【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】	2022年2月21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】	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）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	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、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位

(7)【申込期間】

2022年2月22日から2022年8月24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】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）　0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ　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】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注1）商品分類の定義

単位型・追加型	**単位型**	**当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド**
	追加型	**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**

投資対象地域	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
	海外	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海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	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
	債券	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債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	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不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	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、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＭＦ
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＲＦ
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第１号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	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
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

投資対象資産	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
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信		目論見書等において、主として不動産投信（リート）に投資する旨の記載があるもの
	その他資産		目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信（リート）以外に投資する旨の記載があるもの
	資産複合		目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの
	資産複合　資産配分固定型		目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
	資産複合　資産配分変更型		目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
決算頻度	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
	年2回		目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
	年4回		目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの
	年6回（隔月）		目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
	年12回（毎月）		目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
	日々		目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの
	その他		上記属性にあてはまらないすべてのもの

投資対象地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東（中東）	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	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
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
対象インデックス	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	ＴＯＰＩＸ	目論見書等において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

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

＜信託金の限度額＞

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

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

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

●東京証券取引所第一部上場株式※（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。

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

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

(c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

運用プロセス

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

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

※2022年3月12日以降、「東京証券取引所上場株式」とします。

■ 東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）について

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、東京証券取引所が算出・公表する株価指数で、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークであり、日本経済の動向を示すバロメーターとして経済指標、ETFの連動指標などに用いられています。

① ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株) 東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などＴＯＰＩＸに関するすべての権利、ノウハウおよびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は（株）東京証券取引所が有します。

② （株）東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、ＴＯＰＩＸの指数値の算出もしくは公表の停止またはＴＯＰＩＸの商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。

③ （株）東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの商標の使用もしくはＴＯＰＩＸの指数の引用に関して得られる結果ならびに特定日のＴＯＰＩＸの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

④ （株）東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、（株）東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

⑤ 本件インデックスファンドは、（株）東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

⑥ （株）東京証券取引所は、本件インデックスファンドの購入者または公衆に対し、本件インデックスファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

⑦ （株）東京証券取引所は、当社または本件インデックスファンドの購入者のニーズを、ＴＯＰＩＸの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

⑧ 以上の項目に限らず、（株）東京証券取引所は本件インデックスファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

2 当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合に限り購入できます。

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

〈分配方針〉

①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

②原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2)【ファンドの沿革】

2001年9月14日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者

収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）

お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約(※1)に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③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

↑↓※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	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など

↓運用指図↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充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。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

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

(注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

＜委託会社の概況（2021年11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	%
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	2,608,525	100.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

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

(2)【投資対象】

①　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)③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

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

③　委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

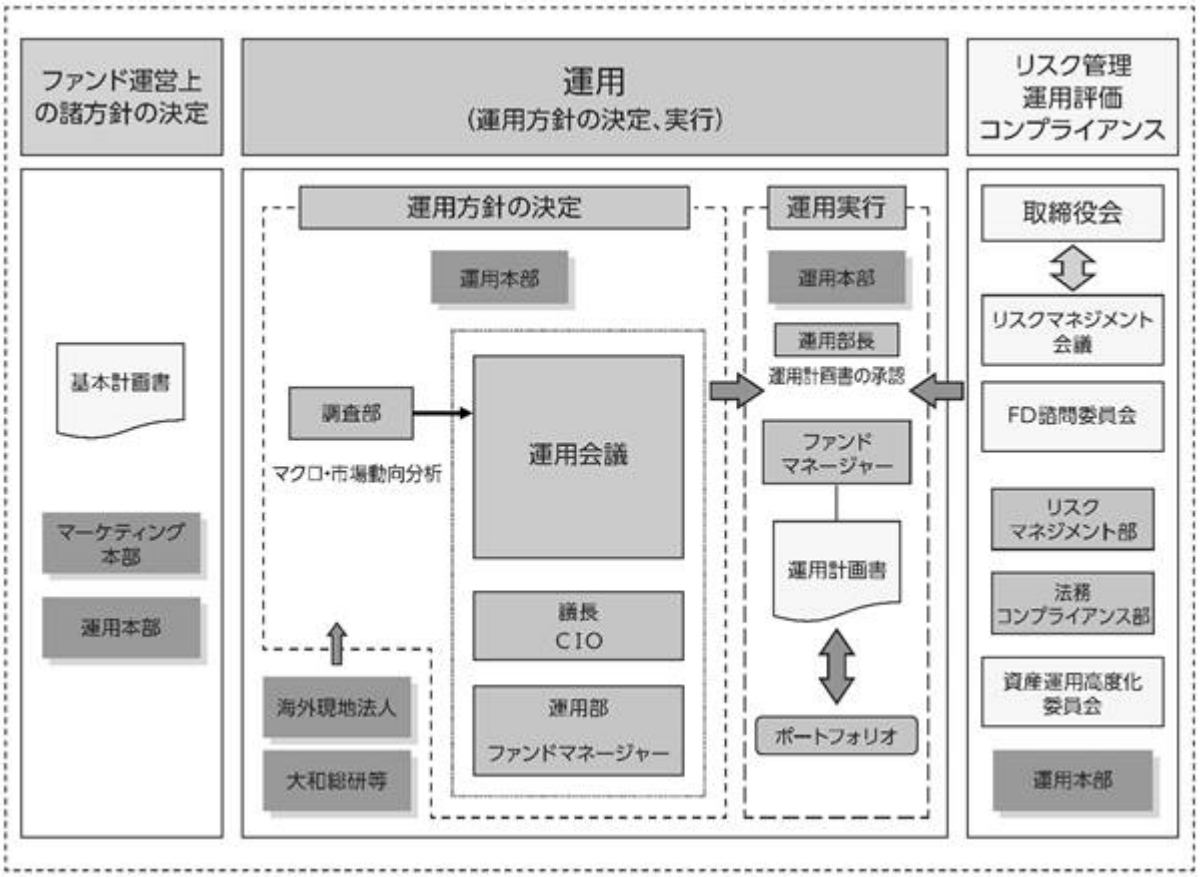
5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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

(3)【運用体制】

①　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。



② 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。

③ 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。

④　リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は45～55名程度です。

イ．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。

ロ．FD諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、ファンド組成・運用に関わる会議体等に対する牽制に資する事項について、取締役会に意見を述べます。

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

⑤　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11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

②　原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　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。

②　株式以外の資産（信託約款）

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

③　先物取引等（信託約款）

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

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

④　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。

⑤　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。

⑥　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。

⑦　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

＜参考＞トピックス・インデックス・マザーファンドの概要

(1) 投資方針

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

①　主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

※2022年3月12日に信託約款を変更し、下記とします。
東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

② 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す。

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

① 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

② 委託会社は、信託金を、前①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

① 株式への投資には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資は、行ないません。

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 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。

② 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、ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3)その他の留意点

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

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

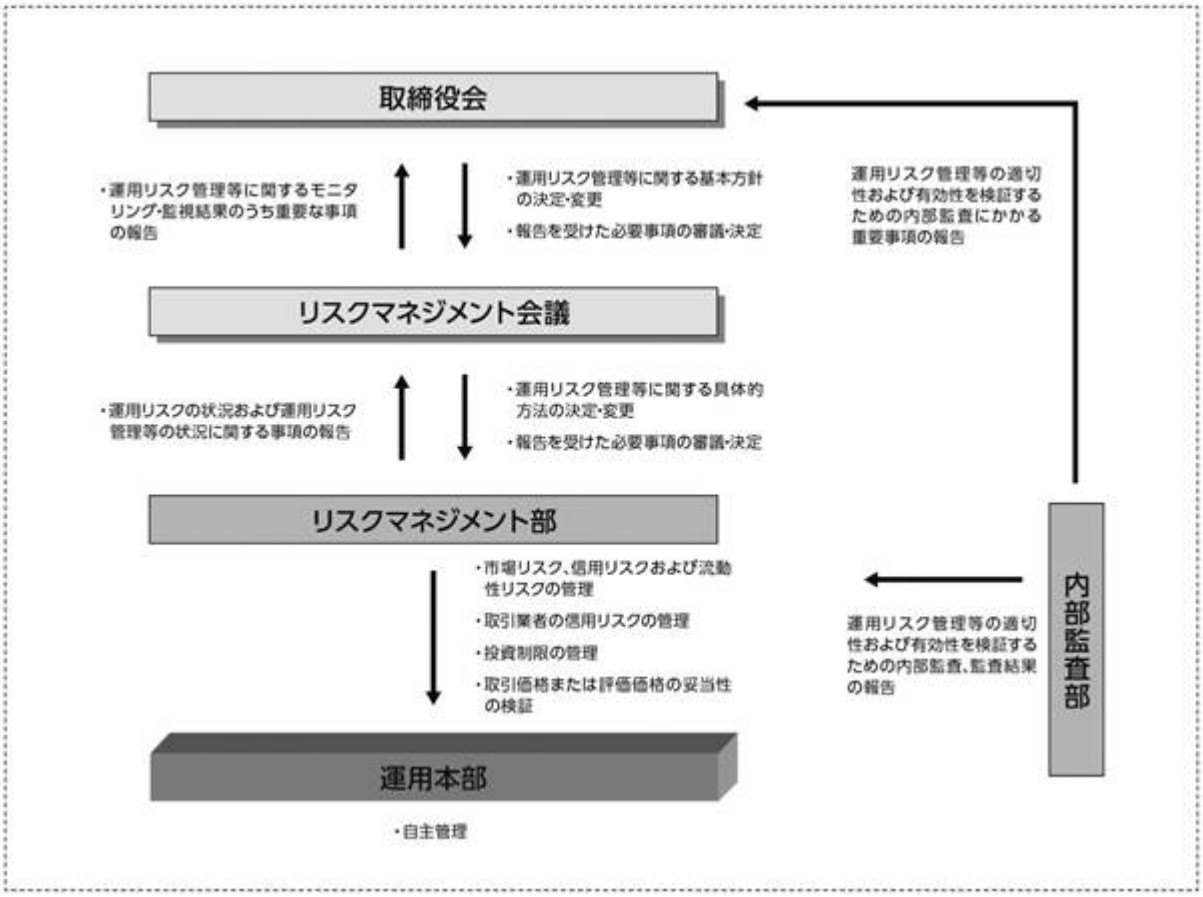
※ 流動性リスクに関する事項

・ 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

(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

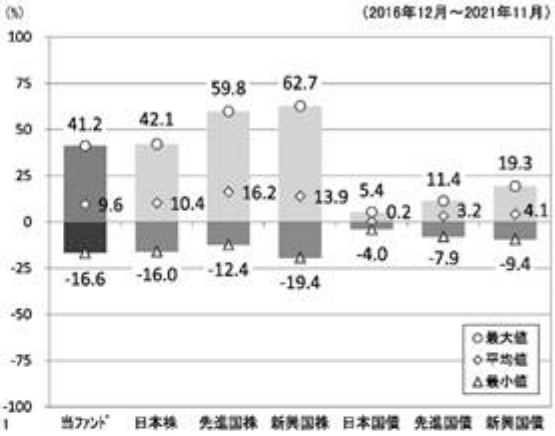
- **委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。**
- **取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。**

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― エマージング・マーケッツ 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、知的所有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― エマージング・マーケッツ 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、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.682%（税抜0.62%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

② 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。

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.20% （税抜）	年率0.36% （税抜）	年率0.06% （税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

④ 前③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】

① 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。

② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③ 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。

④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】(2021年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		13,871,450,457	99.99
	内 日本	13,871,450,457	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		959,615	0.01
純資産総額		13,872,410,072	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11月30日現在)

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
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	10,563,090,510	1.1745 12,406,964,302	1.3132 13,871,450,457	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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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】

① 【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11計算期間末 (2012年11月30日)	7,019,281,868	7,019,281,868	0.8236	0.8236
第12計算期間末 (2013年12月2日)	11,532,134,047	11,532,134,047	1.3432	1.3432
第13計算期間末 (2014年12月1日)	13,209,101,022	13,209,101,022	1.5364	1.5364
第14計算期間末 (2015年11月30日)	14,903,022,444	14,903,022,444	1.7298	1.7298
第15計算期間末 (2016年11月30日)	14,335,781,385	14,335,781,385	1.6320	1.6320
第16計算期間末 (2017年11月30日)	15,763,147,825	15,763,147,825	2.0187	2.0187
第17計算期間末 (2018年11月30日)	14,378,262,347	14,378,262,347	1.9048	1.9048
第18計算期間末 (2019年12月2日)	14,219,446,692	14,219,446,692	1.9951	1.9951
第19計算期間末 (2020年11月30日)	13,356,110,610	13,356,110,610	2.0789	2.0789
2020年12月末日	13,629,694,783	—	2.1395	—
2021年1月末日	13,520,557,480	—	2.1433	—
2月末日	13,772,401,550	—	2.2092	—
3月末日	14,470,133,168	—	2.3343	—
4月末日	13,963,089,236	—	2.2670	—
5月末日	14,057,907,570	—	2.2969	—
6月末日	14,150,929,635	—	2.3228	—
7月末日	13,813,119,040	—	2.2713	—
8月末日	14,152,678,796	—	2.3415	—
9月末日	14,716,455,541	—	2.4428	—
10月末日	14,458,773,891	—	2.4069	—

第20計算期間末 (2021年11月30日)	13,872,410,072	13,872,410,072	2.3177	2.3177

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第11計算期間	9.2
第12計算期間	63.1
第13計算期間	14.4
第14計算期間	12.6
第15計算期間	△5.7
第16計算期間	23.7
第17計算期間	△5.6
第18計算期間	4.7
第19計算期間	4.2
第20計算期間	11.5

(4) 【設定及び解約の実績】

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

第18計算期間	537,570,960	958,865,619
第19計算期間	515,260,387	1,217,776,163
第20計算期間	463,224,447	902,484,871

（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11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	177,548,758,040	97.20
内 日本	177,548,758,040	97.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,114,533,662	2.80
純資産総額	182,663,291,702	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）	5,536,320,000	3.03
内 日本	5,536,320,000	3.03

(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11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3,409,900	1,985.83 6,771,512,900	2,001.00 6,823,209,900	3.74
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	421,700	12,341.45 5,204,389,600	13,825.00 5,830,002,500	3.19
3	キーエンス	日本	株式	電気機器	61,000	71,630.00 4,369,430,000	70,330.00 4,290,130,000	2.35

4	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	496,200	7,015.67 3,481,178,400	6,901.00 3,424,276,200	1.87
5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,258,400	632.50 2,693,438,000	601.40 2,561,001,760	1.40
6	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	42,700	53,941.40 2,303,298,000	59,840.00 2,555,168,000	1.40
7	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	772,600	3,225.94 2,492,365,600	3,125.00 2,414,375,000	1.32
8	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報･通信業	396,100	6,329.00 2,506,916,900	6,030.00 2,388,483,000	1.31
9	HOYA	日本	株式	精密機器	131,400	18,410.21 2,419,101,800	18,020.00 2,367,828,000	1.30
10	日本電産	日本	株式	電気機器	174,500	13,274.47 2,316,395,900	13,000.00 2,268,500,000	1.24
11	日 立	日本	株式	電気機器	323,800	6,443.57 2,086,430,600	6,688.00 2,165,574,400	1.19
12	信越化学	日本	株式	化学	113,200	21,150.00 2,394,180,000	19,000.00 2,150,800,000	1.18
13	ダイキン工業	日本	株式	機械	85,800	26,672.59 2,288,508,600	23,150.00 1,986,270,000	1.09
14	任 天 堂	日本	株式	その他製品	38,000	52,660.00 2,001,080,000	50,100.00 1,903,800,000	1.04
15	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	459,700	3,928.20 1,805,795,900	3,703.00 1,702,269,100	0.93
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	497,900	3,538.11 1,761,629,200	3,391.00 1,688,378,900	0.92
17	村田製作所	日本	株式	電気機器	197,700	10,011.36 1,979,247,500	8,380.00 1,656,726,000	0.91
18	本田技研	日本	株式	輸送用機器	529,900	3,338.09 1,768,855,500	3,101.00 1,643,219,900	0.90
19	武田薬品	日本	株式	医薬品	529,200	3,759.00 1,989,262,800	3,031.00 1,604,005,200	0.88
20	KDDI	日本	株式	情報･通信業	481,600	3,786.00 1,823,337,600	3,300.00 1,589,280,000	0.87
21	ソフトバンク	日本	株式	情報･通信業	1,000,600	1,552.78 1,553,721,600	1,562.50 1,563,437,500	0.86
22	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	465,300	3,453.51 1,606,922,700	3,260.00 1,516,878,000	0.83
23	第一三共	日本	株式	医薬品	529,200	3,019.43 1,597,885,500	2,824.50 1,494,725,400	0.82

24	SMC	日本	株式	機械	19,800	77,236.12 1,529,275,200	72,650.00 1,438,470,000	0.79
25	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	76,100	17,327.22 1,318,601,500	17,840.00 1,357,624,000	0.74
26	三井物産	日本	株式	卸売業	516,000	2,445.70 1,261,986,000	2,557.00 1,319,412,000	0.72
27	ファナック	日本	株式	電気機器	59,100	25,563.75 1,510,817,900	22,245.00 1,314,679,500	0.72
28	東京海上HD	日本	株式	保険業	218,700	6,000.00 1,312,200,600	5,708.00 1,248,339,600	0.68
29	デンソー	日本	株式	輸送用機器	148,200	7,740.93 1,147,206,000	8,331.00 1,234,654,200	0.68
30	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	849,700	1,602.00 1,361,219,400	1,402.00 1,191,279,400	0.65

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.20%
合計	97.20%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.22%
建設業	2.12%
食料品	3.16%
繊維製品	0.45%
パルプ・紙	0.20%
化学	6.62%
医薬品	4.70%
石油・石炭製品	0.39%
ゴム製品	0.64%
ガラス・土石製品	0.77%
鉄鋼	0.69%
非鉄金属	0.67%
金属製品	0.62%
機械	5.23%

電気機器	19.27%
輸送用機器	7.85%
精密機器	2.94%
その他製品	2.12%
電気・ガス業	1.05%
陸運業	2.90%
海運業	0.42%
空運業	0.36%
倉庫・運輸関連業	0.16%
情報・通信業	8.38%
卸売業	4.98%
小売業	4.10%
銀行業	4.54%
証券、商品先物取引業	0.71%
保険業	1.86%
その他金融業	1.10%
不動産業	1.79%
サービス業	6.07%
合計	97.20%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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　０３１２月	買建	292	5,890,975,350	5,536,320,000	3.03%

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

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

（参考情報）運用実績

●DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)

2021年11月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	23,177円
純資産総額	138億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-3.7%
3カ月間	-1.0%
6カ月間	0.9%
1年間	11.5%
3年間	21.7%
5年間	42.0%
設定来	139.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：0円　　設定来分配金合計額：400円

決算期	第9期 10年11月	第10期 11年11月	第11期 12年11月	第12期 13年12月	第13期 14年12月	第14期 15年11月	第15期 16年11月	第16期 17年11月	第17期 18年11月	第18期 19年12月	第19期 20年11月	第20期 21年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式	2,123	97.2%
国内株式先物	1	3.0%
不動産投資信託等	-	-
コール・ローン、その他		2.8%
合計	2,124	-

株式 市場・上場別構成	比率
一部(東証・名証)	97.2%
二部(東証・名証)	-
新興市場他	-
その他	-
合計	97.2%

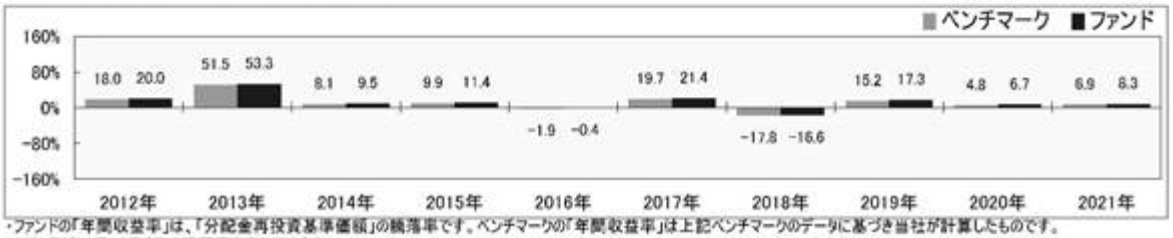
株式東証33業種別構成	比率
電気機器	19.3%
情報・通信業	8.4%
輸送用機器	7.9%
化学	6.6%
サービス業	6.1%
機械	5.2%
卸売業	5.0%
医薬品	4.7%
銀行業	4.5%
その他	29.5%
合計	97.2%

組入上位10銘柄	業種名	比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.7%
ソニーグループ	電気機器	3.2%
TOPIX先物 0312月	-	3.0%
キーエンス	電気機器	2.3%
リクルートホールディングス	サービス業	1.9%
三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.4%
東京エレクトロン	電気機器	1.4%
日本電信電話	情報・通信業	1.3%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.3%
HOYA	精密機器	1.3%
合計		20.9%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。



・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。
・2021年は11月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

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

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

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

２【換金（解約）手続等】

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

＜一部解約＞

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

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

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	https://www.daiwa-am.co.jp/

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	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)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。

5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

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

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

④ 運用報告書

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

⑤ 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。

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金にかかる請求権＞

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

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

＜償還金にかかる請求権＞

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

＜換金請求権＞

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

第３　【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間（2020年12月1日から2021年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 2020年11月30日現在	第20期 2021年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	51,242,037	56,665,086
親投資信託受益証券	13,355,153,448	13,871,450,457
未収入金	37,800,000	13,500,000
流動資産合計	13,444,195,485	13,941,615,543
資産合計	13,444,195,485	13,941,615,543
負債の部		
流動負債		
未払解約金	45,109,825	19,774,248
未払受託者報酬	4,125,570	4,745,373
未払委託者報酬	38,505,773	44,290,492
その他未払費用	343,707	395,358
流動負債合計	88,084,875	69,205,471
負債合計	88,084,875	69,205,471
純資産の部		
元本等		
元本	※1 6,424,598,616	※1 5,985,338,192
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,931,511,994	7,887,071,880
（分配準備積立金）	4,222,651,338	4,974,211,546
元本等合計	13,356,110,610	13,872,410,072
純資産合計	13,356,110,610	13,872,410,072
負債純資産合計	13,444,195,485	13,941,615,543

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期 自　2019年12月3日 至　2020年11月30日	第20期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
営業収益		
受取利息	83	2
有価証券売買等損益	571,616,372	1,614,197,009
営業収益合計	571,616,455	1,614,197,011
営業費用		
支払利息	10,343	7,069
受託者報酬	8,334,384	9,357,355
委託者報酬	77,788,411	87,336,053
その他費用	694,736	779,627
営業費用合計	86,827,874	97,480,104
営業利益	484,788,581	1,516,716,907
経常利益	484,788,581	1,516,716,907
当期純利益	484,788,581	1,516,716,907
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△ 137,825,010	190,517,708
期首剰余金又は期首欠損金（△）	7,092,332,300	6,931,511,994
剰余金増加額又は欠損金減少額	418,339,935	608,085,080
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	418,339,935	608,085,080
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,201,773,832	978,724,393
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,201,773,832	978,724,393
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,931,511,994	7,887,071,880

(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20期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第19期 2020年11月30日現在	第20期 2021年11月30日現在
1.　※1　期首元本額	7,127,114,392円	6,424,598,616円
期中追加設定元本額	515,260,387円	463,224,447円
期中一部解約元本額	1,217,776,163円	902,484,871円
2.　計算期間末日における受益権の総数	6,424,598,616口	5,985,338,192口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第19期 自　2019年12月3日 至　2020年11月30日	第20期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日

