

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2021年2月19日提出
【計算期間】	第19計算期間 (自 2019年12月3日 至 2020年11月30日)
【ファンド名】	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)
【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
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

##### (注1) 商品分類の定義

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

##### (注2) 属性区分の定義

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## &lt; 信託金の限度額 &gt;

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

## &lt; ファンドの特色 &gt;

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

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

## 運用プロセス



ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<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に運用を行なっています。

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

## ■ 東証株価指数（TOPIX）について

株式市場の動向を表わす指標には、東証株価指数、日経平均株価、日経株価指数300等があります。このうち、東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所の第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日から東京証券取引所が算出・公表しています（注1参照）。

新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します（注2参照）。

（注1）TOPIXの算出方法：

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

（注2）基準時の時価総額の修正方法：

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

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

## ファンドの仕組み

## ●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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



## 2

当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合に限り購入できます。

## 3

毎年11月30日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行いません。収益分配金は、自動的に再投資されます。

## 〈分配方針〉

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

## ●基準価額の動きに関する留意点

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2001年9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す。</p> <p>受益権の募集の取扱い</p> <p>一部解約請求に関する事務</p> <p>収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務</p> <p style="text-align: right;">など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金( 3)	
委託会社	大和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</p> <p>信託財産の運用指図</p> <p>信託財産の計算</p> <p>運用報告書の作成</p> <p style="text-align: right;">など</p>
運用指図 2	損益 信託金( 3)	
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</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株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分</p> <p>信託財産の計算</p> <p style="text-align: right;">など</p>
	損益 投資	
投資対象	<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</p> <p>(ファミリーファンド方式で運用を行ないます。)</p>	

(注) 収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

## &lt; 委託会社等の概況（2020年11月末日現在） &gt;

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

## ・ 沿革

- 1959年12月12日 大和証券投資信託委託株式会社として設立
- 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)
- 2020年 4月 1日 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

## ・ 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】

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ます。

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

## (2) 【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産



#### イ．為替手形

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

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

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

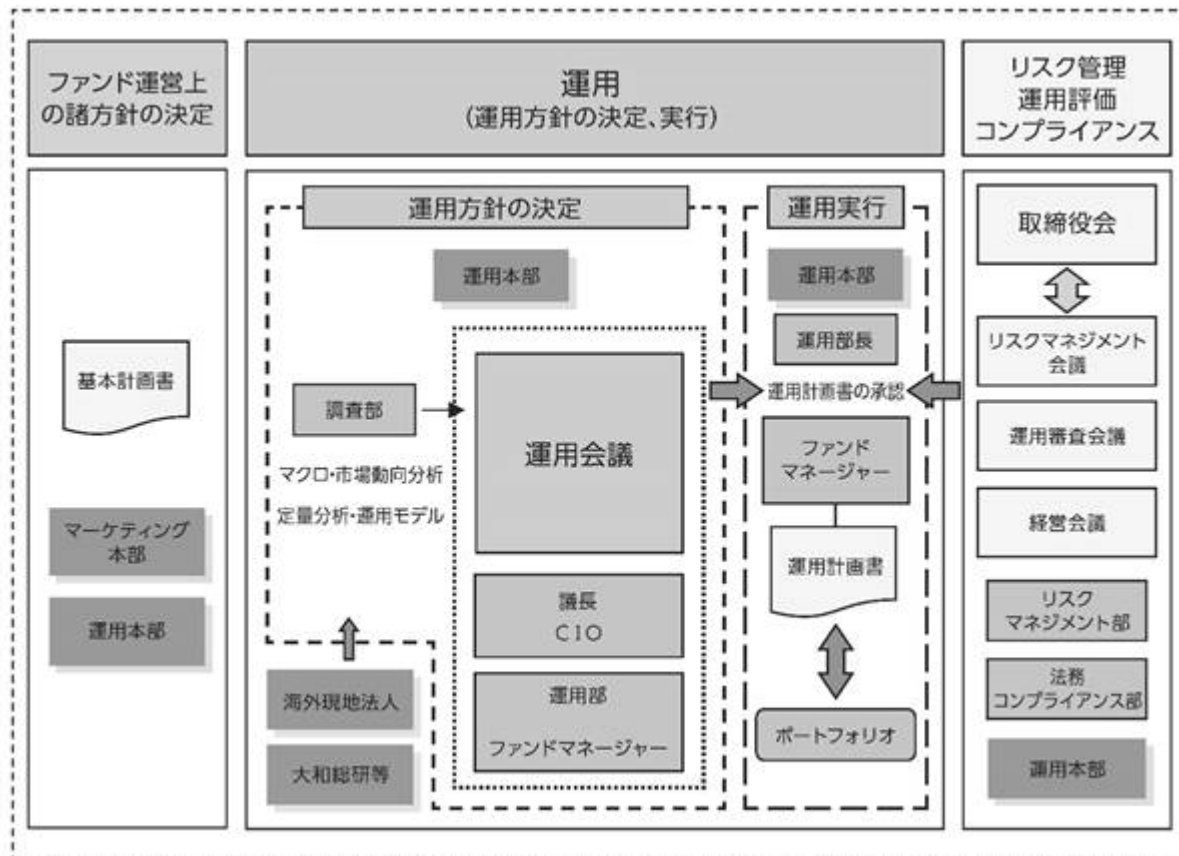
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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

#### (3) 【運用体制】

##### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品担当役員の決裁により決定します。

#### 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) (3名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定
- ・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決定します。

## ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

## ヘ．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経営会議

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．経営会議

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11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

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

原則として、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、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

## (5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式以外の資産（信託約款）

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

先物取引等（信託約款）

委託会社は、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または

金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

#### デリバティブ取引等（信託約款）

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

#### 外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への投資は、行ないません。

#### 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、

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

### <参考> トピックス・インデックス・マザーファンドの概要

#### (1) 投資方針

わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。

#### 主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

#### 投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

## (2) 投資対象

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

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

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

## (3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

## 3 【投資リスク】

### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

## (2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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

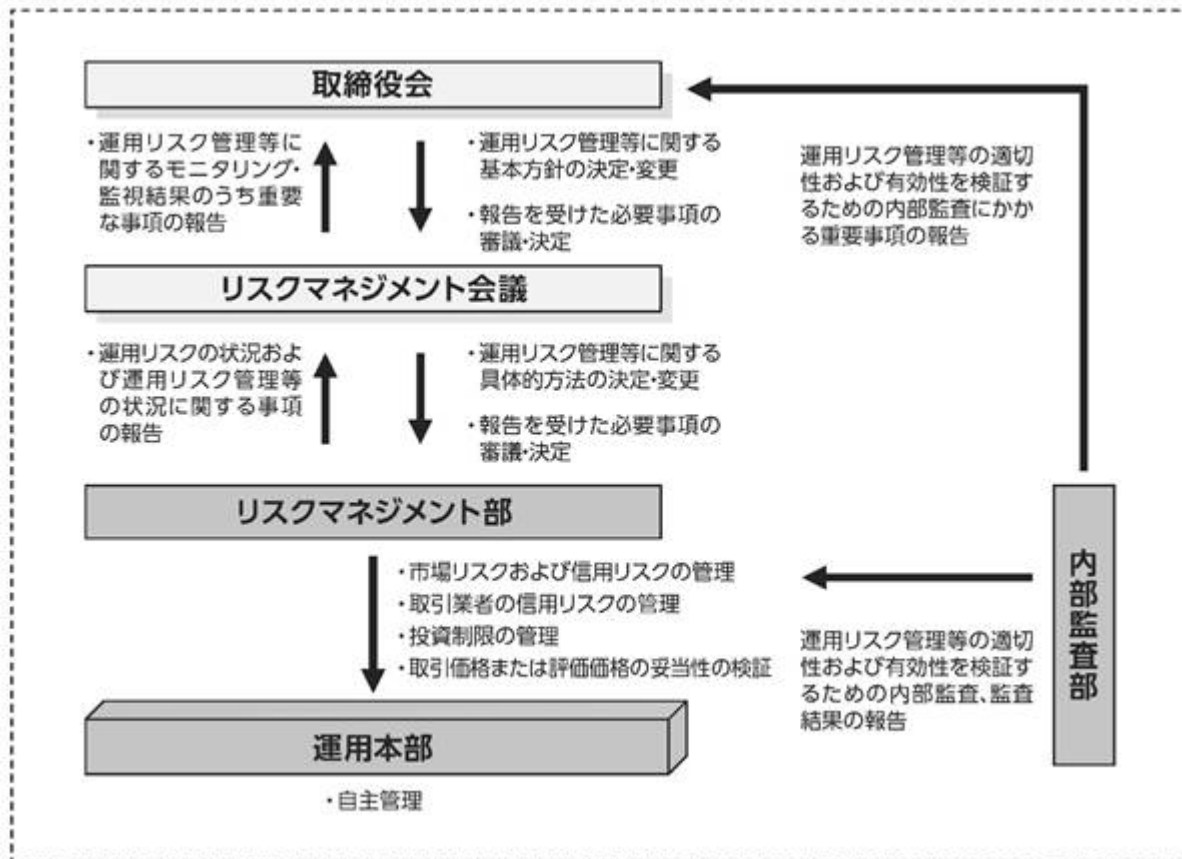
## (3) その他の留意点

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

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。

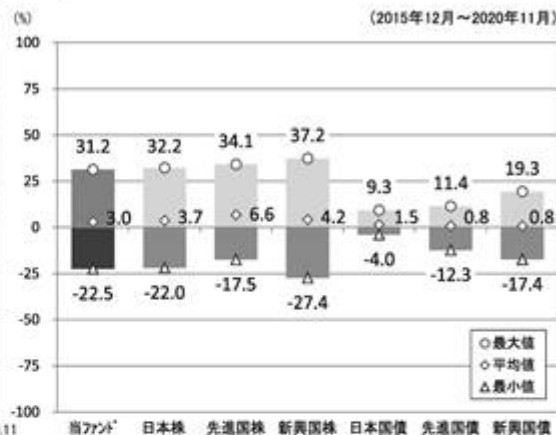
## 参 考 情 報

- 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】



取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

・お電話によるお問い合わせ先（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）

申込手数料には、消費税等が課されます。

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.682%（税抜0.62%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.20% （税抜）	年率0.36% （税抜）	年率0.06% （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および受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

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

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

#### <マザーファンドより支弁する手数料等>

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

( ) 上記は、2020年11月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（2020年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	13,355,153,448	99.99
内 日本	13,355,153,448	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	957,162	0.01
純資産総額	13,356,110,610	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11月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	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	11,416,612,625	1.1119 12,694,781,661	1.1698 13,355,153,448	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10計算期間末 (2011年11月30日)	5,919,531,340	5,919,531,340	0.7543	0.7543
第11計算期間末 (2012年11月30日)	7,019,281,868	7,019,281,868	0.8236	0.8236
第12計算期間末 (2013年12月2日)	11,532,134,047	11,532,134,047	1.3432	1.3432
第13計算期間末 (2014年12月1日)	13,209,101,022	13,209,101,022	1.5364	1.5364
第14計算期間末 (2015年11月30日)	14,903,022,444	14,903,022,444	1.7298	1.7298
第15計算期間末 (2016年11月30日)	14,335,781,385	14,335,781,385	1.6320	1.6320
第16計算期間末 (2017年11月30日)	15,763,147,825	15,763,147,825	2.0187	2.0187
第17計算期間末 (2018年11月30日)	14,378,262,347	14,378,262,347	1.9048	1.9048
2019年11月末日	14,095,574,362	-	1.9775	-
第18計算期間末 (2019年12月2日)	14,219,446,692	14,219,446,692	1.9951	1.9951
12月末日	14,110,585,028	-	2.0050	-
2020年1月末日	13,758,787,594	-	1.9611	-
2月末日	12,212,883,107	-	1.7585	-
3月末日	11,482,014,320	-	1.6527	-
4月末日	11,915,749,353	-	1.7231	-
5月末日	12,604,120,937	-	1.8393	-
6月末日	12,379,705,842	-	1.8354	-
7月末日	11,766,741,128	-	1.7606	-
8月末日	12,609,618,586	-	1.9034	-
9月末日	12,692,395,368	-	1.9267	-
10月末日	12,303,005,711	-	1.8712	-
第19計算期間末 (2020年11月30日)	13,356,110,610	13,356,110,610	2.0789	2.0789

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第10計算期間	14.0
第11計算期間	9.2
第12計算期間	63.1
第13計算期間	14.4
第14計算期間	12.6
第15計算期間	5.7
第16計算期間	23.7
第17計算期間	5.6
第18計算期間	4.7
第19計算期間	4.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第10計算期間	1,350,927,310	744,388,007
第11計算期間	1,485,330,319	810,683,314
第12計算期間	1,867,964,651	1,804,984,163
第13計算期間	1,458,008,546	1,445,882,020
第14計算期間	1,669,675,408	1,651,599,737
第15計算期間	1,265,478,289	1,096,610,893
第16計算期間	752,893,653	1,728,834,334
第17計算期間	738,624,486	998,659,252
第18計算期間	537,570,960	958,865,619

第19計算期間	515,260,387	1,217,776,163
---------	-------------	---------------

(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11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	163,479,342,460	97.93
内 日本	163,479,342,460	97.93
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,462,285,829	2.07
純資産総額	166,941,628,289	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2,966,795,000	1.78
内 日本	2,966,795,000	1.78

(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11月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	750,500	7,080.84 5,314,174,414	6,999.00 5,252,749,500	3.15
2 ソニー	日本	株式	電気機 器	421,400	8,203.43 3,456,927,230	9,704.00 4,089,265,600	2.45
3 ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	523,900	6,376.09 3,340,435,557	7,272.00 3,809,800,800	2.28
4 キーエンス	日本	株式	電気機 器	61,000	46,315.30 2,825,233,832	53,290.00 3,250,690,000	1.95

5	任天堂	日本	株式	その他 製品	41,300	60,420.00 2,495,346,000	59,260.00 2,447,438,000	1.47
6	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	882,200	2,239.53 1,975,714,899	2,465.00 2,174,623,000	1.30
7	日本電産	日本	株式	電気機 器	161,900	9,689.20 1,568,683,079	13,305.00 2,154,079,500	1.29
8	第一三共	日本	株式	医薬品	577,500	3,252.89 1,878,547,261	3,694.00 2,133,285,000	1.28
9	武田薬品	日本	株式	医薬品	559,600	3,922.25 2,194,893,094	3,745.00 2,095,702,000	1.26
10	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,537,800	439.86 1,996,035,250	448.50 2,035,203,300	1.22
11	ダイキン工業	日本	株式	機械	85,700	19,520.36 1,672,895,265	23,665.00 2,028,090,500	1.21
12	リクルートホールディン グス	日本	株式	サービ ス業	460,500	4,290.04 1,975,564,189	4,400.00 2,026,200,000	1.21
13	信越化学	日本	株式	化学	113,100	14,000.88 1,583,500,194	17,135.00 1,937,968,500	1.16
14	HOYA	日本	株式	精密機 器	133,500	11,696.59 1,561,495,798	13,910.00 1,856,985,000	1.11
15	村田製作所	日本	株式	電気機 器	197,600	6,817.94 1,347,226,796	9,129.00 1,803,890,400	1.08
16	ファナック	日本	株式	電気機 器	63,300	20,421.25 1,292,665,620	25,365.00 1,605,604,500	0.96
17	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	529,500	2,539.58 1,344,709,736	2,871.50 1,520,459,250	0.91
18	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	42,700	26,920.00 1,149,484,000	35,470.00 1,514,569,000	0.91
19	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	481,200	2,754.57 1,325,500,066	2,982.50 1,435,179,000	0.86
20	SMC	日本	株式	機械	21,100	58,116.84 1,226,265,371	66,320.00 1,399,352,000	0.84
21	三井住友フィナンシャ ルG	日本	株式	銀行業	458,800	3,073.80 1,410,261,280	3,032.00 1,391,081,600	0.83
22	エムスリー	日本	株式	サービ ス業	142,000	6,550.39 930,155,437	9,622.00 1,366,324,000	0.82
23	日立	日本	株式	電気機 器	323,100	3,688.92 1,191,892,559	3,966.00 1,281,414,600	0.77
24	伊藤忠	日本	株式	卸売業	463,600	2,760.86 1,279,938,232	2,758.50 1,278,840,600	0.77

25	花王	日本	株式	化学	161,000	8,201.46 1,320,435,800	7,808.00 1,257,088,000	0.75
26	東京海上HD	日本	株式	保険業	234,600	4,853.03 1,138,521,297	5,190.00 1,217,574,000	0.73
27	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	68,400	15,129.97 1,034,890,522	17,765.00 1,215,126,000	0.73
28	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	901,100	1,385.83 1,248,773,124	1,327.50 1,196,210,250	0.72
29	中外製薬	日本	株式	医薬品	210,400	4,803.13 1,010,578,806	5,044.00 1,061,257,600	0.64
30	三菱商事	日本	株式	卸売業	434,600	2,621.32 1,139,229,889	2,433.00 1,057,381,800	0.63

(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	97.93%
合計	97.93%

(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	0.08%
鉱業	0.14%
建設業	2.32%
食料品	3.49%
繊維製品	0.46%
パルプ・紙	0.20%
化学	7.47%
医薬品	5.97%
石油・石炭製品	0.35%
ゴム製品	0.53%
ガラス・土石製品	0.78%
鉄鋼	0.60%
非鉄金属	0.65%
金属製品	0.61%
機械	5.66%
電気機器	16.67%
輸送用機器	6.88%



精密機器	2.75%
その他製品	2.66%
電気・ガス業	1.30%
陸運業	3.45%
海運業	0.17%
空運業	0.35%
倉庫・運輸関連業	0.17%
情報・通信業	8.93%
卸売業	4.37%
小売業	4.74%
銀行業	4.47%
証券、商品先物取引業	0.76%
保険業	1.90%
その他金融業	1.09%
不動産業	1.99%
サービス業	5.98%
合計	97.93%

(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12月	買建	169	2,904,334,750	2,966,795,000	1.78%

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

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

#### (参考情報) 運用実績

## ●DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)

2020年11月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	20,789円
純資産総額	133億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	11.1%
3カ月間	9.2%
6カ月間	13.0%
1年間	5.1%
3年間	3.0%
5年間	20.2%
設定来	114.6%



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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円												設定来分配金合計額: 400円
	第8期 09年11月	第9期 10年11月	第10期 11年11月	第11期 12年11月	第12期 13年12月	第13期 14年12月	第14期 15年11月	第15期 16年11月	第16期 17年11月	第17期 18年11月	第18期 19年12月	第19期 20年11月	
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	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

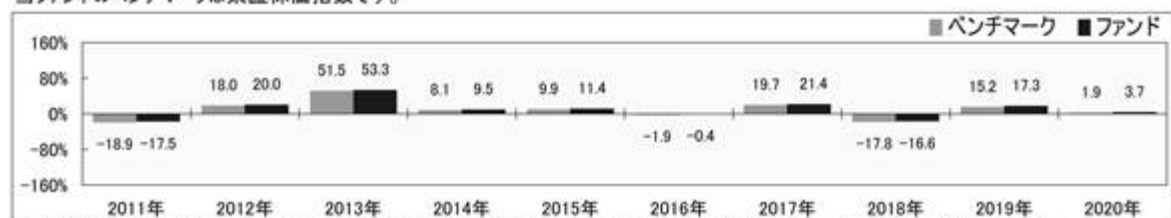
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	2,143	97.9%	電気機器	16.7%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.1%
国内株式先物	1	1.8%	情報・通信業	8.9%	ソニー	電気機器	2.4%
不動産投資信託等	-	-	化学	7.5%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.3%
コール・ローン、その他	-	2.1%	輸送用機器	6.9%	キーエンス	電気機器	1.9%
合計	2,144	-	サービス業	6.0%	TOPIX先物 O212月	-	1.8%
株式市場・上場別構成			医薬品	6.0%	任天堂	その他製品	1.5%
一部(東証・名証)		97.9%	機械	5.7%	日本電信電話	情報・通信業	1.3%
二部(東証・名証)		-	小売業	4.7%	日本電産	電気機器	1.3%
新興市場他		-	銀行業	4.5%	第一三共	医薬品	1.3%
その他		-	その他	31.2%	武田薬品	医薬品	1.3%
合計		97.9%	合計	97.9%	合計		18.2%

※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。  
 ・2020年は11月30日までの騰落率を表しています。  
 ・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

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

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

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

### 2 【換金(解約)手続等】

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

#### <一部解約>

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

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

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

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

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

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する

委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

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

#### 運用報告書

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

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金にかかる請求権

受益者は、収益分配金(分配金額は、委託会社が決定します。)を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### 償還金にかかる請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第19期計算期間(2019年12月3日から2020年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けておりません。



## 1【財務諸表】

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）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 2019年12月2日現在	第19期 2020年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	49,077,052	51,242,037
親投資信託受益証券	14,218,437,076	13,355,153,448
未収入金	2,000,000	37,800,000
流動資産合計	14,269,514,128	13,444,195,485
資産合計	14,269,514,128	13,444,195,485
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,317,641	45,109,825
未払受託者報酬	4,391,520	4,125,570
未払委託者報酬	40,988,029	38,505,773
その他未払費用	370,246	343,707
流動負債合計	50,067,436	88,084,875
負債合計	50,067,436	88,084,875
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 7,127,114,392	1 6,424,598,616
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,092,332,300	6,931,511,994
（分配準備積立金）	4,344,344,677	4,222,651,338
元本等合計	14,219,446,692	13,356,110,610
純資産合計	14,219,446,692	13,356,110,610
負債純資産合計	14,269,514,128	13,444,195,485

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第18期		第19期	
	自	2018年12月1日 至 2019年12月2日	自	2019年12月3日 至 2020年11月30日
<b>営業収益</b>				
受取利息		47		83
有価証券売買等損益		710,236,994		571,616,372
営業収益合計		710,237,041		571,616,455
<b>営業費用</b>				
支払利息		15,475		10,343
受託者報酬		8,748,490		8,334,384
委託者報酬		81,653,617		77,788,411
その他費用		733,987		694,736
営業費用合計		91,151,569		86,827,874
<b>営業利益</b>		619,085,472		484,788,581
経常利益		619,085,472		484,788,581
<b>当期純利益</b>		619,085,472		484,788,581
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		68,886,554		137,825,010
期首剰余金又は期首欠損金( )		6,829,853,296		7,092,332,300
剰余金増加額又は欠損金減少額		438,086,806		418,339,935
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		438,086,806		418,339,935
剰余金減少額又は欠損金増加額		863,579,828		1,201,773,832
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		863,579,828		1,201,773,832
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		7,092,332,300		6,931,511,994

## (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19期	
	自 2019年12月3日	至 2020年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第18期	第19期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首元本額	7,548,409,051円	7,127,114,392円
期中追加設定元本額	537,570,960円	515,260,387円
期中一部解約元本額	958,865,619円	1,217,776,163円
2. 計算期間末日における受益権の総数	7,127,114,392口	6,424,598,616口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第18期	第19期
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

<p>1 分配金の計算過程</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,777,569,310円)及び分配準備積立金(4,344,344,677円)より分配対象額は10,121,913,987円(1万口当たり14,201.98円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(591,084,241円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,492,634,361円)及び分配準備積立金(3,631,567,097円)より分配対象額は9,715,285,699円(1万口当たり15,122.01円)であり、分配を行っておりません。</p>
-------------------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第19期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第19期
	2020年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第18期	第19期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	761,249,339	660,371,787
合計	761,249,339	660,371,787

