

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2021年6月16日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワつみたてインデックス日本株式
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ダイワつみたてインデックス日本株式

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

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

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

(5) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

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

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

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

(7) 【申込期間】

2021年6月17日から2021年12月14日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

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

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

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

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

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、2,500億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

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

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

運用プロセス



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

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

●東証株価指数（TOPIX）について

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

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

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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

・安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。

(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

(b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的

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

分配方針

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

（注）第1計算期間は、2019年9月19日（休業日の場合翌営業日）までとします。

【分配方針】

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

主な投資制限

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

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

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果をあげることをめざして運用を行いません。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。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2018年8月16日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3 ）

お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約(1)に基づき、次の業務を行ないません。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金(3)	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約(以下「信託契約」といいます。)(2)の委託者であり、次の業務を行ないません。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金(3)	
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 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せん。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 信託財産の計算 など</p>
損益 投資		
投資対象	<p>東京証券取引所第一部上場株式(上場予定を含みます。) など (ファミリーファンド方式で運用を行ないません。)</p>	

(注)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況（2021年3月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

- 1959年12月12日 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】

主要投資対象

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

投資態度

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

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

ハ．安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。

(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

(b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的

- 二．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。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

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

(2) 【投資対象】

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

1. 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)、および に定めるものに限ります。)

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー

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

なお、前1. の証券または証書ならびに前12. および前17. の証券または証書のうち前1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2. から前6. までの証券ならびに前14. の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに前12. および前17. の証券または証書のうち前2. から前6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13. の証券および前14. の証券(新投資口予約権証券、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

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

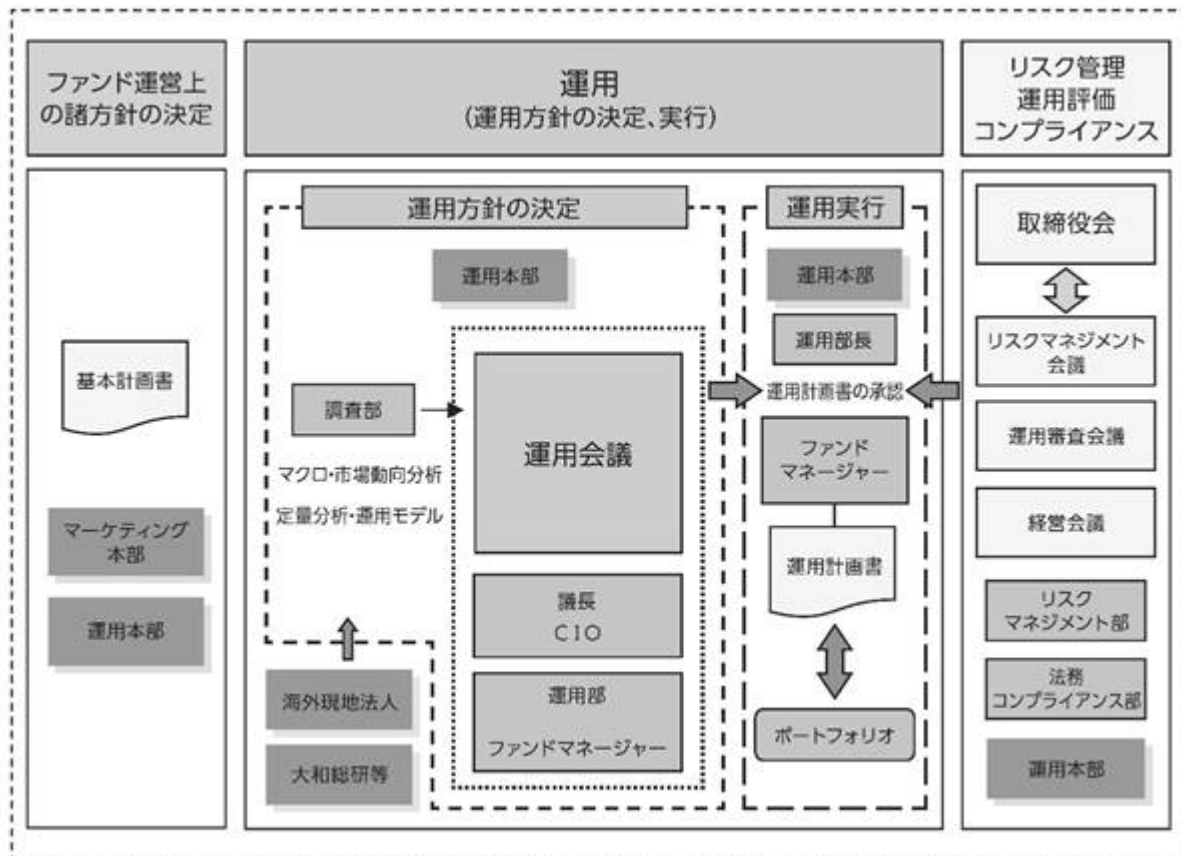
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5. の権利の性質を有するもの

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

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を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2021年3月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券等（信託約款）

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

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

投資信託証券(信託約款)

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

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

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

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

同一銘柄の新株引受権証券等(信託約款)

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

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

信用取引(信託約款)

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

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予

約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等（信託約款）

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

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

スワップ取引（信託約款）

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

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

ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

金利先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

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

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

デリバティブ取引等(信託約款)

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

有価証券の貸付け(信託約款)

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

1．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

3．投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

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

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

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への投資は、行ないません。

信用リスク集中回避（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

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

(1) 投資方針

投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への投資には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けた取得申込みを取消すことがあります。

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

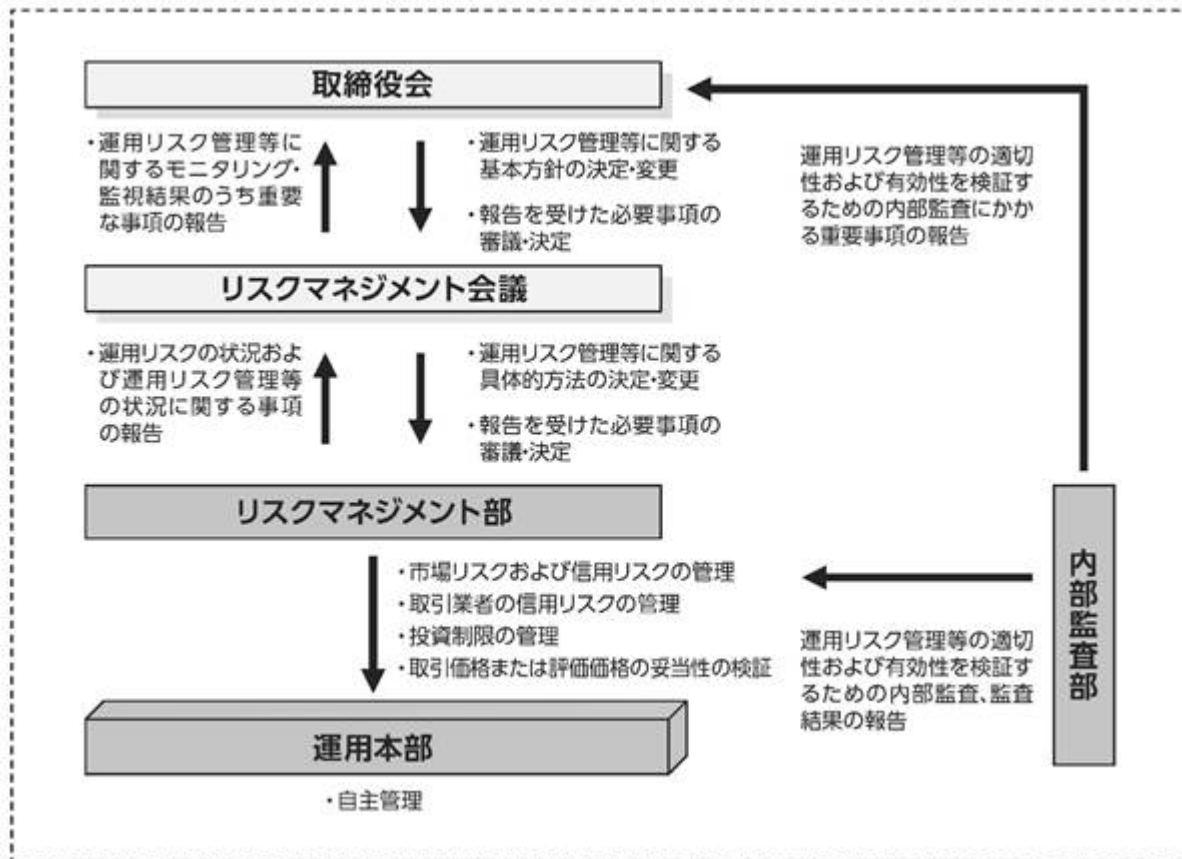
(3) その他の留意点

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

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。



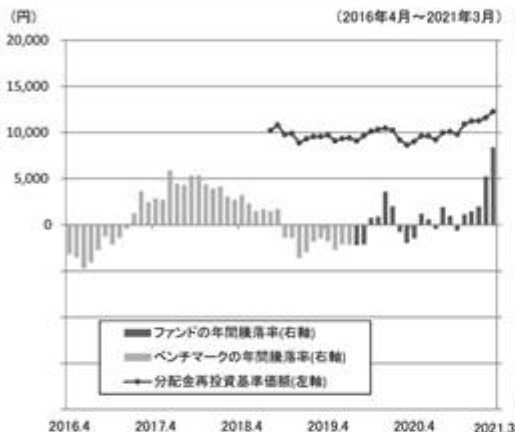
流動性リスクに対する管理体制

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。

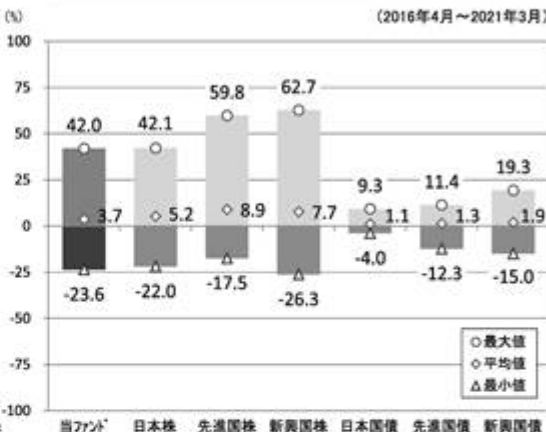
参考情報

- 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。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

(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0.154%（税抜0.14%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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0.0625%（税抜）	年率0.0625%（税抜）	年率0.015%（税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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、前にかかわらず所得税がかかりません。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。

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合

には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

- () 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- () 上記は、2021年3月末現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（2021年3月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,225,894,764	99.99
内 日本	1,225,894,764	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	89,788	0.01
純資産総額	1,225,984,552	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】（2021年3月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	トピックス・インデックス・マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	931,177,185	1.1134 1,036,844,607	1.3165 1,225,894,764	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2019年9月19日)	202,356,608	202,356,608	0.9723	0.9723
2020年3月末日	494,124,390	-	0.8642	-
4月末日	542,296,430	-	0.9015	-
5月末日	621,896,272	-	0.9627	-
6月末日	659,808,098	-	0.9610	-
7月末日	676,699,289	-	0.9223	-
8月末日	767,608,064	-	0.9975	-
第2計算期間末 (2020年9月23日)	806,503,187	806,503,187	1.0136	1.0136
9月末日	829,718,709	-	1.0102	-
10月末日	840,481,649	-	0.9815	-
11月末日	956,715,252	-	1.0910	-
12月末日	1,018,640,138	-	1.1233	-
2021年1月末日	1,046,379,772	-	1.1257	-
2月末日	1,112,911,547	-	1.1608	-
3月末日	1,225,984,552	-	1.2271	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
2020年9月24日～ 2021年3月23日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.8
第2計算期間	4.2
2020年9月24日～ 2021年3月23日	21.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	239,881,168	32,762,950
第2計算期間	718,271,452	130,686,219
2020年9月24日～ 2021年3月23日	299,739,020	116,975,251

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2021年3月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	172,478,466,130	98.08
内 日本	172,478,466,130	98.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,384,490,633	1.92
純資産総額	175,862,956,763	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)	4,865,460,000	2.77
内 日本	4,865,460,000	2.77

(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 (2021年3月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	652,100	7,084.05 4,619,511,103	8,616.00 5,618,493,600	3.19

2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	501,300	6,409.17 3,212,918,349	9,330.00 4,677,129,000	2.66
3	ソニー	日本	株式	電気機 器	403,300	8,236.50 3,321,781,969	11,595.00 4,676,263,500	2.66
4	キーエンス	日本	株式	電気機 器	63,200	47,308.57 2,989,902,084	50,270.00 3,177,064,000	1.81
5	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,342,600	440.53 1,913,084,206	591.70 2,569,516,420	1.46
6	リクルートホールディン グス	日本	株式	サービ ス業	440,600	4,296.76 1,893,153,241	5,401.00 2,379,680,600	1.35
7	任天堂	日本	株式	その他 製品	36,800	60,420.00 2,223,456,000	61,810.00 2,274,608,000	1.29
8	信越化学	日本	株式	化学	116,600	14,413.66 1,680,633,420	18,610.00 2,169,926,000	1.23
9	武田薬品	日本	株式	医薬品	535,600	3,920.02 2,099,567,121	3,985.00 2,134,366,000	1.21
10	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	738,900	2,241.07 1,655,928,795	2,842.00 2,099,953,800	1.19
11	日本電産	日本	株式	電気機 器	154,900	9,763.22 1,512,324,032	13,435.00 2,081,081,500	1.18
12	ダイキン工業	日本	株式	機械	82,000	19,569.77 1,604,721,177	22,320.00 1,830,240,000	1.04
13	第一三共	日本	株式	医薬品	552,600	3,255.97 1,799,250,631	3,225.00 1,782,135,000	1.01
14	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	37,700	26,970.06 1,016,771,443	46,790.00 1,763,983,000	1.00
15	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	439,200	3,078.43 1,352,047,455	4,007.00 1,759,874,400	1.00
16	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	506,700	2,802.85 1,420,205,927	3,395.00 1,720,246,500	0.98
17	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	506,800	2,545.25 1,289,933,333	3,319.00 1,682,069,200	0.96
18	村田製作所	日本	株式	電気機 器	189,100	6,871.54 1,299,409,642	8,842.00 1,672,022,200	0.95
19	HOYA	日本	株式	精密機 器	127,500	11,714.29 1,493,572,546	13,005.00 1,658,137,500	0.94
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	443,400	2,766.78 1,226,793,721	3,587.00 1,590,475,800	0.90
21	日立	日本	株式	電気機 器	309,400	3,703.39 1,145,830,644	5,004.00 1,548,237,600	0.88

22	ファナック	日本	株式	電気機器	56,500	20,432.58 1,154,441,183	26,185.00 1,479,452,500	0.84
23	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	862,000	1,386.43 1,195,103,897	1,599.00 1,378,338,000	0.78
24	S M C	日本	株式	機械	18,800	58,116.84 1,092,596,639	64,310.00 1,209,028,000	0.69
25	三菱商事	日本	株式	卸売業	386,000	2,622.69 1,012,359,801	3,130.00 1,208,180,000	0.69
26	三井物産	日本	株式	卸売業	514,700	1,888.47 971,996,382	2,302.00 1,184,839,400	0.67
27	花王	日本	株式	化学	154,000	8,192.42 1,261,633,392	7,313.00 1,126,202,000	0.64
28	東京海上HD	日本	株式	保険業	210,500	4,854.60 1,021,893,534	5,265.00 1,108,282,500	0.63
29	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	248,000	3,376.67 837,416,045	4,463.00 1,106,824,000	0.63
30	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	65,400	15,148.80 990,732,085	16,625.00 1,087,275,000	0.62

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.08%
合計	98.08%

(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	0.09%
鉱業	0.17%
建設業	2.36%
食料品	3.26%
繊維製品	0.48%
パルプ・紙	0.25%
化学	7.24%
医薬品	5.40%
石油・石炭製品	0.44%
ゴム製品	0.60%
ガラス・土石製品	0.81%

鉄鋼	0.76%
非鉄金属	0.75%
金属製品	0.62%
機械	5.56%
電気機器	17.14%
輸送用機器	7.22%
精密機器	2.50%
その他製品	2.32%
電気・ガス業	1.34%
陸運業	3.35%
海運業	0.23%
空運業	0.45%
倉庫・運輸関連業	0.17%
情報・通信業	9.05%
卸売業	4.70%
小売業	4.61%
銀行業	5.07%
証券、商品先物取引業	0.77%
保険業	1.82%
その他金融業	1.13%
不動産業	1.97%
サービス業	5.46%
合計	98.08%

(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 2021年6月	買建	249	4,823,559,850	4,865,460,000	2.77%

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

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

(参考情報) 運用実績

●ダイワつみたてインデックス日本株式

2021年3月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,271円
純資産総額	12億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	5.7%
3カ月間	9.2%
6カ月間	21.5%
1年間	42.0%
3年間	-
5年間	-
設定来	22.7%



※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: 0円	
	第1期 19年9月	第2期 20年9月		
分配金	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

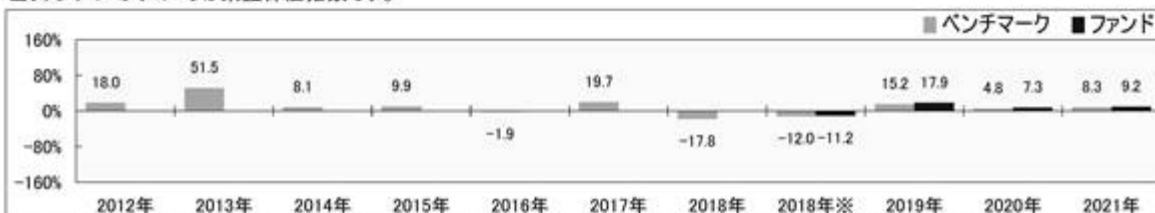
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	2,137	98.1%	電気機器	17.1%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.2%
国内株式先物	1	2.8%	情報・通信業	9.1%	TOPIX先物 0306月	-	2.8%
不動産投資信託等	-	-	化学	7.2%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.7%
コール・ローン、その他	-	1.9%	輸送用機器	7.2%	ソニー	電気機器	2.7%
合計	2,138	-	機械	5.6%	キーエンス	電気機器	1.8%
株式市場・上場別構成			サービス業	5.5%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.5%
一部(東証・名証)		98.1%	医薬品	5.4%	リクルートホールディングス	サービス業	1.4%
二部(東証・名証)		-	銀行業	5.1%	任天堂	その他製品	1.3%
新興市場他		-	卸売業	4.7%	信越化学	化学	1.2%
その他		-	その他	31.2%	武田薬品	医薬品	1.2%
合計		98.1%	合計	98.1%	合計		19.6%

※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。

・2018年※は設定日(8月16日)から年末、2021年は3月31日までの騰落率を表しています。

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

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

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

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

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

2 【換金(解約)手続等】

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

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

< 一部解約 >

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

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

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年9月20日から翌年9月19日までとします。ただし、第1計算期間は、2018年8月16日から2019年9月19日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、東証株価指数が改廃された場合、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項

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

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2. から前4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2. から前4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、 の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本 の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

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

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

公告

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

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

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

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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

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

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

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

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

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2019年9月20日から2020年9月23日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワつみたてインデックス日本株式

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2019年9月19日現在	第2期 2020年9月23日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	166,997	653,050
親投資信託受益証券	202,342,835	806,447,103
流動資産合計	202,509,832	807,100,153
資産合計	202,509,832	807,100,153
負債の部		
流動負債		
未払解約金	24,775	75,377
未払受託者報酬	13,748	53,921
未払委託者報酬	111,095	449,773
その他未払費用	3,606	17,895
流動負債合計	153,224	596,966
負債合計	153,224	596,966
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 208,118,218	¹ 795,703,451
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	² 5,761,610	² 10,799,736
(分配準備積立金)	8,691,902	44,845,198
元本等合計	202,356,608	806,503,187
純資産合計	202,356,608	806,503,187
負債純資産合計	202,509,832	807,100,153

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2018年8月16日 至 2019年9月19日	自	2019年9月20日 至 2020年9月23日
営業収益				
受取利息		-		2
有価証券売買等損益		8,646,225		35,376,268
その他収益		250		-
営業収益合計		8,646,475		35,376,270
営業費用				
支払利息		53		248
受託者報酬		15,146		80,754
委託者報酬		122,830		673,761
その他費用		3,980		26,772
営業費用合計		142,009		781,535
営業利益		8,504,466		34,594,735
経常利益		8,504,466		34,594,735
当期純利益		8,504,466		34,594,735
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		187,436		3,545,781
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		5,761,610
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,916,471		3,257,272
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,916,471		3,257,272
剰余金減少額又は欠損金増加額		16,369,983		24,836,442
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		16,369,983		24,836,442
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,761,610		10,799,736

(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2期	
	自 2019年9月20日	至 2020年9月23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 2020年9月19日から2020年9月22日までが休日のため、当計算期間末日を2020年9月23日としております。このため、当計算期間は370日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	2019年9月19日現在	2020年9月23日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	208,118,218円
期中追加設定元本額	239,881,168円	718,271,452円
期中一部解約元本額	32,762,950円	130,686,219円
2. 計算期間末日における受益権の総数	208,118,218口	795,703,451口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,761,610円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期	第2期
	自 2018年8月16日 至 2019年9月19日	自 2019年9月20日 至 2020年9月23日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（199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（8,691,703円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は8,691,902円（1万口当たり417.64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（38,140,754円）、投資信託約款に規定される収益調整金（26,527,258円）及び分配準備積立金（6,704,444円）より分配対象額は71,372,456円（1万口当たり896.97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2期 自 2019年9月20日 至 2020年9月23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2期
	2020年9月23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1期	第2期
	2019年9月19日現在	2020年9月23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	8,737,497	36,400,627
合計	8,737,497	36,400,627

（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1期	第2期
2019年9月19日現在	2020年9月23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2期
自 2019年9月20日 至 2020年9月23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1期	第2期
	2019年9月19日現在	2020年9月23日現在
1口当たり純資産額	0.9723円	1.0136円

(1万口当たり純資産額)	(9,723円)	(10,136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	742,243,077	806,447,103	
親投資信託受益証券 合計			806,447,103	
合計			806,447,103	

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9月19日現在	2020年9月23日現在
	金 額(円)	金 額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	19,763,867,043	16,181,037,878
株式 2 3	144,383,908,290	155,810,906,285
派生商品評価勘定	2,711,360	6,670,250

未収入金	4,979,111,357	-
未収配当金	61,109,873	64,970,916
未収利息	1,004,073	1,190,061
その他未収収益	4	11,859,248
差入委託証拠金	-	33,660,000
流動資産合計	169,203,571,244	172,102,760,017
資産合計	169,203,571,244	172,102,760,017
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	51,080	1,550
前受金	1,600,000	8,410,000
未払金	-	5,600
未払解約金	5,440,424,660	157,714,320
受入担保金	18,897,468,081	15,187,919,669
その他未払費用	2,724	89,578
流動負債合計	24,339,546,545	15,354,140,717
負債合計	24,339,546,545	15,354,140,717
純資産の部		
元本等		
元本	1	139,218,477,453
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,645,547,246	12,474,802,077
元本等合計	144,864,024,699	156,748,619,300
純資産合計	144,864,024,699	156,748,619,300
負債純資産合計	169,203,571,244	172,102,760,017

