

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成30年12月12日提出
【計算期間】	第30計算期間 (自 平成29年9月20日 至 平成30年9月19日)
【ファンド名】	トピックス・インデックスファンド
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 岩本 信之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	高橋 慎
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【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、信託財産の成長をはかることを目的として、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

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	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、1,500億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1 わが国の株式に投資し、東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

運用プロセス



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

株式市場の動向を表わす指標には、東証株価指数（TOPIX）、日経平均株価、日経500種株価等があります。このうち、TOPIXは、東京証券取引所の第1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（注1、注2参照）。

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（注3参照）。

（注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式会社東京証券取引所が有します。株式会社東京証券取引所は、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。

（注2） TOPIXの算出方法：毎日の指数 = 当日の時価総額 ÷ 基準時の時価総額 × 100

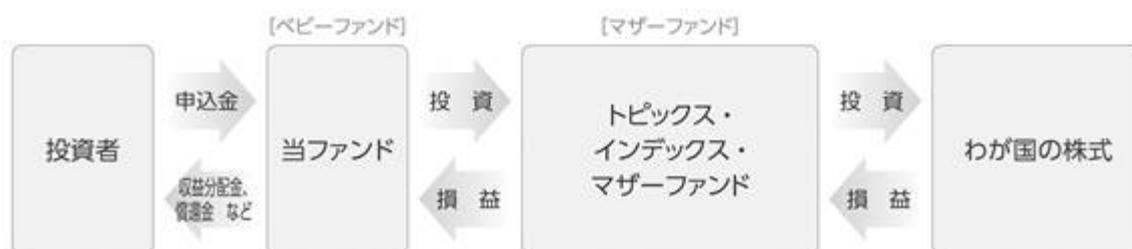
（注3） 基準時の時価総額の修正方法：

$$\text{修正後の基準時価総額} = \text{修正前日の基準時価総額} \times (\text{修正前日の時価総額} \pm \text{修正額}) \div \text{修正前日の時価総額}$$

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ないます。

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。



2

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ないます。

〈分配方針〉

- ① 分配対象額は、利息等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ② 分配対象額から、利息等収益は原則として全額分配し、売買益は運用実績を勘案して分配します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●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いません。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

- (a) 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
- (b) 運用管理費用（信託報酬）、売買委託手数料等の費用負担
- (c) 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
- (d) 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
- (e) 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）
- (f) 株式および株価指数先物取引の最低取引単位の影響
- (g) 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
- (h) 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】

1988年10月28日	信託契約締結、当初設定、運用開始
1998年 5月 1日	信託期間の更新（信託終了日を1998年9月19日から2008年9月19日に変更）
2000年 9月11日	受益権の再分割（元本1口1万円を元本1口1円に変更）
2001年 9月 3日	信託期間を無期限に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3 ）	
お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3 ）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 3 ）

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

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】

委託会社は、信託金を、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。）で市場性のあるものに投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 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。）
3. 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

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

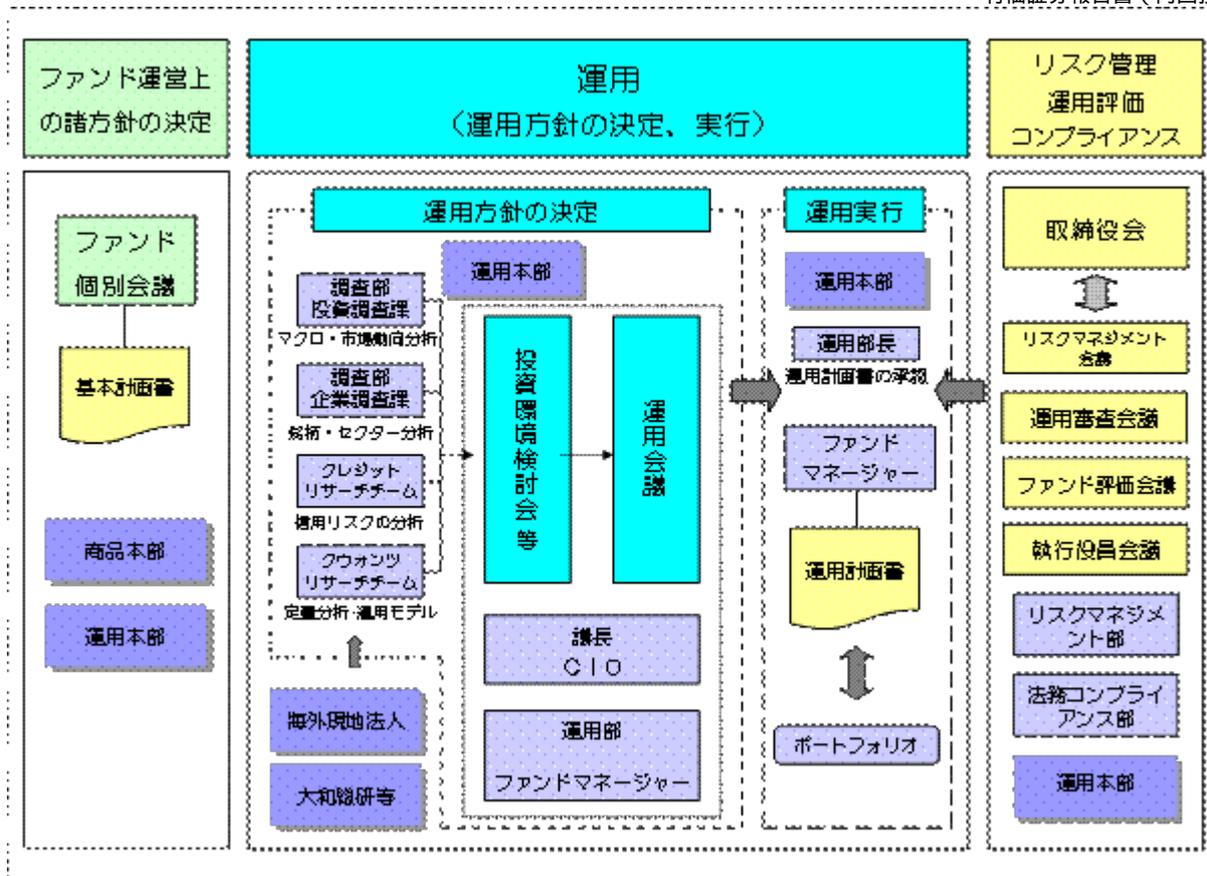
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更

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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ．ファンド評価会議

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

ロ．運用審査会議

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

ハ．リスクマネジメント会議

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

ニ．執行役員会議

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

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2018年9月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

分配対象額は、利息等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

分配対象額から、利息等収益は原則として全額分配し、売買益は運用実績を勘案して分配します。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

受益証券（信託約款）

受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式以外の資産（信託約款）

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。

先物取引等（信託約款）

委託会社は、わが国の金融商品取引所（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のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号イもしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）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。

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。

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。

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より支弁します。

<参考> 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

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

- (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。

(2) 投資対象

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

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。

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。

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) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

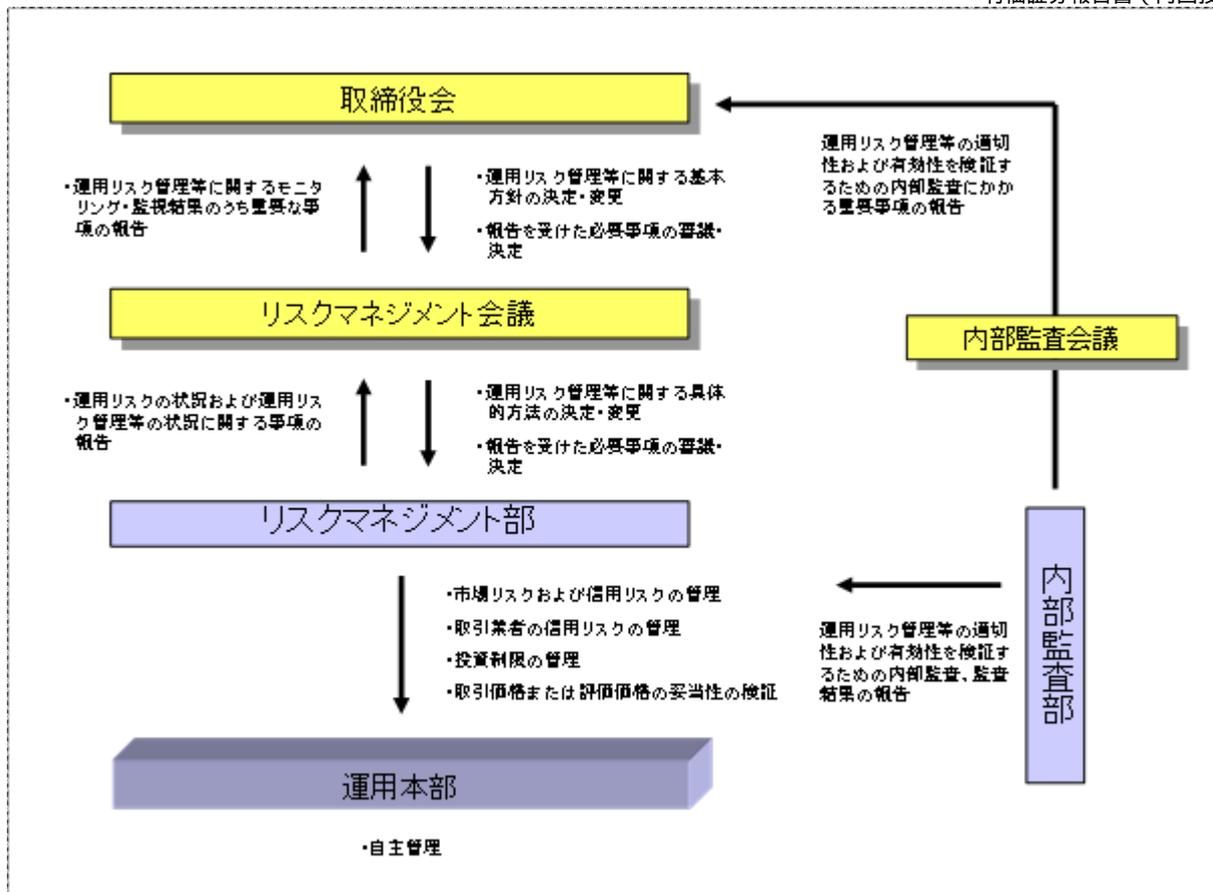
(3) その他の留意点

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

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。

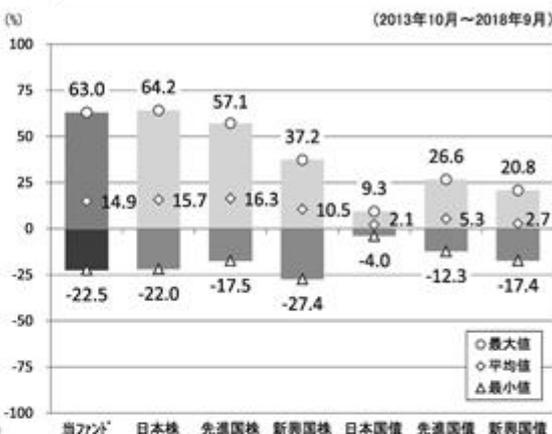
参 考 情 報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、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）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

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

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.6696%（税抜0.62%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、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信託財産中から支弁するものとします。

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。

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0.24%（税抜）	年率0.3%（税抜）	年率0.08%（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。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用は、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等を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）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。

買取請求時の1万口当たりの手取額は、買取請求受付日の基準価額から、当該買取りに関して課税対象者にかかる源泉徴収額に相当する金額を差引いた金額となります（当該課税対象者にかかる源泉

徴収は、免除されることがあります。）。買取価額と取得価額との差額については、譲渡所得の取扱いとなります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

買取請求時の1万口当たりの手取額は、買取請求受付日の基準価額から、当該買取りに関して課税対象者にかかる源泉徴収額に相当する金額を差引いた金額となります（当該課税対象者にかかる源泉徴収は、免除されることがあります。）。この税相当額は税金ではないため、税額控除はありません。

<注1> 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。なお、個別元本方式は2000年4月1日算出の基準価額より適用されており、個別元本方式への移行時に既に受益権を保有していた場合、2000年3月31日の平均信託金が当該受益権にかかる個別元本となります。

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

- () 上記は、2018年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 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】（2018年9月28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	4,809,989,857	99.99
内 日本	4,809,989,857	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	245,518	0.01
純資産総額	4,810,235,375	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】（2018年9月28日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	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	4,174,251,373	1.1233 4,688,936,768	1.1523 4,809,989,857	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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第21計算期間末 (2009年9月24日)	6,025,932,413	6,025,932,413	0.3964	0.3964
第22計算期間末 (2010年9月21日)	5,247,270,758	5,247,270,758	0.3590	0.3590
第23計算期間末 (2011年9月20日)	4,358,382,670	4,358,382,670	0.3238	0.3238
第24計算期間末 (2012年9月19日)	4,281,009,243	4,281,009,243	0.3337	0.3337
第25計算期間末 (2013年9月19日)	5,859,756,210	5,859,756,210	0.5386	0.5386
第26計算期間末 (2014年9月19日)	5,717,796,146	5,717,796,146	0.5976	0.5976
第27計算期間末 (2015年9月24日)	4,843,405,991	4,843,405,991	0.6480	0.6480
第28計算期間末 (2016年9月20日)	4,663,449,967	4,663,449,967	0.6066	0.6066
第29計算期間末 (2017年9月19日)	5,012,112,703	5,012,112,703	0.7796	0.7796
2017年9月末日	4,958,605,081	-	0.7887	-
10月末日	4,899,893,960	-	0.8310	-
11月末日	4,857,840,739	-	0.8431	-
12月末日	4,872,185,396	-	0.8555	-
2018年1月末日	4,914,264,217	-	0.8640	-
2月末日	4,745,317,075	-	0.8318	-
3月末日	4,685,630,029	-	0.8144	-
4月末日	4,781,001,869	-	0.8430	-
5月末日	4,578,695,580	-	0.8288	-
6月末日	4,563,510,753	-	0.8214	-
7月末日	4,598,365,571	-	0.8316	-
8月末日	4,627,036,485	-	0.8227	-
第30計算期間末 (2018年9月19日)	4,769,872,496	4,769,872,496	0.8463	0.8463

9月末日	4,810,235,375	-	0.8680	-
------	---------------	---	--------	---

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000
第25計算期間	0.0000
第26計算期間	0.0000
第27計算期間	0.0000
第28計算期間	0.0000
第29計算期間	0.0000
第30計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第21計算期間	16.2
第22計算期間	9.4
第23計算期間	9.8
第24計算期間	3.1
第25計算期間	61.4
第26計算期間	11.0
第27計算期間	8.4
第28計算期間	6.4
第29計算期間	28.5
第30計算期間	8.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第21計算期間	3,481,842,035	2,619,533,961
第22計算期間	1,111,899,186	1,698,456,311
第23計算期間	773,893,099	1,927,611,824
第24計算期間	554,881,824	1,188,778,198
第25計算期間	1,122,499,164	3,069,770,335
第26計算期間	1,559,530,615	2,872,010,998

第27計算期間	2,368,938,480	4,461,840,782
第28計算期間	1,115,514,771	902,675,621
第29計算期間	561,698,268	1,820,667,726
第30計算期間	758,901,951	1,551,260,067

(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 (2018年9月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	150,594,260,490	98.74
内 日本	150,594,260,490	98.74
新株予約権証券	1,352,000	0.00
内 日本	1,352,000	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,918,127,967	1.26
純資産総額	152,513,740,457	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)	1,999,250,000	1.31
内 日本	1,999,250,000	1.31

(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 (2018年9月28日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	705,800	7,019.00 4,954,010,200	7,095.00 5,007,651,000	3.28

2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	258,300	10,915.00 2,819,344,500	11,470.00 2,962,701,000	1.94
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	3,988,000	702.70 2,802,367,600	709.10 2,827,890,800	1.85
4	ソニー	日本	株式	電気機 器	389,300	6,682.00 2,601,302,600	6,966.00 2,711,863,800	1.78
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	408,400	5,154.00 2,104,893,600	5,132.00 2,095,908,800	1.37
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	428,600	4,538.00 1,944,986,800	4,586.00 1,965,559,600	1.29
7	キーエンス	日本	株式	電気機 器	28,500	63,370.00 1,806,045,000	65,980.00 1,880,430,000	1.23
8	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	521,400	3,383.00 1,763,896,200	3,439.00 1,793,094,600	1.18
9	リクルートホールディング ス	日本	株式	サービ ス業	430,000	3,665.00 1,575,950,000	3,792.00 1,630,560,000	1.07
10	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	502,100	3,090.00 1,551,489,000	3,139.00 1,576,091,900	1.03
11	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,787,100	198.30 1,544,181,930	198.20 1,543,403,220	1.01
12	任天堂	日本	株式	その他製 品	35,800	40,000.00 1,432,000,000	41,460.00 1,484,268,000	0.97
13	三菱商事	日本	株式	卸売業	401,800	3,473.00 1,395,451,400	3,501.00 1,406,701,800	0.92
14	花王	日本	株式	化学	142,900	9,055.00 1,293,959,500	9,174.00 1,310,964,600	0.86
15	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	409,100	3,049.00 1,247,345,900	3,055.00 1,249,800,500	0.82
16	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	52,200	23,270.00 1,214,694,000	23,660.00 1,235,052,000	0.81
17	東京海上HD	日本	株式	保険業	215,500	5,447.00 1,173,828,500	5,637.00 1,214,773,500	0.80
18	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	239,800	5,100.00 1,222,980,000	5,060.00 1,213,388,000	0.80
19	ダイキン工業	日本	株式	機械	79,400	15,605.00 1,239,037,000	15,125.00 1,200,925,000	0.79
20	ファナック	日本	株式	電気機 器	55,200	22,170.00 1,223,784,000	21,420.00 1,182,384,000	0.78
21	日本電産	日本	株式	電気機 器	70,000	16,500.00 1,155,000,000	16,345.00 1,144,150,000	0.75

