

【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12月19日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社 (2020年4月1日より、大和アセットマネジメント株式会社(予定))
【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】	為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド（愛称：ぶち債・ちーと株）

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、1.65%（税抜1.5%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

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

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

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

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

(7) 【申込期間】

2019年12月20日から2020年6月19日まで（継続申込期間）
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

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

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

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

申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

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

（ ）前 の申込受付中止日を除きます。

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

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

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

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの特色 >

1 米国国債とわが国の株式に投資します。

◆米国国債とわが国の株式へ、以下の組入比率をめどに投資します。

米国国債・・・90%　わが国の株式・・・10%

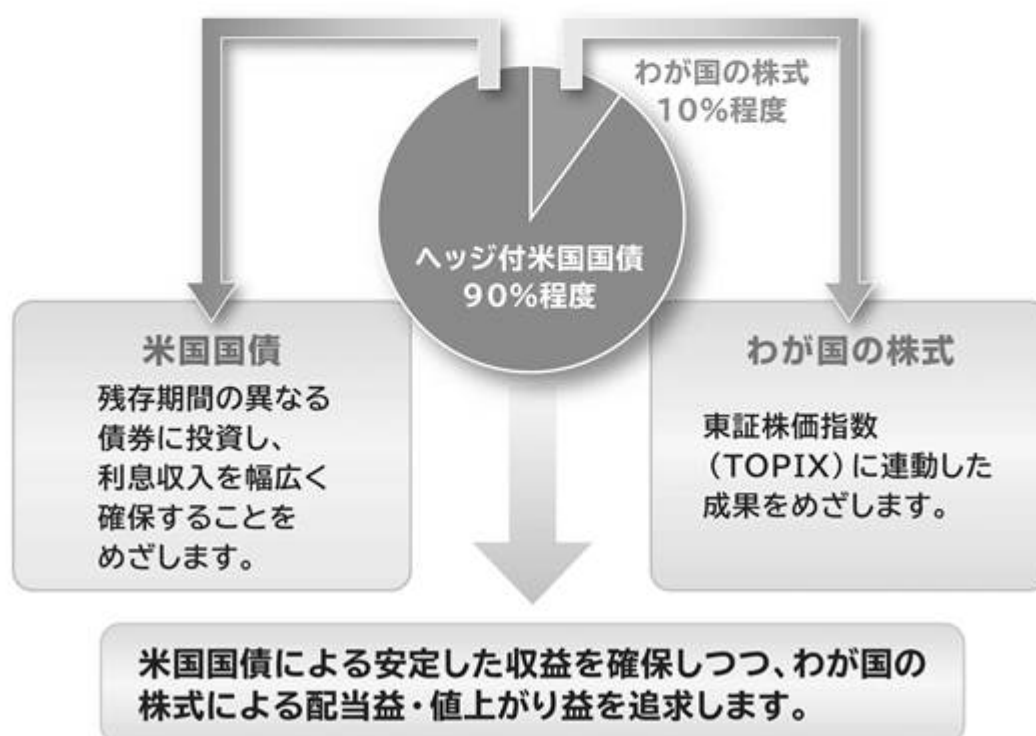
－上記の組入比率を基本とし、原則1か月ごとにリバランスを行なうものとします。

◆米国国債については為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

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

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

当ファンドのイメージ

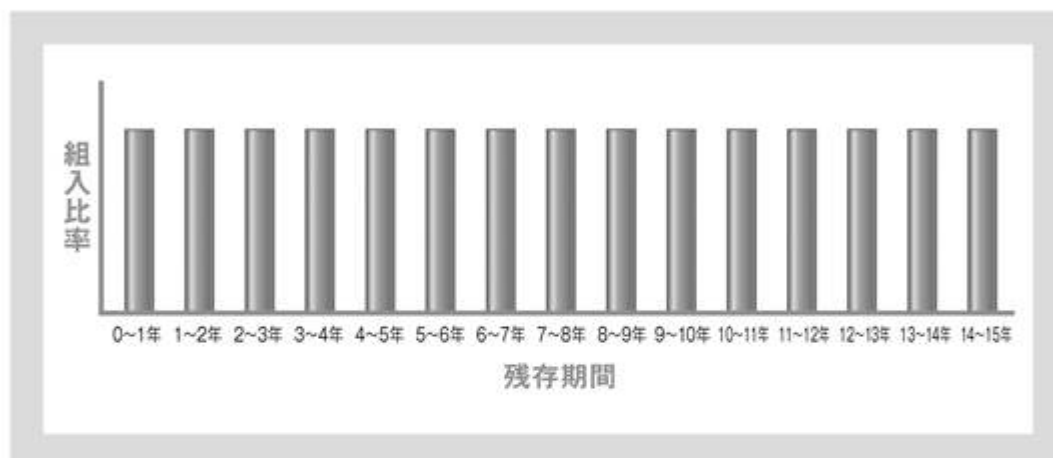


※上記はイメージであり、実際の組入比率が上記のとおりになるとは限りません。

2 米国国債への投資にあたってはラダー型運用を行いません。

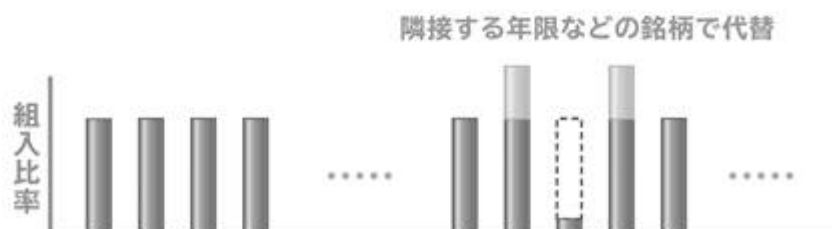
- ◆米国国債への投資にあたっては、残存期間が最長15年程度までの国債を、残存期間ごとの国債の投資金額がほぼ同程度となるように組入れることをめざします。このような運用手法をラダー型運用といいます。

残存期間ごとの組入イメージ



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

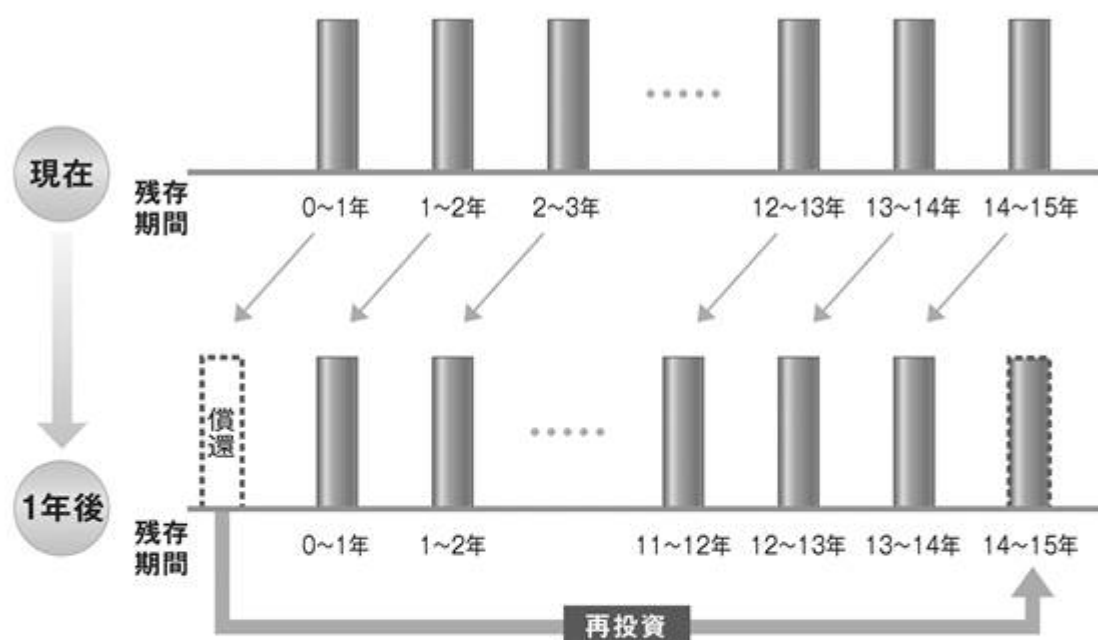
●投資対象の流動性が低い場合の組入イメージの例●



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

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

ラダー型運用のイメージ



ラダー型運用の主な特徴

◆金利変動リスクの分散

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

◆安定した収益性

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

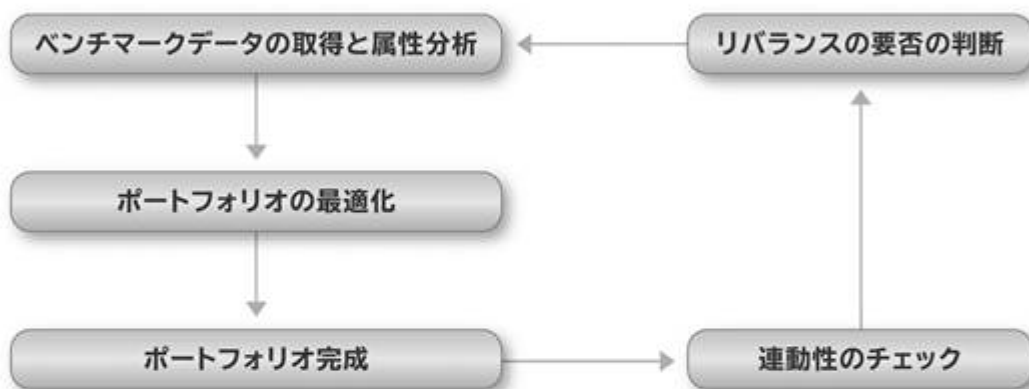
※上記は一般的な特徴を示したものです。また、元本の安全性および将来の成果を示唆・保証するものではありません。

3

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

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

運用プロセス



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

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

◆東証株価指数（TOPIX）について

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

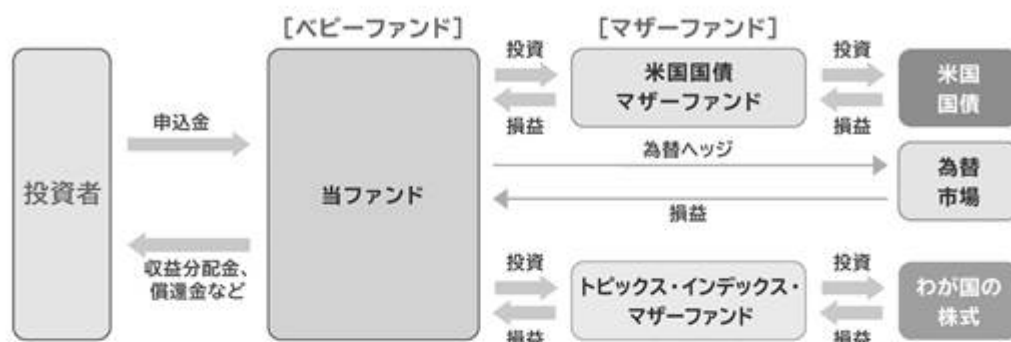
TOPIXは、1968年1月4日（基準時）の時価総額を100として1969年7月1日から株式会社東京証券取引所が算出・公表しております。

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

ファンドの仕組み

◆当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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



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

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

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

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

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

〈分配方針〉

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

主な投資制限

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

(2) 【ファンドの沿革】

2016年4月1日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

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

(注)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況（2019年9月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

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

・ 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

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

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

投資態度

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．米国国債マザーファンドの受益証券

2．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

3．株券または新株引受権証書

4．国債証券

5．地方債証券

6．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

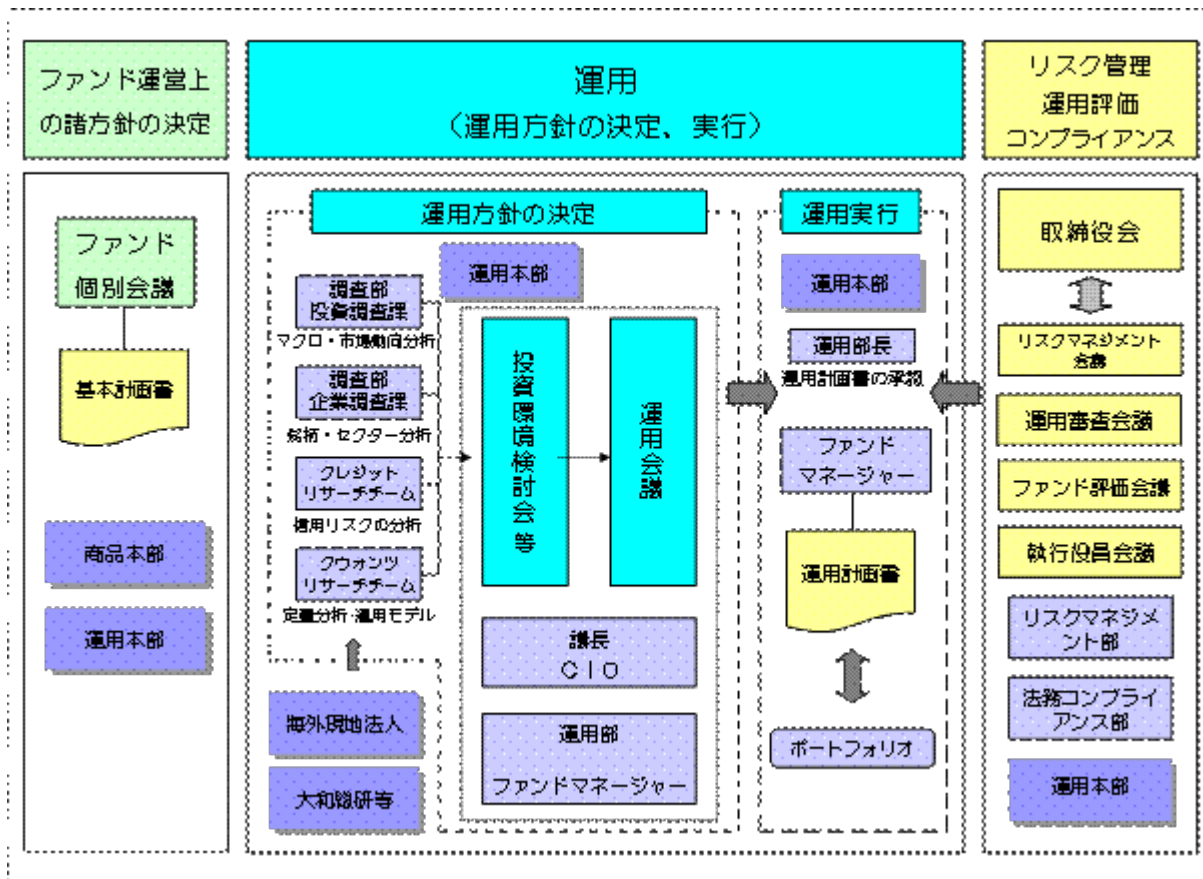
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5. の権利の性質を有するもの

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

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営

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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は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9月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

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

原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券等（信託約款）

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

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

投資信託証券（信託約款）

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

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

投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

信用取引（信託約款）

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

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

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

先物取引等（信託約款）

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

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

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

スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引(信託約款)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

デリバティブ取引等（信託約款）

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

有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

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

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

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

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

信用リスク集中回避（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> マザーファンドの概要

1. 米国国債マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

米国国債を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

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

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

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

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

2. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への投資には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

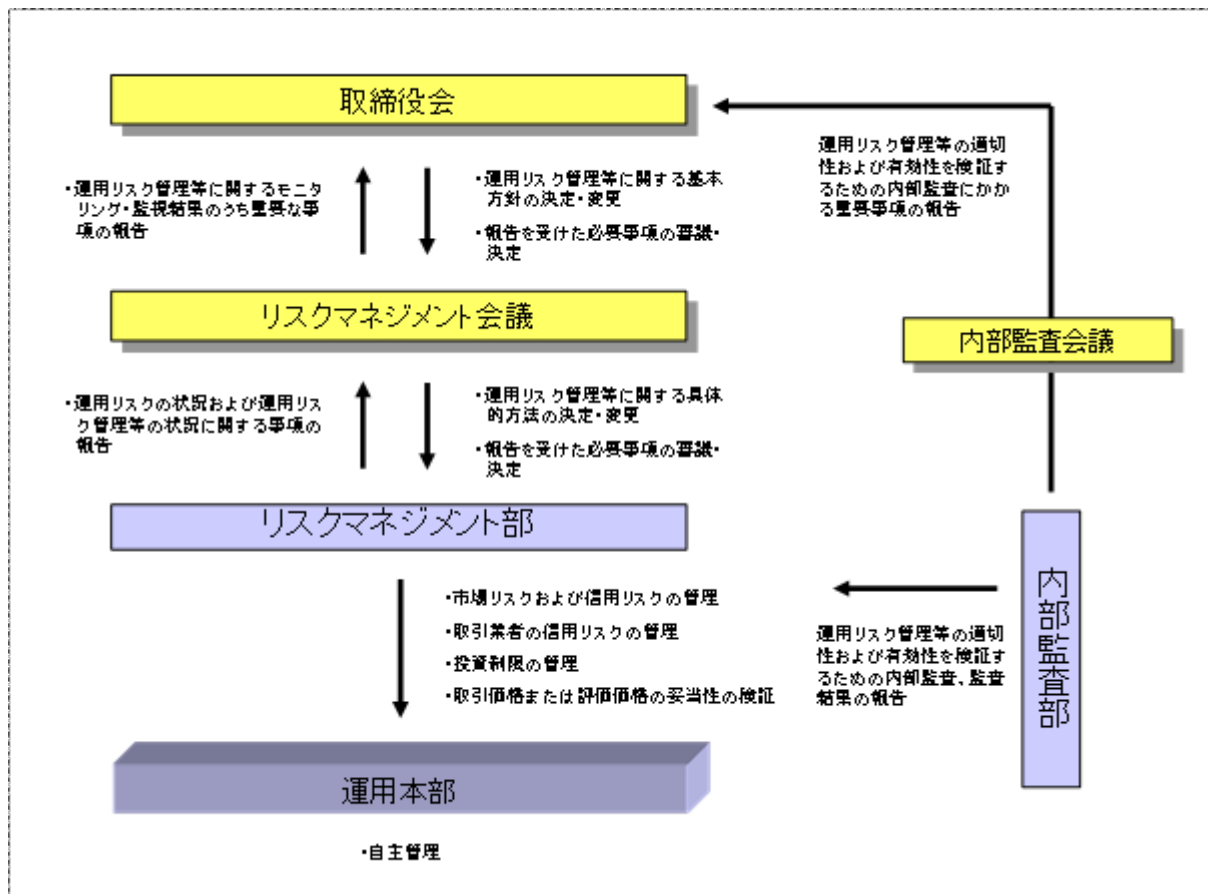
ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

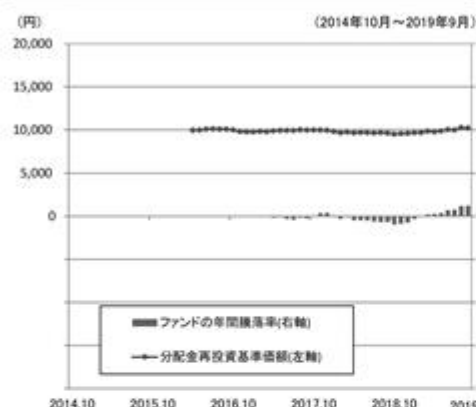
当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な

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

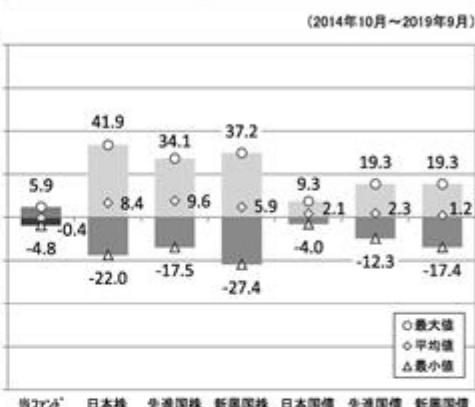
参考情報

◆下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に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年間ににおける年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、1.65%（税抜1.5%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

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

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、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に信託財産中から支弁します。

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

（新発10年米回国債の利回りが）

イ．1%未満の場合 …年率0.407%（税抜0.37%）

ロ．1%以上の場合 …年率0.605%（税抜0.55%）

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次の通りとします。

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

（ ）2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

- () 上記は、2019年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（2019年9月30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	193,495,993	98.47
内 日本	193,495,993	98.47
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,013,535	1.53
純資産総額	196,509,528	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	170,952,210	86.99
内 日本	170,952,210	86.99

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

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

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 【投資資産】（2019年9月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	米国国債マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	130,322,738	1.2876 167,813,971	1.3378 174,345,758	88.72
2	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	18,549,240	1.0207 18,934,638	1.0324 19,150,235	9.75

(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	98.47%
合計	98.47%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2019年10月	売建	1,587,300	170,954,591	170,952,210	86.99%

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

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年3月27日)	266,685,163	266,685,163	0.9814	0.9814
第2計算期間末 (2018年3月26日)	258,640,721	258,640,721	0.9681	0.9681
2018年9月末日	233,130,476	-	0.9645	-
10月末日	217,062,497	-	0.9520	-
11月末日	209,799,139	-	0.9569	-
12月末日	209,177,863	-	0.9615	-
2019年1月末日	202,031,108	-	0.9674	-
2月末日	200,851,538	-	0.9692	-
第3計算期間末 (2019年3月26日)	204,353,707	204,353,707	0.9845	0.9845
3月末日	204,637,682	-	0.9861	-
4月末日	204,737,057	-	0.9787	-
5月末日	203,512,343	-	0.9889	-
6月末日	207,557,190	-	1.0039	-
7月末日	205,666,181	-	1.0002	-
8月末日	197,922,184	-	1.0267	-

9月末日	196,509,528	-	1.0218	-
------	-------------	---	--------	---

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2019年3月27日～ 2019年9月26日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.9
第2計算期間	1.4
第3計算期間	1.7
2019年3月27日～ 2019年9月26日	3.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	284,191,584	13,450,334
第2計算期間	48,543,123	53,132,295
第3計算期間	35,742,605	95,321,161
2019年3月27日～ 2019年9月26日	13,882,264	28,655,108

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

米国国債マザーファンド

(1) 投資状況 (2019年9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	14,813,180,133	97.99
内 アメリカ	14,813,180,133	97.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	303,127,773	2.01
純資産総額	15,116,307,906	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	149,989,157	0.99
内 日本	149,989,157	0.99

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

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

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産 (2019年9月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Strip Coupon	アメリカ	国債証券	11,970,000	69.39 896,485,105	77.53 1,001,650,662	- 2033/02/15	6.63
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,711,000	129.82 940,283,235	137.96 999,176,845	5.375000 2031/02/15	6.61
3	United States Treasury Strip Coupon	アメリカ	国債証券	12,150,000	66.94 877,798,185	75.65 991,957,094	- 2034/02/15	6.56
4	United States Treasury Strip Coupon	アメリカ	国債証券	11,540,000	71.26 887,495,843	79.42 989,181,316	- 2032/02/15	6.54
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	145.98 992,568,484	144.30 981,089,928	6.250000 2030/05/15	6.49
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,207,000	102.46 465,188,318	105.00 476,720,412	2.750000 2024/02/15	3.15
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,369,000	99.78 470,505,392	100.82 475,387,660	2.125000 2021/08/15	3.14
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,355,000	98.35 462,279,346	100.63 472,961,946	1.750000 2023/05/15	3.13
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,250,000	99.37 455,805,601	100.15 459,357,163	1.625000 2022/08/15	3.04
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,120,000	94.88 421,879,480	99.26 441,362,366	1.500000 2026/08/15	2.92
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,840,000	99.42 412,039,721	104.54 433,252,005	2.250000 2027/08/15	2.87

12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,969,000	100.39 430,046,323	100.68 431,260,004	2.625000 2020/08/15	2.85
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,795,000	133.66 403,186,655	140.42 423,560,849	6.125000 2029/08/15	2.80
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,755,000	98.57 399,459,295	102.14 413,944,146	2.000000 2025/02/15	2.74
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,514,000	124.18 336,932,842	130.30 353,528,929	5.250000 2028/11/15	2.34
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,994,000	101.22 327,057,636	103.75 335,251,815	2.375000 2024/08/15	2.22
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,775,000	102.54 307,113,214	102.52 307,045,809	3.625000 2021/02/15	2.03
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,720,000	99.67 292,584,057	104.39 306,452,394	2.250000 2027/02/15	2.03
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,793,000	100.99 304,428,356	100.64 303,349,651	3.625000 2020/02/15	2.01
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,350,000	103.93 263,581,433	109.75 278,356,922	2.875000 2028/05/15	1.84
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,300,000	103.85 257,794,655	109.96 272,938,313	2.875000 2028/08/15	1.81
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,490,000	99.23 266,662,398	101.38 272,434,521	2.000000 2023/02/15	1.80
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,483,000	99.47 266,561,221	100.93 270,465,476	2.000000 2022/02/15	1.79
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	1,847,000	129.05 257,249,039	134.15 267,410,793	6.125000 2027/11/15	1.77
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,340,000	100.10 252,787,858	105.44 266,283,210	2.375000 2027/05/15	1.76
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,194,000	98.67 233,646,670	100.41 237,747,263	1.750000 2022/05/15	1.57
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,084,000	101.20 227,619,886	101.00 227,170,076	3.500000 2020/05/15	1.50
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	1,970,000	96.28 204,702,695	100.10 212,834,136	1.625000 2026/02/15	1.41
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	1,850,000	99.88 199,419,719	106.21 212,066,361	2.375000 2029/05/15	1.40
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	1,891,000	99.12 202,284,264	102.85 209,911,273	2.125000 2025/05/15	1.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.99%
合計	97.99%

(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。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2019年10月	買建	1,390,076	150,000,000	149,989,157	0.99%

