

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2019年8月23日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【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】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D C ダイワ日本株式インデックス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

DCダイワ日本株式インデックス

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

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

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

(5) 【申込手数料】

取得申込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。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、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。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

2019年8月24日から2020年2月21日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により取得の申込みを行なう場合に限り取得できます。

受益権の取得申込者は、販売会社に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。

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

当ファンドは、積立投資専用です。

イ．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。)を締結するものとします。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします(以下同じ。)

ロ．収益分配金は、自動的に再投資されます。

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

取得申込金額に利息は付きません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なうことを基本とします。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	年2回	日本		日経225
大型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	
中小型株	年6回 (隔月)	欧州		TOPIX
債券	年12回 (毎月)	アジア		
一般	日々	オセアニア		
公債	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ()
社債		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、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

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

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

運用プロセス



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

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

■ 東証株価指数（TOPIX）について

◆ 東証株価指数（TOPIX）とは

株式市場の動向を表す指標には、東証株価指数、日経平均株価、日経500種株価等があります。このうち、東証株価指数（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日から東京証券取引所が算出・公表しています（注1参照）。

◆ 東証株価指数（TOPIX）の特徴

東証第1部上場の全銘柄を対象としているため、市場全体の動きを確実に表します。

なお、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2参照）。

（注1）TOPIXの算出方法：

$$\text{毎日の指数} = \text{当日の時価総額} \div \text{基準時の時価総額} \times 100$$

（注2）基準時の時価総額の修正方法：

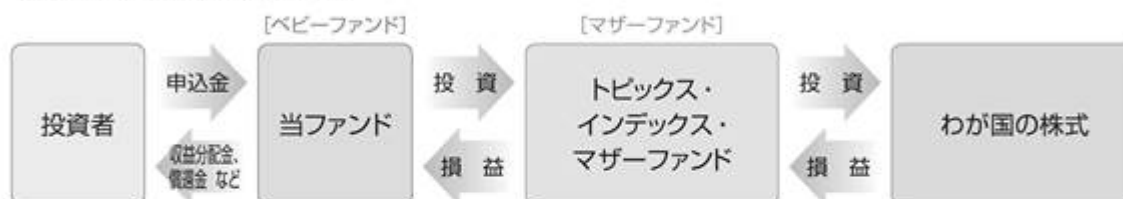
$$\text{修正後の基準時価総額} = \text{修正前日の基準時価総額} \times (\text{修正前日の時価総額} \pm \text{修正額}) \div \text{修正前日の時価総額}$$

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

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。



- ・運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

2

当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により購入の申込みを行なう場合に限り購入できます。

3

毎年11月30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。収益分配金は、自動的に再投資されます。

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2003年 1月27日

信託契約締結、当初設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）	
お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い</p> <p>一部解約請求に関する事務</p> <p>収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務</p> <p style="text-align: right;">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</p> <p>信託財産の運用指図</p> <p>信託財産の計算</p> <p>運用報告書の作成</p> <p style="text-align: right;">など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 3）
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	<p>信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分</p> <p>信託財産の計算</p> <p style="text-align: right;">など</p>
		損益 投資

投資対象

東京証券取引所第一部上場株式(上場予定を含みます。) など
(ファミリーファンド方式で運用を行ないます。)

(注) 収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況(2019年6月末日現在) >

- ・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

- ・ 沿革

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

- ・ 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

投資態度

- イ．投資成果を東証株価指数(TOPIX)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
- ロ．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ニ．大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

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

(2) 【投資対象】

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

- 1．次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)に定めるものに限ります。)
 - ハ．約束手形
 - ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

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

- 1．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

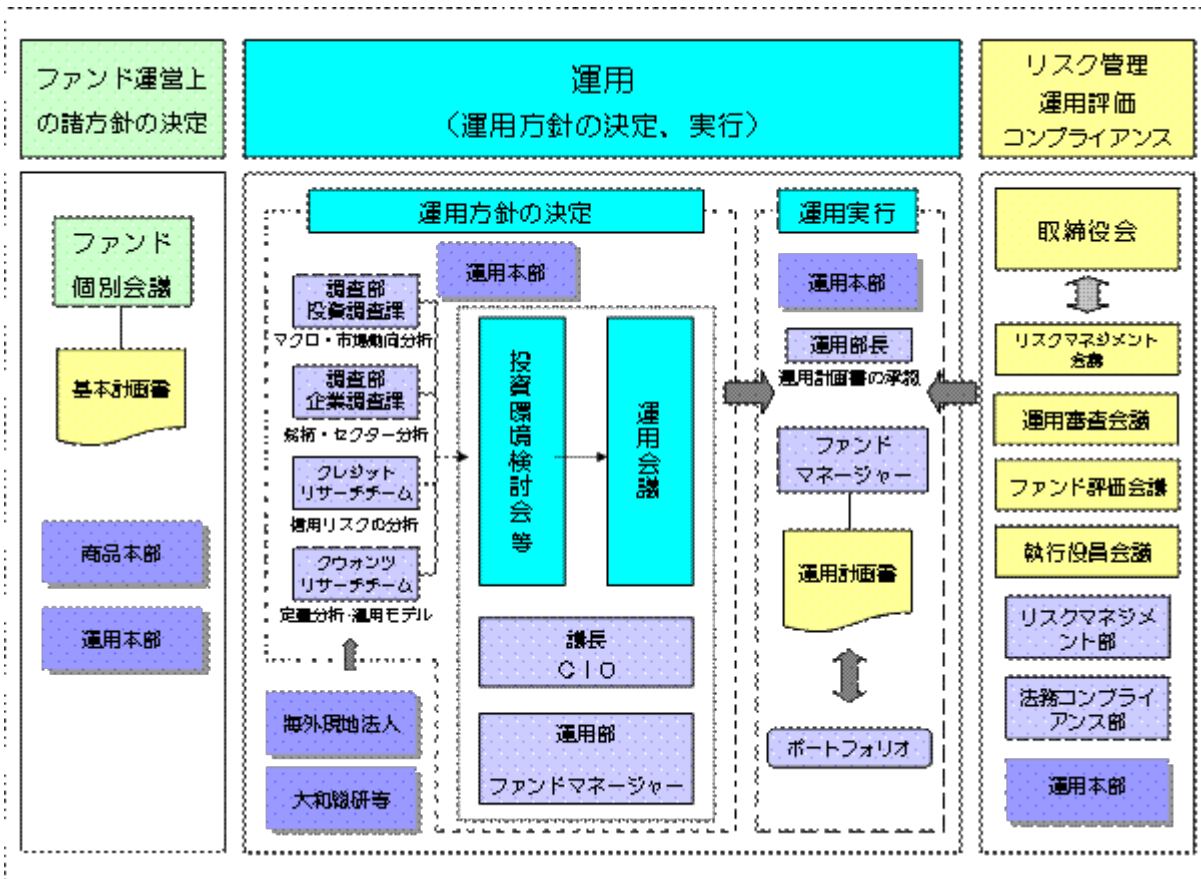
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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30～40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2019年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。

原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券(信託約款)

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

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号口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。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

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。

信用リスク集中回避(信託約款)

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

資金の借入れ(信託約款)

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

ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または解約代金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> マザーファンド（トピックス・インデックス・マザーファンド）の概要

(1) 投資方針

投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資には、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。

株価指数先物取引の利用に伴うリスク

株価指数先物の価格は、対象指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します（売建てている場合は逆の結果となります。）。ファンドで行なっている株価指数先物取引について損失が発生した場合、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付を中止することがあります。ご換金の申込みの受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

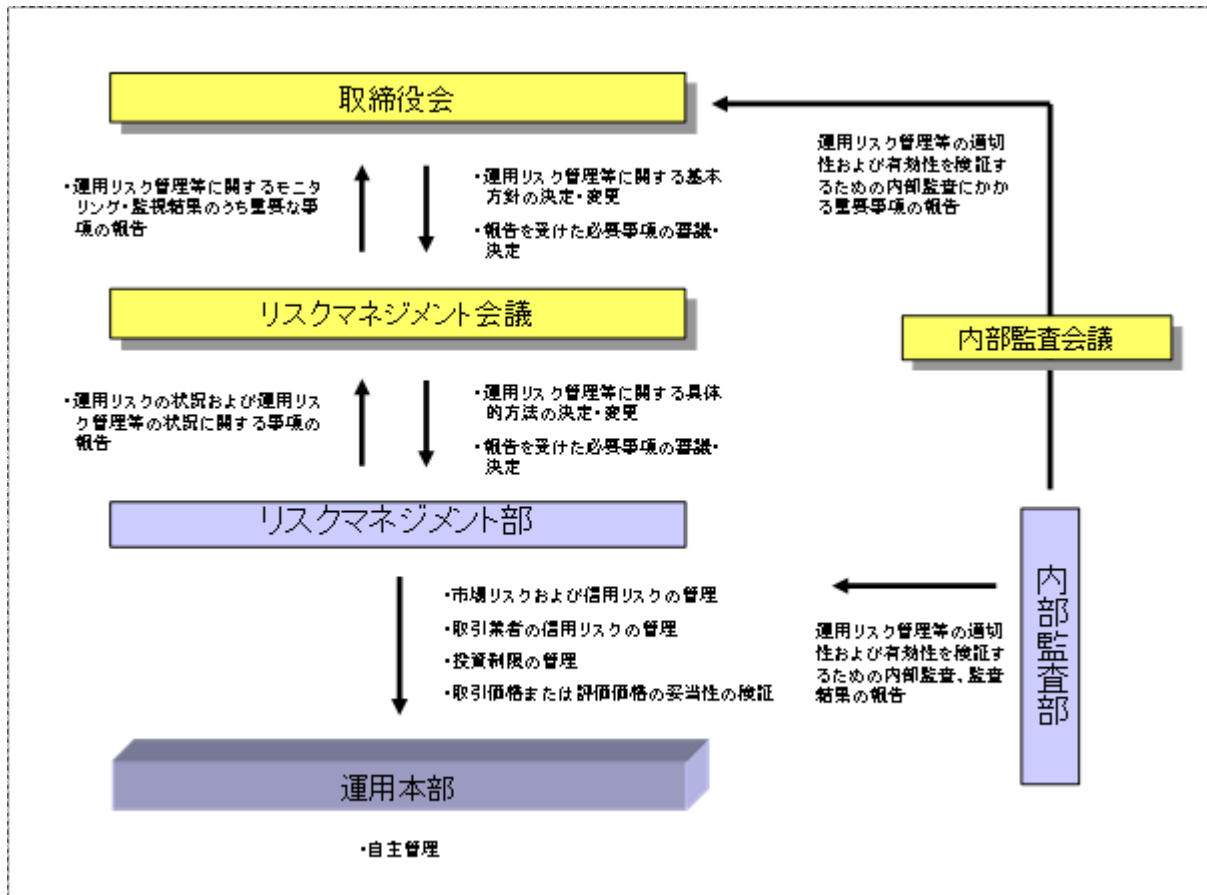
(3) その他の留意点

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

参 考 情 報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（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。



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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

取得申込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。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、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。

- ・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。

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。

(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%¹（税抜0.62%）以内（有価証券届出書提出日現在、年率0.27%²（税抜0.25%））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。

1 消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.682%となります。

2 消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.275%となります。

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（有価証券届出書提出日現在）。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.09% （税抜）	年率0.12% （税抜）	年率0.04% （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および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により受益権を取得した場合、上記にかかわらず、次の取扱いとなります。

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。

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

（ ） 上記は、2019年6月末現在のもので、税法または確定拠出年金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】（2019年6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	65,419,912,108	99.99
内 日本	65,419,912,108	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,592,865	0.01
純資産総額	65,424,504,973	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】（2019年6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	65,518,189,393	1.0544 69,082,922,995	0.9985 65,419,912,108	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7計算期間末 (2009年11月30日)	22,197,411,154	22,197,411,154	1.0622	1.0622
第8計算期間末 (2010年11月30日)	25,555,883,098	25,555,883,098	1.1084	1.1084
第9計算期間末 (2011年11月30日)	24,177,954,974	24,177,954,974	0.9573	0.9573
第10計算期間末 (2012年11月30日)	28,164,446,865	28,164,446,865	1.0494	1.0494
第11計算期間末 (2013年12月2日)	45,294,346,724	45,294,346,724	1.7181	1.7181
第12計算期間末 (2014年12月1日)	50,829,621,260	50,829,621,260	1.9730	1.9730
第13計算期間末 (2015年11月30日)	57,404,914,294	57,404,914,294	2.2302	2.2302
第14計算期間末 (2016年11月30日)	57,003,477,005	57,003,477,005	2.1126	2.1126
第15計算期間末 (2017年11月30日)	67,558,051,699	67,558,051,699	2.6238	2.6238
2018年6月末日	69,601,995,269	-	2.5624	-
7月末日	70,579,287,512	-	2.5950	-
8月末日	70,246,366,151	-	2.5683	-
9月末日	73,596,864,611	-	2.7103	-
10月末日	67,801,430,457	-	2.4538	-
第16計算期間末 (2018年11月30日)	69,264,493,765	69,264,493,765	2.4857	2.4857
12月末日	62,126,574,026	-	2.2306	-
2019年1月末日	65,923,403,450	-	2.3400	-
2月末日	67,239,184,789	-	2.4001	-
3月末日	67,221,615,054	-	2.4017	-
4月末日	67,557,498,213	-	2.4411	-
5月末日	63,628,364,324	-	2.2818	-
6月末日	65,424,504,973	-	2.3437	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
2018年12月1日～ 2019年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第7計算期間	3.1
第8計算期間	4.3
第9計算期間	13.6
第10計算期間	9.6
第11計算期間	63.7
第12計算期間	14.8
第13計算期間	13.0
第14計算期間	5.3
第15計算期間	24.2
第16計算期間	5.3
2018年12月1日～ 2019年5月31日	8.2

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第7計算期間	5,428,627,508	2,851,557,801
第8計算期間	5,084,050,851	2,924,597,492
第9計算期間	5,987,607,804	3,789,251,109
第10計算期間	5,522,945,007	3,939,767,684
第11計算期間	8,883,287,293	9,359,729,031
第12計算期間	6,645,370,985	7,245,362,528
第13計算期間	7,715,628,600	7,738,797,562

第14計算期間	6,667,631,688	5,423,871,842
第15計算期間	6,173,599,760	7,408,064,686
第16計算期間	6,643,294,461	4,526,289,678
2018年12月1日～ 2019年5月31日	2,592,876,419	2,573,235,203

(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 (2019年6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	136,528,797,240	99.28
内 日本	136,528,797,240	99.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	987,472,928	0.72
純資産総額	137,516,270,168	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)	1,209,780,000	0.88
内 日本	1,209,780,000	0.88

(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 (2019年6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	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	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	684,700	7,002.13 4,794,358,634	6,688.00 4,579,273,600	3.33
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	502,600	5,432.23 2,730,241,635	5,165.00 2,595,929,000	1.89

3	ソニー	日本	株式	電気機器	412,300	6,605.26 2,723,352,608	5,648.00 2,328,670,400	1.69
4	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,172,000	694.17 2,896,112,059	512.00 2,136,064,000	1.55
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	412,400	5,132.86 2,116,793,830	5,017.00 2,069,010,800	1.50
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	536,400	4,556.67 2,444,200,308	3,823.00 2,050,657,200	1.49
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	30,200	63,227.90 1,909,482,653	66,130.00 1,997,126,000	1.45
8	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	427,100	4,506.32 1,924,650,475	3,806.00 1,625,542,600	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	420,600	3,643.31 1,532,380,234	3,594.00 1,511,636,400	1.10
10	本田技研	日本	株式	輸送用機器	518,400	3,360.02 1,741,839,491	2,785.00 1,443,744,000	1.05
11	任天堂	日本	株式	その他製品	35,200	39,807.41 1,401,221,162	39,490.00 1,390,048,000	1.01
12	KDDI	日本	株式	情報・通信業	494,300	3,066.57 1,515,807,494	2,743.50 1,356,112,050	0.99
13	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	8,233,500	196.65 1,619,139,859	156.10 1,285,249,350	0.93
14	花王	日本	株式	化学	149,200	9,005.24 1,343,583,051	8,210.00 1,224,932,000	0.89
15	三菱商事	日本	株式	卸売業	424,700	3,440.64 1,461,240,474	2,840.00 1,206,148,000	0.88
16	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	55,000	23,215.72 1,276,864,735	21,580.00 1,186,900,000	0.86
17	ダイキン工業	日本	株式	機械	83,800	15,440.65 1,293,927,266	14,065.00 1,178,647,000	0.86
18	東京海上HD	日本	株式	保険業	216,600	5,446.76 1,179,768,304	5,399.00 1,169,423,400	0.85
19	ファナック	日本	株式	電気機器	58,400	21,966.60 1,282,849,654	19,930.00 1,163,912,000	0.85
20	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	109,300	10,625.98 1,161,419,768	10,080.00 1,101,744,000	0.80
21	日立	日本	株式	電気機器	276,500	3,730.31 1,031,431,359	3,949.00 1,091,898,500	0.79
22	日本電産	日本	株式	電気機器	74,000	16,358.09 1,210,498,675	14,725.00 1,089,650,000	0.79

23	信越化学	日本	株式	化学	106,000	9,825.51 1,041,504,206	10,035.00 1,063,710,000	0.77
24	キヤノン	日本	株式	電気機器	330,800	3,520.44 1,164,564,730	3,146.00 1,040,696,800	0.76
25	HOYA	日本	株式	精密機器	123,700	6,647.96 822,352,660	8,254.00 1,021,019,800	0.74
26	資生堂	日本	株式	化学	122,100	7,912.72 966,143,938	8,121.00 991,574,100	0.72
27	第一三共	日本	株式	医薬品	175,800	4,600.86 808,832,455	5,635.00 990,633,000	0.72
28	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	381,800	3,014.14 1,150,801,071	2,512.50 959,272,500	0.70
29	村田製作所	日本	株式	電気機器	193,400	5,930.90 1,147,036,173	4,840.00 936,056,000	0.68
30	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	69,400	11,724.38 813,672,509	13,340.00 925,796,000	0.67

(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	99.28%
合計	99.28%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.11%
鉱業	0.27%
建設業	2.78%
食料品	4.09%
繊維製品	0.65%
パルプ・紙	0.28%
化学	7.35%
医薬品	5.45%
石油・石炭製品	0.62%
ゴム製品	0.78%
ガラス・土石製品	0.86%
鉄鋼	0.90%
非鉄金属	0.77%

金属製品	0.55%
機械	5.14%
電気機器	13.51%
輸送用機器	7.78%
精密機器	2.12%
その他製品	2.15%
電気・ガス業	1.65%
陸運業	4.69%
海運業	0.16%
空運業	0.54%
倉庫・運輸関連業	0.20%
情報・通信業	8.84%
卸売業	4.92%
小売業	4.52%
銀行業	5.82%
証券、商品先物取引業	0.75%
保険業	2.27%
その他金融業	1.12%
不動産業	2.38%
サービス業	5.24%
合計	99.28%

(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 2019年9月	買建	78	1,198,049,120	1,209,780,000	0.88%

(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

●DCダイワ日本株式インデックス

2019年6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	23,437円
純資産総額	654億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.7%
3カ月間	-2.4%
6カ月間	5.1%
1年間	-8.5%
3年間	31.8%
5年間	34.6%
設定来	134.4%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期
	07年11月	08年12月	09年11月	10年11月	11年11月	12年11月	13年12月	14年12月	15年11月	16年11月	17年11月	18年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

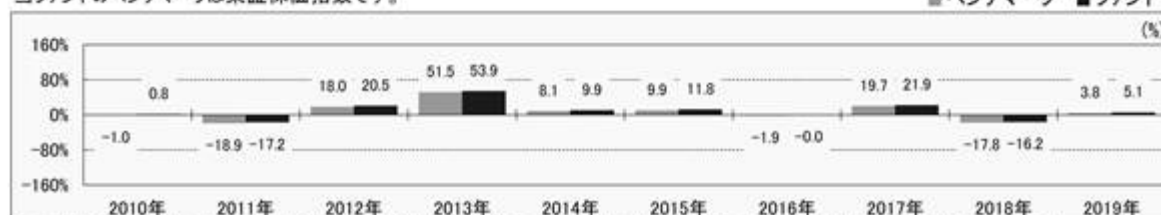
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,126	99.3%	電気機器	13.5%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.3%
国内株式先物	1	0.9%	情報・通信業	8.8%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.9%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	7.8%	ソニー	電気機器	1.7%
コール・ローン、その他	-	0.7%	化学	7.3%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.6%
合計	2,127	-	銀行業	5.8%	日本電信電話	情報・通信業	1.5%
株式市場・上場別構成			医薬品	5.5%	武田薬品	医薬品	1.5%
一部(東証・名証)		99.3%	サービス業	5.2%	キーエンス	電気機器	1.5%
二部(東証・名証)		-	機械	5.1%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.2%
新興市場他		-	卸売業	4.9%	リクルートホールディングス	サービス業	1.1%
その他		-	その他	35.2%	本田技研	輸送用機器	1.0%
合計		99.3%	合計	99.3%	合計		16.2%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■ベンチマーク ■ファンド



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

・2019年は6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。

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、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。）を結んだ受益権の取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって、受益権の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、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】

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。

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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。

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、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 <https://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付けたものとして、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。

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 <https://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12月1日から翌年11月30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、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。
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、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。
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 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 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 の3.または前 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る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 <https://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。

<https://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。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。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。

償還金にかかる請求権

受益者は、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとし、

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(平成29年12月1日から平成30年11月30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】

【財務諸表】

DCダイワ日本株式インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 平成29年11月30日現在	第16期 平成30年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	55,928,463
コール・ローン	174,194,873	108,767,849
親投資信託受益証券	67,553,842,684	69,260,185,124
流動資産合計	67,728,037,557	69,424,881,436
資産合計		
67,728,037,557		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	84,515,768	65,277,337
未払受託者報酬	13,500,861	15,042,107
未払委託者報酬	70,879,738	78,971,234
その他未払費用	1,089,491	1,096,993
流動負債合計	169,985,858	160,387,671
負債合計		
169,985,858		
純資産の部		
元本等		
元本	1 25,748,634,260	1 27,865,639,043
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	41,809,417,439	41,398,854,722
（分配準備積立金）	20,347,250,836	17,175,109,929
元本等合計	67,558,051,699	69,264,493,765
純資産合計		
67,558,051,699		
負債純資産合計		
67,728,037,557		