22	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	571,300	2,006.50 1,146,313,450	1,982.00 1,132,316,600	0.74
23	キヤノン	日本	株式	電気機器	310,100	3,553.00 1,101,785,300	3,610.00 1,119,461,000	0.73
24	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	103,500	10,670.00 1,104,345,000	10,555.00 1,092,442,500	0.72
25	日立	日本	株式	電気機器	278,000	3,736.00 1,038,608,000	3,860.00 1,073,080,000	0.70
26	村田製作所	日本	株式	電気機器	60,900	17,940.00 1,092,546,000	17,465.00 1,063,618,500	0.70
27	武田薬品	日本	株式	医薬品	213,800	4,686.00 1,001,866,800	4,861.00 1,039,281,800	0.68
28	資生堂	日本	株式	化学	115,900	7,928.00 918,855,200	8,799.00 1,019,804,100	0.67
29	信越化学	日本	株式	化学	100,200	9,833.00 985,266,600	10,065.00 1,008,513,000	0.66
30	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	336,000	2,990.00 1,004,640,000	2,966.00 996,576,000	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	98.74%
新株予約権証券	0.00%
合計	98.74%

(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	0.12%
鉱業	0.33%
建設業	2.80%
食料品	3.96%
繊維製品	0.63%
パルプ・紙	0.29%
化学	7.45%
医薬品	5.07%
石油・石炭製品	0.89%
ゴム製品	0.72%

ガラス・土石製品	0.96%
鉄鋼	1.06%
非鉄金属	0.80%
金属製品	0.59%
機械	5.17%
電気機器	13.12%
輸送用機器	8.36%
精密機器	1.75%
その他製品	2.11%
電気・ガス業	1.72%
陸運業	4.22%
海運業	0.19%
空運業	0.55%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	7.94%
卸売業	4.79%
小売業	4.85%
銀行業	6.67%
証券、商品先物取引業	0.92%
保険業	2.38%
その他金融業	1.17%
不動産業	2.28%
サービス業	4.69%
合計	98.74%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2018年12月	買建	110	1,981,805,220	1,999,250,000	1.31%

(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

●トピックス・インデックスファンド

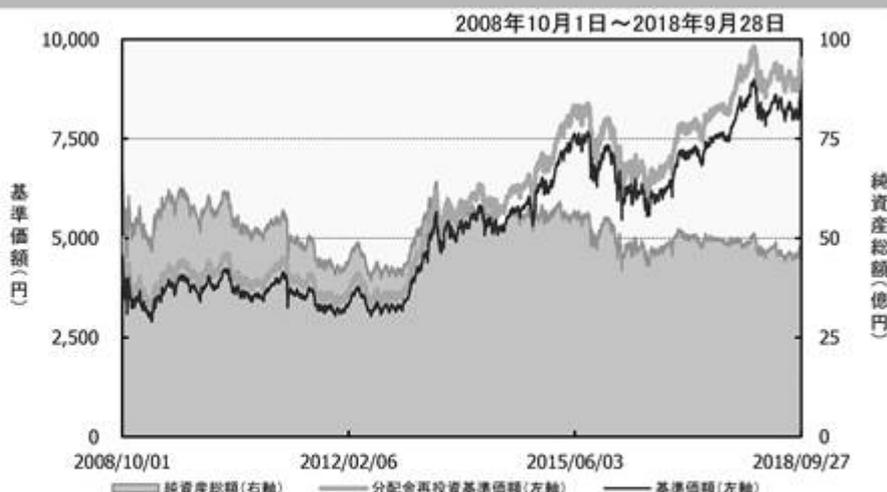
2018年9月28日現在

※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	8,680円
純資産総額	48億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	5.5%
3カ月間	5.7%
6カ月間	6.6%
1年間	10.1%
3年間	34.4%
5年間	63.0%
設定来	-5.2%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 926円

決算期	第19期 07年9月	第20期 08年9月	第21期 09年9月	第22期 10年9月	第23期 11年9月	第24期 12年9月	第25期 13年9月	第26期 14年9月	第27期 15年9月	第28期 16年9月	第29期 17年9月	第30期 18年9月
分配金	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。

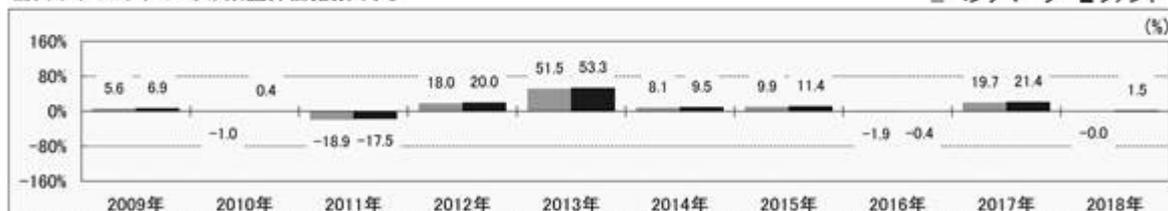
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,497	98.7%	電気機器	13.1%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.3%
国内株式先物	1	1.3%	輸送用機器	8.4%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.9%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	7.9%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.9%
コール・ローン、その他	-	1.3%	化学	7.4%	ソニー	電気機器	1.8%
合計	1,498	-	銀行業	6.7%	日本電信電話	情報・通信業	1.4%
株式市場・上場別構成			機械	5.2%	TOPIX先物 3012月	-	1.3%
一部(東証・名証)		98.7%	医薬品	5.1%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.3%
二部(東証・名証)		-	小売業	4.9%	キーエンス	電気機器	1.2%
新興市場他		-	卸売業	4.8%	本田技研	輸送用機器	1.2%
その他		-	その他	35.3%	リクルートホールディングス	サービス業	1.1%
合計		98.7%	合計	98.7%	合計		16.3%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額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。

・2018年は9月28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い契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

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

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。

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】

受益者は、保有する受益権について、一部解約の実行を請求すること、または買取りを請求することにより換金することができます。

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。

イ．一部解約

受益者は、自己に帰属する受益権について、1口単位または1万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、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとして、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の実行の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。

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

ロ．買取り

受益者が買取り請求をするときは、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。

販売会社は、受益者の請求があるときは、1口単位または1万口単位として販売会社が定める単位をもって、その振替受益権を買取ります。

振替受益権の買取り価額は、買取りの申込みを受けた日の基準価額から、当該買取りに関して課税対象者にかかる源泉徴収額に相当する金額を控除した額とします（当該課税対象者にかかる源泉徴収は、免除されることがあります。）。

受益者は、買取り価額を、販売会社に問合わせることにより知ることができます。

販売会社は、金融商品取引所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、委託会社との協議に基づいて、振替受益権の買取りを中止することができます。振替受益権の買取りが中止された場合には、受益者は買取り中止以前に行なった当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の買取り価額は、買取り中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取りの申込みを受けたものとして、上記に準じて計算された価額とします。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数

と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問い合わせ先（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/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(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。

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。

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、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3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 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。
8. 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、この4.に該当する場合を除き、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。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

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ができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

6. 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5.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

前 1.の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 1.の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 1.の3.または前 1.の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取べき旨を請求することができます。

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られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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。

換金請求権

受益者は、保有する受益権について、一部解約の実行を請求すること、または買取りを請求することにより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30期計算期間(平成29年9月20日から平成30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。

1【財務諸表】

トピックス・インデックスファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第29期 平成29年9月19日現在	第30期 平成30年9月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,410,906	15,794,575
親投資信託受益証券	5,012,066,412	4,769,629,771
未収入金	2,356,000	7,773,000
流動資産合計	5,032,833,318	4,793,197,346
資産合計	5,032,833,318	4,793,197,346
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,120,533	7,570,285
未払受託者報酬	2,124,698	2,016,552
未払委託者報酬	14,341,946	13,612,052
その他未払費用	133,438	125,961
流動負債合計	20,720,615	23,324,850
負債合計	20,720,615	23,324,850
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,428,770,955	1 5,636,412,839
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 1,416,658,252	2 866,540,343
（分配準備積立金）	1,389,675,861	1,409,022,019
元本等合計	5,012,112,703	4,769,872,496
純資産合計	5,012,112,703	4,769,872,496
負債純資産合計	5,032,833,318	4,793,197,346

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第29期		第30期	
	自	平成28年9月21日 至 平成29年9月19日	自	平成29年9月20日 至 平成30年9月19日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,281,852,604		443,123,359
営業収益合計		1,281,852,604		443,123,359
営業費用				
支払利息		5,134		5,657
受託者報酬		4,274,488		4,102,137
委託者報酬		28,853,315		27,689,945
その他費用		266,956		256,849
営業費用合計		33,399,893		32,054,588
営業利益		1,248,452,711		411,068,771
経常利益		1,248,452,711		411,068,771
当期純利益		1,248,452,711		411,068,771
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		178,839,478		69,521,986
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,024,290,446		1,416,658,252
剰余金増加額又は欠損金減少額		711,946,384		339,221,457
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		711,946,384		339,221,457
剰余金減少額又は欠損金増加額		173,927,423		130,650,333
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		173,927,423		130,650,333
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,416,658,252		866,540,343

(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30期	
	自 平成29年9月20日	至 平成30年9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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第29期	第30期
	平成29年9月19日現在	平成30年9月19日現在
1. 1 期首元本額	7,687,740,413円	6,428,770,955円
期中追加設定元本額	561,698,268円	758,901,951円
期中一部解約元本額	1,820,667,726円	1,551,260,067円
2. 計算期間末日における受益権の総数	6,428,770,955口	5,636,412,839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1,416,658,252円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は866,540,343円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第29期	第30期
	自 平成28年9月21日 至 平成29年9月19日	自 平成29年9月20日 至 平成30年9月19日

1 分配金の計算過程	<p>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(832,485,455円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,062,510,630円)及び分配準備積立金(557,190,406円)より分配対象額は2,452,186,491円(1万口当たり3,814.39円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>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(341,548,516円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,082,473,914円)及び分配準備積立金(1,067,473,503円)より分配対象額は2,491,495,933円(1万口当たり4,420.36円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第30期 自 平成29年9月20日 至 平成30年9月19日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第30期
	平成30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29期	第30期
	平成29年9月19日現在	平成30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	1,118,239,522	380,086,227
合計	1,118,239,522	380,086,227

（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29期	第30期
平成29年9月19日現在	平成30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30期
自 平成29年9月20日
至 平成30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29期	第30期
	平成29年9月19日現在	平成30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)	0.7796円 (7,796円)	0.8463円 (8,463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	4,246,087,218	4,769,629,771	
親投資信託受益証券 合計			4,769,629,771	
合計			4,769,629,771	

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29年9月19日現在	平成30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		5,243,157,160	12,734,389,759
株式	2 3	135,585,875,410	148,894,152,440
派生商品評価勘定		41,667,600	30,058,400
未収入金		5,711,360	8,991,040
未収配当金		47,733,767	57,194,385
未収利息		275,624	474,420
その他未収収益	4	4,745,552	4,227,872
流動資産合計		140,929,166,473	161,729,488,316
資産合計		140,929,166,473	161,729,488,316
負債の部			
流動負債			
前受金		30,260,000	26,864,000
未払金		-	596,940,475
未払解約金		188,293,300	143,365,900
受入担保金		4,002,234,232	11,194,645,612
その他未払費用		-	13,852
流動負債合計		4,220,787,532	11,961,829,839
負債合計		4,220,787,532	11,961,829,839
純資産の部			
元本等			
元本	1	132,992,880,740	133,322,724,900
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,715,498,201	16,444,933,577
元本等合計		136,708,378,941	149,767,658,477
純資産合計		136,708,378,941	149,767,658,477
負債純資産合計		140,929,166,473	161,729,488,316

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9月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成29年9月19日現在	平成30年9月19日現在
1. 1 期首	平成28年9月21日	平成29年9月20日
期首元本額	143,240,630,767円	132,992,880,740円
期中追加設定元本額	15,781,466,537円	17,323,849,993円
期中一部解約元本額	26,029,216,564円	16,994,005,833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	4,876,025,306円	4,246,087,218円
ファンド		

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	12,004,610,396円	9,335,647,683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	63,814,361円	50,961,008円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	98,324,013円	72,288,859円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,596,875,323円	1,120,195,925円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	73,496,283円	59,077,590円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	2,267,542,428円	1,527,630,494円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	919,561円
D-I's TOPIXイン デックス	29,570,535円	30,019,052円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	27,492,055円	21,906,513円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	571,628円	675,429円
iFree TOPIXイン デックス	219,320,903円	626,644,015円
iFree 8資産バランス	560,747,176円	1,109,565,785円
iFree 年金バランス	- 円	7,355,261円
DCダイワ日本株式インデッ クス	61,209,294,542円	64,305,310,317円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,305,738,742円	2,491,555,747円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,363,094,190円	2,765,694,997円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,234,782,816円	2,681,824,381円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	3,968,008,120円	4,471,005,264円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	20,185,626円	15,185,267円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	59,526,245円	49,889,188円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	12,595,154円	16,774,873円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	- 円	936,048円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	404,752円	337,828円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	400,556円	347,186円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	753,865円	686,510円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	11,529,912円	4,016,770円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	47,889,757円	8,380,481円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	27,538,772円	9,446,810円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	532,798,059円	212,247,455円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	191,358,243円	168,882,290円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	11,883,395,819円	9,877,017,535円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	319,015,775円	21,077,804円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	481,942,796円	25,269,263円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,022,475,874円	856,720,435円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	148,071,718円	129,305,829円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	256,045,701円	223,180,217円
ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	58,249,473円	123,940,950円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	5,574,613,851円	8,293,640,110円

	ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	4,252,692円	225,887,747円
	ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	963,778,473円	1,843,135,534円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,204,591,549円	1,389,161,216円
	ダイワライフスタイル25	192,618,067円	179,686,588円
	ダイワライフスタイル50	643,116,079円	634,139,972円
	ダイワライフスタイル75	521,030,501円	542,537,590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)	14,915,392,614円	13,546,528,305円
	計	132,992,880,740円	133,322,724,900円
2.	期末日における受益権の総数	132,992,880,740口	133,322,724,900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 3,875,321,600円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 10,955,160,650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 672,900,000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 701,900,000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4,045,175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3,027,980円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年9月20日 至 平成30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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年9月19日現在	平成30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	28,013,029,927	9,210,049,346

合計	28,013,029,927	9,210,049,346
----	----------------	---------------

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成28年9月21日から平成29年9月19日まで、及び平成29年9月20日から平成30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29年9月19日 現在				平成30年9月19日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	950,100,000	-	991,800,000	41,700,000	678,120,000	-	708,200,000	30,080,000
合計	950,100,000	-	991,800,000	41,700,000	678,120,000	-	708,200,000	30,080,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年9月19日現在	平成30年9月19日現在
1口当たり純資産額	1.0279円	1.1233円
(1万口当たり純資産額)	(10,279円)	(11,233円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)	備考
----	-----	--------	----

		単 価	金 額	
極 洋	3,800	3,330.00	12,654,000	
日本水産	75,400	641.00	48,331,400	
マルハニチロ	12,700	4,065.00	51,625,500	
カネコ種苗	6,900	1,584.00	10,929,600	
サカタのタネ	10,000	3,910.00	39,100,000	
ホクト	7,100	1,939.00	13,766,900	
ショーボンドHD	6,100	8,740.00	53,314,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ミライト・ホールディングス	20,200	1,838.00	37,127,600	貸付株式数 7,800株 (5,500株)
タマホーム	7,500	1,028.00	7,710,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
TATERU	10,300	523.00	5,386,900	貸付株式数 2,600株
日鉄鉱業	2,100	5,320.00	11,172,000	
三井松島	5,100	1,881.00	9,593,100	
国際石油開発帝石	316,500	1,373.50	434,712,750	
石油資源開発	9,800	2,533.00	24,823,400	
K&Oエナジーグループ	3,500	1,746.00	6,111,000	
安藤・間	54,000	851.00	45,954,000	
東急建設	26,500	1,079.00	28,593,500	
コムシスホールディングス	24,900	3,245.00	80,800,500	
ミサワホーム	6,700	865.00	5,795,500	
高松コンストラクシヨンGP	4,200	3,035.00	12,747,000	
東建コーポレーション	2,400	7,350.00	17,640,000	
ヤマウラ	9,300	873.00	8,118,900	貸付株式数 3,700株
大成建設	65,400	5,010.00	327,654,000	
大 林 組	194,000	1,088.00	211,072,000	
清水建設	199,000	1,001.00	199,199,000	貸付株式数 79,100株 (79,100株)
飛島建設	74,400	183.00	13,615,200	
長谷工コーポレーション	75,600	1,494.00	112,946,400	
松井建設	11,800	897.00	10,584,600	
鹿島建設	286,000	803.00	229,658,000	
不動テトラ	63,700	212.00	13,504,400	
鉄建建設	4,400	2,909.00	12,799,600	
西松建設	14,900	2,747.00	40,930,300	
三井住友建設	47,800	750.00	35,850,000	
大豊建設	27,000	651.00	17,577,000	