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年9月20日 至 2020年9月23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9月19日現在	2020年9月23日現在
1. 1 期首	2018年8月16日	2019年9月20日
期首元本額	132,242,097,665円	139,218,477,453円
期中追加設定元本額	26,095,001,655円	38,212,962,099円
期中一部解約元本額	19,118,621,867円	33,157,622,329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	3,959,780,929円	3,314,021,528円
ファンド		

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	7,634,005,000円	6,818,474,579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	8,941,003円	2,657,999円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	60,746,661円	46,604,616円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	916,911,182円	686,480,990円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	49,098,482円	36,922,244円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,278,942,805円	975,609,786円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	33,474,382円	115,509,117円
D-I's TOPIXイン デックス	40,297,426円	50,828,888円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	19,815,592円	12,744,127円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	3,680,722円	22,523,341円
iFree TOPIXイン デックス	1,240,728,743円	1,984,833,386円
iFree 8資産バランス	1,946,320,135円	2,612,918,610円
iFree 年金バランス	56,248,083円	111,316,445円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,758,738,387円	65,911,437,637円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,935,287,098円	3,014,014,018円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,322,359,411円	3,718,178,204円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,053,282,137円	3,338,684,763円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,860,270,912円	5,125,140,712円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	14,875,081円	12,676,182円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	54,571,393円	49,637,084円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	21,059,608円	35,161,355円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	194,448,237円	742,243,077円
ダイワつみたてインデックス バランス30	198,705円	11,325,834円
ダイワつみたてインデックス バランス50	300,351円	7,141,239円
ダイワつみたてインデックス バランス70	479,367円	10,260,361円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	167,628,084円	146,259,723円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	171,981,504円	156,097,901円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,347,930,150円	8,172,743,694円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	3,092,274円	- 円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	827,002,497円	711,092,768円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	127,742,510円	105,455,426円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	222,487,484円	194,955,500円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	160,214,687円	163,360,908円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	9,622,016,197円	10,589,328,266円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	2,723,875,577円	8,840,247,711円
ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス	2,564,805,669円	2,003,637,126円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,429,476,274円	1,325,135,081円
ダイワライフスタイル25	195,425,595円	188,604,645円
ダイワライフスタイル50	683,313,759円	670,194,395円

	ダイワライフスタイル75	559,222,873円	532,629,983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)	12,947,400,487円	11,706,727,974円
計		139,218,477,453円	144,273,817,223円
2.	期末日における受益権の総数	139,218,477,453口	144,273,817,223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 18,091,114,550円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 14,558,387,700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 535,080,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 535,300,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分9,962,005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2,755,075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9月20日 至 2020年9月23日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年9月23日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2019年9月19日現在	2020年9月23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	12,445,824,821	3,811,271,063
合計	12,445,824,821	3,811,271,063

(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(2018年9月20日から2019年9月19日まで、及び2019年9月20日から2020年9月23日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	2019年9月19日 現在				2020年9月23日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数 先物取引								
買 建	285,060,000	-	287,730,000	2,670,000	906,100,500	-	912,800,000	6,699,500
合計	285,060,000	-	287,730,000	2,670,000	906,100,500	-	912,800,000	6,699,500

(注) 1. 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	2019年9月19日現在	2020年9月23日現在
1口当たり純資産額	1.0406円	1.0865円
(1万口当たり純資産額)	(10,406円)	(10,865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	2,749.00	9,071,700	貸付株式数 800株
日本水産	92,400	456.00	42,134,400	
マルハニチロ	13,400	2,467.00	33,057,800	貸付株式数 4,100株
ハウスイ	500	913.00	456,500	
カネコ種苗	2,800	1,559.00	4,365,200	
サカタのタネ	11,000	3,650.00	40,150,000	貸付株式数 4,300株
ホクト	7,100	2,251.00	15,982,100	貸付株式数 2,800株
ホクリヨウ	1,600	673.00	1,076,800	

ヒノキヤグループ	2,300	1,958.00	4,503,400		
ショーボンドHD	14,300	5,140.00	73,502,000	貸付株式数	5,700株
ミライト・ホールディングス	27,400	1,612.00	44,168,800		
タマホーム	5,000	1,369.00	6,845,000	貸付株式数	1,900株
サンヨーホームズ	500	659.00	329,500	貸付株式数	300株
日本アクア	3,800	672.00	2,553,600	貸付株式数	600株
ファーストコーポレーション	3,000	671.00	2,013,000	貸付株式数	500株
ベステラ	1,600	1,200.00	1,920,000	貸付株式数	300株
キャンディル	1,400	779.00	1,090,600	貸付株式数	500株
スペースバリューHD	11,100	505.00	5,605,500		
住石ホールディングス	18,400	124.00	2,281,600		
日鉄鉱業	2,100	4,760.00	9,996,000		
三井松島HLDGS	3,400	763.00	2,594,200		
国際石油開発帝石	339,100	578.60	196,203,260	貸付株式数	144,000株
石油資源開発	12,100	1,695.00	20,509,500		
K&Oエナジーグループ	4,500	1,489.00	6,700,500	貸付株式数	1,300株
ダイセキ環境ソリューション	1,800	714.00	1,285,200		
第一カッター興業	1,100	2,258.00	2,483,800	貸付株式数	200株
明豊ファシリティワークス	2,700	694.00	1,873,800		
安藤・間	54,900	749.00	41,120,100		
東急建設	27,100	474.00	12,845,400		
コムシスホールディングス	32,600	2,946.00	96,039,600		
ビーアールホールディングス	9,900	794.00	7,860,600	貸付株式数	3,100株
高松コンストラクションGP	5,700	2,275.00	12,967,500	貸付株式数	2,100株
東建コーポレーション	2,800	7,830.00	21,924,000	貸付株式数	1,100株
ソネック	900	897.00	807,300	貸付株式数	300株
ヤマウラ	4,000	876.00	3,504,000	貸付株式数	1,500株
大成建設	70,800	3,710.00	262,668,000		
大林組	212,700	996.00	211,849,200		
清水建設	215,500	815.00	175,632,500		
飛鳥建設	5,900	1,107.00	6,531,300	貸付株式数	1,000株
長谷工コーポレーション	81,800	1,464.00	119,755,200		
松井建設	8,300	664.00	5,511,200	貸付株式数	2,000株
銭高組	900	4,855.00	4,369,500	貸付株式数	200株
鹿島建設	166,700	1,298.00	216,376,600		

不動テトラ	5,500	1,524.00	8,382,000	
大末建設	2,300	920.00	2,116,000	
鉄建建設	4,600	2,128.00	9,788,800	貸付株式数 1,700株
西松建設	16,400	2,119.00	34,751,600	貸付株式数 2,100株
三井住友建設	51,700	433.00	22,386,100	貸付株式数 6,300株
大豊建設	4,800	2,998.00	14,390,400	貸付株式数 1,900株
前田建設	53,500	792.00	42,372,000	
佐田建設	4,500	446.00	2,007,000	貸付株式数 1,800株
ナカノフドー建設	5,700	399.00	2,274,300	貸付株式数 2,200株
奥村組	10,000	2,699.00	26,990,000	
東鉄工業	9,000	2,839.00	25,551,000	
イチケン	1,500	1,611.00	2,416,500	
富士ピー・エス	3,000	647.00	1,941,000	貸付株式数 1,200株
浅沼組	2,400	4,195.00	10,068,000	貸付株式数 900株
戸田建設	87,600	711.00	62,283,600	貸付株式数 35,300株
熊谷組	9,900	2,737.00	27,096,300	貸付株式数 800株
北野建設	1,300	2,670.00	3,471,000	貸付株式数 500株
植木組	900	2,821.00	2,538,900	貸付株式数 300株
矢作建設	9,300	911.00	8,472,300	
ピーエス三菱	7,000	619.00	4,333,000	貸付株式数 2,700株
日本ハウスHLDGS	14,200	279.00	3,961,800	貸付株式数 5,600株
大東建託	23,100	9,337.00	215,684,700	貸付株式数 5,000株
新日本建設	9,000	888.00	7,992,000	
NIPPO	17,400	2,900.00	50,460,000	
東亜道路	1,300	3,640.00	4,732,000	貸付株式数 500株
前田道路	18,800	1,953.00	36,716,400	
日本道路	2,000	7,870.00	15,740,000	
東亜建設	6,700	1,671.00	11,195,700	貸付株式数 2,600株
日本国土開発	20,800	634.00	13,187,200	貸付株式数 8,200株
若築建設	3,700	1,244.00	4,602,800	
東洋建設	23,900	414.00	9,894,600	貸付株式数 9,200株
五洋建設	84,800	685.00	58,088,000	
世紀東急	10,200	800.00	8,160,000	
福田組	2,500	5,450.00	13,625,000	貸付株式数 900株
日本ドライケミカル	1,700	1,565.00	2,660,500	貸付株式数 600株
住友林業	53,900	1,732.00	93,354,800	
日本基礎技術	7,300	495.00	3,613,500	貸付株式数 2,400株
巴コーポレーション	9,200	389.00	3,578,800	貸付株式数 3,500株
大和ハウス	209,900	2,835.50	595,171,450	
ライト工業	12,200	1,604.00	19,568,800	貸付株式数 3,400株

積水ハウス	229,300	1,929.50	442,434,350	貸付株式数	92,600株
日特建設	5,500	802.00	4,411,000		
北陸電気工事	3,600	1,150.00	4,140,000		
ユアテック	11,900	659.00	7,842,100		
日本リーテック	4,500	2,979.00	13,405,500	貸付株式数	1,200株
四電工	1,100	2,280.00	2,508,000		
中電工	8,200	2,329.00	19,097,800		
関電工	29,800	871.00	25,955,800		
きんでん	50,100	1,852.00	92,785,200		
東京エネシス	7,000	767.00	5,369,000	貸付株式数	2,600株
トーエネック	2,000	3,535.00	7,070,000		
住友電設	6,000	2,466.00	14,796,000	貸付株式数	2,000株
日本電設工業	11,600	2,203.00	25,554,800	貸付株式数	4,600株
協和エクシオ	32,200	2,740.00	88,228,000		
新日本空調	5,600	2,211.00	12,381,600	貸付株式数	2,200株
日本工営	4,400	2,914.00	12,821,600	貸付株式数	1,600株
九電工	14,900	3,095.00	46,115,500		
三機工業	15,300	1,198.00	18,329,400		
日揮ホールディングス	65,800	1,058.00	69,616,400		
中外炉工業	2,300	1,603.00	3,686,900	貸付株式数	800株
ヤマト	6,800	690.00	4,692,000		
太平電業	5,200	2,301.00	11,965,200	貸付株式数	100株
高砂熱学	17,700	1,524.00	26,974,800		
三晃金属	800	2,179.00	1,743,200		
NEC ネットエスアイ	18,900	2,070.00	39,123,000	貸付株式数	7,500株
朝日工業社	1,400	3,180.00	4,452,000		
明星工業	13,800	828.00	11,426,400		
大気社	10,400	2,919.00	30,357,600	貸付株式数	200株
ダイダン	5,100	2,810.00	14,331,000		
日比谷総合設備	6,900	1,779.00	12,275,100	貸付株式数	100株
日本製粉	20,100	1,725.00	34,672,500	貸付株式数	100株
日清製粉G本社	77,300	1,706.00	131,873,800		
日東富士製粉	500	6,500.00	3,250,000		
昭和産業	6,300	3,465.00	21,829,500	貸付株式数	1,400株
鳥越製粉	6,000	1,060.00	6,360,000	貸付株式数	2,400株
中部飼料	8,400	1,782.00	14,968,800		
フィード・ワン	45,700	193.00	8,820,100		
東洋精糖	1,200	1,221.00	1,465,200		
日本甜菜糖	3,500	1,853.00	6,485,500	貸付株式数	1,300株
三井製糖	6,000	1,924.00	11,544,000	貸付株式数	2,200株

塩水港精糖	6,900	231.00	1,593,900	貸付株式数	2,100株
日新製糖	3,300	1,900.00	6,270,000		
L I F U L L	22,600	473.00	10,689,800	貸付株式数	100株
ミクシィ	12,400	2,664.00	33,033,600	貸付株式数	500株
ジェイエシーリクルート メント	4,300	1,343.00	5,774,900	貸付株式数	1,700株
日本M & Aセンター	49,200	5,730.00	281,916,000		
メンバーズ	1,900	1,769.00	3,361,100		
中広	600	517.00	310,200	貸付株式数	200株
U T グループ	10,200	3,415.00	34,833,000	貸付株式数	4,000株
アイティメディア	2,600	2,621.00	6,814,600	貸付株式数	1,000株
タケエイ	6,200	1,025.00	6,355,000		
E・Jホールディングス	1,200	2,626.00	3,151,200	貸付株式数	400株
ビーネックスグループ	8,100	1,160.00	9,396,000	貸付株式数	3,200株
コシダカホールディングス	15,500	433.00	6,711,500	貸付株式数	6,200株
アルトナー	1,800	897.00	1,614,600	貸付株式数	300株
パソナグループ	7,000	1,561.00	10,927,000	貸付株式数	2,500株
C D S	1,600	1,363.00	2,180,800	貸付株式数	400株
リンクアンドモチベーショ ン	13,700	414.00	5,671,800	貸付株式数	5,600株
G C A	7,800	663.00	5,171,400	貸付株式数	1,900株
エス・エム・エス	20,200	2,950.00	59,590,000		
サニーサイドアップG	2,100	711.00	1,493,100	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	65,100	1,738.00	113,143,800		
リニカル	3,200	852.00	2,726,400	貸付株式数	1,200株
クックパッド	22,400	380.00	8,512,000	貸付株式数	8,700株
エスクリ	2,000	380.00	760,000	貸付株式数	800株
アイ・ケイ・ケイ	3,100	626.00	1,940,600	貸付株式数	500株
森永製菓	16,000	4,135.00	66,160,000		
中村屋	1,800	4,245.00	7,641,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	19,000	4,660.00	88,540,000	貸付株式数	7,800株
名糖産業	3,300	1,594.00	5,260,200	貸付株式数	1,300株
井村屋グループ	3,800	2,537.00	9,640,600	貸付株式数	600株
不二家	3,800	2,380.00	9,044,000	貸付株式数	1,500株
山崎製パン	51,200	1,825.00	93,440,000	貸付株式数	20,400株
第一屋製パン	1,300	995.00	1,293,500	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,100	5,950.00	6,545,000	貸付株式数	100株
亀田製菓	3,900	5,380.00	20,982,000	貸付株式数	700株
寿スピリッツ	6,600	5,230.00	34,518,000	貸付株式数	2,600株
カルビー	31,200	3,440.00	107,328,000		

森永乳業	12,600	5,420.00	68,292,000	貸付株式数	1,000株
六甲バター	4,500	1,826.00	8,217,000	貸付株式数	1,800株
ヤクルト	46,800	5,870.00	274,716,000		
明治ホールディングス	45,000	8,100.00	364,500,000		
雪印メグミルク	16,500	2,497.00	41,200,500		
プリマハム	10,700	3,145.00	33,651,500	貸付株式数	2,700株
日本ハム	26,100	4,680.00	122,148,000		
林兼産業	2,300	590.00	1,357,000	貸付株式数	400株
丸大食品	7,300	1,860.00	13,578,000	貸付株式数	2,800株
S Foods	5,500	2,906.00	15,983,000	貸付株式数	2,100株
柿安本店	2,300	2,663.00	6,124,900	貸付株式数	900株
伊藤ハム米久HLDGS	44,200	760.00	33,592,000		
学情	2,400	1,120.00	2,688,000	貸付株式数	800株
スタジオアリス	3,200	1,655.00	5,296,000	貸付株式数	1,200株
クロスキャット	1,800	1,448.00	2,606,400	貸付株式数	700株
シミックホールディングス	3,600	1,382.00	4,975,200		
エプコ	1,300	1,007.00	1,309,100	貸付株式数	300株
システナ	23,700	1,922.00	45,551,400	貸付株式数	700株
NJS	1,400	1,926.00	2,696,400	貸付株式数	500株
デジタルアーツ	3,300	8,300.00	27,390,000	貸付株式数	1,300株
日鉄ソリューションズ	9,900	3,200.00	31,680,000		
総合警備保障	25,900	5,150.00	133,385,000		
キューブシステム	3,500	1,349.00	4,721,500	貸付株式数	1,400株
いちご	85,500	307.00	26,248,500		
エイジア	1,400	2,301.00	3,221,400	貸付株式数	500株
日本駐車場開発	69,700	132.00	9,200,400		
コア	2,800	1,397.00	3,911,600		
カカクコム	48,000	2,678.00	128,544,000	貸付株式数	7,400株
アイロムグループ	2,400	2,110.00	5,064,000	貸付株式数	900株 (100株)
セントケア・ホールディング	4,000	799.00	3,196,000	貸付株式数	1,600株
サイネックス	1,100	879.00	966,900		
ルネサンス	3,500	973.00	3,405,500	貸付株式数	1,400株
ディップ	9,100	2,120.00	19,292,000	貸付株式数	3,600株
SBSホールディングス	5,100	2,153.00	10,980,300	貸付株式数	1,900株
デジタルホールディングス	3,500	1,375.00	4,812,500		
新日本科学	7,100	790.00	5,609,000	貸付株式数	2,700株
ツクイ	15,200	631.00	9,591,200		
キャリアデザインセンター	1,700	1,036.00	1,761,200		

ベネフィット・ワン	23,700	2,625.00	62,212,500	貸付株式数	6,900株
エムスリー	142,600	6,550.00	934,030,000		
ツカダ・グローバルHOLD	4,000	305.00	1,220,000	貸付株式数	1,500株
プラス	700	482.00	337,400	貸付株式数	100株
アウトソーシング	37,100	920.00	34,132,000	貸付株式数	14,600株
ウェルネット	6,600	576.00	3,801,600	貸付株式数	2,600株
ワールドホールディングス	2,300	2,023.00	4,652,900	貸付株式数	800株 (100株)
ディー・エヌ・エー	27,500	1,880.00	51,700,000	貸付株式数	300株
博報堂DYHLDGS	90,500	1,441.00	130,410,500		
ぐるなび	11,300	732.00	8,271,600		
タカミヤ	6,700	568.00	3,805,600		
ジャパンベストレスキューS	5,000	1,028.00	5,140,000		
ファンコミュニケーションズ	18,000	478.00	8,604,000	貸付株式数	2,300株
ライク	2,300	1,839.00	4,229,700	貸付株式数	900株
ビジネス・ブレークスルー	3,200	382.00	1,222,400	貸付株式数	1,000株
エスプール	16,600	798.00	13,246,800	貸付株式数	6,600株
WDBホールディングス	3,000	3,070.00	9,210,000		
手間いらず	400	5,530.00	2,212,000	貸付株式数	100株
ティア	3,600	445.00	1,602,000		
CDG	700	1,770.00	1,239,000	貸付株式数	200株 (200株)
バリューコマース	3,600	3,555.00	12,798,000	貸付株式数	100株
インフォマート	65,600	969.00	63,566,400	貸付株式数	27,600株
サッポロホールディングス	23,300	1,920.00	44,736,000	貸付株式数	8,900株
アサヒグループホールディングン	143,300	3,726.00	533,935,800	貸付株式数	57,300株
麒麟HD	288,000	1,964.50	565,776,000	貸付株式数	116,000株
宝ホールディングス	50,700	1,140.00	57,798,000		
オエノンホールディングス	18,000	424.00	7,632,000	貸付株式数	7,200株
養命酒	2,100	1,863.00	3,912,300	貸付株式数	800株
コカ・コーラボトラーズJHD	48,000	1,761.00	84,528,000	貸付株式数	19,200株
サントリー食品インター	45,700	3,950.00	180,515,000	貸付株式数	18,300株
ダイドーグループHD	3,500	5,410.00	18,935,000	貸付株式数	1,400株
伊藤園	20,800	7,420.00	154,336,000	貸付株式数	8,300株
キーコーヒー	6,700	2,292.00	15,356,400	貸付株式数	2,600株

ユニカフェ	1,600	1,030.00	1,648,000		
ジャパンフーズ	900	1,300.00	1,170,000		
日清オイリオグループ	8,800	3,235.00	28,468,000		
不二製油グループ	16,700	3,240.00	54,108,000		
かどや製油	800	3,840.00	3,072,000		
J - オイルミルズ	3,600	3,925.00	14,130,000		
ローソン	16,900	5,070.00	85,683,000	貸付株式数	6,800株
サンエー	5,500	4,690.00	25,795,000	貸付株式数	500株
カワチ薬品	5,200	2,971.00	15,449,200	貸付株式数	1,600株
エービーシー・マート	10,400	5,400.00	56,160,000	貸付株式数	4,100株
ハードオフコーポレーション	2,500	663.00	1,657,500		
高千穂交易	2,500	1,007.00	2,517,500		
アスクル	7,000	4,360.00	30,520,000	貸付株式数	900株
ゲオホールディングス	11,900	1,690.00	20,111,000		
アダストリア	9,300	1,622.00	15,084,600	貸付株式数	2,700株
ジーフット	4,400	519.00	2,283,600	貸付株式数	1,300株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	450.00	450,000	貸付株式数	400株
カワニシホールディングス	700	1,414.00	989,800		
伊藤忠食品	1,700	5,450.00	9,265,000		
くら寿司	3,500	5,660.00	19,810,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
キャンドウ	3,200	2,159.00	6,908,800	貸付株式数	1,200株
エレマテック	6,300	983.00	6,192,900		
パルグループHLDGS	6,900	1,127.00	7,776,300	貸付株式数	1,700株
JALUX	1,800	1,594.00	2,869,200	貸付株式数	700株

エディオン	30,800	1,128.00	34,742,400	貸付株式数	12,200株 (400株)
あらた	5,300	5,260.00	27,878,000	貸付株式数	1,100株
サーラコーポレーション	13,400	584.00	7,825,600	貸付株式数	5,400株
ワッツ	2,800	955.00	2,674,000	貸付株式数	700株
トーマンデバイス	1,000	4,100.00	4,100,000	貸付株式数	400株
ハローズ	2,500	4,400.00	11,000,000	貸付株式数	900株
J Pホールディングス	20,200	319.00	6,443,800	貸付株式数	8,000株
フジオフードG本社	5,700	1,402.00	7,991,400	貸付株式数	2,200株 (100株)
あみやき亭	1,400	2,998.00	4,197,200	貸付株式数	500株
東京エレクトロンデバイス	2,400	3,215.00	7,716,000		