※1　分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（591,084,241円）、投資信託約款に規定される収益調整金（5,492,634,361円）及び分配準備積立金（3,631,567,097円）より分配対象額は9,715,285,699円（1万口当たり15,122.01円）であり、分配を行っておりません。	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（1,326,197,803円）、投資信託約款に規定される収益調整金（5,403,018,636円）及び分配準備積立金（3,648,013,743円）より分配対象額は10,377,230,182円（1万口当たり17,337.75円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第20期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2．　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第20期 2021年11月30日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第19期 2020年11月30日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第20期 2021年11月30日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	660,371,787	1,464,486,155
合計	660,371,787	1,464,486,155

（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19期 2020年11月30日現在	第20期 2021年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第20期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第19期 2020年11月30日現在	第20期 2021年11月30日現在

1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0789円 (20,789円)	2.3177円 (23,177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	10,563,090,510	13,871,450,457	
親投資信託受益証券　合計			13,871,450,457	
合計			13,871,450,457	

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

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		

流動資産			
コール・ローン		12,212,008,294	8,845,838,998
株式	※2※3	163,479,342,460	177,548,758,040
派生商品評価勘定		89,140,900	－
未収配当金		1,010,955,223	1,233,193,430
未収利息		814,653	551,974
前払金		－	211,095,600
その他未収収益	※4	33,720,594	21,961,225
差入委託証拠金		－	18,795,000
流動資産合計		176,825,982,124	187,880,194,267
資産合計		176,825,982,124	187,880,194,267
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		23,231,250	355,476,200
前受金		102,752,600	－
未払解約金		189,585,900	44,822,370
受入担保金		9,568,784,085	4,816,603,995
流動負債合計		9,884,353,835	5,216,902,565
負債合計		9,884,353,835	5,216,902,565
純資産の部			
元本等			
元本	※1	142,709,508,970	139,094,932,448
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		24,232,119,319	43,568,359,254
元本等合計		166,941,628,289	182,663,291,702
純資産合計		166,941,628,289	182,663,291,702
負債純資産合計		176,825,982,124	187,880,194,267

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12月1日 至　2021年11月30日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1．※1　期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	147,704,616,967円	142,709,508,970円
期中追加設定元本額	28,551,522,466円	20,968,397,493円
期中一部解約元本額	33,546,630,463円	24,582,974,015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	3,193,110,083円	2,975,507,036円

ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	6,674,458,363円	5,686,561,941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	930,834円	924,307円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	32,952,471円	24,862,174円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	668,546,231円	418,851,032円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	35,731,278円	21,795,176円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	908,394,726円	711,622,184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）	126,217,518円	242,143,159円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	38,327,788円	48,516,772円
為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド	10,549,517円	－円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	23,213,652円	150,899,876円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	2,041,017,760円	4,912,109,453円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,619,294,575円	3,289,496,110円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	125,857,474円	524,441,173円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	64,944,239,094円	66,361,817,159円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,972,314,135円	2,933,677,304円
ダイワ・ライフ・バランス５０	3,751,798,888円	4,117,458,139円
ダイワ・ライフ・バランス７０	3,333,100,735円	4,042,208,265円
年金ダイワ日本株式インデックス	5,191,048,366円	6,020,854,667円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	11,676,676円	－円

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	46,996,347円	53,651,007円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	34,721,962円	58,568,334円
ダイワつみたてインデックス日本株式	817,787,252円	1,539,852,892円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	10,918,252円	10,210,048円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	7,976,371円	9,943,370円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	11,268,546円	19,590,190円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	－円	721,071円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	141,666,674円	108,723,511円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	149,563,586円	125,845,796円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	7,748,159,579円	5,927,962,438円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	659,469,668円	524,674,963円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	99,902,437円	75,481,125円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	178,714,272円	141,439,467円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	149,232,217円	200,182,570円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	10,242,225,102円	10,416,484,453円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	9,426,768,765円	1,750,254,771円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	2,261,893,318円	2,681,477,325円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,247,128,871円	1,175,509,780円
ダイワライフスタイル２５	180,844,569円	150,358,577円
ダイワライフスタイル５０	655,627,347円	597,518,476円

	ダイワライフスタイル７５	519,251,046円	479,645,847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）	11,416,612,625円	10,563,090,510円
	計	142,709,508,970円	139,094,932,448円
2.	期末日における受益権の総数	142,709,508,970口	139,094,932,448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　9,033,368,760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　4,435,964,100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　740,845,000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　952,550,000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32,214,780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21,209,315円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2020年12月1日 至　2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。

3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2021年11月30日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)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	2020年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2021年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	9,890,799,472	△12,356,661,736
合計	9,890,799,472	△12,356,661,736

（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（2020年9月24日から2020年11月30日まで、及び2021年9月22日から2021年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種　類	2020年11月30日 現在				2021年11月30日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買　建	2,900,792,400	－	2,966,795,000	66,002,600	5,891,635,600	－	5,536,320,000	△355,315,600
合計	2,900,792,400	－	2,966,795,000	66,002,600	5,891,635,600	－	5,536,320,000	△355,315,600

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1698円	1.3132円
（1万口当たり純資産額）	(11,698円)	(13,132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	3,200	2,900.00	9,280,000	貸付株式数　400株
日本水産	91,400	573.00	52,372,200	
マルハニチロ	14,300	2,277.00	32,561,100	
ホウスイ	600	879.00	527,400	貸付株式数　100株
カネコ種苗	2,800	1,348.00	3,774,400	
サカタのタネ	10,900	3,125.00	34,062,500	

ホクト	7,900	1,842.00	14,551,800		
ホクリヨウ	1,500	677.00	1,015,500		
ヒノキヤグループ	2,300	2,118.00	4,871,400		
ショーボンドＨＤ	13,200	4,885.00	64,482,000	貸付株式数	3,200株
ミライト・ホールディングス	29,400	1,965.00	57,771,000	貸付株式数	3,400株
タマホーム	5,900	2,290.00	13,511,000	貸付株式数	2,200株
サンヨーホームズ	1,500	713.00	1,069,500	貸付株式数	300株
日本アクア	4,400	672.00	2,956,800		
ファーストコーポレーション	2,500	689.00	1,722,500	貸付株式数	1,000株
ベステラ	1,900	1,276.00	2,424,400	貸付株式数	700株
キャンディル	1,700	494.00	839,800	貸付株式数	600株
スペースバリューＨＤ	9,600	1,146.00	11,001,600		
住石ホールディングス	21,600	126.00	2,721,600	貸付株式数	6,400株
日鉄鉱業	2,300	6,160.00	14,168,000		
三井松島ＨＬＤＧＳ	3,600	1,293.00	4,654,800	貸付株式数	1,400株
ＩＮＰＥＸ	367,200	937.00	344,066,400		
石油資源開発	10,700	2,291.00	24,513,700	貸付株式数	1,800株
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,400	1,502.00	6,608,800		
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,658.00	2,984,400		
第一カッター興業	2,300	1,269.00	2,918,700		
明豊ファシリティワークス	2,900	841.00	2,438,900	貸付株式数	1,100株
安藤・間	50,300	841.00	42,302,300	貸付株式数	20,000株
東急建設	29,000	645.00	18,705,000		
コムシスホールディングス	29,500	2,476.00	73,042,000		
ビーアールホールディングス	12,700	353.00	4,483,100	貸付株式数	4,900株
高松コンストラクショングループ	5,700	1,869.00	10,653,300	貸付株式数	2,100株
東建コーポレーション	2,800	8,950.00	25,060,000	貸付株式数	1,100株
ソネック	1,000	984.00	984,000	貸付株式数	100株
ヤマウラ	4,400	924.00	4,065,600	貸付株式数	1,600株
オリエンタル白石	32,300	227.00	7,332,100		
大成建設	61,000	3,310.00	201,910,000		
大　林　組	211,100	836.00	176,479,600		
清水建設	197,800	717.00	141,822,600		
飛島建設	5,500	977.00	5,373,500	貸付株式数	600株
長谷工コーポレーシヨン	62,700	1,354.00	84,895,800		

松井建設	8,400	703.00	5,905,200		
錢　高　組	900	3,765.00	3,388,500		
鹿島建設	154,700	1,251.00	193,529,700		
不動テトラ	4,400	1,612.00	7,092,800		
大末建設	2,200	1,118.00	2,459,600	貸付株式数	600株
鉄建建設	4,500	1,717.00	7,726,500		
西松建設	12,800	3,385.00	43,328,000		
三井住友建設	47,600	414.00	19,706,400	貸付株式数	5,100株
大豊建設	3,100	3,620.00	11,222,000	貸付株式数	1,800株
佐田建設	4,600	478.00	2,198,800	貸付株式数	500株
ナカノフドー建設	5,000	333.00	1,665,000		
奥　村　組	12,400	3,140.00	38,936,000		
東鉄工業	9,800	2,273.00	22,275,400	貸付株式数	3,400株
イチケン	1,500	1,810.00	2,715,000		
富士ピー・エス	2,900	495.00	1,435,500	貸付株式数	700株
淺沼組	2,400	5,260.00	12,624,000	貸付株式数	200株
戸田建設	87,300	668.00	58,316,400		
熊　谷　組	10,700	2,628.00	28,119,600		
北野建設	1,200	2,050.00	2,460,000		
植　木　組	1,700	1,361.00	2,313,700	貸付株式数	700株
矢作建設	9,300	691.00	6,426,300		
ピーエス三菱	6,900	593.00	4,091,700	貸付株式数	1,000株
日本ハウスＨＬＤＧＳ	14,700	347.00	5,100,900	貸付株式数	5,600株
大東建託	21,600	12,290.00	265,464,000		
新日本建設	8,900	745.00	6,630,500		
ＮＩＰＰＯ	17,700	4,010.00	70,977,000		
東亜道路	1,100	4,650.00	5,115,000	貸付株式数	300株
日本道路	2,000	7,800.00	15,600,000		
東亜建設	5,100	2,379.00	12,132,900	貸付株式数	2,600株
日本国土開発	20,300	532.00	10,799,600		
若築建設	3,500	1,900.00	6,650,000		
東洋建設	24,200	524.00	12,680,800		
五洋建設	83,700	651.00	54,488,700	貸付株式数	8,900株
世紀東急	10,200	824.00	8,404,800		
福　田　組	2,400	4,110.00	9,864,000	貸付株式数	800株
日本ドライケミカル	1,600	1,772.00	2,835,200	貸付株式数	200株
住友林業	54,400	2,287.00	124,412,800		
日本基礎技術	5,800	551.00	3,195,800		
巴コーポレーション	9,000	432.00	3,888,000		
大和ハウス	194,900	3,316.00	646,288,400		

ライト工業	13,300	2,025.00	26,932,500		
積水ハウス	228,800	2,210.00	505,648,000		
日特建設	4,300	641.00	2,756,300	貸付株式数	1,300株
北陸電気工事	3,800	1,051.00	3,993,800		
ユアテック	12,100	601.00	7,272,100		
日本リーテック	4,500	1,393.00	6,268,500	貸付株式数	500株
四電工	2,400	1,627.00	3,904,800		
中電工	10,100	2,027.00	20,472,700		
関　電　工	34,900	810.00	28,269,000		
きんでん	47,100	1,643.00	77,385,300		
東京エネシス	6,700	1,032.00	6,914,400		
トーエネック	2,100	3,120.00	6,552,000		
住友電設	5,200	1,926.00	10,015,200	貸付株式数	1,200株
日本電設工業	11,600	1,549.00	17,968,400	貸付株式数	400株
エクシオグループ	32,300	2,406.00	77,713,800		
新日本空調	5,700	2,093.00	11,930,100	貸付株式数	1,400株
日本工営	3,800	3,170.00	12,046,000		
九電工	16,300	3,360.00	54,768,000		
三機工業	13,600	1,373.00	18,672,800	貸付株式数	1,900株
日揮ホールディングス	64,700	957.00	61,917,900		
中外炉工業	2,000	1,552.00	3,104,000	貸付株式数	200株
ヤマト	6,200	738.00	4,575,600		
太平電業	4,900	2,706.00	13,259,400		
高砂熱学	19,100	1,908.00	36,442,800		
三晃金属	900	2,300.00	2,070,000		
ＮＥＣネッツエスアイ	22,300	1,809.00	40,340,700		
朝日工業社	1,300	2,809.00	3,651,700	貸付株式数	200株
明星工業	13,600	652.00	8,867,200		
大　氣　社	10,200	2,900.00	29,580,000	貸付株式数	2,200株
ダイダン	4,700	2,050.00	9,635,000		
日比谷総合設備	7,000	1,864.00	13,048,000	貸付株式数	400株
ニップン	19,800	1,567.00	31,026,600		
日清製粉Ｇ本社	76,400	1,636.00	124,990,400		
日東富士製粉	1,000	3,455.00	3,455,000		
昭和産業	6,400	2,617.00	16,748,800		
鳥越製粉	6,400	710.00	4,544,000	貸付株式数	2,400株
中部飼料	7,800	944.00	7,363,200	貸付株式数	3,100株
フィード・ワン	9,300	714.00	6,640,200		
東洋精糖	1,300	1,127.00	1,465,100		
日本甜菜糖	3,500	1,595.00	5,582,500		

ＤＭ三井製糖ホールディ	6,100	1,862.00	11,358,200	貸付株式数	400株
塩水港精糖	10,300	213.00	2,193,900	貸付株式数	900株
日新製糖	3,300	1,629.00	5,375,700		
ＬＩＦＵＬＬ	22,500	258.00	5,805,000	貸付株式数	7,600株
ミクシィ	14,800	2,021.00	29,910,800	貸付株式数	6,600株
ジェイエイシーリクルートメント	5,500	1,988.00	10,934,000	貸付株式数	500株
日本M&Aセンターホールデ	105,500	3,335.00	351,842,500		
メンバーズ	2,000	2,333.00	4,666,000	貸付株式数	700株
中広	1,100	386.00	424,600	貸付株式数	400株
ＵＴグループ	9,400	4,050.00	38,070,000	貸付株式数	2,900株
アイティメディア	3,100	2,006.00	6,218,600	貸付株式数	200株
Ｅ・Ｊホールディングス	3,300	1,179.00	3,890,700	貸付株式数	1,300株
夢真ビーネックスグループ	17,600	1,666.00	29,321,600		
コシダカホールディングス	18,600	598.00	11,122,800	貸付株式数	6,100株
アルトナー	1,300	825.00	1,072,500		
パソナグループ	7,300	3,545.00	25,878,500		
ＣＤＳ	1,500	1,638.00	2,457,000		
リンクアンドモチベーション	14,500	707.00	10,251,500	貸付株式数	5,600株
エス・エム・エス	22,200	4,235.00	94,017,000		
サニーサイドアップＧ	2,100	730.00	1,533,000	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	64,200	3,280.00	210,576,000		
リニカル	3,400	851.00	2,893,400	貸付株式数	1,400株
クックパッド	21,700	256.00	5,555,200	貸付株式数	7,800株
エスクリ	3,100	412.00	1,277,200	貸付株式数	700株
アイ・ケイ・ケイホールディンク	3,400	608.00	2,067,200	貸付株式数	1,200株
森永製菓	15,900	3,530.00	56,127,000		
中　村　屋	1,600	3,605.00	5,768,000		
江崎グリコ	18,600	3,505.00	65,193,000		
名糖産業	3,000	1,650.00	4,950,000	貸付株式数	400株
井村屋グループ	3,800	2,162.00	8,215,600		
不　二　家	4,100	2,232.00	9,151,200	貸付株式数	1,600株
山崎製パン	50,700	1,475.00	74,782,500		
第一屋製パン	1,300	529.00	687,700	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,100	5,290.00	5,819,000		
亀田製菓	3,800	4,325.00	16,435,000		
寿スピリッツ	6,600	6,160.00	40,656,000	貸付株式数	1,400株

カルビー	30,800	2,548.00	78,478,400	貸付株式数	4,700株
森永乳業	12,600	5,440.00	68,544,000		
六甲バター	5,000	1,528.00	7,640,000	貸付株式数	2,000株
ヤクルト	50,100	5,670.00	284,067,000		
明治ホールディングス	44,700	6,660.00	297,702,000		
雪印メグミルク	16,300	1,920.00	31,296,000	貸付株式数	100株
プリマハム	8,500	2,371.00	20,153,500	貸付株式数	2,700株
日本ハム	25,900	3,870.00	100,233,000		
林兼産業	2,200	531.00	1,168,200		
丸大食品	6,600	1,433.00	9,457,800		
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,100	3,285.00	20,038,500	貸付株式数	2,400株
柿安本店	2,300	2,590.00	5,957,000	貸付株式数	900株
伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ	43,800	642.00	28,119,600	貸付株式数	1,400株
学情	2,800	1,079.00	3,021,200	貸付株式数	200株
スタジオアリス	3,000	2,022.00	6,066,000	貸付株式数	1,200株
クロスキャット	1,700	1,482.00	2,519,400	貸付株式数	600株
シミックホールディングス	3,600	1,546.00	5,565,600		
エプコ	1,500	809.00	1,213,500	貸付株式数	500株
システナ	96,000	472.00	45,312,000		
ＮＪＳ	1,300	1,943.00	2,525,900		
デジタルアーツ	3,500	9,430.00	33,005,000	貸付株式数	500株
日鉄ソリューションズ	9,700	3,440.00	33,368,000		
綜合警備保障	25,500	4,840.00	123,420,000		
キューブシステム	3,100	898.00	2,783,800		
いちご	74,300	284.00	21,101,200	貸付株式数	4,800株
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	900	1,396.00	1,256,400	貸付株式数	300株
日本駐車場開発	73,500	136.00	9,996,000		
コア	2,600	1,530.00	3,978,000		
カカクコム	47,800	3,175.00	151,765,000		
アイロムグループ	2,400	1,709.00	4,101,600	貸付株式数	100株
セントケア・ホールディング	4,300	744.00	3,199,200	貸付株式数	800株
サイネックス	1,300	625.00	812,500	貸付株式数	200株
ルネサンス	4,700	1,129.00	5,306,300	貸付株式数	1,500株
ディップ	11,400	3,980.00	45,372,000	貸付株式数	4,500株
ＳＢＳホールディングス	5,400	3,465.00	18,711,000		
デジタルホールディングス	4,900	1,390.00	6,811,000	貸付株式数	1,100株
新日本科学	8,100	1,615.00	13,081,500		
キャリアデザインセンター	1,600	965.00	1,544,000		
ベネフィット・ワン	23,500	5,320.00	125,020,000		

エムスリー	113,600	6,119.00	695,118,400		
ツカダ・グローバルＨＯＬＤ	4,900	283.00	1,386,700	貸付株式数	1,600株
ブラス	1,400	642.00	898,800	貸付株式数	300株
アウトソーシング	37,400	1,504.00	56,249,600	貸付株式数	14,000株
ウェルネット	6,300	449.00	2,828,700	貸付株式数	1,900株
ワールドホールディングス	2,600	2,529.00	6,575,400		
ディー・エヌ・エー	24,600	1,680.00	41,328,000		
博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ	89,300	1,693.00	151,184,900		
ぐるなび	10,700	469.00	5,018,300	貸付株式数	900株
タカミヤ	7,500	430.00	3,225,000		
ジャパンベストレスキューＳ	5,000	955.00	4,775,000		
ファンコミュニケーションズ	16,400	404.00	6,625,600	貸付株式数	6,300株
ライク	1,900	1,645.00	3,125,500		
ビジネス・ブレークスルー	2,600	412.00	1,071,200	貸付株式数	1,000株
エスプール	19,100	1,275.00	24,352,500		
ＷＤＢホールディングス	2,900	3,125.00	9,062,500	貸付株式数	800株
手間いらず	1,000	5,160.00	5,160,000	貸付株式数	300株
ティア	4,200	434.00	1,822,800		
ＣＤＧ	500	1,390.00	695,000	貸付株式数	200株
バリューコマース	5,300	4,520.00	23,956,000		
インフォマート	71,500	1,026.00	73,359,000		
サッポロホールディングス	23,000	2,180.00	50,140,000		
アサヒグループホールディン	159,000	4,194.00	666,846,000		
キリンＨＤ	248,500	1,817.00	451,524,500		
宝ホールディングス	46,000	1,220.00	56,120,000		
オエノンホールディングス	19,900	356.00	7,084,400	貸付株式数	7,700株
養　命　酒	2,100	1,770.00	3,717,000		
コカ・コーラボトラーズＪＨＤ	47,400	1,265.00	59,961,000		
サントリー食品インター	45,200	4,005.00	181,026,000		
ダイドーグループＨＤ	3,500	4,910.00	17,185,000	貸付株式数	1,500株
伊　藤　園	20,500	6,670.00	136,735,000	貸付株式数	500株
キーコーヒー	6,900	1,941.00	13,392,900		
ユニカフェ	2,000	1,012.00	2,024,000	貸付株式数	800株
ジャパンフーズ	900	1,214.00	1,092,600	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	8,500	2,778.00	23,613,000		

不二製油グループ	14,600	2,236.00	32,645,600	貸付株式数	3,200株
かどや製油	800	4,040.00	3,232,000	貸付株式数	200株
Ｊ－オイルミルズ	6,300	1,651.00	10,401,300	貸付株式数	1,400株
ローソン	14,600	5,540.00	80,884,000	貸付株式数	3,400株
サンエー	5,000	3,990.00	19,950,000	貸付株式数	2,000株
カワチ薬品	5,100	2,159.00	11,010,900	貸付株式数	2,000株
エービーシー・マート	10,300	5,340.00	55,002,000	貸付株式数	4,100株
ハードオフコーポレーション	3,000	699.00	2,097,000		
高千穂交易	2,500	1,246.00	3,115,000	貸付株式数	1,000株
アスクル	11,200	1,419.00	15,892,800	貸付株式数	4,200株
ゲオホールディングス	8,900	1,189.00	10,582,100	貸付株式数	1,900株
アダストリア	7,200	1,863.00	13,413,600	貸付株式数	3,600株
ジーフット	4,100	384.00	1,574,400	貸付株式数	1,600株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,000	380.00	380,000	貸付株式数	400株
オルバヘルスケアＨＬＤＧＳ	1,000	1,495.00	1,495,000		
伊藤忠食品	1,600	4,905.00	7,848,000		
くら寿司	7,100	3,740.00	26,554,000	貸付株式数	2,800株
キャンドゥ	1,800	2,315.00	4,167,000	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,800	1,009.00	5,852,200		
パルグループＨＬＤＧＳ	5,900	1,546.00	9,121,400		
ＪＡＬＵＸ	1,700	2,552.00	4,338,400	貸付株式数	700株
エディオン	30,400	999.00	30,369,600	貸付株式数	12,100株
あらた	5,300	3,850.00	20,405,000	貸付株式数	2,000株
サーラコーポレーション	13,600	569.00	7,738,400	貸付株式数	5,400株
ワッツ	3,300	740.00	2,442,000	貸付株式数	1,200株
トーメンデバイス	1,000	6,720.00	6,720,000	貸付株式数	300株
ハローズ	3,000	2,647.00	7,941,000	貸付株式数	1,200株
ＪＰホールディングス	17,600	245.00	4,312,000	貸付株式数	7,200株
フジオフードＧ本社	5,700	1,344.00	7,660,800	貸付株式数	2,200株 (100株)
あみやき亭	1,600	2,870.00	4,592,000	貸付株式数	500株
東京エレクトロンデバイス	2,000	6,770.00	13,540,000	貸付株式数	300株
ひらまつ	14,200	194.00	2,754,800	貸付株式数	100株
フィールズ	5,900	532.00	3,138,800		
双日	74,200	1,606.00	119,165,200		
アルフレッサホールディングス	73,800	1,538.00	113,504,400		