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

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2019年9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	141,141,122,590	98.53
内 日本	141,141,122,590	98.53
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,104,334,530	1.47
純資産総額	143,245,457,120	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2,254,960,000	1.57
内 日本	2,254,960,000	1.57

(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9月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	692,200	7,364.00 5,097,360,800	7,216.00 4,994,915,200	3.49
2	ソニー	日本	株式	電気機 器	417,000	6,375.00 2,658,375,000	6,347.00 2,646,699,000	1.85
3	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,217,500	565.10 2,383,309,250	548.40 2,312,877,000	1.61
4	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	416,900	5,271.00 2,197,479,900	5,156.00 2,149,536,400	1.50
5	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	483,700	4,616.00 2,232,759,200	4,240.00 2,050,888,000	1.43
6	キーエンス	日本	株式	電気機 器	30,500	66,890.00 2,040,145,000	66,900.00 2,040,450,000	1.42
7	武田薬品	日本	株式	医薬品	542,400	3,757.00 2,037,796,800	3,690.00 2,001,456,000	1.40
8	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	431,700	3,786.00 1,634,416,200	3,695.00 1,595,131,500	1.11
9	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	524,000	2,885.50 1,512,002,000	2,798.50 1,466,414,000	1.02
10	任天堂	日本	株式	その他 製品	35,600	42,460.00 1,511,576,000	40,020.00 1,424,712,000	0.99
11	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	499,700	2,867.00 1,432,639,900	2,825.00 1,411,652,500	0.99
12	リクルートホールディン グス	日本	株式	サービ ス業	425,200	3,422.00 1,455,034,400	3,286.00 1,397,207,200	0.98
13	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	8,324,800	168.50 1,402,728,800	165.60 1,378,586,880	0.96
14	東京海上HD	日本	株式	保険業	219,100	5,899.00 1,292,470,900	5,779.00 1,266,178,900	0.88

15	信越化学	日本	株式	化学	107,200	11,820.00 1,267,104,000	11,560.00 1,239,232,000	0.87
16	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	55,600	22,500.00 1,251,000,000	22,220.00 1,235,432,000	0.86
17	第一三共	日本	株式	医薬品	177,800	7,126.00 1,267,002,800	6,804.00 1,209,751,200	0.84
18	ダイキン工業	日本	株式	機械	84,800	14,475.00 1,227,480,000	14,180.00 1,202,464,000	0.84
19	ファナック	日本	株式	電気機器	59,000	20,445.00 1,206,255,000	20,340.00 1,200,060,000	0.84
20	花王	日本	株式	化学	148,700	7,937.00 1,180,231,900	7,984.00 1,187,220,800	0.83
21	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	70,100	15,825.00 1,109,332,500	16,440.00 1,152,444,000	0.80
22	三菱商事	日本	株式	卸売業	429,300	2,783.00 1,194,741,900	2,651.00 1,138,074,300	0.79
23	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	109,300	10,550.00 1,153,115,000	10,310.00 1,126,883,000	0.79
24	日立	日本	株式	電気機器	279,600	4,065.00 1,136,574,000	4,023.00 1,124,830,800	0.79
25	HOYA	日本	株式	精密機器	125,100	8,850.00 1,107,135,000	8,819.00 1,103,256,900	0.77
26	日本電産	日本	株式	電気機器	74,700	15,330.00 1,145,151,000	14,520.00 1,084,644,000	0.76
27	資生堂	日本	株式	化学	123,400	8,722.00 1,076,294,800	8,629.00 1,064,818,600	0.74
28	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	385,900	2,789.00 1,076,275,100	2,753.00 1,062,382,700	0.74
29	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	256,400	4,178.00 1,071,239,200	4,132.00 1,059,444,800	0.74
30	村田製作所	日本	株式	電気機器	195,500	5,046.00 986,493,000	5,185.00 1,013,667,500	0.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.53%
合計	98.53%

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

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.10%
鉱業	0.27%
建設業	2.85%
食料品	4.00%
繊維製品	0.65%
パルプ・紙	0.24%
化学	7.16%
医薬品	5.45%
石油・石炭製品	0.55%
ゴム製品	0.75%
ガラス・土石製品	0.81%
鉄鋼	0.76%
非鉄金属	0.74%
金属製品	0.56%
機械	4.97%
電気機器	13.84%
輸送用機器	7.74%
精密機器	2.22%
その他製品	2.22%
電気・ガス業	1.62%
陸運業	4.65%
海運業	0.16%
空運業	0.51%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	8.42%
卸売業	4.79%
小売業	4.74%
銀行業	5.79%
証券、商品先物取引業	0.77%
保険業	2.28%
その他金融業	1.11%
不動産業	2.48%
サービス業	5.13%
合計	98.53%

(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12月	買建	142	2,277,622,360	2,254,960,000	1.57%

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

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

(参考情報) 運用実績

● 為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド

2019年9月30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	10,218円
純資産総額	1.9億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.5%
3カ月間	1.8%
6カ月間	3.6%
1年間	5.9%
3年間	1.2%
5年間	-
設定来	2.2%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年3月	第2期 18年3月	第3期 19年3月						
分配金	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	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄(除く債券)	東証33業種名	比率	
外国債券	41	86.9%	日本円	98.5%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	輸送用機器	0.3%	
国内株式・先物	2,132	9.8%	米ドル	1.5%	最終利回り(%)	ソニー	電気機器	0.2%	
					修正デュレーション	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	0.2%	
					残存年数	TOPIX先物 O112月	-	0.2%	
					債券格付別構成	日本電信電話	情報・通信業	0.1%	
					AAA	100.0%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.1%
					AA	-	キーエンス	電気機器	0.1%
					A	-	武田薬品	医薬品	0.1%
					BBB	-	三井住友フィナンシャルG	銀行業	0.1%
					BB	-	本田技研	輸送用機器	0.1%
コール・ローン、その他		3.5%							
合計	2,173	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	1.6%	

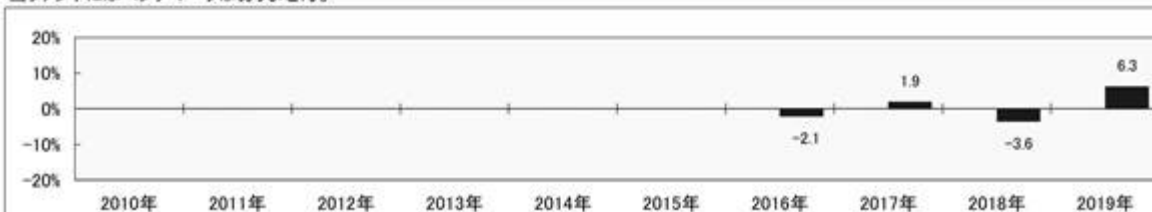
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2016年は設定日(4月1日)から年末、2019年は9月30日までの騰落率を表しています。

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

2 【換金(解約)手続等】

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

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

< 一部解約 >

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

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

- ・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

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

(4) 【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

信託の終了

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

信託約款の変更等

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

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

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

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

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

収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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

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

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

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

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

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成30年3月27日から平成31年3月26日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 平成30年3月26日現在	第3期 平成31年3月26日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	150,901	-
コール・ローン	2,139,157	3,655,704
親投資信託受益証券	252,333,227	199,130,873
派生商品評価勘定	-	791,297
未収入金	5,240,273	1,862,261
流動資産合計	259,863,558	205,440,135
資産合計	259,863,558	205,440,135
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	214,491	-
未払金	-	448,533
未払解約金	182,200	-
未払受託者報酬	58,473	44,964
未払委託者報酬	745,993	573,784
その他未払費用	21,680	19,147
流動負債合計	1,222,837	1,086,428
負債合計	1,222,837	1,086,428
純資産の部		
元本等		
元本	1 267,152,078	1 207,573,522
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 8,511,357	2 3,219,815
元本等合計	258,640,721	204,353,707
純資産合計	258,640,721	204,353,707
負債純資産合計	259,863,558	205,440,135

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	平成29年3月28日 至 平成30年3月26日	自	平成30年3月27日 至 平成31年3月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		8,765,954		21,437,646
為替差損益		6,726,232		17,120,818
営業収益合計		2,039,722		4,316,828
営業費用				
支払利息		2,790		3,107
受託者報酬		117,579		98,861
委託者報酬		1,500,102		1,261,344
その他費用		32,697		29,645
営業費用合計		1,653,168		1,392,957
営業利益又は営業損失（ ）		3,692,890		2,923,871
経常利益又は経常損失（ ）		3,692,890		2,923,871
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,692,890		2,923,871
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（ ）		315,252		575,089
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,056,087		8,511,357
剰余金増加額又は欠損金減少額		916,450		3,056,939
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		916,450		3,056,939
剰余金減少額又は欠損金増加額		363,578		1,264,357
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		363,578		1,264,357
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,511,357		3,219,815

(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3期	
	自 平成30年3月27日	至 平成31年3月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	平成30年3月26日現在	平成31年3月26日現在
1. 1 期首元本額	271,741,250円	267,152,078円
期中追加設定元本額	48,543,123円	35,742,605円
期中一部解約元本額	53,132,295円	95,321,161円
2. 計算期間末日における受益権の総数	267,152,078口	207,573,522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8,511,357円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,219,815円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	自 平成29年3月28日 至 平成30年3月26日	自 平成30年3月27日 至 平成31年3月26日

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 平成30年3月27日 至 平成31年3月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもありま す。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期 平成31年3月26日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第2期 平成30年3月26日現在	第3期 平成31年3月26日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	10,968,221	15,463,210
合計	10,968,221	15,463,210

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	第2期 平成30年3月26日 現在			第3期 平成31年3月26日 現在		
	契約額等 （円）	うち	時価 （円）	契約額等 （円）	うち	時価 （円）

		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	222,945,609	-	223,160,100	214,491	176,239,577	-	175,448,280	791,297
アメリカ・ドル	222,945,609	-	223,160,100	214,491	176,239,577	-	175,448,280	791,297
合計	222,945,609	-	223,160,100	214,491	176,239,577	-	175,448,280	791,297

(注) 1. 時価の算定方法

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

に評価しております。

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第3期	
自 平成30年3月27日	
至 平成31年3月26日	
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	

(1口当たり情報)

	第2期 平成30年3月26日現在	第3期 平成31年3月26日現在
1口当たり純資産額	0.9681円	0.9845円
(1万口当たり純資産額)	(9,681円)	(9,845円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	米国国債マザーファンド	139,355,285	179,196,960	
	トピックス・インデックス・マザー ファンド	19,387,195	19,933,913	
親投資信託受益証券 合計			199,130,873	
合計			199,130,873	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

(参考)

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

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

「米国国債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年3月26日現在	平成31年3月26日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金		41,448,483	58,628,636
金銭信託		1,966,611	-
コール・ローン		27,878,543	157,248,323
国債証券		14,123,275,539	13,871,037,156
未収利息		66,944,801	56,303,303
前払費用		2,591,796	1,668,830
流動資産合計		14,264,105,773	14,144,886,248
資産合計		14,264,105,773	14,144,886,248
負債の部			
流動負債			
未払解約金		23,800,000	38,549,000
その他未払費用		74	-
流動負債合計		23,800,074	38,549,000
負債合計		23,800,074	38,549,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	12,248,755,249	10,969,616,964
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		1,991,550,450	3,136,720,284
元本等合計		14,240,305,699	14,106,337,248
純資産合計		14,240,305,699	14,106,337,248
負債純資産合計		14,264,105,773	14,144,886,248

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30年3月27日 至 平成31年3月26日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年3月26日現在	平成31年3月26日現在
1. 1 期首	平成29年3月28日	平成30年3月27日
期首元本額	9,754,406,810円	12,248,755,249円
期中追加設定元本額	5,900,166,371円	1,630,854,945円
期中一部解約元本額	3,405,817,932円	2,909,993,230円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
米回国債ファンド 為替ヘッジあり（年1回決算型）	3,944,739,357円	3,152,902,673円

米国国債ファンド 為替ヘッジなし（年1回決算型）	1,776,683,872円	1,768,054,865円
米国国債ファンド フレックスヘッジ（年1回決算型）	199,246,519円	154,226,484円
米国国債ファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	6,042,807,183円	5,695,252,260円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	196,055,473円	139,355,285円
米国国債ファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	89,222,845円	59,825,397円
計	12,248,755,249円	10,969,616,964円
2. 期末日における受益権の総数	12,248,755,249口	10,969,616,964口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年3月27日 至 平成31年3月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成31年3月26日現在
-----	--------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成30年3月26日現在	平成31年3月26日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	318,465,109	359,481,672
合計	318,465,109	359,481,672

(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3月28日から平成30年3月26日まで、及び平成30年3月27日から平成31年3月26日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年3月26日現在	平成31年3月26日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成30年3月26日現在	平成31年3月26日現在
1口当たり純資産額	1.1626円	1.2859円
(1万口当たり純資産額)	(11,626円)	(12,859円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20190515	2,113,000.000	2,114,796.050	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20190815	3,163,000.000	3,177,328.390	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215	2,943,000.000	2,972,753.730	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515	2,084,000.000	2,109,153.880	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	3,819,000.000	3,834,352.380	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,275,000.000	2,331,784.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	1,896,000.000	1,930,734.720	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	3,939,000.000	3,928,994.940	
2% United States Treasury Note/Bond 20220215	2,483,000.000	2,469,989.080	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	4,044,000.000	3,989,972.160	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	1,920,000.000	1,884,000.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,490,000.000	2,470,926.600	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	1,505,000.000	1,477,593.950	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	1,245,000.000	1,260,164.100	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	4,207,000.000	4,310,492.200	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	1,664,000.000	1,685,698.560	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	1,016,000.000	1,186,291.760	
7.625% United States Treasury Note/Bond 20250215	654,000.000	846,112.500	
6.875% United States Treasury Note/Bond 20250815	1,362,000.000	1,731,755.760	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	739,000.000	912,029.460	

6.75% United States Treasury Note/Bond 20260815	491,000.000	637,990.670	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	2,247,000.000	2,899,933.260	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	950,000.000	1,195,404.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	2,514,000.000	3,122,061.180	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,245,000.000	8,350,189.500	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	300,000.000	410,319.000	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	6,261,000.000	8,127,779.760	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	2,344,000.000	2,359,189.120	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	3,555,000.000	3,500,821.800	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	1,541,000.000	1,526,422.140	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	2,890,000.000	2,838,500.200	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	1,470,000.000	1,405,569.900	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	1,666,000.000	1,589,847.140	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	4,320,000.000	4,076,308.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	2,320,000.000	2,302,948.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	2,340,000.000	2,342,363.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	3,190,000.000	3,159,567.400	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	1,550,000.000	1,609,690.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	2,300,000.000	2,388,757.000	
United States Treasury Strip Coupon 20320215	11,890,000.000	8,472,576.200	

	United States Treasury Strip Coupon 20330215	12,270,000.000	8,484,582.300	
	United States Treasury Strip Coupon 20340215	12,600,000.000	8,434,314.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 125,860,059.490 (13,871,037,156)	
国債証券	合計		13,871,037,156 [13,871,037,156]	
合計			13,871,037,156 [13,871,037,156]	

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

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

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年3月26日現在	平成31年3月26日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	839,376,610	-
コール・ローン	11,898,947,937	17,433,830,118
株式 2 3	134,541,211,690	137,866,843,610
派生商品評価勘定	-	8,393,400
未収入金	-	306,342,180

未収配当金		158,321,350	170,831,663
未収利息		428,860	1,283,352
前払金		32,645,000	8,645,000
その他未収収益	4	6,060,204	13,034,658
流動資産合計		147,476,991,651	155,809,203,981
資産合計		147,476,991,651	155,809,203,981
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		26,495,780	6,539,780
未払金		1,068,240	-
未払解約金		117,755,500	332,234,300
受入担保金		11,801,415,202	16,631,456,477
その他未払費用		8,027	-
流動負債合計		11,946,742,749	16,970,230,557
負債合計		11,946,742,749	16,970,230,557
純資産の部			
元本等			
元本	1	130,371,388,477	135,032,886,401
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,158,860,425	3,806,087,023
元本等合計		135,530,248,902	138,838,973,424
純資産合計		135,530,248,902	138,838,973,424
負債純資産合計		147,476,991,651	155,809,203,981

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30年3月27日 至 平成31年3月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年3月26日現在	平成31年3月26日現在
1. 1 期首	平成29年3月28日	平成30年3月27日
期首元本額	135,803,715,077円	130,371,388,477円
期中追加設定元本額	16,795,623,456円	16,681,753,425円
期中一部解約元本額	22,227,950,056円	12,020,255,501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	4,344,300,848円	4,176,147,043円
ファンド		

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	10,144,312,936円	8,283,159,488円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドVA2	61,617,006円	40,752,005円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	77,134,028円	74,962,444円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,282,417,660円	999,469,686円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	60,750,134円	52,904,622円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,764,892,302円	1,405,832,535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	9,076,686円
D-I's TOPIXイン デックス	29,632,470円	40,633,120円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	23,469,734円	19,387,195円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	615,913円	717,506円
iFree TOPIXイン デックス	422,122,245円	957,121,577円
iFree 8資産バランス	792,154,062円	1,549,047,401円
iFree 年金バランス	-円	30,126,086円
DCダイワ日本株式インデッ クス	62,537,486,847円	65,490,030,837円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,214,432,874円	2,742,694,313円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,412,758,430円	3,121,279,957円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,346,940,901円	2,992,964,602円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,129,426,450円	4,671,356,318円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	16,623,307円	15,867,819円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	51,553,250円	51,802,361円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	14,437,491円	18,057,500円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	- 円	67,226,516円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	330,547円	358,303円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	362,318円	367,695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	726,124円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	2,857,428円	4,245,918円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	4,967,348円	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)	10,530,833円	9,860,562円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	264,211,563円	169,236,991円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	168,062,338円	163,134,462円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	10,298,005,823円	9,663,868,782円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	133,716,617円	9,890,322円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	162,233,235円	10,043,665円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	874,973,797円	825,057,420円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	134,813,124円	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)	230,374,774円	229,100,612円
ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	105,802,337円	156,065,624円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	7,169,889,658円	8,525,497,319円

	ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	89,582,064円	112,898,232円
	ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	1,437,851,570円	2,015,712,818円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,314,382,361円	1,418,503,246円
	ダイワライフスタイル25	175,089,091円	193,092,690円
	ダイワライフスタイル50	612,401,594円	696,617,398円
	ダイワライフスタイル75	517,314,102円	554,117,022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)	13,935,866,084円	13,332,273,841円
	計	130,371,388,477円	135,032,886,401円
2.	期末日における受益権の総数	130,371,388,477口	135,032,886,401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 10,873,342,910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 15,859,680,910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 664,200,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 676,000,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分4,719,250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10,151,608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30年3月27日 至 平成31年3月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<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31年3月26日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<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30年3月26日現在	平成31年3月26日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	66,172,173	13,301,451,096

合計	66,172,173	13,301,451,096
----	------------	----------------

(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30年3月26日まで、及び平成30年9月20日から平成31年3月26日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	平成30年3月26日 現在				平成31年3月26日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	968,390,000	-	941,925,000	26,465,000	2,342,717,000	-	2,344,650,000	1,933,000
合計	968,390,000	-	941,925,000	26,465,000	2,342,717,000	-	2,344,650,000	1,933,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成30年3月26日現在	平成31年3月26日現在
1口当たり純資産額	1.0396円	1.0282円
(1万口当たり純資産額)	(10,396円)	(10,282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	3,000.00	7,800,000	貸付株式数	1,000株
日本水産	81,300	817.00	66,422,100		
マルハニチロ	11,700	4,075.00	47,677,500		
ハウスイ	500	845.00	422,500	貸付株式数	200株
カネコ種苗	2,200	1,428.00	3,141,600	貸付株式数	800株
サカタのタネ	9,900	3,840.00	38,016,000	貸付株式数	3,900株
ホクト	6,700	2,002.00	13,413,400		
ホクリヨウ	1,000	624.00	624,000	貸付株式数	400株
ヒノキヤグループ	1,700	2,224.00	3,780,800		
ショーボンドHD	5,800	7,500.00	43,500,000	貸付株式数	2,300株 (1,600株)
ミライト・ホールディングス	20,800	1,601.00	33,300,800	貸付株式数	8,300株 (5,500株)
タマホーム	4,500	1,063.00	4,783,500	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
サンヨーホームズ	1,400	897.00	1,255,800	貸付株式数	400株
日本アクア	2,000	557.00	1,114,000		
ファーストコーポレーション	2,300	804.00	1,849,200	貸付株式数	900株
ベステラ	1,600	1,418.00	2,268,800	貸付株式数	600株
スペースバリューHD	9,900	512.00	5,068,800	貸付株式数	3,900株
住石ホールディングス	17,000	103.00	1,751,000	貸付株式数	3,100株
日鉄鉱業	1,900	4,650.00	8,835,000	貸付株式数	700株
三井松島HLDGS	3,300	1,330.00	4,389,000	貸付株式数	100株
国際石油開発帝石	323,800	1,051.00	340,313,800		
石油資源開発	11,700	2,300.00	26,910,000		
K&Oエナジーグループ	3,600	1,595.00	5,742,000	貸付株式数	1,500株
ダイセキ環境ソリューション	1,500	640.00	960,000	貸付株式数	600株
第一カッター興業	900	1,744.00	1,569,600		
安藤・間	52,100	776.00	40,429,600		
東急建設	23,700	854.00	20,239,800		
コムシスホールディングス	28,800	2,966.00	85,420,800		
ミサワホーム	6,800	835.00	5,678,000		
ビーアールホールディングス	6,500	350.00	2,275,000		
高松コンストラクションGP	5,100	2,610.00	13,311,000	貸付株式数	2,000株
東建コーポレーション	2,500	7,200.00	18,000,000	貸付株式数	1,000株

ソネック	800	728.00	582,400	貸付株式数	300株
ヤマウラ	3,000	995.00	2,985,000	貸付株式数	1,500株
大成建設	66,400	5,290.00	351,256,000		
大林組	200,100	1,126.00	225,312,600		
清水建設	204,000	994.00	202,776,000		
飛鳥建設	5,600	1,400.00	7,840,000	貸付株式数	2,200株
長谷工コーポレーション	83,400	1,457.00	121,513,800		
松井建設	7,300	746.00	5,445,800		
銭高組	800	5,490.00	4,392,000	貸付株式数	300株
鹿島建設	156,100	1,668.00	260,374,800		
不動テトラ	5,000	1,498.00	7,490,000		
大末建設	2,300	945.00	2,173,500	貸付株式数	900株
鉄建建設	4,000	2,811.00	11,244,000	貸付株式数	1,100株
西松建設	14,400	2,605.00	37,512,000		
三井住友建設	48,400	782.00	37,848,800		
大豊建設	4,600	3,230.00	14,858,000		
前田建設	47,700	1,146.00	54,664,200	貸付株式数	19,000株
佐田建設	4,000	394.00	1,576,000	貸付株式数	1,600株
ナカノフドー建設	4,900	505.00	2,474,500	貸付株式数	1,900株
奥村組	11,000	3,665.00	40,315,000		
東鉄工業	8,100	3,150.00	25,515,000		
イチケン	1,200	1,937.00	2,324,400		
富士ピー・エス	2,000	511.00	1,022,000	貸付株式数	800株
浅沼組	2,400	2,628.00	6,307,200	貸付株式数	800株
戸田建設	77,800	731.00	56,871,800		
熊谷組	9,600	3,530.00	33,888,000		
青木あすなろ建設	3,600	1,045.00	3,762,000		
北野建設	1,400	3,280.00	4,592,000		
植木組	800	2,372.00	1,897,600	貸付株式数	300株
矢作建設	9,100	831.00	7,562,100		
ピーエス三菱	7,000	685.00	4,795,000		
日本ハウスHLDGS	12,900	459.00	5,921,100	貸付株式数	5,100株
大東建託	23,700	15,850.00	375,645,000		
新日本建設	8,200	1,020.00	8,364,000	貸付株式数	900株
NIPPON	17,400	2,107.00	36,661,800		
東亜道路	1,200	3,040.00	3,648,000		
前田道路	20,800	2,238.00	46,550,400		
日本道路	1,800	6,750.00	12,150,000		
東亜建設	5,900	1,626.00	9,593,400		
若築建設	3,400	1,531.00	5,205,400		

東洋建設	24,300	453.00	11,007,900	
五洋建設	80,100	528.00	42,292,800	
世紀東急	9,700	617.00	5,984,900	貸付株式数 200株
福田組	2,200	4,420.00	9,724,000	貸付株式数 800株
日本ドライケミカル	1,500	1,113.00	1,669,500	
住友林業	46,900	1,525.00	71,522,500	
日本基礎技術	6,600	387.00	2,554,200	貸付株式数 100株
巴コーポレーション	8,300	363.00	3,012,900	貸付株式数 3,300株
大和ハウス	184,200	3,592.00	661,646,400	
ライト工業	12,900	1,484.00	19,143,600	貸付株式数 2,900株
積水ハウス	201,200	1,838.00	369,805,600	貸付株式数 82,000株
日特建設	5,600	618.00	3,460,800	貸付株式数 2,200株
北陸電気工事	3,100	918.00	2,845,800	貸付株式数 1,200株
ユアテック	10,800	848.00	9,158,400	貸付株式数 500株
四電工	1,000	2,740.00	2,740,000	
中電工	7,700	2,343.00	18,041,100	
関電工	30,500	980.00	29,890,000	貸付株式数 12,200株
きんでん	44,200	1,879.00	83,051,800	貸付株式数 700株
東京エネシス	6,800	986.00	6,704,800	
トーエネック	1,900	3,125.00	5,937,500	
住友電設	4,600	1,908.00	8,776,800	
日本電設工業	11,400	2,399.00	27,348,600	
協和エクシオ	26,400	2,999.00	79,173,600	
新日本空調	5,700	2,065.00	11,770,500	
日本工営	3,900	2,376.00	9,266,400	貸付株式数 1,500株
九電工	13,100	3,480.00	45,588,000	
三機工業	15,100	1,244.00	18,784,400	
日揮	57,600	1,504.00	86,630,400	
中外炉工業	1,900	1,842.00	3,499,800	
ヤマト	5,900	508.00	2,997,200	貸付株式数 2,300株
太平電業	4,500	2,440.00	10,980,000	貸付株式数 1,300株
高砂熱学	16,100	1,821.00	29,318,100	貸付株式数 5,900株
三晃金属	800	2,966.00	2,372,800	貸付株式数 300株
NEC ネットエスアイ	6,500	2,684.00	17,446,000	
朝日工業社	1,400	3,040.00	4,256,000	貸付株式数 500株
明星工業	12,000	785.00	9,420,000	貸付株式数 4,800株
大気社	9,100	3,385.00	30,803,500	貸付株式数 3,600株 (2,100株)
ダイダン	4,500	2,721.00	12,244,500	
日比谷総合設備	6,100	1,933.00	11,791,300	貸付株式数 1,300株