## （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18期	第19期
2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第19期
自 2019年12月3日
至 2020年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第18期	第19期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9951円 (19,951円)	2.0789円 (20,789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	11,416,612,625	13,355,153,448	
親投資信託受益証券 合計			13,355,153,448	
合計			13,355,153,448	

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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		15,866,424,459	12,212,008,294
株式	2 3	162,602,439,840	163,479,342,460
派生商品評価勘定		76,885,750	89,140,900
未収入金		44,835,510	-
未収配当金		717,704,956	1,010,955,223
未収利息		1,374,718	814,653
その他未収収益	4	32,184,457	33,720,594
差入委託証拠金		39,360,000	-
流動資産合計		179,381,209,690	176,825,982,124
資産合計		179,381,209,690	176,825,982,124
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	23,231,250
前受金		86,417,200	102,752,600
未払金		1,370,527,390	-
未払解約金		123,739,000	189,585,900
受入担保金		13,103,577,689	9,568,784,085
その他未払費用		10,575	-
流動負債合計		14,684,271,854	9,884,353,835
負債合計		14,684,271,854	9,884,353,835
純資産の部			
元本等			
元本	1	147,704,616,967	142,709,508,970
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		16,992,320,869	24,232,119,319
元本等合計		164,696,937,836	166,941,628,289
純資産合計		164,696,937,836	166,941,628,289
負債純資産合計		179,381,209,690	176,825,982,124

## 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12月3日 至 2020年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	134,890,694,102円	147,704,616,967円
期中追加設定元本額	33,001,020,844円	28,551,522,466円
期中一部解約元本額	20,187,097,979円	33,546,630,463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	3,765,431,907円	3,193,110,083円
ファンド		



ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	7,517,011,572円	6,674,458,363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	5,764,295円	930,834円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	59,609,321円	32,952,471円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	777,014,581円	668,546,231円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	46,976,403円	35,731,278円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,145,153,691円	908,394,726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)	46,927,453円	126,217,518円
D-I's TOPIXイン デックス	50,758,188円	38,327,788円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	16,362,055円	10,549,517円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	7,650,621円	23,213,652円
iFree TOPIXイン デックス	1,290,732,581円	2,041,017,760円
iFree 8資産バランス	1,996,082,570円	2,619,294,575円
iFree 年金バランス	64,246,554円	125,857,474円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,235,675,867円	64,944,239,094円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,856,480,263円	2,972,314,135円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,215,288,075円	3,751,798,888円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,971,577,942円	3,333,100,735円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,856,558,312円	5,191,048,366円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	13,563,401円	11,676,676円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	55,375,861円	46,996,347円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	24,888,377円	34,721,962円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	266,294,654円	817,787,252円
ダイワつみたてインデックス バランス30	431,467円	10,918,252円
ダイワつみたてインデックス バランス50	315,899円	7,976,371円
ダイワつみたてインデックス バランス70	2,320,710円	11,268,546円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	150,205,619円	141,666,674円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	158,266,050円	149,563,586円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	8,647,121,514円	7,748,159,579円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	730,190,060円	659,469,668円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	124,454,938円	99,902,437円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	216,391,069円	178,714,272円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	152,878,769円	149,232,217円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,075,963,979円	10,242,225,102円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	13,126,419,796円	9,426,768,765円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,555,624,273円	2,261,893,318円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,351,353,152円	1,247,128,871円
ダイワライフスタイル25	182,799,162円	180,844,569円
ダイワライフスタイル50	662,351,711円	655,627,347円
ダイワライフスタイル75	530,142,751円	519,251,046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)	12,751,961,504円	11,416,612,625円
計		147,704,616,967円	142,709,508,970円
2.	期末日における受益権の総数	147,704,616,967口	142,709,508,970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 12,524,034,910円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 9,033,368,760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 565,900,000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 740,845,000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29,453,875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32,214,780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 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>
--------------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	8,993,918,872	9,890,799,472
合計	8,993,918,872	9,890,799,472

（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（2019年9月20日から2019年12月2日まで、及び2020年9月24日から2020年11月30日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

	2019年12月2日 現在	2020年11月30日 現在

種類	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	2,308,972,800	-	2,385,935,000	76,962,200	2,900,792,400	-	2,966,795,000	66,002,600
合計	2,308,972,800	-	2,385,935,000	76,962,200	2,900,792,400	-	2,966,795,000	66,002,600

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1150円	1.1698円
(1万口当たり純資産額)	(11,150円)	(11,698円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,300	2,795.00	9,223,500	
日本水産	91,600	401.00	36,731,600	
マルハニチロ	13,300	2,124.00	28,249,200	
ハウスイ	500	965.00	482,500	
カネコ種苗	2,800	1,543.00	4,320,400	
サカタのタネ	11,000	3,365.00	37,015,000	
ホクト	7,100	2,060.00	14,626,000	貸付株式数 2,800株
ホクリヨウ	1,600	693.00	1,108,800	
ヒノキヤグループ	2,300	2,175.00	5,002,500	

ショーボンドHD	14,300	5,200.00	74,360,000	
ミライト・ホールディングス	27,100	1,565.00	42,411,500	
タマホーム	5,000	1,439.00	7,195,000	貸付株式数 1,900株
サンヨーホームズ	500	697.00	348,500	貸付株式数 300株
日本アクア	3,800	635.00	2,413,000	貸付株式数 1,400株
ファーストコーポレーション	3,000	695.00	2,085,000	貸付株式数 600株 (600株)
ベステラ	1,600	1,533.00	2,452,800	貸付株式数 600株
キャンディル	1,400	508.00	711,200	
スペースバリューHD	11,100	611.00	6,782,100	
住石ホールディングス	18,400	117.00	2,152,800	
日鉄鉱業	2,100	5,290.00	11,109,000	
三井松島HLDGS	3,400	738.00	2,509,200	
国際石油開発帝石	336,200	584.00	196,340,800	
石油資源開発	12,100	1,758.00	21,271,800	貸付株式数 500株
K&Oエナジーグループ	4,500	1,460.00	6,570,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,800	682.00	1,227,600	
第一カッター興業	1,100	2,218.00	2,439,800	
明豊ファシリティワークス	2,700	621.00	1,676,700	
安藤・間	54,700	688.00	37,633,600	
東急建設	27,100	469.00	12,709,900	
コムシスホールディングス	32,500	3,090.00	100,425,000	
ピーアールホールディングス	9,900	710.00	7,029,000	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
高松コンストラクションGP	5,600	2,037.00	11,407,200	貸付株式数 2,100株
東建コーポレーション	2,800	8,090.00	22,652,000	貸付株式数 600株
ソネック	900	866.00	779,400	
ヤマウラ	4,000	906.00	3,624,000	貸付株式数 1,500株
大成建設	70,300	3,690.00	259,407,000	
大林組	210,600	920.00	193,752,000	
清水建設	213,700	793.00	169,464,100	
飛鳥建設	5,900	1,077.00	6,354,300	貸付株式数 1,900株
長谷工コーポレーション	81,600	1,129.00	92,126,400	
松井建設	8,300	733.00	6,083,900	
銭高組	900	4,595.00	4,135,500	
鹿島建設	165,400	1,373.00	227,094,200	
不動テトラ	5,500	1,678.00	9,229,000	

大末建設	2,300	893.00	2,053,900	
鉄建建設	4,600	1,803.00	8,293,800	
西松建設	16,400	1,940.00	31,816,000	貸付株式数 6,500株
三井住友建設	51,400	429.00	22,050,600	貸付株式数 1,000株
大豊建設	4,800	3,470.00	16,656,000	貸付株式数 1,900株
前田建設	52,700	818.00	43,108,600	
佐田建設	4,500	447.00	2,011,500	貸付株式数 800株
ナカノフドー建設	5,700	409.00	2,331,300	貸付株式数 1,300株
奥村組	9,900	2,441.00	24,165,900	
東鉄工業	9,000	2,800.00	25,200,000	
イチケン	1,500	1,755.00	2,632,500	
富士ピー・エス	3,000	606.00	1,818,000	貸付株式数 1,000株
浅沼組	2,400	3,975.00	9,540,000	
戸田建設	87,500	613.00	53,637,500	貸付株式数 35,000株
熊谷組	9,800	2,362.00	23,147,600	
北野建設	1,300	2,725.00	3,542,500	貸付株式数 400株
植木組	900	2,745.00	2,470,500	貸付株式数 300株
矢作建設	9,300	902.00	8,388,600	
ピーエス三菱	7,000	568.00	3,976,000	貸付株式数 2,700株
日本ハウスHLDGS	14,200	238.00	3,379,600	貸付株式数 1,400株
大東建託	23,000	10,240.00	235,520,000	
新日本建設	8,900	850.00	7,565,000	
NIPPO	17,400	2,727.00	47,449,800	
東亜道路	1,300	3,695.00	4,803,500	
前田道路	18,700	1,677.00	31,359,900	
日本道路	2,000	7,390.00	14,780,000	
東亜建設	6,700	1,990.00	13,333,000	貸付株式数 2,600株
日本国土開発	20,700	545.00	11,281,500	貸付株式数 8,200株
若築建設	3,700	1,151.00	4,258,700	
東洋建設	23,900	397.00	9,488,300	
五洋建設	83,800	777.00	65,112,600	貸付株式数 15,600株
世紀東急	10,200	807.00	8,231,400	
福田組	2,500	5,290.00	13,225,000	貸付株式数 900株
日本ドライケミカル	1,700	1,547.00	2,629,900	貸付株式数 600株
住友林業	53,500	1,901.00	101,703,500	
日本基礎技術	7,300	492.00	3,591,600	貸付株式数 800株
巴コーポレーション	9,200	424.00	3,900,800	
大和ハウス	208,700	3,200.00	667,840,000	
ライト工業	12,200	1,675.00	20,435,000	
積水ハウス	228,600	1,878.00	429,310,800	

日特建設	5,500	801.00	4,405,500	
北陸電気工事	3,700	1,195.00	4,421,500	
ユアテック	11,700	665.00	7,780,500	貸付株式数 1,200株
日本リーテック	4,500	2,489.00	11,200,500	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
四電工	1,100	2,587.00	2,845,700	
中電工	8,200	2,132.00	17,482,400	
関電工	29,800	798.00	23,780,400	
きんでん	50,000	1,673.00	83,650,000	
東京エネシス	7,000	890.00	6,230,000	貸付株式数 1,300株
トーエネック	2,000	3,710.00	7,420,000	
住友電設	5,900	2,594.00	15,304,600	貸付株式数 500株
日本電設工業	11,500	2,157.00	24,805,500	
協和エクシオ	32,000	2,687.00	85,984,000	
新日本空調	5,600	2,239.00	12,538,400	貸付株式数 2,200株
日本工営	4,400	2,835.00	12,474,000	
九電工	14,800	2,985.00	44,178,000	貸付株式数 800株
三機工業	15,200	1,149.00	17,464,800	
日揮ホールディングス	64,900	935.00	60,681,500	貸付株式数 4,100株
中外炉工業	2,300	1,612.00	3,707,600	
ヤマト	6,800	741.00	5,038,800	
太平電業	5,100	2,411.00	12,296,100	貸付株式数 100株
高砂熱学	16,200	1,433.00	23,214,600	
三晃金属	800	2,632.00	2,105,600	
NEC ネットズエスアイ	18,900	1,837.00	34,719,300	貸付株式数 7,500株
朝日工業社	1,400	3,220.00	4,508,000	
明星工業	13,600	777.00	10,567,200	
大気社	10,200	2,777.00	28,325,400	貸付株式数 1,900株
ダイダン	5,000	2,782.00	13,910,000	貸付株式数 100株
日比谷総合設備	6,900	1,833.00	12,647,700	貸付株式数 100株
日本製粉	20,000	1,627.00	32,540,000	貸付株式数 7,900株
日清製粉G本社	76,400	1,697.00	129,650,800	
日東富士製粉	500	6,550.00	3,275,000	
昭和産業	6,300	3,160.00	19,908,000	
鳥越製粉	6,000	1,051.00	6,306,000	貸付株式数 2,400株
中部飼料	8,400	1,397.00	11,734,800	
フィード・ワン	9,100	885.00	8,053,500	
東洋精糖	1,200	1,211.00	1,453,200	
日本甜菜糖	3,500	1,596.00	5,586,000	
三井製糖	6,000	1,789.00	10,734,000	貸付株式数 2,200株



塩水港精糖	6,900	224.00	1,545,600	貸付株式数	2,100株
日新製糖	3,100	1,850.00	5,735,000	貸付株式数	700株
L I F U L L	22,600	391.00	8,836,600		
ミクシィ	12,400	2,851.00	35,352,400		
ジェイエイシーリクルート メント	4,300	1,854.00	7,972,200	貸付株式数	1,700株
日本M & Aセンター	49,300	7,300.00	359,890,000		
メンバーズ	1,900	2,290.00	4,351,000		
中広	600	385.00	231,000	貸付株式数	200株
UTグループ	10,200	3,295.00	33,609,000	貸付株式数	4,000株 (800株)
アイティメディア	2,600	2,560.00	6,656,000	貸付株式数	1,000株
タケエイ	6,200	1,303.00	8,078,600		
E・Jホールディングス	2,400	1,034.00	2,481,600	貸付株式数	400株
ビーネックスグループ	8,100	1,140.00	9,234,000		
コシダカホールディングス	15,500	397.00	6,153,500	貸付株式数	6,100株
アルトナー	1,800	896.00	1,612,800		
パソナグループ	7,000	1,804.00	12,628,000	貸付株式数	2,500株
C D S	1,600	1,290.00	2,064,000	貸付株式数	400株
リンクアンドモチベーショ ン	12,300	558.00	6,863,400	貸付株式数	5,600株
G C A	7,800	711.00	5,545,800		
エス・エム・エス	20,100	3,785.00	76,078,500	貸付株式数	8,000株
サニーサイドアップG	2,100	653.00	1,371,300	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	64,400	1,912.00	123,132,800		
リニカル	3,200	706.00	2,259,200	貸付株式数	1,200株
クックパッド	22,400	320.00	7,168,000	貸付株式数	8,600株
エスクリ	2,000	310.00	620,000	貸付株式数	200株
アイ・ケイ・ケイ	3,100	617.00	1,912,700		
森永製菓	15,900	3,810.00	60,579,000		
中村屋	1,800	4,045.00	7,281,000		
江崎グリコ	18,700	4,345.00	81,251,500		
名糖産業	3,300	1,470.00	4,851,000	貸付株式数	1,300株
井村屋グループ	3,800	2,568.00	9,758,400		
不二家	3,800	2,364.00	8,983,200	貸付株式数	1,500株
山崎製パン	50,800	1,732.00	87,985,600	貸付株式数	19,800株
第一屋製パン	1,300	997.00	1,296,100	貸付株式数	500株
モロゾフ	1,100	6,210.00	6,831,000		
亀田製菓	3,900	4,915.00	19,168,500		
寿スピリッツ	6,500	5,340.00	34,710,000	貸付株式数	2,600株

カルビー	31,000	3,085.00	95,635,000	
森永乳業	12,600	5,070.00	63,882,000	
六甲バター	4,500	1,887.00	8,491,500	貸付株式数 400株
ヤクルト	46,500	4,975.00	231,337,500	
明治ホールディングス	44,700	7,380.00	329,886,000	
雪印メグミルク	16,300	2,237.00	36,463,100	貸付株式数 4,900株
プリマハム	10,700	2,887.00	30,890,900	
日本ハム	25,800	4,455.00	114,939,000	
林兼産業	2,300	604.00	1,389,200	
丸大食品	7,300	1,657.00	12,096,100	貸付株式数 1,500株
S Foods	5,500	3,140.00	17,270,000	
柿安本店	2,300	2,510.00	5,773,000	貸付株式数 400株 (400株)
伊藤ハム米久HLDGS	43,400	654.00	28,383,600	
学情	2,400	1,088.00	2,611,200	
スタジオアリス	3,200	1,883.00	6,025,600	貸付株式数 1,200株
クロスキャット	1,800	1,380.00	2,484,000	貸付株式数 700株
シミックホールディングス	3,300	1,371.00	4,524,300	貸付株式数 400株
エプコ	1,300	1,010.00	1,313,000	
システナ	23,700	2,150.00	50,955,000	貸付株式数 5,300株
NJS	1,400	1,951.00	2,731,400	貸付株式数 400株
デジタルアーツ	3,300	8,930.00	29,469,000	貸付株式数 1,100株
日鉄ソリューションズ	9,800	3,085.00	30,233,000	
総合警備保障	25,500	5,590.00	142,545,000	
キューブシステム	3,500	1,446.00	5,061,000	貸付株式数 1,400株
いちご	84,900	330.00	28,017,000	
エイジア	1,400	2,074.00	2,903,600	貸付株式数 300株
日本駐車場開発	66,200	127.00	8,407,400	
コア	2,800	1,395.00	3,906,000	
カカクコム	47,800	2,929.00	140,006,200	貸付株式数 19,100株
アイロムグループ	2,400	1,815.00	4,356,000	貸付株式数 900株 (100株)
セントケア・ホールディング	4,000	899.00	3,596,000	貸付株式数 1,500株
サイネックス	1,100	738.00	811,800	
ルネサンス	3,500	865.00	3,027,500	
ディップ	9,100	2,434.00	22,149,400	貸付株式数 3,600株
SBSホールディングス	5,100	2,518.00	12,841,800	
デジタルホールディングス	3,800	1,867.00	7,094,600	
新日本科学	7,100	677.00	4,806,700	貸付株式数 2,700株

ツクイホールディングス	15,200	578.00	8,785,600		
キャリアデザインセンター	1,700	987.00	1,677,900		
ベネフィット・ワン	23,500	3,370.00	79,195,000	貸付株式数	9,400株
エムスリー	142,000	9,622.00	1,366,324,000		
ツカダ・グローバルHOLD	4,000	256.00	1,024,000	貸付株式数	1,600株
プラス	700	400.00	280,000		
アウトソーシング	37,000	1,434.00	53,058,000	貸付株式数	14,800株
ウェルネット	6,600	491.00	3,240,600	貸付株式数	2,600株
ワールドホールディングス	2,300	2,034.00	4,678,200	貸付株式数	100株 (100株)
ディー・エヌ・エー	27,500	1,830.00	50,325,000		
博報堂DYHLDGS	89,200	1,510.00	134,692,000	貸付株式数	6,900株
ぐるなび	11,300	517.00	5,842,100	貸付株式数	2,000株
タカミヤ	6,700	547.00	3,664,900		
ジャパンベストレスキューS	5,000	960.00	4,800,000	貸付株式数	2,000株
ファンコミュニケーションズ	17,800	418.00	7,440,400		
ライク	2,200	2,093.00	4,604,600	貸付株式数	900株
ビジネス・ブレークスルー	3,200	421.00	1,347,200	貸付株式数	700株
エスプール	16,600	761.00	12,632,600	貸付株式数	6,600株
WDBホールディングス	3,000	2,840.00	8,520,000		
手間いらず	400	5,320.00	2,128,000	貸付株式数	100株
ティア	3,600	413.00	1,486,800		
CDG	700	1,498.00	1,048,600	貸付株式数	200株 (200株)
バリューコマース	4,100	3,480.00	14,268,000	貸付株式数	100株
インフォマート	65,200	1,071.00	69,829,200	貸付株式数	27,600株
サッポロホールディングス	23,200	1,950.00	45,240,000		
アサヒグループホールディング	147,600	4,037.00	595,861,200	貸付株式数	55,400株
麒麟HD	286,400	2,273.50	651,130,400		
宝ホールディングス	50,200	1,199.00	60,189,800	貸付株式数	3,500株
オエノンホールディングス	18,000	411.00	7,398,000		
養命酒	2,100	1,879.00	3,945,900	貸付株式数	800株
コカ・コーラボトラーズJHD	51,300	1,606.00	82,387,800		
サントリー食品インター	45,200	3,815.00	172,438,000		
ダイドーグループHD	3,500	5,580.00	19,530,000	貸付株式数	1,300株

伊藤園	20,600	8,060.00	166,036,000	貸付株式数	8,100株
キーコーヒー	6,700	2,108.00	14,123,600	貸付株式数	2,600株
ユニカフェ	1,600	1,145.00	1,832,000	貸付株式数	600株
ジャパンフーズ	900	1,251.00	1,125,900		
日清オイリオグループ	8,800	2,906.00	25,572,800		
不二製油グループ	16,600	2,796.00	46,413,600	貸付株式数	6,600株
かどや製油	800	3,880.00	3,104,000		
J - オイルミルズ	3,600	3,560.00	12,816,000		
ローソン	16,800	4,730.00	79,464,000		
サンエー	5,500	4,035.00	22,192,500	貸付株式数	400株
カワチ薬品	5,200	2,998.00	15,589,600	貸付株式数	1,600株
エービーシー・マート	10,300	5,440.00	56,032,000		
ハードオフコーポレーション	2,500	674.00	1,685,000		
高千穂交易	2,500	1,091.00	2,727,500	貸付株式数	300株
アスクル	7,000	4,175.00	29,225,000	貸付株式数	2,600株
ゲオホールディングス	11,900	1,269.00	15,101,100		
アダストリア	9,300	1,700.00	15,810,000		
ジーフット	4,400	436.00	1,918,400	貸付株式数	1,600株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	423.00	423,000	貸付株式数	300株
カワニシホールディングス	700	1,424.00	996,800		
伊藤忠食品	1,600	5,620.00	8,992,000		
くら寿司	3,700	5,650.00	20,905,000		
キャンドウ	3,200	1,842.00	5,894,400	貸付株式数	1,200株
エレマテック	6,200	958.00	5,939,600		
パルグループHLDGS	6,900	1,140.00	7,866,000		
JALUX	1,800	1,345.00	2,421,000	貸付株式数	700株
エディオン	30,400	975.00	29,640,000	貸付株式数	12,300株 (400株)
あらた	5,300	4,960.00	26,288,000		
サーラコーポレーション	13,400	564.00	7,557,600	貸付株式数	5,300株
ワッツ	2,800	818.00	2,290,400		
トーメンデバイス	1,000	3,335.00	3,335,000		
ハローズ	2,500	3,460.00	8,650,000	貸付株式数	900株
J Pホールディングス	20,200	281.00	5,676,200	貸付株式数	7,800株
フジオフードG本社	5,600	1,422.00	7,963,200	貸付株式数	2,200株
あみやき亭	1,400	2,852.00	3,992,800	貸付株式数	500株
東京エレクトロンデバイス	2,400	3,130.00	7,512,000		
ひらまつ	11,800	184.00	2,171,200	貸付株式数	300株