大黒天物産	2,100	6,120.00	12,852,000	貸付株式数	800株
ハニーズホールディングス	5,300	1,000.00	5,300,000		
ファーマライズＨＤ	1,900	751.00	1,426,900	貸付株式数	600株
キッコーマン	48,600	8,660.00	420,876,000		
味　の　素	149,200	3,407.00	508,324,400		
キユーピー	35,500	2,309.00	81,969,500		
ハウス食品Ｇ本社	25,300	2,789.00	70,561,700	貸付株式数	300株
カ　ゴ　メ	25,700	2,765.00	71,060,500		
焼津水産化工	3,400	931.00	3,165,400	貸付株式数	700株
アリアケジャパン	6,200	6,400.00	39,680,000		
ピエトロ	900	1,770.00	1,593,000	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,500	2,307.00	3,460,500		
やまみ	800	1,767.00	1,413,600		
ニチレイ	32,200	2,601.00	83,752,200		
横浜冷凍	18,200	803.00	14,614,600	貸付株式数	6,900株
東洋水産	32,500	4,600.00	149,500,000	貸付株式数	3,500株
イートアンドＨＬＤＧＳ	2,600	2,079.00	5,405,400	貸付株式数	1,000株
大冷	800	1,910.00	1,528,000	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ	3,600	627.00	2,257,200	貸付株式数	1,400株
日清食品ＨＤ	26,500	8,340.00	221,010,000		
永谷園ホールディングス	3,000	1,933.00	5,799,000		
一正蒲鉾	2,800	853.00	2,388,400		
フジッコ	7,500	1,808.00	13,560,000		
ロックフィールド	7,500	1,438.00	10,785,000	貸付株式数	2,800株
日本たばこ産業	362,200	2,273.50	823,461,700		
ケンコーマヨネーズ	3,900	1,271.00	4,956,900	貸付株式数	1,500株
わらべや日洋ＨＤ	4,500	1,842.00	8,289,000	貸付株式数	1,700株
なとり	3,800	1,901.00	7,223,800	貸付株式数	1,500株
イフジ産業	1,500	927.00	1,390,500	貸付株式数	300株
ピックルスコーポレーション	3,400	1,765.00	6,001,000	貸付株式数	1,200株
北の達人コーポ	24,000	356.00	8,544,000	貸付株式数	9,400株 (2,500株)
ユーグレナ	35,300	795.00	28,063,500	貸付株式数	13,600株
スター・マイカ・ＨＬＤＧＳ	3,500	1,239.00	4,336,500	貸付株式数	100株
ＡＤワークスグループ	13,100	157.00	2,056,700	貸付株式数	5,200株
片倉工業	8,800	2,191.00	19,280,800	貸付株式数	1,200株
グ　ン　ゼ	4,700	3,945.00	18,541,500	貸付株式数	600株

ヒューリック	157,900	1,076.00	169,900,400	貸付株式数	54,800株
神　栄	1,200	821.00	985,200		
ラサ商事	4,400	857.00	3,770,800		
アルペン	5,300	2,174.00	11,522,200	貸付株式数	2,000株
ハブ	2,200	660.00	1,452,000	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	4,700	1,533.00	7,205,100	貸付株式数	1,800株
クオールホールディングス	8,200	1,381.00	11,324,200	貸付株式数	1,200株
アルコニックス	7,500	1,175.00	8,812,500		
神戸物産	51,600	4,280.00	220,848,000	貸付株式数	20,500株
ソリトンシステムズ	3,600	1,197.00	4,309,200		
ジンズホールディングス	4,500	6,450.00	29,025,000	貸付株式数	1,700株
ビックカメラ	39,300	937.00	36,824,100	貸付株式数	15,700株 (300株)
ＤＣＭホールディングス	40,900	1,051.00	42,985,900		
ペッパーフードサービス	9,200	391.00	3,597,200	貸付株式数	3,600株 (300株)
ハイパー	1,700	549.00	933,300	貸付株式数	600株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	84,200	2,256.00	189,955,200		
東京一番フーズ	1,700	585.00	994,500	貸付株式数	600株
ＤＤホールディングス	3,500	459.00	1,606,500	貸付株式数	1,400株
あい　ホールディングス	9,500	1,938.00	18,411,000		
ディーブイエックス	2,100	1,005.00	2,110,500	貸付株式数	800株
きちりホールディングス	1,400	463.00	648,200	貸付株式数	500株
アークランドサービスＨＤ	5,500	2,254.00	12,397,000	貸付株式数	2,000株
Ｊ．　フロント　リテイリング	79,400	932.00	74,000,800		
ドトール・日レスＨＤ	11,400	1,517.00	17,293,800	貸付株式数	4,500株
マツキヨココカラ＆カンパニー	40,800	4,450.00	181,560,000		
ブロンコビリー	3,800	2,278.00	8,656,400	貸付株式数	1,500株
ＺＯＺＯ	45,600	3,615.00	164,844,000		
トレジャー・ファクトリー	2,100	871.00	1,829,100		
物語コーポレーション	3,500	7,250.00	25,375,000	貸付株式数	1,400株
三越伊勢丹ＨＤ	116,500	776.00	90,404,000		
東洋紡	27,200	1,195.00	32,504,000		
ユニチカ	18,500	289.00	5,346,500		
富士紡ホールディングス	2,900	3,765.00	10,918,500	貸付株式数	400株
日清紡ホールディングス	40,900	819.00	33,497,100		
倉敷紡績	5,600	1,822.00	10,203,200	貸付株式数	400株
ダイワボウＨＤ	32,200	1,809.00	58,249,800		

シキボウ	3,100	894.00	2,771,400	貸付株式数	400株
日東紡績	10,300	2,666.00	27,459,800		
トヨタ紡織	27,200	2,239.00	60,900,800		
マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ	16,000	2,558.00	40,928,000	貸付株式数	1,400株
Ｈａｍｅｅ	1,900	1,109.00	2,107,100	貸付株式数	900株
ラクト・ジャパン	3,000	2,336.00	7,008,000	貸付株式数	100株
ウエルシアＨＤ	35,200	4,025.00	141,680,000		
クリエイトＳＤＨ	9,800	3,120.00	30,576,000	貸付株式数	3,700株
バイタルＫＳＫＨＤ	11,800	765.00	9,027,000		
八洲電機	4,600	900.00	4,140,000	貸付株式数	1,800株
メディアスホールディングス	3,900	903.00	3,521,700	貸付株式数	1,400株
レスターホールディングス	6,100	1,852.00	11,297,200	貸付株式数	1,000株
ジューテックＨＤ	1,600	1,033.00	1,652,800	貸付株式数	500株
丸善ＣＨＩ　ＨＤ	7,700	362.00	2,787,400	貸付株式数	2,500株
大光	2,500	689.00	1,722,500	貸付株式数	1,100株
ＯＣＨＩホールディングス	2,000	1,256.00	2,512,000	貸付株式数	700株
ＴＯＫＡＩホールディングス	31,500	826.00	26,019,000		
黒谷	1,500	588.00	882,000	貸付株式数	700株
ミサワ	1,900	653.00	1,240,700	貸付株式数	500株
ティーライフ	1,400	1,310.00	1,834,000	貸付株式数	300株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	500	721.00	360,500	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,700	441.00	749,700	貸付株式数	400株
三洋貿易	7,700	969.00	7,461,300		
チムニー	2,000	1,229.00	2,458,000	貸付株式数	800株
シュッピン	5,500	973.00	5,351,500	貸付株式数	2,200株
ビューティガレージ	1,100	3,735.00	4,108,500	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	9,500	3,340.00	31,730,000	貸付株式数	2,500株
ウイン・パートナーズ	4,600	940.00	4,324,000		
ネクステージ	13,700	2,290.00	31,373,000		
ジョイフル本田	19,400	1,560.00	30,264,000	貸付株式数	7,300株
鳥貴族ホールディングス	2,600	1,655.00	4,303,000	貸付株式数	900株
ホットランド	4,900	1,300.00	6,370,000	貸付株式数	1,900株 (200株)
すかいらーくＨＤ	92,600	1,469.00	136,029,400	貸付株式数	34,200株
ＳＦＰホールディングス	3,300	1,301.00	4,293,300	貸付株式数	1,300株
綿半ホールディングス	5,000	1,215.00	6,075,000	貸付株式数	1,400株

日本毛織	20,200	841.00	16,988,200	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	12,100	100.00	1,210,000	貸付株式数	4,400株
トーア紡コーポレーション	2,300	427.00	982,100	貸付株式数	300株
ダイドーリミテツド	7,600	160.00	1,216,000	貸付株式数	3,000株
ヨシックスホールディングス	1,300	1,972.00	2,563,600	貸付株式数	500株
ユナイテッド・スーパーマーケ	19,000	1,000.00	19,000,000	貸付株式数	7,600株
三栄建築設計	2,500	1,621.00	4,052,500		
野村不動産ＨＬＤＧＳ	33,900	2,465.00	83,563,500		
三重交通グループＨＤ	13,000	456.00	5,928,000	貸付株式数	5,100株
サムティ	10,400	2,286.00	23,774,400	貸付株式数	4,100株
日本商業開発	4,600	1,691.00	7,778,600	貸付株式数	1,700株
プレサンスコーポレーション	8,500	1,714.00	14,569,000	貸付株式数	4,300株
フィル・カンパニー	1,200	2,192.00	2,630,400	貸付株式数	400株
ハウスコム	700	1,255.00	878,500		
日本管理センター	3,700	1,022.00	3,781,400		
サンセイランディック	1,000	778.00	778,000	貸付株式数	700株
エストラスト	1,100	613.00	674,300		
フージャースＨＤ	7,300	630.00	4,599,000	貸付株式数	3,600株
オープンハウス	21,200	6,440.00	136,528,000		
東急不動産ＨＤ	194,500	586.00	113,977,000		
飯田ＧＨＤ	55,300	2,348.00	129,844,400		
イーグランド	800	1,558.00	1,246,400		
帝国繊維	7,600	1,973.00	14,994,800	貸付株式数	2,900株
日本コークス工業	58,300	122.00	7,112,600		
ゴルフダイジェスト・オン	3,900	1,009.00	3,935,100	貸付株式数	1,400株
ミタチ産業	1,100	890.00	979,000	貸付株式数	600株
ＢＥＥＮＯＳ	3,600	2,732.00	9,835,200		
あさひ	5,600	1,284.00	7,190,400	貸付株式数	2,100株
日本調剤	4,200	1,267.00	5,321,400	貸付株式数	1,500株
コスモス薬品	6,700	17,610.00	117,987,000	貸付株式数	2,600株
シップヘルスケアＨＤ	21,200	2,530.00	53,636,000	貸付株式数	3,200株
トーエル	3,100	774.00	2,399,400	貸付株式数	1,200株
ソフトクリエイトＨＤ	2,900	4,385.00	12,716,500		
オンリー	1,100	759.00	834,900		
セブン&アイ・ＨＬＤＧＳ	259,400	4,554.00	1,181,307,600		
クリエイト・レストランツ・ホール	31,700	680.00	21,556,000	貸付株式数	14,200株

明治電機工業	1,700	1,226.00	2,084,200	貸付株式数	300株
ツルハホールディングス	14,500	12,800.00	185,600,000		
デリカフーズＨＬＤＧＳ	2,800	591.00	1,654,800	貸付株式数	1,100株
スターティアホールディングス	1,600	1,134.00	1,814,400	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,200	1,408.00	7,321,600	貸付株式数	300株
フェリシモ	1,600	1,321.00	2,113,600	貸付株式数	500株
トリドールホールディングス	16,600	2,421.00	40,188,600	貸付株式数	6,400株
帝　人	61,900	1,301.00	80,531,900		
東　レ	477,800	660.80	315,730,240		
ク　ラ　レ	96,300	944.00	90,907,200		
旭　化　成	436,700	1,071.50	467,924,050		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	6,900	669.00	4,616,100	貸付株式数	2,400株
稲葉製作所	3,700	1,308.00	4,839,600	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングＧ	2,000	2,906.00	5,812,000	貸付株式数	200株
トーカロ	16,800	1,484.00	24,931,200		
アルファＣＯ	2,500	1,070.00	2,675,000	貸付株式数	1,000株
ＳＵＭＣＯ	102,400	2,488.00	254,771,200	貸付株式数	33,200株
川田テクノロジーズ	1,400	3,695.00	5,173,000	貸付株式数	100株
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	2,200	6,440.00	14,168,000	貸付株式数	600株
信和	5,600	748.00	4,188,800		
ビーロット	3,900	503.00	1,961,700	貸付株式数	1,500株
ファーストブラザーズ	1,500	923.00	1,384,500	貸付株式数	600株 (200株)
ハウスドゥ	2,900	905.00	2,624,500	貸付株式数	600株
シーアールイー	1,900	1,673.00	3,178,700	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	700	1,740.00	1,218,000	貸付株式数	400株
ケイアイスター不動産	3,000	8,530.00	25,590,000		
アグレ都市デザイン	900	1,698.00	1,528,200	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,400	2,734.00	3,827,600	貸付株式数	500株
テンポイノベーション	1,600	831.00	1,329,600	貸付株式数	600株
グロバルリンクマネジメント	800	932.00	745,600	貸付株式数	400株
住江織物	1,300	1,534.00	1,994,200		
日本フエルト	4,100	431.00	1,767,100		
イチカワ	800	1,355.00	1,084,000		

エコナックホールディングス	13,500	94.00	1,269,000		
日東製網	900	1,451.00	1,305,900	貸付株式数	200株
芦森工業	1,200	904.00	1,084,800		
アツギ	5,200	666.00	3,463,200		
ウイルプラスＨＬＤＧＳ	1,000	883.00	883,000	貸付株式数	400株
ＪＭホールディングス	4,900	1,722.00	8,437,800		
コメダホールディングス	14,600	1,944.00	28,382,400	貸付株式数	5,700株
サツドラホールディングス	3,000	680.00	2,040,000		
アレンザホールディングス	5,100	1,021.00	5,207,100	貸付株式数	2,000株
串カツ田中ＨＬＤＧＳ	1,800	1,933.00	3,479,400		
バロックジャパン	4,900	824.00	4,037,600	貸付株式数	1,800株
クスリのアオキＨＬＤＧＳ	6,600	7,190.00	47,454,000		
ダイニック	2,500	685.00	1,712,500		
共和レザー	3,800	605.00	2,299,000		
ピーバンドットコム	1,200	586.00	703,200	貸付株式数	300株
力の源ＨＤ	3,300	596.00	1,966,800	貸付株式数	1,300株
ＦＯＯＤ＆ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮ	38,900	4,825.00	187,692,500		
アセンテック	2,200	1,167.00	2,567,400	貸付株式数	600株
セーレン	13,400	2,273.00	30,458,200	貸付株式数	6,400株
ソトー	1,800	825.00	1,485,000	貸付株式数	400株
東海染工	800	1,129.00	903,200	貸付株式数	100株
小松マテーレ	10,900	1,177.00	12,829,300		
ワコールホールディングス	16,500	2,013.00	33,214,500		
ホギメディカル	8,800	3,000.00	26,400,000	貸付株式数	800株
クラウディアＨＬＤＧＳ	1,000	240.00	240,000	貸付株式数	600株
ＴＳＩホールディングス	22,100	345.00	7,624,500	貸付株式数	7,700株
マツオカコーポレーション	2,100	1,217.00	2,555,700	貸付株式数	800株
ワールド	8,600	1,189.00	10,225,400		
ＴＩＳ	62,800	3,510.00	220,428,000		
ＪＮＳホールディングス	2,900	526.00	1,525,400	貸付株式数	1,300株
グリー	42,600	998.00	42,514,800		
コーエーテクモＨＤ	21,100	4,755.00	100,330,500		
三菱総合研究所	2,700	3,710.00	10,017,000		
ボルテージ	2,000	344.00	688,000	貸付株式数	900株
電算	800	2,355.00	1,884,000	貸付株式数	100株
ＡＧＳ	3,100	821.00	2,545,100	貸付株式数	200株
ファインデックス	6,100	1,014.00	6,185,400	貸付株式数	1,600株
ブレインパッド	1,700	5,640.00	9,588,000	貸付株式数	200株

ＫＬａｂ	12,100	556.00	6,727,600	貸付株式数	4,800株
ポールトゥウィン・ピットクル	9,400	964.00	9,061,600		
イーブックイニシアティブ	300	4,720.00	1,416,000		
ネクソン	148,800	2,254.00	335,395,200		
アイスタイル	21,600	275.00	5,940,000	貸付株式数	8,000株
エムアップホールディングス	2,000	4,300.00	8,600,000		
エイチーム	4,600	1,058.00	4,866,800	貸付株式数	1,700株
エニグモ	7,200	975.00	7,020,000		
テクノスジャパン	5,300	520.00	2,756,000		
ｅｎｉｓｈ	4,100	366.00	1,500,600	貸付株式数	1,600株
コロプラ	21,700	693.00	15,038,100		
オルトプラス	5,100	333.00	1,698,300	貸付株式数	2,000株
ブロードリーフ	33,800	480.00	16,224,000	貸付株式数	13,200株
クロス・マーケティングＧ	3,300	1,105.00	3,646,500	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツＨＬＤＧＳ	3,000	2,478.00	7,434,000		
システム情報	5,400	880.00	4,752,000	貸付株式数	1,900株
メディアドゥ	2,400	4,575.00	10,980,000	貸付株式数	900株
じげん	18,300	309.00	5,654,700		
ブイキューブ	7,000	1,135.00	7,945,000	貸付株式数	2,600株
エンカレッジ・テクノロジ	1,100	611.00	672,100	貸付株式数	400株
サイバーリンクス	2,600	1,047.00	2,722,200		
ディー・エル・イー	4,300	296.00	1,272,800		
フィックスターズ	7,100	831.00	5,900,100	貸付株式数	2,800株
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,700	2,130.00	5,751,000	貸付株式数	1,200株
オプティム	4,600	1,437.00	6,610,200	貸付株式数	1,800株
セレス	2,600	2,252.00	5,855,200	貸付株式数	900株
ＳＨＩＦＴ	3,400	25,320.00	86,088,000		
特種東海製紙	4,000	4,025.00	16,100,000		
ティーガイア	5,900	1,616.00	9,534,400	貸付株式数	1,400株
セック	800	2,262.00	1,809,600	貸付株式数	300株
テクマトリックス	11,100	1,955.00	21,700,500	貸付株式数	4,000株
プロシップ	2,200	1,537.00	3,381,400		
ガンホー・オンライン・エンター	17,900	3,040.00	54,416,000		
GMOペイメントゲートウェイ	12,900	15,230.00	196,467,000		
ザッパラス	4,100	533.00	2,185,300		

システムリサーチ	2,100	1,826.00	3,834,600	貸付株式数	600株
インターネットイニシアティブ	18,000	4,860.00	87,480,000		
さくらインターネット	7,800	531.00	4,141,800	貸付株式数	2,700株
ヴィンクス	1,700	824.00	1,400,800	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインHD	1,500	3,995.00	5,992,500	貸付株式数	500株 (400株)
ＳＲＡホールディングス	3,000	2,758.00	8,274,000		
システムインテグレータ	1,800	544.00	979,200	貸付株式数	700株
朝日ネット	6,200	602.00	3,732,400		
ｅＢＡＳＥ	8,600	644.00	5,538,400	貸付株式数	3,100株
アバント	7,700	1,341.00	10,325,700		
アドソル日進	2,700	1,708.00	4,611,600	貸付株式数	900株
フリービット	4,000	1,220.00	4,880,000	貸付株式数	100株 (100株)
コムチュア	7,400	3,535.00	26,159,000		
サイバーコム	800	1,160.00	928,000	貸付株式数	400株
アステリア	4,700	803.00	3,774,100	貸付株式数	1,900株
アイル	3,600	1,551.00	5,583,600		
王子ホールディングス	275,000	525.00	144,375,000		
日本製紙	30,900	1,066.00	32,939,400	貸付株式数	10,400株
三菱製紙	7,800	313.00	2,441,400		
北越コーポレーション	42,700	780.00	33,306,000		
中越パルプ	2,300	970.00	2,231,000		
巴川製紙	2,100	845.00	1,774,500	貸付株式数	200株
大王製紙	31,800	1,799.00	57,208,200		
阿波製紙	1,200	366.00	439,200		
マークラインズ	3,600	2,648.00	9,532,800		
メディカル・データ・ビジ	8,900	1,329.00	11,828,100	貸付株式数	3,300株
ｇｕｍｉ	9,500	816.00	7,752,000		
ショーケース	1,900	500.00	950,000	貸付株式数	500株
モバイルファクトリー	2,100	969.00	2,034,900	貸付株式数	600株
テラスカイ	2,500	2,049.00	5,122,500	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメーション	2,800	1,391.00	3,894,800	貸付株式数	1,100株
ＰＣＩホールディングス	2,900	1,140.00	3,306,000	貸付株式数	1,200株
パイプドＨＤ	1,600	2,472.00	3,955,200		
アイビーシー	900	739.00	665,100	貸付株式数	300株
ネオジャパン	1,800	1,303.00	2,345,400	貸付株式数	700株
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,800	3,185.00	5,733,000	貸付株式数	500株

ラクス	22,700	3,070.00	69,689,000		
ランドコンピュータ	1,500	818.00	1,227,000		
ダブルスタンダード	2,000	3,745.00	7,490,000		
オープンドア	3,900	1,827.00	7,125,300	貸付株式数	1,500株
マイネット	2,600	601.00	1,562,600	貸付株式数	1,000株
アカツキ	3,000	2,738.00	8,214,000	貸付株式数	400株
ベネフィットジャパン	700	2,648.00	1,853,600		
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	1,700	2,860.00	4,862,000	貸付株式数	700株
カナミックネットワーク	7,500	491.00	3,682,500	貸付株式数	1,500株
ノムラシステムコーポレーション	3,900	246.00	959,400	貸付株式数	1,400株
レンゴー	61,500	767.00	47,170,500	貸付株式数	3,200株
トーモク	4,100	1,761.00	7,220,100		
ザ・パック	5,100	2,680.00	13,668,000	貸付株式数	1,900株
チェンジ	12,600	2,110.00	26,586,000		
シンクロ・フード	3,700	354.00	1,309,800	貸付株式数	400株
オークネット	3,900	1,686.00	6,575,400	貸付株式数	1,400株
セグエグループ	2,000	735.00	1,470,000		
エイトレッド	900	2,261.00	2,034,900	貸付株式数	500株
マクロミル	13,500	919.00	12,406,500	貸付株式数	1,500株
ビーグリー	1,700	1,785.00	3,034,500		
オロ	2,100	3,400.00	7,140,000	貸付株式数	200株
ユーザーローカル	2,000	1,626.00	3,252,000	貸付株式数	800株
テモナ	2,000	483.00	966,000	貸付株式数	600株
ニーズウェル	1,800	569.00	1,024,200		
マネーフォワード	10,000	7,820.00	78,200,000		
サインポスト	2,100	1,439.00	3,021,900	貸付株式数	800株
昭和電工	57,200	2,502.00	143,114,400		
住友化学	483,500	524.00	253,354,000		
住友精化	2,800	3,020.00	8,456,000	貸付株式数	400株
日産化学	36,000	6,540.00	235,440,000		
ラサ工業	2,200	1,658.00	3,647,600		
クレハ	5,200	7,900.00	41,080,000	貸付株式数	700株
多木化学	2,600	5,450.00	14,170,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,600	1,163.00	5,349,800		
石原産業	10,800	1,166.00	12,592,800	貸付株式数	1,300株
片倉コープアグリ	1,100	1,154.00	1,269,400	貸付株式数	200株
日本曹達	8,300	3,215.00	26,684,500	貸付株式数	900株
東ソー	94,900	1,631.00	154,781,900		