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期		第16期	
	自	平成28年12月1日 至 平成29年11月30日	自	平成29年12月1日 至 平成30年11月30日
営業収益				
受取利息		-		36
有価証券売買等損益		13,460,905,532		3,500,173,560
営業収益合計		13,460,905,532		3,500,173,524
営業費用				
支払利息		67,715		79,088
受託者報酬		26,033,416		29,869,451
委託者報酬		136,675,839		156,814,937
その他費用		2,160,380		2,167,594
営業費用合計		164,937,350		188,931,070
営業利益又は営業損失（ ）		13,295,968,182		3,689,104,594
経常利益又は経常損失（ ）		13,295,968,182		3,689,104,594
当期純利益又は当期純損失（ ）		13,295,968,182		3,689,104,594
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,418,662,896		117,746,425
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		30,020,377,819		41,809,417,439
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,255,619,789		10,505,420,030
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,255,619,789		10,505,420,030
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,343,885,455		7,344,624,578
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,343,885,455		7,344,624,578
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		41,809,417,439		41,398,854,722

(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16期	
	自 平成29年12月1日	至 平成30年11月30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15期	第16期
	平成29年11月30日現在	平成30年11月30日現在
1. 1 期首元本額	26,983,099,186円	25,748,634,260円
期中追加設定元本額	6,173,599,760円	6,643,294,461円
期中一部解約元本額	7,408,064,686円	4,526,289,678円
2. 計算期間末日における受益権の総数	25,748,634,260口	27,865,639,043口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第15期	第16期
	自 平成28年12月1日 至 平成29年11月30日	自 平成29年12月1日 至 平成30年11月30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（10,786,956,026円）、投資信託約款に規定される収益調整金（24,553,869,525円）及び分配準備積立金（9,560,294,810円）より分配対象額は44,901,120,361円（1万口当たり17,438.25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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（31,417,690,266円）及び分配準備積立金（17,175,109,929円）より分配対象額は48,592,800,195円（1万口当たり17,438.25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16期 自 平成29年12月1日 至 平成30年11月30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16期
	平成30年11月30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15期	第16期
	平成29年11月30日現在	平成30年11月30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	12,825,928,222	3,484,564,156
合計	12,825,928,222	3,484,564,156

（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15期	第16期
平成29年11月30日現在	平成30年11月30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16期
自 平成29年12月1日
至 平成30年11月30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15期	第16期
	平成29年11月30日現在	平成30年11月30日現在
1口当たり純資産額	2.6238円	2.4857円
（1万口当たり純資産額）	（26,238円）	（24,857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	65,506,653,858	69,260,185,124	
親投資信託受益証券 合計			69,260,185,124	
合計			69,260,185,124	

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11月30日現在	平成30年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	5,748,360,758
コール・ローン	5,276,595,266	11,179,224,344

株式	2 3	141,293,259,400	140,729,270,900
派生商品評価勘定		81,277,080	26,461,940
未収入金		-	76,903,429
未収配当金		779,613,672	875,753,046
未収利息		327,444	1,251,373
前払金		-	21,520,000
その他未収収益	4	9,771,083	30,930,674
流動資産合計		147,440,843,945	158,689,676,464
資産合計		147,440,843,945	158,689,676,464
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,080	7,672,420
前受金		69,750,000	-
未払金		452,160	1,030,901,154
未払解約金		254,453,100	23,803,900
受入担保金		3,958,464,457	15,009,839,092
その他未払費用		-	174,575
流動負債合計		4,283,120,797	16,072,391,141
負債合計		4,283,120,797	16,072,391,141
純資産の部			
元本等			
元本	1	128,627,233,302	134,890,694,102
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		14,530,489,846	7,726,591,221
元本等合計		143,157,723,148	142,617,285,323
純資産合計		143,157,723,148	142,617,285,323
負債純資産合計		147,440,843,945	158,689,676,464

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12月1日 至 平成30年11月30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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</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11月30日現在	平成30年11月30日現在
1. 1 期首	平成28年12月1日	平成29年12月1日
期首元本額	141,237,185,956円	128,627,233,302円
期中追加設定元本額	15,344,235,430円	18,705,077,077円
期中一部解約元本額	27,954,188,084円	12,441,616,277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	4,364,412,056円	4,208,196,163円
ファンド		

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	11,109,078,226円	8,873,990,627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	63,469,755円	50,893,960円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	80,019,243円	65,059,832円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,411,218,462円	1,060,778,978円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	70,073,352円	59,055,392円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,949,560,771円	1,449,339,094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	4,513,952円
D-I's TOPIXイン デックス	28,367,467円	39,579,272円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	25,160,362円	19,750,054円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	571,628円	687,039円
iFree TOPIXイン デックス	294,793,376円	766,287,386円
iFree 8資産バランス	624,779,967円	1,279,701,333円
iFree 年金バランス	-円	18,821,903円
DCダイワ日本株式インデッ クス	60,695,276,446円	65,506,653,858円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,195,311,787円	2,604,113,138円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,320,693,161円	2,907,019,868円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,181,670,247円	2,813,203,474円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,033,420,970円	4,626,136,087円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	17,249,227円	15,110,700円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	51,964,735円	52,614,491円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	13,124,314円	16,862,669円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	- 円	9,822,989円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	364,602円	350,718円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	362,318円	359,201円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	690,983円	712,052円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	6,930,943円	4,149,572円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	19,322,872円	4,912,940円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	15,921,448円	9,756,807円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	359,581,980円	184,587,297円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	168,953,117円	162,072,230円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	11,001,597,589円	9,658,927,568円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	227,225,197円	11,433,435円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	239,347,643円	14,487,998円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	895,003,489円	823,275,779円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	144,200,065円	129,734,372円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	242,040,229円	221,128,598円
ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	70,307,122円	140,301,263円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	5,865,224,891円	8,504,620,250円

	ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	4,249,531円	292,440,998円
	ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	1,175,567,763円	1,905,520,921円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,188,177,701円	1,400,114,800円
	ダイワライフスタイル25	176,027,159円	181,369,214円
	ダイワライフスタイル50	628,315,358円	649,148,174円
	ダイワライフスタイル75	505,576,948円	544,757,466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)	14,162,028,802円	13,598,340,190円
	計	128,627,233,302円	134,890,694,102円
2.	期末日における受益権の総数	128,627,233,302口	134,890,694,102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 3,819,839,950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 14,441,000,290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 704,400,000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 680,300,000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8,686,485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28,279,195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12月1日 至 平成30年11月30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11月30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	<p>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。</p>
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11月30日現在	平成30年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	9,624,573,051	9,360,479,994

合計	9,624,573,051	9,360,479,994
----	---------------	---------------

(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29年9月20日から平成29年11月30日まで、及び平成30年9月20日から平成30年11月30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11月30日 現在				平成30年11月30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	1,715,670,000	-	1,797,000,000	81,330,000	1,849,310,000	-	1,868,160,000	18,850,000
合計	1,715,670,000	-	1,797,000,000	81,330,000	1,849,310,000	-	1,868,160,000	18,850,000

(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11月30日現在	平成30年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1130円	1.0573円
(1万口当たり純資産額)	(11,130円)	(10,573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	2,600	3,225.00	8,385,000	
日本水産	81,100	686.00	55,634,600	
マルハニチロ	11,700	4,105.00	48,028,500	
ハウスイ	500	911.00	455,500	
カネコ種苗	2,200	1,437.00	3,161,400	
サカタのタネ	9,900	3,895.00	38,560,500	
ホクト	6,700	2,019.00	13,527,300	
ホクリヨウ	1,000	752.00	752,000	
ヒノキヤグループ	1,700	2,113.00	3,592,100	
ショーボンドHD	6,300	8,700.00	54,810,000	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ミライト・ホールディングス	20,500	1,664.00	34,112,000	貸付株式数 5,500株 (5,500株)
タマホーム	5,200	1,111.00	5,777,200	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
サンヨーホームズ	1,400	875.00	1,225,000	貸付株式数 400株
日本アクア	2,000	390.00	780,000	貸付株式数 800株
ファーストコーポレーション	2,300	1,066.00	2,451,800	貸付株式数 900株
ベステラ	1,500	1,565.00	2,347,500	
スペースバリューHD	9,800	1,046.00	10,250,800	
住石ホールディングス	16,400	115.00	1,886,000	
日鉄鉱業	1,800	5,560.00	10,008,000	
三井松島HLDGS	3,300	1,612.00	5,319,600	
国際石油開発帝石	324,500	1,205.00	391,022,500	
石油資源開発	11,600	2,354.00	27,306,400	
K&Oエナジーグループ	3,900	1,636.00	6,380,400	
ダイセキ環境ソリューション	1,500	865.00	1,297,500	
第一カッター興業	900	2,140.00	1,926,000	
安藤・間	51,500	686.00	35,329,000	
東急建設	23,600	1,145.00	27,022,000	
コムシスホールディングス	28,700	2,930.00	84,091,000	
ミサワホーム	6,800	831.00	5,650,800	
ビーアールホールディングス	6,500	397.00	2,580,500	
高松コンストラクションGP	5,100	2,899.00	14,784,900	
東建コーポレーション	2,500	7,780.00	19,450,000	

ソネック	800	778.00	622,400	
ヤマウラ	3,000	902.00	2,706,000	貸付株式数 1,500株
大成建設	66,500	4,990.00	331,835,000	
大林組	200,300	1,132.00	226,739,600	
清水建設	204,400	970.00	198,268,000	
飛鳥建設	5,600	1,560.00	8,736,000	
長谷工コーポレーション	83,700	1,374.00	115,003,800	
松井建設	7,300	853.00	6,226,900	
銭高組	800	5,500.00	4,400,000	
鹿島建設	156,400	1,571.00	245,704,400	
不動テトラ	5,000	1,952.00	9,760,000	
大末建設	2,300	1,190.00	2,737,000	
鉄建建設	4,000	3,020.00	12,080,000	
西松建設	14,400	2,618.00	37,699,200	
三井住友建設	48,000	705.00	33,840,000	
大豊建設	4,600	3,775.00	17,365,000	
前田建設	47,600	1,192.00	56,739,200	
佐田建設	4,000	433.00	1,732,000	
ナカノフドー建設	4,900	625.00	3,062,500	貸付株式数 1,000株
奥村組	11,000	3,785.00	41,635,000	
東鉄工業	8,000	3,340.00	26,720,000	
イチケン	1,200	2,165.00	2,598,000	貸付株式数 100株
富士ピー・エス	2,000	517.00	1,034,000	
浅沼組	2,400	3,475.00	8,340,000	
戸田建設	77,800	764.00	59,439,200	
熊谷組	9,600	3,595.00	34,512,000	
青木あすなろ建設	3,600	1,028.00	3,700,800	
北野建設	1,400	4,075.00	5,705,000	
植木組	800	2,453.00	1,962,400	
矢作建設	9,100	764.00	6,952,400	
ピーエス三菱	7,000	711.00	4,977,000	
日本ハウスHLDGS	12,600	504.00	6,350,400	貸付株式数 3,100株
大東建託	23,900	14,830.00	354,437,000	
新日本建設	8,200	1,210.00	9,922,000	
NIPPON	17,700	1,935.00	34,249,500	
東亜道路	1,200	3,250.00	3,900,000	貸付株式数 800株
前田道路	21,100	2,230.00	47,053,000	
日本道路	1,800	6,170.00	11,106,000	
東亜建設	5,800	1,576.00	9,140,800	
若築建設	3,400	1,723.00	5,858,200	貸付株式数 1,000株

東洋建設	24,200	423.00	10,236,600	
五洋建設	79,300	716.00	56,778,800	
世紀東急	9,400	674.00	6,335,600	
福田組	2,200	5,410.00	11,902,000	貸付株式数 600株
日本ドライケミカル	1,500	1,318.00	1,977,000	
住友林業	47,300	1,675.00	79,227,500	
日本基礎技術	6,600	346.00	2,283,600	
巴コーポレーション	8,300	451.00	3,743,300	貸付株式数 4,600株
大和ハウス	185,100	3,575.00	661,732,500	
ライト工業	12,900	1,545.00	19,930,500	
積水ハウス	205,200	1,711.00	351,097,200	
日特建設	5,600	700.00	3,920,000	
北陸電気工事	3,100	1,000.00	3,100,000	
ユアテック	10,700	936.00	10,015,200	貸付株式数 500株
四電工	1,000	2,738.00	2,738,000	
中電工	8,600	2,524.00	21,706,400	
関電工	30,500	1,178.00	35,929,000	貸付株式数 6,800株
きんでん	44,600	1,966.00	87,683,600	
東京エネシス	6,700	965.00	6,465,500	貸付株式数 3,200株
トーエネック	1,900	3,140.00	5,966,000	
住友電設	4,600	2,079.00	9,563,400	貸付株式数 2,000株
日本電設工業	11,500	2,482.00	28,543,000	
協和エクシオ	26,100	2,860.00	74,646,000	
新日本空調	5,700	2,063.00	11,759,100	
日本工営	3,800	2,731.00	10,377,800	
九電工	13,200	4,415.00	58,278,000	
三機工業	15,100	1,221.00	18,437,100	
日揮	57,500	1,658.00	95,335,000	
中外炉工業	1,900	2,468.00	4,689,200	
ヤマト	5,900	636.00	3,752,400	
太平電業	4,400	2,790.00	12,276,000	
高砂熱学	16,900	2,037.00	34,425,300	
三晃金属	800	3,010.00	2,408,000	
NEC ネットズエスアイ	6,500	2,528.00	16,432,000	
朝日工業社	1,400	3,330.00	4,662,000	
明星工業	12,000	845.00	10,140,000	貸付株式数 1,000株
大気社	9,100	3,190.00	29,029,000	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
ダイダン	4,400	2,553.00	11,233,200	
日比谷総合設備	6,300	1,926.00	12,133,800	貸付株式数 1,000株

東芝プラントシステム	14,500	2,483.00	36,003,500	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
日本製粉	19,700	1,937.00	38,158,900	
日清製粉G本社	67,700	2,385.00	161,464,500	
日東富士製粉	400	5,620.00	2,248,000	
昭和産業	5,400	2,837.00	15,319,800	貸付株式数 700株
鳥越製粉	5,300	948.00	5,024,400	貸付株式数 1,000株
中部飼料	7,200	1,405.00	10,116,000	
フィード・ワン	39,500	210.00	8,295,000	貸付株式数 5,000株
東洋精糖	900	1,173.00	1,055,700	
日本甜菜糖	3,400	1,967.00	6,687,800	
三井製糖	4,700	3,020.00	14,194,000	
塩水港精糖	6,500	251.00	1,631,500	
日新製糖	2,900	2,385.00	6,916,500	
L I F U L L	19,800	897.00	17,760,600	
ジェイエイシーリクルート メント	4,600	2,315.00	10,649,000	貸付株式数 1,800株
日本M&Aセンター	42,500	2,647.00	112,497,500	
メンバーズ	1,900	1,030.00	1,957,000	
中広	500	621.00	310,500	
タケエイ	5,800	866.00	5,022,800	
E・Jホールディングス	700	1,186.00	830,200	貸付株式数 200株
トラスト・テック	2,700	3,260.00	8,802,000	貸付株式数 1,000株
コシダカホールディングス	15,300	1,535.00	23,485,500	
アルトナー	1,000	781.00	781,000	
パソナグループ	5,400	1,397.00	7,543,800	貸付株式数 500株 (500株)
C D S	1,400	1,329.00	1,860,600	貸付株式数 700株
リンクアンドモチベーショ ン	10,500	1,041.00	10,930,500	貸付株式数 4,100株
G C A	5,700	802.00	4,571,400	
エス・エム・エス	20,900	1,870.00	39,083,000	
パーソルホールディングス	56,900	2,126.00	120,969,400	
リニカル	3,200	1,616.00	5,171,200	
クックパッド	17,800	413.00	7,351,400	貸付株式数 8,200株
エスクリ	1,600	669.00	1,070,400	
アイ・ケイ・ケイ	2,800	724.00	2,027,200	
森永製菓	15,000	4,990.00	74,850,000	
中村屋	1,600	4,515.00	7,224,000	
江崎グリコ	18,000	5,530.00	99,540,000	貸付株式数 1,000株

名糖産業	2,900	1,475.00	4,277,500	
井村屋グループ	2,600	3,115.00	8,099,000	
不二家	3,200	2,514.00	8,044,800	
山崎製パン	49,000	2,383.00	116,767,000	貸付株式数 5,200株
第一屋製パン	1,100	1,144.00	1,258,400	貸付株式数 400株
モロゾフ	1,000	5,470.00	5,470,000	
亀田製菓	3,700	5,360.00	19,832,000	
寿スピリッツ	6,300	4,850.00	30,555,000	
カルビー	27,200	3,760.00	102,272,000	貸付株式数 10,300株
森永乳業	11,900	3,325.00	39,567,500	
六甲バター	4,300	2,383.00	10,246,900	
ヤクルト	44,300	8,550.00	378,765,000	
明治ホールディングス	42,400	8,930.00	378,632,000	
雪印メグミルク	14,400	3,160.00	45,504,000	
プリマハム	8,300	2,156.00	17,894,800	
日本ハム	25,800	4,210.00	108,618,000	
林兼産業	1,800	672.00	1,209,600	
丸大食品	6,300	2,021.00	12,732,300	
S Foods	5,300	4,905.00	25,996,500	
伊藤ハム米久HLDGS	38,100	755.00	28,765,500	貸付株式数 3,000株
学情	2,300	1,536.00	3,532,800	
スタジオアリス	2,900	2,598.00	7,534,200	
シミックホールディングス	3,200	2,177.00	6,966,400	
システナ	20,900	1,461.00	30,534,900	
NJS	1,200	1,719.00	2,062,800	
デジタルアーツ	3,100	6,490.00	20,119,000	貸付株式数 1,200株
新日鉄住金SOL	8,800	3,245.00	28,556,000	
総合警備保障	22,700	5,340.00	121,218,000	
キューブシステム	3,100	771.00	2,390,100	貸付株式数 1,000株
いちご	74,000	389.00	28,786,000	
エイジア	1,200	1,404.00	1,684,800	貸付株式数 400株
日本駐車場開発	75,600	160.00	12,096,000	
コア	2,400	1,401.00	3,362,400	
カカクコム	42,900	2,284.00	97,983,600	
アイロムグループ	2,200	2,193.00	4,824,600	
セントケア・ホールディング	3,100	585.00	1,813,500	
サイネックス	900	763.00	686,700	
ルネサンス	3,100	2,372.00	7,353,200	
ディップ	9,100	2,550.00	23,205,000	

SBSホールディングス	6,100	1,369.00	8,350,900	貸付株式数	1,000株
オプトホールディング	3,500	2,117.00	7,409,500	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
新日本科学	7,900	711.00	5,616,900		
ツクイ	13,300	1,021.00	13,579,300	貸付株式数	400株
キャリアデザインセンター	1,400	1,302.00	1,822,800		
エムスリー	120,100	1,834.00	220,263,400		
ツカダ・グローバルHOLD	3,800	628.00	2,386,400	貸付株式数	1,000株
プラス	500	632.00	316,000		
アウトソーシング	30,000	1,423.00	42,690,000		
ウェルネット	5,700	1,145.00	6,526,500	貸付株式数	3,600株
ワールドホールディングス	1,600	2,736.00	4,377,600	貸付株式数	100株
ディー・エヌ・エー	30,800	2,106.00	64,864,800	貸付株式数	3,700株
博報堂DYHLDGS	79,400	1,738.00	137,997,200		
ぐるなび	8,100	842.00	6,820,200	貸付株式数	1,300株
エスアールジータカミヤ	6,100	695.00	4,239,500		
ジャパンベストレスキュー	4,400	1,624.00	7,145,600	貸付株式数	1,700株
ファンコミュニケーションズ	15,600	705.00	10,998,000	貸付株式数	6,300株
ライク	2,200	1,662.00	3,656,400	貸付株式数	800株
ビジネス・ブレークスルー	2,300	377.00	867,100		
WDBホールディングス	2,600	2,878.00	7,482,800		
ティア	2,600	690.00	1,794,000	貸付株式数	1,000株
CDG	500	1,461.00	730,500		
バリューコマース	3,900	1,486.00	5,795,400	貸付株式数	1,500株
インフォマート	31,300	1,394.00	43,632,200	貸付株式数	12,300株
サッポロホールディングス	21,900	2,585.00	56,611,500	貸付株式数	8,600株
アサヒグループホールディング	125,300	4,754.00	595,676,200		
麒麟HD	270,900	2,665.00	721,948,500		
宝ホールディングス	45,000	1,447.00	65,115,000		
オエノンホールディングス	16,800	386.00	6,484,800	貸付株式数	4,500株
養命酒	1,900	2,423.00	4,603,700		
コカ・コーラボトラーズJHD	45,900	3,250.00	149,175,000		
サントリー食品インター	40,000	4,760.00	190,400,000		
ダイドーグループHD	3,400	6,180.00	21,012,000	貸付株式数	800株
伊藤園	19,900	5,210.00	103,679,000		

キーコーヒー	5,900	2,149.00	12,679,100		
ユニカフェ	1,800	1,268.00	2,282,400		
ジャパンフーズ	800	1,233.00	986,400		
日清オイリオグループ	7,700	3,520.00	27,104,000		
不二製油グループ	14,600	3,630.00	52,998,000		
かどや製油	600	5,840.00	3,504,000		
J-オイルミルズ	3,100	4,050.00	12,555,000		
ローソン	14,800	7,430.00	109,964,000		
サンエー	4,400	4,765.00	20,966,000		
カワチ薬品	4,500	2,209.00	9,940,500		
エービーシー・マート	9,200	6,380.00	58,696,000		
ハードオフコーポレーション	2,300	915.00	2,104,500		
高千穂交易	2,200	1,079.00	2,373,800		
アスクル	5,100	2,965.00	15,121,500	貸付株式数	2,000株
ゲオホールディングス	8,900	1,911.00	17,007,900	貸付株式数	3,500株
アダストリア	8,100	1,859.00	15,057,900	貸付株式数	800株 (100株)
ジーフット	3,900	752.00	2,932,800	貸付株式数	1,000株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	700	744.00	520,800		
伊藤忠食品	1,400	5,320.00	7,448,000		
くらコーポレーション	3,400	7,140.00	24,276,000		
キャンドウ	2,700	1,684.00	4,546,800		
エレマテック	2,700	2,261.00	6,104,700		
パルグループHLDGS	3,000	3,080.00	9,240,000		
JALUX	1,700	2,862.00	4,865,400	貸付株式数	200株
エディオン	24,900	1,248.00	31,075,200	貸付株式数	9,000株
あらた	3,200	4,930.00	15,776,000		
サーラコーポレーション	11,800	661.00	7,799,800		
ワッツ	1,900	815.00	1,548,500	貸付株式数	100株
トーメンデバイス	800	2,461.00	1,968,800		
ハローズ	2,200	2,598.00	5,715,600		
J Pホールディングス	16,100	309.00	4,974,900	貸付株式数	6,400株 (2,000株)
あみやき亭	1,300	4,100.00	5,330,000		
東京エレクトロデバイス	2,100	1,911.00	4,013,100		
ひらまつ	11,600	369.00	4,280,400	貸付株式数	5,900株
フィールズ	5,100	916.00	4,671,600	貸付株式数	1,200株
双日	324,700	402.00	130,529,400		