東芝プラントシステム	14,500	2,001.00	29,014,500	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
日本製粉	19,000	1,966.00	37,354,000	貸付株式数 4,700株
日清製粉G本社	67,600	2,566.00	173,461,600	
日東富士製粉	400	6,300.00	2,520,000	貸付株式数 100株
昭和産業	5,500	3,085.00	16,967,500	貸付株式数 2,200株
鳥越製粉	5,300	784.00	4,155,200	貸付株式数 2,100株
中部飼料	7,000	1,241.00	8,687,000	貸付株式数 600株
フィード・ワン	40,000	182.00	7,280,000	
東洋精糖	900	1,043.00	938,700	貸付株式数 300株
日本甜菜糖	3,400	2,097.00	7,129,800	
三井製糖	4,600	2,943.00	13,537,800	貸付株式数 1,300株
塩水港精糖	6,500	239.00	1,553,500	貸付株式数 2,600株
日新製糖	2,900	2,103.00	6,098,700	貸付株式数 1,100株
L I F U L L	19,900	564.00	11,223,600	貸付株式数 7,900株
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	42,800	3,105.00	132,894,000	貸付株式数 17,000株
メンバーズ	1,900	1,782.00	3,385,800	貸付株式数 200株
中広	500	574.00	287,000	貸付株式数 200株
タケエイ	5,900	729.00	4,301,100	
E・Jホールディングス	700	1,097.00	767,900	貸付株式数 200株
トラスト・テック	2,700	3,620.00	9,774,000	貸付株式数 1,000株
コシダカホールディングス	15,300	1,632.00	24,969,600	貸付株式数 6,100株
アルトナー	1,000	915.00	915,000	
パソナグループ	5,400	1,560.00	8,424,000	貸付株式数 2,100株 (500株)
C D S	1,400	1,213.00	1,698,200	貸付株式数 500株
リンクアンドモチベーショ ン	10,500	787.00	8,263,500	貸付株式数 4,200株
G C A	5,800	811.00	4,703,800	貸付株式数 2,300株
エス・エム・エス	21,100	1,952.00	41,187,200	貸付株式数 4,200株
パーソルホールディングス	57,500	1,817.00	104,477,500	
リニカル	3,200	1,396.00	4,467,200	貸付株式数 1,200株
クックパッド	18,000	271.00	4,878,000	貸付株式数 7,100株
エスクリ	1,600	646.00	1,033,600	貸付株式数 600株
アイ・ケイ・ケイ	2,800	785.00	2,198,000	貸付株式数 1,100株
森永製菓	15,000	4,955.00	74,325,000	
中村屋	1,600	4,545.00	7,272,000	貸付株式数 600株
江崎グリコ	17,900	5,910.00	105,789,000	貸付株式数 4,600株

名糖産業	2,900	1,541.00	4,468,900	貸付株式数	1,100株
井村屋グループ	2,600	2,515.00	6,539,000		
不二家	3,300	2,204.00	7,273,200	貸付株式数	1,300株
山崎製パン	48,600	1,824.00	88,646,400	貸付株式数	19,600株
第一屋製パン	1,100	1,030.00	1,133,000	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,000	5,030.00	5,030,000	貸付株式数	400株
亀田製菓	3,700	5,520.00	20,424,000	貸付株式数	1,200株
寿スピリッツ	6,400	4,305.00	27,552,000	貸付株式数	1,500株
カルビー	27,200	3,045.00	82,824,000		
森永乳業	12,000	3,760.00	45,120,000	貸付株式数	4,800株
六甲バター	4,300	2,233.00	9,601,900	貸付株式数	1,700株
ヤクルト	44,200	7,710.00	340,782,000		
明治ホールディングス	42,200	8,980.00	378,956,000		
雪印メグミルク	14,500	2,733.00	39,628,500		
プリマハム	8,400	2,117.00	17,782,800		
日本ハム	24,700	4,085.00	100,899,500		
林兼産業	1,800	573.00	1,031,400		
丸大食品	6,400	1,966.00	12,582,400		
S Foods	5,400	4,110.00	22,194,000	貸付株式数	2,100株
伊藤ハム米久HLDGS	38,000	722.00	27,436,000	貸付株式数	14,300株
学情	2,300	1,257.00	2,891,100	貸付株式数	900株 (900株)
スタジオアリス	2,900	2,293.00	6,649,700	貸付株式数	1,100株
シミックホールディングス	3,200	1,588.00	5,081,600	貸付株式数	1,200株
システナ	21,000	1,151.00	24,171,000		
NJS	1,200	1,456.00	1,747,200	貸付株式数	400株
デジタルアーツ	3,200	8,820.00	28,224,000	貸付株式数	1,000株
新日鉄住金SOL	8,800	2,939.00	25,863,200		
総合警備保障	22,700	4,800.00	108,960,000		
キューブシステム	3,100	821.00	2,545,100	貸付株式数	1,000株
いちご	74,300	386.00	28,679,800		
エイジア	1,200	1,368.00	1,641,600	貸付株式数	400株
日本駐車場開発	75,600	169.00	12,776,400	貸付株式数	28,500株
コア	2,500	1,200.00	3,000,000	貸付株式数	900株
カカクコム	43,100	2,078.00	89,561,800		
アイロムグループ	2,200	1,472.00	3,238,400	貸付株式数	800株 (800株)
セントケア・ホールディング	3,100	564.00	1,748,400	貸付株式数	1,200株
サイネックス	900	740.00	666,000	貸付株式数	300株

ルネサンス	3,100	2,093.00	6,488,300	貸付株式数	1,200株
ディップ	9,200	1,858.00	17,093,600	貸付株式数	3,600株
SBSホールディングス	6,100	1,787.00	10,900,700	貸付株式数	2,300株 (2,300株)
オプトホールディング	3,500	1,763.00	6,170,500	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
新日本科学	7,900	838.00	6,620,200	貸付株式数	2,500株
ツクイ	13,400	726.00	9,728,400	貸付株式数	5,300株
キャリアデザインセンター	1,400	1,270.00	1,778,000	貸付株式数	500株
ベネフィット・ワン	10,200	2,058.00	20,991,600		
エムスリー	120,500	1,839.00	221,599,500		
ツカダ・グローバルHOLD	3,800	610.00	2,318,000	貸付株式数	1,400株
プラス	500	611.00	305,500	貸付株式数	100株
アウトソーシング	30,200	1,321.00	39,894,200	貸付株式数	12,000株
ウェルネット	5,700	1,079.00	6,150,300	貸付株式数	2,300株
ワールドホールディングス	1,600	1,882.00	3,011,200		
ディー・エヌ・エー	31,000	1,695.00	52,545,000		
博報堂DYHLDGS	79,900	1,811.00	144,698,900		
ぐるなび	8,100	730.00	5,913,000		
エスアールジータカミヤ	6,100	671.00	4,093,100	貸付株式数	2,300株
ジャパンベストレスキューS	4,400	1,582.00	6,960,800	貸付株式数	1,700株
ファンコミュニケーションズ	15,900	580.00	9,222,000		
ライク	2,200	921.00	2,026,200	貸付株式数	800株
ビジネス・ブレークスルー	2,300	406.00	933,800	貸付株式数	800株
WDBホールディングス	2,600	3,110.00	8,086,000	貸付株式数	1,000株
ティア	2,600	680.00	1,768,000		
CDG	500	1,320.00	660,000	貸付株式数	200株
バリューコマース	3,900	2,237.00	8,724,300	貸付株式数	1,500株
インフォマート	31,300	1,340.00	41,942,000	貸付株式数	12,500株
サッポロホールディングス	21,800	2,546.00	55,502,800	貸付株式数	8,700株
アサヒグループホールディング	124,900	4,838.00	604,266,200	貸付株式数	50,300株
麒麟HD	269,900	2,597.00	700,930,300	貸付株式数	108,700株
宝ホールディングス	45,100	1,362.00	61,426,200		
オエノンホールディングス	16,900	415.00	7,013,500	貸付株式数	6,700株
養命酒	1,900	2,194.00	4,168,600	貸付株式数	200株

コカ・コーラボトラーズJHD	45,700	2,776.00	126,863,200	貸付株式数	18,400株
サントリー食品インター	39,900	5,130.00	204,687,000	貸付株式数	16,000株
ダイドーグループHD	3,400	5,090.00	17,306,000	貸付株式数	1,300株
伊藤園	18,300	5,590.00	102,297,000		
キーコーヒー	5,900	2,161.00	12,749,900	貸付株式数	2,300株
ユニカフェ	1,800	998.00	1,796,400	貸付株式数	600株
ジャパンフーズ	800	1,306.00	1,044,800	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	7,700	3,415.00	26,295,500		
不二製油グループ	14,700	3,775.00	55,492,500		
かどや製油	600	5,410.00	3,246,000		
J-オイルミルズ	3,100	4,230.00	13,113,000		
ローソン	14,800	6,270.00	92,796,000	貸付株式数	4,100株
サンエー	4,500	4,425.00	19,912,500	貸付株式数	1,700株
カワチ薬品	4,600	1,803.00	8,293,800		
エービーシー・マート	9,200	6,660.00	61,272,000	貸付株式数	3,600株
ハードオフコーポレーション	2,300	845.00	1,943,500		
高千穂交易	2,200	1,016.00	2,235,200	貸付株式数	800株
アスクル	5,200	2,772.00	14,414,400	貸付株式数	2,000株 (400株)
ゲオホールディングス	9,000	1,511.00	13,599,000	貸付株式数	3,000株
アダストリア	8,200	2,478.00	20,319,600	貸付株式数	700株
ジーフット	3,900	661.00	2,577,900		
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	700	725.00	507,500	貸付株式数	200株
伊藤忠食品	1,400	4,965.00	6,951,000		
くらコーポレーション	3,500	5,130.00	17,955,000	貸付株式数	1,300株
キャンドウ	2,800	1,694.00	4,743,200	貸付株式数	1,100株
エレマテック	2,700	1,758.00	4,746,600		
バルグループHLDGS	3,000	3,175.00	9,525,000	貸付株式数	1,200株
JALUX	1,700	2,649.00	4,503,300	貸付株式数	400株
エディオン	25,100	1,003.00	25,175,300	貸付株式数	9,900株
あらた	3,300	3,915.00	12,919,500	貸付株式数	1,200株
サーラコーポレーション	11,900	634.00	7,544,600	貸付株式数	1,900株
ワッツ	2,000	740.00	1,480,000	貸付株式数	700株
トーメンデバイス	900	2,529.00	2,276,100	貸付株式数	100株
ハローズ	2,200	2,196.00	4,831,200	貸付株式数	300株
J Pホールディングス	16,100	288.00	4,636,800	貸付株式数	6,400株 (2,000株)

あみやき亭	1,300	3,750.00	4,875,000	貸付株式数	500株
東京エレクトロニクス	2,100	1,851.00	3,887,100	貸付株式数	100株
ひらまつ	11,600	358.00	4,152,800	貸付株式数	4,600株
フィールズ	5,200	713.00	3,707,600	貸付株式数	1,200株
双日	324,800	403.00	130,894,400		
アルフレッサホールディングス	65,300	3,225.00	210,592,500		
大黒天物産	1,400	3,845.00	5,383,000	貸付株式数	500株
ハニーズホールディングス	5,600	1,129.00	6,322,400	貸付株式数	900株
ファーマライズHD	1,400	539.00	754,600	貸付株式数	500株 (500株)
キッコーマン	39,500	5,490.00	216,855,000		
味の素	130,800	1,820.00	238,056,000		
キューピー	33,100	2,682.00	88,774,200	貸付株式数	13,300株
ハウス食品G本社	23,000	4,535.00	104,305,000		
カゴメ	24,000	3,145.00	75,480,000	貸付株式数	9,600株
焼津水産化工	2,900	1,184.00	3,433,600	貸付株式数	1,000株
アリアケジャパン	5,500	6,190.00	34,045,000		
ピエトロ	700	1,680.00	1,176,000	貸付株式数	200株
エバラ食品工業	1,400	2,252.00	3,152,800	貸付株式数	300株
ニチレイ	31,200	2,716.00	84,739,200		
横浜冷凍	15,400	915.00	14,091,000	貸付株式数	4,300株
東洋水産	30,700	4,255.00	130,628,500		
イトアンド	2,000	1,719.00	3,438,000	貸付株式数	800株
大冷	700	1,815.00	1,270,500	貸付株式数	200株
ヨシムラ・フード・HLD GS	1,600	552.00	883,200	貸付株式数	600株
日清食品HD	25,300	7,730.00	195,569,000		
永谷園ホールディングス	3,100	2,663.00	8,255,300		
一正蒲鉾	2,300	1,142.00	2,626,600	貸付株式数	900株
フジッコ	6,500	2,262.00	14,703,000	貸付株式数	2,500株
ロックフィールド	6,500	1,675.00	10,887,500		
日本たばこ産業	344,000	2,767.50	952,020,000	貸付株式数	138,600株
ケンコーマヨネーズ	3,300	2,264.00	7,471,200	貸付株式数	1,300株
わらべや日洋HD	3,900	1,875.00	7,312,500	貸付株式数	600株
なとり	3,300	1,705.00	5,626,500		
イフジ産業	1,000	718.00	718,000	貸付株式数	400株
ピクルスコーポレーション	1,400	1,914.00	2,679,600	貸付株式数	500株
北の達人コーポ	23,500	429.00	10,081,500	貸付株式数	8,600株

ユーグレナ	25,000	684.00	17,100,000	貸付株式数 10,000株 (5,800株)
片倉工業	7,200	1,300.00	9,360,000	貸付株式数 2,800株
グ ン ゼ	4,000	4,755.00	19,020,000	
ヒューリック	122,100	1,100.00	134,310,000	貸付株式数 49,300株
神 栄	700	835.00	584,500	貸付株式数 200株
ラサ商事	3,200	870.00	2,784,000	貸付株式数 1,200株
アルペン	4,500	1,745.00	7,852,500	貸付株式数 1,600株
ハブ	1,900	992.00	1,884,800	貸付株式数 700株
ラクーンホールディングス	3,400	685.00	2,329,000	貸付株式数 1,200株
クオールホールディングス	8,700	1,505.00	13,093,500	貸付株式数 3,400株
アルコニックス	6,200	1,306.00	8,097,200	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
神戸物産	8,900	3,945.00	35,110,500	
ソリトンシステムズ	3,300	1,124.00	3,709,200	貸付株式数 1,300株
ジンズ	4,000	5,970.00	23,880,000	貸付株式数 1,600株
ビックカメラ	31,600	1,207.00	38,141,200	貸付株式数 12,500株
D C Mホールディングス	31,900	1,056.00	33,686,400	貸付株式数 12,600株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	4,700	2,224.00	10,452,800	貸付株式数 1,800株 (300株)
M o n o t a R O	37,400	2,454.00	91,779,600	貸付株式数 11,600株
東京一番フーズ	1,400	625.00	875,000	貸付株式数 500株 (500株)
D Dホールディングス	1,300	1,885.00	2,450,500	貸付株式数 500株
あい ホールディングス	8,700	1,872.00	16,286,400	貸付株式数 3,300株
ディーブイエックス	2,300	1,003.00	2,306,900	貸付株式数 900株
きちりホールディングス	1,500	771.00	1,156,500	
アークランドサービスHD	4,300	2,067.00	8,888,100	貸付株式数 1,700株
J . フロント リテイリ ング	72,700	1,301.00	94,582,700	貸付株式数 30,100株
ドトール・日レスHD	10,400	2,148.00	22,339,200	貸付株式数 4,100株
マツモトキヨシH L D G S	24,300	3,720.00	90,396,000	
ブロンコビリー	3,100	2,695.00	8,354,500	貸付株式数 1,400株 (900株)
Z O Z O	63,600	2,030.00	129,108,000	
トレジャー・ファクトリー	1,700	772.00	1,312,400	貸付株式数 600株
物語コーポレーション	1,500	9,120.00	13,680,000	貸付株式数 500株
ココカラファイン	6,600	4,600.00	30,360,000	貸付株式数 1,200株
三越伊勢丹HD	108,900	1,143.00	124,472,700	

東洋紡	24,900	1,536.00	38,246,400	
ユニチカ	17,300	439.00	7,594,700	貸付株式数 6,800株
富士紡ホールディングス	3,000	2,789.00	8,367,000	貸付株式数 1,200株
日清紡ホールディングス	33,200	955.00	31,706,000	貸付株式数 13,200株
倉敷紡績	5,500	2,172.00	11,946,000	
ダイワボウHD	5,400	6,390.00	34,506,000	
シキボウ	3,200	1,065.00	3,408,000	
日東紡績	9,000	2,073.00	18,657,000	
トヨタ紡織	20,700	1,735.00	35,914,500	
マクニカ・富士エレHLDGS	16,100	1,524.00	24,536,400	貸付株式数 6,500株
Hamee	1,500	771.00	1,156,500	貸付株式数 600株
ラクト・ジャパン	1,300	8,670.00	11,271,000	
ウエルシアHD	15,600	3,740.00	58,344,000	貸付株式数 6,200株
クリエイトSDH	8,800	2,788.00	24,534,400	貸付株式数 3,400株
バイタルKSKHD	11,000	1,108.00	12,188,000	貸付株式数 800株
八洲電機	5,400	867.00	4,681,800	貸付株式数 1,800株
メディアスホールディングス	3,200	685.00	2,192,000	貸付株式数 1,200株
UKCホールディングス	3,800	1,978.00	7,516,400	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ジューテックHD	1,300	1,060.00	1,378,000	貸付株式数 500株
丸善CHIHD	6,600	367.00	2,422,200	貸付株式数 2,600株
大光	1,400	682.00	954,800	
OCHIホールディングス	1,800	1,301.00	2,341,800	貸付株式数 600株 (100株)
TOKAIホールディングス	31,200	888.00	27,705,600	貸付株式数 12,400株
黒谷	1,000	452.00	452,000	貸付株式数 300株
ミサワ	1,000	410.00	410,000	貸付株式数 400株
ティーライフ	800	925.00	740,000	貸付株式数 300株
Cominix	900	893.00	803,700	貸付株式数 300株
エー・ピーカンパニー	900	562.00	505,800	貸付株式数 300株
三洋貿易	3,000	1,861.00	5,583,000	
チムニー	1,700	2,662.00	4,525,400	貸付株式数 600株
シュッピン	4,000	811.00	3,244,000	貸付株式数 1,600株
ビューティガレージ	800	1,419.00	1,135,200	貸付株式数 300株
ウイン・パートナーズ	3,700	1,238.00	4,580,600	貸付株式数 1,400株
ネクステージ	9,000	1,179.00	10,611,000	貸付株式数 3,600株
ジョイフル本田	17,300	1,431.00	24,756,300	貸付株式数 6,900株

鳥貴族	1,900	1,757.00	3,338,300	貸付株式数	900株
キリン堂ホールディングス	2,300	1,511.00	3,475,300	貸付株式数	900株
ホットランド	3,000	1,523.00	4,569,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
すかいらーくHD	55,000	1,809.00	99,495,000	貸付株式数	21,900株 (2,800株)
綿半ホールディングス	2,200	2,223.00	4,890,600	貸付株式数	800株
日本毛織	19,700	949.00	18,695,300	貸付株式数	7,700株
ダイトウボウ	12,700	82.00	1,041,400	貸付株式数	3,800株
トーア紡コーポレーション	2,600	452.00	1,175,200	貸付株式数	900株
ガイドーリミテッド	6,900	337.00	2,325,300	貸付株式数	2,700株 (200株)
ヨシックス	1,000	3,480.00	3,480,000		
ユナイテッド・スーパー マーケ	17,200	1,134.00	19,504,800	貸付株式数	6,800株
三栄建築設計	2,600	1,637.00	4,256,200	貸付株式数	900株
野村不動産HLDGS	38,100	2,195.00	83,629,500		
三重交通グループHD	12,500	583.00	7,287,500	貸付株式数	4,400株 (1,000株)
サムティ	8,300	1,515.00	12,574,500	貸付株式数	3,200株
エー・ディー・ワークス	96,100	34.00	3,267,400		
日本商業開発	4,100	1,624.00	6,658,400	貸付株式数	1,900株
プレサンスコーポレーショ ン	9,600	1,411.00	13,545,600	貸付株式数	3,700株
ユニゾホールディングス	8,600	2,141.00	18,412,600	貸付株式数	3,100株
日本管理センター	4,100	792.00	3,247,200	貸付株式数	1,500株
サンセイランディック	1,900	745.00	1,415,500	貸付株式数	600株
エストラスト	1,300	725.00	942,500	貸付株式数	500株
フージャースHD	13,400	684.00	9,165,600	貸付株式数	6,000株
オープンハウス	9,600	3,890.00	37,344,000		
東急不動産HD	156,400	667.00	104,318,800		
飯田GHD	48,200	2,063.00	99,436,600		
イーランド	1,100	723.00	795,300	貸付株式数	100株
帝国繊維	6,600	2,863.00	18,895,800	貸付株式数	2,600株
日本コークス工業	50,100	104.00	5,210,400		
ゴルフダイジェスト・オン	2,400	643.00	1,543,200	貸付株式数	900株
ミタチ産業	1,400	744.00	1,041,600	貸付株式数	500株
B E E N O S	1,400	1,153.00	1,614,200	貸付株式数	200株
あさひ	4,800	1,541.00	7,396,800		
日本調剤	2,100	3,975.00	8,347,500	貸付株式数	800株

コスモス薬品	2,600	19,320.00	50,232,000	貸付株式数	1,100株
シップヘルスケアHD	12,300	4,535.00	55,780,500	貸付株式数	2,400株
トーエル	2,800	850.00	2,380,000	貸付株式数	100株
ソフトクリエイイトHD	2,500	1,551.00	3,877,500	貸付株式数	1,000株
オンリー	1,000	1,009.00	1,009,000	貸付株式数	300株
セブン&アイ・HLDGS	245,300	4,351.00	1,067,300,300	貸付株式数	98,700株
薬王堂	2,500	2,639.00	6,597,500	貸付株式数	1,000株
クリエイイト・レストランツ・ホール	15,800	1,366.00	21,582,800	貸付株式数	6,300株
明治電機工業	1,800	1,726.00	3,106,800		
ツルハホールディングス	12,800	9,170.00	117,376,000	貸付株式数	5,100株
デリカフーズHLDGS	1,000	1,400.00	1,400,000	貸付株式数	400株
スターティアホールディングス	1,100	578.00	635,800	貸付株式数	400株
サンマルクホールディングス	4,700	2,599.00	12,215,300		
フェリシモ	1,300	1,138.00	1,479,400	貸付株式数	500株
トリドールホールディングス	7,300	2,253.00	16,446,900	貸付株式数	2,800株 (800株)
帝人	47,400	1,886.00	89,396,400		
東レ	451,400	731.90	330,379,660		
クラレ	98,100	1,444.00	141,656,400	貸付株式数	39,500株
旭化成	414,000	1,194.00	494,316,000		
サカイオーベックス	1,400	1,811.00	2,535,400		
TOKYO BASE	5,200	956.00	4,971,200		
稲葉製作所	3,200	1,424.00	4,556,800	貸付株式数	800株
宮地エンジニアリングG	1,800	1,940.00	3,492,000		
トーカロ	15,300	880.00	13,464,000		
アルファCO	2,100	1,338.00	2,809,800		
SUMCO	65,200	1,247.00	81,304,400	貸付株式数	26,100株
川田テクノロジーズ	1,300	7,850.00	10,205,000	貸付株式数	200株
RS TECHNOLOGIES	1,200	2,906.00	3,487,200	貸付株式数	400株
ビーロッド	1,000	1,490.00	1,490,000	貸付株式数	300株
ファーストブラザーズ	1,600	1,109.00	1,774,400	貸付株式数	200株
ハウスドゥ	2,300	1,389.00	3,194,700	貸付株式数	900株
シーアールイー	2,400	962.00	2,308,800	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	800	1,145.00	916,000	貸付株式数	200株
ケイアイスター不動産	1,800	1,732.00	3,117,600		
アグレ都市デザイン	1,000	570.00	570,000		

