

## 【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4月1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 小松 幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワ上場投信 - トピックス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	20兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	名 称 株式会社東京証券取引所 所在地 東京都中央区日本橋兜町2番1号

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

ダイワ上場投信 - トピックス

### (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。

### (3)【発行（売出）価額の総額】

20兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

10口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

（注1）営業日の午後2時までに取得申込みをした場合には、当日を取得申込受付日として取得申込みを受付けます。

（注2）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】

販売会社は、当該販売会社が定める申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を取得申込者から徴収することができるものとします。当該申込手数料は、当該販売会社および受託会社が収受するものとします。

販売会社については、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/>

### (6)【申込単位】

委託会社は、取得申込みに適用される各銘柄の株式（以下「取得時のバスケット」といいます。）を所定の方法（ 1 ）によって提示するものとします。

受益権の取得申込者は、販売会社（ 2）に対し、取得時のバスケットを単位として受益権の取得申込みを行なうことができます。

取得時のバスケットは、日々変更されます。

原則として、所定の方法に定められる金銭の支払い以外に、金銭によって受益権の取得申込みを行なうことはできません。

（ 1）所定の方法

1. 委託会社は、取得申込受付日の3営業日前までに、取得申込受付日に適用される「取得時のバスケット」を定めます。委託会社は、原則として、取得時のバスケットを、取得申込可能日の毎日、インターネット・サイト「<https://www.daiwa-am.co.jp/etf/>」に掲示します。
2. 「取得時のバスケット」1単位当たりの取得口数は、取得時のバスケットの評価額を取得申込受付日の基準価額で除して得た口数をもとに、委託会社が定めるもの（10口の整数倍とします。）とします。
3. 取得時のバスケットの評価額が、委託会社が定める口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額に満たない場合には、取得申込者はその差額に相当する金銭を支払うものとします。
4. 取得時のバスケットに取得申込者の自社株式等（自社が発行した株式またはその親会社（会社法第2条第1項第4号に規定する親会社をいいます。）が発行した株式をいいます。以下同じ。）が含まれている場合には、当該株式に代えて、当該株式の評価額に、これを信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該評価額に別に定める率を乗じて得た額を加算した金額の金銭を引渡すことによって、取得の申込みに応じることができるものとします。

取得申込者は、販売会社を通じて、委託会社に取得時のバスケットに自社株式等が含まれている旨を通知するものとします。この通知が取得申込時に行なわれなかった場合において、そのことによって取得申込者または信託財産その他に損害が生じた場合には、当該取得申込者がすべての責を負うものとします。

（ 2）販売会社

販売会社については、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/>

(7)【申込期間】

2022年4月2日から2022年10月3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、取得申込みにかかる取得時のバスケットの各銘柄の株式および金銭を、当該取得申込みにかかる信託が設定される日までに販売会社に引渡し、当該取得時のバスケットの各銘柄の

株式を保護預けするものとしします。取得申込みにかかる株式については、販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、受託会社の指定するファンド口座に移管されます。(株式等に金銭が含まれる場合は、当該金銭については、販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、委託会社の口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込まれます。)

(10)【払込取扱場所】

前(9)の引渡しは、販売会社において行なうものとしします。販売会社については、前(6)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、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を東証株価指数の変動率に一致させることを目的とします。

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)	独立区分	補足分類
単位型投信	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券	MRF	
追加型投信	内外	不動産投信	ETF	特殊型
		その他資産 ( )		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

##### (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。

#### < 信託の限度 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、20兆円に相当する株券および金銭を限度として追加信託することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、上記の限度を変更することができます。

#### < ファンドの特色 >

1

信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を東証株価指数（TOPIX）の変動率に一致させることを目的として、東証株価指数に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式に投資します。

- 東証株価指数を構成する全銘柄の株式の時価総額構成比率の95%以上を構成する銘柄の株式を組入れることを原則とします。
- 上記に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行なうこと（有価証券指数等先物取引等を利用することを含みます。）があります。

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

(a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

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

・市況動向、資産規模等によっては、上記の運用が行なえないことがあります。

#### 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パラ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。

- T O P I Xの指数値およびT O P I X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」という。）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T O P I Xに関するすべての権利・ノウハウおよびT O P I Xの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有する。
- (株)東京証券取引所は、T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の停止またはT O P I Xの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができる。
- (株)東京証券取引所は、T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のT O P I Xの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- (株)東京証券取引所は、T O P I X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ない。また、(株)東京証券取引所は、T O P I X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、責任を負わない。
- 「ダイワ上場投信ートピックス」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ない。
- (株)東京証券取引所は、「ダイワ上場投信ートピックス」の購入者または公衆に対し、「ダイワ上場投信ートピックス」の説明、投資のアドバイスをする義務を負わない。
- (株)東京証券取引所は、当社または「ダイワ上場投信ートピックス」の購入者のニーズを、T O P I Xの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではない。
- 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は「ダイワ上場投信ートピックス」の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。

## 2

### 当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

- 受益権は、東京証券取引所に上場され、株式と同様に売買することができます。
  - 売買単位は、10口単位です。
  - 取引方法は、原則として株式と同様です。
- 追加設定は、株式により行ないます。
  - 追加設定にかかる受益権の取得申込者は、取得時のバスケット（東証株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。
  - 原則として、所定の方法に定められる金銭の支払い以外に、金銭によって受益権の取得申込を行なうことはできません。

●受益権を株式と交換することができます。

- 受益者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に対し、委託会社が定める一定口数の整数倍の受益権をもって、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換を申込むことができます。
- 解約申込により受益権を換金することはできません。

●収益分配金は、名義登録受益者に対して支払われます。

- 名義登録受益者とは、計算期間終了日において氏名または名称、住所および個人番号または法人番号（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所）が受託会社に登録されている者をいいます。

**3** 収益の分配は、計算期間ごとに、信託財産について生じる配当、受取利息その他これらに類する収益の額の合計額から支払利子、運用管理費用（信託報酬）その他これらに類する費用の額の合計額を控除した額の全額について行ないます。決算日は毎年7月10日です。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を東証株価指数の変動率に一致させることを目的と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。

- 同指数が加重平均であるため、個別銘柄の組入比率を同指数構成銘柄の時価総額構成比率と全くの同一の比率とすることができないこと
- 運用管理費用（信託報酬）、売買委託手数料等の費用負担
- 株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- 指数の算出に使用する株価と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- 株価指数先物取引と指数の動きの不一致（株価指数先物取引を利用した場合）
- 株式および株価指数先物取引（株価指数先物取引を利用した場合）の最低取引単位の影響
- 株式および株価指数先物取引（株価指数先物取引を利用した場合）の流動性低下時における売買対応の影響
- 指数の構成銘柄の入替えおよび指数の算出方法の変更による影響
- 追加設定時、および組入銘柄の配当金や権利処理等によって信託財産に現金が発生すること

(2) 【ファンドの沿革】

2001年7月11日	信託契約締結、当初設定、運用開始
2001年7月13日	受益証券を東京証券取引所に上場

(3) 【ファンドの仕組み】

名	称	関係業務の内容

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。）（ 1 ）の委託者であり、受益権の募集・発行、信託財産の運用指図、受益権とその信託財産に属する株式との交換の指図、信託財産の計算等を行ないます。
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（ 1 ）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、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。
取扱窓口	販売会社	受益権の募集、交換の取扱い等に関する委託会社および受託会社との三者間契約（ 2 ）に基づき、受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務等を行ないます。

- 1：「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。
- 2：受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務の内容等が規定されています。

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から收受します。

#### < 委託会社の概況（2022年1月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

#### ・ 沿革

- 1959年12月12日 大和証券投資信託委託株式会社として設立
- 1960年 2月17日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
- 1960年 4月 1日 営業開始
- 1985年11月 8日 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
- 1995年 5月31日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
- 1995年 9月14日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
- 2007年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。  
（金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）
- 2020年 4月 1日 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

#### ・ 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

委託会社は、信託財産の運用にあたっては、次の基本方針にしたがって、その指図を行ないます。

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を東証株価指数の変動率に一致させることを目的として、東証株価指数に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式に対する投資として運用を行ないます。

東証株価指数を構成する全銘柄の株式の時価総額構成比率の95%以上を構成する銘柄の株式を組入れることを原則とします。

前 および前 の基本方針に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行なうこと（有価証券指数等先物取引等を利用することを含みます。）があります。

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

イ．投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

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

市況動向、資産規模等によっては、上記の運用を行なえないことがあります。

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

### (2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
6. 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。）

なお、前1.の証券または証書を「株式」といいます。

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

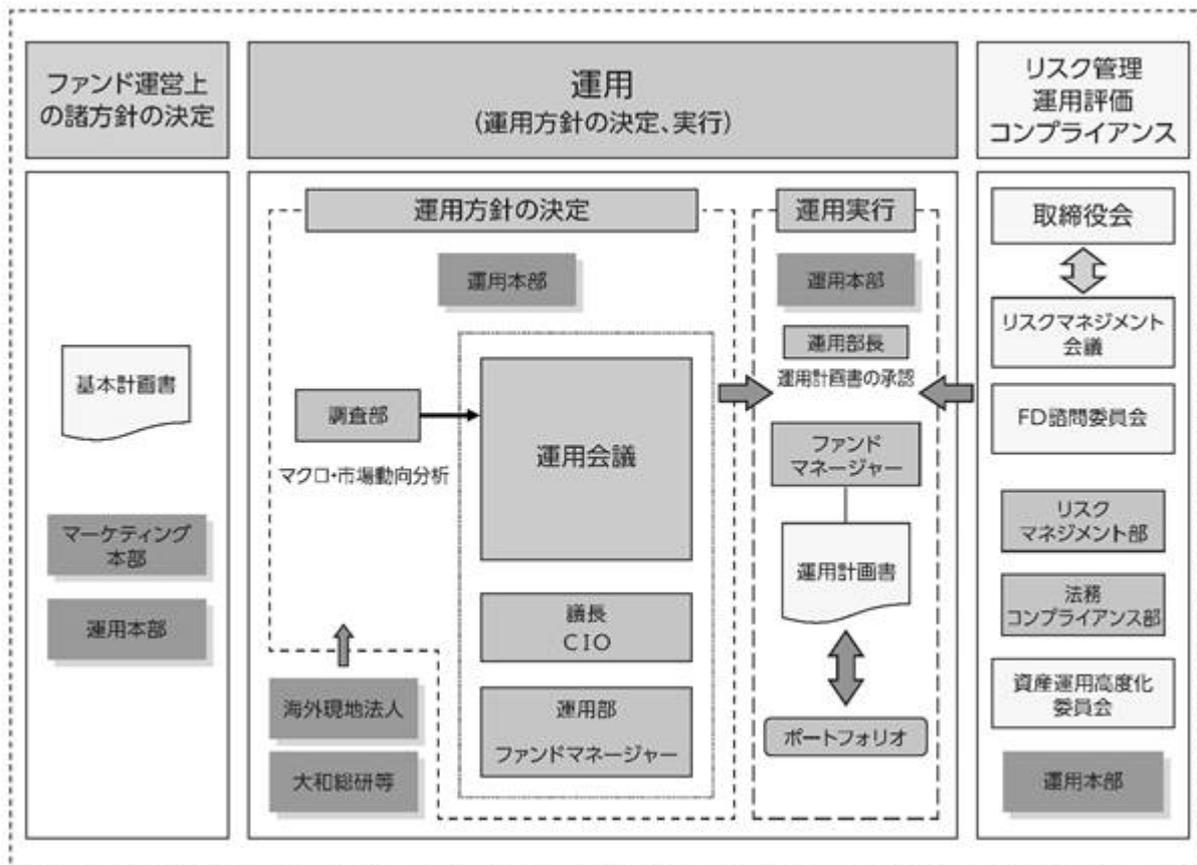
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

### (3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．基本的な運用方針の決定

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

#### ハ．運用計画書の作成・承認

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

#### 職務権限

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

#### イ．CIO（Chief Investment Officer）（3名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

#### ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

#### ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

#### ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

#### ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

#### 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。

#### 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2022年1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】

収益の分配は、計算期間ごとに、信託財産について生じる配当、受取利息その他これらに類する収益の額の合計額から支払利子、信託報酬その他これらに類する費用の額の合計額を控除した額の全額について行ないます。

#### (5)【投資制限】

株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資する株式の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、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。）に上場されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

ロ．前イ．にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとし、

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

デリバティブ取引等（信託約款）

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

有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への投資は、行ないません。

### 信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一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。

## 3【投資リスク】

### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

#### その他

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

### (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。くわしくは「第2 管理及び運営」をご参照下さい。

### (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。

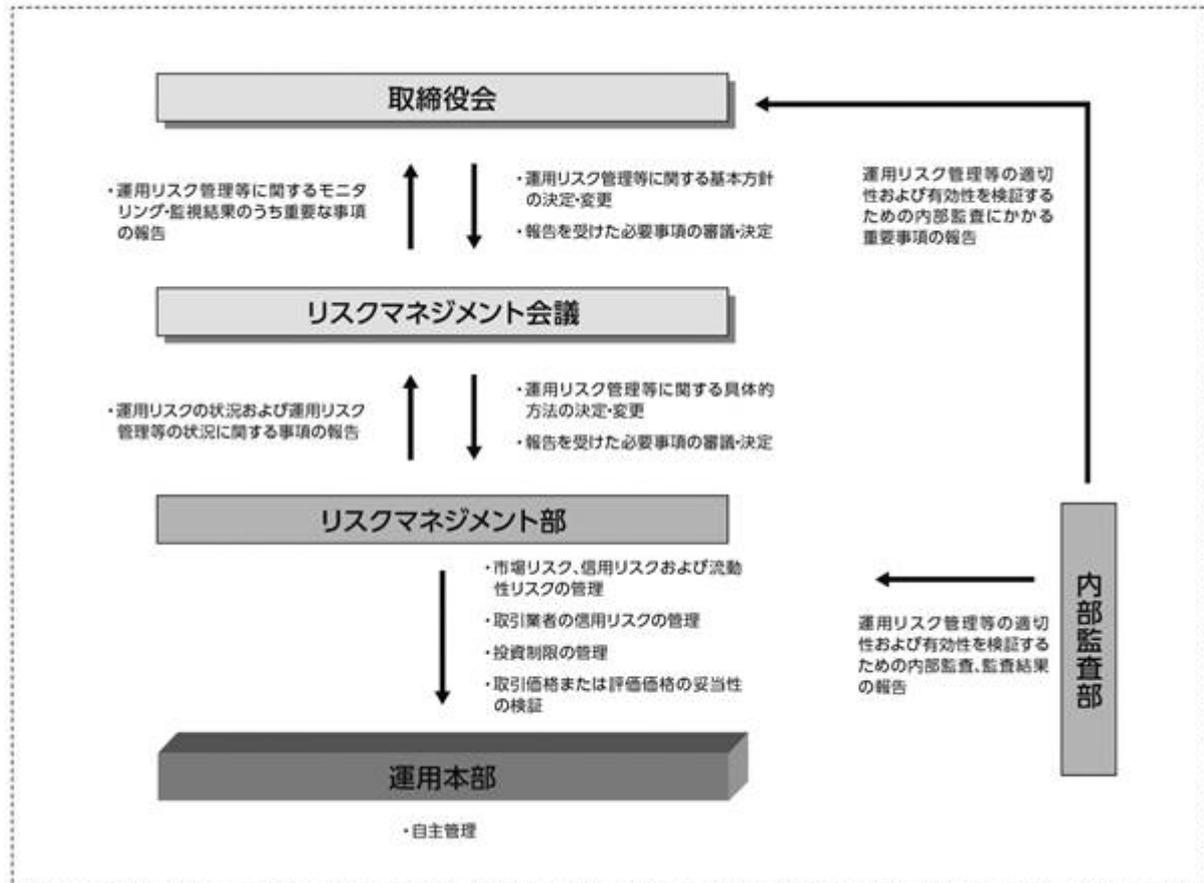
### 流動性リスクに関する事項

- 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性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。

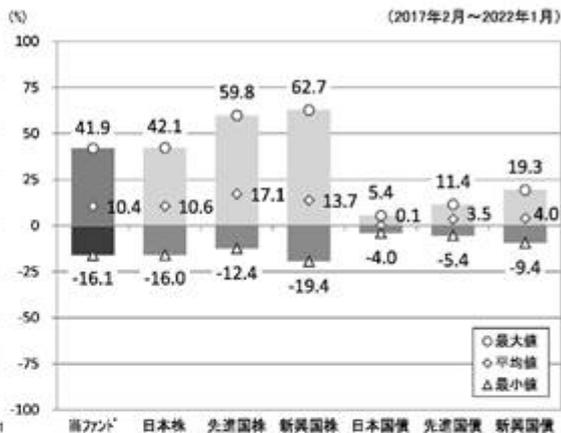
## 参考情報

- 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・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

### ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村証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証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

販売会社は、当該販売会社が定める申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を取得申込者から徴収することができるものとします。当該申込手数料は、当該販売会社および受託会社が収受するものとします。

販売会社については、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/>

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

## (2)【換金（解約）手数料】

### 換金手数料

販売会社は、受益権の交換または買取りに際して、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を受益者から徴収することができるものとします。当該手数料は、販売会社ならびに受託会社が収受するものとします。

販売会社については、前(1)をご参照下さい。

信託財産留保額

ありません。

交換手数料は、受益権の交換に関する事務等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

## (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、次のイ.の額にロ.の額を加算して得た額とします。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します。

イ. 信託財産の純資産総額に年率10,000分の12.1（税抜10,000分の11）以内を乗じて得た額

ロ. 信託財産に属する株式の貸付けにかかる品貸料（貸付株券から発生する配当金相当額等を含まないものとし、株式の貸付けにあたって担保として現金を受入れた場合には、当該現金の運用により生じたとみなし得る収益を加算し、貸付けの相手方に支払う当該現金に対する利息額を控除するものとします（控除した額が負数のときは零とします。）。）に100分の55（税抜100分の50）以内の率を乗じて得た額。

なお、提出日現在における上記イ.およびロ.に定める率は、次のとおりとなっております（今後、変更されることがあります。）。

イ. 年率10,000分の12.1（税抜10,000分の11）

ロ. 100分の55（税抜100分の50）

ただし、イ.とロ.の合計は、年率0.275%以内（税抜0.25%以内）

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。

提出日現在における信託報酬にかかる委託会社、受託会社への配分については、次のとおりとなっております（今後、変更されることがあります。）。

イ. 前 イ.の報酬

委託会社 年率10,000分の7.5（税抜）

受託会社 年率10,000分の3.5（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。

ロ. 前 ロ.の報酬

委託会社 報酬の50%

受託会社 報酬の50%

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、目論見書作成等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4) 【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息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。なお、受益権の上場にかかる費用および対象指数の商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（以下「商標使用料」といいます。）ならびにこれらにかかる消費税等に相当する金額を、受益者の負担として信託財産中から支弁することができます。ただし、各計算期間において、信託財産中から支弁する受益権の上場にかかる費用および商標使用料の合計額は、信託財産の純資産総額に年率10,000分の6.6（税抜10,000分の6）を乗じて得た額を超えないものとし、

\* 提出日現在、商標使用料は信託財産の純資産総額に、年率10,000分の3.3（税抜10,000分の3）以内を乗じて得た額（ただし、165万円(税抜150万円)を下回る場合は、165万円(税抜150万円)）となります。

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

（ ）売買委託手数料などの「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。

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は特定株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

##### イ．受益権の売却時

受益権を売却される場合には、「申告分離課税」の取扱いとなり、譲渡益に対して20%（所得税15%および地方税5%）の税率で課税されます。

ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

受益権を譲渡して生じた損失金額は上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益・償還差益および申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得・利子所得と通算できます。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。売却時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

##### ロ．収益分配金の受取時

収益分配金は、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。

ただし、2037年12月31日まで、収益分配金の受取時に、収益分配金に対する所得税の源泉徴収額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

収益分配金については、源泉徴収のみで課税関係が終了する申告不要制度を選択することができます。

一方、確定申告を行なう場合には、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択します。総合課税を選択した場合は、配当控除の適用があり、その取扱いは、株式の配当金と同様となります。

#### ハ．受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、前イ．と同様の取扱いとなります。

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

#### 法人の投資者に対する課税

##### イ．受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、受益権の取得価額と売却価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されます。

##### ロ．収益分配金の受取時

収益分配金は、配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収（ ）されます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

ただし、2037年12月31日までは基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。益金不算入制度が適用されます。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

#### ハ．受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、前イ．と同様の取扱いとなります。

( ) 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

( ) 上記は、2022年1月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】（2022年1月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	7,191,376,174,700	98.66
内 日本	7,191,376,174,700	98.66
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	97,797,457,138	1.34
純資産総額	7,289,173,631,838	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)	97,677,825,000	1.34
内 日本	97,677,825,000	1.34

(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】（2022年1月31日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	140,546,100	1,932.95 271,669,234,586	2,245.50 315,596,267,550	4.33
2 ソニーグループ	日本	株式	電気機 器	17,381,800	11,098.90 192,918,864,480	12,720.00 221,096,496,000	3.03
3 キーエンス	日本	株式	電気機 器	2,514,200	56,675.47 142,493,479,522	58,230.00 146,401,866,000	2.01
4 三菱UFJフィナン シャルG	日本	株式	銀行業	171,627,400	588.33 100,973,920,807	691.10 118,611,696,140	1.63
5 リクルートホール ディングス	日本	株式	サービ ス業	20,453,900	5,684.24 116,265,031,813	5,595.00 114,439,570,500	1.57

