,000	
東海理化電機	13,700	2,153.00	29,496,100	
ニチコン	18,600	1,328.00	24,700,800	
日本ケミコン	51,000	394.00	20,094,000	
K O A	8,900	2,087.00	18,574,300	貸付株式数 800株
三井造船	197,000	142.00	27,974,000	
日立造船	42,600	576.00	24,537,600	
三菱重工業	932,000	436.70	407,004,400	
川崎重工業	429,000	367.00	157,443,000	
I H I	432,000	385.00	166,320,000	
名村造船所	18,400	629.00	11,573,600	
日本車輛	26,000	299.00	7,774,000	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
F P G	20,700	1,287.00	26,640,900	貸付株式数 1,400株
じもとホールディングス	59,200	201.00	11,899,200	
全国保証	16,000	4,520.00	72,320,000	
めぶきフィナンシャルG	266,800	411.00	109,654,800	
東京TYフィナンシャルG	8,100	2,737.00	22,169,700	
九州フィナンシャルG	88,900	665.00	59,118,500	
かんぽ生命保険	20,100	2,387.00	47,978,700	
ゆうちょ銀行	155,400	1,389.00	215,850,600	
富山第一銀行	14,400	516.00	7,430,400	
コンコルディア・フィナンシャル	357,400	558.10	199,464,940	
西日本フィナンシャルHD	35,800	1,167.00	41,778,600	
日産自動車	658,900	1,153.00	759,711,700	貸付株式数 185,900株
いすゞ自動車	161,700	1,490.50	241,013,850	
トヨタ自動車 ※	679,300	6,729.00	4,571,009,700	
日野自動車	80,600	1,360.00	109,616,000	
三菱自動車工業	206,000	865.00	178,190,000	
エフテック	5,000	1,805.00	9,025,000	貸付株式数 1,200株
武蔵精密工業	6,900	3,385.00	23,356,500	貸付株式数 1,800株
日産車体	23,900	1,261.00	30,137,900	
新明和工業	22,700	1,029.00	23,358,300	
極東開発工業	11,800	1,805.00	21,299,000	
日信工業	12,000	2,004.00	24,048,000	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
トピー工業	4,700	3,740.00	17,578,000	
ティラド	25,000	460.00	11,500,000	
曙ブレーキ	29,200	358.00	10,453,600	

タチエス	9,800	2,031.00	19,903,800	
N O K	26,700	2,593.00	69,233,100	
フタバ産業	18,900	1,273.00	24,059,700	貸付株式数 4,900 株
KYB	64,000	635.00	40,640,000	
市光工業	15,000	722.00	10,830,000	貸付株式数 3,000 株
大同メタル工業	7,400	1,003.00	7,422,200	
プレス工業	30,100	628.00	18,902,800	貸付株式数 8,400 株
太平洋工業	13,400	1,442.00	19,322,800	
ケーヒン	11,600	1,834.00	21,274,400	
河西工業	8,500	1,692.00	14,382,000	
アイシン精機	51,400	5,610.00	288,354,000	
マ ツ ダ	175,600	1,659.00	291,320,400	
今仙電機製作所	8,100	1,288.00	10,432,800	
本田技研	502,000	3,294.00	1,653,588,000	
スズキ	111,300	6,128.00	682,046,400	
SUBARU	173,800	3,980.00	691,724,000	
ヤマハ発動機	79,200	3,275.00	259,380,000	貸付株式数 22,000 株
ショーワ	15,900	1,281.00	20,367,900	
小糸製作所	33,600	7,280.00	244,608,000	貸付株式数 9,400 株
TBK	20,000	499.00	9,980,000	
エクセディ	7,600	3,340.00	25,384,000	
ミツバ	10,600	1,680.00	17,808,000	
豊田合成	17,100	2,698.00	46,135,800	
愛三工業	10,000	1,016.00	10,160,000	
ヨロズ	5,200	2,288.00	11,897,600	
エフ・シー・シー	9,200	2,504.00	23,036,800	
シマノ	22,600	14,870.00	336,062,000	貸付株式数 6,300 株
テイ・エス テック	12,500	3,615.00	45,187,500	
ジャムコ	3,500	2,521.00	8,823,500	貸付株式数 1,100 株 (900 株)
小野建	5,500	1,903.00	10,466,500	
ノジマ	9,200	2,057.00	18,924,400	貸付株式数 2,400 株
佐島電機	8,500	974.00	8,279,000	
カップ・クリエイト	7,500	1,307.00	9,802,500	貸付株式数 2,100 株
伯東	5,300	1,670.00	8,851,000	
コンドーテック	7,700	1,121.00	8,631,700	
ライトオン	5,700	935.00	5,329,500	貸付株式数 1,400 株 (1,400 株)
ナガイレーベン	7,400	2,990.00	22,126,000	
三菱食品	5,500	3,225.00	17,737,500	
良品計画	7,400	33,900.00	250,860,000	
松田産業	4,600	1,632.00	7,507,200	
第一興商	8,900	5,370.00	47,793,000	
メディパルHD	55,100	1,943.00	107,059,300	
アドヴァン	6,900	955.00	6,589,500	貸付株式数 1,900 株 (600 株)
萩原電気	3,500	2,785.00	9,747,500	
アルビス	2,200	4,245.00	9,339,000	貸付株式数 500 株 (100 株)
アズワン	4,200	6,390.00	26,838,000	

シモジマ	4,900	1,124.00	5,507,600	
ドウシシャ	6,800	2,410.00	16,388,000	
小津産業	4,000	2,120.00	8,480,000	
コナカ	12,000	559.00	6,708,000	
コーナン商事	7,600	2,068.00	15,716,800	
黒田電気	7,300	1,989.00	14,519,700	
ネットワンシステムズ	25,800	1,161.00	29,953,800	
ワタミ	7,200	1,558.00	11,217,600	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ドンキホーテホールディング	36,000	4,290.00	154,440,000	
丸文	5,800	855.00	4,959,000	
西松屋チェーン	9,700	1,247.00	12,095,900	貸付株式数 2,700株
ゼンショーホールディングス	29,200	2,069.00	60,414,800	貸付株式数 8,000株
ハピネット	5,800	1,699.00	9,854,200	
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,750.00	12,075,000	貸付株式数 1,900株 (1,600株)
日本ライフライン	6,700	5,680.00	38,056,000	貸付株式数 1,700株
サイゼリヤ	8,600	3,110.00	26,746,000	
エクセル	4,200	1,905.00	8,001,000	
VTホールディングス	19,500	639.00	12,460,500	
マルカキカイ	4,000	1,827.00	7,308,000	
アルゴグラフィックス	3,800	3,405.00	12,939,000	
I DOM	17,000	670.00	11,390,000	貸付株式数 4,600株
ポプラ	10,500	588.00	6,174,000	
ユナイテッドアローズ	7,600	4,100.00	31,160,000	貸付株式数 2,000株
進和	5,400	2,231.00	12,047,400	
ハイデイ日高	6,500	3,455.00	22,457,500	
シークス	3,600	4,725.00	17,010,000	
京都きもの友禅	11,300	936.00	10,576,800	
コロワイド	17,600	2,106.00	37,065,600	貸付株式数 5,100株
壱番屋	3,900	4,815.00	18,778,500	貸付株式数 900株
スギホールディングス	12,100	5,930.00	71,753,000	
島津製作所	71,900	2,255.00	162,134,500	
J M S	22,000	338.00	7,436,000	
ブイ・テクノロジー	1,200	19,640.00	23,568,000	
スター精密	10,100	1,901.00	19,200,100	貸付株式数 2,700株
東京計器	29,000	303.00	8,787,000	
東京精密	10,700	3,980.00	42,586,000	
マニー	7,000	2,683.00	18,781,000	貸付株式数 1,900株
ニコン	96,100	1,890.00	181,629,000	
トプコン	28,400	2,021.00	57,396,400	
オリンパス	89,000	3,865.00	343,985,000	貸付株式数 25,300株 (25,300株)
理研計器	5,900	2,139.00	12,620,100	
SCREENホールディングス	11,500	7,600.00	87,400,000	
キヤノン電子	6,100	2,281.00	13,914,100	
タムロン	4,200	2,131.00	8,950,200	
HOYA	115,000	6,261.00	720,015,000	
ノーリツ鋼機	6,700	1,491.00	9,989,700	