ジェイ・エス・ビー	200	3,830.00	766,000		
テンポイノベーション	500	1,585.00	792,500	貸付株式数	100株
住江織物	1,600	2,760.00	4,416,000	貸付株式数	600株
日本フェルト	3,200	475.00	1,520,000	貸付株式数	700株
イチカワ	800	1,412.00	1,129,600		
エコナックホールディングス	10,400	122.00	1,268,800	貸付株式数	700株
日東製網	600	1,419.00	851,400	貸付株式数	200株
芦森工業	1,200	1,673.00	2,007,600	貸付株式数	400株
アツギ	4,800	1,002.00	4,809,600	貸付株式数	1,900株
ウイルプラスHLDGS	500	855.00	427,500		
ジャパンミート	2,200	1,945.00	4,279,000		
コメダホールディングス	13,600	2,115.00	28,764,000		
サツドラホールディングス	1,000	1,883.00	1,883,000	貸付株式数	300株
デファクトスタンダード	400	422.00	168,800	貸付株式数	100株
ダイユー・リックHLDGS	3,200	899.00	2,876,800	貸付株式数	1,200株
バロックジャパン	4,700	868.00	4,079,600	貸付株式数	400株
クスリのアオキHLDGS	4,900	7,710.00	37,779,000	貸付株式数	1,500株
ダイニック	2,400	759.00	1,821,600	貸付株式数	400株
共和レザー	3,400	767.00	2,607,800	貸付株式数	1,300株
力の源HD	1,600	781.00	1,249,600	貸付株式数	600株
スシローグローバルHLDGS	6,500	7,590.00	49,335,000		
LIXILピバ	4,900	1,452.00	7,114,800	貸付株式数	1,900株
セーレン	14,400	1,710.00	24,624,000		
ソトー	2,200	995.00	2,189,000	貸付株式数	800株
東海染工	700	1,116.00	781,200		
小松マテーレ	9,600	829.00	7,958,400		
ワコールホールディングス	16,600	2,761.00	45,832,600		
ホギメディカル	7,300	3,955.00	28,871,500	貸付株式数	2,200株
レナウン	16,700	102.00	1,703,400	貸付株式数	6,600株
クラウディアHLDGS	1,400	492.00	688,800	貸付株式数	500株
T S Iホールディングス	21,500	673.00	14,469,500	貸付株式数	8,600株
マツオカコーポレーション	1,800	3,475.00	6,255,000	貸付株式数	700株
ワールド	5,900	2,282.00	13,463,800		
T I S	19,700	5,110.00	100,667,000		
ネオス	2,100	1,000.00	2,100,000	貸付株式数	800株
電算システム	2,200	3,320.00	7,304,000	貸付株式数	700株
グリー	31,800	452.00	14,373,600	貸付株式数	12,700株

コーエーテクモHD	12,000	2,132.00	25,584,000		
三菱総合研究所	2,300	3,405.00	7,831,500		
ボルテージ	1,200	544.00	652,800	貸付株式数	400株
電算	700	2,119.00	1,483,300	貸付株式数	200株 (100株)
AGS	3,300	742.00	2,448,600	貸付株式数	1,300株
ファインデックス	5,000	748.00	3,740,000	貸付株式数	1,900株
ブレインパッド	1,200	6,210.00	7,452,000	貸付株式数	500株
KLab	10,500	845.00	8,872,500	貸付株式数	4,200株
ポルトゥウィン・ピット クル	7,800	1,089.00	8,494,200	貸付株式数	3,100株
イーブックイニシアティブ	900	1,589.00	1,430,100		
ネクソン	149,000	1,737.00	258,813,000	貸付株式数	59,800株
アイスタイル	15,000	850.00	12,750,000	貸付株式数	6,000株
エムアップ	2,000	2,900.00	5,800,000	貸付株式数	800株
エイチーム	3,600	1,807.00	6,505,200	貸付株式数	1,700株
テクノスジャパン	4,900	725.00	3,552,500	貸付株式数	2,000株
enish	2,000	492.00	984,000	貸付株式数	700株
コロプラ	16,500	696.00	11,484,000	貸付株式数	6,700株 (4,500株)
オルトプラス	3,600	299.00	1,076,400	貸付株式数	1,400株
ブロードリーフ	29,200	581.00	16,965,200	貸付株式数	11,600株
クロス・マーケティングG	1,700	400.00	680,000		
デジタルハーツHLDGS	2,700	1,314.00	3,547,800	貸付株式数	1,100株
メディアドゥHLDGS	1,800	2,871.00	5,167,800	貸付株式数	700株
じげん	6,300	570.00	3,591,000	貸付株式数	2,400株 (1,400株)
ブイキューブ	3,100	445.00	1,379,500	貸付株式数	1,200株
サイバーリンクス	900	1,085.00	976,500		
フィックスターズ	5,600	1,341.00	7,509,600	貸付株式数	2,200株
CARTAHOLDINGS	3,100	1,038.00	3,217,800	貸付株式数	1,200株
オブティム	1,300	5,200.00	6,760,000	貸付株式数	500株
セレス	1,900	2,038.00	3,872,200		
特種東海製紙	3,600	4,300.00	15,480,000		
ベリサーブ	200	6,690.00	1,338,000	貸付株式数	200株
ティーガイア	5,900	1,952.00	11,516,800		
セック	900	3,320.00	2,988,000	貸付株式数	300株
日本アジアグループ	6,400	353.00	2,259,200	貸付株式数	2,400株
豆蔵ホールディングス	4,000	1,032.00	4,128,000		

テクマトリックス	4,100	1,827.00	7,490,700		
プロシップ	1,600	1,293.00	2,068,800	貸付株式数	600株
ガンホー・オンライン・エンター	141,700	403.00	57,105,100		
GMOペイメントゲートウェイ	9,700	7,750.00	75,175,000	貸付株式数	3,800株
ザッパラス	3,000	430.00	1,290,000	貸付株式数	1,200株
システムリサーチ	800	2,958.00	2,366,400	貸付株式数	300株
インターネットイニシアティブ	9,600	2,136.00	20,505,600	貸付株式数	2,800株
さくらインターネット	7,000	519.00	3,633,000	貸付株式数	2,800株
ヴィンクス	2,000	955.00	1,910,000	貸付株式数	700株
GMOクラウド	1,300	3,710.00	4,823,000		
SRAホールディングス	3,100	2,594.00	8,041,400	貸付株式数	1,200株
MINORISソリューションズ	1,100	1,586.00	1,744,600	貸付株式数	400株
システムインテグレータ	1,600	768.00	1,228,800	貸付株式数	600株
朝日ネット	4,900	537.00	2,631,300	貸付株式数	1,900株
eBASE	1,700	2,407.00	4,091,900		
アバント	1,600	1,545.00	2,472,000	貸付株式数	200株
アドソル日進	2,000	1,612.00	3,224,000	貸付株式数	800株
フリービット	4,000	931.00	3,724,000	貸付株式数	1,300株
コムチュア	3,300	3,390.00	11,187,000		
サイバーコム	1,000	2,026.00	2,026,000	貸付株式数	400株
アステリア	2,900	949.00	2,752,100	貸付株式数	1,100株
王子ホールディングス	263,200	709.00	186,608,800		
日本製紙	27,900	2,337.00	65,202,300	貸付株式数	600株
三菱製紙	9,800	561.00	5,497,800		
北越コーポレーション	39,200	669.00	26,224,800		
中越パルプ	2,600	1,410.00	3,666,000	貸付株式数	100株
巴川製紙	1,900	1,033.00	1,962,700	貸付株式数	200株
大王製紙	28,700	1,344.00	38,572,800	貸付株式数	8,000株
阿波製紙	1,500	499.00	748,500	貸付株式数	600株 (100株)
マークライنز	2,000	1,360.00	2,720,000		
メディカル・データ・ビジ	5,200	1,109.00	5,766,800	貸付株式数	2,000株
gumi	6,700	714.00	4,783,800	貸付株式数	2,400株
ショーケース・ティービー	1,200	720.00	864,000	貸付株式数	400株
モバイルファクトリー	1,600	1,427.00	2,283,200	貸付株式数	600株

デジタル・インフォメーション	2,600	1,425.00	3,705,000	貸付株式数	1,000株
P C Iホールディングス	1,000	2,479.00	2,479,000	貸付株式数	400株
パイブドHD	900	903.00	812,700	貸付株式数	300株
アイビーシー	900	1,444.00	1,299,600	貸付株式数	300株
ネオジャパン	1,100	915.00	1,006,500	貸付株式数	400株
P R T I M E S	400	2,015.00	806,000	貸付株式数	100株
ランドコンピュータ	700	1,208.00	845,600		
オープンドア	2,900	3,290.00	9,541,000	貸付株式数	1,100株
マイネット	1,900	1,011.00	1,920,900	貸付株式数	700株
アカツキ	2,100	5,880.00	12,348,000	貸付株式数	800株
ベネフィットジャパン	300	894.00	268,200	貸付株式数	100株
U B I C O Mホールディングス	1,100	1,330.00	1,463,000	貸付株式数	400株
L I N E	18,000	3,820.00	68,760,000	貸付株式数	7,100株 (2,100株)
カナミックネットワーク	900	1,939.00	1,745,100	貸付株式数	300株
ノムラシステムコーポレーション	500	702.00	351,000		
レンゴー	60,500	1,022.00	61,831,000		
トーモク	3,500	1,742.00	6,097,000	貸付株式数	1,300株
ザ・パック	4,400	3,580.00	15,752,000	貸付株式数	1,700株
チェンジ	800	3,770.00	3,016,000	貸付株式数	300株
シンクロ・フード	2,400	567.00	1,360,800	貸付株式数	900株
オークネット	3,100	1,351.00	4,188,100	貸付株式数	1,200株
A O I T Y O H O L D I N G S	6,400	788.00	5,043,200	貸付株式数	2,500株
マクロミル	7,400	1,335.00	9,879,000	貸付株式数	2,900株
ビーグリー	1,100	940.00	1,034,000	貸付株式数	100株
オロ	600	5,690.00	3,414,000	貸付株式数	200株
昭和電工	38,800	3,805.00	147,634,000	貸付株式数	15,500株
住友化学	455,300	534.00	243,130,200		
住友精化	2,900	4,100.00	11,890,000	貸付株式数	800株
日産化学	35,900	5,130.00	184,167,000		
ラサ工業	2,100	1,581.00	3,320,100	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,400	6,460.00	34,884,000		
多木化学	1,800	5,970.00	10,746,000	貸付株式数	600株
テイカ	4,800	2,610.00	12,528,000		
石原産業	11,200	1,168.00	13,081,600		
片倉コープアグリ	2,200	1,201.00	2,642,200		

日東エフシー	3,800	813.00	3,089,400	貸付株式数	1,200株
日本曹達	9,300	3,025.00	28,132,500		
東ソー	89,600	1,740.00	155,904,000		
トクヤマ	16,900	2,658.00	44,920,200		
セントラル硝子	12,800	2,450.00	31,360,000		
東亜合成	36,600	1,215.00	44,469,000	貸付株式数	14,700株
大阪ソーダ	6,400	2,805.00	17,952,000	貸付株式数	2,500株
関東電化	13,900	756.00	10,508,400		
デンカ	23,000	3,240.00	74,520,000		
イビデン	36,500	1,718.00	62,707,000		
信越化学	102,600	9,239.00	947,921,400		
日本カ-バイド	2,000	1,545.00	3,090,000	貸付株式数	800株
堺化学	3,900	2,511.00	9,792,900		
第一稀元素化学工	4,800	886.00	4,252,800	貸付株式数	1,900株
エア・ウォーター	47,400	1,652.00	78,304,800		
大陽日酸	48,200	1,674.00	80,686,800		
日本化学工業	2,000	2,041.00	4,082,000		
東邦アセチレン	1,000	1,476.00	1,476,000	貸付株式数	300株
日本パ-カラライジング	31,500	1,455.00	45,832,500		
高圧ガス	9,500	896.00	8,512,000		
チタン工業	800	2,351.00	1,880,800		
四国化成	9,900	1,219.00	12,068,100	貸付株式数	2,100株
戸田工業	1,300	2,225.00	2,892,500		
ステラケミファ	3,400	3,100.00	10,540,000	貸付株式数	1,300株
保土谷化学	2,000	3,290.00	6,580,000		
日本触媒	9,800	7,510.00	73,598,000	貸付株式数	200株
大日精化	4,800	3,210.00	15,408,000		
カネカ	15,000	4,250.00	63,750,000		
協和発酵キリン	69,900	2,339.00	163,496,100	貸付株式数	29,900株
三菱瓦斯化学	59,700	1,663.00	99,281,100		
三井化学	52,200	2,738.00	142,923,600		
J S R	58,300	1,771.00	103,249,300		
東京応化工業	10,000	3,175.00	31,750,000	貸付株式数	4,000株
大阪有機化学	5,400	1,107.00	5,977,800	貸付株式数	2,100株
三菱ケミカルH L D G S	388,500	828.10	321,716,850	貸付株式数	161,600株
K Hネオケム	8,900	2,743.00	24,412,700	貸付株式数	3,500株
ダイセル	85,100	1,193.00	101,524,300		
住友ベ-クライト	10,100	4,085.00	41,258,500		
積水化学	126,800	1,849.00	234,453,200		

日本ゼオン	52,500	1,140.00	59,850,000	貸付株式数 21,100株 (21,100株)
アイカ工業	17,600	3,690.00	64,944,000	
宇部興産	29,300	2,404.00	70,437,200	
積水樹脂	9,700	1,991.00	19,312,700	貸付株式数 3,400株
タキロンシーアイ	12,600	649.00	8,177,400	
旭有機材	4,000	1,691.00	6,764,000	
日立化成	27,200	2,491.00	67,755,200	
ニチバン	3,100	2,280.00	7,068,000	貸付株式数 200株
リケンテクノス	16,300	462.00	7,530,600	貸付株式数 1,600株
大倉工業	3,000	1,821.00	5,463,000	貸付株式数 1,200株
積水化成成品	8,700	938.00	8,160,600	貸付株式数 2,500株
群栄化学	1,600	2,675.00	4,280,000	貸付株式数 600株
タイガース ポリマー	2,800	612.00	1,713,600	貸付株式数 1,100株
ミライアル	1,700	1,073.00	1,824,100	
ダイキアクシス	2,000	837.00	1,674,000	
ダイキョーニシカワ	12,300	1,108.00	13,628,400	
竹本容器	2,000	1,456.00	2,912,000	貸付株式数 800株
森六ホールディングス	3,000	2,670.00	8,010,000	
日本化薬	36,600	1,341.00	49,080,600	
カーリットホールディングス	6,300	786.00	4,951,800	貸付株式数 2,500株
E P Sホールディングス	8,500	1,925.00	16,362,500	貸付株式数 2,600株
ソルクシーズ	2,400	773.00	1,855,200	
レグス	1,500	897.00	1,345,500	貸付株式数 500株
プレステージ・インター	10,700	1,335.00	14,284,500	貸付株式数 3,800株
フェイス	2,300	864.00	1,987,200	
ハイマックス	700	1,840.00	1,288,000	貸付株式数 200株
アミューズ	3,400	2,470.00	8,398,000	
野村総合研究所	37,500	5,010.00	187,875,000	
ドリームインキュベータ	1,700	1,620.00	2,754,000	貸付株式数 800株
サイバネットシステム	4,800	565.00	2,712,000	貸付株式数 1,900株
クイック	3,500	1,781.00	6,233,500	貸付株式数 1,300株
T A C	3,100	225.00	697,500	貸付株式数 1,200株
C Eホールディングス	1,500	797.00	1,195,500	貸付株式数 600株
ケネディクス	50,800	556.00	28,244,800	貸付株式数 21,200株
日本システム技術	900	1,407.00	1,266,300	貸付株式数 300株
電通	69,400	4,710.00	326,874,000	貸付株式数 27,800株
インテージホールディングス	7,600	882.00	6,703,200	

テイクアンドギヴニーズ	2,200	1,395.00	3,069,000	貸付株式数	800株
東邦システムサイエンス	1,800	940.00	1,692,000	貸付株式数	600株
びあ	1,600	4,675.00	7,480,000	貸付株式数	700株
イオンファンタジー	1,800	2,843.00	5,117,400		
ソースネクスト	22,800	454.00	10,351,200	貸付株式数	9,100株 (9,100株)
シーティーエス	6,400	638.00	4,083,200	貸付株式数	2,500株
ネクシーズグループ	1,700	2,152.00	3,658,400	貸付株式数	600株
メディカルシステムネット ワーク	6,200	534.00	3,310,800	貸付株式数	2,400株
日本精化	4,900	1,259.00	6,169,100	貸付株式数	1,800株
扶桑化学工業	5,900	1,874.00	11,056,600	貸付株式数	2,300株
トリケミカル	1,300	5,280.00	6,864,000	貸付株式数	500株
F I G	5,100	320.00	1,632,000	貸付株式数	1,000株
A D E K A	28,700	1,652.00	47,412,400		
日油	22,000	3,850.00	84,700,000		
ミヨシ油脂	2,800	1,100.00	3,080,000	貸付株式数	1,000株
新日本理化	11,300	201.00	2,271,300	貸付株式数	2,200株
ハリマ化成グループ	5,000	1,065.00	5,325,000		
ヒト・コミュニケーション ズHD	1,300	1,664.00	2,163,200		
花 王	144,200	8,718.00	1,257,135,600	貸付株式数	58,000株
第一工業製薬	2,200	3,575.00	7,865,000	貸付株式数	800株
石原ケミカル	1,600	1,763.00	2,820,800	貸付株式数	500株
日華化学	2,100	995.00	2,089,500	貸付株式数	700株
ニイタカ	900	1,510.00	1,359,000	貸付株式数	300株
三洋化成	4,000	5,400.00	21,600,000		
武田薬品	519,000	4,710.00	2,444,490,000		
アステラス製薬	548,700	1,684.50	924,285,150		
大日本住友製薬	44,400	2,735.00	121,434,000		
塩野義製薬	76,200	6,741.00	513,664,200		
田辺三菱製薬	61,800	1,545.00	95,481,000		
わかもと製薬	7,100	286.00	2,030,600	貸付株式数	2,800株
あすか製薬	7,400	1,204.00	8,909,600	貸付株式数	2,900株
日本新薬	15,600	7,770.00	121,212,000		
ビオフェルミン製薬	1,000	2,356.00	2,356,000		
中外製薬	62,100	7,520.00	466,992,000	貸付株式数	24,900株
科研製薬	10,700	5,310.00	56,817,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
エーザイ	71,300	6,293.00	448,690,900		

理研ビタミン	2,800	3,595.00	10,066,000		
ロート製薬	30,800	2,845.00	87,626,000	貸付株式数	12,200株
小野薬品	140,500	2,224.50	312,542,250		
久光製薬	17,600	5,030.00	88,528,000	貸付株式数	7,000株
有機合成薬品	6,700	203.00	1,360,100		
持田製薬	4,500	11,410.00	51,345,000		
参天製薬	113,000	1,664.00	188,032,000		
扶桑薬品	2,100	2,721.00	5,714,100	貸付株式数	800株
日本ケミファ	800	2,965.00	2,372,000	貸付株式数	300株
ツムラ	18,600	3,350.00	62,310,000		
日医工	14,900	1,507.00	22,454,300		
テルモ	84,200	6,901.00	581,064,200		
みらかホールディングス	15,900	2,818.00	44,806,200		
キッセイ薬品工業	10,600	2,930.00	31,058,000		
生化学工業	11,600	1,256.00	14,569,600		
栄研化学	10,500	2,652.00	27,846,000	貸付株式数	4,100株
日水製薬	2,500	1,217.00	3,042,500	貸付株式数	1,000株
鳥居薬品	3,200	2,262.00	7,238,400	貸付株式数	1,200株
JCRファーマ	4,200	6,400.00	26,880,000	貸付株式数	1,600株
東和薬品	2,900	9,050.00	26,245,000	貸付株式数	1,100株
富士製薬工業	4,000	1,793.00	7,172,000	貸付株式数	100株
沢井製薬	12,300	6,570.00	80,811,000		
ゼリア新薬工業	11,800	1,893.00	22,337,400	貸付株式数	300株
第一三共	170,300	4,452.00	758,175,600		
キョーリン製薬HD	13,400	2,252.00	30,176,800	貸付株式数	4,600株
大幸薬品	2,700	1,907.00	5,148,900	貸付株式数	1,000株
ダイト	3,400	2,851.00	9,693,400	貸付株式数	1,300株
大塚ホールディングス	113,300	4,442.00	503,278,600	貸付株式数	45,500株
大正製薬HD	13,400	10,850.00	145,390,000	貸付株式数	3,700株
ペプチドリーム	27,600	5,310.00	146,556,000	貸付株式数	11,000株
大日本塗料	7,000	1,163.00	8,141,000		
日本ペイントHOLD	48,100	4,380.00	210,678,000	貸付株式数	19,200株
関西ペイント	65,500	2,183.00	142,986,500	貸付株式数	15,700株
神東塗料	7,900	177.00	1,398,300	貸付株式数	1,000株
中国塗料	19,200	1,006.00	19,315,200	貸付株式数	7,600株
日本特殊塗料	4,300	1,229.00	5,284,700		
藤倉化成	8,200	616.00	5,051,200		
太陽ホールディングス	4,800	3,785.00	18,168,000	貸付株式数	1,200株
DIC	26,200	3,285.00	86,067,000	貸付株式数	10,600株
サカティンクス	12,600	1,035.00	13,041,000	貸付株式数	5,100株

東洋インキSCホールディングン	11,900	2,561.00	30,475,900	貸付株式数	4,900株
T & K TOKA	4,700	980.00	4,606,000	貸付株式数	2,000株
アルプス技研	5,000	1,838.00	9,190,000	貸付株式数	2,000株
サニックス	10,000	236.00	2,360,000	貸付株式数	3,900株
ダイオーズ	1,300	1,430.00	1,859,000	貸付株式数	500株
日本空調サービス	6,500	707.00	4,595,500	貸付株式数	700株
オリエンタルランド	67,100	12,630.00	847,473,000	貸付株式数	26,900株
フォーカスシステムズ	3,900	952.00	3,712,800	貸付株式数	1,500株
ダスキン	15,000	2,691.00	40,365,000		
パーク24	34,600	2,462.00	85,185,200	貸付株式数	10,600株
明光ネットワークジャパン	7,200	980.00	7,056,000	貸付株式数	2,800株
ファルコホールディングス	3,200	1,426.00	4,563,200	貸付株式数	1,000株
クレスコ	1,800	3,430.00	6,174,000		
フジ・メディア・HD	60,600	1,547.00	93,748,200		
秀英予備校	1,500	500.00	750,000	貸付株式数	600株
田谷	1,400	643.00	900,200	貸付株式数	100株
ラウンドワン	17,700	1,400.00	24,780,000		
リゾートトラスト	23,900	1,589.00	37,977,100		
オービック	20,500	11,210.00	229,805,000		
ジャストシステム	8,400	2,827.00	23,746,800	貸付株式数	800株
TDCソフト	5,100	896.00	4,569,600	貸付株式数	1,600株
ヤフー	384,200	277.00	106,423,400		
ビー・エム・エル	7,400	3,200.00	23,680,000	貸付株式数	2,800株
ワタベウエディング	1,000	661.00	661,000	貸付株式数	100株
トレンドマイクロ	31,400	5,190.00	162,966,000	貸付株式数	12,500株
りらいあコミュニケーション	10,400	994.00	10,337,600	貸付株式数	4,100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	510.00	14,688,000		
日本オラクル	10,200	7,920.00	80,784,000	貸付株式数	3,800株
早稲田アカデミー	800	1,437.00	1,149,600		
アルファシステムズ	1,900	2,778.00	5,278,200	貸付株式数	500株
フューチャー	8,000	1,829.00	14,632,000	貸付株式数	3,100株
CAC HOLDINGS	4,400	1,380.00	6,072,000	貸付株式数	1,600株
ソフトバンク・テクノ	2,500	2,416.00	6,040,000	貸付株式数	900株
トーセ	1,600	933.00	1,492,800	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	69,800	2,069.00	144,416,200		
オービックビジネスC	6,000	4,425.00	26,550,000	貸付株式数	2,400株

伊藤忠テクノソリュー	26,900	2,584.00	69,509,600		
アイティフォー	7,100	927.00	6,581,700	貸付株式数	2,800株
東京個別指導学院	2,000	1,120.00	2,240,000	貸付株式数	800株
東計電算	900	3,045.00	2,740,500	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	35,300	4,510.00	159,203,000	貸付株式数	14,100株
楽天	265,900	1,047.00	278,397,300	貸付株式数	106,600株
エクスネット	1,100	939.00	1,032,900	貸付株式数	400株
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,135.00	3,859,000	貸付株式数	1,300株
テー・オー・ダブリュー	5,400	742.00	4,006,800	貸付株式数	2,000株
大塚商会	31,900	4,005.00	127,759,500	貸付株式数	12,700株
サイボウズ	6,800	819.00	5,569,200	貸付株式数	2,700株
ソフトブレーン	4,500	460.00	2,070,000	貸付株式数	1,800株
セントラルスポーツ	2,100	3,480.00	7,308,000	貸付株式数	600株
パラカ	1,500	2,009.00	3,013,500	貸付株式数	800株
電通国際情報S	3,600	3,770.00	13,572,000	貸付株式数	1,400株
デジタルガレージ	11,500	3,190.00	36,685,000	貸付株式数	4,500株
イーエムシステムズ	4,800	1,346.00	6,460,800	貸付株式数	1,900株
ウェザーニューズ	2,000	3,220.00	6,440,000	貸付株式数	700株 (700株)
C I J	4,600	825.00	3,795,000	貸付株式数	1,800株
東洋ビジネスエンジ	600	2,286.00	1,371,600	貸付株式数	200株
日本エンタープライズ	5,800	175.00	1,015,000	貸付株式数	1,000株
WOWOW	2,800	3,030.00	8,484,000	貸付株式数	1,100株
スカラ	4,700	810.00	3,807,000	貸付株式数	1,600株
フルキャストホールディングス	5,700	2,338.00	13,326,600	貸付株式数	2,200株
エン・ジャパン	6,300	3,075.00	19,372,500		
富士フイルムHLDGS	123,400	5,147.00	635,139,800		
コニカミノルタ	130,100	1,091.00	141,939,100		
資生堂	118,200	7,905.00	934,371,000	貸付株式数	47,500株
ライオン	83,000	2,376.00	197,208,000	貸付株式数	33,300株
高砂香料	4,100	3,545.00	14,534,500	貸付株式数	100株
マンダム	13,200	2,902.00	38,306,400	貸付株式数	5,300株 (2,900株)
ミルボン	7,400	5,130.00	37,962,000	貸付株式数	2,900株
ファンケル	26,700	2,861.00	76,388,700	貸付株式数	9,100株
コーセー	10,100	19,590.00	197,859,000		
コタ	2,800	1,494.00	4,183,200		
シーボン	700	2,684.00	1,878,800		