前田建設	47,100	1,482.00	69,802,200	
奥村組	10,800	3,450.00	37,260,000	
東鉄工業	8,000	2,952.00	23,616,000	貸付株式数 600株
浅沼組	29,000	354.00	10,266,000	
戸田建設	75,200	798.00	60,009,600	
熊谷組	10,500	3,020.00	31,710,000	
北野建設	21,000	402.00	8,442,000	
三井ホーム	11,000	976.00	10,736,000	
矢作建設	10,700	850.00	9,095,000	
ピーエス三菱	13,100	543.00	7,113,300	貸付株式数 5,000株
日本ハウスHLDGS	17,500	581.00	10,167,500	貸付株式数 3,600株
大東建託	23,400	15,130.00	354,042,000	
新日本建設	9,200	1,161.00	10,681,200	
NIPPO	14,300	2,119.00	30,301,700	
東亜道路	2,000	3,690.00	7,380,000	
前田道路	18,400	2,291.00	42,154,400	
日本道路	1,900	6,110.00	11,609,000	
東亜建設	5,800	2,506.00	14,534,800	
若築建設	6,100	1,611.00	9,827,100	
東洋建設	22,900	440.00	10,076,000	
五洋建設	76,700	714.00	54,763,800	
世紀東急	13,600	709.00	9,642,400	
福田組	2,400	5,440.00	13,056,000	貸付株式数 600株
住友林業	40,500	1,903.00	77,071,500	貸付株式数 15,900株
日本基礎技術	22,000	388.00	8,536,000	貸付株式数 3,000株
日成ビルド工業	12,100	1,083.00	13,104,300	
巴コーポレーション	14,900	478.00	7,122,200	貸付株式数 1,600株
大和ハウス	193,000	3,301.00	637,093,000	貸付株式数 76,600株 (76,600株)
ライト工業	14,300	1,472.00	21,049,600	
積水ハウス	211,600	1,733.00	366,702,800	貸付株式数 58,500株
日特建設	10,900	735.00	8,011,500	
ユアテック	9,400	924.00	8,685,600	貸付株式数 500株
中電工	7,500	2,674.00	20,055,000	
関電工	24,400	1,134.00	27,669,600	貸付株式数 6,800株
きんでん	41,200	1,793.00	73,871,600	
東京エネシス	8,200	1,112.00	9,118,400	
トーエネック	1,900	3,255.00	6,184,500	
住友電設	5,300	1,843.00	9,767,900	貸付株式数 300株
日本電設工業	9,800	2,245.00	22,001,000	

協和エクシオ	25,000	3,260.00	81,500,000	貸付株式数	800株
日本工営	4,200	2,939.00	12,343,800	貸付株式数	100株
九電工	12,900	4,500.00	58,050,000		
三機工業	14,000	1,221.00	17,094,000		
日揮	56,500	2,403.00	135,769,500	貸付株式数	13,800株
中外炉工業	3,300	2,982.00	9,840,600		
太平電業	4,600	2,803.00	12,893,800		
高砂熱学	17,500	2,060.00	36,050,000		
N E C ネットエスアイ	6,100	2,603.00	15,878,300		
明星工業	13,200	900.00	11,880,000		
大 気 社	8,200	3,585.00	29,397,000	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
ダイダン	4,700	2,864.00	13,460,800		
日比谷総合設備	8,000	1,913.00	15,304,000	貸付株式数	1,000株
東芝プラントシステム	13,500	2,419.00	32,656,500	貸付株式数	3,700株 (3,700株)
日本製粉	19,200	1,948.00	37,401,600		
日清製粉G本社	71,800	2,314.00	166,145,200		
昭和産業	5,400	2,894.00	15,627,600	貸付株式数	1,400株
中部飼料	8,000	1,530.00	12,240,000	貸付株式数	1,000株
フィード・ワン	48,200	213.00	10,266,600		
東洋精糖	9,900	1,227.00	12,147,300		
三井製糖	5,000	3,165.00	15,825,000		
塩水港精糖	43,900	271.00	11,896,900		
日新製糖	4,600	2,231.00	10,262,600		
L I F U L L	21,800	619.00	13,494,200	貸付株式数	7,900株
ジェイエシーリクルート メント	5,300	2,489.00	13,191,700	貸付株式数	1,900株
日本M & Aセンター	39,800	3,255.00	129,549,000		
タケエイ	9,100	825.00	7,507,500	貸付株式数	600株
トラスト・テック	3,200	4,570.00	14,624,000		
コシダカホールディングス	16,200	1,210.00	19,602,000	貸付株式数	1,000株
パソナグループ	6,200	1,695.00	10,509,000	貸付株式数	500株 (500株)
C D S	7,000	1,463.00	10,241,000	貸付株式数	1,900株
リンクアンドモチベーショ ン	12,200	1,253.00	15,286,600	貸付株式数	2,900株
G C A	9,600	885.00	8,496,000		
エス・エム・エス	22,900	2,131.00	48,799,900	貸付株式数	4,600株
パーソルホールディングス	52,500	2,545.00	133,612,500		

リニカル	4,800	1,749.00	8,395,200	貸付株式数	800株
クックパッド	21,900	447.00	9,789,300	貸付株式数	8,200株
森永製菓	13,700	4,155.00	56,923,500		
江崎グリコ	16,400	5,440.00	89,216,000	貸付株式数	4,500株
不二家	3,800	2,545.00	9,671,000		
山崎製パン	48,900	2,329.00	113,888,100		
モロゾフ	1,900	5,930.00	11,267,000		
亀田製菓	3,900	5,230.00	20,397,000		
寿スピリッツ	6,000	4,865.00	29,190,000		
カルビー	26,800	3,650.00	97,820,000	貸付株式数	10,600株
森永乳業	11,700	2,997.00	35,064,900		
六甲バター	5,000	2,518.00	12,590,000		
ヤクルト	34,300	8,880.00	304,584,000		
明治ホールディングス	38,700	7,450.00	288,315,000		
雪印メグミルク	14,400	2,880.00	41,472,000		
プリマハム	42,000	536.00	22,512,000		
日本ハム	24,600	4,050.00	99,630,000		
丸大食品	35,000	455.00	15,925,000		
S Foods	4,800	4,655.00	22,344,000		
伊藤ハム米久HLDGS	36,800	751.00	27,636,800		
スタジオアリス	3,900	2,329.00	9,083,100		
シミックホールディングス	4,300	2,280.00	9,804,000		
システナ	19,900	1,542.00	30,685,800		
デジタルアーツ	3,200	5,150.00	16,480,000	貸付株式数	1,000株
新日鉄住金SOL	9,500	3,600.00	34,200,000		
総合警備保障	22,600	5,060.00	114,356,000		
キューブシステム	9,200	943.00	8,675,600		
いちご	85,100	433.00	36,848,300		
日本駐車場開発	84,600	179.00	15,143,400		
コア	4,800	1,378.00	6,614,400		
カカクコム	43,300	2,152.00	93,181,600		
ディップ	8,500	2,633.00	22,380,500		
オプトホールディング	4,400	2,924.00	12,865,600	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
ツクイ	15,600	1,026.00	16,005,600		
エムスリー	59,800	5,160.00	308,568,000		
アウトソーシング	25,300	1,589.00	40,201,700		
ウェルネット	9,700	1,021.00	9,903,700	貸付株式数	3,500株
ワールドホールディングス	2,000	3,235.00	6,470,000	貸付株式数	500株 (500株)

ディー・エヌ・エー	30,500	1,919.00	58,529,500	貸付株式数	8,300株
博報堂D Y H L D G S	78,000	1,962.00	153,036,000		
ぐるなび	11,000	932.00	10,252,000	貸付株式数	1,300株
ファンコミュニケーションズ	19,000	679.00	12,901,000		
W D Bホールディングス	3,100	3,915.00	12,136,500		
ティア	7,800	949.00	7,402,200		
バリューコマース	4,600	2,312.00	10,635,200		
インフォマート	32,200	1,400.00	45,080,000	貸付株式数	7,900株
サッポロホールディングス	20,800	2,337.00	48,609,600	貸付株式数	8,300株
アサヒグループホールディングン	123,100	4,926.00	606,390,600	貸付株式数	34,000株
麒麟HD	266,200	2,907.00	773,843,400	貸付株式数	73,500株
宝ホールディングス	45,400	1,522.00	69,098,800		
オエノンホールディングス	24,600	399.00	9,815,400	貸付株式数	2,900株
コカ・コーラボトラーズJHD	45,000	3,095.00	139,275,000		
サントリー食品インター	39,200	4,660.00	182,672,000		
ダイドーグループHD	3,200	5,650.00	18,080,000	貸付株式数	1,200株
伊藤園	19,800	4,755.00	94,149,000	貸付株式数	7,700株
キーコーヒー	7,000	2,166.00	15,162,000	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	7,000	3,255.00	22,785,000		
不二製油グループ	16,000	3,520.00	56,320,000		
J - オイルミルズ	3,100	3,755.00	11,640,500		
ローソン	14,300	6,840.00	97,812,000	貸付株式数	5,600株 (800株)
サンエー	4,400	5,280.00	23,232,000	貸付株式数	1,200株
カワチ薬品	4,800	2,230.00	10,704,000		
エービーシー・マート	10,400	6,220.00	64,688,000		
ハードオフコーポレーション	8,300	985.00	8,175,500		
アスクル	5,100	3,340.00	17,034,000	貸付株式数	2,000株
ゲオホールディングス	10,900	1,601.00	17,450,900	貸付株式数	3,600株
アダストリア	9,300	1,513.00	14,070,900	貸付株式数	2,500株
くらコーポレーション	3,600	7,410.00	26,676,000		
エレマテック	2,900	2,597.00	7,531,300	貸付株式数	500株
パルグループH L D G S	3,400	2,620.00	8,908,000		
J A L U X	2,500	2,816.00	7,040,000		
エディオン	22,600	1,254.00	28,340,400	貸付株式数	8,800株
あらた	3,100	5,480.00	16,988,000	貸付株式数	1,200株

サーラコーポレーション	13,700	674.00	9,233,800	
ワッツ	7,200	939.00	6,760,800	
ハローズ	3,600	2,676.00	9,633,600	
J Pホールディングス	25,800	314.00	8,101,200	貸付株式数 6,100株 (2,000株)
あみやき亭	2,200	4,400.00	9,680,000	
東京エレクトロニクス	3,600	1,966.00	7,077,600	貸付株式数 100株
ひらまつ	16,200	453.00	7,338,600	貸付株式数 6,400株
フィールズ	5,700	924.00	5,266,800	貸付株式数 1,200株
双日	340,900	403.00	137,382,700	
アルフレッサホールディングス	63,400	2,924.00	185,381,600	
大黒天物産	1,900	4,485.00	8,521,500	貸付株式数 400株
ハニーズホールディングス	10,000	1,040.00	10,400,000	
キッコーマン	42,800	6,630.00	283,764,000	
味の素	133,800	1,912.50	255,892,500	貸付株式数 20,600株
キューピー	32,500	2,633.00	85,572,500	
ハウス食品G本社	22,400	3,345.00	74,928,000	貸付株式数 800株
カゴメ	23,700	3,250.00	77,025,000	
アリアケジャパン	5,500	10,760.00	59,180,000	
ニチレイ	28,200	2,884.00	81,328,800	
横浜冷凍	16,400	924.00	15,153,600	
東洋水産	32,200	4,405.00	141,841,000	
日清食品HD	22,900	7,660.00	175,414,000	
永谷園ホールディングス	9,000	1,525.00	13,725,000	
フジッコ	6,700	2,382.00	15,959,400	
ロックフィールド	7,500	1,827.00	13,702,500	
日本たばこ産業	338,200	2,990.00	1,011,218,000	貸付株式数 93,600株
ケンコーマヨネーズ	4,700	2,842.00	13,357,400	貸付株式数 200株
わらべや日洋HD	4,300	2,250.00	9,675,000	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
北の達人コーポ	19,800	611.00	12,097,800	貸付株式数 7,400株
ユーグレナ	23,600	837.00	19,753,200	貸付株式数 9,400株 (5,800株)
片倉工業	8,100	1,356.00	10,983,600	
ゲンゼ	4,800	5,790.00	27,792,000	
ヒューリック	119,700	1,090.00	130,473,000	
アルペン	4,400	2,015.00	8,866,000	貸付株式数 1,400株
クオール	6,900	2,382.00	16,435,800	

アルコニックス	7,400	1,580.00	11,692,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
神戸物産	4,500	5,460.00	24,570,000	
ジンス	4,100	5,590.00	22,919,000	貸付株式数 1,000株
ビックカメラ	31,700	1,526.00	48,374,200	貸付株式数 8,900株 (8,900株)
D C Mホールディングス	27,600	1,031.00	28,455,600	貸付株式数 9,300株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	4,800	3,965.00	19,032,000	貸付株式数 1,800株 (300株)
MonotaRO	18,700	6,290.00	117,623,000	貸付株式数 5,600株
あいホールディングス	9,600	2,520.00	24,192,000	貸付株式数 3,700株
ディービーエックス	5,700	1,418.00	8,082,600	
アークランドサービスHD	4,800	2,054.00	9,859,200	貸付株式数 1,200株
J. フロントリテイリング	67,400	1,654.00	111,479,600	
ドトール・日レスHD	9,400	2,128.00	20,003,200	
マツモトキヨシHLDGS	24,000	4,450.00	106,800,000	
ブロンコビリー	3,800	3,540.00	13,452,000	貸付株式数 900株 (900株)
スタートトゥデイ	57,100	3,335.00	190,428,500	貸付株式数 200株
物語コーポレーション	1,900	10,550.00	20,045,000	貸付株式数 600株
ココカラファイン	6,100	7,280.00	44,408,000	
三越伊勢丹HD	107,500	1,351.00	145,232,500	
東洋紡	22,100	1,886.00	41,680,600	
ユニチカ	19,400	706.00	13,696,400	
富士紡ホールディングス	3,900	3,295.00	12,850,500	貸付株式数 300株
日清紡ホールディングス	36,900	1,318.00	48,634,200	貸付株式数 9,600株
倉敷紡績	63,000	300.00	18,900,000	
ダイワボウHD	5,100	7,130.00	36,363,000	
シキボウ	6,800	1,323.00	8,996,400	
日東紡績	9,000	2,699.00	24,291,000	貸付株式数 700株
トヨタ紡織	16,600	2,039.00	33,847,400	
マクニカ・富士エレHLDGS	11,000	1,997.00	21,967,000	
ウエルシアHD	15,700	5,720.00	89,804,000	
クリエイトSDH	8,700	2,775.00	24,142,500	
バイタルKSKHD	10,700	1,273.00	13,621,100	貸付株式数 4,200株
U K Cホールディングス	4,100	2,697.00	11,057,700	

TO K A Iホールディングス	31,600	1,095.00	34,602,000		
三洋貿易	3,900	2,138.00	8,338,200		
ウイン・パートナーズ	5,400	1,299.00	7,014,600		
ジョイフル本田	16,500	1,752.00	28,908,000	貸付株式数	4,600株
鳥貴族	2,900	2,261.00	6,556,900	貸付株式数	1,000株
ホットランド	5,800	1,312.00	7,609,600	貸付株式数	2,300株 (1,300株)
すかいらーくHD	53,000	1,656.00	87,768,000	貸付株式数	20,900株 (2,800株)
綿半ホールディングス	3,100	2,970.00	9,207,000	貸付株式数	1,100株
日本毛織	18,900	921.00	17,406,900		
ユナイテッド・スーパー マーケ	20,200	1,381.00	27,896,200		
三栄建築設計	3,600	1,674.00	6,026,400		
野村不動産HLDGS	38,000	2,362.00	89,756,000		
三重交通グループHD	15,700	556.00	8,729,200	貸付株式数	600株
サムティ	6,500	1,803.00	11,719,500	貸付株式数	2,200株
日本商業開発	5,100	1,863.00	9,501,300	貸付株式数	1,900株
プレサンスコーポレーショ ン	9,200	1,500.00	13,800,000		
ユニゾホールディングス	8,000	2,190.00	17,520,000	貸付株式数	1,700株
日本管理センター	6,700	1,298.00	8,696,600		
フージャースHD	17,400	706.00	12,284,400		
オープンハウス	10,000	5,580.00	55,800,000	貸付株式数	1,000株
東急不動産HD	138,000	788.00	108,744,000		
飯田GHD	47,300	2,007.00	94,931,100		
帝国繊維	7,200	2,791.00	20,095,200		
日本コークス工業	58,300	114.00	6,646,200		
あさひ	6,400	1,504.00	9,625,600		
日本調剤	2,300	3,540.00	8,142,000	貸付株式数	800株 (100株)
コスモス薬品	3,000	25,220.00	75,660,000		
シップヘルスケアHD	11,600	4,095.00	47,502,000		
ソフトクリエイトHD	5,700	1,737.00	9,900,900	貸付株式数	1,100株
セブン&アイ・HLDGS	241,300	5,100.00	1,230,630,000		
薬王堂	2,800	3,795.00	10,626,000	貸付株式数	800株
クリエイト・レストラン ツ・ホール	16,500	1,352.00	22,308,000	貸付株式数	6,300株

ツルハホールディングス	12,600	13,080.00	164,808,000	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
サンマルクホールディングス	4,100	2,692.00	11,037,200	
トリドールホールディングス	7,600	2,506.00	19,045,600	貸付株式数 2,800株 (800株)
帝人	48,500	2,213.00	107,330,500	貸付株式数 13,200株 (13,000株)
東レ	442,200	866.60	383,210,520	
クラレ	93,300	1,642.00	153,198,600	貸付株式数 25,600株
旭化成	382,600	1,690.00	646,594,000	
サカイオーベックス	3,400	2,354.00	8,003,600	
TOKYO BASE	7,200	599.00	4,312,800	
宮地エンジニアリングG	2,800	2,889.00	8,089,200	
トーカロ	17,100	1,194.00	20,417,400	
アルファCO	3,400	1,434.00	4,875,600	
SUMCO	64,100	1,674.00	107,303,400	貸付株式数 7,700株
川田テクノロジーズ	1,400	6,190.00	8,666,000	
住江織物	2,800	3,210.00	8,988,000	貸付株式数 600株
アツギ	8,900	1,177.00	10,475,300	
コメダホールディングス	11,800	2,240.00	26,432,000	
ダイユー・リックHLDGS	6,200	1,171.00	7,260,200	
クスリのアオキHLDGS	4,700	8,330.00	39,151,000	貸付株式数 1,200株
ダイニック	8,300	941.00	7,810,300	貸付株式数 300株
共和レザー	9,800	997.00	9,770,600	
スシローグローバルHLDGS	6,700	6,960.00	46,632,000	
LIXILビバ	7,700	1,766.00	13,598,200	
セーレン	14,400	1,894.00	27,273,600	貸付株式数 400株
ソトー	12,800	1,011.00	12,940,800	貸付株式数 2,600株
東海染工	6,300	1,384.00	8,719,200	貸付株式数 1,700株
小松精練	11,500	1,034.00	11,891,000	
ワコールホールディングス	16,100	3,285.00	52,888,500	
ホギメディカル	8,000	3,925.00	31,400,000	貸付株式数 2,400株
TSIホールディングス	21,200	774.00	16,408,800	
TIS	19,500	5,850.00	114,075,000	
電算システム	6,300	2,252.00	14,187,600	
グリー	33,400	554.00	18,503,600	
コーエーテクモHD	9,600	2,267.00	21,763,200	