トクヤマ	21,000	1,784.00	37,464,000		
セントラル硝子	11,500	1,944.00	22,356,000	貸付株式数	2,800株
東亞合成	39,000	1,176.00	45,864,000	貸付株式数	2,300株
大阪ソーダ	6,000	2,555.00	15,330,000	貸付株式数	800株
関東電化	14,000	1,008.00	14,112,000	貸付株式数	1,800株
デンカ	24,000	3,345.00	80,280,000		
イビデン	35,400	7,070.00	250,278,000		
信越化学	113,200	19,000.00	2,150,800,000		
日本カーバイド	1,900	1,255.00	2,384,500	貸付株式数	300株
電算システムＨＤ	2,700	2,255.00	6,088,500		
堺　化　学	4,400	2,096.00	9,222,400	貸付株式数	1,700株
第一稀元素化学工	6,000	1,278.00	7,668,000	貸付株式数	800株
エア・ウォーター	62,200	1,677.00	104,309,400	貸付株式数	2,500株
日本酸素ＨＬＤＧＳ	63,300	2,403.00	152,109,900		
日本化学工業	2,000	2,520.00	5,040,000		
東邦アセチレン	1,200	1,194.00	1,432,800	貸付株式数	400株
日本パーカライジング	32,800	1,060.00	34,768,000		
高圧ガス	10,100	736.00	7,433,600		
チタン工業	600	1,676.00	1,005,600	貸付株式数	300株
四国化成	8,400	1,366.00	11,474,400		
戸田工業	1,500	3,440.00	5,160,000		
ステラ　ケミファ	3,200	2,500.00	8,000,000	貸付株式数	1,400株
保土谷化学	2,100	4,625.00	9,712,500		
日本触媒	11,000	5,070.00	55,770,000	貸付株式数	1,300株
大日精化	5,300	2,200.00	11,660,000		
カネカ	17,000	3,700.00	62,900,000		
協和キリン	79,100	3,170.00	250,747,000		
三菱瓦斯化学	61,100	1,889.00	115,417,900	貸付株式数	2,500株
三井化学	59,800	3,045.00	182,091,000		
ＪＳＲ	61,400	4,240.00	260,336,000		
東京応化工業	11,400	7,120.00	81,168,000		
大阪有機化学	6,100	3,650.00	22,265,000		
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	440,000	892.20	392,568,000		
ＫＨネオケム	11,100	3,080.00	34,188,000		
ダイセル	95,000	783.00	74,385,000		
住友ベークライト	10,400	5,310.00	55,224,000		
積水化学	137,800	1,845.00	254,241,000		
日本ゼオン	60,300	1,203.00	72,540,900		
アイカ工業	18,300	3,315.00	60,664,500		
宇部興産	32,100	1,900.00	60,990,000		

積水樹脂	10,200	2,019.00	20,593,800		
タキロンシーアイ	16,400	522.00	8,560,800		
旭有機材	5,000	1,490.00	7,450,000		
ニチバン	3,900	1,747.00	6,813,300	貸付株式数	1,200株
リケンテクノス	16,200	481.00	7,792,200	貸付株式数	700株
大倉工業	3,300	2,052.00	6,771,600	貸付株式数	1,300株
積水化成品	14,700	476.00	6,997,200		
群栄化学	1,400	3,275.00	4,585,000		
タイガース　ポリマー	9,600	427.00	4,099,200		
ミライアル	2,100	1,627.00	3,416,700		
ダイキアクシス	2,600	835.00	2,171,000	貸付株式数	900株
ダイキョーニシカワ	16,500	537.00	8,860,500	貸付株式数	6,200株
竹本容器	2,900	774.00	2,244,600	貸付株式数	900株
森六ホールディングス	3,500	1,710.00	5,985,000		
日本化薬	51,600	1,114.00	57,482,400		
カーリットホールディングス	6,300	653.00	4,113,900		
ソルクシーズ	6,000	463.00	2,778,000		
レッグス	1,300	1,453.00	1,888,900	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	23,800	690.00	16,422,000	貸付株式数	8,000株
フェイス	1,900	633.00	1,202,700	貸付株式数	400株
プロトコーポレーション	7,100	1,271.00	9,024,100	貸付株式数	3,000株
ハイマックス	1,600	1,094.00	1,750,400	貸付株式数	100株
アミューズ	3,600	1,895.00	6,822,000		
野村総合研究所	127,500	4,880.00	622,200,000		
ドリームインキュベータ	1,800	827.00	1,488,600	貸付株式数	700株
サイバネットシステム	5,300	682.00	3,614,600		
クイック	4,300	1,403.00	6,032,900		
ＴＡＣ	4,200	217.00	911,400		
ＣＥホールディングス	3,300	468.00	1,544,400	貸付株式数	1,400株
日本システム技術	1,300	2,819.00	3,664,700		
電通グループ	66,200	3,610.00	238,982,000		
インテージホールディングス	8,800	1,751.00	15,408,800	貸付株式数	3,200株
テイクアンドギヴニーズ	3,100	900.00	2,790,000	貸付株式数	1,000株
東邦システムサイエンス	1,500	991.00	1,486,500	貸付株式数	600株
ぴあ	2,300	3,770.00	8,671,000	貸付株式数	900株
イオンファンタジー	2,500	1,738.00	4,345,000	貸付株式数	900株
ソースネクスト	28,000	185.00	5,180,000	貸付株式数	11,200株
シーティーエス	7,300	779.00	5,686,700	貸付株式数	2,600株

ネクシィーズグループ	2,300	792.00	1,821,600	貸付株式数	800株
インフォコム	7,200	1,909.00	13,744,800		
メディカルシステムネットワーク	6,500	620.00	4,030,000		
日本精化	5,300	2,000.00	10,600,000		
扶桑化学工業	5,900	4,720.00	27,848,000		
トリケミカル	6,800	3,500.00	23,800,000	貸付株式数	2,400株
ＨＥＲＯＺ	1,800	1,440.00	2,592,000	貸付株式数	700株
ラクスル	7,400	6,260.00	46,324,000	貸付株式数	2,800株
ＦＩＧ	6,800	329.00	2,237,200	貸付株式数	2,700株
システムサポート	1,900	1,209.00	2,297,100		
ＡＤＥＫＡ	30,200	2,411.00	72,812,200		
日油	22,500	5,600.00	126,000,000	貸付株式数	1,800株
ミヨシ油脂	2,400	1,267.00	3,040,800	貸付株式数	900株
新日本理化	13,000	244.00	3,172,000	貸付株式数	4,200株
ハリマ化成グループ	4,700	791.00	3,717,700		
イーソル	4,000	666.00	2,664,000	貸付株式数	1,600株
アルテリア・ネットワークス	8,600	1,539.00	13,235,400	貸付株式数	3,100株
東海ソフト	900	1,031.00	927,900	貸付株式数	400株
ヒト・コミュニケーションズＨＤ	1,500	2,416.00	3,624,000	貸付株式数	600株
トビラシステムズ	1,300	925.00	1,202,500	貸付株式数	200株
Ｓａｎｓａｎ	24,000	3,130.00	75,120,000	貸付株式数	500株
花　王	148,900	5,787.00	861,684,300	貸付株式数	47,000株
第一工業製薬	2,400	3,095.00	7,428,000		
石原ケミカル	3,400	1,265.00	4,301,000		
日華化学	2,100	818.00	1,717,800	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	2,250.00	3,150,000	貸付株式数	500株
三洋化成	3,800	5,090.00	19,342,000		
武田薬品	529,200	3,031.00	1,604,005,200		
アステラス製薬	583,800	1,779.50	1,038,872,100		
大日本住友製薬	41,600	1,382.00	57,491,200		
塩野義製薬	84,700	7,923.00	671,078,100		
わかもと製薬	8,500	287.00	2,439,500	貸付株式数	3,100株
日本新薬	17,600	8,400.00	147,840,000	貸付株式数	800株
中外製薬	210,700	3,680.00	775,376,000		
科研製薬	10,600	4,045.00	42,877,000	貸付株式数	500株
エーザイ	80,600	6,873.00	553,963,800		
理研ビタミン	7,100	1,603.00	11,381,300	貸付株式数	800株

ロート製薬	34,600	3,235.00	111,931,000		
小野薬品	154,800	2,505.50	387,851,400		
久光製薬	17,800	3,990.00	71,022,000	貸付株式数	7,700株
有機合成薬品	4,300	266.00	1,143,800	貸付株式数	1,900株
持田製薬	8,600	3,180.00	27,348,000	貸付株式数	1,300株
参天製薬	125,700	1,504.00	189,052,800		
扶桑薬品	2,400	2,369.00	5,685,600		
日本ケミファ	900	2,041.00	1,836,900		
ツムラ	20,900	3,235.00	67,611,500	貸付株式数	2,400株
日医工	21,000	672.00	14,112,000	貸付株式数	8,200株
テ　ル　モ	190,400	4,628.00	881,171,200		
ＨＵグループＨＤ	16,900	2,862.00	48,367,800	貸付株式数	1,800株
キッセイ薬品工業	11,900	2,284.00	27,179,600		
生化学工業	12,000	938.00	11,256,000		
栄研化学	12,000	1,893.00	22,716,000		
日水製薬	2,700	939.00	2,535,300		
鳥居薬品	3,700	2,778.00	10,278,600		
ＪＣＲファーマ	19,300	2,499.00	48,230,700		
東和薬品	9,800	2,626.00	25,734,800		
富士製薬工業	4,500	1,080.00	4,860,000		
ゼリア新薬工業	12,300	1,919.00	23,603,700	貸付株式数	4,900株
第一三共	529,200	2,824.50	1,494,725,400		
キョーリン製薬ＨＤ	13,600	1,688.00	22,956,800	貸付株式数	2,000株
大幸薬品	10,500	808.00	8,484,000	貸付株式数	4,000株
ダイト	4,400	2,841.00	12,500,400		
大塚ホールディングス	140,000	4,146.00	580,440,000		
大正製薬ＨＤ	16,100	5,580.00	89,838,000	貸付株式数	800株
ペプチドリーム	35,400	2,862.00	101,314,800		
大日本塗料	7,800	791.00	6,169,800		
日本ペイントＨＯＬＤ	247,700	1,193.00	295,506,100		
関西ペイント	68,200	2,550.00	173,910,000	貸付株式数	3,100株
神東塗料	5,800	183.00	1,061,400		
中国塗料	16,400	862.00	14,136,800		
日本特殊塗料	4,900	793.00	3,885,700		
藤倉化成	7,500	490.00	3,675,000	貸付株式数	1,000株
太陽ホールディングス	9,800	3,225.00	31,605,000		
ＤＩＣ	27,600	2,845.00	78,522,000		
サカタインクス	13,700	972.00	13,316,400	貸付株式数	3,100株
東洋インキＳＣホールディン	13,500	1,875.00	25,312,500		

Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	4,900	746.00	3,655,400		
アルプス技研	5,500	1,870.00	10,285,000		
サニックス	11,300	246.00	2,779,800	貸付株式数	4,400株
ダイオーズ	800	991.00	792,800	貸付株式数	400株
日本空調サービス	6,300	779.00	4,907,700		
オリエンタルランド	76,100	17,840.00	1,357,624,000		
フォーカスシステムズ	4,200	1,023.00	4,296,600	貸付株式数	1,300株
ダスキン	15,000	2,617.00	39,255,000		
パーク２４	35,800	1,610.00	57,638,000		
明光ネットワークジャパン	8,100	541.00	4,382,100	貸付株式数	3,000株
ファルコホールディングス	2,900	1,693.00	4,909,700	貸付株式数	400株
クレスコ	4,700	1,920.00	9,024,000		
フジ・メディア・ＨＤ	63,700	1,128.00	71,853,600	貸付株式数	7,400株
秀英予備校	2,200	410.00	902,000	貸付株式数	600株
田谷	1,600	530.00	848,000	貸付株式数	600株
ラウンドワン	18,000	1,309.00	23,562,000	貸付株式数	6,100株
リゾートトラスト	29,800	1,860.00	55,428,000	貸付株式数	11,200株
オービック	20,800	20,990.00	436,592,000		
ジャストシステム	9,500	5,190.00	49,305,000		
ＴＤＣソフト	5,900	1,193.00	7,038,700		
Ｚホールディングス	960,600	752.00	722,371,200		
ビー・エム・エル	8,400	3,530.00	29,652,000		
トレンドマイクロ	35,300	6,550.00	231,215,000		
りらいあコミュニケーショ	9,900	1,009.00	9,989,100		
ＩＤホールディングス	3,700	833.00	3,082,100		
リソー教育	29,700	405.00	12,028,500	貸付株式数	5,000株
日本オラクル	13,500	11,160.00	150,660,000		
早稲田アカデミー	3,800	977.00	3,712,600	貸付株式数	400株
アルファシステムズ	1,700	3,810.00	6,477,000	貸付株式数	700株
フューチャー	7,900	4,055.00	32,034,500		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,600	1,497.00	5,389,200	貸付株式数	100株
ＳＢテクノロジー	2,900	2,696.00	7,818,400	貸付株式数	1,000株
トーセ	1,700	713.00	1,212,100	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	71,800	1,666.00	119,618,800		
オービックビジネスＣ	6,500	5,100.00	33,150,000	貸付株式数	2,500株
伊藤忠テクノソリュー	30,500	3,695.00	112,697,500		
アイティフォー	7,500	792.00	5,940,000	貸付株式数	500株
東京個別指導学院	5,900	624.00	3,681,600	貸付株式数	2,200株
東計電算	900	5,150.00	4,635,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	159,100	2,093.00	332,996,300		

楽天グループ	330,500	1,161.00	383,710,500		
エックスネット	900	984.00	885,600	貸付株式数	100株
クリーク・アンド・リバー社	3,500	1,999.00	6,996,500		
テー・オー・ダブリュー	10,800	312.00	3,369,600	貸付株式数	4,200株
大塚商会	35,900	5,190.00	186,321,000	貸付株式数	13,500株
サイボウズ	9,200	2,163.00	19,899,600		
山田コンサルティンググループ	3,200	1,113.00	3,561,600	貸付株式数	600株
セントラルスポーツ	2,500	2,343.00	5,857,500	貸付株式数	900株
パラカ	1,900	1,506.00	2,861,400	貸付株式数	600株
電通国際情報サービス	9,800	3,680.00	36,064,000		
ＡＣＣＥＳＳ	7,300	763.00	5,569,900	貸付株式数	500株
デジタルガレージ	10,900	4,980.00	54,282,000		
イーエムシステムズ	11,700	695.00	8,131,500	貸付株式数	2,800株
ウェザーニューズ	2,000	9,620.00	19,240,000	貸付株式数	700株
ＣＩＪ	4,000	805.00	3,220,000	貸付株式数	1,600株
ビジネスエンジニアリング	800	3,400.00	2,720,000	貸付株式数	300株
日本エンタープライズ	8,400	178.00	1,495,200	貸付株式数	400株
WOWOW	3,300	2,034.00	6,712,200	貸付株式数	1,300株
スカラ	6,500	608.00	3,952,000	貸付株式数	400株
インテリジェント　ウェイブ	3,300	522.00	1,722,600		
フルキャストホールディングス	5,700	2,648.00	15,093,600	貸付株式数	500株
エン・ジャパン	10,400	3,540.00	36,816,000	貸付株式数	1,500株
あすか製薬ＨＤ	7,800	962.00	7,503,600		
サワイグループＨＤ	14,800	4,200.00	62,160,000		
富士フイルムＨＬＤＧＳ	118,300	8,931.00	1,056,537,300		
コニカミノルタ	146,700	469.00	68,802,300		
資　生　堂	125,400	6,503.00	815,476,200		
ライオン	81,300	1,611.00	130,974,300		
高砂香料	4,500	2,750.00	12,375,000		
マンダム	14,500	1,424.00	20,648,000	貸付株式数	5,300株
ミルボン	8,500	5,760.00	48,960,000	貸付株式数	3,200株
ファンケル	27,300	3,425.00	93,502,500		
コーセー	12,800	13,670.00	174,976,000		
コタ	4,700	1,505.00	7,073,500		
シーボン	800	1,686.00	1,348,800	貸付株式数	200株
ポーラ・オルビスＨＤ	28,900	2,022.00	58,435,800		
ノエビアホールディングス	5,700	5,250.00	29,925,000	貸付株式数	2,200株

アジュバンホールディング	1,900	1,090.00	2,071,000	貸付株式数	500株
エステー	4,400	1,537.00	6,762,800		
アグロカネショウ	2,500	1,172.00	2,930,000	貸付株式数	900株
コ　ニ　シ	11,500	1,598.00	18,377,000		
長谷川香料	11,500	2,812.00	32,338,000	貸付株式数	2,400株
星光ＰＭＣ	3,500	691.00	2,418,500		
小林製薬	18,900	8,920.00	168,588,000		
荒川化学工業	5,100	1,129.00	5,757,900	貸付株式数	1,900株
メック	5,200	4,120.00	21,424,000	貸付株式数	1,900株
日本高純度化学	1,700	2,560.00	4,352,000		
タカラバイオ	17,700	2,639.00	46,710,300	貸付株式数	100株
ＪＣＵ	7,500	4,800.00	36,000,000		
新田ゼラチン	4,100	600.00	2,460,000		
ＯＡＴアグリオ	1,300	2,118.00	2,753,400	貸付株式数	500株
デクセリアルズ	17,400	3,345.00	58,203,000	貸付株式数	2,000株
アース製薬	5,600	6,140.00	34,384,000	貸付株式数	2,200株
北興化学	6,400	846.00	5,414,400		
大成ラミック	2,000	2,740.00	5,480,000		
クミアイ化学	27,100	798.00	21,625,800		
日本農薬	12,100	465.00	5,626,500		
富士興産	2,100	1,032.00	2,167,200		
ニチレキ	8,700	1,307.00	11,370,900		
ユシロ化学	3,400	1,038.00	3,529,200	貸付株式数	500株
ビーピー・カストロール	2,400	1,365.00	3,276,000		
富士石油	18,900	242.00	4,573,800		
ＭＯＲＥＳＣＯ	1,800	1,077.00	1,938,600	貸付株式数	700株
出光興産	74,500	2,931.00	218,359,500		
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,010,700	423.40	427,930,380		
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	19,400	2,225.00	43,165,000	貸付株式数	1,100株
インフロニアＨＤ	90,000	939.00	84,510,000		
横浜ゴム	39,200	1,766.00	69,227,200		
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	35,700	1,726.00	61,618,200		
ブリヂストン	193,800	4,605.00	892,449,000		
住友ゴム	60,900	1,139.00	69,365,100		
藤倉コンポジット	6,200	788.00	4,885,600	貸付株式数	2,400株
オカモト	4,500	3,770.00	16,965,000		
アキレス	4,500	1,209.00	5,440,500	貸付株式数	500株
フ　コ　ク	2,700	920.00	2,484,000		

ニッタ	8,200	2,602.00	21,336,400		
クリエートメディック	1,800	976.00	1,756,800		
住友理工	15,500	574.00	8,897,000		
三ツ星ベルト	9,600	1,932.00	18,547,200		
バンドー化学	11,100	850.00	9,435,000	貸付株式数	1,500株
ＡＧＣ	62,000	5,550.00	344,100,000		
日本板硝子	34,200	502.00	17,168,400		
石塚硝子	1,000	1,905.00	1,905,000	貸付株式数	400株
有沢製作所	9,300	925.00	8,602,500	貸付株式数	3,600株
日本山村硝子	2,400	760.00	1,824,000		
日本電気硝子	28,000	2,939.00	82,292,000		
オハラ	2,800	1,363.00	3,816,400	貸付株式数	1,000株 (100株)
住友大阪セメント	13,300	3,450.00	45,885,000		
太平洋セメント	39,100	2,199.00	85,980,900		
リソルホールディングス	800	4,035.00	3,228,000	貸付株式数	200株
日本ヒユーム	6,400	666.00	4,262,400		
日本コンクリート	13,300	252.00	3,351,600	貸付株式数	1,800株
三谷セキサン	3,100	7,080.00	21,948,000	貸付株式数	1,200株
アジアパイルＨＤ	10,300	412.00	4,243,600		
東海カーボン	57,600	1,177.00	67,795,200		
日本カーボン	4,200	4,145.00	17,409,000		
東洋炭素	5,100	3,110.00	15,861,000		
ノリタケ	3,900	4,630.00	18,057,000		
ＴＯＴＯ	48,100	5,030.00	241,943,000		
日本碍子	73,300	1,797.00	131,720,100		
日本特殊陶業	51,500	1,888.00	97,232,000		
ダントーホールディングス	6,200	198.00	1,227,600	貸付株式数	1,800株
ＭＡＲＵＷＡ	2,400	13,400.00	32,160,000		
品川リフラクトリーズ	1,900	3,475.00	6,602,500		
黒崎播磨	1,400	3,900.00	5,460,000		
ヨータイ	5,000	1,211.00	6,055,000	貸付株式数	800株
イソライト	4,300	927.00	3,986,100		
東京窯業	14,700	294.00	4,321,800	貸付株式数	3,000株
ニッカトー	4,300	660.00	2,838,000		
フジミインコーポレーテッド	5,600	7,350.00	41,160,000		
クニミネ工業	3,000	1,014.00	3,042,000		
エーアンドエーマテリアル	900	886.00	797,400	貸付株式数	200株
ニチアス	15,600	2,566.00	40,029,600	貸付株式数	800株

日本製鉄	297,600	1,699.50	505,771,200		
神戸製鋼所	123,700	549.00	67,911,300		
中山製鋼所	9,100	413.00	3,758,300		
合同製鐵	3,500	1,314.00	4,599,000		
ＪＦＥホールディングス	179,700	1,316.00	236,485,200		
東京製鐵	22,400	1,203.00	26,947,200	貸付株式数	4,900株
共英製鋼	7,400	1,251.00	9,257,400	貸付株式数	2,800株
大和工業	12,600	3,485.00	43,911,000	貸付株式数	2,100株
東京鐵鋼	2,700	1,241.00	3,350,700		
大阪製鐵	3,300	1,013.00	3,342,900		
淀川製鋼所	8,400	2,280.00	19,152,000	貸付株式数	400株
丸一鋼管	23,200	2,427.00	56,306,400		
モリ工業	1,900	2,574.00	4,890,600		
大同特殊鋼	11,000	3,930.00	43,230,000		
日本高周波	2,300	349.00	802,700		
日本冶金工	4,600	2,043.00	9,397,800		
山陽特殊製鋼	6,500	1,818.00	11,817,000	貸付株式数	1,700株
愛知製鋼	3,800	2,427.00	9,222,600		
日立金属	71,500	2,102.00	150,293,000		
日本金属	1,700	901.00	1,531,700	貸付株式数	500株
大平洋金属	3,900	2,030.00	7,917,000		
新日本電工	44,300	292.00	12,935,600	貸付株式数	6,900株
栗本鉄工所	2,700	1,473.00	3,977,100		
虹　技	400	998.00	399,200	貸付株式数	200株
日本鋳鉄管	700	1,115.00	780,500		
日本製鋼所	20,300	3,425.00	69,527,500		
三菱製鋼	4,400	970.00	4,268,000	貸付株式数	1,800株
日亜鋼業	7,200	262.00	1,886,400		
日本精線	1,100	4,375.00	4,812,500	貸付株式数	100株
エンビプロＨＤ	2,800	1,897.00	5,311,600	貸付株式数	1,100株
大紀アルミニウム	10,100	1,462.00	14,766,200		
日本軽金属ＨＤ	16,200	1,669.00	27,037,800		
三井金属	18,000	2,930.00	52,740,000		
東邦亜鉛	3,600	2,122.00	7,639,200		
三菱マテリアル	43,900	1,954.00	85,780,600		
住友鉱山	85,000	4,233.00	359,805,000		
ＤＯＷＡホールディングス	18,000	4,220.00	75,960,000		
古河機金	10,300	1,198.00	12,339,400		
エス・サイエンス	23,300	29.00	675,700	貸付株式数	3,100株
大阪チタニウム	7,100	780.00	5,538,000	貸付株式数	2,800株