6	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1,760,600	46,557.50 81,969,141,121	54,730.00 96,357,638,000	1.32
7	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	28,483,600	2,857.80 81,400,479,322	3,267.00 93,055,921,200	1.28
8	信越化学	日本	株式	化学	4,666,200	17,739.68 82,776,922,090	19,040.00 88,844,448,000	1.22
9	任天堂	日本	株式	その他製品	1,566,200	62,919.41 98,544,391,364	56,160.00 87,957,792,000	1.21
10	ダイキン工業	日本	株式	機械	3,535,100	21,479.57 75,932,430,980	23,825.00 84,223,757,500	1.16
11	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	16,326,700	7,282.78 118,903,828,575	5,011.00 81,813,093,700	1.12
12	HOYA	日本	株式	精密機器	5,414,200	14,933.03 80,850,421,307	14,755.00 79,886,521,000	1.10
13	三菱商事	日本	株式	卸売業	20,478,200	3,170.84 64,933,108,056	3,877.00 79,393,981,400	1.09
14	日立	日本	株式	電気機器	13,345,500	6,549.65 87,408,460,437	5,939.00 79,258,924,500	1.09
15	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	18,943,200	3,723.27 70,530,769,898	4,113.00 77,913,381,600	1.07
16	本田技研	日本	株式	輸送用機器	21,846,400	3,444.91 75,258,945,486	3,354.00 73,272,825,600	1.01
17	武田薬品	日本	株式	医薬品	21,808,600	3,639.88 79,380,698,536	3,328.00 72,579,020,800	1.00
18	日本電産	日本	株式	電気機器	7,191,400	12,543.85 90,207,857,918	10,090.00 72,561,226,000	1.00
19	KDDI	日本	株式	情報・通信業	19,849,500	3,453.42 68,548,741,878	3,645.00 72,351,427,500	0.99
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	19,114,400	3,192.50 61,022,729,402	3,667.00 70,092,504,800	0.96
21	村田製作所	日本	株式	電気機器	8,150,600	8,889.69 72,456,369,251	8,539.00 69,597,973,400	0.95
22	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	3,133,100	16,086.51 50,400,650,015	19,880.00 62,286,028,000	0.85
23	東京海上HD	日本	株式	保険業	9,013,000	5,111.39 46,069,008,483	6,830.00 61,558,790,000	0.84
24	三井物産	日本	株式	卸売業	21,222,200	2,521.08 53,503,040,947	2,853.50 60,557,547,700	0.83
25	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	10,690,900	5,018.28 53,649,976,897	5,593.00 59,794,203,700	0.82

26	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	41,239,100	1,489.53 61,427,240,258	1,434.00 59,136,869,400	0.81
27	第一三共	日本	株式	医薬品	21,804,600	2,255.02 49,169,842,517	2,565.00 55,928,799,000	0.77
28	ファナック	日本	株式	電気機器	2,435,100	25,758.50 62,724,539,845	22,460.00 54,692,346,000	0.75
29	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	34,999,200	1,560.09 54,601,996,831	1,550.00 54,248,760,000	0.74
30	デンソー	日本	株式	輸送用機器	6,109,000	7,417.24 45,311,946,654	8,494.00 51,889,846,000	0.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.66%
合計	98.66%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.27%
建設業	2.25%
食料品	3.34%
繊維製品	0.48%
パルプ・紙	0.22%
化学	6.63%
医薬品	4.70%
石油・石炭製品	0.43%
ゴム製品	0.70%
ガラス・土石製品	0.77%
鉄鋼	0.76%
非鉄金属	0.77%
金属製品	0.61%
機械	5.33%
電気機器	18.05%
輸送用機器	8.60%
精密機器	2.66%
その他製品	2.27%

電気・ガス業	1.11%
陸運業	2.96%
海運業	0.55%
空運業	0.40%
倉庫・運輸関連業	0.18%
情報・通信業	7.75%
卸売業	5.49%
小売業	4.17%
銀行業	5.26%
証券、商品先物取引業	0.75%
保険業	2.23%
その他金融業	1.18%
不動産業	1.93%
サービス業	5.76%
合計	98.66%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 04 03月	買建	5,145	101,747,243,750	97,677,825,000	1.34%

(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。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)	東京証券取 引所 市場相場
第11計算期間末 (2012年7月10日)	293,772,258,294	299,715,502,142	766.2	781.7	767

第12計算期間末 (2013年7月10日)	935,579,160,460	943,078,552,355	1,222.6	1,232.4	1,222
第13計算期間末 (2014年7月10日)	1,123,731,191,021	1,137,960,316,067	1,295.2	1,311.6	1,294
第14計算期間末 (2015年7月10日)	1,279,925,104,350	1,298,892,337,720	1,633.0	1,657.2	1,632
第15計算期間末 (2016年7月10日)	1,178,144,843,356	1,202,723,169,102	1,246.3	1,272.3	1,247
第16計算期間末 (2017年7月10日)	2,472,283,433,116	2,510,269,439,522	1,672.7	1,698.4	1,673
第17計算期間末 (2018年7月10日)	3,714,241,986,557	3,781,221,701,176	1,780.0	1,812.1	1,782
第18計算期間末 (2019年7月10日)	4,327,811,695,639	4,420,375,738,345	1,631.7	1,666.6	1,631
第19計算期間末 (2020年7月10日)	5,463,405,113,650	5,578,156,609,339	1,599.7	1,633.3	1,600
2021年1月末日	6,691,243,020,702	-	1,902.6	-	1,904
2月末日	6,921,103,472,110	-	1,961.9	-	1,953
3月末日	7,433,605,582,235	-	2,073.4	-	2,076
4月末日	7,158,959,006,890	-	2,014.6	-	2,018
5月末日	7,309,647,035,254	-	2,042.1	-	2,044
6月末日	7,417,681,690,209	-	2,066.0	-	2,065
第20計算期間末 (2021年7月10日)	7,160,029,881,685	7,294,591,878,160	1,995.4	2,032.9	1,999
7月末日	7,111,821,629,673	-	1,983.5	-	1,984
8月末日	7,431,854,569,893	-	2,046.1	-	2,043
9月末日	7,772,815,934,700	-	2,135.1	-	2,137
10月末日	7,645,194,639,908	-	2,104.6	-	2,103
11月末日	7,377,381,751,072	-	2,028.1	-	2,028
12月末日	7,626,724,789,335	-	2,098.3	-	2,097
2022年1月末日	7,289,173,631,838	-	1,996.8	-	1,999

(注) 計算期間末日が休業日の場合は、前営業日の市場相場を記載しております。

#### 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第11計算期間	15.50
第12計算期間	9.80
第13計算期間	16.40
第14計算期間	24.20

第15計算期間	26.00
第16計算期間	25.70
第17計算期間	32.10
第18計算期間	34.90
第19計算期間	33.60
第20計算期間	37.50
2021年7月11日～ 2022年1月10日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第11計算期間	11.3
第12計算期間	60.8
第13計算期間	7.3
第14計算期間	27.9
第15計算期間	22.1
第16計算期間	36.3
第17計算期間	8.3
第18計算期間	6.4
第19計算期間	0.1
第20計算期間	27.1
2021年7月11日～ 2022年1月10日	5.3

## (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	147,354,900	39,691,586
第12計算期間	425,333,390	43,524,406
第13計算期間	501,946,560	399,561,055
第14計算期間	258,772,110	342,631,712
第15計算期間	282,232,170	120,681,923
第16計算期間	786,531,040	253,796,537
第17計算期間	819,848,810	211,308,063
第18計算期間	646,528,910	80,859,547
第19計算期間	817,564,030	54,605,778
第20計算期間	375,247,580	202,150,760
2021年7月11日～ 2022年1月10日	116,767,830	71,428,607

## (参考情報) 運用実績

## ●ダイワ上場投信-トピックス

2022年1月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	19,968円
純資産総額	72,891億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-4.8%
3カ月間	-5.1%
6カ月間	0.7%
1年間	6.9%
3年間	29.2%
5年間	38.6%
設定来	114.5%



※上記の「基準価額の騰落率」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口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 375円 設定来分配金合計額: 3,954.4円

決算期	第9期 10年7月	第10期 11年7月	第11期 12年7月	第12期 13年7月	第13期 14年7月	第14期 15年7月	第15期 16年7月	第16期 17年7月	第17期 18年7月	第18期 19年7月	第19期 20年7月	第20期 21年7月
分配金	134.9円	153円	155円	98円	164円	242円	260円	257円	321円	349円	336円	375円

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

## 主要な資産の状況

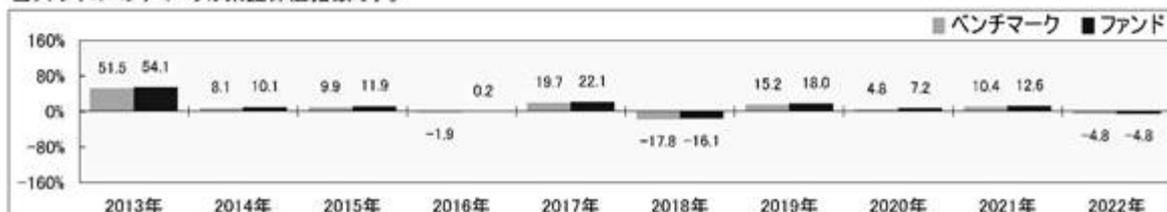
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,181	98.7%	電気機器	18.1%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.3%
国内株式先物	1	1.3%	輸送用機器	8.6%	ソニーグループ	電気機器	3.0%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	7.8%	キーエンス	電気機器	2.0%
コール・ローン、その他	-	1.3%	化学	6.6%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.6%
合計	2,182	-	サービス業	5.8%	リクルートホールディングス	サービス業	1.6%
株式 市場・上場別構成			卸売業	5.5%	TOPIX先物 0403月	-	1.3%
一部(東証・名証)		98.7%	機械	5.3%	東京エレクトロン	電気機器	1.3%
二部(東証・名証)		-	銀行業	5.3%	日本電信電話	情報・通信業	1.3%
新興市場他		-	医薬品	4.7%	信越化学	化学	1.2%
その他		-	その他	31.1%	任天堂	その他製品	1.2%
合計		98.7%	合計	98.7%	合計		18.9%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。



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

・2022年は1月31日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- イ．受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。
- ロ．受益権の取得申込者は、東証株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの（以下「取得時のバスケット」といいます。）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。また、当該取得時のバスケットの評価額（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評価して得た額をいいます。以下同じ。）をもって、それに相当するものとして委託会社が定める一定口数の受益権を単位として取得するものとします。受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額とします。
- ハ．受益権の取得申込者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後2時）までに取得申込みをした場合には、当日を取得申込受付日として委託会社は当該取得申込みを受付けます。
- ニ．取得申込受付日に対応する取得時のバスケットを構成する各株式の銘柄名とその数量は、委託会社が取得申込受付日以前の別に定める期日に別に定める方法により提示するものとします。
- ホ．前ロ．にかかわらず、受益権の取得申込者は、取得時のバスケットの評価額が取得する一定口数の受益権の評価額に満たない場合には、その差額に相当する部分を金銭をもって支払うものとします。
- ヘ．前ロ．にかかわらず、取得時のバスケットに受益権の取得申込者が発行した株式またはその親会社（会社法第2条第1項第4号に規定する親会社をいいます。以下同じ。）が発行した株式（以下「自社株式等」といいます。）が含まれる場合には、当該取得申込者は当該自社株式等に代えて当該自社株式等に相当する金額（評価額により算出したものに限ります。）に、当該自社株式等を信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該金額に別に定める率を乗じて得た額を加算して得た金額の金銭をもって取得することができるものとします。
- ト．前ヘ．に該当する場合には、受益権の取得申込者は、販売会社を通じてその旨を委託会社に通知するものとします。この通知が取得申込みの際に行なわれなかった場合において、そのことによって当該取得申込者または信託財産その他に損害が生じた場合には、当該取得申込者がすべての責を負うものとします。
- チ．前ロ．にかかわらず、取得時のバスケットに、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは当該権利を取得することができる者が確定する日またはその前営業日に取得の申込みに応じて受益権の受渡しが行なわれることとなる株式（以下本チ．において「配当落ち株式等」といいます。）が含まれる場合には、当該取得申込者は当該配当落ち株式等に代えて当該配当落ち株式等に相当する金額（評価額により算出したものに限ります。）に、当該配当落ち株式等を信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該金額に別に定める率を乗じて得た額を加算して得た金額の金銭をもって取得することができるものとします。
- リ．販売会社は、取得申込みにかかる取得時のバスケットの各銘柄の株式を、取得申込みにかかる信託が設定される日までに、別に定める契約に基づき委託会社に代わって受託会社に引渡すものとします。
- ヌ．販売会社は、受益権の取得申込者が引渡すべき取得時のバスケットの各銘柄の一部の引渡日を別に定める方法に基づいて指定する場合には、担保金を差入れるものとします。なお、担保金に付利は行なわないものとします。担保金が差入れられた場合には、委託会社は信託財産への担保金の受入れの指図を行なうものとします。

ル．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、前リ．に定める株式（前ホ．、前ヘ．および前チ．に該当する場合の金銭を含みます。）または前ヌ．に定める担保金の引渡しと引換えに、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。また、別に定める金融商品取引清算機関（金融商品取引法第2条第29項に規定する金融商品取引清算機関とし、以下「清算機関」といいます。）の業務方法書（以下「業務方法書」といいます。）に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受け付けによって生じる株式および金銭の委託会社への受渡または支払いの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、振替機関等における当該清算機関の名義の口座に口数の増加の記載または記録が行なわれ、取得申込者が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における口数の増加の記載または記録は、当該清算機関と販売会社（販売会社による清算機関への債務の負担の申込みにおいて、当該販売会社の委託を受けて金融商品取引法第2条第27項に定める有価証券等清算取次ぎが行なわれる場合には、当該有価証券等清算取次ぎを行なう金融商品取引業者または登録金融機関を含みます。）との間で振替機関等を介して行なわれます。別に定める金融商品取引清算機関は、株式会社日本証券クリアリング機構とします。

ヲ．委託会社は、原則として、次の1.から4.までに該当する場合は、受益権の取得申込みの受け付けを停止します。なお、次の1.から3.までに該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の取得申込みを受け付けることがあります。

- 1．東証株価指数構成銘柄の配当落日および権利落日
- 2．東証株価指数構成銘柄の変更および増減資等に伴う株数の変更日の2営業日前から起算して6営業日以内
- 3．計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）
- 4．前1.から前3.までのほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めたとき

ワ．販売会社は、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を、受益権の取得申込者から徴収することができるものとします。当該手数料は、販売会社ならびに受託会社が収受するものとします。

カ．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および委託会社が必要と認めるときは、取得申込みの受け付けの中止、取得申込みの受け付けの取消またはその両方を行なうことができます。

ヨ．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、取得申込みにかかる取得時のバスケットの各銘柄の株式および金銭または担保金について、受入れまたは振替済みの通知を受けた場合は、振替機関に対し追加信託が行なわれた旨を通知するものとします。ただし、業務方法書に定めるところにより、当該株式および金銭の委託会社への受渡または支払いの債務を清算機関が負担する場合には、受託会社は、委託会社の指図に基づき、当該株式および金銭についての受入れまたは振替済みの通知にかかわらず、振替機関に対し追加信託が行なわれた旨を通知するものとします。

## 2【換金（解約）手続等】

### <解約>

受益者は、自己に帰属する受益権（受託会社が「3 資産管理等の概要(5) 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からの「3 資産管理等の概要(5)」の規定による請求により買取った受益権を除きます。）について、信託期間中において信託契約の一部解約の実行を請求することはできません。

### <交換>

イ．受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、当該受益権と当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換（以下「交換」といいます。）を請求することができます。

ロ．受益者が交換の請求をするときは、販売会社に対し、委託会社が定める一定口数の整数倍の振替受益権をもって、販売会社所定の方法で行なうものとします。

ハ．交換を請求しようとする受益者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後2時）までに交換請求をした場合には、当日を交換請求受付日として委託会社は当該交換請求を受付けます。

ニ．委託会社は、交換に際し、信託財産に属する株式の評価額をもって、それに相当する口数の振替受益権と交換するものとします。交換に際し、振替受益権の価額は、交換請求受付日の基準価額とします。

ホ．前イ．にかかわらず、委託会社は、原則として、次の1.から3.までに該当する場合は、振替受益権の交換請求の受け付けを停止します。なお、次の1.から2.までに該当する場合であっても、委託会社の判断により、振替受益権の交換請求を受け付けることがあります。

1．東証株価指数構成銘柄の変更および増減資等に伴う株数の変更日の2営業日前から起算して6営業日以内

2．計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）

3．前1.から前2.までのほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

ヘ．販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続きを行なうものとします。なお、業務方法書に定めるところにより、当該販売会社が、振替受益権の委託会社への受渡しの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、当該清算機関が振替受益権の抹消にかかる手続きを行ないません。当該抹消にかかる手続きおよび後ヨ．に掲げる交換株式にかかる振替請求が行なわれた後に、振替機関は、後ル．または後ヲ．に定める当該交換にかかる振替受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座に前イ．の交換の請求を行なった受益者にかかる当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

ト．受託会社は、後ル．または後ヲ．の委託会社の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび後タ．に定める抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ、抹消したものとして取扱います。

チ．販売会社は、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を交換請求者から徴収することができるものとします。当該手数料は、販売会社ならびに受託会社が収受するものとします。

- リ．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および委託会社が必要と認めるときは、交換請求の受付けの中止、交換請求の受付けの取消またはその両方を行なうことができます。
- ヌ．前リ．により、交換請求の受付けを中止したときは、受益者は、当該受付中止以前に行なった当日の交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換の請求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交換の請求を受付けたものとして計算されるものとします。
- ル．委託会社は、交換の請求を受付けた場合には、当該請求にかかる振替受益権と、当該振替受益権の信託財産に対する持分に相当する株式として委託会社が指定するものとの交換を行なうよう受託会社に指図します。
- ロ．前ル．にかかわらず、委託会社が指定する株式に自社株式等が含まれる場合には、原則として、委託会社は、前ル．の請求にかかる振替受益権の口数から当該自社株式等に相当する金額（評価額により算出したものから、当該株式売却および当該売却代金により信託財産中の株式の銘柄およびその数量を変更するための取引にかかる経費に相当する金額として、当該評価額に別に定める率を乗じて得た額を減じた金額とします。）に相当する口数を除いた口数の振替受益権と、当該振替受益権の持分に相当する株式（当該自社株式等を除きます。）を交換するよう受託会社に指図するものとします。
- ワ．前ロ．に該当する場合には、交換請求を行なう受益者は、販売会社を通じてその旨を委託会社に通知するものとします。この通知が交換請求の際に行なわれなかった場合において、そのことによって交換請求者または信託財産その他に損害が生じた場合には、交換請求者がすべての責を負うものとします。
- カ．前ル．にかかわらず、前ル．の委託会社が指定する株式に、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは当該権利を取得することができる者が確定する日に交換の申込みに応じて受益権の受渡しが行なわれることとなる株式（以下本カ．において「配当落ち株式等」といいます。）が含まれる場合には、委託会社は、当該配当落ち株式等に代えて当該配当落ち株式等の評価額（当該評価額から、当該株式売却および当該売却代金により信託財産中の株式の銘柄およびその数量を変更するための取引にかかる経費に相当する金額として、当該評価額に別に定める率を乗じて得た額を減じた額とします。）に相当する金銭の交付をもって交換するよう受託会社に指図することができるものとします。
- コ．受託会社は、前ヘ．に掲げる手続きが行なわれたことを確認したときには、委託会社の指図にしたがい、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式にかかる振替請求および金銭の交付を行なうものとします。ただし、業務方法書の定めるところにより、前ク．に掲げる交換の請求を受付けた販売会社が、振替受益権の委託会社への受渡しの債務の負担を当該清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、受託会社は、前ヘ．に掲げる手続きにかかわらず、委託会社の指図にしたがい、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式にかかる振替請求および金銭の交付を行なうものとします。別に定める期日から、受益者への交換株式の交付に際しては振替機関等の口座に前イ．の交換の請求を行なった受益者にかかる株数の増加の記載または記録が行なわれ、受益者への金銭の交付については販売会社において行なわれます。
- ク．委託会社は、交換請求受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したものとして取扱うこととし、受託会社は、当該受益権にかかる振替受益権が交換株式の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

#### < 買取り >

- イ．販売会社は、次に該当する場合で、受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。
1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権
  2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき

- ロ．前イ．の買取価額は、買取申込みを受付けた日の基準価額から、販売会社が定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を控除した価額とすることができます。
- ハ．販売会社は、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、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することができます。
- 二．前ハ．により受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取停止以前に行なった当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受付けたものとして、前ロ．に準じて計算されたものとします。

### 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10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）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）主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東証株価指数に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式：  
原則として金融商品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) 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7月11日から翌年7月10日までとします。

#### (5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が200万口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合

- 意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となったときまたは東証株価指数が廃止された場合には、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。
  3. 委託会社は、前1.および前2.の各事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
  4. 前3.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。
  5. 前4.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。
  6. 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信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
  7. 前4.から前6.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約する場合には適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前4.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も同じとします。
  8. 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。
  9. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
  10. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

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

6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

前 の1.から7.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 の4.または前 の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

受益権の募集、交換の取扱い等に関する委託会社、受託会社および販売会社との三者間契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社、受託会社もしくは販売会社の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。ただし、業務方法書に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受付けによって生じる株式および金銭の委託会社への受渡または支払いの債務の負担を当該清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合の信託契約締結当初または追加信託当初の受益者は当該清算機関とします。

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

##### <支払方法>

イ. 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。

ロ. 計算期間終了日において氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者）にあっては、氏名または名称および住所とします。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、受託会社は収益分

配金を当該名義登録受益者に支払います。この場合、名義登録受益者が当該計算期間終了日における振替制度移行後も受益証券を保有している所有者と異なる場合であっても、委託会社および受託会社は当該所有者に対して収益分配金の支払いおよびその他損害についてその責を負わないものとします。

ハ．受益者は、原則として前口．に規定する登録を当ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の取引参加者を經由して行なうものとします。この場合、当該取引参加者は、当該取引参加者が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

ただし、証券金融会社等は前口．に規定する登録を受託会社に対して直接行なうことができます。

ニ．社振法関係法令等に基づき、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権の名義登録の手続きは原則として以下のとおりとします。

(a) 受益権は、前ハ．の取引参加者の振替口座簿に口数が記載または記録されることにより、当該振替口座簿に記載または記録された口数に応じた受益権が帰属します。

(b) 前ハ．の取引参加者は、計算期間終了日までに当該取引参加者にかかる前(a)の受益権の受益者の氏名もしくは名称および住所その他受託会社が定める事項を書面等により受託会社に届出するものとします。また、届出た内容に変更が生じた場合は、当該取引参加者所定の方法による当該受益者からの申し出に基づき、当該取引参加者はこれを受託会社に通知するものとします。