エー・アンド・デイ	13,100	538.00	7,047,800	
キヤノン	299,500	3,837.00	1,149,181,500	
リコー	166,800	1,100.00	183,480,000	
シチズン時計	58,000	779.00	45,182,000	
リズム時計	39,000	234.00	9,126,000	
大研医器	7,100	779.00	5,530,900	貸付株式数 1,400株
メニコン	3,900	4,400.00	17,160,000	
パラマウントベッドHD	5,200	4,935.00	25,662,000	
ニホンフラッシュ	4,500	1,616.00	7,272,000	
前田工織	7,700	1,827.00	14,067,900	
永大産業	15,000	544.00	8,160,000	
アートネイチャー	8,000	713.00	5,704,000	
ダンロップスポーツ	4,100	1,544.00	6,330,400	
バンダイナムコHLDGS	61,900	3,645.00	225,625,500	
共立印刷	27,100	344.00	9,322,400	
SHOEI	3,200	3,330.00	10,656,000	貸付株式数 800株
フランスベッドHLDGS	4,300	1,049.00	4,510,700	
マーベラス	10,800	969.00	10,465,200	貸付株式数 2,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	9,700	5,190.00	50,343,000	貸付株式数 2,500株
萩原工業	2,600	3,580.00	9,308,000	
エイベックス・グループHD	10,500	1,452.00	15,246,000	
トッパン・フォームズ	8,900	1,181.00	10,510,900	
フジシールインターナショナル	12,800	3,490.00	44,672,000	
タカラトミー	22,500	1,447.00	32,557,500	
レック	4,500	2,965.00	13,342,500	貸付株式数 1,100株
大建工業	4,600	2,744.00	12,622,400	
きもと	22,500	245.00	5,512,500	
凸版印刷	153,000	1,114.00	170,442,000	
大日本印刷	154,000	1,325.00	204,050,000	
共同印刷	19,000	372.00	7,068,000	
日本写真印刷	10,100	2,913.00	29,421,300	貸付株式数 2,800株 (2,700株)
光村印刷	29,000	246.00	7,134,000	
藤森工業	4,900	3,790.00	18,571,000	
宝印刷	5,700	1,649.00	9,399,300	
前澤化成工業	8,700	1,247.00	10,848,900	
アシックス	55,100	1,679.00	92,512,900	貸付株式数 15,400株
ツツミ	2,000	1,896.00	3,792,000	
ジェイ エス ピー	3,000	3,410.00	10,230,000	
ニチハ	8,400	4,020.00	33,768,000	
エフピコ	5,300	5,610.00	29,733,000	
ヤマハ	37,800	3,910.00	147,798,000	
河合楽器	3,400	2,235.00	7,599,000	
クリナップ	7,100	902.00	6,404,200	
ピジョン	34,000	4,035.00	137,190,000	
天馬	3,700	2,294.00	8,487,800	
キングジム	8,200	1,013.00	8,306,600	
リンテック	11,900	3,080.00	36,652,000	

信越ポリマー	12,500	1,023.00	12,787,500	
東リ	23,600	403.00	9,510,800	
イトーキ	13,500	853.00	11,515,500	貸付株式数 1,300株
任天堂	34,500	40,950.00	1,412,775,000	
三菱鉛筆	9,600	2,839.00	27,254,400	貸付株式数 2,600株
松風	4,400	1,309.00	5,759,600	
タカラスタンダード	10,600	1,971.00	20,892,600	
コクヨ	26,500	1,842.00	48,813,000	
ナカバヤシ	21,000	335.00	7,035,000	
ニフコ	10,100	6,880.00	69,488,000	貸付株式数 2,800株
グローブライド	3,600	1,943.00	6,994,800	
岡村製作所	19,200	1,232.00	23,654,400	
日本バルカー	5,400	2,876.00	15,530,400	
伊藤忠	405,000	1,833.00	742,365,000	
丸紅	546,100	742.90	405,697,690	
スクロール	12,700	391.00	4,965,700	
高島	32,000	235.00	7,520,000	
ヨンドシーホールディングス	5,700	3,240.00	18,468,000	貸付株式数 1,500株
三陽商会	4,400	1,644.00	7,233,600	
長瀬産業	30,000	1,823.00	54,690,000	
蝶理	4,800	2,099.00	10,075,200	
豊田通商	61,900	3,660.00	226,554,000	
オンワードホールディングス	37,000	834.00	30,858,000	
兼松	121,000	275.00	33,275,000	
美津濃	30,000	651.00	19,530,000	
ユニー・ファミリーマートHD	24,400	5,730.00	139,812,000	貸付株式数 6,800株
三井物産	499,000	1,686.50	841,563,500	
日本紙パルプ	27,000	479.00	12,933,000	
東京エレクトロン	37,500	17,230.00	646,125,000	
日立ハイテクノロジーズ	19,300	4,060.00	78,358,000	
カメイ	7,600	1,722.00	13,087,200	
OUGホールディングス	27,000	289.00	7,803,000	
スターゼン	2,500	5,310.00	13,275,000	
セイコーHD	38,000	499.00	18,962,000	
山善	20,600	1,183.00	24,369,800	
住友商事	344,900	1,608.50	554,771,650	
日本ユニシス	15,700	1,714.00	26,909,800	
内田洋行	3,200	3,455.00	11,056,000	
三菱商事	414,600	2,620.50	1,086,459,300	
第一実業	17,000	615.00	10,455,000	
キヤノンマーケティングJPN	16,000	2,600.00	41,600,000	
西華産業	22,000	593.00	13,046,000	
菱洋エレクトロ	5,200	1,973.00	10,259,600	
ユアサ商事	5,600	3,835.00	21,476,000	
神鋼商事	2,600	3,905.00	10,153,000	
阪和興業	56,000	767.00	42,952,000	
カナデン	8,900	1,177.00	10,475,300	
菱電商事	10,000	805.00	8,050,000	