三菱総合研究所	2,800	4,210.00	11,788,000		
K L a b	10,900	1,046.00	11,401,400	貸付株式数	4,200株
ポルトゥウィン・ピット クル	5,000	2,985.00	14,925,000	貸付株式数	1,200株
ネクソン	146,200	1,393.00	203,656,600		
アイスタイル	16,300	1,320.00	21,516,000	貸付株式数	3,400株
エイチーム	5,200	1,943.00	10,103,600	貸付株式数	1,700株
テクノスジャパン	10,000	1,020.00	10,200,000	貸付株式数	3,400株
コロプラ	16,500	725.00	11,962,500	貸付株式数	6,500株 (4,500株)
ブロードリーフ	31,200	672.00	20,966,400		
デジタルハーツHLDGS	5,100	1,589.00	8,103,900	貸付株式数	1,700株
メディアドゥHLDGS	3,000	2,495.00	7,485,000	貸付株式数	900株
特種東海製紙	3,300	4,575.00	15,097,500		
ティーガイア	6,100	3,040.00	18,544,000		
豆蔵ホールディングス	7,900	934.00	7,378,600	貸付株式数	1,700株
ガンホー・オンライン・エ ンター	138,000	229.00	31,602,000	貸付株式数	54,900株
GMOペイメントゲート ウェイ	5,000	13,900.00	69,500,000	貸付株式数	1,300株
インターネットイニシア ティブ	10,600	2,256.00	23,913,600		
さくらインターネット	13,900	700.00	9,730,000	貸付株式数	2,800株
S R Aホールディングス	3,700	3,430.00	12,691,000		
システムインテグレータ	5,800	1,890.00	10,962,000		
朝日ネット	23,000	523.00	12,029,000	貸付株式数	100株
コムチュア	3,900	4,055.00	15,814,500		
王子ホールディングス	258,000	816.00	210,528,000		
日本製紙	25,000	2,032.00	50,800,000	貸付株式数	9,200株
三菱製紙	14,100	647.00	9,122,700	貸付株式数	2,600株
北越コーポレーション	31,700	639.00	20,256,300		
中越パルプ	4,900	1,608.00	7,879,200	貸付株式数	100株
大王製紙	23,100	1,650.00	38,115,000	貸付株式数	9,100株 (6,200株)
g u m i	9,500	627.00	5,956,500	貸付株式数	3,300株
アカツキ	1,800	3,490.00	6,282,000	貸付株式数	600株
L I N E	18,200	4,930.00	89,726,000	貸付株式数	7,000株 (2,100株)
レンゴー	59,700	932.00	55,640,400	貸付株式数	15,700株 (15,700株)

トーマク	4,300	2,057.00	8,845,100		
ザ・パック	4,400	3,575.00	15,730,000	貸付株式数	400株
AOI TYO HOLDINGS	7,900	1,454.00	11,486,600		
マクロミル	8,200	2,435.00	19,967,000	貸付株式数	2,000株
昭和電工	38,500	5,400.00	207,900,000	貸付株式数	15,100株
住友化学	445,000	645.00	287,025,000		
住友精化	2,600	5,980.00	15,548,000	貸付株式数	1,000株
日産化学	35,600	6,000.00	213,600,000		
ラサ工業	3,700	2,301.00	8,513,700	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,400	7,950.00	42,930,000		
テイカ	5,500	2,530.00	13,915,000		
石原産業	12,300	1,605.00	19,741,500		
日本曹達	42,000	685.00	28,770,000		
東ソー	87,200	1,722.00	150,158,400		
トクヤマ	18,100	3,075.00	55,657,500	貸付株式数	7,000株
セントラル硝子	12,700	2,890.00	36,703,000		
東亜合成	34,200	1,283.00	43,878,600		
大阪ソーダ	6,900	3,010.00	20,769,000	貸付株式数	1,800株
関東電化	16,100	1,164.00	18,740,400		
デンカ	22,200	3,810.00	84,582,000		
イビデン	34,600	1,611.00	55,740,600		
信越化学	100,900	9,833.00	992,149,700		
日本カ-バイド	3,600	1,742.00	6,271,200		
堺化学	4,700	2,767.00	13,004,900		
エア・ウォーター	49,000	2,036.00	99,764,000		
大陽日酸	47,800	1,669.00	79,778,200		
日本化学工業	2,800	3,620.00	10,136,000	貸付株式数	100株
日本パ-カラライジング	30,200	1,506.00	45,481,200		
高压ガス	11,000	927.00	10,197,000		
四国化成	9,800	1,584.00	15,523,200		
戸田工業	2,400	2,841.00	6,818,400		
ステラ ケミファ	3,600	3,885.00	13,986,000	貸付株式数	1,300株 (400株)
保土谷化学	2,500	3,200.00	8,000,000		
日本触媒	9,600	8,460.00	81,216,000		
大日精化	4,800	3,460.00	16,608,000		
カネカ	80,000	1,061.00	84,880,000		
協和発酵キリン	72,700	2,097.00	152,451,900	貸付株式数	20,100株
三菱瓦斯化学	49,900	2,355.00	117,514,500		

三井化学	54,700	2,838.00	155,238,600	
J S R	61,500	2,127.00	130,810,500	
東京応化工業	9,500	3,355.00	31,872,500	
大阪有機化学	7,000	1,347.00	9,429,000	貸付株式数 300株
三菱ケミカルH L D G S	407,700	1,010.50	411,980,850	
K H ネオケム	9,200	4,355.00	40,066,000	
ダイセル	80,700	1,331.00	107,411,700	
住友ベークライト	50,000	1,051.00	52,550,000	
積水化学	123,800	2,014.00	249,333,200	
日本ゼオン	51,000	1,179.00	60,129,000	
アイカ工業	17,100	4,540.00	77,634,000	
宇部興産	30,300	2,853.00	86,445,900	
積水樹脂	9,600	2,112.00	20,275,200	貸付株式数 100株
タキロンシーアイ	15,100	652.00	9,845,200	
旭有機材	5,000	2,659.00	13,295,000	
日立化成	29,000	2,172.00	62,988,000	
ニチバン	3,500	2,577.00	9,019,500	
リケンテクノス	16,100	587.00	9,450,700	貸付株式数 600株
大倉工業	3,400	2,183.00	7,422,200	貸付株式数 1,200株
積水化成成品	9,100	1,102.00	10,028,200	
群栄化学	2,500	3,410.00	8,525,000	
ダイキョーニシカワ	11,900	1,358.00	16,160,200	
竹本容器	2,400	3,195.00	7,668,000	貸付株式数 200株
日本化薬	38,100	1,317.00	50,177,700	
カーリットホールディングス	8,000	1,003.00	8,024,000	貸付株式数 4,000株
E P S ホールディングス	9,200	2,370.00	21,804,000	
プレステージ・インター	13,300	1,308.00	17,396,400	
アミューズ	4,200	3,125.00	13,125,000	
野村総合研究所	37,000	5,780.00	213,860,000	
ドリームインキュベータ	3,100	2,116.00	6,559,600	貸付株式数 800株
クイック	5,000	1,993.00	9,965,000	
T A C	17,100	267.00	4,565,700	
ケネディクス	55,900	664.00	37,117,600	
電通	68,300	5,190.00	354,477,000	貸付株式数 18,800株 (400株)
インテージホールディングス	9,600	996.00	9,561,600	貸付株式数 300株
ぴあ	2,000	5,710.00	11,420,000	貸付株式数 700株
イオンファンタジー	2,200	3,690.00	8,118,000	

ネクシィーズグループ	3,600	1,995.00	7,182,000	
日本精化	7,700	1,358.00	10,456,600	貸付株式数 2,400株
扶桑化学工業	6,200	2,747.00	17,031,400	貸付株式数 2,200株
A D E K A	25,200	1,911.00	48,157,200	
日油	23,900	3,660.00	87,474,000	
ハリマ化成グループ	7,100	982.00	6,972,200	
花 王	143,200	9,055.00	1,296,676,000	貸付株式数 39,700株
第一工業製薬	14,000	703.00	9,842,000	
三洋化成	3,700	5,550.00	20,535,000	
武田薬品	215,200	4,686.00	1,008,427,200	貸付株式数 58,300株
アステラス製薬	574,700	2,006.50	1,153,135,550	
大日本住友製薬	44,000	2,427.00	106,788,000	貸付株式数 17,200株
塩野義製薬	82,200	7,216.00	593,155,200	貸付株式数 22,600株 (22,600株)
田辺三菱製薬	70,600	1,870.00	132,022,000	
あすか製薬	7,900	1,439.00	11,368,100	
日本新薬	15,500	6,930.00	107,415,000	
中外製薬	61,300	6,980.00	427,874,000	貸付株式数 16,900株
科研製薬	10,400	5,870.00	61,048,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
エーザイ	70,200	10,545.00	740,259,000	
理研ビタミン	2,600	3,820.00	9,932,000	
ロート製薬	32,400	3,815.00	123,606,000	
小野薬品	138,200	3,080.00	425,656,000	
久光製薬	17,300	8,640.00	149,472,000	
持田製薬	3,800	8,850.00	33,630,000	
参天製薬	110,400	1,775.00	195,960,000	
扶桑薬品	4,000	2,922.00	11,688,000	
日本ケミファ	2,200	4,725.00	10,395,000	
ツムラ	20,800	4,030.00	83,824,000	
日医工	14,300	1,653.00	23,637,900	
テ ル モ	89,900	6,530.00	587,047,000	
みらかホールディングス	16,500	3,305.00	54,532,500	
キッセイ薬品工業	9,800	3,405.00	33,369,000	
生化学工業	12,200	1,701.00	20,752,200	
栄研化学	9,900	2,550.00	25,245,000	
鳥居薬品	3,400	2,662.00	9,050,800	貸付株式数 1,300株
J C Rファーマ	4,400	5,690.00	25,036,000	
東和薬品	3,000	7,900.00	23,700,000	
富士製薬工業	4,500	1,758.00	7,911,000	貸付株式数 1,800株

沢井製薬	11,600	5,960.00	69,136,000		
ゼリア新薬工業	13,000	2,456.00	31,928,000	貸付株式数	400株
第一三共	167,700	4,580.00	768,066,000		
キョーリン製薬HD	15,200	2,355.00	35,796,000		
大幸薬品	4,400	1,942.00	8,544,800	貸付株式数	1,100株
ダイト	4,100	3,340.00	13,694,000		
大塚ホールディングス	111,400	5,413.00	603,008,200	貸付株式数	30,800株
大正製薬HD	13,200	13,450.00	177,540,000		
ペプチドリーム	27,200	4,220.00	114,784,000	貸付株式数	10,600株
大日本塗料	8,800	1,310.00	11,528,000		
日本ペイントHOLD	47,400	4,305.00	204,057,000	貸付株式数	8,900株
関西ペイント	64,000	2,095.00	134,080,000	貸付株式数	25,400株
中国塗料	18,800	1,215.00	22,842,000	貸付株式数	7,100株
日本特殊塗料	4,900	2,499.00	12,245,100	貸付株式数	900株
藤倉化成	15,000	663.00	9,945,000		
太陽ホールディングス	4,500	4,335.00	19,507,500		
D I C	25,500	3,915.00	99,832,500		
サカタックス	13,100	1,430.00	18,733,000		
東洋インキSCホールディングン	11,200	2,974.00	33,308,800		
T & K TOKA	6,400	1,179.00	7,545,600		
アルプス技研	6,000	2,522.00	15,132,000		
オリエンタルランド	66,300	11,705.00	776,041,500		
ダスキン	14,900	2,802.00	41,749,800		
パーク24	34,000	3,365.00	114,410,000	貸付株式数	2,300株
明光ネットワークジャパン	9,700	1,039.00	10,078,300		
ファルコホールディングス	8,200	1,856.00	15,219,200		
クレスコ	2,100	3,210.00	6,741,000		
フジ・メディア・HD	59,300	1,975.00	117,117,500	貸付株式数	200株
ラウンドワン	18,400	1,411.00	25,962,400	貸付株式数	7,000株
リゾートトラスト	23,400	1,869.00	43,734,600		
オービック	18,500	10,510.00	194,435,000		
ジャストシステム	10,000	2,425.00	24,250,000		
ヤフー	423,200	408.00	172,665,600	貸付株式数	163,800株
ビー・エム・エル	7,900	3,355.00	26,504,500	貸付株式数	300株
トレンドマイクロ	30,900	7,120.00	220,008,000	貸付株式数	8,300株
りらいあコミュニケーション	9,900	1,454.00	14,394,600		
リソー教育	11,700	895.00	10,471,500		
日本オラクル	9,700	9,200.00	89,240,000		
フューチャー	9,700	1,875.00	18,187,500	貸付株式数	400株

CAC HOLDINGS	8,800	1,103.00	9,706,400	
ユー・エス・エス	67,800	2,121.00	143,803,800	
オービックビジネスC	3,200	9,490.00	30,368,000	
伊藤忠テクノソリュー	26,800	2,492.00	66,785,600	
アイティフォー	10,300	948.00	9,764,400	貸付株式数 2,800株
サイバーエージェント	35,000	6,320.00	221,200,000	貸付株式数 9,500株
楽天	262,400	840.60	220,573,440	貸付株式数 72,500株
テー・オー・ダブリュー	13,100	796.00	10,427,600	
大塚商会	31,600	4,095.00	129,402,000	
総合メディカル	5,500	2,481.00	13,645,500	
サイボウズ	15,400	648.00	9,979,200	
セントラルスポーツ	2,500	4,340.00	10,850,000	貸付株式数 300株
パラカ	2,900	2,375.00	6,887,500	貸付株式数 800株
電通国際情報S	4,100	4,030.00	16,523,000	貸付株式数 900株
デジタルガレージ	10,700	3,625.00	38,787,500	
イーエムシステムズ	6,500	1,194.00	7,761,000	
ウェザーニューズ	3,300	3,410.00	11,253,000	貸付株式数 700株 (700株)
C I J	13,200	749.00	9,886,800	
WOWOW	3,200	3,605.00	11,536,000	貸付株式数 1,200株
フルキャストホールディングス	6,600	2,575.00	16,995,000	
富士フイルムHLDGS	121,100	5,109.00	618,699,900	
コニカミノルタ	135,300	1,184.00	160,195,200	
資生堂	116,600	7,928.00	924,404,800	貸付株式数 46,100株
ライオン	81,700	2,457.00	200,736,900	
高砂香料	3,800	4,045.00	15,371,000	
マンダム	11,100	3,500.00	38,850,000	貸付株式数 2,900株 (2,900株)
ミルボン	7,400	4,985.00	36,889,000	
ファンケル	14,500	5,200.00	75,400,000	
コーセー	10,000	20,160.00	201,600,000	
シーズ・ホールディングス	7,400	3,985.00	29,489,000	
ポーラ・オルビスHD	25,200	3,805.00	95,886,000	
ノエビアホールディングス	3,700	6,200.00	22,940,000	
エステー	4,700	2,079.00	9,771,300	
コニシ	10,800	1,783.00	19,256,400	
長谷川香料	7,400	2,344.00	17,345,600	貸付株式数 500株
小林製薬	16,500	8,200.00	135,300,000	貸付株式数 4,300株 (4,300株)

荒川化学工業	6,200	1,902.00	11,792,400	貸付株式数	200株
メック	5,200	1,813.00	9,427,600	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	5,300	2,419.00	12,820,700		
タカラバイオ	15,800	2,954.00	46,673,200	貸付株式数	1,000株
J C U	7,600	2,598.00	19,744,800		
新田ゼラチン	12,700	844.00	10,718,800		
デクセリアルズ	15,900	1,156.00	18,380,400	貸付株式数	300株
アース製薬	4,300	5,140.00	22,102,000	貸付株式数	1,700株
北興化学	12,800	589.00	7,539,200	貸付株式数	500株
クミアイ化学	25,000	780.00	19,500,000		
日本農薬	14,800	811.00	12,002,800		
昭和シエル石油	55,900	2,427.00	135,669,300		
ニチレキ	8,600	1,243.00	10,689,800		
ユシロ化学	4,800	1,551.00	7,444,800	貸付株式数	100株
ビーピー・カストロール	2,900	1,582.00	4,587,800		
富士石油	18,200	451.00	8,208,200	貸付株式数	700株
M O R E S C O	5,200	1,670.00	8,684,000		
出光興産	49,300	6,130.00	302,209,000		
J X T Gホールディングス	932,500	835.00	778,637,500		
コスモエネルギーHLDG S	17,300	4,410.00	76,293,000	貸付株式数	4,500株 (4,500株)
横浜ゴム	32,300	2,384.00	77,003,200	貸付株式数	8,900株
東洋ゴム	29,800	1,996.00	59,480,800		
ブリヂストン	179,300	4,245.00	761,128,500	貸付株式数	49,600株
住友ゴム	50,900	1,679.00	85,461,100	貸付株式数	20,100株
藤倉ゴム	12,100	575.00	6,957,500		
オカモト	21,000	1,228.00	25,788,000		
アキレス	5,400	2,356.00	12,722,400	貸付株式数	100株
ニッタ	5,700	4,145.00	23,626,500	貸付株式数	800株
住友理工	9,800	1,112.00	10,897,600		
三ツ星ベルト	16,000	1,405.00	22,480,000		
バンドー化学	11,300	1,289.00	14,565,700	貸付株式数	400株
A G C	58,200	4,730.00	275,286,000	貸付株式数	16,100株
日本板硝子	30,000	1,213.00	36,390,000	貸付株式数	7,600株
有沢製作所	11,600	980.00	11,368,000		
日本山村硝子	59,000	187.00	11,033,000		
日本電気硝子	25,200	3,465.00	87,318,000	貸付株式数	6,800株
住友大阪セメント	110,000	487.00	53,570,000		
太平洋セメント	36,700	3,440.00	126,248,000		