東邦チタニウム	12,500	948.00	11,850,000	貸付株式数	2,200株
ＵＡＣＪ	10,000	2,295.00	22,950,000		
ＣＫサンエツ	1,400	3,355.00	4,697,000		
古河電工	21,400	2,255.00	48,257,000		
住友電工	248,700	1,489.50	370,438,650		
フジクラ	74,100	573.00	42,459,300		
昭和電線ＨＬＤＧＳ	5,800	1,878.00	10,892,400	貸付株式数	1,000株
東京特殊電線	1,100	2,656.00	2,921,600	貸付株式数	400株
タツタ電線	12,500	461.00	5,762,500		
カナレ電気	800	1,703.00	1,362,400	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	3,700	1,102.00	4,077,400	貸付株式数	1,400株
リョービ	7,800	1,007.00	7,854,600	貸付株式数	3,000株
アーレステイ	6,600	362.00	2,389,200	貸付株式数	1,700株
アサヒＨＤ	26,500	1,914.00	50,721,000		
東洋製罐グループＨＤ	43,500	1,386.00	60,291,000		
ホッカンホールディングス	5,100	1,410.00	7,191,000		
コロナ	3,700	890.00	3,293,000		
横河ブリッジＨＬＤＧＳ	11,600	2,121.00	24,603,600		
駒井ハルテック	1,200	1,720.00	2,064,000	貸付株式数	200株
高田機工	600	2,636.00	1,581,600	貸付株式数	100株
三和ホールディングス	62,800	1,213.00	76,176,400		
文化シヤッター	21,100	1,009.00	21,289,900	貸付株式数	7,700株
三協立山	9,400	684.00	6,429,600		
アルインコ	4,600	934.00	4,296,400	貸付株式数	1,800株
東洋シヤッター	1,600	615.00	984,000		
ＬＩＸＩＬ	104,800	2,789.00	292,287,200		
日本フイルコン	7,900	515.00	4,068,500	貸付株式数	1,600株
ノーリツ	13,600	1,629.00	22,154,400	貸付株式数	400株
長府製作所	6,900	2,001.00	13,806,900	貸付株式数	2,600株
リンナイ	12,600	10,720.00	135,072,000		
ユニプレス	9,600	710.00	6,816,000	貸付株式数	1,600株
ダイニチ工業	3,800	776.00	2,948,800		
日東精工	9,500	593.00	5,633,500		
三洋工業	900	1,851.00	1,665,900	貸付株式数	100株
岡　部	13,100	674.00	8,829,400	貸付株式数	5,100株
ジーテクト	8,000	1,333.00	10,664,000		
東　プ　レ	12,400	1,091.00	13,528,400		
高周波熱錬	11,800	553.00	6,525,400	貸付株式数	4,700株
東京製綱	2,900	760.00	2,204,000		
サンコール	5,400	447.00	2,413,800		

モリテックスチル	5,400	354.00	1,911,600	貸付株式数	2,100株
パイオラックス	9,300	1,610.00	14,973,000		
エイチワン	6,400	621.00	3,974,400		
日本発条	61,500	847.00	52,090,500	貸付株式数	7,600株
中央発條	4,400	838.00	3,687,200		
アドバネクス	1,100	1,119.00	1,230,900	貸付株式数	300株
三浦工業	28,800	3,985.00	114,768,000		
タ　ク　マ	22,900	1,370.00	31,373,000		
テクノプロ・ホールディング	38,600	3,120.00	120,432,000		
アトラグループ	1,900	280.00	532,000	貸付株式数	600株
インターワークス	1,300	417.00	542,100		
アイ・アールジャパンＨＤ	3,000	7,090.00	21,270,000		
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,400	2,574.00	11,325,600		
ファーストロジック	1,500	731.00	1,096,500		
三機サービス	1,300	974.00	1,266,200	貸付株式数	400株
Ｇｕｎｏｓｙ	4,800	546.00	2,620,800		
デザインワン・ジャパン	2,100	193.00	405,300	貸付株式数	700株
イー・ガーディアン	3,200	3,485.00	11,152,000		
リブセンス	4,400	193.00	849,200	貸付株式数	2,400株 (2,400株)
ジャパンマテリアル	19,700	1,552.00	30,574,400		
ベクトル	9,000	1,249.00	11,241,000	貸付株式数	3,600株
ウチヤマホールディングス	3,000	293.00	879,000	貸付株式数	1,200株
チャームケアコーポレーション	5,400	1,482.00	8,002,800	貸付株式数	1,900株
キャリアリンク	2,500	1,264.00	3,160,000	貸付株式数	100株
ＩＢＪ	5,900	1,020.00	6,018,000	貸付株式数	2,000株
アサンテ	2,700	1,689.00	4,560,300	貸付株式数	900株
バリューＨＲ	2,700	2,506.00	6,766,200	貸付株式数	1,000株
M&Aキャピタルパートナー	5,500	5,500.00	30,250,000	貸付株式数	300株
ライドオンエクスプレスＨＤ	2,600	1,713.00	4,453,800		
ＥＲＩホールディングス	1,700	1,386.00	2,356,200	貸付株式数	300株
アビスト	900	2,753.00	2,477,700	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス・ホールディンク	3,900	2,801.00	10,923,900		
ウィルグループ	4,700	1,360.00	6,392,000	貸付株式数	1,600株

エスクローＡＪ	8,300	177.00	1,469,100	貸付株式数	3,800株
リクルートホールディングス	496,200	6,901.00	3,424,276,200		
エラン	9,700	1,239.00	12,018,300		
ツ　ガ　ミ	16,000	1,411.00	22,576,000	貸付株式数	5,700株
オークマ	7,600	4,745.00	36,062,000		
芝浦機械	7,300	3,370.00	24,601,000		
アマダ	104,400	1,063.00	110,977,200		
アイダエンジニア	16,900	922.00	15,581,800		
滝澤鉄工所	1,100	1,116.00	1,227,600		
ＦＵＪＩ	30,500	2,489.00	75,914,500		
牧野フライス	7,100	3,455.00	24,530,500	貸付株式数	700株
オーエスジー	30,500	1,646.00	50,203,000		
ダイジェット	500	1,074.00	537,000		
旭ダイヤモンド	17,000	634.00	10,778,000	貸付株式数	1,600株
ＤＭＧ森精機	39,700	1,774.00	70,427,800		
ソディツク	16,100	767.00	12,348,700		
ディスコ	9,800	32,600.00	319,480,000		
日東工器	4,100	1,740.00	7,134,000		
日進工具	5,100	1,429.00	7,287,900	貸付株式数	600株
パンチ工業	5,800	510.00	2,958,000		
冨士ダイス	2,800	643.00	1,800,400		
土木管理総合試験	2,500	332.00	830,000	貸付株式数	1,000株
ネットマーケティング	4,600	448.00	2,060,800	貸付株式数	1,200株
日本郵政	496,300	856.00	424,832,800		
ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ	9,100	1,255.00	11,420,500	貸付株式数	4,300株
鎌倉新書	7,300	775.00	5,657,500	貸付株式数	2,900株 (1,800株)
ＳＭＮ	2,100	645.00	1,354,500	貸付株式数	500株
一蔵	1,000	391.00	391,000		
グローバルキッズＣＯＭＰ	1,700	759.00	1,290,300	貸付株式数	400株
エアトリ	4,600	3,155.00	14,513,000	貸付株式数	1,500株
アトラエ	4,900	2,481.00	12,156,900		
ストライク	2,600	5,660.00	14,716,000		
ソラスト	16,200	1,234.00	19,990,800		
セラク	2,000	1,758.00	3,516,000	貸付株式数	800株
インソース	6,700	2,453.00	16,435,100	貸付株式数	2,400株
豊田自動織機	54,400	9,320.00	507,008,000		
豊和工業	3,700	776.00	2,871,200		

ＯＫＫ	2,900	742.00	2,151,800		
石川製作所	1,700	1,360.00	2,312,000	貸付株式数	600株
東洋機械金属	3,300	497.00	1,640,100	貸付株式数	700株
津田駒工業	800	655.00	524,000		
エンシュウ	900	628.00	565,200		
島精機製作所	9,500	1,908.00	18,126,000	貸付株式数	3,700株
オプトラン	8,300	2,243.00	18,616,900		
ＮＣホールディングス	2,200	1,388.00	3,053,600	貸付株式数	100株
イワキポンプ	4,000	1,004.00	4,016,000		
フリュー	6,000	1,272.00	7,632,000	貸付株式数	900株
ヤマシンフィルタ	14,800	523.00	7,740,400	貸付株式数	5,700株
日阪製作所	8,100	788.00	6,382,800		
やまびこ	12,600	1,248.00	15,724,800		
平田機工	3,100	5,970.00	18,507,000		
ペガサスミシン製造	6,600	436.00	2,877,600		
マルマエ	2,800	2,993.00	8,380,400	貸付株式数	100株
タツモ	3,100	1,669.00	5,173,900		
ナブテスコ	39,000	3,285.00	128,115,000		
三井海洋開発	7,300	1,398.00	10,205,400		
レオン自動機	6,900	1,309.00	9,032,100	貸付株式数	2,500株
ＳＭＣ	19,800	72,650.00	1,438,470,000		
ホソカワミクロン	4,600	2,842.00	13,073,200		
ユニオンツール	2,600	3,745.00	9,737,000	貸付株式数	900株
オイレス工業	11,600	1,643.00	19,058,800	貸付株式数	3,500株
日精エーエスビー	2,200	2,844.00	6,256,800	貸付株式数	800株
サト－ホールディングス	8,800	2,126.00	18,708,800		
技研製作所	5,900	4,130.00	24,367,000		
日本エアーテック	3,000	1,210.00	3,630,000	貸付株式数	900株
カ　ワ　タ	2,000	857.00	1,714,000		
日精樹脂工業	4,500	980.00	4,410,000	貸付株式数	700株
オカダアイヨン	1,800	1,417.00	2,550,600	貸付株式数	700株
ワイエイシイホールディングス	2,600	927.00	2,410,200		
小松製作所	304,800	2,592.00	790,041,600		
住友重機械	38,500	2,521.00	97,058,500		
日立建機	26,900	3,300.00	88,770,000		
日　工	8,500	610.00	5,185,000	貸付株式数	2,200株
巴工業	3,400	2,288.00	7,779,200	貸付株式数	1,200株
井関農機	6,300	1,409.00	8,876,700		
ＴＯＷＡ	5,800	3,200.00	18,560,000	貸付株式数	800株

丸山製作所	1,200	1,456.00	1,747,200		
北川鉄工所	3,000	1,393.00	4,179,000		
シンニッタン	14,200	213.00	3,024,600		
ローツェ	3,300	11,950.00	39,435,000		
タカキタ	2,300	634.00	1,458,200	貸付株式数	900株
クボタ	328,200	2,369.00	777,505,800		
荏原実業	3,100	2,510.00	7,781,000		
東洋エンジニア	9,100	710.00	6,461,000	貸付株式数	3,100株
三菱化工機	2,100	2,265.00	4,756,500		
月島機械	12,000	1,068.00	12,816,000		
帝国電機製作所	4,500	1,391.00	6,259,500		
東京機械	3,400	1,222.00	4,154,800		
新東工業	13,600	677.00	9,207,200	貸付株式数	1,700株
渋谷工業	5,900	2,858.00	16,862,200		
アイチ　コーポレーション	9,100	779.00	7,088,900	貸付株式数	2,500株
小森コーポレーション	16,800	630.00	10,584,000	貸付株式数	6,700株
鶴見製作所	5,000	1,530.00	7,650,000		
住友精密	900	2,082.00	1,873,800		
日本ギア工業	2,400	274.00	657,600	貸付株式数	900株
酒井重工業	1,100	2,753.00	3,028,300		
荏原製作所	28,000	6,100.00	170,800,000	貸付株式数	11,100株
石井鉄工所	700	2,996.00	2,097,200		
酉島製作所	5,500	863.00	4,746,500	貸付株式数	900株
北越工業	6,000	946.00	5,676,000	貸付株式数	1,000株
ダイキン工業	85,800	23,150.00	1,986,270,000		
オルガノ	1,900	6,820.00	12,958,000	貸付株式数	400株
トーヨーカネツ	2,600	2,494.00	6,484,400		
栗田工業	36,700	5,300.00	194,510,000		
椿本チエイン	9,500	2,875.00	27,312,500	貸付株式数	1,200株
大同工業	2,800	852.00	2,385,600	貸付株式数	400株
日　機　装	21,500	848.00	18,232,000		
木村化工機	6,300	986.00	6,211,800	貸付株式数	2,100株
レイズネクスト	9,800	1,121.00	10,985,800		
アネスト岩田	10,100	854.00	8,625,400	貸付株式数	3,600株
ダイフク	37,000	9,090.00	336,330,000		
サムコ	1,700	2,911.00	4,948,700	貸付株式数	700株
加藤製作所	2,600	765.00	1,989,000	貸付株式数	700株
油研工業	700	1,715.00	1,200,500	貸付株式数	200株
タダノ	34,900	1,008.00	35,179,200		
フジテック	24,800	2,382.00	59,073,600		

ＣＫＤ	20,300	2,223.00	45,126,900		
キトー	5,600	1,754.00	9,822,400		
平和	18,700	1,848.00	34,557,600		
理想科学工業	5,700	2,022.00	11,525,400		
ＳＡＮＫＹＯ	14,500	2,894.00	41,963,000	貸付株式数	6,300株
日本金銭機械	6,600	688.00	4,540,800	貸付株式数	2,600株
マースグループＨＬＤＧＳ	4,200	1,590.00	6,678,000		
フクシマガリレイ	4,700	4,180.00	19,646,000	貸付株式数	300株
オーイズミ	2,300	347.00	798,100	貸付株式数	200株
ダイコク電機	3,100	1,190.00	3,689,000	貸付株式数	1,000株
竹内製作所	10,100	2,718.00	27,451,800	貸付株式数	900株
ア　マ　ノ	17,600	2,491.00	43,841,600	貸付株式数	6,700株
ＪＵＫＩ	9,200	919.00	8,454,800		
サンデンホールディングス	8,900	251.00	2,233,900	貸付株式数	100株
ジャノメ	5,600	622.00	3,483,200	貸付株式数	2,400株
ブラザー工業	82,100	1,954.00	160,423,400		
マックス	8,800	1,795.00	15,796,000	貸付株式数	100株
モリタホールディングス	10,500	1,273.00	13,366,500		
グローリー	17,400	2,075.00	36,105,000	貸付株式数	6,700株
新晃工業	6,500	1,831.00	11,901,500		
大和冷機工業	10,900	1,206.00	13,145,400		
セガサミーホールディングス	66,700	1,845.00	123,061,500		
日本ピストンリング	2,700	1,219.00	3,291,300	貸付株式数	900株
リ　ケ　ン	2,700	2,437.00	6,579,900	貸付株式数	700株
ＴＰＲ	8,800	1,368.00	12,038,400	貸付株式数	3,300株
ツバキ・ナカシマ	15,000	1,370.00	20,550,000		
ホシザキ	19,700	8,620.00	169,814,000		
大豊工業	6,000	728.00	4,368,000		
日本精工	127,500	771.00	98,302,500		
Ｎ　Ｔ　Ｎ	154,300	210.00	32,403,000		
ジェイテクト	66,400	992.00	65,868,800		
不　二　越	6,000	3,860.00	23,160,000		
ミネベアミツミ	116,000	3,000.00	348,000,000		
日本トムソン	21,600	691.00	14,925,600		
Ｔ　Ｈ　Ｋ	40,000	2,711.00	108,440,000		
ユーシン精機	4,600	728.00	3,348,800		
前澤給装工業	5,100	1,001.00	5,105,100		
イーグル工業	8,500	1,025.00	8,712,500		
前澤工業	4,900	580.00	2,842,000		

日本ピラー工業	7,400	3,200.00	23,680,000	貸付株式数	2,600株
キッツ	26,500	701.00	18,576,500	貸付株式数	4,100株
日　立	323,800	6,688.00	2,165,574,400		
東　芝	117,600	4,527.00	532,375,200		
三菱電機	673,700	1,424.50	959,685,650		
富士電機	40,700	5,940.00	241,758,000		
東洋電機製造	3,200	1,050.00	3,360,000		
安川電機	72,400	5,090.00	368,516,000		
シンフォニア　テクノロジー	8,300	1,261.00	10,466,300	貸付株式数	3,000株
明　電　舎	11,600	2,588.00	30,020,800		
オリジン	1,300	1,262.00	1,640,600	貸付株式数	200株
山洋電気	3,000	5,670.00	17,010,000	貸付株式数	400株
デンヨー	6,100	1,657.00	10,107,700		
ベイカレントコンサルティング	4,500	47,300.00	212,850,000		
ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ　ＨＬＤＧＳ	1,200	3,970.00	4,764,000	貸付株式数	400株
アイモバイル	2,600	1,281.00	3,330,600	貸付株式数	700株
キャリアインデックス	2,300	1,073.00	2,467,900	貸付株式数	400株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,000	935.00	2,805,000	貸付株式数	900株
船場	1,200	790.00	948,000		
グレイステクノロジー	8,400	422.00	3,544,800	貸付株式数	3,300株
ジャパンエレベーターＳＨＤ	20,400	2,125.00	43,350,000		
フルテック	1,600	1,410.00	2,256,000	貸付株式数	300株
グリーンズ	2,800	488.00	1,366,400	貸付株式数	900株
ツナググループＨＬＤＧＳ	2,100	289.00	606,900	貸付株式数	600株
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	1,700	504.00	856,800	貸付株式数	100株
ソウルドアウト	1,500	997.00	1,495,500	貸付株式数	600株
ＭＳ＆ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	800	671.00	536,800	貸付株式数	100株
ミダックホールディングス	2,800	4,965.00	13,902,000	貸付株式数	1,100株
日総工産	5,300	808.00	4,282,400	貸付株式数	1,900株
キュービーネットＨＬＤＧＳ	3,100	1,653.00	5,124,300		
ＲＰＡホールディングス	9,000	372.00	3,348,000	貸付株式数	3,600株
三桜工業	9,500	937.00	8,901,500	貸付株式数	3,600株
マキタ	81,900	4,984.00	408,189,600	貸付株式数	3,000株
東芝テック	7,300	4,355.00	31,791,500		

芝浦メカトロニクス	1,200	8,250.00	9,900,000		
マブチモーター	15,700	3,730.00	58,561,000	貸付株式数	6,200株
日本電産	174,500	13,000.00	2,268,500,000		
ユーエムシーエレクトロニクス	2,900	481.00	1,394,900	貸付株式数	600株
トレックス・セミコンダクター	3,400	3,785.00	12,869,000	貸付株式数	300株
東光高岳	4,000	1,304.00	5,216,000	貸付株式数	1,300株
ダブル・スコープ	19,300	829.00	15,999,700	貸付株式数	6,200株
宮越ホールディングス	2,700	1,203.00	3,248,100	貸付株式数	1,000株
ダイヘン	7,500	4,300.00	32,250,000		
ヤーマン	11,500	1,008.00	11,592,000	貸付株式数	4,300株
ＪＶＣケンウッド	54,900	165.00	9,058,500	貸付株式数	5,100株
ミマキエンジニアリング	6,200	882.00	5,468,400		
Ｉ－ＰＥＸ	3,200	1,940.00	6,208,000	貸付株式数	500株
日新電機	16,000	1,417.00	22,672,000		
大崎電気	13,200	441.00	5,821,200	貸付株式数	1,900株
オムロン	56,300	10,965.00	617,329,500		
日東工業	9,500	1,487.00	14,126,500	貸付株式数	1,400株
ＩＤＥＣ	8,200	2,688.00	22,041,600	貸付株式数	1,000株
正興電機製作所	2,300	1,181.00	2,716,300	貸付株式数	800株
不二電機工業	1,000	1,257.00	1,257,000	貸付株式数	400株
ジーエス・ユアサ　コーポ	22,400	2,306.00	51,654,400		
サクサホールディングス	1,500	1,348.00	2,022,000		
メルコホールディングス	1,900	3,900.00	7,410,000	貸付株式数	700株
テクノメディカ	1,400	1,600.00	2,240,000	貸付株式数	500株
ダイヤモンドエレクトリクHD	1,900	1,291.00	2,452,900	貸付株式数	700株
日本電気	85,500	5,120.00	437,760,000		
富　士　通	60,600	18,795.00	1,138,977,000		
沖　電　気	27,400	838.00	22,961,200		
岩崎通信機	2,500	854.00	2,135,000		
電気興業	3,500	2,518.00	8,813,000		
サンケン電気	7,500	5,780.00	43,350,000		
ナカヨ	1,100	1,299.00	1,428,900		
アイホン	3,800	2,087.00	7,930,600		
ルネサスエレクトロニクス	364,400	1,442.00	525,464,800		
セイコーエプソン	83,500	1,830.00	152,805,000		
ワコム	52,200	874.00	45,622,800	貸付株式数	20,800株
アルバック	12,500	6,500.00	81,250,000		

アクセル	2,800	813.00	2,276,400	貸付株式数	1,100株
ＥＩＺＯ	5,200	3,940.00	20,488,000	貸付株式数	700株
ジャパンディスプレイ	61,700	37.00	2,282,900		
日本信号	18,000	861.00	15,498,000		
京三製作所	15,200	431.00	6,551,200		
能美防災	9,300	1,999.00	18,590,700		
ホーチキ	5,400	1,246.00	6,728,400		
星和電機	4,400	498.00	2,191,200		
エレコム	15,600	1,325.00	20,670,000		
パナソニック	718,200	1,242.50	892,363,500		
シャープ	76,800	1,270.00	97,536,000	貸付株式数	28,400株
アンリツ	43,300	1,765.00	76,424,500	貸付株式数	16,100株
富士通ゼネラル	18,300	2,580.00	47,214,000	貸付株式数	3,500株
ソニーグループ ※	421,700	13,825.00	5,830,002,500		
ＴＤＫ	97,500	4,500.00	438,750,000		
帝国通信工業	2,700	1,225.00	3,307,500	貸付株式数	1,000株
タムラ製作所	25,800	689.00	17,776,200	貸付株式数	9,800株
アルプスアルパイン	59,400	1,023.00	60,766,200		
池上通信機	2,000	703.00	1,406,000	貸付株式数	800株
日本電波工業	6,000	1,684.00	10,104,000	貸付株式数	100株
鈴木	2,900	914.00	2,650,600	貸付株式数	1,100株
日本トリム	1,300	3,360.00	4,368,000		
ローランド　ディー.ジー.	4,000	2,584.00	10,336,000	貸付株式数	1,500株
フオスター電機	6,600	703.00	4,639,800		
ＳＭＫ	1,500	2,281.00	3,421,500	貸付株式数	600株
ヨコオ	4,900	2,684.00	13,151,600		
ティアック	11,200	123.00	1,377,600		
ホシデン	15,800	1,174.00	18,549,200	貸付株式数	2,000株
ヒロセ電機	10,400	19,050.00	198,120,000		
日本航空電子	15,800	1,815.00	28,677,000		
ＴＯＡ	7,400	725.00	5,365,000	貸付株式数	1,000株
マクセル	13,400	1,309.00	17,540,600		
古野電気	8,000	1,146.00	9,168,000	貸付株式数	400株
ユニデンホールディングス	1,400	3,350.00	4,690,000		
スミダコーポレーション	6,200	1,122.00	6,956,400		
アイコム	2,400	2,310.00	5,544,000	貸付株式数	400株
リオン	2,600	2,135.00	5,551,000	貸付株式数	400株
本多通信工業	4,700	426.00	2,002,200	貸付株式数	1,700株
横河電機	67,200	2,135.00	143,472,000		