ひらまつ	11,800	235.00	2,773,000	貸付株式数	4,400株
フィールズ	4,900	333.00	1,631,700		
双日	368,100	249.00	91,656,900		
アルフレッサホールディングス	73,900	2,361.00	174,477,900		
大黒天物産	1,600	5,840.00	9,344,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	5,800	1,006.00	5,834,800	貸付株式数	2,200株
ファーマライズHD	1,500	795.00	1,192,500		
キッコーマン	49,100	5,800.00	284,780,000		
味の素	150,400	2,174.00	326,969,600		
キューピー	38,100	2,109.00	80,352,900	貸付株式数	15,100株
ハウス食品G本社	25,600	3,670.00	93,952,000		
カゴメ	26,000	3,605.00	93,730,000	貸付株式数	10,400株
焼津水産化工	3,200	987.00	3,158,400		
アリアケジャパン	6,200	7,250.00	44,950,000		
ピエトロ	800	1,715.00	1,372,000	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,700	2,339.00	3,976,300	貸付株式数	500株
やまみ	600	2,206.00	1,323,600	貸付株式数	100株
ニチレイ	32,600	2,799.00	91,247,400		
横浜冷凍	17,500	928.00	16,240,000	貸付株式数	6,800株
東洋水産	35,100	5,720.00	200,772,000		
イトアアンド	2,300	1,989.00	4,574,700	貸付株式数	900株
大冷	800	2,410.00	1,928,000	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・HLD GS	3,800	938.00	3,564,400	貸付株式数	1,500株 (100株)
日清食品HD	29,000	10,020.00	290,580,000		
永谷園ホールディングス	3,400	2,349.00	7,986,600		
一正蒲鉾	2,600	1,081.00	2,810,600		
フジッコ	7,400	2,072.00	15,332,800		
ロックフィールド	7,300	1,446.00	10,555,800	貸付株式数	2,900株 (2,400株)
日本たばこ産業	364,800	1,955.50	713,366,400	貸付株式数	153,400株
ケンコーマヨネーズ	3,800	1,852.00	7,037,600	貸付株式数	800株
わらべや日洋HD	4,400	1,556.00	6,846,400		
なとり	3,900	2,051.00	7,998,900		
イフジ産業	1,000	945.00	945,000	貸付株式数	400株
ピックルスコーポレーション	1,500	2,885.00	4,327,500	貸付株式数	200株
北の達人コーポ	23,800	569.00	13,542,200	貸付株式数	9,500株
ユーグレナ	29,400	926.00	27,224,400	貸付株式数	11,700株

スター・マイカ・HLDGS	3,300	1,274.00	4,204,200	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
ADワークスグループ	14,900	157.00	2,339,300		
片倉工業	9,200	1,264.00	11,628,800	貸付株式数	3,600株
グンゼ	4,900	4,145.00	20,310,500	貸付株式数	1,700株
ヒューリック	141,500	989.00	139,943,500	貸付株式数	56,900株
神栄	1,000	658.00	658,000	貸付株式数	300株
ラサ商事	3,400	922.00	3,134,800		
アルペン	5,100	1,975.00	10,072,500	貸付株式数	2,000株
ハブ	1,900	694.00	1,318,600	貸付株式数	600株
ラクーンホールディングス	3,200	2,101.00	6,723,200	貸付株式数	1,200株
クオールホールディングス	9,800	1,251.00	12,259,800	貸付株式数	3,900株
アルコニックス	7,100	1,553.00	11,026,300		
神戸物産	23,000	5,550.00	127,650,000	貸付株式数	9,200株
ソリトンシステムズ	3,100	2,126.00	6,590,600	貸付株式数	600株
ジンスホールディングス	3,600	8,450.00	30,420,000	貸付株式数	1,400株
ビックカメラ	39,800	1,126.00	44,814,800	貸付株式数	15,700株
DCMホールディングス	37,300	1,525.00	56,882,500	貸付株式数	14,900株
ペッパーフードサービス	5,700	357.00	2,034,900	貸付株式数	2,200株 (300株)
ハイパー	900	562.00	505,800	貸付株式数	200株
MonotaRO	47,500	5,040.00	239,400,000	貸付株式数	19,000株
東京一番フーズ	1,500	585.00	877,500	貸付株式数	600株 (600株)
DDホールディングス	2,700	750.00	2,025,000	貸付株式数	1,000株
あいホールディングス	9,500	1,896.00	18,012,000	貸付株式数	800株
ディーブイエックス	2,300	998.00	2,295,400		
きちりホールディングス	1,700	641.00	1,089,700	貸付株式数	400株
アークランドサービスHD	4,900	2,113.00	10,353,700	貸付株式数	1,900株
J. フロントリテイリング	79,800	704.00	56,179,200	貸付株式数	32,000株
ドトール・日レスHD	9,700	1,662.00	16,121,400	貸付株式数	4,000株
マツモトキヨシHLDGS	27,500	3,790.00	104,225,000		
ブロンコビリー	3,500	2,379.00	8,326,500	貸付株式数	500株
ZOZO	45,900	2,906.00	133,385,400		
トレジャー・ファクトリー	2,000	778.00	1,556,000	貸付株式数	300株
物語コーポレーション	1,800	9,890.00	17,802,000	貸付株式数	700株 (100株)
ココカラファイン	6,900	6,670.00	46,023,000		
三越伊勢丹HD	117,300	553.00	64,866,900		

東洋紡	26,400	1,662.00	43,876,800		
ユニチカ	19,800	366.00	7,246,800	貸付株式数	7,900株
富士紡ホールディングス	3,200	3,715.00	11,888,000		
日清紡ホールディングス	42,400	737.00	31,248,800	貸付株式数	16,700株
倉敷紡績	6,600	2,029.00	13,391,400	貸付株式数	1,200株
ダイワボウHD	5,700	6,590.00	37,563,000		
シキボウ	4,000	985.00	3,940,000	貸付株式数	600株
日東紡績	10,100	4,495.00	45,399,500	貸付株式数	1,400株
トヨタ紡織	19,800	1,485.00	29,403,000		
マクニカ・富士エレHLDGS	15,900	1,961.00	31,179,900	貸付株式数	700株
Hamee	2,400	2,337.00	5,608,800	貸付株式数	900株
ラクト・ジャパン	2,500	3,715.00	9,287,500	貸付株式数	1,000株
ウエルシアHD	39,600	4,560.00	180,576,000	貸付株式数	15,900株
クリエイトSDH	11,200	3,755.00	42,056,000	貸付株式数	4,500株
バイタルKSKHD	11,500	1,100.00	12,650,000	貸付株式数	1,000株
八洲電機	5,100	1,016.00	5,181,600	貸付株式数	2,000株
メディアスホールディングス	3,700	893.00	3,304,100	貸付株式数	600株
レスターホールディングス	7,000	2,185.00	15,295,000		
ジューテックHD	1,300	1,030.00	1,339,000	貸付株式数	100株
丸善CHIHD	5,600	385.00	2,156,000	貸付株式数	2,800株
大光	2,800	698.00	1,954,400	貸付株式数	100株
OCHIホールディングス	1,900	1,632.00	3,100,800	貸付株式数	100株
TOKAIホールディングス	34,900	1,070.00	37,343,000	貸付株式数	14,100株
黒谷	1,600	509.00	814,400	貸付株式数	200株
ミサワ	1,600	708.00	1,132,800	貸付株式数	200株
ティーライフ	900	1,274.00	1,146,600	貸付株式数	200株
Cominix	1,100	724.00	796,400	貸付株式数	400株
エー・ピーカンパニー	1,500	437.00	655,500	貸付株式数	400株
三洋貿易	6,700	1,013.00	6,787,100		
チムニー	2,000	1,432.00	2,864,000	貸付株式数	800株
シュッピン	4,600	837.00	3,850,200		
ビューティガレージ	1,100	2,729.00	3,001,900	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	6,600	3,275.00	21,615,000	貸付株式数	2,600株
ウイン・パートナーズ	4,800	997.00	4,785,600	貸付株式数	1,900株
ネクステージ	9,600	1,173.00	11,260,800	貸付株式数	3,800株
ジョイフル本田	19,600	1,688.00	33,084,800	貸付株式数	7,700株
鳥貴族	2,300	1,501.00	3,452,300	貸付株式数	700株

キリン堂ホールディングス	2,600	3,505.00	9,113,000	貸付株式数	1,000株
ホットランド	4,500	1,193.00	5,368,500	貸付株式数	1,800株
すかいらーくHD	74,900	1,530.00	114,597,000	貸付株式数	30,000株 (2,800株)
SFPホールディングス	3,800	1,416.00	5,380,800	貸付株式数	1,400株
綿半ホールディングス	2,500	3,245.00	8,112,500	貸付株式数	900株
日本毛織	21,400	988.00	21,143,200	貸付株式数	8,400株
ダイトウボウ	12,100	114.00	1,379,400	貸付株式数	4,100株
トーア紡コーポレーション	2,600	498.00	1,294,800	貸付株式数	1,000株
ダイドーリミテッド	9,700	200.00	1,940,000	貸付株式数	2,700株
ヨシックス	1,100	1,811.00	1,992,100	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパー マーケ	19,300	1,279.00	24,684,700	貸付株式数	7,800株
三栄建築設計	2,700	1,428.00	3,855,600	貸付株式数	300株
野村不動産HLDS	40,500	2,078.00	84,159,000		
三重交通グループHD	13,300	482.00	6,410,600	貸付株式数	5,300株
サムティ	9,500	1,521.00	14,449,500	貸付株式数	3,800株
日本商業開発	4,500	1,701.00	7,654,500	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーショ ン	11,100	1,442.00	16,006,200	貸付株式数	4,300株
フィル・カンパニー	1,200	1,947.00	2,336,400	貸付株式数	400株
ハウスコム	900	1,325.00	1,192,500		
日本管理センター	3,900	1,301.00	5,073,900	貸付株式数	1,300株
サンセイランディック	2,500	735.00	1,837,500	貸付株式数	300株
エストラスト	1,400	666.00	932,400	貸付株式数	300株
フージャースHD	13,300	660.00	8,778,000	貸付株式数	3,300株
オープンハウス	19,500	3,690.00	71,955,000		
東急不動産HD	181,900	474.00	86,220,600	貸付株式数	72,700株
飯田GHD	55,500	2,165.00	120,157,500		
イーランド	1,000	795.00	795,000		
帝国繊維	7,500	2,703.00	20,272,500	貸付株式数	3,000株
日本コークス工業	56,000	61.00	3,416,000		
ゴルフダイジェスト・オン	2,900	674.00	1,954,600		
ミタチ産業	2,000	622.00	1,244,000	貸付株式数	600株
B E E N O S	3,000	1,751.00	5,253,000	貸付株式数	1,200株
あさひ	5,000	1,903.00	9,515,000	貸付株式数	1,900株
日本調剤	4,100	1,708.00	7,002,800	貸付株式数	400株
コスモス薬品	5,900	18,040.00	106,436,000	貸付株式数	2,300株
シップヘルスケアHD	10,700	5,200.00	55,640,000		
トーエル	3,200	825.00	2,640,000	貸付株式数	1,200株

ソフトクリエイイトHD	2,900	2,728.00	7,911,200		
オンリー	1,100	512.00	563,200	貸付株式数	100株
セブン&アイ・HLDGS	260,500	3,363.00	876,061,500	貸付株式数	105,000株
クリエイイト・レストランツ・ホール	36,100	634.00	22,887,400	貸付株式数	14,400株 (800株)
明治電機工業	2,000	1,420.00	2,840,000		
ツルハホールディングス	14,500	15,190.00	220,255,000	貸付株式数	5,800株
デリカフーズHLDGS	2,200	685.00	1,507,000	貸付株式数	800株
スターティアホールディングス	1,700	734.00	1,247,800	貸付株式数	600株
サンマルクホールディングス	5,300	1,593.00	8,442,900		
フェリシモ	1,400	1,076.00	1,506,400	貸付株式数	400株
トリドールホールディングス	16,600	1,564.00	25,962,400	貸付株式数	6,600株 (1,600株)
帝人	54,100	1,689.00	91,374,900	貸付株式数	4,900株
東レ	480,700	494.60	237,754,220		
クラレ	104,800	1,077.00	112,869,600	貸付株式数	28,900株
旭化成	439,200	929.70	408,324,240		
サカイオーベックス	1,700	2,105.00	3,578,500		
TOKYO BASE	6,000	401.00	2,406,000	貸付株式数	2,300株
稲葉製作所	3,700	1,372.00	5,076,400	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングG	2,000	1,675.00	3,350,000	貸付株式数	700株
トーカロ	18,700	1,100.00	20,570,000	貸付株式数	1,100株
アルファCO	2,200	1,003.00	2,206,600		
SUMCO	80,100	1,462.00	117,106,200	貸付株式数	32,000株
川田テクノロジーズ	1,400	4,920.00	6,888,000		
RS TECHNOLOGIES	1,900	3,460.00	6,574,000	貸付株式数	700株
信和	3,600	713.00	2,566,800		
ビーロット	3,400	709.00	2,410,600	貸付株式数	500株
ファーストブラザーズ	1,500	922.00	1,383,000	貸付株式数	500株
ハウスドゥ	3,500	1,114.00	3,899,000	貸付株式数	1,200株
シーアールイー	1,800	1,459.00	2,626,200	貸付株式数	600株
プロパティエージェント	1,100	1,363.00	1,499,300	貸付株式数	400株
ケイアイスター不動産	2,200	2,665.00	5,863,000	貸付株式数	800株
アグレ都市デザイン	1,700	626.00	1,064,200	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,300	2,999.00	3,898,700	貸付株式数	400株
テンポイノベーション	1,700	747.00	1,269,900	貸付株式数	600株

グローバルリンクマネジメン ト	1,400	666.00	932,400		
住江織物	1,400	1,938.00	2,713,200	貸付株式数	400株
日本フエルト	3,500	493.00	1,725,500		
イチカワ	900	1,388.00	1,249,200	貸付株式数	100株
エコナックホールディング ス	13,500	97.00	1,309,500		
日東製網	800	1,488.00	1,190,400		
芦森工業	1,300	883.00	1,147,900	貸付株式数	500株
アツギ	5,300	544.00	2,883,200		
ウイルプラスHLDGS	1,100	582.00	640,200		
JMホールディングス	5,100	3,050.00	15,555,000	貸付株式数	1,300株
コマダホールディングス	14,600	1,934.00	28,236,400	貸付株式数	5,600株
サツドラホールディングス	900	2,060.00	1,854,000		
アレンザホールディングス	3,300	1,701.00	5,613,300	貸付株式数	1,100株 (300株)
串カツ田中HLDGS	1,300	1,801.00	2,341,300	貸付株式数	500株
パロックジャパン	4,600	632.00	2,907,200		
クスリのアオキHLDGS	6,000	9,070.00	54,420,000	貸付株式数	2,300株
ダイニック	2,400	816.00	1,958,400		
共和レザー	3,600	652.00	2,347,200	貸付株式数	600株
ピーバンドットコム	600	970.00	582,000		
力の源HD	3,000	674.00	2,022,000	貸付株式数	1,200株
スシローグローバルHLD GS	36,700	2,726.00	100,044,200		
アセンテック	1,400	2,269.00	3,176,600	貸付株式数	500株
セーレン	16,400	1,508.00	24,731,200		
ソトー	2,400	976.00	2,342,400	貸付株式数	300株
東海染工	900	1,140.00	1,026,000	貸付株式数	200株
小松マテーレ	10,800	893.00	9,644,400		
ワコールホールディングス	16,700	1,971.00	32,915,700	貸付株式数	3,300株
ホギメディカル	7,500	3,700.00	27,750,000		
クラウディアHLDGS	1,700	318.00	540,600	貸付株式数	600株
TSIホールディングス	22,100	324.00	7,160,400		
マツオカコーポレーション	1,900	2,192.00	4,164,800	貸付株式数	700株
ワールド	9,500	1,418.00	13,471,000		
TIS	66,300	2,239.00	148,445,700		
JNSホールディングス	2,800	786.00	2,200,800		
電算システム	2,500	3,635.00	9,087,500	貸付株式数	900株
グリー	40,900	474.00	19,386,600	貸付株式数	16,300株

コーエーテクモHD	13,600	4,900.00	66,640,000	
三菱総合研究所	2,900	4,465.00	12,948,500	
ボルテージ	1,900	551.00	1,046,900	貸付株式数 600株
電算	700	2,356.00	1,649,200	
AGS	3,700	926.00	3,426,200	
ファインデックス	5,700	1,354.00	7,717,800	貸付株式数 2,100株
ブレインパッド	1,700	4,435.00	7,539,500	
KLab	12,600	936.00	11,793,600	貸付株式数 3,600株
ポルトゥウィン・ピット クル	8,000	958.00	7,664,000	貸付株式数 3,100株
イーブックイニシアティブ	900	3,280.00	2,952,000	貸付株式数 300株
ネクソン	167,200	2,680.00	448,096,000	貸付株式数 72,400株
アイスタイル	18,400	310.00	5,704,000	貸付株式数 7,300株
エムアップホールディング ス	1,900	3,270.00	6,213,000	貸付株式数 700株
エイチーム	4,500	818.00	3,681,000	貸付株式数 1,600株
エニグモ	6,300	1,774.00	11,176,200	貸付株式数 2,400株
テクノスジャパン	5,300	971.00	5,146,300	
enish	3,500	615.00	2,152,500	貸付株式数 1,400株
コロプラ	21,900	920.00	20,148,000	貸付株式数 8,700株 (8,700株)
オルトプラス	4,600	533.00	2,451,800	貸付株式数 1,600株
ブロードリーフ	32,900	554.00	18,226,600	貸付株式数 13,100株
クロス・マーケティングG	3,200	372.00	1,190,400	
デジタルハーツHLDGS	3,700	1,079.00	3,992,300	貸付株式数 1,400株
システム情報	4,900	1,433.00	7,021,700	貸付株式数 1,900株
メディアドゥ	2,100	7,760.00	16,296,000	貸付株式数 800株
じげん	16,500	346.00	5,709,000	貸付株式数 2,800株
ブイキューブ	3,700	1,791.00	6,626,700	貸付株式数 1,600株
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	901.00	1,171,300	貸付株式数 100株
サイバーリンクス	1,200	2,355.00	2,826,000	貸付株式数 200株
ディー・エル・イー	4,300	445.00	1,913,500	
フィックスターズ	7,100	1,061.00	7,533,100	貸付株式数 2,700株
CARTA HOLDING GS	3,100	1,233.00	3,822,300	貸付株式数 1,200株
オプティム	3,500	3,200.00	11,200,000	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
セレス	2,300	2,264.00	5,207,200	貸付株式数 800株
SHIFT	2,700	15,250.00	41,175,000	貸付株式数 1,000株
特種東海製紙	4,100	4,645.00	19,044,500	貸付株式数 300株

ティーガイア	5,900	2,020.00	11,918,000	貸付株式数	2,400株
セック	1,000	3,185.00	3,185,000		
日本アジアグループ	7,300	314.00	2,292,200		
テクマトリックス	9,400	2,288.00	21,507,200	貸付株式数	3,700株
プロシップ	1,900	1,603.00	3,045,700	貸付株式数	700株
ガンホー・オンライン・エンター	16,100	2,339.00	37,657,900	貸付株式数	6,400株
GMOペイメントゲートウェイ	14,100	10,850.00	152,985,000	貸付株式数	1,100株
ザッパラス	2,900	474.00	1,374,600	貸付株式数	1,300株
システムリサーチ	1,800	1,871.00	3,367,800	貸付株式数	700株
インターネットイニシアティブ	9,900	4,790.00	47,421,000		
さくらインターネット	7,000	810.00	5,670,000	貸付株式数	2,800株
ヴィンクス	1,900	1,311.00	2,490,900	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインHD	1,200	9,330.00	11,196,000	貸付株式数	400株 (400株)
SRAホールディングス	3,600	2,399.00	8,636,400		
システムインテグレータ	2,300	729.00	1,676,700	貸付株式数	800株
朝日ネット	4,700	979.00	4,601,300		
eBASE	8,000	1,374.00	10,992,000	貸付株式数	3,100株
アバント	6,300	1,056.00	6,652,800	貸付株式数	2,500株
アドソル日進	2,400	2,596.00	6,230,400	貸付株式数	900株
フリービット	3,700	913.00	3,378,100	貸付株式数	1,400株 (1,300株)
コムチュア	7,500	2,710.00	20,325,000	貸付株式数	3,000株
サイバーコム	1,200	1,896.00	2,275,200	貸付株式数	400株 (400株)
アステリア	4,400	819.00	3,603,600	貸付株式数	1,600株
アイル	3,700	1,526.00	5,646,200	貸付株式数	1,400株
王子ホールディングス	277,100	494.00	136,887,400		
日本製紙	29,300	1,319.00	38,646,700		
三菱製紙	7,300	362.00	2,642,600		
北越コーポレーション	39,900	364.00	14,523,600		
中越パルプ	2,800	1,520.00	4,256,000		
巴川製紙	2,100	925.00	1,942,500		
大王製紙	29,000	1,390.00	40,310,000	貸付株式数	200株
阿波製紙	2,000	479.00	958,000		
マークライنز	3,200	2,259.00	7,228,800	貸付株式数	1,100株
メディカル・データ・ビジ	5,000	2,052.00	10,260,000	貸付株式数	100株

g u m i	8,600	1,034.00	8,892,400	貸付株式数	3,400株
ショーケース	1,600	1,053.00	1,684,800	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,600	1,306.00	2,089,600	貸付株式数	100株
テラスカイ	2,400	4,920.00	11,808,000	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメーション	2,900	1,341.00	3,888,900	貸付株式数	1,000株
P C Iホールディングス	2,800	1,296.00	3,628,800	貸付株式数	1,000株
パイプドHD	900	1,888.00	1,699,200	貸付株式数	300株 (200株)
アイピーシー	1,400	1,116.00	1,562,400	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,200	2,143.00	2,571,600		
P R T I M E S	1,200	2,510.00	3,012,000	貸付株式数	400株
ランドコンピュータ	1,000	1,071.00	1,071,000	貸付株式数	400株
ダブルスタンダード	900	5,030.00	4,527,000	貸付株式数	300株
オープンドア	3,400	1,413.00	4,804,200	貸付株式数	1,300株
マイネット	2,100	1,451.00	3,047,100	貸付株式数	800株
アカツキ	2,400	4,480.00	10,752,000	貸付株式数	900株
ベネフィットジャパン	500	1,913.00	956,500	貸付株式数	200株 (200株)
U B I C O Mホールディングス	1,600	2,280.00	3,648,000		
L I N E	20,400	5,360.00	109,344,000		
カナミックネットワーク	6,000	810.00	4,860,000		
ノムラシステムコーポレーション	3,600	429.00	1,544,400	貸付株式数	1,100株
レンゴー	62,500	804.00	50,250,000		
トーモク	4,100	1,690.00	6,929,000	貸付株式数	1,400株
ザ・パック	5,000	3,135.00	15,675,000	貸付株式数	2,000株
チェンジ	4,600	11,410.00	52,486,000	貸付株式数	1,800株
シンクロ・フード	2,700	337.00	909,900	貸付株式数	400株
オークネット	3,600	1,320.00	4,752,000	貸付株式数	1,500株
セグエグループ	1,300	1,500.00	1,950,000	貸付株式数	100株
エイトレッド	1,100	2,308.00	2,538,800	貸付株式数	400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	802.00	10,827,000	貸付株式数	5,200株
ビーグリー	1,300	2,027.00	2,635,100	貸付株式数	100株
オロ	1,700	3,405.00	5,788,500	貸付株式数	600株
ユーザーローカル	600	4,405.00	2,643,000	貸付株式数	200株
テモナ	1,300	1,358.00	1,765,400	貸付株式数	500株