ニプロ	38,600	1,470.00	56,742,000	
岩谷産業	59,000	667.00	39,353,000	
すてきナイスグループ	45,000	154.00	6,930,000	
兼松エレクトロニクス	3,900	3,285.00	12,811,500	
三愛石油	15,100	1,254.00	18,935,400	
稲畑産業	12,700	1,470.00	18,669,000	
ゴールドウイン	2,600	7,600.00	19,760,000	貸付株式数 700株 (700株)
ユニ・チャーム	118,700	2,602.00	308,857,400	貸付株式数 12,800株
デサント	13,500	1,458.00	19,683,000	貸付株式数 3,500株
ワキタ	12,800	1,325.00	16,960,000	貸付株式数 3,400株
東邦ホールディングス	16,800	2,089.00	35,095,200	貸付株式数 4,700株
サンゲツ	17,700	2,012.00	35,612,400	
ミツウロコグループ	9,500	864.00	8,208,000	
シナネンホールディングス	2,700	2,276.00	6,145,200	
伊藤忠エネクス	10,200	1,157.00	11,801,400	
サンリオ	16,400	2,165.00	35,506,000	貸付株式数 4,600株
リョーサン	7,300	4,715.00	34,419,500	
新光商事	6,900	1,893.00	13,061,700	
トーヨー	3,200	2,670.00	8,544,000	
三信電気	6,900	1,659.00	11,447,100	
東陽テクニカ	7,400	1,040.00	7,696,000	
モスフード サービス	7,200	3,565.00	25,668,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
加賀電子	5,400	3,190.00	17,226,000	
三益半導体	5,800	1,792.00	10,393,600	
木曽路	6,700	2,802.00	18,773,400	貸付株式数 1,800株
サトレストランシステムズ	10,100	946.00	9,554,600	貸付株式数 2,800株 (2,600株)
千趣会	13,600	675.00	9,180,000	貸付株式数 2,600株
ケーヨー	14,500	783.00	11,353,500	
上新電機	14,000	1,830.00	25,620,000	
日本瓦斯	10,500	3,600.00	37,800,000	貸付株式数 1,800株
ロイヤルホールディングス	9,600	2,814.00	27,014,400	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
いなげや	6,900	1,969.00	13,586,100	
島忠	13,500	2,781.00	37,543,500	
チョダ	6,300	2,809.00	17,696,700	
ライフコーポレーション	4,200	2,833.00	11,898,600	貸付株式数 1,100株
リンガーハット	6,700	2,570.00	17,219,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
AOKIホールディングス	9,400	1,432.00	13,460,800	貸付株式数 2,600株
オークワ	9,000	1,189.00	10,701,000	
コメリ	8,100	3,205.00	25,960,500	貸付株式数 2,200株
青山商事	11,200	3,975.00	44,520,000	貸付株式数 2,900株
しまむら	6,400	13,550.00	86,720,000	
高島屋	91,000	1,043.00	94,913,000	
松屋	13,600	1,072.00	14,579,200	貸付株式数 3,800株 (3,500株)
エイチ・ツー・オーリテイリ	28,100	1,967.00	55,272,700	

ング				
近鉄百貨店	1,500	3,720.00	5,580,000	
丸井グループ	58,800	1,627.00	95,667,600	
クレディセゾン	41,200	2,055.00	84,666,000	貸付株式数 11,500株
アクシアル リテイリング	4,400	4,520.00	19,888,000	貸付株式数 400株
イオン	226,000	1,638.50	370,301,000	貸付株式数 63,400株
イズミ	10,300	5,990.00	61,697,000	
平和堂	10,600	2,525.00	26,765,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
フジ	5,900	2,869.00	16,927,100	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ヤオコー	6,000	5,430.00	32,580,000	貸付株式数 100株
ゼビオホールディングス	7,000	2,110.00	14,770,000	
ケーズホールディングス	22,800	2,416.00	55,084,800	貸付株式数 6,600株 (3,000株)
PALTAC	9,300	4,320.00	40,176,000	
新生銀行	523,000	175.00	91,525,000	
あおぞら銀行	346,000	427.00	147,742,000	
三菱UFJフィナンシャルG	4,183,000	708.90	2,965,328,700	
りそなホールディングス	647,200	552.90	357,836,880	
三井住友トラストHD	114,900	3,975.00	456,727,500	
三井住友フィナンシャルG	442,400	4,288.00	1,897,011,200	
第四銀行	63,000	527.00	33,201,000	
北越銀行	6,400	2,518.00	16,115,200	
千葉銀行	213,000	761.00	162,093,000	
群馬銀行	119,200	668.00	79,625,600	
武蔵野銀行	8,000	3,220.00	25,760,000	
千葉興業銀行	17,600	567.00	9,979,200	
筑波銀行	30,700	364.00	11,174,800	
七十七銀行	84,000	530.00	44,520,000	
青森銀行	40,000	437.00	17,480,000	
秋田銀行	32,000	348.00	11,136,000	
山形銀行	27,000	534.00	14,418,000	
岩手銀行	2,800	4,375.00	12,250,000	貸付株式数 600株
東邦銀行	43,000	411.00	17,673,000	貸付株式数 1,000株
東北銀行	73,000	150.00	10,950,000	
みちのく銀行	41,000	190.00	7,790,000	
ふくおかフィナンシャルG	220,000	488.00	107,360,000	
静岡銀行	143,000	996.00	142,428,000	
十六銀行	62,000	356.00	22,072,000	
スルガ銀行	56,400	2,334.00	131,637,600	
八十二銀行	103,500	675.00	69,862,500	
山梨中央銀行	33,000	459.00	15,147,000	
大垣共立銀行	84,000	303.00	25,452,000	
福井銀行	51,000	290.00	14,790,000	
北國銀行	55,000	470.00	25,850,000	
清水銀行	3,000	3,365.00	10,095,000	貸付株式数 200株
滋賀銀行	43,000	598.00	25,714,000	
南都銀行	6,500	3,095.00	20,117,500	
百五銀行	44,000	475.00	20,900,000	