新電元工業	2,700	3,380.00	9,126,000		
アズビル	39,600	5,020.00	198,792,000		
東亜ディーケーケー	2,800	840.00	2,352,000	貸付株式数	1,100株
日本光電工業	27,800	3,345.00	92,991,000		
チ　ノ　ー	1,900	1,431.00	2,718,900	貸付株式数	700株
共和電業	6,600	388.00	2,560,800		
日本電子材料	3,300	2,194.00	7,240,200	貸付株式数	1,200株
堀場製作所	12,400	6,750.00	83,700,000		
アドバンテスト	50,000	9,990.00	499,500,000		
小野測器	2,300	488.00	1,122,400		
エスペック	5,300	2,103.00	11,145,900	貸付株式数	800株
キーエンス ※	61,000	70,330.00	4,290,130,000		
日置電機	3,300	8,860.00	29,238,000	貸付株式数	100株
シスメックス	56,900	14,160.00	805,704,000		
日本マイクロニクス	11,700	1,794.00	20,989,800	貸付株式数	3,400株
メガチップス	6,300	4,755.00	29,956,500	貸付株式数	1,700株
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	2,900	3,320.00	9,628,000	貸付株式数	1,400株
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	5,600	787.00	4,407,200		
澤藤電機	800	1,692.00	1,353,600	貸付株式数	300株
デンソー	148,200	8,331.00	1,234,654,200		
原田工業	2,900	972.00	2,818,800		
コーセル	8,200	898.00	7,363,600		
イリソ電子工業	5,700	4,575.00	26,077,500	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	11,300	1,485.00	16,780,500		
千代田インテグレ	2,700	2,169.00	5,856,300		
アイ・オー・データ	2,400	775.00	1,860,000	貸付株式数	900株
レーザーテック	29,600	29,745.00	880,452,000		
スタンレー電気	46,900	2,952.00	138,448,800		
岩崎電気	2,600	2,246.00	5,839,600		
ウシオ電機	35,000	2,107.00	73,745,000		
岡谷電機	4,600	321.00	1,476,600	貸付株式数	200株
ヘリオステクノＨ	6,200	272.00	1,686,400		
エノモト	1,800	1,695.00	3,051,000		
日本セラミック	6,700	2,862.00	19,175,400	貸付株式数	2,400株
遠藤照明	3,300	1,023.00	3,375,900	貸付株式数	500株
古河電池	4,900	1,463.00	7,168,700	貸付株式数	1,900株
双信電機	3,300	635.00	2,095,500		
山一電機	4,700	2,305.00	10,833,500		
図　研	4,600	3,735.00	17,181,000	貸付株式数	1,700株

日本電子	14,000	9,470.00	132,580,000		
カ　シ　オ	48,800	1,474.00	71,931,200		
ファナック	59,100	22,245.00	1,314,679,500		
日本シイエムケイ	12,800	504.00	6,451,200	貸付株式数	5,500株
エンプラス	1,700	2,521.00	4,285,700	貸付株式数	600株
大真空	10,000	1,570.00	15,700,000		
ロ　ー　ム	30,100	10,630.00	319,963,000		
浜松ホトニクス	48,300	6,980.00	337,134,000		
三井ハイテック	6,700	9,160.00	61,372,000		
新光電気工業	19,700	5,350.00	105,395,000	貸付株式数	100株
京　セ　ラ	94,700	6,731.00	637,425,700		
協栄産業	500	1,491.00	745,500		
太陽誘電	32,600	6,260.00	204,076,000		
村田製作所	197,700	8,380.00	1,656,726,000		
双葉電子工業	10,800	689.00	7,441,200		
日東電工	40,800	7,900.00	322,320,000		
北陸電気工業	2,200	1,266.00	2,785,200		
東海理化電機	17,500	1,484.00	25,970,000		
ニチコン	21,800	1,162.00	25,331,600		
日本ケミコン	6,300	1,801.00	11,346,300	貸付株式数	700株
ＫＯＡ	9,900	1,530.00	15,147,000		
三井Ｅ＆ＳＨＤ	21,700	379.00	8,224,300		
日立造船	56,700	841.00	47,684,700		
三菱重工業	105,800	2,561.00	270,953,800		
川崎重工業	49,000	1,908.00	93,492,000		
ＩＨＩ	41,900	2,141.00	89,707,900		
名村造船所	21,900	201.00	4,401,900	貸付株式数	8,100株
サノヤスホールディングス	9,800	121.00	1,185,800	貸付株式数	1,300株
スプリックス	1,900	1,494.00	2,838,600		
マネジメントソリューションズ	3,400	3,260.00	11,084,000	貸付株式数	1,200株
プロレド・パートナーズ	1,700	1,152.00	1,958,400	貸付株式数	500株
ＡＮＤ　ＦＡＣＴＯＲＹ	1,200	419.00	502,800	貸付株式数	600株
ギークス	1,200	2,011.00	2,413,200		
カーブスホールディングス	18,200	774.00	14,086,800	貸付株式数	6,100株
フォーラムエンジニアリング	4,300	829.00	3,564,700		
日本車輌	2,200	2,008.00	4,417,600		
三菱ロジスネクスト	9,100	1,027.00	9,345,700	貸付株式数	1,900株
近畿車輌	600	996.00	597,600	貸付株式数	200株

一家ホールディングス	1,500	541.00	811,500		
フルサト・マルカＨＤ	6,300	1,999.00	12,593,700	貸付株式数	2,500株
ヤマエグループＨＤ	4,500	1,003.00	4,513,500	貸付株式数	600株
ＦＰＧ	22,700	551.00	12,507,700	貸付株式数	2,900株
島根銀行	2,200	538.00	1,183,600	貸付株式数	300株
じもとホールディングス	5,000	585.00	2,925,000		
全国保証	15,900	4,960.00	78,864,000	貸付株式数	6,400株
めぶきフィナンシャルＧ	344,200	224.00	77,100,800		
東京きらぼしＦＧ	8,800	1,393.00	12,258,400		
九州フィナンシャルＧ	135,700	380.00	51,566,000		
かんぽ生命保険	66,800	1,758.00	117,434,400	貸付株式数	23,900株
ゆうちょ銀行	156,700	928.00	145,417,600	貸付株式数	37,600株
富山第一銀行	16,100	266.00	4,282,600		
コンコルディア・フィナンシャル	379,000	413.00	156,527,000		
ジェイリース	2,500	2,055.00	5,137,500	貸付株式数	500株
西日本フィナンシャルＨＤ	43,300	682.00	29,530,600		
イントラスト	3,100	725.00	2,247,500	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	3,900	1,038.00	4,048,200		
Ｃａｓａ	2,600	878.00	2,282,800	貸付株式数	900株
アルヒ	10,100	1,001.00	10,110,100	貸付株式数	3,800株
プレミアグループ	3,400	3,500.00	11,900,000		
日産自動車	793,500	562.90	446,661,150		
いすゞ自動車	211,000	1,532.00	323,252,000		
トヨタ自動車	3,409,900	2,001.00	6,823,209,900		
日野自動車	84,600	944.00	79,862,400		
三菱自動車工業	250,800	366.00	91,792,800	貸付株式数	19,800株
エフテック	5,300	496.00	2,628,800		
レシップホールディングス	2,900	550.00	1,595,000		
ＧＭＢ	1,600	703.00	1,124,800	貸付株式数	400株
ファルテック	1,000	665.00	665,000		
武蔵精密工業	15,400	1,772.00	27,288,800		
日産車体	9,500	676.00	6,422,000	貸付株式数	3,700株
新明和工業	19,500	845.00	16,477,500		
極東開発工業	12,100	1,402.00	16,964,200		
トピー工業	5,400	1,051.00	5,675,400		
ティラド	2,000	2,855.00	5,710,000	貸付株式数	300株
タチエス	11,600	1,144.00	13,270,400	貸付株式数	3,900株
Ｎ　Ｏ　Ｋ	32,400	1,214.00	39,333,600		
フタバ産業	16,300	385.00	6,275,500		

ＫＹＢ	6,900	2,904.00	20,037,600	貸付株式数	800株
市光工業	9,800	496.00	4,860,800		
大同メタル工業	12,200	568.00	6,929,600	貸付株式数	5,200株
プレス工業	33,300	373.00	12,420,900		
ミクニ	9,000	287.00	2,583,000		
太平洋工業	14,100	1,051.00	14,819,100		
河西工業	7,200	266.00	1,915,200	貸付株式数	1,200株
アイシン	49,200	4,170.00	205,164,000		
マ　ツ　ダ	211,900	918.00	194,524,200		
今仙電機製作所	4,100	551.00	2,259,100	貸付株式数	2,000株
本田技研 ※	529,900	3,101.00	1,643,219,900		
スズキ	153,900	4,585.00	705,631,500		
ＳＵＢＡＲＵ	192,600	2,142.50	412,645,500		
安永	3,200	963.00	3,081,600	貸付株式数	1,200株
ヤマハ発動機	87,800	2,859.00	251,020,200		
小糸製作所	36,900	6,530.00	240,957,000	貸付株式数	2,200株
ＴＢＫ	6,500	393.00	2,554,500	貸付株式数	900株
エクセディ	9,900	1,610.00	15,939,000		
ミツバ	12,700	459.00	5,829,300		
豊田合成	22,000	2,269.00	49,918,000		
愛三工業	10,600	761.00	8,066,600		
盟和産業	400	979.00	391,600	貸付株式数	300株
日本プラスト	4,700	495.00	2,326,500	貸付株式数	600株
ヨ　ロ　ズ	6,000	1,054.00	6,324,000	貸付株式数	2,200株
エフ・シー・シー	10,600	1,436.00	15,221,600		
新家工業	1,600	1,705.00	2,728,000		
シマノ	27,100	31,400.00	850,940,000		
テイ・エス　テック	28,000	1,333.00	37,324,000	貸付株式数	1,900株
３３ＦＧ	6,000	1,355.00	8,130,000		
第四北越フィナンシャルＧ	10,800	2,300.00	24,840,000	貸付株式数	600株
ひろぎんＨＬＤＧＳ	98,700	622.00	61,391,400	貸付株式数	600株
マーキュリアホールディングス	2,200	727.00	1,599,400		
おきなわＦＧ	5,800	2,066.00	11,982,800		
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	5,600	4,190.00	23,464,000		
十六ＦＧ	8,900	1,976.00	17,586,400		
北國ＦＨＤ	6,200	2,114.00	13,106,800		
ジャムコ	3,800	827.00	3,142,600	貸付株式数	1,500株
小　野　建	6,100	1,572.00	9,589,200		
はるやまＨＬＤＧＳ	3,100	558.00	1,729,800		

南　陽	1,200	1,895.00	2,274,000		
ノ　ジ　マ	10,800	2,225.00	24,030,000	貸付株式数	700株
佐鳥電機	4,000	931.00	3,724,000		
カッパ・クリエイト	9,300	1,327.00	12,341,100	貸付株式数	3,700株
エコートレーディング	1,300	591.00	768,300	貸付株式数	400株
伯東	4,400	2,225.00	9,790,000		
コンドーテック	5,300	960.00	5,088,000		
中山福	3,300	358.00	1,181,400	貸付株式数	300株
ライトオン	5,000	695.00	3,475,000	貸付株式数	1,800株
ナガイレーベン	8,900	2,342.00	20,843,800	貸付株式数	2,300株
三菱食品	6,400	2,690.00	17,216,000	貸付株式数	1,400株
良品計画	76,300	1,835.00	140,010,500		
三城ホールディングス	7,900	235.00	1,856,500	貸付株式数	2,800株
松田産業	5,200	2,701.00	14,045,200		
第一興商	12,900	3,580.00	46,182,000	貸付株式数	1,300株
メディパルＨＤ	71,600	2,040.00	146,064,000		
アドヴァングループ	6,800	883.00	6,004,400	貸付株式数	400株
ＳＰＫ	2,500	1,300.00	3,250,000	貸付株式数	300株
萩原電気ＨＬＤＧＳ	2,400	1,992.00	4,780,800		
アルビス	2,100	2,114.00	4,439,400	貸付株式数	700株
アズワン	4,800	14,050.00	67,440,000		
スズデン	2,200	1,623.00	3,570,600		
尾家産業	1,800	1,046.00	1,882,800	貸付株式数	400株
シモジマ	4,200	1,079.00	4,531,800		
ドウシシャ	7,100	1,468.00	10,422,800	貸付株式数	500株
小津産業	1,200	1,901.00	2,281,200		
コナカ	7,800	311.00	2,425,800		
高速	3,900	1,473.00	5,744,700		
ハウス　ローゼ	800	1,661.00	1,328,800		
Ｇ－７ホールディングス	7,800	1,654.00	12,901,200		
たけびし	3,000	1,387.00	4,161,000		
イオン北海道	11,600	1,334.00	15,474,400	貸付株式数	4,600株
コ　ジ　マ	12,300	556.00	6,838,800	貸付株式数	4,400株
ヒマラヤ	2,200	914.00	2,010,800		
コーナン商事	9,600	3,320.00	31,872,000		
ネットワンシステムズ	25,200	3,410.00	85,932,000	貸付株式数	2,700株
エコス	2,500	1,748.00	4,370,000	貸付株式数	900株
ワタミ	8,200	850.00	6,970,000	貸付株式数	3,400株
マルシェ	1,500	402.00	603,000	貸付株式数	600株
リックス	3,400	1,443.00	4,906,200		

システムソフト	18,400	118.00	2,171,200	貸付株式数	2,700株
パンパシフィックＨＤ	132,600	1,936.00	256,713,600		
丸文	5,600	856.00	4,793,600		
西松屋チェーン	14,900	1,497.00	22,305,300	貸付株式数	5,800株
ゼンショーホールディングス	32,400	2,581.00	83,624,400	貸付株式数	300株
ハピネット	6,000	1,429.00	8,574,000	貸付株式数	100株
幸楽苑ホールディングス	4,200	1,413.00	5,934,600	貸付株式数	1,600株
ハークスレイ	3,200	448.00	1,433,600		
橋本総業ＨＬＤＧＳ	1,400	1,910.00	2,674,000	貸付株式数	500株
日本ライフライン	19,500	1,058.00	20,631,000	貸付株式数	1,100株
サイゼリヤ	10,200	2,926.00	29,845,200	貸付株式数	3,700株
タカショー	5,100	715.00	3,646,500	貸付株式数	2,000株
ＶＴホールディングス	25,200	421.00	10,609,200	貸付株式数	9,500株
アルゴグラフィックス	5,300	2,841.00	15,057,300		
魚力	1,900	1,952.00	3,708,800	貸付株式数	700株
ＩＤＯＭ	20,100	689.00	13,848,900	貸付株式数	3,300株
日本エム・ディ・エム	3,900	1,936.00	7,550,400		
ポプラ	1,800	174.00	313,200	貸付株式数	600株
フジ・コーポレーション	3,600	1,164.00	4,190,400		
ユナイテッドアローズ	7,000	1,903.00	13,321,000	貸付株式数	2,100株
進和	3,700	1,940.00	7,178,000	貸付株式数	1,500株
エスケイジャパン	2,600	437.00	1,136,200		
ダイトロン	2,700	2,014.00	5,437,800		
ハイデイ日高	9,600	1,571.00	15,081,600	貸付株式数	3,800株
シークス	9,400	1,331.00	12,511,400	貸付株式数	3,700株
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　Ｈ	3,600	210.00	756,000	貸付株式数	400株
コロワイド	27,300	1,522.00	41,550,600	貸付株式数	10,900株 (2,200株)
ピーシーデポコーポ	7,900	321.00	2,535,900	貸付株式数	3,500株
田中商事	2,100	621.00	1,304,100	貸付株式数	500株
オーハシテクニカ	3,500	1,469.00	5,141,500	貸付株式数	400株
壱番屋	4,700	4,435.00	20,844,500	貸付株式数	1,800株
白銅	2,000	2,355.00	4,710,000	貸付株式数	500株
トップカルチャー	2,500	300.00	750,000		
ＰＬＡＮＴ	1,600	697.00	1,115,200	貸付株式数	500株
スギホールディングス	13,300	7,140.00	94,962,000	貸付株式数	5,200株
ダイコー通産	800	1,174.00	939,200	貸付株式数	300株
薬王堂ホールディングス	3,300	2,138.00	7,055,400		

島津製作所	86,600	4,810.00	416,546,000		
Ｊ　Ｍ　Ｓ	5,900	590.00	3,481,000	貸付株式数	2,100株
クボテック	1,000	285.00	285,000	貸付株式数	600株
長野計器	5,100	1,691.00	8,624,100		
ブイ・テクノロジー	2,900	3,445.00	9,990,500	貸付株式数	1,000株
スター精密	10,400	1,446.00	15,038,400		
東京計器	4,100	969.00	3,972,900	貸付株式数	1,600株
愛知時計	1,000	4,505.00	4,505,000		
インターアクション	3,400	2,325.00	7,905,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
オーバル	6,600	253.00	1,669,800		
東京精密	11,400	4,800.00	54,720,000		
マニー	26,800	1,660.00	44,488,000	貸付株式数	10,600株
ニコン	102,700	1,177.00	120,877,900		
トプコン	31,500	1,791.00	56,416,500	貸付株式数	3,300株
オリンパス	353,000	2,539.00	896,267,000		
理研計器	5,400	5,370.00	28,998,000	貸付株式数	700株
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	11,700	11,500.00	134,550,000		
キヤノン電子	6,200	1,486.00	9,213,200		
タムロン	5,600	2,523.00	14,128,800	貸付株式数	2,000株
ＨＯＹＡ	131,400	18,020.00	2,367,828,000		
シ　ー　ド	2,900	561.00	1,626,900	貸付株式数	1,100株
ノーリツ鋼機	6,200	2,743.00	17,006,600		
エー・アンド・デイ	6,100	1,118.00	6,819,800		
朝日インテック	73,800	2,488.00	183,614,400		
キヤノン	334,500	2,500.00	836,250,000		
リ　コ　ー	186,900	1,003.00	187,460,700		
シチズン時計	78,400	519.00	40,689,600		
リズム	2,000	1,190.00	2,380,000	貸付株式数	600株
大研医器	5,000	545.00	2,725,000		
メニコン	22,300	3,755.00	83,736,500	貸付株式数	8,900株
シンシア	800	554.00	443,200	貸付株式数	200株
中本パックス	1,800	1,595.00	2,871,000	貸付株式数	700株
スノーピーク	9,000	3,875.00	34,875,000	貸付株式数	1,700株
パラマウントベッドＨＤ	12,800	1,931.00	24,716,800		
トランザクション	4,500	967.00	4,351,500	貸付株式数	1,400株
粧美堂	1,900	384.00	729,600	貸付株式数	300株
ニホンフラッシュ	5,800	1,065.00	6,177,000	貸付株式数	200株
前田工繊	7,600	3,510.00	26,676,000	貸付株式数	2,000株

永大産業	8,800	272.00	2,393,600		
アートネイチャー	6,000	646.00	3,876,000	貸付株式数	1,100株
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	60,300	8,837.00	532,871,100		
アイフィスジャパン	1,800	646.00	1,162,800	貸付株式数	700株
共立印刷	9,700	141.00	1,367,700	貸付株式数	400株
ＳＨＯＥＩ	6,500	4,800.00	31,200,000		
フランスベッドＨＬＤＧＳ	9,800	853.00	8,359,400	貸付株式数	3,400株
マーベラス	10,400	716.00	7,446,400		
パイロットコーポレーション	11,300	4,145.00	46,838,500	貸付株式数	4,500株
萩原工業	4,300	1,326.00	5,701,800	貸付株式数	1,500株
エイベックス	11,700	1,695.00	19,831,500		
トッパン・フォームズ	9,300	1,546.00	14,377,800	貸付株式数	3,700株
フジシールインターナショナル	16,300	2,058.00	33,545,400	貸付株式数	4,700株
タカラトミー	28,000	999.00	27,972,000	貸付株式数	3,000株
広済堂ホールディングス	4,200	819.00	3,439,800	貸付株式数	1,300株
エステールホールディングス	1,300	636.00	826,800	貸付株式数	700株
レック	8,800	819.00	7,207,200		
タカノ	2,100	640.00	1,344,000	貸付株式数	800株
三光合成	8,500	374.00	3,179,000	貸付株式数	300株
プロネクサス	5,300	1,015.00	5,379,500		
ホクシン	6,900	156.00	1,076,400		
ウッドワン	2,000	952.00	1,904,000	貸付株式数	200株
大建工業	4,000	2,158.00	8,632,000	貸付株式数	800株
き　も　と	12,700	210.00	2,667,000		
凸版印刷	102,100	1,723.00	175,918,300		
大日本印刷	79,400	2,663.00	211,442,200		
共同印刷	1,900	2,761.00	5,245,900		
ＮＩＳＳＨＡ	13,800	1,578.00	21,776,400		
光村印刷	600	1,475.00	885,000	貸付株式数	200株
藤森工業	6,000	3,580.00	21,480,000		
ヴィア・ホールディングス	8,500	153.00	1,300,500		
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,300	1,731.00	5,712,300	貸付株式数	1,200株
前澤化成工業	4,500	1,251.00	5,629,500	貸付株式数	1,600株
未来工業	2,500	1,616.00	4,040,000		
アシックス	59,700	2,818.00	168,234,600		
ツ　ツ　ミ	1,700	2,070.00	3,519,000	貸付株式数	600株

ウェーブロックＨＬＤＧＳ	2,300	706.00	1,623,800	貸付株式数	900株
ジェイ　エス　ピー	3,700	1,515.00	5,605,500	貸付株式数	1,400株
ニ　チ　ハ	9,400	2,791.00	26,235,400		
エフピコ	12,500	3,745.00	46,812,500		
小松ウオール工業	2,000	1,846.00	3,692,000		
ヤマハ	40,000	5,820.00	232,800,000		
河合楽器	1,900	3,210.00	6,099,000		
クリナップ	6,300	512.00	3,225,600		
ピジョン	40,800	2,301.00	93,880,800	貸付株式数	16,200株
天馬	6,300	2,402.00	15,132,600		
兼松サステック	500	1,788.00	894,000		
キングジム	5,700	853.00	4,862,100		
象印マホービン	18,300	1,591.00	29,115,300		
リンテック	16,500	2,500.00	41,250,000		
信越ポリマー	11,700	951.00	11,126,700		
東　リ	16,500	219.00	3,613,500		
イトーキ	12,900	342.00	4,411,800		
任　天　堂	38,000	50,100.00	1,903,800,000		
三菱鉛筆	11,000	1,213.00	13,343,000	貸付株式数	500株
松　風	2,700	2,027.00	5,472,900	貸付株式数	1,200株
タカラスタンダード	14,000	1,366.00	19,124,000	貸付株式数	200株
コ　ク　ヨ	32,500	1,656.00	53,820,000		
ナカバヤシ	5,800	499.00	2,894,200	貸付株式数	600株
ニ　フ　コ	23,100	3,120.00	72,072,000		
立川ブラインド	3,200	1,090.00	3,488,000	貸付株式数	1,100株
グローブライド	6,000	3,460.00	20,760,000	貸付株式数	700株
オカムラ	23,600	1,275.00	30,090,000		
バルカー	7,200	2,442.00	17,582,400		
ＭＵＴＯＨホールディングス	900	1,648.00	1,483,200		
伊　藤　忠	465,300	3,260.00	1,516,878,000		
丸　紅	654,000	1,017.50	665,445,000		
スクロール	10,200	767.00	7,823,400		
高　島	1,000	2,147.00	2,147,000	貸付株式数	100株
ヨンドシーホールディングス	6,200	1,595.00	9,889,000	貸付株式数	2,400株
三陽商会	3,200	823.00	2,633,600	貸付株式数	900株
長瀬産業	36,000	1,683.00	60,588,000		
ナイガイ	2,700	310.00	837,000	貸付株式数	700株
蝶　理	3,600	1,712.00	6,163,200	貸付株式数	800株