アルフレッサホールディングス	65,200	3,020.00	196,904,000		
大黒天物産	1,400	4,485.00	6,279,000	貸付株式数	400株
ハニーズホールディングス	5,600	909.00	5,090,400		
ファーマライズHD	1,400	603.00	844,200	貸付株式数	500株 (500株)
キッコーマン	39,500	6,620.00	261,490,000		
味の素	135,500	1,962.50	265,918,750	貸付株式数	20,600株
キューピー	33,300	2,756.00	91,774,800		
ハウス食品G本社	22,900	4,025.00	92,172,500		
カゴメ	23,900	3,315.00	79,228,500		
焼津水産化工	2,900	1,092.00	3,166,800	貸付株式数	1,000株
アリアケジャパン	5,500	9,810.00	53,955,000		
ピエトロ	700	1,643.00	1,150,100		
エバラ食品工業	1,400	2,228.00	3,119,200		
ニチレイ	31,100	3,205.00	99,675,500		
横浜冷凍	15,200	948.00	14,409,600		
東洋水産	30,700	3,890.00	119,423,000		
イトアンド	2,000	1,771.00	3,542,000		
大冷	700	1,825.00	1,277,500		
ヨシムラ・フード・HLDGS	1,600	671.00	1,073,600		
日清食品HD	25,400	7,330.00	186,182,000		
永谷園ホールディングス	3,100	2,787.00	8,639,700		
一正蒲鉾	2,300	1,096.00	2,520,800	貸付株式数	800株
フジッコ	6,400	2,494.00	15,961,600		
ロックフィールド	6,400	1,687.00	10,796,800		
日本たばこ産業	345,600	2,823.50	975,801,600		
ケンコーマヨネーズ	3,300	2,300.00	7,590,000	貸付株式数	200株
わらべや日洋HD	3,900	1,957.00	7,632,300	貸付株式数	600株
なとり	3,300	1,875.00	6,187,500		
イフジ産業	1,000	713.00	713,000		
ピクルスコーポレーション	1,400	2,256.00	3,158,400		
北の達人コーポ	23,500	525.00	12,337,500	貸付株式数	7,900株
ユーグレナ	24,500	698.00	17,101,000	貸付株式数	9,400株 (5,800株)
片倉工業	7,200	1,218.00	8,769,600		
グンゼ	4,200	4,455.00	18,711,000		
ヒューリック	124,000	1,038.00	128,712,000		

神 栄	700	1,161.00	812,700		
ラサ商事	3,200	973.00	3,113,600		
アルペン	4,500	1,947.00	8,761,500	貸付株式数	1,700株
ハブ	1,900	955.00	1,814,500		
ラクーンホールディングス	3,400	705.00	2,397,000	貸付株式数	300株
クオールホールディングス	8,600	2,030.00	17,458,000	貸付株式数	2,700株
アルコニックス	6,200	1,305.00	8,091,000	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
神戸物産	8,900	3,480.00	30,972,000		
ソリトンシステムズ	3,300	906.00	2,989,800	貸付株式数	1,300株
ジンズ	4,000	7,020.00	28,080,000		
ビックカメラ	31,400	1,596.00	50,114,400	貸付株式数	8,900株 (8,900株)
D C Mホールディングス	31,600	1,126.00	35,581,600	貸付株式数	12,500株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	4,600	4,100.00	18,860,000	貸付株式数	1,800株 (300株)
Monotaro	37,200	3,075.00	114,390,000	貸付株式数	14,700株
東京一番フーズ	1,400	633.00	886,200	貸付株式数	500株 (500株)
DDホールディングス	1,300	2,466.00	3,205,800	貸付株式数	500株
あい ホールディングス	9,400	2,263.00	21,272,200	貸付株式数	3,700株
ディー・ブイエックス	2,200	1,220.00	2,684,000		
きちり	1,500	825.00	1,237,500	貸付株式数	600株
アークランドサービスHD	4,200	2,514.00	10,558,800		
J. フロント リテイリング	75,200	1,550.00	116,560,000	貸付株式数	26,800株
ドトール・日レスHD	10,200	2,215.00	22,593,000		
マツモトキヨシHLDGS	24,300	4,215.00	102,424,500		
ブロンコビリー	3,100	2,981.00	9,241,100	貸付株式数	1,400株 (900株)
ZOZO	63,400	2,525.00	160,085,000	貸付株式数	22,500株
トレジャー・ファクトリー	1,700	745.00	1,266,500		
物語コーポレーション	1,700	11,070.00	18,819,000		
ココカラファイン	6,600	6,480.00	42,768,000	貸付株式数	2,600株
三越伊勢丹HD	110,000	1,313.00	144,430,000	貸付株式数	43,400株
東洋紡	24,700	1,643.00	40,582,100		
ユニチカ	17,000	548.00	9,316,000		
富士紡ホールディングス	3,000	3,110.00	9,330,000		
日清紡ホールディングス	32,900	1,033.00	33,985,700		

倉敷紡績	5,500	2,900.00	15,950,000	
ダイワボウHD	5,400	6,360.00	34,344,000	
シキボウ	3,200	1,164.00	3,724,800	
日東紡績	8,800	2,174.00	19,131,200	
トヨタ紡織	20,800	1,749.00	36,379,200	
マクニカ・富士エレHLD GS	16,200	1,752.00	28,382,400	貸付株式数 4,300株
Hamee	1,500	1,831.00	2,746,500	貸付株式数 100株
ラクト・ジャパン	1,300	7,960.00	10,348,000	
ウエルシアHD	15,600	5,750.00	89,700,000	
クリエイトSDH	8,700	3,095.00	26,926,500	
バイタルKSKHD	11,000	1,212.00	13,332,000	貸付株式数 4,400株
八洲電機	6,000	835.00	5,010,000	貸付株式数 1,000株
メディアスホールディング ス	3,100	827.00	2,563,700	
UKCホールディングス	3,800	2,436.00	9,256,800	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ジューテックHD	1,300	1,065.00	1,384,500	
丸善CHI HD	6,600	346.00	2,283,600	
大光	1,400	683.00	956,200	貸付株式数 500株
OCHIホールディングス	1,800	1,267.00	2,280,600	
TOKAIホールディング ス	30,900	1,004.00	31,023,600	
黒谷	1,000	513.00	513,000	貸付株式数 300株
ミサワ	1,000	495.00	495,000	
ティーライフ	800	980.00	784,000	
Cominix	900	841.00	756,900	
エー・ピーカンパニー	900	540.00	486,000	
三洋貿易	3,000	2,023.00	6,069,000	
チムニー	1,700	2,751.00	4,676,700	貸付株式数 600株
シュッピン	4,000	1,095.00	4,380,000	
ビューティガレージ	800	1,798.00	1,438,400	
ウイン・パートナーズ	3,700	1,162.00	4,299,400	貸付株式数 1,000株
ネクステージ	9,000	1,199.00	10,791,000	貸付株式数 3,500株
ジョイフル本田	17,200	1,731.00	29,773,200	貸付株式数 4,600株
鳥貴族	1,900	2,242.00	4,259,800	貸付株式数 900株
麒麟堂ホールディングス	2,300	1,615.00	3,714,500	
ホットランド	3,000	1,483.00	4,449,000	貸付株式数 1,400株 (1,300株)

すかいらーくHD	54,600	1,860.00	101,556,000	貸付株式数 21,100株 (2,800株)
綿半ホールディングス	2,200	2,717.00	5,977,400	貸付株式数 700株
日本毛織	19,700	919.00	18,104,300	
ダイトウボウ	12,700	101.00	1,282,700	貸付株式数 3,800株
トーア紡コーポレーション	2,600	544.00	1,414,400	
ダイドーリミテッド	6,900	366.00	2,525,400	貸付株式数 1,000株
ヨシックス	1,000	3,325.00	3,325,000	
ユナイテッド・スーパー マーケ	17,200	1,319.00	22,686,800	
三栄建築設計	2,600	1,575.00	4,095,000	
野村不動産HLDGS	40,300	2,242.00	90,352,600	
三重交通グループHD	12,500	614.00	7,675,000	貸付株式数 3,000株
サムティ	8,300	1,516.00	12,582,800	貸付株式数 3,200株
エー・ディー・ワークス	96,100	41.00	3,940,100	
日本商業開発	4,200	1,732.00	7,274,400	貸付株式数 1,900株
プレサンスコーポレーショ ン	9,600	1,416.00	13,593,600	貸付株式数 3,600株
ユニゾホールディングス	9,100	2,312.00	21,039,200	貸付株式数 3,500株
日本管理センター	4,100	1,019.00	4,177,900	
サンセイランディック	1,900	1,017.00	1,932,300	
エストラスト	1,300	797.00	1,036,100	
フージャースHD	13,500	656.00	8,856,000	貸付株式数 6,000株
オープンハウス	9,600	4,040.00	38,784,000	貸付株式数 3,800株
東急不動産HD	160,200	637.00	102,047,400	
飯田GHD	49,600	2,003.00	99,348,800	貸付株式数 3,000株
イーランド	1,100	740.00	814,000	
帝国繊維	6,600	2,454.00	16,196,400	
日本コークス工業	49,400	106.00	5,236,400	
ゴルフダイジェスト・オン	2,300	806.00	1,853,800	貸付株式数 900株
ミタチ産業	1,400	787.00	1,101,800	貸付株式数 500株
B E E N O S	1,400	1,639.00	2,294,600	
あさひ	4,800	1,461.00	7,012,800	
日本調剤	2,100	3,670.00	7,707,000	貸付株式数 400株 (100株)
コスモス薬品	3,000	23,030.00	69,090,000	貸付株式数 1,100株
シップヘルスケアHD	12,200	4,270.00	52,094,000	
トーエル	2,800	813.00	2,276,400	
一六堂	1,200	513.00	615,600	
ソフトクリエイイトHD	2,500	1,739.00	4,347,500	

オンリー	1,000	1,080.00	1,080,000	
セブン&アイ・HLDGS	246,300	4,943.00	1,217,460,900	
薬王堂	2,500	3,400.00	8,500,000	貸付株式数 1,000株
クリエイト・レストランツ・ホール	15,700	1,325.00	20,802,500	貸付株式数 6,200株
明治電機工業	1,800	2,126.00	3,826,800	
ツルハホールディングス	12,700	11,200.00	142,240,000	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
デリカフーズHLDGS	1,000	1,452.00	1,452,000	
スターティアホールディングス	1,100	723.00	795,300	
サンマルクホールディングス	4,600	2,774.00	12,760,400	貸付株式数 400株
フェリシモ	1,300	1,212.00	1,575,600	貸付株式数 500株
トリドールホールディングス	7,200	2,212.00	15,926,400	貸付株式数 2,800株 (800株)
帝人	47,400	1,960.00	92,904,000	
東レ	453,200	890.30	403,483,960	
クラレ	98,300	1,764.00	173,401,200	
旭化成	415,300	1,243.00	516,217,900	貸付株式数 37,900株
サカイオーベックス	1,400	2,467.00	3,453,800	
TOKYO BASE	5,200	696.00	3,619,200	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
稲葉製作所	3,200	1,357.00	4,342,400	
宮地エンジニアリングG	1,800	2,148.00	3,866,400	
トーカロ	15,000	990.00	14,850,000	貸付株式数 6,000株
アルファCO	2,000	1,395.00	2,790,000	貸付株式数 800株
SUMCO	65,200	1,740.00	113,448,000	貸付株式数 25,500株
川田テクノロジーズ	1,300	8,530.00	11,089,000	
RS TECHNOLOGIES	1,200	5,040.00	6,048,000	貸付株式数 400株
ビーロット	1,000	1,369.00	1,369,000	貸付株式数 300株
ファーストブラザーズ	1,600	1,360.00	2,176,000	貸付株式数 600株
ハウストゥ	2,300	1,248.00	2,870,400	貸付株式数 800株
シーアールイー	2,600	1,009.00	2,623,400	
プロパティエージェント	800	1,033.00	826,400	貸付株式数 200株
ケイアイスター不動産	1,800	1,881.00	3,385,800	
アグレ都市デザイン	1,000	635.00	635,000	
ジェイ・エス・ビー	200	4,495.00	899,000	
テンポイノベーション	500	1,536.00	768,000	

住江織物	1,600	2,730.00	4,368,000	貸付株式数	500株
日本フェルト	2,900	480.00	1,392,000		
イチカワ	800	1,508.00	1,206,400		
エコナックホールディングス	10,400	116.00	1,206,400		
日東製網	600	1,512.00	907,200		
芦森工業	1,200	1,719.00	2,062,800		
アツギ	4,800	1,071.00	5,140,800		
ウイルプラスHLDGS	500	968.00	484,000		
ジャパンミート	2,200	1,988.00	4,373,600		
コメダホールディングス	13,500	2,370.00	31,995,000		
サツドラホールディングス	1,000	1,964.00	1,964,000		
デファクトスタンダード	400	623.00	249,200		
ダイユー・リックHLDGS	3,100	1,191.00	3,692,100		
パロックジャパン	4,700	1,073.00	5,043,100		
クスリのアオキHLDGS	4,700	8,400.00	39,480,000	貸付株式数	400株
ダイニック	2,200	807.00	1,775,400		
共和レザー	3,400	888.00	3,019,200	貸付株式数	1,300株
力の源HD	1,600	966.00	1,545,600		
スシローグローバルHLDGS	6,400	6,220.00	39,808,000		
LIXILピバ	4,900	1,779.00	8,717,100	貸付株式数	1,000株
セーレン	14,400	1,898.00	27,331,200		
ソトー	2,200	988.00	2,173,600		
東海染工	700	1,123.00	786,100		
小松マテーレ	9,600	905.00	8,688,000		
ワコールホールディングス	17,000	3,095.00	52,615,000		
ホギメディカル	7,200	3,425.00	24,660,000		
レナウン	16,300	117.00	1,907,100		
クラウディアHLDGS	1,400	495.00	693,000		
T S Iホールディングス	21,400	753.00	16,114,200	貸付株式数	100株
マツオカコーポレーション	1,800	3,245.00	5,841,000		
ワールド	6,000	1,975.00	11,850,000	貸付株式数	2,400株
T I S	19,500	5,240.00	102,180,000		
ネオス	2,100	1,335.00	2,803,500		
電算システム	2,200	2,273.00	5,000,600		
グリー	31,400	496.00	15,574,400		
コーエーテクモHD	12,000	1,884.00	22,608,000		
三菱総合研究所	2,300	3,860.00	8,878,000		

ボルテージ	1,200	680.00	816,000	貸付株式数	400株
電算	700	2,127.00	1,488,900		
A G S	3,300	786.00	2,593,800		
ファインデックス	4,900	722.00	3,537,800	貸付株式数	1,900株
ヒト・コミュニケーションズ	1,300	1,959.00	2,546,700		
ブレインパッド	1,300	7,370.00	9,581,000		
K L a b	10,400	1,188.00	12,355,200	貸付株式数	4,100株
ポルトゥウィン・ピットクル	3,900	2,625.00	10,237,500	貸付株式数	1,200株
イーブックイニシアティブ	900	1,757.00	1,581,300	貸付株式数	300株
ネクソン	148,900	1,342.00	199,823,800		
アイスタイル	14,900	1,163.00	17,328,700	貸付株式数	6,000株
エムアップ	2,000	2,203.00	4,406,000	貸付株式数	800株
エイチーム	3,600	1,695.00	6,102,000	貸付株式数	1,700株
テクノスジャパン	4,900	1,022.00	5,007,800	貸付株式数	2,000株
e n i s h	2,000	578.00	1,156,000		
コロプラ	16,600	855.00	14,193,000	貸付株式数	4,500株 (4,500株)
オルトプラス	3,600	422.00	1,519,200	貸付株式数	1,400株
ブロードリーフ	28,900	635.00	18,351,500	貸付株式数	11,400株
クロス・マーケティングG	1,700	432.00	734,400		
デジタルハーツHLDGS	2,600	1,670.00	4,342,000	貸付株式数	1,100株
メディアドゥHLDGS	1,800	2,771.00	4,987,800	貸付株式数	900株
じげん	6,300	669.00	4,214,700		
ブイキューブ	3,100	524.00	1,624,400		
サイバーリンクス	900	1,043.00	938,700	貸付株式数	300株
ディー・エル・イー	3,800	309.00	1,174,200	貸付株式数	1,000株
フィックスターズ	5,600	1,353.00	7,576,800	貸付株式数	2,200株
VOYAGE GROUP	3,100	1,264.00	3,918,400		
オプティム	1,300	4,775.00	6,207,500	貸付株式数	500株
セレス	1,900	2,134.00	4,054,600		
特種東海製紙	3,700	4,625.00	17,112,500		
ベリサーブ	600	5,530.00	3,318,000		
ティーガイア	5,900	2,422.00	14,289,800		
セック	900	4,390.00	3,951,000		
日本アジアグループ	6,400	368.00	2,355,200		
豆蔵ホールディングス	4,000	1,072.00	4,288,000	貸付株式数	1,700株
テクマトリックス	4,100	1,890.00	7,749,000		
プロシップ	800	2,490.00	1,992,000		

ガンホー・オンライン・エ ンター	141,300	252.00	35,607,600	貸付株式数	54,900株
GMOペイメントゲート ウェイ	9,700	6,990.00	67,803,000	貸付株式数	3,800株
ザッパラス	2,800	400.00	1,120,000		
システムリサーチ	800	3,605.00	2,884,000		
インターネットイニシア ティブ	9,600	2,792.00	26,803,200		
さくらインターネット	7,000	592.00	4,144,000	貸付株式数	1,000株
ヴィンクス	2,000	1,836.00	3,672,000	貸付株式数	700株
GMOクラウド	1,300	4,010.00	5,213,000		
S R Aホールディングス	3,100	3,040.00	9,424,000		
M I N O R I ソリュショ ンズ	1,100	1,625.00	1,787,500		
システムインテグレータ	1,600	1,003.00	1,604,800	貸付株式数	600株
朝日ネット	4,800	546.00	2,620,800		
e B A S E	1,700	1,729.00	2,939,300		
アバント	1,600	1,377.00	2,203,200		
アドソル日進	2,000	1,962.00	3,924,000		
フリービット	4,000	988.00	3,952,000		
コムチュア	3,300	3,325.00	10,972,500		
サイバーコム	1,000	1,719.00	1,719,000		
アステリア	2,900	904.00	2,621,600		
王子ホールディングス	263,000	664.00	174,632,000		
日本製紙	28,000	2,110.00	59,080,000	貸付株式数	600株
三菱製紙	9,400	586.00	5,508,400	貸付株式数	4,300株
北越コーポレーション	38,500	575.00	22,137,500	貸付株式数	1,000株
中越パルプ	2,600	1,599.00	4,157,400		
巴川製紙	1,900	1,140.00	2,166,000		
大王製紙	28,500	1,394.00	39,729,000	貸付株式数	9,200株 (6,200株)
阿波製紙	1,500	588.00	882,000	貸付株式数	500株
マークラインズ	2,000	1,524.00	3,048,000		
メディカル・データ・ビジ	5,200	1,026.00	5,335,200	貸付株式数	2,000株
g u m i	6,700	742.00	4,971,400	貸付株式数	2,600株
ショーケース・ティービー	1,200	941.00	1,129,200	貸付株式数	400株
モバイルファクトリー	1,600	1,354.00	2,166,400	貸付株式数	600株
デジタル・インフォメー ション	2,600	1,613.00	4,193,800	貸付株式数	1,000株
P C Iホールディングス	1,000	2,794.00	2,794,000		

パイプドHD	900	1,035.00	931,500		
アイビーシー	900	1,365.00	1,228,500	貸付株式数	300株
ネオジャパン	1,100	906.00	996,600	貸付株式数	400株
P R T I M E S	400	2,331.00	932,400	貸付株式数	100株
ランドコンピュータ	700	1,021.00	714,700		
オープンドア	2,900	3,325.00	9,642,500		
マイネット	1,800	1,848.00	3,326,400		
アカツキ	2,100	5,540.00	11,634,000	貸付株式数	400株
ベネフィットジャパン	300	923.00	276,900		
UBICOMホールディングス	1,100	1,149.00	1,263,900	貸付株式数	400株
L I N E	17,800	4,080.00	72,624,000	貸付株式数	7,000株 (2,100株)
カナミックネットワーク	900	1,970.00	1,773,000		
ノムラシステムコーポレーション	500	1,014.00	507,000		
レンゴー	60,400	963.00	58,165,200		
トーモク	3,500	1,885.00	6,597,500	貸付株式数	1,400株
ザ・パック	4,400	3,230.00	14,212,000		
チェンジ	400	7,420.00	2,968,000	貸付株式数	100株
シンクロ・フード	2,400	636.00	1,526,400	貸付株式数	900株
オークネット	3,000	1,120.00	3,360,000		
A O I T Y O H O L D I N G S	6,400	1,050.00	6,720,000	貸付株式数	1,000株
マクロミル	7,300	1,781.00	13,001,300	貸付株式数	2,000株
ビーグリー	1,100	1,010.00	1,111,000		
オロ	600	3,805.00	2,283,000	貸付株式数	200株
昭和電工	38,800	4,550.00	176,540,000		
住友化学	459,000	616.00	282,744,000		
住友精化	2,900	4,820.00	13,978,000		
日産化学	35,900	6,160.00	221,144,000		
ラサ工業	2,100	1,663.00	3,492,300	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,400	7,950.00	42,930,000		
多木化学	900	9,670.00	8,703,000	貸付株式数	300株
テイカ	4,800	2,040.00	9,792,000		
石原産業	11,200	1,247.00	13,966,400		
片倉コープアグリ	2,200	1,197.00	2,633,400		
日東エフシー	4,600	782.00	3,597,200		
日本曹達	9,200	2,708.00	24,913,600		
東ソー	90,000	1,600.00	144,000,000		