京都銀行	99,000	1,087.00	107,613,000	
紀陽銀行	19,500	1,770.00	34,515,000	
三重銀行	3,800	2,588.00	9,834,400	
ほくほくフィナンシャルG	35,100	1,706.00	59,880,600	
広島銀行	160,000	439.00	70,240,000	
山陰合同銀行	30,600	931.00	28,488,600	
中国銀行	37,500	1,484.00	55,650,000	
鳥取銀行	6,000	1,711.00	10,266,000	
伊予銀行	78,100	834.00	65,135,400	貸付株式数 21,600 株
百十四銀行	52,000	374.00	19,448,000	
四国銀行	45,000	331.00	14,895,000	
阿波銀行	45,000	708.00	31,860,000	貸付株式数 1,000 株
大分銀行	29,000	458.00	13,282,000	
宮崎銀行	38,000	400.00	15,200,000	
佐賀銀行	32,000	271.00	8,672,000	
十八銀行	39,000	269.00	10,491,000	
沖縄銀行	5,200	4,565.00	23,738,000	貸付株式数 100 株
琉球銀行	11,500	1,658.00	19,067,000	
セブン銀行	208,500	414.00	86,319,000	貸付株式数 58,500 株
みずほフィナンシャルG	7,486,600	195.80	1,465,876,280	
高知銀行	85,000	126.00	10,710,000	
山口フィナンシャルG	49,000	1,283.00	62,867,000	貸付株式数 13,000 株
芙蓉総合リース	6,500	7,300.00	47,450,000	
興銀リース	9,900	2,905.00	28,759,500	
東京センチュリー	11,000	4,840.00	53,240,000	
SBIホールディングス	62,500	1,600.00	100,000,000	貸付株式数 17,300 株
日本証券金融	23,800	600.00	14,280,000	
アイフル	99,100	391.00	38,748,100	貸付株式数 27,400 株 (300 株)
長野銀行	4,600	1,933.00	8,891,800	貸付株式数 800 株
名古屋銀行	4,000	4,315.00	17,260,000	貸付株式数 1,200 株
北洋銀行	84,800	343.00	29,086,400	
愛知銀行	2,000	6,550.00	13,100,000	
第三銀行	3,500	1,775.00	6,212,500	
中京銀行	2,200	2,360.00	5,192,000	
大光銀行	30,000	240.00	7,200,000	
愛媛銀行	7,100	1,436.00	10,195,600	貸付株式数 1,700 株 (1,700 株)
トマト銀行	6,200	1,523.00	9,442,600	
みなと銀行	5,400	1,853.00	10,006,200	
京葉銀行	33,000	496.00	16,368,000	
関西アーバン銀行	8,800	1,333.00	11,730,400	
栃木銀行	31,500	464.00	14,616,000	
北日本銀行	3,100	3,020.00	9,362,000	
東和銀行	119,000	117.00	13,923,000	
福島銀行	108,000	89.00	9,612,000	
大東銀行	45,000	170.00	7,650,000	
リコーリース	4,800	4,160.00	19,968,000	貸付株式数 1,300 株
イオンフィナンシャルサービス	35,500	2,359.00	83,744,500	貸付株式数 10,100 株 (10,100 株)

アコム	116,700	437.00	50,997,900	貸付株式数	32,900株
ジャックス	32,000	545.00	17,440,000		
オリコ	118,000	183.00	21,594,000	貸付株式数	35,700株
日立キャピタル	12,900	2,639.00	34,043,100		
オリックス	390,200	1,812.00	707,042,400		
三菱UFJリース	140,000	578.00	80,920,000		
ジャフコ	9,500	5,490.00	52,155,000		
トモニホールディングス	44,000	480.00	21,120,000		
大和証券G本社	497,000	634.10	315,147,700		
野村ホールディングス	1,128,300	631.70	712,747,110		
岡三証券グループ	44,000	626.00	27,544,000		
丸三証券	17,400	949.00	16,512,600	貸付株式数	5,000株 (300株)
東洋証券	32,000	262.00	8,384,000		
東海東京HD	57,500	641.00	36,857,500		
光世証券	39,000	166.00	6,474,000		
水戸証券	28,500	333.00	9,490,500		
いちよし証券	12,500	1,056.00	13,200,000		
松井証券	27,200	860.00	23,392,000		
SOMPOホールディングス	115,200	4,529.00	521,740,800		
日本取引所グループ	173,400	1,927.00	334,141,800		
マネックスG	56,300	296.00	16,664,800	貸付株式数	16,700株
カブドットコム証券	37,900	330.00	12,507,000		
極東証券	8,000	1,517.00	12,136,000	貸付株式数	2,000株
岩井コスモホールディング	8,000	1,350.00	10,800,000		
藍澤証券	14,800	773.00	11,440,400		
フィデアホール	68,800	192.00	13,209,600		
池田泉州HD	55,200	423.00	23,349,600		
アニコムホールディングス	4,200	3,280.00	13,776,000	貸付株式数	700株
MS&AD	154,200	3,650.00	562,830,000		
SONY FH	53,100	1,782.00	94,624,200	貸付株式数	100株
マネーパートナーズGP	10,000	471.00	4,710,000		
第一生命HLDGS	333,200	1,899.50	632,913,400		
東京海上HD	221,900	4,525.00	1,004,097,500		
イー・ギャランティ	2,700	3,130.00	8,451,000	貸付株式数	700株 (700株)
NECキャピタルソリューション	3,500	2,096.00	7,336,000		
T&Dホールディングス	200,800	1,567.50	314,754,000		
アドバンスクリエイト	3,500	1,945.00	6,807,500		
三井不動産	293,200	2,337.00	685,208,400		
三菱地所	411,400	1,900.00	781,660,000		
平和不動産	11,300	1,951.00	22,046,300		
東京建物	59,000	1,383.00	81,597,000		
ダイビル	14,400	1,145.00	16,488,000		
京阪神ビルディング	12,700	710.00	9,017,000		
住友不動産	133,000	3,439.00	457,387,000		
大京	105,000	217.00	22,785,000		
テーオーシー	19,500	1,012.00	19,734,000		
東京楽天地	1,400	5,540.00	7,756,000		

レオパレス21	68,700	805.00	55,303,500		
スターツコーポレーション	7,800	2,835.00	22,113,000	貸付株式数	1,900株
フジ住宅	10,500	815.00	8,557,500		
空港施設	7,600	590.00	4,484,000		
ゴールドクレスト	5,400	2,543.00	13,732,200		
リログループ	30,400	2,568.00	78,067,200		
日神不動産	11,100	725.00	8,047,500		
タカラレーベン	25,200	526.00	13,255,200	貸付株式数	7,100株
サンヨーハウジ名古屋	8,200	1,048.00	8,593,600		
イオンモール	36,000	2,005.00	72,180,000		
ファースト住建	4,000	1,696.00	6,784,000	貸付株式数	900株
東祥	2,100	5,500.00	11,550,000		
トーセイ	10,100	930.00	9,393,000		
エヌ・ティ・ティ都市開発	34,000	1,079.00	36,686,000		
サンフロンティア不動産	7,100	1,140.00	8,094,000	貸付株式数	1,700株 (100株)
エフ・ジェー・ネクスト	8,900	972.00	8,650,800		
グランディハウス	16,000	431.00	6,896,000		
東武鉄道	294,000	625.00	183,750,000		
相鉄ホールディングス	85,000	553.00	47,005,000		
東京急行	149,600	1,605.00	240,108,000		
京浜急行	155,000	1,160.00	179,800,000		
小田急電鉄	88,600	2,141.00	189,692,600		
京王電鉄	152,000	939.00	142,728,000		
京成電鉄	41,500	3,105.00	128,857,500		
富士急行	16,000	1,220.00	19,520,000		
新京成電鉄	14,000	418.00	5,852,000		
東日本旅客鉄道	108,300	10,195.00	1,104,118,500		
西日本旅客鉄道	53,900	7,877.00	424,570,300		
東海旅客鉄道	46,400	19,435.00	901,784,000		
西武ホールディングス	77,400	1,844.00	142,725,600		
鴻池運輸	8,700	1,633.00	14,207,100		
西日本鉄道	61,000	544.00	33,184,000		
ハマキョウレックス	4,100	2,987.00	12,246,700		
サカイ引越センター	2,900	5,830.00	16,907,000	貸付株式数	700株 (100株)
近鉄グループHLDGS	547,000	426.00	233,022,000		
阪急阪神HLDGS	70,000	4,245.00	297,150,000		
南海電鉄	116,000	562.00	65,192,000		
京阪ホールディングス	123,000	674.00	82,902,000		
神戸電鉄	22,000	413.00	9,086,000		
名古屋鉄道	199,000	497.00	98,903,000		
山陽電鉄	22,000	584.00	12,848,000		
トランコム	1,800	6,070.00	10,926,000		
日本通運	205,000	741.00	151,905,000		
ヤマトホールディングス	100,200	2,316.00	232,063,200		
山九	74,000	905.00	66,970,000		
日新	28,000	597.00	16,716,000		
丸全昭和運輸	21,000	515.00	10,815,000		
センコーグループHLDGS	26,500	804.00	21,306,000		