(c) 前ハ．の取引参加者は、計算期間終了日現在の当該取引参加者にかかる前(a)の受益権の受益者の振替機関の定める事項を(当該取引参加者が直接口座管理機関でない場合はその上位機関を通じて)振替機関に報告するとともに、振替機関は業務規程等に基づき、これを受託会社に通知するものとします。

ホ．追加信託時の受益者については、前口．に規定する登録を行なったうえで、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されるものとします。

ヘ．前口．に規定する収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定した預金口座等に当該収益分配金を振込む方式により行なうものとします。なお、名義登録受益者が前ハ．に規定する取引参加者と別途収益分配金の取扱いにかかる契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとします。

ト．受託会社は、支払開始日から5年経過した後に、前口．の名義登録受益者にかかる収益分配金の未払い残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとします。

チ．受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

#### 信託終了時の交換等

イ．委託会社は、信託が終了することとなったときは、委託会社が別に定める一定口数以上の受益権を有する受益者に対しては、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権または当該受益権を表示する受益証券と引換えに交換するものとします。この場合は、「2 換金(解約)手続等」の規定に準じるものとします。

ロ．委託会社が信託の終了に関して指定する販売会社は、委託会社が別に定める一定口数未満の受益権について買取るものとします。この場合には、当該販売会社が別に定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

ハ．信託終了に際して、委託会社が信託終了に関して指定する販売会社は、その所有にかかるすべての受益権を交換請求するものとします。交換により引渡される株式に当該販売会社の自社株式等が含ま

れる場合には、委託会社は、受託会社に対しこれを売却する指図をするとともに、当該自社株式等の評価額に相当する口数の受益権を、受託会社は信託財産をもって買取るものとします。

二．受益者が、前イ．の交換について、交換開始日から10年間その交換の請求をしないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

#### 交換請求権および買取請求権

受益者は、保有する受益権について、交換または買取りを請求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7月11日から2021年7月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ上場投信 - トピックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 2020年7月10日現在	第20期 2021年7月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,260,908,721,953	609,558,265,442
株式	2 3 5,454,497,452,700	2 3 7,131,149,308,360
未収入金	12,826,102,750	-
未収配当金	5,829,639,416	7,278,348,963
未収利息	27,949,473	11,211,110
前払金	4,468,873,300	3,602,472,000
その他未収収益	4 2,791,546,255	4 1,782,106,099
差入委託証拠金	1,289,200,000	2,477,364,000
流動資産合計	6,742,639,485,847	7,755,859,075,974
資産合計	6,742,639,485,847	7,755,859,075,974
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	479,659,500	487,270,000
未払金	5,470,632,300	3,753,205,000
未払収益分配金	114,751,495,689	134,561,996,475
未払受託者報酬	1,301,487,508	1,618,929,354
未払委託者報酬	2,404,980,887	3,196,684,411
未払利息	-	703,747
受入担保金	1,154,136,652,209	451,324,642,607
その他未払費用	689,464,104	885,762,695
流動負債合計	1,279,234,372,197	595,829,194,289
負債合計	1,279,234,372,197	595,829,194,289
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 4,269,028,857,500	1 4,485,399,882,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,194,376,256,150	2,674,629,999,185
（分配準備積立金）	198,337,368	88,592,191
元本等合計	5,463,405,113,650	7,160,029,881,685
純資産合計	5,463,405,113,650	7,160,029,881,685
負債純資産合計	6,742,639,485,847	7,755,859,075,974

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第19期		第20期	
	自	2019年7月11日 至 2020年7月10日	自	2020年7月11日 至 2021年7月10日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		109,123,790,562		133,512,207,920
受取利息		948,757,442		819,712,841
有価証券売買等損益		78,381,777,316		1,366,287,741,066
派生商品取引等損益		8,274,034,270		11,880,974,000
その他収益	1	12,956,138,897	1	10,334,029,735
<b>営業収益合計</b>		<b>52,920,943,855</b>		<b>1,522,834,665,562</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		400,320,959		239,615,407
受託者報酬		2,535,192,113		3,087,973,040
委託者報酬		4,673,587,382		6,009,869,055
その他費用		680,366,537		876,241,696
<b>営業費用合計</b>		<b>8,289,466,991</b>		<b>10,213,699,198</b>
<b>営業利益</b>		<b>44,631,476,864</b>		<b>1,512,620,966,364</b>
<b>経常利益</b>		<b>44,631,476,864</b>		<b>1,512,620,966,364</b>
<b>当期純利益</b>		<b>44,631,476,864</b>		<b>1,512,620,966,364</b>
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,012,480,653,139		1,194,376,256,150
剰余金増加額又は欠損金減少額		274,515,576,786		228,584,980,746
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		274,515,576,786		228,584,980,746
剰余金減少額又は欠損金増加額		22,499,954,950		126,390,207,600
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		22,499,954,950		126,390,207,600
分配金	2	114,751,495,689	2	134,561,996,475
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>1,194,376,256,150</b>		<b>2,674,629,999,185</b>

## (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7月11日	至 2021年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第19期	第20期
	2020年7月10日現在	2021年7月10日現在
1. 1 期首元本額	3,315,331,042,500円	4,269,028,857,500円
期中追加設定元本額	1,021,955,037,500円	469,059,475,000円
期中一部交換元本額	68,257,222,500円	252,688,450,000円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,415,223,086口	3,588,319,906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 1,083,789,603,930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 424,922,672,060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 5,804,388,500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 9,160,662,000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2,747,489,778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1,759,675,291円が含まれております。

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

区 分		第19期 自 2019年7月11日 至 2020年7月10日	第20期 自 2020年7月11日 至 2021年7月10日	
1.	1	その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額11,042,821,067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8,965,965,775円が含まれております。
2.	2	分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(122,628,365,942円)及び分配準備積立金(210,613,147円)の合計額から、経費(7,889,146,032円)を控除して計算される分配対象額は114,949,833,057円(10口当たり336円)であり、うち114,751,495,689円(10口当たり336円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(144,426,335,089円)及び分配準備積立金(198,337,368円)の合計額から、経費(9,974,083,791円)を控除して計算される分配対象額は134,650,588,666円(10口当たり375円)であり、うち134,561,996,475円(10口当たり375円)を分配金額としております。

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第20期 自 2020年7月11日 至 2021年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第20期 2021年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第19期 2020年7月10日現在	第20期 2021年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	88,860,381,910	1,267,226,998,920
合計	88,860,381,910	1,267,226,998,920

（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	第19期 2020年7月10日 現在				第20期 2021年7月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	9,559,435,000	-	9,080,100,000	479,335,000	27,485,500,000	-	26,999,000,000	486,500,000
合計	9,559,435,000	-	9,080,100,000	479,335,000	27,485,500,000	-	26,999,000,000	486,500,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間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、計算期間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。

（関連当事者との取引に関する注記）

## 第20期

自 2020年7月11日

至 2021年7月10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7月10日現在	第20期 2021年7月10日現在
1口当たり純資産額 (10口当たり純資産額)	1,599.7円 (15,997円)	1,995.4円 (19,954円)

## (4) 【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	119,900	2,872.00	344,352,800	貸付株式数 31,400株 (2,000株)
日本水産	3,426,800	520.00	1,781,936,000	
マルハニチロ	577,500	2,352.00	1,358,280,000	
ハウスイ	21,200	924.00	19,588,800	貸付株式数 300株
雪国まいたけ	303,000	1,661.00	503,283,000	貸付株式数 272,000株 (7,000株)
カネコ種苗	111,800	1,449.00	161,998,200	
サカタのタネ	440,100	3,650.00	1,606,365,000	貸付株式数 100株
ホクト	309,600	1,921.00	594,741,600	貸付株式数 239,500株
ホクリヨウ	57,100	821.00	46,879,100	貸付株式数 500株
ヒノキヤグループ	91,700	2,296.00	210,543,200	
ショーボンドHD	526,700	4,650.00	2,449,155,000	貸付株式数 53,800株
ミライト・ホールディングス	1,279,500	2,042.00	2,612,739,000	
タマホーム	223,600	2,273.00	508,242,800	貸付株式数 201,000株
サンヨーホームズ	42,600	721.00	30,714,600	貸付株式数 15,000株
日本アクア	146,700	526.00	77,164,200	貸付株式数 131,000株
ファーストコーポレーション	112,800	754.00	85,051,200	貸付株式数 101,000株
ベステラ	71,000	1,478.00	104,938,000	
ROBOT HOME	692,000	232.00	160,544,000	
キャンディル	63,400	582.00	36,898,800	

スペースバリューHD	450,100	723.00	325,422,300	貸付株式数	22,100株
住石ホールディングス	645,900	127.00	82,029,300	貸付株式数	96,100株
日鉄鉱業	84,600	5,650.00	477,990,000		
三井松島HLDGS	154,400	990.00	152,856,000		
INPEX	13,569,500	804.00	10,909,878,000	貸付株式数	3,096,900株
石油資源開発	482,300	1,874.00	903,830,200		
K&Oエナジーグループ	179,300	1,305.00	233,986,500		
ダイセキ環境ソリューション	71,000	1,154.00	81,934,000		
第一カッター興業	91,200	1,331.00	121,387,200		
明豊ファシリティワークス	118,600	870.00	103,182,000	貸付株式数	700株
安藤・間	2,366,400	839.00	1,985,409,600		
東急建設	1,080,900	793.00	857,153,700		
コムシスホールディングス	1,308,600	2,993.00	3,916,639,800		
ピーアールホールディングス	493,600	463.00	228,536,800	貸付株式数	130,200株
高松コンストラクションGP	229,600	2,006.00	460,577,600	貸付株式数	1,300株
東建コーポレーション	113,700	10,260.00	1,166,562,000	貸付株式数	7,700株
ソネック	38,000	1,001.00	38,038,000	貸付株式数	34,000株
ヤマウラ	160,300	903.00	144,750,900	貸付株式数	129,600株
オリエンタル白石	1,240,400	281.00	348,552,400	貸付株式数	16,700株
大成建設	2,652,200	3,685.00	9,773,357,000		
大林組	8,522,600	893.00	7,610,681,800		
清水建設	7,983,400	868.00	6,929,591,200		
飛鳥建設	244,300	1,076.00	262,866,800	貸付株式数	200株
長谷工コーポレーション	2,791,600	1,458.00	4,070,152,800		
松井建設	335,400	741.00	248,531,400	貸付株式数	1,600株
銭高組	37,200	3,935.00	146,382,000		
鹿島建設	6,244,500	1,413.00	8,823,478,500		
不動テトラ	208,600	1,825.00	380,695,000		
大末建設	107,500	978.00	105,135,000	貸付株式数	300株
鉄建建設	172,000	1,867.00	321,124,000		
西松建設	609,700	3,545.00	2,161,386,500	貸付株式数	105,500株
三井住友建設	2,058,700	483.00	994,352,100		
大豊建設	186,500	4,170.00	777,705,000	貸付株式数	139,000株
前田建設	2,134,600	949.00	2,025,735,400		
佐田建設	196,300	479.00	94,027,700	貸付株式数	1,900株
ナカノフード建設	203,700	413.00	84,128,100	貸付株式数	3,700株
奥村組	468,600	2,892.00	1,355,191,200		

東鉄工業	365,500	2,296.00	839,188,000	貸付株式数	100株
イチケン	61,400	1,865.00	114,511,000		
富士ピー・エス	109,900	545.00	59,895,500	貸付株式数	98,000株
浅沼組	102,300	4,620.00	472,626,000		
戸田建設	3,539,000	741.00	2,622,399,000	貸付株式数	32,600株
熊谷組	394,900	2,804.00	1,107,299,600		
北野建設	51,900	2,301.00	119,421,900	貸付株式数	1,500株
植木組	75,400	1,438.00	108,425,200		
矢作建設	376,400	718.00	270,255,200		
ピーエス三菱	280,400	612.00	171,604,800	貸付株式数	600株
日本ハウスHLDGS	581,700	403.00	234,425,100	貸付株式数	3,100株
大東建託	930,300	12,510.00	11,638,053,000		
新日本建設	362,400	822.00	297,892,800	貸付株式数	100株
NIPPO	705,200	3,080.00	2,172,016,000		
東亜道路	52,900	4,520.00	239,108,000		
前田道路	526,700	2,146.00	1,130,298,200		
日本道路	82,400	8,000.00	659,200,000		
東亜建設	227,700	2,474.00	563,329,800	貸付株式数	168,300株
日本国土開発	829,100	571.00	473,416,100	貸付株式数	25,300株
若築建設	153,200	1,635.00	250,482,000		
東洋建設	955,400	577.00	551,265,800		
五洋建設	3,619,800	756.00	2,736,568,800	貸付株式数	42,000株
世紀東急	409,200	855.00	349,866,000		
福田組	98,600	4,835.00	476,731,000	貸付株式数	400株
日本ドライケミカル	66,700	1,756.00	117,125,200	貸付株式数	47,400株
住友林業	2,004,700	1,985.00	3,979,329,500	貸付株式数	1,369,300株
日本基礎技術	260,200	550.00	143,110,000		
巴コーポレーション	378,300	373.00	141,105,900	貸付株式数	14,300株
大和ハウス	7,868,300	3,312.00	26,059,809,600		
ライト工業	487,800	1,837.00	896,088,600		
積水ハウス	9,241,400	2,218.50	20,502,045,900	貸付株式数	4,144,800株
日特建設	211,100	762.00	160,858,200	貸付株式数	500株
北陸電気工事	147,600	1,252.00	184,795,200		
ユアテック	487,600	714.00	348,146,400		
日本リーテック	178,400	1,573.00	280,623,200	貸付株式数	160,000株 (15,000株)
四電工	46,300	3,000.00	138,900,000		
中電工	392,400	2,266.00	889,178,400	貸付株式数	3,000株
関電工	1,385,600	874.00	1,211,014,400		
きんでん	1,730,800	1,800.00	3,115,440,000		

東京エネシス	282,900	946.00	267,623,400	
トーエネック	85,700	3,700.00	317,090,000	
住友電設	240,500	2,202.00	529,581,000	
日本電設工業	467,300	1,882.00	879,458,600	貸付株式数 10,100株
協和エクシオ	1,292,100	2,695.00	3,482,209,500	
新日本空調	225,300	2,025.00	456,232,500	貸付株式数 10,100株
日本工営	152,400	2,978.00	453,847,200	
九電工	597,800	3,550.00	2,122,190,000	
三機工業	604,000	1,428.00	862,512,000	
日揮ホールディングス	2,843,200	1,002.00	2,848,886,400	貸付株式数 113,000株
中外炉工業	92,200	1,908.00	175,917,600	
ヤマト	272,600	794.00	216,444,400	
太平電業	188,700	2,624.00	495,148,800	貸付株式数 1,300株
高砂熱学	770,500	1,869.00	1,440,064,500	
三晃金属	33,400	2,349.00	78,456,600	
NEC ネットズエスアイ	881,800	1,737.00	1,531,686,600	
朝日工業社	63,100	3,155.00	199,080,500	
明星工業	551,100	740.00	407,814,000	
大 気 社	414,400	3,265.00	1,353,016,000	貸付株式数 14,000株
ダイダン	189,000	2,553.00	482,517,000	貸付株式数 11,400株
日比谷総合設備	274,200	1,781.00	488,350,200	貸付株式数 5,200株
ニッポン	798,100	1,560.00	1,245,036,000	貸付株式数 17,900株
日清製粉G本社	3,081,500	1,650.00	5,084,475,000	
日東富士製粉	19,800	6,920.00	137,016,000	
昭和産業	229,400	2,986.00	684,988,400	
鳥越製粉	241,600	769.00	185,790,400	貸付株式数 4,400株
中部飼料	333,100	1,124.00	374,404,400	貸付株式数 229,000株
フィード・ワン	366,400	732.00	268,204,800	貸付株式数 600株
東洋精糖	46,100	1,187.00	54,720,700	貸付株式数 1,100株
日本甜菜糖	142,300	1,626.00	231,379,800	
DM三井製糖ホールディ	215,100	1,834.00	394,493,400	貸付株式数 166,000株
塩水港精糖	324,800	221.00	71,780,800	貸付株式数 27,800株
日新製糖	129,200	1,702.00	219,898,400	
L I F U L L	792,900	339.00	268,793,100	貸付株式数 58,900株
ミクシィ	660,000	2,764.00	1,824,240,000	貸付株式数 31,600株
ジェイエシーリクルート メント	178,400	1,773.00	316,303,200	貸付株式数 1,200株
日本M&Aセンター	4,259,200	3,015.00	12,841,488,000	貸付株式数 247,400株
メンバーズ	77,200	3,430.00	264,796,000	
中広	35,700	359.00	12,816,300	貸付株式数 2,500株

U Tグループ	374,600	3,350.00	1,254,910,000	貸付株式数	157,200株
アイティメディア	86,700	2,067.00	179,208,900	貸付株式数	64,400株
タケエイ	289,700	1,683.00	487,565,100		
E・Jホールディングス	135,700	1,056.00	143,299,200	貸付株式数	41,000株
夢真ビーネックスグループ	691,000	1,288.00	890,008,000	貸付株式数	62,700株
コシダカホールディングス	694,400	631.00	438,166,400	貸付株式数	624,000株
アルトナー	62,800	839.00	52,689,200		
パソナグループ	281,400	2,266.00	637,652,400	貸付株式数	88,200株
C D S	64,300	1,540.00	99,022,000	貸付株式数	1,800株
リンクアンドモチベーション	477,100	836.00	398,855,600	貸付株式数	42,500株
G C A	339,500	1,044.00	354,438,000	貸付株式数	55,100株
エス・エム・エス	882,000	3,290.00	2,901,780,000	貸付株式数	3,500株
サニーサイドアップG	89,800	747.00	67,080,600	貸付株式数	32,000株
パーソルホールディングス	2,596,300	2,244.00	5,826,097,200	貸付株式数	63,200株
リニカル	146,200	1,012.00	147,954,400	貸付株式数	73,000株
クックパッド	815,800	245.00	199,871,000	貸付株式数	16,900株
エスクリ	81,500	474.00	38,631,000	貸付株式数	73,000株
アイ・ケイ・ケイ	126,400	669.00	84,561,600	貸付株式数	105,700株
森永製菓	640,100	3,630.00	2,323,563,000	貸付株式数	20,200株
中村屋	65,600	3,775.00	247,640,000	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
江崎グリコ	751,000	4,160.00	3,124,160,000	貸付株式数	201,000株
名糖産業	120,200	1,578.00	189,675,600	貸付株式数	21,200株
井村屋グループ	154,700	2,264.00	350,240,800	貸付株式数	1,700株 (1,000株)
不二家	174,100	2,183.00	380,060,300	貸付株式数	156,000株
山崎製パン	2,044,400	1,535.00	3,138,154,000	貸付株式数	46,100株
第一屋製パン	52,700	939.00	49,485,300	貸付株式数	12,200株
モロゾフ	43,400	5,360.00	232,624,000	貸付株式数	27,000株
亀田製菓	155,400	4,520.00	702,408,000	貸付株式数	2,100株
寿スピリッツ	262,500	7,550.00	1,981,875,000	貸付株式数	158,300株
カルビー	1,242,900	2,556.00	3,176,852,400	貸付株式数	35,000株
森永乳業	504,600	5,730.00	2,891,358,000	貸付株式数	1,200株
六甲バター	181,100	1,523.00	275,815,300	貸付株式数	500株
ヤクルト	1,876,200	6,310.00	11,838,822,000		
明治ホールディングス	1,803,500	6,710.00	12,101,485,000		
雪印メグミルク	656,600	2,039.00	1,338,807,400		
プリマハム	383,700	2,951.00	1,132,298,700	貸付株式数	49,300株
日本ハム	1,042,400	4,265.00	4,445,836,000		

林兼産業	90,300	578.00	52,193,400	
丸大食品	268,300	1,698.00	455,573,400	
S Foods	245,000	3,220.00	788,900,000	貸付株式数 1,400株
柿安本店	94,600	2,470.00	233,662,000	貸付株式数 49,900株 (5,000株)
伊藤ハム米久HLDGS	1,756,200	709.00	1,245,145,800	
学情	92,000	1,331.00	122,452,000	貸付株式数 82,000株
スタジオアリス	130,600	2,476.00	323,365,600	貸付株式数 117,000株 (1,000株)
クロスキャット	70,000	966.00	67,620,000	貸付株式数 52,000株
シミックホールディングス	143,800	1,559.00	224,184,200	貸付株式数 900株
エプコ	62,900	861.00	54,156,900	貸付株式数 56,000株
システナ	951,000	2,152.00	2,046,552,000	貸付株式数 221,600株
NJS	63,600	1,922.00	122,239,200	
デジタルアーツ	155,100	8,220.00	1,274,922,000	貸付株式数 8,700株
日鉄ソリューションズ	386,000	3,455.00	1,333,630,000	
総合警備保障	1,033,100	4,925.00	5,088,017,500	
キューブシステム	134,700	1,008.00	135,777,600	貸付株式数 110,000株 (1,000株)
いちご	2,984,900	361.00	1,077,548,900	貸付株式数 47,500株
WOW WORLD	41,000	1,885.00	77,285,000	貸付株式数 33,000株
日本駐車場開発	2,939,600	167.00	490,913,200	貸付株式数 1,000,000株
コア	112,700	1,417.00	159,695,900	貸付株式数 10,200株
カカクコム	1,918,500	3,195.00	6,129,607,500	貸付株式数 53,600株
アイロムグループ	93,300	1,953.00	182,214,900	貸付株式数 83,000株 (1,000株)
セントケア・ホールディング	189,700	985.00	186,854,500	貸付株式数 1,100株
サイネックス	43,700	694.00	30,327,800	貸付株式数 1,300株
ルネサンス	162,400	1,296.00	210,470,400	貸付株式数 145,000株
ディップ	406,000	3,415.00	1,386,490,000	貸付株式数 13,600株
SBSホールディングス	201,000	3,240.00	651,240,000	貸付株式数 1,800株
デジタルホールディングス	181,000	2,159.00	390,779,000	貸付株式数 118,900株
新日本科学	316,100	1,023.00	323,370,300	貸付株式数 5,200株
キャリアデザインセンター	65,500	1,045.00	68,447,500	貸付株式数 43,300株
ベネフィット・ワン	944,700	3,300.00	3,117,510,000	
エムスリー	4,581,700	7,631.00	34,962,952,700	
ツカダ・グローバルHOLD	206,500	388.00	80,122,000	貸付株式数 99,400株
プラス	33,700	532.00	17,928,400	貸付株式数 30,000株

