

## 【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】	2020年6月12日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワ・ノーロード TOPIX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】

ダイワ・ノーロード TOPIXファンド

### (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合わせる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】

ありません。

### (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】

2020年6月13日から2020年12月16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、取得申込金額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、取得申込金額を、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。

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

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。

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、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

##### (注1) 商品分類の定義

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

##### (注2) 属性区分の定義

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式		グローバル		
一般	年1回	日本		日経225
大型株				
中小型株	年2回	北米	ファミリー ファンド	
債券		欧州		
一般	年4回	アジア		TOPIX
公債		オセアニア		
社債	年6回 (隔月)	中南米		
その他債券		アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ( )
クレジット属性 ( )	年12回 (毎月)	中近東 (中東)		
不動産投信		エマージング		
その他資産 (投資信託証券) (株式 一般)	日々			
資産複合 ( )	その他 ( )			
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。

## &lt; 信託金の限度額 &gt;

- ・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。

## &lt; ファンドの特色 &gt;



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

- ① 東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。
- (a) 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。
  - (b) ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。
  - (c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

### 運用プロセス



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

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

### ◆ 東証株価指数（TOPIX）について

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ないます。

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



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

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



### 2 購入時および換金時の手数料はありません。

- ① 購入時手数料がないノーロードタイプです。
  - ② 換金時手数料および信託財産留保額もありません。
- （注）保有期間中に運用管理費用（信託報酬）等をご負担いただきます。

## 分配方針

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

〔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。
- 外貨建資産への投資は、行ないません。



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

## ●基準価額の動きに関する留意点

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

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

### (2) 【ファンドの沿革】

2016年3月14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	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金（ 3 ）	
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す。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社（*）に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
	損益 投資	
投資対象	<p>東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。） など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）</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経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

\*再信託受託会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

< 委託会社の概況(2020年3月末日現在) >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長(金商)第352号)

・大株主の状況

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

## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

#### 主要投資対象

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

#### 投資態度

イ. 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数(TOPIX)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

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

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

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

## (2) 【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)、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、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1. から前11. までの証券または証書の性質を有するもの

13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14. 投資証券、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。）

15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前14.の証券のうち投資法人債券ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券(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。

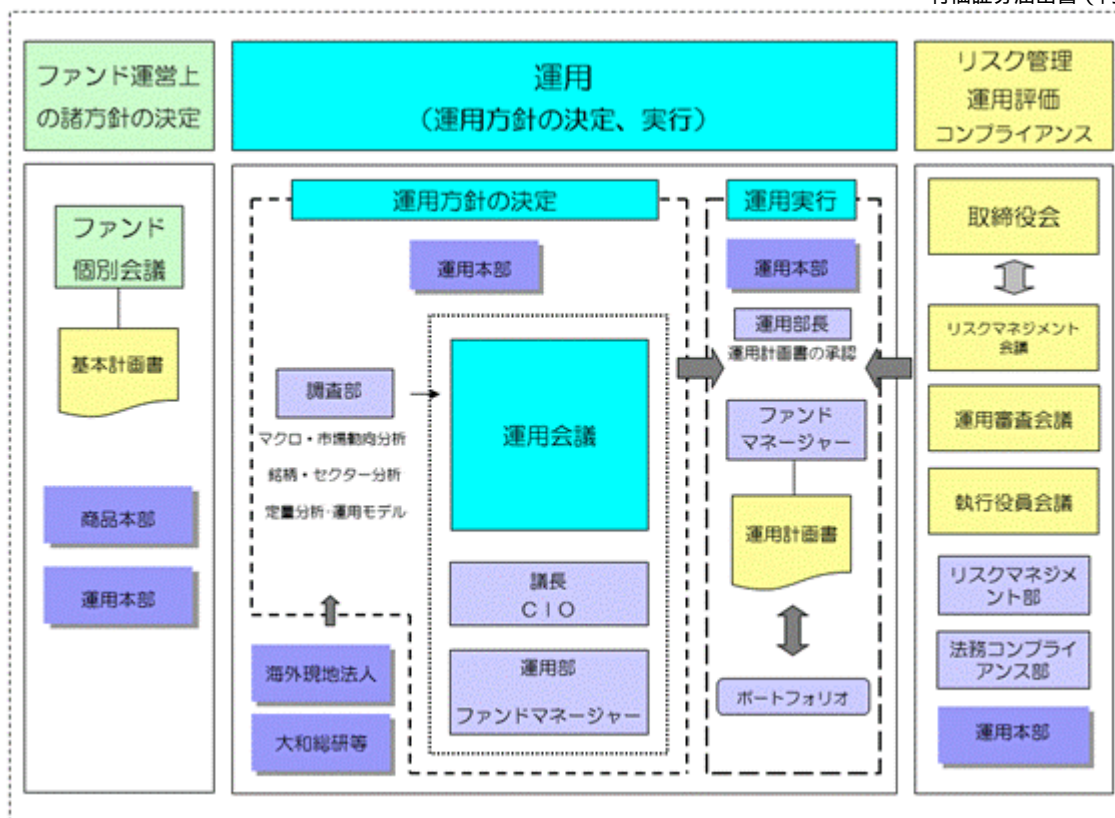
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。 )
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

### (3) 【運用体制】

#### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．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。

#### ハ．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。

## 運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

## イ．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。

## ロ．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。

## ハ．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2020年3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】

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。

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ます（以下同じ。）。

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

スワップ取引（信託約款）

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

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

ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

金利先渡取引（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八．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．金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ．委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。
- 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）

外貨建資産への投資は、行ないません。

#### 信用リスク集中回避（信託約款）

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

#### 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

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

##### (1) 投資方針

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

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

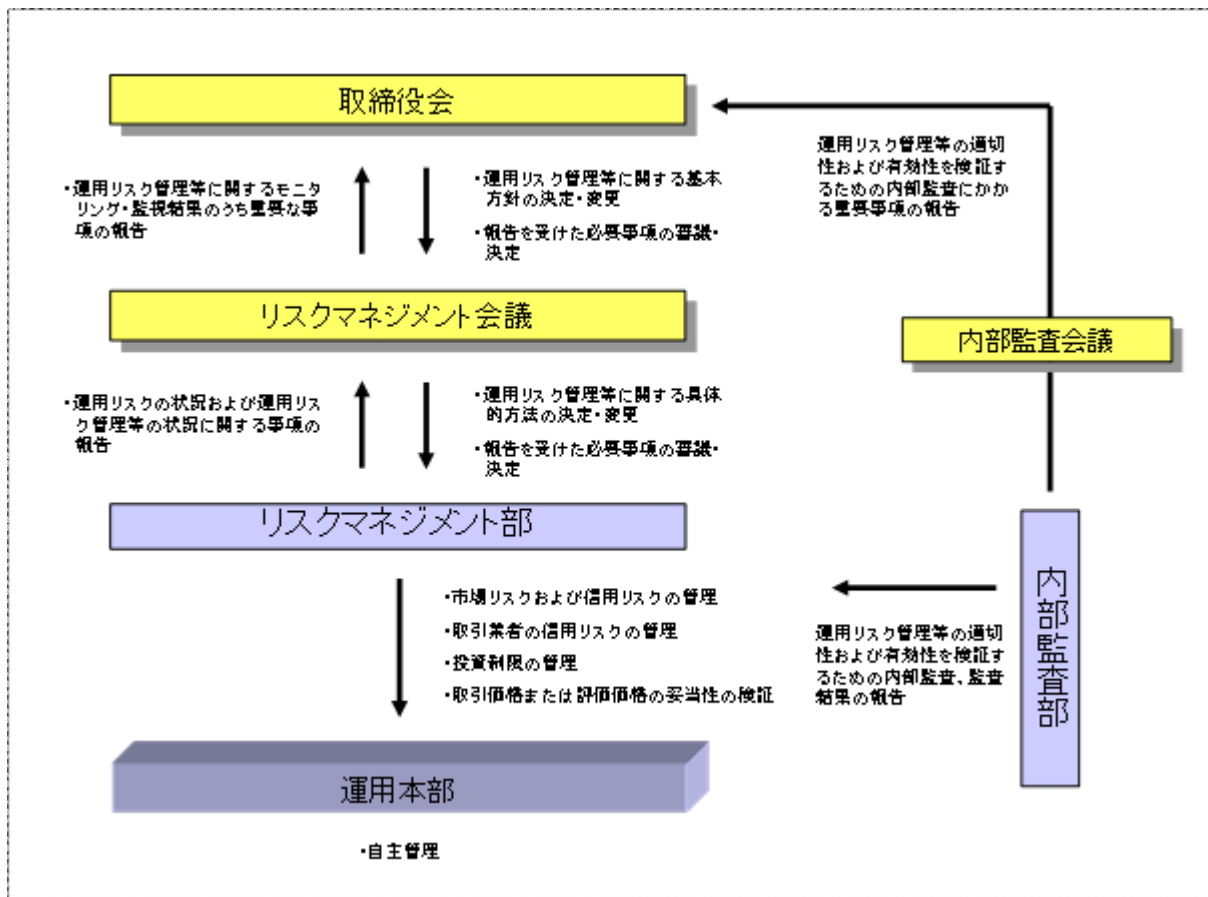
#### (3) その他の留意点

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

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

#### (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

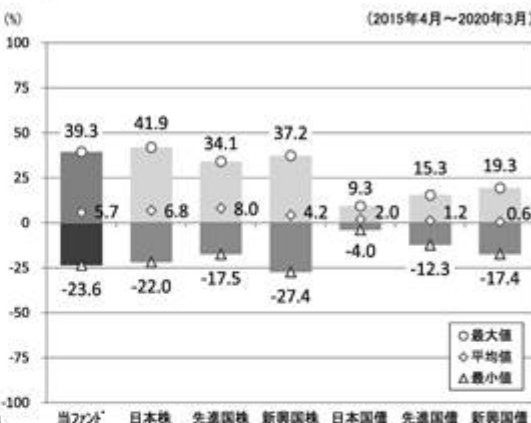
## 参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

### ※資産クラスについて

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

### ※指数について

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

ありません。

### (2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

### (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.55%（税抜0.50%）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するものとします。

信託報酬にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.24%（税抜）	年率0.23%（税抜）	年率0.03%（税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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 >

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（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用を控除した利益）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：N I S A（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「N I S A（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたN I S A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N I S A」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。

- ( ) 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、2020年3月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（2020年3月31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	174,033,866	99.99
内 日本	174,033,866	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,862	0.01
純資産総額	174,046,728	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】（2020年3月31日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	188,002,448	1.0207 191,905,307	0.9257 174,033,866	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2016年9月20日)	20,973,537	20,973,537	0.9773	0.9773
第2計算期間末 (2017年9月19日)	59,875,242	59,875,242	1.2577	1.2577
第3計算期間末 (2018年9月19日)	139,230,873	139,230,873	1.3670	1.3670
2019年3月末日	162,114,685	-	1.2408	-
4月末日	154,864,492	-	1.2609	-
5月末日	158,047,454	-	1.1783	-
6月末日	165,335,752	-	1.2100	-
7月末日	169,144,401	-	1.2205	-
8月末日	167,968,357	-	1.1788	-
第4計算期間末 (2019年9月19日)	166,730,681	166,730,681	1.2595	1.2595
9月末日	155,058,770	-	1.2494	-
10月末日	164,346,364	-	1.3112	-
11月末日	169,381,897	-	1.3361	-
12月末日	166,231,830	-	1.3548	-
2020年1月末日	160,073,099	-	1.3253	-
2月末日	149,593,051	-	1.1886	-
3月末日	174,046,728	-	1.1172	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
2019年9月20日～ 2020年3月19日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.3
第2計算期間	28.7
第3計算期間	8.7
第4計算期間	7.9
2019年9月20日～ 2020年3月19日	19.8

## (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	68,189,418	47,728,670
第2計算期間	192,710,801	166,565,615
第3計算期間	151,486,100	97,241,752
第4計算期間	140,518,518	109,989,718
2019年9月20日～ 2020年3月19日	109,296,959	92,603,939

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年3月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	134,184,505,210	97.56
内 日本	134,184,505,210	97.56
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,357,957,680	2.44
純資産総額	137,542,462,890	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)	3,142,720,000	2.28
内 日本	3,142,720,000	2.28

(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 (2020年3月31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	759,200	7,330.12 5,565,033,497	6,501.00 4,935,559,200	3.59
2	ソニー	日本	株式	電気機 器	430,500	6,380.14 2,746,650,376	6,421.00 2,764,240,500	2.01
3	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	892,500	2,625.25 2,343,040,569	2,575.50 2,298,633,750	1.67
4	キーエンス	日本	株式	電気機 器	61,600	33,481.59 2,062,466,222	34,830.00 2,145,528,000	1.56
5	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	529,600	4,539.51 2,404,127,991	3,788.00 2,006,124,800	1.46
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	566,100	3,750.10 2,122,932,018	3,308.00 1,872,658,800	1.36
7	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,591,200	557.70 2,560,527,262	403.00 1,850,253,600	1.35
8	任天堂	日本	株式	その他 製品	41,700	41,698.66 1,738,834,211	41,610.00 1,735,137,000	1.26
9	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	493,100	2,832.04 1,396,481,857	3,377.00 1,665,198,700	1.21
10	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	497,400	2,884.55 1,434,775,767	3,190.00 1,586,706,000	1.15
11	第一三共	日本	株式	医薬品	194,700	7,064.75 1,375,508,595	7,434.00 1,447,399,800	1.05
12	花王	日本	株式	化学	162,900	7,988.98 1,301,405,300	8,830.00 1,438,407,000	1.05
13	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	535,800	2,864.95 1,535,044,048	2,430.00 1,301,994,000	0.95
14	リクルートホールディン グス	日本	株式	サービ ス業	465,600	3,420.82 1,592,737,773	2,796.00 1,301,817,600	0.95
15	HOYA	日本	株式	精密機 器	135,800	8,917.79 1,211,036,284	9,200.00 1,249,360,000	0.91
16	信越化学	日本	株式	化学	114,400	11,741.89 1,343,272,390	10,730.00 1,227,512,000	0.89

17	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	464,100	3,734.05 1,732,974,125	2,623.00 1,217,334,300	0.89
18	東京海上HD	日本	株式	保険業	239,900	5,827.20 1,397,946,925	4,950.00 1,187,505,000	0.86
19	ダイキン工業	日本	株式	機械	86,600	14,426.65 1,249,348,503	13,170.00 1,140,522,000	0.83
20	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	9,119,200	165.80 1,511,995,631	123.60 1,127,133,120	0.82
21	村田製作所	日本	株式	電気機器	199,700	5,108.27 1,020,122,673	5,472.00 1,092,758,400	0.79
22	三菱商事	日本	株式	卸売業	469,800	2,758.62 1,296,002,537	2,291.50 1,076,546,700	0.78
23	伊藤忠	日本	株式	卸売業	468,400	2,294.79 1,074,881,080	2,242.50 1,050,387,000	0.76
24	日立	日本	株式	電気機器	326,800	4,027.26 1,316,108,915	3,143.00 1,027,132,400	0.75
25	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	593,600	1,543.55 916,252,758	1,671.00 991,905,600	0.72
26	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	56,600	22,177.43 1,255,243,075	17,320.00 980,312,000	0.71
27	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	119,800	10,372.84 1,242,666,436	8,176.00 979,484,800	0.71
28	SMC	日本	株式	機械	21,300	45,540.76 970,018,387	45,750.00 974,475,000	0.71
29	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	69,100	15,703.19 1,085,090,693	13,820.00 954,962,000	0.69
30	ファナック	日本	株式	電気機器	64,600	20,168.18 1,302,864,839	14,655.00 946,713,000	0.69

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.56%
合計	97.56%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.10%

鉱業	0.20%
建設業	2.63%
食料品	4.12%
繊維製品	0.53%
パルプ・紙	0.27%
化学	7.38%
医薬品	6.40%
石油・石炭製品	0.45%
ゴム製品	0.64%
ガラス・土石製品	0.74%
鉄鋼	0.57%
非鉄金属	0.63%
金属製品	0.54%
機械	4.78%
電気機器	13.83%
輸送用機器	7.12%
精密機器	2.50%
その他製品	2.41%
電気・ガス業	1.75%
陸運業	4.40%
海運業	0.13%
空運業	0.39%
倉庫・運輸関連業	0.18%
情報・通信業	9.43%
卸売業	4.83%
小売業	4.69%
銀行業	5.04%
証券、商品先物取引業	0.77%
保険業	2.16%
その他金融業	1.10%
不動産業	2.08%
サービス業	4.78%
合計	97.56%

(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 2020年6月	買建	224	2,965,694,800	3,142,720,000	2.28%

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

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

(参考情報) 運用実績

## ●ダイワ・ノーロード TOPIXファンド

2020年3月31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	11,172円
純資産総額	1.7億円



※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 16年9月	第2期 17年9月	第3期 18年9月	第4期 19年9月				
分配金	0円	0円	0円	0円				

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

## 主要な資産の状況

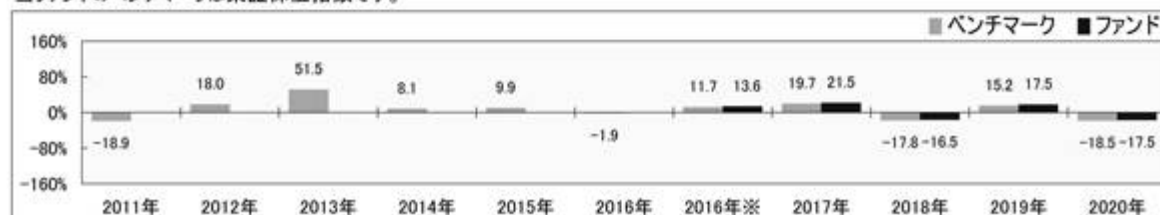
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,122	97.6%	電気機器	13.8%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.6%
国内株式先物	1	2.3%	情報・通信業	9.4%	TOPIX先物 0206月	-	2.3%
不動産投資信託等	-	-	化学	7.4%	ソニー	電気機器	2.0%
コール・ローン、その他		2.4%	輸送用機器	7.1%	日本電信電話	情報・通信業	1.7%
合計	2,123	-	医薬品	6.4%	キーエンス	電気機器	1.6%
株式市場・市場別構成			銀行業	5.0%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.5%
一部(東証・名証)		97.6%	卸売業	4.8%	武田薬品	医薬品	1.4%
二部(東証・名証)		-	サービス業	4.8%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.3%
新興市場他		-	機械	4.8%	任天堂	その他製品	1.3%
その他		-	その他	34.0%	NTTドコモ	情報・通信業	1.2%
合計		97.6%	合計	97.6%	合計		17.8%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。



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

・2016年※は設定日(3月14日)から年末、2020年は3月31日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

お申込手数料は、ありません。

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。

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

### 2 【換金(解約)手続等】

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

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

### <一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <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その他やむを得ない事情があるときは、一部解約請求の受け付けを中止することができます。一部解約請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、当該計算日の基準価額とします。

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

委託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。委託会社は、委託会社の指定する預金口座等の一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

## 3 【資産管理等の概要】

### (1) 【資産の評価】

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

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

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <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3月14日から2026年9月19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9月20日から翌年9月19日までとします。ただし、第1計算期間は、2016年3月14日から2016年9月19日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、東証株価指数が改廃された場合、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。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発送します。
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、信託約款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. 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します。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

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

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

#### 換金請求権

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



### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2018年9月20日から2019年9月19日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ・ノーロード TOPIXファンド

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2018年9月19日現在	第4期 2019年9月19日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	704,308	1,371,092
親投資信託受益証券	139,222,869	166,719,403
未収入金	2,861,000	3,467,000
流動資産合計	142,788,177	171,557,495
資産合計	142,788,177	171,557,495
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,229,957	4,377,214
未払受託者報酬	19,404	26,675
未払委託者報酬	304,786	418,483
その他未払費用	3,157	4,442
流動負債合計	3,557,304	4,826,814
負債合計	3,557,304	4,826,814
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 101,850,282	1 132,379,082
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	37,380,591	34,351,599
(分配準備積立金)	4,168,045	1,681,903
元本等合計	139,230,873	166,730,681
純資産合計	139,230,873	166,730,681
負債純資産合計	142,788,177	171,557,495

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2017年9月20日 至 2018年9月19日	自	2018年9月20日 至 2019年9月19日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		7,020,337		6,890,466
その他収益		-		34
営業収益合計		7,020,337		6,890,432
<b>営業費用</b>				
支払利息		149		211
受託者報酬		33,205		50,064
委託者報酬		521,566		785,699
その他費用		5,385		8,270
営業費用合計		560,305		844,244
営業利益又は営業損失( )		6,460,032		7,734,676
経常利益又は経常損失( )		6,460,032		7,734,676
当期純利益又は当期純損失( )		6,460,032		7,734,676
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( )		3,089,852		6,042,305
期首剰余金又は期首欠損金( )		12,269,308		37,380,591
剰余金増加額又は欠損金減少額		51,970,665		32,960,157
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		51,970,665		32,960,157
剰余金減少額又は欠損金増加額		30,229,562		34,296,778
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		30,229,562		34,296,778
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		37,380,591		34,351,599

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第4期	
	自 2018年9月20日	至 2019年9月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	2018年9月19日現在	2019年9月19日現在
1. 1 期首元本額	47,605,934円	101,850,282円
期中追加設定元本額	151,486,100円	140,518,518円
期中一部解約元本額	97,241,752円	109,989,718円
2. 計算期間末日における受益権の総数	101,850,282口	132,379,082口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	自 2017年9月20日 至 2018年9月19日	自 2018年9月20日 至 2019年9月19日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(3,370,256円)、投資信託約款に規定される収益調整金(33,212,644円)及び分配準備積立金(797,789円)より分配対象額は37,380,689円(1万口当たり3,670.16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(32,669,856円)及び分配準備積立金(1,681,903円)より分配対象額は34,351,759円(1万口当たり2,594.95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4期 自 2018年9月20日 至 2019年9月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期
	2019年9月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第3期	第4期
	2018年9月19日現在	2019年9月19日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	4,697,200	2,872,664
合計	4,697,200	2,872,664

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第3期	第4期
2018年9月19日現在	2019年9月19日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第4期
自 2018年9月20日
至 2019年9月19日

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

(1口当たり情報)

	第3期 2018年9月19日現在	第4期 2019年9月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3670円 (13,670円)	1.2595円 (12,595円)

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	160,214,687	166,719,403	
親投資信託受益証券 合計			166,719,403	
合計			166,719,403	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2018年9月19日現在	2019年9月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,734,389,759	19,763,867,043
株式 2 3	148,894,152,440	144,383,908,290
派生商品評価勘定	30,058,400	2,711,360
未収入金	8,991,040	4,979,111,357
未収配当金	57,194,385	61,109,873
未収利息	474,420	1,004,073
その他未収収益 4	4,227,872	11,859,248
流動資産合計	161,729,488,316	169,203,571,244
資産合計	161,729,488,316	169,203,571,244
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	51,080
前受金	26,864,000	1,600,000
未払金	596,940,475	-
未払解約金	143,365,900	5,440,424,660
受入担保金	11,194,645,612	18,897,468,081
その他未払費用	13,852	2,724
流動負債合計	11,961,829,839	24,339,546,545
負債合計	11,961,829,839	24,339,546,545
純資産の部		
元本等		
元本 1	133,322,724,900	139,218,477,453
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	16,444,933,577	5,645,547,246
元本等合計	149,767,658,477	144,864,024,699
純資産合計	149,767,658,477	144,864,024,699
負債純資産合計	161,729,488,316	169,203,571,244

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)



区 分	自 2018年9月20日 至 2019年9月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2018年9月19日現在	2019年9月19日現在
1. 1 期首	2017年9月20日	2018年9月20日
期首元本額	132,992,880,740円	133,322,724,900円
期中追加設定元本額	17,323,849,993円	24,456,356,141円
期中一部解約元本額	16,994,005,833円	18,560,603,588円

期末元本額の内訳 ファンド名		
トピックス・インデックス ファンド	4,246,087,218円	3,959,780,929円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	9,335,647,683円	7,634,005,000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	50,961,008円	8,941,003円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	72,288,859円	60,746,661円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,120,195,925円	916,911,182円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	59,077,590円	49,098,482円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,527,630,494円	1,278,942,805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)	919,561円	33,474,382円
D-I's TOPIXイン デックス	30,019,052円	40,297,426円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	21,906,513円	19,815,592円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	675,429円	3,680,722円
iFree TOPIXイン デックス	626,644,015円	1,240,728,743円
iFree 8資産バランス	1,109,565,785円	1,946,320,135円
iFree 年金バランス	7,355,261円	56,248,083円
DCダイワ日本株式インデッ クス	64,305,310,317円	65,758,738,387円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,491,555,747円	2,935,287,098円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,765,694,997円	3,322,359,411円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,681,824,381円	3,053,282,137円