トナミホールディングス	15,000	535.00	8,025,000	
ニッコンホールディングス	17,800	2,670.00	47,526,000	
福山通運	30,000	682.00	20,460,000	
セイノーホールディングス	38,800	1,506.00	58,432,800	貸付株式数 1,000株
神奈川中央交通	8,000	733.00	5,864,000	
日立物流	11,300	2,502.00	28,272,600	
丸和運輸機関	1,700	4,610.00	7,837,000	貸付株式数 400株 (400株)
日本郵船	469,000	232.00	108,808,000	
商船三井	292,000	351.00	102,492,000	
川崎汽船	208,000	293.00	60,944,000	
NSユナイテッド海運	29,000	245.00	7,105,000	
飯野海運	29,000	507.00	14,703,000	
九州旅客鉄道	56,100	3,275.00	183,727,500	
日本航空	97,900	3,787.00	370,747,300	
ANAホールディングス	1,039,000	419.70	436,068,300	
三菱倉庫	34,000	1,396.00	47,464,000	
三井倉庫HOLD	38,000	340.00	12,920,000	
住友倉庫	35,000	744.00	26,040,000	
渋沢倉庫	30,000	397.00	11,910,000	
ヤマタネ	5,800	1,860.00	10,788,000	
東陽倉庫	26,200	308.00	8,069,600	
日本トランスシティ	20,000	468.00	9,360,000	
東洋埠頭	50,000	194.00	9,700,000	
上組	66,000	1,276.00	84,216,000	
キューソー流通システム	2,100	3,035.00	6,373,500	
郵船ロジスティクス	4,700	1,006.00	4,728,200	
近鉄エクスプレス	10,200	1,767.00	18,023,400	
東海運	11,500	411.00	4,726,500	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
内外トランスライン	6,200	1,547.00	9,591,400	
東京放送HD	36,600	2,092.00	76,567,200	貸付株式数 10,200株
日本テレビHLDS	49,500	1,913.00	94,693,500	
テレビ朝日HD	14,900	2,145.00	31,960,500	貸付株式数 4,100株
スカパーJ SATHD	33,200	506.00	16,799,200	
テレビ東京HD	5,300	2,375.00	12,587,500	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
ワイヤレスゲート	4,700	1,359.00	6,387,300	貸付株式数 1,300株 (800株)
コネクシオ	5,500	1,966.00	10,813,000	
日本通信	56,900	138.00	7,852,200	貸付株式数 17,100株
日本電信電話	442,900	5,135.00	2,274,291,500	
KDDI	537,900	2,981.00	1,603,479,900	
光通信	6,700	13,700.00	91,790,000	
NTTドコモ	405,700	2,583.50	1,048,125,950	
エムティーアイ	10,300	713.00	7,343,900	貸付株式数 100株
GMOインターネット	21,900	1,500.00	32,850,000	貸付株式数 5,800株
カドカワ	16,300	1,344.00	21,907,200	
学研ホールディングス	3,200	3,255.00	10,416,000	
ゼンリン	8,000	3,400.00	27,200,000	

東京電力HD	472,500	458.00	216,405,000		
中部電力	184,300	1,438.50	265,115,550		
関西電力	229,400	1,540.50	353,390,700		
中国電力	74,400	1,241.00	92,330,400	貸付株式数	21,600株
北陸電力	51,800	1,018.00	52,732,400	貸付株式数	13,700株
東北電力	139,900	1,494.00	209,010,600		
四国電力	50,500	1,416.00	71,508,000		
九州電力	123,100	1,234.00	151,905,400		
北海道電力	51,500	834.00	42,951,000		
沖縄電力	9,800	2,454.00	24,049,200		
電源開発	44,200	2,928.00	129,417,600		
イーレックス	8,200	1,049.00	8,601,800	貸付株式数	2,100株
東京瓦斯	602,000	574.50	345,849,000		
大阪瓦斯	544,000	428.50	233,104,000		
東邦瓦斯	137,000	696.00	95,352,000		
北海道瓦斯	26,000	279.00	7,254,000	貸付株式数	5,000株
広島ガス	20,600	354.00	7,292,400		
西部瓦斯	58,000	274.00	15,892,000		
静岡ガス	13,900	897.00	12,468,300		
メタウォーター	3,300	3,070.00	10,131,000	貸付株式数	600株 (600株)
松竹	3,600	16,150.00	58,140,000		
東宝	36,100	3,930.00	141,873,000		
エイチ・アイ・エス	8,700	3,530.00	30,711,000	貸付株式数	2,800株
東映	20,000	1,272.00	25,440,000		
NTTデータ	170,300	1,200.00	204,360,000		
共立メンテナンス	9,500	3,235.00	30,732,500	貸付株式数	2,700株
イチネンホールディングス	7,100	1,494.00	10,607,400		
建設技術研究所	7,200	1,032.00	7,430,400		
アインホールディングス	7,400	8,070.00	59,718,000		
東京テアトル	60,000	153.00	9,180,000		
タナベ経営	4,300	1,419.00	6,101,700		
ナガワ	1,100	4,120.00	4,532,000		
よみうりランド	15,000	482.00	7,230,000		
東京都競馬	4,300	3,330.00	14,319,000		
常磐興産	5,800	1,826.00	10,590,800		
カナモト	8,400	3,465.00	29,106,000		
東京ドーム	22,600	1,007.00	22,758,200		
DTS	6,300	3,105.00	19,561,500	貸付株式数	2,000株
スクウェア・エニックス・HD	21,400	3,925.00	83,995,000		
シーイーシー	4,400	2,549.00	11,215,600		
カプコン	12,900	2,723.00	35,126,700	貸付株式数	3,600株
西尾レントオール	4,900	3,790.00	18,571,000		
日本空港ビルデング	17,700	3,790.00	67,083,000		
トランス・コスモス	6,800	2,512.00	17,081,600		
乃村工藝社	13,500	2,539.00	34,276,500		
ジャステック	5,800	1,333.00	7,731,400		
SCSK	15,500	4,640.00	71,920,000		
藤田観光	2,200	3,525.00	7,755,000		