ニーズウェル	1,000	880.00	880,000		
サインポスト	1,300	1,377.00	1,790,100	貸付株式数	500株
昭和電工	47,500	2,070.00	98,325,000	貸付株式数	19,000株
住友化学	488,400	365.00	178,266,000		
住友精化	3,000	3,420.00	10,260,000		
日産化学	36,800	5,420.00	199,456,000		
ラサ工業	2,300	2,052.00	4,719,600	貸付株式数	800株
クレハ	5,700	4,805.00	27,388,500		
多木化学	2,600	6,710.00	17,446,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,900	1,434.00	7,026,600	貸付株式数	400株
石原産業	11,900	748.00	8,901,200		
片倉コープアグリ	1,600	1,268.00	2,028,800	貸付株式数	200株
日本曹達	9,900	3,120.00	30,888,000		
東ソー	102,500	1,755.00	179,887,500		
トクヤマ	19,200	2,626.00	50,419,200		
セントラル硝子	13,500	2,263.00	30,550,500		
東亜合成	41,500	1,160.00	48,140,000	貸付株式数	16,800株
大阪ソーダ	6,700	2,633.00	17,641,100		
関東電化	15,800	754.00	11,913,200		
デンカ	24,200	3,260.00	78,892,000		
イビデン	41,500	3,635.00	150,852,500		
信越化学	113,700	14,000.00	1,591,800,000		
日本カ - バイド	2,100	1,277.00	2,681,700		
堺 化 学	4,300	2,045.00	8,793,500	貸付株式数	400株
第一稀元素化学工	7,100	755.00	5,360,500	貸付株式数	1,800株
エア・ウォーター	61,800	1,497.00	92,514,600		
大陽日酸	63,700	1,673.00	106,570,100		
日本化学工業	2,100	2,397.00	5,033,700	貸付株式数	500株
東邦アセチレン	800	1,260.00	1,008,000		
日本パ - カライジング	33,600	1,009.00	33,902,400		
高圧ガス	10,600	858.00	9,094,800		
チタン工業	900	1,698.00	1,528,200	貸付株式数	100株
四国化成	9,700	1,150.00	11,155,000		
戸田工業	1,500	2,484.00	3,726,000	貸付株式数	500株
ステラ ケミファ	3,600	3,040.00	10,944,000	貸付株式数	1,400株 (100株)
保土谷化学	2,500	4,850.00	12,125,000		
日本触媒	10,200	5,780.00	58,956,000		
大日精化	5,900	2,293.00	13,528,700		
カネカ	17,200	2,996.00	51,531,200		

協和キリン	68,000	2,875.00	195,500,000	貸付株式数	27,400株
三菱瓦斯化学	61,800	1,988.00	122,858,400		
三井化学	61,500.04	2,631.00	161,806,605		
J S R	61,800	2,500.00	154,500,000		
東京応化工業	11,400	5,360.00	61,104,000	貸付株式数	4,500株 (100株)
大阪有機化学	6,100	2,793.00	17,037,300		
三菱ケミカルH L D G S	442,500	653.20	289,041,000		
K H ネオケム	11,000	2,461.00	27,071,000	貸付株式数	4,400株
ダイセル	86,700	811.00	70,313,700		
住友ベ - クライト	10,500	2,945.00	30,922,500		
積水化学	139,900	1,698.00	237,550,200		
日本ゼオン	60,200	1,183.00	71,216,600		
アイカ工業	19,900	3,795.00	75,520,500		
宇部興産	33,400	1,888.00	63,059,200		
積水樹脂	11,900	2,247.00	26,739,300		
タキロンシーアイ	14,000	704.00	9,856,000		
旭有機材	3,800	1,399.00	5,316,200		
ニチバン	3,500	1,749.00	6,121,500	貸付株式数	1,400株
リケンテクノス	16,600	412.00	6,839,200		
大倉工業	3,100	1,561.00	4,839,100	貸付株式数	1,200株
積水化成成品	8,900	603.00	5,366,700		
群栄化学	1,400	2,650.00	3,710,000		
タイガース ポリマー	3,400	433.00	1,472,200	貸付株式数	1,300株
ミライアル	2,300	1,169.00	2,688,700	貸付株式数	800株
ダイキアクシス	2,400	874.00	2,097,600	貸付株式数	400株
ダイキョーニシカワ	14,100	574.00	8,093,400		
竹本容器	2,200	989.00	2,175,800		
森六ホールディングス	3,600	1,832.00	6,595,200		
日本化薬	41,400	1,004.00	41,565,600		
カーリットホールディングス	6,900	533.00	3,677,700	貸付株式数	2,700株
E P S ホールディングス	9,000	1,067.00	9,603,000		
ソルクシーズ	3,000	1,146.00	3,438,000	貸付株式数	1,000株
レグス	1,700	1,105.00	1,878,500	貸付株式数	500株
プレステージ・インター	24,300	920.00	22,356,000		
フェイス	2,300	1,083.00	2,490,900		
プロトコーポレーション	6,000	1,256.00	7,536,000	貸付株式数	500株
ハイマックス	800	2,386.00	1,908,800		
アミューズ	3,500	2,496.00	8,736,000	貸付株式数	600株

野村総合研究所	94,000	3,210.00	301,740,000	
ドリームインキュベータ	1,900	1,517.00	2,882,300	
サイバネットシステム	5,100	887.00	4,523,700	貸付株式数 1,900株
クイック	3,900	1,221.00	4,761,900	
T A C	4,400	228.00	1,003,200	貸付株式数 1,600株
C Eホールディングス	4,000	676.00	2,704,000	貸付株式数 1,400株
ケネディクス	56,800	538.00	30,558,400	貸付株式数 22,900株
日本システム技術	1,200	1,884.00	2,260,800	貸付株式数 400株
電通グループ	67,100	3,200.00	214,720,000	貸付株式数 26,800株
インテージホールディングス	8,400	946.00	7,946,400	貸付株式数 3,300株
テイクアンドギヴニーズ	2,400	647.00	1,552,800	貸付株式数 900株
東邦システムサイエンス	1,700	980.00	1,666,000	貸付株式数 600株
ぴあ	1,800	3,475.00	6,255,000	貸付株式数 700株
イオンファンタジー	2,500	1,705.00	4,262,500	貸付株式数 1,000株 (200株)
ソースネクスト	31,600	344.00	10,870,400	貸付株式数 12,600株
シーティーエス	7,300	948.00	6,920,400	貸付株式数 2,900株
ネクシィーズグループ	2,400	1,126.00	2,702,400	貸付株式数 800株
インフォコム	7,300	4,035.00	29,455,500	
メディカルシステムネットワーク	6,400	460.00	2,944,000	
日本精化	5,400	1,688.00	9,115,200	
扶桑化学工業	6,700	3,640.00	24,388,000	
トリケミカル	1,500	11,800.00	17,700,000	貸付株式数 500株
H E R O Z	900	3,795.00	3,415,500	貸付株式数 300株
ラクスル	5,300	4,435.00	23,505,500	貸付株式数 2,000株
F I G	7,700	272.00	2,094,400	貸付株式数 2,900株
システムサポート	1,400	1,785.00	2,499,000	貸付株式数 200株
A D E K A	30,500	1,597.00	48,708,500	
日油	24,900	4,190.00	104,331,000	
ミヨシ油脂	2,500	1,150.00	2,875,000	貸付株式数 400株
新日本理化	10,700	163.00	1,744,100	
ハリマ化成グループ	5,500	1,099.00	6,044,500	貸付株式数 1,200株
イーソル	3,100	1,221.00	3,785,100	貸付株式数 1,200株
アルテリア・ネットワークス	7,400	1,814.00	13,423,600	貸付株式数 2,100株
東海ソフト	400	1,347.00	538,800	貸付株式数 100株
ヒト・コミュニケーションズHD	1,600	1,326.00	2,121,600	貸付株式数 200株

トピラスシステムズ	800	2,074.00	1,659,200	貸付株式数	200株
花王	162,000	8,202.00	1,328,724,000	貸付株式数	64,900株
第一工業製薬	2,500	4,300.00	10,750,000	貸付株式数	1,000株
石原ケミカル	1,800	2,341.00	4,213,800	貸付株式数	700株
日華化学	2,200	939.00	2,065,800	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	3,395.00	4,753,000	貸付株式数	500株
三洋化成	3,900	5,020.00	19,578,000		
武田薬品	562,500	3,923.00	2,206,687,500		
アステラス製薬	586,300	1,623.50	951,858,050		
大日本住友製薬	50,200	1,383.00	69,426,600		
塩野義製薬	85,100	5,769.00	490,941,900		
わかもと製薬	8,500	283.00	2,405,500	貸付株式数	900株
あすか製薬	7,700	1,516.00	11,673,200		
日本新薬	17,700	8,640.00	152,928,000		
ピオフェルミン製薬	1,200	2,487.00	2,984,400		
中外製薬	211,400	4,805.00	1,015,777,000	貸付株式数	85,200株
科研製薬	11,600	4,850.00	56,260,000		
エーザイ	81,000	9,548.00	773,388,000		
理研ビタミン	6,500	2,236.00	14,534,000		
ロート製薬	34,700	3,615.00	125,440,500		
小野薬品	155,300	3,360.00	521,808,000		
久光製薬	17,900	5,440.00	97,376,000	貸付株式数	7,200株
有機合成薬品	5,900	343.00	2,023,700	貸付株式数	2,100株
持田製薬	9,300	4,025.00	37,432,500		
参天製薬	126,100	2,121.00	267,458,100		
扶桑薬品	2,400	2,900.00	6,960,000		
日本ケミファ	900	2,558.00	2,302,200		
ツムラ	21,000	3,285.00	68,985,000		
日医工	19,200	1,216.00	23,347,200	貸付株式数	7,600株
テルモ	191,400	4,145.00	793,353,000		
HUグループHD	18,200	2,867.00	52,179,400		
キッセイ薬品工業	12,000	2,362.00	28,344,000		
生化学工業	13,200	1,166.00	15,391,200		
栄研化学	11,900	2,112.00	25,132,800		
日水製薬	2,800	1,176.00	3,292,800	貸付株式数	1,100株
鳥居薬品	4,300	3,000.00	12,900,000		
JCRファーマ	4,800	12,320.00	59,136,000		
東和薬品	8,600	2,196.00	18,885,600		
富士製薬工業	4,600	1,310.00	6,026,000		
沢井製薬	13,900	5,650.00	78,535,000		

ゼリア新薬工業	12,300	2,063.00	25,374,900	貸付株式数	2,300株
第一三共	193,500	9,762.00	1,888,947,000		
キョーリン製薬HD	15,000	2,201.00	33,015,000	貸付株式数	2,500株
大幸薬品	8,300	2,389.00	19,828,700		
ダイト	4,200	3,510.00	14,742,000	貸付株式数	1,400株
大塚ホールディングス	140,500	4,483.00	629,861,500	貸付株式数	56,600株
大正製薬HD	14,300	6,810.00	97,383,000		
ペプチドリーム	34,400	4,350.00	149,640,000	貸付株式数	13,800株
大日本塗料	7,500	1,028.00	7,710,000		
日本ペイントHOLD	54,700	11,040.00	603,888,000	貸付株式数	22,000株
関西ペイント	74,500	2,640.00	196,680,000		
神東塗料	6,800	172.00	1,169,600	貸付株式数	2,700株
中国塗料	18,800	1,032.00	19,401,600		
日本特殊塗料	5,000	1,014.00	5,070,000		
藤倉化成	8,900	565.00	5,028,500		
太陽ホールディングス	4,900	5,590.00	27,391,000		
D I C	28,100	2,627.00	73,818,700	貸付株式数	11,200株
サカティンクス	14,600	1,029.00	15,023,400	貸付株式数	4,200株
東洋インキSCホールディングン	13,900	1,978.00	27,494,200	貸付株式数	5,600株
T & K TOKA	5,100	818.00	4,171,800	貸付株式数	2,000株
アルプス技研	5,700	2,017.00	11,496,900	貸付株式数	1,100株
サニックス	11,400	260.00	2,964,000	貸付株式数	4,500株
ダイオーズ	1,200	1,044.00	1,252,800	貸付株式数	400株
日本空調サービス	6,800	745.00	5,066,000		
オリエンタルランド	68,700	15,130.00	1,039,431,000		
フォーカスシステムズ	4,200	1,021.00	4,288,200	貸付株式数	1,600株
ダスキン	16,200	2,921.00	47,320,200	貸付株式数	100株
パーク24	36,000	1,873.00	67,428,000	貸付株式数	14,400株
明光ネットワークジャパン	8,100	747.00	6,050,700	貸付株式数	3,200株
ファルコホールディングス	3,500	1,594.00	5,579,000	貸付株式数	1,400株
クレスコ	4,000	1,320.00	5,280,000		
フジ・メディア・HD	64,400	1,050.00	67,620,000		
秀英予備校	1,400	458.00	641,200	貸付株式数	500株
田谷	1,200	588.00	705,600	貸付株式数	400株
ラウンドワン	18,100	829.00	15,004,900	貸付株式数	7,200株
リゾートトラスト	29,800	1,625.00	48,425,000		
オービック	23,000	18,740.00	431,020,000		
ジャストシステム	10,800	7,400.00	79,920,000		
TDCソフト	5,900	1,060.00	6,254,000		

Zホールディングス	912,600	690.00	629,694,000		
ビー・エム・エル	8,300	3,155.00	26,186,500		
ワタベウェディング	1,000	396.00	396,000	貸付株式数	400株
トレンドマイクロ	35,500	6,470.00	229,685,000	貸付株式数	14,200株
りらいあコミュニケーション	11,700	1,349.00	15,783,300	貸付株式数	3,300株
IDホールディングス	2,500	1,500.00	3,750,000		
リソー教育	29,600	287.00	8,495,200		
日本オラクル	13,400	12,870.00	172,458,000	貸付株式数	5,400株
早稲田アカデミー	2,800	1,016.00	2,844,800	貸付株式数	1,100株
アルファシステムズ	2,100	3,800.00	7,980,000	貸付株式数	800株
フューチャー	8,000	2,298.00	18,384,000	貸付株式数	3,200株
CAC HOLDINGS	4,400	1,451.00	6,384,400	貸付株式数	1,700株
SBテクノロジー	2,400	3,635.00	8,724,000	貸付株式数	900株
トーセ	1,800	907.00	1,632,600	貸付株式数	700株
ユー・エス・エス	72,900	1,910.00	139,239,000		
オービックビジネスC	6,800	6,080.00	41,344,000	貸付株式数	400株
伊藤忠テクノソリューションズ	30,100	4,075.00	122,657,500		
アイティフォー	8,100	890.00	7,209,000	貸付株式数	200株
東京個別指導学院	2,300	553.00	1,271,900		
東計電算	1,000	4,800.00	4,800,000	貸付株式数	400株
サイバーエージェント	39,900	6,220.00	248,178,000		
楽天	301,700	1,220.00	368,074,000	貸付株式数	121,400株
エクスネット	1,100	1,005.00	1,105,500		
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,346.00	4,576,400	貸付株式数	100株
テー・オー・ダブリュー	10,400	329.00	3,421,600		
大塚商会	35,900	5,530.00	198,527,000	貸付株式数	14,400株
サイボウズ	7,800	3,510.00	27,378,000	貸付株式数	3,100株
ソフトブレーン	4,100	868.00	3,558,800	貸付株式数	1,600株
山田コンサルティンググループ	4,100	1,185.00	4,858,500		
セントラルスポーツ	2,400	2,525.00	6,060,000	貸付株式数	900株
パラカ	1,700	1,803.00	3,065,100	貸付株式数	600株
電通国際情報サービス	4,100	6,450.00	26,445,000	貸付株式数	1,600株
ACCESS	6,100	915.00	5,581,500	貸付株式数	2,400株
デジタルガレージ	12,000	3,460.00	41,520,000		
イーエムシステムズ	9,300	880.00	8,184,000	貸付株式数	3,600株
ウェザーニューズ	2,300	6,310.00	14,513,000	貸付株式数	800株
CIJ	4,800	937.00	4,497,600	貸付株式数	1,800株
ビジネスエンジニアリング	800	3,800.00	3,040,000	貸付株式数	300株
日本エンタープライズ	7,300	304.00	2,219,200	貸付株式数	2,800株

WOWOW	3,200	2,801.00	8,963,200	貸付株式数	1,200株
スカラ	4,600	914.00	4,204,400	貸付株式数	1,700株 (100株)
インテリジェント ウェイブ	3,700	853.00	3,156,100	貸付株式数	700株
フルキャストホールディングス	6,200	1,703.00	10,558,600	貸付株式数	2,400株
エン・ジャパン	11,500	2,883.00	33,154,500		
富士フイルムHLDGS	129,700	5,283.00	685,205,100		
コニカミノルタ	148,900	302.00	44,967,800	貸付株式数	59,500株
資生堂	134,500	6,210.00	835,245,000	貸付株式数	54,100株
ライオン	88,000	2,229.00	196,152,000	貸付株式数	35,400株
高砂香料	4,300	2,142.00	9,210,600		
マンダム	15,300	1,832.00	28,029,600	貸付株式数	600株
ミルボン	9,100	5,780.00	52,598,000	貸付株式数	3,600株
ファンケル	27,500	3,325.00	91,437,500	貸付株式数	9,500株
コーセー	12,800	12,900.00	165,120,000		
コタ	3,900	1,359.00	5,300,100	貸付株式数	1,500株
シーボン	800	1,957.00	1,565,600	貸付株式数	300株
ポーラ・オルビスHD	29,100	2,042.00	59,422,200	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	5,800	5,280.00	30,624,000	貸付株式数	2,300株
アジュバンコスメジャパン	1,400	1,000.00	1,400,000		
エステー	4,400	2,165.00	9,526,000		
アグロカネショウ	2,700	1,679.00	4,533,300	貸付株式数	600株
コニシ	11,100	1,522.00	16,894,200	貸付株式数	500株
長谷川香料	11,700	2,084.00	24,382,800		
星光PMC	3,800	668.00	2,538,400	貸付株式数	700株
小林製薬	19,000	10,100.00	191,900,000	貸付株式数	7,600株
荒川化学工業	6,100	1,272.00	7,759,200	貸付株式数	400株
メック	4,600	1,900.00	8,740,000	貸付株式数	1,800株 (1,500株)
日本高純度化学	1,800	2,730.00	4,914,000	貸付株式数	700株
タカラバイオ	17,800	2,940.00	52,332,000	貸付株式数	7,100株
JCU	8,200	3,495.00	28,659,000		
新田ゼラチン	4,000	724.00	2,896,000		
OATアグリオ	1,200	1,228.00	1,473,600	貸付株式数	200株
デクセリアルズ	17,600	1,158.00	20,380,800		
アース製薬	4,800	7,850.00	37,680,000	貸付株式数	1,800株
北興化学	6,600	717.00	4,732,200	貸付株式数	2,700株
大成ラミック	2,200	2,847.00	6,263,400		

クミアイ化学	28,100	1,080.00	30,348,000	貸付株式数	11,200株
日本農薬	12,000	511.00	6,132,000	貸付株式数	2,200株
富士興産	2,200	673.00	1,480,600	貸付株式数	700株
ニチレキ	8,000	1,734.00	13,872,000	貸付株式数	3,100株
ユシロ化学	3,700	1,341.00	4,961,700		
ビーピー・カストロール	2,400	1,185.00	2,844,000	貸付株式数	900株
富士石油	17,700	185.00	3,274,500		
MORESCO	2,300	964.00	2,217,200	貸付株式数	900株
出光興産	74,900	2,418.00	181,108,200		
ENEOSホールディングス	1,014,500	401.00	406,814,500		
コスモエネルギーHLDGS	19,700	1,593.00	31,382,100	貸付株式数	2,300株
横浜ゴム	39,400	1,541.00	60,715,400	貸付株式数	13,900株
TOYO TIRE	35,900	1,716.00	61,604,400	貸付株式数	15,100株
ブリヂストン	179,500	3,404.00	611,018,000	貸付株式数	76,200株
住友ゴム	61,200	956.00	58,507,200	貸付株式数	24,400株
藤倉コンポジット	6,200	364.00	2,256,800		
オカモト	4,100	4,255.00	17,445,500		
アキレス	4,700	1,766.00	8,300,200	貸付株式数	600株
フコク	3,000	682.00	2,046,000	貸付株式数	1,200株
ニッタ	7,700	2,284.00	17,586,800		
クリエートメディック	2,100	1,044.00	2,192,400	貸付株式数	800株
住友理工	13,300	554.00	7,368,200		
三ツ星ベルト	9,000	1,691.00	15,219,000		
バンドー化学	12,000	613.00	7,356,000		
AGC	62,100	3,165.00	196,546,500	貸付株式数	26,100株
日本板硝子	32,300	406.00	13,113,800	貸付株式数	12,700株
石塚硝子	1,200	1,922.00	2,306,400		
有沢製作所	10,700	966.00	10,336,200	貸付株式数	700株
日本山村硝子	2,800	940.00	2,632,000		
日本電気硝子	25,500	2,060.00	52,530,000	貸付株式数	10,600株
オハラ	2,700	1,248.00	3,369,600	貸付株式数	300株
住友大阪セメント	12,800	3,610.00	46,208,000		
太平洋セメント	43,000	2,799.00	120,357,000		
リソルホールディングス	700	3,780.00	2,646,000		
日本ヒュ-ム	6,700	801.00	5,366,700	貸付株式数	2,400株
日本コンクリ-ト	14,600	325.00	4,745,000		
三谷セキサン	3,100	5,910.00	18,321,000		
アジアパイルHD	9,600	488.00	4,684,800		

東海カーボン	66,300	1,133.00	75,117,900	貸付株式数	27,800株
日本カーボン	3,500	3,860.00	13,510,000	貸付株式数	1,400株
東洋炭素	4,000	1,800.00	7,200,000	貸付株式数	1,000株
ノリタケ	3,800	3,480.00	13,224,000		
TOTO	48,300	4,815.00	232,564,500		
日本碍子	81,600	1,468.00	119,788,800		
日本特殊陶業	51,600	1,865.00	96,234,000		
ダントーホールディングス	6,300	473.00	2,979,900	貸付株式数	2,000株
MARUWA	2,600	9,310.00	24,206,000	貸付株式数	100株
品川リフラクトリーズ	1,700	2,481.00	4,217,700		
黒崎播磨	1,300	2,965.00	3,854,500		
ヨータイ	5,300	741.00	3,927,300	貸付株式数	2,000株
イソライト	3,400	464.00	1,577,600		
東京窯業	8,400	332.00	2,788,800	貸付株式数	2,500株
ニッカトー	3,000	720.00	2,160,000		
フジミインコーポレーテッド	6,100	3,730.00	22,753,000		
クニミネ工業	2,800	1,079.00	3,021,200	貸付株式数	900株
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,110.00	1,221,000		
ニチアス	18,600	2,499.00	46,481,400		
日本製鉄	299,900	1,035.00	310,396,500		
神戸製鋼所	123,200	415.00	51,128,000		
中山製鋼所	8,700	354.00	3,079,800	貸付株式数	100株
合同製鐵	3,600	2,091.00	7,527,600	貸付株式数	300株
JFEホールディングス	181,800	783.00	142,349,400	貸付株式数	68,500株
東京製鐵	32,600	725.00	23,635,000		
共英製鋼	7,600	1,405.00	10,678,000		
大和工業	14,200	2,665.00	37,843,000		
東京鐵鋼	2,700	1,713.00	4,625,100		
大阪製鐵	3,600	1,083.00	3,898,800		
淀川製鋼所	8,900	1,847.00	16,438,300		
丸一鋼管	21,700	2,845.00	61,736,500	貸付株式数	8,700株
モリ工業	2,000	2,563.00	5,126,000		
大同特殊鋼	11,100	3,335.00	37,018,500		
日本高周波	2,400	349.00	837,600		
日本冶金工	5,500	1,623.00	8,926,500		
山陽特殊製鋼	4,600	985.00	4,531,000		
愛知製鋼	3,600	2,575.00	9,270,000		
日立金属	72,100	1,644.00	118,532,400		
日本金属	1,600	612.00	979,200	貸付株式数	500株