アウトソーシング	1,487,300	2,110.00	3,138,203,000	
ウェルネット	261,800	521.00	136,397,800	貸付株式数 64,400株
ワールドホールディングス	89,000	3,110.00	276,790,000	
ディー・エヌ・エー	1,098,600	2,229.00	2,448,779,400	
博報堂D Y H L D G S	3,614,000	1,682.00	6,078,748,000	
ぐるなび	451,800	533.00	240,809,400	貸付株式数 369,000株
タカミヤ	314,400	507.00	159,400,800	
ジャパンベストレスキュー S	175,700	901.00	158,305,700	貸付株式数 15,900株
ファンコミュニケーションズ	714,000	390.00	278,460,000	貸付株式数 24,800株
ライク	68,800	2,047.00	140,833,600	貸付株式数 29,000株 (1,400株)
ビジネス・ブレークスルー	108,400	420.00	45,528,000	貸付株式数 500株
エスプール	666,600	1,005.00	669,933,000	
W D Bホールディングス	118,500	3,080.00	364,980,000	
手間いらず	32,800	6,220.00	204,016,000	貸付株式数 29,000株
ティア	151,300	465.00	70,354,500	
C D G	23,700	1,586.00	37,588,200	
アドウェイズ	421,900	837.00	353,130,300	貸付株式数 279,000株
バリューコマース	174,600	3,050.00	532,530,000	貸付株式数 400株
インフォマート	2,626,700	899.00	2,361,403,300	
サッポロホールディングス	930,700	2,307.00	2,147,124,900	
アサヒグループホールディ ン	5,958,800	5,043.00	30,050,228,400	貸付株式数 918,300株
キリンH D	11,567,400	2,084.00	24,106,461,600	
宝ホールディングス	2,021,800	1,327.00	2,682,928,600	
オエノンホールディングス	774,800	368.00	285,126,400	
養 命 酒	83,600	1,805.00	150,898,000	貸付株式数 300株
コカ・コーラボトラーズJ H D	2,088,400	1,722.00	3,596,224,800	貸付株式数 49,000株
サントリー食品インター	1,825,000	4,145.00	7,564,625,000	貸付株式数 1,549,800株
ダイドーグループH D	153,900	4,965.00	764,113,500	貸付株式数 125,000株
伊 藤 園	828,000	6,470.00	5,357,160,000	貸付株式数 673,000株
キーコーヒー	268,000	2,108.00	564,944,000	貸付株式数 171,400株
ユニカフェ	81,900	991.00	81,162,900	
ジャパンフーズ	38,700	1,214.00	46,981,800	貸付株式数 700株
日清オイリオグループ	341,400	3,050.00	1,041,270,000	貸付株式数 13,500株
不二製油グループ	664,900	2,510.00	1,668,899,000	貸付株式数 43,100株
かどや製油	29,800	4,025.00	119,945,000	貸付株式数 600株

J - オイルミルズ	254,400	1,856.00	472,166,400	貸付株式数	4,200株
ローソン	677,000	5,160.00	3,493,320,000	貸付株式数	19,300株
サンエー	202,300	4,090.00	827,407,000		
カワチ薬品	186,600	2,132.00	397,831,200	貸付株式数	75,700株
エービーシー・マート	417,900	6,270.00	2,620,233,000		
ハードオフコーポレーション	117,800	771.00	90,823,800		
高千穂交易	103,000	1,130.00	116,390,000	貸付株式数	74,400株
アスクル	432,500	1,626.00	703,245,000	貸付株式数	1,700株
ゲオホールディングス	357,800	1,230.00	440,094,000	貸付株式数	241,200株
アダストリア	370,600	1,922.00	712,293,200	貸付株式数	324,300株
ジーフット	161,700	414.00	66,943,800	貸付株式数	145,000株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	38,500	423.00	16,285,500	貸付株式数	34,000株
オルバヘルスケアHLDGS	43,500	1,683.00	73,210,500	貸付株式数	200株
伊藤忠食品	64,400	5,130.00	330,372,000		
くら寿司	314,300	4,155.00	1,305,916,500	貸付株式数	261,900株
キャンドゥ	127,400	1,903.00	242,442,200	貸付株式数	114,000株
エレマテック	214,100	1,225.00	262,272,500	貸付株式数	7,700株
アイケイ	77,100	748.00	57,670,800	貸付株式数	6,000株
パルグループHLDGS	234,200	1,671.00	391,348,200	貸付株式数	2,600株
JALUX	75,500	1,779.00	134,314,500	貸付株式数	63,800株
エディオン	1,134,100	1,074.00	1,218,023,400	貸付株式数	850,000株
あらた	212,900	4,105.00	873,954,500	貸付株式数	700株
サーラコーポレーション	543,200	600.00	325,920,000	貸付株式数	600株
ワッツ	129,600	909.00	117,806,400	貸付株式数	106,000株
トーメンデバイス	34,500	4,090.00	141,105,000		
ハローズ	107,300	2,690.00	288,637,000	貸付株式数	65,500株
J Pホールディングス	741,200	264.00	195,676,800	貸付株式数	5,900株
フジオフードG本社	225,700	1,283.00	289,573,100	貸付株式数	203,000株 (1,700株)
あみやき亭	57,800	2,907.00	168,024,600	貸付株式数	50,100株
東京エレクトロンデバイス	88,200	5,210.00	459,522,000		
ひらまつ	492,200	210.00	103,362,000	貸付株式数	369,000株
フィールズ	234,200	529.00	123,891,800	貸付株式数	39,000株
双日	14,782,800	334.00	4,937,455,200		
アルフレッサホールディングス	2,776,000	1,676.00	4,652,576,000	貸付株式数	74,400株
大黒天物産	85,500	6,550.00	560,025,000	貸付株式数	76,000株

ハニーズホールディングス	211,800	1,183.00	250,559,400	貸付株式数	190,000株
ファーマライズHD	64,900	727.00	47,182,300	貸付株式数	9,600株
キッコーマン	1,962,900	6,840.00	13,426,236,000		
味の素	6,486,900	2,800.00	18,163,320,000		
ブルドックソ - ス	123,700	2,278.00	281,788,600	貸付株式数	102,300株
キューピー	1,518,800	2,450.00	3,721,060,000	貸付株式数	24,500株
ハウス食品G本社	1,020,000	3,385.00	3,452,700,000		
カゴメ	1,114,700	2,842.00	3,167,977,400	貸付株式数	42,100株
焼津水産化工	132,300	943.00	124,758,900	貸付株式数	3,300株
アリアケジャパン	249,100	6,850.00	1,706,335,000	貸付株式数	6,900株
ピエトロ	35,700	1,715.00	61,225,500	貸付株式数	31,500株
エバラ食品工業	59,700	2,545.00	151,936,500	貸付株式数	500株
やまみ	29,400	1,910.00	56,154,000	貸付株式数	300株
ニチレイ	1,299,300	2,898.00	3,765,371,400		
横浜冷凍	750,100	868.00	651,086,800	貸付株式数	900株
東洋水産	1,403,300	4,170.00	5,851,761,000		
イトアンドHLDGS	94,300	1,936.00	182,564,800	貸付株式数	77,000株
大冷	30,400	1,987.00	60,404,800	貸付株式数	27,000株
ヨシムラ・フード・HLDGS	152,600	754.00	115,060,400	貸付株式数	131,300株 (6,000株)
日清食品HD	1,070,200	7,780.00	8,326,156,000		
永谷園ホールディングス	133,300	2,126.00	283,395,800		
一正蒲鉾	105,900	927.00	98,169,300		
フジッコ	295,200	1,903.00	561,765,600	貸付株式数	10,000株
ロックフィールド	293,800	1,491.00	438,055,800	貸付株式数	167,100株
日本たばこ産業	14,622,100	2,090.50	30,567,500,050	貸付株式数	10,122,000株
ケンコーマヨネーズ	166,900	1,536.00	256,358,400	貸付株式数	7,100株
わらべや日洋HD	178,600	2,359.00	421,317,400	貸付株式数	129,000株
なとり	152,300	1,906.00	290,283,800		
イフジ産業	42,300	940.00	39,762,000	貸付株式数	29,400株
ピックルスコーポレーション	65,100	3,295.00	214,504,500		
ファーマフーズ	257,400	2,824.00	726,897,600	貸付株式数	220,000株
北の達人コーポ	952,100	473.00	450,343,300	貸付株式数	837,700株 (226,400株)
ユーグレナ	1,389,100	1,078.00	1,497,449,800	貸付株式数	595,800株 (162,400株)
紀文食品	159,000	1,308.00	207,972,000	貸付株式数	142,000株
スター・マイカ・HLDGS	138,500	1,166.00	161,491,000	貸付株式数	1,400株

S R Eホールディングス	39,300	7,270.00	285,711,000	貸付株式数	8,000株
A Dワークスグループ	543,200	157.00	85,282,400		
片倉工業	356,500	1,449.00	516,568,500	貸付株式数	221,200株
グ ン ゼ	195,300	4,530.00	884,709,000		
ヒューリック	5,685,900	1,243.00	7,067,573,700	貸付株式数	5,117,000株
神 栄	36,800	1,240.00	45,632,000	貸付株式数	6,800株
ラサ商事	141,700	898.00	127,246,600	貸付株式数	74,400株
アルペン	204,900	3,045.00	623,920,500	貸付株式数	182,400株 (9,100株)
ハブ	85,600	717.00	61,375,200	貸付株式数	77,000株
ラクーンホールディングス	188,800	2,267.00	428,009,600	貸付株式数	105,600株 (5,000株)
クオールホールディングス	361,100	1,459.00	526,844,900	貸付株式数	2,100株
アルコニックス	284,500	1,424.00	405,128,000	貸付株式数	1,700株
神戸物産	1,846,800	3,740.00	6,907,032,000	貸付株式数	1,659,900株
ソリトンシステムズ	133,300	1,550.00	206,615,000	貸付株式数	93,200株
ジンスホールディングス	182,200	8,070.00	1,470,354,000	貸付株式数	163,000株
ビックカメラ	1,587,300	1,084.00	1,720,633,200	貸付株式数	1,428,000株
D C Mホールディングス	1,651,300	1,060.00	1,750,378,000		
ペッパーフードサービス	394,700	425.00	167,747,500	貸付株式数	210,700株 (2,100株)
ハイパー	54,200	544.00	29,484,800		
M o n o t a R O	3,806,400	2,551.00	9,710,126,400	貸付株式数	44,700株
東京一番フーズ	67,800	586.00	39,730,800	貸付株式数	61,000株 (37,200株)
D Dホールディングス	131,800	524.00	69,063,200	貸付株式数	118,000株
あい ホールディングス	382,000	2,100.00	802,200,000	貸付株式数	300,000株
ディー・ブイエックス	81,900	973.00	79,688,700	貸付株式数	70,100株
きちりホールディングス	71,300	592.00	42,209,600	貸付株式数	5,600株 (2,000株)
アークランドサービスHD	223,300	2,216.00	494,832,800	貸付株式数	200,000株
J . フロント リテイリ ング	3,196,000	1,015.00	3,243,940,000		
ドトール・日レスHD	423,300	1,752.00	741,621,600		
マツモトキヨシH L D G S	1,106,400	4,700.00	5,200,080,000		
ブロンコビリー	140,000	2,357.00	329,980,000	貸付株式数	113,900株
Z O Z O	1,577,700	3,525.00	5,561,392,500	貸付株式数	6,700株
トレジャー・ファクトリー	78,300	980.00	76,734,000	貸付株式数	30,400株
物語コーポレーション	142,700	7,430.00	1,060,261,000	貸付株式数	90,000株
ココカラファイン	238,500	7,900.00	1,884,150,000		

三越伊勢丹HD	4,683,500	799.00	3,742,116,500	
東洋紡	1,051,900	1,286.00	1,352,743,400	
ユニチカ	779,700	334.00	260,419,800	
富士紡ホールディングス	128,600	3,765.00	484,179,000	
日清紡ホールディングス	1,661,000	922.00	1,531,442,000	貸付株式数 100,000株
倉敷紡績	227,600	1,906.00	433,805,600	
ダイワボウHD	1,219,600	1,902.00	2,319,679,200	
シキボウ	149,600	927.00	138,679,200	貸付株式数 89,000株
日東紡績	404,400	3,215.00	1,300,146,000	貸付株式数 115,200株
トヨタ紡織	791,700	2,208.00	1,748,073,600	貸付株式数 6,100株
マクニカ・富士エレHLDGS	638,100	2,596.00	1,656,507,600	貸付株式数 2,700株
Hamee	68,600	1,435.00	98,441,000	貸付株式数 61,000株 (3,700株)
マーケットエンタープライズ	16,800	1,126.00	18,916,800	貸付株式数 15,000株
ラクト・ジャパン	116,800	2,665.00	311,272,000	貸付株式数 74,000株
ウエルシアHD	1,415,000	3,290.00	4,655,350,000	貸付株式数 161,000株
クリエイトSDH	394,700	3,150.00	1,243,305,000	貸付株式数 355,000株
グリムス	79,300	1,953.00	154,872,900	貸付株式数 53,100株
バイタルKSKHD	465,000	735.00	341,775,000	
八洲電機	206,700	950.00	196,365,000	貸付株式数 165,000株
メディアスホールディングス	151,800	1,013.00	153,773,400	貸付株式数 48,500株 (1,000株)
レスターホールディングス	279,100	1,873.00	522,754,300	貸付株式数 500株
ジューテックHD	61,000	1,012.00	61,732,000	
丸善CHIHD	312,300	399.00	124,607,700	貸付株式数 281,000株 (2,000株)
大光	102,200	677.00	69,189,400	貸付株式数 91,000株
OCHIホールディングス	77,600	1,260.00	97,776,000	貸付株式数 800株
TOKAIホールディングス	1,296,300	896.00	1,161,484,800	
黒谷	72,600	861.00	62,508,600	貸付株式数 65,000株 (3,800株)
ミサワ	54,000	690.00	37,260,000	貸付株式数 500株
ティーライフ	35,900	1,552.00	55,716,800	貸付株式数 32,000株
Cominix	46,400	738.00	34,243,200	貸付株式数 38,700株
エー・ピーホールディングス	50,200	505.00	25,351,000	貸付株式数 43,300株
三洋貿易	269,200	1,220.00	328,424,000	貸付株式数 2,700株

チムニー	81,600	1,404.00	114,566,400	貸付株式数 73,000株 (400株)
シュッピン	182,200	1,063.00	193,678,600	貸付株式数 161,000株 (20,000株)
ビューティガレージ	43,100	4,485.00	193,303,500	貸付株式数 38,000株 (300株)
オイシックス・ラ・大地	352,700	4,200.00	1,481,340,000	貸付株式数 288,000株 (21,000株)
ウイン・パートナーズ	193,100	988.00	190,782,800	貸付株式数 2,100株
ネクステージ	471,900	2,131.00	1,005,618,900	
ジョイフル本田	783,900	1,334.00	1,045,722,600	貸付株式数 702,400株
鳥貴族ホールディングス	98,100	1,842.00	180,700,200	貸付株式数 88,000株 (38,300株)
ホットランド	199,800	1,311.00	261,937,800	貸付株式数 163,000株
すかいらーくHD	3,410,400	1,493.00	5,091,727,200	貸付株式数 1,531,300株 (47,200株)
SFPホールディングス	130,600	1,463.00	191,067,800	貸付株式数 117,000株
綿半ホールディングス	200,500	1,215.00	243,607,500	貸付株式数 55,700株
日本毛織	875,700	951.00	832,790,700	貸付株式数 652,000株
ダイトウボウ	430,300	101.00	43,460,300	貸付株式数 87,400株
トーア紡コーポレーション	105,700	440.00	46,508,000	貸付株式数 4,400株
ダイドーリミテッド	349,900	174.00	60,882,600	貸付株式数 14,500株
ヨシックスホールディングス	52,300	2,326.00	121,649,800	貸付株式数 46,400株
ユナイテッド・スーパー マケ	777,800	1,015.00	789,467,000	貸付株式数 700,000株 (2,000株)
三栄建築設計	107,500	2,019.00	217,042,500	
野村不動産HLDGS	1,537,600	2,725.00	4,189,960,000	
三重交通グループHD	543,100	468.00	254,170,800	貸付株式数 488,000株
サムティ	380,700	2,283.00	869,138,100	貸付株式数 7,900株
ディア・ライフ	344,600	468.00	161,272,800	貸付株式数 5,300株
コーセーアールイー	78,800	649.00	51,141,200	
日本商業開発	169,800	1,683.00	285,773,400	貸付株式数 138,000株
プレサンスコーポレーション	441,000	1,490.00	657,090,000	
フィル・カンパニー	48,800	2,611.00	127,416,800	貸付株式数 43,000株
THEグローバル社	167,300	226.00	37,809,800	貸付株式数 104,100株
ハウスコム	46,000	1,236.00	56,856,000	
日本管理センター	144,600	1,262.00	182,485,200	
サンセイランディック	78,700	866.00	68,154,200	貸付株式数 12,500株

エストラスト	31,200	664.00	20,716,800	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
フージャースHD	437,100	726.00	317,334,600	
オープンハウス	851,200	5,180.00	4,409,216,000	
東急不動産HD	7,288,000	649.00	4,729,912,000	
飯田GHD	2,235,800	2,618.00	5,853,324,400	
イーグランド	43,100	1,013.00	43,660,300	
ムゲンエステート	164,500	511.00	84,059,500	貸付株式数 147,000株
帝国繊維	300,400	2,012.00	604,404,800	貸付株式数 27,000株
日本コークス工業	2,295,800	100.00	229,580,000	
ゴルフダイジェスト・オン	138,800	1,724.00	239,291,200	貸付株式数 41,400株
ミタチ産業	73,400	837.00	61,435,800	貸付株式数 45,500株
B E E N O S	135,100	3,485.00	470,823,500	貸付株式数 5,400株
あさひ	199,200	1,345.00	267,924,000	貸付株式数 178,000株 (7,300株)
日本調剤	162,300	1,636.00	265,522,800	貸付株式数 6,700株
コスモス薬品	269,900	15,920.00	4,296,808,000	貸付株式数 242,000株
シップヘルスケアHD	943,500	2,670.00	2,519,145,000	貸付株式数 1,900株
トーエル	129,700	796.00	103,241,200	貸付株式数 500株
ソフトクリエイイトHD	104,700	2,716.00	284,365,200	貸付株式数 500株
オンリー	45,400	466.00	21,156,400	貸付株式数 1,000株
セブン&アイ・HLDGS	10,470,700	5,018.00	52,541,972,600	
クリエイイト・レストラン ツ・ホール	1,438,600	951.00	1,368,108,600	貸付株式数 1,294,000株 (257,400株)
明治電機工業	91,700	1,402.00	128,563,400	貸付株式数 100株
ツルハホールディングス	583,700	12,440.00	7,261,228,000	貸付株式数 6,200株
デリカフーズHLDGS	103,600	645.00	66,822,000	貸付株式数 91,900株
スターティアホールディング ス	51,900	2,014.00	104,526,600	貸付株式数 46,000株 (500株)
サンマルクホールディング ス	211,300	1,618.00	341,883,400	貸付株式数 9,500株
フェリシモ	59,400	1,686.00	100,148,400	貸付株式数 53,000株
トリドールホールディング ス	662,600	1,886.00	1,249,663,600	貸付株式数 431,300株 (50,000株)
帝人	2,505,300	1,633.00	4,091,154,900	
東レ	19,271,200	705.70	13,599,685,840	
クラレ	4,191,700	997.00	4,179,124,900	貸付株式数 554,500株
旭化成	17,638,700	1,170.00	20,637,279,000	
サカイオーベックス	70,600	2,990.00	211,094,000	
TOKYO BASE	242,100	667.00	161,480,700	貸付株式数 168,500株

稲葉製作所	151,300	1,531.00	231,640,300	貸付株式数	135,000株
宮地エンジニアリングG	87,600	2,434.00	213,218,400	貸付株式数	300株
トーカロ	693,200	1,361.00	943,445,200	貸付株式数	600株
アルファCO	94,700	1,120.00	106,064,000		
SUMCO	3,427,500	2,645.00	9,065,737,500	貸付株式数	1,791,900株 (289,000株)
川田テクノロジーズ	54,900	3,655.00	200,659,500	貸付株式数	1,100株
RS TECHNOLOGIES	87,300	6,140.00	536,022,000	貸付株式数	5,600株
ジェイテックコーポレーション	29,700	3,280.00	97,416,000	貸付株式数	26,000株
信和	142,900	704.00	100,601,600		
ビーロット	148,800	570.00	84,816,000	貸付株式数	9,300株
ファーストブラザーズ	48,800	1,063.00	51,874,400	貸付株式数	43,000株
ハウストゥ	132,000	1,010.00	133,320,000	貸付株式数	7,300株
シーアールイー	69,600	1,556.00	108,297,600	貸付株式数	62,000株
プロパティエージェント	43,000	2,524.00	108,532,000	貸付株式数	37,000株
ケイアイスター不動産	84,100	5,290.00	444,889,000	貸付株式数	2,800株
アグレ都市デザイン	48,400	988.00	47,819,200	貸付株式数	31,000株
グッドコムアセット	128,400	1,390.00	178,476,000	貸付株式数	115,000株
ジェイ・エス・ビー	49,700	3,795.00	188,611,500		
テンポイノベーション	75,200	900.00	67,680,000	貸付株式数	62,400株 (10,000株)
グローバルリンクマネジメント	46,300	862.00	39,910,600	貸付株式数	30,000株
フェイスネットワーク	22,100	1,357.00	29,989,700	貸付株式数	400株
住江織物	58,400	2,019.00	117,909,600		
日本フェルト	150,800	435.00	65,598,000		
イチカワ	34,600	1,341.00	46,398,600		
エコナックホールディングス	468,700	88.00	41,245,600	貸付株式数	30,800株
日東製網	28,600	1,515.00	43,329,000	貸付株式数	300株
芦森工業	51,100	1,165.00	59,531,500	貸付株式数	100株
アツギ	204,500	613.00	125,358,500		
ウイルプラスHLDGS	41,800	1,024.00	42,803,200	貸付株式数	36,500株
JMホールディングス	180,000	2,090.00	376,200,000	貸付株式数	162,000株 (1,000株)
コメダホールディングス	583,600	2,051.00	1,196,963,600		
サツドラホールディングス	40,000	2,012.00	80,480,000	貸付株式数	13,600株