年金ダイワ日本株式インデックス	4,471,005,264円	4,860,270,912円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	15,185,267円	14,875,081円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	49,889,188円	54,571,393円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	16,774,873円	21,059,608円
ダイワつみたてインデックス日本株式	936,048円	194,448,237円
ダイワつみたてインデックスバランス30	- 円	198,705円
ダイワつみたてインデックスバランス50	- 円	300,351円
ダイワつみたてインデックスバランス70	- 円	479,367円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	337,828円	- 円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	347,186円	- 円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)	686,510円	- 円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	4,016,770円	- 円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	8,380,481円	- 円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA(国内株式型)	9,446,810円	- 円
ダイワ世界バランスファンド40VA	212,247,455円	167,628,084円
ダイワ世界バランスファンド60VA	168,882,290円	171,981,504円
ダイワ・バランスファンド35VA	9,877,017,535円	9,347,930,150円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	21,077,804円	- 円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	25,269,263円	3,092,274円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	856,720,435円	827,002,497円

	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)	129,305,829円	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)	223,180,217円	222,487,484円
	ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	123,940,950円	160,214,687円
	ダイワファンドラップTOP PIXインデックス	8,293,640,110円	9,622,016,197円
	ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	225,887,747円	2,723,875,577円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス	1,843,135,534円	2,564,805,669円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,389,161,216円	1,429,476,274円
	ダイワライフスタイル25	179,686,588円	195,425,595円
	ダイワライフスタイル50	634,139,972円	683,313,759円
	ダイワライフスタイル75	542,537,590円	559,222,873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)	13,546,528,305円	12,947,400,487円
	計	133,322,724,900円	139,218,477,453円
2.	期末日における受益権の総数	133,322,724,900口	139,218,477,453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 10,955,160,650円	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 18,091,114,550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 701,900,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 535,080,000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3,027,980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9,962,005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 2018年9月20日 至 2019年9月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年9月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2018年9月19日現在	2019年9月19日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	9,210,049,346	12,445,824,821
合計	9,210,049,346	12,445,824,821

(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(2017年9月20日から2018年9月19日まで、及び2018年9月20日から2019年9月19日まで)を指して  
おります。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	2018年9月19日 現在				2019年9月19日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	678,120,000	-	708,200,000	30,080,000	285,060,000	-	287,730,000	2,670,000
合計	678,120,000	-	708,200,000	30,080,000	285,060,000	-	287,730,000	2,670,000

## (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)

	2018年9月19日現在	2019年9月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1233円 (11,233円)	1.0406円 (10,406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	2,800	2,919.00	8,173,200	貸付株式数 1,000株
日本水産	84,900	631.00	53,571,900	
マルハニチロ	12,300	2,787.00	34,280,100	
ハウスイ	500	833.00	416,500	貸付株式数 200株
カネコ種苗	2,600	1,253.00	3,257,800	
サカタのタネ	10,100	3,810.00	38,481,000	貸付株式数 3,400株
ホクト	7,100	1,968.00	13,972,800	貸付株式数 2,300株
ホクリヨウ	1,100	676.00	743,600	貸付株式数 300株
ヒノキヤグループ	2,100	1,924.00	4,040,400	貸付株式数 700株 (200株)
ショーボンドHD	12,100	3,970.00	48,037,000	貸付株式数 5,000株 (3,200株)
ミライト・ホールディングス	23,800	1,690.00	40,222,000	貸付株式数 7,600株 (5,200株)
タマホーム	4,100	1,449.00	5,940,900	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
サンヨーホームズ	1,200	649.00	778,800	貸付株式数 500株
日本アクア	3,400	592.00	2,012,800	貸付株式数 1,300株
ファーストコーポレーション	2,600	595.00	1,547,000	貸付株式数 900株
ベステラ	1,600	1,238.00	1,980,800	
スペースバリューHD	10,400	496.00	5,158,400	貸付株式数 2,000株
住石ホールディングス	18,500	134.00	2,479,000	貸付株式数 7,100株
日鉄鉱業	1,900	4,240.00	8,056,000	
三井松島HLDGS	3,600	1,231.00	4,431,600	
国際石油開発帝石	340,300	1,065.50	362,589,650	
石油資源開発	12,200	3,010.00	36,722,000	
K&Oエナジーグループ	4,100	1,339.00	5,489,900	貸付株式数 1,600株
ダイセキ環境ソリューション	1,600	705.00	1,128,000	
第一カッター興業	1,000	1,668.00	1,668,000	貸付株式数 400株

安藤・間	54,400	780.00	42,432,000		
東急建設	24,800	805.00	19,964,000		
コムシスホールディングス	30,100	2,984.00	89,818,400		
ミサワホーム	6,700	1,134.00	7,597,800		
ビーアールホールディングス	9,300	382.00	3,552,600	貸付株式数	2,600株
高松コンストラクションG P	5,300	2,525.00	13,382,500	貸付株式数	1,100株
東建コーポレーション	2,600	6,800.00	17,680,000	貸付株式数	1,000株
ソネック	800	888.00	710,400	貸付株式数	300株
ヤマウラ	3,300	888.00	2,930,400		
大成建設	69,700	4,165.00	290,300,500		
大林組	209,800	1,104.00	231,619,200		
清水建設	214,100	997.00	213,457,700		
飛鳥建設	6,000	1,168.00	7,008,000	貸付株式数	1,500株
長谷工コーポレーション	87,400	1,257.00	109,861,800	貸付株式数	500株
松井建設	7,700	722.00	5,559,400	貸付株式数	2,800株
銭高組	900	4,040.00	3,636,000		
鹿島建設	164,000	1,438.00	235,832,000	貸付株式数	4,100株
不動テトラ	4,800	1,206.00	5,788,800	貸付株式数	1,200株
大末建設	2,500	936.00	2,340,000		
鉄建建設	4,300	2,729.00	11,734,700	貸付株式数	1,700株
西松建設	15,100	2,014.00	30,411,400		
三井住友建設	50,500	565.00	28,532,500	貸付株式数	20,800株
大豊建設	4,700	2,900.00	13,630,000		
前田建設	49,100	957.00	46,988,700	貸付株式数	20,300株
佐田建設	4,500	403.00	1,813,500		
ナカノフドー建設	5,400	453.00	2,446,200		
奥村組	11,500	2,964.00	34,086,000		
東鉄工業	8,400	3,245.00	27,258,000	貸付株式数	3,200株
イチケン	1,300	1,647.00	2,141,100		
富士ピー・エス	2,900	499.00	1,447,100	貸付株式数	700株
浅沼組	2,400	3,775.00	9,060,000	貸付株式数	900株
戸田建設	81,300	640.00	52,032,000	貸付株式数	33,200株
熊谷組	10,000	3,140.00	31,400,000		
青木あすなろ建設	3,600	1,207.00	4,345,200	貸付株式数	1,300株
北野建設	1,500	2,335.00	3,502,500	貸付株式数	500株
植木組	900	2,494.00	2,244,600	貸付株式数	300株
矢作建設	9,500	726.00	6,897,000	貸付株式数	3,400株
ピーエス三菱	7,400	716.00	5,298,400	貸付株式数	2,300株



日本ハウスHLDGS	13,400	472.00	6,324,800		
大東建託	24,900	14,455.00	359,929,500		
新日本建設	8,300	796.00	6,606,800	貸付株式数	2,200株
NIPPO	18,500	1,996.00	36,926,000	貸付株式数	1,300株
東亜道路	1,300	3,445.00	4,478,500		
前田道路	20,800	2,415.00	50,232,000	貸付株式数	7,600株
日本道路	1,900	6,560.00	12,464,000		
東亜建設	6,100	1,328.00	8,100,800	貸付株式数	2,000株
日本国土開発	11,500	535.00	6,152,500	貸付株式数	4,400株
若築建設	3,500	1,515.00	5,302,500		
東洋建設	25,700	456.00	11,719,200	貸付株式数	9,400株
五洋建設	83,300	589.00	49,063,700	貸付株式数	34,300株
世紀東急	10,200	729.00	7,435,800	貸付株式数	1,200株
福田組	2,300	4,280.00	9,844,000	貸付株式数	300株
日本ドライケミカル	1,700	1,145.00	1,946,500	貸付株式数	600株
住友林業	49,600	1,434.00	71,126,400	貸付株式数	2,000株
日本基礎技術	7,200	333.00	2,397,600		
巴コーポレーション	8,700	398.00	3,462,600	貸付株式数	3,300株
大和ハウス	193,800	3,582.00	694,191,600		
ライト工業	13,500	1,429.00	19,291,500		
積水ハウス	214,200	2,088.00	447,249,600	貸付株式数	88,600株
日特建設	6,000	653.00	3,918,000		
北陸電気工事	3,400	879.00	2,988,600	貸付株式数	200株
ユアテック	11,200	681.00	7,627,200	貸付株式数	1,400株
四電工	1,000	2,830.00	2,830,000	貸付株式数	200株
中電工	9,000	2,418.00	21,762,000		
関電工	31,800	990.00	31,482,000		
きんでん	46,500	1,648.00	76,632,000		
東京エネシス	7,200	913.00	6,573,600	貸付株式数	2,400株
トーエネック	2,000	3,445.00	6,890,000	貸付株式数	600株
住友電設	4,800	2,131.00	10,228,800		
日本電設工業	11,900	2,315.00	27,548,500	貸付株式数	4,400株
協和エクシオ	27,400	2,658.00	72,829,200		
新日本空調	5,600	1,861.00	10,421,600	貸付株式数	2,300株
日本工営	4,000	3,120.00	12,480,000	貸付株式数	1,600株
九電工	13,800	3,605.00	49,749,000		
三機工業	15,300	1,323.00	20,241,900		
日揮	60,400	1,449.00	87,519,600	貸付株式数	24,900株
中外炉工業	2,000	1,479.00	2,958,000		
ヤマト	6,300	696.00	4,384,800	貸付株式数	2,100株

太平電業	4,700	2,392.00	11,242,400	貸付株式数	400株
高砂熱学	17,000	1,825.00	31,025,000		
三晃金属	800	2,479.00	1,983,200		
NEC ネットエスアイ	6,800	3,005.00	20,434,000		
朝日工業社	1,500	2,936.00	4,404,000		
明星工業	12,700	759.00	9,639,300	貸付株式数	5,200株
大 氣 社	9,500	3,395.00	32,252,500	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
ダイダン	4,700	2,142.00	10,067,400		
日比谷総合設備	6,300	2,000.00	12,600,000	貸付株式数	1,800株
東芝プラントシステム	15,200	1,811.00	27,527,200		
日本製粉	19,800	1,743.00	34,511,400	貸付株式数	2,500株
日清製粉G本社	70,800	2,048.00	144,998,400		
日東富士製粉	400	6,440.00	2,576,000		
昭和産業	5,700	3,135.00	17,869,500		
鳥越製粉	5,600	864.00	4,838,400	貸付株式数	2,200株
中部飼料	7,600	1,239.00	9,416,400	貸付株式数	2,600株
フィード・ワン	42,100	162.00	6,820,200		
東洋精糖	900	1,067.00	960,300	貸付株式数	300株
日本甜菜糖	3,600	1,836.00	6,609,600	貸付株式数	1,300株
三井製糖	4,900	2,292.00	11,230,800		
塩水港精糖	6,600	209.00	1,379,400		
日新製糖	2,900	2,010.00	5,829,000	貸付株式数	600株
L I F U L L	20,900	684.00	14,295,600		
ジェイエシーリクルート メント	4,000	2,065.00	8,260,000	貸付株式数	1,800株
日本M&Aセンター	45,100	3,110.00	140,261,000		
メンバーズ	2,000	1,713.00	3,426,000	貸付株式数	700株
中広	500	604.00	302,000	貸付株式数	200株
アイティメディア	1,100	684.00	752,400	貸付株式数	400株 (400株)
タケエイ	6,200	987.00	6,119,400	貸付株式数	200株
E・Jホールディングス	700	1,263.00	884,100	貸付株式数	100株
トラスト・テック	6,600	1,279.00	8,441,400	貸付株式数	2,700株
コシダカホールディングス	14,400	1,604.00	23,097,600	貸付株式数	6,000株
アルトナー	1,400	748.00	1,047,200	貸付株式数	200株
パソナグループ	7,300	1,568.00	11,446,400	貸付株式数	2,800株
C D S	1,500	1,323.00	1,984,500	貸付株式数	300株
リンクアンドモチベーショ ン	13,200	608.00	8,025,600	貸付株式数	5,300株

G C A	7,100	752.00	5,339,200	貸付株式数	2,700株
エス・エム・エス	22,000	2,730.00	60,060,000		
サニーサイドアップ	1,300	932.00	1,211,600		
パーソルホールディングス	59,700	2,282.00	136,235,400	貸付株式数	20,900株
リニカル	3,400	1,007.00	3,423,800	貸付株式数	1,200株 (600株)
クックパッド	19,100	318.00	6,073,800	貸付株式数	2,600株
エスクリ	1,600	824.00	1,318,400	貸付株式数	600株
アイ・ケイ・ケイ	2,900	703.00	2,038,700	貸付株式数	1,100株
森永製菓	15,800	5,020.00	79,316,000	貸付株式数	6,200株
中村屋	1,600	4,460.00	7,136,000	貸付株式数	500株
江崎グリコ	18,600	4,735.00	88,071,000	貸付株式数	5,100株
名糖産業	3,000	1,320.00	3,960,000	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	2,700	2,129.00	5,748,300	貸付株式数	800株
不二家	3,500	2,070.00	7,245,000	貸付株式数	1,400株
山崎製パン	47,100	1,948.00	91,750,800	貸付株式数	19,400株
第一屋製パン	1,100	948.00	1,042,800	貸付株式数	100株
モロゾフ	1,100	4,955.00	5,450,500	貸付株式数	100株
亀田製菓	3,900	4,830.00	18,837,000	貸付株式数	1,400株
寿スピリッツ	6,600	7,060.00	46,596,000	貸付株式数	100株
カルビー	28,600	3,405.00	97,383,000	貸付株式数	11,200株
森永乳業	12,600	4,125.00	51,975,000	貸付株式数	5,100株
六甲バター	4,200	1,795.00	7,539,000	貸付株式数	1,700株
ヤクルト	46,400	6,370.00	295,568,000		
明治ホールディングス	44,400	7,940.00	352,536,000		
雪印メグミルク	15,100	2,572.00	38,837,200	貸付株式数	6,100株
プリマハム	8,800	2,206.00	19,412,800	貸付株式数	3,600株
日本ハム	26,000	4,410.00	114,660,000		
林兼産業	2,000	581.00	1,162,000		
丸大食品	6,700	2,288.00	15,329,600	貸付株式数	2,700株
S Foods	5,600	3,220.00	18,032,000	貸付株式数	2,200株
伊藤ハム米久HLDGS	40,300	685.00	27,605,500	貸付株式数	1,100株
学情	2,100	1,403.00	2,946,300	貸付株式数	900株 (900株)
スタジオアリス	3,000	2,010.00	6,030,000	貸付株式数	100株
クロスキャット	1,600	1,028.00	1,644,800	貸付株式数	600株
シミックホールディングス	3,300	1,815.00	5,989,500	貸付株式数	1,100株
システナ	21,900	1,575.00	34,492,500		
N J S	1,300	1,721.00	2,237,300		

デジタルアーツ	3,300	6,940.00	22,902,000	貸付株式数 1,300株 (200株)
日鉄ソリューションズ	9,200	3,705.00	34,086,000	
総合警備保障	23,700	5,600.00	132,720,000	
キューブシステム	3,300	816.00	2,692,800	貸付株式数 1,300株
いちご	78,500	429.00	33,676,500	貸付株式数 300株
エイジア	1,200	1,219.00	1,462,800	貸付株式数 400株
日本駐車場開発	67,800	173.00	11,729,400	貸付株式数 27,600株
コア	2,600	1,337.00	3,476,200	貸付株式数 900株
カカクコム	44,700	2,671.00	119,393,700	
アイロムグループ	2,300	1,627.00	3,742,100	貸付株式数 900株
セントケア・ホールディング	4,400	547.00	2,406,800	貸付株式数 1,700株
サイネックス	900	641.00	576,900	貸付株式数 200株
ルネサンス	3,300	1,653.00	5,454,900	貸付株式数 1,200株
ディップ	9,600	2,561.00	24,585,600	貸付株式数 3,900株
SBSホールディングス	5,400	1,603.00	8,656,200	貸付株式数 2,200株
オプトホールディング	3,300	1,574.00	5,194,200	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
新日本科学	8,100	711.00	5,759,100	貸付株式数 2,900株
ツクイ	14,100	456.00	6,429,600	
キャリアデザインセンター	1,500	1,394.00	2,091,000	貸付株式数 100株
ベネフィット・ワン	16,400	1,916.00	31,422,400	貸付株式数 6,700株
エムスリー	125,700	2,527.00	317,643,900	貸付株式数 51,800株
ツカダ・グローバルHOLD	3,800	595.00	2,261,000	貸付株式数 1,300株
プラス	600	660.00	396,000	貸付株式数 100株
アウトソーシング	34,200	1,027.00	35,123,400	貸付株式数 14,000株
ウェルネット	5,700	715.00	4,075,500	貸付株式数 1,600株
ワールドホールディングス	1,900	1,636.00	3,108,400	貸付株式数 600株
ディー・エヌ・エー	32,200	1,963.00	63,208,600	貸付株式数 13,000株
博報堂DYHLDGS	82,900	1,639.00	135,873,100	
ぐるなび	8,500	725.00	6,162,500	
タカミヤ	6,300	655.00	4,126,500	貸付株式数 2,300株
ジャパンベストレスキュー	4,000	1,125.00	4,500,000	貸付株式数 1,600株
ファンコミュニケーションズ	16,500	537.00	8,860,500	貸付株式数 6,700株
ライク	2,400	1,608.00	3,859,200	貸付株式数 900株
ビジネス・ブレークスルー	2,500	367.00	917,500	貸付株式数 1,000株

エスプール	2,300	2,886.00	6,637,800		
WDBホールディングス	2,700	2,698.00	7,284,600		
ティア	3,500	630.00	2,205,000	貸付株式数	1,400株
CDG	500	1,479.00	739,500	貸付株式数	200株 (200株)
バリューコマース	3,400	1,688.00	5,739,200	貸付株式数	1,500株 (1,300株)
インフォマート	32,700	1,672.00	54,674,400	貸付株式数	13,400株
サッポロホールディングス	21,400	2,639.00	56,474,600	貸付株式数	9,000株
アサヒグループホールディングン	131,300	5,330.00	699,829,000	貸付株式数	54,200株
キリンHD	265,900	2,281.00	606,517,900	貸付株式数	110,000株
宝ホールディングス	47,000	1,120.00	52,640,000		
オエノンホールディングス	16,600	400.00	6,640,000	貸付株式数	6,800株
養命酒	1,900	1,943.00	3,691,700	貸付株式数	700株
コカ・コーラボトラーズJHD	44,000	2,413.00	106,172,000	貸付株式数	18,800株
サントリー食品インター	41,900	4,735.00	198,396,500	貸付株式数	17,000株
ダイドーグループHD	3,500	4,500.00	15,750,000	貸付株式数	1,400株
伊藤園	19,000	5,170.00	98,230,000	貸付株式数	7,800株
キーコーヒー	6,200	2,206.00	13,677,200	貸付株式数	2,500株
ユニカフェ	1,600	989.00	1,582,400	貸付株式数	100株
ジャパンフーズ	900	1,211.00	1,089,900		
日清オイリオグループ	8,000	3,500.00	28,000,000	貸付株式数	1,100株
不二製油グループ	15,300	3,040.00	46,512,000	貸付株式数	6,200株
かどや製油	700	3,655.00	2,558,500	貸付株式数	100株
J-オイルミルズ	3,200	4,165.00	13,328,000	貸付株式数	1,200株
ローソン	15,600	5,720.00	89,232,000	貸付株式数	6,400株
サンエー	4,600	4,845.00	22,287,000	貸付株式数	1,900株
カワチ薬品	4,800	2,156.00	10,348,800	貸付株式数	1,800株
エービーシー・マート	9,600	6,850.00	65,760,000	貸付株式数	3,900株
ハードオフコーポレーション	2,400	719.00	1,725,600		
高千穂交易	2,400	1,122.00	2,692,800	貸付株式数	800株
アスクル	6,400	2,811.00	17,990,400	貸付株式数	2,500株
ゲオホールディングス	9,400	1,330.00	12,502,000	貸付株式数	3,800株
アダストリア	8,500	2,388.00	20,298,000	貸付株式数	3,500株
ジーフット	3,800	628.00	2,386,400	貸付株式数	300株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	681.00	544,800	貸付株式数	300株

伊藤忠食品	1,500	4,410.00	6,615,000		
くら寿司	3,200	4,535.00	14,512,000	貸付株式数	1,400株
キャンドウ	2,900	1,670.00	4,843,000	貸付株式数	1,200株 (600株)
エレマテック	5,700	1,046.00	5,962,200	貸付株式数	1,800株
パルグループHLDGS	3,100	3,340.00	10,354,000	貸付株式数	1,300株
JALUX	1,700	2,422.00	4,117,400	貸付株式数	700株
エディオン	26,100	1,033.00	26,961,300	貸付株式数	700株
あらた	4,500	3,925.00	17,662,500	貸付株式数	1,600株
サーラコーポレーション	12,500	619.00	7,737,500	貸付株式数	5,100株
ワッツ	2,800	624.00	1,747,200	貸付株式数	600株 (400株)
トーメンデバイス	900	2,445.00	2,200,500	貸付株式数	300株
ハローズ	2,300	2,298.00	5,285,400	貸付株式数	100株
J Pホールディングス	17,100	285.00	4,873,500	貸付株式数	6,600株
フジオフードシステム	2,600	2,845.00	7,397,000	貸付株式数	1,000株
あみやき亭	1,300	3,480.00	4,524,000		
東京エレクトロニクス	2,200	2,100.00	4,620,000		
ひらまつ	12,400	358.00	4,439,200	貸付株式数	5,000株
フィールズ	5,400	524.00	2,829,600		
双日	340,000	350.00	119,000,000		
アルフレッサホールディングス	68,300	2,522.00	172,252,600		
大黒天物産	1,500	3,420.00	5,130,000		
ハニーズホールディングス	5,400	1,456.00	7,862,400	貸付株式数	2,200株 (2,100株)
ファーマライズHD	1,400	572.00	800,800	貸付株式数	500株 (500株)
キッコーマン	41,400	5,160.00	213,624,000		
味の素	138,500	2,040.00	282,540,000	貸付株式数	20,800株
キューピー	34,900	2,584.00	90,181,600	貸付株式数	14,200株
ハウス食品G本社	23,400	4,165.00	97,461,000	貸付株式数	5,000株
カゴメ	23,800	2,755.00	65,569,000	貸付株式数	10,200株
焼津水産化工	3,100	1,061.00	3,289,100		
アリアケジャパン	5,700	8,360.00	47,652,000	貸付株式数	1,700株
ピエトロ	800	1,629.00	1,303,200	貸付株式数	100株
エバラ食品工業	1,500	2,110.00	3,165,000		
やまみ	300	2,003.00	600,900		
ニチレイ	32,600	2,504.00	81,630,400		
横浜冷凍	17,300	1,046.00	18,095,800	貸付株式数	7,000株