日本ヒュ-ム	10,300	1,024.00	10,547,200	
日本コンクリ-ト	25,000	359.00	8,975,000	
アジアパイルHD	10,800	804.00	8,683,200	貸付株式数 2,900株
東海カーボン	54,700	2,064.00	112,900,800	貸付株式数 21,100株
日本カーボン	3,100	7,220.00	22,382,000	貸付株式数 1,100株
東洋炭素	4,000	3,240.00	12,960,000	
ノリタケ	3,500	7,030.00	24,605,000	
TOTO	45,300	4,895.00	221,743,500	
日本碍子	68,700	1,806.00	124,072,200	
日本特殊陶業	49,400	3,295.00	162,773,000	
MARUWA	2,200	7,610.00	16,742,000	
品川リフラクトリーズ	2,300	4,550.00	10,465,000	
黒崎播磨	1,400	8,720.00	12,208,000	貸付株式数 300株
ニッカトー	4,600	1,265.00	5,819,000	
フジインコーポレーテッド	5,700	2,970.00	16,929,000	
ニチアス	33,000	1,504.00	49,632,000	
新日鐵住金	256,500	2,310.50	592,643,250	
神戸製鋼所	104,000	956.00	99,424,000	
中山製鋼所	9,000	713.00	6,417,000	貸付株式数 1,700株
合同製鐵	3,900	2,349.00	9,161,100	
JFEホールディングス	155,500	2,497.00	388,283,500	
日新製鋼	16,200	1,612.00	26,114,400	
東京製鐵	31,600	856.00	27,049,600	
共英製鋼	6,800	2,128.00	14,470,400	
大和工業	12,200	3,295.00	40,199,000	
東京鐵鋼	5,000	1,663.00	8,315,000	貸付株式数 700株
大阪製鐵	3,900	2,262.00	8,821,800	
淀川製鋼所	7,100	2,716.00	19,283,600	
丸一鋼管	20,500	3,485.00	71,442,500	貸付株式数 1,700株
大同特殊鋼	9,800	5,370.00	52,626,000	
日本高周波	8,000	772.00	6,176,000	
日本冶金工	54,300	329.00	17,864,700	
山陽特殊製鋼	6,900	2,588.00	17,857,200	
愛知製鋼	2,700	4,180.00	11,286,000	
日立金属	61,400	1,361.00	83,565,400	
日本金属	2,800	1,630.00	4,564,000	
大平洋金属	4,000	3,755.00	15,020,000	貸付株式数 800株
新日本電工	39,600	283.00	11,206,800	
栗本鉄工所	4,300	1,852.00	7,963,600	貸付株式数 100株

日本製鋼所	19,400	2,791.00	54,145,400	
三菱製鋼	5,200	2,140.00	11,128,000	
日本精線	1,700	4,125.00	7,012,500	貸付株式数 100株
大紀アルミニウム	12,700	755.00	9,588,500	貸付株式数 4,600株
日本軽金属HD	166,600	247.00	41,150,200	
三井金属	15,500	3,080.00	47,740,000	
東邦亜鉛	3,500	4,050.00	14,175,000	貸付株式数 1,200株
三菱マテリアル	37,200	3,245.00	120,714,000	
住友鉱山	73,900	3,786.00	279,785,400	貸付株式数 29,200株
DOWAホールディングス	14,200	3,480.00	49,416,000	貸付株式数 3,900株
古河機金	9,900	1,635.00	16,186,500	貸付株式数 2,700株
大阪チタニウム	7,100	1,775.00	12,602,500	貸付株式数 2,500株 (1,800株)
東邦チタニウム	12,100	1,247.00	15,088,700	貸付株式数 4,300株
UACJ	8,700	2,706.00	23,542,200	貸付株式数 3,200株
古河電工	19,100	3,740.00	71,434,000	
住友電工	213,700	1,799.00	384,446,300	
フジクラ	67,300	604.00	40,649,200	
昭和電線HLDGS	11,200	775.00	8,680,000	
タツタ電線	13,800	607.00	8,376,600	
リョービ	7,500	4,285.00	32,137,500	
アーレステイ	9,600	847.00	8,131,200	
アサヒHD	10,500	2,097.00	22,018,500	
東洋製罐グループHD	36,600	2,319.00	84,875,400	
ホッカンホールディングス	20,000	448.00	8,960,000	
横河ブリッジHLDGS	11,300	2,437.00	27,538,100	
OSJBHD	38,100	297.00	11,315,700	
駒井ハルテック	4,300	2,360.00	10,148,000	
三和ホールディングス	55,700	1,405.00	78,258,500	
文化シヤツタ-	18,600	840.00	15,624,000	
三協立山	8,400	1,444.00	12,129,600	貸付株式数 2,700株
アルインコ	8,700	1,066.00	9,274,200	
LIXILグループ	84,800	2,267.00	192,241,600	
日本ファイルコン	13,500	581.00	7,843,500	貸付株式数 2,100株
ノーリツ	12,200	1,755.00	21,411,000	
長府製作所	5,900	2,565.00	15,133,500	
リンナイ	10,200	8,350.00	85,170,000	
ユニプレス	10,900	2,200.00	23,980,000	
岡部	13,400	1,088.00	14,579,200	
ジーテクト	7,000	1,839.00	12,873,000	

東 プ レ	10,500	2,841.00	29,830,500	
高周波熱錬	12,300	1,101.00	13,542,300	
東京製綱	5,400	1,468.00	7,927,200	貸付株式数 2,100株
パイオラックス	8,900	2,351.00	20,923,900	
エイチワン	6,600	1,360.00	8,976,000	
日本発条	56,400	1,190.00	67,116,000	貸付株式数 21,900株
三浦工業	25,300	3,410.00	86,273,000	
タ ク マ	19,800	1,424.00	28,195,200	貸付株式数 5,000株
テクノプロ・ホールディング	10,800	6,720.00	72,576,000	
イー・ガーディアン	3,800	2,661.00	10,111,800	貸付株式数 1,200株
ジャパンマテリアル	17,100	1,425.00	24,367,500	貸付株式数 2,400株
ベクトル	7,600	2,562.00	19,471,200	貸付株式数 1,900株
アサンテ	4,700	2,380.00	11,186,000	貸付株式数 1,000株
N・フィールド	4,800	1,821.00	8,740,800	貸付株式数 1,200株
M&Aキャピタルパート	1,700	6,280.00	10,676,000	貸付株式数 400株
エスコローAJ	12,700	428.00	5,435,600	
日本ビューホテル	8,200	1,347.00	11,045,400	
リクルートホールディング	432,500	3,665.00	1,585,112,500	
ツ ガ ミ	17,000	1,135.00	19,295,000	
オークマ	6,500	6,200.00	40,300,000	貸付株式数 2,500株
東芝機械	34,000	515.00	17,510,000	
アマダホールディングス	85,200	1,167.00	99,428,400	
アイダエンジニア	14,100	995.00	14,029,500	
滝澤鉄工所	4,300	1,734.00	7,456,200	
F U J I	17,400	1,840.00	32,016,000	貸付株式数 6,700株
牧野フライス	29,000	976.00	28,304,000	
オーエスジー	27,800	2,511.00	69,805,800	貸付株式数 8,400株
旭ダイヤモンド	19,100	791.00	15,108,100	貸付株式数 7,400株
D M G 森精機	35,600	1,866.00	66,429,600	貸付株式数 13,900株
ソディック	13,200	999.00	13,186,800	貸付株式数 3,500株
ディスコ	7,900	19,460.00	153,734,000	
日東工器	4,000	2,588.00	10,352,000	
パンチ工業	7,400	800.00	5,920,000	貸付株式数 1,800株
日本郵政	315,700	1,343.00	423,985,100	
ベルシステム24HLDGS	10,600	1,783.00	18,899,800	
ソラスト	12,100	1,305.00	15,790,500	

豊田自動織機	46,600	6,490.00	302,434,000	
豊和工業	4,900	929.00	4,552,100	貸付株式数 900株 (900株)
OKK	5,600	1,086.00	6,081,600	
石川製作所	2,400	1,519.00	3,645,600	貸付株式数 400株
東洋機械金属	9,700	746.00	7,236,200	
島精機製作所	7,400	5,070.00	37,518,000	貸付株式数 2,900株 (100株)
オプトラン	5,900	3,210.00	18,939,000	貸付株式数 2,200株
ヤマシンフィルタ	10,400	929.00	9,661,600	貸付株式数 3,700株 (1,700株)
日阪製作所	10,100	1,159.00	11,705,900	
やまびこ	11,400	1,358.00	15,481,200	貸付株式数 3,700株
平田機工	2,300	8,660.00	19,918,000	貸付株式数 800株
ナプテスコ	31,500	2,945.00	92,767,500	
三井海洋開発	6,300	3,600.00	22,680,000	
レオン自動機	6,200	1,972.00	12,226,400	
S M C	18,400	36,160.00	665,344,000	
ホソカワミクロン	2,300	6,230.00	14,329,000	
ユニオンツール	2,900	4,075.00	11,817,500	
オイレス工業	7,800	2,358.00	18,392,400	貸付株式数 500株
日精エーエスピー	1,900	4,960.00	9,424,000	貸付株式数 700株
サト - ホールディングス	8,100	3,645.00	29,524,500	貸付株式数 2,100株
技研製作所	4,900	2,881.00	14,116,900	貸付株式数 1,700株
日精樹脂工業	6,800	1,155.00	7,854,000	貸付株式数 2,000株
小松製作所	282,100	3,282.00	925,852,200	
住友重機械	32,800	3,900.00	127,920,000	
日立建機	27,200	3,525.00	95,880,000	
巴工業	4,300	2,220.00	9,546,000	貸付株式数 300株
井関農機	6,100	2,010.00	12,261,000	貸付株式数 1,600株
T O W A	5,900	1,045.00	6,165,500	貸付株式数 1,400株
丸山製作所	3,800	1,743.00	6,623,400	
北川鉄工所	3,900	2,918.00	11,380,200	貸付株式数 700株
シンニッタン	17,300	506.00	8,753,800	
ローツェ	3,400	2,259.00	7,680,600	貸付株式数 1,300株
クボタ	312,700	1,848.00	577,869,600	貸付株式数 124,200株 (37,700株)
東洋エンジニア	11,600	990.00	11,484,000	貸付株式数 3,500株 (1,300株)
三菱化工機	4,300	1,847.00	7,942,100	貸付株式数 100株

月島機械	11,700	1,488.00	17,409,600	
帝国電機製作所	6,500	1,745.00	11,342,500	
新東工業	13,300	1,119.00	14,882,700	貸付株式数 5,300株
渋谷工業	5,600	4,240.00	23,744,000	
アイチ コーポレーション	9,900	645.00	6,385,500	貸付株式数 3,800株
小森コーポレーション	13,700	1,404.00	19,234,800	貸付株式数 300株
鶴見製作所	5,500	1,855.00	10,202,500	貸付株式数 300株
住友精密	24,000	394.00	9,456,000	
酒井重工業	1,600	3,495.00	5,592,000	
荏原製作所	26,000	3,900.00	101,400,000	貸付株式数 100株
西島製作所	7,400	1,115.00	8,251,000	貸付株式数 400株
北越工業	8,400	1,293.00	10,861,200	
千代田化工建	43,400	849.00	36,846,600	貸付株式数 16,900株
ダイキン工業	80,000	15,605.00	1,248,400,000	
オルガノ	2,800	3,365.00	9,422,000	
ト - ヨ - カネツ	3,000	3,010.00	9,030,000	
栗田工業	31,000	3,230.00	100,130,000	
椿本チエイン	33,000	1,016.00	33,528,000	
日 機 装	19,300	1,319.00	25,456,700	
新興プランテック	13,400	1,078.00	14,445,200	
アネスト岩田	11,100	1,169.00	12,975,900	貸付株式数 200株
ダイフク	30,000	5,510.00	165,300,000	
加藤製作所	3,400	3,475.00	11,815,000	
油研工業	3,100	2,256.00	6,993,600	
タダノ	27,700	1,265.00	35,040,500	
フジテック	17,400	1,480.00	25,752,000	
C K D	16,700	1,440.00	24,048,000	
キトー	5,200	2,019.00	10,498,800	
平和	18,000	2,703.00	48,654,000	
理想科学工業	6,200	2,681.00	16,622,200	
SANKYO	14,000	4,505.00	63,070,000	貸付株式数 1,800株
日本金銭機械	6,500	1,272.00	8,268,000	貸付株式数 1,800株
マースエンジニアリング	3,800	2,367.00	8,994,600	貸付株式数 1,500株
福島工業	3,800	5,360.00	20,368,000	
ダイコク電機	3,800	1,820.00	6,916,000	
竹内製作所	9,800	3,020.00	29,596,000	
ア マ ノ	18,100	2,430.00	43,983,000	
JUKI	9,200	1,310.00	12,052,000	
サンデンホールディングス	8,300	1,535.00	12,740,500	貸付株式数 3,100株
ブラザー工業	70,100	2,254.00	158,005,400	貸付株式数 16,200株

マックス	9,000	1,650.00	14,850,000	
モリタホールディングス	9,700	2,355.00	22,843,500	
グローリー	16,800	2,779.00	46,687,200	
新晃工業	6,900	1,751.00	12,081,900	貸付株式数 2,600株
大和冷機工業	9,000	1,261.00	11,349,000	
セガサミーホールディングス	57,500	1,769.00	101,717,500	
日本ピストンリング	4,500	2,299.00	10,345,500	
リケン	2,800	6,210.00	17,388,000	
TPR	6,400	2,847.00	18,220,800	
ツバキ・ナカシマ	9,200	2,185.00	20,102,000	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,200	10,920.00	187,824,000	
大豊工業	5,900	1,269.00	7,487,100	
日本精工	118,300	1,268.00	150,004,400	貸付株式数 46,900株 (46,900株)
NTN	128,000	460.00	58,880,000	貸付株式数 50,700株
ジェイテクト	60,200	1,631.00	98,186,200	
不二越	5,500	5,520.00	30,360,000	貸付株式数 1,900株
ミネベアミツミ	108,300	2,143.00	232,086,900	
日本トムソン	21,000	757.00	15,897,000	
THK	36,500	2,915.00	106,397,500	
ユーシン精機	6,500	1,206.00	7,839,000	
イーグル工業	6,700	1,489.00	9,976,300	貸付株式数 1,600株
日本ピラ-工業	7,300	1,579.00	11,526,700	
キッツ	25,300	964.00	24,389,200	
日立	1,399,000	747.20	1,045,332,800	
三菱電機	582,700	1,526.50	889,491,550	
富士電機	177,000	926.00	163,902,000	
東洋電機製造	4,300	1,648.00	7,086,400	貸付株式数 1,300株
安川電機	68,200	3,500.00	238,700,000	貸付株式数 26,800株
シンフォニアテクノロジー	41,000	375.00	15,375,000	
明電舎	49,000	380.00	18,620,000	
オリジン電気	3,600	1,756.00	6,321,600	貸付株式数 600株
山洋電気	2,900	5,480.00	15,892,000	
デンヨー	5,900	1,829.00	10,791,100	
三桜工業	11,700	716.00	8,377,200	
マキタ	76,000	5,340.00	405,840,000	
東芝テック	41,000	691.00	28,331,000	

マブチモーター	15,500	4,300.00	66,650,000	
日本電産	70,400	16,500.00	1,161,600,000	
東光高岳	4,200	1,749.00	7,345,800	貸付株式数 1,000株
ダブル・スコープ	9,600	974.00	9,350,400	貸付株式数 3,600株 (900株)
ダイヘン	33,000	605.00	19,965,000	
ヤーマン	9,200	2,148.00	19,761,600	貸付株式数 2,400株 (100株)
JVCケンウッド	49,100	314.00	15,417,400	貸付株式数 12,800株
第一精工	3,600	1,597.00	5,749,200	
日新電機	13,400	1,021.00	13,681,400	貸付株式数 5,300株
大崎電気	14,400	875.00	12,600,000	貸付株式数 3,900株
オムロン	61,500	4,995.00	307,192,500	貸付株式数 4,200株
日東工業	10,600	2,012.00	21,327,200	
I D E C	8,100	2,360.00	19,116,000	貸付株式数 2,900株
ジーエス・ユアサ コーポ	104,000	557.00	57,928,000	
メルコホールディングス	3,100	4,190.00	12,989,000	貸付株式数 800株
日本電気	74,600	3,060.00	228,276,000	貸付株式数 20,600株 (20,600株)
富士通	601,000	814.60	489,574,600	
沖電気	22,300	1,440.00	32,112,000	
電気興業	4,100	3,345.00	13,714,500	貸付株式数 200株
サンケン電気	36,000	574.00	20,664,000	
アイホン	5,700	1,688.00	9,621,600	貸付株式数 700株
ルネサスエレクトロニクス	61,900	772.00	47,786,800	
セイコーエプソン	85,600	1,954.00	167,262,400	
ワコム	47,600	505.00	24,038,000	貸付株式数 12,500株
アルバック	13,500	4,225.00	57,037,500	貸付株式数 5,200株
E I Z O	5,500	4,990.00	27,445,000	貸付株式数 600株
ジャパンディスプレイ	124,600	137.00	17,070,200	貸付株式数 47,600株 (30,400株)
日本信号	16,200	1,137.00	18,419,400	
京三製作所	16,700	610.00	10,187,000	貸付株式数 5,800株
能美防災	8,600	2,478.00	21,310,800	
ホーチキ	5,400	1,661.00	8,969,400	
エレコム	5,800	2,866.00	16,622,800	
パナソニック	665,800	1,347.50	897,165,500	
シャープ	58,000	2,416.00	140,128,000	貸付株式数 21,600株
アンリツ	43,300	1,839.00	79,628,700	
富士通ゼネラル	18,200	1,912.00	34,798,400	貸付株式数 7,100株