豊田通商	66,900	4,955.00	331,489,500		
オンワードホールディングス	41,800	288.00	12,038,400	貸付株式数	15,700株
三共生興	8,500	547.00	4,649,500	貸付株式数	1,900株
兼　松	25,900	1,231.00	31,882,900	貸付株式数	900株
美　津　濃	6,800	2,131.00	14,490,800		
ツカモトコーポレーション	1,100	1,360.00	1,496,000		
ルックホールディングス	2,100	1,290.00	2,709,000	貸付株式数	800株
三井物産	516,000	2,557.00	1,319,412,000		
日本紙パルプ	3,300	3,575.00	11,797,500		
東京エレクトロン	42,700	59,840.00	2,555,168,000		
カメイ	7,800	992.00	7,737,600	貸付株式数	1,100株
東都水産	400	4,500.00	1,800,000		
ＯＵＧホールディングス	1,000	2,525.00	2,525,000	貸付株式数	400株
スターゼン	5,000	1,844.00	9,220,000		
セイコーＨＤ	9,700	2,198.00	21,320,600		
山　善	29,200	972.00	28,382,400	貸付株式数	1,900株
椿本興業	1,500	3,880.00	5,820,000		
住友商事	420,700	1,546.00	650,402,200		
日本ユニシス	20,600	3,280.00	67,568,000	貸付株式数	1,600株
内田洋行	2,800	4,635.00	12,978,000		
三菱商事	497,900	3,391.00	1,688,378,900		
第一実業	3,300	4,890.00	16,137,000		
キヤノンマーケティングＪＰＮ	16,400	2,200.00	36,080,000		
西華産業	3,300	1,507.00	4,973,100		
佐藤商事	5,100	1,063.00	5,421,300		
菱洋エレクトロ	3,900	2,249.00	8,771,100	貸付株式数	1,500株
東京産業	6,600	739.00	4,877,400	貸付株式数	2,000株
ユアサ商事	6,600	2,797.00	18,460,200	貸付株式数	700株
神鋼商事	1,700	3,145.00	5,346,500		
トルク	9,200	207.00	1,904,400	貸付株式数	3,000株
阪和興業	13,500	3,070.00	41,445,000		
正栄食品	4,300	3,775.00	16,232,500	貸付株式数	1,700株
カナデン	6,900	986.00	6,803,400		
菱電商事	6,300	1,677.00	10,565,100	貸付株式数	1,600株
ニプロ	49,900	1,075.00	53,642,500	貸付株式数	12,200株
岩谷産業	16,100	5,730.00	92,253,000		
ナイス	2,500	1,612.00	4,030,000		
ニチモウ	1,000	2,029.00	2,029,000	貸付株式数	100株

極東貿易	2,100	2,332.00	4,897,200	貸付株式数	700株
アステナホールディングス	10,800	486.00	5,248,800		
兼松エレクトロニクス	3,600	3,600.00	12,960,000		
三愛石油	16,300	1,184.00	19,299,200		
稲畑産業	15,600	1,529.00	23,852,400	貸付株式数	2,000株
ＧＳＩクレオス	3,200	1,021.00	3,267,200	貸付株式数	1,200株
明和産業	6,400	819.00	5,241,600	貸付株式数	2,400株
クワザワホールディングス	2,700	572.00	1,544,400	貸付株式数	900株
ゴールドウイン	11,900	6,450.00	76,755,000		
ユニ・チャーム	129,800	4,888.00	634,462,400		
デサント	12,900	4,610.00	59,469,000		
キ　ン　グ	3,200	550.00	1,760,000	貸付株式数	100株
ワ　キ　タ	13,800	1,026.00	14,158,800		
ヤマトインターナシヨナル	5,800	302.00	1,751,600	貸付株式数	2,200株
東邦ホールディングス	21,400	1,692.00	36,208,800	貸付株式数	8,300株
サンゲツ	17,600	1,519.00	26,734,400	貸付株式数	100株
ミツウロコグループ	9,900	1,165.00	11,533,500		
シナネンホールディングス	2,500	3,420.00	8,550,000	貸付株式数	400株
伊藤忠エネクス	14,900	951.00	14,169,900		
サンリオ	20,500	2,479.00	50,819,500	貸付株式数	500株
サンワ　テクノス	3,900	1,675.00	6,532,500	貸付株式数	500株
リョーサン	7,200	2,108.00	15,177,600		
新光商事	9,500	873.00	8,293,500	貸付株式数	3,600株
トーホー	3,100	1,375.00	4,262,500	貸付株式数	1,200株
三信電気	2,900	1,395.00	4,045,500		
東陽テクニカ	6,900	1,077.00	7,431,300		
モスフード　サービス	8,700	3,055.00	26,578,500	貸付株式数	1,000株
加賀電子	6,200	2,932.00	18,178,400		
三益半導体	5,200	2,341.00	12,173,200		
ソーダニツカ	6,400	676.00	4,326,400		
立花エレテック	5,100	1,519.00	7,746,900	貸付株式数	1,800株
木曽路	8,700	2,088.00	18,165,600	貸付株式数	3,400株
ＳＲＳホールディングス	9,100	742.00	6,752,200	貸付株式数	3,600株
千　趣　会	11,900	388.00	4,617,200	貸付株式数	4,700株
タカキユー	7,300	122.00	890,600	貸付株式数	2,200株
リテールパートナーズ	8,000	1,212.00	9,696,000	貸付株式数	3,200株
ケーヨー	12,300	803.00	9,876,900		
上新電機	7,600	2,048.00	15,564,800		
日本瓦斯	32,600	1,417.00	46,194,200		
ロイヤルホールディングス	11,600	1,819.00	21,100,400	貸付株式数	4,500株

東　天　紅	500	1,001.00	500,500		
いなげや	8,100	1,301.00	10,538,100	貸付株式数	2,900株
チヨダ	6,400	702.00	4,492,800	貸付株式数	2,500株
ライフコーポレーション	6,200	3,355.00	20,801,000		
リンガーハツト	8,200	2,136.00	17,515,200	貸付株式数	3,200株
ＭｒＭａｘＨＤ	8,300	529.00	4,390,700	貸付株式数	3,500株
テンアライド	6,600	308.00	2,032,800	貸付株式数	2,600株
ＡＯＫＩホールディングス	13,300	614.00	8,166,200	貸付株式数	2,400株
オークワ	10,200	955.00	9,741,000	貸付株式数	4,000株
コメリ	10,200	2,444.00	24,928,800		
青山商事	13,700	719.00	9,850,300	貸付株式数	2,900株
しまむら	7,700	9,700.00	74,690,000		
はせがわ	3,400	230.00	782,000	貸付株式数	600株
高　島　屋	49,200	995.00	48,954,000		
松　屋	13,300	838.00	11,145,400	貸付株式数	1,700株
エイチ・ツー・オーリテイリング	32,500	790.00	25,675,000	貸付株式数	12,400株
近鉄百貨店	2,500	2,428.00	6,070,000	貸付株式数	1,000株
丸井グループ	56,400	2,086.00	117,650,400		
クレディセゾン	42,800	1,124.00	48,107,200		
アクシアル　リテイリング	5,100	3,260.00	16,626,000	貸付株式数	2,100株
井　筒　屋	3,100	309.00	957,900	貸付株式数	1,200株
イオン	255,100	2,644.50	674,611,950		
イ　ズ　ミ	11,900	3,145.00	37,425,500	貸付株式数	4,700株
フオーバル	3,000	991.00	2,973,000		
平　和　堂	12,200	1,853.00	22,606,600	貸付株式数	5,200株
フ　ジ	8,000	1,920.00	15,360,000	貸付株式数	3,200株
ヤオコー	7,500	6,690.00	50,175,000	貸付株式数	2,900株
ゼビオホールディングス	9,000	879.00	7,911,000	貸付株式数	2,900株
ケーズホールディングス	61,200	1,149.00	70,318,800		
ＰＡＬＴＡＣ	9,300	4,405.00	40,966,500	貸付株式数	2,000株
三谷産業	9,400	297.00	2,791,800	貸付株式数	1,500株
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	3,400	611.00	2,077,400	貸付株式数	700株
日産東京販売ＨＤ	8,900	225.00	2,002,500		
新生銀行	43,300	1,916.00	82,962,800		
あおぞら銀行	37,000	2,472.00	91,464,000		
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ ※	4,258,400	601.40	2,561,001,760		
りそなホールディングス	760,700	415.60	316,146,920		
三井住友トラストＨＤ	125,500	3,560.00	446,780,000		

三井住友フィナンシャルG ※	459,700	3,703.00	1,702,269,100		
千葉銀行	221,500	661.00	146,411,500		
群馬銀行	127,200	331.00	42,103,200	貸付株式数	13,600株
武蔵野銀行	9,900	1,558.00	15,424,200	貸付株式数	3,800株
千葉興業銀行	15,800	245.00	3,871,000	貸付株式数	2,000株
筑波銀行	26,200	157.00	4,113,400	貸付株式数	2,500株
七十七銀行	20,600	1,156.00	23,813,600	貸付株式数	7,900株
青森銀行	5,100	1,593.00	8,124,300		
秋田銀行	4,200	1,430.00	6,006,000		
山形銀行	7,400	811.00	6,001,400		
岩手銀行	4,400	1,610.00	7,084,000		
東邦銀行	54,800	194.00	10,631,200	貸付株式数	22,600株
東北銀行	3,100	964.00	2,988,400		
みちのく銀行	4,500	731.00	3,289,500		
ふくおかフィナンシャルG	55,900	1,838.00	102,744,200		
静岡銀行	161,800	800.00	129,440,000		
スルガ銀行	63,000	471.00	29,673,000		
八十二銀行	149,300	356.00	53,150,800		
山梨中央銀行	6,900	788.00	5,437,200	貸付株式数	800株
大垣共立銀行	13,200	1,771.00	23,377,200	貸付株式数	2,600株
福井銀行	5,900	1,332.00	7,858,800		
清水銀行	2,800	1,516.00	4,244,800		
富山銀行	1,200	1,696.00	2,035,200	貸付株式数	100株
滋賀銀行	12,400	1,751.00	21,712,400	貸付株式数	1,200株
南都銀行	10,200	1,790.00	18,258,000	貸付株式数	400株
百五銀行	63,600	318.00	20,224,800		
京都銀行	23,900	4,825.00	115,317,500		
紀陽銀行	23,400	1,359.00	31,800,600		
ほくほくフィナンシャルG	41,300	770.00	31,801,000	貸付株式数	4,100株
山陰合同銀行	39,300	564.00	22,165,200	貸付株式数	3,600株
中国銀行	53,100	836.00	44,391,600	貸付株式数	6,100株
鳥取銀行	2,000	1,102.00	2,204,000		
伊予銀行	88,300	524.00	46,269,200	貸付株式数	32,800株
百十四銀行	6,900	1,350.00	9,315,000		
四国銀行	9,700	704.00	6,828,800	貸付株式数	3,700株
阿波銀行	10,200	2,035.00	20,757,000		
大分銀行	3,900	1,680.00	6,552,000	貸付株式数	400株
宮崎銀行	4,100	1,952.00	8,003,200		
佐賀銀行	3,700	1,408.00	5,209,600	貸付株式数	200株

琉球銀行	14,600	712.00	10,395,200		
セブン銀行	196,900	228.00	44,893,200	貸付株式数	88,100株
みずほフィナンシャルG	849,700	1,402.00	1,191,279,400		
高知銀行	2,500	719.00	1,797,500		
山口フィナンシャルG	77,000	621.00	47,817,000	貸付株式数	8,300株
芙蓉総合リース	7,000	7,180.00	50,260,000		
みずほリース	10,500	2,964.00	31,122,000	貸付株式数	3,900株
東京センチュリー	12,900	5,420.00	69,918,000	貸付株式数	6,100株
ＳＢＩホールディングス	81,900	2,924.00	239,475,600	貸付株式数	32,600株
日本証券金融	26,300	814.00	21,408,200		
アイフル	113,800	352.00	40,057,600		
日本アジア投資	5,900	187.00	1,103,300	貸付株式数	500株
長野銀行	2,200	1,100.00	2,420,000		
名古屋銀行	4,900	2,193.00	10,745,700	貸付株式数	600株
北洋銀行	101,200	231.00	23,377,200	貸付株式数	12,700株
愛知銀行	2,400	3,505.00	8,412,000		
中京銀行	2,600	1,185.00	3,081,000		
大光銀行	2,300	1,266.00	2,911,800		
愛媛銀行	9,300	720.00	6,696,000		
トマト銀行	2,300	1,005.00	2,311,500	貸付株式数	300株
京葉銀行	28,000	422.00	11,816,000	貸付株式数	10,000株
栃木銀行	31,700	174.00	5,515,800		
北日本銀行	2,100	1,414.00	2,969,400	貸付株式数	700株
東和銀行	12,200	480.00	5,856,000		
福島銀行	7,700	202.00	1,555,400		
大東銀行	3,100	656.00	2,033,600		
リコーリース	6,000	3,615.00	21,690,000	貸付株式数	2,000株
イオンフィナンシャルサービス	36,100	1,227.00	44,294,700	貸付株式数	3,800株
ア　コ　ム	132,000	337.00	44,484,000	貸付株式数	50,900株
ジャックス	7,700	2,753.00	21,198,100		
オ　リ　コ	181,600	124.00	22,518,400		
オリックス	403,000	2,245.00	904,735,000		
三菱ＨＣキャピタル	246,300	534.00	131,524,200		
ジャフコ　グループ	8,700	7,120.00	61,944,000		
九州　リースサービス	3,300	566.00	1,867,800	貸付株式数	500株
トモニホールディングス	51,200	291.00	14,899,200	貸付株式数	900株
大和証券G本社	497,100	630.90	313,620,390		
野村ホールディングス	1,013,000	477.40	483,606,200		
岡三証券グループ	52,000	369.00	19,188,000	貸付株式数	6,600株

丸三証券	19,700	499.00	9,830,300		
東洋証券	21,700	143.00	3,103,100	貸付株式数	8,600株
東海東京ＨＤ	75,500	372.00	28,086,000	貸付株式数	30,200株
光世証券	1,400	500.00	700,000	貸付株式数	600株
水戸証券	17,800	269.00	4,788,200	貸付株式数	5,000株
いちよし証券	12,400	619.00	7,675,600	貸付株式数	5,200株
松井証券	32,500	781.00	25,382,500		
ＳＯＭＰＯホールディングス	117,000	4,674.00	546,858,000		
日本取引所グループ	168,300	2,459.00	413,849,700		
マネックスＧ	54,100	931.00	50,367,100		
極東証券	8,900	732.00	6,514,800	貸付株式数	1,700株
岩井コスモホールディング	6,300	1,292.00	8,139,600	貸付株式数	800株
アイザワ証券グループ	11,000	986.00	10,846,000	貸付株式数	2,900株
フィデアホール	5,900	1,197.00	7,062,300	貸付株式数	200株
池田泉州ＨＤ	74,900	149.00	11,160,100	貸付株式数	29,900株
アニコム　ホールディングス	20,500	777.00	15,928,500		
ＭＳ＆ＡＤ	148,900	3,316.00	493,752,400	貸付株式数	44,000株
マネーパートナーズＧＰ	9,100	218.00	1,983,800		
スパークス・グループ	31,600	312.00	9,859,200	貸付株式数	12,100株
小林洋行	2,300	246.00	565,800		
第一生命ＨＬＤＧＳ	326,800	2,287.00	747,391,600		
東京海上ＨＤ	218,700	5,708.00	1,248,339,600		
アドバンテッジリスクマネ	3,300	657.00	2,168,100	貸付株式数	1,300株
イー・ギャランティ	9,800	2,457.00	24,078,600		
アサックス	4,200	684.00	2,872,800	貸付株式数	1,100株
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,000	1,914.00	5,742,000		
Ｔ＆Ｄホールディングス	172,400	1,342.00	231,360,800		
アドバンスクリエイト	3,200	981.00	3,139,200	貸付株式数	1,100株
三井不動産	302,300	2,336.00	706,172,800		
三菱地所	435,500	1,565.00	681,557,500		
平和不動産	11,500	3,400.00	39,100,000		
東京建物	65,400	1,608.00	105,163,200		
ダイビル	16,900	1,464.00	24,741,600	貸付株式数	400株
京阪神ビルディング	10,500	1,377.00	14,458,500		
住友不動産	139,100	3,539.00	492,274,900		
太平洋興発	2,200	591.00	1,300,200	貸付株式数	200株
テーオーシー	12,100	556.00	6,727,600	貸付株式数	3,300株

東京楽天地	1,000	3,980.00	3,980,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	8,800	2,429.00	21,375,200		
フジ住宅	7,700	664.00	5,112,800		
空港施設	7,200	525.00	3,780,000		
明和地所	3,400	550.00	1,870,000		
ゴールドクレスト	4,700	1,492.00	7,012,400	貸付株式数	2,300株
リログループ	35,200	2,093.00	73,673,600		
エスリード	2,500	1,599.00	3,997,500	貸付株式数	1,000株
日神グループＨＬＤＧＳ	9,300	465.00	4,324,500	貸付株式数	4,100株
日本エスコン	13,100	750.00	9,825,000		
タカラレーベン	29,300	266.00	7,793,800	貸付株式数	11,200株
ＡＶＡＮＴＩＡ	2,800	828.00	2,318,400	貸付株式数	600株
イオンモール	33,100	1,607.00	53,191,700	貸付株式数	13,200株
毎日コムネット	2,700	727.00	1,962,900		
ファースト住建	2,900	1,184.00	3,433,600	貸付株式数	900株
ランド	371,200	11.00	4,083,200	貸付株式数	119,600株
カチタス	16,400	4,190.00	68,716,000		
東祥	4,900	1,674.00	8,202,600	貸付株式数	1,500株
トーセイ	9,300	963.00	8,955,900	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,100	1,865.00	2,051,500	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	8,500	958.00	8,143,000		
インテリックス	900	654.00	588,600		
ランドビジネス	2,300	247.00	568,100		
サンネクスタグループ	2,300	1,005.00	2,311,500	貸付株式数	800株
グランディハウス	5,200	458.00	2,381,600		
東武鉄道	65,800	2,565.00	168,777,000		
相鉄ホールディングス	21,400	1,975.00	42,265,000	貸付株式数	2,300株
東急	169,800	1,571.00	266,755,800		
京浜急行	86,300	1,122.00	96,828,600		
小田急電鉄	100,100	2,187.00	218,918,700		
京王電鉄	34,900	5,110.00	178,339,000		
京成電鉄	46,900	3,110.00	145,859,000		
富士急行	8,100	4,105.00	33,250,500	貸付株式数	3,600株
新京成電鉄	1,600	1,970.00	3,152,000	貸付株式数	300株
東日本旅客鉄道	118,500	6,986.00	827,841,000		
西日本旅客鉄道	81,600	4,898.00	399,676,800		
東海旅客鉄道	56,000	15,600.00	873,600,000		
西武ホールディングス	87,800	1,085.00	95,263,000	貸付株式数	32,300株
鴻池運輸	10,600	1,089.00	11,543,400		
西日本鉄道	18,600	2,544.00	47,318,400		

ハマキョウレックス	4,700	2,850.00	13,395,000	貸付株式数	600株
サカイ引越センター	3,100	4,195.00	13,004,500	貸付株式数	500株
近鉄グループＨＬＤＧＳ	63,700	3,260.00	207,662,000		
阪急阪神ＨＬＤＧＳ	79,600	3,365.00	267,854,000	貸付株式数	2,800株
南海電鉄	28,400	2,032.00	57,708,800	貸付株式数	11,900株
京阪ホールディングス	28,300	2,548.00	72,108,400		
神戸電鉄	1,500	3,205.00	4,807,500	貸付株式数	500株
名古屋鉄道	52,400	1,660.00	86,984,000	貸付株式数	3,800株
山陽電鉄	4,700	1,930.00	9,071,000	貸付株式数	1,700株
トランコム	1,800	8,050.00	14,490,000	貸付株式数	700株
日本通運	22,100	6,470.00	142,987,000		
ヤマトホールディングス	89,300	2,504.00	223,607,200		
山　九	17,600	4,510.00	79,376,000		
日　新	5,000	1,523.00	7,615,000		
丸　運	4,300	250.00	1,075,000	貸付株式数	1,400株
丸全昭和運輸	5,200	3,165.00	16,458,000		
センコーグループＨＬＤＧＳ	32,300	926.00	29,909,800	貸付株式数	13,900株
トナミホールディングス	1,500	3,520.00	5,280,000		
ニッコンホールディングス	21,300	1,983.00	42,237,900		
日石輸送	600	2,607.00	1,564,200		
福山通運	10,500	3,760.00	39,480,000		
セイノーホールディングス	43,300	1,147.00	49,665,100	貸付株式数	8,200株
エスライン	1,800	900.00	1,620,000		
神奈川中央交通	1,600	3,220.00	5,152,000		
日立物流	12,300	4,630.00	56,949,000	貸付株式数	200株
丸和運輸機関	13,800	1,380.00	19,044,000	貸付株式数	5,300株
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	6,500	1,502.00	9,763,000		
日本郵船	53,400	7,400.00	395,160,000		
商船三井	35,300	6,500.00	229,450,000		
川崎汽船	19,800	4,870.00	96,426,000		
ＮＳユナイテッド海運	3,500	3,230.00	11,305,000		
明治海運	7,500	686.00	5,145,000	貸付株式数	3,000株
飯野海運	29,300	517.00	15,148,100	貸付株式数	3,900株
共栄タンカー	1,100	819.00	900,900	貸付株式数	400株
九州旅客鉄道	49,500	2,395.00	118,552,500		
ＳＧホールディングス	120,500	2,510.00	302,455,000		
日本航空	146,200	2,056.00	300,587,200		
ＡＮＡホールディングス	162,000	2,239.50	362,799,000		

パスコ	1,100	1,298.00	1,427,800		
ＴＲＥホールディングス	8,800	1,775.00	15,620,000	貸付株式数	100株
人・夢・技術グループ	2,600	1,813.00	4,713,800		
西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	1,500	3,220.00	4,830,000	貸付株式数	600株
シルバーライフ	1,500	1,287.00	1,930,500	貸付株式数	500株
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	900	1,985.00	1,786,500	貸付株式数	200株
ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	2,900	5,120.00	14,848,000	貸付株式数	800株
国際紙パルプ商事	15,900	311.00	4,944,900		
ナルミヤ・インターナショナル	1,600	1,038.00	1,660,800	貸付株式数	500株
ブックオフＧＨＤ	3,800	970.00	3,686,000	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	20,100	2,774.00	55,757,400		
三井倉庫ＨＯＬＤ	6,900	2,280.00	15,732,000		
住友倉庫	22,500	1,817.00	40,882,500	貸付株式数	400株
渋沢倉庫	3,800	2,097.00	7,968,600		
ヤマタネ	2,900	1,516.00	4,396,400		
東陽倉庫	10,600	305.00	3,233,000	貸付株式数	300株
乾汽船	4,500	2,009.00	9,040,500	貸付株式数	1,700株
日本トランスシティ	14,000	554.00	7,756,000		
ケイヒン	1,000	1,279.00	1,279,000	貸付株式数	200株
中央倉庫	3,500	934.00	3,269,000		
川西倉庫	1,200	1,067.00	1,280,400	貸付株式数	400株
安田倉庫	5,000	930.00	4,650,000		
ファイズホールディングス	1,400	552.00	772,800	貸付株式数	500株
東洋埠頭	1,900	1,407.00	2,673,300		
宇徳	5,400	516.00	2,786,400		
上　組	35,000	2,099.00	73,465,000		
サンリツ	1,900	797.00	1,514,300	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,500	1,173.00	1,759,500	貸付株式数	400株
キユーソー流通システム	3,000	882.00	2,646,000	貸付株式数	600株
近鉄エクスプレス	12,000	2,728.00	32,736,000	貸付株式数	400株
東海運	3,600	298.00	1,072,800	貸付株式数	1,400株
エーアイテイー	4,100	1,139.00	4,669,900		
内外トランスライン	2,700	1,826.00	4,930,200	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	2,500	687.00	1,717,500	貸付株式数	600株
日本コンセプト	2,100	1,644.00	3,452,400	貸付株式数	800株
ＴＢＳホールディングス	40,200	1,715.00	68,943,000	貸付株式数	5,500株