アレンザホールディングス	203,700	1,252.00	255,032,400	貸付株式数 183,000株 (1,200株)
串カツ田中HLDGS	71,000	1,865.00	132,415,000	貸付株式数 63,000株
バロックジャパン	185,600	806.00	149,593,600	貸付株式数 167,000株
クスリのアオキHLDGS	266,000	7,120.00	1,893,920,000	貸付株式数 239,000株
ダイニック	100,500	744.00	74,772,000	貸付株式数 300株
共和レザー	144,800	702.00	101,649,600	貸付株式数 400株
ピーバンドットコム	36,400	781.00	28,428,400	貸付株式数 32,000株
力の源HD	122,000	614.00	74,908,000	貸付株式数 109,000株
FOOD & LIFE CO MPAN	1,567,000	4,260.00	6,675,420,000	
アセンテック	68,500	1,181.00	80,898,500	貸付株式数 59,600株
セーレン	654,400	2,138.00	1,399,107,200	貸付株式数 163,400株
ソトー	105,900	798.00	84,508,200	
東海染工	33,600	1,133.00	38,068,800	
小松マテーレ	436,800	891.00	389,188,800	貸付株式数 300株
ワコールホールディングス	664,000	2,464.00	1,636,096,000	貸付株式数 700株
ホギメディカル	358,500	3,385.00	1,213,522,500	貸付株式数 3,600株
クラウドシアHLDGS	65,400	291.00	19,031,400	貸付株式数 51,700株
T S Iホールディングス	808,200	370.00	299,034,000	
マツオカコーポレーション	85,100	1,613.00	137,266,300	貸付株式数 76,000株
ワールド	348,200	1,426.00	496,533,200	貸付株式数 12,900株
T I S	2,666,400	2,817.00	7,511,248,800	
J N Sホールディングス	131,300	603.00	79,173,900	貸付株式数 90,000株
グリー	1,635,100	591.00	966,344,100	貸付株式数 80,700株
GMOベパボ	23,100	4,450.00	102,795,000	貸付株式数 20,000株
コーエーテクモHD	708,900	5,030.00	3,565,767,000	
三菱総合研究所	114,400	4,065.00	465,036,000	
ボルテージ	71,500	457.00	32,675,500	貸付株式数 18,600株
電算	29,600	2,300.00	68,080,000	貸付株式数 500株
A G S	135,600	865.00	117,294,000	貸付株式数 2,900株
ファインデックス	224,400	1,156.00	259,406,400	貸付株式数 105,000株
ブレインパッド	69,000	4,695.00	323,955,000	貸付株式数 5,500株
K L a b	488,900	634.00	309,962,600	貸付株式数 293,000株 (30,400株)
ポルトゥウィン・ピット クル	354,100	1,023.00	362,244,300	貸付株式数 2,800株
イーブックイニシアティブ	43,400	3,300.00	143,220,000	貸付株式数 39,000株
ネクソン	6,753,400	2,275.00	15,363,985,000	
アイスタイル	813,300	477.00	387,944,100	貸付株式数 35,400株

エムアップホールディングス	69,300	3,430.00	237,699,000	貸付株式数	62,000株
エイチーム	183,800	1,502.00	276,067,600	貸付株式数	150,000株
エニグモ	251,800	1,376.00	346,476,800	貸付株式数	12,100株
テクノスジャパン	206,500	600.00	123,900,000	貸付株式数	10,900株
e n i s h	139,100	566.00	78,730,600	貸付株式数	103,000株 (900株)
コロプラ	876,000	806.00	706,056,000	貸付株式数	788,000株
オルトプラス	205,500	407.00	83,638,500	貸付株式数	131,900株
ブロードリーフ	1,321,500	507.00	670,000,500	貸付株式数	454,300株
クロス・マーケティングG	118,000	673.00	79,414,000	貸付株式数	57,500株
デジタルハーツHLDGS	121,000	1,518.00	183,678,000	貸付株式数	61,500株 (29,000株)
システム情報	199,600	906.00	180,837,600	貸付株式数	179,000株
メディアドゥ	103,800	4,660.00	483,708,000	貸付株式数	93,000株 (11,000株)
じげん	659,700	451.00	297,524,700		
ブイキューブ	145,500	2,351.00	342,070,500	貸付株式数	130,000株
エンカレッジ・テクノロジー	46,800	639.00	29,905,200	貸付株式数	32,900株
サイバーリンクス	88,000	1,483.00	130,504,000	貸付株式数	70,600株
ディー・エル・イー	214,300	421.00	90,220,300	貸付株式数	192,000株 (1,500株)
フィックスターズ	283,700	806.00	228,662,200	貸付株式数	248,300株
CARTA HOLDINGS	107,800	1,881.00	202,771,800	貸付株式数	95,500株
オプティム	186,200	2,071.00	385,620,200	貸付株式数	167,000株 (66,000株)
セレス	87,800	3,100.00	272,180,000	貸付株式数	68,300株
SHIFT	134,100	19,300.00	2,588,130,000	貸付株式数	26,100株
特種東海製紙	163,500	4,290.00	701,415,000		
ティーガイア	283,800	1,976.00	560,788,800	貸付株式数	255,000株
セック	38,900	2,653.00	103,201,700	貸付株式数	34,000株
日本アジアグループ	257,600	959.00	247,038,400		
テクマトリックス	413,200	1,836.00	758,635,200	貸付株式数	24,400株
プロシップ	77,900	1,419.00	110,540,100	貸付株式数	400株
ガンホー・オンライン・エンター	642,600	2,038.00	1,309,618,800	貸付株式数	578,000株
GMOペイメントゲートウェイ	516,300	13,790.00	7,119,777,000	貸付株式数	40,000株
ザッパラス	103,700	503.00	52,161,100	貸付株式数	4,000株

システムリサーチ	77,600	2,180.00	169,168,000	貸付株式数	31,400株
インターネットイニシア ティブ	710,000	3,600.00	2,556,000,000		
さくらインターネット	285,600	598.00	170,788,800	貸付株式数	257,000株 (37,000株)
ヴィンクス	74,800	941.00	70,386,800	貸付株式数	36,600株
GMOグローバルサインH D	59,200	4,445.00	263,144,000	貸付株式数	53,000株 (4,000株)
SRAホールディングス	141,500	2,683.00	379,644,500		
システムインテグレータ	74,800	642.00	48,021,600	貸付株式数	23,500株
朝日ネット	215,900	676.00	145,948,400	貸付株式数	2,800株
eBASE	318,300	831.00	264,507,300	貸付株式数	269,900株
アバント	285,500	1,582.00	451,661,000		
アドソル日進	94,800	2,177.00	206,379,600		
ODKソリューションズ	55,400	795.00	44,043,000	貸付株式数	500株
フリービット	158,100	768.00	121,420,800	貸付株式数	142,000株 (17,000株)
コムチュア	244,800	2,360.00	577,728,000	貸付株式数	14,400株
サイバーコム	47,400	1,421.00	67,355,400	貸付株式数	31,600株
アステリア	192,000	801.00	153,792,000	貸付株式数	132,000株
アイル	148,000	1,323.00	195,804,000	貸付株式数	35,500株
王子ホールディングス	11,982,000	628.00	7,524,696,000		
日本製紙	1,177,100	1,240.00	1,459,604,000	貸付株式数	35,800株
三菱製紙	377,500	351.00	132,502,500		
北越コーポレーション	1,904,100	600.00	1,142,460,000	貸付株式数	494,900株
中越パルプ	101,500	1,235.00	125,352,500		
巴川製紙	87,700	772.00	67,704,400		
大王製紙	1,283,300	1,767.00	2,267,591,100		
阿波製紙	68,700	400.00	27,480,000		
マークライنز	111,400	2,890.00	321,946,000		
メディカル・データ・ピジ	303,900	1,991.00	605,064,900	貸付株式数	141,300株
gumi	368,900	759.00	279,995,100	貸付株式数	181,200株
ショーケース	57,300	713.00	40,854,900	貸付株式数	51,000株
モバイルファクトリー	59,700	1,132.00	67,580,400	貸付株式数	53,000株
テラスカイ	86,100	2,387.00	205,520,700	貸付株式数	77,000株 (900株)
デジタル・インフォメー ション	117,800	1,853.00	218,283,400	貸付株式数	81,100株
PCIホールディングス	119,300	1,134.00	135,286,200	貸付株式数	53,700株

パイプドHD	55,000	2,264.00	124,520,000	貸付株式数 31,400株 (4,500株)
アイビーシー	43,500	951.00	41,368,500	貸付株式数 38,100株
ネオジャパン	50,300	1,459.00	73,387,700	貸付株式数 45,000株
P R T I M E S	56,800	3,415.00	193,972,000	貸付株式数 50,800株
ラクス	802,800	3,315.00	2,661,282,000	貸付株式数 100,000株
ランドコンピュータ	40,400	1,106.00	44,682,400	貸付株式数 22,800株
ダブルスタンダード	34,400	5,420.00	186,448,000	貸付株式数 600株
オープンドア	158,300	2,312.00	365,989,600	貸付株式数 140,000株 (8,700株)
マイネット	87,300	676.00	59,014,800	貸付株式数 66,000株
アカツキ	106,800	3,380.00	360,984,000	貸付株式数 16,000株
ベネフィットジャパン	20,000	1,935.00	38,700,000	貸付株式数 13,100株
UBICOMホールディングス	69,800	3,665.00	255,817,000	貸付株式数 8,400株 (8,000株)
カナミックネットワーク	284,200	609.00	173,077,800	貸付株式数 17,200株
ノムラシステムコーポレーション	117,100	298.00	34,895,800	貸付株式数 104,000株
レンゴー	2,744,300	898.00	2,464,381,400	
トーモク	163,300	1,899.00	310,106,700	貸付株式数 80,000株
ザ・パック	201,400	2,688.00	541,363,200	貸付株式数 1,900株
チェンジ	490,600	2,648.00	1,299,108,800	貸付株式数 15,800株
シンクロ・フード	158,900	366.00	58,157,400	貸付株式数 143,000株
オークネット	141,200	1,398.00	197,397,600	
キャピタル・アセット・プラン	53,000	987.00	52,311,000	
セグエグループ	68,700	1,062.00	72,959,400	貸付株式数 22,700株
エイトレッド	50,500	2,254.00	113,827,000	貸付株式数 45,000株
AOI TYO HOLDINGS	269,400	898.00	241,921,200	貸付株式数 100株
マクロミル	545,000	817.00	445,265,000	貸付株式数 50,200株
ビーグリー	52,200	1,494.00	77,986,800	貸付株式数 45,000株
オロ	84,100	3,700.00	311,170,000	
ユーザーローカル	80,500	2,008.00	161,644,000	貸付株式数 400株
テモナ	57,600	1,106.00	63,705,600	貸付株式数 51,000株
ニーズウェル	54,300	633.00	34,371,900	
サインポスト	64,100	789.00	50,574,900	貸付株式数 57,000株 (14,200株)
昭和電工	2,021,000	3,090.00	6,244,890,000	
住友化学	20,951,100	557.00	11,669,762,700	

住友精化	129,800	3,585.00	465,333,000	
日産化学	1,458,000	5,190.00	7,567,020,000	
ラサ工業	87,200	1,820.00	158,704,000	貸付株式数 400株
クレハ	228,100	6,480.00	1,478,088,000	
多木化学	103,800	5,040.00	523,152,000	貸付株式数 68,300株
テイカ	195,200	1,280.00	249,856,000	
石原産業	477,100	1,102.00	525,764,200	
片倉コープアグリ	68,600	1,209.00	82,937,400	
日本曹達	372,000	3,135.00	1,166,220,000	
東ソー	4,114,100	1,929.00	7,936,098,900	
トクヤマ	790,700	2,208.00	1,745,865,600	
セントラル硝子	507,700	2,097.00	1,064,646,900	
東亜合成	1,623,700	1,120.00	1,818,544,000	貸付株式数 50,000株
大阪ソーダ	270,600	2,389.00	646,463,400	
関東電化	631,100	987.00	622,895,700	貸付株式数 5,700株
デンカ	971,300	3,635.00	3,530,675,500	貸付株式数 500株
イビデン	1,307,300	6,100.00	7,974,530,000	
信越化学	4,921,700	17,690.00	87,064,873,000	
日本カ-バイド	97,800	1,283.00	125,477,400	貸付株式数 600株
電算システムHD	99,900	2,931.00	292,806,900	
堺化学	186,600	1,819.00	339,425,400	
第一稀元素化学工	267,600	1,758.00	470,440,800	貸付株式数 59,500株
エア・ウォーター	2,713,800	1,632.00	4,428,921,600	貸付株式数 78,900株
日本酸素HLDGS	2,192,500	2,339.00	5,128,257,500	
日本化学工業	75,300	3,095.00	233,053,500	
東邦アセチレン	39,900	1,180.00	47,082,000	
日本パ-カラライジング	1,342,500	1,088.00	1,460,640,000	
高压ガス	422,100	664.00	280,274,400	貸付株式数 31,600株
チタン工業	33,200	1,861.00	61,785,200	貸付株式数 22,000株
四国化成	353,600	1,269.00	448,718,400	貸付株式数 1,600株
戸田工業	56,600	2,653.00	150,159,800	
ステラケミファ	145,000	2,798.00	405,710,000	貸付株式数 45,700株
保土谷化学	78,100	3,840.00	299,904,000	貸付株式数 2,400株
日本触媒	482,000	5,190.00	2,501,580,000	
大日精化	219,800	2,216.00	487,076,800	貸付株式数 1,200株
カネカ	688,500	4,400.00	3,029,400,000	
協和キリン	2,733,600	3,925.00	10,729,380,000	
三菱瓦斯化学	2,666,400	2,259.00	6,023,397,600	
三井化学	2,297,300	3,575.00	8,212,847,500	
J S R	2,670,900	3,485.00	9,308,086,500	

東京応化工業	456,700	7,010.00	3,201,467,000	貸付株式数	102,400株
大阪有機化学	245,700	3,615.00	888,205,500		
三菱ケミカルHLDGS	17,789,600	927.40	16,498,075,040		
KHネオケム	438,900	2,488.00	1,091,983,200	貸付株式数	219,400株
ダイセル	3,578,400	912.00	3,263,500,800		
住友ベークライト	418,400	4,815.00	2,014,596,000		
積水化学	5,569,500	1,867.00	10,398,256,500		
日本ゼオン	2,400,300	1,419.00	3,406,025,700	貸付株式数	545,600株 (493,500株)
アイカ工業	741,400	3,760.00	2,787,664,000		
宇部興産	1,344,000	2,192.00	2,946,048,000		
積水樹脂	402,000	2,108.00	847,416,000		
タキロンシーアイ	575,800	590.00	339,722,000	貸付株式数	100株
旭有機材	150,400	1,328.00	199,731,200		
ニチバン	140,100	1,735.00	243,073,500	貸付株式数	30,600株
リケンテクノス	649,100	572.00	371,285,200		
大倉工業	125,800	2,393.00	301,039,400		
積水化成成品	356,800	596.00	212,652,800		
群栄化学	60,800	2,431.00	147,804,800		
タイガースポリマー	140,100	464.00	65,006,400	貸付株式数	3,000株
ミライアル	85,400	1,263.00	107,860,200	貸付株式数	600株
ダイキアクシス	101,800	833.00	84,799,400	貸付株式数	90,000株
ダイキョーニシカワ	561,100	689.00	386,597,900	貸付株式数	21,400株
竹本容器	95,200	980.00	93,296,000	貸付株式数	13,100株
森六ホールディングス	143,200	2,222.00	318,190,400	貸付株式数	100株
恵和	52,000	3,505.00	182,260,000		
日本化薬	1,647,300	1,075.00	1,770,847,500		
カーリットホールディングス	263,700	725.00	191,182,500	貸付株式数	100株
EPSホールディングス	390,800	1,794.00	701,095,200		
ソルクシーズ	101,900	942.00	95,989,800	貸付株式数	90,000株
レグス	64,100	2,566.00	164,480,600	貸付株式数	56,500株
プレステージ・インター	972,900	716.00	696,596,400	貸付株式数	2,700株
フェイス	81,700	709.00	57,925,300	貸付株式数	100株
プロトコーポレーション	318,300	1,325.00	421,747,500	貸付株式数	2,200株
ハイマックス	75,400	1,082.00	81,582,800		
アミューズ	141,500	2,343.00	331,534,500		
野村総合研究所	4,632,100	3,580.00	16,582,918,000		
ドリームインキュベータ	79,200	994.00	78,724,800		
サイバネットシステム	189,400	687.00	130,117,800	貸付株式数	53,700株

クイック	161,200	1,205.00	194,246,000	貸付株式数	5,900株
T A C	140,600	230.00	32,338,000	貸付株式数	3,300株
C Eホールディングス	141,000	542.00	76,422,000	貸付株式数	115,000株
日本システム技術	47,400	1,505.00	71,337,000		
電通グループ	2,920,100	4,000.00	11,680,400,000	貸付株式数	115,200株
インテージホールディングス	332,500	1,560.00	518,700,000		
テイクアンドギヴニーズ	121,300	1,001.00	121,421,300	貸付株式数	1,900株
東邦システムサイエンス	70,200	940.00	65,988,000	貸付株式数	15,400株
ぴあ	74,200	3,495.00	259,329,000	貸付株式数	51,300株 (700株)
イオンファンタジー	100,100	2,142.00	214,414,200	貸付株式数	89,900株 (8,000株)
ソースネクスト	1,264,500	305.00	385,672,500	貸付株式数	349,700株 (92,000株)
シーティーエス	292,900	830.00	243,107,000	貸付株式数	8,100株
ネクシーズグループ	90,600	903.00	81,811,800	貸付株式数	80,700株
インフォコム	242,900	2,814.00	683,520,600		
メディカルシステムネットワーク	232,600	733.00	170,495,800	貸付株式数	86,300株
日本精化	192,600	1,584.00	305,078,400	貸付株式数	8,500株
扶桑化学工業	209,600	4,260.00	892,896,000		
トリケミカル	246,700	3,120.00	769,704,000	貸付株式数	129,900株
H E R O Z	76,100	2,105.00	160,190,500	貸付株式数	68,000株 (10,000株)
ラクスル	289,700	5,550.00	1,607,835,000	貸付株式数	131,400株
I P S	62,700	3,005.00	188,413,500	貸付株式数	55,900株
F I G	288,500	276.00	79,626,000	貸付株式数	33,300株
システムサポート	78,700	1,330.00	104,671,000	貸付株式数	50,300株
A D E K A	1,225,200	2,066.00	2,531,263,200	貸付株式数	17,700株
日油	1,002,100	5,620.00	5,631,802,000		
ミヨシ油脂	95,700	1,261.00	120,677,700	貸付株式数	200株
新日本理化	440,500	264.00	116,292,000	貸付株式数	1,900株
ハリマ化成グループ	198,000	864.00	171,072,000		
イーソル	144,900	1,018.00	147,508,200	貸付株式数	130,000株
アルテリア・ネットワークス	295,300	1,888.00	557,526,400	貸付株式数	5,900株
E D U L A B	25,300	5,250.00	132,825,000	貸付株式数	4,400株
東海ソフト	41,500	1,468.00	60,922,000	貸付株式数	32,500株
ウイングアーク1 S T	140,300	2,113.00	296,453,900	貸付株式数	1,000株

ヒト・コミュニケーションズHD	60,400	2,210.00	133,484,000		
サーバーワークス	25,900	3,900.00	101,010,000	貸付株式数	12,500株
東名	24,800	1,052.00	26,089,600	貸付株式数	21,900株 (1,000株)
ヴィッツ	24,500	1,988.00	48,706,000	貸付株式数	14,800株
トビラシステムズ	35,400	1,303.00	46,126,200	貸付株式数	31,000株
Sansan	236,700	8,730.00	2,066,391,000	貸付株式数	94,000株
Link-U	47,700	1,650.00	78,705,000	貸付株式数	42,000株
ギフトィ	161,400	3,675.00	593,145,000	貸付株式数	145,000株 (34,500株)
花王	6,506,900	6,664.00	43,361,981,600	貸付株式数	1,359,100株
第一工業製薬	90,200	3,170.00	285,934,000	貸付株式数	900株
石原ケミカル	67,100	2,124.00	142,520,400	貸付株式数	58,400株
日華化学	89,700	1,287.00	115,443,900	貸付株式数	42,700株
ニイタカ	55,200	2,062.00	113,822,400	貸付株式数	45,000株
三洋化成	158,900	5,210.00	827,869,000		
ベース	30,200	5,300.00	160,060,000	貸付株式数	27,000株
武田薬品	22,609,900	3,644.00	82,390,475,600		
アステラス製薬	23,562,400	1,871.00	44,085,250,400		
大日本住友製薬	2,014,200	2,185.00	4,401,027,000		
塩野義製薬	3,417,500	5,678.00	19,404,565,000		
わかもと製薬	323,300	308.00	99,576,400	貸付株式数	264,000株
日本新薬	770,600	8,580.00	6,611,748,000		
ピオファエルミン製薬	46,200	2,932.00	135,458,400		
中外製薬	8,500,000	4,124.00	35,054,000,000		
科研製薬	465,200	4,695.00	2,184,114,000	貸付株式数	3,200株
エーザイ	3,002,500	10,695.00	32,111,737,500		
理研ビタミン	257,500	1,565.00	402,987,500	貸付株式数	3,000株
ロート製薬	1,295,200	2,983.00	3,863,581,600		
小野薬品	6,240,800	2,450.00	15,289,960,000		
久光製薬	790,500	5,270.00	4,165,935,000	貸付株式数	2,500株
有機合成薬品	203,900	380.00	77,482,000	貸付株式数	166,000株
持田製薬	377,100	3,590.00	1,353,789,000	貸付株式数	2,200株
参天製薬	4,729,300	1,513.00	7,155,430,900		
扶桑薬品	87,800	2,194.00	192,633,200		
日本ケミファ	32,400	2,248.00	72,835,200	貸付株式数	200株
ツムラ	906,600	3,360.00	3,046,176,000	貸付株式数	20,400株
日医工	769,700	858.00	660,402,600	貸付株式数	494,000株
テルモ	8,330,700	4,404.00	36,688,402,800		