フィールズ	4,900	372.00	1,822,800	
双日	366,900	229.00	84,020,100	
アルフレッサホールディングス	73,600	2,090.00	153,824,000	
大黒天物産	1,600	5,740.00	9,184,000	貸付株式数 600株
ハニーズホールディングス	5,800	955.00	5,539,000	貸付株式数 2,200株
ファーマライズHD	1,500	780.00	1,170,000	貸付株式数 600株
キッコーマン	48,600	6,490.00	315,414,000	
味の素	149,200	2,180.50	325,330,600	
キューピー	37,700	2,174.00	81,959,800	貸付株式数 200株
ハウス食品G本社	25,300	3,600.00	91,080,000	
カゴメ	27,500	3,810.00	104,775,000	貸付株式数 1,600株
焼津水産化工	3,200	991.00	3,171,200	
アリアケジャパン	6,200	6,910.00	42,842,000	貸付株式数 1,000株
ピエトロ	800	1,705.00	1,364,000	貸付株式数 300株
エバラ食品工業	1,700	2,380.00	4,046,000	貸付株式数 500株
やまみ	600	2,033.00	1,219,800	
ニチレイ	32,300	2,834.00	91,538,200	
横浜冷凍	17,500	850.00	14,875,000	
東洋水産	34,900	5,130.00	179,037,000	貸付株式数 5,100株
イトアンドHLDGS	2,300	1,820.00	4,186,000	貸付株式数 800株
大冷	800	1,982.00	1,585,600	
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,800	868.00	3,298,400	貸付株式数 1,300株 (800株)
日清食品HD	28,800	8,620.00	248,256,000	
永谷園ホールディングス	3,400	2,250.00	7,650,000	
一正蒲鉾	2,600	1,153.00	2,997,800	
フジッコ	7,400	1,959.00	14,496,600	
ロックフィールド	7,300	1,457.00	10,636,100	貸付株式数 500株
日本たばこ産業	361,800	2,120.00	767,016,000	貸付株式数 150,400株
ケンコーマヨネーズ	3,800	1,786.00	6,786,800	貸付株式数 1,300株
わらべや日洋HD	4,400	1,392.00	6,124,800	
なとり	3,900	1,990.00	7,761,000	
イフジ産業	1,000	826.00	826,000	貸付株式数 100株
ピクルスコーポレーション	1,500	2,924.00	4,386,000	
北の達人コーポ	23,800	509.00	12,114,200	貸付株式数 9,500株
ユーグレナ	29,400	821.00	24,137,400	貸付株式数 11,700株
スター・マイカ・HLDGS	3,300	1,380.00	4,554,000	貸付株式数 1,300株

A Dワークスグループ	14,300	155.00	2,216,500		
片倉工業	8,900	1,368.00	12,175,200	貸付株式数	3,500株
グ ン ゼ	4,800	3,600.00	17,280,000		
ヒューリック	140,400	1,057.00	148,402,800	貸付株式数	56,600株
神 栄	1,000	691.00	691,000	貸付株式数	100株
ラサ商事	3,400	902.00	3,066,800		
アルペン	5,100	2,185.00	11,143,500	貸付株式数	2,000株
ハブ	1,900	593.00	1,126,700	貸付株式数	700株
ラクーンホールディングス	3,200	2,175.00	6,960,000	貸付株式数	1,200株
クオールホールディングス	9,800	1,042.00	10,211,600	貸付株式数	3,700株
アルコニックス	7,100	1,379.00	9,790,900		
神戸物産	45,900	3,640.00	167,076,000	貸付株式数	18,400株
ソリトンシステムズ	3,100	2,153.00	6,674,300		
ジズホールディングス	3,500	7,110.00	24,885,000	貸付株式数	1,400株
ビックカメラ	39,400	1,121.00	44,167,400	貸付株式数	6,900株
D C Mホールディングス	39,800	1,186.00	47,202,800		
ペッパーフードサービス	5,700	282.00	1,607,400	貸付株式数	2,200株 (300株)
ハイパー	900	584.00	525,600		
M o n o t a R O	47,200	6,370.00	300,664,000		
東京一番フーズ	1,500	555.00	832,500	貸付株式数	600株 (600株)
D Dホールディングス	2,700	619.00	1,671,300	貸付株式数	1,000株
あい ホールディングス	9,500	1,947.00	18,496,500	貸付株式数	800株
ディー・ブイエックス	2,300	1,028.00	2,364,400		
きちりホールディングス	1,700	651.00	1,106,700	貸付株式数	600株
アークランドサービスHD	4,900	2,061.00	10,098,900	貸付株式数	1,900株
J . フロント リテイリ ング	79,300	837.00	66,374,100	貸付株式数	32,000株
ドトール・日レスHD	9,700	1,443.00	13,997,100	貸付株式数	4,000株
マツモトキヨシH L D G S	27,400	4,885.00	133,849,000		
ブロンコビリー	3,500	2,301.00	8,053,500	貸付株式数	1,400株
Z O Z O	45,700	2,604.00	119,002,800	貸付株式数	15,100株
トレジャー・ファクトリー	2,000	693.00	1,386,000	貸付株式数	400株
物語コーポレーション	1,800	11,530.00	20,754,000	貸付株式数	700株 (100株)
ココカラファイン	6,900	7,590.00	52,371,000		
三越伊勢丹HD	116,400	561.00	65,300,400	貸付株式数	42,000株
東洋紡	26,200	1,305.00	34,191,000		
ユニチカ	19,800	378.00	7,484,400	貸付株式数	7,900株

富士紡ホールディングス	3,200	3,605.00	11,536,000	
日清紡ホールディングス	40,900	740.00	30,266,000	
倉敷紡績	6,600	1,842.00	12,157,200	貸付株式数 1,200株
ダイワボウHD	5,700	6,520.00	37,164,000	
シキボウ	4,000	1,041.00	4,164,000	貸付株式数 400株
日東紡績	10,100	4,250.00	42,925,000	貸付株式数 3,100株
トヨタ紡織	19,500	1,370.00	26,715,000	
マクニカ・富士エレHLDGS	15,800	2,067.00	32,658,600	貸付株式数 4,900株
Hamee	2,400	1,763.00	4,231,200	貸付株式数 900株
ラクト・ジャパン	2,600	2,943.00	7,651,800	貸付株式数 1,000株
ウエルシアHD	39,500	4,195.00	165,702,500	貸付株式数 10,600株
クリエイトSDH	11,200	3,710.00	41,552,000	
バイタルKSKHD	12,700	861.00	10,934,700	
八洲電機	5,100	942.00	4,804,200	貸付株式数 100株
メディアスホールディングス	3,700	901.00	3,333,700	
レスターホールディングス	6,900	2,242.00	15,469,800	
ジューテックHD	1,300	1,014.00	1,318,200	貸付株式数 100株
丸善CHI HD	7,200	360.00	2,592,000	貸付株式数 2,800株
大光	2,800	680.00	1,904,000	貸付株式数 1,100株
OCHIホールディングス	1,900	1,305.00	2,479,500	貸付株式数 100株
TOKAIホールディングス	34,900	991.00	34,585,900	
黒谷	1,600	621.00	993,600	
ミサワ	1,600	812.00	1,299,200	
ティーライフ	900	1,330.00	1,197,000	
Cominix	1,100	774.00	851,400	貸付株式数 400株
エー・ピーホールディングス	1,500	412.00	618,000	貸付株式数 400株
三洋貿易	6,700	1,019.00	6,827,300	
チムニー	2,000	1,231.00	2,462,000	貸付株式数 400株
シュッピン	4,600	833.00	3,831,800	
ビューティガレージ	1,100	3,050.00	3,355,000	貸付株式数 400株
オイシックス・ラ・大地	6,600	3,225.00	21,285,000	貸付株式数 2,600株
ウイン・パートナーズ	4,700	1,145.00	5,381,500	
ネクステージ	10,500	1,388.00	14,574,000	
ジョイフル本田	19,400	1,453.00	28,188,200	貸付株式数 7,400株
鳥貴族	2,200	1,372.00	3,018,400	貸付株式数 700株
キリン堂ホールディングス	1,300	3,485.00	4,530,500	

ホットランド	4,500	1,252.00	5,634,000	貸付株式数	1,800株
すかいらーくHD	74,400	1,581.00	117,626,400	貸付株式数	29,900株 (2,800株)
SFPホールディングス	3,800	1,274.00	4,841,200	貸付株式数	1,500株
綿半ホールディングス	5,000	1,375.00	6,875,000	貸付株式数	300株
日本毛織	21,300	1,056.00	22,492,800	貸付株式数	5,700株
ダイトウボウ	12,100	115.00	1,391,500	貸付株式数	4,300株
トーア紡コーポレーション	2,600	488.00	1,268,800	貸付株式数	1,000株
ダイドーリミテッド	9,700	197.00	1,910,900	貸付株式数	2,700株
ヨシックス	1,100	1,732.00	1,905,200		
ユナイテッド・スーパー マーケ	19,300	1,081.00	20,863,300	貸付株式数	7,700株
三栄建築設計	2,700	1,735.00	4,684,500		
野村不動産HLDGS	40,200	2,260.00	90,852,000		
三重交通グループHD	13,100	467.00	6,117,700	貸付株式数	3,500株
サムティ	9,500	1,654.00	15,713,000	貸付株式数	3,800株
日本商業開発	4,500	1,712.00	7,704,000	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーショ ン	11,000	1,754.00	19,294,000	貸付株式数	4,300株
フィル・カンパニー	1,200	2,062.00	2,474,400	貸付株式数	400株
ハウスコム	900	1,295.00	1,165,500		
日本管理センター	3,800	1,301.00	4,943,800		
サンセイランディック	2,500	735.00	1,837,500		
エストラスト	1,400	726.00	1,016,400	貸付株式数	300株
フージャースHD	13,300	674.00	8,964,200	貸付株式数	600株
オープンハウス	20,700	4,135.00	85,594,500		
東急不動産HD	180,200	506.00	91,181,200		
飯田GHD	55,200	2,098.00	115,809,600	貸付株式数	8,700株
イーランド	1,000	782.00	782,000		
帝国繊維	7,500	2,573.00	19,297,500	貸付株式数	2,900株
日本コークス工業	56,000	71.00	3,976,000		
ゴルフダイジェスト・オン	2,900	925.00	2,682,500	貸付株式数	1,100株
ミタチ産業	2,000	602.00	1,204,000	貸付株式数	600株
B E E N O S	3,000	2,535.00	7,605,000	貸付株式数	200株
あさひ	5,000	1,559.00	7,795,000	貸付株式数	1,900株
日本調剤	4,100	1,515.00	6,211,500		
コスモス薬品	5,900	18,000.00	106,200,000	貸付株式数	2,000株
シップヘルスケアHD	10,700	5,200.00	55,640,000	貸付株式数	4,200株
トーエル	3,200	768.00	2,457,600	貸付株式数	1,100株
ソフトクリエイイトHD	2,900	3,185.00	9,236,500	貸付株式数	1,100株



オンリー	1,100	465.00	511,500	貸付株式数	300株
セブン&アイ・HLDGS	259,200	3,313.00	858,729,600		
クリエイト・レストランツ・ホール	36,000	551.00	19,836,000	貸付株式数	14,400株 (800株)
明治電機工業	2,100	1,414.00	2,969,400		
ツルハホールディングス	14,500	15,280.00	221,560,000		
デリカフーズHLDGS	2,200	609.00	1,339,800		
スターティアホールディングス	1,700	726.00	1,234,200	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,300	1,437.00	7,616,100		
フェリシモ	1,400	1,358.00	1,901,200	貸付株式数	400株
トリドールホールディングス	16,500	1,402.00	23,133,000	貸付株式数	6,100株 (4,500株)
帝人	53,600	1,784.00	95,622,400		
東レ	476,400	566.10	269,690,040		
クラレ	103,600	1,036.00	107,329,600		
旭化成	436,400	957.10	417,678,440	貸付株式数	5,600株
サカイオーベックス	1,700	2,039.00	3,466,300		
TOKYO BASE	6,000	487.00	2,922,000	貸付株式数	2,400株
稲葉製作所	3,700	1,362.00	5,039,400	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングG	2,000	2,160.00	4,320,000	貸付株式数	700株
トーカロ	18,600	1,245.00	23,157,000		
アルファCO	2,200	970.00	2,134,000		
SUMCO	84,300	2,114.00	178,210,200	貸付株式数	33,700株
川田テクノロジーズ	1,400	4,215.00	5,901,000		
RS TECHNOLOGIES	1,900	4,465.00	8,483,500	貸付株式数	700株
信和	3,600	684.00	2,462,400		
ビーロット	3,400	830.00	2,822,000		
ファーストブラザーズ	1,500	945.00	1,417,500	貸付株式数	500株
ハウスドゥ	3,500	1,183.00	4,140,500	貸付株式数	1,300株
シーアールイー	1,800	1,315.00	2,367,000	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	1,100	1,574.00	1,731,400		
ケイアイスター不動産	2,200	2,539.00	5,585,800		
アグレ都市デザイン	1,700	645.00	1,096,500	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,300	3,265.00	4,244,500		
テンポイノベーション	1,700	844.00	1,434,800	貸付株式数	600株
グローバルリンクマネジメント	1,400	828.00	1,159,200	貸付株式数	400株

住江織物	1,400	2,178.00	3,049,200	貸付株式数	400株
日本フェルト	3,500	455.00	1,592,500		
イチカワ	900	1,347.00	1,212,300		
エコナックホールディングス	13,500	90.00	1,215,000		
日東製網	800	1,483.00	1,186,400	貸付株式数	200株
芦森工業	1,300	982.00	1,276,600	貸付株式数	500株
アツギ	5,300	525.00	2,782,500		
ウイルプラスHLDGS	1,100	674.00	741,400		
JMホールディングス	5,100	2,435.00	12,418,500	貸付株式数	1,300株
コメダホールディングス	14,600	1,860.00	27,156,000	貸付株式数	5,600株
サツドラホールディングス	900	2,020.00	1,818,000		
アレンザホールディングス	3,300	1,382.00	4,560,600	貸付株式数	300株 (300株)
串カツ田中HLDGS	1,300	1,600.00	2,080,000	貸付株式数	500株 (400株)
パロックジャパン	4,600	673.00	3,095,800		
クスリのアオキHLDGS	6,000	8,700.00	52,200,000	貸付株式数	2,300株
ダイニック	2,400	871.00	2,090,400		
共和レザー	3,600	605.00	2,178,000		
ピーバンドットコム	600	912.00	547,200		
力の源HD	3,000	588.00	1,764,000	貸付株式数	100株
スシローグローバルHLDGS	36,500	3,320.00	121,180,000		
アセンテック	1,400	1,938.00	2,713,200	貸付株式数	500株
セーレン	16,300	1,526.00	24,873,800	貸付株式数	5,600株
ソトー	2,400	926.00	2,222,400	貸付株式数	200株
東海染工	900	1,112.00	1,000,800	貸付株式数	200株
小松マテーレ	10,800	953.00	10,292,400		
ワコールホールディングス	16,400	2,001.00	32,816,400		
ホギメディカル	7,500	3,160.00	23,700,000		
クラウドディアHLDGS	1,700	302.00	513,400	貸付株式数	600株
TSIホールディングス	20,900	201.00	4,200,900		
マツオカコーポレーション	1,900	2,532.00	4,810,800	貸付株式数	700株
ワールド	9,400	1,282.00	12,050,800		
TIS	66,100	2,078.00	137,355,800		
JNSホールディングス	2,800	607.00	1,699,600		
電算システム	2,500	3,325.00	8,312,500	貸付株式数	900株
グリー	40,900	585.00	23,926,500		
コーエーテクモHD	13,600	5,550.00	75,480,000		

三菱総合研究所	2,800	4,160.00	11,648,000	
ボルテージ	1,900	554.00	1,052,600	貸付株式数 600株
電算	700	2,412.00	1,688,400	
A G S	3,700	862.00	3,189,400	
ファインデックス	5,700	1,362.00	7,763,400	貸付株式数 2,100株
ブレインパッド	1,700	4,275.00	7,267,500	貸付株式数 100株
K L a b	12,200	1,018.00	12,419,600	
ポルトゥウィン・ピット クル	8,000	960.00	7,680,000	貸付株式数 3,200株
イーブックイニシアティブ	900	2,921.00	2,628,900	貸付株式数 300株
ネクソン	166,700	3,155.00	525,938,500	
アイスタイル	18,400	453.00	8,335,200	貸付株式数 7,300株
エムアップホールディング ス	1,900	2,629.00	4,995,100	貸付株式数 700株
エイチーム	4,500	977.00	4,396,500	貸付株式数 1,800株
エニグモ	6,300	1,325.00	8,347,500	
テクノスジャパン	5,300	759.00	4,022,700	
e n i s h	3,500	473.00	1,655,500	貸付株式数 200株
コロプラ	21,700	914.00	19,833,800	貸付株式数 8,700株 (8,700株)
オルトプラス	4,400	442.00	1,944,800	貸付株式数 1,500株
ブロードリーフ	32,900	648.00	21,319,200	貸付株式数 13,100株
クロス・マーケティングG	3,200	354.00	1,132,800	
デジタルハーツH L D G S	3,700	1,185.00	4,384,500	貸付株式数 1,400株
システム情報	4,900	1,170.00	5,733,000	貸付株式数 1,900株
メディアドゥ	2,100	7,500.00	15,750,000	貸付株式数 800株
じげん	16,500	327.00	5,395,500	
ブイキューブ	3,600	3,370.00	12,132,000	貸付株式数 1,400株
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	779.00	1,012,700	貸付株式数 500株
サイバーリンクス	1,200	6,670.00	8,004,000	貸付株式数 400株
ディー・エル・イー	4,300	346.00	1,487,800	
フィックスターズ	7,100	1,039.00	7,376,900	貸付株式数 2,700株
C A R T A H O L D I N G S	2,900	1,274.00	3,694,600	貸付株式数 1,200株
オプティム	3,500	3,080.00	10,780,000	貸付株式数 1,300株
セレス	2,300	2,817.00	6,479,100	貸付株式数 800株
S H I F T	2,700	15,470.00	41,769,000	貸付株式数 1,000株
特種東海製紙	4,100	5,350.00	21,935,000	貸付株式数 300株
ティーガイア	5,900	1,839.00	10,850,100	
セック	1,000	3,030.00	3,030,000	

日本アジアグループ	7,300	835.00	6,095,500	貸付株式数	2,900株
テクマトリックス	9,400	2,296.00	21,582,400		
プロシップ	1,900	1,423.00	2,703,700	貸付株式数	700株
ガンホー・オンライン・エンター	16,000	2,653.00	42,448,000		
GMOペイメントゲートウェイ	14,000	14,640.00	204,960,000	貸付株式数	3,700株
ザッパラス	2,900	484.00	1,403,600	貸付株式数	1,300株
システムリサーチ	1,800	1,634.00	2,941,200	貸付株式数	300株
インターネットイニシアティブ	9,900	4,975.00	49,252,500		
さくらインターネット	7,000	736.00	5,152,000	貸付株式数	2,800株
ヴィンクス	1,900	1,245.00	2,365,500	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインHD	1,400	10,320.00	14,448,000	貸付株式数	500株 (400株)
SRAホールディングス	3,500	2,480.00	8,680,000		
システムインテグレータ	2,300	664.00	1,527,200	貸付株式数	800株
朝日ネット	4,700	877.00	4,121,900		
eBASE	8,000	1,059.00	8,472,000	貸付株式数	3,100株
アバント	6,300	1,105.00	6,961,500	貸付株式数	2,500株
アドソル日進	2,400	2,958.00	7,099,200		
フリービット	3,700	920.00	3,404,000	貸付株式数	1,300株
コムチュア	7,500	3,230.00	24,225,000		
サイバーコム	1,200	1,769.00	2,122,800	貸付株式数	400株
アステリア	4,400	1,095.00	4,818,000	貸付株式数	1,600株
アイル	3,700	1,428.00	5,283,600	貸付株式数	1,400株
王子ホールディングス	275,600	474.00	130,634,400		
日本製紙	29,300	1,125.00	32,962,500	貸付株式数	11,700株
三菱製紙	7,300	321.00	2,343,300		
北越コーポレーション	39,900	351.00	14,004,900		
中越パルプ	2,800	1,347.00	3,771,600		
巴川製紙	2,100	885.00	1,858,500		
大王製紙	30,500	1,806.00	55,083,000	貸付株式数	200株
阿波製紙	2,000	452.00	904,000		
マークライنز	3,000	2,717.00	8,151,000		
メディカル・データ・ビジ	7,400	3,120.00	23,088,000	貸付株式数	2,900株
gumi	8,600	868.00	7,464,800		
ショーケース	1,600	750.00	1,200,000	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,600	993.00	1,588,800	貸付株式数	500株
テラスカイ	2,400	4,890.00	11,736,000	貸付株式数	900株

デジタル・インフォメーション	2,900	1,509.00	4,376,100	貸付株式数	1,000株
P C Iホールディングス	2,800	1,320.00	3,696,000	貸付株式数	1,000株
パイプドHD	900	1,697.00	1,527,300	貸付株式数	200株 (200株)
アイビーシー	1,400	1,191.00	1,667,400	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,200	2,756.00	3,307,200		
P R T I M E S	1,200	3,550.00	4,260,000	貸付株式数	400株
ランドコンピュータ	1,000	1,126.00	1,126,000	貸付株式数	400株
ダブルスタンダード	900	4,425.00	3,982,500		
オープンドア	3,400	1,261.00	4,287,400	貸付株式数	1,300株
マイネット	2,100	961.00	2,018,100	貸付株式数	800株
アカツキ	2,400	4,485.00	10,764,000	貸付株式数	900株
ベネフィットジャパン	500	2,074.00	1,037,000		
U B I C O Mホールディングス	1,600	3,580.00	5,728,000		
L I N E	15,300	5,380.00	82,314,000		
カナミックネットワーク	6,000	814.00	4,884,000		
ノムラシステムコーポレーション	3,400	387.00	1,315,800	貸付株式数	1,100株
レンゴー	62,500	795.00	49,687,500		
トーモク	4,100	1,730.00	7,093,000	貸付株式数	1,100株
ザ・パック	5,000	2,892.00	14,460,000	貸付株式数	800株
チェンジ	4,600	8,100.00	37,260,000		
シンクロ・フード	2,700	310.00	837,000	貸付株式数	400株
オークネット	3,600	1,369.00	4,928,400	貸付株式数	1,400株
セグエグループ	1,300	1,357.00	1,764,100		
エイトレッド	1,100	2,799.00	3,078,900	貸付株式数	100株
A O I T Y O H O L D I N G S	6,700	417.00	2,793,900	貸付株式数	2,600株
マクロミル	13,500	650.00	8,775,000	貸付株式数	5,200株
ビーグリー	1,300	1,970.00	2,561,000	貸付株式数	500株
オロ	1,900	3,890.00	7,391,000	貸付株式数	700株
ユーザーローカル	600	4,045.00	2,427,000		
テモナ	1,300	1,377.00	1,790,100	貸付株式数	500株
ニーズウェル	1,000	753.00	753,000	貸付株式数	100株
サインポスト	1,300	988.00	1,284,400	貸付株式数	500株
昭和電工	49,800	1,937.00	96,462,600		
住友化学	482,900	370.00	178,673,000		
住友精化	3,000	4,150.00	12,450,000		