ソニー	391,700	6,682.00	2,617,339,400	
T D K	30,700	12,190.00	374,233,000	
帝国通信工業	6,900	1,291.00	8,907,900	貸付株式数 100株
タムラ製作所	24,700	741.00	18,302,700	
アルプス電気	50,300	3,115.00	156,684,500	
池上通信機	48,000	139.00	6,672,000	
パイオニア	118,600	107.00	12,690,200	貸付株式数 46,600株
日本電波工業	12,800	505.00	6,464,000	貸付株式数 5,100株
日本トリム	1,700	5,870.00	9,979,000	貸付株式数 400株 (200株)
ローランド ディー・ ジー	3,600	2,655.00	9,558,000	
フオスタ - 電機	7,700	1,426.00	10,980,200	
クラリオン	35,000	325.00	11,375,000	
S M K	20,000	323.00	6,460,000	
ヨコオ	5,200	1,427.00	7,420,400	貸付株式数 1,800株
ホシデン	15,100	1,100.00	16,610,000	
ヒロセ電機	9,400	12,750.00	119,850,000	
日本航空電子	15,000	1,988.00	29,820,000	
T O A	8,500	1,318.00	11,203,000	貸付株式数 1,200株
マクセルホールディングス	11,500	1,825.00	20,987,500	貸付株式数 3,400株
古野電気	8,300	1,437.00	11,927,100	
ユニデンホールディングス	23,000	286.00	6,578,000	
アルパイン	13,900	2,315.00	32,178,500	
スミダコーポレーション	6,000	1,392.00	8,352,000	貸付株式数 1,800株 (1,700株)
アイコム	3,800	2,542.00	9,659,600	
リオン	3,700	2,334.00	8,635,800	
本多通信工業	7,300	842.00	6,146,600	
船井電機	10,000	678.00	6,780,000	貸付株式数 4,000株 (1,800株)
横河電機	58,200	2,349.00	136,711,800	
新電元工業	2,200	5,130.00	11,286,000	貸付株式数 200株
アズビル	17,300	4,810.00	83,213,000	
日本光電工業	24,400	3,460.00	84,424,000	
共和電業	20,100	426.00	8,562,600	
堀場製作所	11,700	6,460.00	75,582,000	貸付株式数 4,600株 (3,100株)
アドバンテスト	33,100	2,406.00	79,638,600	
エスペック	6,100	2,179.00	13,291,900	

キーエンス	28,700	63,370.00	1,818,719,000	
日置電機	3,500	3,545.00	12,407,500	
シスメックス	45,600	9,930.00	452,808,000	
日本マイクロニクス	11,200	801.00	8,971,200	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
メガチップス	5,200	2,233.00	11,611,600	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,300	5,450.00	17,985,000	
デンソー	129,600	5,707.00	739,627,200	
コーセル	8,800	1,271.00	11,184,800	
イリソ電子工業	4,900	6,030.00	29,547,000	貸付株式数 1,300株
オプテックスグループ	10,900	2,198.00	23,958,200	貸付株式数 4,200株
千代田インテグレ	3,200	2,354.00	7,532,800	
レーザーテック	12,600	3,800.00	47,880,000	
スタンレー電気	44,300	3,815.00	169,004,500	
岩崎電気	4,700	1,558.00	7,322,600	貸付株式数 900株
ウシオ電機	32,300	1,533.00	49,515,900	
ヘリオステクノH	8,300	948.00	7,868,400	
日本セラミック	6,100	2,962.00	18,068,200	
古河電池	7,500	866.00	6,495,000	貸付株式数 1,400株 (1,000株)
山一電機	5,200	1,580.00	8,216,000	貸付株式数 1,900株
図 研	4,800	1,845.00	8,856,000	
日本電子	23,000	1,216.00	27,968,000	
カ シ オ	46,900	1,860.00	87,234,000	
ファナック	55,500	22,170.00	1,230,435,000	
日本シイエムケイ	11,700	837.00	9,792,900	貸付株式数 3,100株
エンプラス	2,900	3,135.00	9,091,500	貸付株式数 700株 (700株)
大真空	4,100	1,364.00	5,592,400	
ロ - ム	26,200	8,080.00	211,696,000	
浜松ホトニクス	41,700	4,240.00	176,808,000	
三井ハイテック	8,500	1,509.00	12,826,500	貸付株式数 3,200株 (100株)
新光電気工業	22,100	947.00	20,928,700	
京 セ ラ	95,700	6,619.00	633,438,300	
太陽誘電	28,800	2,811.00	80,956,800	貸付株式数 10,500株
村田製作所	61,300	17,940.00	1,099,722,000	貸付株式数 4,800株 (4,800株)

ユーシン	15,500	767.00	11,888,500	貸付株式数 6,000株 (3,500株)
双葉電子工業	9,200	2,032.00	18,694,400	貸付株式数 200株
日東電工	43,900	8,516.00	373,852,400	
北陸電気工業	5,400	1,251.00	6,755,400	貸付株式数 2,100株
東海理化電機	14,800	2,409.00	35,653,200	
ニチコン	18,900	1,111.00	20,997,900	貸付株式数 400株
日本ケミコン	5,000	3,145.00	15,725,000	
K O A	8,500	1,996.00	16,966,000	
三井E & S H D	21,100	2,025.00	42,727,500	貸付株式数 8,100株
日立造船	42,000	461.00	19,362,000	
三菱重工業	96,800	4,163.00	402,978,400	
川崎重工業	44,200	3,165.00	139,893,000	
I H I	44,800	4,435.00	198,688,000	
名村造船所	19,200	545.00	10,464,000	
日本車輛	27,000	300.00	8,100,000	
三菱ロジスネクスト	7,900	1,333.00	10,530,700	貸付株式数 900株
F P G	20,900	1,180.00	24,662,000	貸付株式数 7,700株
じもとホールディングス	67,900	179.00	12,154,100	
全国保証	16,400	4,510.00	73,964,000	貸付株式数 3,800株
めぶきフィナンシャルG	294,000	395.00	116,130,000	
東京きらぼしF G	7,800	2,423.00	18,899,400	
九州フィナンシャルG	90,100	547.00	49,284,700	
かんぼ生命保険	21,500	2,625.00	56,437,500	
ゆうちょ銀行	161,800	1,337.00	216,326,600	
富山第一銀行	21,300	469.00	9,989,700	貸付株式数 400株
コンコルディア・フィナンシャル	344,900	547.00	188,660,300	
西日本フィナンシャルH D	35,100	1,259.00	44,190,900	
アルヒ	7,300	2,447.00	17,863,100	貸付株式数 2,700株
日産自動車	688,400	1,086.50	747,946,600	
いすゞ自動車	169,600	1,752.00	297,139,200	
トヨタ自動車	710,400	7,019.00	4,986,297,600	貸付株式数 281,600株 (281,600株)
日野自動車	82,400	1,236.00	101,846,400	
三菱自動車工業	215,700	786.00	169,540,200	
エフテック	6,000	1,246.00	7,476,000	
武蔵精密工業	6,600	3,760.00	24,816,000	貸付株式数 1,700株
日産車体	22,200	1,081.00	23,998,200	貸付株式数 600株
新明和工業	25,600	1,403.00	35,916,800	

極東開発工業	11,500	1,726.00	19,849,000	貸付株式数	900株
日信工業	11,600	1,862.00	21,599,200	貸付株式数	4,600株
トピー工業	4,900	3,200.00	15,680,000		
ティラド	2,600	3,005.00	7,813,000		
曙ブレーキ	34,900	252.00	8,794,800	貸付株式数	12,800株 (100株)
タチエス	10,400	1,810.00	18,824,000	貸付株式数	3,800株
N O K	28,700	1,993.00	57,199,100		
フタバ産業	18,700	744.00	13,912,800		
K Y B	6,000	4,560.00	27,360,000		
市光工業	10,400	905.00	9,412,000		
大同メタル工業	9,400	945.00	8,883,000		
プレス工業	33,100	585.00	19,363,500		
太平洋工業	12,900	1,885.00	24,316,500		
ケーヒン	13,300	2,321.00	30,869,300	貸付株式数	1,000株
河西工業	8,100	1,208.00	9,784,800		
アイシン精機	48,200	5,340.00	257,388,000		
マ ッ ダ	179,400	1,322.50	237,256,500		
今仙電機製作所	8,300	1,165.00	9,669,500		
本田技研	524,500	3,383.00	1,774,383,500		
スズキ	116,200	7,101.00	825,136,200	貸付株式数	45,900株
S U B A R U	181,000	3,269.00	591,689,000		
安永	3,500	1,991.00	6,968,500	貸付株式数	1,300株
ヤマハ発動機	82,000	2,927.00	240,014,000	貸付株式数	29,300株
ショーワ	15,900	1,677.00	26,664,300		
小糸製作所	35,200	7,240.00	254,848,000		
T B K	20,800	500.00	10,400,000		
エクセディ	6,700	3,720.00	24,924,000		
ミツバ	11,400	970.00	11,058,000		
豊田合成	20,800	2,784.00	57,907,200		
愛三工業	11,100	952.00	10,567,200	貸付株式数	900株
ヨ ロ ズ	6,900	1,721.00	11,874,900		
エフ・シー・シー	9,800	3,350.00	32,830,000		
シマノ	23,600	18,580.00	438,488,000	貸付株式数	5,800株
テイ・エス テック	13,500	3,915.00	52,852,500		
関西みらいFG	26,500	971.00	25,731,500		
3 3 F G	5,000	2,397.00	11,985,000	貸付株式数	900株
ジャムコ	3,200	3,080.00	9,856,000	貸付株式数	900株 (900株)

小野建	6,000	1,779.00	10,674,000	貸付株式数 1,500株 (1,400株)
ノジマ	10,600	2,457.00	26,044,200	
佐島電機	7,500	979.00	7,342,500	
伯東	4,300	1,586.00	6,819,800	
コンドーテック	10,400	1,083.00	11,263,200	
ライトオン	7,800	1,016.00	7,924,800	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ナガイレベン	8,400	2,577.00	21,646,800	
三菱食品	5,800	3,035.00	17,603,000	
良品計画	7,700	33,500.00	257,950,000	
松田産業	5,500	1,562.00	8,591,000	貸付株式数 200株
第一興商	8,400	5,310.00	44,604,000	
メディパルHD	56,200	2,285.00	128,417,000	
アドヴァン	7,400	1,016.00	7,518,400	貸付株式数 600株 (600株)
萩原電気HLDGS	2,900	3,330.00	9,657,000	
アルビス	2,500	3,065.00	7,662,500	
アズワン	4,700	8,390.00	39,433,000	
ドウシシャ	6,500	2,290.00	14,885,000	貸付株式数 400株
小津産業	5,500	1,997.00	10,983,500	貸付株式数 2,000株
コジマ	13,100	511.00	6,694,100	
コーナン商事	8,800	2,714.00	23,883,200	
ネットワンシステムズ	24,400	2,615.00	63,806,000	
ワタミ	8,200	1,339.00	10,979,800	貸付株式数 3,200株
ドンキホーテホールディング グ	37,600	5,530.00	207,928,000	
丸文	7,000	858.00	6,006,000	貸付株式数 2,500株
西松屋チェーン	12,900	1,192.00	15,376,800	貸付株式数 3,600株
ゼンショーホールディング ス	30,500	2,368.00	72,224,000	貸付株式数 11,900株
ハピネット	5,300	1,900.00	10,070,000	
幸楽苑ホールディングス	5,900	1,643.00	9,693,700	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
日本ライフライン	16,800	2,170.00	36,456,000	貸付株式数 6,500株
サイゼリヤ	9,400	2,223.00	20,896,200	貸付株式数 2,600株
エクセル	3,500	1,863.00	6,520,500	
V Tホールディングス	21,200	502.00	10,642,400	
マルカキカイ	3,900	2,073.00	8,084,700	
アルゴグラフィックス	3,300	4,855.00	16,021,500	

I D O M	21,000	382.00	8,022,000		
ポプラ	10,400	676.00	7,030,400	貸付株式数	3,200株
ユナイテッドアローズ	7,400	4,360.00	32,264,000	貸付株式数	1,900株 (1,900株)
進和	4,400	2,118.00	9,319,200		
ダイトロン	4,100	2,222.00	9,110,200	貸付株式数	1,400株
ハイデイ日高	8,000	2,330.00	18,640,000		
シークス	7,400	2,009.00	14,866,600	貸付株式数	2,000株
コロワイド	19,800	3,165.00	62,667,000	貸付株式数	7,600株
ピーシーデポコーポ	11,200	519.00	5,812,800	貸付株式数	700株 (500株)
壺番屋	4,300	4,550.00	19,565,000	貸付株式数	1,200株
スギホールディングス	12,500	5,530.00	69,125,000		
島津製作所	70,200	3,330.00	233,766,000		
長野計器	7,500	1,142.00	8,565,000		
ブイ・テクノロジー	1,400	17,150.00	24,010,000		
スター精密	10,200	1,984.00	20,236,800	貸付株式数	3,700株
東京計器	5,200	1,156.00	6,011,200	貸付株式数	1,400株 (1,300株)
東京精密	10,200	2,922.00	29,804,400		
マニー	7,400	5,170.00	38,258,000		
ニコン	101,100	2,142.00	216,556,200		
トプコン	30,800	1,890.00	58,212,000		
オリンパス	86,700	4,475.00	387,982,500		
理研計器	6,100	2,477.00	15,109,700		
S C R E E Nホールディングス	11,200	7,310.00	81,872,000		
キヤノン電子	4,600	2,357.00	10,842,200		
タムロン	5,900	2,334.00	13,770,600	貸付株式数	100株
H O Y A	117,700	6,608.00	777,761,600		
ノーリツ鋼機	6,700	2,754.00	18,451,800	貸付株式数	1,700株 (1,000株)
エー・アンド・デイ	8,200	904.00	7,412,800	貸付株式数	300株
キヤノン	312,600	3,553.00	1,110,667,800	貸付株式数	86,400株
リ コ ー	175,800	1,191.00	209,377,800		
シチズン時計	66,700	743.00	49,558,100	貸付株式数	26,600株
リズム時計	5,000	2,037.00	10,185,000	貸付株式数	600株
メニコン	8,600	2,623.00	22,557,800		
パラマウントベッドHD	6,000	5,170.00	31,020,000		
S H O B I	14,000	399.00	5,586,000	貸付株式数	3,000株

ニホンフラッシュ	3,600	2,290.00	8,244,000	
前田工織	8,100	2,122.00	17,188,200	
アートネイチャー	10,700	711.00	7,607,700	
バンダイナムコHLDGS	60,500	4,540.00	274,670,000	
SHOEI	3,200	4,955.00	15,856,000	貸付株式数 1,200株
マーベラス	10,000	899.00	8,990,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,100	6,290.00	63,529,000	
萩原工業	5,400	1,757.00	9,487,800	貸付株式数 1,400株
エイベックス	11,000	1,550.00	17,050,000	
トッパン・フォームズ	12,400	1,105.00	13,702,000	貸付株式数 100株
フジシールインターナショナル	13,000	3,935.00	51,155,000	
タカラトミー	25,600	1,145.00	29,312,000	
レック	3,700	5,550.00	20,535,000	貸付株式数 200株
大建工業	5,400	2,290.00	12,366,000	貸付株式数 200株
凸版印刷	157,000	911.00	143,027,000	
大日本印刷	75,300	2,655.00	199,921,500	
共同印刷	3,300	2,860.00	9,438,000	貸付株式数 200株
NISSHA	12,400	2,157.00	26,746,800	貸付株式数 4,800株 (2,700株)
藤森工業	4,900	3,690.00	18,081,000	
ヴィア・ホールディングス	13,400	737.00	9,875,800	貸付株式数 3,700株
宝印刷	7,200	1,873.00	13,485,600	
アシックス	57,600	1,645.00	94,752,000	貸付株式数 22,900株
ジェイ エス ピー	3,800	2,824.00	10,731,200	貸付株式数 1,000株
ニチハ	9,000	3,075.00	27,675,000	
エフピコ	4,900	7,050.00	34,545,000	
ヤマハ	38,600	5,830.00	225,038,000	
河合楽器	2,600	4,680.00	12,168,000	貸付株式数 600株
クリナップ	9,700	803.00	7,789,100	貸付株式数 3,300株
ピジョン	35,500	6,070.00	215,485,000	貸付株式数 9,700株
天馬	5,200	2,045.00	10,634,000	貸付株式数 1,000株
キングジム	9,500	983.00	9,338,500	
象印マホービン	11,500	1,611.00	18,526,500	貸付株式数 4,400株
リンテック	13,200	2,894.00	38,200,800	
信越ポリマー	12,100	916.00	11,083,600	
東リ	24,600	362.00	8,905,200	貸付株式数 1,300株
イトーキ	15,400	618.00	9,517,200	貸付株式数 4,400株