ポーラ・オルビスHD	25,400	3,470.00	88,138,000	貸付株式数	10,200株
ノエビアホールディングス	3,800	5,510.00	20,938,000	貸付株式数	1,500株
アジュバンコスメジャパン	1,300	959.00	1,246,700	貸付株式数	500株
エステー	4,300	1,982.00	8,522,600	貸付株式数	100株
アグロカネショウ	2,400	2,211.00	5,306,400	貸付株式数	900株
コニシ	10,600	1,634.00	17,320,400	貸付株式数	4,200株
長谷川香料	7,200	1,870.00	13,464,000		
星光PMC	4,300	809.00	3,478,700	貸付株式数	1,500株
小林製薬	16,700	9,250.00	154,475,000	貸付株式数	6,700株 (4,300株)
荒川化学工業	5,400	1,343.00	7,252,200		
メック	4,100	1,030.00	4,223,000	貸付株式数	1,600株 (1,500株)
日本高純度化学	2,000	2,418.00	4,836,000	貸付株式数	500株
タカラバイオ	15,600	2,600.00	40,560,000		
JCU	7,700	1,807.00	13,913,900		
新田ゼラチン	3,700	718.00	2,656,600		
OATアグリオ	800	1,689.00	1,351,200	貸付株式数	300株
デクセリアルズ	15,400	756.00	11,642,400	貸付株式数	4,200株
アース製薬	4,400	5,260.00	23,144,000	貸付株式数	1,800株
北興化学	6,500	559.00	3,633,500	貸付株式数	2,400株
大成ラミック	1,900	2,894.00	5,498,600	貸付株式数	400株
クミアイ化学	24,600	787.00	19,360,200	貸付株式数	6,900株
日本農薬	14,300	468.00	6,692,400		
昭和シエル石油	55,500	1,682.00	93,351,000		
富士興産	2,200	710.00	1,562,000	貸付株式数	800株
ニチレキ	7,700	1,147.00	8,831,900		
ユシロ化学	3,100	1,339.00	4,150,900	貸付株式数	1,200株
ピーピー・カストロール	2,200	1,408.00	3,097,600	貸付株式数	800株
富士石油	14,300	265.00	3,789,500		
MORESCO	2,400	1,490.00	3,576,000	貸付株式数	500株
出光興産	46,200	4,025.00	185,955,000	貸付株式数	18,500株
JXTGホールディングス	998,200	533.30	532,340,060		
コスモエネルギーHLDGS	17,400	2,463.00	42,856,200	貸付株式数	2,300株
横浜ゴム	34,700	2,080.00	72,176,000	貸付株式数	13,800株
TOYO TIRE	30,700	1,305.00	40,063,500	貸付株式数	12,200株
ブリヂストン	182,700	4,282.00	782,321,400	貸付株式数	73,500株
住友ゴム	53,700	1,359.00	72,978,300	貸付株式数	21,500株
藤倉ゴム	4,900	441.00	2,160,900	貸付株式数	1,000株

オカモト	4,200	5,810.00	24,402,000	
アキレス	4,300	2,005.00	8,621,500	
フコク	2,500	911.00	2,277,500	貸付株式数 1,000株
ニッタ	6,800	3,705.00	25,194,000	
クリエートメディック	1,800	969.00	1,744,200	貸付株式数 700株
住友理工	11,700	958.00	11,208,600	
三ツ星ベルト	7,900	2,064.00	16,305,600	貸付株式数 1,500株
バンドー化学	11,400	1,146.00	13,064,400	
A G C	58,500	3,875.00	226,687,500	貸付株式数 23,600株
日本板硝子	28,700	918.00	26,346,600	貸付株式数 200株
石塚硝子	800	1,758.00	1,406,400	貸付株式数 300株
有沢製作所	9,300	821.00	7,635,300	貸付株式数 1,400株
日本山村硝子	2,400	1,498.00	3,595,200	貸付株式数 900株
日本電気硝子	25,700	2,974.00	76,431,800	貸付株式数 10,300株
オハラ	2,400	1,239.00	2,973,600	貸付株式数 900株
住友大阪セメント	12,000	4,390.00	52,680,000	
太平洋セメント	37,600	3,710.00	139,496,000	
リソルホールディングス	600	4,430.00	2,658,000	貸付株式数 200株
日本ヒューム	5,900	783.00	4,619,700	
日本コンクリート	12,900	284.00	3,663,600	
三谷セキサン	2,800	3,115.00	8,722,000	貸付株式数 1,100株
アジアパイルHD	8,300	614.00	5,096,200	貸付株式数 3,300株
東海カーボン	54,500	1,372.00	74,774,000	貸付株式数 21,700株 (100株)
日本カーボン	2,900	4,845.00	14,050,500	貸付株式数 1,100株
東洋炭素	3,500	2,078.00	7,273,000	貸付株式数 1,400株
ノリタケ	3,600	5,270.00	18,972,000	
TOTO	45,800	4,665.00	213,657,000	
日本碍子	71,600	1,633.00	116,922,800	
日本特殊陶業	50,300	2,120.00	106,636,000	
ダントーホールディングス	5,600	110.00	616,000	貸付株式数 2,000株
MARUWA	2,100	5,100.00	10,710,000	
品川リフラクトリーズ	1,600	3,280.00	5,248,000	貸付株式数 600株
黒崎播磨	1,200	5,940.00	7,128,000	貸付株式数 400株 (400株)
ヨータイ	5,100	536.00	2,733,600	貸付株式数 2,000株
イソライト	3,100	517.00	1,602,700	
東京窯業	7,500	371.00	2,782,500	貸付株式数 1,000株
ニッカトー	2,700	933.00	2,519,100	

フジミインコーポレーテッド	5,400	2,476.00	13,370,400	貸付株式数	100株
クニミネ工業	2,000	821.00	1,642,000		
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,082.00	1,190,200	貸付株式数	400株
ニチアス	16,400	2,200.00	36,080,000		
新日鐵住金	270,800	2,008.00	543,766,400		
神戸製鋼所	107,200	850.00	91,120,000		
中山製鋼所	7,400	513.00	3,796,200		
合同製鐵	2,800	1,755.00	4,914,000		
J F Eホールディングス	158,400	1,932.50	306,108,000		
東京製鐵	31,800	956.00	30,400,800	貸付株式数	12,600株
共英製鋼	6,700	1,650.00	11,055,000	貸付株式数	2,600株
大和工業	12,600	3,095.00	38,997,000	貸付株式数	800株
東京鐵鋼	2,500	1,316.00	3,290,000	貸付株式数	800株
大阪製鐵	4,000	1,978.00	7,912,000		
淀川製鋼所	7,800	2,203.00	17,183,400	貸付株式数	2,000株
丸一鋼管	21,000	3,355.00	70,455,000		
モリ工業	1,700	2,510.00	4,267,000	貸付株式数	600株
大同特殊鋼	9,600	4,580.00	43,968,000	貸付株式数	3,800株
日本高周波	2,100	532.00	1,117,200	貸付株式数	800株
日本冶金工	48,900	251.00	12,273,900	貸付株式数	19,500株
山陽特殊製鋼	7,500	2,355.00	17,662,500		
愛知製鋼	3,100	3,595.00	11,144,500	貸付株式数	500株
日立金属	63,300	1,327.00	83,999,100		
日本金属	1,400	1,230.00	1,722,000	貸付株式数	500株
大平洋金属	4,000	2,757.00	11,028,000	貸付株式数	800株
新日本電工	35,300	229.00	8,083,700	貸付株式数	14,100株
栗本鉄工所	3,100	1,539.00	4,770,900	貸付株式数	900株
虹 技	800	1,421.00	1,136,800		
日本鑄鉄管	500	896.00	448,000	貸付株式数	200株
日本製鋼所	18,000	2,085.00	37,530,000		
三菱製鋼	4,400	1,649.00	7,255,600	貸付株式数	300株
日亜鋼業	8,400	367.00	3,082,800		
日本精線	800	3,395.00	2,716,000	貸付株式数	300株
エンビプロHD	1,200	651.00	781,200	貸付株式数	400株
大紀アルミニウム	9,700	702.00	6,809,400	貸付株式数	3,800株
日本軽金属HD	162,200	255.00	41,361,000		
三井金属	16,000	2,896.00	46,336,000		
東邦亜鉛	3,300	3,165.00	10,444,500	貸付株式数	1,300株
三菱マテリアル	38,800	2,967.00	115,119,600		

住友鉱山	80,500	3,290.00	264,845,000		
DOWAホールディングス	13,900	3,770.00	52,403,000		
古河機金	9,800	1,439.00	14,102,200	貸付株式数	2,700株
エス・サイエンス	26,400	63.00	1,663,200	貸付株式数	1,200株 (100株)
大阪チタニウム	6,900	1,701.00	11,736,900	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
東邦チタニウム	10,600	972.00	10,303,200	貸付株式数	4,200株
UACJ	9,000	2,187.00	19,683,000	貸付株式数	3,500株 (100株)
CKサンエツ	1,100	3,225.00	3,547,500	貸付株式数	400株
古河電工	16,900	2,858.00	48,300,200		
住友電工	218,900	1,517.50	332,180,750		
フジクラ	70,900	429.00	30,416,100		
昭和電線HLDGS	7,000	719.00	5,033,000	貸付株式数	3,000株
東京特殊電線	700	2,170.00	1,519,000	貸付株式数	200株
タツタ電線	11,800	473.00	5,581,400		
カナレ電気	1,000	1,959.00	1,959,000	貸付株式数	200株
平河ビューテック	2,400	1,494.00	3,585,600	貸付株式数	900株
リョービ	7,300	2,517.00	18,374,100	貸付株式数	2,900株
アーレステイ	7,200	672.00	4,838,400		
アサヒHD	11,100	2,157.00	23,942,700		
東洋製罐グループHD	37,600	2,395.00	90,052,000		
ホッカンホールディングス	3,000	2,039.00	6,117,000		
コロナ	3,200	1,136.00	3,635,200	貸付株式数	200株
横河ブリッジHLDGS	11,000	1,950.00	21,450,000	貸付株式数	1,600株
OSJBHD	29,700	281.00	8,345,700		
駒井ハルテック	1,100	1,955.00	2,150,500		
高田機工	500	2,671.00	1,335,500	貸付株式数	200株
三和ホールディングス	61,100	1,324.00	80,896,400		
文化シャッタ-	17,500	833.00	14,577,500		
三協立山	8,200	1,554.00	12,742,800	貸付株式数	3,200株
アルインコ	4,700	1,010.00	4,747,000	貸付株式数	1,800株
東洋シャッタ-	1,400	721.00	1,009,400		
LIXILグループ	86,800	1,525.00	132,370,000		
日本フィルコン	4,400	546.00	2,402,400	貸付株式数	1,700株
ノーリツ	13,300	1,774.00	23,594,200	貸付株式数	5,200株
長府製作所	6,100	2,409.00	14,694,900		
リンナイ	10,500	7,930.00	83,265,000		
ユニプレス	11,500	1,776.00	20,424,000		

ダイニチ工業	3,100	706.00	2,188,600	貸付株式数	1,200株
日東精工	8,200	578.00	4,739,600	貸付株式数	3,200株
三洋工業	700	1,942.00	1,359,400	貸付株式数	100株
岡 部	12,200	1,015.00	12,383,000	貸付株式数	4,800株
ジーテクト	6,500	1,577.00	10,250,500		
中国工業	900	580.00	522,000	貸付株式数	300株
東 プ レ	10,900	2,136.00	23,282,400		
高周波熱錬	11,300	937.00	10,588,100		
東京製綱	3,600	1,004.00	3,614,400	貸付株式数	1,300株
サンコール	3,200	641.00	2,051,200	貸付株式数	200株
モリテックスチル	4,500	426.00	1,917,000		
パイオラックス	9,500	2,224.00	21,128,000	貸付株式数	2,300株
エイチワン	5,800	953.00	5,527,400	貸付株式数	1,100株
日本発条	58,800	1,011.00	59,446,800		
中央発條	700	2,968.00	2,077,600	貸付株式数	100株
アドバネクス	800	1,729.00	1,383,200	貸付株式数	300株 (300株)
三浦工業	25,600	2,552.00	65,331,200	貸付株式数	10,200株
タ ク マ	21,700	1,332.00	28,904,400		
テクノプロ・ホールディング グ	10,800	6,620.00	71,496,000	貸付株式数	4,300株
アトラ	1,200	371.00	445,200	貸付株式数	400株
インターワークス	1,100	768.00	844,800	貸付株式数	400株
アイ・アールジャパンHD	1,800	1,751.00	3,151,800	貸付株式数	700株
K e e P e r 技研	1,900	1,277.00	2,426,300	貸付株式数	700株
ファーストロジック	1,100	602.00	662,200	貸付株式数	400株
三機サービス	900	1,416.00	1,274,400	貸付株式数	300株
G u n o s y	3,500	2,387.00	8,354,500	貸付株式数	1,400株
デザインワン・ジャパン	1,200	300.00	360,000		
イー・ガーディアン	2,700	2,153.00	5,813,100	貸付株式数	1,000株
リブセンス	3,100	266.00	824,600	貸付株式数	1,200株
ジャパンマテリアル	15,600	1,309.00	20,420,400	貸付株式数	6,200株
ベクトル	6,900	1,426.00	9,839,400	貸付株式数	2,700株
ウチヤマホールディングス	3,000	456.00	1,368,000	貸付株式数	1,100株
ライクキッズネクスト	1,200	913.00	1,095,600	貸付株式数	400株
キャリアリンク	2,100	404.00	848,400	貸付株式数	800株
I B J	3,800	902.00	3,427,600		
アサンテ	2,200	2,255.00	4,961,000	貸付株式数	800株
N・フィールド	3,700	743.00	2,749,100	貸付株式数	1,400株
バリューHR	1,200	2,509.00	3,010,800	貸付株式数	400株

M & Aキャピタルパートナー	1,400	5,040.00	7,056,000	貸付株式数 300株 (300株)
ライドオンエクスプレスHD	2,400	1,196.00	2,870,400	貸付株式数 700株
E R Iホールディングス	1,600	874.00	1,398,400	貸付株式数 600株
アビスト	900	3,360.00	3,024,000	貸付株式数 300株
シグマクシス	2,700	1,027.00	2,772,900	貸付株式数 1,000株
ウィルグループ	3,700	1,326.00	4,906,200	貸付株式数 1,400株
エスクローAJ	7,700	251.00	1,932,700	貸付株式数 3,200株
日本ビューホテル	1,800	1,171.00	2,107,800	貸付株式数 700株
リクルートホールディングス	407,700	3,111.00	1,268,354,700	
エラン	4,000	1,353.00	5,412,000	貸付株式数 1,500株
ツガミ	13,200	802.00	10,586,400	
オークマ	7,500	5,970.00	44,775,000	貸付株式数 100株
東芝機械	6,700	2,240.00	15,008,000	
アマダホールディングス	87,900	1,108.00	97,393,200	
アイダエンジニア	15,800	829.00	13,098,200	
滝澤鉄工所	1,800	1,601.00	2,881,800	貸付株式数 700株
F U J I	17,800	1,513.00	26,931,400	
牧野フライス	7,000	4,335.00	30,345,000	
オーエスジー	29,000	2,095.00	60,755,000	貸付株式数 11,600株
ダイジェット	600	1,752.00	1,051,200	貸付株式数 200株
旭ダイヤモンド	15,600	769.00	11,996,400	
D M G森精機	37,400	1,364.00	51,013,600	貸付株式数 14,800株
ソディック	12,800	811.00	10,380,800	貸付株式数 5,100株
ディスコ	8,000	15,500.00	124,000,000	貸付株式数 3,200株
日東工器	3,300	2,237.00	7,382,100	貸付株式数 1,200株
日進工具	1,700	2,638.00	4,484,600	
パンチ工業	4,100	593.00	2,431,300	貸付株式数 1,600株
富士ダイス	2,500	671.00	1,677,500	貸付株式数 400株
土木管理総合試験	2,500	490.00	1,225,000	貸付株式数 900株
日本郵政	465,200	1,324.00	615,924,800	
ベルシステム24HLDGS	9,600	1,402.00	13,459,200	貸付株式数 3,800株
鎌倉新書	4,200	1,428.00	5,997,600	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
一蔵	700	585.00	409,500	貸付株式数 200株
L I T A L I C O	1,300	1,825.00	2,372,500	貸付株式数 500株
グローバルグループ	700	1,002.00	701,400	貸付株式数 200株

エボラブルアジア	1,600	2,368.00	3,788,800	貸付株式数	600株 (600株)
アトラエ	1,100	3,765.00	4,141,500	貸付株式数	400株
ストライク	1,400	2,310.00	3,234,000	貸付株式数	500株
ソラスト	13,900	1,246.00	17,319,400	貸付株式数	5,500株
セラク	1,300	551.00	716,300	貸付株式数	500株
インソース	1,900	2,479.00	4,710,100		
豊田自動織機	47,800	5,700.00	272,460,000		
豊和工業	3,200	986.00	3,155,200	貸付株式数	1,200株 (900株)
OKK	2,300	822.00	1,890,600	貸付株式数	100株
石川製作所	1,400	1,775.00	2,485,000	貸付株式数	400株
東洋機械金属	4,200	607.00	2,549,400		
津田駒工業	1,200	1,839.00	2,206,800	貸付株式数	400株
エンシュウ	1,500	1,189.00	1,783,500	貸付株式数	600株
島精機製作所	8,200	3,575.00	29,315,000	貸付株式数	1,800株 (100株)
オプトラン	5,800	2,075.00	12,035,000	貸付株式数	2,300株 (100株)
NCホールディングス	1,800	531.00	955,800		
フリー	4,700	1,010.00	4,747,000	貸付株式数	200株
ヤマシンフィルタ	10,300	733.00	7,549,900	貸付株式数	4,100株 (1,800株)
日阪製作所	7,200	955.00	6,876,000		
やまびこ	11,400	1,065.00	12,141,000	貸付株式数	4,400株
平田機工	2,800	7,180.00	20,104,000	貸付株式数	200株 (200株)
ペガサスミシン製造	5,500	631.00	3,470,500	貸付株式数	2,200株
タツモ	1,800	720.00	1,296,000	貸付株式数	700株
ナブテスコ	32,500	3,170.00	103,025,000	貸付株式数	13,000株
三井海洋開発	6,300	3,230.00	20,349,000	貸付株式数	2,500株
レオン自動機	5,800	1,587.00	9,204,600	貸付株式数	1,000株
S M C	17,400	41,850.00	728,190,000		
新川	4,400	429.00	1,887,600		
ホソカワミクロン	2,100	5,030.00	10,563,000		
ユニオンツール	2,600	2,966.00	7,711,600	貸付株式数	1,000株
オイレス工業	8,300	1,946.00	16,151,800	貸付株式数	3,300株
日精エーエスピー	1,700	3,795.00	6,451,500	貸付株式数	700株
サト - ホールディングス	7,100	2,518.00	17,877,800		
技研製作所	4,100	3,420.00	14,022,000	貸付株式数	1,600株

日本エアーテック	1,800	579.00	1,042,200	貸付株式数	700株
カワタ	1,200	1,364.00	1,636,800	貸付株式数	400株
日精樹脂工業	5,000	926.00	4,630,000	貸付株式数	300株
オカダアイヨン	2,000	1,351.00	2,702,000	貸付株式数	500株
ワイエイシイホールディングス	2,300	732.00	1,683,600		
小松製作所	269,100	2,603.00	700,467,300	貸付株式数	108,300株 (108,300株)
住友重機械	34,100	3,615.00	123,271,500		
日立建機	23,900	2,897.00	69,238,300		
日工	1,600	2,375.00	3,800,000		
巴工業	2,500	2,563.00	6,407,500	貸付株式数	1,000株
井関農機	6,000	1,670.00	10,020,000	貸付株式数	2,300株
TOWA	5,100	688.00	3,508,800	貸付株式数	2,000株
丸山製作所	1,200	1,396.00	1,675,200	貸付株式数	400株
北川鉄工所	2,700	2,351.00	6,347,700	貸付株式数	1,000株
シンニッタン	9,100	371.00	3,376,100		
ローツェ	2,600	1,643.00	4,271,800	貸付株式数	1,300株
タカキタ	2,000	600.00	1,200,000	貸付株式数	800株
クボタ	318,200	1,595.00	507,529,000	貸付株式数	128,200株
荏原実業	1,700	1,993.00	3,388,100	貸付株式数	600株
東洋エンジニア	7,800	638.00	4,976,400	貸付株式数	2,900株 (700株)
三菱化工機	1,900	1,548.00	2,941,200	貸付株式数	700株
月島機械	11,900	1,470.00	17,493,000		
帝国電機製作所	4,200	1,135.00	4,767,000	貸付株式数	1,600株
東京機械	2,400	450.00	1,080,000	貸付株式数	200株
新東工業	14,200	993.00	14,100,600	貸付株式数	5,300株
渋谷工業	5,300	3,385.00	17,940,500	貸付株式数	2,000株
アイチコーポレーション	10,200	734.00	7,486,800	貸付株式数	3,700株
小森コーポレーション	15,700	1,276.00	20,033,200		
鶴見製作所	4,700	2,079.00	9,771,300	貸付株式数	1,000株
住友精密	1,000	3,055.00	3,055,000		
酒井重工業	1,100	2,619.00	2,880,900		
荏原製作所	26,400	3,095.00	81,708,000	貸付株式数	10,600株
石井鉄工所	1,100	1,985.00	2,183,500	貸付株式数	100株
西島製作所	6,200	942.00	5,840,400		
北越工業	6,100	1,168.00	7,124,800		
千代田化工建	47,600	288.00	13,708,800	貸付株式数	16,900株
ダイキン工業	81,100	12,780.00	1,036,458,000		

オルガノ	2,100	3,190.00	6,699,000	貸付株式数	400株
ト - ヨ - カネツ	2,200	2,161.00	4,754,200		
栗田工業	32,000	2,820.00	90,240,000		
椿本チエイン	7,800	4,070.00	31,746,000	貸付株式数	1,300株
大同工業	2,800	889.00	2,489,200	貸付株式数	900株
日 機 装	19,400	1,302.00	25,258,800	貸付株式数	7,700株
木村化工機	4,800	395.00	1,896,000	貸付株式数	1,900株
新興プランテック	12,000	1,214.00	14,568,000		
アネスト岩田	9,400	973.00	9,146,200		
ダイフク	32,800	5,730.00	187,944,000		
サムコ	1,600	852.00	1,363,200	貸付株式数	500株
加藤製作所	3,000	2,685.00	8,055,000		
油研工業	1,000	1,812.00	1,812,000	貸付株式数	300株
タダノ	28,800	1,059.00	30,499,200		
フジテック	21,600	1,317.00	28,447,200	貸付株式数	8,200株
C K D	16,700	1,000.00	16,700,000	貸付株式数	5,900株
キトー	4,500	1,692.00	7,614,000		
平和	16,600	2,275.00	37,765,000	貸付株式数	6,600株
理想科学工業	5,200	1,888.00	9,817,600		
S A N K Y O	14,500	4,290.00	62,205,000		
日本金銭機械	6,600	1,122.00	7,405,200	貸付株式数	2,100株 (300株)
マースグループHLDGS	3,800	2,250.00	8,550,000		
福島工業	3,800	3,685.00	14,003,000	貸付株式数	1,400株
オーズミ	2,800	371.00	1,038,800	貸付株式数	100株
ダイコク電機	2,800	1,458.00	4,082,400		
竹内製作所	10,000	1,931.00	19,310,000	貸付株式数	4,000株
ア マ ノ	17,100	2,587.00	44,237,700		
J U K I	8,300	1,119.00	9,287,700	貸付株式数	3,300株
サンデンホールディングス	7,200	801.00	5,767,200	貸付株式数	2,800株
蛇の目マシン	5,300	489.00	2,591,700	貸付株式数	1,000株
ブラザー工業	77,500	2,073.00	160,657,500		
マックス	9,200	1,645.00	15,134,000	貸付株式数	1,500株
モリタホールディングス	10,500	1,857.00	19,498,500		
グローリー	16,400	2,699.00	44,263,600	貸付株式数	4,200株
新晃工業	5,500	1,542.00	8,481,000	貸付株式数	2,200株
大和冷機工業	8,700	1,138.00	9,900,600	貸付株式数	3,400株
セガサミーホールディングス	59,100	1,333.00	78,780,300		
日本ピストンリング	2,100	1,643.00	3,450,300	貸付株式数	800株