KNT-CTホールディングス	40,000	219.00	8,760,000	
日本管財	5,200	2,029.00	10,550,800	
トーカイ	2,700	4,900.00	13,230,000	
セコム	60,300	8,326.00	502,057,800	
セントラル警備保障	3,500	2,086.00	7,301,000	貸付株式数 900株 (100株)
アイネス	8,800	1,023.00	9,002,400	
丹青社	12,100	1,407.00	17,024,700	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
メイテック	6,900	5,480.00	37,812,000	
TKC	5,200	3,300.00	17,160,000	
アサツー ディ・ケイ	10,000	3,075.00	30,750,000	
富士ソフト	7,500	3,270.00	24,525,000	
応用地質	7,000	1,628.00	11,396,000	
船井総研ホールディング	8,300	3,430.00	28,469,000	
NSD	11,700	2,038.00	23,844,600	
丸紅建材リース	34,000	223.00	7,582,000	
コナミホールディングス	25,300	5,630.00	142,439,000	
学 究 社	5,100	1,529.00	7,797,900	
ベネッセホールディングス	19,800	3,895.00	77,121,000	
イオンディライト	6,500	4,080.00	26,520,000	
福井コンピュータHLDS	2,100	2,893.00	6,075,300	貸付株式数 500株 (500株)
ニチイ学館	11,600	1,196.00	13,873,600	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
ダイセキ	10,200	2,855.00	29,121,000	
日鉄住金物産	4,700	6,200.00	29,140,000	
元気寿司	3,200	2,533.00	8,105,600	貸付株式数 700株
トラスコ中山	11,700	2,719.00	31,812,300	貸付株式数 2,500株
ヤマダ電機	186,500	598.00	111,527,000	貸付株式数 52,400株
オートバックスセブン	18,900	1,887.00	35,664,300	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
アークランドサカモト	9,700	1,601.00	15,529,700	
ニトリホールディングス	24,000	17,250.00	414,000,000	
吉野家ホールディングス	20,300	1,883.00	38,224,900	貸付株式数 5,700株
加藤産業	8,000	3,310.00	26,480,000	
イノテック	9,900	945.00	9,355,500	
イエローハット	5,200	3,120.00	16,224,000	
松屋フーズ	3,100	4,325.00	13,407,500	
JBCホールディングス	11,500	1,070.00	12,305,000	
サガミチェーン	8,500	1,413.00	12,010,500	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
日 伝	2,700	4,560.00	12,312,000	
関西スーパーマーケット	6,100	1,417.00	8,643,700	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ミロク情報サービス	6,400	2,663.00	17,043,200	
因幡電機産業	6,500	4,430.00	28,795,000	
王将フードサービス	3,400	4,530.00	15,402,000	貸付株式数 800株
プレナス	6,500	2,445.00	15,892,500	貸付株式数 1,700株

				(1,700株)
ミニストップ	4,300	2,186.00	9,399,800	貸付株式数 1,100株
アークス	9,500	2,511.00	23,854,500	
バローホールディングス	11,200	2,405.00	26,936,000	
ミスミグループ本社	64,200	3,030.00	194,526,000	
ベルク	2,800	5,700.00	15,960,000	
大庄	4,300	1,697.00	7,297,100	貸付株式数 1,200株
ファーストリテイリング	9,300	32,800.00	305,040,000	貸付株式数 2,500株
ソフトバンクグループ	248,800	8,904.00	2,215,315,200	
スズケン	25,000	3,955.00	98,875,000	
サンドラッグ	21,100	4,665.00	98,431,500	
サックスバーホールディング	6,900	1,328.00	9,163,200	
ジェコス	5,500	1,223.00	6,726,500	
ベルーナ	14,100	1,121.00	15,806,100	
合計			135,585,875,410	

(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。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間(平成29年9月20日から平成30年3月19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。


独立監査人の中間監査報告書

平成 30 年 4 月 20 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
業務執行社員

貞廣篤典 

指定有限責任社員 公認会計士
業務執行社員

小林 英之 

当監査法人は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・インデックスセレクト TOPIX の平成 29 年 9 月 20 日から平成 30 年 3 月 19 日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワ・インデックスセレクト TOPIX の平成 30 年 3 月 19 日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成 29 年 9 月 20 日から平成 30 年 3 月 19 日まで）の損益の状況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

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

ダイワ・インデックスセレクト TOPIX

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成 30 年 3 月 19 日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,645,779
親投資信託受益証券	1,394,891,646
流動資産合計	1,398,537,425
資産合計	1,398,537,425
負債の部	
流動負債	
未払解約金	664,367
未払受託者報酬	217,199
未払委託者報酬	2,679,267
その他未払費用	36,109
流動負債合計	3,596,942
負債合計	3,596,942
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	942,636,543
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	452,303,940
(分配準備積立金)	168,492,961
元本等合計	1,394,940,483
純資産合計	1,394,940,483
負債純資産合計	1,398,537,425

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間 自 平成 29 年 9 月 20 日 至 平成 30 年 3 月 19 日
	金額 (円)
営業収益	
有価証券売買等損益	44,071,993
営業収益合計	44,071,993
営業費用	
支払利息	743
受託者報酬	217,199
委託者報酬	2,679,267
その他費用	36,109
営業費用合計	2,933,318
営業利益	41,138,675
経常利益	41,138,675
中間純利益	41,138,675
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	9,693,757
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	369,180,228
剰余金増加額又は欠損金減少額	98,627,622
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	98,627,622
剰余金減少額又は欠損金増加額	46,948,828
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	46,948,828
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	452,303,940

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成 29 年 9 月 20 日 至 平成 30 年 3 月 19 日
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。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成 30 年 3 月 19 日現在
1. ※1 期首元本額	869,030,713 円
期中追加設定元本額	182,584,420 円
期中一部解約元本額	108,978,590 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	942,636,543 口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成 29 年 9 月 20 日 至 平成 30 年 3 月 19 日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成 30 年 3 月 19 日現在
1. 金融商品の時価及び中間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、中間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。

(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

当中間計算期間末 平成 30 年 3 月 19 日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成 30 年 3 月 19 日現在
1口当たり純資産額	1.4798 円
(1万口当たり純資産額)	(14,798 円)

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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、当ファンドの中間計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年3月19日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		7,129,623,865
株式 ※2※3		138,081,314,410
派生商品評価勘定		8,241,660
未収配当金		201,707,601
未収利息		255,611
その他未収収益 ※4		6,073,296
流動資産合計		145,427,216,443
資産合計		145,427,216,443
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		3,918,640
前受金		18,290,000
未払解約金		39,326,800
受入担保金		5,776,260,525
その他未払費用		6,282
流動負債合計		5,837,802,247
負債合計		5,837,802,247
純資産の部		
元本等		
元本 ※1		130,474,406,735
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)		9,115,007,461
元本等合計		139,589,414,196
純資産合計		139,589,414,196
負債純資産合計		145,427,216,443