トクヤマ	16,800	3,110.00	52,248,000	貸付株式数	3,500株
セントラル硝子	12,700	2,798.00	35,534,600		
東亜合成	36,600	1,242.00	45,457,200		
大阪ソーダ	6,400	2,657.00	17,004,800	貸付株式数	2,600株
関東電化	13,900	944.00	13,121,600		
デンカ	22,900	3,660.00	83,814,000		
イビデン	36,600	1,579.00	57,791,400	貸付株式数	14,400株
信越化学	102,900	10,135.00	1,042,891,500	貸付株式数	40,600株
日本カ - バイド	2,000	1,937.00	3,874,000		
堺 化 学	3,900	2,778.00	10,834,200		
第一稀元素化学工	4,800	1,046.00	5,020,800		
エア・ウォーター	47,500	1,837.00	87,257,500	貸付株式数	2,000株
大陽日酸	48,200	1,912.00	92,158,400		
日本化学工業	2,000	2,748.00	5,496,000		
東邦アセチレン	1,000	1,436.00	1,436,000		
日本パ - カライジング	31,700	1,487.00	47,137,900		
高压ガス	9,600	887.00	8,515,200		
チタン工業	800	2,571.00	2,056,800		
四国化成	9,900	1,246.00	12,335,400		
戸田工業	1,300	2,455.00	3,191,500		
ステラ ケミファ	3,400	3,215.00	10,931,000	貸付株式数	900株
保土谷化学	2,000	2,589.00	5,178,000		
日本触媒	9,800	7,570.00	74,186,000	貸付株式数	2,800株
大日精化	4,900	3,320.00	16,268,000		
カネカ	15,500	4,250.00	65,875,000		
協和発酵キリン	74,600	2,327.00	173,594,200		
三菱瓦斯化学	59,700	1,864.00	111,280,800		
三井化学	52,800	2,881.00	152,116,800		
J S R	58,300	1,817.00	105,931,100		
東京応化工業	10,000	3,615.00	36,150,000		
大阪有機化学	5,400	1,395.00	7,533,000	貸付株式数	1,700株
三菱ケミカルH L D G S	389,200	928.60	361,411,120	貸付株式数	161,600株
K H ネオケム	8,900	3,045.00	27,100,500		
ダイセル	90,400	1,270.00	114,808,000		
住友ベ - クライト	10,000	4,120.00	41,200,000		
積水化学	127,500	1,842.00	234,855,000		
日本ゼオン	52,600	1,154.00	60,700,400		
アイカ工業	17,500	3,825.00	66,937,500		
宇部興産	29,300	2,587.00	75,799,100		
積水樹脂	9,700	2,236.00	21,689,200		

タキロンシーアイ	12,600	639.00	8,051,400	
旭有機材	4,000	1,851.00	7,404,000	貸付株式数 700株
日立化成	26,800	1,796.00	48,132,800	
ニチバン	3,000	2,262.00	6,786,000	
リケンテクノス	16,300	512.00	8,345,600	貸付株式数 6,400株
大倉工業	2,900	2,153.00	6,243,700	
積水化成品	8,700	1,081.00	9,404,700	
群栄化学	1,700	3,150.00	5,355,000	貸付株式数 600株
タイガース ポリマー	2,800	690.00	1,932,000	
ミライアル	1,600	972.00	1,555,200	
ダイキアクシス	2,000	1,181.00	2,362,000	
ダイキョーニシカワ	12,200	1,148.00	14,005,600	
竹本容器	1,000	2,783.00	2,783,000	
森六ホールディングス	3,200	3,015.00	9,648,000	
日本化薬	37,000	1,495.00	55,315,000	
カーリットホールディングス	6,300	922.00	5,808,600	貸付株式数 2,400株
E P Sホールディングス	8,500	2,185.00	18,572,500	
ソルクシーズ	2,400	829.00	1,989,600	
レグス	1,500	1,105.00	1,657,500	
プレステージ・インター	10,700	1,441.00	15,418,700	
フェイス	2,300	1,193.00	2,743,900	
ハイマックス	700	1,811.00	1,267,700	
アミューズ	3,400	2,737.00	9,305,800	
野村総合研究所	37,300	4,985.00	185,940,500	
ドリームインキュベータ	1,700	1,895.00	3,221,500	貸付株式数 800株
サイバネットシステム	4,800	676.00	3,244,800	貸付株式数 1,900株
クイック	3,500	1,517.00	5,309,500	
T A C	3,100	266.00	824,600	
C Eホールディングス	1,500	762.00	1,143,000	
ケネディクス	53,800	535.00	28,783,000	
日本システム技術	900	1,998.00	1,798,200	貸付株式数 300株
電通	69,500	5,060.00	351,670,000	貸付株式数 400株 (400株)
インテージホールディングス	7,400	1,019.00	7,540,600	
テイクアンドギヴニーズ	2,200	1,929.00	4,243,800	
東邦システムサイエンス	1,800	905.00	1,629,000	
ぴあ	1,600	5,110.00	8,176,000	貸付株式数 700株
イオンファンタジー	1,800	3,170.00	5,706,000	貸付株式数 700株

ソースネクスト	22,700	736.00	16,707,200	
シーティーエス	6,400	757.00	4,844,800	
ネクシィーズグループ	1,700	1,803.00	3,065,100	
メディカルシステムネット ワーク	6,200	460.00	2,852,000	
日本精化	4,900	1,108.00	5,429,200	貸付株式数 1,300株
扶桑化学工業	5,900	2,374.00	14,006,600	
トリケミカル	1,300	4,490.00	5,837,000	
F I G	5,100	405.00	2,065,500	貸付株式数 2,000株
A D E K A	28,600	1,799.00	51,451,400	
日油	22,500	3,750.00	84,375,000	
ミヨシ油脂	2,800	1,278.00	3,578,400	貸付株式数 1,000株
新日本理化	11,300	189.00	2,135,700	
ハリマ化成グループ	5,000	1,168.00	5,840,000	
花 王	144,800	8,358.00	1,210,238,400	
第一工業製薬	2,200	2,753.00	6,056,600	貸付株式数 800株
石原ケミカル	1,600	2,137.00	3,419,200	
日華化学	2,100	1,227.00	2,576,700	
ニイタカ	900	1,737.00	1,563,300	貸付株式数 300株
三洋化成	4,000	5,620.00	22,480,000	
武田薬品	235,400	4,255.00	1,001,627,000	貸付株式数 93,200株 (800株)
アステラス製薬	549,800	1,744.50	959,126,100	貸付株式数 217,600株
大日本住友製薬	44,300	3,700.00	163,910,000	
塩野義製薬	78,000	7,508.00	585,624,000	
田辺三菱製薬	62,000	1,743.00	108,066,000	
わかもと製薬	7,100	298.00	2,115,800	
あすか製薬	7,200	1,230.00	8,856,000	
日本新薬	15,600	7,760.00	121,056,000	
ビオフェルミン製薬	1,000	2,758.00	2,758,000	
中外製薬	62,200	7,770.00	483,294,000	
科研製薬	10,700	5,810.00	62,167,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
エーザイ	71,400	10,415.00	743,631,000	
理研ビタミン	2,800	3,870.00	10,836,000	
ロート製薬	30,600	3,585.00	109,701,000	
小野薬品	140,700	2,745.50	386,291,850	
久光製薬	17,600	7,250.00	127,600,000	
有機合成薬品	6,700	249.00	1,668,300	
持田製薬	4,500	10,310.00	46,395,000	

参天製薬	112,900	1,943.00	219,364,700	
扶桑薬品	2,100	2,842.00	5,968,200	
日本ケミファ	800	4,135.00	3,308,000	
ツムラ	18,400	3,515.00	64,676,000	
日医工	14,500	1,744.00	25,288,000	
テ ル モ	84,400	6,685.00	564,214,000	
みらかホールディングス	15,800	2,625.00	41,475,000	
キッセイ薬品工業	10,500	3,510.00	36,855,000	
生化学工業	11,500	1,560.00	17,940,000	
栄研化学	10,400	2,605.00	27,092,000	貸付株式数 3,800株
日水製薬	2,500	1,218.00	3,045,000	貸付株式数 200株
鳥居薬品	3,200	2,630.00	8,416,000	貸付株式数 300株
J C R ファーマ	4,200	5,810.00	24,402,000	
東和薬品	2,800	8,440.00	23,632,000	貸付株式数 1,100株
富士製薬工業	4,000	1,923.00	7,692,000	
沢井製薬	12,100	6,000.00	72,600,000	
ゼリア新薬工業	11,700	2,104.00	24,616,800	
第一三共	170,700	4,167.00	711,306,900	
キョーリン製薬HD	15,100	2,728.00	41,192,800	
大幸薬品	2,700	2,010.00	5,427,000	貸付株式数 1,000株
ダイト	3,400	3,420.00	11,628,000	
大塚ホールディングス	113,700	5,535.00	629,329,500	
大正製薬HD	13,400	13,120.00	175,808,000	
ペプチドリーム	27,400	4,650.00	127,410,000	貸付株式数 10,800株
大日本塗料	7,000	1,121.00	7,847,000	貸付株式数 2,000株
日本ペイントHOLD	48,200	4,025.00	194,005,000	貸付株式数 19,000株
関西ペイント	65,600	2,127.00	139,531,200	貸付株式数 25,900株
神東塗料	7,900	184.00	1,453,600	貸付株式数 1,000株
中国塗料	19,200	1,042.00	20,006,400	貸付株式数 2,000株
日本特殊塗料	4,300	1,772.00	7,619,600	
藤倉化成	8,700	634.00	5,515,800	
太陽ホールディングス	4,900	3,655.00	17,909,500	
D I C	26,400	3,605.00	95,172,000	
サカタインクス	12,800	1,353.00	17,318,400	貸付株式数 5,100株
東洋インキSCホールディングン	12,500	2,807.00	35,087,500	
T & K T O K A	5,000	1,205.00	6,025,000	貸付株式数 2,000株
アルプス技研	5,000	2,098.00	10,490,000	
サニックス	10,000	231.00	2,310,000	貸付株式数 2,200株
ダイオーズ	1,200	1,390.00	1,668,000	

日本空調サービス	6,300	761.00	4,794,300	貸付株式数	600株
オリエンタルランド	67,400	11,295.00	761,283,000		
フォーカスシステムズ	3,900	1,114.00	4,344,600		
ダスキン	15,200	2,617.00	39,778,400		
パーク24	34,300	3,065.00	105,129,500	貸付株式数	9,700株
明光ネットワークジャパン	7,200	1,039.00	7,480,800	貸付株式数	2,900株
ファルコホールディングス	3,100	1,666.00	5,164,600	貸付株式数	1,000株
クレスコ	1,800	3,850.00	6,930,000		
フジ・メディア・HD	60,900	1,769.00	107,732,100		
秀英予備校	1,500	496.00	744,000	貸付株式数	600株
田谷	1,400	649.00	908,600		
ラウンドワン	17,600	1,260.00	22,176,000		
リゾートトラスト	24,200	1,867.00	45,181,400	貸付株式数	3,000株
オービック	20,300	9,810.00	199,143,000		
ジャストシステム	8,300	2,551.00	21,173,300	貸付株式数	3,800株
TDCソフト	5,100	973.00	4,962,300	貸付株式数	1,000株
ヤフー	380,700	325.00	123,727,500		
ビー・エム・エル	7,300	2,885.00	21,060,500		
ワタベウェディング	1,000	1,095.00	1,095,000		
トレンドマイクロ	31,200	6,510.00	203,112,000	貸付株式数	3,900株 (3,800株)
りらいあコミュニケーション	10,200	1,061.00	10,822,200	貸付株式数	3,800株 (3,800株)
インフォメーションディベロ	1,600	1,445.00	2,312,000		
リソー教育	28,800	390.00	11,232,000		
日本オラクル	9,500	7,370.00	70,015,000	貸付株式数	2,400株
早稲田アカデミー	800	2,295.00	1,836,000		
アルファシステムズ	1,900	2,666.00	5,065,400		
フューチャー	8,000	1,753.00	14,024,000		
CAC HOLDINGS	4,400	1,074.00	4,725,600	貸付株式数	1,000株
ソフトバンク・テクノ	2,500	2,118.00	5,295,000	貸付株式数	1,000株
トーセ	1,600	938.00	1,500,800	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	69,600	2,014.00	140,174,400		
オービックビジネスC	3,000	9,940.00	29,820,000		
伊藤忠テクノソリューションズ	26,700	2,189.00	58,446,300		
アイティフォー	7,000	855.00	5,985,000	貸付株式数	2,800株
東京個別指導学院	2,000	1,333.00	2,666,000		
東計電算	900	3,395.00	3,055,500		
サイバーエージェント	35,100	5,140.00	180,414,000	貸付株式数	9,500株

楽天	265,800	914.00	242,941,200	
エックスネット	1,100	916.00	1,007,600	
クリーク・アンド・リバー社	3,300	1,186.00	3,913,800	貸付株式数 1,300株
テー・オー・ダブリュー	5,400	896.00	4,838,400	
大塚商会	31,700	3,820.00	121,094,000	
サイボウズ	6,800	700.00	4,760,000	
ソフトブレーン	4,500	528.00	2,376,000	貸付株式数 1,000株
セントラルスポーツ	2,100	3,790.00	7,959,000	
パラカ	1,500	1,936.00	2,904,000	貸付株式数 800株
電通国際情報S	3,600	3,840.00	13,824,000	貸付株式数 900株
デジタルガレージ	11,400	3,105.00	35,397,000	貸付株式数 4,500株
イーエムシステムズ	4,700	1,172.00	5,508,400	貸付株式数 1,800株
ウェザーニューズ	1,900	3,215.00	6,108,500	貸付株式数 700株 (700株)
C I J	4,500	753.00	3,388,500	貸付株式数 1,000株
東洋ビジネスエンジ	600	2,210.00	1,326,000	貸付株式数 200株
日本エンタープライズ	5,700	230.00	1,311,000	貸付株式数 2,200株
WOWOW	2,800	3,320.00	9,296,000	貸付株式数 1,200株
スカラ	4,700	843.00	3,962,100	
フルキャストホールディングス	5,700	2,311.00	13,172,700	
エン・ジャパン	6,200	4,580.00	28,396,000	貸付株式数 2,400株
富士フイルムHLDGS	123,900	4,510.00	558,789,000	
コニカミノルタ	130,300	1,022.00	133,166,600	
資生堂	118,600	7,224.00	856,766,400	貸付株式数 6,500株
ライオン	83,000	2,239.00	185,837,000	
高砂香料	4,100	3,890.00	15,949,000	
マンダム	13,400	3,330.00	44,622,000	貸付株式数 2,900株 (2,900株)
ミルボン	7,400	4,920.00	36,408,000	
ファンケル	26,600	2,962.00	78,789,200	
コーセー	10,100	16,930.00	170,993,000	
コタ	2,800	1,566.00	4,384,800	
シーズ・ホールディングス	7,400	5,860.00	43,364,000	
シーボン	700	2,712.00	1,898,400	
ポーラ・オルビスHD	25,400	3,205.00	81,407,000	
ノエビアホールディングス	3,800	5,290.00	20,102,000	
アジュバンコスメジャパン	1,300	1,027.00	1,335,100	貸付株式数 500株
エステー	4,200	2,182.00	9,164,400	

アグロカネショウ	2,400	2,468.00	5,923,200	
コニシ	10,600	1,873.00	19,853,800	
長谷川香料	7,200	1,568.00	11,289,600	貸付株式数 2,800株
星光PMC	4,300	916.00	3,938,800	
小林製薬	16,700	7,900.00	131,930,000	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
荒川化学工業	5,400	1,631.00	8,807,400	貸付株式数 200株
メック	4,100	1,340.00	5,494,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	2,000	2,387.00	4,774,000	
タカラバイオ	15,600	2,838.00	44,272,800	
JCU	7,700	1,848.00	14,229,600	
新田ゼラチン	3,700	747.00	2,763,900	貸付株式数 2,000株
OATアグリオ	800	2,239.00	1,791,200	
デクセリアルズ	15,400	991.00	15,261,400	貸付株式数 300株
アース製薬	4,500	5,590.00	25,155,000	貸付株式数 200株
北興化学	6,500	558.00	3,627,000	
大成ラミック	1,900	3,090.00	5,871,000	
クミアイ化学	24,600	726.00	17,859,600	
日本農薬	14,600	558.00	8,146,800	
昭和シエル石油	55,400	1,759.00	97,448,600	
富士興産	2,200	629.00	1,383,800	
ニチレキ	7,500	1,144.00	8,580,000	貸付株式数 1,000株
ユシロ化学	3,000	1,356.00	4,068,000	貸付株式数 1,900株
ビーピー・カストロール	2,100	1,505.00	3,160,500	貸付株式数 800株
富士石油	14,100	340.00	4,794,000	
MORESCO	2,400	1,664.00	3,993,600	
出光興産	46,200	4,130.00	190,806,000	貸付株式数 18,100株 (18,100株)
JXTGホールディングス	1,008,300	686.30	691,996,290	
コスモエネルギーHLDGS	17,200	2,649.00	45,562,800	貸付株式数 6,800株 (4,500株)
横浜ゴム	34,600	2,376.00	82,209,600	
東洋ゴム	30,600	1,793.00	54,865,800	
ブリヂストン	183,400	4,600.00	843,640,000	
住友ゴム	53,600	1,517.00	81,311,200	貸付株式数 3,800株
藤倉ゴム	4,900	512.00	2,508,800	貸付株式数 1,000株
オカモト	4,200	5,970.00	25,074,000	
アキレス	4,200	2,256.00	9,475,200	
フコク	2,500	931.00	2,327,500	

ニッタ	6,700	3,910.00	26,197,000	貸付株式数	1,500株
クリエートメディック	1,800	1,101.00	1,981,800		
住友理工	11,700	1,112.00	13,010,400	貸付株式数	2,500株
三ツ星ベルト	7,800	2,461.00	19,195,800	貸付株式数	3,000株
バンドー化学	11,400	1,233.00	14,056,200		
A G C	59,700	3,855.00	230,143,500		
日本板硝子	28,300	968.00	27,394,400		
石塚硝子	800	2,149.00	1,719,200	貸付株式数	300株
有沢製作所	9,300	821.00	7,635,300	貸付株式数	2,300株
日本山村硝子	2,300	1,782.00	4,098,600		
日本電気硝子	25,800	3,050.00	78,690,000		
オハラ	2,400	2,389.00	5,733,600	貸付株式数	900株
住友大阪セメント	12,000	5,100.00	61,200,000	貸付株式数	300株
太平洋セメント	37,700	3,840.00	144,768,000		
リソルホールディングス	600	4,035.00	2,421,000		
日本ヒユ - ム	5,900	960.00	5,664,000		
日本コンクリート	12,700	308.00	3,911,600		
三谷セキサン	2,800	2,841.00	7,954,800		
アジアパイルHD	8,300	694.00	5,760,200	貸付株式数	2,900株
東海カーボン	54,100	1,576.00	85,261,600	貸付株式数	21,400株
日本カーボン	2,800	5,420.00	15,176,000	貸付株式数	1,100株
東洋炭素	3,500	2,737.00	9,579,500		
ノリタケ	3,600	5,630.00	20,268,000		
T O T O	45,900	4,395.00	201,730,500	貸付株式数	18,100株
日本碍子	72,500	1,683.00	122,017,500		
日本特殊陶業	50,400	2,332.00	117,532,800		
ダントーホールディングス	5,600	127.00	711,200		
M A R U W A	2,000	6,420.00	12,840,000		
品川リフラクトリーズ	1,600	4,305.00	6,888,000		
黒崎播磨	1,200	6,750.00	8,100,000	貸付株式数	400株 (400株)
ヨータイ	5,100	686.00	3,498,600	貸付株式数	1,900株
イソライト	3,000	547.00	1,641,000		
東京窯業	7,500	466.00	3,495,000	貸付株式数	1,000株
ニッカトー	2,700	1,079.00	2,913,300		
フジインコーポレーテッド	5,300	2,436.00	12,910,800		
クニミネ工業	2,000	983.00	1,966,000		
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,143.00	1,257,300		
ニチアス	16,300	2,203.00	35,908,900		

新日鐵住金	263,900	2,076.00	547,856,400	
神戸製鋼所	108,100	934.00	100,965,400	
中山製鋼所	7,700	585.00	4,504,500	
合同製鐵	2,800	1,946.00	5,448,800	
J F E ホールディングス	159,200	2,001.50	318,638,800	
日新製鋼	14,400	1,465.00	21,096,000	
東京製鐵	31,500	978.00	30,807,000	
共英製鋼	6,700	2,200.00	14,740,000	貸付株式数 2,600株
大和工業	12,500	2,968.00	37,100,000	
東京鐵鋼	2,300	1,371.00	3,153,300	貸付株式数 600株
大阪製鐵	4,000	2,001.00	8,004,000	
淀川製鋼所	7,900	2,429.00	19,189,100	貸付株式数 2,000株
丸一鋼管	20,900	3,370.00	70,433,000	
モリ工業	1,700	2,716.00	4,617,200	
大同特殊鋼	9,600	4,595.00	44,112,000	
日本高周波	2,000	686.00	1,372,000	
日本冶金工	48,700	282.00	13,733,400	貸付株式数 19,900株
山陽特殊製鋼	7,400	2,580.00	19,092,000	
愛知製鋼	3,300	3,995.00	13,183,500	
日立金属	63,600	1,278.00	81,280,800	貸付株式数 3,000株
日本金属	1,400	1,397.00	1,955,800	
大平洋金属	4,000	3,320.00	13,280,000	貸付株式数 1,400株
新日本電工	35,000	268.00	9,380,000	貸付株式数 13,900株
栗本鉄工所	2,900	1,645.00	4,770,500	
虹 技	700	1,601.00	1,120,700	
日本鑄鉄管	500	1,274.00	637,000	貸付株式数 200株
日本製鋼所	17,900	2,074.00	37,124,600	
三菱製鋼	4,300	2,029.00	8,724,700	
日亜鋼業	8,400	337.00	2,830,800	
日本精線	800	3,510.00	2,808,000	貸付株式数 200株
エンビプロHD	1,200	582.00	698,400	
大紀アルミニウム	9,600	651.00	6,249,600	貸付株式数 4,600株
日本軽金属HD	159,700	254.00	40,563,800	
三井金属	15,900	2,593.00	41,228,700	
東邦亜鉛	3,200	3,830.00	12,256,000	
三菱マテリアル	39,000	3,185.00	124,215,000	
住友鉱山	80,800	3,305.00	267,044,000	
DOWAホールディングス	13,800	3,740.00	51,612,000	貸付株式数 4,700株
古河機金	9,700	1,439.00	13,958,300	貸付株式数 3,900株
エス・サイエンス	26,400	69.00	1,821,600	