日本テレビＨＬＤＳ	55,400	1,150.00	63,710,000		
朝日放送グループＨＤ	6,400	682.00	4,364,800		
テレビ朝日ＨＤ	16,000	1,492.00	23,872,000	貸付株式数	8,100株
スカパーＪＳＡＴＨＤ	56,300	405.00	22,801,500	貸付株式数	22,400株
テレビ東京ＨＤ	4,800	2,027.00	9,729,600		
日本ＢＳ放送	2,400	1,102.00	2,644,800	貸付株式数	900株
ビジョン	11,900	1,319.00	15,696,100		
スマートバリュー	1,800	500.00	900,000	貸付株式数	600株
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ	6,800	3,235.00	21,998,000	貸付株式数	2,500株
ワイヤレスゲート	2,900	324.00	939,600	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,600	1,407.00	6,472,200		
日本通信	55,100	270.00	14,877,000	貸付株式数	5,100株
クロップス	1,100	1,109.00	1,219,900	貸付株式数	400株
日本電信電話	772,600	3,125.00	2,414,375,000		
ＫＤＤＩ	481,600	3,300.00	1,589,280,000		
ソフトバンク	1,000,600	1,562.50	1,563,437,500		
光通信	7,800	16,460.00	128,388,000		
エムティーアイ	7,600	584.00	4,438,400	貸付株式数	2,500株
ＧＭＯインターネット	23,700	2,858.00	67,734,600	貸付株式数	9,000株
ファイバーゲート	2,200	1,079.00	2,373,800	貸付株式数	800株
アイドママーケティングコミュ	1,000	313.00	313,000	貸付株式数	600株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	19,300	6,020.00	116,186,000		
学研ホールディングス	9,600	978.00	9,388,800	貸付株式数	3,700株
ゼンリン	10,900	935.00	10,191,500	貸付株式数	4,600株
昭文社ホールディングス	2,700	478.00	1,290,600	貸付株式数	1,000株
インプレスホールディングス	8,900	210.00	1,869,000		
東京電力ＨＤ	503,800	303.00	152,651,400	貸付株式数	94,500株
中部電力	205,400	1,146.00	235,388,400		
関西電力	254,700	1,027.00	261,576,900		
中国電力	104,800	891.00	93,376,800		
北陸電力	62,400	563.00	35,131,200		
東北電力	156,800	786.00	123,244,800	貸付株式数	11,300株
四国電力	60,200	755.00	45,451,000		
九州電力	138,300	811.00	112,161,300	貸付株式数	5,200株
北海道電力	58,100	469.00	27,248,900	貸付株式数	22,400株
沖縄電力	13,900	1,389.00	19,307,100		
電源開発	57,200	1,445.00	82,654,000		

エフオン	4,500	655.00	2,947,500	貸付株式数	200株
イーレックス	10,200	2,558.00	26,091,600		
レノバ	13,100	5,350.00	70,085,000		
東京瓦斯	129,100	1,945.00	251,099,500		
大阪瓦斯	121,800	1,827.00	222,528,600		
東邦瓦斯	30,900	3,205.00	99,034,500		
北海道瓦斯	3,100	1,471.00	4,560,100	貸付株式数	400株
広島ガス	11,700	351.00	4,106,700	貸付株式数	1,600株
西部ガスＨＬＤＧＳ	7,400	2,120.00	15,688,000		
静岡ガス	19,300	968.00	18,682,400		
メタウォーター	7,900	1,950.00	15,405,000		
アイネット	3,000	1,300.00	3,900,000		
松　竹	4,400	10,960.00	48,224,000	貸付株式数	800株
東　宝	39,000	5,050.00	196,950,000		
エイチ・アイ・エス	14,500	1,941.00	28,144,500	貸付株式数	5,700株
東　映	2,200	18,600.00	40,920,000	貸付株式数	200株
ラックランド	1,700	2,908.00	4,943,600	貸付株式数	600株
ＮＴＴデータ	175,800	2,394.00	420,865,200		
共立メンテナンス	11,500	3,995.00	45,942,500	貸付株式数	4,500株
イチネンホールディングス	6,200	1,300.00	8,060,000		
建設技術研究所	3,800	2,364.00	8,983,200		
スペース	3,900	893.00	3,482,700		
アインホールディングス	9,700	6,110.00	59,267,000		
燦ホールディングス	2,700	1,386.00	3,742,200		
ピー・シー・エー	3,900	1,463.00	5,705,700	貸付株式数	1,100株
スバル興業	400	7,970.00	3,188,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,300	1,209.00	2,780,700		
タナベ経営	2,000	721.00	1,442,000		
ビジネスＢ太田昭和	2,600	1,964.00	5,106,400		
ナ　ガ　ワ	2,000	11,420.00	22,840,000	貸付株式数	700株
東京都競馬	4,800	3,990.00	19,152,000	貸付株式数	1,900株
常磐興産	2,600	1,401.00	3,642,600	貸付株式数	1,000株
カナモト	11,000	2,154.00	23,694,000		
ＤＴＳ	12,500	2,367.00	29,587,500	貸付株式数	2,200株
スクウェア・エニックス・ＨＤ	30,700	5,930.00	182,051,000		
シーイーシー	7,200	1,242.00	8,942,400		
カプコン	62,300	2,829.00	176,246,700		
西尾レントオール	5,800	2,519.00	14,610,200	貸付株式数	2,000株
アイ・エス・ビー	3,000	1,013.00	3,039,000		

アゴーラ　ホスピタリティーG	52,200	23.00	1,200,600		
日本空港ビルデング	25,300	5,000.00	126,500,000		
トランス・コスモス	8,100	3,150.00	25,515,000	貸付株式数	1,400株
乃村工藝社	27,700	1,003.00	27,783,100		
ジャステック	3,600	1,018.00	3,664,800	貸付株式数	1,400株
ＳＣＳＫ	45,900	2,155.00	98,914,500		
藤田観光	2,900	2,237.00	6,487,300	貸付株式数	1,100株
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	4,100	1,412.00	5,789,200	貸付株式数	1,500株
日本管財	6,700	2,736.00	18,331,200	貸付株式数	1,800株
トーカイ	5,600	1,949.00	10,914,400	貸付株式数	2,200株
白　洋　舎	800	1,868.00	1,494,400	貸付株式数	300株
セコム	63,300	7,664.00	485,131,200		
日本システムウエア	2,300	2,152.00	4,949,600		
セントラル警備保障	3,000	2,407.00	7,221,000		
アイネス	5,700	1,390.00	7,923,000	貸付株式数	2,700株
丹青社	13,000	810.00	10,530,000		
メイテツク	7,800	6,660.00	51,948,000	貸付株式数	900株
ＴＫＣ	11,500	3,290.00	37,835,000		
富士ソフト	7,200	5,280.00	38,016,000		
応用地質	7,100	1,963.00	13,937,300		
船井総研ホールディン	13,100	2,559.00	33,522,900		
ＮＳＤ	21,600	2,117.00	45,727,200		
進学会ホールディングス	2,100	341.00	716,100	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	300	1,741.00	522,300	貸付株式数	100株
オ　オ　バ	4,300	760.00	3,268,000	貸付株式数	1,800株
コナミホールディングス	24,000	5,810.00	139,440,000		
いであ	1,700	1,815.00	3,085,500	貸付株式数	600株
学　究　社	2,200	1,457.00	3,205,400		
ベネッセホールディングス	21,500	2,199.00	47,278,500	貸付株式数	3,300株
イオンディライト	7,800	3,545.00	27,651,000	貸付株式数	3,100株
ナック	2,400	929.00	2,229,600	貸付株式数	300株
福井コンピュータＨＬＤＳ	3,000	3,820.00	11,460,000		
ダイセキ	11,800	5,160.00	60,888,000	貸付株式数	5,100株
ステップ	2,600	1,772.00	4,607,200	貸付株式数	800株
日鉄物産	4,600	4,605.00	21,183,000	貸付株式数	900株
泉州電業	1,900	4,590.00	8,721,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,800	2,446.00	4,402,800		
トラスコ中山	14,200	2,631.00	37,360,200		

ヤマダホールディングス	242,500	396.00	96,030,000	貸付株式数	96,800株
オートバックスセブン	22,200	1,309.00	29,059,800	貸付株式数	9,300株
モリト	4,900	641.00	3,140,900		
アークランドサカモト	10,400	1,659.00	17,253,600		
ニトリホールディングス	26,300	18,030.00	474,189,000		
グルメ杵屋	5,300	982.00	5,204,600	貸付株式数	2,100株
愛　眼	4,100	189.00	774,900		
ケーユーホールディングス	3,400	934.00	3,175,600	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	23,100	2,225.00	51,397,500	貸付株式数	9,200株
加藤産業	9,600	3,170.00	30,432,000		
北恵	1,700	819.00	1,392,300	貸付株式数	600株
イノテック	3,900	1,354.00	5,280,600		
イエローハット	11,500	1,550.00	17,825,000	貸付株式数	2,200株
松屋フーズＨＬＤＧＳ	3,200	3,430.00	10,976,000	貸付株式数	1,200株
ＪＢＣＣホールディングス	4,200	1,763.00	7,404,600		
ＪＫホールディングス	5,300	1,030.00	5,459,000	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	10,300	991.00	10,207,300	貸付株式数	4,000株
日　伝	6,300	2,180.00	13,734,000	貸付株式数	100株
関西スーパーマーケット	5,000	1,834.00	9,170,000	貸付株式数	400株
ミロク情報サービス	5,700	1,464.00	8,344,800	貸付株式数	2,600株
北沢産業	4,400	249.00	1,095,600		
杉本商事	3,000	2,090.00	6,270,000	貸付株式数	400株
因幡電機産業	18,400	2,459.00	45,245,600		
王将フードサービス	4,400	5,780.00	25,432,000	貸付株式数	1,500株
プレナス	7,500	1,935.00	14,512,500		
ミニストップ	5,400	1,361.00	7,349,400	貸付株式数	1,900株
アークス	12,700	2,067.00	26,250,900	貸付株式数	5,000株
バローホールディングス	14,600	2,116.00	30,893,600		
東　テ　ク	2,300	2,325.00	5,347,500		
ミスミグループ本社	83,300	4,785.00	398,590,500		
藤　　久	1,600	771.00	1,233,600	貸付株式数	500株
アルテック	6,300	298.00	1,877,400		
ベ　ル　ク	2,900	5,260.00	15,254,000	貸付株式数	500株
大　庄	3,500	923.00	3,230,500	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	2,000	1,690.00	3,380,000	貸付株式数	800株
ファーストリテイリング	8,900	67,400.00	599,860,000		
ソフトバンクグループ	396,100	6,030.00	2,388,483,000		
蔵王産業	900	1,856.00	1,670,400		
スズケン	26,000	3,085.00	80,210,000	貸付株式数	3,300株
サンドラッグ	25,000	2,989.00	74,725,000		

サックスバーホールディング	6,100	520.00	3,172,000		
ジェコス	4,500	768.00	3,456,000		
ヤマザワ	1,400	1,680.00	2,352,000	貸付株式数	500株
や　ま　や	1,300	2,328.00	3,026,400	貸付株式数	500株
グローセル	7,300	392.00	2,861,600	貸付株式数	2,100株
ベルーナ	14,900	667.00	9,938,300	貸付株式数	5,700株
合計			177,548,758,040		

（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。

ソニーグループ	20,000株	キーエンス	5,000株
本田技研	30,000株	三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	200,000株
三井住友フィナンシャルＧ	30,000株		

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年11月30日

Ⅰ	資産総額	13,941,615,543円
Ⅱ	負債総額	69,205,471円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,872,410,072円
Ⅳ	発行済数量	5,985,338,192口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3177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11月30日

Ⅰ	資産総額	187,880,194,267円
Ⅱ	負債総額	5,216,902,565円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	182,663,291,702円
Ⅳ	発行済数量	139,094,932,448口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3132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

① 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。

② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③ 上記①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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2021年11月末日現在

資本金の額	**151億7,427万2,500円**
発行可能株式総数	**799万9,980株**
発行済株式総数	**260万8,525株**

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　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。

②　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．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。

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11月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	60	175,229
追加型株式投資信託	772	21,068,563
株式投資信託　　合計	832	21,243,792
単位型公社債投資信託	78	215,962
追加型公社債投資信託	14	1,474,160
公社債投資信託　合計	92	1,690,122
総合計	924	22,933,914

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（2021年４月１日から2021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62期事業年度（2020年４月１日から2021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63期事業年度に係る中間会計期間（2021年４月１日から2021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 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2,741	4,860
有価証券	22,167	333
前払費用	205	237
未収委託者報酬	10,847	13,150
未収収益	63	49
関係会社短期貸付金	-	18,700
その他	62	207
流動資産計	36,088	37,539

固定資産				
有形固定資産	※1	217	※1	224
建物		7		6
器具備品		209		218
無形固定資産		2,362		1,937
ソフトウェア		2,028		1,882
ソフトウェア仮勘定		333		54
投資その他の資産		15,844		16,121
投資有価証券		9,153		10,159
関係会社株式		3,972		3,705
出資金		183		183
長期差入保証金		1,069		1,068
繰延税金資産		1,431		973
その他		33		30
固定資産計		18,424		18,283
資産合計		54,512		55,822

（単位:百万円）

	前事業年度 （2020年３月31日）		当事業年度 （2021年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		69		68
未払金		7,573		8,405
未払収益分配金		14		13
未払償還金		39		39
未払手数料		3,988		4,734
その他未払金	※2	3,530	※2	3,617
未払費用		3,830		3,777
未払法人税等		656		804
未払消費税等		590		631
賞与引当金		688		950
その他		5		88
流動負債計		13,414		14,725
固定負債				
退職給付引当金		2,574		2,452
役員退職慰労引当金		88		74
その他		5		3

固定負債計	2,667	2,530
負債合計	16,082	17,256
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	11,749	10,574
利益剰余金合計	12,123	10,948
株主資本合計	38,793	37,618
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△363	947
評価・換算差額等合計	△363	947
純資産合計	38,430	38,566
負債・純資産合計	54,512	55,822

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	69,550	65,487
その他営業収益	583	419
営業収益計	70,134	65,906
営業費用		
支払手数料	31,120	27,965
広告宣伝費	745	624
調査費	8,858	8,245
調査費	1,188	1,134
委託調査費	7,670	7,110
委託計算費	1,410	1,501
営業雑経費	1,770	1,870
通信費	240	240
印刷費	524	478
協会費	56	51

諸会費	13	14
その他営業雑経費	936	1,084
営業費用計	43,906	40,207
一般管理費		
給料	5,793	5,991
役員報酬	374	351
給料・手当	4,335	4,293
賞与	395	395
賞与引当金繰入額	688	950
福利厚生費	838	893
交際費	62	32
旅費交通費	154	37
租税公課	451	472
不動産賃借料	1,299	1,302
退職給付費用	368	449
役員退職慰労引当金繰入額	37	28
固定資産減価償却費	925	661
諸経費	1,770	1,763
一般管理費計	11,702	11,631
営業利益	14,525	14,067

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	214	578
有価証券償還益	24	42
その他	991	68
営業外収益計	1,230	689
営業外費用		
投資有価証券売却損	1	69
有価証券償還損	71	47
その他	54	24
営業外費用計	127	141
経常利益	15,629	14,616
特別損失		
システム刷新関連費用	537	547
関係会社整理損失	-	267
投資有価証券評価損	48	45
特別損失計	585	860

税引前当期純利益	15,043	13,756
法人税、住民税及び事業税	4,555	4,476
法人税等調整額	△78	△ 109
法人税等合計	4,477	4,366
当期純利益	10,566	9,389

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自　2020年４月１日 至　2021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	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,564	△10,564	△10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△1,175	△1,175	△1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

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

市場価格のない株式等以外のもの

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。

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通りであります。

建物	10～18年
器具備品	４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて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。

（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。この結果、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

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。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2019年７月４日）第７-４項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（未適用の会計基準等）

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

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

（表示方法の変更）

（損益計算書関係）

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。

この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」912百万円、「その他」78百万円は、「その他」991百万円として組替えております。

（注記に関する表示方法の変更）

「会計上の見積りの開示に関する会計基準」（企業会計基準第31号　2020年3月31日。以下「見積り会計基準」という）が公表日以後終了する事業年度における年度末に係る財務諸表から適用できることになったことに伴い、当事業年度末から適用し、（重要な会計上の見積り）を開示しております。

見積り会計基準の適用については、見積り会計基準第11項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、会計基準第６項及び第７項に定める注記事項について、前事業年度における財務諸表に関する注記を省略しております。

（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 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
建物	34百万円	35百万円
器具備品	276百万円	259百万円

※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 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
未払金	3,397百万円	3,473百万円

３　保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（2021年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,727百万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　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。

① 剰余金の配当の総額　10,564百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　4,050円
④ 基準日　2020年３月31日
⑤ 効力発生日　2020年６月24日

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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
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

（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

2021年６月22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。

① 剰余金の配当の総額　9,388百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　3,599円
④ 基準日　2021年３月31日

⑤　効力発生日　　2021年６月23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。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

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関係す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

①市場リスクの管理

（ⅰ）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。

（ⅱ）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。

②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．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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。

前事業年度（2020年３月31日）

（１）時価をもって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）

	貸借対照表　　計上額	時価	差額
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267百万円、投資有価証券8,426百万円は上記の表に含めておりません。

（２）時価をもって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。

当事業年度（2021年３月31日）

（１）時価をもって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）

	貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券（※１）	85	－	－	85
資産合計	85	－	－	85

（※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333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

（２）時価をもって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、関係会社短期貸付金、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

れている基準価額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	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,944	1,677
関連会社株式	2,027	2,027

（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（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、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2021年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,677百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

２．その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度（2021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	85	55	30

（２）その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	△160
小計	2,561	2,721	△160
合計	9,826	8,474	1,352

（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。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、関係会社株式について267百万円、証券投資信託について45百万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　2019年４月１日　至　2020年３月31日）	当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	△183	△ 378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

(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　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,574百万円	2,452百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,574	2,452
退職給付引当金	2,574	2,452
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,574	2,452

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
勤務費用	159百万円	155百万円
その他	27	108
確定給付制度に係る退職給付費用	187	263

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181百万円、当事業年度186百万円であります。

（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 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	788	750

賞与引当金	177	243
未払事業税	129	170
システム関連費用	198	155
投資有価証券評価損	47	128
出資金評価損	94	94
その他	399	298
繰延税金資産小計	1,835	1,841
評価性引当額	△173	△ 254
繰延税金資産合計	1,661	1,586
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	△71	△ 453
繰延税金負債合計	△230	△ 612
繰延税金資産の純額	1,431	973

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（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。

当事業年度（2021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　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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親会社

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	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(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	19,300 0	関係会社短期貸付金	18,700 ―

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は１年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（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。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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）	1,727	－	－

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。

（ウ）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　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㈱	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	㈱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㈱	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す。

(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　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	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）
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 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注4）	14,917 527	未払手数料 長期差入保証金	3,321 1,054
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）	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	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）	527	―	―

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す。

(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。

(注５)大和プロパティ株式会社は、2020年10月1日付で大和証券株式会社を存続会社とする吸収合併により消滅しております。このため、取引金額は関連当事者であった期間の金額を記載しております。

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　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
１株当たり純資産額　14,732.52円	１株当たり純資産額　14,784.79円
１株当たり当期純利益　4,050.66円	１株当たり当期純利益　3,599.54円

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

(注２)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　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
当期純利益（百万円）	10,556	9,389
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 （2021年９月30日）
資産の部	
流動資産	
現金・預金	2,139
有価証券	250
未収委託者報酬	13,857
関係会社短期貸付金	16,300
その他	369
流動資産合計	32,916
固定資産	

有形固定資産	※1	211
無形固定資産		
ソフトウエア		1,633
その他		134
無形固定資産合計		1,768
投資その他の資産		
投資有価証券		11,373
関係会社株式		3,705
繰延税金資産		786
その他		1,246
投資その他の資産合計		17,111
固定資産合計		19,091
資産合計		52,007

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2021年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		7,322
未払費用		3,879
未払法人税等		795
賞与引当金		711
その他	※2	927
流動負債合計		13,635
固定負債		
退職給付引当金		2,475
役員退職慰労引当金		92
その他		2
固定負債合計		2,571
負債合計		16,206
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	7,594
利益剰余金合計	7,968
株主資本合計	34,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,162
評価・換算差額等合計	1,162
純資産合計	35,801
負債・純資産合計	52,007

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （自　2021年４月１日 至　2021年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		37,075
その他営業収益		295
営業収益合計		37,371
営業費用		
支払手数料		15,707
その他営業費用		6,525
営業費用合計		22,233
一般管理費	※１	5,737
営業利益		9,400
営業外収益	※２	228
営業外費用	※３	87
経常利益		9,540
特別利益		―
特別損失	※４	129
税引前中間純利益		9,411
法人税、住民税及び事業税		2,910
法人税等調整額		92
中間純利益		6,407

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2021年４月１日 至　2021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	10,574	10,948	37,618
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△9,388	△9,388	△9,388
中間純利益	-	-	-	6,407	6,407	6,407
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	-	-	-	△2,980	△2,980	△2,980
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,594	7,968	34,638

	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	947	947	38,566
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△9,388
中間純利益	-	-	6,407
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	214	214	214
当中間期変動額合計	214	214	△2,765
当中間期末残高	1,162	1,162	35,801

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	**10～18年**
器具備品	**４～20年**

（２）無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウエアについては、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．収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

当社は投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。

当社の日々のサービス提供時に当履行義務が充足されるため、一定期間にわたり収益を認識しております。

５．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。

６．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

７．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。

（会計方針の変更）

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年３月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。これによる当中間会計期間の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2021年９月30日現在）
有形固定資産	307百万円

※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（2021年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,726百万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　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
有形固定資産	12百万円
無形固定資産	289百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
投資有価証券売却益	117百万円
時効成立分配金・償還金	28百万円
受取配当金	26百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
投資有価証券売却損	58百万円
未収入金清算費用	9百万円

※４　特別損失の項目

	当中間会計期間 （自　2021年４月　１日 至　2021年９月30日）
投資有価証券評価損	102百万円
出資金評価損	27百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）
当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021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
2021年6月22日定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年3月31日	2021年6月23日

（金融商品関係）

当中間会計期間（2021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、2019年７月４日公表の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、「2019年適用指針」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			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券（※１）	85			85
資産合計	85			85

（※１）2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券250百万円、投資有価証券10,621百万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、短期貸付金、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、2019年適用指針第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	1,677
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2021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　1,677百万円）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	85	55	30
（２）その他	7,691	5,841	1,850
小計	7,777	5,896	1,881
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	3,179	3,398	△219
小計	3,179	3,398	△219
合計	10,956	9,294	1,661

（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。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

注記事項（セグメント情報等）に記載のとおり、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%を超えており、かつ、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、セグメント情報に追加しての記載は行っておりません。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2021年４月１日　至　2021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　2021年４月１日　至　2021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　2021年４月１日　至　2021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　2021年４月１日　至　2021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　2021年４月１日　至　2021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　2021年４月１日 至　2021年９月30日）
１株当たり純資産額	13,724.67円

１株当たり中間純利益	2,456.52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おりません。

（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　2021年４月１日 至　2021年９月30日）	
中間純利益(百万円)	6,407
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,407
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。

① 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。)。

② 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。)。

③ 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④⑤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。

④ 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。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

	①　名　称	②　資本金の額 (2021年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	（注6）	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	（注1）	
	株式会社青森銀行	19,562百万円	（注3）	
	株式会社秋田銀行	14,100百万円	（注3）	
	株式会社愛媛銀行	21,367百万円	（注3）	
	株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	（注3）	
	株式会社鹿児島銀行	18,130百万円	（注3）	
	株式会社群馬銀行	48,652百万円	（注3）	
	株式会社佐賀銀行	16,062百万円	（注3）	
	株式会社中国銀行	15,149百万円	（注3）	
	株式会社北洋銀行	121,101百万円	（注3）	
	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
	株式会社山形銀行	12,008百万円	（注3）	
	労働金庫連合会	120,000百万円	（注11）	

（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）主として中小企業向け融資業を営んでいます。
（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
（注4）全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
（注5）協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
（注6）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7）信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。
（注8）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
（注9）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
（注10）全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。
（注11）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ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充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。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部（信託財産の管理等）を行ないます。

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

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。
①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
②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。
①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
②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。
①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
②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
③「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

2021年５月21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

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の2021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

2022年1月7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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内　知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）の2020年12月1日から2021年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）の2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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

2021年11月25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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井	康治

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2021年４月１日から2022年３月31日までの第63期事業年度の中間会計期間（2021年４月１日から2021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2021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（2021年４月１日から2021年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

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

利害関係

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

以　上

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

(注)２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。