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 9 月 20 日 至 平成 30 年 3 月 19 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。</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)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。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。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 30 年 3 月 19 日現在
1. ※1 期首	平成 29 年 9 月 20 日
期首元本額	132,992,880,740 円
期中追加設定元本額	8,933,049,586 円
期中一部解約元本額	11,451,523,591 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	4,330,981,270 円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	10,186,045,553 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VA2	61,624,510 円
ダイワ国内重視バランスフ ォンド30VA(一般投資 家私募)	76,998,209 円
ダイワ国内重視バランスフ ォンド50VA(一般投資 家私募)	1,282,417,660 円
ダイワ国際分散バランスフ ォンド30VA(一般投資 家私募)	61,878,852 円
ダイワ国際分散バランスフ ォンド50VA(一般投資 家私募)	1,780,342,462 円
D-I's TOPIXイン デックス	29,634,336 円
為替ヘッジ付米国国債プラ ス日本株式ファンド	23,469,734 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	615,913 円
iFree TOPIXイン デックス	416,491,291 円
iFree 8資産バラ ンス	782,827,876 円
DCダイワ日本株式インデ ックス	62,633,261,718 円
ダイワ・ライフ・バランス 30	2,211,400,095 円
ダイワ・ライフ・バランス 50	2,403,000,688 円
ダイワ・ライフ・バランス 70	2,346,707,303 円
年金ダイワ日本株式インデ ックス	4,135,650,033 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	16,623,307 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	51,545,758 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	14,426,274 円
ダイワ世界分散バランスフ ォンド15VA	330,547 円
ダイワ世界分散バランスフ ォンド20VA	362,318 円
ダイワ世界分散バランスフ ォンド20VA(国内株式 型)	690,983 円

	ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	2,857,428円
	ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	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)	10,530,833円
	ダイワ世界バランスファン ド40VA	279,427,937円
	ダイワ世界バランスファン ド60VA	168,062,338円
	ダイワ・バランスファン ド35VA	10,298,005,823円
	ダイワ・ワールド・ balan スファン ド50VA	149,974,112円
	ダイワ・ワールド・ balan スファン ド75VA	162,233,235円
	ダイワ・バランスファン ド25VA (適格機関投資家 専用)	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)	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)	230,374,774円
	ダイワ・ノーロード TOP IXファン ド	103,708,402円
	ダイワファン ドラップ TOPIXイン デックス	7,112,070,242円
	ダイワTOPIXイン デックス (ダイワSMA専用)	89,587,691円
	ダイワファン ドラップ オンライン TOPIXイン デックス	1,429,317,610円
	ダイワ・イン デックス セレクト TOPIX	1,303,758,899円
	ダイワライフ スタイル 25	175,089,091円
	ダイワライフ スタイル 50	612,401,594円
	ダイワライフ スタイル 75	517,189,536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)	13,967,736,231円
	計	130,474,406,735円
2.	期末日における受益権の総 数	130,474,406,735口
3.	※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 5,419,713,400円

4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 682,700,000円
5. ※4 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 5,154,423円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成 30 年 3 月 19 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。

(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 30 年 3 月 19 日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	1,474,630,000	—	1,479,000,000	4,370,000
合計	1,474,630,000	—	1,479,000,000	4,370,000

(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30年3月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0699円 (10,699円)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

平成 30 年 4 月 27 日

I 資産総額	1,487,703,951 円
II 負債総額	3,454,851 円
III 純資産総額 (I - II)	1,484,249,100 円
IV 発行済数量	962,006,928 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.5429 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

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

第4 国内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
 - ① 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。
 - ② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。
 - ③ 上記①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）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、一部解約請求の受け付け、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

① 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。

② 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。


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

高波博文 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

貞廣篤典 

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

内田和男 

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

(1) 貸借対照表

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,715	31,260
有価証券	1,137	110
前払費用	159	190
未収委託者報酬	9,896	10,453
未収収益	87	72
繰延税金資産	468	439
その他	83	34
流動資産計	43,547	42,560
固定資産		
有形固定資産	※1	※1
建物	243	229
器具備品	18	15
器具備品	224	214
無形固定資産	2,706	2,650
ソフトウェア	2,385	2,323
ソフトウェア仮勘定	321	327
投資その他の資産	14,223	12,353
投資有価証券	7,872	5,920
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	123	185
長期差入保証金	1,049	1,050
繰延税金資産	-	31
その他	47	37
固定資産計	17,173	15,234
資産合計	60,720	57,795

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	61	79
未払金	8,789	9,466
未払収益分配金	5	7
未払償還金	63	59
未払手数料	4,330	4,453
その他未払金	※2 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					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	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					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,261	△13,261	△13,261
当期純利益	-	-	-	11,533	11,533	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,728	△1,728	△1,728
当期末残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた73百万円は、「有価証券償還益」0百万円、「その他」72百万円として組替えております。

(追加情報)

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

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

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

※2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度（平成28年3月31日）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

- ① 剰余金の配当の総額 13,262百万円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 5,084円
- ④ 基準日 平成28年3月31日
- ⑤ 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。

- ① 剰余金の配当の総額 11,532百万円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 4,421円
- ④ 基準日 平成29年3月31日
- ⑤ 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

①市場リスクの管理

(i) 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。

(ii) 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。

②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おります。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度172百万円、当事業年度173百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
法定実効税率 (調整)	33.06%	法定実効税率と税効果会計 適用後の法人税等の負担率と の間の差異が法定実効税率の 100分の5以下であるため注記 を省略しております。
交際費等永久に損金に算入され ない項目	0.77%	
受取配当金等永久に益金に算入 されない項目	△0.02%	
評価性引当額の増減額	△1.29%	
税率変更による期末繰延税金資 産の減額修正	△0.19%	
その他	△0.43%	
税効果会計適用後の法人税等の負 担率	31.89%	

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

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㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	—	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	—	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入 (注3)	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	—	本社ビルの管理	不動産の賃借料 (注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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㈱	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	㈱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㈱	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。


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 公認会計士
業務執行社員

高波 博之 

指定有限責任社員 公認会計士
業務執行社員

貞廣 篤典 

指定有限責任社員 公認会計士
業務執行社員

内田 和男 

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

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					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	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) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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いません。

(注2) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成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。

- ① 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。)
- ② 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。)
- ③ 通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤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。
- ④ 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。
- ⑤ 上記③④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。

追加型証券投資信託

(ダイワ・インデックスセレクト TOPIX)

約 款

大和証券投資信託委託株式会社

運用の基本方針

約款第18条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

- ① 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
- ② マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ③ 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ④ 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。