大平洋金属	4,500	1,674.00	7,533,000	
新日本電工	43,600	221.00	9,635,600	貸付株式数 17,300株
栗本鉄工所	3,300	2,015.00	6,649,500	
虹 技	1,000	1,398.00	1,398,000	貸付株式数 300株
日本鑄鉄管	800	1,249.00	999,200	
日本製鋼所	20,400	1,784.00	36,393,600	
三菱製鋼	4,900	588.00	2,881,200	
日亜鋼業	9,600	314.00	3,014,400	貸付株式数 300株
日本精線	1,100	3,440.00	3,784,000	貸付株式数 100株
エンビプロHD	3,000	579.00	1,737,000	貸付株式数 1,100株
大紀アルミニウム	11,000	569.00	6,259,000	貸付株式数 300株
日本軽金属HD	170,700	176.00	30,043,200	
三井金属	18,200	2,639.00	48,029,800	
東邦亜鉛	3,400	2,027.00	6,891,800	貸付株式数 1,300株
三菱マテリアル	44,200	2,183.00	96,488,600	貸付株式数 15,700株
住友鉱山	85,500	3,483.00	297,796,500	
DOWAホールディングス	17,000	3,205.00	54,485,000	貸付株式数 5,400株
古河機金	12,000	1,157.00	13,884,000	
エス・サイエンス	37,600	46.00	1,729,600	貸付株式数 10,600株
大阪チタニウム	6,900	911.00	6,285,900	貸付株式数 2,700株
東邦チタニウム	12,000	684.00	8,208,000	貸付株式数 4,700株 (2,800株)
UACJ	10,200	1,859.00	18,961,800	
CKサンエツ	1,400	3,740.00	5,236,000	貸付株式数 500株
古河電工	20,900	2,539.00	53,065,100	貸付株式数 8,300株
住友電工	250,100	1,230.00	307,623,000	
フジクラ	81,200	306.00	24,847,200	
昭和電線HLDGS	7,800	1,197.00	9,336,600	貸付株式数 1,000株
東京特殊電線	1,000	2,418.00	2,418,000	貸付株式数 400株
タツタ電線	13,300	638.00	8,485,400	
カナレ電気	1,100	1,780.00	1,958,000	貸付株式数 300株
平河ヒューテック	3,300	1,010.00	3,333,000	
リョービ	8,300	1,227.00	10,184,100	貸付株式数 1,600株
アーレステイ	8,600	335.00	2,881,000	
アサヒHD	11,800	3,610.00	42,598,000	
東洋製罐グループHD	42,900	1,072.00	45,988,800	
ホッカンホールディングス	3,700	1,479.00	5,472,300	
コロナ	3,400	1,037.00	3,525,800	貸付株式数 200株
横河ブリッジHLDGS	12,500	1,965.00	24,562,500	
OSJB HD	33,300	244.00	8,125,200	

駒井ハルテック	1,200	1,565.00	1,878,000	貸付株式数	400株
高田機工	600	2,520.00	1,512,000	貸付株式数	100株
三和ホールディングス	63,400	1,176.00	74,558,400	貸付株式数	1,100株
文化シャツタ -	19,800	828.00	16,394,400		
三協立山	8,700	1,058.00	9,204,600	貸付株式数	1,100株
アルインコ	4,900	979.00	4,797,100	貸付株式数	1,400株
東洋シャツタ -	1,700	779.00	1,324,300	貸付株式数	600株
L I X I Lグループ	98,800	2,082.00	205,701,600	貸付株式数	39,700株
日本ファイルコン	5,000	579.00	2,895,000	貸付株式数	2,000株
ノーリツ	14,000	1,477.00	20,678,000	貸付株式数	5,500株
長府製作所	6,800	2,141.00	14,558,800	貸付株式数	1,700株
リンナイ	13,100	10,070.00	131,917,000		
ユニプレス	13,200	877.00	11,576,400		
ダイニチ工業	3,500	751.00	2,628,500		
日東精工	9,200	485.00	4,462,000	貸付株式数	3,600株
三洋工業	800	1,968.00	1,574,400		
岡 部	13,700	799.00	10,946,300	貸付株式数	5,300株
ジーテクト	8,400	1,212.00	10,180,800		
東 プ レ	12,600	1,187.00	14,956,200	貸付株式数	400株
高周波熱錬	12,900	517.00	6,669,300	貸付株式数	1,900株
東京製綱	4,700	565.00	2,655,500		
サンコール	4,900	449.00	2,200,100		
モリテックスチル	5,400	296.00	1,598,400	貸付株式数	2,100株
パイオラックス	9,900	1,536.00	15,206,400	貸付株式数	3,700株
エイチワン	6,400	578.00	3,699,200		
日本発条	72,000	678.00	48,816,000		
中央発條	700	2,995.00	2,096,500		
アドバネクス	900	1,645.00	1,480,500	貸付株式数	300株
三浦工業	28,900	4,770.00	137,853,000	貸付株式数	2,200株
タ ク マ	22,700	1,778.00	40,360,600		
テクノプロ・ホールディング グ	13,000	6,320.00	82,160,000	貸付株式数	5,200株
アトラ	1,700	264.00	448,800	貸付株式数	200株
インターワークス	1,600	343.00	548,800		
アイ・アールジャパンHD	2,600	12,150.00	31,590,000	貸付株式数	1,000株
K e e P e r 技研	2,400	3,080.00	7,392,000		
ファーストロジック	1,400	753.00	1,054,200	貸付株式数	500株
三機サービス	1,300	1,108.00	1,440,400	貸付株式数	200株
G u n o s y	4,000	949.00	3,796,000	貸付株式数	1,600株
デザインワン・ジャパン	1,500	275.00	412,500	貸付株式数	600株

イー・ガーディアン	3,200	3,200.00	10,240,000	貸付株式数	700株
リブセンス	4,500	288.00	1,296,000	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
ジャパンマテリアル	20,000	1,513.00	30,260,000	貸付株式数	8,000株
ベクトル	8,200	1,095.00	8,979,000	貸付株式数	3,200株
ウチヤマホールディングス	3,200	320.00	1,024,000		
チャームケアコーポレーション	5,500	1,162.00	6,391,000	貸付株式数	2,200株 (200株)
キャリアリンク	2,400	1,067.00	2,560,800	貸付株式数	100株
I B J	4,500	1,105.00	4,972,500	貸付株式数	1,800株
アサンテ	2,700	1,638.00	4,422,600	貸付株式数	1,000株
N・フィールド	4,300	696.00	2,992,800	貸付株式数	1,700株
バリューHR	2,600	1,605.00	4,173,000	貸付株式数	1,000株
M&Aキャピタルパートナー	5,300	4,210.00	22,313,000	貸付株式数	1,400株
ライドオンエクスプレスHD	2,500	2,545.00	6,362,500	貸付株式数	900株
E R Iホールディングス	1,800	650.00	1,170,000	貸付株式数	600株
アビスト	900	3,235.00	2,911,500	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス	4,400	1,688.00	7,427,200	貸付株式数	1,700株
ウィルグループ	4,300	876.00	3,766,800	貸付株式数	1,600株
エスクローAJ	9,000	374.00	3,366,000	貸付株式数	3,600株
リクルートホールディングス	463,100	4,290.00	1,986,699,000		
エラン	3,800	2,507.00	9,526,600		
ツガミ	13,900	1,196.00	16,624,400		
オークマ	7,900	5,160.00	40,764,000		
芝浦機械	7,600	2,282.00	17,343,200	貸付株式数	3,000株
アマダ	83,300	1,024.00	85,299,200		
アイダエンジニア	17,700	723.00	12,797,100		
滝澤鉄工所	2,000	1,069.00	2,138,000	貸付株式数	100株
F U J I	29,000	2,101.00	60,929,000	貸付株式数	11,600株
牧野フライス	7,900	3,965.00	31,323,500	貸付株式数	200株
オーエスジー	31,200	1,671.00	52,135,200	貸付株式数	12,400株
ダイジェット	700	1,424.00	996,800		
旭ダイヤモンド	17,600	513.00	9,028,800		
D M G 森精機	42,600	1,525.00	64,965,000	貸付株式数	17,000株
ソディック	15,400	750.00	11,550,000	貸付株式数	5,900株
ディスコ	9,100	25,680.00	233,688,000		

日東工器	3,700	2,097.00	7,758,900		
日進工具	2,600	2,282.00	5,933,200	貸付株式数	1,000株
パンチ工業	5,900	412.00	2,430,800	貸付株式数	600株
富士ダイス	2,900	683.00	1,980,700	貸付株式数	1,100株
土木管理総合試験	2,900	382.00	1,107,800	貸付株式数	500株
ネットマーケティング	2,300	668.00	1,536,400	貸付株式数	500株
日本郵政	527,000	743.60	391,877,200		
ベルシステム24HLDGS	10,900	1,760.00	19,184,000	貸付株式数	4,300株
鎌倉新書	4,900	947.00	4,640,300	貸付株式数	1,700株 (400株)
SMN	1,300	922.00	1,198,600		
一蔵	700	367.00	256,900	貸付株式数	200株
LITALICO	2,200	2,804.00	6,168,800		
グローバルキッズCOMP	1,000	888.00	888,000	貸付株式数	200株
エアトリ	3,300	1,482.00	4,890,600	貸付株式数	1,300株 (200株)
アトラエ	1,900	2,907.00	5,523,300	貸付株式数	500株
ストライク	2,400	5,460.00	13,104,000	貸付株式数	900株
ソラスト	18,000	1,323.00	23,814,000		
セラク	2,200	2,065.00	4,543,000	貸付株式数	800株

インソース	2,800	2,803.00	7,848,400	貸付株式数	1,000株 (900株)
豊田自動織機	54,800	6,510.00	356,748,000		
豊和工業	3,900	845.00	3,295,500		
OKK	2,700	391.00	1,055,700		
石川製作所	1,700	1,853.00	3,150,100	貸付株式数	600株 (600株)
東洋機械金属	4,600	416.00	1,913,600	貸付株式数	1,800株
津田駒工業	1,200	829.00	994,800	貸付株式数	400株
エンシュウ	1,500	939.00	1,408,500		
島精機製作所	10,600	1,652.00	17,511,200		
オプトラン	7,500	2,171.00	16,282,500		
NCホールディングス	2,000	625.00	1,250,000	貸付株式数	700株
イワキポンプ	4,200	943.00	3,960,600	貸付株式数	500株
フリーー	6,500	1,172.00	7,618,000	貸付株式数	2,400株
ヤマシンフィルタ	14,600	1,069.00	15,607,400	貸付株式数	5,800株
日阪製作所	8,400	865.00	7,266,000		
やまびこ	13,000	1,242.00	16,146,000	貸付株式数	4,700株

平田機工	3,200	6,310.00	20,192,000	貸付株式数	1,200株
ペガサスミシン製造	6,600	300.00	1,980,000		
マルマエ	2,700	981.00	2,648,700	貸付株式数	900株
タツモ	3,100	1,485.00	4,603,500	貸付株式数	700株
ナブテスコ	39,500	3,775.00	149,112,500	貸付株式数	15,800株
三井海洋開発	7,100	1,688.00	11,984,800	貸付株式数	1,800株
レオン自動機	6,600	1,099.00	7,253,400	貸付株式数	300株
S M C	21,200	58,120.00	1,232,144,000		
ホソカワミクロン	2,400	5,770.00	13,848,000	貸付株式数	900株
ユニオンツール	2,500	3,120.00	7,800,000	貸付株式数	1,000株
オイレス工業	8,800	1,516.00	13,340,800	貸付株式数	100株
日精エーエスビー	2,000	4,140.00	8,280,000		
サト - ホールディングス	9,600	2,185.00	20,976,000		
技研製作所	5,900	3,970.00	23,423,000	貸付株式数	2,300株
日本エアーテック	2,300	1,369.00	3,148,700	貸付株式数	900株
カワタ	1,900	921.00	1,749,900	貸付株式数	700株
日精樹脂工業	5,600	884.00	4,950,400	貸付株式数	2,200株
オカダアイヨン	2,000	1,021.00	2,042,000	貸付株式数	700株
ワイエイシイホールディングス	2,800	674.00	1,887,200		
小松製作所	306,900	2,374.50	728,734,050	貸付株式数	43,200株 (14,300株)
住友重機械	39,000	2,514.00	98,046,000		
日立建機	27,300	3,685.00	100,600,500		
日工	9,200	720.00	6,624,000		
巴工業	2,700	1,965.00	5,305,500	貸付株式数	1,100株
井関農機	6,800	1,372.00	9,329,600	貸付株式数	2,200株
T O W A	6,800	1,172.00	7,969,600	貸付株式数	2,500株
丸山製作所	1,800	1,406.00	2,530,800		
北川鉄工所	3,000	1,529.00	4,587,000	貸付株式数	700株
シンニッタン	10,400	227.00	2,360,800		
ローツェ	3,000	4,995.00	14,985,000	貸付株式数	1,100株
タカキタ	2,500	756.00	1,890,000	貸付株式数	900株
クボタ	359,000	1,839.00	660,201,000	貸付株式数	144,500株
荏原実業	1,700	2,979.00	5,064,300	貸付株式数	600株
東洋エンジニア	8,700	348.00	3,027,600		
三菱化工機	2,300	1,866.00	4,291,800		
月島機械	12,600	1,347.00	16,972,200		
帝国電機製作所	5,600	1,115.00	6,244,000	貸付株式数	600株
東京機械	3,100	288.00	892,800	貸付株式数	1,200株

新東工業	16,200	731.00	11,842,200	貸付株式数	6,400株
渋谷工業	5,900	3,595.00	21,210,500	貸付株式数	2,400株
アイチ コーポレーション	11,800	882.00	10,407,600		
小森コーポレーション	17,300	745.00	12,888,500		
鶴見製作所	5,100	1,795.00	9,154,500		
住友精密	1,000	2,387.00	2,387,000	貸付株式数	300株
日本ギア工業	2,400	298.00	715,200	貸付株式数	900株 (200株)
酒井重工業	1,200	2,400.00	2,880,000		
荏原製作所	28,100	2,876.00	80,815,600	貸付株式数	10,900株
石井鉄工所	900	2,734.00	2,460,600		
西島製作所	6,800	831.00	5,650,800		
北越工業	7,000	1,095.00	7,665,000		
ダイキン工業	86,200	19,520.00	1,682,624,000		
オルガノ	2,400	5,630.00	13,512,000		
ト - ヨ - カネツ	3,000	2,259.00	6,777,000		
栗田工業	36,700	3,555.00	130,468,500		
椿本チエイン	9,800	2,521.00	24,705,800		
大同工業	3,200	611.00	1,955,200		
日 機 装	20,400	1,111.00	22,664,400		
木村化工機	5,700	434.00	2,473,800	貸付株式数	300株
レイズネクスト	11,200	1,291.00	14,459,200		
アネスト岩田	10,600	838.00	8,882,800		
ダイフク	34,700	10,160.00	352,552,000		
サムコ	1,900	2,844.00	5,403,600	貸付株式数	700株
加藤製作所	3,700	1,131.00	4,184,700		
油研工業	1,100	1,559.00	1,714,900	貸付株式数	400株
タダノ	32,800	840.00	27,552,000	貸付株式数	12,700株
フジテック	24,800	2,338.00	57,982,400		
C K D	18,700	1,641.00	30,686,700		
キトー	5,200	1,216.00	6,323,200	貸付株式数	900株
平和	18,700	1,841.00	34,426,700	貸付株式数	7,600株
理想科学工業	6,000	1,437.00	8,622,000	貸付株式数	1,700株
S A N K Y O	15,000	2,894.00	43,410,000		
日本金銭機械	7,300	583.00	4,255,900	貸付株式数	2,900株
マースグループHLDGS	4,200	1,813.00	7,614,600		
フクシマガリレイ	4,200	3,900.00	16,380,000		
オーイズミ	2,800	392.00	1,097,600		
ダイコク電機	3,100	1,087.00	3,369,700	貸付株式数	1,200株
竹内製作所	11,400	2,065.00	23,541,000	貸付株式数	4,500株

アマノ	17,800	2,462.00	43,823,600		
JUKI	9,300	459.00	4,268,700	貸付株式数	3,200株
サンデンホールディングス	9,000	326.00	2,934,000	貸付株式数	3,600株
蛇の目マシン	6,000	647.00	3,882,000	貸付株式数	2,400株
ブラザー工業	83,100	1,696.00	140,937,600		
マックス	10,400	1,567.00	16,296,800		
モリタホールディングス	12,000	1,984.00	23,808,000	貸付株式数	500株
グローリー	17,500	2,399.00	41,982,500		
新晃工業	6,300	1,511.00	9,519,300	貸付株式数	2,200株
大和冷機工業	9,800	935.00	9,163,000	貸付株式数	3,800株
セガサミーホールディングス	67,100	1,328.00	89,108,800		
日本ピストンリング	2,400	1,040.00	2,496,000		
リケン	3,100	2,570.00	7,967,000	貸付株式数	100株
TPR	9,100	1,306.00	11,884,600	貸付株式数	3,300株
ツバキ・ナカシマ	13,800	804.00	11,095,200	貸付株式数	5,000株
ホシザキ	19,900	8,380.00	166,762,000	貸付株式数	7,900株
大豊工業	5,400	571.00	3,083,400		
日本精工	128,400	841.00	107,984,400		
NTN	157,300	210.00	33,033,000		
ジェイテクト	65,500	846.00	55,413,000		
不二越	6,400	3,705.00	23,712,000		
ミネベアミツミ	125,900	2,021.00	254,443,900		
日本トムソン	19,900	392.00	7,800,800		
THK	39,600	2,659.00	105,296,400	貸付株式数	15,800株
ユーシン精機	5,300	722.00	3,826,600		
前澤給装工業	2,400	2,074.00	4,977,600		
イーグル工業	8,500	816.00	6,936,000		
前澤工業	4,000	476.00	1,904,000		
日本ピラ-工業	6,800	1,581.00	10,750,800		
キッツ	27,700	616.00	17,063,200		
日立	325,000	3,689.00	1,198,925,000		
三菱電機	676,100	1,470.00	993,867,000		
富士電機	41,000	3,400.00	139,400,000		
東洋電機製造	2,400	1,160.00	2,784,000	貸付株式数	500株
安川電機	72,900	3,985.00	290,506,500	貸付株式数	29,300株
シンフォニアテクノロジー	8,800	1,131.00	9,952,800		
明電舎	12,500	1,668.00	20,850,000		
オリジン	1,800	1,344.00	2,419,200	貸付株式数	700株

山洋電気	3,300	4,930.00	16,269,000		
デンヨー	5,800	2,489.00	14,436,200		
ベイカレントコンサルティング	3,900	12,980.00	50,622,000	貸付株式数	500株
ORCHESTRA HLDGS	1,600	2,273.00	3,636,800	貸付株式数	500株
アイモバイル	2,200	1,237.00	2,721,400	貸付株式数	800株
キャリアインデックス	2,800	580.00	1,624,000	貸付株式数	1,000株
MS - Japan	2,200	832.00	1,830,400	貸付株式数	800株
船場	1,100	940.00	1,034,000	貸付株式数	400株
グレイステクノロジー	3,000	4,840.00	14,520,000	貸付株式数	1,200株
ジャパンエレベーターSHD	6,800	3,830.00	26,044,000	貸付株式数	2,700株
フルテック	900	1,373.00	1,235,700	貸付株式数	200株
グリーンズ	1,800	533.00	959,400	貸付株式数	700株
ツナググループHLDGS	900	463.00	416,700	貸付株式数	300株
GAMEWITH	1,700	653.00	1,110,100	貸付株式数	600株
ソウルドアウト	1,300	1,606.00	2,087,800	貸付株式数	400株
MS&CONSULTING	1,000	732.00	732,000	貸付株式数	300株
ミダック	800	2,308.00	1,846,400		
日総工産	4,500	813.00	3,658,500	貸付株式数	500株
キュービーネットHLDGS	2,900	1,862.00	5,399,800	貸付株式数	1,000株
RPAホールディングス	4,800	872.00	4,185,600		
三桜工業	8,600	588.00	5,056,800	貸付株式数	3,400株
マキタ	88,200	5,000.00	441,000,000		
東芝テック	8,500	4,505.00	38,292,500		
芝浦メカトロニクス	1,200	3,150.00	3,780,000		
マブチモーター	18,800	4,090.00	76,892,000	貸付株式数	7,200株
日本電産	162,700	9,688.00	1,576,237,600		
ユーエムシーエレクトロニクス	4,200	349.00	1,465,800	貸付株式数	1,600株
トレックス・セミコンダクター	3,900	1,211.00	4,722,900	貸付株式数	1,000株
東光高岳	3,700	1,081.00	3,999,700		
ダブル・スコープ	10,700	933.00	9,983,100	貸付株式数	4,200株
宮越ホールディングス	2,700	728.00	1,965,600	貸付株式数	1,000株
ダイヘン	7,500	4,285.00	32,137,500		
ヤーマン	11,100	1,678.00	18,625,800	貸付株式数	4,400株

JVCケンウッド	55,100	153.00	8,430,300	
ミマキエンジニアリング	6,000	436.00	2,616,000	貸付株式数 2,100株
I - P E X	2,800	2,266.00	6,344,800	貸付株式数 1,100株 (500株)
日新電機	16,000	1,097.00	17,552,000	
大崎電気	13,300	611.00	8,126,300	
オムロン	60,600	8,060.00	488,436,000	
日東工業	10,000	2,086.00	20,860,000	
I D E C	9,800	1,960.00	19,208,000	貸付株式数 3,900株
正興電機製作所	1,800	1,071.00	1,927,800	貸付株式数 600株
不二電機工業	1,000	1,321.00	1,321,000	貸付株式数 400株 (200株)
ジーエス・ユアサ コーポ	22,700	1,844.00	41,858,800	
サクサホールディングス	1,500	1,492.00	2,238,000	貸付株式数 500株
メルコホールディングス	2,300	2,482.00	5,708,600	貸付株式数 100株
テクノメディカ	1,500	1,844.00	2,766,000	貸付株式数 600株
ダイヤモンドエレクトリック H D	1,400	759.00	1,062,600	貸付株式数 500株
日本電気	82,000	5,910.00	484,620,000	
富士通	65,200	14,380.00	937,576,000	
沖電気	27,700	1,064.00	29,472,800	
岩崎通信機	2,900	841.00	2,438,900	
電気興業	3,300	2,680.00	8,844,000	
サンケン電気	7,400	2,409.00	17,826,600	貸付株式数 2,800株
ナカヨ	1,300	1,460.00	1,898,000	
アイホン	3,800	1,521.00	5,779,800	
ルネサスエレクトロニクス	290,100	763.00	221,346,300	貸付株式数 126,800株
セイコーエプソン	84,400	1,239.00	104,571,600	
ワコム	45,800	712.00	32,609,600	
アルバック	12,500	3,855.00	48,187,500	貸付株式数 5,000株
アクセル	2,700	908.00	2,451,600	
E I Z O	5,300	3,980.00	21,094,000	貸付株式数 600株
ジャパンディスプレイ	61,700	59.00	3,640,300	
日本信号	17,400	1,046.00	18,200,400	
京三製作所	15,800	488.00	7,710,400	貸付株式数 6,200株
能美防災	9,000	2,272.00	20,448,000	
ホーチキ	4,900	1,304.00	6,389,600	
星和電機	3,500	607.00	2,124,500	
エレコム	7,600	5,100.00	38,760,000	
パナソニック	773,400	926.40	716,477,760	