日産化学	36,400	6,240.00	227,136,000	
ラサ工業	2,300	1,999.00	4,597,700	貸付株式数 800株
クレハ	5,600	5,300.00	29,680,000	
多木化学	2,600	6,650.00	17,290,000	貸付株式数 1,000株
テイカ	4,900	1,463.00	7,168,700	
石原産業	11,900	576.00	6,854,400	
片倉コープアグリ	1,600	1,247.00	1,995,200	
日本曹達	9,800	2,747.00	26,920,600	
東ソー	101,800	1,646.00	167,562,800	
トクヤマ	19,000	2,217.00	42,123,000	
セントラル硝子	13,400	2,224.00	29,801,600	貸付株式数 400株
東亜合成	41,100	1,250.00	51,375,000	貸付株式数 900株
大阪ソーダ	6,700	2,447.00	16,394,900	
関東電化	15,800	702.00	11,091,600	
デンカ	24,100	3,230.00	77,843,000	
イビデン	41,300	4,890.00	201,957,000	
信越化学	113,100	17,135.00	1,937,968,500	
日本カ - バイド	2,100	1,309.00	2,748,900	
堺 化 学	4,200	1,943.00	8,160,600	
第一稀元素化学工	7,100	697.00	4,948,700	
エア・ウォーター	61,300	1,721.00	105,497,300	
日本酸素HLDGS	63,300	1,744.00	110,395,200	貸付株式数 25,400株
日本化学工業	2,100	2,554.00	5,363,400	
東邦アセチレン	800	1,231.00	984,800	
日本パ - カライジング	33,000	1,095.00	36,135,000	貸付株式数 5,500株
高圧ガス	10,400	757.00	7,872,800	
チタン工業	900	1,947.00	1,752,300	貸付株式数 300株
四国化成	9,600	1,192.00	11,443,200	
戸田工業	1,500	2,185.00	3,277,500	貸付株式数 500株
ステラ ケミファ	3,600	3,350.00	12,060,000	貸付株式数 1,400株 (100株)
保土谷化学	2,500	4,605.00	11,512,500	
日本触媒	10,200	5,220.00	53,244,000	
大日精化	5,800	2,388.00	13,850,400	
カネカ	17,100	3,140.00	53,694,000	
協和キリン	67,600	2,835.00	191,646,000	
三菱瓦斯化学	61,400	2,214.00	135,939,600	
三井化学	61,100	2,933.00	179,206,300	
J S R	61,500	2,885.00	177,427,500	

東京応化工業	11,400	6,580.00	75,012,000	貸付株式数 3,600株 (100株)
大阪有機化学	6,100	2,899.00	17,683,900	
三菱ケミカルHLDGS	439,800	577.50	253,984,500	
KHネオケム	10,900	2,787.00	30,378,300	
ダイセル	82,400	734.00	60,481,600	貸付株式数 28,100株
住友ベークライト	10,400	3,220.00	33,488,000	
積水化学	139,000	1,803.00	250,617,000	
日本ゼオン	59,600	1,293.00	77,062,800	
アイカ工業	19,800	3,690.00	73,062,000	
宇部興産	33,200	1,775.00	58,930,000	
積水樹脂	11,800	2,190.00	25,842,000	貸付株式数 2,200株
タキロンシーアイ	14,000	708.00	9,912,000	
旭有機材	3,800	1,457.00	5,536,600	
ニチバン	3,500	1,621.00	5,673,500	貸付株式数 100株
リケンテクノス	16,400	446.00	7,314,400	貸付株式数 2,800株
大倉工業	3,100	1,877.00	5,818,700	貸付株式数 900株
積水化成成品	8,900	538.00	4,788,200	
群栄化学	1,400	2,533.00	3,546,200	
タイガース ポリマー	3,400	422.00	1,434,800	
ミライアル	2,300	1,211.00	2,785,300	貸付株式数 800株
ダイキアクシス	2,400	1,047.00	2,512,800	貸付株式数 800株
ダイキョーニシカワ	13,800	685.00	9,453,000	貸付株式数 5,100株
竹本容器	2,200	983.00	2,162,600	貸付株式数 800株
森六ホールディングス	3,600	1,989.00	7,160,400	
日本化薬	41,000	917.00	37,597,000	
カーリットホールディングス	6,900	600.00	4,140,000	貸付株式数 2,700株
E P Sホールディングス	8,800	959.00	8,439,200	
ソルクシーズ	2,900	1,056.00	3,062,400	貸付株式数 1,000株
レッグス	1,700	1,493.00	2,538,100	貸付株式数 600株
プレステージ・インター	24,300	962.00	23,376,600	
フェイス	2,300	798.00	1,835,400	
プロトコーポレーション	6,000	1,053.00	6,318,000	
ハイマックス	1,600	1,158.00	1,852,800	
アミューズ	3,500	2,575.00	9,012,500	
野村総合研究所	93,500	3,525.00	329,587,500	
ドリームインキュベータ	1,900	1,451.00	2,756,900	
サイバネットシステム	5,100	968.00	4,936,800	
クイック	3,900	1,125.00	4,387,500	貸付株式数 600株

T A C	4,400	219.00	963,600		
C Eホールディングス	4,000	601.00	2,404,000	貸付株式数	900株
ケネディクス	55,800	759.00	42,352,200		
日本システム技術	1,200	1,588.00	1,905,600		
電通グループ	72,200	3,400.00	245,480,000	貸付株式数	28,800株
インテージホールディングス	8,300	1,035.00	8,590,500	貸付株式数	3,300株
テイクアンドギヴニーズ	2,400	576.00	1,382,400	貸付株式数	900株
東邦システムサイエンス	1,700	932.00	1,584,400		
びあ	1,800	2,715.00	4,887,000	貸付株式数	700株
イオンファンタジー	2,500	2,200.00	5,500,000	貸付株式数	700株
ソースネクスト	31,600	313.00	9,890,800	貸付株式数	9,200株
シーティーエス	7,300	940.00	6,862,000	貸付株式数	2,900株
ネクシィーズグループ	2,200	858.00	1,887,600	貸付株式数	800株
インフォコム	7,300	3,660.00	26,718,000		
メディカルシステムネットワーク	6,400	626.00	4,006,400		
日本精化	5,400	1,453.00	7,846,200	貸付株式数	1,100株
扶桑化学工業	6,700	3,455.00	23,148,500		
トリケミカル	1,500	14,110.00	21,165,000		
HEROZ	900	2,908.00	2,617,200	貸付株式数	300株 (300株)
ラクスル	5,300	5,070.00	26,871,000	貸付株式数	2,100株
F I G	7,700	273.00	2,102,100	貸付株式数	2,800株
システムサポート	1,400	1,487.00	2,081,800	貸付株式数	200株
A D E K A	30,300	1,658.00	50,237,400		
日油	24,800	4,630.00	114,824,000	貸付株式数	300株
ミヨシ油脂	2,500	1,233.00	3,082,500		
新日本理化	10,700	166.00	1,776,200	貸付株式数	2,100株
ハリマ化成グループ	5,500	1,022.00	5,621,000	貸付株式数	1,200株
イーソル	3,100	1,416.00	4,389,600	貸付株式数	1,200株
アルテリア・ネットワークス	7,400	1,591.00	11,773,400		
東海ソフト	400	1,117.00	446,800	貸付株式数	100株
ヒト・コミュニケーションズHD	1,300	1,500.00	1,950,000		
トビラシステムズ	800	1,728.00	1,382,400		
花 王	161,000	7,808.00	1,257,088,000		
第一工業製薬	2,500	4,510.00	11,275,000	貸付株式数	900株
石原ケミカル	1,800	2,097.00	3,774,600	貸付株式数	700株



日華化学	2,200	959.00	2,109,800	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	3,110.00	4,354,000	貸付株式数	500株
三洋化成	3,900	4,480.00	17,472,000		
武田薬品	559,600	3,745.00	2,095,702,000		
アステラス製薬	583,100	1,483.50	865,028,850		
大日本住友製薬	49,700	1,323.00	65,753,100		
塩野義製薬	84,600	5,593.00	473,167,800		
わかもと製薬	8,500	273.00	2,320,500		
あすか製薬	7,700	1,704.00	13,120,800		
日本新薬	17,600	7,460.00	131,296,000		
ピオフェルミン製薬	1,200	2,401.00	2,881,200		
中外製薬	210,400	5,044.00	1,061,257,600		
科研製薬	11,600	3,810.00	44,196,000		
エーザイ	80,600	7,887.00	635,692,200	貸付株式数	32,400株
理研ビタミン	6,500	1,332.00	8,658,000		
ロート製薬	34,600	3,425.00	118,505,000		
小野薬品	154,500	3,303.00	510,313,500		
久光製薬	17,700	6,120.00	108,324,000		
有機合成薬品	5,900	306.00	1,805,400	貸付株式数	2,000株
持田製薬	9,300	4,010.00	37,293,000		
参天製薬	125,600	1,735.00	217,916,000	貸付株式数	19,900株
扶桑薬品	2,400	2,833.00	6,799,200		
日本ケミファ	900	2,470.00	2,223,000		
ツムラ	20,800	3,045.00	63,336,000		
日医工	19,200	1,000.00	19,200,000	貸付株式数	7,600株
テルモ	190,300	4,147.00	789,174,100		
HUグループHD	18,100	2,826.00	51,150,600		
キッセイ薬品工業	11,800	2,090.00	24,662,000		
生化学工業	13,000	993.00	12,909,000		
栄研化学	11,900	1,937.00	23,050,300		
日水製薬	2,800	989.00	2,769,200		
鳥居薬品	4,200	3,165.00	13,293,000		
JCRファーマ	19,100	2,720.00	51,952,000		
東和薬品	8,600	1,901.00	16,348,600		
富士製薬工業	4,600	1,248.00	5,740,800	貸付株式数	900株
沢井製薬	13,800	4,715.00	65,067,000		
ゼリア新薬工業	12,100	1,868.00	22,602,800	貸付株式数	2,900株
第一三共	577,500	3,694.00	2,133,285,000		
キョーリン製薬HD	15,000	1,877.00	28,155,000	貸付株式数	100株
大幸薬品	8,300	1,685.00	13,985,500	貸付株式数	3,300株

ダイト	4,200	3,620.00	15,204,000	
大塚ホールディングス	139,700	4,242.00	592,607,400	貸付株式数 3,100株
大正製薬HD	14,100	6,640.00	93,624,000	
ペプチドリーム	34,200	5,320.00	181,944,000	貸付株式数 13,800株
大日本塗料	7,500	923.00	6,922,500	
日本ペイントHOLD	54,400	13,370.00	727,328,000	
関西ペイント	74,000	3,165.00	234,210,000	貸付株式数 29,800株
神東塗料	6,800	181.00	1,230,800	貸付株式数 2,000株
中国塗料	18,800	994.00	18,687,200	
日本特殊塗料	5,000	1,145.00	5,725,000	
藤倉化成	8,900	507.00	4,512,300	
太陽ホールディングス	4,900	6,410.00	31,409,000	
D I C	27,800	2,567.00	71,362,600	貸付株式数 10,800株
サカタインクス	14,400	1,158.00	16,675,200	貸付株式数 5,800株
東洋インキSCホールディングン	13,700	1,961.00	26,865,700	
T & K TOKA	5,000	860.00	4,300,000	貸付株式数 1,900株
アルプス技研	5,700	2,095.00	11,941,500	
サニックス	11,400	278.00	3,169,200	貸付株式数 4,500株
ダイオーズ	1,200	943.00	1,131,600	貸付株式数 400株
日本空調サービス	6,800	762.00	5,181,600	
オリエンタルランド	68,400	17,765.00	1,215,126,000	貸付株式数 4,900株
フォーカスシステムズ	4,200	903.00	3,792,600	貸付株式数 1,600株
ダスキン	15,900	2,774.00	44,106,600	貸付株式数 2,600株
パーク24	35,800	1,556.00	55,704,800	貸付株式数 14,300株
明光ネットワークジャパン	8,100	528.00	4,276,800	貸付株式数 3,200株
ファルコホールディングス	3,500	1,587.00	5,554,500	
クレスコ	4,000	1,280.00	5,120,000	
フジ・メディア・HD	63,500	1,087.00	69,024,500	
秀英予備校	1,400	420.00	588,000	貸付株式数 500株
田谷	1,200	547.00	656,400	貸付株式数 400株
ラウンドワン	18,100	859.00	15,547,900	貸付株式数 7,200株
リゾートトラスト	29,600	1,628.00	48,188,800	
オービック	22,900	23,470.00	537,463,000	
ジャストシステム	10,800	7,030.00	75,924,000	
TDCソフト	5,900	1,044.00	6,159,600	
Zホールディングス	908,800	657.00	597,081,600	
ビー・エム・エル	8,300	3,280.00	27,224,000	
ワタベウェディング	1,000	289.00	289,000	貸付株式数 300株
トレンドマイクロ	35,200	5,670.00	199,584,000	

りらいあコミュニケーション	11,400	1,234.00	14,067,600	貸付株式数	4,400株
IDホールディングス	2,500	1,224.00	3,060,000		
リソー教育	29,600	315.00	9,324,000		
日本オラクル	13,400	11,570.00	155,038,000		
早稲田アカデミー	2,800	953.00	2,668,400		
アルファシステムズ	2,100	3,520.00	7,392,000	貸付株式数	800株
フューチャー	8,000	1,777.00	14,216,000		
CAC HOLDINGS	4,400	1,470.00	6,468,000		
SBテクノロジー	2,400	3,620.00	8,688,000		
トーセ	1,800	872.00	1,569,600	貸付株式数	300株
ユー・エス・エス	71,800	2,184.00	156,811,200		
オービックビジネスC	6,700	7,400.00	49,580,000		
伊藤忠テクノソリュー	30,100	3,685.00	110,918,500		
アイティフォー	8,100	921.00	7,460,100	貸付株式数	200株
東京個別指導学院	2,300	613.00	1,409,900		
東計電算	1,000	4,355.00	4,355,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	39,800	7,150.00	284,570,000	貸付株式数	15,900株
楽天	300,700	1,169.00	351,518,300		
エクスネット	1,100	981.00	1,079,100		
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,034.00	3,515,600		
テー・オー・ダブリュー	10,400	280.00	2,912,000		
大塚商会	35,700	5,060.00	180,642,000		
サイボウズ	7,800	2,870.00	22,386,000	貸付株式数	3,100株
山田コンサルティングG P	4,100	970.00	3,977,000		
セントラルスポーツ	2,400	2,150.00	5,160,000	貸付株式数	300株
パラカ	1,700	1,642.00	2,791,400	貸付株式数	600株
電通国際情報S	4,100	6,990.00	28,659,000		
ACCESS	6,100	820.00	5,002,000	貸付株式数	2,400株
デジタルガレージ	11,900	4,225.00	50,277,500	貸付株式数	4,700株
イーエムシステムズ	9,300	820.00	7,626,000	貸付株式数	3,600株
ウェザーニューズ	2,300	5,600.00	12,880,000	貸付株式数	800株
CIJ	4,700	973.00	4,573,100		
ビジネスエンジニアリング	800	3,465.00	2,772,000	貸付株式数	200株
日本エンタープライズ	7,300	224.00	1,635,200	貸付株式数	2,800株
WOWOW	3,200	2,837.00	9,078,400	貸付株式数	800株
スカラ	4,600	865.00	3,979,000	貸付株式数	1,800株 (100株)
インテリジェント ウェイブ	3,700	710.00	2,627,000		

フルキャストホールディングス	5,800	1,693.00	9,819,400	貸付株式数	2,400株
エン・ジャパン	11,500	3,250.00	37,375,000	貸付株式数	2,200株
富士フイルムHLDGS	129,000	5,625.00	725,625,000		
コニカミノルタ	148,300	334.00	49,532,200		
資生堂	133,700	7,360.00	984,032,000		
ライオン	87,500	2,468.00	215,950,000	貸付株式数	7,000株
高砂香料	4,200	2,520.00	10,584,000		
マンダム	15,300	1,637.00	25,046,100	貸付株式数	6,100株
ミルボン	9,000	5,960.00	53,640,000	貸付株式数	200株
ファンケル	27,300	4,235.00	115,615,500	貸付株式数	11,000株
コーセー	12,700	15,940.00	202,438,000	貸付株式数	4,600株
コタ	3,900	1,359.00	5,300,100		
シーボン	800	1,972.00	1,577,600		
ポーラ・オルビスHD	28,800	2,085.00	60,048,000	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	5,700	4,295.00	24,481,500		
アジュバンコスメジャパン	1,400	1,018.00	1,425,200		
エステー	4,400	2,037.00	8,962,800		
アグロカネショウ	2,600	1,745.00	4,537,000	貸付株式数	1,000株
コニシ	11,000	1,592.00	17,512,000		
長谷川香料	11,700	2,012.00	23,540,400	貸付株式数	4,000株
星光PMC	3,800	718.00	2,728,400		
小林製薬	18,900	12,550.00	237,195,000	貸付株式数	2,800株
荒川化学工業	6,000	1,120.00	6,720,000		
メック	4,600	2,279.00	10,483,400	貸付株式数	1,800株 (1,500株)
日本高純度化学	1,800	2,695.00	4,851,000	貸付株式数	400株
タカラバイオ	17,700	2,973.00	52,622,100	貸付株式数	7,100株
JCU	8,200	3,685.00	30,217,000		
新田ゼラチン	4,000	702.00	2,808,000	貸付株式数	200株
OATアグリオ	1,200	1,422.00	1,706,400	貸付株式数	200株
デクセリアルズ	17,600	1,275.00	22,440,000		
アース製薬	4,800	6,150.00	29,520,000	貸付株式数	1,900株
北興化学	6,500	1,124.00	7,306,000	貸付株式数	2,600株
大成ラミック	2,200	2,904.00	6,388,800		
クミアイ化学	28,000	1,021.00	28,588,000	貸付株式数	11,200株
日本農薬	12,000	531.00	6,372,000	貸付株式数	1,900株
富士興産	2,200	920.00	2,024,000	貸付株式数	400株
ニチレキ	8,000	1,636.00	13,088,000		
ユシロ化学	3,700	1,164.00	4,306,800		

ビーピー・カストロール	2,400	1,266.00	3,038,400	貸付株式数	900株
富士石油	17,700	184.00	3,256,800		
MORESCO	2,300	1,011.00	2,325,300	貸付株式数	900株
出光興産	74,700	2,174.00	162,397,800		
ENEOSホールディングス	1,011,500	358.50	362,622,750		
コスモエネルギーHLDGS	19,600	1,774.00	34,770,400	貸付株式数	2,300株
横浜ゴム	39,000	1,523.00	59,397,000		
TOYO TIRE	35,500	1,647.00	58,468,500	貸付株式数	1,200株
ブリヂストン	178,700	3,644.00	651,182,800	貸付株式数	800株
住友ゴム	60,500	923.00	55,841,500	貸付株式数	1,000株
藤倉コンポジット	6,200	386.00	2,393,200		
オカモト	4,100	4,075.00	16,707,500		
アキレス	4,700	1,424.00	6,692,800		
フコク	3,000	697.00	2,091,000	貸付株式数	1,100株
ニッタ	7,600	2,206.00	16,765,600		
クリエートメディック	2,100	962.00	2,020,200		
住友理工	12,800	513.00	6,566,400		
三ツ星ベルト	8,800	1,631.00	14,352,800		
バンドー化学	11,800	576.00	6,796,800		
AGC	61,800	3,475.00	214,755,000	貸付株式数	12,500株
日本板硝子	32,300	401.00	12,952,300	貸付株式数	12,900株
石塚硝子	1,200	1,917.00	2,300,400		
有沢製作所	10,700	917.00	9,811,900	貸付株式数	700株
日本山村硝子	2,800	863.00	2,416,400		
日本電気硝子	25,000	2,282.00	57,050,000		
オハラ	2,700	1,508.00	4,071,600	貸付株式数	100株
住友大阪セメント	12,700	3,090.00	39,243,000		
太平洋セメント	42,400	2,806.00	118,974,400		
リソルホールディングス	700	3,765.00	2,635,500	貸付株式数	200株
日本ヒュム	6,700	780.00	5,226,000	貸付株式数	2,400株
日本コンクリート	14,600	318.00	4,642,800		
三谷セキサン	3,100	4,175.00	12,942,500		
アジアパイルHD	9,600	455.00	4,368,000		
東海カーボン	66,100	1,146.00	75,750,600	貸付株式数	26,500株
日本カーボン	3,500	3,735.00	13,072,500	貸付株式数	1,100株
東洋炭素	4,000	1,784.00	7,136,000		
ノリタケ	3,700	2,931.00	10,844,700		
TOTO	48,000	5,910.00	283,680,000		

日本碍子	80,600	1,659.00	133,715,400		
日本特殊陶業	51,400	1,891.00	97,197,400	貸付株式数	8,700株
ダントーホールディングス	5,600	487.00	2,727,200	貸付株式数	2,000株
MARUWA	2,600	11,080.00	28,808,000	貸付株式数	1,000株
品川リフラクトリーズ	1,700	2,459.00	4,180,300		
黒崎播磨	1,300	3,595.00	4,673,500		
ヨータイ	5,300	825.00	4,372,500	貸付株式数	2,000株
イソライト	3,400	442.00	1,502,800		
東京窯業	8,400	345.00	2,898,000	貸付株式数	3,300株
ニッカトー	3,000	708.00	2,124,000		
フジインコーポレーテッド	6,100	3,640.00	22,204,000		
クニミネ工業	2,800	1,098.00	3,074,400	貸付株式数	100株
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,034.00	1,137,400		
ニチアス	18,500	2,437.00	45,084,500		
日本製鉄	297,600	1,276.50	379,886,400		
神戸製鋼所	122,100	505.00	61,660,500	貸付株式数	48,400株
中山製鋼所	8,700	376.00	3,271,200		
合同製鐵	3,600	1,855.00	6,678,000	貸付株式数	300株
JFEホールディングス	179,700	956.00	171,793,200		
東京製鐵	32,600	656.00	21,385,600	貸付株式数	5,300株
共英製鋼	7,600	1,494.00	11,354,400	貸付株式数	1,500株
大和工業	14,200	2,646.00	37,573,200		
東京鐵鋼	2,700	2,207.00	5,958,900		
大阪製鐵	3,500	1,188.00	4,158,000		
淀川製鋼所	8,900	1,973.00	17,559,700		
丸一鋼管	21,700	2,196.00	47,653,200	貸付株式数	8,600株
モリ工業	2,000	2,441.00	4,882,000		
大同特殊鋼	10,800	4,340.00	46,872,000		
日本高周波	2,400	337.00	808,800		
日本冶金工	5,500	1,650.00	9,075,000		
山陽特殊製鋼	4,500	1,250.00	5,625,000		
愛知製鋼	3,600	2,550.00	9,180,000		
日立金属	71,800	1,533.00	110,069,400		
日本金属	1,600	1,221.00	1,953,600	貸付株式数	400株
大平洋金属	4,500	1,850.00	8,325,000		
新日本電工	43,600	228.00	9,940,800		
栗本鉄工所	3,300	1,711.00	5,646,300		
虹 技	1,000	1,257.00	1,257,000		
日本鑄鉄管	800	1,316.00	1,052,800		