東洋水産	32,300	4,475.00	144,542,500		
イトアンド	2,200	1,743.00	3,834,600	貸付株式数	800株
大冷	700	2,069.00	1,448,300	貸付株式数	200株
ヨシムラ・フード・HLD GS	1,700	877.00	1,490,900	貸付株式数	600株
日清食品HD	26,600	7,760.00	206,416,000	貸付株式数	10,300株
永谷園ホールディングス	3,400	2,179.00	7,408,600	貸付株式数	900株
一正蒲鉾	2,400	1,098.00	2,635,200	貸付株式数	800株 (800株)
フジッコ	6,800	2,003.00	13,620,400	貸付株式数	2,500株
ロックフィールド	6,800	1,463.00	9,948,400	貸付株式数	2,700株
日本たばこ産業	361,900	2,298.00	831,646,200	貸付株式数	149,700株
ケンコーマヨネーズ	3,500	2,362.00	8,267,000		
わらべや日洋HD	4,100	1,856.00	7,609,600	貸付株式数	600株
なとり	3,500	1,625.00	5,687,500		
イフジ産業	1,000	733.00	733,000	貸付株式数	400株
ピクルスコーポレーショ ン	1,500	2,588.00	3,882,000	貸付株式数	100株
北の達人コーポ	24,600	706.00	17,367,600	貸付株式数	10,000株
ユーグレナ	26,800	901.00	24,146,800	貸付株式数	11,000株 (5,800株)
片倉工業	8,900	1,295.00	11,525,500	貸付株式数	3,600株
グンゼ	4,100	4,530.00	18,573,000	貸付株式数	1,600株
ヒューリック	131,600	1,108.00	145,812,800	貸付株式数	54,200株
神栄	800	756.00	604,800	貸付株式数	100株
ラサ商事	3,300	849.00	2,801,700	貸付株式数	100株
アルペン	4,700	1,707.00	8,022,900	貸付株式数	1,900株 (600株)
ハブ	2,000	1,271.00	2,542,000		
ラクーンホールディングス	3,000	628.00	1,884,000		
クオールホールディングス	9,100	1,504.00	13,686,400	貸付株式数	100株 (100株)
アルコニックス	6,500	1,229.00	7,988,500		
神戸物産	10,600	5,000.00	53,000,000	貸付株式数	4,300株
ソリトンシステムズ	2,700	983.00	2,654,100		
ジンスホールディングス	3,300	6,490.00	21,417,000	貸付株式数	1,300株
ビックカメラ	36,500	1,117.00	40,770,500	貸付株式数	10,500株
DCMホールディングス	33,200	1,066.00	35,391,200	貸付株式数	13,700株 (9,100株)

ペッパーフードサービス	4,900	1,571.00	7,697,900	貸付株式数 2,000株 (300株)
MonotaRO	43,700	2,944.00	128,652,800	貸付株式数 18,000株 (2,500株)
東京一番フーズ	1,600	626.00	1,001,600	貸付株式数 600株 (500株)
DDホールディングス	2,700	1,500.00	4,050,000	
あいホールディングス	8,800	1,800.00	15,840,000	貸付株式数 3,500株
ディービーエックス	2,400	867.00	2,080,800	貸付株式数 900株
きちりホールディングス	1,600	759.00	1,214,400	貸付株式数 600株
アークランドサービスHD	4,500	1,971.00	8,869,500	貸付株式数 1,800株
J. フロントリテイリング	78,700	1,278.00	100,578,600	貸付株式数 32,500株
ドトール・日レスHD	10,800	2,154.00	23,263,200	貸付株式数 4,400株
マツモトキヨシHLDGS	25,400	4,025.00	102,235,000	貸付株式数 10,400株
ブロンコビリー	3,200	2,349.00	7,516,800	貸付株式数 1,400株 (900株)
ZOZO	66,500	2,500.00	166,250,000	貸付株式数 27,400株
トレジャー・ファクトリー	1,800	1,360.00	2,448,000	貸付株式数 600株
物語コーポレーション	1,500	10,270.00	15,405,000	貸付株式数 600株 (100株)
ココカラファイン	6,900	5,980.00	41,262,000	
三越伊勢丹HD	115,200	860.00	99,072,000	
東洋紡	26,000	1,439.00	37,414,000	貸付株式数 10,500株
ユニチカ	18,100	326.00	5,900,600	貸付株式数 7,200株
富士紡ホールディングス	3,200	2,933.00	9,385,600	
日清紡ホールディングス	41,700	878.00	36,612,600	貸付株式数 17,100株
倉敷紡績	5,800	2,238.00	12,980,400	貸付株式数 600株
ダイワボウHD	5,600	4,345.00	24,332,000	貸付株式数 2,000株
シキボウ	3,200	924.00	2,956,800	貸付株式数 700株
日東紡績	9,300	3,150.00	29,295,000	
トヨタ紡織	21,800	1,524.00	33,223,200	
マクニカ・富士エレHLDGS	17,100	1,458.00	24,931,800	
Hamee	1,900	994.00	1,888,600	貸付株式数 700株
ラクト・ジャパン	2,300	3,755.00	8,636,500	貸付株式数 1,000株 (500株)
ウエルシアHD	16,300	5,460.00	88,998,000	貸付株式数 6,700株
クリエイトSDH	9,100	2,517.00	22,904,700	貸付株式数 3,700株
バイタルKSKHD	11,500	1,086.00	12,489,000	貸付株式数 1,000株



八洲電機	4,900	907.00	4,444,300	貸付株式数	1,900株
メディアスホールディングス	3,500	725.00	2,537,500	貸付株式数	1,300株
レスターホールディングス	6,800	1,758.00	11,954,400	貸付株式数	600株
ジューテックHD	1,400	980.00	1,372,000	貸付株式数	500株
丸善CHI HD	7,200	383.00	2,757,600		
大光	2,600	678.00	1,762,800	貸付株式数	1,000株
OCHIホールディングス	1,800	1,275.00	2,295,000		
TOKAIホールディングス	32,500	1,032.00	33,540,000	貸付株式数	1,400株
黒谷	1,400	435.00	609,000	貸付株式数	500株
ミサワ	1,100	506.00	556,600	貸付株式数	400株
ティーライフ	800	846.00	676,800	貸付株式数	300株
Cominix	1,100	819.00	900,900		
エー・ピーカンパニー	1,100	535.00	588,500	貸付株式数	400株
三洋貿易	3,100	2,295.00	7,114,500		
チムニー	1,900	2,503.00	4,755,700	貸付株式数	700株
シュッピン	4,200	1,064.00	4,468,800	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ビューティガレージ	1,000	1,930.00	1,930,000	貸付株式数	100株
ウイン・パートナーズ	4,000	1,177.00	4,708,000	貸付株式数	1,300株
ネクステージ	8,800	1,131.00	9,952,800		
ジョイフル本田	18,000	1,425.00	25,650,000	貸付株式数	7,300株
鳥貴族	2,000	2,292.00	4,584,000	貸付株式数	900株
麒麟堂ホールディングス	2,400	2,101.00	5,042,400	貸付株式数	700株
ホットランド	3,700	1,153.00	4,266,100	貸付株式数	1,400株
すかいらーくHD	69,000	1,915.00	132,135,000	貸付株式数	28,500株 (2,800株)
SFPホールディングス	2,600	2,170.00	5,642,000	貸付株式数	1,000株
綿半ホールディングス	2,300	2,056.00	4,728,800	貸付株式数	400株
日本毛織	20,000	965.00	19,300,000	貸付株式数	8,300株
ダイトウボウ	10,400	81.00	842,400	貸付株式数	4,100株
トーア紡コーポレーション	2,500	518.00	1,295,000	貸付株式数	100株
ダイドーリミテッド	7,200	272.00	1,958,400	貸付株式数	2,800株
ヨシックス	1,000	3,125.00	3,125,000	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパー マーケ	17,800	993.00	17,675,400	貸付株式数	7,000株
三栄建築設計	2,400	1,481.00	3,554,400	貸付株式数	1,000株 (900株)
野村不動産HLDGS	41,000	2,415.00	99,015,000		

三重交通グループHD	12,500	574.00	7,175,000	貸付株式数	5,100株
サムティ	8,700	1,880.00	16,356,000	貸付株式数	3,600株
エー・ディー・ワークス	191,500	35.00	6,702,500		
日本商業開発	3,900	1,531.00	5,970,900	貸付株式数	1,500株
プレサンスコーポレーション	9,800	1,716.00	16,816,800	貸付株式数	1,000株
ユニゾホールディングス	9,400	4,220.00	39,668,000	貸付株式数	3,600株
日本管理センター	4,100	1,415.00	5,801,500	貸付株式数	800株 (800株)
サンセイランディック	1,800	837.00	1,506,600	貸付株式数	700株 (500株)
エストラスト	900	836.00	752,400	貸付株式数	300株
フージャースHD	13,400	638.00	8,549,200	貸付株式数	5,500株
オープンハウス	8,900	5,350.00	47,615,000		
東急不動産HD	165,800	682.00	113,075,600		
飯田GHD	51,300	1,825.00	93,622,500	貸付株式数	1,900株
イーランド	900	705.00	634,500		
帝国繊維	6,900	1,816.00	12,530,400	貸付株式数	2,800株
日本コークス工業	52,600	88.00	4,628,800		
ゴルフダイジェスト・オン	2,500	692.00	1,730,000		
ミタチ産業	1,800	681.00	1,225,800	貸付株式数	700株
B E E N O S	2,200	1,237.00	2,721,400	貸付株式数	800株
あさひ	5,100	1,245.00	6,349,500	貸付株式数	2,100株
日本調剤	2,200	3,885.00	8,547,000		
コスモス薬品	2,700	21,600.00	58,320,000	貸付株式数	1,100株
シップヘルスケアHD	12,800	4,700.00	60,160,000	貸付株式数	4,100株
トーエル	3,000	710.00	2,130,000	貸付株式数	600株
ソフトクリエイイトHD	2,700	1,744.00	4,708,800	貸付株式数	1,000株
オンリー	1,000	813.00	813,000	貸付株式数	400株
セブン&アイ・HLDGS	257,800	4,178.00	1,077,088,400	貸付株式数	106,600株
クリエイイト・レストランツ・ホール	16,600	1,781.00	29,564,600	貸付株式数	6,800株 (6,400株)
明治電機工業	1,900	1,367.00	2,597,300		
ツルハホールディングス	13,400	11,700.00	156,780,000	貸付株式数	5,500株
デリカフーズHLDGS	2,200	732.00	1,610,400	貸付株式数	800株
スターティアホールディングス	1,200	536.00	643,200	貸付株式数	400株
サンマルクホールディングス	4,900	2,463.00	12,068,700	貸付株式数	1,400株
フェリシモ	1,400	1,023.00	1,432,200	貸付株式数	500株

トリドールホールディングス	7,600	2,603.00	19,782,800	貸付株式数 3,100株 (2,800株)
帝人	49,800	2,062.00	102,687,600	貸付株式数 11,000株
東レ	474,600	837.70	397,572,420	
クラレ	96,300	1,358.00	130,775,400	貸付株式数 39,900株
旭化成	435,100	1,102.50	479,697,750	
サカイオーベックス	1,500	1,695.00	2,542,500	
TOKYO BASE	5,600	871.00	4,877,600	貸付株式数 2,200株 (2,100株)
稲葉製作所	3,500	1,459.00	5,106,500	貸付株式数 200株
宮地エンジニアリングG	1,900	1,583.00	3,007,700	貸付株式数 700株
トーカロ	16,000	916.00	14,656,000	貸付株式数 1,300株
アルファCO	2,200	1,182.00	2,600,400	
SUMCO	74,000	1,435.00	106,190,000	貸付株式数 30,500株 (3,400株)
川田テクノロジーズ	1,400	6,840.00	9,576,000	貸付株式数 500株
RS TECHNOLOGIES	1,700	3,580.00	6,086,000	貸付株式数 700株 (400株)
信和	3,300	1,004.00	3,313,200	
ビーロット	1,400	1,749.00	2,448,600	
ファーストブラザーズ	1,400	1,100.00	1,540,000	貸付株式数 600株
ハウスドゥ	3,400	1,541.00	5,239,400	貸付株式数 1,400株
シーアールイー	1,500	1,015.00	1,522,500	貸付株式数 100株
プロパティエージェント	800	1,179.00	943,200	貸付株式数 300株
ケイアイスター不動産	1,700	2,063.00	3,507,100	貸付株式数 600株
アグレ都市デザイン	1,000	443.00	443,000	
ジェイ・エス・ビー	700	4,525.00	3,167,500	
テンポイノベーション	700	1,660.00	1,162,000	貸付株式数 100株
グローバルリンクマネジメント	900	590.00	531,000	貸付株式数 100株
住江織物	1,800	2,960.00	5,328,000	貸付株式数 500株
日本フェルト	3,500	471.00	1,648,500	貸付株式数 900株
イチカワ	900	1,418.00	1,276,200	貸付株式数 100株
エコナックホールディングス	10,800	126.00	1,360,800	貸付株式数 1,500株
日東製網	700	1,469.00	1,028,300	貸付株式数 200株
芦森工業	1,300	1,421.00	1,847,300	
アツギ	5,100	836.00	4,263,600	貸付株式数 1,900株
ウイルプラスHLDGS	900	764.00	687,600	貸付株式数 300株
ジャパンミート	3,100	2,280.00	7,068,000	

コマダホールディングス	14,300	2,037.00	29,129,100	貸付株式数	5,900株
サツドラホールディングス	900	1,772.00	1,594,800	貸付株式数	300株
デファクトスタンダード	500	315.00	157,500	貸付株式数	200株
アレンザホールディングス	3,300	795.00	2,623,500	貸付株式数	1,300株
串カツ田中HLDGS	900	2,137.00	1,923,300	貸付株式数	300株
バロックジャパン	5,000	1,006.00	5,030,000		
クスリのアオキHLDGS	6,100	8,230.00	50,203,000	貸付株式数	2,500株
ダイニック	2,500	739.00	1,847,500	貸付株式数	1,000株
共和レザー	3,800	781.00	2,967,800	貸付株式数	300株
力の源HD	2,300	835.00	1,920,500	貸付株式数	900株
スシローグローバルHLDGS	6,800	7,070.00	48,076,000	貸付株式数	2,600株
LIXILビバ	5,200	1,683.00	8,751,600	貸付株式数	1,100株
セーレン	15,100	1,261.00	19,041,100		
ソトー	2,400	992.00	2,380,800	貸付株式数	900株
東海染工	800	1,154.00	923,200		
小松マテーレ	10,000	819.00	8,190,000	貸付株式数	3,500株
ワコールホールディングス	17,300	2,758.00	47,713,400	貸付株式数	5,000株
ホギメディカル	7,600	3,100.00	23,560,000	貸付株式数	600株
レナウン	17,900	111.00	1,986,900	貸付株式数	6,600株
クラウディアHLDGS	1,500	499.00	748,500	貸付株式数	100株
TSIホールディングス	22,600	580.00	13,108,000	貸付株式数	9,200株
マツオカコーポレーション	1,900	2,071.00	3,934,900		
ワールド	8,000	2,522.00	20,176,000		
TIS	20,400	6,210.00	126,684,000		
ネオス	2,500	772.00	1,930,000	貸付株式数	1,000株
電算システム	2,300	2,955.00	6,796,500		
グリー	42,500	502.00	21,335,000	貸付株式数	17,100株
コーエーテクモHD	12,500	2,309.00	28,862,500	貸付株式数	5,200株
三菱総合研究所	2,600	3,715.00	9,659,000		
ボルテージ	1,200	498.00	597,600	貸付株式数	400株
電算	700	2,040.00	1,428,000	貸付株式数	100株 (100株)
AGS	3,500	690.00	2,415,000	貸付株式数	1,400株
ファインデックス	5,200	950.00	4,940,000		
ブレインパッド	1,200	6,680.00	8,016,000		
KLab	11,800	1,097.00	12,944,600	貸付株式数	4,800株
ポルトゥウィン・ピットクル	8,200	1,025.00	8,405,000		
イーブクイニシアティブ	1,000	1,826.00	1,826,000	貸付株式数	400株

ネクソン	173,900	1,445.00	251,285,500	貸付株式数	71,900株
アイスタイル	15,800	674.00	10,649,200	貸付株式数	6,400株
エムアップ	2,100	2,254.00	4,733,400	貸付株式数	800株
エイチーム	4,300	1,067.00	4,588,100	貸付株式数	1,700株
エニグモ	4,400	1,006.00	4,426,400	貸付株式数	1,700株
テクノスジャパン	5,200	519.00	2,698,800	貸付株式数	1,900株
e n i s h	2,700	867.00	2,340,900	貸付株式数	1,000株
コロプラ	20,100	881.00	17,708,100	貸付株式数	8,200株 (4,500株)
オルトプラス	4,100	261.00	1,070,100	貸付株式数	1,600株
ブロードリーフ	30,400	595.00	18,088,000	貸付株式数	12,300株
クロス・マーケティングG	2,600	356.00	925,600	貸付株式数	900株
デジタルハーツHLDGS	2,800	966.00	2,704,800		
システム情報	3,100	1,019.00	3,158,900	貸付株式数	1,200株
メディアドゥHLDGS	2,200	3,540.00	7,788,000	貸付株式数	800株
じげん	8,700	587.00	5,106,900	貸付株式数	3,500株
ブイキューブ	3,300	432.00	1,425,600	貸付株式数	900株
エンカレッジ・テクノロジー	800	751.00	600,800	貸付株式数	300株
サイバーリンクス	900	1,100.00	990,000	貸付株式数	100株
ディー・エル・イー	4,300	179.00	769,700		
フィックスターズ	6,500	1,444.00	9,386,000	貸付株式数	2,500株
CARTA HOLDINGS	3,000	1,030.00	3,090,000	貸付株式数	1,200株 (100株)
オプティム	2,700	2,826.00	7,630,200	貸付株式数	1,100株
セレス	2,000	1,297.00	2,594,000	貸付株式数	800株
特種東海製紙	3,900	3,950.00	15,405,000	貸付株式数	1,500株
ティーガイア	4,400	2,228.00	9,803,200		
セック	1,000	3,105.00	3,105,000		
日本アジアグループ	6,500	330.00	2,145,000	貸付株式数	1,000株
豆蔵ホールディングス	4,200	1,647.00	6,917,400		
テクマトリックス	4,300	2,233.00	9,601,900		
プロシップ	1,800	1,185.00	2,133,000		
ガンホー・オンライン・エンター	14,800	2,384.00	35,283,200	貸付株式数	6,100株 (300株)
GMOペイメントゲートウェイ	10,100	7,410.00	74,841,000	貸付株式数	4,100株
ザッパラス	3,000	355.00	1,065,000	貸付株式数	400株
システムリサーチ	800	3,960.00	3,168,000	貸付株式数	200株
インターネットイニシアティブ	10,000	2,538.00	25,380,000		

さくらインターネット	7,300	618.00	4,511,400		
ヴィンクス	1,700	1,203.00	2,045,100	貸付株式数	800株
GMOクラウド	1,100	2,665.00	2,931,500	貸付株式数	500株
S R Aホールディングス	3,300	2,520.00	8,316,000		
M I N O R Iソリューションズ	1,200	1,906.00	2,287,200	貸付株式数	400株
システムインテグレータ	1,700	664.00	1,128,800	貸付株式数	600株
朝日ネット	4,900	680.00	3,332,000	貸付株式数	1,500株
e B A S E	3,700	995.00	3,681,500	貸付株式数	300株
アバント	2,200	2,027.00	4,459,400	貸付株式数	800株
アドソル日進	2,200	2,205.00	4,851,000	貸付株式数	800株
フリービット	3,700	872.00	3,226,400	貸付株式数	100株
コムチュア	3,400	4,105.00	13,957,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
サイバーコム	1,100	1,784.00	1,962,400	貸付株式数	400株
アステリア	4,100	636.00	2,607,600	貸付株式数	400株
アイル	1,000	2,496.00	2,496,000	貸付株式数	400株
王子ホールディングス	275,200	517.00	142,278,400	貸付株式数	33,400株
日本製紙	29,400	1,822.00	53,566,800	貸付株式数	12,100株
三菱製紙	10,000	491.00	4,910,000	貸付株式数	2,400株
北越コーポレーション	40,500	552.00	22,356,000	貸付株式数	13,100株
中越パルプ	2,600	1,567.00	4,074,200	貸付株式数	600株
巴川製紙	2,000	989.00	1,978,000	貸付株式数	800株
大王製紙	29,900	1,355.00	40,514,500	貸付株式数	8,200株
阿波製紙	1,600	410.00	656,000	貸付株式数	100株 (100株)
マークライنز	3,100	1,894.00	5,871,400		
メディカル・データ・ビジ	4,700	1,246.00	5,856,200	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
g u m i	7,900	670.00	5,293,000	貸付株式数	3,200株 (2,400株)
ショーケース	1,300	729.00	947,700	貸付株式数	400株
モバイルファクトリー	1,400	1,599.00	2,238,600		
テラスカイ	1,000	1,807.00	1,807,000		
デジタル・インフォメーション	2,700	1,538.00	4,152,600		
P C Iホールディングス	1,300	2,100.00	2,730,000		
パイプドHD	1,000	1,330.00	1,330,000	貸付株式数	300株
アイピーシー	1,100	1,072.00	1,179,200	貸付株式数	300株
ネオジャパン	1,200	967.00	1,160,400	貸付株式数	400株

P R T I M E S	500	2,729.00	1,364,500		
ランドコンピュータ	900	1,094.00	984,600	貸付株式数	100株
ダブルスタンダード	500	4,925.00	2,462,500	貸付株式数	200株
オープンドア	3,000	2,235.00	6,705,000		
マイネット	2,000	491.00	982,000	貸付株式数	800株
アカツキ	2,200	7,630.00	16,786,000		
ベネフィットジャパン	400	1,599.00	639,600	貸付株式数	100株 (100株)
UBICOMホールディングス	1,100	1,491.00	1,640,100	貸付株式数	400株
L I N E	14,100	4,010.00	56,541,000	貸付株式数	7,100株 (2,100株)
カナミックネットワーク	3,700	570.00	2,109,000		
ノムラシステムコーポレーション	1,400	479.00	670,600	貸付株式数	500株
レンゴー	63,000	798.00	50,274,000		
トーモク	3,700	1,596.00	5,905,200	貸付株式数	1,500株
ザ・パック	4,600	3,405.00	15,663,000	貸付株式数	1,900株
チェンジ	1,200	1,951.00	2,341,200	貸付株式数	400株
シンクロ・フード	2,600	520.00	1,352,000		
オークネット	3,400	1,373.00	4,668,200	貸付株式数	1,300株
セグエグループ	200	1,379.00	275,800		
エイトレッド	700	1,636.00	1,145,200	貸付株式数	200株
A O I T Y O H O L D I N G S	6,200	637.00	3,949,400	貸付株式数	2,500株
マクロミル	10,900	919.00	10,017,100	貸付株式数	3,400株
ビーグリー	1,300	924.00	1,201,200	貸付株式数	100株
オロ	1,600	2,703.00	4,324,800	貸付株式数	600株
テモナ	800	561.00	448,800	貸付株式数	300株
ニーズウェル	400	746.00	298,400		
サインポスト	900	2,310.00	2,079,000	貸付株式数	300株
昭和電工	43,500	2,992.00	130,152,000	貸付株式数	18,000株
住友化学	481,200	504.00	242,524,800		
住友精化	3,000	3,340.00	10,020,000	貸付株式数	1,000株
日産化学	37,100	4,560.00	169,176,000		
ラサ工業	2,200	1,215.00	2,673,000	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,700	6,460.00	36,822,000	貸付株式数	900株
多木化学	1,800	5,020.00	9,036,000	貸付株式数	700株
テイカ	5,000	1,973.00	9,865,000	貸付株式数	100株
石原産業	11,800	931.00	10,985,800	貸付株式数	4,500株

片倉コープアグリ	1,800	1,094.00	1,969,200	
日本曹達	9,700	2,605.00	25,268,500	貸付株式数 3,100株
東ソー	94,500	1,464.00	138,348,000	
トクヤマ	17,600	2,442.00	42,979,200	
セントラル硝子	13,400	2,322.00	31,114,800	
東亜合成	38,400	1,185.00	45,504,000	貸付株式数 15,800株
大阪ソーダ	6,800	2,752.00	18,713,600	貸付株式数 600株
関東電化	14,600	779.00	11,373,400	
デンカ	24,000	2,996.00	71,904,000	貸付株式数 3,700株
イビデン	38,300	2,103.00	80,544,900	貸付株式数 2,500株
信越化学	107,800	11,820.00	1,274,196,000	
日本カ-バイド	2,100	1,248.00	2,620,800	貸付株式数 700株
堺化学	4,100	2,599.00	10,655,900	
第一稀元素化学工	6,600	822.00	5,425,200	貸付株式数 2,500株
エア・ウォーター	50,100	1,929.00	96,642,900	貸付株式数 17,900株
大陽日酸	50,400	2,139.00	107,805,600	
日本化学工業	2,100	2,436.00	5,115,600	貸付株式数 800株
東邦アセチレン	900	1,318.00	1,186,200	
日本パ-カラライジング	33,400	1,224.00	40,881,600	
高圧ガス	9,700	843.00	8,177,100	貸付株式数 1,400株
チタン工業	800	2,608.00	2,086,400	貸付株式数 200株
四国化成	10,300	1,153.00	11,875,900	貸付株式数 2,000株
戸田工業	1,300	2,229.00	2,897,700	貸付株式数 500株
ステラケミファ	3,600	2,826.00	10,173,600	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
保土谷化学	2,100	3,085.00	6,478,500	
日本触媒	10,300	6,450.00	66,435,000	
大日精化	5,100	3,280.00	16,728,000	貸付株式数 400株
カネカ	15,800	3,425.00	54,115,000	
協和キリン	62,800	2,113.00	132,696,400	貸付株式数 28,800株
三菱瓦斯化学	62,100	1,465.00	90,976,500	
三井化学	55,500	2,525.00	140,137,500	貸付株式数 10,800株
J S R	61,400	1,718.00	105,485,200	
東京応化工業	10,500	3,965.00	41,632,500	貸付株式数 200株
大阪有機化学	5,600	1,074.00	6,014,400	貸付株式数 700株
三菱ケミカルH L D G S	408,700	809.10	330,679,170	
K H ネオケム	10,800	2,345.00	25,326,000	貸付株式数 4,400株
ダイセル	90,200	907.00	81,811,400	
住友ベ-クライト	10,600	4,165.00	44,149,000	
積水化学	131,500	1,741.00	228,941,500	