シャープ	78,800	1,317.00	103,779,600	貸付株式数	31,500株
アンリツ	43,600	2,255.00	98,318,000	貸付株式数	17,500株
富士通ゼネラル	18,500	3,000.00	55,500,000		
ソニー	423,600	8,204.00	3,475,214,400		
T D K	32,700	11,660.00	381,282,000		
帝国通信工業	3,000	1,230.00	3,690,000		
タムラ製作所	22,700	537.00	12,189,900		
アルプスアルパイン	60,300	1,527.00	92,078,100		
池上通信機	2,100	850.00	1,785,000		
日本電波工業	6,300	365.00	2,299,500	貸付株式数	2,400株
鈴木	3,300	698.00	2,303,400	貸付株式数	600株
日本トリム	900	3,760.00	3,384,000		
ローランド ディー・ジー	3,700	1,294.00	4,787,800	貸付株式数	1,400株
フオスタ - 電機	7,100	1,150.00	8,165,000		
S M K	1,700	2,689.00	4,571,300	貸付株式数	500株
ヨコオ	4,400	2,712.00	11,932,800		
ティアック	4,900	127.00	622,300	貸付株式数	900株
ホシデン	18,600	983.00	18,283,800		
ヒロセ電機	10,400	13,460.00	139,984,000		
日本航空電子	15,600	1,486.00	23,181,600		
T O A	7,300	830.00	6,059,000	貸付株式数	1,300株
マクセルホールディングス	14,600	1,092.00	15,943,200		
古野電気	8,700	1,013.00	8,813,100	貸付株式数	3,000株
ユニデンホールディングス	1,900	1,578.00	2,998,200	貸付株式数	600株
スミダコーポレーション	5,200	729.00	3,790,800	貸付株式数	100株 (100株)
アイコム	3,800	2,737.00	10,400,600		
リオン	2,800	2,397.00	6,711,600		
本多通信工業	5,800	503.00	2,917,400	貸付株式数	2,300株
船井電機	6,800	472.00	3,209,600	貸付株式数	800株
横河電機	62,500	1,677.00	104,812,500		
新電元工業	2,400	1,943.00	4,663,200		
アズビル	42,900	3,595.00	154,225,500		
東亜ディーケーケー	3,300	917.00	3,026,100	貸付株式数	1,300株
日本光電工業	28,000	3,390.00	94,920,000		
チノ	2,300	1,379.00	3,171,700	貸付株式数	700株
共和電業	6,900	445.00	3,070,500	貸付株式数	2,700株
日本電子材料	2,700	2,026.00	5,470,200	貸付株式数	1,000株
堀場製作所	13,500	5,530.00	74,655,000	貸付株式数	5,400株

アドバンテスト	50,500	5,220.00	263,610,000		
小野測器	2,700	539.00	1,455,300		
エスベック	6,000	1,853.00	11,118,000		
キーエンス	61,300	46,310.00	2,838,803,000		
日置電機	3,300	3,870.00	12,771,000		
シスメックス	48,300	9,993.00	482,661,900		
日本マイクロニクス	11,800	1,124.00	13,263,200	貸付株式数	4,500株
メガチップス	6,300	2,741.00	17,268,300		
OBARA GROUP	4,000	3,700.00	14,800,000	貸付株式数	1,600株
IMAGICA GROUP	5,700	387.00	2,205,900	貸付株式数	2,200株 (2,000株)
澤藤電機	900	2,025.00	1,822,500	貸付株式数	300株
デンソー	148,800	4,580.00	681,504,000		
原田工業	3,200	913.00	2,921,600	貸付株式数	1,200株
コーセル	9,000	1,110.00	9,990,000		
イリソ電子工業	5,700	4,250.00	24,225,000	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	11,200	1,540.00	17,248,000	貸付株式数	4,300株
千代田インテグレ	2,900	1,651.00	4,787,900		
アイ・オー・データ	2,300	1,075.00	2,472,500	貸付株式数	800株
レーザーテック	29,800	8,590.00	255,982,000	貸付株式数	11,900株
スタンレー電気	47,500	3,010.00	142,975,000		
岩崎電気	2,600	1,510.00	3,926,000		
ウシオ電機	37,600	1,322.00	49,707,200	貸付株式数	15,000株
岡谷電機	5,200	361.00	1,877,200	貸付株式数	2,000株
ヘリオステクノH	6,300	327.00	2,060,100		
エノモト	2,000	1,057.00	2,114,000		
日本セラミック	6,900	2,677.00	18,471,300	貸付株式数	1,700株
遠藤照明	3,300	665.00	2,194,500		
古河電池	4,800	1,054.00	5,059,200	貸付株式数	1,900株
双信電機	3,300	433.00	1,428,900	貸付株式数	600株
山一電機	4,900	1,339.00	6,561,100	貸付株式数	1,800株
函 研	4,400	2,915.00	12,826,000	貸付株式数	1,700株
日本電子	13,400	3,490.00	46,766,000		
カ シ オ	60,300	1,673.00	100,881,900	貸付株式数	24,100株
ファナック	63,600	20,420.00	1,298,712,000		
日本シイエムケイ	15,900	503.00	7,997,700	貸付株式数	6,300株
エンプラス	3,500	2,229.00	7,801,500		
大真空	2,500	1,857.00	4,642,500		
ロ - ム	28,200	7,910.00	223,062,000		
浜松ホトニクス	48,500	5,230.00	253,655,000		

三井ハイテック	7,500	2,082.00	15,615,000	貸付株式数	2,900株
新光電気工業	22,900	1,760.00	40,304,000		
京セラ	95,000	6,167.00	585,865,000		
協栄産業	700	1,321.00	924,700		
太陽誘電	30,200	3,265.00	98,603,000		
村田製作所	198,600	6,817.00	1,353,856,200		
双葉電子工業	10,800	953.00	10,292,400		
日東電工	46,700	6,500.00	303,550,000		
北陸電気工業	2,700	975.00	2,632,500	貸付株式数	800株
東海理化電機	18,000	1,585.00	28,530,000		
ニチコン	23,100	823.00	19,011,300		
日本ケミコン	5,100	1,428.00	7,282,800		
K O A	10,200	1,095.00	11,169,000		
三井E & S H D	21,700	400.00	8,680,000		
日立造船	53,600	448.00	24,012,800		
三菱重工業	113,900	2,469.00	281,219,100		
川崎重工業	53,000	1,483.00	78,599,000		
I H I	49,100	1,466.00	71,980,600	貸付株式数	19,600株
名村造船所	22,200	165.00	3,663,000		
サノヤスホールディングス	9,400	167.00	1,569,800		
スプリックス	2,200	868.00	1,909,600	貸付株式数	500株
マネジメントソリューションズ	2,800	1,643.00	4,600,400	貸付株式数	1,100株
プロレド・パートナーズ	900	5,090.00	4,581,000	貸付株式数	300株
AND FACTORY	500	1,043.00	521,500	貸付株式数	200株
ギークス	600	1,213.00	727,800	貸付株式数	200株
カーブスホールディングス	17,800	681.00	12,121,800	貸付株式数	7,100株
フォーラムエンジニアリング	3,300	872.00	2,877,600		
日本車輛	2,500	2,843.00	7,107,500	貸付株式数	900株
三菱ロジスネクスト	9,000	953.00	8,577,000	貸付株式数	1,500株
近畿車輛	1,000	1,357.00	1,357,000	貸付株式数	200株
F P G	20,600	605.00	12,463,000	貸付株式数	8,200株 (200株)
島根銀行	1,500	697.00	1,045,500	貸付株式数	600株
じもとホールディングス	45,000	119.00	5,355,000		
全国保証	18,900	3,970.00	75,033,000	貸付株式数	7,500株
めぶきフィナンシャルG	346,000	241.00	83,386,000		
東京きらぼしF G	9,000	1,188.00	10,692,000		
九州フィナンシャルG	146,200	489.00	71,491,800		

かんぽ生命保険	23,500	1,701.00	39,973,500	
ゆうちょ銀行	187,600	836.00	156,833,600	貸付株式数 75,800株
富山第一銀行	15,700	304.00	4,772,800	
コンコルディア・フィナンシャル	380,600	387.00	147,292,200	
ジェイリース	2,500	554.00	1,385,000	貸付株式数 600株
西日本フィナンシャルHD	44,600	747.00	33,316,200	
マーキュリアインベストメント	2,800	634.00	1,775,200	貸付株式数 1,100株
イントラスト	2,500	865.00	2,162,500	貸付株式数 900株
日本モーゲージサービス	2,800	1,136.00	3,180,800	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
C a s a	2,300	1,231.00	2,831,300	貸付株式数 900株
アルヒ	10,700	1,774.00	18,981,800	貸付株式数 3,800株
プレミアグループ	3,600	2,116.00	7,617,600	貸付株式数 900株
日産自動車	799,900	372.00	297,562,800	
いすゞ自動車	196,800	949.00	186,763,200	
トヨタ自動車	754,300	7,081.00	5,341,198,300	
日野自動車	85,100	658.00	55,995,800	
三菱自動車工業	252,400	233.00	58,809,200	
エフテック	4,800	501.00	2,404,800	貸付株式数 1,600株
レシップホールディングス	2,600	612.00	1,591,200	貸付株式数 700株
G M B	1,500	648.00	972,000	貸付株式数 200株
ファルテック	1,400	621.00	869,400	貸付株式数 200株
武蔵精密工業	15,100	1,010.00	15,251,000	貸付株式数 900株
日産車体	13,300	894.00	11,890,200	貸付株式数 3,100株
新明和工業	18,300	919.00	16,817,700	
極東開発工業	12,600	1,358.00	17,110,800	
日信工業	13,300	2,244.00	29,845,200	
トピー工業	5,600	1,175.00	6,580,000	貸付株式数 500株
ティラド	2,400	1,347.00	3,232,800	貸付株式数 900株
タチエス	11,100	950.00	10,545,000	
N O K	36,600	1,122.00	41,065,200	
フタバ産業	18,900	530.00	10,017,000	貸付株式数 1,200株
K Y B	7,600	2,098.00	15,944,800	貸付株式数 3,000株
市光工業	10,200	457.00	4,661,400	貸付株式数 4,000株
大同メタル工業	13,100	528.00	6,916,800	貸付株式数 2,900株
プレス工業	33,600	289.00	9,710,400	
ミクニ	8,400	278.00	2,335,200	
太平洋工業	14,300	985.00	14,085,500	

ケーヒン	15,000	2,592.00	38,880,000	
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	55,700	3,290.00	183,253,000	
マ ッ ダ	200,400	630.00	126,252,000	貸付株式数 79,800株
今仙電機製作所	6,100	678.00	4,135,800	
本田技研	532,400	2,539.50	1,352,029,800	
スズキ	134,200	4,148.00	556,661,600	
S U B A R U	210,200	2,068.00	434,693,600	
安永	3,300	1,169.00	3,857,700	
ヤマハ発動機	88,900	1,573.00	139,839,700	貸付株式数 35,500株
ショーワ	15,400	2,293.00	35,312,200	
小糸製作所	40,600	5,470.00	222,082,000	
T B K	7,900	470.00	3,713,000	
エクセディ	9,300	1,353.00	12,582,900	貸付株式数 2,400株
ミツバ	12,400	390.00	4,836,000	貸付株式数 4,900株
豊田合成	22,000	2,334.00	51,348,000	
愛三工業	10,600	475.00	5,035,000	貸付株式数 3,000株
盟和産業	1,000	1,003.00	1,003,000	貸付株式数 300株
日本プラスト	5,000	421.00	2,105,000	
ヨ ロ ズ	6,400	1,016.00	6,502,400	貸付株式数 1,400株
エフ・シー・シー	11,200	1,939.00	21,716,800	
新家工業	1,500	1,133.00	1,699,500	
シマノ	25,300	21,350.00	540,155,000	貸付株式数 10,200株
テイ・エス テック	15,700	3,075.00	48,277,500	貸付株式数 5,500株
関西みらいF G	39,500	442.00	17,459,000	貸付株式数 2,300株
3 3 F G	6,200	1,403.00	8,698,600	貸付株式数 2,400株
第四北越フィナンシャルG	11,700	2,260.00	26,442,000	貸付株式数 100株
ジャムコ	3,300	679.00	2,240,700	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
小 野 建	5,500	1,135.00	6,242,500	
はるやまH L D G S	3,100	744.00	2,306,400	貸付株式数 1,000株
南 陽	1,400	1,752.00	2,452,800	
ノ ジ マ	12,000	2,885.00	34,620,000	
佐鳥電機	4,500	841.00	3,784,500	貸付株式数 1,600株
カップ・クリエイト	9,400	1,660.00	15,604,000	貸付株式数 3,700株
エコートレーディング	1,500	586.00	879,000	貸付株式数 500株
伯東	4,100	1,173.00	4,809,300	
コンドーテック	5,200	1,290.00	6,708,000	貸付株式数 1,800株
中山福	3,700	485.00	1,794,500	貸付株式数 1,400株

ライトオン	4,900	557.00	2,729,300	貸付株式数 1,500株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,900	2,805.00	24,964,500	貸付株式数 3,400株
ジーンズメイト	2,700	218.00	588,600	貸付株式数 700株
三菱食品	7,400	2,805.00	20,757,000	
良品計画	88,900	1,759.00	156,375,100	貸付株式数 35,600株
三城ホールディングス	6,900	288.00	1,987,200	貸付株式数 2,700株
松田産業	4,900	1,516.00	7,428,400	
第一興商	10,000	3,425.00	34,250,000	貸付株式数 3,700株
メディカルHD	71,500	2,124.00	151,866,000	
アドヴァン	10,300	1,329.00	13,688,700	
S P K	2,800	1,461.00	4,090,800	
萩原電気HLDGS	2,500	2,192.00	5,480,000	
アルビス	2,500	2,765.00	6,912,500	貸付株式数 400株
アズワン	4,400	14,950.00	65,780,000	貸付株式数 1,700株
スズデン	2,300	1,212.00	2,787,600	貸付株式数 800株
尾家産業	1,900	1,650.00	3,135,000	貸付株式数 700株
シモジマ	4,100	1,448.00	5,936,800	貸付株式数 900株
ドウシシャ	6,300	2,100.00	13,230,000	
小津産業	1,500	1,838.00	2,757,000	貸付株式数 200株
コナカ	7,700	287.00	2,209,900	貸付株式数 3,000株
高速	4,000	1,761.00	7,044,000	貸付株式数 1,600株
ハウス ローゼ	800	1,640.00	1,312,000	
G-7ホールディングス	3,900	2,706.00	10,553,400	
たけびし	2,400	1,531.00	3,674,400	貸付株式数 900株
イオン北海道	8,500	843.00	7,165,500	貸付株式数 2,700株
コジマ	11,400	515.00	5,871,000	貸付株式数 4,300株
ヒマラヤ	2,200	943.00	2,074,600	貸付株式数 400株
コーナン商事	9,500	4,040.00	38,380,000	貸付株式数 3,700株
ネットワンシステムズ	25,300	4,835.00	122,325,500	
エコス	2,400	2,192.00	5,260,800	貸付株式数 900株
ワタミ	7,900	1,065.00	8,413,500	貸付株式数 3,100株
マルシェ	1,500	602.00	903,000	貸付株式数 600株
リックス	1,500	1,649.00	2,473,500	貸付株式数 500株
システムソフト	22,400	107.00	2,396,800	
パンパシフィックHD	146,400	2,332.00	341,404,800	貸付株式数 59,000株
丸文	5,600	498.00	2,788,800	貸付株式数 800株
西松屋チェーン	14,700	1,360.00	19,992,000	貸付株式数 5,600株
ゼンショーホールディングス	32,000	2,572.00	82,304,000	貸付株式数 12,800株 (700株)

ハピネット	5,500	1,317.00	7,243,500	貸付株式数	300株
幸楽苑ホールディングス	4,200	1,786.00	7,501,200	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,300	993.00	1,290,900	貸付株式数	500株
橋本総業HLDGS	1,300	2,498.00	3,247,400		
日本ライフライン	19,900	1,419.00	28,238,100		
サイゼリヤ	10,000	2,162.00	21,620,000	貸付株式数	4,000株
タカショー	3,900	661.00	2,577,900		
VTホールディングス	27,600	427.00	11,785,200		
マルカ	2,300	2,134.00	4,908,200	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	5,700	3,605.00	20,548,500		
魚力	1,900	1,899.00	3,608,100	貸付株式数	700株
IDOM	18,000	636.00	11,448,000	貸付株式数	2,000株
日本エム・ディ・エム	3,900	2,214.00	8,634,600	貸付株式数	1,500株
ポプラ	1,800	422.00	759,600	貸付株式数	700株
フジ・コーポレーション	1,800	2,300.00	4,140,000		
ユナイテッドアローズ	7,000	1,576.00	11,032,000		
進和	4,000	2,174.00	8,696,000	貸付株式数	1,400株
エスケイジャパン	1,600	321.00	513,600	貸付株式数	600株
ダイトロン	2,800	1,514.00	4,239,200	貸付株式数	1,000株
ハイデイ日高	9,700	1,893.00	18,362,100	貸付株式数	2,900株
シークス	8,500	1,236.00	10,506,000	貸付株式数	3,300株
京都きもの友禅	3,900	228.00	889,200	貸付株式数	1,600株
コロワイド	22,300	1,977.00	44,087,100	貸付株式数	8,900株
ピーシーデポコーポ	8,800	662.00	5,825,600	貸付株式数	3,500株
田中商事	2,100	750.00	1,575,000	貸付株式数	700株
オーハシテクニカ	3,500	1,425.00	4,987,500		
壱番屋	4,700	5,640.00	26,508,000	貸付株式数	1,800株
白銅	2,300	1,303.00	2,996,900	貸付株式数	800株
トップカルチャー	2,400	406.00	974,400	貸付株式数	400株
PLANT	1,600	879.00	1,406,400	貸付株式数	600株
スギホールディングス	13,300	7,560.00	100,548,000	貸付株式数	5,300株
ダイコー通産	400	1,365.00	546,000	貸付株式数	100株
薬王堂ホールディングス	2,900	2,517.00	7,299,300	貸付株式数	1,100株
島津製作所	80,900	3,270.00	264,543,000		
JMS	5,700	898.00	5,118,600		
クボテック	1,900	343.00	651,700	貸付株式数	700株
長野計器	5,000	884.00	4,420,000		
ブイ・テクノロジー	3,200	4,305.00	13,776,000	貸付株式数	1,200株
スター精密	10,500	1,424.00	14,952,000	貸付株式数	4,000株

東京計器	4,200	943.00	3,960,600	貸付株式数	1,600株
愛知時計	900	4,290.00	3,861,000		
インターアクション	3,600	2,009.00	7,232,400	貸付株式数	1,400株
オーバル	6,400	239.00	1,529,600	貸付株式数	1,200株
東京精密	12,400	3,325.00	41,230,000		
マニー	27,000	2,840.00	76,680,000		
ニコン	104,100	717.00	74,639,700	貸付株式数	39,600株
トプコン	34,300	946.00	32,447,800	貸付株式数	12,800株
オリンパス	374,200	2,081.00	778,710,200		
理研計器	6,000	2,891.00	17,346,000		
S C R E E Nホールディングス	11,800	5,530.00	65,254,000	貸付株式数	4,700株
キヤノン電子	6,100	1,454.00	8,869,400	貸付株式数	2,700株
タムロン	5,500	1,654.00	9,097,000	貸付株式数	2,100株
HOYA	134,100	11,695.00	1,568,299,500		
シード	2,900	727.00	2,108,300	貸付株式数	1,100株
ノーリツ鋼機	4,600	1,681.00	7,732,600		
エー・アンド・デイ	6,100	669.00	4,080,900		
朝日インテック	76,600	3,085.00	236,311,000	貸付株式数	30,800株
キヤノン	336,300	1,724.00	579,781,200	貸付株式数	142,300株
リコー	173,200	714.00	123,664,800		
シチズン時計	79,600	311.00	24,755,600	貸付株式数	30,500株
リズム時計	2,100	644.00	1,352,400		
大研医器	5,100	562.00	2,866,200		
メニコン	9,600	7,030.00	67,488,000	貸付株式数	2,400株
シンシア	900	407.00	366,300	貸付株式数	100株
中本パックス	1,600	1,586.00	2,537,600	貸付株式数	600株
スノーピーク	3,500	1,896.00	6,636,000	貸付株式数	1,400株
パラマウントベッドHD	7,100	4,340.00	30,814,000	貸付株式数	300株
トランザクション	4,400	1,151.00	5,064,400	貸付株式数	100株
粧美堂	2,000	402.00	804,000	貸付株式数	700株
ニホンフラッシュ	6,300	1,400.00	8,820,000	貸付株式数	700株
前田工織	7,500	2,682.00	20,115,000	貸付株式数	2,300株
永大産業	8,600	327.00	2,812,200		
アートネイチャー	7,200	666.00	4,795,200		
バンダイナムコHLDGS	69,900	7,258.00	507,334,200		
アイフィスジャパン	1,800	781.00	1,405,800		
共立印刷	11,300	136.00	1,536,800		
SHOEI	6,000	3,555.00	21,330,000		
フランスベッドHLDGS	9,200	874.00	8,040,800	貸付株式数	3,600株

マーベラス	10,000	806.00	8,060,000		
パイロットコーポレーション	11,100	3,125.00	34,687,500	貸付株式数	4,400株
萩原工業	3,700	1,600.00	5,920,000	貸付株式数	1,400株 (300株)
エイベックス	11,500	1,005.00	11,557,500	貸付株式数	4,600株
トッパン・フォームズ	14,600	978.00	14,278,800		
フジシールインターナショナル	15,300	1,972.00	30,171,600		
タカラトミー	30,500	908.00	27,694,000		
廣済堂	4,900	688.00	3,371,200		
エステールホールディングス	2,000	685.00	1,370,000	貸付株式数	800株
レック	7,200	1,690.00	12,168,000		
タカノ	2,600	647.00	1,682,200	貸付株式数	1,000株
三光合成	7,500	279.00	2,092,500	貸付株式数	1,300株
プロネクサス	5,800	1,142.00	6,623,600		
ホクシン	5,700	120.00	684,000		
ウッドワン	2,400	1,304.00	3,129,600	貸付株式数	500株
大建工業	4,600	1,763.00	8,109,800		
きもと	12,400	168.00	2,083,200	貸付株式数	3,800株
凸版印刷	95,900	1,586.00	152,097,400		
大日本印刷	88,800	2,210.00	196,248,000		
共同印刷	2,100	2,676.00	5,619,600	貸付株式数	800株
N I S S H A	13,900	1,319.00	18,334,100	貸付株式数	5,500株
光村印刷	600	1,649.00	989,400	貸付株式数	200株
藤森工業	6,100	4,255.00	25,955,500		
ヴィア・ホールディングス	8,100	342.00	2,770,200	貸付株式数	3,200株
TAKARA & COMPANY	3,300	2,266.00	7,477,800	貸付株式数	1,300株 (100株)
前澤化成工業	4,300	1,024.00	4,403,200	貸付株式数	1,600株
未来工業	3,500	2,083.00	7,290,500	貸付株式数	900株
アシックス	56,200	1,404.00	78,904,800	貸付株式数	22,800株
ツツミ	2,100	2,295.00	4,819,500		
ウェーブロックHLDGS	2,300	764.00	1,757,200		
ジェイ エス ピー	4,000	1,580.00	6,320,000	貸付株式数	1,400株
ニチハ	9,500	3,175.00	30,162,500	貸付株式数	3,700株
エフピコ	7,500	8,540.00	64,050,000		
小松ウオール工業	1,900	1,850.00	3,515,000		
ヤマハ	40,300	5,100.00	205,530,000		