日本製鋼所	20,300	2,550.00	51,765,000	
三菱製鋼	4,900	554.00	2,714,600	貸付株式数 1,800株
日亜鋼業	9,600	308.00	2,956,800	貸付株式数 2,600株
日本精線	1,100	3,310.00	3,641,000	貸付株式数 100株
エンビプロHD	3,000	559.00	1,677,000	貸付株式数 1,000株
大紀アルミニウム	11,000	681.00	7,491,000	
日本軽金属HD	16,900	1,792.00	30,284,800	
三井金属	18,000	2,958.00	53,244,000	
東邦亜鉛	3,400	2,040.00	6,936,000	貸付株式数 1,300株
三菱マテリアル	44,000	1,982.00	87,208,000	
住友鉱山	85,000	3,887.00	330,395,000	
DOWAホールディングス	16,800	3,450.00	57,960,000	
古河機金	11,800	1,136.00	13,404,800	
エス・サイエンス	37,600	44.00	1,654,400	貸付株式数 11,500株
大阪チタニウム	6,900	840.00	5,796,000	貸付株式数 2,700株
東邦チタニウム	12,000	689.00	8,268,000	貸付株式数 3,700株
UACJ	10,100	1,791.00	18,089,100	
CKサンエツ	1,400	3,855.00	5,397,000	貸付株式数 500株
古河電工	20,800	2,644.00	54,995,200	
住友電工	248,200	1,194.00	296,350,800	
フジクラ	81,000	407.00	32,967,000	
昭和電線HLDGS	7,800	1,612.00	12,573,600	貸付株式数 2,100株
東京特殊電線	1,000	2,407.00	2,407,000	貸付株式数 400株
タツタ電線	13,300	620.00	8,246,000	
カナレ電気	1,100	1,763.00	1,939,300	貸付株式数 400株
平河ヒューテック	3,300	1,060.00	3,498,000	
リョービ	8,200	1,216.00	9,971,200	貸付株式数 900株
アーステイ	8,600	322.00	2,769,200	
アサヒHD	11,800	3,105.00	36,639,000	
東洋製罐グループHD	42,400	1,007.00	42,696,800	
ホッカンホールディングス	3,700	1,380.00	5,106,000	
コロナ	3,400	903.00	3,070,200	
横河ブリッジHLDGS	12,500	1,982.00	24,775,000	
OSJBHD	33,300	236.00	7,858,800	
駒井ハルテック	1,200	1,658.00	1,989,600	
高田機工	600	2,549.00	1,529,400	貸付株式数 100株
三和ホールディングス	62,900	1,270.00	79,883,000	
文化シヤツタ-	19,800	912.00	18,057,600	貸付株式数 7,800株
三協立山	8,700	765.00	6,655,500	貸付株式数 3,400株
アルインコ	4,900	908.00	4,449,200	

東洋シヤツタ -	1,700	744.00	1,264,800	
L I X I Lグループ	98,200	2,505.00	245,991,000	貸付株式数 7,700株
日本ファイルコン	5,000	529.00	2,645,000	
ノーリツ	13,800	1,611.00	22,231,800	
長府製作所	6,800	2,040.00	13,872,000	貸付株式数 2,700株
リンナイ	13,000	12,180.00	158,340,000	
ユニプレス	13,200	895.00	11,814,000	
ダイニチ工業	3,500	960.00	3,360,000	
日東精工	8,900	430.00	3,827,000	
三洋工業	800	1,916.00	1,532,800	
岡 部	13,700	806.00	11,042,200	貸付株式数 5,400株
ジーテクト	8,200	1,390.00	11,398,000	貸付株式数 3,300株
東 プ レ	12,500	1,304.00	16,300,000	
高周波熱錬	12,900	446.00	5,753,400	
東京製綱	4,700	747.00	3,510,900	
サンコール	4,900	416.00	2,038,400	
モリテックスチル	5,400	495.00	2,673,000	貸付株式数 2,100株
パイオラックス	9,900	1,561.00	15,453,900	貸付株式数 3,900株
エイチワン	6,400	700.00	4,480,000	
日本発条	71,000	633.00	44,943,000	
中央発條	700	2,964.00	2,074,800	
アドバネクス	900	1,290.00	1,161,000	
三浦工業	28,800	5,490.00	158,112,000	
タ ク マ	22,700	1,793.00	40,701,100	
テクノプロ・ホールディング グ	12,900	8,800.00	113,520,000	
アトラ	1,700	268.00	455,600	貸付株式数 500株
インターワークス	1,600	323.00	516,800	
アイ・アールジャパンHD	2,600	16,650.00	43,290,000	貸付株式数 1,000株
K e e P e r 技研	4,800	2,105.00	10,104,000	
ファーストロジック	1,400	818.00	1,145,200	貸付株式数 400株
三機サービス	1,300	999.00	1,298,700	
G u n o s y	4,000	751.00	3,004,000	貸付株式数 100株
デザインワン・ジャパン	1,500	224.00	336,000	貸付株式数 600株
イー・ガーディアン	3,200	3,170.00	10,144,000	
リブセンス	4,400	251.00	1,104,400	
ジャパンマテリアル	19,900	1,451.00	28,874,900	貸付株式数 7,900株
ベクトル	8,200	920.00	7,544,000	貸付株式数 3,200株
ウチヤマホールディングス	3,200	298.00	953,600	



チャームケアコーポレーション	5,500	1,349.00	7,419,500	
キャリアリンク	2,300	1,948.00	4,480,400	貸付株式数 800株
I B J	4,500	767.00	3,451,500	貸付株式数 1,200株
アサンテ	2,700	1,407.00	3,798,900	貸付株式数 1,000株
N・フィールド	4,300	785.00	3,375,500	貸付株式数 1,700株
バリューHR	2,600	1,856.00	4,825,600	貸付株式数 1,000株
M & Aキャピタルパートナー	5,300	6,300.00	33,390,000	貸付株式数 2,000株 (1,700株)
ライドオンエクスプレスHD	2,500	2,021.00	5,052,500	貸付株式数 900株
E R Iホールディングス	1,800	692.00	1,245,600	貸付株式数 600株
アビスト	900	2,997.00	2,697,300	貸付株式数 300株 (300株)
シグマクシス	4,400	1,640.00	7,216,000	貸付株式数 1,700株
ウィルグループ	4,300	979.00	4,209,700	貸付株式数 1,600株
エスクローAJ	9,000	331.00	2,979,000	
リクルートホールディングス	460,500	4,400.00	2,026,200,000	
エラン	4,200	3,190.00	13,398,000	
ツガミ	13,900	1,650.00	22,935,000	貸付株式数 5,500株
オークマ	7,800	6,020.00	46,956,000	
芝浦機械	7,600	2,301.00	17,487,600	貸付株式数 3,000株
アマダ	82,500	1,006.00	82,995,000	
アイダエンジニア	17,400	884.00	15,381,600	
滝澤鉄工所	2,000	1,003.00	2,006,000	貸付株式数 100株
F U J I	28,700	2,529.00	72,582,300	
牧野フライス	7,800	4,200.00	32,760,000	
オーエスジー	31,500	1,887.00	59,440,500	貸付株式数 1,200株
ダイジェット	700	1,412.00	988,400	
旭ダイヤモンド	17,600	424.00	7,462,400	
D M G 森精機	42,200	1,542.00	65,072,400	貸付株式数 700株
ソディック	14,900	833.00	12,411,700	
ディスコ	9,000	33,250.00	299,250,000	
日東工器	3,700	1,664.00	6,156,800	
日進工具	2,600	2,931.00	7,620,600	貸付株式数 700株
パンチ工業	5,900	440.00	2,596,000	
富士ダイス	2,900	664.00	1,925,600	貸付株式数 1,100株
土木管理総合試験	2,900	360.00	1,044,000	貸付株式数 100株
ネットマーケティング	2,300	579.00	1,331,700	貸付株式数 900株

日本郵政	525,500	772.70	406,053,850	
ベルシステム24HLDGS	10,900	1,603.00	17,472,700	
鎌倉新書	4,900	1,072.00	5,252,800	貸付株式数 1,900株 (400株)
SMN	1,300	768.00	998,400	
一蔵	700	368.00	257,600	貸付株式数 200株
LITALICO	2,200	3,550.00	7,810,000	
グローバルキッズCOMP	1,000	922.00	922,000	
エアトリ	3,300	1,227.00	4,049,100	貸付株式数 1,300株 (200株)
アトラエ	1,900	3,070.00	5,833,000	貸付株式数 700株
ストライク	2,400	6,320.00	15,168,000	貸付株式数 900株
ソラスト	17,900	1,517.00	27,154,300	
セラク	2,100	2,479.00	5,205,900	貸付株式数 800株
インソース	2,800	3,690.00	10,332,000	貸付株式数 1,000株 (900株)
豊田自動織機	54,400	7,540.00	410,176,000	貸付株式数 21,900株
豊和工業	3,900	810.00	3,159,000	
OKK	2,700	384.00	1,036,800	
石川製作所	1,700	1,689.00	2,871,300	貸付株式数 600株 (600株)
東洋機械金属	4,600	405.00	1,863,000	
津田駒工業	1,200	906.00	1,087,200	貸付株式数 400株
エンシュウ	1,500	915.00	1,372,500	
島精機製作所	10,500	1,741.00	18,280,500	貸付株式数 600株
オプトラン	7,900	2,184.00	17,253,600	
NCホールディングス	2,000	604.00	1,208,000	
イワキポンプ	4,200	801.00	3,364,200	貸付株式数 500株
フリーー	6,500	1,181.00	7,676,500	貸付株式数 2,400株
ヤマシンフィルタ	14,600	1,066.00	15,563,600	貸付株式数 5,800株
日阪製作所	8,400	838.00	7,039,200	
やまびこ	13,000	1,414.00	18,382,000	貸付株式数 700株
平田機工	3,100	8,340.00	25,854,000	貸付株式数 1,200株
ペガサスマシン製造	6,600	293.00	1,933,800	
マルマエ	2,700	1,072.00	2,894,400	貸付株式数 900株
タツモ	3,000	1,506.00	4,518,000	
ナプテスコ	39,200	4,310.00	168,952,000	
三井海洋開発	7,100	1,770.00	12,567,000	
レオン自動機	6,600	1,107.00	7,306,200	

S M C	21,100	66,320.00	1,399,352,000	
ホソカワミクロン	2,400	6,330.00	15,192,000	
ユニオンツール	2,400	3,065.00	7,356,000	貸付株式数 100株
オイレス工業	8,600	1,594.00	13,708,400	
日精エーエスビー	2,000	5,700.00	11,400,000	
サト - ホールディングス	9,600	2,023.00	19,420,800	
技研製作所	5,900	4,100.00	24,190,000	
日本エアーテック	2,300	1,589.00	3,654,700	貸付株式数 800株
カワタ	1,900	916.00	1,740,400	
日精樹脂工業	5,600	862.00	4,827,200	貸付株式数 2,200株
オカダアイヨン	2,000	997.00	1,994,000	貸付株式数 800株
ワイエイシイホールディングス	2,800	865.00	2,422,000	
小松製作所	304,800	2,540.00	774,192,000	貸付株式数 100株
住友重機械	38,600	2,253.00	86,965,800	貸付株式数 15,500株
日立建機	27,200	2,891.00	78,635,200	
日工	9,200	663.00	6,099,600	
巴工業	2,700	1,919.00	5,181,300	貸付株式数 300株
井関農機	6,800	1,369.00	9,309,200	貸付株式数 1,300株
T O W A	6,800	1,814.00	12,335,200	貸付株式数 100株
丸山製作所	1,700	1,356.00	2,305,200	
北川鉄工所	3,000	1,279.00	3,837,000	
シンニッタン	10,400	183.00	1,903,200	
ローツェ	3,000	5,420.00	16,260,000	貸付株式数 1,100株
タカキタ	2,500	691.00	1,727,500	貸付株式数 500株
クボタ	357,000	2,070.50	739,168,500	貸付株式数 18,600株
荏原実業	1,700	3,670.00	6,239,000	
東洋エンジニア	8,700	351.00	3,053,700	
三菱化工機	2,300	2,245.00	5,163,500	
月島機械	12,300	1,201.00	14,772,300	
帝国電機製作所	5,600	1,245.00	6,972,000	
東京機械	3,100	265.00	821,500	貸付株式数 1,200株
新東工業	16,000	711.00	11,376,000	
渋谷工業	5,900	3,650.00	21,535,000	
アイチ コーポレーション	11,600	928.00	10,764,800	
小森コーポレーション	17,200	713.00	12,263,600	
鶴見製作所	5,100	1,711.00	8,726,100	
住友精密	1,000	2,003.00	2,003,000	
日本ギア工業	2,400	314.00	753,600	貸付株式数 700株
酒井重工業	1,200	2,485.00	2,982,000	貸付株式数 300株

荏原製作所	27,900	3,340.00	93,186,000	
石井鉄工所	900	2,790.00	2,511,000	
西島製作所	6,800	840.00	5,712,000	
北越工業	7,000	1,041.00	7,287,000	貸付株式数 100株
ダイキン工業	85,700	23,665.00	2,028,090,500	
オルガノ	2,400	5,930.00	14,232,000	
ト - ヨ - カネツ	3,000	2,131.00	6,393,000	
栗田工業	36,500	3,850.00	140,525,000	
椿本チエイン	9,500	2,529.00	24,025,500	
大同工業	3,200	676.00	2,163,200	
日 機 装	20,600	995.00	20,497,000	
木村化工機	5,700	503.00	2,867,100	貸付株式数 300株
レイズネクスト	11,200	1,111.00	12,443,200	
アネスト岩田	10,500	987.00	10,363,500	貸付株式数 2,500株
ダイフク	34,400	12,100.00	416,240,000	貸付株式数 11,600株
サムコ	1,800	3,565.00	6,417,000	貸付株式数 700株
加藤製作所	3,700	1,016.00	3,759,200	
油研工業	1,100	1,514.00	1,665,400	
タダノ	32,800	823.00	26,994,400	貸付株式数 12,700株
フジテック	24,600	2,132.00	52,447,200	
C K D	18,500	2,225.00	41,162,500	
キトー	5,200	1,586.00	8,247,200	
平和	18,600	1,421.00	26,430,600	
理想科学工業	6,000	1,291.00	7,746,000	
S A N K Y O	15,000	2,568.00	38,520,000	貸付株式数 1,900株
日本金銭機械	7,300	541.00	3,949,300	貸付株式数 2,900株
マースグループH L D G S	4,100	1,598.00	6,551,800	
フクシマガリレイ	4,200	4,395.00	18,459,000	貸付株式数 200株
オーイズミ	2,800	399.00	1,117,200	
ダイコク電機	3,100	881.00	2,731,100	
竹内製作所	11,400	2,457.00	28,009,800	
ア マ ノ	17,800	2,454.00	43,681,200	貸付株式数 7,000株
J U K I	9,300	542.00	5,040,600	
サンデンホールディングス	9,000	372.00	3,348,000	貸付株式数 2,700株
蛇の目ミシン	6,000	854.00	5,124,000	
ブラザー工業	82,100	2,000.00	164,200,000	
マックス	10,400	1,400.00	14,560,000	
モリタホールディングス	11,800	1,784.00	21,051,200	
グローリー	17,500	2,100.00	36,750,000	
新晃工業	6,300	1,718.00	10,823,400	貸付株式数 2,200株

大和冷機工業	9,800	1,026.00	10,054,800	
セガサミーホールディングス	66,600	1,467.00	97,702,200	貸付株式数 8,000株
日本ピストンリング	2,400	935.00	2,244,000	
リケン	3,100	2,215.00	6,866,500	貸付株式数 400株
T P R	9,100	1,308.00	11,902,800	貸付株式数 3,300株
ツバキ・ナカシマ	13,300	881.00	11,717,300	
ホシザキ	21,200	10,330.00	218,996,000	
大豊工業	5,400	608.00	3,283,200	
日本精工	126,600	845.00	106,977,000	
N T N	157,300	218.00	34,291,400	
ジェイテクト	64,500	811.00	52,309,500	
不二越	6,200	4,310.00	26,722,000	貸付株式数 1,900株
ミネベアミツミ	124,800	2,174.00	271,315,200	
日本トムソン	19,900	328.00	6,527,200	
T H K	41,400	3,225.00	133,515,000	貸付株式数 15,800株
ユーシン精機	5,300	787.00	4,171,100	
前澤給装工業	2,400	2,310.00	5,544,000	
イーグル工業	8,500	903.00	7,675,500	
前澤工業	4,000	458.00	1,832,000	
日本ピラ - 工業	6,800	1,621.00	11,022,800	
キッツ	27,500	563.00	15,482,500	貸付株式数 1,100株
日立	323,100	3,966.00	1,281,414,600	
三菱電機	672,100	1,533.50	1,030,665,350	
富士電機	40,600	3,710.00	150,626,000	
東洋電機製造	2,400	1,105.00	2,652,000	貸付株式数 500株
安川電機	72,400	5,030.00	364,172,000	貸付株式数 29,300株
シンフォニアテクノロジー	8,700	1,318.00	11,466,600	
明電舎	12,400	1,818.00	22,543,200	
オリジン	1,800	1,371.00	2,467,800	貸付株式数 100株
山洋電気	3,300	5,160.00	17,028,000	
デンヨー	5,800	2,089.00	12,116,200	貸付株式数 500株
ベイカレントコンサルティング	3,900	17,380.00	67,782,000	貸付株式数 1,500株
ORCHESTRA HDGS	1,600	2,530.00	4,048,000	貸付株式数 500株
アイモバイル	2,200	1,303.00	2,866,600	貸付株式数 800株
キャリアインデックス	2,800	726.00	2,032,800	貸付株式数 1,000株
MS - Japan	2,200	792.00	1,742,400	貸付株式数 800株

船場	1,100	905.00	995,500	貸付株式数	200株
グレイステクノロジー	3,000	8,330.00	24,990,000		
ジャパンエレベーターSHD	7,100	4,865.00	34,541,500		
フルテック	900	1,441.00	1,296,900	貸付株式数	300株
グリーンズ	1,800	458.00	824,400	貸付株式数	600株
ツナググループHLDGS	900	354.00	318,600	貸付株式数	300株
GAMEWITH	1,700	576.00	979,200	貸付株式数	600株
ソウルドアウト	1,300	1,555.00	2,021,500	貸付株式数	500株
MS&CONSULTING	1,000	620.00	620,000	貸付株式数	300株
ミダック	800	3,385.00	2,708,000		
日総工産	4,500	752.00	3,384,000		
キュービーネットHLDGS	2,900	1,587.00	4,602,300	貸付株式数	1,000株
RPAホールディングス	4,800	673.00	3,230,400	貸付株式数	1,900株
三桜工業	8,600	661.00	5,684,600	貸付株式数	3,400株
マキタ	87,700	5,400.00	473,580,000	貸付株式数	3,200株
東芝テック	8,500	3,750.00	31,875,000		
芝浦メカトロニクス	1,200	3,885.00	4,662,000		
マブチモーター	18,700	4,660.00	87,142,000		
日本電産	161,900	13,305.00	2,154,079,500	貸付株式数	5,000株
ユーエムシーエレクトロニクス	4,200	409.00	1,717,800	貸付株式数	1,600株
トレックス・セミコンダクター	3,900	1,305.00	5,089,500		
東光高岳	3,700	1,332.00	4,928,400		
ダブル・スコープ	10,700	786.00	8,410,200	貸付株式数	4,200株
宮越ホールディングス	2,600	685.00	1,781,000	貸付株式数	900株
ダイヘン	7,400	4,540.00	33,596,000	貸付株式数	300株
ヤーマン	11,100	2,324.00	25,796,400	貸付株式数	1,000株
JVCケンウッド	55,100	141.00	7,769,100		
ミマキエンジニアリング	6,000	510.00	3,060,000	貸付株式数	2,100株
I-PEX	2,800	1,965.00	5,502,000	貸付株式数	500株 (500株)
日新電機	15,700	1,165.00	18,290,500		
大崎電気	13,300	552.00	7,341,600	貸付株式数	5,300株
オムロン	60,300	9,430.00	568,629,000		
日東工業	10,000	1,856.00	18,560,000		
IDEC	9,800	1,845.00	18,081,000	貸付株式数	3,900株

正興電機製作所	1,700	2,146.00	3,648,200	貸付株式数	600株
不二電機工業	1,000	1,301.00	1,301,000	貸付株式数	200株 (200株)
ジーエス・ユアサ コーポ	22,600	2,524.00	57,042,400		
サクサホールディングス	1,500	1,441.00	2,161,500		
メルコホールディングス	2,300	3,060.00	7,038,000		
テクノメディカ	1,500	1,491.00	2,236,500	貸付株式数	300株
ダイヤモンドエレクトリク HD	1,400	1,292.00	1,808,800		
日本電気	81,600	5,630.00	459,408,000		
富士通	64,800	14,505.00	939,924,000		
沖電気	27,700	906.00	25,096,200		
岩崎通信機	3,000	850.00	2,550,000		
電気興業	3,300	2,900.00	9,570,000	貸付株式数	800株
サンケン電気	7,400	3,815.00	28,231,000		
ナカヨ	1,300	1,475.00	1,917,500		
アイホン	3,800	1,539.00	5,848,200		
ルネサスエレクトロニクス	287,900	928.00	267,171,200		
セイコーエプソン	83,600	1,557.00	130,165,200		
ワコム	45,600	965.00	44,004,000		
アルバック	12,400	4,220.00	52,328,000		
アクセル	2,700	807.00	2,178,900		
E I Z O	5,300	3,630.00	19,239,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	50.00	3,085,000		
日本信号	17,400	931.00	16,199,400		
京三製作所	15,800	421.00	6,651,800		
能美防災	8,900	2,263.00	20,140,700		
ホーチキ	4,900	1,246.00	6,105,400		
星和電機	3,500	614.00	2,149,000		
エレコム	7,600	4,775.00	36,290,000		
パナソニック	768,700	1,112.50	855,178,750	貸付株式数	309,300株
シャープ	78,200	1,400.00	109,480,000	貸付株式数	31,300株
アンリツ	43,500	2,379.00	103,486,500	貸付株式数	17,500株
富士通ゼネラル	18,500	3,165.00	58,552,500		
ソニ	421,400	9,704.00	4,089,265,600		
T D K	32,500	14,720.00	478,400,000		
帝国通信工業	3,000	1,168.00	3,504,000		
タムラ製作所	22,700	535.00	12,144,500		
アルプスアルパイン	59,800	1,308.00	78,218,400		
池上通信機	2,100	949.00	1,992,900		

日本電波工業	6,300	511.00	3,219,300	貸付株式数	2,400株
鈴木	3,300	897.00	2,960,100		
日本トリム	900	4,065.00	3,658,500		
ローランド ディー . ジー .	3,700	1,707.00	6,315,900	貸付株式数	1,400株
フオスタ - 電機	7,100	1,118.00	7,937,800		
S M K	1,700	3,045.00	5,176,500	貸付株式数	100株
ヨコオ	4,400	2,428.00	10,683,200	貸付株式数	1,700株
ティアック	4,900	106.00	519,400	貸付株式数	1,300株
ホシデン	18,600	876.00	16,293,600		
ヒロセ電機	10,400	14,760.00	153,504,000	貸付株式数	4,100株
日本航空電子	15,500	1,400.00	21,700,000		
T O A	7,200	870.00	6,264,000		
マクセルホールディングス	14,600	1,200.00	17,520,000		
古野電気	8,700	1,188.00	10,335,600		
ユニデンホールディングス	1,900	2,389.00	4,539,100	貸付株式数	200株
スミダコーポレーション	5,200	1,052.00	5,470,400		
アイコム	3,800	2,658.00	10,100,400	貸付株式数	100株
リオン	2,800	3,205.00	8,974,000		
本多通信工業	5,800	473.00	2,743,400		
船井電機	6,800	420.00	2,856,000		
横河電機	61,700	1,844.00	113,774,800		
新電元工業	2,400	2,346.00	5,630,400		
アズビル	42,500	4,685.00	199,112,500		
東亜ディーケーケー	3,300	851.00	2,808,300	貸付株式数	1,300株
日本光電工業	27,800	3,300.00	91,740,000		
チ ノ ー	2,300	1,424.00	3,275,200	貸付株式数	700株
共和電業	6,900	402.00	2,773,800		
日本電子材料	2,700	1,567.00	4,230,900	貸付株式数	1,000株
堀場製作所	13,300	5,600.00	74,480,000	貸付株式数	3,700株
アドバンテスト	50,100	7,260.00	363,726,000		
小野測器	2,700	522.00	1,409,400		
エスベック	6,000	1,940.00	11,640,000		
キーエンス	61,000	53,290.00	3,250,690,000	貸付株式数	5,300株
日置電機	3,300	3,925.00	12,952,500	貸付株式数	800株
シスメックス	48,100	10,930.00	525,733,000		
日本マイクロニクス	11,800	985.00	11,623,000		
メガチップス	6,300	2,857.00	17,999,100		
O B A R A G R O U P	4,000	3,390.00	13,560,000	貸付株式数	1,600株