日本ゼオン	55,100	1,367.00	75,321,700	貸付株式数 22,800株 (5,000株)
アイカ工業	18,400	3,285.00	60,444,000	
宇部興産	30,800	2,215.00	68,222,000	
積水樹脂	10,100	2,185.00	22,068,500	貸付株式数 1,200株
タキロンシーアイ	13,100	663.00	8,685,300	貸付株式数 900株
旭有機材	4,200	1,335.00	5,607,000	貸付株式数 700株
日立化成	28,300	3,450.00	97,635,000	貸付株式数 11,500株
ニチバン	3,200	1,621.00	5,187,200	貸付株式数 1,300株
リケンテクノス	16,700	479.00	7,999,300	貸付株式数 3,900株
大倉工業	2,900	1,637.00	4,747,300	貸付株式数 1,100株
積水化成成品	9,100	787.00	7,161,700	
群栄化学	1,600	2,432.00	3,891,200	
タイガース ポリマー	3,100	572.00	1,773,200	
ミライアル	1,800	1,362.00	2,451,600	貸付株式数 600株
ダイキアクシス	2,200	809.00	1,779,800	貸付株式数 800株
ダイキョーニシカワ	12,900	799.00	10,307,100	貸付株式数 4,900株
竹本容器	2,200	909.00	1,999,800	
森六ホールディングス	3,300	2,508.00	8,276,400	
日本化薬	37,900	1,300.00	49,270,000	
カーリットホールディングス	6,500	584.00	3,796,000	貸付株式数 100株
E P Sホールディングス	9,000	1,294.00	11,646,000	貸付株式数 2,300株
ソルクシーズ	2,600	977.00	2,540,200	貸付株式数 1,000株
レグス	1,500	1,634.00	2,451,000	貸付株式数 600株
プレステージ・インター	11,200	1,727.00	19,342,400	貸付株式数 100株
フェイス	2,400	784.00	1,881,600	貸付株式数 900株
プロトコーポレーション	5,500	1,182.00	6,501,000	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
ハイマックス	700	1,850.00	1,295,000	
アミューズ	3,600	2,777.00	9,997,200	貸付株式数 200株
野村総合研究所	116,900	2,114.00	247,126,600	
ドリームインキュベータ	1,800	1,366.00	2,458,800	
サイバネットシステム	4,400	638.00	2,807,200	
クイック	3,700	1,372.00	5,076,400	
T A C	3,100	197.00	610,700	貸付株式数 1,200株
C Eホールディングス	1,800	985.00	1,773,000	貸付株式数 600株
ケネディクス	56,800	556.00	31,580,800	貸付株式数 22,700株
日本システム技術	1,000	1,240.00	1,240,000	
電通	61,500	3,985.00	245,077,500	貸付株式数 28,600株

インテージホールディングス	7,700	956.00	7,361,200	貸付株式数	3,100株
テイクアンドギヴニーズ	2,300	1,196.00	2,750,800		
東邦システムサイエンス	1,800	1,085.00	1,953,000	貸付株式数	700株
ぴあ	1,700	4,505.00	7,658,500	貸付株式数	600株 (400株)
イオンファンタジー	1,900	2,840.00	5,396,000	貸付株式数	300株
ソースネクスト	23,800	456.00	10,852,800	貸付株式数	9,600株 (9,100株)
シーティーエス	6,700	707.00	4,736,900	貸付株式数	600株
ネクシィーズグループ	2,100	1,973.00	4,143,300	貸付株式数	800株
インフォコム	6,700	2,510.00	16,817,000	貸付株式数	2,700株
メディカルシステムネットワーク	6,600	537.00	3,544,200		
日本精化	4,900	1,212.00	5,938,800	貸付株式数	1,900株
扶桑化学工業	6,200	2,366.00	14,669,200		
トリケミカル	1,400	6,350.00	8,890,000	貸付株式数	500株
F I G	6,400	313.00	2,003,200	貸付株式数	300株
A D E K A	30,100	1,379.00	41,507,900		
日油	23,000	3,630.00	83,490,000		
ミヨシ油脂	2,400	1,127.00	2,704,800	貸付株式数	1,000株
新日本理化	10,900	192.00	2,092,800	貸付株式数	4,400株
ハリマ化成グループ	5,000	1,256.00	6,280,000	貸付株式数	1,700株
アルテリア・ネットワークス	6,800	1,389.00	9,445,200		
ヒト・コミュニケーションズHD	1,400	1,740.00	2,436,000	貸付株式数	500株
花 王	149,500	7,937.00	1,186,581,500	貸付株式数	61,800株 (200株)
第一工業製薬	2,300	2,836.00	6,522,800	貸付株式数	900株
石原ケミカル	1,600	1,714.00	2,742,400	貸付株式数	600株
日華化学	2,100	816.00	1,713,600	貸付株式数	200株
ニイタカ	1,000	1,500.00	1,500,000	貸付株式数	200株
三洋化成	4,100	5,050.00	20,705,000		
武田薬品	545,300	3,757.00	2,048,692,100		
アステラス製薬	549,400	1,522.00	836,186,800		
大日本住友製薬	46,300	1,851.00	85,701,300		
塩野義製薬	79,800	5,850.00	466,830,000		
田辺三菱製薬	65,400	1,255.00	82,077,000		
わかもと製薬	7,500	246.00	1,845,000	貸付株式数	1,200株

あすか製薬	7,700	1,122.00	8,639,400	貸付株式数	1,000株
日本新薬	16,300	9,020.00	147,026,000	貸付株式数	3,100株
ビオフェルミン製薬	1,100	2,207.00	2,427,700		
中外製薬	65,100	8,020.00	522,102,000	貸付株式数	26,500株
科研製薬	10,700	5,080.00	54,356,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
エーザイ	74,800	5,412.00	404,817,600		
理研ビタミン	3,000	3,600.00	10,800,000	貸付株式数	600株
ロート製薬	32,100	2,898.00	93,025,800	貸付株式数	9,200株
小野薬品	147,500	2,054.50	303,038,750		
久光製薬	18,500	4,755.00	87,967,500	貸付株式数	7,600株
有機合成薬品	4,800	234.00	1,123,200	貸付株式数	600株
持田製薬	9,400	4,205.00	39,527,000	貸付株式数	3,600株
参天製薬	116,300	1,903.00	221,318,900		
扶桑薬品	2,200	2,035.00	4,477,000		
日本ケミファ	800	2,801.00	2,240,800	貸付株式数	300株
ツムラ	19,400	2,995.00	58,103,000		
日医工	16,500	1,240.00	20,460,000		
テルモ	176,700	3,315.00	585,760,500	貸付株式数	68,400株
みらかホールディングス	16,700	2,546.00	42,518,200		
キッセイ薬品工業	11,000	2,607.00	28,677,000		
生化学工業	12,100	1,134.00	13,721,400	貸付株式数	3,800株
栄研化学	11,000	1,707.00	18,777,000	貸付株式数	4,200株 (700株)
日水製薬	2,600	1,219.00	3,169,400		
鳥居薬品	3,900	2,917.00	11,376,300	貸付株式数	1,600株
JCRファーマ	4,400	8,140.00	35,816,000	貸付株式数	1,800株
東和薬品	9,000	2,542.00	22,878,000	貸付株式数	2,200株
富士製薬工業	4,300	1,339.00	5,757,700	貸付株式数	100株
沢井製薬	12,800	5,730.00	73,344,000		
ゼリア新薬工業	12,400	1,936.00	24,006,400	貸付株式数	1,800株
第一三共	178,700	7,126.00	1,273,416,200		
キョーリン製薬HD	13,800	1,841.00	25,405,800		
大幸薬品	2,800	2,387.00	6,683,600		
ダイト	3,700	2,934.00	10,855,800	貸付株式数	300株
大塚ホールディングス	119,000	4,747.00	564,893,000	貸付株式数	46,600株
大正製薬HD	13,200	7,910.00	104,412,000		
ペプチドリーム	31,600	5,460.00	172,536,000	貸付株式数	13,000株
大日本塗料	6,900	1,107.00	7,638,300		
日本ペイントHOLD	50,500	5,300.00	267,650,000	貸付株式数	20,800株

関西ペイント	68,800	2,381.00	163,812,800	貸付株式数	28,400株
神東塗料	5,000	165.00	825,000	貸付株式数	1,800株
中国塗料	20,100	921.00	18,512,100	貸付株式数	700株
日本特殊塗料	4,600	1,123.00	5,165,800	貸付株式数	400株
藤倉化成	8,200	545.00	4,469,000	貸付株式数	2,800株
太陽ホールディングス	5,100	3,480.00	17,748,000	貸付株式数	1,100株
D I C	25,800	3,015.00	77,787,000	貸付株式数	10,800株
サカイク	13,400	1,109.00	14,860,600	貸付株式数	5,400株
東洋インキ S C ホールディ ン	12,900	2,470.00	31,863,000	貸付株式数	5,300株
T & K T O K A	4,700	977.00	4,591,900	貸付株式数	100株
アルプス技研	5,300	1,552.00	8,225,600	貸付株式数	2,100株
サニックス	10,600	352.00	3,731,200	貸付株式数	4,200株 (4,200株)
ダイオーズ	1,400	1,483.00	2,076,200	貸付株式数	500株
日本空調サービス	6,800	697.00	4,739,600	貸付株式数	400株
オリエンタルランド	70,500	15,825.00	1,115,662,500	貸付株式数	200株
フォーカスシステムズ	4,200	866.00	3,637,200		
ダスキン	15,300	2,837.00	43,406,100	貸付株式数	400株
パーク 2 4	33,100	2,378.00	78,711,800	貸付株式数	14,100株
明光ネットワークジャパン	7,100	906.00	6,432,600	貸付株式数	2,800株
ファルコホールディングス	3,300	1,717.00	5,666,100	貸付株式数	1,300株
クレスコ	1,900	3,515.00	6,678,500		
フジ・メディア・HD	63,600	1,451.00	92,283,600		
秀英予備校	1,400	445.00	623,000	貸付株式数	600株
田谷	1,200	615.00	738,000	貸付株式数	500株
ラウンドワン	18,500	1,626.00	30,081,000	貸付株式数	7,600株
リゾートトラスト	25,300	1,758.00	44,477,400	貸付株式数	3,600株
オービック	21,300	12,300.00	261,990,000	貸付株式数	1,000株
ジャストシステム	8,700	3,920.00	34,104,000		
T D C ソフト	5,400	782.00	4,222,800	貸付株式数	700株
ヤフー	399,900	314.00	125,568,600	貸付株式数	164,100株
ビー・エム・エル	7,700	3,065.00	23,600,500		
ワタベウェディング	1,000	593.00	593,000		
トレンドマイクロ	27,300	5,260.00	143,598,000	貸付株式数	12,800株
りらいあコミュニケーション	10,800	1,342.00	14,493,600		
I D ホールディングス	2,400	1,244.00	2,985,600		
リソー教育	30,300	462.00	13,998,600		
日本オラクル	12,400	9,690.00	120,156,000	貸付株式数	5,000株
早稲田アカデミー	1,700	815.00	1,385,500	貸付株式数	600株

アルファシステムズ	1,900	2,837.00	5,390,300	貸付株式数	700株
フューチャー	7,400	1,871.00	13,845,400	貸付株式数	3,000株
CAC HOLDINGS	4,000	1,313.00	5,252,000	貸付株式数	1,600株
ソフトバンク・テクノ	2,600	2,100.00	5,460,000	貸付株式数	1,000株
トーセ	1,700	833.00	1,416,100		
ユー・エス・エス	72,900	2,104.00	153,381,600		
オービックビジネスC	6,300	4,515.00	28,444,500	貸付株式数	2,500株 (1,100株)
伊藤忠テクノソリュー	27,900	2,941.00	82,053,900		
アイティフォー	7,500	862.00	6,465,000		
東京個別指導学院	2,100	937.00	1,967,700	貸付株式数	800株
東計電算	900	3,040.00	2,736,000	貸付株式数	200株
サイバーエージェント	34,300	4,205.00	144,231,500	貸付株式数	14,100株
楽天	278,300	1,016.00	282,752,800	貸付株式数	114,800株
エックスネット	1,100	991.00	1,090,100		
クリーク・アンド・リバー社	3,500	1,185.00	4,147,500		
テー・オー・ダブリュー	5,200	754.00	3,920,800	貸付株式数	500株
大塚商会	33,200	4,205.00	139,606,000	貸付株式数	13,600株
サイボウズ	7,200	1,048.00	7,545,600	貸付株式数	2,900株
ソフトブレーン	3,600	711.00	2,559,600	貸付株式数	1,400株
山田コンサルティングGP	2,900	1,745.00	5,060,500		
セントラルスポーツ	2,200	3,230.00	7,106,000	貸付株式数	800株
パラカ	1,600	2,245.00	3,592,000	貸付株式数	800株
電通国際情報S	3,800	3,480.00	13,224,000	貸付株式数	1,500株
デジタルガレージ	12,000	3,365.00	40,380,000	貸付株式数	4,600株
イーエムシステムズ	5,000	1,987.00	9,935,000	貸付株式数	1,400株
ウェザーニューズ	2,100	3,400.00	7,140,000	貸付株式数	800株 (700株)
CIJ	4,600	833.00	3,831,800	貸付株式数	1,000株
東洋ビジネスエンジ	600	2,724.00	1,634,400	貸付株式数	200株
日本エンタープライズ	6,100	177.00	1,079,700	貸付株式数	2,400株
WOWOW	2,900	2,680.00	7,772,000	貸付株式数	1,100株
スカラ	4,300	1,016.00	4,368,800		
インテリジェント ウェイブ	2,300	816.00	1,876,800	貸付株式数	900株
フルキャストホールディングス	6,000	2,165.00	12,990,000	貸付株式数	2,400株
エン・ジャパン	8,700	4,165.00	36,235,500	貸付株式数	3,500株
富士フイルムHLDGS	129,700	4,799.00	622,430,300		

コニカミノルタ	136,700	794.00	108,539,800		
資 生 堂	124,100	8,722.00	1,082,400,200	貸付株式数	51,300株 (2,000株)
ライオン	81,200	2,128.00	172,793,600	貸付株式数	34,200株
高砂香料	4,300	2,782.00	11,962,600	貸付株式数	1,000株
マンダム	14,100	2,786.00	39,282,600	貸付株式数	4,800株 (2,900株)
ミルボン	8,300	5,290.00	43,907,000	貸付株式数	3,400株
ファンケル	27,800	2,783.00	77,367,400	貸付株式数	1,400株
コーセー	10,600	18,940.00	200,764,000		
コタ	3,300	1,206.00	3,979,800		
シーボン	800	2,414.00	1,931,200	貸付株式数	200株
ポーラ・オルビスHD	26,700	2,480.00	66,216,000	貸付株式数	11,000株
ノエビアホールディングス	6,000	5,800.00	34,800,000	貸付株式数	600株
アジュバンコスメジャパン	1,400	946.00	1,324,400	貸付株式数	500株
エステー	4,500	1,693.00	7,618,500	貸付株式数	1,800株
アグロカネショウ	2,000	1,535.00	3,070,000	貸付株式数	100株
コ ニ シ	11,000	1,500.00	16,500,000	貸付株式数	2,800株
長谷川香料	8,300	2,050.00	17,015,000	貸付株式数	3,300株
星光PMC	3,600	781.00	2,811,600	貸付株式数	1,400株
小林製薬	17,500	8,400.00	147,000,000	貸付株式数	6,900株 (4,300株)
荒川化学工業	5,600	1,531.00	8,573,600		
メック	4,300	1,452.00	6,243,600	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	1,700	2,464.00	4,188,800	貸付株式数	700株
タカラバイオ	16,400	2,359.00	38,687,600	貸付株式数	2,300株
JCU	8,100	2,115.00	17,131,500		
新田ゼラチン	4,000	677.00	2,708,000	貸付株式数	700株
OATアグリオ	1,000	1,429.00	1,429,000		
デクセリアルズ	16,200	785.00	12,717,000	貸付株式数	300株
アース製薬	4,700	5,400.00	25,380,000	貸付株式数	1,900株
北興化学	6,400	495.00	3,168,000		
大成ラミック	2,100	2,920.00	6,132,000		
クミアイ化学	25,900	944.00	24,449,600	貸付株式数	10,600株
日本農薬	11,200	473.00	5,297,600		
富士興産	2,400	721.00	1,730,400	貸付株式数	900株 (800株)
ニチレキ	8,000	1,123.00	8,984,000	貸付株式数	2,600株
ユシロ化学	3,200	1,370.00	4,384,000	貸付株式数	1,100株

ビーピー・カストロール	2,200	1,375.00	3,025,000	
富士石油	15,300	250.00	3,825,000	貸付株式数 6,100株
MORESCO	2,300	1,357.00	3,121,100	貸付株式数 500株
出光興産	72,100	3,240.00	233,604,000	
JXTGホールディングス	1,033,000	499.10	515,570,300	
コスモエネルギーHLDGS	18,100	2,225.00	40,272,500	貸付株式数 7,400株
横浜ゴム	36,100	2,172.00	78,409,200	貸付株式数 14,900株
TOYO TIRE	35,900	1,414.00	50,762,600	貸付株式数 14,800株
ブリヂストン	191,900	4,305.00	826,129,500	貸付株式数 79,400株
住友ゴム	56,100	1,287.00	72,200,700	貸付株式数 22,800株 (200株)
藤倉コンポジット	5,500	432.00	2,376,000	貸付株式数 1,000株
オカモト	4,200	4,115.00	17,283,000	
アキレス	4,300	1,716.00	7,378,800	
フコク	2,700	702.00	1,895,400	
ニッタ	7,000	3,055.00	21,385,000	
クリエートメディック	2,100	948.00	1,990,800	
住友理工	12,100	890.00	10,769,000	貸付株式数 4,700株
三ツ星ベルト	8,200	1,881.00	15,424,200	貸付株式数 1,600株
バンドー化学	11,900	888.00	10,567,200	
AGC	61,700	3,290.00	202,993,000	貸付株式数 25,100株
日本板硝子	30,000	658.00	19,740,000	貸付株式数 8,400株
石塚硝子	1,100	1,943.00	2,137,300	
有沢製作所	9,900	1,025.00	10,147,500	貸付株式数 4,000株
日本山村硝子	2,600	1,270.00	3,302,000	
日本電気硝子	25,100	2,413.00	60,566,300	貸付株式数 10,600株
オハラ	2,500	1,446.00	3,615,000	貸付株式数 1,000株
住友大阪セメント	12,600	4,735.00	59,661,000	貸付株式数 3,300株
太平洋セメント	39,500	2,915.00	115,142,500	
リソルホールディングス	700	4,045.00	2,831,500	貸付株式数 200株
日本ヒュム	6,200	715.00	4,433,000	貸付株式数 2,300株
日本コンクリート	13,400	283.00	3,792,200	貸付株式数 1,300株
三谷セキサン	2,900	3,175.00	9,207,500	貸付株式数 1,100株
アジアパイルHD	8,900	525.00	4,672,500	貸付株式数 2,900株
東海カーボン	65,400	1,120.00	73,248,000	貸付株式数 22,600株 (100株)
日本カーボン	3,200	3,805.00	12,176,000	貸付株式数 1,300株
東洋炭素	3,700	2,372.00	8,776,400	貸付株式数 1,500株
ノリタケ	3,700	4,030.00	14,911,000	

TOTO	48,100	4,155.00	199,855,500	貸付株式数	19,800株
日本碍子	76,300	1,570.00	119,791,000		
日本特殊陶業	52,700	2,089.00	110,090,300	貸付株式数	2,100株
ダントーホールディングス	4,900	114.00	558,600	貸付株式数	2,000株
MARUWA	2,200	6,620.00	14,564,000	貸付株式数	700株
品川リフラクトリーズ	1,600	2,674.00	4,278,400	貸付株式数	600株
黒崎播磨	1,200	5,600.00	6,720,000	貸付株式数	400株 (400株)
ヨータイ	5,500	612.00	3,366,000		
イソライト	3,200	454.00	1,452,800		
東京窯業	8,000	299.00	2,392,000	貸付株式数	1,800株
ニッカトー	2,800	691.00	1,934,800	貸付株式数	200株
フジインコーポレーテッド	5,600	2,599.00	14,554,400		
クニミネ工業	2,800	915.00	2,562,000	貸付株式数	1,100株
エーアンドエーマテリアル	1,200	1,020.00	1,224,000	貸付株式数	100株
ニチアス	17,100	1,931.00	33,020,100		
日本製鉄	286,900	1,524.50	437,379,050		
神戸製鋼所	113,200	585.00	66,222,000	貸付株式数	46,000株
中山製鋼所	8,500	463.00	3,935,500	貸付株式数	300株
合同製鐵	3,000	2,237.00	6,711,000		
JFEホールディングス	166,800	1,318.50	219,925,800		
東京製鐵	33,100	853.00	28,234,300		
共英製鋼	7,000	2,020.00	14,140,000		
大和工業	13,100	2,835.00	37,138,500	貸付株式数	4,300株
東京鐵鋼	2,500	1,340.00	3,350,000	貸付株式数	600株
大阪製鐵	4,100	1,361.00	5,580,100		
淀川製鋼所	8,300	2,006.00	16,649,800	貸付株式数	800株
丸一鋼管	21,900	2,840.00	62,196,000		
モリ工業	1,900	1,915.00	3,638,500		
大同特殊鋼	10,100	4,225.00	42,672,500	貸付株式数	4,100株
日本高周波	2,200	434.00	954,800		
日本冶金工	51,200	221.00	11,315,200		
山陽特殊製鋼	7,800	1,498.00	11,684,400		
愛知製鋼	3,500	3,160.00	11,060,000	貸付株式数	1,100株
日立金属	66,500	1,224.00	81,396,000	貸付株式数	27,500株
日本金属	1,500	826.00	1,239,000		
大平洋金属	4,200	2,249.00	9,445,800	貸付株式数	1,700株
新日本電工	40,000	169.00	6,760,000	貸付株式数	16,300株
栗本鉄工所	3,100	1,524.00	4,724,400		



虹 技	900	1,315.00	1,183,500	貸付株式数	300株
日本鑄鉄管	600	1,058.00	634,800	貸付株式数	200株
日本製鋼所	18,800	2,087.00	39,235,600	貸付株式数	7,700株
三菱製鋼	4,600	1,175.00	5,405,000		
日亜鋼業	9,000	306.00	2,754,000	貸付株式数	3,300株
日本精線	900	2,570.00	2,313,000		
エンピプロHD	2,300	660.00	1,518,000	貸付株式数	900株
大紀アルミニウム	10,100	749.00	7,564,900	貸付株式数	3,500株
日本軽金属HD	168,100	200.00	33,620,000		
三井金属	16,700	2,582.00	43,119,400	貸付株式数	6,800株
東邦亜鉛	3,400	2,019.00	6,864,600		
三菱マテリアル	40,800	2,937.00	119,829,600		
住友鉱山	84,600	3,424.00	289,670,400		
DOWAホールディングス	14,400	3,685.00	53,064,000	貸付株式数	5,600株
古河機金	10,200	1,462.00	14,912,400		
エス・サイエンス	27,600	54.00	1,490,400	貸付株式数	10,400株 (7,200株)
大阪チタニウム	7,200	1,772.00	12,758,400	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
東邦チタニウム	11,100	826.00	9,168,600	貸付株式数	4,500株
UACJ	9,400	1,774.00	16,675,600		
CKサンエツ	1,200	2,818.00	3,381,600		
古河電工	17,800	2,522.00	44,891,600	貸付株式数	7,000株
住友電工	230,700	1,397.50	322,403,250		
フジクラ	74,800	394.00	29,471,200		
昭和電線HLDGS	7,200	879.00	6,328,800	貸付株式数	1,400株
東京特殊電線	800	1,989.00	1,591,200		
タツタ電線	12,200	472.00	5,758,400		
カナレ電気	1,100	1,904.00	2,094,400	貸付株式数	200株
平河ビューテック	2,600	1,113.00	2,893,800	貸付株式数	600株
リョービ	7,600	1,768.00	13,436,800	貸付株式数	3,000株
アーステイ	7,600	579.00	4,400,400		
アサヒHD	11,600	2,361.00	27,387,600		
東洋製罐グループHD	39,300	1,699.00	66,770,700		
ホッカンホールディングス	3,100	1,527.00	4,733,700		
コロナ	3,400	1,054.00	3,583,600	貸付株式数	400株
横河ブリッジHLDGS	11,500	1,632.00	18,768,000	貸付株式数	2,000株
OSJBHD	31,000	246.00	7,626,000		
駒井ハルテック	1,200	1,637.00	1,964,400		
高田機工	600	2,508.00	1,504,800		