リケン	2,800	5,300.00	14,840,000	貸付株式数	800株
T P R	8,100	2,214.00	17,933,400		
ツバキ・ナカシマ	9,100	1,938.00	17,635,800	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,500	6,970.00	121,975,000	貸付株式数	7,000株
大豊工業	4,800	952.00	4,569,600	貸付株式数	1,900株
日本精工	121,800	1,032.00	125,697,600		
N T N	127,400	342.00	43,570,800	貸付株式数	51,400株
ジェイテクト	56,100	1,386.00	77,754,600		
不二越	5,600	4,535.00	25,396,000	貸付株式数	2,200株
ミネベアミツミ	110,500	1,671.00	184,645,500		
日本トムソン	17,600	515.00	9,064,000		
T H K	37,300	2,765.00	103,134,500	貸付株式数	14,900株
ユーシン精機	4,700	1,050.00	4,935,000	貸付株式数	900株
前澤給装工業	2,400	2,000.00	4,800,000		
イーグル工業	7,300	1,273.00	9,292,900	貸付株式数	1,900株
前澤工業	4,300	344.00	1,479,200	貸付株式数	1,400株
日本ピラ - 工業	6,000	1,300.00	7,800,000	貸付株式数	1,400株
キッツ	24,300	805.00	19,561,500	貸付株式数	5,600株
日立	267,500	3,568.00	954,440,000		
三菱電機	593,600	1,453.00	862,500,800		
富士電機	38,500	3,270.00	125,895,000		
東洋電機製造	2,700	1,205.00	3,253,500	貸付株式数	900株
安川電機	69,100	3,440.00	237,704,000	貸付株式数	27,700株
シンフォニア テクノロ ジー	8,300	1,373.00	11,395,900	貸付株式数	3,300株
明電舎	11,700	1,575.00	18,427,500		
オリジン電気	1,600	2,087.00	3,339,200		
山洋電気	2,900	4,035.00	11,701,500		
デンヨー	5,800	1,413.00	8,195,400		
ベイカレントコンサルティ ング	1,700	3,485.00	5,924,500		
アイモバイル	1,300	1,026.00	1,333,800	貸付株式数	500株
キャリアインデックス	2,000	865.00	1,730,000	貸付株式数	700株
M S - J a p a n	2,300	1,595.00	3,668,500	貸付株式数	900株
船場	900	962.00	865,800	貸付株式数	300株
グレイステクノロジー	1,500	2,064.00	3,096,000		
ジャパンエレベーター S H D	3,400	2,207.00	7,503,800	貸付株式数	1,300株
フルテック	700	1,170.00	819,000		

グリーンズ	1,200	1,497.00	1,796,400	貸付株式数	400株
ツナグ・ソリューションズ	500	713.00	356,500	貸付株式数	200株
日総工産	1,400	2,406.00	3,368,400	貸付株式数	500株
キュービーネットHLDGS	2,800	2,028.00	5,678,400		
三桜工業	7,500	532.00	3,990,000	貸付株式数	3,000株
マキタ	72,300	3,770.00	272,571,000		
東芝テック	7,400	3,200.00	23,680,000	貸付株式数	2,900株
芝浦メカトロニクス	1,000	3,720.00	3,720,000	貸付株式数	400株
マブチモーター	16,400	3,920.00	64,288,000	貸付株式数	6,600株
日本電産	71,600	13,770.00	985,932,000	貸付株式数	28,800株 (28,800株)
ユーエムシーエレクトロニクス	3,200	1,584.00	5,068,800	貸付株式数	1,000株
トレックス・セミコンダクター	2,000	1,198.00	2,396,000	貸付株式数	800株
東光高岳	3,400	1,385.00	4,709,000	貸付株式数	1,200株
ダブル・スコープ	8,700	1,558.00	13,554,600	貸付株式数	3,600株 (900株)
宮越ホールディングス	2,500	1,020.00	2,550,000		
ダイヘン	6,500	2,828.00	18,382,000	貸付株式数	2,600株
ヤーマン	8,700	1,171.00	10,187,700	貸付株式数	3,400株
JVCケンウッド	43,900	269.00	11,809,100		
ミマキエンジニアリング	5,300	653.00	3,460,900	貸付株式数	2,100株
第一精工	2,500	1,053.00	2,632,500	貸付株式数	500株
日新電機	14,000	1,020.00	14,280,000		
大崎電気	12,400	710.00	8,804,000		
オムロン	63,300	5,220.00	330,426,000		
日東工業	9,900	2,273.00	22,502,700		
I D E C	8,000	1,896.00	15,168,000	貸付株式数	3,200株
不二電機工業	600	1,322.00	793,200	貸付株式数	200株
ジーエス・ユアサコーポ	21,600	2,212.00	47,779,200	貸付株式数	8,600株
サクサホールディングス	1,400	1,790.00	2,506,000		
メルコホールディングス	2,500	3,880.00	9,700,000	貸付株式数	800株
テクノメディカ	1,400	2,160.00	3,024,000	貸付株式数	200株
日本電気	76,900	3,840.00	295,296,000	貸付株式数	30,800株 (100株)
富士通	57,400	7,947.00	456,157,800		
沖電気	25,900	1,357.00	35,146,300		
岩崎通信機	2,800	825.00	2,310,000		

電気興業	3,100	3,345.00	10,369,500	
サンケン電気	7,000	2,033.00	14,231,000	
ナカヨ	1,100	1,504.00	1,654,400	
アイホン	3,400	1,831.00	6,225,400	
ルネサスエレクトロニクス	62,400	533.00	33,259,200	貸付株式数 24,700株
セイコーエプソン	73,600	1,698.00	124,972,800	
ワコム	43,400	452.00	19,616,800	貸付株式数 12,600株
アルバック	11,900	3,170.00	37,723,000	貸付株式数 4,700株
アクセル	2,500	484.00	1,210,000	貸付株式数 500株
E I Z O	5,500	4,550.00	25,025,000	
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	15,000	1,033.00	15,495,000	
京三製作所	12,400	376.00	4,662,400	
能美防災	7,900	1,872.00	14,788,800	貸付株式数 700株
ホーチキ	3,900	1,175.00	4,582,500	貸付株式数 1,100株
星和電機	3,000	500.00	1,500,000	貸付株式数 1,000株
エレコム	5,500	3,385.00	18,617,500	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
パナソニック	678,100	978.60	663,588,660	
シャープ	59,400	1,228.00	72,943,200	貸付株式数 23,700株
アンリツ	38,600	2,058.00	79,438,800	
富士通ゼネラル	18,300	1,549.00	28,346,700	貸付株式数 100株
ソ ニ ー	398,900	4,769.00	1,902,354,100	
T D K	31,100	8,700.00	270,570,000	
帝国通信工業	2,600	1,234.00	3,208,400	
タムラ製作所	23,000	614.00	14,122,000	貸付株式数 6,700株
アルプスアルパイン	61,800	2,293.00	141,707,400	
池上通信機	1,800	1,153.00	2,075,400	貸付株式数 900株
日本電波工業	5,400	436.00	2,354,400	貸付株式数 2,300株
鈴木	2,900	665.00	1,928,500	貸付株式数 1,100株
日本トリム	1,100	5,870.00	6,457,000	貸付株式数 400株 (200株)
ローランド ディー . ジー .	3,100	2,358.00	7,309,800	貸付株式数 1,200株
フオスタ - 電機	7,000	1,600.00	11,200,000	
S M K	1,700	2,710.00	4,607,000	貸付株式数 600株
ヨコオ	4,200	1,602.00	6,728,400	貸付株式数 1,600株
ティアック	4,200	193.00	810,600	貸付株式数 1,600株
ホシデン	17,700	937.00	16,584,900	貸付株式数 7,000株
ヒロセ電機	8,500	11,760.00	99,960,000	

日本航空電子	13,700	1,548.00	21,207,600		
T O A	6,500	1,111.00	7,221,500	貸付株式数	2,500株
マクセルホールディングス	12,700	1,601.00	20,332,700		
古野電気	7,700	1,027.00	7,907,900	貸付株式数	2,600株
ユニデンホールディングス	1,700	2,215.00	3,765,500	貸付株式数	400株
スミダコーポレーション	5,100	1,555.00	7,930,500	貸付株式数	2,000株 (1,700株)
アイコム	3,300	2,299.00	7,586,700	貸付株式数	1,300株
リオン	2,700	2,111.00	5,699,700	貸付株式数	1,000株
本多通信工業	5,000	554.00	2,770,000		
船井電機	6,100	722.00	4,404,200	貸付株式数	2,800株 (1,800株)
横河電機	59,700	2,255.00	134,623,500		
新電元工業	2,100	4,385.00	9,208,500		
アズビル	38,400	2,611.00	100,262,400		
東亜ディーケーケー	2,900	771.00	2,235,900	貸付株式数	1,100株
日本光電工業	26,400	3,490.00	92,136,000		
チノール	2,000	1,378.00	2,756,000		
共和電業	6,300	400.00	2,520,000	貸付株式数	2,500株
日本電子材料	2,300	673.00	1,547,900	貸付株式数	200株
堀場製作所	11,900	6,070.00	72,233,000	貸付株式数	4,700株 (3,100株)
アドバンテスト	40,800	2,546.00	103,876,800		
小野測器	2,600	624.00	1,622,400	貸付株式数	1,000株
エスベック	5,300	2,069.00	10,965,700	貸付株式数	1,600株
キーエンス	29,200	70,100.00	2,046,920,000	貸付株式数	11,700株
日置電機	3,100	4,800.00	14,880,000	貸付株式数	1,200株
シスメックス	46,400	6,973.00	323,547,200		
日本マイクロニクス	9,700	750.00	7,275,000	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
メガチップス	4,700	1,601.00	7,524,700	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
O B A R A G R O U P	3,400	3,850.00	13,090,000		
I M A G I C A G R O U P	4,900	597.00	2,925,300	貸付株式数	1,900株
澤藤電機	700	1,646.00	1,152,200		
デンソー	130,700	4,478.00	585,274,600		
原田工業	1,900	921.00	1,749,900	貸付株式数	700株
コーセル	8,000	1,181.00	9,448,000	貸付株式数	3,100株
イリソ電子工業	5,500	5,150.00	28,325,000	貸付株式数	2,100株

オプテックスグループ	10,500	1,830.00	19,215,000	貸付株式数	2,100株
千代田インテグレ	2,600	2,099.00	5,457,400	貸付株式数	1,000株
アイ・オー・データ	2,400	1,169.00	2,805,600	貸付株式数	800株
レーザーテック	12,300	4,590.00	56,457,000	貸付株式数	4,900株
スタンレー電気	42,000	3,020.00	126,840,000		
岩崎電気	2,800	1,456.00	4,076,800		
ウシオ電機	33,500	1,353.00	45,325,500		
岡谷電機	4,300	385.00	1,655,500	貸付株式数	1,700株
ヘリオステクノH	5,500	706.00	3,883,000	貸付株式数	900株
日本セラミック	6,100	2,915.00	17,781,500	貸付株式数	2,400株
遠藤照明	3,500	780.00	2,730,000	貸付株式数	200株
古河電池	5,000	725.00	3,625,000	貸付株式数	1,300株 (1,000株)
双信電機	2,800	550.00	1,540,000	貸付株式数	1,100株
山一電機	4,300	1,083.00	4,656,900	貸付株式数	1,700株
図 研	3,900	1,496.00	5,834,400		
日本電子	11,900	1,968.00	23,419,200	貸付株式数	4,300株
カ シ オ	52,900	1,477.00	78,133,300		
ファナック	56,500	19,120.00	1,080,280,000		
日本シイエムケイ	15,200	648.00	9,849,600	貸付株式数	2,800株
エンプラス	2,700	2,830.00	7,641,000	貸付株式数	1,000株 (700株)
大真空	2,200	1,099.00	2,417,800		
ロ - ム	28,500	6,930.00	197,505,000		
浜松ホトニクス	42,700	4,270.00	182,329,000		
三井ハイテック	6,600	1,000.00	6,600,000	貸付株式数	2,500株 (500株)
新光電気工業	20,200	859.00	17,351,800		
京 セ ラ	90,600	6,494.00	588,356,400		
協栄産業	700	1,580.00	1,106,000	貸付株式数	100株
太陽誘電	26,700	2,146.00	57,298,200		
村田製作所	62,400	16,385.00	1,022,424,000	貸付株式数	4,800株 (4,800株)
ユーシン	9,200	986.00	9,071,200	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
双葉電子工業	9,800	1,837.00	18,002,600		
日東電工	41,000	5,915.00	242,515,000		
北陸電気工業	2,100	1,078.00	2,263,800	貸付株式数	800株
東海理化電機	15,600	1,927.00	30,061,200		
ニチコン	18,900	1,011.00	19,107,900		

日本ケミコン	4,200	1,930.00	8,106,000	
K O A	9,000	1,537.00	13,833,000	
三井E & S H D	21,300	1,153.00	24,558,900	
日立造船	45,600	345.00	15,732,000	貸付株式数 18,900株
三菱重工業	99,600	4,630.00	461,148,000	
川崎重工業	46,200	2,732.00	126,218,400	
I H I	45,800	2,681.00	122,789,800	
名村造船所	18,000	391.00	7,038,000	
サノヤホールディングス	7,800	180.00	1,404,000	貸付株式数 200株
スプリックス	1,600	2,613.00	4,180,800	
日本車輛	2,200	2,718.00	5,979,600	貸付株式数 800株
三菱ロジスネクスト	7,200	1,223.00	8,805,600	貸付株式数 2,800株
近畿車輛	800	2,043.00	1,634,400	貸付株式数 300株
F P G	18,700	936.00	17,503,200	
島根銀行	1,400	805.00	1,127,000	貸付株式数 400株
じもとホールディングス	40,000	119.00	4,760,000	
全国保証	16,700	4,130.00	68,971,000	貸付株式数 6,600株
めぶきフィナンシャルG	302,800	296.00	89,628,800	
東京きらぼしF G	7,900	1,750.00	13,825,000	
九州フィナンシャルG	96,800	485.00	46,948,000	
かんぼ生命保険	22,000	2,485.00	54,670,000	貸付株式数 5,300株
ゆうちょ銀行	160,300	1,264.00	202,619,200	
富山第一銀行	13,800	400.00	5,520,000	貸付株式数 5,500株
コンコルディア・フィナンシャル	370,600	441.00	163,434,600	
ジェイリース	1,200	379.00	454,800	貸付株式数 400株
西日本フィナンシャルH D	37,900	994.00	37,672,600	貸付株式数 15,100株
マーキュリアインベストメント	2,300	684.00	1,573,200	貸付株式数 700株
イントラスト	1,700	445.00	756,500	貸付株式数 600株
日本モーゲージサービス	800	1,305.00	1,044,000	貸付株式数 300株
C a s a	1,900	1,034.00	1,964,600	
アルヒ	5,300	2,100.00	11,130,000	貸付株式数 2,700株
日産自動車	700,600	958.50	671,525,100	
いすゞ自動車	188,300	1,497.00	281,885,100	
トヨタ自動車	662,300	6,760.00	4,477,148,000	
日野自動車	73,300	960.00	70,368,000	
三菱自動車工業	218,100	609.00	132,822,900	
エフテック	4,200	957.00	4,019,400	貸付株式数 1,600株
レシップホールディングス	3,900	789.00	3,077,100	貸付株式数 800株

G M B	1,100	879.00	966,900	貸付株式数	400株
ファルテック	1,000	908.00	908,000		
武蔵精密工業	14,100	1,518.00	21,403,800		
日産車体	11,600	990.00	11,484,000	貸付株式数	2,100株
新明和工業	25,300	1,360.00	34,408,000		
極東開発工業	11,900	1,582.00	18,825,800	貸付株式数	4,700株
日信工業	11,000	1,471.00	16,181,000		
トピー工業	5,000	2,348.00	11,740,000	貸付株式数	400株
ティラド	2,200	2,282.00	5,020,400	貸付株式数	500株
タチエス	10,100	1,675.00	16,917,500		
N O K	31,200	1,791.00	55,879,200		
フタバ産業	16,700	546.00	9,118,200		
K Y B	6,200	2,822.00	17,496,400	貸付株式数	2,200株 (1,900株)
市光工業	8,900	624.00	5,553,600	貸付株式数	3,500株
大同メタル工業	9,700	743.00	7,207,100	貸付株式数	3,300株
プレス工業	29,700	603.00	17,909,100		
ミクニ	7,500	449.00	3,367,500	貸付株式数	3,000株
太平洋工業	12,600	1,535.00	19,341,000		
ケーヒン	13,800	1,843.00	25,433,400		
河西工業	7,300	913.00	6,664,900		
アイシン精機	48,900	4,105.00	200,734,500	貸付株式数	19,000株
マ ッ ダ	185,000	1,271.50	235,227,500		
今仙電機製作所	5,600	1,025.00	5,740,000		
本田技研	501,300	3,055.00	1,531,471,500		
スズキ	108,900	5,063.00	551,360,700	貸付株式数	23,400株
S U B A R U	184,600	2,781.50	513,464,900		
安永	2,900	1,378.00	3,996,200		
ヤマハ発動機	83,900	2,182.00	183,069,800	貸付株式数	33,800株
ショーワ	14,100	1,426.00	20,106,600		
小糸製作所	35,800	6,360.00	227,688,000		
T B K	7,000	433.00	3,031,000	貸付株式数	1,000株
エクセディ	8,100	2,523.00	20,436,300	貸付株式数	2,500株
ミツバ	11,000	670.00	7,370,000	貸付株式数	4,400株
豊田合成	19,400	2,436.00	47,258,400		
愛三工業	9,100	701.00	6,379,100		
盟和産業	1,000	1,102.00	1,102,000	貸付株式数	200株
日本プラスト	4,600	799.00	3,675,400	貸付株式数	1,800株
ヨ ロ ズ	5,500	1,605.00	8,827,500		
エフ・シー・シー	10,800	2,378.00	25,682,400		

新家工業	1,300	1,681.00	2,185,300	貸付株式数	500株
シマノ	24,000	17,250.00	414,000,000	貸付株式数	9,600株
テイ・エス テック	13,900	3,340.00	46,426,000		
関西みらいFG	27,700	857.00	23,738,900	貸付株式数	9,500株
33FG	5,100	1,648.00	8,404,800	貸付株式数	100株
第四北越フィナンシャルG	10,300	3,320.00	34,196,000	貸付株式数	4,000株
ジャムコ	3,000	2,250.00	6,750,000	貸付株式数	1,100株 (900株)
小野建	5,100	1,659.00	8,460,900	貸付株式数	1,800株 (1,400株)
はるやまHLDGS	2,700	895.00	2,416,500	貸付株式数	1,000株
ノジマ	10,500	2,060.00	21,630,000	貸付株式数	4,100株
佐島電機	4,400	957.00	4,210,800	貸付株式数	1,700株
カップ・クリエイト	8,400	1,493.00	12,541,200	貸付株式数	3,300株
エコトレーディング	1,500	566.00	849,000	貸付株式数	500株
伯東	4,000	1,256.00	5,024,000		
コンドーテック	4,600	1,024.00	4,710,400	貸付株式数	1,800株
中山福	3,400	572.00	1,944,800		
ライトオン	5,000	757.00	3,785,000	貸付株式数	1,900株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,500	2,540.00	21,590,000	貸付株式数	2,900株
ジーンズメイト	1,800	418.00	752,400		
三菱食品	5,900	3,030.00	17,877,000		
良品計画	8,300	26,900.00	223,270,000	貸付株式数	3,300株
三城ホールディングス	7,500	412.00	3,090,000		
松田産業	4,500	1,464.00	6,588,000		
第一興商	8,700	5,610.00	48,807,000		
メディパルHD	63,400	2,647.00	167,819,800		
アドヴァン	9,000	1,059.00	9,531,000	貸付株式数	3,600株 (600株)
SPK	1,200	2,417.00	2,900,400		
萩原電気HLDGS	2,100	3,195.00	6,709,500	貸付株式数	800株
アルビス	2,200	2,412.00	5,306,400	貸付株式数	900株
アズワン	4,200	9,000.00	37,800,000		
スズデン	1,900	1,844.00	3,503,600	貸付株式数	700株
尾家産業	1,800	1,380.00	2,484,000	貸付株式数	100株
シモジマ	3,500	1,212.00	4,242,000	貸付株式数	1,400株
ドウシシャ	5,400	1,830.00	9,882,000	貸付株式数	2,200株
小津産業	1,300	1,938.00	2,519,400	貸付株式数	500株
コナカ	7,700	465.00	3,580,500	貸付株式数	3,000株

高速	3,500	1,274.00	4,459,000	貸付株式数	100株
ハウス ローゼ	700	1,811.00	1,267,700	貸付株式数	200株
G - 7ホールディングス	1,700	2,305.00	3,918,500	貸付株式数	600株
たけびし	2,700	1,495.00	4,036,500	貸付株式数	800株
イオン北海道	5,500	767.00	4,218,500	貸付株式数	2,300株
コジマ	8,800	618.00	5,438,400		
ヒマラヤ	1,700	965.00	1,640,500	貸付株式数	600株
コーナン商事	7,700	2,761.00	21,259,700	貸付株式数	700株
ネットワンシステムズ	20,800	2,679.00	55,723,200		
エコス	2,200	1,591.00	3,500,200	貸付株式数	800株
ワタミ	7,700	1,648.00	12,689,600	貸付株式数	3,200株
マルシェ	1,400	805.00	1,127,000	貸付株式数	100株
リックス	1,300	1,610.00	2,093,000	貸付株式数	400株
システムソフト	13,500	101.00	1,363,500	貸付株式数	5,400株
パンパシフィックHD	35,200	7,270.00	255,904,000	貸付株式数	15,200株
丸文	5,200	681.00	3,541,200		
西松屋チェーン	12,900	973.00	12,551,700	貸付株式数	5,100株
ゼンショーホールディングス	27,900	2,621.00	73,125,900	貸付株式数	11,100株
ハピネット	4,900	1,550.00	7,595,000		
幸楽苑ホールディングス	3,700	2,538.00	9,390,600	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,200	1,153.00	1,383,600	貸付株式数	400株
橋本総業HLDGS	1,000	1,650.00	1,650,000		
日本ライフライン	18,500	1,852.00	34,262,000	貸付株式数	700株
サイゼリヤ	9,700	2,173.00	21,078,100	貸付株式数	3,800株
タカショー	2,800	442.00	1,237,600	貸付株式数	1,100株
エクセル	2,200	2,603.00	5,726,600	貸付株式数	1,300株
VTホールディングス	19,600	433.00	8,486,800		
マルカキカイ	1,900	2,148.00	4,081,200	貸付株式数	700株
アルゴグラフィックス	2,500	4,560.00	11,400,000		
魚力	1,600	1,473.00	2,356,800	貸付株式数	500株
IDOM	19,900	328.00	6,527,200		
日本エム・ディ・エム	3,400	1,091.00	3,709,400		
ポプラ	1,500	561.00	841,500		
フジ・コーポレーション	1,200	2,291.00	2,749,200	貸付株式数	400株
ユナイテッドアローズ	6,800	3,785.00	25,738,000	貸付株式数	2,600株 (1,900株)
進和	3,500	2,250.00	7,875,000	貸付株式数	1,300株
エスケイジャパン	1,400	737.00	1,031,800	貸付株式数	500株

ダイトロン	2,700	1,698.00	4,584,600	貸付株式数	1,000株
ハイデイ日高	8,500	2,143.00	18,215,500	貸付株式数	2,600株
シークス	7,500	1,653.00	12,397,500	貸付株式数	2,100株
京都きもの友禅	4,000	408.00	1,632,000	貸付株式数	1,500株
コロワイド	19,600	2,395.00	46,942,000	貸付株式数	7,800株
ピーシーデポコーポ	7,900	460.00	3,634,000	貸付株式数	3,100株 (500株)
田中商事	2,000	615.00	1,230,000	貸付株式数	700株
オーハシテクニカ	3,200	1,471.00	4,707,200	貸付株式数	1,200株
壱番屋	4,100	4,805.00	19,700,500	貸付株式数	1,600株
白銅	1,900	1,705.00	3,239,500	貸付株式数	600株
トップカルチャー	2,200	328.00	721,600	貸付株式数	800株
P L A N T	1,400	1,007.00	1,409,800	貸付株式数	500株
スギホールディングス	12,800	4,965.00	63,552,000		
島津製作所	76,800	3,060.00	235,008,000		
J M S	5,200	693.00	3,603,600	貸付株式数	1,300株
クボテック	1,200	358.00	429,600	貸付株式数	400株
長野計器	4,600	825.00	3,795,000	貸付株式数	1,800株
ブイ・テクノロジー	1,400	13,930.00	19,502,000		
スター精密	10,300	1,693.00	17,437,900	貸付株式数	4,000株
東京計器	3,900	1,142.00	4,453,800	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
愛知時計	800	4,095.00	3,276,000	貸付株式数	100株
インターアクション	3,100	1,648.00	5,108,800	貸付株式数	1,100株
オーバル	5,800	252.00	1,461,600	貸付株式数	1,000株
東京精密	10,900	2,824.00	30,781,600		
マニー	7,300	5,260.00	38,398,000	貸付株式数	2,900株
ニコン	103,700	1,583.00	164,157,100		
トプコン	32,000	1,358.00	43,456,000	貸付株式数	11,700株
オリンパス	88,700	4,805.00	426,203,500		
理研計器	5,300	2,242.00	11,882,600	貸付株式数	1,400株
S C R E E Nホールディングス	10,400	4,565.00	47,476,000		
キャノン電子	5,300	1,775.00	9,407,500	貸付株式数	2,100株
タムロン	5,300	2,062.00	10,928,600	貸付株式数	2,100株
H O Y A	119,800	7,382.00	884,363,600		
シード	2,500	1,195.00	2,987,500	貸付株式数	1,000株 (300株)
ノーリツ鋼機	4,700	2,470.00	11,609,000	貸付株式数	1,200株
エー・アンド・デイ	5,400	755.00	4,077,000	貸付株式数	1,000株