IMAGICA GROUP	5,700	403.00	2,297,100	貸付株式数 2,200株 (2,000株)
澤藤電機	900	1,813.00	1,631,700	貸付株式数 300株
デンソー	148,000	4,929.00	729,492,000	
原田工業	3,200	851.00	2,723,200	貸付株式数 1,200株
コーセル	9,000	1,105.00	9,945,000	
イリソ電子工業	5,700	4,225.00	24,082,500	貸付株式数 2,200株
オプテックスグループ	11,100	1,887.00	20,945,700	
千代田インテグレ	2,900	1,527.00	4,428,300	
アイ・オー・データ	2,300	969.00	2,228,700	貸付株式数 800株
レーザーテック	29,600	11,000.00	325,600,000	
スタンレー電気	47,200	3,070.00	144,904,000	
岩崎電気	2,600	1,386.00	3,603,600	
ウシオ電機	37,300	1,315.00	49,049,500	
岡谷電機	5,200	428.00	2,225,600	
ヘリオステクノH	6,300	302.00	1,902,600	貸付株式数 200株
エノモト	2,000	1,272.00	2,544,000	貸付株式数 800株
日本セラミック	6,900	2,867.00	19,782,300	
遠藤照明	3,300	565.00	1,864,500	
古河電池	4,800	1,696.00	8,140,800	貸付株式数 1,900株
双信電機	3,300	498.00	1,643,400	貸付株式数 1,200株
山一電機	4,900	1,513.00	7,413,700	
函 研	4,400	2,642.00	11,624,800	貸付株式数 300株
日本電子	13,300	4,095.00	54,463,500	
カ シ オ	59,700	1,875.00	111,937,500	貸付株式数 2,000株
ファナック	63,300	25,365.00	1,605,604,500	
日本シイエムケイ	15,900	401.00	6,375,900	貸付株式数 6,300株
エンプラス	3,500	2,829.00	9,901,500	
大真空	2,500	2,146.00	5,365,000	
ロ ー ム	28,000	8,710.00	243,880,000	
浜松ホトニクス	48,300	5,870.00	283,521,000	貸付株式数 4,300株
三井ハイテック	7,500	2,879.00	21,592,500	貸付株式数 2,600株
新光電気工業	22,700	2,311.00	52,459,700	
京 セ ラ	94,600	5,963.00	564,099,800	
協栄産業	700	1,292.00	904,400	
太陽誘電	30,000	4,735.00	142,050,000	
村田製作所	197,600	9,129.00	1,803,890,400	
双葉電子工業	10,800	865.00	9,342,000	
日東電工	46,400	8,640.00	400,896,000	
北陸電気工業	2,700	915.00	2,470,500	

東海理化電機	17,800	1,597.00	28,426,600	
ニチコン	22,900	1,094.00	25,052,600	
日本ケミコン	5,100	1,512.00	7,711,200	
K O A	10,200	1,431.00	14,596,200	
三井E & S H D	21,700	341.00	7,399,700	
日立造船	53,500	402.00	21,507,000	
三菱重工業	112,700	2,351.50	265,014,050	
川崎重工業	52,500	1,515.00	79,537,500	貸付株式数 17,400株
I H I	48,600	1,551.00	75,378,600	貸付株式数 19,500株
名村造船所	22,200	151.00	3,352,200	貸付株式数 8,700株
サノヤスホールディングス	9,400	156.00	1,466,400	
スプリックス	2,100	842.00	1,768,200	貸付株式数 500株
マネジメントソリューションズ	2,800	1,508.00	4,222,400	貸付株式数 1,100株
プロレド・パートナーズ	900	4,870.00	4,383,000	貸付株式数 300株
A N D F A C T O R Y	500	791.00	395,500	貸付株式数 200株
ギークス	600	1,202.00	721,200	貸付株式数 200株
カーブスホールディングス	17,800	722.00	12,851,600	貸付株式数 7,100株
フォーラムエンジニアリング	3,300	816.00	2,692,800	
日本車輛	2,500	2,482.00	6,205,000	貸付株式数 900株
三菱ロジスネクスト	9,000	1,108.00	9,972,000	貸付株式数 2,000株
近畿車輛	1,000	1,303.00	1,303,000	貸付株式数 200株
F P G	20,600	497.00	10,238,200	貸付株式数 8,200株 (200株)
島根銀行	1,500	637.00	955,500	
じもとホールディングス	4,500	897.00	4,036,500	
全国保証	18,800	4,775.00	89,770,000	貸付株式数 6,800株
めぶきフィナンシャルG	344,900	214.00	73,808,600	
東京きらぼしF G	9,000	1,140.00	10,260,000	
九州フィナンシャルG	145,000	510.00	73,950,000	
かんぼ生命保険	23,400	1,740.00	40,716,000	
ゆうちょ銀行	187,100	822.00	153,796,200	貸付株式数 75,800株
富山第一銀行	15,700	292.00	4,584,400	
コンコルディア・フィナンシャル	378,600	371.00	140,460,600	
ジェイリース	2,300	672.00	1,545,600	貸付株式数 700株
西日本フィナンシャルH D	44,300	723.00	32,028,900	貸付株式数 1,500株
マーキュリアインベストメント	2,800	656.00	1,836,800	貸付株式数 1,100株

イントラスト	2,500	898.00	2,245,000	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	2,800	1,139.00	3,189,200		
C a s a	2,300	1,280.00	2,944,000	貸付株式数	800株
アルヒ	10,700	1,921.00	20,554,700	貸付株式数	3,800株
プレミアグループ	3,600	2,245.00	8,082,000		
日産自動車	793,300	492.50	390,700,250		
いすゞ自動車	195,000	1,018.00	198,510,000		
トヨタ自動車	750,500	6,999.00	5,252,749,500		
日野自動車	84,100	905.00	76,110,500		
三菱自動車工業	250,500	188.00	47,094,000	貸付株式数	100,900株
エフテック	4,800	568.00	2,726,400	貸付株式数	1,800株
レシップホールディングス	2,600	543.00	1,411,800		
G M B	1,500	634.00	951,000		
ファルテック	1,400	587.00	821,800		
武蔵精密工業	15,100	1,539.00	23,238,900		
日産車体	13,100	902.00	11,816,200	貸付株式数	3,900株
新明和工業	18,300	826.00	15,115,800		
極東開発工業	12,500	1,381.00	17,262,500		
トピー工業	5,600	1,078.00	6,036,800	貸付株式数	1,100株
ティラド	2,400	1,279.00	3,069,600		
タチエス	11,100	1,125.00	12,487,500		
N O K	36,100	1,152.00	41,587,200		
フタバ産業	18,900	505.00	9,544,500	貸付株式数	7,400株
K Y B	7,600	2,518.00	19,136,800	貸付株式数	2,500株
市光工業	10,200	528.00	5,385,600	貸付株式数	4,000株
大同メタル工業	13,100	467.00	6,117,700		
プレス工業	33,600	303.00	10,180,800		
ミクニ	8,400	277.00	2,326,800	貸付株式数	2,200株
太平洋工業	14,300	1,073.00	15,343,900	貸付株式数	4,400株
河西工業	9,200	347.00	3,192,400	貸付株式数	3,400株
アイシン精機	55,400	3,095.00	171,463,000		
マ ッ ダ	198,200	617.00	122,289,400		
今仙電機製作所	6,100	872.00	5,319,200	貸付株式数	2,400株
本田技研	529,500	2,871.50	1,520,459,250		
スズキ	133,400	5,604.00	747,573,600		
S U B A R U	208,800	2,073.00	432,842,400		
安永	3,300	1,150.00	3,795,000	貸付株式数	1,300株
ヤマハ発動機	94,300	2,010.00	189,543,000		
小糸製作所	40,300	6,280.00	253,084,000	貸付株式数	7,300株
T B K	7,900	452.00	3,570,800		

エクセディ	9,300	1,234.00	11,476,200	
ミツバ	12,400	513.00	6,361,200	
豊田合成	21,800	2,832.00	61,737,600	
愛三工業	10,600	443.00	4,695,800	
盟和産業	1,000	873.00	873,000	貸付株式数 200株
日本プラスト	5,000	450.00	2,250,000	
ヨロズ	6,400	1,130.00	7,232,000	貸付株式数 2,500株
エフ・シー・シー	11,200	1,992.00	22,310,400	貸付株式数 4,200株
新家工業	1,500	1,152.00	1,728,000	
シマノ	25,200	24,740.00	623,448,000	貸付株式数 1,000株
テイ・エス テック	15,700	3,050.00	47,885,000	貸付株式数 5,500株
関西みらいFG	39,500	522.00	20,619,000	貸付株式数 400株
33FG	6,200	1,281.00	7,942,200	
第四北越フィナンシャルG	11,500	2,364.00	27,186,000	貸付株式数 600株
ひろぎんHLDGS	98,300	581.00	57,112,300	貸付株式数 30,000株
ジャムコ	3,300	621.00	2,049,300	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
小野建	5,500	1,215.00	6,682,500	貸付株式数 2,200株
はるやまHLDGS	3,100	690.00	2,139,000	貸付株式数 1,000株
南陽	1,400	1,755.00	2,457,000	
ノジマ	12,000	2,730.00	32,760,000	
佐島電機	4,500	773.00	3,478,500	貸付株式数 1,600株
カップ・クリエイト	9,400	1,407.00	13,225,800	貸付株式数 3,500株
エコートレーディング	1,500	618.00	927,000	貸付株式数 600株 (100株)
伯東	4,100	1,056.00	4,329,600	
コンドーテック	5,200	1,016.00	5,283,200	貸付株式数 1,800株
中山福	3,700	502.00	1,857,400	
ライトオン	4,900	618.00	3,028,200	貸付株式数 1,800株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,700	2,702.00	23,507,400	
ジーンズメイト	2,700	336.00	907,200	貸付株式数 900株 (200株)
三菱食品	7,200	2,758.00	19,857,600	
良品計画	88,100	2,147.00	189,150,700	
三城ホールディングス	6,900	291.00	2,007,900	貸付株式数 2,700株
松田産業	4,900	1,721.00	8,432,900	
第一興商	9,900	3,370.00	33,363,000	
メディパルHD	71,400	1,963.00	140,158,200	
アドヴァン	10,300	1,301.00	13,400,300	

S P K	2,800	1,248.00	3,494,400	貸付株式数	1,000株
萩原電気H L D G S	2,500	2,416.00	6,040,000		
アルビス	2,500	2,556.00	6,390,000	貸付株式数	600株
アズワン	4,300	16,040.00	68,972,000		
スズデン	2,300	1,200.00	2,760,000	貸付株式数	800株
尾家産業	1,900	1,476.00	2,804,400	貸付株式数	700株
シモジマ	4,100	1,329.00	5,448,900	貸付株式数	900株
ドウシシャ	6,300	2,009.00	12,656,700		
小津産業	1,500	1,840.00	2,760,000		
コナカ	7,700	258.00	1,986,600	貸付株式数	3,000株
高速	4,000	1,576.00	6,304,000		
ハウス ローゼ	800	1,667.00	1,333,600		
G - 7ホールディングス	3,900	2,436.00	9,500,400		
たけびし	2,400	1,498.00	3,595,200	貸付株式数	900株
イオン北海道	8,600	956.00	8,221,600	貸付株式数	1,400株
コジマ	11,400	755.00	8,607,000	貸付株式数	4,300株
ヒマラヤ	2,200	906.00	1,993,200		
コーナン商事	9,500	3,230.00	30,685,000	貸付株式数	300株
ネットワンシステムズ	25,200	3,720.00	93,744,000	貸付株式数	10,100株
エコス	2,400	2,304.00	5,529,600		
ワタミ	7,900	887.00	7,007,300	貸付株式数	3,000株
マルシェ	1,500	505.00	757,500	貸付株式数	600株
リックス	1,500	1,650.00	2,475,000	貸付株式数	500株
システムソフト	20,300	92.00	1,867,600		
パンパシフィックHD	145,800	2,467.00	359,688,600		
丸文	5,600	487.00	2,727,200		
西松屋チェーン	14,700	1,572.00	23,108,400	貸付株式数	5,600株
ゼンショーホールディングス	31,700	2,610.00	82,737,000		
ハピネット	5,500	1,426.00	7,843,000		
幸楽苑ホールディングス	4,200	1,774.00	7,450,800	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,400	914.00	1,279,600	貸付株式数	500株
橋本総業H L D G S	1,300	2,317.00	3,012,100		
日本ライフライン	19,700	1,438.00	28,328,600		
サイゼリヤ	10,000	1,790.00	17,900,000	貸付株式数	500株
タカショー	3,900	805.00	3,139,500	貸付株式数	1,500株
V Tホールディングス	27,600	375.00	10,350,000		
マルカ	2,300	1,980.00	4,554,000	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	5,700	3,200.00	18,240,000		

魚力	1,900	1,704.00	3,237,600		
I D O M	18,000	572.00	10,296,000	貸付株式数	5,100株
日本エム・ディ・エム	3,900	2,345.00	9,145,500	貸付株式数	1,500株
ポプラ	1,800	408.00	734,400	貸付株式数	700株
フジ・コーポレーション	1,800	2,331.00	4,195,800	貸付株式数	700株 (700株)
ユナイテッドアローズ	7,000	1,463.00	10,241,000	貸付株式数	2,800株
進和	4,000	2,157.00	8,628,000	貸付株式数	1,400株
エスケイジャパン	1,600	451.00	721,600	貸付株式数	500株
ダイトロン	2,800	1,475.00	4,130,000	貸付株式数	1,000株
ハイデイ日高	9,600	1,693.00	16,252,800	貸付株式数	2,700株
シークス	8,500	1,566.00	13,311,000	貸付株式数	1,600株
京都きもの友禅	3,900	226.00	881,400	貸付株式数	1,600株
コロワイド	22,100	1,542.00	34,078,200	貸付株式数	8,800株 (300株)
ピーシーデポコーポ	8,800	597.00	5,253,600	貸付株式数	3,500株
田中商事	2,100	696.00	1,461,600		
オーハシテクニカ	3,500	1,350.00	4,725,000		
壱番屋	4,600	5,120.00	23,552,000	貸付株式数	1,800株
白銅	2,300	1,433.00	3,295,900	貸付株式数	800株
トップカルチャー	2,400	359.00	861,600		
P L A N T	1,600	774.00	1,238,400	貸付株式数	600株
スギホールディングス	13,300	6,930.00	92,169,000		
ダイコー通産	400	1,403.00	561,200	貸付株式数	100株
薬王堂ホールディングス	2,900	2,401.00	6,962,900		
島津製作所	80,400	3,755.00	301,902,000		
J M S	5,700	939.00	5,352,300		
クボテック	1,900	369.00	701,100	貸付株式数	600株
長野計器	5,000	785.00	3,925,000		
ブイ・テクノロジー	3,200	5,270.00	16,864,000	貸付株式数	1,200株
スター精密	10,500	1,471.00	15,445,500		
東京計器	4,200	893.00	3,750,600	貸付株式数	200株
愛知時計	900	4,405.00	3,964,500		
インターアクション	3,600	1,880.00	6,768,000	貸付株式数	1,400株
オーバル	6,400	229.00	1,465,600	貸付株式数	1,200株
東京精密	12,300	4,605.00	56,641,500		
マニー	26,800	2,558.00	68,554,400		
ニコン	102,700	649.00	66,652,300		
トプコン	34,000	1,327.00	45,118,000	貸付株式数	13,600株
オリンパス	372,300	2,256.50	840,094,950		

理研計器	6,000	2,798.00	16,788,000	
S C R E E Nホールディングス	11,700	6,960.00	81,432,000	
キヤノン電子	6,100	1,453.00	8,863,300	貸付株式数 700株
タムロン	5,500	1,599.00	8,794,500	
H O Y A	133,500	13,910.00	1,856,985,000	
シ ー ド	2,900	598.00	1,734,200	貸付株式数 1,100株
ノーリツ鋼機	4,600	2,228.00	10,248,800	貸付株式数 1,100株
エー・アンド・デイ	6,100	910.00	5,551,000	
朝日インテック	76,300	3,825.00	291,847,500	
キヤノン	334,300	1,853.50	619,625,050	貸付株式数 141,500株
リ コ ー	172,100	697.00	119,953,700	貸付株式数 68,900株
シチズン時計	79,600	275.00	21,890,000	貸付株式数 31,600株
リズム	2,100	637.00	1,337,700	
大研医器	5,100	512.00	2,611,200	
メニコン	9,600	6,480.00	62,208,000	貸付株式数 2,400株
シンシア	900	383.00	344,700	
中本パックス	1,600	1,587.00	2,539,200	貸付株式数 600株
スノーピーク	3,500	1,565.00	5,477,500	貸付株式数 1,400株
パラマウントベッドHD	7,100	4,265.00	30,281,500	
トランザクション	4,000	938.00	3,752,000	貸付株式数 1,400株
粧美堂	2,000	392.00	784,000	貸付株式数 300株
ニホンフラッシュ	6,300	1,364.00	8,593,200	
前田工織	7,500	2,597.00	19,477,500	貸付株式数 2,300株
永大産業	8,600	290.00	2,494,000	
アートネイチャー	7,200	669.00	4,816,800	
バンダイナムコHLDGS	69,600	9,530.00	663,288,000	
アイフィスジャパン	1,800	792.00	1,425,600	貸付株式数 600株
共立印刷	11,300	124.00	1,401,200	
S H O E I	6,000	3,605.00	21,630,000	
フランスベッドHLDGS	9,200	851.00	7,829,200	貸付株式数 3,600株
マーベラス	10,000	907.00	9,070,000	
パイロットコーポレーション	11,500	2,959.00	34,028,500	
萩原工業	3,700	1,533.00	5,672,100	
エイベックス	11,500	942.00	10,833,000	
トッパン・フォームズ	14,400	998.00	14,371,200	
フジシールインターナショナル	15,200	1,937.00	29,442,400	
タカラトミー	30,300	933.00	28,269,900	

廣濟堂	4,900	631.00	3,091,900	
エステールホールディングス	2,000	617.00	1,234,000	貸付株式数 700株
レック	7,200	1,548.00	11,145,600	
タカノ	2,600	597.00	1,552,200	貸付株式数 1,000株
三光合成	7,500	292.00	2,190,000	
プロネクサス	5,700	1,075.00	6,127,500	貸付株式数 100株
ホクシン	5,700	110.00	627,000	
ウッドワン	2,400	1,168.00	2,803,200	
大建工業	4,500	1,975.00	8,887,500	
きもと	12,400	182.00	2,256,800	貸付株式数 4,400株
凸版印刷	94,700	1,425.00	134,947,500	
大日本印刷	87,800	1,956.00	171,736,800	
共同印刷	2,100	2,918.00	6,127,800	貸付株式数 700株
N I S S H A	13,900	1,376.00	19,126,400	貸付株式数 5,500株
光村印刷	600	1,795.00	1,077,000	貸付株式数 200株
藤森工業	6,000	4,725.00	28,350,000	貸付株式数 400株
ヴィア・ホールディングス	8,100	249.00	2,016,900	貸付株式数 3,200株
TAKARA & COMPANY	3,300	1,938.00	6,395,400	貸付株式数 1,300株 (100株)
前澤化成工業	4,300	982.00	4,222,600	
未来工業	3,600	1,880.00	6,768,000	貸付株式数 900株
アシックス	59,200	1,880.00	111,296,000	貸付株式数 800株
ツツミ	2,100	2,111.00	4,433,100	
ウェーブロックHLDGS	2,300	738.00	1,697,400	
ジェイエスピー	3,900	1,507.00	5,877,300	貸付株式数 1,500株
ニチハ	9,400	3,260.00	30,644,000	貸付株式数 400株
エフピコ	14,200	4,185.00	59,427,000	
小松ウオール工業	1,900	1,742.00	3,309,800	
ヤマハ	40,000	5,960.00	238,400,000	
河合楽器	2,100	2,700.00	5,670,000	
クリナップ	6,300	462.00	2,910,600	
ビジョン	43,300	4,660.00	201,778,000	
天馬	4,500	1,907.00	8,581,500	
オリバー	1,400	2,361.00	3,305,400	貸付株式数 100株
兼松サステック	400	1,610.00	644,000	
キングジム	5,700	895.00	5,101,500	
象印マホービン	18,400	1,886.00	34,702,400	
リンテック	16,000	2,155.00	34,480,000	
信越ポリマー	12,100	940.00	11,374,000	



東リ	16,800	256.00	4,300,800	
イトーキ	13,700	338.00	4,630,600	
任天堂	41,300	59,260.00	2,447,438,000	
三菱鉛筆	10,800	1,442.00	15,573,600	貸付株式数 800株
松風	3,000	1,823.00	5,469,000	
タカラスタンダ-ド	13,700	1,380.00	18,906,000	
コクヨ	32,200	1,342.00	43,212,400	
ナカバヤシ	6,600	607.00	4,006,200	貸付株式数 200株
ニフコ	24,700	3,675.00	90,772,500	貸付株式数 7,300株
立川ブラインド	3,000	1,246.00	3,738,000	貸付株式数 1,100株
グローブライド	3,000	4,045.00	12,135,000	
オカムラ	23,400	937.00	21,925,800	貸付株式数 1,000株
バルカー	5,500	1,870.00	10,285,000	
MUTOHホールディングス	1,000	1,461.00	1,461,000	貸付株式数 300株
伊藤忠	463,600	2,758.50	1,278,840,600	
丸紅	689,300	608.50	419,439,050	
スクロール	10,100	773.00	7,807,300	貸付株式数 600株
高島	1,000	1,574.00	1,574,000	
ヨンドシーホールディングス	6,800	1,864.00	12,675,200	
三陽商会	3,500	529.00	1,851,500	貸付株式数 1,400株
長瀬産業	36,900	1,435.00	52,951,500	
ナイガイ	2,500	353.00	882,500	
蝶理	4,300	1,540.00	6,622,000	貸付株式数 100株
豊田通商	73,900	3,610.00	266,779,000	貸付株式数 29,800株
オンワードホールディングス	40,100	185.00	7,418,500	
三共生興	9,300	437.00	4,064,100	
兼松	25,000	1,205.00	30,125,000	
美津濃	6,100	1,812.00	11,053,200	
ツカモトコーポレーション	1,300	1,401.00	1,821,300	
ルックホールディングス	2,100	976.00	2,049,600	貸付株式数 800株
三井物産	573,900	1,780.00	1,021,542,000	
日本紙パルプ	3,800	3,445.00	13,091,000	貸付株式数 100株
東京エレクトロン	42,700	35,470.00	1,514,569,000	貸付株式数 17,200株
カメイ	8,500	1,173.00	9,970,500	貸付株式数 1,400株
東都水産	800	4,550.00	3,640,000	貸付株式数 300株
OUGホールディングス	1,100	2,844.00	3,128,400	
スターゼン	2,500	4,245.00	10,612,500	