三和ホールディングス	63,800	1,271.00	81,089,800	貸付株式数	24,600株
文化シャツタ -	18,200	921.00	16,762,200	貸付株式数	7,500株
三協立山	8,600	1,242.00	10,681,200	貸付株式数	3,500株
アルインコ	4,900	941.00	4,610,900		
東洋シャツタ -	1,500	698.00	1,047,000		
L I X I Lグループ	91,200	1,894.00	172,732,800		
日本ファイルコン	4,700	504.00	2,368,800	貸付株式数	1,700株
ノーリツ	12,800	1,312.00	16,793,600	貸付株式数	5,200株
長府製作所	6,300	2,501.00	15,756,300	貸付株式数	2,500株
リンナイ	11,000	7,330.00	80,630,000		
ユニプレス	12,100	1,761.00	21,308,100		
ダイニチ工業	3,300	640.00	2,112,000	貸付株式数	200株
日東精工	8,500	577.00	4,904,500		
三洋工業	800	1,899.00	1,519,200		
岡 部	12,500	852.00	10,650,000	貸付株式数	5,000株
ジーテクト	6,800	1,696.00	11,532,800		
中国工業	1,000	534.00	534,000		
東 プ レ	11,500	1,700.00	19,550,000	貸付株式数	2,300株
高周波熱錬	11,900	905.00	10,769,500	貸付株式数	4,500株
東京製綱	3,800	957.00	3,636,600	貸付株式数	1,300株
サンコール	3,500	463.00	1,620,500		
モリテックスチル	4,800	353.00	1,694,400		
パイオラックス	9,900	1,910.00	18,909,000	貸付株式数	1,100株
エイチワン	6,100	658.00	4,013,800	貸付株式数	2,300株
日本発条	61,600	836.00	51,497,600	貸付株式数	21,100株
中央発條	700	2,756.00	1,929,200	貸付株式数	200株
アドバネクス	800	1,630.00	1,304,000	貸付株式数	300株 (300株)
三浦工業	26,700	3,070.00	81,969,000	貸付株式数	4,900株
タ ク マ	22,500	1,255.00	28,237,500		
テクノプロ・ホールディング グ	12,000	6,490.00	77,880,000	貸付株式数	4,900株
アトラ	1,200	372.00	446,400	貸付株式数	400株
インターワークス	1,100	559.00	614,900		
アイ・アールジャパンHD	2,400	3,660.00	8,784,000	貸付株式数	400株
K e e P e r 技研	2,200	1,443.00	3,174,600		
ファーストロジック	1,400	619.00	866,600	貸付株式数	400株
三機サービス	1,300	927.00	1,205,100	貸付株式数	400株
G u n o s y	4,200	1,406.00	5,905,200	貸付株式数	1,600株
デザインワン・ジャパン	1,200	314.00	376,800	貸付株式数	400株

イー・ガーディアン	3,100	1,686.00	5,226,600	
リブセンス	3,300	257.00	848,100	
ジャパンマテリアル	16,300	1,285.00	20,945,500	貸付株式数 6,700株
ベクトル	7,500	929.00	6,967,500	貸付株式数 3,000株
ウチヤマホールディングス	3,000	481.00	1,443,000	貸付株式数 200株
チャームケアコーポレーション	1,900	1,990.00	3,781,000	貸付株式数 700株
ライクキッズネクスト	1,400	912.00	1,276,800	貸付株式数 500株
キャリアリンク	2,200	592.00	1,302,400	貸付株式数 800株
I B J	4,000	1,104.00	4,416,000	貸付株式数 1,500株
アサンテ	2,400	2,020.00	4,848,000	貸付株式数 900株
N・フィールド	4,000	588.00	2,352,000	貸付株式数 1,300株
バリューHR	1,200	3,215.00	3,858,000	貸付株式数 400株
M&Aキャピタルパートナー	2,100	6,380.00	13,398,000	貸付株式数 800株 (500株)
ライドオンエクスプレスHD	2,500	1,442.00	3,605,000	
E R Iホールディングス	1,700	807.00	1,371,900	
アピスト	900	2,766.00	2,489,400	貸付株式数 300株 (300株)
シグマクシス	2,900	1,401.00	4,062,900	
ウィルグループ	3,900	864.00	3,369,600	
エスクローAJ	8,300	240.00	1,992,000	貸付株式数 3,300株
リクルートホールディングス	427,500	3,422.00	1,462,905,000	
エラン	3,500	1,774.00	6,209,000	貸付株式数 1,400株
ツガミ	13,900	910.00	12,649,000	貸付株式数 2,500株
オークマ	7,900	5,850.00	46,215,000	
東芝機械	7,000	2,303.00	16,121,000	貸付株式数 1,800株
アマダホールディングス	92,700	1,174.00	108,829,800	
アイダエンジニア	16,700	853.00	14,245,100	
滝澤鉄工所	1,900	1,315.00	2,498,500	
F U J I	24,700	1,566.00	38,680,200	貸付株式数 100株
牧野フライス	7,200	4,675.00	33,660,000	
オーエスジー	28,500	2,256.00	64,296,000	貸付株式数 11,900株
ダイジェット	700	1,497.00	1,047,900	
旭ダイヤモンド	16,200	646.00	10,465,200	貸付株式数 6,000株
D M G 森精機	39,100	1,574.00	61,543,400	貸付株式数 16,100株
ソディック	14,500	780.00	11,310,000	貸付株式数 5,900株

ディスコ	8,400	21,700.00	182,280,000	貸付株式数 700株 (700株)
日東工器	3,400	2,219.00	7,544,600	貸付株式数 700株
日進工具	1,800	1,980.00	3,564,000	貸付株式数 700株
パンチ工業	4,300	500.00	2,150,000	
富士ダイス	2,700	592.00	1,598,400	
土木管理総合試験	2,600	438.00	1,138,800	貸付株式数 300株
ネットマーケティング	2,100	740.00	1,554,000	
日本郵政	489,100	1,038.00	507,685,800	
ベルシステム24HLDGS	10,000	1,578.00	15,780,000	貸付株式数 1,300株
鎌倉新書	4,400	1,428.00	6,283,200	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ソネット・メディア・ネットワー	700	654.00	457,800	貸付株式数 200株
一蔵	700	601.00	420,700	貸付株式数 200株
LITALICO	1,400	1,924.00	2,693,600	貸付株式数 500株
グローバルキッズCOMP	900	872.00	784,800	貸付株式数 200株
エポラブルアジア	2,700	2,005.00	5,413,500	貸付株式数 1,000株
アトラエ	1,500	2,892.00	4,338,000	貸付株式数 600株
ストライク	2,300	2,781.00	6,396,300	貸付株式数 300株
ソラスト	14,600	1,212.00	17,695,200	
セラク	1,900	780.00	1,482,000	貸付株式数 100株
インソース	2,900	2,442.00	7,081,800	
豊田自動織機	50,600	6,340.00	320,804,000	
豊和工業	3,400	778.00	2,645,200	貸付株式数 300株
OKK	2,500	697.00	1,742,500	貸付株式数 500株
石川製作所	1,500	1,423.00	2,134,500	貸付株式数 600株
東洋機械金属	4,400	573.00	2,521,200	貸付株式数 1,000株
津田駒工業	1,200	1,328.00	1,593,600	貸付株式数 500株 (500株)
エンシュウ	1,600	1,146.00	1,833,600	貸付株式数 300株
島精機製作所	8,500	2,538.00	21,573,000	貸付株式数 3,400株 (2,100株)
オプトラン	6,900	3,205.00	22,114,500	貸付株式数 2,800株
NCホールディングス	2,000	473.00	946,000	
イワキポンプ	2,600	996.00	2,589,600	貸付株式数 1,000株
フリーー	5,000	958.00	4,790,000	
ヤマシンフィルタ	10,800	781.00	8,434,800	貸付株式数 4,300株 (2,100株)

日阪製作所	7,600	895.00	6,802,000	貸付株式数	100株
やまびこ	12,000	1,156.00	13,872,000	貸付株式数	4,800株
平田機工	2,900	6,940.00	20,126,000		
ペガサスミシン製造	5,800	500.00	2,900,000		
マルマエ	2,500	861.00	2,152,500	貸付株式数	900株
タツモ	2,900	1,099.00	3,187,100	貸付株式数	1,100株
ナブテスコ	36,400	3,395.00	123,578,000	貸付株式数	15,000株 (1,500株)
三井海洋開発	6,600	2,628.00	17,344,800	貸付株式数	2,700株
レオン自動機	6,100	1,621.00	9,888,100		
S M C	18,300	45,480.00	832,284,000	貸付株式数	5,300株
ヤマハモーターロボH L D G S	4,700	413.00	1,941,100	貸付株式数	1,800株
ホソカワミクロン	2,200	3,860.00	8,492,000	貸付株式数	800株
ユニオンツール	2,300	3,275.00	7,532,500	貸付株式数	900株
オイレス工業	8,700	1,657.00	14,415,900		
日精エーエスビー	2,100	3,320.00	6,972,000	貸付株式数	800株
サト - ホールディングス	7,500	2,924.00	21,930,000		
技研製作所	5,400	3,345.00	18,063,000		
日本エアーテック	1,900	594.00	1,128,600	貸付株式数	200株
カワタ	1,700	962.00	1,635,400	貸付株式数	600株
日精樹脂工業	5,200	1,004.00	5,220,800	貸付株式数	400株
オカダアイヨン	2,100	1,234.00	2,591,400	貸付株式数	100株
ワイエイシイホールディング クス	2,500	693.00	1,732,500		
小松製作所	282,800	2,482.00	701,909,600	貸付株式数	117,000株 (8,200株)
住友重機械	35,700	3,300.00	117,810,000	貸付株式数	4,600株
日立建機	25,000	2,641.00	66,025,000		
日工	1,700	3,430.00	5,831,000	貸付株式数	500株
巴工業	2,700	2,446.00	6,604,200	貸付株式数	1,000株
井関農機	6,300	1,495.00	9,418,500	貸付株式数	2,400株
T O W A	5,400	822.00	4,438,800	貸付株式数	2,200株
丸山製作所	1,300	1,205.00	1,566,500		
北川鉄工所	2,800	1,990.00	5,572,000		
シンニッタン	9,600	468.00	4,492,800	貸付株式数	3,900株
ローツェ	2,700	2,471.00	6,671,700	貸付株式数	1,100株
タカキタ	2,200	562.00	1,236,400	貸付株式数	600株
クボタ	334,700	1,700.00	568,990,000	貸付株式数	138,400株
荏原実業	1,600	2,036.00	3,257,600	貸付株式数	500株

東洋エンジニア	8,300	617.00	5,121,100	貸付株式数 3,300株 (700株)
三菱化工機	2,200	1,787.00	3,931,400	貸付株式数 100株
月島機械	12,400	1,425.00	17,670,000	貸付株式数 5,000株
帝国電機製作所	4,400	1,217.00	5,354,800	
東京機械	2,400	370.00	888,000	
新東工業	14,800	975.00	14,430,000	貸付株式数 5,800株
渋谷工業	5,400	2,819.00	15,222,600	貸付株式数 2,200株
アイチ コーポレーション	10,800	725.00	7,830,000	
小森コーポレーション	15,800	1,156.00	18,264,800	貸付株式数 6,200株
鶴見製作所	4,900	2,110.00	10,339,000	
住友精密	1,000	3,070.00	3,070,000	
日本ギア工業	1,700	491.00	834,700	貸付株式数 600株
酒井重工業	1,200	2,870.00	3,444,000	
荏原製作所	27,700	2,837.00	78,584,900	貸付株式数 11,400株
石井鉄工所	900	2,055.00	1,849,500	貸付株式数 200株
西島製作所	6,400	1,007.00	6,444,800	
北越工業	6,400	1,265.00	8,096,000	貸付株式数 2,200株
ダイキン工業	85,300	14,475.00	1,234,717,500	
オルガノ	2,200	4,615.00	10,153,000	貸付株式数 700株
ト - ヨ - カネツ	2,400	1,936.00	4,646,400	貸付株式数 500株
栗田工業	33,800	2,915.00	98,527,000	貸付株式数 1,000株
椿本チエイン	8,200	3,455.00	28,331,000	
大同工業	3,000	833.00	2,499,000	
日 機 装	18,700	1,153.00	21,561,100	貸付株式数 7,700株
木村化工機	5,200	404.00	2,100,800	貸付株式数 400株
レイズネクスト	12,500	1,248.00	15,600,000	貸付株式数 4,800株
アネスト岩田	9,700	975.00	9,457,500	貸付株式数 3,500株
ダイフク	34,400	5,650.00	194,360,000	貸付株式数 200株
サムコ	1,700	900.00	1,530,000	貸付株式数 200株
加藤製作所	3,200	1,912.00	6,118,400	
油研工業	1,000	1,588.00	1,588,000	貸付株式数 200株
タダノ	30,200	1,060.00	32,012,000	貸付株式数 12,400株
フジテック	22,700	1,372.00	31,144,400	貸付株式数 3,500株
C K D	17,400	1,260.00	21,924,000	貸付株式数 7,100株
キトー	4,700	1,558.00	7,322,600	
平和	17,400	2,214.00	38,523,600	貸付株式数 7,200株
理想科学工業	5,500	1,678.00	9,229,000	貸付株式数 2,200株
S A N K Y O	15,600	3,790.00	59,124,000	
日本金銭機械	6,900	997.00	6,879,300	貸付株式数 500株

マースグループHLDGS	4,000	1,962.00	7,848,000	貸付株式数	1,000株
福島工業	3,900	3,255.00	12,694,500	貸付株式数	1,000株
オーイズミ	2,600	455.00	1,183,000	貸付株式数	300株
ダイコク電機	2,900	1,560.00	4,524,000	貸付株式数	1,100株
竹内製作所	10,500	1,661.00	17,440,500	貸付株式数	4,200株
アマノ	17,900	3,285.00	58,801,500	貸付株式数	5,800株
JUKI	8,700	906.00	7,882,200	貸付株式数	3,400株
サンデンホールディングス	7,700	605.00	4,658,500	貸付株式数	2,300株
蛇の目ミシン	5,800	407.00	2,360,600	貸付株式数	1,800株
ブラザー工業	81,500	2,028.00	165,282,000	貸付株式数	3,300株
マックス	9,500	1,840.00	17,480,000	貸付株式数	2,500株
モリタホールディングス	10,900	1,792.00	19,532,800	貸付株式数	3,800株
グローリー	17,400	3,125.00	54,375,000	貸付株式数	2,600株
新晃工業	5,800	1,830.00	10,614,000	貸付株式数	700株
大和冷機工業	9,000	1,157.00	10,413,000	貸付株式数	3,600株
セガサミーホールディングス	61,900	1,545.00	95,635,500	貸付株式数	2,300株
日本ピストンリング	2,300	1,335.00	3,070,500		
リケン	2,900	3,950.00	11,455,000	貸付株式数	400株
TPR	8,400	1,770.00	14,868,000	貸付株式数	2,700株
ツバキ・ナカシマ	12,800	1,668.00	21,350,400	貸付株式数	5,200株
ホシザキ	18,300	8,320.00	152,256,000	貸付株式数	7,500株
大豊工業	5,100	710.00	3,621,000		
日本精工	128,400	949.00	121,851,600		
NTN	134,600	316.00	42,533,600		
ジェイテクト	59,900	1,292.00	77,390,800	貸付株式数	6,000株
不二越	5,800	4,740.00	27,492,000	貸付株式数	2,400株
ミネベアミツミ	115,900	1,838.00	213,024,200		
日本トムソン	18,600	477.00	8,872,200		
THK	36,300	2,870.00	104,181,000	貸付株式数	15,300株
ユーシン精機	4,800	1,017.00	4,881,600		
前澤給装工業	2,400	2,000.00	4,800,000	貸付株式数	600株
イーグル工業	7,700	1,014.00	7,807,800	貸付株式数	2,000株
前澤工業	4,200	359.00	1,507,800	貸付株式数	600株
日本ピラ-工業	6,300	1,273.00	8,019,900	貸付株式数	1,000株
キッツ	25,400	736.00	18,694,400	貸付株式数	9,700株
日立	281,100	4,065.00	1,142,671,500		
三菱電機	624,600	1,462.50	913,477,500		
富士電機	40,500	3,375.00	136,687,500		
東洋電機製造	2,500	1,597.00	3,992,500	貸付株式数	300株

安川電機	72,400	3,895.00	281,998,000	貸付株式数	29,900株
シンフォニアテクノロジー	8,700	1,225.00	10,657,500		
明電舎	12,400	1,874.00	23,237,600		
オリジン	1,700	1,399.00	2,378,300		
山洋電気	3,000	4,680.00	14,040,000	貸付株式数	300株
デンヨー	5,700	1,834.00	10,453,800		
ベйкаレントコンサルティング	4,200	4,530.00	19,026,000		
ORCHESTRA HOLDINGS	1,200	1,030.00	1,236,000	貸付株式数	400株
アイモバイル	1,900	599.00	1,138,100	貸付株式数	700株
キャリアインデックス	2,100	444.00	932,400	貸付株式数	800株
MS - Japan	2,400	1,451.00	3,482,400	貸付株式数	1,000株
船場	900	909.00	818,100		
グレイステクノロジー	2,200	2,912.00	6,406,400	貸付株式数	800株
ジャパニーズエレベーターSHD	4,700	2,768.00	13,009,600	貸付株式数	1,800株
フルテック	800	1,250.00	1,000,000	貸付株式数	100株
グリーンズ	2,300	1,359.00	3,125,700		
ツナググループHOLDINGS	700	598.00	418,600	貸付株式数	200株
ソウルドアウト	900	1,388.00	1,249,200		
MS & CONSULTING	900	913.00	821,700		
日総工産	4,000	1,114.00	4,456,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
キュービーネットHOLDINGS	3,600	2,178.00	7,840,800	貸付株式数	1,400株
RPAホールディングス	2,500	1,690.00	4,225,000	貸付株式数	1,000株
三桜工業	8,000	600.00	4,800,000	貸付株式数	3,200株
マキタ	76,000	3,275.00	248,900,000	貸付株式数	29,400株
東芝テック	7,800	3,205.00	24,999,000	貸付株式数	1,500株
芝浦メカトロニクス	1,100	2,994.00	3,293,400	貸付株式数	400株
マブチモーター	17,300	4,085.00	70,670,500	貸付株式数	7,100株
日本電産	75,200	15,330.00	1,152,816,000	貸付株式数	28,800株
ユーエムシーエレクトロニクス	3,400	724.00	2,461,600		
トレックス・セミコンダクター	2,800	1,287.00	3,603,600	貸付株式数	200株
東光高岳	3,200	1,160.00	3,712,000		



ダブル・スコープ	8,600	623.00	5,357,800	貸付株式数 3,500株 (100株)
宮越ホールディングス	2,300	1,128.00	2,594,400	貸付株式数 900株 (100株)
ダイヘン	6,800	3,175.00	21,590,000	
ヤーマン	9,100	685.00	6,233,500	貸付株式数 3,700株
JVCケンウッド	47,800	309.00	14,770,200	
ミマキエンジニアリング	5,600	534.00	2,990,400	貸付株式数 2,200株
第一精工	2,300	2,504.00	5,759,200	貸付株式数 900株 (500株)
日新電機	14,600	1,271.00	18,556,600	
大崎電気	12,400	656.00	8,134,400	
オムロン	66,400	5,830.00	387,112,000	
日東工業	10,000	2,120.00	21,200,000	貸付株式数 3,600株
I D E C	8,400	2,037.00	17,110,800	貸付株式数 2,400株
正興電機製作所	1,400	791.00	1,107,400	
不二電機工業	700	1,226.00	858,200	貸付株式数 200株 (200株)
ジーエス・ユアサ コーポ	22,500	1,914.00	43,065,000	貸付株式数 3,500株
サクサホールディングス	1,600	1,855.00	2,968,000	貸付株式数 200株
メルコホールディングス	2,600	2,759.00	7,173,400	貸付株式数 600株
テクノメディカ	1,400	2,249.00	3,148,600	貸付株式数 500株
日本電気	80,900	4,710.00	381,039,000	貸付株式数 13,300株 (100株)
富士通	60,200	8,821.00	531,024,200	
沖電気	27,100	1,495.00	40,514,500	貸付株式数 11,100株
岩崎通信機	2,900	816.00	2,366,400	貸付株式数 900株
電気興業	3,300	3,150.00	10,395,000	
サンケン電気	7,300	2,181.00	15,921,300	貸付株式数 2,700株
ナカヨ	1,200	1,626.00	1,951,200	
アイホン	3,500	1,617.00	5,659,500	貸付株式数 800株
ルネサスエレクトロニクス	297,400	663.00	197,176,200	貸付株式数 122,800株
セイコーエプソン	77,600	1,558.00	120,900,800	
ワコム	45,300	364.00	16,489,200	
アルバック	12,500	4,495.00	56,187,500	貸付株式数 5,100株
アクセル	2,600	627.00	1,630,200	貸付株式数 100株
E I Z O	5,700	3,780.00	21,546,000	貸付株式数 600株
ジャパンディスプレイ	61,700	65.00	4,010,500	貸付株式数 55,600株
日本信号	15,900	1,232.00	19,588,800	貸付株式数 1,400株
京三製作所	13,400	392.00	5,252,800	

能美防災	8,200	2,164.00	17,744,800	貸付株式数	2,900株
ホーチキ	4,000	1,533.00	6,132,000		
星和電機	3,300	513.00	1,692,900	貸付株式数	1,000株
エレコム	5,900	4,285.00	25,281,500	貸付株式数	2,400株
パナソニック	714,100	892.60	637,405,660		
シャープ	62,100	1,244.00	77,252,400	貸付株式数	25,600株
アンリツ	40,200	2,162.00	86,912,400	貸付株式数	16,600株
富士通ゼネラル	19,100	1,791.00	34,208,100	貸付株式数	7,800株
ソニー	419,200	6,375.00	2,672,400,000		
T D K	32,700	9,550.00	312,285,000		
帝国通信工業	2,700	1,144.00	3,088,800		
タムラ製作所	24,100	583.00	14,050,300	貸付株式数	4,900株
アルプスアルパイン	65,100	2,063.00	134,301,300		
池上通信機	2,000	1,098.00	2,196,000	貸付株式数	900株
日本電波工業	5,700	449.00	2,559,300	貸付株式数	2,200株
鈴木	3,300	653.00	2,154,900		
日本トリム	1,200	4,685.00	5,622,000	貸付株式数	400株 (200株)
ローランド ディー . ジー .	3,400	2,028.00	6,895,200	貸付株式数	700株
フオスタ - 電機	7,100	1,875.00	13,312,500	貸付株式数	2,700株
S M K	1,700	2,828.00	4,807,600	貸付株式数	600株
ヨコオ	4,500	2,927.00	13,171,500		
ティアック	4,500	192.00	864,000	貸付株式数	1,800株
ホシデン	18,300	1,090.00	19,947,000		
ヒロセ電機	8,900	13,280.00	118,192,000		
日本航空電子	14,300	1,627.00	23,266,100	貸付株式数	5,500株
T O A	6,700	1,309.00	8,770,300	貸付株式数	2,300株
マクセルホールディングス	13,500	1,553.00	20,965,500		
古野電気	8,000	973.00	7,784,000		
ユニデンホールディングス	1,800	1,906.00	3,430,800	貸付株式数	600株
スミダコーポレーション	4,800	1,050.00	5,040,000	貸付株式数	1,900株 (1,700株)
アイコム	3,400	2,211.00	7,517,400		
リオン	2,900	2,301.00	6,672,900	貸付株式数	500株
本多通信工業	5,300	525.00	2,782,500	貸付株式数	2,100株
船井電機	6,300	590.00	3,717,000	貸付株式数	2,000株 (1,900株)
横河電機	62,500	2,009.00	125,562,500		
新電元工業	2,200	3,625.00	7,975,000	貸付株式数	300株