任 天 堂	36,100	40,000.00	1,444,000,000	
三菱鉛筆	9,300	1,999.00	18,590,700	
タカラスタンダ - ド	12,000	1,982.00	23,784,000	貸付株式数 2,200株
コ ク ヨ	27,900	1,997.00	55,716,300	
ナカバヤシ	12,600	668.00	8,416,800	
ニ フ コ	20,800	3,090.00	64,272,000	
立川ブラインド	4,800	1,187.00	5,697,600	貸付株式数 400株
グロープライド	3,500	3,095.00	10,832,500	
オカムラ	20,900	1,515.00	31,663,500	
日本バルカー	5,200	3,110.00	16,172,000	
伊 藤 忠	422,700	2,092.50	884,499,750	
丸 紅	472,900	997.40	471,670,460	
スクロール	16,600	682.00	11,321,200	貸付株式数 3,300株
高 島	4,200	2,062.00	8,660,400	貸付株式数 900株
ヨンドシーホールディング ス	6,000	2,329.00	13,974,000	貸付株式数 1,200株
三陽商会	4,400	2,075.00	9,130,000	貸付株式数 1,200株
長瀬産業	32,300	1,936.00	62,532,800	
蝶 理	4,300	2,051.00	8,819,300	
豊田通商	62,800	4,090.00	256,852,000	
オンワ - ドホールディング ス	36,500	729.00	26,608,500	
兼 松	24,500	1,707.00	41,821,500	
美 津 濃	6,100	2,892.00	17,641,200	
ツカモトコーポレーション	6,100	1,214.00	7,405,400	貸付株式数 200株
ユニー・ファミリーマート HD	18,700	11,060.00	206,822,000	貸付株式数 5,100株
三井物産	474,000	1,965.50	931,647,000	
日本紙パルプ	2,700	4,510.00	12,177,000	
東京エレクトロン	39,100	16,370.00	640,067,000	
日立ハイテクノロジーズ	19,800	4,005.00	79,299,000	
カメイ	7,200	1,476.00	10,627,200	貸付株式数 1,000株
スターゼン	2,600	4,790.00	12,454,000	貸付株式数 400株
セイコーHD	9,400	3,130.00	29,422,000	
山 善	22,100	1,339.00	29,591,900	
住友商事	361,500	1,876.50	678,354,750	
日本ユニシス	17,000	2,762.00	46,954,000	
内田洋行	3,300	2,977.00	9,824,100	貸付株式数 1,300株
三菱商事	404,100	3,473.00	1,403,439,300	
第一実業	3,200	3,830.00	12,256,000	貸付株式数 200株

キヤノンマーケティングJ PN	16,600	2,355.00	39,093,000	
西華産業	4,200	2,001.00	8,404,200	
菱洋エレクトロ	6,000	1,757.00	10,542,000	
ユアサ商事	5,400	4,000.00	21,600,000	
神鋼商事	2,000	3,150.00	6,300,000	
阪和興業	10,500	3,785.00	39,742,500	
正栄食品	3,400	3,470.00	11,798,000	
カナデン	7,100	1,213.00	8,612,300	貸付株式数 300株
菱電商事	5,300	1,690.00	8,957,000	
ニプロ	40,400	1,547.00	62,498,800	貸付株式数 15,800株
岩谷産業	12,500	3,985.00	49,812,500	貸付株式数 4,900株
すてきナイスグループ	8,100	1,294.00	10,481,400	貸付株式数 600株
極東貿易	19,000	415.00	7,885,000	
イワキ	13,300	518.00	6,889,400	
兼松エレクトロニクス	3,900	3,675.00	14,332,500	
三愛石油	14,600	1,403.00	20,483,800	
稲畑産業	13,700	1,718.00	23,536,600	
ゴ-ルドウイン	3,700	7,420.00	27,454,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ユニ・チャ-ム	124,200	3,835.00	476,307,000	貸付株式数 34,300株
デサント	14,400	2,276.00	32,774,400	貸付株式数 5,600株
ワキタ	12,900	1,393.00	17,969,700	
東邦ホールディングス	15,700	2,983.00	46,833,100	貸付株式数 6,200株
サンゲツ	16,700	2,213.00	36,957,100	
ミツウロコグループ	8,700	846.00	7,360,200	
シナネンホールディングス	2,400	2,798.00	6,715,200	
伊藤忠エネクス	10,400	1,157.00	12,032,800	
サンリオ	16,000	2,241.00	35,856,000	貸付株式数 6,400株
サンワテクノス	5,400	1,411.00	7,619,400	
リョ-サン	6,200	4,205.00	26,071,000	貸付株式数 2,400株
新光商事	7,300	1,682.00	12,278,600	貸付株式数 100株
トーヨー	4,500	2,093.00	9,418,500	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
三信電気	5,900	2,009.00	11,853,100	貸付株式数 100株
東陽テクニカ	11,500	922.00	10,603,000	
モスフードサービス	7,200	2,965.00	21,348,000	貸付株式数 2,000株
加賀電子	5,200	2,350.00	12,220,000	
三益半導体	5,300	1,739.00	9,216,700	貸付株式数 1,600株
木曽路	7,400	2,741.00	20,283,400	貸付株式数 2,900株

千趣会	14,400	437.00	6,292,800	貸付株式数	4,200株
タカキユー	35,600	205.00	7,298,000	貸付株式数	4,400株
ケーヨー	12,900	545.00	7,030,500		
上新電機	7,000	3,115.00	21,805,000		
日本瓦斯	11,100	5,910.00	65,601,000		
ロイヤルホールディングス	10,400	2,845.00	29,588,000		
いなげや	6,700	1,743.00	11,678,100	貸付株式数	1,900株
島忠	13,000	3,630.00	47,190,000		
チヨダ	6,900	2,182.00	15,055,800		
ライフコーポレーション	4,000	2,800.00	11,200,000		
リンガーハット	7,900	2,433.00	19,220,700	貸付株式数	2,200株 (1,700株)
M r M a x H D	10,700	606.00	6,484,200	貸付株式数	100株
A O K Iホールディングス	11,100	1,556.00	17,271,600	貸付株式数	3,700株
オークワ	10,000	1,122.00	11,220,000		
コメリ	8,200	2,689.00	22,049,800		
青山商事	10,200	3,470.00	35,394,000	貸付株式数	4,000株
しまむら	6,800	10,550.00	71,740,000		
高島屋	43,900	1,860.00	81,654,000		
松屋	12,800	1,215.00	15,552,000	貸付株式数	5,000株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	25,900	1,815.00	47,008,500		
丸井グループ	53,700	2,690.00	144,453,000		
クレディセゾン	42,600	1,801.00	76,722,600		
アクシアル リテイリング	5,000	4,015.00	20,075,000		
イオン	223,100	2,663.50	594,226,850	貸付株式数	61,400株
イズミ	10,500	7,510.00	78,855,000		
平和堂	11,700	3,040.00	35,568,000		
フジ	7,200	2,257.00	16,250,400	貸付株式数	400株
ヤオコー	6,700	6,870.00	46,029,000		
ゼビオホールディングス	7,000	1,652.00	11,564,000	貸付株式数	900株
ケースホールディングス	51,200	1,381.00	70,707,200	貸付株式数	13,000株 (13,000株)
P A L T A C	8,300	6,020.00	49,966,000		
新生銀行	46,300	1,767.00	81,812,100	貸付株式数	400株
あおぞら銀行	34,100	4,010.00	136,741,000		
三菱UFJフィナンシャル G	4,012,900	702.70	2,819,864,830		
りそなホールディングス	634,400	624.30	396,055,920		
三井住友トラストHD	113,000	4,577.00	517,201,000		

三井住友フィナンシャルG	431,800	4,538.00	1,959,508,400	
第四銀行	6,500	4,695.00	30,517,500	
北越銀行	5,900	2,368.00	13,971,200	
千葉銀行	202,600	741.00	150,126,600	
群馬銀行	107,200	572.00	61,318,400	
武蔵野銀行	8,100	3,175.00	25,717,500	
千葉興業銀行	23,700	481.00	11,399,700	
筑波銀行	39,200	273.00	10,701,600	
七十七銀行	16,800	2,654.00	44,587,200	
青森銀行	4,600	3,450.00	15,870,000	貸付株式数 1,400株
秋田銀行	4,000	2,916.00	11,664,000	
山形銀行	6,500	2,522.00	16,393,000	貸付株式数 2,600株 (1,600株)
岩手銀行	4,000	4,990.00	19,960,000	貸付株式数 1,200株
東邦銀行	49,800	423.00	21,065,400	貸付株式数 5,800株
東北銀行	10,400	1,358.00	14,123,200	
ふくおかフィナンシャルG	236,000	630.00	148,680,000	
静岡銀行	140,300	968.00	135,810,400	
十六銀行	6,800	2,849.00	19,373,200	
スルガ銀行	59,600	534.00	31,826,400	貸付株式数 15,200株 (7,000株)
八十二銀行	94,300	504.00	47,527,200	
山梨中央銀行	37,000	403.00	14,911,000	
大垣共立銀行	8,100	2,899.00	23,481,900	
福井銀行	5,400	2,410.00	13,014,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
北國銀行	6,400	4,365.00	27,936,000	
清水銀行	4,100	2,171.00	8,901,100	貸付株式数 300株 (300株)
滋賀銀行	46,000	580.00	26,680,000	
南都銀行	6,000	2,859.00	17,154,000	貸付株式数 1,800株
百五銀行	50,700	470.00	23,829,000	
京都銀行	21,600	5,740.00	123,984,000	
紀陽銀行	20,600	1,746.00	35,967,600	
ほくほくフィナンシャルG	34,900	1,570.00	54,793,000	
広島銀行	77,800	763.00	59,361,400	
山陰合同銀行	32,900	965.00	31,748,500	
中国銀行	35,200	1,154.00	40,620,800	貸付株式数 9,700株
伊予銀行	75,800	718.00	54,424,400	
百十四銀行	57,000	340.00	19,380,000	

四国銀行	9,300	1,372.00	12,759,600	貸付株式数	400株
阿波銀行	43,000	722.00	31,046,000		
大分銀行	3,300	4,050.00	13,365,000	貸付株式数	900株
宮崎銀行	4,100	3,195.00	13,099,500	貸付株式数	200株
佐賀銀行	4,200	2,358.00	9,903,600		
十八銀行	42,000	364.00	15,288,000		
沖縄銀行	5,400	4,105.00	22,167,000		
琉球銀行	13,400	1,364.00	18,277,600	貸付株式数	4,700株
セブン銀行	214,000	346.00	74,044,000	貸付株式数	84,200株
みずほフィナンシャルG	7,834,100	198.30	1,553,502,030		
高知銀行	11,900	1,140.00	13,566,000		
山口フィナンシャルG	68,700	1,245.00	85,531,500	貸付株式数	26,700株
芙蓉総合リース	6,600	6,890.00	45,474,000		
興銀リース	10,800	2,967.00	32,043,600		
東京センチュリー	12,100	6,600.00	79,860,000		
S B Iホールディングス	66,100	3,300.00	218,130,000	貸付株式数	24,500株 (7,900株)
日本証券金融	24,500	654.00	16,023,000		
アイフル	101,700	327.00	33,255,900	貸付株式数	27,400株 (300株)
名古屋銀行	4,300	3,790.00	16,297,000	貸付株式数	1,700株
北洋銀行	82,700	381.00	31,508,700		
愛知銀行	2,000	4,935.00	9,870,000		
中京銀行	3,200	2,354.00	7,532,800		
大光銀行	5,000	2,187.00	10,935,000		
愛媛銀行	9,200	1,289.00	11,858,800	貸付株式数	3,600株
トマト銀行	9,400	1,498.00	14,081,200		
京葉銀行	40,000	480.00	19,200,000		
栃木銀行	32,200	385.00	12,397,000		
北日本銀行	4,300	2,632.00	11,317,600		
東和銀行	12,100	1,040.00	12,584,000		
福島銀行	18,000	697.00	12,546,000		
大東銀行	10,800	1,250.00	13,500,000		
リコーリース	4,200	3,805.00	15,981,000		
イオンフィナンシャルサー ビス	39,800	2,330.00	92,734,000		
アコム	118,600	456.00	54,081,600	貸付株式数	6,500株
ジャックス	6,900	2,315.00	15,973,500		
オリコ	114,400	161.00	18,418,400	貸付株式数	33,900株
日立キャピタル	15,700	3,170.00	49,769,000		

アプラスフィナンシャル	56,300	108.00	6,080,400	貸付株式数	16,300株
オリックス	384,800	1,817.00	699,181,600		
三菱UFJリース	144,900	656.00	95,054,400		
ジャフコ	8,300	4,170.00	34,611,000	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
トモニホールディングス	46,400	482.00	22,364,800	貸付株式数	4,000株
大和証券G本社	489,000	692.00	338,388,000		
野村ホールディングス	983,700	541.70	532,870,290		
岡三証券グループ	46,000	549.00	25,254,000		
丸三証券	20,500	968.00	19,844,000		
東洋証券	38,000	254.00	9,652,000		
東海東京HD	62,500	667.00	41,687,500		
水戸証券	25,600	382.00	9,779,200	貸付株式数	2,100株
いちよし証券	13,700	1,130.00	15,481,000		
松井証券	29,200	1,196.00	34,923,200		
SOMPOホールディングス	113,000	4,746.00	536,298,000		
日本取引所グループ	165,500	2,012.00	332,986,000		
マネックスG	63,400	541.00	34,299,400	貸付株式数	23,800株
カブドットコム証券	39,400	382.00	15,050,800		
極東証券	8,200	1,456.00	11,939,200		
岩井コスモホールディング	8,000	1,563.00	12,504,000		
藍澤證券	14,000	768.00	10,752,000		
フィデアホール	71,500	168.00	12,012,000		
池田泉州HD	57,200	388.00	22,193,600		
アニコムホールディングス	4,400	3,650.00	16,060,000	貸付株式数	1,100株
MS&AD	149,600	3,659.00	547,386,400		
SONY FH	47,700	2,398.00	114,384,600		
第一生命HLDS	325,600	2,301.50	749,368,400		
東京海上HD	216,900	5,447.00	1,181,454,300		
イー・ギャランティ	9,800	1,161.00	11,377,800	貸付株式数	500株
NECキャピタルソリューション	4,000	1,881.00	7,524,000		
T&Dホールディングス	176,700	1,787.00	315,762,900		
アドバンスクリエイト	4,600	2,547.00	11,716,200		
三井不動産	288,200	2,636.50	759,839,300		
三菱地所	429,300	1,930.00	828,549,000		
平和不動産	10,600	2,027.00	21,486,200		
東京建物	61,300	1,361.00	83,429,300	貸付株式数	16,900株

ダイビル	14,700	1,220.00	17,934,000	
京阪神ビルディング	12,300	875.00	10,762,500	
住友不動産	139,000	3,991.00	554,749,000	
大京	9,000	2,263.00	20,367,000	
テーオーシー	20,600	842.00	17,345,200	
レオパレス21	69,300	605.00	41,926,500	
スターツコーポレーション	7,800	2,419.00	18,868,200	
フジ住宅	11,700	904.00	10,576,800	
空港施設	12,200	637.00	7,771,400	
ゴールドクレスト	4,700	1,874.00	8,807,800	
リログループ	31,100	3,185.00	99,053,500	
日本エスリード	4,100	1,541.00	6,318,100	
日神不動産	11,800	561.00	6,619,800	
日本エスコン	13,300	816.00	10,852,800	貸付株式数 4,600株 (3,200株)
タカラレーベン	29,800	346.00	10,310,800	
サンヨーハウジ 名古屋	10,100	1,121.00	11,322,100	
イオンモール	36,300	1,959.00	71,111,700	
カチタス	8,300	3,435.00	28,510,500	貸付株式数 3,100株
東祥	4,200	4,490.00	18,858,000	貸付株式数 1,000株
トーセイ	10,200	1,107.00	11,291,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	35,600	1,241.00	44,179,600	貸付株式数 9,500株 (9,500株)
サンフロンティア不動産	8,700	1,326.00	11,536,200	
エフ・ジェー・ネクスト	7,000	905.00	6,335,000	
グランディハウス	19,000	477.00	9,063,000	
東武鉄道	61,500	3,405.00	209,407,500	
相鉄ホールディングス	18,300	3,705.00	67,801,500	
東京急行	158,900	2,055.00	326,539,500	
京浜急行	79,800	2,036.00	162,472,800	
小田急電鉄	87,500	2,706.00	236,775,000	
京王電鉄	32,900	6,250.00	205,625,000	
京成電鉄	41,200	3,930.00	161,916,000	
富士急行	8,600	3,530.00	30,358,000	貸付株式数 3,300株 (2,200株)
東日本旅客鉄道	104,200	10,670.00	1,111,814,000	
西日本旅客鉄道	52,400	7,813.00	409,401,200	
東海旅客鉄道	52,500	23,270.00	1,221,675,000	
西武ホールディングス	74,400	2,071.00	154,082,400	
鴻池運輸	8,600	1,903.00	16,365,800	

西日本鉄道	16,000	3,115.00	49,840,000	
ハマキョウレックス	4,600	4,085.00	18,791,000	
サカイ引越センター	3,400	6,430.00	21,862,000	貸付株式数 900株 (800株)
近鉄グループHLDGS	54,200	4,505.00	244,171,000	
阪急阪神HLDGS	73,200	4,080.00	298,656,000	
南海電鉄	26,200	2,942.00	77,080,400	
京阪ホールディングス	24,600	4,290.00	105,534,000	
名古屋鉄道	44,100	2,729.00	120,348,900	
山陽電鉄	5,100	2,551.00	13,010,100	貸付株式数 200株
トランコム	1,800	7,700.00	13,860,000	
日本通運	21,500	7,430.00	159,745,000	
ヤマトホールディングス	97,700	3,373.00	329,542,100	
山 九	14,200	6,060.00	86,052,000	
日 新	5,200	2,514.00	13,072,800	
丸全昭和運輸	22,000	562.00	12,364,000	
センコーグループHLDGS	34,300	915.00	31,384,500	貸付株式数 1,100株
トナミホールディングス	1,700	6,900.00	11,730,000	
ニッコンホールディングス	19,700	2,975.00	58,607,500	
福山通運	8,600	4,995.00	42,957,000	
セイノーホールディングス	41,800	1,715.00	71,687,000	貸付株式数 11,200株 (11,200株)
日立物流	12,300	3,175.00	39,052,500	
丸和運輸機関	3,400	4,065.00	13,821,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
日本郵船	45,200	2,115.00	95,598,000	
商船三井	34,200	3,160.00	108,072,000	
川崎汽船	24,900	2,247.00	55,950,300	貸付株式数 9,700株
NSユニテッド海運	2,900	2,479.00	7,189,100	
飯野海運	30,100	598.00	17,999,800	
九州旅客鉄道	46,100	3,450.00	159,045,000	
SGホールディングス	52,900	2,835.00	149,971,500	
日本航空	101,300	4,081.00	413,405,300	
ANAホールディングス	107,400	3,945.00	423,693,000	
ヤマシタヘルスケアHLDGS	8,100	1,404.00	11,372,400	貸付株式数 1,500株
GENKY DRUG STORES	2,500	4,350.00	10,875,000	貸付株式数 900株
三菱倉庫	18,900	2,807.00	53,052,300	貸付株式数 5,500株