大阪チタニウム	6,900	2,119.00	14,621,100	貸付株式数 2,500株 (1,800株)
東邦チタニウム	10,600	1,395.00	14,787,000	
U A C J	8,900	2,377.00	21,155,300	貸付株式数 3,400株
C Kサンエツ	1,100	2,760.00	3,036,000	
古河電工	17,000	3,315.00	56,355,000	
住友電工	220,500	1,592.50	351,146,250	
フジクラ	70,700	493.00	34,855,100	
昭和電線H L D G S	6,800	697.00	4,739,600	貸付株式数 3,000株
東京特殊電線	700	1,961.00	1,372,700	
タツタ電線	11,600	537.00	6,229,200	
カナレ電気	1,000	2,028.00	2,028,000	
平河ヒューテック	2,400	1,324.00	3,177,600	
リョービ	7,200	3,095.00	22,284,000	貸付株式数 500株
アールステイ	7,200	730.00	5,256,000	
アサヒHD	11,000	2,351.00	25,861,000	
東洋製罐グループHD	37,800	2,585.00	97,713,000	
ホッカンホールディングス	2,900	1,717.00	4,979,300	
コロナ	3,200	1,141.00	3,651,200	
横河ブリッジH L D G S	10,900	1,860.00	20,274,000	貸付株式数 3,000株
O S J B HD	29,000	338.00	9,802,000	
駒井ハルテック	1,100	2,177.00	2,394,700	
高田機工	500	2,751.00	1,375,500	
三和ホールディングス	60,900	1,378.00	83,920,200	
文化シャッター -	17,200	784.00	13,484,800	
三協立山	8,200	1,317.00	10,799,400	
アルインコ	4,700	1,099.00	5,165,300	貸付株式数 1,000株
東洋シャッター -	1,400	681.00	953,400	
L I X I Lグループ	87,000	1,471.00	127,977,000	
日本ファイルコン	4,400	592.00	2,604,800	貸付株式数 2,100株
ノーリツ	13,200	1,688.00	22,281,600	
長府製作所	6,000	2,388.00	14,328,000	
リンナイ	10,500	8,140.00	85,470,000	
ユニプレス	11,500	2,138.00	24,587,000	
ダイニチ工業	3,100	745.00	2,309,500	
日東精工	8,000	643.00	5,144,000	
三洋工業	700	2,047.00	1,432,900	
岡 部	11,800	990.00	11,682,000	
ジーテクト	6,400	1,591.00	10,182,400	貸付株式数 2,500株
中国工業	900	595.00	535,500	

東 プ レ	10,900	2,312.00	25,200,800	
高周波熱錬	11,300	1,024.00	11,571,200	貸付株式数 1,700株
東京製綱	3,600	1,153.00	4,150,800	貸付株式数 1,400株
サンコール	3,200	722.00	2,310,400	
モリテックスチル	4,500	476.00	2,142,000	
パイオラックス	9,500	2,780.00	26,410,000	貸付株式数 500株
エイチワン	5,800	1,100.00	6,380,000	
日本発条	58,700	1,010.00	59,287,000	
中央発條	600	3,470.00	2,082,000	
アドバネクス	700	1,588.00	1,111,600	
三浦工業	25,600	3,025.00	77,440,000	
タ ク マ	21,600	1,595.00	34,452,000	
テクノプロ・ホールディング グ	10,700	5,680.00	60,776,000	
アトラ	1,200	505.00	606,000	貸付株式数 400株
インターワークス	1,100	759.00	834,900	
アイ・アールジャパンHD	1,800	1,456.00	2,620,800	貸付株式数 700株
K e e P e r 技研	1,900	1,117.00	2,122,300	
ファーストロジック	1,100	875.00	962,500	
三機サービス	900	1,862.00	1,675,800	
G u n o s y	3,500	3,380.00	11,830,000	
デザインワン・ジャパン	1,200	436.00	523,200	
イー・ガーディアン	2,700	2,675.00	7,222,500	貸付株式数 1,000株
リブセンス	3,100	339.00	1,050,900	
ジャパンマテリアル	15,600	1,314.00	20,498,400	貸付株式数 2,400株
ベクトル	6,900	1,840.00	12,696,000	貸付株式数 2,700株
ウチヤマホールディングス	3,000	488.00	1,464,000	
ライクキッズネクスト	1,200	1,194.00	1,432,800	
キャリアリンク	2,100	444.00	932,400	
I B J	3,800	809.00	3,074,200	貸付株式数 1,500株
アサンテ	2,200	2,278.00	5,011,600	貸付株式数 800株
N・フィールド	3,600	1,154.00	4,154,400	貸付株式数 1,200株 (100株)
バリューHR	1,200	2,074.00	2,488,800	
M&Aキャピタルパート ナー	1,400	4,265.00	5,971,000	貸付株式数 600株
ライドオンエクスプレスH D	2,400	1,572.00	3,772,800	
E R Iホールディングス	1,600	925.00	1,480,000	
アビスト	900	3,530.00	3,177,000	

シグマクシス	2,700	1,076.00	2,905,200	
ウィルグループ	3,700	1,181.00	4,369,700	
エスクローAJ	7,700	465.00	3,580,500	貸付株式数 3,200株
日本ビューホテル	1,800	1,199.00	2,158,200	
リクルートホールディングス	408,400	3,123.00	1,275,433,200	
エラン	2,000	3,000.00	6,000,000	貸付株式数 700株
ツガミ	13,100	852.00	11,161,200	
オークマ	7,500	5,650.00	42,375,000	貸付株式数 2,900株
東芝機械	6,600	1,984.00	13,094,400	
アマダホールディングス	91,300	1,232.00	112,481,600	
アイダエンジニア	16,200	909.00	14,725,800	
滝澤鉄工所	1,700	1,615.00	2,745,500	
FUJII	17,600	1,493.00	26,276,800	
牧野フライス	6,900	4,605.00	31,774,500	
オーエスジー	29,000	2,279.00	66,091,000	
ダイジェット	600	1,860.00	1,116,000	
旭ダイヤモンド	15,300	702.00	10,740,600	
DMG森精機	37,200	1,590.00	59,148,000	貸付株式数 13,800株
ソディック	12,800	838.00	10,726,400	貸付株式数 5,100株
ディスコ	8,000	16,550.00	132,400,000	
日東工器	3,300	2,510.00	8,283,000	
日進工具	1,700	2,651.00	4,506,700	貸付株式数 100株
パンチ工業	4,100	622.00	2,550,200	
富士ダイス	2,500	785.00	1,962,500	
土木管理総合試験	2,500	608.00	1,520,000	貸付株式数 900株
日本郵政	464,000	1,382.00	641,248,000	貸付株式数 184,800株
ベルシステム24HLDGS	9,600	1,507.00	14,467,200	
鎌倉新書	4,200	1,254.00	5,266,800	
一蔵	700	713.00	499,100	
LITALICO	1,300	1,910.00	2,483,000	貸付株式数 500株
グローバルグループ	700	1,182.00	827,400	
エポラブルアジア	1,600	2,259.00	3,614,400	
アトラエ	1,100	2,400.00	2,640,000	
ストライク	1,400	2,929.00	4,100,600	貸付株式数 500株
ソラスト	13,900	1,436.00	19,960,400	
セラク	1,300	717.00	932,100	
インソース	1,900	2,471.00	4,694,900	貸付株式数 700株
豊田自動織機	48,300	5,820.00	281,106,000	

豊和工業	3,200	864.00	2,764,800	貸付株式数 900株 (900株)
OKK	2,300	909.00	2,090,700	
石川製作所	1,400	1,498.00	2,097,200	貸付株式数 400株
東洋機械金属	4,200	604.00	2,536,800	
津田駒工業	1,200	2,216.00	2,659,200	
エンシュウ	1,500	1,323.00	1,984,500	貸付株式数 600株
島精機製作所	8,100	3,515.00	28,471,500	貸付株式数 3,200株 (100株)
オプトラン	5,800	2,459.00	14,262,200	貸付株式数 2,200株
NCホールディングス	1,800	574.00	1,033,200	
フリー	4,700	1,025.00	4,817,500	
ヤマシンフィルタ	10,300	905.00	9,321,500	貸付株式数 4,000株 (1,700株)
日阪製作所	7,200	953.00	6,861,600	
やまびこ	11,300	1,298.00	14,667,400	
平田機工	2,800	6,040.00	16,912,000	貸付株式数 1,100株
ペガサスミシン製造	5,500	831.00	4,570,500	
タツモ	1,800	898.00	1,616,400	貸付株式数 700株
ナプテスコ	32,500	3,140.00	102,050,000	
三井海洋開発	6,300	2,825.00	17,797,500	
レオン自動機	5,800	1,822.00	10,567,600	貸付株式数 2,200株
SMC	17,500	38,480.00	673,400,000	
新川	4,400	513.00	2,257,200	
ホソカワミクロン	2,000	5,170.00	10,340,000	
ユニオンツール	2,600	3,630.00	9,438,000	
オイレス工業	8,300	1,997.00	16,575,100	貸付株式数 200株
日精エーエスビー	1,700	4,065.00	6,910,500	貸付株式数 700株
サト - ホールディングス	7,100	2,995.00	21,264,500	
技研製作所	4,100	4,140.00	16,974,000	貸付株式数 800株
日本エアーテック	1,800	691.00	1,243,800	
カワタ	1,200	1,756.00	2,107,200	貸付株式数 400株
日精樹脂工業	4,800	1,021.00	4,900,800	
オカダアイヨン	2,000	1,718.00	3,436,000	
ワイエイシイホールディングス	2,300	739.00	1,699,700	貸付株式数 900株
小松製作所	270,100	3,033.00	819,213,300	貸付株式数 106,800株 (102,200株)
住友重機械	34,100	3,765.00	128,386,500	
日立建機	23,900	3,135.00	74,926,500	

日 工	1,600	2,505.00	4,008,000	
巴工業	2,400	2,366.00	5,678,400	
井関農機	5,900	1,847.00	10,897,300	
TOWA	5,000	741.00	3,705,000	貸付株式数 1,400株
丸山製作所	1,200	1,638.00	1,965,600	
北川鉄工所	2,600	2,573.00	6,689,800	
シンニッタン	9,100	413.00	3,758,300	
ローツエ	2,600	1,859.00	4,833,400	貸付株式数 1,300株
タカキタ	2,000	667.00	1,334,000	
クボタ	320,100	1,937.00	620,033,700	貸付株式数 37,700株
荏原実業	1,600	2,005.00	3,208,000	
東洋エンジニア	7,700	874.00	6,729,800	貸付株式数 3,500株 (1,300株)
三菱化工機	1,900	1,731.00	3,288,900	貸付株式数 100株
月島機械	11,800	1,330.00	15,694,000	
帝国電機製作所	4,200	1,656.00	6,955,200	
東京機械	2,400	441.00	1,058,400	
新東工業	14,100	980.00	13,818,000	
渋谷工業	5,300	4,135.00	21,915,500	
アイチ コーポレーション	10,000	657.00	6,570,000	貸付株式数 3,800株
小森コーポレーション	16,400	1,252.00	20,532,800	
鶴見製作所	4,700	1,988.00	9,343,600	貸付株式数 1,000株
住友精密	900	3,515.00	3,163,500	
酒井重工業	1,100	2,694.00	2,963,400	
荏原製作所	26,400	2,944.00	77,721,600	
石井鉄工所	1,100	1,884.00	2,072,400	
西島製作所	5,900	1,042.00	6,147,800	貸付株式数 1,000株
北越工業	6,100	1,262.00	7,698,200	貸付株式数 2,000株
千代田化工建	47,600	322.00	15,327,200	貸付株式数 19,000株
ダイキン工業	81,200	12,610.00	1,023,932,000	貸付株式数 32,100株
オルガノ	2,100	3,140.00	6,594,000	
ト - ヨ - カネツ	2,200	2,414.00	5,310,800	
栗田工業	32,200	3,045.00	98,049,000	
椿本チエイン	7,800	4,245.00	33,111,000	
大同工業	2,700	1,076.00	2,905,200	
日 機 装	19,400	1,132.00	21,960,800	
木村化工機	4,700	450.00	2,115,000	貸付株式数 1,000株
新興プランテック	12,100	1,154.00	13,963,400	
アネスト岩田	9,400	1,232.00	11,580,800	貸付株式数 1,800株
ダイフク	32,800	5,810.00	190,568,000	貸付株式数 13,000株

サムコ	1,600	1,310.00	2,096,000		
加藤製作所	3,000	3,035.00	9,105,000		
油研工業	1,000	2,045.00	2,045,000		
タダノ	28,800	1,361.00	39,196,800	貸付株式数	11,300株
フジテック	21,700	1,394.00	30,249,800	貸付株式数	3,800株
C K D	16,500	1,141.00	18,826,500	貸付株式数	6,600株
キトー	4,500	1,871.00	8,419,500		
平和	16,700	2,418.00	40,380,600		
理想科学工業	5,200	1,938.00	10,077,600		
SANKYO	15,100	4,540.00	68,554,000		
日本金銭機械	6,500	1,128.00	7,332,000	貸付株式数	1,800株
マースグループHLDGS	3,700	2,344.00	8,672,800	貸付株式数	600株
福島工業	3,800	4,375.00	16,625,000		
オーイズミ	2,800	519.00	1,453,200		
ダイコク電機	2,700	1,701.00	4,592,700		
竹内製作所	9,900	2,285.00	22,621,500		
アマノ	17,000	2,448.00	41,616,000		
JUKI	8,300	1,515.00	12,574,500		
サンデンホールディングス	7,200	880.00	6,336,000		
蛇の目ミシン	5,300	567.00	3,005,100	貸付株式数	1,000株
ブラザー工業	77,700	1,897.00	147,396,900		
マックス	9,100	1,492.00	13,577,200		
モリタホールディングス	10,400	2,238.00	23,275,200		
グローリー	16,400	2,871.00	47,084,400		
新晃工業	5,700	1,650.00	9,405,000		
大和冷機工業	9,100	1,314.00	11,957,400		
セガサミーホールディングス	59,200	1,602.00	94,838,400		
日本ピストンリング	2,100	2,086.00	4,380,600		
リケン	2,800	5,660.00	15,848,000		
TPR	8,000	2,699.00	21,592,000		
ツバキ・ナカシマ	8,900	1,933.00	17,203,700	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,400	8,810.00	153,294,000		
大豊工業	4,800	1,115.00	5,352,000		
日本精工	122,300	1,067.00	130,494,100		
NTN	128,100	381.00	48,806,100		
ジェイテクト	57,200	1,444.00	82,596,800		
不二越	5,500	4,850.00	26,675,000	貸付株式数	2,200株
ミネベアミツミ	110,700	1,842.00	203,909,400		

日本トムソン	17,600	628.00	11,052,800	貸付株式数	7,800株
T H K	37,000	2,601.00	96,237,000		
ユーシン精機	4,700	1,174.00	5,517,800		
前澤給装工業	2,300	1,933.00	4,445,900		
イーグル工業	7,200	1,489.00	10,720,800	貸付株式数	2,300株
前澤工業	4,200	386.00	1,621,200	貸付株式数	1,600株
日本ピラ - 工業	6,000	1,538.00	9,228,000		
キッツ	24,200	972.00	23,522,400		
日立	268,000	3,288.00	881,184,000	貸付株式数	106,000株
三菱電機	595,400	1,498.00	891,909,200	貸付株式数	235,200株
富士電機	38,400	3,565.00	136,896,000		
東洋電機製造	2,700	1,534.00	4,141,800	貸付株式数	600株
安川電機	69,200	3,540.00	244,968,000	貸付株式数	300株
シンフォニア テクノロ ジー	8,300	1,689.00	14,018,700		
明電舎	12,200	1,606.00	19,593,200		
オリジン電気	1,600	1,932.00	3,091,200		
山洋電気	2,800	4,360.00	12,208,000		
デンヨー	6,000	1,604.00	9,624,000		
アイモバイル	1,300	701.00	911,300		
キャリアインデックス	2,000	2,117.00	4,234,000		
MS - J a p a n	2,300	1,562.00	3,592,600	貸付株式数	900株
船場	900	967.00	870,300		
グレイステクノロジー	1,500	2,151.00	3,226,500	貸付株式数	600株
ジャパンエレベーターSH D	3,400	2,125.00	7,225,000		
フルテック	700	1,172.00	820,400	貸付株式数	200株
グリーンズ	1,200	1,542.00	1,850,400		
ツナグ・ソリューションズ	500	732.00	366,000	貸付株式数	200株
日総工産	1,400	1,965.00	2,751,000	貸付株式数	500株 (500株)
キュービーネットHLDG S	2,900	2,219.00	6,435,100		
三桜工業	7,500	648.00	4,860,000		
マキタ	72,600	4,455.00	323,433,000		
東芝テック	7,400	3,065.00	22,681,000	貸付株式数	2,900株
芝浦メカトロニクス	1,000	4,060.00	4,060,000		
マブチモーター	16,400	3,955.00	64,862,000	貸付株式数	6,500株
日本電産	71,800	15,120.00	1,085,616,000	貸付株式数	28,400株

ユーエムシーエレクトロニクス	3,200	2,491.00	7,971,200	
トレックス・セミコンダクター	2,000	1,559.00	3,118,000	
東光高岳	3,500	1,582.00	5,537,000	貸付株式数 1,000株
ダブル・スコープ	8,700	1,379.00	11,997,300	貸付株式数 3,600株 (900株)
宮越ホールディングス	2,500	1,138.00	2,845,000	貸付株式数 900株
ダイヘン	6,800	2,775.00	18,870,000	
ヤーマン	8,700	1,871.00	16,277,700	
JVCケンウッド	43,800	288.00	12,614,400	貸付株式数 12,800株
ミマキエンジニアリング	5,300	929.00	4,923,700	
第一精工	2,500	1,384.00	3,460,000	貸付株式数 1,000株
日新電機	14,200	951.00	13,504,200	
大崎電気	12,900	813.00	10,487,700	
オムロン	63,400	4,990.00	316,366,000	
日東工業	10,000	1,928.00	19,280,000	
I D E C	8,000	2,517.00	20,136,000	
不二電機工業	600	1,373.00	823,800	
ジーエス・ユアサ コーポ	21,500	2,623.00	56,394,500	
サクサホールディングス	1,400	2,017.00	2,823,800	
メルコホールディングス	2,500	3,890.00	9,725,000	貸付株式数 800株
テクノメディカ	1,300	2,191.00	2,848,300	
日本電気	77,300	3,520.00	272,096,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
富士通	57,500	6,987.00	401,752,500	
沖電気	25,800	1,500.00	38,700,000	
岩崎通信機	2,800	755.00	2,114,000	
電気興業	3,100	2,960.00	9,176,000	貸付株式数 1,000株
サンケン電気	6,900	2,419.00	16,691,100	
ナカヨ	1,100	1,529.00	1,681,900	
アイホン	3,300	1,717.00	5,666,100	貸付株式数 1,400株
ルネサスエレクトロニクス	62,000	535.00	33,170,000	
セイコーエプソン	74,000	1,804.00	133,496,000	
ワコム	43,400	574.00	24,911,600	貸付株式数 17,000株
アルバック	13,700	4,170.00	57,129,000	
アクセル	2,400	586.00	1,406,400	
E I Z O	5,400	4,750.00	25,650,000	貸付株式数 2,100株
ジャパンディスプレイ	139,100	70.00	9,737,000	貸付株式数 55,600株
日本信号	16,100	1,012.00	16,293,200	貸付株式数 3,000株

京三製作所	14,000	505.00	7,070,000	貸付株式数	2,000株
能美防災	8,200	2,254.00	18,482,800		
ホーチキ	4,100	1,313.00	5,383,300	貸付株式数	1,800株
星和電機	3,000	460.00	1,380,000	貸付株式数	1,000株
エレコム	5,500	3,005.00	16,527,500	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
パナソニック	680,500	1,164.50	792,442,250		
シャープ	59,100	1,684.00	99,524,400		
アンリツ	38,500	1,861.00	71,648,500	貸付株式数	5,600株
富士通ゼネラル	18,100	1,603.00	29,014,300	貸付株式数	7,100株
ソニー	399,700	5,937.00	2,373,018,900		
T D K	31,200	8,950.00	279,240,000	貸付株式数	10,000株
帝国通信工業	2,500	1,219.00	3,047,500		
タムラ製作所	23,000	656.00	15,088,000	貸付株式数	9,000株
アルプス電気	55,000	2,631.00	144,705,000		
池上通信機	1,800	1,431.00	2,575,800	貸付株式数	900株
パイオニア	98,800	92.00	9,089,600	貸付株式数	40,000株
日本電波工業	5,400	491.00	2,651,400	貸付株式数	2,600株
鈴木	2,800	716.00	2,004,800		
日本トリム	1,100	6,200.00	6,820,000	貸付株式数	400株 (200株)
ローランド ディー・ ジー	3,000	2,461.00	7,383,000	貸付株式数	300株
フオスタ - 電機	7,000	1,547.00	10,829,000		
クラリオン	7,000	2,490.00	17,430,000		
S M K	1,600	2,552.00	4,083,200		
ヨコオ	4,200	1,729.00	7,261,800	貸付株式数	1,200株
ティアック	4,200	262.00	1,100,400	貸付株式数	1,600株
ホシデン	17,400	880.00	15,312,000		
ヒロセ電機	8,600	11,970.00	102,942,000		
日本航空電子	13,600	1,430.00	19,448,000		
T O A	6,900	1,228.00	8,473,200		
マクセルホールディングス	12,700	1,592.00	20,218,400	貸付株式数	5,000株
古野電気	7,700	1,292.00	9,948,400	貸付株式数	2,900株
ユニデンホールディングス	1,700	2,521.00	4,285,700		
アルパイン	10,300	1,839.00	18,941,700		
スミダコーポレーション	5,100	1,520.00	7,752,000	貸付株式数	1,800株 (1,700株)
アイコム	3,200	2,352.00	7,526,400		
リオン	2,700	2,032.00	5,486,400		