朝日インテック	22,900	5,130.00	117,477,000	貸付株式数	8,600株
キヤノン	319,300	3,211.00	1,025,272,300	貸付株式数	128,700株
リコー	178,700	1,156.00	206,577,200		
シチズン時計	64,800	632.00	40,953,600		
リズム時計	2,000	1,452.00	2,904,000		
大研医器	4,800	574.00	2,755,200	貸付株式数	1,100株
メニコン	8,200	3,220.00	26,404,000	貸付株式数	2,900株
シンシア	900	614.00	552,600	貸付株式数	300株
中本パックス	1,700	1,531.00	2,602,700	貸付株式数	600株
スノーピーク	2,200	1,465.00	3,223,000	貸付株式数	800株
パラマウントベッドHD	6,800	4,945.00	33,626,000		
トランザクション	3,200	741.00	2,371,200	貸付株式数	1,200株
SHOBI	1,700	347.00	589,900	貸付株式数	600株
ニホンフラッシュ	2,500	1,962.00	4,905,000	貸付株式数	600株
前田工織	6,600	2,671.00	17,628,600		
永大産業	7,600	435.00	3,306,000	貸付株式数	1,200株
アートネイチャー	6,400	655.00	4,192,000	貸付株式数	2,500株
バンダイナムコHLDGS	61,500	5,250.00	322,875,000		
アイフィスジャパン	1,300	590.00	767,000	貸付株式数	500株
共立印刷	10,200	220.00	2,244,000		
SHOEI	2,900	4,720.00	13,688,000	貸付株式数	1,200株
フランスベッドHLDGS	8,200	906.00	7,429,200	貸付株式数	3,300株
マーベラス	9,000	896.00	8,064,000	貸付株式数	3,500株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,400	4,515.00	46,956,000	貸付株式数	4,100株
萩原工業	3,200	1,428.00	4,569,600	貸付株式数	1,200株
エイベックス	10,100	1,475.00	14,897,500		
トッパン・フォームズ	13,000	968.00	12,584,000		
フジシールインターナショナル	13,400	4,110.00	55,074,000	貸付株式数	4,800株
タカラトミー	25,100	1,230.00	30,873,000	貸付株式数	9,100株
廣済堂	5,500	818.00	4,499,000	貸付株式数	500株
エステールホールディングス	1,500	705.00	1,057,500	貸付株式数	600株
アーク	23,500	100.00	2,350,000		
レック	6,400	1,479.00	9,465,600	貸付株式数	2,500株
タカノ	2,300	876.00	2,014,800		
三光合成	4,600	350.00	1,610,000	貸付株式数	1,800株
プロネクサス	5,100	1,254.00	6,395,400		

ホクシン	3,700	139.00	514,300	貸付株式数	1,400株
ウッドワン	2,000	1,103.00	2,206,000	貸付株式数	800株
大建工業	4,600	2,292.00	10,543,200	貸付株式数	600株
き も と	10,000	174.00	1,740,000		
凸版印刷	83,900	1,706.00	143,133,400		
大日本印刷	83,800	2,532.00	212,181,600		
図書印刷	5,600	1,009.00	5,650,400		
共同印刷	1,900	2,457.00	4,668,300		
N I S S H A	12,300	1,155.00	14,206,500	貸付株式数	4,200株 (2,700株)
光村印刷	500	2,398.00	1,199,000	貸付株式数	200株
藤森工業	5,300	3,200.00	16,960,000		
ヴィア・ホールディングス	7,200	684.00	4,924,800	貸付株式数	3,200株
宝印刷	3,100	1,687.00	5,229,700	貸付株式数	1,100株
前澤化成工業	4,200	1,059.00	4,447,800		
未来工業	1,500	2,620.00	3,930,000		
アシックス	56,200	1,449.00	81,433,800	貸付株式数	23,600株
ツ ツ ミ	1,900	2,040.00	3,876,000	貸付株式数	700株
ウェーブロックHLDGS	1,400	818.00	1,145,200		
ジェイ エス ピー	3,500	2,475.00	8,662,500	貸付株式数	1,400株
ニ チ ハ	8,400	3,015.00	25,326,000	貸付株式数	2,100株
エフピコ	4,900	6,610.00	32,389,000	貸付株式数	1,400株
小松ウオール工業	1,800	1,978.00	3,560,400	貸付株式数	400株
ヤマハ	35,400	5,590.00	197,886,000		
河合楽器	1,800	3,310.00	5,958,000	貸付株式数	700株
クリナップ	5,700	619.00	3,528,300		
ビジョン	36,000	4,500.00	162,000,000	貸付株式数	14,400株
天馬	4,100	2,064.00	8,462,400	貸付株式数	1,600株
兼松サステック	400	1,636.00	654,400	貸付株式数	100株
キングジム	4,800	873.00	4,190,400	貸付株式数	1,900株
象印マホービン	11,100	1,105.00	12,265,500	貸付株式数	4,400株
リンテック	14,000	2,462.00	34,468,000		
信越ポリマー	10,700	841.00	8,998,700		
東 リ	14,600	283.00	4,131,800		
イトーキ	10,900	541.00	5,896,900	貸付株式数	4,300株
任 天 堂	36,600	31,900.00	1,167,540,000		
三菱鉛筆	9,500	2,208.00	20,976,000	貸付株式数	3,900株
松 風	2,700	1,339.00	3,615,300	貸付株式数	1,000株
タカラスタンダ - ド	12,400	1,774.00	21,997,600	貸付株式数	3,800株
コ ク ヨ	28,600	1,649.00	47,161,400	貸付株式数	11,400株

ナカバヤシ	5,700	553.00	3,152,100	貸付株式数	1,000株
ニフコ	23,700	2,830.00	67,071,000	貸付株式数	9,500株
立川ブラインド	2,600	1,200.00	3,120,000	貸付株式数	400株
グローブライド	2,900	2,737.00	7,937,300	貸付株式数	1,100株
オカムラ	20,900	1,171.00	24,473,900		
バルカー	4,800	2,251.00	10,804,800	貸付株式数	200株
MUTOHホールディングス	700	1,923.00	1,346,100		
伊藤忠	409,300	2,085.50	853,595,150		
丸紅	578,100	805.00	465,370,500		
スクロール	9,000	390.00	3,510,000	貸付株式数	300株
高島	900	1,859.00	1,673,100	貸付株式数	300株
ヨンドシーホールディングス	6,500	2,140.00	13,910,000	貸付株式数	2,600株
三陽商会	3,600	1,769.00	6,368,400	貸付株式数	1,400株
長瀬産業	32,300	1,670.00	53,941,000	貸付株式数	12,500株
ナイガイ	2,000	518.00	1,036,000	貸付株式数	800株
蝶理	3,500	1,670.00	5,845,000	貸付株式数	100株
豊田通商	65,400	3,725.00	243,615,000		
オンワードホールディングス	35,400	596.00	21,098,400	貸付株式数	13,500株
三共生興	10,200	485.00	4,947,000	貸付株式数	4,000株
兼松	23,500	1,342.00	31,537,000		
美津濃	5,900	2,657.00	15,676,300		
ツカモトコーポレーション	1,000	1,284.00	1,284,000	貸付株式数	400株
ユニー・ファミリーマートHD	65,800	2,955.00	194,439,000	貸付株式数	26,300株
ルックホールディングス	2,100	1,533.00	3,219,300	貸付株式数	800株
三井物産	481,800	1,808.00	871,094,400		
日本紙パルプ	3,200	4,465.00	14,288,000	貸付株式数	900株
東京エレクトロン	39,700	16,345.00	648,896,500		
日立ハイテクノロジーズ	17,900	4,645.00	83,145,500		
カメイ	7,500	1,245.00	9,337,500	貸付株式数	3,000株
東都水産	800	2,531.00	2,024,800	貸付株式数	300株
OUGホールディングス	900	2,680.00	2,412,000	貸付株式数	300株
スターゼン	2,200	4,085.00	8,987,000	貸付株式数	800株
セイコーHD	9,200	2,683.00	24,683,600		
山善	23,000	1,233.00	28,359,000		
椿本興業	1,300	4,140.00	5,382,000	貸付株式数	500株
住友商事	345,200	1,601.50	552,837,800		

日本ユニシス	18,400	2,813.00	51,759,200		
内田洋行	2,700	3,280.00	8,856,000	貸付株式数	1,000株
三菱商事	410,400	3,252.00	1,334,620,800		
第一実業	2,700	3,435.00	9,274,500		
キャノンマーケティングJ PN	16,900	2,246.00	37,957,400		
西華産業	3,300	1,519.00	5,012,700	貸付株式数	1,300株
佐藤商事	5,100	962.00	4,906,200	貸付株式数	700株
菱洋エレクトロ	5,800	1,657.00	9,610,600	貸付株式数	2,300株
東京産業	6,300	522.00	3,288,600	貸付株式数	2,000株
ユアサ商事	6,000	3,355.00	20,130,000		
神鋼商事	1,300	2,736.00	3,556,800	貸付株式数	500株
小林産業	3,100	349.00	1,081,900	貸付株式数	1,200株
阪和興業	10,200	3,310.00	33,762,000	貸付株式数	4,000株
正栄食品	3,100	3,155.00	9,780,500	貸付株式数	1,200株
カナデン	5,700	1,252.00	7,136,400	貸付株式数	2,200株
菱電商事	4,600	1,563.00	7,189,800		
ニプロ	41,500	1,455.00	60,382,500	貸付株式数	16,500株
フルサト工業	3,200	1,684.00	5,388,800		
岩谷産業	13,000	3,680.00	47,840,000	貸付株式数	5,200株
すてきナイスグループ	2,500	920.00	2,300,000	貸付株式数	600株
昭光通商	2,300	632.00	1,453,600	貸付株式数	900株
ニチモウ	1,300	1,740.00	2,262,000	貸付株式数	500株
極東貿易	1,900	1,695.00	3,220,500	貸付株式数	400株
イワキ	7,000	406.00	2,842,000	貸付株式数	2,800株
兼松エレクトロニクス	3,200	3,390.00	10,848,000		
三愛石油	15,600	1,004.00	15,662,400	貸付株式数	6,300株
稲畑産業	14,200	1,551.00	22,024,200	貸付株式数	4,000株
G S Iクレオス	1,600	1,211.00	1,937,600	貸付株式数	600株
明和産業	6,200	454.00	2,814,800	貸付株式数	2,100株
ゴ - ルドウィン	5,300	14,980.00	79,394,000	貸付株式数	2,100株 (1,400株)
ユニ・チャ - ム	126,000	3,580.00	451,080,000	貸付株式数	50,700株
デサント	10,200	2,803.00	28,590,600	貸付株式数	5,700株
キ ン グ	3,000	584.00	1,752,000	貸付株式数	700株
ワ キ タ	12,500	1,134.00	14,175,000	貸付株式数	5,000株
ヤマトインタ - ナショナル	3,700	422.00	1,561,400	貸付株式数	1,400株
東邦ホールディングス	17,400	2,812.00	48,928,800	貸付株式数	6,300株
サンゲツ	17,400	2,095.00	36,453,000	貸付株式数	6,500株
ミツウロコグループ	8,300	895.00	7,428,500	貸付株式数	600株

シナネンホールディングス	2,400	2,238.00	5,371,200	
伊藤忠エネクス	12,300	943.00	11,598,900	
サンリオ	18,200	2,551.00	46,428,200	貸付株式数 6,700株 (2,100株)
サンワ テクノス	3,600	920.00	3,312,000	貸付株式数 1,000株
リョーサン	6,400	3,130.00	20,032,000	
新光商事	5,600	1,935.00	10,836,000	貸付株式数 1,600株
トーホー	2,700	2,228.00	6,015,600	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
三信電気	4,200	1,875.00	7,875,000	
東陽テクニカ	6,800	911.00	6,194,800	貸付株式数 900株
モスフード サービス	7,700	2,854.00	21,975,800	貸付株式数 3,000株
加賀電子	5,900	2,166.00	12,779,400	
三益半導体	4,600	1,535.00	7,061,000	貸付株式数 1,800株
ソーダニツカ	6,600	606.00	3,999,600	貸付株式数 2,400株 (900株)
立花エレテック	4,300	1,745.00	7,503,500	貸付株式数 1,200株
木曽路	7,300	2,735.00	19,965,500	貸付株式数 2,800株
S R Sホールディングス	6,900	1,027.00	7,086,300	貸付株式数 2,000株
千趣会	11,100	241.00	2,675,100	貸付株式数 4,200株
タカキュー	4,800	172.00	825,600	貸付株式数 1,800株 (1,600株)
ケーヨー	10,700	505.00	5,403,500	貸付株式数 4,200株
上新電機	7,000	2,714.00	18,998,000	貸付株式数 2,700株
日本瓦斯	9,600	3,245.00	31,152,000	
ロイヤルホールディングス	10,300	2,788.00	28,716,400	貸付株式数 4,100株
東天紅	500	1,244.00	622,000	貸付株式数 100株
いなげや	6,700	1,344.00	9,004,800	貸付株式数 2,200株
島忠	13,400	2,925.00	39,195,000	貸付株式数 5,300株
チヨダ	6,100	1,814.00	11,065,400	貸付株式数 2,400株
ライフコーポレーション	4,400	2,410.00	10,604,000	貸付株式数 1,700株
リンガーハット	7,300	2,384.00	17,403,200	貸付株式数 2,900株 (1,700株)
MrMaxHD	8,100	451.00	3,653,100	
テナライド	5,300	413.00	2,188,900	貸付株式数 2,100株
AOKIホールディングス	11,600	1,228.00	14,244,800	
オークワ	8,300	1,163.00	9,652,900	貸付株式数 3,300株
コメリ	9,100	2,766.00	25,170,600	
青山商事	10,600	2,601.00	27,570,600	
しまむら	6,800	9,420.00	64,056,000	貸付株式数 2,700株

はせがわ	2,900	407.00	1,180,300	貸付株式数	1,100株
高島屋	45,300	1,521.00	68,901,300	貸付株式数	18,400株
松屋	12,000	1,048.00	12,576,000	貸付株式数	4,700株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	29,000	1,554.00	45,066,000		
近鉄百貨店	2,200	3,530.00	7,766,000	貸付株式数	900株
パルコ	5,400	1,030.00	5,562,000	貸付株式数	2,200株
丸井グループ	49,800	2,276.00	113,344,800		
クレディセゾン	41,100	1,551.00	63,746,100		
アクシアルリテイリング	4,800	3,600.00	17,280,000	貸付株式数	1,900株
井筒屋	3,300	266.00	877,800	貸付株式数	1,300株
イオン	225,700	2,333.50	526,670,950	貸付株式数	90,700株
イズミ	11,900	5,180.00	61,642,000	貸付株式数	4,700株
フオーバル	2,600	849.00	2,207,400	貸付株式数	1,000株
平和堂	11,900	2,436.00	28,988,400	貸付株式数	4,300株
フジ	7,000	1,940.00	13,580,000	貸付株式数	2,800株
ヤオコー	6,700	5,780.00	38,726,000		
ゼビオホールディングス	7,100	1,281.00	9,095,100		
ケースホールディングス	61,500	1,008.00	61,992,000	貸付株式数	13,000株 (13,000株)
PALTAC	10,600	6,210.00	65,826,000		
三谷産業	7,900	290.00	2,291,000	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
OLYMPICグループ	3,500	688.00	2,408,000		
日産東京販売HD	8,500	318.00	2,703,000	貸付株式数	3,400株
新生銀行	43,400	1,592.00	69,092,800		
あおぞら銀行	33,000	2,847.00	93,951,000		
三菱UFJフィナンシャル G	4,034,500	561.60	2,265,775,200		
りそなホールディングス	643,200	496.10	319,091,520		
三井住友トラストHD	115,500	4,115.00	475,282,500		
三井住友フィナンシャルG	413,400	4,005.00	1,655,667,000		
千葉銀行	203,900	626.00	127,641,400		
群馬銀行	117,000	478.00	55,926,000		
武蔵野銀行	8,500	2,347.00	19,949,500		
千葉興業銀行	16,300	315.00	5,134,500		
筑波銀行	24,500	207.00	5,071,500		
七十七銀行	18,100	1,617.00	29,267,700	貸付株式数	7,400株
青森銀行	4,600	3,030.00	13,938,000	貸付株式数	1,800株
秋田銀行	3,800	2,385.00	9,063,000		

山形銀行	6,600	2,086.00	13,767,600	貸付株式数	2,600株 (1,600株)
岩手銀行	4,100	3,485.00	14,288,500	貸付株式数	800株
東邦銀行	52,600	311.00	16,358,600		
東北銀行	3,000	1,143.00	3,429,000	貸付株式数	1,000株
みちのく銀行	3,800	1,683.00	6,395,400	貸付株式数	1,500株
ふくおかフィナンシャルG	48,000	2,511.00	120,528,000		
静岡銀行	147,300	879.00	129,476,700		
十六銀行	7,800	2,440.00	19,032,000		
スルガ銀行	59,500	520.00	30,940,000	貸付株式数	23,800株 (7,000株)
八十二銀行	107,500	476.00	51,170,000		
山梨中央銀行	7,300	1,452.00	10,599,600		
大垣共立銀行	9,200	2,452.00	22,558,400		
福井銀行	5,100	1,785.00	9,103,500	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
北國銀行	6,300	3,645.00	22,963,500	貸付株式数	2,100株
清水銀行	2,500	1,949.00	4,872,500	貸付株式数	500株 (300株)
富山銀行	1,100	3,260.00	3,586,000	貸付株式数	300株
滋賀銀行	11,900	2,712.00	32,272,800	貸付株式数	3,600株
南都銀行	6,900	2,229.00	15,380,100	貸付株式数	2,700株
百五銀行	53,400	380.00	20,292,000	貸付株式数	10,600株
京都銀行	21,100	4,860.00	102,546,000		
紀陽銀行	20,900	1,621.00	33,878,900	貸付株式数	8,200株
ほくほくフィナンシャルG	38,300	1,263.00	48,372,900	貸付株式数	15,700株
広島銀行	87,800	595.00	52,241,000		
山陰合同銀行	35,100	858.00	30,115,800		
中国銀行	38,200	1,105.00	42,211,000		
鳥取銀行	2,000	1,502.00	3,004,000	貸付株式数	400株
伊予銀行	76,600	627.00	48,028,200	貸付株式数	28,700株
百十四銀行	6,300	2,460.00	15,498,000	貸付株式数	100株
四国銀行	8,400	1,125.00	9,450,000	貸付株式数	2,000株
阿波銀行	9,500	2,985.00	28,357,500	貸付株式数	3,700株
大分銀行	3,600	3,710.00	13,356,000	貸付株式数	1,000株
宮崎銀行	3,900	2,844.00	11,091,600	貸付株式数	200株
佐賀銀行	3,600	2,036.00	7,329,600	貸付株式数	300株
十八銀行	3,700	2,743.00	10,149,100		
沖縄銀行	5,400	3,740.00	20,196,000		
琉球銀行	13,500	1,249.00	16,861,500	貸付株式数	5,400株

セブン銀行	200,000	336.00	67,200,000	貸付株式数	78,700株
みずほフィナンシャルG	7,968,600	174.70	1,392,114,420	貸付株式数	2,800,000株
高知銀行	2,000	835.00	1,670,000	貸付株式数	300株
山口フィナンシャルG	74,100	1,012.00	74,989,200	貸付株式数	2,400株
芙蓉総合リース	6,700	5,700.00	38,190,000	貸付株式数	400株
興銀リース	11,000	2,815.00	30,965,000	貸付株式数	4,400株
東京センチュリー	11,900	4,830.00	57,477,000		
SBIホールディングス	70,100	2,532.00	177,493,200		
日本証券金融	26,000	631.00	16,406,000		
アイフル	90,000	282.00	25,380,000	貸付株式数	300株 (300株)
日本アジア投資	5,000	193.00	965,000	貸付株式数	1,300株
長野銀行	2,000	1,763.00	3,526,000		
名古屋銀行	4,800	3,695.00	17,736,000	貸付株式数	200株
北洋銀行	89,100	293.00	26,106,300		
愛知銀行	2,200	3,660.00	8,052,000		
中京銀行	2,400	2,320.00	5,568,000	貸付株式数	900株
大光銀行	2,000	1,748.00	3,496,000	貸付株式数	700株
愛媛銀行	8,200	1,182.00	9,692,400	貸付株式数	3,100株
トマト銀行	2,300	1,093.00	2,513,900		
京葉銀行	24,900	693.00	17,255,700		
栃木銀行	30,100	251.00	7,555,100		
北日本銀行	1,800	2,147.00	3,864,600	貸付株式数	600株 (400株)
東和銀行	10,300	782.00	8,054,600		
福島銀行	5,100	382.00	1,948,200	貸付株式数	3,000株
大東銀行	2,900	656.00	1,902,400	貸付株式数	1,100株
リコーリース	4,600	3,555.00	16,353,000	貸付株式数	1,800株
イオンフィナンシャルサー ビス	37,800	2,322.00	87,771,600		
アコム	118,800	399.00	47,401,200	貸付株式数	38,900株
ジャックス	6,500	1,927.00	12,525,500	貸付株式数	500株
オリコ	153,900	117.00	18,006,300	貸付株式数	61,600株
日立キャピタル	14,000	2,692.00	37,688,000		
アプラスフィナンシャル	31,700	87.00	2,757,900		
オリックス	391,300	1,647.50	644,666,750		
三菱UFJリース	132,700	574.00	76,169,800		
ジャフコ	9,700	4,075.00	39,527,500		
九州リースサービス	3,000	700.00	2,100,000	貸付株式数	1,100株
トモニホールディングス	45,600	452.00	20,611,200	貸付株式数	9,300株

大和証券G本社	470,200	561.60	264,064,320	
野村ホールディングス	1,029,300	406.40	418,307,520	
岡三証券グループ	49,800	447.00	22,260,600	
丸三証券	17,800	694.00	12,353,200	貸付株式数 1,000株
東洋証券	21,300	152.00	3,237,600	貸付株式数 500株
東海東京HD	70,000	422.00	29,540,000	貸付株式数 23,000株
光世証券	1,400	732.00	1,024,800	貸付株式数 200株
水戸証券	17,100	213.00	3,642,300	貸付株式数 6,800株
いちよし証券	12,300	813.00	9,999,900	
松井証券	29,000	1,194.00	34,626,000	貸付株式数 11,500株
SOMP Oホールディングス	103,700	4,140.00	429,318,000	
だいこう証券ビジ	2,400	424.00	1,017,600	貸付株式数 900株
日本取引所グループ	158,600	2,055.00	325,923,000	
マネックスG	55,400	400.00	22,160,000	貸付株式数 16,400株
カブドットコム証券	43,900	560.00	24,584,000	
極東証券	7,800	1,109.00	8,650,200	貸付株式数 3,100株
岩井コスモホールディング	6,000	1,335.00	8,010,000	貸付株式数 2,400株
藍澤証券	11,000	690.00	7,590,000	貸付株式数 4,400株
フィデアホール	57,900	136.00	7,874,400	
池田泉州HD	63,100	309.00	19,497,900	
アニコムホールディングス	4,500	2,839.00	12,775,500	貸付株式数 1,800株
MS&AD	153,000	3,435.00	525,555,000	
SONY FH	48,000	2,097.00	100,656,000	
マネーパートナーズGP	6,800	328.00	2,230,400	貸付株式数 2,700株
小林洋行	2,000	276.00	552,000	貸付株式数 800株
第一生命HLDGS	332,000	1,596.50	530,038,000	
東京海上HD	212,700	5,462.00	1,161,767,400	
アドバンテッジリスクマネ	2,200	871.00	1,916,200	貸付株式数 800株
イー・ギャランティ	5,500	1,073.00	5,901,500	貸付株式数 3,300株
アサックス	2,600	553.00	1,437,800	貸付株式数 900株
NECキャピタルソリューション	2,500	1,812.00	4,530,000	貸付株式数 900株
T&Dホールディングス	180,800	1,166.00	210,812,800	
アドバンスクリエイト	1,300	1,848.00	2,402,400	貸付株式数 500株
三井不動産	310,700	2,841.00	882,698,700	
三菱地所	410,200	2,031.00	833,116,200	
平和不動産	11,200	2,195.00	24,584,000	
東京建物	63,500	1,377.00	87,439,500	貸付株式数 25,800株

ダイビル	17,400	1,093.00	19,018,200	
京阪神ビルディング	10,800	1,069.00	11,545,200	
住友不動産	131,800	4,653.00	613,265,400	
太平洋興発	2,300	786.00	1,807,800	
テーオーシー	13,100	797.00	10,440,700	貸付株式数 5,400株
東京楽天地	900	4,980.00	4,482,000	貸付株式数 300株
スターツコーポレーション	7,800	2,397.00	18,696,600	
フジ住宅	8,200	847.00	6,945,400	貸付株式数 3,000株
空港施設	6,500	565.00	3,672,500	
明和地所	4,200	635.00	2,667,000	貸付株式数 1,200株
ゴールドクレスト	4,500	1,545.00	6,952,500	
リログループ	31,300	3,110.00	97,343,000	貸付株式数 12,500株
日本エスリード	2,400	1,675.00	4,020,000	貸付株式数 900株
日神不動産	8,800	477.00	4,197,600	貸付株式数 3,400株
日本エスコ	10,900	735.00	8,011,500	貸付株式数 4,600株
タカラレーベン	27,100	369.00	9,999,900	貸付株式数 2,800株
サンヨーハウジ 名古屋	4,000	935.00	3,740,000	
イオンモール	29,100	1,848.00	53,776,800	貸付株式数 11,800株
ファースト住建	2,300	1,265.00	2,909,500	貸付株式数 900株
ランド	258,500	8.00	2,068,000	貸付株式数 96,400株 (24,800株)
カチタス	6,600	3,720.00	24,552,000	貸付株式数 3,100株
東祥	3,600	3,150.00	11,340,000	貸付株式数 1,400株
トーセイ	8,400	1,025.00	8,610,000	貸付株式数 3,200株
穴吹興産	900	2,941.00	2,646,900	貸付株式数 300株
サンフロンティア不動産	8,400	1,225.00	10,290,000	
インテリックス	2,000	685.00	1,370,000	貸付株式数 600株
ランドビジネス	4,000	808.00	3,232,000	貸付株式数 1,600株
グランディハウス	6,100	472.00	2,879,200	貸付株式数 1,000株
東武鉄道	62,600	3,275.00	205,015,000	
相鉄ホールディングス	20,500	3,415.00	70,007,500	貸付株式数 8,200株
東京急行	161,700	1,972.00	318,872,400	
京浜急行	81,500	1,886.00	153,709,000	貸付株式数 100株
小田急電鉄	95,300	2,717.00	258,930,100	
京王電鉄	33,400	7,230.00	241,482,000	
京成電鉄	44,700	4,065.00	181,705,500	
富士急行	8,200	4,195.00	34,399,000	貸付株式数 3,200株 (100株)
新京成電鉄	1,500	2,205.00	3,307,500	貸付株式数 500株
東日本旅客鉄道	105,600	10,910.00	1,152,096,000	