河合楽器	2,100	2,778.00	5,833,800	
クリナップ	6,300	518.00	3,263,400	貸付株式数 2,100株
ピジヨン	41,200	4,650.00	191,580,000	貸付株式数 16,400株
天馬	4,500	1,789.00	8,050,500	
オリバー	1,400	2,550.00	3,570,000	貸付株式数 500株
兼松サステック	400	1,608.00	643,200	
キングジム	5,700	899.00	5,124,300	貸付株式数 1,300株
象印マホービン	18,400	1,737.00	31,960,800	貸付株式数 2,200株
リンテック	16,100	2,492.00	40,121,200	
信越ポリマー	12,200	896.00	10,931,200	
東リ	16,800	273.00	4,586,400	
イトーキ	14,400	364.00	5,241,600	貸付株式数 3,800株
任天堂	41,500	60,420.00	2,507,430,000	
三菱鉛筆	11,300	1,362.00	15,390,600	貸付株式数 3,600株
松風	3,000	1,481.00	4,443,000	貸付株式数 1,100株
タカラスタンダ-ド	13,700	1,378.00	18,878,600	
コクヨ	32,300	1,313.00	42,409,900	貸付株式数 13,000株
ナカバヤシ	6,600	663.00	4,375,800	貸付株式数 2,100株
ニフコ	25,100	2,839.00	71,258,900	
立川ブラインド	3,000	1,335.00	4,005,000	貸付株式数 1,100株
グローブライド	3,000	3,185.00	9,555,000	
オカムラ	23,500	761.00	17,883,500	
バルカー	5,500	1,898.00	10,439,000	
MUTOHホールディングス	1,000	1,508.00	1,508,000	
伊藤忠	465,800	2,761.50	1,286,306,700	
丸紅	693,500	632.10	438,361,350	
スクロール	10,100	899.00	9,079,900	貸付株式数 4,000株
高島	1,000	1,909.00	1,909,000	
ヨンドシーホールディングス	6,800	1,835.00	12,478,000	貸付株式数 2,600株
三陽商会	3,500	598.00	2,093,000	貸付株式数 1,400株
長瀬産業	37,300	1,571.00	58,598,300	
ナイガイ	2,500	388.00	970,000	貸付株式数 400株
蝶理	4,300	1,618.00	6,957,400	
豊田通商	74,500	3,035.00	226,107,500	
オンワードホールディングス	40,100	275.00	11,027,500	貸付株式数 16,000株
三共生興	10,000	425.00	4,250,000	貸付株式数 1,700株
兼松	25,000	1,317.00	32,925,000	

美津濃	6,200	1,953.00	12,108,600		
ツカモトコーポレーション	1,300	1,289.00	1,675,700		
ファミリーマート	53,200	2,340.00	124,488,000		
ルックホールディングス	2,100	852.00	1,789,200	貸付株式数	700株
三井物産	577,000	1,887.50	1,089,087,500		
日本紙パルプ	3,800	3,745.00	14,231,000		
東京エレクトロン	43,000	26,920.00	1,157,560,000	貸付株式数	17,200株
カメイ	8,600	1,110.00	9,546,000		
東都水産	800	3,670.00	2,936,000	貸付株式数	300株
OUGホールディングス	1,100	2,842.00	3,126,200	貸付株式数	400株
スターゼン	2,500	4,100.00	10,250,000	貸付株式数	600株
セイコーHD	9,600	1,497.00	14,371,200	貸付株式数	3,800株
山善	26,200	1,067.00	27,955,400		
椿本興業	1,200	3,615.00	4,338,000	貸付株式数	400株
住友商事	420,500	1,315.00	552,957,500		
日本ユニシス	20,700	3,355.00	69,448,500		
内田洋行	2,700	5,160.00	13,932,000	貸付株式数	1,000株
三菱商事	436,900	2,621.50	1,145,333,350		
第一実業	3,300	3,825.00	12,622,500		
キャノンマーケティングJPN	16,700	2,002.00	33,433,400	貸付株式数	6,400株
西華産業	3,700	1,418.00	5,246,600		
佐藤商事	5,600	1,030.00	5,768,000		
菱洋エレクトロ	6,800	2,910.00	19,788,000	貸付株式数	2,700株
東京産業	6,000	533.00	3,198,000	貸付株式数	900株
ユアサ商事	6,400	3,320.00	21,248,000		
神鋼商事	1,600	1,738.00	2,780,800	貸付株式数	100株
トルク	3,900	305.00	1,189,500	貸付株式数	1,500株
阪和興業	12,500	2,236.00	27,950,000		
正栄食品	4,300	4,445.00	19,113,500	貸付株式数	1,700株
カナデン	5,400	1,522.00	8,218,800	貸付株式数	1,900株
菱電商事	4,800	1,494.00	7,171,200	貸付株式数	1,600株
ニプロ	46,900	1,247.00	58,484,300	貸付株式数	500株
フルサト工業	3,400	1,455.00	4,947,000	貸付株式数	1,300株
岩谷産業	14,900	4,030.00	60,047,000	貸付株式数	5,900株
ナイス	2,500	1,486.00	3,715,000		
昭光通商	2,300	604.00	1,389,200	貸付株式数	400株
ニチモウ	1,000	2,017.00	2,017,000	貸付株式数	400株
極東貿易	1,900	1,436.00	2,728,400	貸付株式数	600株
イワキ	8,700	512.00	4,454,400	貸付株式数	3,300株

兼松エレクトロニクス	3,600	4,280.00	15,408,000	
三愛石油	16,500	985.00	16,252,500	
稲畑産業	14,800	1,382.00	20,453,600	貸付株式数 5,900株
G S Iクレオス	1,600	1,792.00	2,867,200	貸付株式数 600株
明和産業	6,300	487.00	3,068,100	貸付株式数 2,500株
クワザワ	2,100	526.00	1,104,600	
ヤマエ久野	4,900	1,263.00	6,188,700	貸付株式数 1,900株
ゴ - ルドウイン	12,000	7,870.00	94,440,000	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
ユニ・チャ - ム	143,700	4,677.00	672,084,900	貸付株式数 57,800株
デサント	13,000	1,790.00	23,270,000	
キ ン グ	3,000	588.00	1,764,000	貸付株式数 1,100株
ワ キ タ	14,200	1,020.00	14,484,000	
ヤマトインタ - ナショナル	5,700	360.00	2,052,000	貸付株式数 100株
東邦ホールディングス	21,100	2,315.00	48,846,500	
サンゲツ	18,300	1,654.00	30,268,200	貸付株式数 5,100株
ミツウロコグループ	9,800	1,286.00	12,602,800	貸付株式数 1,000株
シナネンホールディングス	2,800	3,135.00	8,778,000	
伊藤忠エネクス	14,100	989.00	13,944,900	
サンリオ	18,800	1,953.00	36,716,400	貸付株式数 7,500株
サンワ テクノス	4,700	933.00	4,385,100	貸付株式数 1,700株
リョーサン	7,400	2,120.00	15,688,000	
新光商事	10,300	899.00	9,259,700	
トーホー	3,000	1,995.00	5,985,000	
三信電気	3,600	1,975.00	7,110,000	
東陽テクニカ	7,600	1,010.00	7,676,000	
モスフード サービス	8,800	3,075.00	27,060,000	貸付株式数 3,500株
加賀電子	6,700	2,201.00	14,746,700	
三益半導体	5,300	2,550.00	13,515,000	貸付株式数 1,900株
ソーダニツカ	6,800	555.00	3,774,000	貸付株式数 2,200株
立花エレテック	4,900	1,793.00	8,785,700	貸付株式数 1,600株
木曽路	8,800	2,637.00	23,205,600	貸付株式数 3,500株
S R Sホールディングス	8,100	997.00	8,075,700	貸付株式数 3,100株
千 趣 会	12,200	420.00	5,124,000	貸付株式数 4,800株
タカキュー	6,100	138.00	841,800	貸付株式数 1,800株 (1,600株)
リテールパートナーズ	8,900	1,826.00	16,251,400	
ケーヨー	13,700	989.00	13,549,300	貸付株式数 5,300株
上新電機	7,900	2,497.00	19,726,300	貸付株式数 3,100株
日本瓦斯	10,600	4,520.00	47,912,000	

ロイヤルホールディングス	11,700	1,930.00	22,581,000	貸付株式数	4,500株
東 天 紅	500	1,001.00	500,500	貸付株式数	100株
いなげや	8,200	2,024.00	16,596,800	貸付株式数	600株
島 忠	12,500	3,380.00	42,250,000	貸付株式数	5,000株
チヨダ	7,100	962.00	6,830,200	貸付株式数	600株
ライフコーポレーション	5,100	4,845.00	24,709,500	貸付株式数	1,300株
リンガーハット	8,300	2,641.00	21,920,300	貸付株式数	3,100株 (1,700株)
MrMaxHD	9,200	918.00	8,445,600	貸付株式数	900株
テンアライド	5,900	417.00	2,460,300	貸付株式数	2,300株
AOKIホールディングス	13,500	573.00	7,735,500		
オークワ	10,500	1,478.00	15,519,000		
コメリ	10,300	3,365.00	34,659,500		
青山商事	13,800	574.00	7,921,200	貸付株式数	5,200株
しまむら	7,800	8,950.00	69,810,000	貸付株式数	3,100株
はせがわ	3,400	323.00	1,098,200	貸付株式数	300株
高 島 屋	48,900	827.00	40,440,300	貸付株式数	19,500株
松 屋	13,500	751.00	10,138,500	貸付株式数	5,400株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	31,800	735.00	23,373,000	貸付株式数	12,700株
近鉄百貨店	2,600	3,230.00	8,398,000	貸付株式数	1,000株
丸井グループ	61,200	1,967.00	120,380,400		
クレディセゾン	47,000	1,122.00	52,734,000		
アクシアル リテイリング	5,500	4,915.00	27,032,500	貸付株式数	400株
井 筒 屋	4,000	174.00	696,000	貸付株式数	600株
イオン	256,100	2,829.00	724,506,900	貸付株式数	103,300株
イ ズ ミ	13,700	3,830.00	52,471,000	貸付株式数	5,400株
フオーバル	2,900	981.00	2,844,900		
平 和 堂	13,400	2,215.00	29,681,000	貸付株式数	5,400株
フ ジ	8,100	1,884.00	15,260,400	貸付株式数	3,200株
ヤオコー	7,600	7,950.00	60,420,000	貸付株式数	3,000株
ゼビオホールディングス	8,000	790.00	6,320,000	貸付株式数	3,200株
ケーズホールディングス	64,400	1,404.00	90,417,600		
PALTAC	10,700	5,600.00	59,920,000		
三谷産業	8,700	402.00	3,497,400	貸付株式数	3,300株
OLYMPICグループ	3,400	1,034.00	3,515,600	貸付株式数	600株
日産東京販売HD	9,700	255.00	2,473,500		
新生銀行	49,100	1,341.00	65,843,100		
あおぞら銀行	40,000	1,786.00	71,440,000	貸付株式数	15,400株

三菱UFJフィナンシャルG	4,562,200	439.90	2,006,911,780	
りそなホールディングス	725,800	387.70	281,392,660	
三井住友トラストHD	126,000	3,009.00	379,134,000	
三井住友フィナンシャルG	461,000	3,074.00	1,417,114,000	
千葉銀行	222,500	598.00	133,055,000	
群馬銀行	128,000	362.00	46,336,000	
武蔵野銀行	10,000	1,676.00	16,760,000	
千葉興業銀行	18,000	262.00	4,716,000	貸付株式数 3,400株
筑波銀行	28,100	210.00	5,901,000	貸付株式数 10,500株
七十七銀行	22,700	1,652.00	37,500,400	貸付株式数 400株
青森銀行	5,200	2,529.00	13,150,800	貸付株式数 400株
秋田銀行	4,300	1,647.00	7,082,100	貸付株式数 1,700株
山形銀行	7,500	1,352.00	10,140,000	貸付株式数 1,500株
岩手銀行	4,400	2,555.00	11,242,000	
東邦銀行	59,700	232.00	13,850,400	貸付株式数 3,700株
東北銀行	3,100	1,150.00	3,565,000	貸付株式数 1,200株
みちのく銀行	4,400	1,279.00	5,627,600	
ふくおかフィナンシャルG	56,300	1,903.00	107,138,900	
静岡銀行	162,200	750.00	121,650,000	
十六銀行	8,400	2,028.00	17,035,200	貸付株式数 3,300株
スルガ銀行	63,000	393.00	24,759,000	
八十二銀行	161,000	421.00	67,781,000	
山梨中央銀行	7,800	848.00	6,614,400	
大垣共立銀行	13,200	2,368.00	31,257,600	貸付株式数 5,300株
福井銀行	5,700	1,756.00	10,009,200	貸付株式数 500株
北國銀行	6,700	3,075.00	20,602,500	貸付株式数 400株
清水銀行	2,700	1,930.00	5,211,000	
富山銀行	1,300	3,150.00	4,095,000	
滋賀銀行	13,400	2,548.00	34,143,200	
南都銀行	11,200	2,021.00	22,635,200	
百五銀行	59,500	325.00	19,337,500	
京都銀行	23,900	5,100.00	121,890,000	
紀陽銀行	23,700	1,601.00	37,943,700	貸付株式数 2,100株
ほくほくフィナンシャルG	44,500	1,088.00	48,416,000	貸付株式数 17,800株
広島銀行	99,000	601.00	59,499,000	
山陰合同銀行	39,900	575.00	22,942,500	
中国銀行	57,500	1,024.00	58,880,000	貸付株式数 2,900株
鳥取銀行	2,200	1,256.00	2,763,200	
伊予銀行	95,100	717.00	68,186,700	

百十四銀行	7,100	1,812.00	12,865,200	貸付株式数	2,000株
四国銀行	10,200	754.00	7,690,800	貸付株式数	2,700株
阿波銀行	10,900	2,588.00	28,209,200		
大分銀行	3,900	2,396.00	9,344,400		
宮崎銀行	4,500	2,447.00	11,011,500		
佐賀銀行	4,000	1,378.00	5,512,000		
沖縄銀行	6,100	3,195.00	19,489,500	貸付株式数	400株
琉球銀行	15,500	925.00	14,337,500		
セブン銀行	223,000	261.00	58,203,000		
みずほフィナンシャルG	9,059,100	138.60	1,255,591,260		
高知銀行	2,500	822.00	2,055,000	貸付株式数	1,000株
山口フィナンシャルG	83,500	710.00	59,285,000		
芙蓉総合リース	7,000	7,060.00	49,420,000	貸付株式数	100株
みずほリース	10,200	2,759.00	28,141,800		
東京センチュリー	13,400	5,810.00	77,854,000		
SBIホールディングス	74,600	2,741.00	204,478,600		
日本証券金融	29,500	523.00	15,428,500	貸付株式数	7,900株
アイフル	102,000	275.00	28,050,000	貸付株式数	2,200株
日本アジア投資	6,300	237.00	1,493,100	貸付株式数	2,500株
長野銀行	2,100	1,415.00	2,971,500	貸付株式数	800株
名古屋銀行	5,100	2,469.00	12,591,900		
北洋銀行	101,300	233.00	23,602,900		
愛知銀行	2,400	3,275.00	7,860,000		
中京銀行	2,700	2,047.00	5,526,900		
大光銀行	2,200	1,449.00	3,187,800		
愛媛銀行	9,000	1,187.00	10,683,000	貸付株式数	3,600株
トマト銀行	2,500	1,170.00	2,925,000	貸付株式数	200株
京葉銀行	28,500	500.00	14,250,000	貸付株式数	11,400株
栃木銀行	31,600	193.00	6,098,800	貸付株式数	11,700株
北日本銀行	2,000	1,967.00	3,934,000		
東和銀行	11,700	761.00	8,903,700		
福島銀行	7,300	251.00	1,832,300	貸付株式数	2,500株
大東銀行	3,300	685.00	2,260,500		
リコーリース	5,200	2,854.00	14,840,800	貸付株式数	2,100株
イオンフィナンシャルサー ビス	41,100	951.00	39,086,100	貸付株式数	16,400株
アコム	133,900	456.00	61,058,400		
ジャックス	7,400	1,758.00	13,009,200		
オリコ	181,600	114.00	20,702,400	貸付株式数	8,900株
日立キャピタル	15,800	2,592.00	40,953,600		

アプラスフィナンシャル	34,100	74.00	2,523,400	貸付株式数	12,900株
オリックス	413,900	1,383.00	572,423,700		
三菱UFJリース	168,400	525.00	88,410,000		
ジャフコ	10,300	4,265.00	43,929,500		
九州リースサービス	2,900	640.00	1,856,000	貸付株式数	1,200株
トモニホールディングス	51,800	341.00	17,663,800	貸付株式数	3,100株
大和証券G本社	534,400	464.00	247,961,600		
野村ホールディングス	1,174,100	499.50	586,462,950	貸付株式数	473,000株
岡三証券グループ	57,300	356.00	20,398,800	貸付株式数	1,400株
丸三証券	19,700	478.00	9,416,600	貸付株式数	6,400株
東洋証券	24,300	113.00	2,745,900		
東海東京HD	76,900	280.00	21,532,000		
光世証券	1,800	604.00	1,087,200	貸付株式数	600株
水戸証券	19,100	216.00	4,125,600	貸付株式数	5,300株
いちよし証券	12,200	491.00	5,990,200		
松井証券	37,700	955.00	36,003,500		
SOMPOホールディングス	125,400	3,790.00	475,266,000		
日本取引所グループ	191,300	2,900.00	554,770,000		
マネックスG	50,000	264.00	13,200,000	貸付株式数	19,900株
極東証券	8,700	599.00	5,211,300		
岩井コスモホールディング	6,300	1,273.00	8,019,900	貸付株式数	1,700株
藍澤證券	12,000	690.00	8,280,000		
フィデアホール	64,400	116.00	7,470,400		
池田泉州HD	76,900	185.00	14,226,500	貸付株式数	7,000株
アニコムホールディングス	5,500	4,240.00	23,320,000		
MS&AD	174,300	2,962.50	516,363,750		
マネーパートナーズGP	6,600	213.00	1,405,800		
スパークス・グループ	30,800	208.00	6,406,400	貸付株式数	4,300株
小林洋行	2,800	265.00	742,000	貸付株式数	700株
第一生命HLDS	377,800	1,522.50	575,200,500		
東京海上HD	235,900	4,853.00	1,144,822,700		
アドバンテッジリスクマネ	3,300	769.00	2,537,700	貸付株式数	1,300株
イー・ギャランティ	7,200	2,360.00	16,992,000	貸付株式数	400株
アサックス	3,500	760.00	2,660,000	貸付株式数	1,200株
NECキャピタルソリューション	2,700	1,891.00	5,105,700		
T&Dホールディングス	199,700	1,092.00	218,072,400		
アドバンスクリエイト	1,600	2,287.00	3,659,200	貸付株式数	500株

三井不動産	329,000	1,949.00	641,221,000	
三菱地所	467,200	1,618.50	756,163,200	
平和不動産	12,200	2,836.00	34,599,200	
東京建物	66,100	1,300.00	85,930,000	貸付株式数 27,100株
ダイビル	17,000	1,218.00	20,706,000	
京阪神ビルディング	10,500	1,687.00	17,713,500	
住友不動産	149,900	3,132.00	469,486,800	
太平洋興発	2,600	633.00	1,645,800	貸付株式数 900株
テーオーシー	12,900	672.00	8,668,800	貸付株式数 4,900株
東京楽天地	1,200	4,485.00	5,382,000	貸付株式数 400株
スターツコーポレーション	9,000	2,319.00	20,871,000	
フジ住宅	7,700	540.00	4,158,000	貸付株式数 2,200株
空港施設	6,800	462.00	3,141,600	
明和地所	4,200	520.00	2,184,000	貸付株式数 600株
ゴールドクレスト	5,000	1,403.00	7,015,000	貸付株式数 2,000株
リログループ	35,400	2,501.00	88,535,400	
エスリード	2,700	1,363.00	3,680,100	
日神グループHLDGS	10,300	423.00	4,356,900	貸付株式数 3,700株
日本エスコン	12,200	845.00	10,309,000	貸付株式数 2,100株
タカラレーベン	30,200	328.00	9,905,600	貸付株式数 1,100株
A V A N T I A	3,800	800.00	3,040,000	貸付株式数 1,200株
イオンモール	33,400	1,497.00	49,999,800	貸付株式数 13,300株
毎日コムネット	2,000	811.00	1,622,000	貸付株式数 300株
ファースト住建	2,900	1,037.00	3,007,300	貸付株式数 1,000株
ランド	378,100	9.00	3,402,900	貸付株式数 138,400株
カチタス	16,600	2,886.00	47,907,600	
東祥	4,000	1,287.00	5,148,000	貸付株式数 1,600株
トーセイ	9,400	951.00	8,939,400	貸付株式数 3,500株
穴吹興産	1,500	1,559.00	2,338,500	貸付株式数 200株
サンフロンティア不動産	9,500	867.00	8,236,500	
インテリックス	2,800	478.00	1,338,400	貸付株式数 400株
ランドビジネス	2,600	380.00	988,000	貸付株式数 800株
サンネクスタグループ	1,900	1,012.00	1,922,800	貸付株式数 300株
グランディハウス	5,300	385.00	2,040,500	貸付株式数 1,600株
東武鉄道	70,400	3,375.00	237,600,000	
相鉄ホールディングス	21,600	2,940.00	63,504,000	
東急	170,500	1,436.00	244,838,000	
京浜急行	87,100	1,674.00	145,805,400	貸付株式数 23,700株
小田急電鉄	100,500	2,679.00	269,239,500	
京王電鉄	35,100	6,590.00	231,309,000	