セイコーHD	9,500	1,344.00	12,768,000	貸付株式数	1,800株
山 善	26,100	994.00	25,943,400		
椿本興業	1,200	3,645.00	4,374,000		
住友商事	418,200	1,286.50	538,014,300		
日本ユニシス	20,600	3,860.00	79,516,000		
内田洋行	2,600	5,130.00	13,338,000	貸付株式数	1,000株
三菱商事	434,600	2,433.00	1,057,381,800		
第一実業	3,300	4,025.00	13,282,500		
キャノンマーケティングJ PN	16,500	2,183.00	36,019,500	貸付株式数	6,400株
西華産業	3,700	1,260.00	4,662,000		
佐藤商事	5,400	1,028.00	5,551,200		
菱洋エレクトロ	6,800	2,752.00	18,713,600	貸付株式数	2,400株
東京産業	6,000	557.00	3,342,000		
ユアサ商事	6,400	3,275.00	20,960,000		
神鋼商事	1,600	1,860.00	2,976,000		
トルク	3,900	275.00	1,072,500		
阪和興業	12,500	2,500.00	31,250,000		
正栄食品	4,300	3,770.00	16,211,000	貸付株式数	1,700株
カナデン	5,400	1,289.00	6,960,600	貸付株式数	1,900株
菱電商事	4,800	1,508.00	7,238,400	貸付株式数	1,600株
ニプロ	46,400	1,120.00	51,968,000	貸付株式数	500株
フルサト工業	3,400	1,253.00	4,260,200	貸付株式数	1,300株
岩谷産業	14,900	5,680.00	84,632,000		
ナイス	2,500	1,561.00	3,902,500		
昭光通商	2,300	607.00	1,396,100		
ニチモウ	1,000	1,976.00	1,976,000		
極東貿易	1,900	1,377.00	2,616,300	貸付株式数	700株
イ ワ キ	8,700	526.00	4,576,200	貸付株式数	3,300株
兼松エレクトロニクス	3,600	4,040.00	14,544,000		
三愛石油	16,300	1,154.00	18,810,200	貸付株式数	6,500株
稲畑産業	14,800	1,378.00	20,394,400	貸付株式数	5,900株
G S Iクレオス	1,600	1,799.00	2,878,400	貸付株式数	600株
明和産業	6,300	407.00	2,564,100	貸付株式数	2,300株
クワザワホールディングス	2,300	583.00	1,340,900		
ヤマエ久野	4,900	1,191.00	5,835,900		
ゴ-ルドウイン	11,900	7,020.00	83,538,000	貸付株式数	4,100株
ユニ・チャ-ム	142,700	5,063.00	722,490,100	貸付株式数	27,300株
デサント	12,800	1,724.00	22,067,200		
キ ン グ	3,000	546.00	1,638,000		

ワキタ	14,200	1,145.00	16,259,000		
ヤマトインタ - ナショナル	5,700	337.00	1,920,900	貸付株式数	100株
東邦ホールディングス	21,200	1,903.00	40,343,600		
サンゲツ	17,700	1,465.00	25,930,500		
ミツウロコグループ	9,800	1,292.00	12,661,600	貸付株式数	3,700株
シナネンホールディングス	2,800	2,958.00	8,282,400	貸付株式数	400株
伊藤忠エネクス	14,700	1,000.00	14,700,000		
サンリオ	18,600	1,575.00	29,295,000	貸付株式数	300株
サンワテクノス	4,700	941.00	4,422,700		
リョーサン	7,200	1,855.00	13,356,000		
新光商事	10,000	768.00	7,680,000		
トーヨー	3,000	2,034.00	6,102,000	貸付株式数	100株
三信電気	3,600	2,146.00	7,725,600		
東陽テクニカ	7,400	1,058.00	7,829,200		
モスフードサービス	8,700	2,703.00	23,516,100	貸付株式数	3,100株
加賀電子	6,600	2,165.00	14,289,000	貸付株式数	500株
三益半導体	5,300	2,800.00	14,840,000		
ソーダニツカ	6,800	540.00	3,672,000	貸付株式数	600株
立花エレテック	4,900	1,647.00	8,070,300	貸付株式数	1,600株
木曽路	8,800	2,359.00	20,759,200	貸付株式数	1,800株
S R Sホールディングス	8,100	868.00	7,030,800	貸付株式数	3,100株
千趣会	12,200	332.00	4,050,400	貸付株式数	4,800株
タカキユー	6,100	139.00	847,900	貸付株式数	2,200株 (1,600株)
リテールパートナーズ	8,900	1,481.00	13,180,900	貸付株式数	400株
ケーヨー	13,700	742.00	10,165,400		
上新電機	7,700	2,742.00	21,113,400	貸付株式数	2,800株
日本瓦斯	10,500	5,280.00	55,440,000		
ロイヤルホールディングス	11,700	1,782.00	20,849,400	貸付株式数	4,600株
東天紅	500	926.00	463,000		
いなげや	8,200	2,039.00	16,719,800		
島忠	12,500	5,480.00	68,500,000	貸付株式数	5,000株
チヨダ	7,000	893.00	6,251,000	貸付株式数	2,800株
ライフコーポレーション	5,100	3,685.00	18,793,500	貸付株式数	2,000株
リンガーハット	8,300	2,212.00	18,359,600	貸付株式数	3,100株 (1,700株)
MrMaxHD	9,200	854.00	7,856,800		
テンアライド	5,900	350.00	2,065,000	貸付株式数	2,300株
AOKIホールディングス	13,500	409.00	5,521,500		
オークワ	10,500	1,339.00	14,059,500		

コメリ	10,300	2,835.00	29,200,500	
青山商事	13,800	446.00	6,154,800	貸付株式数 5,500株
しまむら	7,700	10,800.00	83,160,000	
はせがわ	3,400	296.00	1,006,400	貸付株式数 300株
高島屋	48,700	803.00	39,106,100	貸付株式数 19,500株
松屋	13,500	719.00	9,706,500	貸付株式数 2,800株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	31,800	643.00	20,447,400	
近鉄百貨店	2,500	3,295.00	8,237,500	貸付株式数 1,000株
丸井グループ	60,800	1,906.00	115,884,800	
クレディセゾン	46,600	1,195.00	55,687,000	
アクシアル リテイリング	5,500	4,745.00	26,097,500	
井筒屋	4,000	179.00	716,000	
イオン	254,900	3,105.00	791,464,500	貸付株式数 102,600株
イズミ	13,500	3,600.00	48,600,000	貸付株式数 5,400株
フオーバル	2,900	879.00	2,549,100	貸付株式数 100株
平和堂	13,400	2,124.00	28,461,600	貸付株式数 5,200株
フジ	8,000	1,921.00	15,368,000	貸付株式数 2,100株
ヤオコー	7,600	7,140.00	54,264,000	貸付株式数 3,000株
ゼビオホールディングス	8,000	760.00	6,080,000	貸付株式数 3,200株
ケースホールディングス	64,000	1,268.00	81,152,000	貸付株式数 25,700株
PALTAC	10,600	5,980.00	63,388,000	
三谷産業	8,700	423.00	3,680,100	
OLYMPICグループ	3,400	1,000.00	3,400,000	貸付株式数 1,300株
日産東京販売HD	9,700	250.00	2,425,000	
新生銀行	48,900	1,242.00	60,733,800	
あおぞら銀行	39,800	1,895.00	75,421,000	
三菱UFJフィナンシャル G	4,537,800	448.50	2,035,203,300	
りそなホールディングス	722,200	365.70	264,108,540	
三井住友トラストHD	125,400	3,051.00	382,595,400	
三井住友フィナンシャルG	458,800	3,032.00	1,391,081,600	
千葉銀行	221,400	592.00	131,068,800	
群馬銀行	127,500	325.00	41,437,500	
武蔵野銀行	9,900	1,588.00	15,721,200	
千葉興業銀行	18,000	263.00	4,734,000	
筑波銀行	28,100	196.00	5,507,600	
七十七銀行	22,400	1,466.00	32,838,400	
青森銀行	5,200	2,433.00	12,651,600	

秋田銀行	4,300	1,393.00	5,989,900	貸付株式数	1,600株
山形銀行	7,500	1,181.00	8,857,500	貸付株式数	3,000株
岩手銀行	4,400	2,216.00	9,750,400		
東邦銀行	59,500	227.00	13,506,500		
東北銀行	3,100	1,076.00	3,335,600	貸付株式数	1,000株
みちのく銀行	4,400	1,183.00	5,205,200		
ふくおかフィナンシャルG	56,000	1,863.00	104,328,000		
静岡銀行	161,600	742.00	119,907,200		
十六銀行	8,300	1,983.00	16,458,900		
スルガ銀行	63,000	337.00	21,231,000		
八十二銀行	160,200	371.00	59,434,200		
山梨中央銀行	7,800	739.00	5,764,200		
大垣共立銀行	13,100	2,348.00	30,758,800		
福井銀行	5,700	1,995.00	11,371,500		
北國銀行	6,600	2,884.00	19,034,400		
清水銀行	2,700	1,890.00	5,103,000		
富山銀行	1,300	3,460.00	4,498,000		
滋賀銀行	13,300	2,373.00	31,560,900	貸付株式数	1,900株
南都銀行	11,200	1,871.00	20,955,200		
百五銀行	59,500	317.00	18,861,500		
京都銀行	23,800	5,210.00	123,998,000	貸付株式数	9,500株
紀陽銀行	23,500	1,590.00	37,365,000	貸付株式数	2,100株
ほくほくフィナンシャルG	44,000	1,037.00	45,628,000	貸付株式数	1,200株
山陰合同銀行	39,500	545.00	21,527,500		
中国銀行	57,000	921.00	52,497,000	貸付株式数	9,900株
鳥取銀行	2,200	1,185.00	2,607,000		
伊予銀行	94,800	692.00	65,601,600		
百十四銀行	7,100	1,618.00	11,487,800	貸付株式数	1,700株
四国銀行	10,200	708.00	7,221,600	貸付株式数	2,700株
阿波銀行	10,800	2,568.00	27,734,400	貸付株式数	400株
大分銀行	3,900	2,325.00	9,067,500		
宮崎銀行	4,500	2,300.00	10,350,000		
佐賀銀行	4,000	1,370.00	5,480,000	貸付株式数	300株
沖縄銀行	6,100	2,953.00	18,013,300	貸付株式数	600株
琉球銀行	15,500	873.00	13,531,500		
セブン銀行	222,800	229.00	51,021,200	貸付株式数	51,800株
みずほフィナンシャルG	901,100	1,327.50	1,196,210,250		
高知銀行	2,500	786.00	1,965,000		
山口フィナンシャルG	82,600	652.00	53,855,200		
芙蓉総合リース	7,000	6,380.00	44,660,000		

みずほリース	10,200	2,777.00	28,325,400		
東京センチュリー	13,400	6,910.00	92,594,000	貸付株式数	3,000株
SBIホールディングス	75,100	2,830.00	212,533,000	貸付株式数	4,400株
日本証券金融	29,500	500.00	14,750,000	貸付株式数	7,900株
アイフル	102,000	267.00	27,234,000		
日本アジア投資	6,300	225.00	1,417,500		
長野銀行	2,100	1,450.00	3,045,000		
名古屋銀行	5,100	2,706.00	13,800,600		
北洋銀行	101,000	233.00	23,533,000		
愛知銀行	2,400	3,080.00	7,392,000		
中京銀行	2,700	2,139.00	5,775,300	貸付株式数	1,000株
大光銀行	2,200	1,253.00	2,756,600		
愛媛銀行	9,000	1,075.00	9,675,000	貸付株式数	2,200株
トマト銀行	2,500	1,101.00	2,752,500		
京葉銀行	28,000	457.00	12,796,000		
栃木銀行	31,600	183.00	5,782,800		
北日本銀行	2,000	2,041.00	4,082,000		
東和銀行	11,700	642.00	7,511,400	貸付株式数	1,500株
福島銀行	7,300	225.00	1,642,500	貸付株式数	2,500株
大東銀行	3,300	615.00	2,029,500		
リコーリース	5,200	2,901.00	15,085,200	貸付株式数	2,100株
イオンフィナンシャルサー ビス	40,900	1,138.00	46,544,200	貸付株式数	16,400株
アコム	133,000	501.00	66,633,000		
ジャックス	7,400	1,816.00	13,438,400		
オリコ	180,900	115.00	20,803,500		
日立キャピタル	15,700	2,394.00	37,585,800		
オリックス	411,500	1,553.00	639,059,500		
三菱UFJリース	167,900	479.00	80,424,100		
ジャフコグループ	10,300	4,480.00	46,144,000		
九州リースサービス	2,900	608.00	1,763,200	貸付株式数	1,200株
トモニホールディングス	51,500	334.00	17,201,000		
大和証券G本社	534,400	454.10	242,671,040		
野村ホールディングス	1,166,900	524.00	611,455,600		
岡三証券グループ	56,400	369.00	20,811,600	貸付株式数	2,500株
丸三証券	19,700	474.00	9,337,800		
東洋証券	24,300	133.00	3,231,900	貸付株式数	500株
東海東京HD	76,600	308.00	23,592,800	貸付株式数	30,600株
光世証券	1,800	682.00	1,227,600		
水戸証券	19,100	236.00	4,507,600	貸付株式数	7,200株

いちよし証券	12,200	470.00	5,734,000	
松井証券	37,700	840.00	31,668,000	
S O M P Oホールディングス	124,800	4,010.00	500,448,000	
日本取引所グループ	190,600	2,583.50	492,415,100	
マネックスG	50,000	349.00	17,450,000	貸付株式数 19,900株
極東証券	8,700	722.00	6,281,400	貸付株式数 2,100株
岩井コスモホールディング	6,300	1,332.00	8,391,600	
藍澤證券	12,000	724.00	8,688,000	
フィデアホール	64,400	109.00	7,019,600	
池田泉州HD	76,900	152.00	11,688,800	
アニコムホールディングス	22,000	1,093.00	24,046,000	
M S & A D	173,500	3,035.00	526,572,500	
マネーパートナーズGP	6,600	205.00	1,353,000	
スパークス・グループ	30,800	235.00	7,238,000	貸付株式数 6,600株
小林洋行	2,800	266.00	744,800	
第一生命HLDGS	375,500	1,644.50	617,509,750	
東京海上HD	234,600	5,190.00	1,217,574,000	
アドバンテッジリスクマネ	3,300	692.00	2,283,600	貸付株式数 1,300株
イー・ギャランティ	7,400	2,067.00	15,295,800	貸付株式数 400株
アサックス	3,500	706.00	2,471,000	貸付株式数 300株
NECキャピタルソリューション	2,700	1,813.00	4,895,100	
T & Dホールディングス	198,400	1,219.00	241,849,600	
アドバンスクリエイト	1,600	1,920.00	3,072,000	貸付株式数 500株
三井不動産	322,400	2,181.50	703,315,600	
三菱地所	464,700	1,804.00	838,318,800	
平和不動産	12,200	3,420.00	41,724,000	
東京建物	65,300	1,433.00	93,574,900	
ダイビル	17,000	1,343.00	22,831,000	貸付株式数 6,800株
京阪神ビルディング	10,500	1,918.00	20,139,000	貸付株式数 400株
住友不動産	149,000	3,405.00	507,345,000	
太平洋興発	2,600	618.00	1,606,800	貸付株式数 300株
テーオーシー	12,500	639.00	7,987,500	
東京楽天地	1,100	4,355.00	4,790,500	貸付株式数 200株
スターツコーポレーション	8,900	2,819.00	25,089,100	貸付株式数 3,300株
フジ住宅	7,700	615.00	4,735,500	貸付株式数 2,200株
空港施設	6,300	464.00	2,923,200	
明和地所	4,000	533.00	2,132,000	

ゴールドクレスト	5,000	1,405.00	7,025,000	貸付株式数	2,000株
リログループ	35,200	2,913.00	102,537,600	貸付株式数	500株
エスリード	2,700	1,317.00	3,555,900		
日神グループHLDGS	10,300	377.00	3,883,100	貸付株式数	3,700株
日本エスコ	12,200	922.00	11,248,400		
タカラレーベン	30,200	296.00	8,939,200	貸付株式数	3,800株
AVANTIA	3,800	805.00	3,059,000	貸付株式数	600株
イオンモール	33,100	1,675.00	55,442,500	貸付株式数	13,300株
毎日コムネット	2,000	715.00	1,430,000		
ファースト住建	2,900	1,069.00	3,100,100	貸付株式数	1,100株 (100株)
ランド	378,100	9.00	3,402,900		
カチタス	16,500	3,100.00	51,150,000	貸付株式数	5,000株
東祥	4,000	1,330.00	5,320,000		
トーセイ	9,400	1,163.00	10,932,200	貸付株式数	3,700株
穴吹興産	1,500	1,681.00	2,521,500	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	9,400	921.00	8,657,400		
インテリックス	2,400	560.00	1,344,000	貸付株式数	100株
ランドビジネス	2,600	336.00	873,600		
サンネクスタグループ	1,900	1,025.00	1,947,500		
グランディハウス	5,300	380.00	2,014,000		
東武鉄道	70,000	3,130.00	219,100,000		
相鉄ホールディングス	21,400	2,549.00	54,548,600	貸付株式数	1,600株
東急	169,400	1,267.00	214,629,800		
京浜急行	86,200	1,787.00	154,039,400	貸付株式数	27,100株
小田急電鉄	100,000	3,165.00	316,500,000		
京王電鉄	34,900	7,410.00	258,609,000		
京成電鉄	46,800	3,505.00	164,034,000		
富士急行	9,200	4,825.00	44,390,000	貸付株式数	3,600株
新京成電鉄	1,700	2,150.00	3,655,000	貸付株式数	600株
東日本旅客鉄道	118,400	6,488.00	768,179,200		
西日本旅客鉄道	60,000	4,764.00	285,840,000		
東海旅客鉄道	55,900	13,300.00	743,470,000		
西武ホールディングス	88,200	1,035.00	91,287,000		
鴻池運輸	10,600	1,037.00	10,992,200		
西日本鉄道	18,600	2,959.00	55,037,400	貸付株式数	4,200株
ハマキョウレックス	5,200	2,921.00	15,189,200		
サカイ引越センター	3,600	5,170.00	18,612,000		
近鉄グループHLDGS	63,700	4,630.00	294,931,000		
阪急阪神HLDGS	84,700	3,410.00	288,827,000		



南海電鉄	30,100	2,622.00	78,922,200	貸付株式数	4,800株
京阪ホールディングス	28,300	4,915.00	139,094,500	貸付株式数	3,100株
神戸電鉄	1,500	3,595.00	5,392,500		
名古屋鉄道	52,300	2,872.00	150,205,600	貸付株式数	5,300株
山陽電鉄	4,600	2,033.00	9,351,800		
トランコム	1,800	8,380.00	15,084,000		
日本通運	22,000	6,980.00	153,560,000		
ヤマトホールディングス	111,800	2,637.00	294,816,600		
山 九	17,700	3,845.00	68,056,500		
日 新	5,600	1,212.00	6,787,200		
丸 運	3,500	248.00	868,000	貸付株式数	800株
丸全昭和運輸	5,200	3,345.00	17,394,000	貸付株式数	800株
センコーグループHLDGS	35,100	970.00	34,047,000	貸付株式数	13,900株
トナミホールディングス	1,500	5,850.00	8,775,000		
ニッコンホールディングス	22,700	2,032.00	46,126,400		
日石輸送	600	2,583.00	1,549,800		
福山通運	8,100	4,630.00	37,503,000	貸付株式数	2,100株
セイノーホールディングス	47,800	1,462.00	69,883,600		
エスライン	2,000	932.00	1,864,000	貸付株式数	500株
神奈川中央交通	1,600	3,860.00	6,176,000	貸付株式数	500株
日立物流	11,700	3,110.00	36,387,000		
丸和運輸機関	6,800	4,625.00	31,450,000		
C & F ロジホールディングス	6,400	1,858.00	11,891,200		
日本郵船	53,400	2,276.00	121,538,400		
商船三井	40,400	2,728.00	110,211,200		
川崎汽船	19,700	1,689.00	33,273,300	貸付株式数	7,800株
NSユニテッド海運	3,600	1,325.00	4,770,000		
明治海運	6,600	409.00	2,699,400		
飯野海運	30,200	387.00	11,687,400		
共栄タンカー	1,200	816.00	979,200		
九州旅客鉄道	55,900	2,198.00	122,868,200		
SGホールディングス	133,900	3,120.00	417,768,000		
日本航空	142,600	1,977.00	281,920,200		
ANAホールディングス	116,600	2,517.50	293,540,500		
パスコ	1,300	1,283.00	1,667,900		
西本WISMETTACHD	1,200	2,255.00	2,706,000	貸付株式数	400株
シルバーライフ	900	1,970.00	1,773,000		

ヤマシタヘルスケアHLD GS	700	1,419.00	993,300	貸付株式数	100株
一家ダイニングプロジ	500	551.00	275,500	貸付株式数	200株
GENKY DRUGS STORES	2,900	4,150.00	12,035,000		
国際紙パルプ商事	15,900	255.00	4,054,500		
ナルミヤ・インターナシヨ ナル	1,400	751.00	1,051,400		
ブックオフGHD	3,900	839.00	3,272,100	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	20,200	2,990.00	60,398,000		
三井倉庫HOLD	7,400	2,247.00	16,627,800		
住友倉庫	22,600	1,350.00	30,510,000		
渋沢倉庫	3,500	2,246.00	7,861,000		
ヤマタネ	3,300	1,371.00	4,524,300		
東陽倉庫	11,300	304.00	3,435,200		
乾汽船	3,700	938.00	3,470,600	貸付株式数	100株
日本トランスシティ	13,800	566.00	7,810,800	貸付株式数	2,800株
ケイヒン	1,200	1,379.00	1,654,800	貸付株式数	300株
中央倉庫	3,900	1,200.00	4,680,000		
川西倉庫	1,100	1,141.00	1,255,100	貸付株式数	100株
安田倉庫	5,100	988.00	5,038,800		
ファイズホールディングス	1,400	1,111.00	1,555,400	貸付株式数	500株
東洋埠頭	2,000	1,444.00	2,888,000		
宇徳	5,500	463.00	2,546,500	貸付株式数	1,200株
上組	35,600	1,805.00	64,258,000		
サンリツ	1,500	683.00	1,024,500		
キムラユニティー	1,600	1,032.00	1,651,200		
キューソー流通システム	1,600	1,650.00	2,640,000	貸付株式数	600株
近鉄エクスプレス	13,600	2,170.00	29,512,000	貸付株式数	5,400株
東海運	3,600	306.00	1,101,600	貸付株式数	1,300株
エーアイティー	4,500	994.00	4,473,000		
内外トランスライン	2,100	1,270.00	2,667,000	貸付株式数	800株
ショーエイコーポ	900	1,027.00	924,300	貸付株式数	300株
日本コンセプト	2,000	1,743.00	3,486,000	貸付株式数	500株
TBSホールディングス	40,000	1,869.00	74,760,000		
日本テレビHLD S	54,900	1,137.00	62,421,300	貸付株式数	22,000株
朝日放送グループHD	6,400	693.00	4,435,200	貸付株式数	2,500株
テレビ朝日HD	18,100	1,684.00	30,480,400	貸付株式数	7,300株
スカパーJ S A T H D	43,600	473.00	20,622,800		
テレビ東京HD	5,400	2,349.00	12,684,600	貸付株式数	600株