西日本旅客鉄道	53,200	8,540.00	454,328,000	
東海旅客鉄道	53,200	25,765.00	1,370,698,000	
西武ホールディングス	73,600	1,904.00	140,134,400	
鴻池運輸	9,500	1,855.00	17,622,500	
西日本鉄道	16,300	2,765.00	45,069,500	貸付株式数 6,600株
ハマキョウレックス	4,600	4,425.00	20,355,000	貸付株式数 1,800株
サカイ引越センター	3,200	7,120.00	22,784,000	貸付株式数 1,000株
近鉄グループHLDGS	56,300	5,270.00	296,701,000	
阪急阪神HLDGS	75,100	4,225.00	317,297,500	
南海電鉄	25,200	3,155.00	79,506,000	貸付株式数 10,100株
京阪ホールディングス	25,300	4,610.00	116,633,000	
神戸電鉄	1,400	4,000.00	5,600,000	貸付株式数 500株
名古屋鉄道	45,400	3,125.00	141,875,000	貸付株式数 300株
山陽電鉄	4,300	2,295.00	9,868,500	貸付株式数 1,700株
トランコム	1,600	6,910.00	11,056,000	貸付株式数 600株
日本通運	22,200	6,310.00	140,082,000	
ヤマトホールディングス	98,700	2,983.00	294,422,100	
山 九	15,700	5,520.00	86,664,000	
日 新	4,900	1,934.00	9,476,600	
丸 運	3,200	294.00	940,800	貸付株式数 200株
丸全昭和運輸	4,600	3,045.00	14,007,000	貸付株式数 1,200株
センコーグループHLDGS	31,200	941.00	29,359,200	貸付株式数 12,400株
トナミホールディングス	1,400	6,600.00	9,240,000	貸付株式数 300株
ニッコンホールディングス	21,300	2,754.00	58,660,200	貸付株式数 1,500株
日石輸送	700	2,949.00	2,064,300	貸付株式数 200株
福山通運	7,300	4,335.00	31,645,500	
セイノーホールディングス	42,400	1,552.00	65,804,800	
エスライン	1,600	1,102.00	1,763,200	貸付株式数 600株
神奈川中央交通	1,400	3,940.00	5,516,000	貸付株式数 100株
日立物流	12,500	3,350.00	41,875,000	
丸和運輸機関	3,000	3,920.00	11,760,000	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
C & F ロジホールディングス	5,700	1,340.00	7,638,000	
日本郵船	45,900	1,647.00	75,597,300	
商船三井	33,300	2,452.00	81,651,600	
川崎汽船	17,600	1,222.00	21,507,200	貸付株式数 6,900株
N S ユナイテッド海運	3,200	2,528.00	8,089,600	貸付株式数 1,200株
明治海運	5,900	351.00	2,070,900	貸付株式数 1,300株

飯野海運	26,900	393.00	10,571,700		
共栄タンカー	500	1,530.00	765,000	貸付株式数	100株
九州旅客鉄道	47,300	3,725.00	176,192,500		
S Gホールディングス	53,300	3,270.00	174,291,000	貸付株式数	21,400株
日本航空	102,900	3,903.00	401,618,700		
A N Aホールディングス	102,800	4,072.00	418,601,600		
パスコ	1,100	855.00	940,500	貸付株式数	400株
西本W I S M E T T A C H D	1,300	4,415.00	5,739,500	貸付株式数	500株
ヤマシタヘルスケアH L D G S	400	1,133.00	453,200	貸付株式数	100株
G E N K Y D R U G S T O R E S	2,300	2,388.00	5,492,400	貸付株式数	900株
国際紙パルプ商事	10,600	305.00	3,233,000	貸付株式数	1,000株
総合メディカルH D	5,100	1,712.00	8,731,200	貸付株式数	2,000株
ブックオフG H D	3,000	823.00	2,469,000	貸付株式数	1,200株
三菱倉庫	19,700	3,060.00	60,282,000		
三井倉庫H O L D	6,900	1,832.00	12,640,800		
住友倉庫	20,900	1,455.00	30,409,500		
渋沢倉庫	3,100	1,765.00	5,471,500		
ヤマタネ	2,900	1,639.00	4,753,100	貸付株式数	200株
東陽倉庫	9,900	334.00	3,306,600	貸付株式数	1,000株
乾汽船	5,200	863.00	4,487,600	貸付株式数	2,000株
日本トランスシティ	12,600	490.00	6,174,000	貸付株式数	4,700株
ケイヒン	1,000	1,443.00	1,443,000	貸付株式数	400株
中央倉庫	3,400	1,084.00	3,685,600	貸付株式数	1,000株
川西倉庫	1,100	1,393.00	1,532,300	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,600	941.00	4,328,600	貸付株式数	1,800株
東洋埠頭	1,700	1,550.00	2,635,000		
宇徳	4,700	585.00	2,749,500	貸付株式数	300株
上 組	34,600	2,600.00	89,960,000	貸付株式数	13,900株 (13,900株)
サンリツ	1,400	719.00	1,006,600	貸付株式数	500株
キムラユニティー	1,500	1,133.00	1,699,500	貸付株式数	600株
キューソー流通システム	1,400	2,086.00	2,920,400	貸付株式数	500株 (200株)
近鉄エクスプレス	10,700	1,740.00	18,618,000	貸付株式数	4,200株
東海運	3,300	282.00	930,600	貸付株式数	1,000株
エーアイティー	3,600	1,169.00	4,208,400	貸付株式数	1,400株
内外トランスライン	1,800	1,363.00	2,453,400	貸付株式数	700株

日本コンセプト	1,500	961.00	1,441,500	貸付株式数	600株
東京放送HD	38,800	2,114.00	82,023,200	貸付株式数	12,000株
日本テレビHD	53,500	1,713.00	91,645,500	貸付株式数	13,500株
朝日放送グループHD	6,100	817.00	4,983,700		
テレビ朝日HD	16,200	2,040.00	33,048,000	貸付株式数	600株
スカパーJSATHD	44,500	484.00	21,538,000		
テレビ東京HD	4,800	2,498.00	11,990,400	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本BS放送	2,000	1,066.00	2,132,000	貸付株式数	700株
ビジョン	1,800	4,720.00	8,496,000	貸付株式数	700株
USEN-NEXT HD DGS	2,300	881.00	2,026,300	貸付株式数	700株
ワイアレスゲート	2,500	419.00	1,047,500	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,100	1,445.00	5,924,500		
日本通信	50,500	111.00	5,605,500	貸付株式数	22,900株 (1,000株)
クロップス	1,000	681.00	681,000	貸付株式数	400株 (400株)
日本電信電話	399,000	4,866.00	1,941,534,000		
KDDI	514,100	2,480.00	1,274,968,000		
ソフトバンク	465,200	1,303.00	606,155,600	貸付株式数	186,800株
光通信	6,900	21,110.00	145,659,000		
NTTドコモ	419,100	2,508.00	1,051,102,800		
エムティーアイ	6,900	635.00	4,381,500	貸付株式数	2,700株
GMOインターネット	21,500	1,814.00	39,001,000	貸付株式数	8,500株
アイドママーケティングコ ミュ	1,300	501.00	651,300		
カドカワ	17,200	1,219.00	20,966,800	貸付株式数	4,700株
学研ホールディングス	2,000	5,430.00	10,860,000		
ゼンリン	11,800	2,520.00	29,736,000	貸付株式数	4,600株
昭文社	2,700	435.00	1,174,500		
インプレスホールディング ス	4,900	146.00	715,400	貸付株式数	1,900株
東京電力HD	475,100	716.00	340,171,600	貸付株式数	173,400株
中部電力	182,600	1,801.50	328,953,900		
関西電力	242,900	1,744.00	423,617,600		
中国電力	82,000	1,462.00	119,884,000	貸付株式数	33,000株
北陸電力	58,600	916.00	53,677,600		
東北電力	139,700	1,485.00	207,454,500		
四国電力	53,700	1,401.00	75,233,700		

九州電力	122,500	1,346.00	164,885,000	
北海道電力	56,100	662.00	37,138,200	
沖縄電力	11,000	1,979.00	21,769,000	
電源開発	47,000	2,786.00	130,942,000	
エフオン	3,600	749.00	2,696,400	貸付株式数 1,100株
イーレックス	10,300	1,061.00	10,928,300	貸付株式数 2,300株
レノバ	6,200	938.00	5,815,600	貸付株式数 2,400株 (1,400株)
東京瓦斯	116,400	3,097.00	360,490,800	
大阪瓦斯	114,700	2,298.00	263,580,600	
東邦瓦斯	29,500	5,140.00	151,630,000	
北海道瓦斯	3,100	1,480.00	4,588,000	
広島ガス	11,900	361.00	4,295,900	貸付株式数 2,000株
西部瓦斯	6,600	2,513.00	16,585,800	貸付株式数 1,700株
静岡ガス	18,200	890.00	16,198,000	貸付株式数 7,200株
メタウォーター	2,900	3,115.00	9,033,500	
アイネット	3,300	1,337.00	4,412,100	貸付株式数 500株
松竹	3,900	12,200.00	47,580,000	貸付株式数 300株
東宝	38,400	4,365.00	167,616,000	貸付株式数 15,400株
エイチ・アイ・エス	10,200	4,030.00	41,106,000	貸付株式数 4,000株 (1,300株)
東映	2,500	15,210.00	38,025,000	貸付株式数 900株
ラックランド	1,100	2,027.00	2,229,700	
NTTデータ	157,300	1,207.00	189,861,100	
共立メンテナンス	8,700	5,740.00	49,938,000	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	1,210.00	7,139,000	貸付株式数 1,200株
建設技術研究所	3,900	1,530.00	5,967,000	貸付株式数 1,500株
スペース	3,700	1,420.00	5,254,000	貸付株式数 300株
長大	2,200	731.00	1,608,200	貸付株式数 800株
アインホールディングス	7,900	8,160.00	64,464,000	貸付株式数 3,100株
燦ホールディングス	1,200	2,502.00	3,002,400	
ピー・シー・エー	700	3,000.00	2,100,000	貸付株式数 200株
スバル興業	400	5,850.00	2,340,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	2,400	1,349.00	3,237,600	
タナベ経営	1,100	1,293.00	1,422,300	貸付株式数 400株
ビジネスB太田昭和	1,000	1,862.00	1,862,000	貸付株式数 400株
ナガワ	1,600	6,430.00	10,288,000	貸付株式数 100株
よみうりランド	1,200	4,565.00	5,478,000	貸付株式数 400株
東京都競馬	3,700	3,430.00	12,691,000	貸付株式数 1,400株

常磐興産	2,200	1,713.00	3,768,600	貸付株式数	800株
カナモト	8,600	2,655.00	22,833,000	貸付株式数	3,400株
東京ドーム	21,500	1,090.00	23,435,000	貸付株式数	8,500株
D T S	6,600	4,100.00	27,060,000	貸付株式数	1,900株
スクウェア・エニックス・HD	27,300	3,925.00	107,152,500		
シーイーシー	6,300	2,096.00	13,204,800		
カプコン	25,200	2,504.00	63,100,800		
西尾レントオール	5,800	3,250.00	18,850,000	貸付株式数	2,300株
アイ・エス・ビー	1,100	1,921.00	2,113,100	貸付株式数	200株
アゴーラ・ホスピタリティーG	33,400	36.00	1,202,400	貸付株式数	12,500株
日本空港ビルデング	18,800	4,805.00	90,334,000	貸付株式数	7,500株
トランス・コスモス	6,400	2,224.00	14,233,600	貸付株式数	2,200株
乃村工藝社	13,400	3,075.00	41,205,000	貸付株式数	5,300株
ジャステック	3,400	983.00	3,342,200	貸付株式数	1,300株
S C S K	15,600	4,935.00	76,986,000		
藤田観光	2,300	2,767.00	6,364,100		
K N T - C Tホールディングス	3,000	1,397.00	4,191,000	貸付株式数	1,200株
日本管財	6,200	1,965.00	12,183,000	貸付株式数	2,400株
トーカイ	5,500	2,760.00	15,180,000	貸付株式数	2,200株
白 洋 舎	700	2,937.00	2,055,900	貸付株式数	200株
セコム	60,400	9,600.00	579,840,000		
日本システムウエア	1,900	2,342.00	4,449,800	貸付株式数	300株
セントラル警備保障	2,800	4,840.00	13,552,000	貸付株式数	1,100株
アイネス	7,400	1,310.00	9,694,000	貸付株式数	1,500株
丹青社	10,800	1,308.00	14,126,400	貸付株式数	4,300株
メイテック	7,300	5,060.00	36,938,000	貸付株式数	2,100株
T K C	4,900	4,180.00	20,482,000	貸付株式数	1,900株
富士ソフト	8,800	4,200.00	36,960,000	貸付株式数	3,500株
応用地質	6,200	1,138.00	7,055,600	貸付株式数	2,400株
船井総研ホールディング	11,900	2,674.00	31,820,600	貸付株式数	4,700株
N S D	9,600	2,587.00	24,835,200	貸付株式数	3,800株
進学会ホールディングス	2,800	569.00	1,593,200	貸付株式数	200株
丸紅建材リース	500	2,013.00	1,006,500	貸付株式数	200株
オ オ バ	4,400	627.00	2,758,800	貸付株式数	1,300株
コナミホールディングス	23,900	4,885.00	116,751,500		
いであ	1,100	1,020.00	1,122,000	貸付株式数	400株
学 究 社	1,900	1,360.00	2,584,000	貸付株式数	700株

ベネッセホールディングス	20,800	2,966.00	61,692,800		
イオンディライト	7,100	4,225.00	29,997,500	貸付株式数	2,800株
ナック	3,800	1,068.00	4,058,400	貸付株式数	1,100株
福井コンピュータHLD S	1,900	1,999.00	3,798,100		
ニチイ学館	8,100	1,329.00	10,764,900		
ダイセキ	9,600	2,755.00	26,448,000	貸付株式数	3,800株
ステップ	2,100	1,494.00	3,137,400	貸付株式数	800株
日鉄住金物産	4,100	4,820.00	19,762,000		
泉州電業	2,000	2,778.00	5,556,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,600	5,140.00	8,224,000		
トラスコ中山	12,300	2,984.00	36,703,200	貸付株式数	4,900株
ヤマダ電機	178,200	567.00	101,039,400	貸付株式数	62,600株 (400株)
オートバックスセブン	23,600	1,879.00	44,344,400		
モリト	4,100	860.00	3,526,000	貸付株式数	1,600株
アークランドサカモト	9,900	1,522.00	15,067,800	貸付株式数	3,900株
ニトリホールディングス	25,400	13,970.00	354,838,000	貸付株式数	10,200株
グルメ杵屋	4,100	1,221.00	5,006,100	貸付株式数	1,300株
愛眼	4,700	310.00	1,457,000		
ケーユーホールディングス	3,000	872.00	2,616,000	貸付株式数	700株
吉野家ホールディングス	20,600	1,750.00	36,050,000	貸付株式数	8,200株
加藤産業	9,200	3,830.00	35,236,000	貸付株式数	100株
北恵	1,000	939.00	939,000	貸付株式数	400株
イノテック	4,000	1,010.00	4,040,000	貸付株式数	2,000株
イエローハット	5,500	2,990.00	16,445,000		
松屋フーズHLDGS	2,800	3,830.00	10,724,000	貸付株式数	1,100株
JBC Cホールディングス	4,600	1,406.00	6,467,600	貸付株式数	1,400株
J Kホールディングス	5,500	615.00	3,382,500	貸付株式数	1,500株
サガミホールディングス	7,800	1,308.00	10,202,400	貸付株式数	3,100株
日伝	4,800	1,685.00	8,088,000	貸付株式数	1,900株
関西スーパーマーケット	4,400	1,114.00	4,901,600	貸付株式数	1,600株
ミロク情報サービス	5,800	2,870.00	16,646,000	貸付株式数	2,300株
北沢産業	4,400	274.00	1,205,600	貸付株式数	1,700株
杉本商事	3,100	1,805.00	5,595,500	貸付株式数	1,200株
因幡電機産業	8,400	4,495.00	37,758,000	貸付株式数	2,700株
王将フードサービス	4,300	7,450.00	32,035,000	貸付株式数	1,700株
プレナス	6,600	1,760.00	11,616,000	貸付株式数	2,500株 (2,500株)
ミニストップ	4,400	1,710.00	7,524,000	貸付株式数	1,700株
アークス	10,900	2,497.00	27,217,300	貸付株式数	4,400株

パローホールディングス	12,700	2,759.00	35,039,300	
バイテックホールディングス	2,700	1,925.00	5,197,500	
東 テ ク	1,900	2,301.00	4,371,900	
ミスミグループ本社	73,700	2,717.00	200,242,900	貸付株式数 26,600株 (26,500株)
藤 久	500	759.00	379,500	貸付株式数 100株
アルテック	4,400	212.00	932,800	貸付株式数 1,700株
ベ ル ク	2,900	5,310.00	15,399,000	貸付株式数 1,100株
大 庄	3,100	1,541.00	4,777,100	貸付株式数 1,200株
タキヒヨー	1,700	1,795.00	3,051,500	貸付株式数 600株
ファーストリテイリング	7,800	52,760.00	411,528,000	貸付株式数 3,100株
ソフトバンクグループ	243,900	10,615.00	2,588,998,500	
蔵王産業	900	1,370.00	1,233,000	貸付株式数 300株
スズケン	26,900	6,340.00	170,546,000	貸付株式数 9,400株
サンドラッグ	22,100	3,190.00	70,499,000	
サクスパーホールディング	5,000	1,164.00	5,820,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
ジェコス	4,000	1,061.00	4,244,000	貸付株式数 1,600株
ヤマザワ	1,200	1,703.00	2,043,600	貸付株式数 400株
や ま や	1,000	2,341.00	2,341,000	貸付株式数 100株
ルネサスイーストン	5,500	436.00	2,398,000	貸付株式数 2,100株
ベルーナ	14,400	898.00	12,931,200	貸付株式数 5,700株
合計			137,866,843,610	

(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（2019年3月27日から2019年9月26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】

為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2019年9月26日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,498,172
親投資信託受益証券	192,707,584
派生商品評価勘定	367,460
未収入金	3,218,576
流動資産合計	199,791,792
資産合計	199,791,792
負債の部	
流動負債	
未払金	2,574,789
未払受託者報酬	44,249
未払委託者報酬	564,805
その他未払費用	8,370
流動負債合計	3,192,213
負債合計	3,192,213
純資産の部	
元本等	
元本	192,800,678
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,798,901
元本等合計	196,599,579
純資産合計	196,599,579
負債純資産合計	199,791,792

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年3月27日 至 2019年9月26日
営業収益	
有価証券売買等損益	6,464,711
為替差損益	1,436,196
営業収益合計	7,900,907
営業費用	
支払利息	1,115
受託者報酬	44,249
委託者報酬	564,805
その他費用	8,386
営業費用合計	618,555
営業利益又は営業損失（ ）	7,282,352
経常利益又は経常損失（ ）	7,282,352
中間純利益又は中間純損失（ ）	7,282,352
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	674,031
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,219,815
剰余金増加額又は欠損金減少額	435,278
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	435,278
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,883
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,883
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,798,901

(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	至
	2019年3月27日	2019年9月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	

(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9月26日現在
1. 1 期首元本額	207,573,522円
期中追加設定元本額	13,882,264円
期中一部解約元本額	28,655,108円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	192,800,678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	至
	2019年3月27日	2019年9月26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9月26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)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

通貨関連

種 類	当中間計算期間末 2019年9月26日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	170,954,591	-	170,587,131	367,460
アメリカ・ドル	170,954,591	-	170,587,131	367,460
合計	170,954,591	-	170,587,131	367,460

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2019年9月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0197円 (10,197円)

(参考)

当ファンドは、「米国国債マザーファンド」受益証券及び「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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。

「米国国債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年9月26日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	45,804,447
コール・ローン	61,296,550
国債証券	14,728,981,871
未収利息	59,112,768
前払費用	11,842,889
流動資産合計	14,907,038,525

資産合計		14,907,038,525
負債の部		
流動負債		
未払解約金		14,897,000
その他未払費用		8
流動負債合計		14,897,008
負債合計		14,897,008
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,197,931,498
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,694,210,019
元本等合計		14,892,141,517
純資産合計		14,892,141,517
負債純資産合計		14,907,038,525

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年3月27日 至 2019年9月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
----------------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年9月26日現在
1. 1 期首	2019年3月27日
期首元本額	10,969,616,964円
期中追加設定元本額	1,358,657,085円
期中一部解約元本額	1,130,342,551円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
米国国債ファンド 為替ヘッジあり(年1回決算型)	3,309,675,508円
米国国債ファンド 為替ヘッジなし(年1回決算型)	1,626,186,083円
米国国債ファンド フレックスヘッジ(年1回決算型)	154,704,975円
米国国債ファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	5,864,184,912円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	130,322,738円
米国国債ファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	112,857,282円
計	11,197,931,498円

2. 期末日における受益権の総数	11,197,931,498口
------------------	-----------------

(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9月26日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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

2019年9月26日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2019年9月26日現在
1口当たり純資産額	1.3299円
(1万口当たり純資産額)	(13,299円)

「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9月26日現在	
	金 額 (円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		15,870,195,021
株式	2 3	144,293,948,550
派生商品評価勘定		3,472,720
未収入金		283,497,674
未収配当金		54,442,053

未収利息		1,387,411
その他未収収益	4	12,142,601
流動資産合計		160,519,086,030
資産合計		160,519,086,030
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,554,000
前受金		1,730,000
未払解約金		219,364,640
受入担保金		15,228,423,261
その他未払費用		2,724
流動負債合計		15,451,074,625
負債合計		15,451,074,625
純資産の部		
元本等		
元本	1	138,762,441,997
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,305,569,408
元本等合計		145,068,011,405
純資産合計		145,068,011,405
負債純資産合計		160,519,086,030

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年3月27日 至 2019年9月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

	<p>(2)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>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<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>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<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	2019年9月26日現在
<p>1. 1 期首</p> <p>期首元本額</p> <p>期中追加設定元本額</p> <p>期中一部解約元本額</p>	<p>2019年3月27日</p> <p>135,032,886,401円</p> <p>16,108,078,116円</p> <p>12,378,522,520円</p>
<p>期末元本額の内訳</p> <p>ファンド名</p> <p>トピックス・インデックス ファンド</p> <p>ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A</p> <p>適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2</p> <p>ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)</p>	<p>3,954,344,146円</p> <p>7,633,016,138円</p> <p>8,939,677円</p> <p>60,746,661円</p>

ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	904,922,781円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	48,937,577円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	1,258,030,680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)	33,511,898円
D-I's TOPIXイン デックス	41,939,206円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	18,549,240円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	4,330,138円
iFree TOPIXイン デックス	1,241,999,605円
iFree 8資産バランス	1,942,470,221円
iFree 年金バランス	56,382,849円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,555,890,960円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,929,934,729円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,302,206,490円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,036,188,397円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,852,291,987円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	14,906,787円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	54,537,768円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	20,807,048円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	195,397,303円
ダイワつみたてインデックス バランス30	198,705円

ダイワつみたてインデックス バランス50	300,351円
ダイワつみたてインデックス バランス70	479,367円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	167,628,084円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	171,981,504円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,233,876,844円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	3,092,274円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	821,177,787円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	127,742,510円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	222,487,484円
ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	151,246,354円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	9,622,901,813円
ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	2,723,415,243円
ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス	2,559,952,991円
ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,422,022,446円
ダイワライフスタイル25	192,737,780円
ダイワライフスタイル50	683,085,044円
ダイワライフスタイル75	558,905,839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)	12,928,927,291円
計	138,762,441,997円
2. 期末日における受益権の総数	138,762,441,997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 14,486,628,900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 539,260,000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9,519,995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9月26日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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9月26日 現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
株価指数 先物取引				

買 建	2,117,930,000	-	2,119,920,000	1,990,000
合計	2,117,930,000	-	2,119,920,000	1,990,000

(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)

	2019年9月26日現在
1口当たり純資産額	1.0454円
(1万口当たり純資産額)	(10,454円)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2019年9月30日

資産総額	197,022,888円
負債総額	513,360円
純資産総額（ - ）	196,509,528円
発行済数量	192,311,193口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.0218円

(参考) 米国国債マザーファンド

純資産額計算書

2019年9月30日

資産総額	15,116,318,757円
負債総額	10,851円
純資産総額（ - ）	15,116,307,906円
発行済数量	11,299,691,355口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3378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9月30日

資産総額	159,044,024,075円
負債総額	15,798,566,955円
純資産総額（ - ）	143,245,457,120円
発行済数量	138,748,757,557口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.0324円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2019年9月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年9月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	63	119,570
追加型株式投資信託	712	15,788,257
株式投資信託 合計	775	15,907,827
単位型公社債投資信託	28	94,090
追加型公社債投資信託	14	1,400,808
公社債投資信託 合計	42	1,494,898
総合計	817	17,402,725

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	1
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					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益	利益剰余金	
				剰余金		
			繰越利益			
			剰余金			

当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
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					株主資本合計	
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金合計		
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金			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ます。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式

は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されておりま。

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 其他有価証券	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、記載しておりません。

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、記載しておりません。

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	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(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

2020年4月1日付で、定款について次の変更を行なう予定です。

- ・ 商号の変更(大和アセットマネジメント株式会社に変更)

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
株式会社西京銀行	23,497	(注)

(注) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（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。

次の事項を記載することがあります。

- ・大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更します。2020年4月1日以降、「大和投資信託」「大和証券投資信託委託株式会社」など
当社名を表す記載につきましては、「大和アセットマネジメント株式会社」とお読み替え下さい。

(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31年4月26日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンドの平成30年3月27日から平成31年3月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンドの平成31年3月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年10月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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」に掲げられている為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンドの2019年3月27日から2019年9月26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、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンドの2019年9月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年3月27日から2019年9月26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。