本多通信工業	5,000	629.00	3,145,000	
船井電機	6,100	747.00	4,556,700	貸付株式数 4,000株 (1,800株)
横河電機	59,700	2,086.00	124,534,200	
新電元工業	2,100	4,675.00	9,817,500	
アズビル	38,900	2,450.00	95,305,000	
東亜ディーケーケー	2,900	958.00	2,778,200	
日本光電工業	26,400	3,695.00	97,548,000	
チノール	2,000	1,481.00	2,962,000	
共和電業	5,700	421.00	2,399,700	
日本電子材料	2,300	735.00	1,690,500	
堀場製作所	11,800	5,320.00	62,776,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
アドバンテスト	40,600	2,436.00	98,901,600	貸付株式数 16,100株
小野測器	2,600	705.00	1,833,000	
エスベック	5,200	2,107.00	10,956,400	
キーエンス	29,300	61,600.00	1,804,880,000	
日置電機	3,100	4,240.00	13,144,000	
シスメックス	46,400	6,049.00	280,673,600	
日本マイクロニクス	9,700	981.00	9,515,700	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
メガチップス	4,700	2,749.00	12,920,300	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,500	4,860.00	17,010,000	
IMAGICA GROUP	4,900	607.00	2,974,300	貸付株式数 1,900株
澤藤電機	700	1,953.00	1,367,100	
デンソー	131,400	5,247.00	689,455,800	
原田工業	1,900	934.00	1,774,600	貸付株式数 600株
コーセル	8,200	1,160.00	9,512,000	貸付株式数 3,200株
イリソ電子工業	5,400	4,975.00	26,865,000	貸付株式数 1,300株
オプテックスグループ	10,500	2,304.00	24,192,000	貸付株式数 4,200株
千代田インテグレ	2,600	2,440.00	6,344,000	
アイ・オー・データ	2,400	1,181.00	2,834,400	
レーザーテック	12,300	3,655.00	44,956,500	
スタンレー電気	42,100	3,305.00	139,140,500	
岩崎電気	3,200	1,524.00	4,876,800	
ウシオ電機	36,100	1,272.00	45,919,200	
岡谷電機	4,300	439.00	1,887,700	
ヘリオステクノH	5,500	786.00	4,323,000	

日本セラミック	6,100	2,860.00	17,446,000	
遠藤照明	4,100	798.00	3,271,800	
古河電池	5,000	829.00	4,145,000	貸付株式数 1,700株 (1,000株)
双信電機	2,800	443.00	1,240,400	
山一電機	4,300	1,535.00	6,600,500	貸付株式数 1,900株
図 研	3,900	1,766.00	6,887,400	
日本電子	11,900	1,987.00	23,645,300	
カ シ オ	52,700	1,583.00	83,424,100	
ファナック	56,700	19,390.00	1,099,413,000	貸付株式数 22,400株
日本シイエムケイ	15,200	900.00	13,680,000	貸付株式数 3,100株
エンプラス	2,700	3,135.00	8,464,500	貸付株式数 700株 (700株)
大真空	2,200	1,036.00	2,279,200	
ロ ー ム	28,800	7,900.00	227,520,000	貸付株式数 10,400株
浜松ホトニクス	42,800	3,950.00	169,060,000	貸付株式数 15,000株
三井ハイテック	6,600	1,285.00	8,481,000	貸付株式数 2,600株 (500株)
新光電気工業	20,100	803.00	16,140,300	
京 セ ラ	90,900	6,125.00	556,762,500	
協栄産業	700	1,738.00	1,216,600	
太陽誘電	26,500	2,153.00	57,054,500	貸付株式数 10,400株
村田製作所	62,600	17,315.00	1,083,919,000	貸付株式数 24,700株 (4,800株)
ユーシン	9,200	985.00	9,062,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
双葉電子工業	9,800	1,779.00	17,434,200	
日東電工	45,000	6,203.00	279,135,000	
北陸電気工業	2,100	1,076.00	2,259,600	貸付株式数 600株
東海理化電機	15,700	2,085.00	32,734,500	
ニチコン	18,800	902.00	16,957,600	
日本ケミコン	4,200	2,343.00	9,840,600	
K O A	8,900	1,527.00	13,590,300	
三井E & S H D	21,300	1,231.00	26,220,300	
日立造船	46,700	390.00	18,213,000	貸付株式数 18,600株
三菱重工業	99,800	4,317.00	430,836,600	貸付株式数 38,400株
川崎重工業	46,400	2,643.00	122,635,200	
I H I	45,800	3,455.00	158,239,000	
名村造船所	17,900	559.00	10,006,100	
サノヤスホールディングス	7,800	215.00	1,677,000	貸付株式数 2,900株

スプリックス	1,600	1,947.00	3,115,200		
日本車輛	2,200	2,646.00	5,821,200	貸付株式数	800株
三菱ロジスネクスト	7,200	1,310.00	9,432,000		
近畿車輛	800	2,395.00	1,916,000		
F P G	18,700	1,230.00	23,001,000	貸付株式数	7,400株
島根銀行	1,400	859.00	1,202,600		
じもとホールディングス	39,600	150.00	5,940,000		
全国保証	16,500	3,880.00	64,020,000	貸付株式数	6,500株
めぶきフィナンシャルG	305,700	343.00	104,855,100	貸付株式数	7,000株
東京きらぼしF G	8,000	2,099.00	16,792,000		
九州フィナンシャルG	97,200	531.00	51,613,200		
かんぼ生命保険	22,000	2,865.00	63,030,000	貸付株式数	4,600株
ゆうちょ銀行	168,000	1,326.00	222,768,000	貸付株式数	65,800株
富山第一銀行	13,700	433.00	5,932,100	貸付株式数	4,400株
コンコルディア・フィナンシャル	375,300	533.00	200,034,900		
ジェイリース	1,200	480.00	576,000		
西日本フィナンシャルHD	37,800	1,232.00	46,569,600		
マーキュリアインベストメント	2,300	864.00	1,987,200	貸付株式数	900株
イントラスト	1,700	430.00	731,000	貸付株式数	600株
日本モーゲージサービス	800	1,003.00	802,400		
C a s a	1,800	1,170.00	2,106,000		
アルヒ	5,300	1,797.00	9,524,100	貸付株式数	2,700株
日産自動車	703,600	994.30	699,589,480		
いすゞ自動車	188,600	1,616.00	304,777,600		
トヨタ自動車	664,800	6,803.00	4,522,634,400		
日野自動車	74,400	1,160.00	86,304,000		
三菱自動車工業	220,600	696.00	153,537,600		
エフテック	4,100	1,113.00	4,563,300		
レシップホールディングス	4,000	723.00	2,892,000		
G M B	1,100	1,174.00	1,291,400		
ファルテック	1,000	969.00	969,000		
武蔵精密工業	14,000	1,796.00	25,144,000		
日産車体	11,800	943.00	11,127,400	貸付株式数	2,100株
新明和工業	27,900	1,527.00	42,603,300	貸付株式数	300株
極東開発工業	11,900	1,646.00	19,587,400		
日信工業	11,000	1,504.00	16,544,000		
トピー工業	4,900	2,678.00	13,122,200		
ティラド	2,100	2,557.00	5,369,700		

曙ブレーキ	32,900	218.00	7,172,200	貸付株式数 13,300株 (100株)
タチエス	10,100	1,599.00	16,149,900	
N O K	31,900	1,710.00	54,549,000	貸付株式数 12,600株
フタバ産業	16,500	612.00	10,098,000	貸付株式数 7,000株
K Y B	6,200	2,827.00	17,527,400	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
市光工業	8,900	744.00	6,621,600	貸付株式数 3,700株
大同メタル工業	9,700	950.00	9,215,000	
プレス工業	29,600	613.00	18,144,800	
ミクニ	7,500	588.00	4,410,000	貸付株式数 1,000株
太平洋工業	12,600	1,703.00	21,457,800	
ケーヒン	13,700	1,964.00	26,906,800	
河西工業	7,200	997.00	7,178,400	
アイシン精機	49,100	4,490.00	220,459,000	貸付株式数 19,000株
マ ッ ダ	186,900	1,210.00	226,149,000	
今仙電機製作所	5,400	1,060.00	5,724,000	
本田技研	503,200	3,202.00	1,611,246,400	
スズキ	109,100	5,655.00	616,960,500	貸付株式数 45,900株
S U B A R U	185,100	2,523.00	467,007,300	
安永	2,900	1,914.00	5,550,600	貸付株式数 1,300株
ヤマハ発動機	84,100	2,335.00	196,373,500	貸付株式数 32,500株
ショーワ	14,100	1,518.00	21,403,800	
小糸製作所	35,800	6,090.00	218,022,000	
T B K	7,000	448.00	3,136,000	貸付株式数 1,000株
エクセディ	8,000	2,914.00	23,312,000	
ミツバ	11,000	747.00	8,217,000	
豊田合成	19,300	2,185.00	42,170,500	
愛三工業	9,200	831.00	7,645,200	
盟和産業	1,000	1,082.00	1,082,000	
日本プラスト	4,600	923.00	4,245,800	
ヨ ロ ズ	5,500	1,494.00	8,217,000	
エフ・シー・シー	10,700	2,951.00	31,575,700	
新家工業	1,300	1,827.00	2,375,100	
シマノ	24,000	16,580.00	397,920,000	
テイ・エス テック	13,800	3,290.00	45,402,000	
関西みらいF G	27,700	915.00	25,345,500	
3 3 F G	5,100	1,919.00	9,786,900	
第四北越フィナンシャルG	10,200	3,700.00	37,740,000	

ジャムコ	3,000	3,205.00	9,615,000	貸付株式数 1,100株 (900株)
小野建	5,100	1,678.00	8,557,800	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
はるやまHLDGS	2,700	896.00	2,419,200	
ノジマ	10,400	2,605.00	27,092,000	
佐鳥電機	4,400	1,051.00	4,624,400	貸付株式数 1,000株
カップ・クリエイト	8,400	1,500.00	12,600,000	
エコトレーディング	1,500	633.00	949,500	
伯東	3,900	1,339.00	5,222,100	
コンドーテック	4,400	1,033.00	4,545,200	貸付株式数 1,000株
中山福	3,400	551.00	1,873,400	
ライトオン	5,000	944.00	4,720,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,500	2,775.00	23,587,500	
ジーンズメイト	1,800	483.00	869,400	
三菱食品	6,400	3,065.00	19,616,000	
良品計画	8,300	30,550.00	253,565,000	貸付株式数 3,200株
三城ホールディングス	7,500	494.00	3,705,000	
松田産業	4,500	1,492.00	6,714,000	
第一興商	8,700	5,180.00	45,066,000	
メディパルHD	63,300	2,600.00	164,580,000	
アドヴァン	9,000	1,099.00	9,891,000	貸付株式数 600株 (600株)
SPK	1,200	2,390.00	2,868,000	
萩原電気HLDGS	2,100	3,205.00	6,730,500	
アルビス	2,200	2,866.00	6,305,200	貸付株式数 900株
アズワン	4,200	8,380.00	35,196,000	
スズデン	1,900	1,287.00	2,445,300	
尾家産業	1,800	1,336.00	2,404,800	
シモジマ	3,500	1,128.00	3,948,000	
ドウシシャ	5,600	2,104.00	11,782,400	貸付株式数 2,000株
小津産業	1,200	1,969.00	2,362,800	
コナカ	7,700	497.00	3,826,900	
高速	3,400	1,209.00	4,110,600	
ハウスローゼ	700	1,907.00	1,334,900	
G-7ホールディングス	1,700	2,636.00	4,481,200	貸付株式数 600株
たけびし	2,700	1,478.00	3,990,600	
イオン北海道	6,000	812.00	4,872,000	
コジマ	8,800	518.00	4,558,400	

ヒマラヤ	1,700	1,039.00	1,766,300	貸付株式数	600株
コーナン商事	7,700	2,800.00	21,560,000		
ネットワンシステムズ	20,800	2,347.00	48,817,600	貸付株式数	7,300株 (7,300株)
エコス	2,200	2,087.00	4,591,400		
ワタミ	7,700	1,422.00	10,949,400	貸付株式数	3,200株
マルシェ	1,300	795.00	1,033,500		
リックス	1,300	1,580.00	2,054,000		
システムソフト	13,500	114.00	1,539,000	貸付株式数	5,400株
ドンキホーテホールディング グ	38,100	6,890.00	262,509,000	貸付株式数	15,000株 (15,000株)
丸文	5,100	847.00	4,319,700		
西松屋チェーン	12,900	997.00	12,861,300		
ゼンショーホールディング ス	27,800	2,826.00	78,562,800		
ハピネット	4,800	1,615.00	7,752,000		
幸楽苑ホールディングス	3,700	2,241.00	8,291,700	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,200	1,094.00	1,312,800		
橋本総業HLDGS	1,000	1,460.00	1,460,000		
日本ライフライン	18,400	1,798.00	33,083,200	貸付株式数	7,200株
サイゼリヤ	9,600	2,170.00	20,832,000	貸付株式数	3,800株
タカショー	2,800	478.00	1,338,400		
エクセル	2,200	2,009.00	4,419,800	貸付株式数	1,300株
V Tホールディングス	19,600	469.00	9,192,400		
マルカキカイ	1,900	2,244.00	4,263,600	貸付株式数	700株
アルゴグラフィックス	2,500	4,540.00	11,350,000		
魚力	1,600	1,441.00	2,305,600		
IDOM	19,800	570.00	11,286,000	貸付株式数	7,800株
日本エム・ディ・エム	3,400	1,389.00	4,722,600		
ポプラ	1,400	610.00	854,000	貸付株式数	500株
フジ・コーポレーション	1,200	1,995.00	2,394,000		
ユナイテッドアローズ	6,700	3,825.00	25,627,500	貸付株式数	1,900株 (1,900株)
進和	3,500	2,430.00	8,505,000	貸付株式数	1,000株
エスケイジャパン	1,400	891.00	1,247,400	貸付株式数	500株
ダイトロン	2,700	1,540.00	4,158,000		
ハイデイ日高	7,600	2,357.00	17,913,200		
シークス	7,400	1,808.00	13,379,200	貸付株式数	2,900株
京都きもの友禅	4,000	449.00	1,796,000		

コロワイド	19,500	2,642.00	51,519,000	
ピーシーデポコーポ	7,700	554.00	4,265,800	貸付株式数 700株 (500株)
田中商事	1,800	627.00	1,128,600	
オーハシテクニカ	3,200	1,398.00	4,473,600	
壱番屋	4,100	4,765.00	19,536,500	貸付株式数 1,700株
白銅	1,800	1,772.00	3,189,600	
トップカルチャー	2,200	383.00	842,600	貸付株式数 800株
P L A N T	1,400	1,095.00	1,533,000	貸付株式数 500株
スギホールディングス	12,800	5,340.00	68,352,000	
島津製作所	76,800	2,654.00	203,827,200	
J M S	5,100	595.00	3,034,500	貸付株式数 1,000株
クボテック	1,200	342.00	410,400	
長野計器	4,600	957.00	4,402,200	
ブイ・テクノロジー	1,400	15,930.00	22,302,000	貸付株式数 500株
スター精密	10,200	1,692.00	17,258,400	
東京計器	3,700	1,109.00	4,103,300	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
愛知時計	800	4,045.00	3,236,000	
インターアクション	3,200	2,580.00	8,256,000	
オーバル	5,500	284.00	1,562,000	貸付株式数 1,000株
東京精密	10,800	3,380.00	36,504,000	
マニー	7,200	5,340.00	38,448,000	
ニコン	104,000	1,780.00	185,120,000	
トプコン	32,000	1,751.00	56,032,000	
オリンパス	88,900	3,195.00	284,035,500	
理研計器	5,200	2,376.00	12,355,200	
S C R E E Nホールディングス	10,300	5,680.00	58,504,000	
キヤノン電子	5,500	2,143.00	11,786,500	
タムロン	5,200	1,828.00	9,505,600	貸付株式数 300株
HOYA	120,100	6,900.00	828,690,000	貸付株式数 47,500株
シード	2,500	1,584.00	3,960,000	
ノーリツ鋼機	4,700	1,955.00	9,188,500	
エー・アンド・デイ	5,400	833.00	4,498,200	貸付株式数 1,000株
朝日インテック	21,600	5,320.00	114,912,000	
キヤノン	321,000	3,220.00	1,033,620,000	
リコー	179,600	1,102.00	197,919,200	
シチズン時計	65,000	600.00	39,000,000	
リズム時計	1,900	2,045.00	3,885,500	

大研医器	4,600	765.00	3,519,000	
メニコン	8,100	2,993.00	24,243,300	
シンシア	900	639.00	575,100	
中本パックス	1,600	1,847.00	2,955,200	
スノーピーク	2,200	1,387.00	3,051,400	
パラマウントベッドHD	6,800	4,795.00	32,606,000	
トランザクション	3,200	827.00	2,646,400	
SHOBI	1,700	398.00	676,600	
ニホンフラッシュ	2,500	2,080.00	5,200,000	
前田工織	6,600	2,606.00	17,199,600	貸付株式数 600株
永大産業	7,600	449.00	3,412,400	貸付株式数 1,000株
アートネイチャー	6,400	682.00	4,364,800	貸付株式数 2,000株
バンダイナムコHLDGS	61,700	4,770.00	294,309,000	
アイフィスジャパン	1,300	663.00	861,900	貸付株式数 100株
共立印刷	10,200	248.00	2,529,600	
SHOEI	2,900	4,435.00	12,861,500	貸付株式数 1,200株
フランスベッドHLDGS	8,200	969.00	7,945,800	
マーベラス	8,800	917.00	8,069,600	貸付株式数 3,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,400	5,870.00	61,048,000	
萩原工業	3,200	1,710.00	5,472,000	
エイベックス	9,900	1,545.00	15,295,500	貸付株式数 3,900株
トッパン・フォームズ	12,700	1,041.00	13,220,700	
フジシールインターナショナル	13,300	4,090.00	54,397,000	
タカラトミー	24,900	1,416.00	35,258,400	貸付株式数 9,800株
廣濟堂	5,500	428.00	2,354,000	貸付株式数 1,000株
エステールホールディングス	1,500	700.00	1,050,000	
アーク	23,500	100.00	2,350,000	
レック	6,400	2,058.00	13,171,200	貸付株式数 2,500株
タカノ	2,200	889.00	1,955,800	
三光合成	4,600	390.00	1,794,000	
プロネクサス	5,000	1,147.00	5,735,000	
ホクシン	3,700	160.00	592,000	
ウッドワン	2,000	1,172.00	2,344,000	貸付株式数 800株
大建工業	4,500	2,116.00	9,522,000	
きもと	10,000	219.00	2,190,000	
凸版印刷	84,200	1,828.00	153,917,600	

大日本印刷	84,000	2,626.00	220,584,000	
図書印刷	5,600	830.00	4,648,000	
共同印刷	1,800	2,651.00	4,771,800	
N I S S H A	12,200	1,781.00	21,728,200	貸付株式数 4,800株 (2,700株)
光村印刷	500	2,305.00	1,152,500	
藤森工業	5,300	3,240.00	17,172,000	
ヴィア・ホールディングス	7,200	731.00	5,263,200	貸付株式数 3,700株
宝印刷	3,100	1,841.00	5,707,100	
前澤化成工業	4,000	1,134.00	4,536,000	
アシックス	59,200	1,636.00	96,851,200	
ツ ツ ミ	1,900	2,174.00	4,130,600	貸付株式数 700株
ウェーブロックHLDGS	1,400	876.00	1,226,400	
ジェイ エス ピー	3,500	2,418.00	8,463,000	貸付株式数 1,000株
ニ チ ハ	8,300	3,105.00	25,771,500	
エフピコ	4,900	6,930.00	33,957,000	貸付株式数 1,900株
小松ウオール工業	1,800	2,095.00	3,771,000	
ヤマハ	35,500	4,890.00	173,595,000	
河合楽器	1,800	4,030.00	7,254,000	貸付株式数 100株
クリナップ	5,500	725.00	3,987,500	貸付株式数 2,200株
ビジョン	36,000	4,675.00	168,300,000	
天馬	4,100	2,087.00	8,556,700	貸付株式数 2,000株
兼松サステック	400	1,761.00	704,400	
キングジム	4,700	914.00	4,295,800	
象印マホービン	11,100	1,171.00	12,998,100	貸付株式数 4,400株
リンテック	14,100	2,570.00	36,237,000	
信越ポリマー	10,600	830.00	8,798,000	
東 リ	14,600	297.00	4,336,200	貸付株式数 1,000株
イトーキ	10,800	617.00	6,663,600	
任 天 堂	36,700	34,610.00	1,270,187,000	
三菱鉛筆	9,800	2,177.00	21,334,600	
松 風	2,700	1,233.00	3,329,100	
タカラスタンダ - ド	12,400	1,778.00	22,047,200	
コ ク ヨ	28,500	1,749.00	49,846,500	
ナカバヤシ	5,700	591.00	3,368,700	
ニ フ コ	23,900	2,895.00	69,190,500	
立川ブラインド	2,600	1,217.00	3,164,200	貸付株式数 400株
グローブライド	2,900	2,889.00	8,378,100	貸付株式数 1,100株
オカムラ	20,900	1,637.00	34,213,300	貸付株式数 8,100株
バルカー	4,800	2,753.00	13,214,400	