日本BS放送	2,100	1,062.00	2,230,200	貸付株式数	800株
ビジョン	6,700	1,156.00	7,745,200	貸付株式数	2,400株
スマートバリュー	1,800	965.00	1,737,000	貸付株式数	600株
USEN-NEXT HLDGS	2,600	1,354.00	3,520,400	貸付株式数	1,000株
ワイヤレスゲート	3,200	650.00	2,080,000	貸付株式数	700株
コネクシオ	3,800	1,227.00	4,662,600		
日本通信	51,700	203.00	10,495,100	貸付株式数	19,600株
クロップス	1,300	804.00	1,045,200		
日本電信電話	882,200	2,465.00	2,174,623,000		
KDDI	481,200	2,982.50	1,435,179,000		
ソフトバンク	600,700	1,284.50	771,599,150		
光通信	6,800	25,070.00	170,476,000		
エムティーアイ	6,400	842.00	5,388,800		
GMOインターネット	24,000	2,936.00	70,464,000		
ファイバーゲート	2,100	2,128.00	4,468,800	貸付株式数	800株
アイドママーケティングコム	2,100	381.00	800,100		
KADOKAWA	17,900	3,310.00	59,249,000		
学研ホールディングス	8,900	1,634.00	14,542,600		
ゼンリン	13,300	1,296.00	17,236,800		
昭文社ホールディングス	3,100	491.00	1,522,100	貸付株式数	1,200株
インプレスホールディングス	5,300	174.00	922,200		
東京電力HD	537,100	272.00	146,091,200	貸付株式数	66,000株
中部電力	205,500	1,257.50	258,416,250		
関西電力	254,500	955.30	243,123,850		
中国電力	97,100	1,327.00	128,851,700		
北陸電力	61,400	735.00	45,129,000	貸付株式数	1,300株
東北電力	167,700	875.00	146,737,500		
四国電力	60,400	710.00	42,884,000		
九州電力	138,500	881.00	122,018,500		
北海道電力	63,600	392.00	24,931,200		
沖縄電力	13,200	1,451.00	19,153,200		
電源開発	53,500	1,404.00	75,114,000		
エフオン	3,700	1,180.00	4,366,000	貸付株式数	1,200株
イーレックス	9,700	1,964.00	19,050,800	貸付株式数	3,800株
レノバ	11,300	2,590.00	29,267,000	貸付株式数	4,500株
東京瓦斯	129,400	2,344.50	303,378,300		
大阪瓦斯	130,500	2,004.00	261,522,000		

東邦瓦斯	33,100	6,830.00	226,073,000	貸付株式数	13,300株
北海道瓦斯	3,600	1,520.00	5,472,000		
広島ガス	14,200	371.00	5,268,200	貸付株式数	4,500株
西部瓦斯	7,500	3,550.00	26,625,000		
静岡ガス	19,300	989.00	19,087,700	貸付株式数	2,200株
メタウォーター	6,600	2,363.00	15,595,800		
アイネット	3,400	1,488.00	5,059,200	貸付株式数	1,300株
松竹	4,400	13,010.00	57,244,000	貸付株式数	600株
東宝	39,000	4,420.00	172,380,000		
エイチ・アイ・エス	10,100	1,610.00	16,261,000	貸付株式数	4,000株
東映	2,500	16,740.00	41,850,000	貸付株式数	500株
ラックランド	1,500	2,336.00	3,504,000	貸付株式数	600株
NTTデータ	175,500	1,388.00	243,594,000		
共立メンテナンス	10,700	3,635.00	38,894,500		
イチネンホールディングス	7,200	1,312.00	9,446,400	貸付株式数	2,800株
建設技術研究所	4,200	2,115.00	8,883,000		
スペース	4,100	807.00	3,308,700		
長大	2,500	1,303.00	3,257,500		
アインホールディングス	8,200	7,110.00	58,302,000	貸付株式数	3,100株
燦ホールディングス	2,800	1,220.00	3,416,000	貸付株式数	300株
ピー・シー・エー	1,100	4,535.00	4,988,500	貸付株式数	400株 (400株)
スバル興業	400	8,130.00	3,252,000		
東京テアトル	3,100	1,288.00	3,992,800	貸付株式数	900株
タナベ経営	1,100	1,318.00	1,449,800		
ビジネスB太田昭和	2,200	1,727.00	3,799,400	貸付株式数	200株
ナガワ	2,000	9,140.00	18,280,000	貸付株式数	200株
よみうりランド	1,400	6,040.00	8,456,000	貸付株式数	500株
東京都競馬	4,200	5,170.00	21,714,000	貸付株式数	1,600株
常磐興産	2,600	1,453.00	3,777,800	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,700	2,173.00	23,251,100	貸付株式数	4,200株
東京ドーム	26,400	1,347.00	35,560,800	貸付株式数	7,000株
DTS	14,800	2,200.00	32,560,000		
スクウェア・エニックス・HD	28,200	6,410.00	180,762,000	貸付株式数	11,300株
シーイーシー	7,100	1,517.00	10,770,700		
カプコン	31,200	5,880.00	183,456,000		
西尾レントオール	6,000	2,033.00	12,198,000		
アイ・エス・ビー	1,400	2,993.00	4,190,200		

アゴラ・ホスピタリティーG	47,500	24.00	1,140,000		
日本空港ビルデング	21,200	6,080.00	128,896,000	貸付株式数	8,500株
トランス・コスモス	6,200	2,700.00	16,740,000		
乃村工藝社	27,700	780.00	21,606,000		
ジャステック	4,200	1,365.00	5,733,000	貸付株式数	1,600株
S C S K	15,200	6,230.00	94,696,000	貸付株式数	200株
藤田観光	2,900	1,475.00	4,277,500	貸付株式数	1,100株 (100株)
KNT-CTホールディングス	3,900	889.00	3,467,100	貸付株式数	1,500株
日本管財	6,900	2,074.00	14,310,600		
トーカイ	6,200	2,033.00	12,604,600		
白洋舎	800	2,447.00	1,957,600	貸付株式数	300株
セコム	68,200	10,395.00	708,939,000		
日本システムウエア	2,200	2,103.00	4,626,600		
セントラル警備保障	3,100	3,475.00	10,772,500		
アイネス	6,500	1,424.00	9,256,000		
丹青社	12,200	762.00	9,296,400		
メイテック	8,000	4,805.00	38,440,000		
T K C	5,600	6,940.00	38,864,000	貸付株式数	900株
富士ソフト	7,100	5,060.00	35,926,000	貸付株式数	2,800株
応用地質	6,900	1,215.00	8,383,500		
船井総研ホールディング	13,300	2,516.00	33,462,800		
N S D	21,200	1,995.00	42,294,000		
進学会ホールディングス	2,500	445.00	1,112,500	貸付株式数	100株
丸紅建材リース	700	1,724.00	1,206,800		
オオバ	4,800	753.00	3,614,400	貸付株式数	1,100株
コナミホールディングス	24,000	5,470.00	131,280,000		
いであ	1,500	1,736.00	2,604,000	貸付株式数	600株
学究社	1,800	1,212.00	2,181,600	貸付株式数	100株
ベネッセホールディングス	21,500	2,192.00	47,128,000		
イオンディライト	7,900	2,634.00	20,808,600		
ナック	3,600	915.00	3,294,000	貸付株式数	600株
福井コンピュータH L D S	2,600	3,355.00	8,723,000	貸付株式数	1,000株
ダイセキ	10,800	2,961.00	31,978,800		
ステップ	2,400	1,561.00	3,746,400	貸付株式数	900株
日鉄物産	4,700	3,550.00	16,685,000		
泉州電業	2,000	2,875.00	5,750,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,700	2,325.00	3,952,500	貸付株式数	100株

トラスコ中山	14,900	2,606.00	38,829,400	貸付株式数	4,200株
ヤマダホールディングス	201,900	496.00	100,142,400	貸付株式数	61,200株
オートバックスセブン	24,600	1,296.00	31,881,600		
モリト	4,900	612.00	2,998,800		
アークランドサカモト	10,500	1,789.00	18,784,500		
ニトリホールディングス	28,700	22,230.00	638,001,000		
グルメ杵屋	4,700	981.00	4,610,700	貸付株式数	1,800株 (200株)
愛眼	5,400	226.00	1,220,400	貸付株式数	2,100株
ケーユーホールディングス	2,900	801.00	2,322,900	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	22,000	1,906.00	41,932,000	貸付株式数	8,500株
加藤産業	9,600	3,455.00	33,168,000	貸付株式数	2,300株
北恵	1,600	953.00	1,524,800	貸付株式数	600株
イノテック	3,800	906.00	3,442,800		
イエローハット	12,600	1,610.00	20,286,000	貸付株式数	5,000株
松屋フーズHLDGS	3,200	3,430.00	10,976,000		
JBCホールディングス	4,500	1,481.00	6,664,500		
JKホールディングス	6,000	810.00	4,860,000	貸付株式数	2,100株
サガミホールディングス	8,900	1,243.00	11,062,700	貸付株式数	3,100株
日伝	6,000	2,358.00	14,148,000	貸付株式数	2,200株
関西スーパーマーケット	5,500	1,252.00	6,886,000	貸付株式数	800株
ミロク情報サービス	5,900	2,039.00	12,030,100	貸付株式数	1,300株 (400株)
北沢産業	5,200	280.00	1,456,000		
杉本商事	3,500	2,385.00	8,347,500	貸付株式数	1,100株
因幡電機産業	18,800	2,397.00	45,063,600	貸付株式数	3,600株
王将フードサービス	4,900	6,000.00	29,400,000		
プレナス	7,200	1,737.00	12,506,400	貸付株式数	1,100株
ミニストップ	5,000	1,350.00	6,750,000	貸付株式数	1,700株
アークス	13,600	2,182.00	29,675,200		
パローホールディングス	14,700	2,592.00	38,102,400		
東テク	2,200	2,520.00	5,544,000		
ミスミグループ本社	83,000	3,275.00	271,825,000	貸付株式数	3,800株
藤久	1,200	891.00	1,069,200	貸付株式数	400株
アルテック	5,600	292.00	1,635,200		
ベルク	3,300	6,110.00	20,163,000		
大庄	3,500	960.00	3,360,000	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	2,000	1,874.00	3,748,000	貸付株式数	700株
ファーストリテイリング	8,900	85,940.00	764,866,000		
ソフトバンクグループ	523,900	7,272.00	3,809,800,800		

蔵王産業	1,100	1,308.00	1,438,800	
スズケン	28,000	3,990.00	111,720,000	貸付株式数 1,300株
サンドラッグ	25,000	4,380.00	109,500,000	
サクスパーホールディング	5,500	531.00	2,920,500	貸付株式数 2,200株
ジェコス	4,500	957.00	4,306,500	
ヤマザワ	1,400	1,726.00	2,416,400	貸付株式数 500株
やまや	1,300	2,110.00	2,743,000	
グローセル	6,500	420.00	2,730,000	
ベルーナ	14,400	956.00	13,766,400	貸付株式数 5,700株
合計			163,479,342,460	

(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せん。

ソニー	20,000株	トヨタ自動車	40,000株
本田技研	30,000株	三菱UFJフィナンシャルG	200,000株
三井住友フィナンシャルG	30,000株		

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2020年11月30日

資産総額	13,444,195,485円
負債総額	88,084,875円
純資産総額( - )	13,356,110,610円
発行済数量	6,424,598,616口
1単位当たり純資産額( / )	2.0789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11月30日

資産総額	176,825,982,124円
負債総額	9,884,353,835円
純資産総額( - )	166,941,628,289円
発行済数量	142,709,508,970口
1単位当たり純資産額( / )	1.1698円



## 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2020年11月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 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、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. 商品会議

ファンド設立時に経営会議の分科会である商品会議を開催し、ファンドの新規設定を決定します。

##### ロ. 商品担当役員

商品担当役員は、ファンド設立の趣旨に沿って、各ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を決定します。

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

## ホ．運用審査会議、リスクマネジメント会議および経営会議

## ・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。

## ・経営会議

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11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	46	77,980
追加型株式投資信託	723	18,565,711
株式投資信託 合計	769	18,643,691
単位型公社債投資信託	41	141,526
追加型公社債投資信託	14	1,525,302
公社債投資信託 合計	55	1,666,829
総合計	824	20,310,520

### 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。

なお、当中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則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61期事業年度(2019年4月1日から2020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62期事業年度に係る中間会計期間(2020年4月1日から2020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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	28,489	2,741
有価証券	554	22,167
前払費用	214	205
未収委託者報酬	11,468	10,847
未収収益	98	63
その他	56	62
流動資産計	40,882	36,088
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	217
建物	10	7
器具備品	195	209
無形固定資産	2,821	2,362

ソフトウェア	2,804	2,028
ソフトウェア仮勘定	17	333
投資その他の資産	12,799	15,844
投資有価証券	8,493	9,153
関係会社株式	1,836	3,972
出資金	183	183
長期差入保証金	1,070	1,069
繰延税金資産	1,183	1,431
その他	31	33
固定資産計	15,827	18,424
資産合計	56,709	54,512

(単位:百万円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	75	69
未払金	8,548	7,573
未払収益分配金	15	14
未払償還金	40	39
未払手数料	4,610	3,988
その他未払金	2 3,882	2 3,530
未払費用	3,735	3,830
未払法人税等	726	656
未払消費税等	255	590
賞与引当金	725	688
その他	2	5
流動負債計	14,070	13,414
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,389	2,574
役員退職慰労引当金	103	88
その他	2	5
固定負債計	2,496	2,667
負債合計	16,567	16,082
<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	13,052	11,749
利益剰余金合計	13,426	12,123
株主資本合計	40,096	38,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	46	363
評価・換算差額等合計	46	363
純資産合計	40,142	38,430
負債・純資産合計	56,709	54,512

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	76,052	69,550
その他営業収益	673	583
営業収益計	76,725	70,134
営業費用		
支払手数料	35,789	31,120
広告宣伝費	694	745
調査費	9,066	8,858
調査費	1,057	1,188
委託調査費	8,009	7,670
委託計算費	1,351	1,410
営業雑経費	1,557	1,770
通信費	228	240
印刷費	513	524
協会費	55	56
諸会費	13	13
その他営業雑経費	746	936
営業費用計	48,459	43,906
一般管理費		

給料	5,755	5,793
役員報酬	373	374
給料・手当	4,145	4,335
賞与	510	395
賞与引当金繰入額	725	688
福利厚生費	796	838
交際費	64	62
旅費交通費	178	154
租税公課	472	451
不動産賃借料	1,291	1,299
退職給付費用	374	368
役員退職慰労引当金繰入額	34	37
固定資産減価償却費	907	925
諸経費	1,819	1,770
一般管理費計	11,693	11,702
営業利益	16,572	14,525

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31 日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	38	912
投資有価証券売却益	215	214
有価証券償還益	133	24
その他	134	78
営業外収益計	521	1,230
営業外費用		
有価証券償還損	32	71
投資有価証券売却損	40	1
その他	60	54
営業外費用計	132	127
経常利益	16,961	15,629
特別損失		
システム刷新関連費用	-	537
投資有価証券評価損	-	48
関係会社整理損失	29	-
特別損失計	29	585
税引前当期純利益	16,931	15,043
法人税、住民税及び事業税	5,076	4,555
法人税等調整額	15	78



法人税等合計	5,060	4,477
当期純利益	11,870	10,566

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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
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
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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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	13,052	13,426	40,096
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,302	1,302	1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	410	410	410
当期変動額合計	410	410	410
当期末残高	363	363	38,430

## 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

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	8～18年
器具備品	4～17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。

## 6．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「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 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

## (未適用の会計基準等)

## 1．収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018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 2018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

2022年3月期の期首より適用予定であります。

#### (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。

## 2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)

#### (1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

#### (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

#### (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)

### (損益計算書)

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた172百万円は、「受取配当金」38百万円、「その他」134百万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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	31百万円	34百万円
器具備品	264百万円	276百万円

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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
未払金	3,788百万円	3,397百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(2020年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万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 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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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
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

## (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

2020年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	10,564百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,050円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020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、子会社株式並びに関連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、子会社株式及び関連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（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。

当事業年度(2020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		2,741	2,741	-
(2) 未収委託者報酬		10,847	10,847	-
(3) 有価証券及び投資有価証券				
有価証券		21,900	21,900	-
その他有価証券		8,754	8,754	-
資産計		44,243	44,243	-
(1) 未払手数料		(3,988)	(3,988)	-
(2) その他未払金		(3,530)	(3,530)	-
(3) 未払費用(*2)		(2,889)	(2,889)	-
負債計		(10,408)	(10,408)	-

(\*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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	666	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	1,836	3,972



(3) 長期差入保証金	1,070	1,069
-------------	-------	-------

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(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

当事業年度(2020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	2,741	-	-	-
未収委託者報酬	10,847	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	21,900 267	- 3,463	- 1,184	- -
合計	35,756	3,463	1,184	-

(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(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。

当事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,944百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(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	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	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。

当事業年度(2020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	60	55	5
(2) その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	764
小計	27,589	28,354	764
合計	30,654	31,181	526

(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 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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

#### 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、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

#### (退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

##### 2. 確定給付制度

###### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,350百万円	2,389百万円
勤務費用	158	159
退職給付の支払額	171	183
その他	52	207
退職給付債務の期末残高	2,389	2,574

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

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,389百万円	2,574百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574
退職給付引当金	2,389	2,574

貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,389	2,574
-------------------------	-------	-------

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	158百万円	159百万円
その他	41	27
確定給付制度に係る退職給付費用	199	187

## 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174百万円、当事業年度181百万円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度	当事業年度
	(2019年3月31日)	(2020年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		788
	731	
システム関連費用	170	198
賞与引当金	182	177
未払事業税	141	129
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	32	47
その他	240	399
繰延税金資産小計	1,592	1,835
評価性引当額	164	173
繰延税金資産合計	1,428	1,661
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	85	71
繰延税金負債合計	244	230
繰延税金資産の純額	1,183	1,431

## 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（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。

当事業年度（2020年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

### 1. サービスごとの情報

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

### 2. 地域ごとの情報

#### （1）営業収益

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

#### （2）有形固定資産

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

### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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 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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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)	1,603	-	-

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。

## (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 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㈱	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	㈱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。

## 当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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)	16,953	未払手数料	2,984
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)	1,031	未払費用	224
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)	1,061	長期差入保証金	1,054

## 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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,389.06円	1株当たり純資産額	14,732.52円
1株当たり当期純利益	4,550.81円	1株当たり当期純利益	4,050.66円

(注1)潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,870	10,566
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 (2020年9月30日)	
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		2,811
有価証券		12,910
未収委託者報酬		11,357
その他		360
流動資産合計		27,439
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	226
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		1,720
その他		687
無形固定資産合計		2,408
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		10,638
関係会社株式		3,972
繰延税金資産		1,053
その他		1,286
投資その他の資産合計		16,951
固定資産合計		19,586
資産合計		47,025



(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2020年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

未払金	5,860
未払費用	3,365
未払法人税等	594
賞与引当金	571
その他	2

流動負債合計	11,000
--------	--------

## 固定負債

退職給付引当金	2,609
役員退職慰労引当金	110
その他	4

固定負債合計	2,724
--------	-------

## 負債合計

負債合計	13,724
------	--------

## 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	5,784

利益剰余金合計	6,158
---------	-------

## 株主資本合計

株主資本合計	32,828
--------	--------

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	472
--------------	-----

評価・換算差額等合計	472
------------	-----

## 純資産合計

純資産合計	33,301
-------	--------

## 負債・純資産合計

負債・純資産合計	47,025
----------	--------

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

## 当中間会計期間

(自 2020年4月1日  
至 2020年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		31,426
その他営業収益		214
営業収益合計		31,641
営業費用		
支払手数料		13,509
その他営業費用		5,825
営業費用合計		19,334
一般管理費	1	5,708
営業利益		6,597
営業外収益	2	239
営業外費用	3	156
経常利益		6,679
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		6,679
法人税、住民税及び事業税		2,071
法人税等調整額		8
中間純利益		4,599

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30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 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	10,564	10,564	10,564

中間純利益	-	-	-	4,599	4,599	4,599
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	5,965	5,965	5,965
当中間期末残高	15,174	11,495	374	5,784	6,158	32,828

	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	363	363	38,430
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	10,564
中間純利益	-	-	4,599
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	836	836	836
当中間期変動額合計	836	836	5,128
当中間期末残高	472	472	33,301

## 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

市場価格のない株式等以外のもの

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。

市場価格のない株式等

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	8～18年
器具備品	4～17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・参与及び上席参事についても、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．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。

## ６．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和２年法律第８号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年３月31日）第３項の取扱いにより、「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 2018年２月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

## （追加情報）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年７月４日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年７月４日）第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

## (中間貸借対照表関係)

## 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2020年9月30日現在)
有形固定資産	316百万円

## 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(2020年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,623百万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 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	327百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
投資有価証券売却益	203百万円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
為替差損	63百万円
有価証券償還損	46百万円
投資有価証券売却損	33百万円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020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
2020年6月23日 定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年3月31日	2020年6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2020年9月30日)

## 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下、「時価算定適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価  
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

## (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券(1)	60			60
資産合計	60			60

（ 1 ）時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券410百万円、投資有価証券9,911百万円は上記の表に含めておりません。

（ 2 ）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、コマーシャル・ペーパー、未払金及び未払費用は、短期間（1年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価格によっていることからレベルを付しておりません。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。

（注2）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中の投資有価証券には含めておりません。

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,944
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2020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 1,944百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、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	60	55	5
（ 2 ）その他	7,989	7,141	847
小計	8,049	7,196	852
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	14,833	15,006	173
小計	14,833	15,006	173
合計	22,882	22,203	679

(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、市場価格がないことから、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 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	12,766.41円
1株当たり中間純利益	1,763.16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 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
中間純利益(百万円)	4,599
普通株式に係る中間純利益(百万円)	4,599
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（2020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 （2020年 3月末日現在）	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注1）
株式会社青森銀行	19,562	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
株式会社秋田銀行	14,100	
株式会社愛媛銀行	21,365	
株式会社大垣共立銀行	46,773	
株式会社鹿児島銀行	18,130	
株式会社群馬銀行	48,652	
株式会社佐賀銀行	16,062	
株式会社中国銀行	15,149	
株式会社北洋銀行	121,101	
三井住友信託銀行株式会社	342,037	
株式会社山形銀行	12,008	（注3）
労働金庫連合会	120,000	（注4）

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

（注2）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

（注4）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

## 2 【関係業務の概要】

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

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

### 3 【資本関係】

該当事項はありません。

#### <再信託受託会社の概要>

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

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

### 第3 【参考情報】

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

(提出年月日)	(書類名)
2020年2月21日	有価証券届出書、有価証券報告書
2020年8月26日	半期報告書、有価証券届出書

**独立監査人の監査報告書**

2020年5月22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

東京事務所

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
--------------------	-------	-------	---

**監査意見**

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アセットマネジメント株式会社（旧社名 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。

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、大和アセットマネジメント株式会社（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2020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全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。

**監査意見の根拠**

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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**

2021年1月8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

東京事務所

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**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）の2019年12月3日から2020年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）の2020年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

**監査意見の根拠**

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

**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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 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**

2020年11月20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

東京事務所

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

**中間監査意見**

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アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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。

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、大和アセットマネジメント株式会社の2020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（2020年4月1日から2020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。

**中間監査意見の根拠**

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

#### 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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、監査人は、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。
- ・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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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。