HUグループHD	726,700	2,801.00	2,035,486,700	貸付株式数	12,800株
キッセイ薬品工業	480,900	2,150.00	1,033,935,000		
生化学工業	479,400	1,081.00	518,231,400		
栄研化学	477,700	2,121.00	1,013,201,700		
日水製薬	99,900	988.00	98,701,200		
鳥居薬品	170,200	2,380.00	405,076,000		
JCRファーマ	766,000	3,580.00	2,742,280,000		
東和薬品	391,200	2,510.00	981,912,000		
富士製薬工業	167,200	1,120.00	187,264,000		
ゼリア新薬工業	493,100	2,052.00	1,011,841,200	貸付株式数	109,900株
第一三共	21,355,700	2,237.50	47,783,378,750		
キョーリン製薬HD	599,600	1,759.00	1,054,696,400	貸付株式数	800株
大幸薬品	335,100	951.00	318,680,100	貸付株式数	301,000株
ダイト	173,700	3,355.00	582,763,500	貸付株式数	900株
大塚ホールディングス	5,647,900	4,304.00	24,308,561,600	貸付株式数	2,900株
大正製薬HD	646,500	5,870.00	3,794,955,000	貸付株式数	58,100株
ペプチドリーム	1,426,000	4,835.00	6,894,710,000	貸付株式数	4,700株
大日本塗料	300,800	839.00	252,371,200		
日本ペイントHOLD	10,980,300	1,382.00	15,174,774,600	貸付株式数	2,266,500株
関西ペイント	2,990,300	2,742.00	8,199,402,600	貸付株式数	52,400株
神東塗料	209,200	191.00	39,957,200	貸付株式数	600株
中国塗料	641,000	868.00	556,388,000	貸付株式数	23,800株
日本特殊塗料	199,100	1,119.00	222,792,900		
藤倉化成	358,900	506.00	181,603,400		
太陽ホールディングス	195,600	5,020.00	981,912,000	貸付株式数	3,100株
DIC	1,124,000	2,698.00	3,032,552,000	貸付株式数	722,000株
サカイクス	580,900	985.00	572,186,500	貸付株式数	1,800株
東洋インキSCホールディングン	562,500	1,941.00	1,091,812,500	貸付株式数	460,000株
T&K TOKA	185,500	838.00	155,449,000		
アルプス技研	229,600	1,905.00	437,388,000	貸付株式数	400株
サニックス	412,800	354.00	146,131,200	貸付株式数	371,000株 (3,000株)
ダイオーズ	51,100	1,034.00	52,837,400	貸付株式数	45,000株
日本空調サービス	271,700	720.00	195,624,000		
オリエンタルランド	2,761,600	15,825.00	43,702,320,000	貸付株式数	129,400株
フォーカスシステムズ	178,800	964.00	172,363,200	貸付株式数	27,900株
ダスキン	602,300	2,545.00	1,532,853,500	貸付株式数	17,600株
パーク24	1,439,000	2,052.00	2,952,828,000	貸付株式数	556,100株

明光ネットワークジャパン	304,900	580.00	176,842,000	貸付株式数 211,000株 (30,000株)
ファルコホールディングス	123,800	1,642.00	203,279,600	貸付株式数 800株
クレスコ	174,700	1,856.00	324,243,200	
フジ・メディア・HD	2,766,300	1,215.00	3,361,054,500	貸付株式数 66,200株
秀英予備校	56,600	410.00	23,206,000	貸付株式数 50,000株
田谷	47,400	556.00	26,354,400	貸付株式数 38,000株 (200株)
ラウンドワン	885,800	1,434.00	1,270,237,200	貸付株式数 32,100株
リゾートトラスト	1,190,400	1,851.00	2,203,430,400	貸付株式数 637,100株
オービック	840,400	20,430.00	17,169,372,000	
ジャストシステム	379,300	6,280.00	2,382,004,000	貸付株式数 20,400株
TDCソフト	233,000	1,005.00	234,165,000	貸付株式数 13,800株
Zホールディングス	36,634,900	544.30	19,940,376,070	
ビー・エム・エル	334,200	3,835.00	1,281,657,000	貸付株式数 11,600株
トレンドマイクロ	1,424,700	5,710.00	8,135,037,000	
りらいあコミュニケーション	394,700	1,377.00	543,501,900	貸付株式数 43,800株
IDホールディングス	152,500	928.00	141,520,000	
リソー教育	1,317,900	330.00	434,907,000	
日本オラクル	540,900	8,070.00	4,365,063,000	貸付株式数 700株
早稲田アカデミー	110,000	943.00	103,730,000	貸付株式数 97,400株
アルファシステムズ	71,200	3,675.00	261,660,000	貸付株式数 14,500株
フューチャー	321,700	1,902.00	611,873,400	貸付株式数 3,600株
CAC HOLDINGS	173,400	1,429.00	247,788,600	
SBテクノロジー	96,000	2,982.00	286,272,000	貸付株式数 21,400株
トーセ	72,100	799.00	57,607,900	貸付株式数 58,000株
ユー・エス・エス	2,907,300	1,871.00	5,439,558,300	
オービックビジネスC	254,400	6,340.00	1,612,896,000	貸付株式数 141,200株
伊藤忠テクノソリューションズ	1,215,000	3,385.00	4,112,775,000	
アイティフォー	347,600	768.00	266,956,800	貸付株式数 9,300株
東京個別指導学院	229,000	616.00	141,064,000	貸付株式数 6,800株
東計電算	39,500	4,530.00	178,935,000	貸付株式数 2,500株
サイバーエージェント	6,400,200	2,272.00	14,541,254,400	
楽天グループ	12,131,900	1,277.00	15,492,436,300	貸付株式数 5,480,900株
エックスネット	41,800	1,027.00	42,928,600	
クリーク・アンド・リバー社	136,000	1,640.00	223,040,000	貸付株式数 1,500株
モーニングスター	378,300	466.00	176,287,800	
テー・オー・ダブリュー	454,500	316.00	143,622,000	貸付株式数 369,000株
大塚商会	1,442,800	5,700.00	8,223,960,000	貸付株式数 394,000株

サイボウズ	311,600	2,422.00	754,695,200	貸付株式数	121,400株
山田コンサルティングG P	151,200	1,159.00	175,240,800	貸付株式数	55,800株
セントラルスポーツ	96,800	2,409.00	233,191,200	貸付株式数	79,400株
パラカ	69,300	1,681.00	116,493,300	貸付株式数	62,000株
電通国際情報S	330,000	4,580.00	1,511,400,000	貸付株式数	132,000株
A C C E S S	333,100	865.00	288,131,500	貸付株式数	252,200株
デジタルガレージ	440,500	4,850.00	2,136,425,000	貸付株式数	27,800株
イーエムシステムズ	440,100	819.00	360,441,900	貸付株式数	10,700株
ウェザーニューズ	80,000	5,540.00	443,200,000	貸付株式数	14,100株
C I J	172,300	833.00	143,525,900		
ビジネスエンジニアリング	26,600	3,170.00	84,322,000	貸付株式数	23,000株
日本エンタープライズ	270,900	208.00	56,347,200	貸付株式数	68,900株
WOWOW	127,800	2,432.00	310,809,600	貸付株式数	115,000株
スカラ	237,300	761.00	180,585,300	貸付株式数	47,400株
インテリジェント ウェイ ブ	155,700	592.00	92,174,400		
フルキャストホールディン グス	221,300	2,262.00	500,580,600	貸付株式数	22,600株
エン・ジャパン	461,500	3,880.00	1,790,620,000		
あすか製薬HD	309,400	935.00	289,289,000		
サワイグループHD	595,200	4,640.00	2,761,728,000		
富士フイルムHLDGS	4,776,100	8,182.00	39,078,050,200		
コニカミノルタ	5,513,300	601.00	3,313,493,300		
資 生 堂	5,399,900	7,910.00	42,713,209,000		
ライオン	3,533,200	1,956.00	6,910,939,200	貸付株式数	1,701,500株
高砂香料	170,100	2,680.00	455,868,000	貸付株式数	500株
マンダム	570,100	1,932.00	1,101,433,200	貸付株式数	254,700株
ミルボン	363,200	6,100.00	2,215,520,000		
ファンケル	989,800	3,475.00	3,439,555,000	貸付株式数	148,300株
コーセー	511,300	17,100.00	8,743,230,000		
コタ	172,300	1,415.00	243,804,500		
シーボン	35,200	1,965.00	69,168,000	貸付株式数	1,700株
ポーラ・オルビスHD	1,160,000	2,815.00	3,265,400,000	貸付株式数	989,800株
ノエビアホールディングス	230,500	5,540.00	1,276,970,000	貸付株式数	4,900株
アジュバンコスメジャパン	60,800	1,034.00	62,867,200	貸付株式数	15,900株
新日本製薬	73,800	2,085.00	153,873,000	貸付株式数	66,000株
エステー	174,700	1,698.00	296,640,600	貸付株式数	100株
アグロカネショウ	101,800	1,382.00	140,687,600	貸付株式数	4,800株
コ ニ シ	446,500	1,558.00	695,647,000	貸付株式数	7,900株
長谷川香料	468,500	2,429.00	1,137,986,500	貸付株式数	2,200株

星光PMC	155,700	928.00	144,489,600		
小林製薬	761,500	9,190.00	6,998,185,000	貸付株式数	241,900株
荒川化学工業	226,500	1,172.00	265,458,000	貸付株式数	13,900株
メック	186,400	3,255.00	606,732,000	貸付株式数	51,100株 (20,200株)
日本高純度化学	74,700	2,861.00	213,716,700	貸付株式数	400株
タカラバイオ	711,200	2,817.00	2,003,450,400		
JCU	305,600	3,595.00	1,098,632,000		
新田ゼラチン	170,600	628.00	107,136,800		
OATアグリオ	51,400	1,396.00	71,754,400		
デクセリアルズ	759,700	2,318.00	1,760,984,600		
アース製薬	204,600	6,190.00	1,266,474,000	貸付株式数	25,500株
北興化学	252,900	925.00	233,932,500		
大成ラミック	83,300	2,717.00	226,326,100	貸付株式数	100株
クミアイ化学	1,123,700	822.00	923,681,400	貸付株式数	48,500株
日本農薬	484,200	508.00	245,973,600		
富士興産	81,200	1,092.00	88,670,400	貸付株式数	19,300株
ニチレキ	320,800	1,300.00	417,040,000		
ユシロ化学	152,500	1,168.00	178,120,000		
ビーピー・カストロール	97,000	1,337.00	129,689,000	貸付株式数	100株
富士石油	659,600	260.00	171,496,000	貸付株式数	590,000株
MORESCO	98,200	1,064.00	104,484,800		
出光興産	3,015,700	2,581.00	7,783,521,700		
ENEOSホールディングス	40,875,700	464.30	18,978,587,510		
コスモエネルギーHLDGS	858,400	2,484.00	2,132,265,600		
テスホールディングス	155,400	1,997.00	310,333,800	貸付株式数	139,000株
横浜ゴム	1,573,700	2,269.00	3,570,725,300		
TOYO TIRE	1,430,300	2,213.00	3,165,253,900	貸付株式数	170,800株
ブリヂストン	7,224,600	4,956.00	35,805,117,600	貸付株式数	3,350,900株
住友ゴム	2,441,300	1,499.00	3,659,508,700	貸付株式数	1,969,700株
藤倉コンポジット	237,300	482.00	114,378,600		
オカモト	161,200	4,115.00	663,338,000		
アキレス	187,300	1,383.00	259,035,900	貸付株式数	500株
フコク	118,900	913.00	108,555,700		
ニッタ	280,900	2,629.00	738,486,100		
クリエートメディック	89,700	966.00	86,650,200		
住友理工	526,800	711.00	374,554,800		
三ツ星ベルト	330,100	1,733.00	572,063,300	貸付株式数	1,500株

バンドー化学	478,100	895.00	427,899,500	
A G C	2,494,700	4,550.00	11,350,885,000	貸付株式数 1,434,600株
日本板硝子	1,379,300	603.00	831,717,900	貸付株式数 156,700株
石塚硝子	46,300	1,880.00	87,044,000	貸付株式数 7,700株
有沢製作所	378,200	872.00	329,790,400	貸付株式数 20,300株
日本山村硝子	112,900	911.00	102,851,900	貸付株式数 300株
日本電気硝子	1,007,600	2,447.00	2,465,597,200	
オハラ	107,400	1,413.00	151,756,200	貸付株式数 96,000株 (17,800株)
住友大阪セメント	489,100	2,982.00	1,458,496,200	貸付株式数 8,400株
太平洋セメント	1,543,900	2,470.00	3,813,433,000	
リソルホールディングス	28,200	3,970.00	111,954,000	貸付株式数 3,500株
日本ヒユ - ム	247,600	728.00	180,252,800	貸付株式数 2,400株
日本コンクリ - ト	584,900	310.00	181,319,000	
三谷セキサン	126,600	4,325.00	547,545,000	貸付株式数 600株
アジアパイルHD	417,800	449.00	187,592,200	
東海カーボン	2,657,000	1,438.00	3,820,766,000	
日本カーボン	149,800	4,065.00	608,937,000	貸付株式数 7,200株
東洋炭素	159,500	2,758.00	439,901,000	貸付株式数 23,700株
ノリタケ	150,400	4,140.00	622,656,000	貸付株式数 4,300株
T O T O	1,941,100	5,610.00	10,889,571,000	
日本碍子	2,990,500	1,804.00	5,394,862,000	
日本特殊陶業	2,067,200	1,597.00	3,301,318,400	貸付株式数 56,400株
ダントーホールディングス	202,400	256.00	51,814,400	貸付株式数 117,000株 (4,000株)
M A R U W A	94,000	10,590.00	995,460,000	貸付株式数 4,300株
品川リフラクトリーズ	63,700	3,855.00	245,563,500	
黒崎播磨	46,200	4,755.00	219,681,000	
ヨータイ	194,200	1,309.00	254,207,800	
イソライト	119,600	659.00	78,816,400	
東京窯業	345,300	311.00	107,388,300	
ニッカトー	122,900	671.00	82,465,900	貸付株式数 400株
フジインコーポレーテッド	217,900	4,740.00	1,032,846,000	
クニミネ工業	85,400	1,163.00	99,320,200	
エーアンドエーマテリアル	52,500	1,009.00	52,972,500	
ニチアス	686,600	2,744.00	1,884,030,400	
日本製鉄	12,829,000	1,783.50	22,880,521,500	貸付株式数 67,500株
神戸製鋼所	4,918,700	693.00	3,408,659,100	貸付株式数 15,000株
中山製鋼所	372,600	391.00	145,686,600	

合同製鐵	144,700	1,596.00	230,941,200	貸付株式数	42,800株
J F Eホールディングス	7,776,200	1,255.00	9,759,131,000	貸付株式数	15,200株
東京製鐵	1,046,600	1,039.00	1,087,417,400	貸付株式数	4,000株
共英製鋼	303,000	1,386.00	419,958,000	貸付株式数	76,800株
大和工業	570,900	3,450.00	1,969,605,000		
東京鐵鋼	102,800	1,548.00	159,134,400	貸付株式数	12,900株
大阪製鐵	142,800	1,085.00	154,938,000	貸付株式数	1,400株
淀川製鋼所	352,700	2,250.00	793,575,000	貸付株式数	5,100株
丸一鋼管	872,500	2,599.00	2,267,627,500	貸付株式数	8,200株
モリ工業	79,500	2,277.00	181,021,500		
大同特殊鋼	440,000	5,160.00	2,270,400,000	貸付株式数	3,600株
日本高周波	99,200	379.00	37,596,800		
日本冶金工	209,100	2,219.00	463,992,900		
山陽特殊製鋼	321,900	1,546.00	497,657,400	貸付株式数	400株
愛知製鋼	151,100	2,984.00	450,882,400		
日立金属	2,533,200	2,128.00	5,390,649,600		
日本金属	67,900	926.00	62,875,400	貸付株式数	29,300株
大平洋金属	181,800	1,652.00	300,333,600		
新日本電工	1,733,600	296.00	513,145,600	貸付株式数	207,900株
栗本鉄工所	121,600	1,664.00	202,342,400		
虹 技	36,900	1,100.00	40,590,000	貸付株式数	100株
日本鑄鉄管	30,600	1,237.00	37,852,200	貸付株式数	100株
日本製鋼所	815,700	2,679.00	2,185,260,300		
三菱製鋼	198,700	1,030.00	204,661,000		
日亜鋼業	393,000	284.00	111,612,000	貸付株式数	3,700株
日本精線	38,400	4,435.00	170,304,000	貸付株式数	100株
エンビプロHD	114,400	1,220.00	139,568,000	貸付株式数	102,000株
大紀アルミニウム	405,000	1,114.00	451,170,000	貸付株式数	3,500株
日本軽金属HD	732,300	1,858.00	1,360,613,400		
三井金属	725,100	3,010.00	2,182,551,000		
東邦亜鉛	149,100	1,859.00	277,176,900	貸付株式数	5,600株
三菱マテリアル	1,775,100	2,198.00	3,901,669,800		
住友鋁山	3,435,100	4,291.00	14,740,014,100		
D O W Aホールディングス	679,900	4,250.00	2,889,575,000		
古河機金	443,700	1,237.00	548,856,900		
エス・サイエンス	1,257,800	37.00	46,538,600	貸付株式数	69,600株
大阪チタニウム	279,400	779.00	217,652,600	貸付株式数	251,000株 (8,200株)
東邦チタニウム	481,100	1,007.00	484,467,700	貸付株式数	355,700株
U A C J	407,800	2,772.00	1,130,421,600		

C Kサンエツ	56,100	2,981.00	167,234,100	貸付株式数	46,500株
古河電工	834,800	2,675.00	2,233,090,000		
住友電工	9,378,000	1,544.00	14,479,632,000	貸付株式数	28,400株
フジクラ	3,245,200	545.00	1,768,634,000		
昭和電線HLDGS	260,000	1,795.00	466,700,000		
東京特殊電線	34,500	2,576.00	88,872,000	貸付株式数	26,400株
タツタ電線	473,600	551.00	260,953,600		
カナレ電気	44,500	1,664.00	74,048,000	貸付株式数	39,000株
平河ヒューテック	148,800	1,188.00	176,774,400	貸付株式数	112,400株
リョービ	330,500	1,468.00	485,174,000	貸付株式数	7,700株
アーレステイ	330,000	475.00	156,750,000	貸付株式数	13,100株
アサヒHD	1,008,800	2,207.00	2,226,421,600		
東洋製罐グループHD	1,711,600	1,432.00	2,451,011,200		
ホッカンホールディングス	136,500	1,402.00	191,373,000		
コロナ	148,600	922.00	137,009,200	貸付株式数	1,300株
横河ブリッジHLDGS	461,400	2,019.00	931,566,600	貸付株式数	2,400株
駒井ハルテック	54,600	1,670.00	91,182,000		
高田機工	24,600	2,728.00	67,108,800	貸付株式数	15,800株
三和ホールディングス	2,533,700	1,292.00	3,273,540,400		
文化シャツタ -	791,900	1,160.00	918,604,000	貸付株式数	4,500株
三協立山	346,100	830.00	287,263,000		
アルインコ	177,600	1,022.00	181,507,200		
東洋シャツタ -	59,300	643.00	38,129,900		
LIXIL	3,701,100	2,818.00	10,429,699,800	貸付株式数	3,000株
日本フィルコン	186,900	518.00	96,814,200	貸付株式数	5,900株
ノーリツ	557,100	1,774.00	988,295,400	貸付株式数	10,800株
長府製作所	273,200	2,018.00	551,317,600	貸付株式数	6,000株
リンナイ	522,700	10,220.00	5,341,994,000		
ユニプレス	445,500	951.00	423,670,500		
ダイニチ工業	128,700	751.00	96,653,700	貸付株式数	1,000株
日東精工	337,400	558.00	188,269,200	貸付株式数	7,200株
三洋工業	32,700	1,880.00	61,476,000	貸付株式数	200株
岡 部	544,500	638.00	347,391,000	貸付株式数	8,200株
ジーテクト	333,600	1,500.00	500,400,000		
東 プ レ	501,500	1,523.00	763,784,500	貸付株式数	900株
高周波熱錬	517,400	536.00	277,326,400	貸付株式数	19,100株
東京製綱	192,300	1,092.00	209,991,600	貸付株式数	59,300株
サンコール	229,800	448.00	102,950,400		
モリテックスチル	209,300	465.00	97,324,500	貸付株式数	170,400株
パイオラックス	397,500	1,484.00	589,890,000	貸付株式数	5,400株

エイチワン	263,500	739.00	194,726,500	貸付株式数	400株
日本発条	2,676,900	842.00	2,253,949,800		
中央発條	129,400	1,362.00	176,242,800	貸付株式数	9,500株
アドバネクス	38,600	1,263.00	48,751,800	貸付株式数	31,000株
三浦工業	1,162,900	4,790.00	5,570,291,000		
タクマ	910,300	1,680.00	1,529,304,000	貸付株式数	10,100株
テクノプロ・ホールディング	1,555,200	2,607.00	4,054,406,400	貸付株式数	20,200株
アトラグループ	60,000	329.00	19,740,000	貸付株式数	52,900株
インターワークス	74,500	405.00	30,172,500		
アイ・アールジャパンHD	105,400	14,150.00	1,491,410,000	貸付株式数	53,500株
Keeper 技研	167,100	2,918.00	487,597,800	貸付株式数	15,800株
ファーストロジック	50,000	792.00	39,600,000	貸付株式数	43,100株
三機サービス	50,200	1,066.00	53,513,200	貸付株式数	45,000株
Gunosy	161,700	915.00	147,955,500	貸付株式数	72,400株 (70,400株)
デザインワン・ジャパン	64,000	242.00	15,488,000	貸付株式数	57,000株
イー・ガーディアン	105,400	2,745.00	289,323,000		
リブセンス	142,600	218.00	31,086,800	貸付株式数	108,400株 (36,700株)
ジャパンマテリアル	798,500	1,320.00	1,054,020,000		
ベクトル	323,500	935.00	302,472,500	貸付株式数	115,900株
ウチヤマホールディングス	127,800	373.00	47,669,400	貸付株式数	9,200株
チャームケアコーポレーション	193,100	1,189.00	229,595,900	貸付株式数	17,500株
キャリアリンク	84,900	2,174.00	184,572,600	貸付株式数	76,000株
I B J	212,500	1,139.00	242,037,500	貸付株式数	130,800株 (2,000株)
アサンテ	93,800	1,750.00	164,150,000	貸付株式数	84,000株
バリューHR	103,400	1,639.00	169,472,600	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
M&Aキャピタルパートナー	214,000	5,540.00	1,185,560,000	貸付株式数	191,000株
ライドオンエクスプレスHD	100,600	1,362.00	137,017,200	貸付株式数	82,000株
ERIホールディングス	72,700	628.00	45,655,600	貸付株式数	44,000株
アビスト	40,300	2,941.00	118,522,300	貸付株式数	29,600株 (13,500株)
シグマクシス	142,500	2,299.00	327,607,500		
ウィルグループ	190,500	981.00	186,880,500	貸付株式数	102,800株