MUTOHホールディングス	700	2,278.00	1,594,600	
伊藤忠	410,600	2,016.00	827,769,600	貸付株式数 169,800株
丸紅	578,600	847.50	490,363,500	
スクロール	9,000	454.00	4,086,000	貸付株式数 3,600株
高島	900	2,032.00	1,828,800	
ヨンドシーホールディングス	6,400	2,465.00	15,776,000	
三陽商会	3,600	2,054.00	7,394,400	貸付株式数 1,200株
長瀬産業	32,800	1,697.00	55,661,600	
ナイガイ	2,000	495.00	990,000	
蝶理	3,800	1,894.00	7,197,200	
豊田通商	65,500	3,920.00	256,760,000	
オンワードホールディングス	35,600	677.00	24,101,200	
三共生興	10,200	457.00	4,661,400	貸付株式数 1,000株
兼松	23,300	1,448.00	33,738,400	
美津濃	5,800	2,582.00	14,975,600	
ツカモトコーポレーション	1,000	1,178.00	1,178,000	
ユニー・ファミリーマートHD	16,400	16,110.00	264,204,000	貸付株式数 6,400株
ルックホールディングス	2,100	1,171.00	2,459,100	
三井物産	483,800	1,774.50	858,503,100	貸付株式数 190,700株
日本紙パルプ	3,300	4,485.00	14,800,500	
東京エレクトロン	39,800	15,875.00	631,825,000	
日立ハイテクノロジーズ	17,900	4,045.00	72,405,500	
カメイ	7,600	1,385.00	10,526,000	
東都水産	800	2,012.00	1,609,600	
OUGホールディングス	900	2,651.00	2,385,900	
スターゼン	2,100	4,390.00	9,219,000	貸付株式数 1,000株
セイコーHD	9,200	2,520.00	23,184,000	
山善	23,000	1,203.00	27,669,000	貸付株式数 1,000株
椿本興業	1,300	3,370.00	4,381,000	貸付株式数 500株
住友商事	347,000	1,743.50	604,994,500	
日本ユニシス	18,400	2,895.00	53,268,000	
内田洋行	2,600	2,701.00	7,022,600	貸付株式数 1,300株
三菱商事	412,300	3,062.00	1,262,462,600	貸付株式数 162,300株
第一実業	2,700	4,010.00	10,827,000	
キヤノンマーケティングJPN	16,800	2,178.00	36,590,400	

西華産業	3,300	1,647.00	5,435,100	貸付株式数	1,000株
佐藤商事	5,000	996.00	4,980,000		
菱洋エレクトロ	6,000	1,798.00	10,788,000		
東京産業	6,300	595.00	3,748,500	貸付株式数	1,000株
ユアサ商事	6,000	3,805.00	22,830,000		
神鋼商事	1,300	2,758.00	3,585,400		
小林産業	3,100	305.00	945,500		
阪和興業	10,100	3,400.00	34,340,000		
正栄食品	3,100	4,840.00	15,004,000		
カナデン	5,800	1,309.00	7,592,200		
菱電商事	4,900	1,600.00	7,840,000		
ニプロ	41,200	1,543.00	63,571,600		
フルサト工業	3,100	1,916.00	5,939,600		
岩谷産業	13,000	3,780.00	49,140,000	貸付株式数	5,200株
すてきナイスグループ	2,400	1,133.00	2,719,200	貸付株式数	600株
昭光通商	2,300	803.00	1,846,900	貸付株式数	900株
ニチモウ	1,300	1,845.00	2,398,500		
極東貿易	1,900	1,767.00	3,357,300		
イワキ	7,000	528.00	3,696,000	貸付株式数	2,800株
兼松エレクトロニクス	3,200	3,640.00	11,648,000	貸付株式数	1,000株
三愛石油	15,600	1,298.00	20,248,800		
稲畑産業	14,200	1,628.00	23,117,600		
G S Iクレオス	1,600	1,488.00	2,380,800		
明和産業	6,200	442.00	2,740,400	貸付株式数	1,000株
ゴ-ルドウイン	5,300	11,770.00	62,381,000	貸付株式数	2,000株 (1,400株)
ユニ・チャ-ム	126,500	3,554.00	449,581,000	貸付株式数	300株 (300株)
デサント	14,300	2,223.00	31,788,900	貸付株式数	5,600株
キング	3,000	500.00	1,500,000		
ワキタ	12,500	1,305.00	16,312,500		
ヤマトインタ-ナショナル	3,700	457.00	1,690,900		
東邦ホールディングス	17,300	3,015.00	52,159,500	貸付株式数	6,800株
サンゲツ	17,700	2,172.00	38,444,400		
ミツウロコグループ	8,300	710.00	5,893,000		
シナネンホールディングス	2,400	2,749.00	6,597,600		
伊藤忠エネクス	12,900	1,067.00	13,764,300		
サンリオ	18,200	2,346.00	42,697,200	貸付株式数	4,600株
サンワテクノス	3,500	1,247.00	4,364,500	貸付株式数	1,000株
リョ-サン	6,500	3,310.00	21,515,000	貸付株式数	100株

新光商事	5,600	1,757.00	9,839,200	
トーヨー	2,600	2,395.00	6,227,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
三信電気	5,000	2,019.00	10,095,000	貸付株式数 2,000株
東陽テクニカ	6,500	908.00	5,902,000	
モスフード サービス	7,600	3,065.00	23,294,000	貸付株式数 2,800株
加賀電子	5,800	2,404.00	13,943,200	
三益半導体	4,500	1,545.00	6,952,500	
ソーダニツカ	6,600	632.00	4,171,200	貸付株式数 1,000株
立花エレテック	4,200	1,769.00	7,429,800	
木曽路	7,100	2,618.00	18,587,800	
S R Sホールディングス	6,700	1,032.00	6,914,400	貸付株式数 2,000株
千趣会	11,100	318.00	3,529,800	貸付株式数 4,600株
タカキュー	4,800	197.00	945,600	
ケーヨー	10,700	609.00	6,516,300	
上新電機	6,900	2,892.00	19,954,800	
日本瓦斯	10,700	4,040.00	43,228,000	
ロイヤルホールディングス	10,300	2,859.00	29,447,700	
東天紅	500	1,465.00	732,500	貸付株式数 200株
いなげや	6,700	1,582.00	10,599,400	貸付株式数 2,500株
島忠	13,300	3,065.00	40,764,500	
チヨダ	6,100	2,049.00	12,498,900	貸付株式数 2,000株
ライフコーポレーション	4,400	2,708.00	11,915,200	
リンガーハット	7,200	2,477.00	17,834,400	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
MrMaxHD	8,100	544.00	4,406,400	
テナライド	5,200	415.00	2,158,000	
AOKIホールディングス	11,700	1,465.00	17,140,500	
オークワ	8,300	1,248.00	10,358,400	貸付株式数 2,000株
コメリ	9,000	2,717.00	24,453,000	
青山商事	11,300	2,848.00	32,182,400	
しまむら	6,800	9,640.00	65,552,000	貸付株式数 2,700株
はせがわ	2,900	465.00	1,348,500	
高島屋	45,900	1,650.00	75,735,000	貸付株式数 18,200株
松屋	11,900	1,414.00	16,826,600	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	30,100	1,947.00	58,604,700	
近鉄百貨店	2,300	3,730.00	8,579,000	
パルコ	5,700	1,310.00	7,467,000	
丸井グループ	49,800	2,447.00	121,860,600	貸付株式数 8,600株

クレディセゾン	40,900	1,457.00	59,591,300	
アクシアル リテイリング	4,800	4,035.00	19,368,000	
井筒屋	3,300	239.00	788,700	貸付株式数 1,300株
イオン	226,300	2,721.00	615,762,300	貸付株式数 89,400株
イズミ	11,900	6,430.00	76,517,000	
フォーバル	2,600	1,009.00	2,623,400	
平和堂	11,900	3,150.00	37,485,000	
フジ	7,000	2,139.00	14,973,000	
ヤオコー	6,700	6,790.00	45,493,000	
ゼビオホールディングス	7,100	1,473.00	10,458,300	貸付株式数 1,000株
ケースホールディングス	61,000	1,197.00	73,017,000	貸付株式数 13,000株 (13,000株)
PALTAC	10,600	6,080.00	64,448,000	貸付株式数 4,200株
三谷産業	7,900	314.00	2,480,600	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
OLYMPICグループ	3,500	865.00	3,027,500	
日産東京販売HD	8,500	347.00	2,949,500	
新生銀行	42,900	1,558.00	66,838,200	貸付株式数 400株
あおぞら銀行	32,700	3,730.00	121,971,000	
三菱UFJフィナンシャルG	4,095,000	624.50	2,557,327,500	
りそなホールディングス	643,500	601.90	387,322,650	
三井住友トラストHD	115,600	4,552.00	526,211,200	
三井住友フィナンシャルG	414,400	4,183.00	1,733,435,200	
千葉銀行	208,400	745.00	155,258,000	
群馬銀行	116,800	541.00	63,188,800	
武蔵野銀行	8,700	3,070.00	26,709,000	
千葉興業銀行	15,900	445.00	7,075,500	
筑波銀行	24,000	242.00	5,808,000	貸付株式数 10,000株
七十七銀行	18,400	2,273.00	41,823,200	
青森銀行	4,500	3,125.00	14,062,500	貸付株式数 1,700株
秋田銀行	3,700	2,332.00	8,628,400	
山形銀行	6,600	2,387.00	15,754,200	貸付株式数 2,600株 (1,600株)
岩手銀行	4,100	4,140.00	16,974,000	貸付株式数 300株
東邦銀行	52,600	376.00	19,777,600	貸付株式数 4,900株
東北銀行	3,000	1,345.00	4,035,000	貸付株式数 1,000株
みちのく銀行	3,800	1,817.00	6,904,600	
ふくおかフィナンシャルG	47,800	2,589.00	123,754,200	
静岡銀行	148,300	1,019.00	151,117,700	

十六銀行	7,800	2,696.00	21,028,800	
スルガ銀行	59,500	538.00	32,011,000	貸付株式数 23,800株 (7,000株)
八十二銀行	106,400	521.00	55,434,400	
山梨中央銀行	7,300	1,663.00	12,139,900	
大垣共立銀行	9,200	2,490.00	22,908,000	
福井銀行	4,900	1,926.00	9,437,400	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
北國銀行	6,200	4,250.00	26,350,000	
清水銀行	2,400	1,901.00	4,562,400	貸付株式数 300株 (300株)
富山銀行	1,100	3,780.00	4,158,000	貸付株式数 400株
滋賀銀行	11,700	2,848.00	33,321,600	貸付株式数 4,600株
南都銀行	6,800	2,574.00	17,503,200	
百五銀行	52,900	450.00	23,805,000	
京都銀行	21,100	5,460.00	115,206,000	
紀陽銀行	20,800	1,808.00	37,606,400	貸付株式数 8,200株
ほくほくフィナンシャルG	38,900	1,484.00	57,727,600	
広島銀行	86,200	684.00	58,960,800	貸付株式数 25,000株
山陰合同銀行	34,900	895.00	31,235,500	
中国銀行	37,600	1,057.00	39,743,200	
鳥取銀行	2,000	1,553.00	3,106,000	
伊予銀行	77,400	697.00	53,947,800	
百十四銀行	6,200	2,883.00	17,874,600	
四国銀行	8,400	1,399.00	11,751,600	貸付株式数 2,000株
阿波銀行	9,400	3,280.00	30,832,000	貸付株式数 1,100株
大分銀行	3,600	3,820.00	13,752,000	貸付株式数 1,400株
宮崎銀行	3,900	3,285.00	12,811,500	
佐賀銀行	3,500	2,065.00	7,227,500	貸付株式数 1,300株
十八銀行	3,700	2,853.00	10,556,100	
沖縄銀行	5,300	3,735.00	19,795,500	貸付株式数 200株
琉球銀行	13,400	1,298.00	17,393,200	貸付株式数 4,700株
セブン銀行	198,600	352.00	69,907,200	貸付株式数 78,100株
みずほフィナンシャルG	7,992,900	188.30	1,505,063,070	貸付株式数 1,400,000株
高知銀行	2,000	909.00	1,818,000	
山口フィナンシャルG	73,300	1,176.00	86,200,800	
アクリーティブ	900	412.00	370,800	
芙蓉総合リース	6,700	6,880.00	46,096,000	
興銀リース	11,000	2,800.00	30,800,000	
東京センチュリー	11,900	5,420.00	64,498,000	

SBIホールディングス	70,100	2,576.00	180,577,600	貸付株式数	1,800株
日本証券金融	26,000	660.00	17,160,000		
アイフル	89,800	311.00	27,927,800	貸付株式数	35,500株 (300株)
日本アジア投資	5,000	255.00	1,275,000	貸付株式数	1,000株
長野銀行	2,000	1,651.00	3,302,000		
名古屋銀行	4,700	3,670.00	17,249,000	貸付株式数	1,200株
北洋銀行	88,000	329.00	28,952,000		
愛知銀行	2,100	4,390.00	9,219,000		
中京銀行	2,400	2,355.00	5,652,000		
大光銀行	2,000	2,125.00	4,250,000		
愛媛銀行	8,100	1,155.00	9,355,500	貸付株式数	3,600株
トマト銀行	2,300	1,303.00	2,996,900		
京葉銀行	25,900	800.00	20,720,000		
栃木銀行	29,900	295.00	8,820,500		
北日本銀行	1,800	2,484.00	4,471,200		
東和銀行	10,300	934.00	9,620,200		
福島銀行	5,100	564.00	2,876,400	貸付株式数	3,000株
大東銀行	2,900	837.00	2,427,300		
リコーリース	4,600	3,695.00	16,997,000		
イオンフィナンシャルサー ビス	37,600	2,200.00	82,720,000		
アコム	118,700	417.00	49,497,900		
ジャックス	6,500	2,058.00	13,377,000	貸付株式数	2,500株
オリコ	163,600	176.00	28,793,600	貸付株式数	46,100株
日立キャピタル	14,000	2,805.00	39,270,000		
アプラスフィナンシャル	31,700	103.00	3,265,100	貸付株式数	16,300株
オリックス	391,800	1,839.50	720,716,100		
三菱UFJリース	133,000	619.00	82,327,000		
ジャフコ	9,600	4,150.00	39,840,000	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
九州リースサービス	3,000	704.00	2,112,000		
トモニホールディングス	45,100	473.00	21,332,300		
大和証券G本社	471,900	626.50	295,645,350		
野村ホールディングス	1,079,200	511.40	551,902,880	貸付株式数	427,200株
岡三証券グループ	49,900	558.00	27,844,200	貸付株式数	18,000株
丸三証券	17,800	894.00	15,913,200	貸付株式数	6,900株
東洋証券	21,300	205.00	4,366,500		
東海東京HD	70,100	555.00	38,905,500		
光世証券	1,400	1,012.00	1,416,800		

水戸証券	17,100	307.00	5,249,700	貸付株式数	400株
いちよし証券	12,300	957.00	11,771,100		
松井証券	29,000	1,286.00	37,294,000		
S O M P Oホールディングス	114,500	4,386.00	502,197,000		
だいこう証券ビジ	2,400	491.00	1,178,400		
日本取引所グループ	159,100	2,045.00	325,359,500		
マネックスG	55,400	420.00	23,268,000	貸付株式数	21,800株 (5,100株)
カブドットコム証券	43,900	419.00	18,394,100		
極東証券	7,800	1,312.00	10,233,600	貸付株式数	3,200株
岩井コスモホールディング	6,000	1,411.00	8,466,000	貸付株式数	2,400株
藍澤証券	11,000	765.00	8,415,000	貸付株式数	1,000株
フィデアホール	56,200	155.00	8,711,000		
池田泉州HD	61,600	338.00	20,820,800	貸付株式数	4,100株
アニコムホールディングス	4,500	3,765.00	16,942,500	貸付株式数	500株
M S & A D	152,700	3,445.00	526,051,500		
S O N Y F H	48,000	2,380.00	114,240,000		
マネーパートナーズGP	6,800	340.00	2,312,000		
小林洋行	2,000	283.00	566,000	貸付株式数	800株
第一生命HLDGS	330,600	1,978.00	653,926,800		
東京海上HD	211,800	5,605.00	1,187,139,000	貸付株式数	84,400株
アドバンテッジリスクマネ	2,200	1,224.00	2,692,800	貸付株式数	800株
イー・ギャランティ	5,500	1,120.00	6,160,000	貸付株式数	3,300株
アサックス	2,600	608.00	1,580,800		
NECキャピタルソリューション	2,500	1,686.00	4,215,000		
T & Dホールディングス	180,800	1,613.00	291,630,400		
アドバンスクリエイト	1,300	2,057.00	2,674,100		
三井不動産	313,300	2,715.00	850,609,500		
三菱地所	414,300	1,821.00	754,440,300		
平和不動産	11,700	1,941.00	22,709,700		
東京建物	65,300	1,294.00	84,498,200	貸付株式数	8,700株
ダイビル	18,200	1,242.00	22,604,400		
京阪神ビルディング	11,700	912.00	10,670,400	貸付株式数	2,000株
住友不動産	133,100	4,208.00	560,084,800		
太平洋興発	2,300	887.00	2,040,100		
大京	9,000	2,969.00	26,721,000		
テーオーシー	14,300	851.00	12,169,300		

東京楽天地	900	4,845.00	4,360,500		
レオパレス21	73,700	493.00	36,334,100	貸付株式数	26,400株
スターツコーポレーション	8,400	2,654.00	22,293,600	貸付株式数	3,100株
フジ住宅	8,500	907.00	7,709,500	貸付株式数	1,000株
空港施設	8,100	599.00	4,851,900		
明和地所	4,200	627.00	2,633,400		
ゴールドクレスト	4,900	1,764.00	8,643,600		
リログループ	31,500	3,120.00	98,280,000	貸付株式数	7,900株 (7,900株)
日本エスリード	2,400	1,621.00	3,890,400		
日神不動産	9,000	513.00	4,617,000		
日本エスコ	10,900	737.00	8,033,300	貸付株式数	4,600株
タカラレーベン	27,900	343.00	9,569,700	貸付株式数	11,200株
サンヨーハウジング名古屋	4,000	1,044.00	4,176,000		
イオンモール	30,200	2,041.00	61,638,200		
ファースト住建	2,600	1,215.00	3,159,000	貸付株式数	900株
ランド	258,500	10.00	2,585,000		
カチタス	6,600	3,265.00	21,549,000	貸付株式数	3,100株
東祥	3,600	4,230.00	15,228,000	貸付株式数	1,400株
トーセイ	8,400	1,029.00	8,643,600		
穴吹興産	900	3,040.00	2,736,000	貸付株式数	300株
エヌ・ティ・ティ都市開発	9,500	1,679.00	15,950,500	貸付株式数	9,500株 (9,500株)
サンフロンティア不動産	8,400	1,202.00	10,096,800	貸付株式数	2,800株
インテリックス	2,000	764.00	1,528,000		
ランドビジネス	4,200	584.00	2,452,800		
グランディハウス	6,100	404.00	2,464,400	貸付株式数	1,000株
東武鉄道	63,000	3,250.00	204,750,000		
相鉄ホールディングス	20,700	3,450.00	71,415,000		
東京急行	162,300	1,976.00	320,704,800		
京浜急行	81,800	1,811.00	148,139,800	貸付株式数	25,500株
小田急電鉄	95,800	2,545.00	243,811,000	貸付株式数	12,400株
京王電鉄	33,400	6,280.00	209,752,000		
京成電鉄	44,700	3,680.00	164,496,000		
富士急行	8,200	3,220.00	26,404,000	貸付株式数	3,000株 (2,200株)
新京成電鉄	1,500	2,122.00	3,183,000		
東日本旅客鉄道	106,100	10,320.00	1,094,952,000	貸付株式数	41,900株
西日本旅客鉄道	53,500	7,909.00	423,131,500		
東海旅客鉄道	53,400	23,325.00	1,245,555,000	貸付株式数	21,100株

西武ホールディングス	76,100	2,098.00	159,657,800	
鴻池運輸	9,400	1,783.00	16,760,200	
西日本鉄道	16,700	2,958.00	49,398,600	貸付株式数 3,000株
ハマキョウレックス	4,600	4,205.00	19,343,000	
サカイ引越センター	3,100	6,430.00	19,933,000	貸付株式数 1,200株 (800株)
近鉄グループHLDGS	56,600	4,730.00	267,718,000	
阪急阪神HLDGS	75,500	3,850.00	290,675,000	
南海電鉄	25,300	3,035.00	76,785,500	
京阪ホールディングス	25,400	4,740.00	120,396,000	
神戸電鉄	1,400	4,000.00	5,600,000	
名古屋鉄道	45,400	2,845.00	129,163,000	
山陽電鉄	4,300	2,363.00	10,160,900	
トランコム	1,600	6,520.00	10,432,000	貸付株式数 200株
日本通運	22,200	6,840.00	151,848,000	
ヤマトホールディングス	99,100	2,998.50	297,151,350	
山 九	15,700	5,320.00	83,524,000	
日 新	4,800	1,956.00	9,388,800	
丸 運	3,200	319.00	1,020,800	
丸全昭和運輸	4,500	3,115.00	14,017,500	
センコーグループHLDGS	31,000	884.00	27,404,000	貸付株式数 1,100株
トナミホールディングス	1,400	6,520.00	9,128,000	貸付株式数 500株
ニッコンホールディングス	21,400	2,907.00	62,209,800	
日石輸送	700	2,887.00	2,020,900	
福山通運	7,300	4,980.00	36,354,000	
セイノーホールディングス	42,300	1,685.00	71,275,500	
エスライン	1,600	1,164.00	1,862,400	
神奈川中央交通	1,400	3,905.00	5,467,000	
日立物流	12,500	3,070.00	38,375,000	
丸和運輸機関	3,000	3,355.00	10,065,000	貸付株式数 800株 (800株)
C & F ロジホールディングス	5,700	1,300.00	7,410,000	
日本郵船	47,400	1,927.00	91,339,800	
商船三井	33,600	2,669.00	89,678,400	
川崎汽船	17,400	1,631.00	28,379,400	貸付株式数 6,900株
NSユニテッド海運	3,200	3,060.00	9,792,000	
明治海運	5,900	379.00	2,236,100	貸付株式数 1,000株
飯野海運	27,500	451.00	12,402,500	