アズビル	39,400	2,912.00	114,732,800	
東亜ディーケーケー	3,100	861.00	2,669,100	貸付株式数 1,200株
日本光電工業	27,500	3,140.00	86,350,000	
チノール	2,200	1,383.00	3,042,600	貸付株式数 100株
共和電業	6,500	422.00	2,743,000	貸付株式数 100株
日本電子材料	2,500	516.00	1,290,000	貸付株式数 400株
堀場製作所	12,400	6,270.00	77,748,000	貸付株式数 5,100株
アドバンテスト	42,600	4,710.00	200,646,000	
小野測器	2,600	529.00	1,375,400	
エスペック	5,500	1,916.00	10,538,000	貸付株式数 1,000株
キーエンス	30,700	66,890.00	2,053,523,000	
日置電機	3,300	3,575.00	11,797,500	
シスメックス	48,700	7,332.00	357,068,400	
日本マイクロニクス	10,900	875.00	9,537,500	
メガチップス	4,900	1,733.00	8,491,700	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,200	3,720.00	11,904,000	貸付株式数 1,100株
IMAGICA GROUP	5,100	513.00	2,616,300	貸付株式数 2,000株
澤藤電機	800	1,711.00	1,368,800	
デンソー	137,500	4,854.00	667,425,000	
原田工業	2,500	835.00	2,087,500	
コーセル	7,600	1,053.00	8,002,800	貸付株式数 3,100株
イリソ電子工業	5,700	5,300.00	30,210,000	貸付株式数 2,300株
オプテックスグループ	10,300	1,631.00	16,799,300	貸付株式数 4,200株
千代田インテグレ	2,900	2,143.00	6,214,700	貸付株式数 1,100株
アイ・オー・データ	2,300	892.00	2,051,600	
レーザーテック	12,800	6,580.00	84,224,000	貸付株式数 5,200株
スタンレー電気	44,100	2,839.00	125,199,900	貸付株式数 6,000株
岩崎電気	2,400	1,260.00	3,024,000	貸付株式数 800株
ウシオ電機	36,300	1,521.00	55,212,300	貸付株式数 13,300株
岡谷電機	4,500	393.00	1,768,500	貸付株式数 1,800株
ヘリオステクノH	5,800	565.00	3,277,000	貸付株式数 2,300株
エノモト	1,700	954.00	1,621,800	
日本セラミック	6,300	2,785.00	17,545,500	貸付株式数 2,500株
遠藤照明	3,200	671.00	2,147,200	
古河電池	4,500	613.00	2,758,500	貸付株式数 1,400株 (1,000株)
双信電機	3,000	439.00	1,317,000	貸付株式数 1,200株
山一電機	4,500	1,241.00	5,584,500	貸付株式数 1,800株

図 研	4,100	1,869.00	7,662,900	貸付株式数	700株
日本電子	12,300	2,527.00	31,082,100	貸付株式数	300株
カ シ オ	55,400	1,603.00	88,806,200	貸付株式数	17,100株
ファナック	59,300	20,445.00	1,212,388,500		
日本シイエムケイ	15,900	593.00	9,428,700	貸付株式数	6,400株
エンプラス	2,800	3,495.00	9,786,000		
大真空	2,300	1,025.00	2,357,500	貸付株式数	300株
ロ ー ム	29,900	8,590.00	256,841,000		
浜松ホトニクス	44,800	3,955.00	177,184,000		
三井ハイテック	6,900	1,682.00	11,605,800	貸付株式数	2,400株 (200株)
新光電気工業	21,000	968.00	20,328,000		
京 セ ラ	95,200	6,785.00	645,932,000		
協栄産業	700	1,351.00	945,700		
太陽誘電	27,800	2,491.00	69,249,800	貸付株式数	11,400株
村田製作所	196,600	5,046.00	992,043,600		
双葉電子工業	9,900	1,375.00	13,612,500	貸付株式数	3,600株
日東電工	43,100	5,364.00	231,188,400		
北陸電気工業	2,300	1,025.00	2,357,500		
東海理化電機	16,300	1,892.00	30,839,600		
ニチコン	19,700	992.00	19,542,400	貸付株式数	1,800株
日本ケミコン	4,400	1,606.00	7,066,400	貸付株式数	1,800株
K O A	9,400	1,355.00	12,737,000	貸付株式数	1,000株
三井E & S H D	21,700	943.00	20,463,100		
日立造船	49,600	353.00	17,508,800	貸付株式数	20,400株
三菱重工業	104,700	4,387.00	459,318,900		
川崎重工業	48,700	2,314.00	112,691,800		
I H I	48,000	2,402.00	115,296,000		
名村造船所	18,900	303.00	5,726,700		
サノヤホールディングス	8,300	188.00	1,560,400	貸付株式数	200株
スプリックス	2,000	1,446.00	2,892,000	貸付株式数	800株
日本車輛	2,300	2,502.00	5,754,600	貸付株式数	900株
三菱ロジスネクスト	10,300	1,032.00	10,629,600	貸付株式数	400株
近畿車輛	1,000	1,308.00	1,308,000	貸付株式数	100株
F P G	19,400	1,148.00	22,271,200		
島根銀行	1,400	681.00	953,400	貸付株式数	500株 (300株)
じもとホールディングス	42,100	101.00	4,252,100		
全国保証	17,400	4,225.00	73,515,000	貸付株式数	7,100株
めぶきフィナンシャルG	319,600	268.00	85,652,800	貸付株式数	42,200株

東京きらぼしFG	8,400	1,431.00	12,020,400		
九州フィナンシャルG	101,200	446.00	45,135,200		
かんぽ生命保険	21,900	1,665.00	36,463,500		
ゆうちょ銀行	174,300	1,073.00	187,023,900	貸付株式数	72,100株
富山第一銀行	14,800	320.00	4,736,000		
コンコルディア・フィナンシャル	386,400	420.00	162,288,000		
ジェイリース	1,700	317.00	538,900	貸付株式数	600株
西日本フィナンシャルHD	38,900	733.00	28,513,700		
マーキュリアインベストメント	2,600	744.00	1,934,400	貸付株式数	1,000株
イントラスト	1,700	646.00	1,098,200	貸付株式数	600株
日本モーゲージサービス	1,100	1,129.00	1,241,900	貸付株式数	300株
C a s a	2,800	1,231.00	3,446,800		
アルヒ	5,600	2,169.00	12,146,400	貸付株式数	2,300株
プレミアグループ	3,500	1,904.00	6,664,000	貸付株式数	1,400株 (1,300株)
日産自動車	736,800	713.70	525,854,160		
いすゞ自動車	197,500	1,246.50	246,183,750		
トヨタ自動車	695,900	7,364.00	5,124,607,600		
日野自動車	78,000	939.00	73,242,000		
三菱自動車工業	231,500	496.00	114,824,000		
エフテック	4,400	709.00	3,119,600		
レシップホールディングス	2,500	793.00	1,982,500	貸付株式数	100株
GMB	1,200	787.00	944,400		
ファルテック	1,100	737.00	810,700		
武蔵精密工業	15,200	1,427.00	21,690,400		
日産車体	12,200	945.00	11,529,000	貸付株式数	3,100株
新明和工業	26,100	1,323.00	34,530,300	貸付株式数	9,300株
極東開発工業	12,400	1,332.00	16,516,800	貸付株式数	3,600株
日信工業	11,400	1,502.00	17,122,800		
トピー工業	5,200	1,981.00	10,301,200	貸付株式数	1,100株
ティラド	2,300	1,846.00	4,245,800	貸付株式数	600株
タチエス	10,300	1,294.00	13,328,200	貸付株式数	2,900株
N O K	33,600	1,669.00	56,078,400	貸付株式数	13,000株
フタバ産業	17,400	760.00	13,224,000	貸付株式数	5,900株
K Y B	6,500	3,225.00	20,962,500	貸付株式数	100株
市光工業	9,400	833.00	7,830,200	貸付株式数	3,800株
大同メタル工業	10,200	653.00	6,660,600	貸付株式数	600株
プレス工業	30,900	476.00	14,708,400	貸付株式数	11,900株

ミクニ	7,900	320.00	2,528,000		
太平洋工業	13,100	1,566.00	20,514,600	貸付株式数	4,900株
ケーヒン	14,300	1,602.00	22,908,600		
河西工業	7,700	839.00	6,460,300		
アイシン精機	51,400	3,555.00	182,727,000		
マ ッ ダ	196,000	981.30	192,334,800		
今仙電機製作所	5,700	898.00	5,118,600		
本田技研	526,800	2,885.50	1,520,081,400		
スズキ	114,300	4,305.00	492,061,500	貸付株式数	43,800株
S U B A R U	193,900	3,063.00	593,915,700		
安永	3,000	1,328.00	3,984,000	貸付株式数	1,100株
ヤマハ発動機	81,400	1,936.00	157,590,400	貸付株式数	34,700株
ショーワ	14,700	1,548.00	22,755,600		
小糸製作所	37,400	5,430.00	203,082,000	貸付株式数	7,400株
T B K	7,400	418.00	3,093,200	貸付株式数	3,000株
エクセディ	8,500	2,129.00	18,096,500	貸付株式数	600株
ミツバ	11,500	647.00	7,440,500	貸付株式数	2,300株
豊田合成	20,200	2,206.00	44,561,200		
愛三工業	9,800	822.00	8,055,600		
盟和産業	1,000	1,104.00	1,104,000	貸付株式数	300株
日本プラスト	4,900	704.00	3,449,600		
ヨ ロ ズ	5,900	1,344.00	7,929,600	貸付株式数	900株
エフ・シー・シー	11,200	2,154.00	24,124,800	貸付株式数	4,500株
新家工業	1,400	1,465.00	2,051,000		
シマノ	23,400	16,300.00	381,420,000	貸付株式数	9,700株
テイ・エス テック	14,500	3,305.00	47,922,500		
関西みらいFG	28,800	737.00	21,225,600	貸付株式数	200株
3 3 F G	5,300	1,785.00	9,460,500	貸付株式数	2,200株
第四北越フィナンシャルG	10,700	2,696.00	28,847,200	貸付株式数	100株
ジャムコ	3,100	1,560.00	4,836,000	貸付株式数	900株 (900株)
小 野 建	5,500	1,377.00	7,573,500	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
はるやまHLDGS	2,900	825.00	2,392,500	貸付株式数	400株
南 陽	1,300	1,605.00	2,086,500		
ノ ジ マ	10,900	1,784.00	19,445,600	貸付株式数	4,400株
佐鳥電機	4,500	785.00	3,532,500	貸付株式数	1,800株
カップ・クリエイト	8,700	1,478.00	12,858,600	貸付株式数	3,500株
エコートレーディング	1,500	529.00	793,500		
伯東	4,200	1,197.00	5,027,400	貸付株式数	700株

コンドーテック	4,700	940.00	4,418,000	貸付株式数	1,000株
中山福	3,500	540.00	1,890,000		
ライトオン	4,700	684.00	3,214,800	貸付株式数	1,500株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,900	2,296.00	20,434,400	貸付株式数	3,000株
ジーンズメイト	1,900	314.00	596,600	貸付株式数	700株
三菱食品	6,700	2,742.00	18,371,400	貸付株式数	2,300株
良品計画	87,200	2,087.00	181,986,400	貸付株式数	36,000株
三城ホールディングス	7,700	307.00	2,363,900	貸付株式数	3,000株
松田産業	4,500	1,485.00	6,682,500		
第一興商	9,100	5,000.00	45,500,000	貸付株式数	3,700株
メディパルHD	66,300	2,469.00	163,694,700		
アドヴァン	9,400	1,193.00	11,214,200		
S P K	1,300	2,518.00	3,273,400	貸付株式数	100株
萩原電気HLDGS	2,300	2,691.00	6,189,300	貸付株式数	400株
アルビス	2,300	2,443.00	5,618,900	貸付株式数	900株
アズワン	4,400	8,970.00	39,468,000	貸付株式数	800株
スズデン	2,100	1,405.00	2,950,500	貸付株式数	800株
尾家産業	2,000	1,368.00	2,736,000	貸付株式数	800株
シモジマ	3,800	1,137.00	4,320,600		
ドウシシャ	5,800	1,780.00	10,324,000	貸付株式数	600株
小津産業	1,400	1,859.00	2,602,600		
コナカ	7,300	437.00	3,190,100	貸付株式数	100株
高速	3,700	1,325.00	4,902,500	貸付株式数	100株
ハウス ローゼ	800	1,630.00	1,304,000	貸付株式数	100株
G-7ホールディングス	1,800	3,150.00	5,670,000		
たけびし	2,100	1,365.00	2,866,500		
イオン北海道	6,000	752.00	4,512,000	貸付株式数	1,000株
コジマ	10,600	478.00	5,066,800		
ヒマラヤ	2,200	815.00	1,793,000		
コーナン商事	8,100	2,434.00	19,715,400	貸付株式数	3,300株
ネットワンシステムズ	21,700	2,858.00	62,018,600	貸付株式数	7,400株
エコス	2,300	1,651.00	3,797,300		
ワタミ	8,100	1,461.00	11,834,100	貸付株式数	3,300株
マルシェ	1,500	780.00	1,170,000	貸付株式数	600株
リックス	1,400	1,544.00	2,161,600	貸付株式数	300株
システムソフト	14,500	109.00	1,580,500	貸付株式数	2,200株
パンパシフィックHD	147,400	1,753.00	258,392,200	貸付株式数	60,900株
丸文	5,400	569.00	3,072,600		

西松屋チェーン	13,600	961.00	13,069,600	貸付株式数 5,400株 (200株)
ゼンショーホールディングス	29,900	2,501.00	74,779,900	貸付株式数 12,300株
ハピネット	5,100	1,307.00	6,665,700	
幸楽苑ホールディングス	3,900	2,442.00	9,523,800	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,300	1,045.00	1,358,500	
橋本総業HLDGS	1,200	1,600.00	1,920,000	
日本ライフライン	18,200	1,867.00	33,979,400	貸付株式数 7,200株
サイゼリヤ	10,200	2,716.00	27,703,200	貸付株式数 4,100株
タカショー	3,000	458.00	1,374,000	貸付株式数 600株
エクセル	2,300	1,252.00	2,879,600	
V Tホールディングス	27,800	459.00	12,760,200	
マルカ	2,200	2,042.00	4,492,400	
アルゴグラフィックス	5,200	2,638.00	13,717,600	
魚力	1,700	1,600.00	2,720,000	貸付株式数 700株
IDOM	20,800	456.00	9,484,800	貸付株式数 8,400株
日本エム・ディ・エム	3,600	1,711.00	6,159,600	貸付株式数 1,300株
ポプラ	1,600	497.00	795,200	貸付株式数 600株
フジ・コーポレーション	1,600	2,170.00	3,472,000	
ユナイテッドアローズ	7,100	3,030.00	21,513,000	貸付株式数 2,600株 (1,900株)
進和	3,600	2,206.00	7,941,600	貸付株式数 1,300株
エスケイジャパン	1,500	410.00	615,000	貸付株式数 500株
ダイトロン	2,600	1,317.00	3,424,200	貸付株式数 200株
ハイデイ日高	8,900	2,161.00	19,232,900	貸付株式数 3,600株
シークス	7,800	1,503.00	11,723,400	貸付株式数 3,200株
京都きもの友禅	4,000	342.00	1,368,000	貸付株式数 1,600株
コロワイド	20,500	2,159.00	44,259,500	貸付株式数 8,400株
ピーシーデポコーポ	8,200	492.00	4,034,400	貸付株式数 500株 (500株)
田中商事	2,100	648.00	1,360,800	貸付株式数 500株
オーハシテクニカ	3,500	1,408.00	4,928,000	貸付株式数 1,300株
壱番屋	4,300	5,030.00	21,629,000	貸付株式数 1,700株 (100株)
白銅	2,000	1,384.00	2,768,000	
トップカルチャー	2,200	355.00	781,000	貸付株式数 800株 (600株)
PLANT	1,600	736.00	1,177,600	貸付株式数 600株



スギホールディングス	13,500	5,800.00	78,300,000	貸付株式数	5,500株
薬王堂ホールディングス	2,700	2,650.00	7,155,000		
島津製作所	80,400	2,830.00	227,532,000		
J M S	5,700	643.00	3,665,100	貸付株式数	1,700株
クボテック	1,300	435.00	565,500	貸付株式数	400株
長野計器	4,900	728.00	3,567,200	貸付株式数	200株
ブイ・テクノロジー	2,900	5,470.00	15,863,000	貸付株式数	1,100株
スター精密	9,800	1,548.00	15,170,400	貸付株式数	4,000株
東京計器	4,000	908.00	3,632,000		
愛知時計	800	4,080.00	3,264,000	貸付株式数	200株
インターアクション	3,400	2,092.00	7,112,800	貸付株式数	1,300株
オーバル	6,100	231.00	1,409,100	貸付株式数	1,800株
東京精密	11,300	3,215.00	36,329,500	貸付株式数	2,900株
マニー	24,900	2,618.00	65,188,200	貸付株式数	10,200株
ニコン	108,800	1,389.00	151,123,200		
トプコン	33,600	1,443.00	48,484,800	貸付株式数	1,400株
オリンパス	372,200	1,405.00	522,941,000	貸付株式数	152,400株
理研計器	5,500	2,119.00	11,654,500	貸付株式数	700株
S C R E E Nホールディングス	10,900	6,540.00	71,286,000	貸付株式数	4,400株
キヤノン電子	6,500	1,833.00	11,914,500	貸付株式数	2,600株
タムロン	5,000	2,268.00	11,340,000	貸付株式数	2,000株
HOYA	125,700	8,850.00	1,112,445,000		
シード	2,700	931.00	2,513,700	貸付株式数	1,000株
ノーリツ鋼機	4,900	1,807.00	8,854,300		
エー・アンド・デイ	5,700	704.00	4,012,800		
朝日インテック	53,000	2,753.00	145,909,000	貸付株式数	21,900株
キヤノン	336,400	2,928.50	985,147,400	貸付株式数	139,000株
リコー	188,200	1,037.00	195,163,400		
シチズン時計	68,500	543.00	37,195,500		
リズム時計	2,100	1,082.00	2,272,200	貸付株式数	600株
大研医器	5,000	535.00	2,675,000	貸付株式数	1,900株
メニコン	8,600	3,905.00	33,583,000	貸付株式数	400株
シンシア	700	638.00	446,600	貸付株式数	300株
中本パックス	1,700	1,442.00	2,451,400	貸付株式数	700株
スノーピーク	2,800	1,305.00	3,654,000	貸付株式数	1,000株
パラマウントベッドHD	7,200	4,065.00	29,268,000		
トランザクション	4,000	999.00	3,996,000	貸付株式数	1,600株
S H O B I	1,800	386.00	694,800	貸付株式数	600株

ニホンフラッシュ	2,700	2,465.00	6,655,500	貸付株式数 1,100株 (800株)
前田工織	6,900	1,442.00	9,949,800	貸付株式数 100株
永大産業	8,300	348.00	2,888,400	
アートネイチャー	6,600	667.00	4,402,200	貸付株式数 1,300株
バンダイナムコHLDGS	64,600	6,380.00	412,148,000	
アイフィスジャパン	1,500	737.00	1,105,500	貸付株式数 100株
共立印刷	10,400	161.00	1,674,400	貸付株式数 3,800株
SHOEI	3,000	4,820.00	14,460,000	貸付株式数 1,200株
フランスベッドHLDGS	8,800	1,068.00	9,398,400	
マーベラス	9,400	798.00	7,501,200	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,900	3,980.00	43,382,000	貸付株式数 4,500株
萩原工業	3,500	1,524.00	5,334,000	
エイベックス	10,500	1,315.00	13,807,500	貸付株式数 1,400株
トッパン・フォームズ	13,400	1,013.00	13,574,200	貸付株式数 5,100株
フジシールインターナショナル	14,000	2,847.00	39,858,000	貸付株式数 1,800株
タカラトミー	26,200	1,204.00	31,544,800	貸付株式数 9,300株
廣済堂	5,800	717.00	4,158,600	
エステールホールディングス	1,600	630.00	1,008,000	
アーク	23,800	94.00	2,237,200	
レック	6,700	998.00	6,686,600	貸付株式数 2,400株
タカノ	2,500	794.00	1,985,000	貸付株式数 900株
三光合成	7,200	355.00	2,556,000	貸付株式数 100株
プロネクサス	5,400	1,167.00	6,301,800	貸付株式数 1,900株
ホクシン	3,700	150.00	555,000	
ウッドワン	2,100	1,052.00	2,209,200	
大建工業	4,700	2,063.00	9,696,100	貸付株式数 1,400株
きもと	10,700	183.00	1,958,100	貸付株式数 3,800株
凸版印刷	92,800	1,909.00	177,155,200	
大日本印刷	88,000	2,774.00	244,112,000	
共同印刷	1,900	2,791.00	5,302,900	貸付株式数 600株
NISSHA	12,900	1,040.00	13,416,000	貸付株式数 5,200株 (2,700株)
光村印刷	500	1,798.00	899,000	貸付株式数 200株
藤森工業	5,600	3,170.00	17,752,000	
ヴィア・ホールディングス	7,600	687.00	5,221,200	

宝印刷	3,000	1,710.00	5,130,000		
前澤化成工業	4,300	1,197.00	5,147,100	貸付株式数	1,500株
未来工業	3,400	1,942.00	6,602,800		
アシックス	51,600	1,706.00	88,029,600	貸付株式数	22,800株
ツ ツ ミ	2,000	2,100.00	4,200,000		
ウェーブロックHLDGS	1,800	741.00	1,333,800		
ジェイ エス ピー	3,700	1,831.00	6,774,700		
ニ チ ハ	8,700	3,030.00	26,361,000	貸付株式数	1,200株
エフピコ	6,900	6,660.00	45,954,000	貸付株式数	400株 (400株)
小松ウオール工業	1,900	1,965.00	3,733,500	貸付株式数	300株
ヤマハ	37,200	4,810.00	178,932,000	貸付株式数	15,200株
河合楽器	1,900	2,842.00	5,399,800	貸付株式数	700株
クリナップ	5,800	560.00	3,248,000	貸付株式数	1,700株
ビジョン	37,700	4,410.00	166,257,000	貸付株式数	15,600株
天馬	4,200	2,031.00	8,530,200	貸付株式数	700株
兼松サステック	400	1,811.00	724,400	貸付株式数	100株
キングジム	5,200	869.00	4,518,800		
象印マホービン	18,300	1,416.00	25,912,800	貸付株式数	7,500株 (3,400株)
リンテック	14,800	2,138.00	31,642,400		
信越ポリマー	11,200	764.00	8,556,800		
東 リ	15,600	258.00	4,024,800	貸付株式数	4,300株
イトーキ	11,700	451.00	5,276,700	貸付株式数	300株
任 天 堂	35,700	42,460.00	1,515,822,000		
三菱鉛筆	10,300	1,753.00	18,055,900	貸付株式数	4,200株
松 風	3,000	1,530.00	4,590,000	貸付株式数	1,100株
タカラスタンダ - ド	12,900	1,832.00	23,632,800	貸付株式数	5,300株
コ ク ヨ	29,900	1,475.00	44,102,500	貸付株式数	12,200株
ナカバヤシ	6,100	527.00	3,214,700		
ニ フ コ	25,000	2,649.00	66,225,000	貸付株式数	5,000株
立川ブラインド	2,700	1,390.00	3,753,000		
グローブライド	3,000	2,922.00	8,766,000		
オカムラ	21,800	1,110.00	24,198,000		
バルカー	5,100	2,295.00	11,704,500	貸付株式数	800株
MUTOHホールディング ス	900	1,645.00	1,480,500	貸付株式数	300株
伊 藤 忠	430,100	2,302.00	990,090,200		
丸 紅	606,500	753.20	456,815,800		
スクロール	9,500	340.00	3,230,000	貸付株式数	3,800株