エスクロー A J	384,900	251.00	96,609,900		
メドピア	199,900	4,225.00	844,577,500	貸付株式数	163,000株
レアジョブ	48,600	1,683.00	81,793,800	貸付株式数	43,000株
リクルートホールディングス	18,601,900	5,514.00	102,570,876,600		
エラン	357,900	1,219.00	436,280,100		
ツガミ	556,800	1,555.00	865,824,000		
オークマ	313,300	5,200.00	1,629,160,000		
芝浦機械	278,200	2,476.00	688,823,200	貸付株式数	900株
アマダ	3,939,000	1,087.00	4,281,693,000		
アイダエンジニア	703,100	934.00	656,695,400	貸付株式数	300株
滝澤鉄工所	77,700	1,111.00	86,324,700		
F U J I	1,073,000	2,452.00	2,630,996,000		
牧野フライス	315,000	4,190.00	1,319,850,000	貸付株式数	8,800株
オーエスジー	1,325,400	1,963.00	2,601,760,200	貸付株式数	8,700株
ダイジェット	30,300	1,294.00	39,208,200	貸付株式数	200株
旭ダイヤモンド	704,900	518.00	365,138,200	貸付株式数	90,000株
D M G 森精機	1,700,300	1,781.00	3,028,234,300	貸付株式数	954,000株
ソディック	644,800	1,003.00	646,734,400		
ディスコ	365,200	32,650.00	11,923,780,000		
日東工器	128,800	1,830.00	235,704,000		
日進工具	210,900	1,432.00	302,008,800	貸付株式数	100,200株
パンチ工業	223,900	608.00	136,131,200		
富士ダイス	135,100	653.00	88,220,300		
土木管理総合試験	126,500	394.00	49,841,000	貸付株式数	113,000株
ネットマーケティング	126,100	399.00	50,313,900	貸付株式数	57,200株
日本郵政	19,643,800	910.50	17,885,679,900		
ベルシステム 2 4 H L D G S	435,200	1,750.00	761,600,000	貸付株式数	99,900株
鎌倉新書	261,800	979.00	256,302,200	貸付株式数	235,000株 (129,300株)
S M N	55,700	793.00	44,170,100	貸付株式数	49,400株
一蔵	32,600	418.00	13,626,800	貸付株式数	2,400株
グローバルキッズCOMP	47,000	923.00	43,381,000	貸付株式数	1,800株
エアトリ	162,700	2,789.00	453,770,300	貸付株式数	145,500株
アトラエ	180,500	2,197.00	396,558,500	貸付株式数	161,600株
ストライク	98,000	3,750.00	367,500,000	貸付株式数	88,000株
ソラスト	637,400	1,366.00	870,688,400	貸付株式数	1,900株
セラク	81,800	2,128.00	174,070,400	貸付株式数	73,000株
インソース	251,700	2,495.00	627,991,500	貸付株式数	195,100株

豊田自動織機	2,199,400	9,240.00	20,322,456,000		
豊和工業	148,300	809.00	119,974,700	貸付株式数	53,800株
OKK	103,200	431.00	44,479,200		
石川製作所	70,100	1,527.00	107,042,700	貸付株式数	48,000株 (4,500株)
東洋機械金属	192,100	507.00	97,394,700		
津田駒工業	51,700	872.00	45,082,400	貸付株式数	800株
エンシュウ	64,400	842.00	54,224,800		
島精機製作所	392,700	1,839.00	722,175,300	貸付株式数	48,300株
オプトラン	336,800	2,357.00	793,837,600	貸付株式数	18,900株
NCホールディングス	81,200	1,258.00	102,149,600		
イワキポンプ	170,900	895.00	152,955,500		
フリーー	262,600	1,370.00	359,762,000		
ヤマシンフィルタ	541,600	718.00	388,868,800	貸付株式数	487,000株 (20,000株)
日阪製作所	331,400	820.00	271,748,000	貸付株式数	900株
やまびこ	521,100	1,224.00	637,826,400		
平田機工	127,100	6,280.00	798,188,000	貸付株式数	2,800株
ペガサスマシン製造	272,300	459.00	124,985,700	貸付株式数	300株
マルマエ	110,200	2,141.00	235,938,200	貸付株式数	98,000株 (13,200株)
タツモ	114,000	1,708.00	194,712,000	貸付株式数	7,900株
ナプテスコ	1,583,800	4,015.00	6,358,957,000	貸付株式数	609,700株
三井海洋開発	285,500	1,951.00	557,010,500	貸付株式数	200株
レオン自動機	263,500	1,335.00	351,772,500	貸付株式数	9,400株
SMC	795,800	65,260.00	51,933,908,000		
ホソカワミクロン	94,500	5,990.00	566,055,000		
ユニオンツール	100,200	4,015.00	402,303,000	貸付株式数	22,700株
オイレス工業	376,200	1,550.00	583,110,000	貸付株式数	244,200株
日精エーエスピー	90,700	4,720.00	428,104,000		
サト - ホールディングス	353,600	2,672.00	944,819,200		
技研製作所	236,900	4,750.00	1,125,275,000		
日本エアーテック	87,800	1,224.00	107,467,200	貸付株式数	79,000株
カワタ	73,000	868.00	63,364,000	貸付株式数	34,800株
日精樹脂工業	206,600	1,337.00	276,224,200	貸付株式数	3,500株
オカダアイヨン	84,900	1,304.00	110,709,600		
ワイエイシイホールディングス	107,100	1,095.00	117,274,500		
小松製作所	12,310,800	2,622.00	32,278,917,600	貸付株式数	1,565,700株
住友重機械	1,555,600	3,060.00	4,760,136,000		

日立建機	1,270,400	3,210.00	4,077,984,000	
日 工	405,000	679.00	274,995,000	
巴工業	106,700	2,226.00	237,514,200	
井関農機	271,500	1,427.00	387,430,500	
TOWA	253,300	2,231.00	565,112,300	貸付株式数 5,800株
丸山製作所	55,200	1,733.00	95,661,600	
北川鉄工所	122,200	1,663.00	203,218,600	
シンニッタン	324,800	246.00	79,900,800	貸付株式数 88,000株
ローツェ	119,100	9,280.00	1,105,248,000	
タカキタ	94,600	597.00	56,476,200	貸付株式数 200株
クボタ	14,275,900	2,221.50	31,713,911,850	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
荏原実業	136,100	2,839.00	386,387,900	
東洋エンジニア	357,900	700.00	250,530,000	貸付株式数 292,000株
三菱化工機	86,900	2,497.00	216,989,300	貸付株式数 59,000株
月島機械	500,500	1,174.00	587,587,000	
帝国電機製作所	189,500	1,210.00	229,295,000	貸付株式数 1,300株
東京機械	110,500	792.00	87,516,000	貸付株式数 37,800株
新東工業	644,700	791.00	509,957,700	貸付株式数 7,400株
渋谷工業	237,400	3,065.00	727,631,000	
アイチ コーポレーション	462,100	841.00	388,626,100	貸付株式数 5,700株
小森コーポレーション	688,500	801.00	551,488,500	貸付株式数 23,100株
鶴見製作所	208,700	1,711.00	357,085,700	
住友精密	40,400	2,919.00	117,927,600	貸付株式数 100株
日本ギア工業	108,500	322.00	34,937,000	貸付株式数 53,400株
酒井重工業	47,600	2,693.00	128,186,800	
荏原製作所	1,127,400	5,420.00	6,110,508,000	貸付株式数 623,000株
石井鉄工所	38,300	2,990.00	114,517,000	貸付株式数 700株
西島製作所	270,100	854.00	230,665,400	
北越工業	279,900	1,078.00	301,732,200	
ダイキン工業	3,462,300	21,300.00	73,746,990,000	
オルガノ	88,100	5,980.00	526,838,000	貸付株式数 2,500株
ト - ヨ - カネツ	102,300	2,396.00	245,110,800	
栗田工業	1,470,700	5,450.00	8,015,315,000	貸付株式数 3,400株
椿本チエイン	387,600	3,160.00	1,224,816,000	貸付株式数 300株
大同工業	129,100	1,134.00	146,399,400	
日 機 装	877,600	1,099.00	964,482,400	
木村化工機	225,900	853.00	192,692,700	貸付株式数 111,500株
レイズネクスト	457,100	1,128.00	515,608,800	貸付株式数 5,700株
アネスト岩田	457,900	1,017.00	465,684,300	貸付株式数 4,700株

ダイフク	1,495,600	9,660.00	14,447,496,000	貸付株式数	143,400株
サムコ	67,900	3,255.00	221,014,500	貸付株式数	61,000株
加藤製作所	148,700	981.00	145,874,700		
油研工業	45,700	1,750.00	79,975,000	貸付株式数	200株
タダノ	1,311,100	1,141.00	1,495,965,100	貸付株式数	64,500株
フジテック	935,500	2,386.00	2,232,103,000	貸付株式数	23,400株
C K D	630,200	2,161.00	1,361,862,200	貸付株式数	4,400株
キトー	228,100	1,655.00	377,505,500		
平和	757,900	1,982.00	1,502,157,800	貸付株式数	571,000株
理想科学工業	199,200	1,735.00	345,612,000	貸付株式数	3,700株
S A N K Y O	645,900	2,807.00	1,813,041,300	貸付株式数	1,600株
日本金銭機械	300,300	619.00	185,885,700	貸付株式数	110,200株 (7,800株)
マースグループH L D G S	172,600	1,605.00	277,023,000		
フクシマガリレイ	186,300	4,475.00	833,692,500		
オーイズミ	114,000	380.00	43,320,000	貸付株式数	900株
ダイコク電機	124,800	899.00	112,195,200		
竹内製作所	454,800	2,941.00	1,337,566,800		
ア マ ノ	711,500	2,794.00	1,987,931,000	貸付株式数	4,200株
J U K I	378,100	774.00	292,649,400	貸付株式数	3,500株
サンデンホールディングス	378,900	325.00	123,142,500	貸付株式数	52,000株
蛇の目ミシン	247,000	742.00	183,274,000	貸付株式数	148,000株
ブラザー工業	3,318,700	2,172.00	7,208,216,400		
マックス	364,000	1,740.00	633,360,000	貸付株式数	1,100株
モリタホールディングス	435,500	1,581.00	688,525,500	貸付株式数	700株
グローリー	698,000	2,322.00	1,620,756,000		
新晃工業	252,500	1,911.00	482,527,500	貸付株式数	6,000株
大和冷機工業	436,400	1,035.00	451,674,000		
セガサミーホールディングス	2,470,900	1,452.00	3,587,746,800	貸付株式数	11,000株
日本ピストンリング	99,000	1,270.00	125,730,000		
リ ケ ン	125,900	2,569.00	323,437,100	貸付株式数	3,500株
T P R	365,500	1,475.00	539,112,500	貸付株式数	264,000株
ツバキ・ナカシマ	523,800	1,629.00	853,270,200	貸付株式数	314,000株
ホシザキ	855,500	9,060.00	7,750,830,000	貸付株式数	204,600株
大豊工業	221,400	926.00	205,016,400	貸付株式数	13,500株
日本精工	5,581,400	899.00	5,017,678,600		
N T N	6,289,500	282.00	1,773,639,000		
ジェイテクト	2,606,800	1,107.00	2,885,727,600		
不 二 越	252,200	4,190.00	1,056,718,000	貸付株式数	13,500株

ミネベアミツミ	4,684,400	2,996.00	14,034,462,400	
日本トムソン	744,200	629.00	468,101,800	
T H K	1,694,000	3,230.00	5,471,620,000	
ユーシン精機	180,300	818.00	147,485,400	
前澤給装工業	189,300	1,048.00	198,386,400	
イーグル工業	335,800	1,095.00	367,701,000	
前澤工業	162,800	701.00	114,122,800	
日本ピラ - 工業	274,600	2,233.00	613,181,800	貸付株式数 177,200株
キッツ	839,000	757.00	635,123,000	貸付株式数 4,500株
日立	13,065,900	6,558.00	85,686,172,200	
東芝	5,377,900	4,830.00	25,975,257,000	貸付株式数 1,949,300株
三菱電機	27,174,600	1,447.00	39,321,646,200	
富士電機	1,637,500	5,010.00	8,203,875,000	
東洋電機製造	106,800	1,132.00	120,897,600	
安川電機	2,925,200	5,410.00	15,825,332,000	貸付株式数 754,300株
シンフォニアテクノロジー	351,900	1,234.00	434,244,600	貸付株式数 9,100株
明電舎	461,000	2,169.00	999,909,000	
オリジン	73,500	1,324.00	97,314,000	貸付株式数 1,800株
山洋電気	131,400	7,390.00	971,046,000	
デンヨー	231,400	1,952.00	451,692,800	貸付株式数 1,000株
ベイカレントコンサルティング	170,600	34,700.00	5,919,820,000	貸付株式数 106,200株
ORCHESTRA HOLDINGS	57,900	2,920.00	169,068,000	貸付株式数 10,400株
アイモバイル	73,800	1,572.00	116,013,600	貸付株式数 66,000株
キャリアインデックス	106,200	912.00	96,854,400	貸付株式数 9,700株
MS - Japan	105,500	1,160.00	122,380,000	貸付株式数 94,000株 (13,300株)
船場	51,700	824.00	42,600,800	
グレイステクノロジー	263,500	1,499.00	394,986,500	貸付株式数 215,000株
ジャパンエレベーターSHD	748,800	2,453.00	1,836,806,400	
フルテック	36,300	1,366.00	49,585,800	貸付株式数 32,000株
グリーンズ	97,900	607.00	59,425,300	貸付株式数 1,800株
ツナググループHLDGS	57,800	349.00	20,172,200	貸付株式数 52,000株
GAMEWITH	77,200	584.00	45,084,800	貸付株式数 69,000株
ソウルドアウト	61,900	1,757.00	108,758,300	貸付株式数 46,900株
MS&CONSULTING	41,500	602.00	24,983,000	貸付株式数 8,400株

ウェルビー	95,800	1,357.00	130,000,600	貸付株式数	23,200株
エル・ティー・エス	25,000	4,110.00	102,750,000	貸付株式数	20,500株
ミダック	113,000	4,135.00	467,255,000	貸付株式数	56,600株 (2,000株)
日総工産	202,600	819.00	165,929,400	貸付株式数	6,900株
キュービーネットHLDGS	118,900	1,658.00	197,136,200	貸付株式数	21,100株
RPAホールディングス	312,700	747.00	233,586,900	貸付株式数	104,300株
三桜工業	375,800	1,154.00	433,673,200	貸付株式数	281,000株
マキタ	3,543,900	5,350.00	18,959,865,000	貸付株式数	6,100株
東芝テック	291,700	4,560.00	1,330,152,000		
芝浦メカトロニクス	48,200	7,700.00	371,140,000	貸付株式数	3,300株
マブチモーター	752,000	4,125.00	3,102,000,000		
日本電産	6,540,200	12,560.00	82,144,912,000		
ユーエムシーエレクトロニクス	141,600	747.00	105,775,200	貸付株式数	3,800株
トレックス・セミコンダクター	146,300	3,015.00	441,094,500	貸付株式数	1,300株
東光高岳	137,400	1,334.00	183,291,600	貸付株式数	87,800株
ダブル・スコープ	643,200	603.00	387,849,600	貸付株式数	413,000株
宮越ホールディングス	101,300	1,088.00	110,214,400	貸付株式数	91,000株
ダイヘン	297,200	4,620.00	1,373,064,000		
ヤーマン	443,100	1,340.00	593,754,000	貸付株式数	397,000株
JVCケンウッド	2,352,200	232.00	545,710,400	貸付株式数	358,800株
ミマキエンジニアリング	243,200	766.00	186,291,200		
I - P E X	126,400	2,369.00	299,441,600	貸付株式数	6,900株 (6,900株)
日新電機	636,800	1,354.00	862,227,200		
大崎電気	540,300	612.00	330,663,600	貸付株式数	19,500株
オムロン	2,262,300	8,970.00	20,292,831,000		
日東工業	399,100	1,797.00	717,182,700		
I D E C	364,400	2,143.00	780,909,200	貸付株式数	11,800株
正興電機製作所	85,100	1,691.00	143,904,100	貸付株式数	74,200株
不二電機工業	45,000	1,287.00	57,915,000	貸付株式数	40,000株 (1,200株)
ジーエス・ユアサコーポ	977,000	2,726.00	2,663,302,000		
サクサホールディングス	63,300	1,334.00	84,442,200	貸付株式数	2,200株
メルコホールディングス	93,900	5,530.00	519,267,000		
テクノメディカ	61,000	1,603.00	97,783,000	貸付株式数	100株

ダイヤモンドエレクトリック HD	79,100	2,781.00	219,977,100	貸付株式数	57,500株
日本電気	3,453,100	5,610.00	19,371,891,000		
富士通	2,445,100	21,080.00	51,542,708,000		
沖電気	1,103,800	1,012.00	1,117,045,600	貸付株式数	100株
岩崎通信機	119,100	930.00	110,763,000	貸付株式数	500株
電気興業	130,800	2,229.00	291,553,200		
サンケン電気	317,600	5,150.00	1,635,640,000		
ナカヨ	52,600	1,409.00	74,113,400	貸付株式数	100株
アイホン	153,800	2,036.00	313,136,800		
ルネサスエレクトロニクス	13,016,300	1,191.00	15,502,413,300	貸付株式数	100,000株
セイコーエプソン	3,371,700	1,906.00	6,426,460,200		
ワコム	1,967,200	685.00	1,347,532,000	貸付株式数	1,264,000株
アルバック	499,800	5,480.00	2,738,904,000	貸付株式数	163,600株
アクセル	113,600	869.00	98,718,400	貸付株式数	2,900株
EIZO	230,100	4,870.00	1,120,587,000	貸付株式数	700株
ジャパンディスプレイ	9,281,100	35.00	324,838,500	貸付株式数	6,254,700株
日本信号	634,200	918.00	582,195,600		
京三製作所	583,200	423.00	246,693,600	貸付株式数	26,600株
能美防災	359,300	2,076.00	745,906,800	貸付株式数	1,100株
ホーチキ	196,800	1,137.00	223,761,600		
星和電機	134,100	527.00	70,670,700	貸付株式数	200株
エレコム	622,400	2,056.00	1,279,654,400		
パナソニック	28,981,800	1,296.00	37,560,412,800		
シャープ	3,614,300	1,753.00	6,335,867,900	貸付株式数	3,038,100株
アンリツ	1,633,400	2,019.00	3,297,834,600	貸付株式数	1,030,000株
富士通ゼネラル	829,900	2,858.00	2,371,854,200		
ソニーグループ	17,023,800	11,055.00	188,198,109,000		
T D K	1,312,000	13,270.00	17,410,240,000		
帝国通信工業	119,900	1,106.00	132,609,400	貸付株式数	6,500株
タムラ製作所	977,700	925.00	904,372,500	貸付株式数	627,000株
アルプスアルパイン	2,220,200	1,129.00	2,506,605,800		
池上通信機	86,100	832.00	71,635,200	貸付株式数	16,300株
日本電波工業	262,700	898.00	235,904,600	貸付株式数	101,400株
鈴木	121,600	916.00	111,385,600	貸付株式数	109,000株
日本トリム	58,500	3,735.00	218,497,500		
ローランド ディー・ ジー	160,300	2,712.00	434,733,600	貸付株式数	56,200株
フオスタ - 電機	274,200	936.00	256,651,200	貸付株式数	54,800株
S M K	69,600	2,406.00	167,457,600	貸付株式数	3,100株

ヨコオ	213,400	2,517.00	537,127,800		
ティアック	171,000	123.00	21,033,000	貸付株式数	41,300株
ホシデン	709,800	1,002.00	711,219,600		
ヒロセ電機	418,800	16,210.00	6,788,748,000	貸付株式数	2,700株
日本航空電子	623,000	1,833.00	1,141,959,000	貸付株式数	61,200株
T O A	320,500	828.00	265,374,000		
マクセルホールディングス	540,000	1,251.00	675,540,000	貸付株式数	2,100株
古野電気	349,800	1,001.00	350,149,800	貸付株式数	4,800株
ユニデンホールディングス	69,300	2,550.00	176,715,000	貸付株式数	10,000株
スミダコーポレーション	231,500	1,210.00	280,115,000	貸付株式数	81,000株
アイコム	112,800	2,342.00	264,177,600		
リオン	114,300	2,687.00	307,124,100		
本多通信工業	210,900	484.00	102,075,600	貸付株式数	41,400株 (10,000株)
船井電機	122,000	917.00	111,874,000		
横河電機	2,719,700	1,618.00	4,400,474,600		
新電元工業	104,700	4,415.00	462,250,500		
アズビル	1,837,700	4,390.00	8,067,503,000		
東亜ディーケーケー	134,300	803.00	107,842,900	貸付株式数	8,500株
日本光電工業	1,123,000	3,250.00	3,649,750,000		
チノ	86,000	1,470.00	126,420,000	貸付株式数	1,900株
共和電業	284,000	379.00	107,636,000	貸付株式数	900株
日本電子材料	112,100	1,783.00	199,874,300	貸付株式数	91,000株
堀場製作所	538,200	6,890.00	3,708,198,000	貸付株式数	128,200株
アドバンテスト	2,020,500	9,490.00	19,174,545,000		
小野測器	113,300	578.00	65,487,400	貸付株式数	9,200株
エスベック	240,700	2,178.00	524,244,600		
キーエンス	2,667,500	56,310.00	150,206,925,000		
日置電機	130,200	6,320.00	822,864,000	貸付株式数	2,000株
シスメックス	2,120,600	13,015.00	27,599,609,000		
日本マイクロニクス	472,900	1,405.00	664,424,500	貸付株式数	1,300株
メガチップス	272,100	3,260.00	887,046,000	貸付株式数	1,200株
OBARA GROUP	123,300	3,825.00	471,622,500	貸付株式数	103,300株
IMAGICA GROUP	226,400	422.00	95,540,800	貸付株式数	18,000株 (18,000株)
澤藤電機	29,200	2,005.00	58,546,000	貸付株式数	25,900株
デンソー	5,982,400	7,397.00	44,251,812,800		
原田工業	110,200	902.00	99,400,400	貸付株式数	95,600株
コーセル	331,400	995.00	329,743,000	貸付株式数	3,000株
イリソ電子工業	228,100	5,200.00	1,186,120,000	貸付株式数	81,200株