共栄タンカー	400	1,829.00	731,600	
九州旅客鉄道	47,300	3,750.00	177,375,000	
S Gホールディングス	53,400	2,779.00	148,398,600	
日本航空	103,300	4,094.00	422,910,200	
A N Aホールディングス	103,100	4,051.00	417,658,100	
パスコ	1,100	1,069.00	1,175,900	
西本W I S M E T T A C H D	1,300	5,180.00	6,734,000	
ヤマシタヘルスケアH L D G S	400	1,259.00	503,600	
G E N K Y D R U G S T O R E S	2,300	3,705.00	8,521,500	貸付株式数 300株
国際紙パルプ商事	10,600	320.00	3,392,000	貸付株式数 1,000株
総合メディカルH D	5,100	2,665.00	13,591,500	
ブックオフG H D	3,000	783.00	2,349,000	
三菱倉庫	19,800	2,804.00	55,519,200	貸付株式数 6,000株
三井倉庫H O L D	6,900	2,005.00	13,834,500	
住友倉庫	21,500	1,457.00	31,325,500	
渋沢倉庫	3,100	1,662.00	5,152,200	
ヤマタネ	2,900	1,959.00	5,681,100	貸付株式数 1,200株
東陽倉庫	9,900	314.00	3,108,600	貸付株式数 1,000株
乾汽船	5,200	1,027.00	5,340,400	
日本トランスシティ	12,600	492.00	6,199,200	貸付株式数 6,000株
ケイヒン	1,000	1,430.00	1,430,000	
中央倉庫	3,300	1,080.00	3,564,000	貸付株式数 1,000株
川西倉庫	1,100	1,663.00	1,829,300	貸付株式数 400株
安田倉庫	4,600	875.00	4,025,000	
東洋埠頭	1,600	1,559.00	2,494,400	
宇徳	4,700	538.00	2,528,600	
上 組	34,800	2,549.00	88,705,200	
サンリツ	1,400	662.00	926,800	
キムラユニティー	1,500	1,116.00	1,674,000	
キューソー流通システム	1,400	2,509.00	3,512,600	貸付株式数 500株 (200株)
近鉄エクスプレス	10,600	1,913.00	20,277,800	
東海運	3,300	350.00	1,155,000	貸付株式数 1,000株
エーアイティー	3,600	1,019.00	3,668,400	貸付株式数 1,000株
内外トランスライン	1,700	1,648.00	2,801,600	貸付株式数 800株
日本コンセプト	1,500	1,144.00	1,716,000	
東京放送H D	39,000	2,126.00	82,914,000	貸付株式数 15,300株

日本テレビH L D S	53,600	1,777.00	95,247,200	
朝日放送グループHD	6,100	785.00	4,788,500	
テレビ朝日HD	16,200	2,285.00	37,017,000	貸付株式数 3,100株 (100株)
スカパーJ S A T H D	44,700	547.00	24,450,900	
テレビ東京HD	4,800	2,750.00	13,200,000	貸付株式数 2,000株 (1,500株)
日本BS放送	1,900	1,238.00	2,352,200	貸付株式数 700株
ビジョン	1,800	4,775.00	8,595,000	貸付株式数 700株
USEN-NEXT H L D G S	2,300	1,207.00	2,776,100	貸付株式数 800株 (500株)
ワイヤレスゲート	2,500	564.00	1,410,000	貸付株式数 1,300株 (1,000株)
コネクシオ	4,100	1,477.00	6,055,700	
日本通信	50,500	139.00	7,019,500	貸付株式数 22,900株 (1,000株)
クロップス	1,000	744.00	744,000	
日本電信電話	400,300	4,680.00	1,873,404,000	
K D D I	515,800	2,664.00	1,374,091,200	貸付株式数 204,000株
光通信	6,900	18,110.00	124,959,000	
N T T ドコモ	420,400	2,628.50	1,105,021,400	貸付株式数 166,200株
エムティーアイ	6,900	601.00	4,146,900	貸付株式数 2,800株
GMOインターネット	21,300	1,490.00	31,737,000	
アイドママーケティングコ ミュ	1,300	536.00	696,800	
カドカワ	17,200	1,411.00	24,269,200	貸付株式数 6,800株
学研ホールディングス	2,000	4,395.00	8,790,000	
ゼンリン	11,700	2,817.00	32,958,900	貸付株式数 3,200株
昭文社	2,700	547.00	1,476,900	
インプレスホールディング ス	4,900	165.00	808,500	
東京電力HD	476,600	689.00	328,377,400	
中部電力	182,400	1,702.00	310,444,800	貸付株式数 11,500株
関西電力	243,300	1,704.00	414,583,200	
中国電力	82,100	1,434.00	117,731,400	貸付株式数 32,600株
北陸電力	58,300	1,011.00	58,941,300	貸付株式数 400株
東北電力	139,400	1,484.00	206,869,600	
四国電力	53,400	1,365.00	72,891,000	
九州電力	122,600	1,333.00	163,425,800	貸付株式数 48,600株
北海道電力	55,600	778.00	43,256,800	

沖縄電力	11,000	2,258.00	24,838,000	貸付株式数	100株
電源開発	47,300	2,922.00	138,210,600		
エフオン	3,600	1,022.00	3,679,200		
イーレックス	10,300	693.00	7,137,900	貸付株式数	4,100株
レノバ	6,200	1,166.00	7,229,200	貸付株式数	1,000株
東京瓦斯	116,900	2,924.50	341,874,050		
大阪瓦斯	115,500	2,069.00	238,969,500		
東邦瓦斯	29,600	4,590.00	135,864,000		
北海道瓦斯	3,100	1,504.00	4,662,400		
広島ガス	11,900	361.00	4,295,900	貸付株式数	2,000株
西部瓦斯	6,700	2,498.00	16,736,600	貸付株式数	2,800株
静岡ガス	18,100	977.00	17,683,700		
メタウォーター	2,800	3,185.00	8,918,000	貸付株式数	1,300株
アイネット	3,300	1,669.00	5,507,700		
松竹	3,900	11,890.00	46,371,000	貸付株式数	1,400株
東宝	38,600	3,950.00	152,470,000		
エイチ・アイ・エス	10,100	3,825.00	38,632,500	貸付株式数	2,600株 (1,300株)
東映	2,500	13,800.00	34,500,000		
ラックランド	1,100	2,955.00	3,250,500	貸付株式数	400株
N T Tデータ	155,700	1,320.00	205,524,000		
共立メンテナンス	8,700	5,700.00	49,590,000	貸付株式数	3,400株 (1,300株)
イチネンホールディングス	5,900	1,456.00	8,590,400	貸付株式数	900株
建設技術研究所	3,900	1,468.00	5,725,200		
スペース	3,600	1,243.00	4,474,800		
長大	2,200	802.00	1,764,400		
アインホールディングス	7,900	8,750.00	69,125,000	貸付株式数	3,000株
燦ホールディングス	1,200	2,576.00	3,091,200		
ピー・シー・エー	700	2,214.00	1,549,800		
スバル興業	400	5,580.00	2,232,000		
東京テアトル	2,400	1,350.00	3,240,000		
タナベ経営	1,100	1,611.00	1,772,100		
ビジネスB太田昭和	1,000	2,068.00	2,068,000	貸付株式数	400株
ナガワ	1,700	6,350.00	10,795,000		
よみうりランド	1,200	4,225.00	5,070,000		
東京都競馬	3,700	3,405.00	12,598,500		
常磐興産	2,200	1,757.00	3,865,400		
カナモト	8,500	3,340.00	28,390,000	貸付株式数	3,100株 (3,100株)

東京ドーム	21,100	1,039.00	21,922,900	
D T S	6,500	4,090.00	26,585,000	
スクウェア・エニックス・HD	27,200	3,700.00	100,640,000	
シーイーシー	6,300	2,455.00	15,466,500	
カプコン	25,100	2,222.00	55,772,200	
西尾レントオール	5,800	4,145.00	24,041,000	貸付株式数 2,000株
アイ・エス・ピー	1,100	2,374.00	2,611,400	
アゴーラ・ホスピタリティーG	33,400	30.00	1,002,000	貸付株式数 6,500株
日本空港ビルデング	18,900	4,410.00	83,349,000	
トランス・コスモス	6,300	2,624.00	16,531,200	
乃村工藝社	13,400	3,045.00	40,803,000	
ジャステック	3,300	1,065.00	3,514,500	貸付株式数 400株
S C S K	15,400	4,505.00	69,377,000	
藤田観光	2,200	3,170.00	6,974,000	
K N T - C Tホールディングス	3,000	1,288.00	3,864,000	
日本管財	6,200	2,089.00	12,951,800	
トーカイ	5,500	2,793.00	15,361,500	貸付株式数 300株
白 洋 舎	700	3,000.00	2,100,000	貸付株式数 200株
セコム	60,500	9,606.00	581,163,000	
日本システムウエア	1,900	2,474.00	4,700,600	
セントラル警備保障	2,800	6,340.00	17,752,000	
アイネス	7,300	1,269.00	9,263,700	貸付株式数 1,000株
丹青社	10,700	1,290.00	13,803,000	貸付株式数 3,000株
メイテック	7,200	5,120.00	36,864,000	
T K C	4,900	4,080.00	19,992,000	
富士ソフト	8,700	5,140.00	44,718,000	
応用地質	6,100	1,338.00	8,161,800	貸付株式数 1,100株
船井総研ホールディング	11,800	2,095.00	24,721,000	貸付株式数 4,600株
N S D	9,500	2,392.00	22,724,000	
進学会ホールディングス	2,800	629.00	1,761,200	
丸紅建材リース	500	2,095.00	1,047,500	
オ オ バ	4,400	732.00	3,220,800	貸付株式数 1,000株
コナミホールディングス	23,900	5,080.00	121,412,000	
いであ	1,100	1,121.00	1,233,100	
学 究 社	1,900	1,649.00	3,133,100	
ベネッセホールディングス	20,800	3,370.00	70,096,000	
イオンディライト	7,000	3,995.00	27,965,000	

ナック	3,800	1,097.00	4,168,600	
福井コンピュータHLD S	1,900	1,755.00	3,334,500	
ニチイ学館	8,100	1,145.00	9,274,500	貸付株式数 100株
ダイセキ	9,600	2,628.00	25,228,800	
ステップ	2,100	1,505.00	3,160,500	貸付株式数 800株
日鉄住金物産	4,100	5,120.00	20,992,000	貸付株式数 1,000株
泉州電業	1,900	2,669.00	5,071,100	
元気寿司	1,600	5,010.00	8,016,000	
トラスコ中山	12,200	3,225.00	39,345,000	貸付株式数 4,400株
ヤマダ電機	179,000	549.00	98,271,000	貸付株式数 74,500株 (400株)
オートバックスセブン	23,300	1,736.00	40,448,800	
モリト	4,100	813.00	3,333,300	
アークランドサカモト	9,900	1,552.00	15,364,800	
ニトリホールディングス	25,400	15,205.00	386,207,000	
グルメ杵屋	4,100	1,195.00	4,899,500	
愛眼	4,700	334.00	1,569,800	貸付株式数 1,800株
ケーユーホールディングス	3,000	904.00	2,712,000	
吉野家ホールディングス	20,500	1,949.00	39,954,500	貸付株式数 8,100株
加藤産業	9,100	3,515.00	31,986,500	
北恵	900	996.00	896,400	
イノテック	4,000	1,172.00	4,688,000	貸付株式数 2,000株
イエローハット	5,500	2,983.00	16,406,500	
松屋フーズHLDGS	2,800	3,895.00	10,906,000	
JBC Cホールディングス	4,600	1,771.00	8,146,600	
J Kホールディングス	5,200	615.00	3,198,000	
サガミホールディングス	7,700	1,382.00	10,641,400	貸付株式数 700株
日伝	4,700	1,828.00	8,591,600	
関西スーパーマーケット	4,400	1,100.00	4,840,000	
ミロク情報サービス	5,800	2,450.00	14,210,000	
北沢産業	4,400	250.00	1,100,000	
杉本商事	3,100	1,800.00	5,580,000	
因幡電機産業	8,600	4,715.00	40,549,000	
王将フードサービス	4,300	7,930.00	34,099,000	
プレナス	6,600	1,985.00	13,101,000	貸付株式数 2,600株 (2,500株)
ミニストップ	4,300	2,072.00	8,909,600	
アークス	11,000	2,844.00	31,284,000	
パローホールディングス	12,700	2,928.00	37,185,600	

バイテックホールディングス	2,700	2,432.00	6,566,400	
東 テ ク	1,900	2,810.00	5,339,000	
ミスミグループ本社	73,600	2,572.00	189,299,200	貸付株式数 26,500株 (26,500株)
藤 久	500	795.00	397,500	
アルテック	4,400	275.00	1,210,000	
ベ ル ク	2,900	6,030.00	17,487,000	
大 庄	3,100	1,718.00	5,325,800	
タキヒヨー	1,700	1,967.00	3,343,900	
ファーストリテイリング	7,900	59,040.00	466,416,000	貸付株式数 100株
ソフトバンクグループ	244,600	9,526.00	2,330,059,600	
蔵王産業	900	1,415.00	1,273,500	
スズケン	26,800	6,110.00	163,748,000	
サンドラッグ	22,100	3,830.00	84,643,000	
サックスパーホールディング グ	4,900	1,124.00	5,507,600	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
ジェコス	4,000	1,154.00	4,616,000	
ヤマザワ	1,200	1,788.00	2,145,600	貸付株式数 400株
や ま や	1,000	2,540.00	2,540,000	
ルネサスイーストン	5,200	449.00	2,334,800	貸付株式数 1,000株
ベルーナ	14,400	1,279.00	18,417,600	
合計			140,729,270,900	

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

トヨタ自動車 100,000株

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

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

DCダイワ日本株式インデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2019年5月31日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	141,069,680
親投資信託受益証券	63,624,334,641
未収入金	105,397,000
流動資産合計	63,870,801,321
資産合計	63,870,801,321
負債の部	
流動負債	
未払解約金	152,576,635
未払受託者報酬	14,208,764
未払委託者報酬	74,596,283
その他未払費用	1,055,315
流動負債合計	242,436,997
負債合計	242,436,997
純資産の部	
元本等	
元本	1 27,885,280,259
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	35,743,084,065
（分配準備積立金）	15,661,552,450
元本等合計	63,628,364,324
純資産合計	63,628,364,324
負債純資産合計	63,870,801,321

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2018年12月1日 至 2019年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	5,559,511,483
営業収益合計	5,559,511,483
営業費用	
支払利息	35,214
受託者報酬	14,208,764
委託者報酬	74,596,283
その他費用	1,059,135
営業費用合計	89,899,396
営業損失（ ）	5,649,410,879
経常損失（ ）	5,649,410,879
中間純損失（ ）	5,649,410,879
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	307,235,752
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	41,398,854,722
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,491,102,513
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,491,102,513
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,804,698,043
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,804,698,043
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	35,743,084,065

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2018年12月1日 至 2019年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年5月31日現在
1. 1 期首元本額	27,865,639,043円
期中追加設定元本額	2,592,876,419円
期中一部解約元本額	2,573,235,203円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	27,885,280,259口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2018年12月1日 至 2019年5月31日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年5月31日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2818円 (22,818円)

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年5月31日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	25,633,881,058
株式	131,113,242,940
未収配当金	1,339,006,285
未収利息	2,210,369
前払金	70,693,300

その他未収収益	5	68,481,875
流動資産合計		158,227,515,827
資産合計		158,227,515,827
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		105,305,520
未払金		1,068,182,272
未払解約金		149,018,200
受入担保金		23,618,009,413
その他未払費用		69,069
流動負債合計		24,940,584,474
負債合計		24,940,584,474
純資産の部		
元本等		
元本	1	137,134,203,836
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	3,847,272,483
元本等合計		133,286,931,353
純資産合計		133,286,931,353
負債純資産合計		158,227,515,827

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年5月31日現在
1. 1 期首	2018年12月1日
期首元本額	134,890,694,102円
期中追加設定元本額	9,724,969,235円
期中一部解約元本額	7,481,459,501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	4,073,523,584円
ファンド	
ダイワ・トピックス・イン	7,850,097,932円
デックスファンドV A	
適格機関投資家専用・ダイ	30,396,804円
ワ・トピックスインデックス	
ファンドV A 2	
ダイワ国内重視バランスファ	60,746,661円
ンド30VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国内重視バランスファ	976,298,947円
ンド50VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国際分散バランスファ	49,591,649円
ンド30VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国際分散バランスファ	1,345,583,232円
ンド50VA(一般投資家私	
募)	
日本株式インデックスファン	16,075,672円
ド(FOFs用)(適格機関投資	
家専用)	

D - I ' s T O P I Xイン デックス	40,214,704円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	19,956,909円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,615,386円
i F r e e T O P I Xイン デックス	1,058,368,415円
i F r e e 8資産バランス	1,668,197,638円
i F r e e 年金バランス	39,259,361円
D Cダイワ日本株式インデッ クス	65,463,869,371円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,822,872,454円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,155,894,448円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,903,880,442円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,924,604,053円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	15,526,759円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	51,731,923円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	18,069,602円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	94,482,729円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	358,303円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	367,695円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA(国内株式型)	726,124円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	4,245,918円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	4,248,105円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA(国内株式型)	8,201,794円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	168,418,017円

	ダイワ世界バランスファンド 60VA	165,937,499円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,582,574,749円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	534,691円
	ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	2,894,230円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	825,721,462円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	127,351,633円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	223,926,223円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	162,607,666円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス	8,816,898,397円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	1,824,429,209円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,511,232,486円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPPIX	1,422,634,051円
	ダイワライフスタイル25	193,069,689円
	ダイワライフスタイル50	678,512,244円
	ダイワライフスタイル75	558,497,294円
	DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)	13,169,957,682円
	計	137,134,203,836円
2.	期末日における受益権の総数	137,134,203,836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3,847,272,483円であります。

4.	3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 22,131,142,240円
5.	4 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 563,220,000円
6.	5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分64,882,793円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	2019年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買 建	2,258,808,300	-	2,153,580,000	105,228,300

合計	2,258,808,300	-	2,153,580,000	105,228,300

(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)

	2019年5月31日現在	
1口当たり純資産額		0.9719円
(1万口当たり純資産額)		(9,719円)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2019年6月28日

資産総額	65,528,138,520円
負債総額	103,633,547円
純資産総額（ - ）	65,424,504,973円
発行済数量	27,914,519,915口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.3437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

2019年6月28日

資産総額	155,598,886,758円
負債総額	18,082,616,590円
純資産総額（ - ）	137,516,270,168円
発行済数量	137,726,173,770口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9985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。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2019年6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。

2019年6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	75	145,253
追加型株式投資信託	721	15,318,969
株式投資信託 合計	796	15,464,222
単位型公社債投資信託	30	111,005
追加型公社債投資信託	14	1,392,102
公社債投資信託 合計	44	1,503,108
総合計	840	16,967,330

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(2018年4月1日から2019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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
固定資産		
有形固定資産	1	206
建物	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799
投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836
出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	2 4,476	2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
固定負債		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145
賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725
福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374

役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	210	215
有価証券償還益	17	133
その他	130	172
営業外収益計	359	521
営業外費用		
投資有価証券売却損	0	40
有価証券償還損	3	32
その他	25	60
営業外費用計	29	132
経常利益	18,741	16,961
特別損失		
関係会社整理損失	333	29
特別損失計	333	29
税引前当期純利益	18,407	16,931
法人税、住民税及び事業税	5,843	5,076
法人税等調整額	106	15
法人税等合計	5,737	5,060
当期純利益	12,670	11,870

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
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	13,850	14,225	40,895

	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
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
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	41,112

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

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。

（会計方針の変更）

（税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用）

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の前事業年度期首残高が480百万円増加しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 平成30年3月30日)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日)

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)等を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

(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「受取配当金」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「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円
器具備品	235百万円	264百万円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
未払金	4,406百万円	3,788百万円

3 保証債務

前事業年度（2018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。

当事業年度（2019年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万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 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017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

2018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	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月26日

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018年 6月26日

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

2019年6月21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	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月24日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は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、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、

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(2018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。

当事業年度(2019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		28,489	28,489	-
(2)未収委託者報酬		11,468	11,468	-
(3)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券		8,380	8,380	-
資産計		48,338	48,338	-
(1)未払手数料		(4,610)	(4,610)	-
(2)その他未払金		(3,882)	(3,882)	-
(3)未払費用(*2)		(2,805)	(2,805)	-
負債計		(11,298)	(11,298)	-

(*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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1)その他有価証券 非上場株式	970	666
(2)子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	1,836
(3)長期差入保証金	1,072	1,070

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(2018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

当事業年度(2019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	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
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	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

(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(2018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、記載していません。

当事業年度(2019年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,836百万円)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、記載していません。

2. その他有価証券

前事業年度(2018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。

当事業年度(2019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	87	55	32
(2) その他			
証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
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	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)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 2017年4月1日 至 2018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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	389	86	-
(2) その他			
証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

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おります。

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,318百万円	2,350百万円
勤務費用	159	158
退職給付の支払額	166	171
その他	38	52
退職給付債務の期末残高	2,350	2,389

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

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,350百万円	2,389百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389
退職給付引当金	2,350	2,389
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	159百万円	158百万円
その他	24	41
確定給付制度に係る退職給付費用	184	199

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度171百万円、当事業年度174百万円であります。

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		731
	719	
賞与引当金	244	182
システム関連費用	16	170
未払事業税	162	141
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	68	32
その他	297	240
繰延税金資産小計	1,602	1,592
評価性引当額	200	164
繰延税金資産合計	1,402	1,428
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	159	159
その他有価証券評価差額金	164	85
繰延税金負債合計	323	244
繰延税金資産の純額	1,078	1,183

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引（譲渡益）は480百万円減少しております。

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（2018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（2019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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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 2017年4月1日 至 2018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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有) 直接91.0	経営管理	有償減資(注2)	3,293	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

(注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

(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 2017年4月1日 至 2018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)(注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	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(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	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せん。

(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 2018年4月1日 至 2019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) (注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,063	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せん。

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	15,760.66円	1株当たり純資産額 15,389.06円
1株当たり当期純利益	4,857.40円	1株当たり当期純利益 4,550.81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おりません。

(注2) 「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の1株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

(注3) 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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,670	11,870
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（2019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 (2019年3月 末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	(注1)
株式会社鹿児島銀行	18,130	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
株式会社京都銀行	42,103	
スルガ銀行株式会社	30,043	
株式会社千葉銀行	145,069	
日本生命保険相互会社	1,350,000	(注2)
株式会社みずほ銀行	1,404,065	(注3)
三井住友信託銀行株式会社	342,037	(注4)
明治安田生命保険相互会社	930,000	(注2)
労働金庫連合会	120,000	(注5)

(注1) 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。

(注2) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 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。

(注5) 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ないません。

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

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

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

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

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

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2019年5月24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	小倉 加奈子	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治	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2018年4月1日から2019年3月31日までの第60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2019年3月31日現在の財政状態及び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12月28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DCダイワ日本株式インデックスの平成29年12月1日から平成30年11月30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、DCダイワ日本株式インデックスの平成30年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年7月5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DCダイワ日本株式インデックスの2018年12月1日から2019年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ日本株式インデックスの2019年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。