高 島	1,000	1,606.00	1,606,000	貸付株式数	200株
ヨンドシーホールディングス	6,800	2,638.00	17,938,400	貸付株式数	2,700株
三陽商会	3,200	1,478.00	4,729,600	貸付株式数	500株
長瀬産業	34,500	1,574.00	54,303,000		
ナイガイ	2,200	377.00	829,400		
蝶 理	3,900	1,727.00	6,735,300	貸付株式数	1,400株
豊田通商	68,700	3,645.00	250,411,500		
オンワ - ドホールディングス	36,800	552.00	20,313,600	貸付株式数	15,000株
三共生興	10,500	526.00	5,523,000		
兼 松	24,600	1,237.00	30,430,200	貸付株式数	2,700株
美 津 濃	6,200	2,811.00	17,428,200		
ツカモトコーポレーション	1,100	1,062.00	1,168,200	貸付株式数	400株
ファミリーマート	68,800	2,701.00	185,828,800	貸付株式数	28,400株
ルックホールディングス	2,100	1,075.00	2,257,500		
三井物産	506,700	1,838.50	931,567,950		
日本紙パルプ	3,500	3,965.00	13,877,500	貸付株式数	600株
東京エレクトロン	41,600	20,780.00	864,448,000		
日立ハイテクノロジーズ	18,700	6,270.00	117,249,000		
カメイ	8,000	1,131.00	9,048,000	貸付株式数	2,600株
東都水産	900	2,631.00	2,367,900	貸付株式数	300株
OUGホールディングス	1,000	2,780.00	2,780,000	貸付株式数	300株
スターゼン	2,300	4,370.00	10,051,000	貸付株式数	900株 (700株)
セイコーHD	9,700	2,380.00	23,086,000	貸付株式数	3,900株
山 善	24,000	977.00	23,448,000		
椿本興業	1,400	3,685.00	5,159,000	貸付株式数	500株
住友商事	363,800	1,755.50	638,650,900		
日本ユニシス	19,100	3,465.00	66,181,500		
内田洋行	2,600	3,835.00	9,971,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
三菱商事	431,600	2,783.00	1,201,142,800		
第一実業	2,800	3,005.00	8,414,000		
キヤノンマーケティングJPN	17,600	2,281.00	40,145,600	貸付株式数	7,200株
西華産業	3,500	1,363.00	4,770,500	貸付株式数	1,200株
佐藤商事	5,500	867.00	4,768,500	貸付株式数	1,400株
菱洋エレクトロ	6,200	1,878.00	11,643,600	貸付株式数	2,400株
東京産業	6,100	511.00	3,117,100	貸付株式数	2,300株

ユアサ商事	6,300	3,165.00	19,939,500		
神鋼商事	1,400	2,420.00	3,388,000		
小林産業	3,700	285.00	1,054,500		
阪和興業	10,700	3,095.00	33,116,500	貸付株式数	1,400株
正栄食品	4,000	3,315.00	13,260,000	貸付株式数	1,600株
カナデン	5,600	1,362.00	7,627,200	貸付株式数	2,200株
菱電商事	4,900	1,649.00	8,080,100		
ニプロ	43,300	1,264.00	54,731,200	貸付株式数	16,700株
フルサト工業	3,400	1,468.00	4,991,200	貸付株式数	1,200株
岩谷産業	13,600	3,595.00	48,892,000	貸付株式数	5,200株
すてきナイスグループ	2,500	741.00	1,852,500	貸付株式数	600株
昭光通商	2,100	632.00	1,327,200	貸付株式数	200株
ニチモウ	1,000	1,823.00	1,823,000	貸付株式数	400株
極東貿易	1,900	1,828.00	3,473,200		
イワキ	8,100	494.00	4,001,400	貸付株式数	2,800株
兼松エレクトロニクス	3,300	3,100.00	10,230,000		
三愛石油	16,500	1,116.00	18,414,000		
稲畑産業	14,800	1,346.00	19,920,800	貸付株式数	6,000株
G S Iクレオス	1,600	1,041.00	1,665,600		
明和産業	5,700	625.00	3,562,500	貸付株式数	900株
クワザワ	2,200	536.00	1,179,200		
ゴ-ルドウイン	5,500	17,800.00	97,900,000	貸付株式数	2,100株 (1,400株)
ユニ・チャ-ム	120,400	3,347.00	402,978,800	貸付株式数	51,200株
デサント	14,900	1,507.00	22,454,300	貸付株式数	100株
キング	3,300	569.00	1,877,700	貸付株式数	1,300株
ワキタ	13,100	1,119.00	14,658,900	貸付株式数	5,400株
ヤマトインタ-ナショナル	3,700	402.00	1,487,400	貸付株式数	1,400株
東邦ホールディングス	18,200	2,580.00	46,956,000	貸付株式数	7,400株
サンゲツ	18,100	2,072.00	37,503,200	貸付株式数	1,000株
ミツウロコグループ	8,200	1,018.00	8,347,600	貸付株式数	2,200株
シナネンホールディングス	2,500	1,735.00	4,337,500	貸付株式数	800株
伊藤忠エネクス	13,500	852.00	11,502,000		
サンリオ	19,000	2,140.00	40,660,000	貸付株式数	7,700株
サンワテクノス	3,700	827.00	3,059,900	貸付株式数	1,500株
リョ-サン	6,800	2,755.00	18,734,000	貸付株式数	400株
新光商事	5,800	1,880.00	10,904,000		
トーヨー	2,800	1,823.00	5,104,400	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
三信電気	4,200	1,555.00	6,531,000		

東陽テクニカ	7,100	1,092.00	7,753,200		
モスフード サービス	8,100	2,516.00	20,379,600	貸付株式数	3,300株 (100株)
加賀電子	6,100	2,046.00	12,480,600	貸付株式数	1,200株
三益半導体	5,400	1,892.00	10,216,800		
ソーダニツカ	6,400	567.00	3,628,800	貸付株式数	2,600株 (900株)
立花エレテック	4,500	1,694.00	7,623,000		
木曽路	7,600	2,779.00	21,120,400	貸付株式数	3,100株
S R Sホールディングス	7,300	1,065.00	7,774,500	貸付株式数	2,900株
千 趣 会	11,200	310.00	3,472,000	貸付株式数	3,500株
タカキュー	4,800	175.00	840,000	貸付株式数	1,900株 (1,600株)
ケーヨー	11,400	511.00	5,825,400	貸付株式数	2,100株
上新電機	7,300	2,170.00	15,841,000	貸付株式数	2,900株
日本瓦斯	9,700	2,971.00	28,818,700	貸付株式数	400株
ロイヤルホールディングス	10,800	2,690.00	29,052,000	貸付株式数	4,400株
東 天 紅	500	1,229.00	614,500	貸付株式数	100株
いなげや	6,900	1,629.00	11,240,100	貸付株式数	2,800株
島 忠	13,000	2,649.00	34,437,000	貸付株式数	5,300株
チヨダ	6,500	1,714.00	11,141,000	貸付株式数	2,600株
ライフコーポレーション	4,700	2,246.00	10,556,200	貸付株式数	1,900株
リンガーハット	7,600	2,514.00	19,106,400	貸付株式数	1,800株 (1,700株)
Mr Max HD	8,400	457.00	3,838,800	貸付株式数	800株
テナライド	5,600	453.00	2,536,800	貸付株式数	2,100株
A O K Iホールディングス	12,300	1,107.00	13,616,100	貸付株式数	4,400株
オークワ	8,800	1,234.00	10,859,200	貸付株式数	3,600株
コメリ	9,500	2,254.00	21,413,000		
青山商事	10,800	1,995.00	21,546,000		
しまむら	7,200	8,560.00	61,632,000	貸付株式数	2,900株
はせがわ	3,100	407.00	1,261,700	貸付株式数	1,100株
高 島 屋	48,300	1,281.00	61,872,300	貸付株式数	19,900株
松 屋	12,400	839.00	10,403,600	貸付株式数	3,200株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	31,600	1,243.00	39,278,800	貸付株式数	10,500株
近鉄百貨店	2,300	3,200.00	7,360,000	貸付株式数	900株
パ ル コ	5,900	1,298.00	7,658,200	貸付株式数	2,400株
丸井グループ	52,100	2,323.00	121,028,300		
クレディセゾン	43,200	1,382.00	59,702,400	貸付株式数	17,800株

アクシアル リテイリング	5,100	4,190.00	21,369,000	貸付株式数	2,100株
井筒屋	3,300	227.00	749,100		
イオン	236,700	1,993.50	471,861,450	貸付株式数	97,900株
イズミ	12,500	4,375.00	54,687,500	貸付株式数	5,100株
フォーバル	2,700	944.00	2,548,800		
平和堂	12,500	2,078.00	25,975,000	貸付株式数	5,100株
フジ	7,400	1,932.00	14,296,800	貸付株式数	3,000株
ヤオコー	7,000	4,950.00	34,650,000		
ゼビオホールディングス	7,400	1,216.00	8,998,400	貸付株式数	2,400株
ケースホールディングス	64,000	1,178.00	75,392,000		
PALTAC	11,100	5,460.00	60,606,000	貸付株式数	3,600株
三谷産業	7,200	291.00	2,095,200	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
OLYMPICグループ	3,600	621.00	2,235,600		
日産東京販売HD	9,000	288.00	2,592,000		
新生銀行	45,300	1,567.00	70,985,100	貸付株式数	17,800株
あおぞら銀行	34,500	2,736.00	94,392,000		
三菱UFJフィナンシャルG	4,240,300	565.10	2,396,193,530		
りそなホールディングス	676,000	477.00	322,452,000		
三井住友トラストHD	121,100	4,016.00	486,337,600		
三井住友フィナンシャルG	434,100	3,786.00	1,643,502,600		
千葉銀行	211,900	565.00	119,723,500	貸付株式数	10,300株
群馬銀行	123,300	359.00	44,264,700		
武蔵野銀行	9,200	1,895.00	17,434,000		
千葉興業銀行	17,100	306.00	5,232,600	貸付株式数	6,800株
筑波銀行	25,900	186.00	4,817,400	貸付株式数	6,600株
七十七銀行	19,300	1,667.00	32,173,100		
青森銀行	4,800	2,709.00	13,003,200	貸付株式数	1,900株
秋田銀行	4,000	2,123.00	8,492,000	貸付株式数	1,400株
山形銀行	6,900	1,510.00	10,419,000	貸付株式数	100株
岩手銀行	4,300	2,550.00	10,965,000	貸付株式数	800株
東邦銀行	55,300	262.00	14,488,600	貸付株式数	21,400株
東北銀行	3,200	1,060.00	3,392,000	貸付株式数	900株
みちのく銀行	4,000	1,652.00	6,608,000	貸付株式数	1,100株
ふくおかフィナンシャルG	54,300	2,123.00	115,278,900		
静岡銀行	152,500	835.00	127,337,500	貸付株式数	12,700株
十六銀行	8,300	2,339.00	19,413,700	貸付株式数	1,000株
スルガ銀行	60,500	442.00	26,741,000	貸付株式数	23,700株 (7,000株)

八十二銀行	148,800	440.00	65,472,000	貸付株式数	6,300株
山梨中央銀行	7,500	1,078.00	8,085,000	貸付株式数	2,600株
大垣共立銀行	13,000	2,413.00	31,369,000	貸付株式数	3,900株
福井銀行	5,300	1,499.00	7,944,700	貸付株式数	800株
北國銀行	6,400	2,575.00	16,480,000		
清水銀行	2,600	1,904.00	4,950,400	貸付株式数	900株 (300株)
富山銀行	1,200	2,429.00	2,914,800	貸付株式数	200株
滋賀銀行	12,400	2,493.00	30,913,200		
南都銀行	9,600	2,491.00	23,913,600		
百五銀行	55,600	353.00	19,626,800	貸付株式数	1,700株
京都銀行	22,100	4,340.00	95,914,000		
紀陽銀行	21,800	1,606.00	35,010,800	貸付株式数	9,000株
ほくほくフィナンシャルG	41,100	1,050.00	43,155,000	貸付株式数	16,900株
広島銀行	91,000	546.00	49,686,000		
山陰合同銀行	36,600	665.00	24,339,000		
中国銀行	53,100	1,005.00	53,365,500	貸付株式数	20,400株
鳥取銀行	2,100	1,452.00	3,049,200		
伊予銀行	81,600	569.00	46,430,400		
百十四銀行	6,600	2,204.00	14,546,400	貸付株式数	600株
四国銀行	8,800	1,012.00	8,905,600	貸付株式数	1,800株
阿波銀行	9,400	2,364.00	22,221,600	貸付株式数	3,700株
大分銀行	3,800	3,020.00	11,476,000		
宮崎銀行	4,100	2,496.00	10,233,600	貸付株式数	100株
佐賀銀行	3,800	1,554.00	5,905,200	貸付株式数	1,400株
沖縄銀行	5,600	3,420.00	19,152,000	貸付株式数	2,200株
琉球銀行	14,200	1,147.00	16,287,400	貸付株式数	3,500株
セブン銀行	205,900	298.00	61,358,200	貸付株式数	80,100株
みずほフィナンシャルG	8,369,900	168.50	1,410,328,150		
高知銀行	2,300	801.00	1,842,300		
山口フィナンシャルG	76,800	765.00	58,752,000	貸付株式数	30,200株
芙蓉総合リース	7,000	6,750.00	47,250,000		
興銀リース	11,600	2,905.00	33,698,000		
東京センチュリー	12,400	5,180.00	64,232,000	貸付株式数	4,500株
SBIホールディングス	73,400	2,499.00	183,426,600	貸付株式数	300株
日本証券金融	27,200	521.00	14,171,200	貸付株式数	9,500株
アイフル	94,300	242.00	22,820,600	貸付株式数	38,500株
日本アジア投資	5,200	303.00	1,575,600	貸付株式数	1,400株
長野銀行	2,000	1,674.00	3,348,000	貸付株式数	800株
名古屋銀行	5,000	3,160.00	15,800,000	貸付株式数	600株



北洋銀行	93,200	231.00	21,529,200		
愛知銀行	2,200	3,670.00	8,074,000	貸付株式数	600株
中京銀行	2,500	2,260.00	5,650,000	貸付株式数	600株
大光銀行	2,100	1,704.00	3,578,400		
愛媛銀行	8,600	1,130.00	9,718,000	貸付株式数	2,200株
トマト銀行	2,400	1,089.00	2,613,600		
京葉銀行	26,100	646.00	16,860,600	貸付株式数	5,500株
栃木銀行	32,300	194.00	6,266,200	貸付株式数	9,700株
北日本銀行	1,900	1,840.00	3,496,000	貸付株式数	700株
東和銀行	10,900	827.00	9,014,300		
福島銀行	5,400	225.00	1,215,000	貸付株式数	2,200株
大東銀行	3,000	590.00	1,770,000	貸付株式数	500株
リコーリース	4,800	3,655.00	17,544,000	貸付株式数	1,400株
イオンフィナンシャルサー ビス	39,400	1,693.00	66,704,200	貸付株式数	16,000株
アコム	124,100	416.00	51,625,600	貸付株式数	1,100株
ジャックス	6,800	2,306.00	15,680,800		
オリコ	167,300	140.00	23,422,000	貸付株式数	27,600株
日立キャピタル	14,500	2,320.00	33,640,000		
アプラスフィナンシャル	29,800	71.00	2,115,800	貸付株式数	800株
オリックス	410,800	1,733.00	711,916,400		
三菱UFJリース	138,900	651.00	90,423,900		
ジャフコ	10,100	4,110.00	41,511,000	貸付株式数	4,100株
九州リースサービス	3,000	605.00	1,815,000		
トモニホールディングス	47,500	348.00	16,530,000	貸付株式数	4,600株
大和証券G本社	494,300	508.50	251,351,550		
野村ホールディングス	1,084,000	474.70	514,574,800		
岡三証券グループ	52,600	385.00	20,251,000	貸付株式数	20,200株
丸三証券	18,400	528.00	9,715,200	貸付株式数	6,500株
東洋証券	22,400	183.00	4,099,200	貸付株式数	8,900株
東海東京HD	71,000	320.00	22,720,000	貸付株式数	21,300株
光世証券	1,500	608.00	912,000	貸付株式数	600株
水戸証券	18,000	213.00	3,834,000	貸付株式数	7,200株
いちよし証券	12,300	703.00	8,646,900	貸付株式数	4,500株
松井証券	30,200	943.00	28,478,600		
SOMPOホールディング ス	108,600	4,639.00	503,795,400		
だいこう証券ビジ	2,500	551.00	1,377,500	貸付株式数	600株
日本取引所グループ	166,400	1,815.00	302,016,000		
マネックスG	56,900	330.00	18,777,000		

極東証券	8,300	914.00	7,586,200	
岩井コスモホールディング	6,200	1,152.00	7,142,400	
藍澤証券	11,000	749.00	8,239,000	
フィデアホール	60,400	118.00	7,127,200	
池田泉州HD	65,900	197.00	12,982,300	貸付株式数 5,800株
アニコムホールディングス	5,100	4,055.00	20,680,500	貸付株式数 2,000株
MS&AD	161,000	3,600.00	579,600,000	
SONY FH	50,600	2,388.00	120,832,800	貸付株式数 20,400株
マネーパートナーズGP	7,300	271.00	1,978,300	
スパークス・グループ	24,400	251.00	6,124,400	
小林洋行	1,900	246.00	467,400	貸付株式数 700株
第一生命HLDGS	348,600	1,628.00	567,520,800	貸付株式数 137,000株
東京海上HD	220,300	5,899.00	1,299,549,700	
アドバンテッジリスクマネ	2,300	783.00	1,800,900	貸付株式数 900株
イー・ギャランティ	5,800	1,325.00	7,685,000	貸付株式数 2,300株
アサックス	2,600	609.00	1,583,400	貸付株式数 1,000株
NECキャピタルソリューション	2,500	2,198.00	5,495,000	
T&Dホールディングス	190,600	1,152.50	219,666,500	
アドバンスクリエイト	1,400	1,968.00	2,755,200	貸付株式数 500株
三井不動産	326,800	2,740.50	895,595,400	
三菱地所	431,600	2,086.00	900,317,600	
平和不動産	11,300	2,470.00	27,911,000	
東京建物	67,400	1,495.00	100,763,000	貸付株式数 27,700株
ダイビル	18,200	1,138.00	20,711,600	
京阪神ビルディング	10,800	1,286.00	13,888,800	貸付株式数 1,000株
住友不動産	138,500	4,140.00	573,390,000	貸付株式数 15,700株
太平洋興発	2,400	777.00	1,864,800	貸付株式数 900株
テーオーシー	14,100	855.00	12,055,500	貸付株式数 4,800株
東京楽天地	900	5,770.00	5,193,000	
スターツコーポレーション	8,300	2,608.00	21,646,400	
フジ住宅	7,900	702.00	5,545,800	貸付株式数 1,300株
空港施設	7,200	543.00	3,909,600	
明和地所	3,400	546.00	1,856,400	貸付株式数 1,200株
ゴールドクレスト	4,800	2,256.00	10,828,800	貸付株式数 2,000株
リログループ	32,600	2,573.00	83,879,800	貸付株式数 13,400株
日本エスリード	2,300	1,663.00	3,824,900	貸付株式数 100株
日神不動産	8,900	448.00	3,987,200	貸付株式数 3,600株
日本エスコン	11,100	791.00	8,780,100	貸付株式数 4,600株

タカラレーベン	28,200	416.00	11,731,200		
サンヨーハウジ 名古屋	3,500	884.00	3,094,000	貸付株式数	1,300株
イオンモール	30,900	1,764.00	54,507,600	貸付株式数	12,700株
毎日コムネット	1,300	757.00	984,100		
ファースト住建	2,600	1,332.00	3,463,200	貸付株式数	1,000株
ランド	255,500	8.00	2,044,000	貸付株式数	31,800株
カチタス	6,900	4,485.00	30,946,500	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
東祥	3,700	2,335.00	8,639,500	貸付株式数	1,400株
トーセイ	8,500	1,299.00	11,041,500	貸付株式数	3,500株
穴吹興産	700	2,821.00	1,974,700		
サンフロンティア不動産	8,500	1,252.00	10,642,000	貸付株式数	500株
インテリックス	1,800	728.00	1,310,400		
ランドビジネス	2,600	770.00	2,002,000	貸付株式数	500株
日本社宅サービス	1,600	1,100.00	1,760,000		
グランディハウス	5,400	451.00	2,435,400		
東武鉄道	65,900	3,550.00	233,945,000	貸付株式数	7,700株
相鉄ホールディングス	21,500	2,962.00	63,683,000	貸付株式数	8,800株
東急	169,700	2,088.00	354,333,600		
京浜急行	85,600	2,154.00	184,382,400		
小田急電鉄	100,100	2,610.00	261,261,000		
京王電鉄	34,900	6,940.00	242,206,000	貸付株式数	4,800株
京成電鉄	46,800	4,370.00	204,516,000	貸付株式数	8,000株
富士急行	8,500	4,800.00	40,800,000	貸付株式数	3,500株 (900株)
新京成電鉄	1,600	2,130.00	3,408,000	貸付株式数	600株
東日本旅客鉄道	109,900	10,550.00	1,159,445,000		
西日本旅客鉄道	55,600	9,439.00	524,808,400		
東海旅客鉄道	55,900	22,500.00	1,257,750,000		
西武ホールディングス	77,400	1,914.00	148,143,600	貸付株式数	10,900株
鴻池運輸	9,900	1,693.00	16,760,700	貸付株式数	2,700株
西日本鉄道	17,400	2,475.00	43,065,000	貸付株式数	7,000株
ハマキョウレックス	4,800	3,680.00	17,664,000		
サカイ引越センター	3,300	6,360.00	20,988,000		
近鉄グループHLDGS	59,200	5,790.00	342,768,000	貸付株式数	24,400株
阪急阪神HLDGS	78,900	4,260.00	336,114,000	貸付株式数	12,800株
南海電鉄	26,500	2,917.00	77,300,500	貸付株式数	10,800株
京阪ホールディングス	26,300	4,860.00	127,818,000	貸付株式数	10,100株
神戸電鉄	1,500	4,045.00	6,067,500	貸付株式数	600株
名古屋鉄道	48,600	3,340.00	162,324,000	貸付株式数	19,900株

山陽電鉄	4,600	2,325.00	10,695,000	貸付株式数	1,800株
トランコム	1,700	6,180.00	10,506,000	貸付株式数	600株
日本通運	22,800	5,790.00	132,012,000	貸付株式数	700株
ヤマトホールディングス	103,800	1,899.00	197,116,200		
山 九	16,400	5,560.00	91,184,000	貸付株式数	6,300株
日 新	5,100	1,584.00	8,078,400	貸付株式数	1,600株
丸 運	3,200	260.00	832,000	貸付株式数	200株
丸全昭和運輸	4,800	3,215.00	15,432,000	貸付株式数	600株
センコーグループHLDGS	32,600	855.00	27,873,000	貸付株式数	1,100株
トナミホールディングス	1,400	5,230.00	7,322,000	貸付株式数	400株
ニッコンホールディングス	22,400	2,564.00	57,433,600	貸付株式数	2,800株
日石輸送	700	2,869.00	2,008,300	貸付株式数	100株
福山通運	7,600	3,965.00	30,134,000	貸付株式数	2,500株
セイノーホールディングス	44,300	1,413.00	62,595,900	貸付株式数	1,500株
エスライン	1,800	862.00	1,551,600	貸付株式数	700株
神奈川中央交通	1,500	3,945.00	5,917,500	貸付株式数	600株
日立物流	13,000	3,265.00	42,445,000	貸付株式数	1,000株
丸和運輸機関	3,100	5,340.00	16,554,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
C & F ロジホールディングス	6,000	1,261.00	7,566,000		
日本郵船	49,500	1,866.00	92,367,000		
商船三井	35,100	2,908.00	102,070,800		
川崎汽船	18,300	1,321.00	24,174,300	貸付株式数	7,500株 (100株)
N S ユナイテッド海運	3,300	2,304.00	7,603,200	貸付株式数	500株
明治海運	6,300	312.00	1,965,600		
飯野海運	28,100	349.00	9,806,900		
共栄タンカー	500	1,387.00	693,500		
九州旅客鉄道	49,600	3,385.00	167,896,000		
S G ホールディングス	55,900	2,751.00	153,780,900		
日本航空	108,200	3,407.00	368,637,400		
A N A ホールディングス	108,000	3,731.00	402,948,000		
パスコ	1,100	901.00	991,100		
西本W I S M E T T A C H D	1,100	3,555.00	3,910,500		
ヤマシタヘルスケアHLDGS	500	1,255.00	627,500		