(3) 投資制限

- ① マザーファンドの受益証券への投資制限
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。
- ② 株式への投資制限
株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ③ 新株引受権証券等への投資制限
新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ④ 投資信託証券への投資制限
投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限
同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥ 同一銘柄の転換社債等への投資制限
同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑦ 外貨建資産への投資制限
外貨建資産への投資は、行ないません。
- ⑧ スワップ取引の範囲
スワップ取引は、約款第23条の範囲で行ないません。
- ⑨ 金利先渡し取引の範囲
金利先渡し取引は、約款第24条の範囲で行ないません。

3. 収益分配方針

- 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、分配を行わないことがあります。
- ③ 留保益は、上記「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

追加型証券投資信託
(ダイワ・インデックスセレクト TOPIX)
約 款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けません。

③ 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第17条第1項、同条第2項および第27条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行なうものとします。

(信託の目的および金額)

第2条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けません。

(信託金の限度額)

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、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。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から平成40年9月19日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

第5条 この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

(当初の受益者)

第6条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により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。

(受益権の分割および再分割)

第7条 委託者は、第2条の規定による受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）に定めるところに従い、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。

③ 前項の規定により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者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、委託者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。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第8条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、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従って時価または一部償却原価法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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は、委託者があらか

じめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者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 委託者は、第7条の規定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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

（受益権の設定にかかる受託者の通知）

第11条 受託者は、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す。

（受益権の申込単位および価額）

第12条 委託者は、第7条第1項の規定により分割される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口単位として委託者が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。）（以下総称して「指定販売会社」といいます。）は、第7条第1項の規定により分割される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口単位として指定販売会社が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める積立投資約款に従い積立投資契約を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応じることができるものとします。
- ③ 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、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。
- ④ 第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益権の価額は、1口につき1円に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑤ 前項の規定にかかわらず、受益者が積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第35条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、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その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することができます。

（受益権の譲渡にかかる記載または記録）

第13条 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。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。）に社振法の規定に従い、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。

- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(投資の対象とする資産の種類)

第15条 この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条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

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第16条 委託者は、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トピックス・インデックス・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 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（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。）

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. 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。）

8. 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。）

9. 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。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 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

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13. 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。）

14. 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。）

15. 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。）

16. 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。）

17. 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。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 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。）
20. 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。）
21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号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、第1号の証券または証書ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第6号までの証券ならびに第14号の証券のうち投資法人債券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（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。

- ② 委託者は、信託金を、前項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号の権利の性質を有するもの
- ③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項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。
- ④ 委託者は、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。
- ⑤ 前項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。
- ⑥ 委託者は、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。
- ⑦ 前項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。

（利害関係人等との取引等）

- 第17条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行なうものを含みます。）および受託者の利害関係人、第27条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条まで、第26条、第30条から第32条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことができます。
- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行なうことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行なうことができるものとし、なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行なう場合も同様とします。
 - ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行なう他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げ

る資産への投資等ならびに第21条から第24条まで、第26条、第30条から第32条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行なうことができます。

- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行ないません。

(運用の基本方針)

第18条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行ないます。

(投資する株式等の範囲)

第19条 委託者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。

- ② 前項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、委託者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への投資制限)

第20条 委託者は、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。

- ② 前項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。

(信用取引の指図範囲)

第21条 委託者は、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。

- ② 前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号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（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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

(先物取引等の運用指図)

第22条 委託者は、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。）。

- ② 委託者は、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。

(スワップ取引の運用指図および範囲)

第23条 委託者は、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。

- ② 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、第4条に定める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。
- ③ 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（以下本項において「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、委託者は、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。
- ④ 前項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。
- ⑤ 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ます。
- ⑥ 委託者は、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たときは、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。

（金利先渡取引の運用指図および範囲）

第24条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

- ② 金利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、第4条に定める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。
- ③ 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（以下本項において「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第16条第2項第1号から第4号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（以下本項において「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、委託者は、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。
- ④ 前項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。
- ⑤ 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ⑥ 委託者は、金利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たときは、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にかかる投資制限）

第24条の2 委託者は、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。

（同一銘柄の転換社債等への投資制限）

第25条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債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10

を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 前項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転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(有価証券の貸付けの指図および範囲)

第26条 委託者は、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各号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。
- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、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。
 - ③ 委託者は、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。

(信託業務の委託等)

第27条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
 - ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
 1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(混蔵寄託)

第28条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第29条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、すみやかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計

算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(一部解約の請求および有価証券売却等の指図)

第30条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第31条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第32条 委託者は、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。

② 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。

③ 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。

④ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

(損益の帰属)

第33条 委託者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、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第34条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第35条 この信託の計算期間は、毎年9月20日から翌年9月19日までとします。ただし、第1計算期間は、平成25年11月18日から平成26年9月19日までとします。

② 前項の規定にかかわらず、前項の規定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。

(信託財産に関する報告等)

第36条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③ 受託者は、前2項の報告を行なうことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行なわないこととします。

④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第37条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者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（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 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な費用（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。

（信託報酬等の額および支弁の方法）

第38条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第35条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の40の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6カ月終了日（6カ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。
- ③ 第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

（収益の分配方式）

第39条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第40条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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計算期間の末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指定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）に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、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指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとします。当該取得申込により増加した受益権は、第10条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 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。）は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、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指定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）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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、社振法の規定に従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。
- ④ 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、4営業日目から受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとします。
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第41条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第4項に規定する支払

開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(収益分配金および償還金の時効)

第42条 受益者が、収益分配金については第40条第1項に規定する支払開始日から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第40条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(信託契約の一部解約)

第43条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、最低単位を1口単位として委託者または指定販売会社が定める単位（積立投資契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託者に一部解約請求をすることができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約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この信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、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、社振法の規定に従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 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の基準価額とします。

- ④ 受益者が第1項の一部解約請求をするときは、委託者または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとし、

- ⑤ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約請求の受付を中止することができます。

- ⑥ 前項により一部解約請求の受付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請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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請求を受け付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第44条 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、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第45条 委託者は、信託期間中において、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、もしくはこの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、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。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等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この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 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託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者を除きます。以下本項において同じ。）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、この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 第2項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 第2項から前項までの規定は、委託者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、この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、第2項から前項までの手続を行なうことが困難な場合も同じとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第46条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第50条の規定に従います。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第47条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第50条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者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第48条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第49条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第50条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第50条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（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け出ます。なお、この信託約款は本条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ます。

- ② 委託者は、前項の事項（前項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、前項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等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この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 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託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者を除きます。以下本項において同じ。）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、この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 第2項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、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者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、この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 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(反対受益者の受益権買取請求の不適用)

第51条 この信託は、受益者が第43条の規定による一部解約請求を行なったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第45条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行なう場合において、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。

(他の受益者の氏名等の開示の請求の制限)

第52条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第52条の2 委託者は、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の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(信託期間の延長)

第53条 委託者は、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たときは、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(公告)

第54条 委託者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 前項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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第55条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付 則)

第 1条 この約款において「積立投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「積立投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、この場合、「積立投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2条 第40条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第 3条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

平成25年11月18日

委託者 大和証券投資信託委託株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社