京成電鉄	47,100	3,085.00	145,303,500	
富士急行	9,300	3,945.00	36,688,500	貸付株式数 3,700株
新京成電鉄	1,700	2,530.00	4,301,000	貸付株式数 600株
東日本旅客鉄道	119,000	6,850.00	815,150,000	
西日本旅客鉄道	60,400	5,670.00	342,468,000	
東海旅客鉄道	56,200	16,090.00	904,258,000	
西武ホールディングス	88,900	1,296.00	115,214,400	
鴻池運輸	10,900	1,172.00	12,774,800	
西日本鉄道	18,800	3,255.00	61,194,000	貸付株式数 3,500株
ハマキョウレックス	5,200	3,295.00	17,134,000	
サカイ引越センター	3,600	5,060.00	18,216,000	
近鉄グループHLDGS	64,100	4,790.00	307,039,000	
阪急阪神HLDGS	85,400	3,555.00	303,597,000	
南海電鉄	30,500	2,406.00	73,383,000	貸付株式数 11,700株
京阪ホールディングス	28,500	4,525.00	128,962,500	
神戸電鉄	1,500	3,890.00	5,835,000	貸付株式数 600株
名古屋鉄道	52,400	2,988.00	156,571,200	貸付株式数 21,200株
山陽電鉄	4,700	2,279.00	10,711,300	貸付株式数 1,800株
トランコム	1,800	7,600.00	13,680,000	
日本通運	22,200	6,230.00	138,306,000	
ヤマトホールディングス	112,300	2,706.00	303,883,800	
山 九	17,800	4,500.00	80,100,000	
日 新	5,600	1,619.00	9,066,400	
丸 運	3,500	243.00	850,500	貸付株式数 800株
丸全昭和運輸	5,200	3,410.00	17,732,000	貸付株式数 500株
センコーグループHLDGS	34,900	984.00	34,341,600	
トナミホールディングス	1,500	6,140.00	9,210,000	貸付株式数 300株
ニッコンホールディングス	22,900	2,375.00	54,387,500	
日石輸送	600	2,649.00	1,589,400	
福山通運	8,200	5,270.00	43,214,000	貸付株式数 1,300株
セイノーホールディングス	47,900	1,596.00	76,448,400	
エスライン	1,700	976.00	1,659,200	貸付株式数 100株
神奈川中央交通	1,500	4,215.00	6,322,500	貸付株式数 600株
日立物流	11,700	3,745.00	43,816,500	
丸和運輸機関	6,800	4,070.00	27,676,000	貸付株式数 2,700株
C & F ロジホールディングス	6,500	1,759.00	11,433,500	貸付株式数 1,100株
日本郵船	53,700	1,885.00	101,224,500	
商船三井	40,700	2,257.00	91,859,900	

川崎汽船	19,800	1,265.00	25,047,000	貸付株式数	6,200株
N Sユニテッド海運	3,600	1,444.00	5,198,400		
明治海運	6,600	364.00	2,402,400		
飯野海運	30,200	373.00	11,264,600	貸付株式数	3,700株
共栄タンカー	1,200	773.00	927,600		
九州旅客鉄道	56,300	2,321.00	130,672,300		
S Gホールディングス	67,200	4,835.00	324,912,000		
日本航空	113,500	2,098.00	238,123,000		
A N Aホールディングス	117,300	2,784.00	326,563,200		
パスコ	1,300	1,400.00	1,820,000	貸付株式数	200株
西本W I S M E T T A C H D	1,200	1,890.00	2,268,000	貸付株式数	400株
シルバーライフ	900	1,998.00	1,798,200	貸付株式数	300株
ヤマシタヘルスケアH L D G S	700	1,508.00	1,055,600	貸付株式数	200株
一家ダイニングプロジ	500	613.00	306,500	貸付株式数	200株
G E N K Y D R U G S T O R E S	2,900	3,725.00	10,802,500	貸付株式数	800株
国際紙パルプ商事	15,900	302.00	4,801,800		
ナルミヤ・インターナショ ナル	1,400	582.00	814,800	貸付株式数	300株
ブックオフG H D	3,900	919.00	3,584,100	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	20,400	3,045.00	62,118,000		
三井倉庫H O L D	7,400	1,936.00	14,326,400		
住友倉庫	23,000	1,366.00	31,418,000		
渋沢倉庫	3,500	2,330.00	8,155,000		
ヤマタネ	3,300	1,322.00	4,362,600		
東陽倉庫	11,300	351.00	3,966,300	貸付株式数	4,400株
乾汽船	3,700	890.00	3,293,000	貸付株式数	1,400株
日本トランスシティ	13,800	576.00	7,948,800	貸付株式数	3,200株
ケイヒン	900	1,395.00	1,255,500		
中央倉庫	3,900	1,180.00	4,602,000		
川西倉庫	1,100	1,143.00	1,257,300	貸付株式数	400株
安田倉庫	5,100	950.00	4,845,000		
ファイズホールディングス	1,400	1,153.00	1,614,200	貸付株式数	500株
東洋埠頭	2,000	1,469.00	2,938,000	貸付株式数	300株
宇徳	5,500	495.00	2,722,500	貸付株式数	1,800株
上 組	35,700	2,159.00	77,076,300		
サンリツ	1,500	632.00	948,000	貸付株式数	500株
キムラユニティー	1,600	1,108.00	1,772,800	貸付株式数	600株

キューソー流通システム	1,600	1,552.00	2,483,200	
近鉄エクスプレス	13,700	2,210.00	30,277,000	貸付株式数 5,400株
東海運	3,600	299.00	1,076,400	貸付株式数 1,300株
エーアイテイー	4,500	1,072.00	4,824,000	貸付株式数 1,600株
内外トランスライン	2,100	1,242.00	2,608,200	
ショーエイコーポ	900	1,268.00	1,141,200	貸付株式数 300株
日本コンセプト	2,000	1,479.00	2,958,000	貸付株式数 700株
東京放送HD	40,200	1,820.00	73,164,000	貸付株式数 16,000株
日本テレビHLD S	55,100	1,183.00	65,183,300	貸付株式数 14,700株
朝日放送グループHD	6,400	743.00	4,755,200	貸付株式数 2,500株
テレビ朝日HD	18,300	1,679.00	30,725,700	貸付株式数 7,300株
スカパーJ S A T H D	43,900	450.00	19,755,000	
テレビ東京HD	5,500	2,349.00	12,919,500	貸付株式数 1,200株
日本BS放送	2,100	1,121.00	2,354,100	貸付株式数 800株
ビジョン	6,100	808.00	4,928,800	貸付株式数 2,400株
スマートバリュー	1,800	1,109.00	1,996,200	貸付株式数 700株
USEN-NEXT H L D G S	2,600	1,219.00	3,169,400	貸付株式数 400株
ワイヤレスゲート	3,200	745.00	2,384,000	貸付株式数 1,200株
コネクシオ	3,800	1,211.00	4,601,800	
日本通信	51,700	229.00	11,839,300	貸付株式数 20,600株 (1,000株)
クロップス	1,300	773.00	1,004,900	
日本電信電話	886,500	2,239.50	1,985,316,750	
K D D I	483,800	2,754.50	1,332,627,100	
ソフトバンク	607,900	1,270.50	772,336,950	貸付株式数 243,000株
光通信	6,800	24,270.00	165,036,000	
N T T ドコモ	474,300	2,705.00	1,282,981,500	
エムティーアイ	6,400	843.00	5,395,200	貸付株式数 800株
G M O インターネット	24,000	2,726.00	65,424,000	
ファイバーゲート	2,100	1,850.00	3,885,000	貸付株式数 800株
アйдママーケティングコ ミュ	2,100	442.00	928,200	
K A D O K A W A	18,000	2,782.00	50,076,000	貸付株式数 7,100株
学研ホールディングス	8,900	1,629.00	14,498,100	貸付株式数 3,500株
ゼンリン	13,300	1,138.00	15,135,400	
昭文社ホールディングス	3,100	502.00	1,556,200	貸付株式数 1,100株
インプレスホールディング ス	5,300	172.00	911,600	貸付株式数 2,100株
東京電力HD	542,000	300.00	162,600,000	

中部電力	205,800	1,346.50	277,109,700	
関西電力	255,900	1,057.00	270,486,300	
中国電力	97,100	1,352.00	131,279,200	
北陸電力	62,200	781.00	48,578,200	
東北電力	168,300	1,089.00	183,278,700	
四国電力	61,100	821.00	50,163,100	
九州電力	139,300	970.00	135,121,000	
北海道電力	63,700	451.00	28,728,700	
沖縄電力	13,200	1,700.00	22,440,000	貸付株式数 600株
電源開発	54,000	1,670.00	90,180,000	
エフオン	3,700	646.00	2,390,200	貸付株式数 1,200株
イーレックス	9,700	1,078.00	10,456,600	貸付株式数 3,800株
レノバ	11,300	1,078.00	12,181,400	貸付株式数 4,500株
東京瓦斯	130,100	2,413.00	313,931,300	
大阪瓦斯	131,500	2,083.00	273,914,500	
東邦瓦斯	33,300	5,080.00	169,164,000	
北海道瓦斯	3,600	1,577.00	5,677,200	貸付株式数 700株
広島ガス	13,000	372.00	4,836,000	貸付株式数 5,600株
西部瓦斯	7,600	2,694.00	20,474,400	
静岡ガス	19,300	909.00	17,543,700	貸付株式数 7,600株
メタウォーター	3,300	4,545.00	14,998,500	
アイネット	3,400	1,662.00	5,650,800	貸付株式数 1,300株
松竹	4,400	15,350.00	67,540,000	貸付株式数 1,600株
東宝	39,200	4,320.00	169,344,000	貸付株式数 15,700株
エイチ・アイ・エス	10,100	1,885.00	19,038,500	貸付株式数 4,000株
東映	2,500	17,790.00	44,475,000	
ラックランド	1,500	2,364.00	3,546,000	貸付株式数 600株
NTTデータ	176,700	1,415.00	250,030,500	
共立メンテナンス	10,800	4,045.00	43,686,000	貸付株式数 4,100株
イチネンホールディングス	7,200	1,281.00	9,223,200	
建設技術研究所	4,400	2,069.00	9,103,600	貸付株式数 1,100株
スペース	4,100	863.00	3,538,300	貸付株式数 1,500株
長大	2,500	1,323.00	3,307,500	
アインホールディングス	8,200	7,230.00	59,286,000	貸付株式数 3,200株
燦ホールディングス	2,800	1,219.00	3,413,200	
ピー・シー・エー	1,100	4,800.00	5,280,000	貸付株式数 400株 (400株)
スバル興業	400	8,000.00	3,200,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	3,100	1,304.00	4,042,400	貸付株式数 1,000株
タナベ経営	1,100	1,511.00	1,662,100	貸付株式数 400株

ビジネス B 太田昭和	2,200	1,378.00	3,031,600	貸付株式数	200株
ナ ガ ワ	2,000	7,910.00	15,820,000	貸付株式数	800株
よみうりランド	1,400	4,315.00	6,041,000	貸付株式数	500株
東京都競馬	4,200	5,290.00	22,218,000	貸付株式数	1,600株
常磐興産	2,600	1,535.00	3,991,000	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,700	2,353.00	25,177,100	貸付株式数	4,100株
東京ドーム	26,400	791.00	20,882,400	貸付株式数	2,100株
D T S	14,900	2,280.00	33,972,000		
スクウェア・エニックス・ H D	28,300	6,910.00	195,553,000		
シーイーシー	7,100	1,649.00	11,707,900	貸付株式数	2,300株
カプコン	31,300	5,910.00	184,983,000		
西尾レントオール	6,000	2,331.00	13,986,000	貸付株式数	400株
アイ・エス・ピー	1,400	2,644.00	3,701,600	貸付株式数	500株
アゴーラ・ホスピタリ ティー G	47,500	28.00	1,330,000	貸付株式数	6,000株
日本空港ビルデング	21,400	4,695.00	100,473,000	貸付株式数	8,200株
トランス・コスモス	6,200	2,890.00	17,918,000		
乃村工藝社	27,800	790.00	21,962,000		
ジャステック	4,200	1,471.00	6,178,200		
S C S K	15,300	5,910.00	90,423,000		
藤田観光	2,900	1,647.00	4,776,300	貸付株式数	1,100株 (100株)
K N T - C Tホールディン グス	3,900	1,117.00	4,356,300	貸付株式数	1,500株
日本管財	7,200	2,050.00	14,760,000	貸付株式数	2,700株
トーカイ	6,300	2,146.00	13,519,800		
白 洋 舎	800	2,634.00	2,107,200	貸付株式数	300株
セコム	68,700	9,834.00	675,595,800		
日本システムウエア	2,200	2,043.00	4,494,600		
セントラル警備保障	3,100	3,500.00	10,850,000	貸付株式数	700株
アイネス	6,500	1,700.00	11,050,000		
丹青社	12,200	730.00	8,906,000	貸付株式数	4,800株
メイテック	8,000	5,430.00	43,440,000	貸付株式数	200株
T K C	5,600	6,670.00	37,352,000	貸付株式数	200株
富士ソフト	7,100	5,220.00	37,062,000	貸付株式数	3,300株
応用地質	6,900	1,257.00	8,673,300	貸付株式数	1,300株
船井総研ホールディン	13,400	2,415.00	32,361,000	貸付株式数	5,300株
N S D	21,300	2,019.00	43,004,700	貸付株式数	8,600株
進学会ホールディングス	2,500	459.00	1,147,500	貸付株式数	500株

丸紅建材リース	700	1,743.00	1,220,100		
オオバ	4,800	809.00	3,883,200	貸付株式数	800株
コナミホールディングス	24,200	4,390.00	106,238,000		
いであ	1,500	1,984.00	2,976,000	貸付株式数	600株
学究社	1,800	1,128.00	2,030,400		
ベネッセホールディングス	21,700	2,744.00	59,544,800		
イオンディライト	8,000	2,931.00	23,448,000	貸付株式数	2,500株
ナック	3,900	988.00	3,853,200		
福井コンピュータHLD S	2,600	3,130.00	8,138,000	貸付株式数	1,000株
ニチイ学館	6,200	1,663.00	10,310,600		
ダイセキ	10,900	2,659.00	28,983,100	貸付株式数	4,300株
ステップ	2,400	1,599.00	3,837,600	貸付株式数	900株
日鉄物産	4,700	3,170.00	14,899,000		
泉州電業	2,000	3,120.00	6,240,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,700	2,521.00	4,285,700	貸付株式数	600株
トラスコ中山	14,000	2,594.00	36,316,000	貸付株式数	5,600株
ヤマダ電機	203,400	527.00	107,191,800	貸付株式数	81,400株
オートバックスセブン	24,600	1,413.00	34,759,800	貸付株式数	9,900株
モリト	4,900	722.00	3,537,800	貸付株式数	1,600株
アークランドサカモト	10,500	2,232.00	23,436,000	貸付株式数	900株
ニトリホールディングス	28,800	21,675.00	624,240,000	貸付株式数	11,600株

グルメ杵屋	4,700	1,070.00	5,029,000	貸付株式数	1,800株 (200株)
愛眼	5,400	233.00	1,258,200	貸付株式数	2,100株
ケーユーホールディングス	2,900	818.00	2,372,200	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	22,000	2,039.00	44,858,000	貸付株式数	8,800株 (300株)
加藤産業	9,700	3,685.00	35,744,500		
北恵	1,600	1,106.00	1,769,600	貸付株式数	300株
イノテック	3,900	1,059.00	4,130,100		
イエローハット	12,600	1,733.00	21,835,800	貸付株式数	5,000株
松屋フーズHLDGS	3,200	3,735.00	11,952,000	貸付株式数	200株
JBC Cホールディングス	4,500	1,759.00	7,915,500	貸付株式数	500株
J Kホールディングス	6,000	802.00	4,812,000	貸付株式数	2,400株
サガミホールディングス	8,900	1,452.00	12,922,800	貸付株式数	3,500株
日伝	6,100	2,336.00	14,249,600	貸付株式数	2,200株
関西スーパーマーケット	5,500	1,330.00	7,315,000	貸付株式数	1,000株
ミロク情報サービス	5,900	2,243.00	13,233,700	貸付株式数	2,300株 (400株)

北沢産業	5,200	282.00	1,466,400	貸付株式数	200株
杉本商事	3,500	1,929.00	6,751,500	貸付株式数	1,300株
因幡電機産業	19,100	2,702.00	51,608,200	貸付株式数	3,600株
王将フードサービス	4,900	6,120.00	29,988,000	貸付株式数	1,900株
ブレナス	7,200	1,808.00	13,017,600	貸付株式数	2,800株 (1,700株)
ミニストップ	5,000	1,524.00	7,620,000	貸付株式数	1,700株
アークス	13,600	2,686.00	36,529,600	貸付株式数	3,500株
パローホールディングス	14,700	2,934.00	43,129,800		
東 テ ク	2,200	2,473.00	5,440,600	貸付株式数	600株
ミスミグループ本社	83,600	3,055.00	255,398,000	貸付株式数	32,500株
藤 久	600	1,940.00	1,164,000		
アルテック	5,600	269.00	1,506,400		
ベ ル ク	3,300	7,610.00	25,113,000	貸付株式数	1,100株
大 庄	3,500	1,270.00	4,445,000	貸付株式数	1,200株
タキヒヨー	2,000	1,844.00	3,688,000	貸付株式数	700株
ファーストリテイリング	8,900	64,620.00	575,118,000	貸付株式数	3,500株
ソフトバンクグループ	526,600	6,375.00	3,357,075,000		
蔵王産業	1,000	1,482.00	1,482,000		
スズケン	28,100	4,120.00	115,772,000		
サンドラッグ	25,100	4,025.00	101,027,500		
サックスパーホールディング グ	5,500	569.00	3,129,500		
ジェコス	4,600	941.00	4,328,600		
ヤマザワ	1,400	1,800.00	2,520,000	貸付株式数	600株
や ま や	1,300	2,308.00	3,000,400	貸付株式数	500株
グローセル	6,700	410.00	2,747,000		
ベルーナ	14,400	954.00	13,737,600		
合計			155,810,906,285		

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

ソ ニ ー	20,000株	トヨタ自動車	40,000株
三菱UFJフィナンシャルG	200,000株		

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

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年9月24日から2021年3月23日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

ダイワつみたてインデックス日本株式

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2021年3月23日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,309,070
親投資信託受益証券	1,201,003,295
流動資産合計	1,202,312,365
資産合計	1,202,312,365
負債の部	
流動負債	
未払解約金	429,525
未払受託者報酬	81,769
未払委託者報酬	681,683
その他未払費用	27,176
流動負債合計	1,220,153
負債合計	1,220,153
純資産の部	
元本等	
元本	1,978,467,220
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	222,624,992
（分配準備積立金）	39,354,040
元本等合計	1,201,092,212
純資産合計	1,201,092,212
負債純資産合計	1,202,312,365

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2020年9月24日 至 2021年3月23日
営業収益	
有価証券売買等損益	194,269,192
営業収益合計	194,269,192
営業費用	
支払利息	108
受託者報酬	81,769
委託者報酬	681,683
その他費用	27,176
営業費用合計	790,736
営業利益又は営業損失（ ）	193,478,456
経常利益又は経常損失（ ）	193,478,456
中間純利益又は中間純損失（ ）	193,478,456
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	10,931,523
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	10,799,736
剰余金増加額又は欠損金減少額	31,809,294
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	31,809,294
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,530,971
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,530,971
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	222,624,992

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2020年9月24日 至 2021年3月23日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年3月23日現在
1. 1 期首元本額	795,703,451円
期中追加設定元本額	299,739,020円
期中一部解約元本額	116,975,251円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	978,467,220口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年9月24日 至 2021年3月23日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年3月23日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年3月23日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年3月23日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2275円 (12,275円)

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年3月23日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	16,031,921,847
株式	2 3 173,060,744,090
派生商品評価勘定	60,772,300

未収入金		172,649
未収配当金		207,634,321
未収利息		859,229
その他未収収益	4	27,988,065
流動資産合計		189,390,092,501
資産合計		189,390,092,501
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,522,750
前受金		77,760,000
未払解約金		443,964,720
受入担保金		13,421,737,097
流動負債合計		13,944,984,567
負債合計		13,944,984,567
純資産の部		
元本等		
元本	1	133,223,152,929
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		42,221,955,005
元本等合計		175,445,107,934
純資産合計		175,445,107,934
負債純資産合計		189,390,092,501

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年9月24日 至 2021年3月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
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	2021年3月23日現在
1. 1 期首	2020年9月24日
期首元本額	144,273,817,223円
期中追加設定元本額	8,085,551,081円
期中一部解約元本額	19,136,215,375円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックス ファンド	3,140,088,652円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	6,318,313,345円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2	928,797円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	27,313,358円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	549,752,939円

ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	26,962,746円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	789,489,552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)	146,085,447円
D-I's TOPIXイン デックス	32,023,241円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	48,936,551円
iFree TOPIXイン デックス	3,038,954,924円
iFree 8資産バランス	2,679,444,590円
iFree 年金バランス	291,615,093円
DCダイワ日本株式インデッ クス	64,883,997,742円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,830,150,753円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,688,166,172円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,407,764,545円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	5,355,042,244円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	43,990,167円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	37,800,038円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	911,992,783円
ダイワつみたてインデックス バランス30	10,674,743円
ダイワつみたてインデックス バランス50	7,946,508円
ダイワつみたてインデックス バランス70	12,127,061円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	121,311,831円

	ダイワ世界バランスファンド 60VA		131,346,461円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA		6,814,987,304円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)		595,127,155円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)		86,777,082円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)		155,220,816円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド		139,758,960円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス		10,272,320,556円
	ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)		991,180,892円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス		2,181,653,596円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPIX		1,195,400,103円
	ダイワライフスタイル25		159,396,622円
	ダイワライフスタイル50		622,407,729円
	ダイワライフスタイル75		495,971,027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)		10,980,730,804円
	計		133,223,152,929円
2.	期末日における受益権の総数		133,223,152,929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	12,550,262,620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	914,360,000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26,862,526円が含まれております。
--------------	-------------------------------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年3月23日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	2021年3月23日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	2,271,300,000	-	2,330,615,000	59,315,000
合計	2,271,300,000	-	2,330,615,000	59,315,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2021年3月23日現在
1口当たり純資産額	1.3169円
(1万口当たり純資産額)	(13,169円)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年3月31日

資産総額	1,226,340,726円
負債総額	356,174円
純資産総額（ - ）	1,225,984,552円
発行済数量	999,084,130口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2271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

2021年3月31日

資産総額	187,489,169,265円
負債総額	11,626,212,502円
純資産総額（ - ）	175,862,956,763円
発行済数量	133,584,109,370口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3165円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2021年3月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

また、取締役、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。

2021年3月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	41	80,646
追加型株式投資信託	735	20,466,276
株式投資信託 合計	776	20,546,922
単位型公社債投資信託	54	165,335
追加型公社債投資信託	14	1,561,179
公社債投資信託 合計	68	1,726,514
総合計	844	22,273,436

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)
資産の部		
流動資産		
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
固定資産		
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)
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		

資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,052	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)	
資産の部		
流動資産		
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
固定資産		
有形固定資産	1	226
無形固定資産		
ソフトウェア		1,720
その他		687
無形固定資産合計		2,408
投資その他の資産		
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)
三井住友信託銀行株式会社	342,037	(注2)
労働金庫連合会	120,000	(注3)

(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) 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 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

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

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

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

2020年10月30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」に掲げられているダイワつみたてインデックス日本株式の2019年9月20日から2020年9月23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、ダイワつみたてインデックス日本株式の2020年9月23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、継続企業的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な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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年4月30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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワつみたてインデックス日本株式の2020年9月24日から2021年3月23日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワつみたてインデックス日本株式の2021年3月23日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年9月24日から2021年3月23日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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、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、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、継続企業的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。

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な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、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。
- ・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、経営者に対して、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

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。