GENKY DRUG STORES	3,000	2,281.00	6,843,000	貸付株式数 (800株)	1,200株
国際紙パルプ商事	14,400	314.00	4,521,600		
総合メディカルHD	5,400	1,790.00	9,666,000	貸付株式数	1,300株
ブックオフGHD	3,200	1,244.00	3,980,800	貸付株式数	1,200株
三菱倉庫	20,500	2,747.00	56,313,500	貸付株式数	8,400株
三井倉庫HOLD	7,300	1,708.00	12,468,400		
住友倉庫	21,700	1,455.00	31,573,500	貸付株式数	8,100株
渋沢倉庫	3,200	1,973.00	6,313,600	貸付株式数	1,200株
ヤマタネ	3,100	1,390.00	4,309,000	貸付株式数	1,000株
東陽倉庫	10,700	334.00	3,573,800	貸付株式数	3,600株
乾汽船	5,300	1,104.00	5,851,200	貸付株式数	2,100株
日本トランスシティ	13,000	499.00	6,487,000		
ケイヒン	1,100	1,250.00	1,375,000		
中央倉庫	3,600	1,099.00	3,956,400	貸付株式数	100株
川西倉庫	1,200	1,092.00	1,310,400	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,800	948.00	4,550,400		
ファイズ	1,100	723.00	795,300	貸付株式数	400株
東洋埠頭	1,800	1,368.00	2,462,400		
宇徳	5,000	499.00	2,495,000	貸付株式数	1,000株
上組	36,400	2,526.00	91,946,400		
サンリツ	1,400	650.00	910,000	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,600	1,040.00	1,664,000	貸付株式数	600株
キューソー流通システム	1,500	1,901.00	2,851,500	貸付株式数 (300株)	400株
近鉄エクスプレス	11,200	1,543.00	17,281,600	貸付株式数	4,500株
東海運	3,400	286.00	972,400	貸付株式数	1,300株
エーアイティー	3,800	984.00	3,739,200		
内外トランスライン	2,100	1,333.00	2,799,300		
ショーエイコーポ	500	760.00	380,000	貸付株式数	200株
日本コンセプト	1,900	1,294.00	2,458,600	貸付株式数	700株
東京放送HD	40,700	1,799.00	73,219,300	貸付株式数	3,000株
日本テレビHLD S	56,300	1,435.00	80,790,500		
朝日放送グループHD	6,000	740.00	4,440,000	貸付株式数	2,400株
テレビ朝日HD	16,900	1,783.00	30,132,700	貸付株式数 (300株)	6,900株
スカパーJ S A T H D	40,500	445.00	18,022,500		
テレビ東京HD	5,000	2,261.00	11,305,000	貸付株式数	1,900株
日本BS放送	2,000	1,075.00	2,150,000	貸付株式数 (700株)	800株

ビジョン	1,900	4,850.00	9,215,000		
スマートバリュー	1,800	714.00	1,285,200	貸付株式数	700株
USEN-NEXT HL DGS	2,300	812.00	1,867,600	貸付株式数	900株
ワイヤレスゲート	2,700	657.00	1,773,900	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,400	1,423.00	6,261,200		
日本通信	53,800	205.00	11,029,000	貸付株式数	22,900株 (1,000株)
クロップス	1,100	609.00	669,900		
日本電信電話	419,200	5,271.00	2,209,603,200		
KDDI	502,400	2,867.00	1,440,380,800		
ソフトバンク	649,900	1,530.00	994,347,000	貸付株式数	162,900株
光通信	7,200	24,430.00	175,896,000	貸付株式数	2,800株
NTTドコモ	388,000	2,789.00	1,082,132,000		
エムティーアイ	6,000	734.00	4,404,000	貸付株式数	2,400株
GMOインターネット	24,200	1,819.00	44,019,800		
ファイバーゲート	1,200	1,458.00	1,749,600		
アйдママーケティングコ ミュ	1,300	560.00	728,000		
KADOKAWA	17,900	1,552.00	27,780,800		
学研ホールディングス	2,100	5,500.00	11,550,000	貸付株式数	800株
ゼンリン	12,300	1,888.00	23,222,400	貸付株式数	4,500株
昭文社	2,700	392.00	1,058,400		
インプレスホールディング ス	4,900	144.00	705,600	貸付株式数	1,900株
東京電力HD	498,400	551.00	274,618,400	貸付株式数	206,200株
中部電力	191,000	1,657.00	316,487,000	貸付株式数	73,900株
関西電力	254,800	1,389.00	353,917,200	貸付株式数	45,800株
中国電力	86,300	1,436.00	123,926,800	貸付株式数	35,500株
北陸電力	61,400	745.00	45,743,000	貸付株式数	16,800株
東北電力	146,400	1,124.00	164,553,600		
四国電力	56,300	1,090.00	61,367,000	貸付株式数	1,100株
九州電力	128,800	1,104.00	142,195,200		
北海道電力	58,500	582.00	34,047,000		
沖縄電力	11,600	1,755.00	20,358,000		
電源開発	49,700	2,629.00	130,661,300		
エフオン	3,000	721.00	2,163,000	貸付株式数	1,200株
イーレックス	10,900	1,113.00	12,131,700	貸付株式数	4,400株
レノバ	10,300	897.00	9,239,100	貸付株式数	4,200株 (200株)

東京瓦斯	120,100	2,827.50	339,582,750	
大阪瓦斯	121,100	2,083.00	252,251,300	
東邦瓦斯	31,000	4,315.00	133,765,000	貸付株式数 11,900株
北海道瓦斯	3,300	1,560.00	5,148,000	貸付株式数 100株
広島ガス	12,800	342.00	4,377,600	貸付株式数 900株
西部瓦斯	7,000	2,440.00	17,080,000	貸付株式数 2,100株
静岡ガス	17,700	932.00	16,496,400	貸付株式数 7,300株
メタウォーター	3,000	3,750.00	11,250,000	貸付株式数 1,000株
アイネット	3,500	1,382.00	4,837,000	貸付株式数 1,400株
松竹	4,100	13,550.00	55,555,000	貸付株式数 1,500株
東宝	40,300	4,705.00	189,611,500	貸付株式数 16,600株
エイチ・アイ・エス	9,300	2,769.00	25,751,700	貸付株式数 4,100株 (3,200株)
東映	2,600	15,310.00	39,806,000	貸付株式数 1,000株
ラックランド	1,200	2,328.00	2,793,600	貸付株式数 400株
NTTデータ	163,200	1,424.00	232,396,800	
共立メンテナンス	9,100	4,480.00	40,768,000	貸付株式数 3,600株 (1,300株)
イチネンホールディングス	6,200	1,132.00	7,018,400	貸付株式数 1,600株
建設技術研究所	4,100	1,656.00	6,789,600	
スペース	3,900	1,255.00	4,894,500	貸付株式数 1,500株
長大	2,200	1,013.00	2,228,600	
アインホールディングス	8,300	6,210.00	51,543,000	貸付株式数 3,400株
燦ホールディングス	1,300	2,188.00	2,844,400	
ピー・シー・エー	800	3,845.00	3,076,000	貸付株式数 300株
スバル興業	400	6,900.00	2,760,000	
東京テアトル	2,400	1,397.00	3,352,800	貸付株式数 900株
タナベ経営	1,200	1,279.00	1,534,800	貸付株式数 400株
ビジネスB太田昭和	1,100	2,535.00	2,788,500	
ナガワ	1,700	5,660.00	9,622,000	貸付株式数 400株
よみうりランド	1,300	4,710.00	6,123,000	貸付株式数 500株
東京都競馬	3,900	3,365.00	13,123,500	貸付株式数 1,600株
常磐興産	2,400	1,742.00	4,180,800	貸付株式数 900株
カナモト	9,800	2,695.00	26,411,000	貸付株式数 4,000株
東京ドーム	22,400	1,029.00	23,049,600	貸付株式数 9,100株 (300株)
DTS	13,700	2,303.00	31,551,100	
スクウェア・エニックス・HD	28,500	4,595.00	130,957,500	
シーイーシー	6,600	2,075.00	13,695,000	貸付株式数 2,400株

カプコン	26,300	2,783.00	73,192,900		
西尾レントオール	6,100	2,899.00	17,683,900		
アイ・エス・ビー	1,200	1,478.00	1,773,600		
アゴーラ・ホスピタリ ティーG	34,800	34.00	1,183,200	貸付株式数	8,000株 (800株)
日本空港ビルデング	19,700	4,630.00	91,211,000	貸付株式数	8,000株
トランス・コスモス	6,600	2,623.00	17,311,800	貸付株式数	700株
乃村工藝社	27,900	1,373.00	38,306,700	貸付株式数	10,700株
ジャステック	3,600	1,146.00	4,125,600	貸付株式数	1,200株
S C S K	16,200	5,240.00	84,888,000		
藤田観光	2,600	2,909.00	7,563,400	貸付株式数	900株 (900株)
KNT - CTホールディン グス	3,200	1,474.00	4,716,800	貸付株式数	1,200株
日本管財	6,400	1,919.00	12,281,600	貸付株式数	2,600株
トーカイ	5,800	2,402.00	13,931,600		
白 洋 舎	700	2,821.00	1,974,700	貸付株式数	200株
セコム	63,300	9,761.00	617,871,300		
日本システムウエア	2,000	2,484.00	4,968,000		
セントラル警備保障	2,900	5,500.00	15,950,000	貸付株式数	1,100株
アイネス	7,800	1,138.00	8,876,400	貸付株式数	2,600株
丹青社	11,300	1,286.00	14,531,800	貸付株式数	1,400株
メイテック	7,400	5,320.00	39,368,000	貸付株式数	1,700株
T K C	5,200	4,680.00	24,336,000	貸付株式数	1,900株
富士ソフト	7,900	4,640.00	36,656,000	貸付株式数	1,000株
応用地質	6,400	1,154.00	7,385,600	貸付株式数	2,600株
船井総研ホールディン	12,300	2,438.00	29,987,400	貸付株式数	5,100株
N S D	10,100	3,160.00	31,916,000	貸付株式数	1,900株
進学会ホールディングス	2,700	508.00	1,371,600	貸付株式数	700株
丸紅建材リース	600	1,720.00	1,032,000	貸付株式数	200株
オ オ バ	4,700	622.00	2,923,400		
コナミホールディングス	25,000	5,020.00	125,500,000	貸付株式数	800株
いであ	1,100	1,207.00	1,327,700	貸付株式数	400株
学 究 社	2,000	1,251.00	2,502,000		
ベネッセホールディングス	21,900	2,824.00	61,845,600	貸付株式数	3,900株
イオンディライト	7,400	3,565.00	26,381,000	貸付株式数	3,000株
ナック	3,800	979.00	3,720,200	貸付株式数	1,500株
福井コンピュータH L D S	2,000	2,403.00	4,806,000		
ニチイ学館	8,500	1,763.00	14,985,500		
ダイセキ	10,000	2,768.00	27,680,000	貸付株式数	4,100株



ステップ	2,200	1,424.00	3,132,800	貸付株式数	800株
日鉄物産	4,400	4,345.00	19,118,000		
泉州電業	1,900	2,759.00	5,242,100	貸付株式数	700株
元気寿司	1,700	2,904.00	4,936,800	貸付株式数	700株
トラスコ中山	12,800	2,540.00	32,512,000	貸付株式数	5,200株
ヤマダ電機	187,600	522.00	97,927,200	貸付株式数	77,300株
オートバックスセブン	24,500	1,831.00	44,859,500	貸付株式数	10,100株
モリト	4,500	797.00	3,586,500		
アークランドサカモト	10,400	1,294.00	13,457,600	貸付株式数	4,300株
ニトリホールディングス	26,600	15,935.00	423,871,000	貸付株式数	11,000株
グルメ杵屋	4,400	1,202.00	5,288,800	貸付株式数	1,800株 (1,700株)
愛眼	5,000	252.00	1,260,000	貸付株式数	1,500株
ケーユーホールディングス	3,100	869.00	2,693,900	貸付株式数	1,000株
吉野家ホールディングス	21,500	2,249.00	48,353,500	貸付株式数	8,800株 (400株)
加藤産業	9,600	3,405.00	32,688,000		
北恵	1,200	967.00	1,160,400	貸付株式数	400株 (400株)
イノテック	3,700	884.00	3,270,800		
イエローハット	11,600	1,643.00	19,058,800	貸付株式数	4,700株
松屋フーズHLDGS	3,000	3,915.00	11,745,000	貸付株式数	800株
JBCホールディングス	4,800	1,562.00	7,497,600		
JKホールディングス	5,600	513.00	2,872,800	貸付株式数	1,000株
サガミホールディングス	8,300	1,394.00	11,570,200	貸付株式数	3,400株
日伝	5,100	2,084.00	10,628,400	貸付株式数	2,100株
関西スーパーマーケット	4,600	1,134.00	5,216,400		
ミロク情報サービス	6,100	2,990.00	18,239,000	貸付株式数	2,400株 (100株)
北沢産業	4,600	263.00	1,209,800	貸付株式数	1,500株
杉本商事	3,300	2,089.00	6,893,700	貸付株式数	1,200株
因幡電機産業	8,700	4,910.00	42,717,000	貸付株式数	3,000株
王将フードサービス	4,500	7,170.00	32,265,000	貸付株式数	1,800株
プレナス	6,900	1,815.00	12,523,500	貸付株式数	2,800株 (2,500株)
ミニストップ	4,600	1,421.00	6,536,600	貸付株式数	1,800株
アークス	11,500	2,280.00	26,220,000	貸付株式数	4,700株
パローホールディングス	13,300	1,875.00	24,937,500		
東テク	2,000	2,068.00	4,136,000		

ミスミグループ本社	77,100	2,576.00	198,609,600	貸付株式数 26,500株 (26,500株)
藤 久	500	743.00	371,500	貸付株式数 100株
アルテック	4,500	205.00	922,500	
ベルク	3,000	5,300.00	15,900,000	貸付株式数 1,200株
大 庄	3,300	1,611.00	5,316,300	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
タキヒヨー	1,900	1,801.00	3,421,900	貸付株式数 100株
ファーストリテイリング	8,200	65,220.00	534,804,000	貸付株式数 3,400株
ソフトバンクグループ	486,300	4,616.00	2,244,760,800	
蔵王産業	1,000	1,418.00	1,418,000	
スズケン	28,000	5,960.00	166,880,000	貸付株式数 4,000株
サンドラッグ	23,200	3,430.00	79,576,000	
サックスパーホールディング グ	5,200	914.00	4,752,800	
ジェコス	4,200	883.00	3,708,600	
ヤマザワ	1,300	1,643.00	2,135,900	貸付株式数 100株
やまや	1,000	2,325.00	2,325,000	貸付株式数 400株
グローセル	5,600	430.00	2,408,000	貸付株式数 600株
ベルーナ	15,100	721.00	10,887,100	貸付株式数 6,100株
合計			144,383,908,290	

(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。

ソ ニ ー	20,000株	トヨタ自動車	40,000株
三菱UFJフィナンシャルG	200,000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9月20日から2020年3月19日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## ダイワ・ノーロード TOPIXファンド

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

当中間計算期間末 2020年3月19日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	820,255
親投資信託受益証券	150,561,031
未収入金	2,160,000
流動資産合計	153,541,286
<b>資産合計</b>	<b>153,541,286</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	2,523,774
未払受託者報酬	26,474
未払委託者報酬	415,347
その他未払費用	4,328
流動負債合計	2,969,923
<b>負債合計</b>	<b>2,969,923</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1,149,072,102
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,499,261
( 分配準備積立金 )	797,046
元本等合計	150,571,363
<b>純資産合計</b>	<b>150,571,363</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>153,541,286</b>

## (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9月20日 至 2020年3月19日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	32,002,372
<b>営業収益合計</b>	<b>32,002,372</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	129
受託者報酬	26,474
委託者報酬	415,347
その他費用	4,328
<b>営業費用合計</b>	<b>446,278</b>
営業損失（ ）	32,448,650
経常損失（ ）	32,448,650
中間純損失（ ）	32,448,650
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（ ）	4,063,805
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	34,351,599
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>28,961,260</b>
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	28,961,260
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>25,301,143</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	25,301,143
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	<b>1,499,261</b>

## (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 2019年9月20日 至 2020年3月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2020年3月19日現在
1. 1 期首元本額	132,379,082円
期中追加設定元本額	109,296,959円
期中一部解約元本額	92,603,939円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	149,072,102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 2019年9月20日 至 2020年3月19日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2020年3月19日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

## (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2020年3月19日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2020年3月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0101円 (10,101円)

## (参考)

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

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

## 「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年3月19日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,919,938,267
株式	121,842,345,997
派生商品評価勘定	50,214,950
未収入金	8,482,500
未収配当金	240,802,656
未収利息	791,907

前払金		56,432,600
その他未収収益	5	38,594,118
差入委託証拠金		45,120,000
流動資産合計		141,202,722,995
資産合計		141,202,722,995
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		48,341,850
未払金		3,019,299,470
未払解約金		171,881,280
受入担保金		14,507,661,997
流動負債合計		17,747,184,597
負債合計		17,747,184,597
純資産の部		
元本等		
元本	1	147,529,997,151
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	24,074,458,753
元本等合計		123,455,538,398
純資産合計		123,455,538,398
負債純資産合計		141,202,722,995

## 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9月20日 至 2020年3月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年3月19日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	2019年9月20日 139,218,477,453円 24,207,048,892円 15,895,529,194円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックス ファンド	3,514,096,739円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	7,207,472,200円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2	2,683,341円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	55,869,990円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	823,813,318円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	40,071,662円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,176,451,005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)	90,918,016円

D - I ' s T O P I Xイン デックス	55,618,566円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	17,543,887円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	15,128,780円
i F r e e T O P I Xイン デックス	1,593,715,530円
i F r e e 8資産バランス	2,515,561,834円
i F r e e 年金バランス	84,508,112円
D Cダイワ日本株式インデッ クス	64,734,237,124円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,246,323,411円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,766,538,921円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,128,157,727円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,841,404,842円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	16,737,194円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	59,487,471円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	33,371,390円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	528,246,166円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	12,589,501円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	7,156,942円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	9,650,103円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	164,825,308円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	171,203,604円
ダイワ・バランスファンド3 5 V A	9,862,168,782円

	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)		860,874,593円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)		133,763,222円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)		232,949,234円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド		179,924,751円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス		10,987,128,730円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)		9,456,664,047円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス		2,617,170,878円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPPIX		1,333,971,435円
	ダイワライフスタイル25		213,052,452円
	ダイワライフスタイル50		736,969,407円
	ダイワライフスタイル75		565,810,402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)		12,436,166,534円
	計		147,529,997,151円
2.	期末日における受益権の総数		147,529,997,151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24,074,458,753円であります。	
4.	3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。	
		株式	14,316,646,330円
5.	4 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。	
		株式	451,080,000円

6. 5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分37,415,328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	2020年3月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	2020年3月19日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	2,296,899,000	-	2,298,870,000	1,971,000
合計	2,296,899,000	-	2,298,870,000	1,971,000

## (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)

	2020年3月19日現在
1口当たり純資産額	0.8368円
(1万口当たり純資産額)	(8,368円)

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2020年3月31日

資産総額	174,858,544円
負債総額	811,816円
純資産総額（ - ）	174,046,728円
発行済数量	155,794,626口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.1172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

2020年3月31日

資産総額	151,585,434,519円
負債総額	14,042,971,629円
純資産総額（ - ）	137,542,462,890円
発行済数量	148,580,785,482口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9257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、）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約請求の受付け、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

2020年3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. 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。

##### ハ. 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。

##### ニ. 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

・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。

2020年3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	54	87,678
追加型株式投資信託	694	14,373,314
株式投資信託 合計	748	14,460,993
単位型公社債投資信託	27	100,159
追加型公社債投資信託	14	1,421,970
公社債投資信託 合計	41	1,522,128
総合計	789	15,983,121

### 3 【委託会社等の経理状況】

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

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

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期事業年度（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。

また、第61期事業年度に係る中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

#### (1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
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
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	1
建物	213	206
器具備品	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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495

資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145

賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725
福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374
役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	41,112

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

注記事項



## （重要な会計方針）

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### （1）子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

#### （2）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### （1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

#### （2）無形固定資産

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

### 3．引当金の計上基準

#### （1）賞与引当金

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

#### （2）退職給付引当金

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

#### （3）役員退職慰労引当金

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

### 4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

### 5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## （会計方針の変更）

### （税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用）

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

### （未適用の会計基準等）

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

## （1）概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

## （2）適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

## （3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## （表示方法の変更）

### （『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

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

### （損益計算書）

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円
器具備品	235百万円	264百万円

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度(2018年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2019年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017年 6月27日

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

2018年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月26日

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018年 6月26日

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

2019年6月21日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## （２）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

## （３）金融商品に係るリスク管理体制

### 市場リスクの管理

#### （ ）為替変動リスクの管理

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

#### （ ）価格変動リスクの管理

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

### 信用リスクの管理

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

## ２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金		28,709	28,709	-
（２）未収委託者報酬		12,368	12,368	-
（３）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券		7,631	7,631	-
資産計		48,709	48,709	-
（１）未払手数料		(5,202)	(5,202)	-
（２）その他未払金		(4,476)	(4,476)	-
（３）未払費用(*2)		(3,286)	(3,286)	-
負債計		(12,965)	(12,965)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		28,489	28,489	-
(2) 未収委託者報酬		11,468	11,468	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券		8,380	8,380	-
資産計		48,338	48,338	-
(1) 未払手数料		(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金		(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)		(2,805)	(2,805)	-
負債計		(11,298)	(11,298)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

#### 資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

#### 負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

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

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

## （注3）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 其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 其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．其他有価証券

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

### 3. 確定拠出制度

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

### (税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別内訳

(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、記載を省略していません。

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、記載を省略していません。

（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、記載を省略していません。

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。

## 中間財務諸表

### (1)中間貸借対照表

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (2019年9月30日)	
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		19,529
有価証券		724
未収委託者報酬		11,175
その他		383
流動資産合計		31,812
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	211
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		2,380
その他		403
無形固定資産合計		2,784
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		7,928
関係会社株式		2,664
繰延税金資産		1,205
その他		1,280
投資その他の資産合計		13,078
固定資産合計		16,073
資産合計		47,886

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2019年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	6,021
未払費用	3,486
未払法人税等	754
賞与引当金	506
その他	2 474
流動負債合計	11,243
固定負債	
退職給付引当金	2,483
役員退職慰労引当金	128
その他	7
固定負債合計	2,619
負債合計	13,862
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,968
利益剰余金合計	7,343
株主資本合計	34,013
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	10
評価・換算差額等合計	10
純資産合計	34,023
負債・純資産合計	47,886

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			35,076
その他営業収益			309
営業収益合計			35,385
営業費用			
支払手数料			15,895
その他営業費用			6,272
営業費用合計			22,167
一般管理費	1		5,954
営業利益			7,263
営業外収益	2		968
営業外費用	3		148
経常利益			8,083
特別利益			-
特別損失			-
税引前中間純利益			8,083
法人税、住民税及び事業税			2,313
法人税等調整額			15
中間純利益			5,785

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当中間期変動額						



剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868
中間純利益	-	-	-	5,785	5,785	5,785
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	6,083	6,083	6,083
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,968	7,343	34,013

	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	46	46	40,142
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
中間純利益	-	-	5,785
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	35	35	35
当中間期変動額合計	35	35	6,118
当中間期末残高	10	10	34,023

## 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）子会社及び関連会社株式

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

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

### (2) 無形固定資産

定額法によっております。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、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

### (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (中間貸借対照表関係)

### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2019年9月30日現在)
有形固定資産	310百万円

### 2 消費税等の取扱い

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

## 3 保証債務

当中間会計期間（2019年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,639百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

## 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）
有形固定資産	14百万円
無形固定資産	472百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）
受取配当金	901百万円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）
有価証券償還損	71百万円
為替差損	68百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

## 2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 （百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日

2019年6月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年 3月31日	2019年 6月24日
----------------------	------	--------	-------	----------------	----------------

(金融商品関係)

当中間会計期間(2019年9月30日)

#### 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金・預金	19,529	19,529	-
(2)未収委託者報酬	11,175	11,175	-
(3)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,986	7,986	-
資産合計	38,691	38,691	-
(1)未払金	(5,965)	(5,965)	-
(2)未払費用(*2)	(2,867)	(2,867)	-
負債合計	(8,833)	(8,833)	-

(\*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・預金及び(2)未収委託者報酬

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

(3)有価証券及び投資有価証券

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

#### 負 債

(1)未払金及び(2)未払費用

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,836
関連会社株式	827
差入保証金	1,068

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（2019年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,836百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 827百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	66	55	11
（2）その他			
証券投資信託	3,971	3,628	343
小計	4,038	3,683	354
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,947	4,292	344
小計	3,947	4,292	344
合計	7,986	7,975	10

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

[ 関連情報 ]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,043.35円
1株当たり中間純利益	2,217.93円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,785
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,785
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2020年2月17日付で、Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.への出資を行い、当該会社を子会社といたしました。

2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 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
大和証券株式会社	100,000	(注)

(注) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 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。

## &lt;再信託受託会社の概要&gt;

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。

\*再信託受託会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

### 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みます。）を掲載することがあります。

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

## 独立監査人の監査報告書

2019年5月24日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小倉 加奈子	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2019年10月18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」に掲げられているダイワ・ノーロードTOPIXファンドの2018年9月20日から2019年9月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ・ノーロードTOPIXファンドの2019年9月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2019年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2020年4月17日

大和アセットマネジメント株式会社

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	深井 康治	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林 英之	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ノーロードTOPIXファンドの2019年9月20日から2020年3月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ・ノーロードTOPIXファンドの2020年3月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年9月20日から2020年3月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

大和アセットマネジメント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。