三井倉庫HOLD	38,000	396.00	15,048,000	
住友倉庫	37,000	790.00	29,230,000	
渋沢倉庫	5,700	1,704.00	9,712,800	貸付株式数 200株
ヤマタネ	5,900	2,016.00	11,894,400	貸付株式数 1,600株
東陽倉庫	33,200	350.00	11,620,000	
日本トランスシティ	18,400	513.00	9,439,200	
東洋埠頭	8,000	1,698.00	13,584,000	
上組	32,900	2,437.00	80,177,300	
キューソー流通システム	2,600	2,913.00	7,573,800	
近鉄エクスプレス	10,300	2,203.00	22,690,900	貸付株式数 400株
内外トランスライン	6,300	1,716.00	10,810,800	貸付株式数 1,500株
東京放送HD	31,300	2,342.00	73,304,600	
日本テレビHLD S	52,000	1,901.00	98,852,000	貸付株式数 14,100株
テレビ朝日HD	15,300	2,143.00	32,787,900	貸付株式数 100株 (100株)
スカパーJ S A T H D	44,200	552.00	24,398,400	
テレビ東京HD	5,400	2,777.00	14,995,800	貸付株式数 2,000株 (1,500株)
日本BS放送	5,900	1,333.00	7,864,700	
ワイヤレスゲート	6,600	652.00	4,303,200	貸付株式数 1,300株 (1,000株)
コネクシオ	4,700	2,101.00	9,874,700	
日本通信	65,200	177.00	11,540,400	貸付株式数 22,900株 (1,000株)
日本電信電話	411,000	5,154.00	2,118,294,000	
KDDI	505,400	3,090.00	1,561,686,000	
光通信	7,000	21,570.00	150,990,000	
NTTドコモ	411,600	3,049.00	1,254,968,400	
エムティーアイ	12,400	637.00	7,898,800	貸付株式数 3,400株
GMOインターネット	22,100	1,887.00	41,702,700	
カドカワ	17,400	1,207.00	21,001,800	貸付株式数 4,800株
ゼンリン	11,000	3,415.00	37,565,000	貸付株式数 4,100株
東京電力HD	467,300	535.00	250,005,500	
中部電力	179,500	1,708.50	306,675,750	貸付株式数 20,300株
関西電力	239,200	1,632.50	390,494,000	
中国電力	78,900	1,454.00	114,720,600	貸付株式数 30,600株
北陸電力	56,700	1,182.00	67,019,400	貸付株式数 15,600株
東北電力	136,400	1,512.00	206,236,800	
四国電力	52,600	1,540.00	81,004,000	
九州電力	129,000	1,313.00	169,377,000	貸付株式数 17,900株

北海道電力	58,400	731.00	42,690,400	貸付株式数	3,300株
沖縄電力	12,400	2,366.00	29,338,400	貸付株式数	100株
電源開発	46,000	3,000.00	138,000,000		
イーレックス	10,800	1,012.00	10,929,600	貸付株式数	3,900株
東京瓦斯	123,200	2,771.00	341,387,200		
大阪瓦斯	112,000	2,181.00	244,272,000		
東邦瓦斯	29,100	4,075.00	118,582,500		
北海道瓦斯	34,000	310.00	10,540,000		
西部瓦斯	7,200	2,633.00	18,957,600		
静岡ガス	20,200	948.00	19,149,600		
メタウォーター	3,400	3,080.00	10,472,000		
松竹	3,800	14,120.00	53,656,000	貸付株式数	300株
東宝	37,800	3,545.00	134,001,000		
エイチ・アイ・エス	10,000	3,800.00	38,000,000	貸付株式数	3,900株 (1,300株)
東映	2,200	12,860.00	28,292,000	貸付株式数	200株
NTTデータ	181,100	1,559.00	282,334,900		
共立メンテナンス	10,300	4,675.00	48,152,500	貸付株式数	3,900株
イチネンホールディングス	8,600	1,473.00	12,667,800	貸付株式数	2,200株
建設技術研究所	7,600	1,704.00	12,950,400		
アインホールディングス	7,800	8,500.00	66,300,000	貸付株式数	3,000株
スバル興業	1,200	5,630.00	6,756,000		
東京テアトル	7,000	1,384.00	9,688,000	貸付株式数	1,500株
よみうりランド	1,900	4,555.00	8,654,500	貸付株式数	500株
東京都競馬	4,000	4,150.00	16,600,000		
常磐興産	6,400	1,863.00	11,923,200	貸付株式数	1,700株
カナモト	8,000	3,965.00	31,720,000		
東京ドーム	22,900	1,007.00	23,060,300		
D T S	6,300	4,430.00	27,909,000		
スクウェア・エニックス・HD	27,000	4,590.00	123,930,000		
シーイーシー	8,000	2,608.00	20,864,000		
カプコン	25,400	2,752.00	69,900,800		
西尾レントオール	5,800	3,595.00	20,851,000		
日本空港ビルデング	17,000	5,050.00	85,850,000		
トランス・コスモス	6,700	2,825.00	18,927,500	貸付株式数	1,800株
乃村工藝社	13,600	2,257.00	30,695,200		
ジャステック	8,100	1,192.00	9,655,200		
S C S K	13,700	5,350.00	73,295,000		
藤田観光	3,000	3,435.00	10,305,000	貸付株式数	100株

KNT - CTホールディングス	4,500	1,236.00	5,562,000	貸付株式数	1,100株
日本管財	6,900	2,156.00	14,876,400		
トーカイ	5,800	2,563.00	14,865,400	貸付株式数	500株
セコム	59,700	9,293.00	554,792,100		
セントラル警備保障	3,200	4,495.00	14,384,000	貸付株式数	1,200株
アイネス	11,100	1,293.00	14,352,300		
丹青社	12,800	1,193.00	15,270,400	貸付株式数	3,000株
メイテック	6,700	5,410.00	36,247,000		
TKC	5,300	4,505.00	23,876,500		
富士ソフト	9,300	5,670.00	52,731,000		
応用地質	7,300	1,481.00	10,811,300	貸付株式数	700株
船井総研ホールディング	12,200	2,422.00	29,548,400	貸付株式数	3,200株
NSD	9,900	2,340.00	23,166,000		
オオバ	16,300	627.00	10,220,100	貸付株式数	3,900株
コナミホールディングス	23,100	4,280.00	98,868,000	貸付株式数	6,300株
学究社	7,000	1,789.00	12,523,000	貸付株式数	2,800株
ベネッセホールディングス	19,800	3,375.00	66,825,000		
イオンディライト	7,800	4,140.00	32,292,000		
ニチイ学館	11,900	952.00	11,328,800	貸付株式数	4,700株
ダイセキ	9,600	2,865.00	27,504,000		
日鉄住金物産	4,300	5,640.00	24,252,000		
元気寿司	2,400	6,490.00	15,576,000		
トラスコ中山	12,500	3,045.00	38,062,500	貸付株式数	4,800株
ヤマダ電機	193,600	562.00	108,803,200	貸付株式数	74,800株 (700株)
オートバックスセブン	20,700	1,925.00	39,847,500		
アークランドサカモト	10,000	1,515.00	15,150,000		
ニトリホールディングス	23,000	16,855.00	387,665,000		
吉野家ホールディングス	20,200	1,933.00	39,046,600	貸付株式数	7,700株
加藤産業	9,000	3,670.00	33,030,000	貸付株式数	2,100株
イノテック	6,500	1,323.00	8,599,500	貸付株式数	1,000株
イエローハット	5,400	3,050.00	16,470,000		
松屋フーズ	3,000	3,605.00	10,815,000		
JBCホールディングス	9,600	1,361.00	13,065,600		
サガミチェーン	10,600	1,417.00	15,020,200	貸付株式数	4,100株 (2,300株)
日伝	4,500	2,040.00	9,180,000		
関西スーパーマーケット	5,800	1,212.00	7,029,600		
ミロク情報サービス	5,700	2,457.00	14,004,900		

北沢産業	17,100	234.00	4,001,400	
因幡電機産業	7,100	4,820.00	34,222,000	
王将フードサービス	4,500	7,800.00	35,100,000	
プレナス	6,300	1,887.00	11,888,100	貸付株式数 2,500株 (1,700株)
ミニストップ	4,300	2,156.00	9,270,800	
アークス	10,600	2,906.00	30,803,600	
パローホールディングス	13,200	2,540.00	33,528,000	
バイテックホールディングス	3,400	2,613.00	8,884,200	
ミスミグループ本社	67,100	2,975.00	199,622,500	
ベルク	2,800	6,140.00	17,192,000	
ファーストリテイリング	7,700	56,230.00	432,971,000	貸付株式数 3,000株
ソフトバンクグループ	259,900	10,915.00	2,836,808,500	
スズケン	26,000	5,160.00	134,160,000	
サンドラッグ	21,400	3,960.00	84,744,000	
サクスパーホールディング	7,100	891.00	6,326,100	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
ジェコス	6,000	1,177.00	7,062,000	
ベルーナ	14,500	1,202.00	17,429,000	
合計			148,894,152,440	

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

トヨタ自動車

100,000株

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2018年9月28日

資産総額	4,820,088,618円
負債総額	9,853,243円
純資産総額（ - ）	4,810,235,375円
発行済数量	5,541,988,649口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.8680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

2018年9月28日

資産総額	165,975,551,051円
負債総額	13,461,810,594円
純資産総額（ - ）	152,513,740,457円
発行済数量	132,351,389,469口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.1523円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

(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、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第二部 【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9月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年9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	177,728
追加型株式投資信託	712	16,079,881
株式投資信託 合計	793	16,257,609
単位型公社債投資信託	28	107,888
追加型公社債投資信託	14	1,484,253
公社債投資信託 合計	42	1,592,142
総合計	835	17,849,750

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。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,260	28,709
有価証券	110	0
前払費用	190	201
未収委託者報酬	10,453	12,368
未収収益	72	82
繰延税金資産	439	552
その他	34	47
流動資産計	42,560	41,962
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	15	12
器具備品	214	200
無形固定資産	2,650	2,614
ソフトウェア	2,323	2,456
ソフトウェア仮勘定	327	158
投資その他の資産	12,353	15,066
投資有価証券	5,920	8,600
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	185	183
長期差入保証金	1,050	1,072
繰延税金資産	31	45
その他	37	34
固定資産計	15,234	17,894
資産合計	57,795	59,856

（単位：百万円）

	前事業年度 （平成29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	79	65
未払金	9,466	9,747
未払収益分配金	7	8
未払償還金	59	59
未払手数料	4,453	5,202
その他未払金	2 4,946	2 4,476
未払費用	4,077	4,148
未払法人税等	980	850
未払消費税等	223	583
賞与引当金	945	1,012
その他	3	335
流動負債計	15,776	16,744
固定負債		
退職給付引当金	2,318	2,350
役員退職慰労引当金	151	125
その他	7	5
固定負債計	2,477	2,481
負債合計	18,254	19,225
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	12,231	13,370
利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	79,747	82,510
その他営業収益	727	733
営業収益計	80,474	83,244
営業費用		
支払手数料	40,110	40,392
広告宣伝費	549	673
調査費	9,436	9,816
調査費	904	955
委託調査費	8,531	8,860
委託計算費	793	839
営業雑経費	1,375	1,579
通信費	251	249
印刷費	501	500
協会費	50	53
諸会費	13	13
その他営業雑経費	557	762
営業費用計	52,265	53,300
一般管理費		
給料	5,833	5,840
役員報酬	416	377
給料・手当	3,940	3,973
賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195
租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316

役員退職慰労引当金繰入額	60	46
固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31 日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	92	75
投資有価証券売却益	224	210
有価証券償還益	94	17
その他	69	55
営業外収益計	481	359
営業外費用		
投資有価証券売却損	24	0
その他	75	29
営業外費用計	100	29
経常利益	16,935	18,741
特別損失		
MMF等償還関連費用	305	-
関係会社整理損失	-	333
特別損失計	305	333
税引前当期純利益	16,629	18,407
法人税、住民税及び事業税	6,501	5,843
法人税等調整額	1,405	106
法人税等合計	5,096	5,737
当期純利益	11,533	12,670

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

(単位:百万円)

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	40,631

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」に独立掲記しておりました「受取利息」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」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」に表示していた「受取利息」12百万円、「その他」56百万円は、「その他」69百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	26百万円	29百万円
器具備品	264百万円	235百万円

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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
未払金	4,877百万円	4,406百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(平成30年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万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28年4月1日至平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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

(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30年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月26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代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

() 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	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(*2)	(3,409)	(3,409)	-
負債計	(12,809)	(12,809)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 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30年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	28,709	28,709	-
(2) 未収委託者報酬	12,368	12,368	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,631	7,631	-
資産計	48,709	48,709	-
(1) 未払手数料	(5,202)	(5,202)	-
(2) その他未払金	(4,476)	(4,476)	-

(3) 未払費用(*2)	(3,286)	(3,286)	-
負債計	(12,965)	(12,965)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	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	1,050	1,072

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

当事業年度(平成30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	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
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	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

(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。

当事業年度(平成30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。

当事業年度(平成30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	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
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	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

(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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首 残高	2,209百万円	2,318百万円
勤務費用	202	159
退職給付の支払額	122	166
その他	29	38
退職給付債務の期末 残高	2,318	2,350

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,318百万円	2,350百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350
退職給付引当金	2,318	2,350
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
勤務費用	202百万円	159百万円
その他	87	24
確定給付制度に係る退職給付費用	289	184

3. 確定拠出制度

社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度173百万円、当事業年度171百万円であります。

(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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		719
	709	
賞与引当金	224	244
未払事業税	169	162
出資金評価損	98	94
投資有価証券評価損	65	68
連結法人間取引（譲渡損）	5	5
その他	185	308
繰延税金資産小計	1,458	1,602
評価性引当額	201	200
繰延税金資産合計	1,257	1,402
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	639	639
その他有価証券評価差額金	146	164
繰延税金負債合計	786	804
繰延税金資産の純額	470	598

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29年3月31日）

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。

当事業年度（平成30年3月31日）

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。

(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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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)	1,701	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	-------------	------	---------	-------	---	---

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。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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)	23,216	未払手数料	3,913
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)	1,020	未払費用	233
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)	1,048	長期差入保証金	1,055

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28年4月1日 至 平成29年3月31日）		当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	
1株当たり純資産額	15,158.25円	1株当たり純資産額	15,576.40円
1株当たり当期純利益	4,421.51円	1株当たり当期純利益	4,857.40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28年4月1日 至 平成29年3月31日）	当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
当期純利益（百万円）	11,533	12,670
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 (2018年3月 末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	金融商品取引法に 定める第一種金融商品 取引業を営んでいます。
藍澤證券株式会社	8,000	
岩井コスモ証券株式会社	13,500	
S M B C 日興証券株式会社	10,000	
株式会社 S B I 証券	48,323	
カブドットコム証券株式会社	7,196	
国府証券株式会社	100	
静銀ティーエム証券株式会社	3,000	
島大証券株式会社	100	
荘内証券株式会社	100	
高木証券株式会社	11,069	
奈良証券株式会社	117	
西村証券株式会社	500	
日産証券株式会社	1,500	
播陽証券株式会社	112	
日の出証券株式会社	4,650	
ひろぎん証券株式会社	5,000	
二浪証券株式会社	100	
松阪証券株式会社	100	
マネックス証券株式会社	12,200	
水戸証券株式会社	12,272	
むさし証券株式会社	5,000	

山和証券株式会社	585		
楽天証券株式会社	7,495		
リテラ・クレア証券株式会社	3,794		
株式会社愛媛銀行	21,359	銀行法に 基づき銀行業を 営んでいます。	
株式会社関西アーバン銀行	47,039		
株式会社近畿大阪銀行	38,971		
株式会社十八銀行	24,404		
株式会社千葉銀行	145,069		
株式会社東京スター銀行	26,000		
株式会社南都銀行	37,924		
株式会社東日本銀行	38,300		
株式会社山形銀行	12,008		
労働金庫連合会	120,000		（注）

（注）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

委託会社は、西村証券株式会社の株式を50,000株所有しております。

委託会社は、播陽証券株式会社の株式を6,500株所有しております。

委託会社は、むさし証券株式会社の株式を41,500株所有しております。

委託会社は、リテラ・クレア証券株式会社の株式を615,736株所有しております。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2018年3月末日現在）

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

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

第3 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

(提出年月日)	(書類名)
2017年12月12日	有価証券届出書、有価証券報告書
2017年12月28日	有価証券届出書の訂正届出書
2018年6月12日	半期報告書、有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成30年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の財務諸表、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30年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注)2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年10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 公認会計士 深井 康治 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているトピックス・インデックスファンドの平成29年9月20日から平成30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、トピックス・インデックスファンドの平成30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

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。