オプテックスグループ	445,800	1,768.00	788,174,400	
千代田インテグレ	114,200	1,738.00	198,479,600	
アイ・オー・データ	100,200	1,006.00	100,801,200	貸付株式数 11,900株
レーザーテック	1,193,400	21,750.00	25,956,450,000	
スタンレー電気	1,902,000	3,035.00	5,772,570,000	
岩崎電気	99,000	1,969.00	194,931,000	
ウシオ電機	1,393,000	2,054.00	2,861,222,000	貸付株式数 17,400株
岡谷電機	193,300	367.00	70,941,100	貸付株式数 4,400株
ヘリオステクノH	250,100	336.00	84,033,600	
エノモト	75,300	1,714.00	129,064,200	貸付株式数 18,300株
日本セラミック	275,700	2,834.00	781,333,800	貸付株式数 5,900株
遠藤照明	137,200	714.00	97,960,800	
古河電池	193,600	1,465.00	283,624,000	貸付株式数 173,400株
双信電機	131,700	553.00	72,830,100	貸付株式数 70,700株 (10,000株)
山一電機	177,300	1,603.00	284,211,900	
図 研	176,800	3,385.00	598,468,000	
日本電子	494,700	6,420.00	3,175,974,000	
カ シ オ	2,185,500	1,857.00	4,058,473,500	
ファナック	2,384,900	25,830.00	61,601,967,000	
日本シイエムケイ	585,200	414.00	242,272,800	貸付株式数 254,100株
エンプラス	122,900	3,505.00	430,764,500	貸付株式数 63,400株
大真空	91,700	3,725.00	341,582,500	貸付株式数 36,500株 (5,400株)
ロ - ム	1,129,800	9,990.00	11,286,702,000	
浜松ホトニクス	1,949,400	6,540.00	12,749,076,000	
三井ハイテック	266,300	6,220.00	1,656,386,000	
新光電気工業	912,300	3,970.00	3,621,831,000	貸付株式数 5,600株
京 セ ラ	4,141,800	6,638.00	27,493,268,400	
協栄産業	29,700	1,442.00	42,827,400	貸付株式数 100株
太陽誘電	1,208,600	5,360.00	6,478,096,000	
村田製作所	7,982,700	8,879.00	70,878,393,300	
双葉電子工業	465,400	769.00	357,892,600	貸付株式数 3,600株
日東電工	1,642,500	8,010.00	13,156,425,000	
北陸電気工業	101,500	999.00	101,398,500	貸付株式数 300株
東海理化電機	715,600	1,723.00	1,232,978,800	貸付株式数 1,400株
ニチコン	855,600	1,158.00	990,784,800	貸付株式数 232,000株
日本ケミコン	274,200	2,611.00	715,936,200	
K O A	375,700	1,587.00	596,235,900	
三井E & S H D	1,051,700	531.00	558,452,700	貸付株式数 264,800株

日立造船	2,154,200	780.00	1,680,276,000	
三菱重工業	4,268,900	3,186.00	13,600,715,400	
川崎重工業	2,114,500	2,312.00	4,888,724,000	
I H I	1,827,100	2,538.00	4,637,179,800	
名村造船所	816,300	186.00	151,831,800	貸付株式数 382,300株
サノヤスホールディングス	333,000	158.00	52,614,000	
スプリックス	73,700	1,179.00	86,892,300	貸付株式数 45,500株
マネジメントソリューションズ	127,100	2,793.00	354,990,300	貸付株式数 31,800株
プロレド・パートナーズ	47,300	2,775.00	131,257,500	貸付株式数 42,000株
A N D F A C T O R Y	58,100	642.00	37,300,200	貸付株式数 52,000株
テノ・ホールディングス	27,700	1,175.00	32,547,500	貸付株式数 24,000株
フロンティア・マネジメント	57,600	1,065.00	61,344,000	
ピアラ	18,000	1,040.00	18,720,000	貸付株式数 16,000株
コプロ・ホールディングス	33,800	1,287.00	43,500,600	貸付株式数 30,000株
ギークス	44,400	1,862.00	82,672,800	貸付株式数 1,200株
カーブスホールディングス	712,700	936.00	667,087,200	貸付株式数 18,800株
フォーラムエンジニアリング	180,400	921.00	166,148,400	貸付株式数 5,800株
日本車輛	99,100	2,106.00	208,704,600	
三菱ロジスネクスト	359,700	998.00	358,980,600	貸付株式数 306,000株
近畿車輛	46,700	1,177.00	54,965,900	貸付株式数 1,400株
F P G	901,800	734.00	661,921,200	貸付株式数 108,500株
島根銀行	92,400	608.00	56,179,200	
じもとホールディングス	181,200	633.00	114,699,600	
全国保証	697,300	4,830.00	3,367,959,000	貸付株式数 374,200株
めぶきフィナンシャルG	13,927,200	232.00	3,231,110,400	
ジャパンインベストメントA	180,800	1,465.00	264,872,000	貸付株式数 162,000株 (9,500株)
東京きらぼしFG	336,200	1,510.00	507,662,000	
九州フィナンシャルG	5,473,400	387.00	2,118,205,800	
かんぼ生命保険	3,322,800	1,949.00	6,476,137,200	貸付株式数 26,400株
ゆうちょ銀行	7,593,400	922.00	7,001,114,800	貸付株式数 6,834,000株
あんしん保証	91,100	335.00	30,518,500	貸付株式数 10,700株
富山第一銀行	638,900	271.00	173,141,900	
コンコルディア・フィナンシャル	16,329,300	395.00	6,450,073,500	
ジェイリース	89,600	1,187.00	106,355,200	貸付株式数 66,000株
西日本フィナンシャルHD	1,750,500	620.00	1,085,310,000	貸付株式数 6,900株

イントラスト	75,500	672.00	50,736,000	貸付株式数	67,000株
日本モーゲージサービス	136,500	998.00	136,227,000	貸付株式数	73,100株
C a s a	74,800	981.00	73,378,800	貸付株式数	67,000株
アルヒ	395,800	1,396.00	552,536,800	貸付株式数	124,700株
プレミアグループ	123,800	3,460.00	428,348,000		
日産自動車	32,050,000	576.10	18,464,005,000		
いすゞ自動車	7,214,100	1,457.00	10,510,943,700		
トヨタ自動車	27,526,400	9,650.00	265,629,760,000		
日野自動車	3,393,400	932.00	3,162,648,800		
三菱自動車工業	10,059,000	306.00	3,078,054,000	貸付株式数	5,082,700株
エフテック	189,400	822.00	155,686,800	貸付株式数	1,700株
レシップホールディングス	107,700	560.00	60,312,000	貸付株式数	100株
G M B	48,800	1,218.00	59,438,400	貸付株式数	13,900株
ファルテック	47,500	724.00	34,390,000	貸付株式数	100株
武蔵精密工業	605,600	2,363.00	1,431,032,800		
日産車体	398,000	708.00	281,784,000	貸付株式数	123,900株
新明和工業	767,800	950.00	729,410,000	貸付株式数	64,000株
極東開発工業	468,800	1,510.00	707,888,000	貸付株式数	4,000株
トピー工業	223,400	1,262.00	281,930,800		
ティラド	84,900	2,679.00	227,447,100		
曙ブレーキ	1,491,700	169.00	252,097,300	貸付株式数	160,600株
タチエス	416,300	1,370.00	570,331,000	貸付株式数	76,000株
N O K	1,314,700	1,316.00	1,730,145,200		
フタバ産業	680,200	528.00	359,145,600		
K Y B	304,100	3,685.00	1,120,608,500	貸付株式数	2,200株
市光工業	406,300	691.00	280,753,300	貸付株式数	25,300株
大同メタル工業	561,200	588.00	329,985,600	貸付株式数	10,500株
プレス工業	1,346,700	353.00	475,385,100	貸付株式数	13,000株
ミクニ	344,700	305.00	105,133,500	貸付株式数	3,400株
太平洋工業	569,000	1,162.00	661,178,000	貸付株式数	4,200株
河西工業	366,700	389.00	142,646,300	貸付株式数	150,700株
アイシン	1,988,900	4,665.00	9,278,218,500		
マ ッ ダ	8,529,100	1,045.00	8,912,909,500	貸付株式数	66,700株
今仙電機製作所	237,600	685.00	162,756,000	貸付株式数	11,100株
本田技研	21,393,700	3,448.00	73,765,477,600		
スズキ	5,386,600	4,585.00	24,697,561,000		
S U B A R U	7,786,400	2,129.00	16,577,245,600		
安永	131,100	1,143.00	149,847,300	貸付株式数	92,500株
ヤマハ発動機	3,840,100	2,782.00	10,683,158,200	貸付株式数	613,100株
小糸製作所	1,627,900	6,380.00	10,386,002,000		

T B K	322,700	405.00	130,693,500	貸付株式数	1,400株
エクセディ	369,000	1,626.00	599,994,000	貸付株式数	18,000株
ミツバ	500,000	771.00	385,500,000		
豊田合成	877,800	2,614.00	2,294,569,200	貸付株式数	26,000株
愛三工業	425,400	859.00	365,418,600	貸付株式数	5,400株
盟和産業	41,400	987.00	40,861,800		
日本プラスト	229,200	696.00	159,523,200		
ヨロズ	232,500	1,181.00	274,582,500	貸付株式数	11,200株
エフ・シー・シー	444,200	1,545.00	686,289,000	貸付株式数	27,000株
新家工業	66,300	1,591.00	105,483,300	貸付株式数	800株
シマノ	1,017,000	27,955.00	28,430,235,000	貸付株式数	379,800株
テイ・エス テック	1,262,100	1,605.00	2,025,670,500		
33FG	231,800	1,368.00	317,102,400	貸付株式数	12,200株
第四北越フィナンシャルG	436,100	2,404.00	1,048,384,400	貸付株式数	54,000株
ひろぎんHLDGS	3,953,400	578.00	2,285,065,200	貸付株式数	75,800株
マーキュリアホールディングス	104,100	734.00	76,409,400		
ダイレクトマーケティングミクス	138,400	4,065.00	562,596,000	貸付株式数	3,500株
ポピンズホールディング	68,700	4,610.00	316,707,000	貸付株式数	700株
LITALICO	104,800	5,240.00	549,152,000	貸付株式数	72,000株
ジャムコ	158,800	1,072.00	170,233,600	貸付株式数	134,600株 (11,100株)
小野建	239,700	1,266.00	303,460,200	貸付株式数	163,000株
はるやまHLDGS	125,300	633.00	79,314,900	貸付株式数	7,100株
南陽	54,400	1,950.00	106,080,000		
ノジマ	476,100	2,708.00	1,289,278,800	貸付株式数	900株
佐島電機	166,700	800.00	133,360,000		
カップ・クリエイト	375,200	1,446.00	542,539,200	貸付株式数	337,000株 (30,000株)
エコートレーディング	56,100	616.00	34,557,600	貸付株式数	6,000株
伯東	163,000	1,507.00	245,641,000		
コンドーテック	206,900	979.00	202,555,100		
中山福	153,600	428.00	65,740,800	貸付株式数	500株
ライトオン	199,900	726.00	145,127,400	貸付株式数	175,000株 (47,300株)
ナガイレーベン	354,900	2,502.00	887,959,800		
三菱食品	294,200	2,734.00	804,342,800	貸付株式数	900株
良品計画	3,079,700	2,060.00	6,344,182,000	貸付株式数	573,600株
三城ホールディングス	331,100	263.00	87,079,300	貸付株式数	3,100株

松田産業	195,000	2,140.00	417,300,000	貸付株式数	3,200株
第一興商	508,100	4,300.00	2,184,830,000	貸付株式数	4,000株
メディバルHD	2,682,000	2,108.00	5,653,656,000		
アドヴァングループ	272,400	909.00	247,611,600	貸付株式数	400株
S P K	114,700	1,348.00	154,615,600		
萩原電気HLDGS	99,000	2,195.00	217,305,000	貸付株式数	400株
アルピス	86,000	2,329.00	200,294,000	貸付株式数	100株
アズワン	192,100	14,770.00	2,837,317,000	貸付株式数	2,000株
スズデン	92,800	1,441.00	133,724,800		
尾家産業	78,100	1,208.00	94,344,800	貸付株式数	4,700株
シモジマ	163,800	1,051.00	172,153,800	貸付株式数	4,300株
ドウシシャ	252,200	1,679.00	423,443,800		
小津産業	58,700	1,916.00	112,469,200	貸付株式数	16,200株
コナカ	315,300	345.00	108,778,500	貸付株式数	10,700株
高速	141,600	1,434.00	203,054,400	貸付株式数	19,200株
ハウス ローゼ	32,800	1,638.00	53,726,400	貸付株式数	600株
G - 7ホールディングス	130,200	3,350.00	436,170,000		
たけびし	93,700	1,514.00	141,861,800	貸付株式数	84,000株
イオン北海道	352,900	1,044.00	368,427,600	貸付株式数	303,900株
コジマ	460,200	679.00	312,475,800	貸付株式数	414,000株 (1,000株)
ヒマラヤ	93,600	1,068.00	99,964,800	貸付株式数	84,000株
コーナン商事	380,400	3,780.00	1,437,912,000	貸付株式数	79,000株
ネットワンシステムズ	1,088,400	3,725.00	4,054,290,000		
エコス	98,300	1,885.00	185,295,500	貸付株式数	88,000株
ワタミ	351,700	977.00	343,610,900	貸付株式数	279,700株 (19,100株)
マルシェ	70,400	500.00	35,200,000	貸付株式数	63,000株
リックス	60,200	1,505.00	90,601,000		
システムソフト	550,900	242.00	133,317,800	貸付株式数	463,000株
パンパシフィックHD	5,351,100	2,350.00	12,575,085,000	貸付株式数	600,000株
丸文	236,600	634.00	150,004,400		
西松屋チェーン	587,100	1,400.00	821,940,000	貸付株式数	528,000株
ゼンショーホールディングス	1,437,300	2,784.00	4,001,443,200	貸付株式数	19,400株
ハピネット	223,100	1,476.00	329,295,600	貸付株式数	4,100株
幸楽苑ホールディングス	169,900	1,512.00	256,888,800	貸付株式数	28,400株
ハークスレイ	55,800	978.00	54,572,400	貸付株式数	46,800株
橋本総業HLDGS	53,900	2,707.00	145,907,300	貸付株式数	1,600株
日本ライフライン	864,900	1,359.00	1,175,399,100	貸付株式数	31,600株

サイゼリヤ	397,000	2,647.00	1,050,859,000	貸付株式数	357,000株
タカショー	173,500	858.00	148,863,000	貸付株式数	111,000株
V Tホールディングス	1,007,200	458.00	461,297,600	貸付株式数	905,400株
マルカ	86,600	2,427.00	210,178,200	貸付株式数	2,800株
アルゴグラフィックス	207,400	3,440.00	713,456,000	貸付株式数	100株
魚力	83,300	2,059.00	171,514,700	貸付株式数	74,000株
I D O M	901,700	662.00	596,925,400		
日本エム・ディ・エム	156,500	2,167.00	339,135,500		
ポプラ	69,700	262.00	18,261,400	貸付株式数	60,900株
フジ・コーポレーション	141,600	1,264.00	178,982,400	貸付株式数	17,200株
ユナイテッドアローズ	305,900	2,092.00	639,942,800	貸付株式数	186,000株
進和	158,200	2,189.00	346,299,800	貸付株式数	109,000株
エスケイジャパン	64,500	487.00	31,411,500	貸付株式数	19,900株
ダイトロン	113,000	1,960.00	221,480,000	貸付株式数	400株
ハイデイ日高	386,200	1,878.00	725,283,600	貸付株式数	285,000株
シークス	340,200	1,402.00	476,960,400	貸付株式数	12,000株
京都きもの友禅	170,100	260.00	44,226,000		
コロワイド	889,200	2,026.00	1,801,519,200	貸付株式数	571,000株 (120,400株)
ピーシーデポコーポ	310,800	480.00	149,184,000	貸付株式数	279,000株
田中商事	82,000	661.00	54,202,000	貸付株式数	1,400株
オーハシテクニカ	137,100	1,488.00	204,004,800	貸付株式数	700株
壱番屋	188,500	4,905.00	924,592,500	貸付株式数	169,000株
白銅	95,800	2,180.00	208,844,000	貸付株式数	3,400株
トップカルチャー	96,400	351.00	33,836,400	貸付株式数	9,700株 (9,700株)
P L A N T	68,300	713.00	48,697,900	貸付株式数	48,900株
スギホールディングス	534,200	7,800.00	4,166,760,000	貸付株式数	60,900株
ダイコー通産	31,500	1,326.00	41,769,000	貸付株式数	700株
薬王堂ホールディングス	116,700	2,270.00	264,909,000	貸付株式数	31,800株
島津製作所	3,497,200	4,315.00	15,090,418,000		
J M S	229,500	797.00	182,911,500	貸付株式数	124,700株
クボテック	70,100	322.00	22,572,200	貸付株式数	8,400株
長野計器	196,700	1,024.00	201,420,800		
ブイ・テクノロジー	127,400	5,080.00	647,192,000	貸付株式数	3,400株
スター精密	418,500	1,645.00	688,432,500	貸付株式数	1,200株
東京計器	173,000	1,052.00	181,996,000	貸付株式数	8,300株
愛知時計	35,800	4,280.00	153,224,000		
インターアクション	136,000	2,410.00	327,760,000	貸付株式数	16,800株
オーバル	242,900	286.00	69,469,400	貸付株式数	1,100株

東京精密	458,400	4,755.00	2,179,692,000	貸付株式数	500株
マニー	1,082,500	2,550.00	2,760,375,000	貸付株式数	35,500株
ニコン	4,149,700	1,070.00	4,440,179,000		
トプコン	1,368,800	1,604.00	2,195,555,200		
オリンパス	15,036,700	2,200.00	33,080,740,000		
理研計器	239,500	2,587.00	619,586,500		
S C R E E Nホールディングス	471,500	10,150.00	4,785,725,000		
キヤノン電子	249,200	1,668.00	415,665,600		
タムロン	218,900	2,436.00	533,240,400	貸付株式数	3,400株
HOYA	5,302,700	14,845.00	78,718,581,500		
シード	105,700	765.00	80,860,500	貸付株式数	51,600株 (19,100株)
ノーリツ鋼機	244,200	2,459.00	600,487,800		
エー・アンド・デイ	228,500	973.00	222,330,500	貸付株式数	54,700株
朝日インテック	2,878,800	2,768.00	7,968,518,400	貸付株式数	256,200株
キヤノン	13,501,700	2,477.00	33,443,710,900	貸付株式数	10,126,000株
リコー	6,913,400	1,201.00	8,302,993,400		
シチズン時計	3,447,900	410.00	1,413,639,000		
リズム	84,900	763.00	64,778,700	貸付株式数	400株
大研医器	214,800	544.00	116,851,200		
メニコン	417,700	7,770.00	3,245,529,000	貸付株式数	176,100株
シンシア	29,000	608.00	17,632,000		
中本パックス	69,000	1,750.00	120,750,000	貸付株式数	9,600株
スノーピーク	161,000	3,410.00	549,010,000	貸付株式数	110,900株
パラマウントベッドHD	521,100	1,952.00	1,017,187,200	貸付株式数	2,600株
トランザクション	148,800	1,351.00	201,028,800	貸付株式数	133,000株
粧美堂	79,200	415.00	32,868,000	貸付株式数	71,000株
ニホンフラッシュ	232,500	1,235.00	287,137,500	貸付株式数	600株
前田工織	299,400	3,505.00	1,049,397,000	貸付株式数	164,200株
永大産業	355,300	295.00	104,813,500		
アートネイチャー	261,100	670.00	174,937,000		
バンダイナムコHLDGS	2,247,800	7,233.00	16,258,337,400		
アイフィスジャパン	69,200	673.00	46,571,600	貸付株式数	1,100株
共立印刷	453,900	138.00	62,638,200		
SHOEI	254,900	4,175.00	1,064,207,500		
フランスベッドHLDGS	349,300	908.00	317,164,400		
マーベラス	420,000	766.00	321,720,000	貸付株式数	700株
パイロットコーポレーション	458,700	3,780.00	1,733,886,000		

萩原工業	150,900	1,451.00	218,955,900	
エイベックス	459,100	1,719.00	789,192,900	
トッパン・フォームズ	485,200	1,069.00	518,678,800	
フジシールインターナショナル	558,300	2,208.00	1,232,726,400	貸付株式数 445,900株
タカラトミー	1,218,700	943.00	1,149,234,100	
廣濟堂	189,200	830.00	157,036,000	
エステールホールディングス	72,600	640.00	46,464,000	貸付株式数 62,800株
レック	322,000	1,120.00	360,640,000	貸付株式数 500株
タカノ	92,900	642.00	59,641,800	貸付株式数 300株
三光合成	284,800	430.00	122,464,000	貸付株式数 500株
プロネクサス	218,000	1,020.00	222,360,000	
ホクシン	167,700	156.00	26,161,200	貸付株式数 150,000株 (1,000株)
ウッドワン	91,400	1,192.00	108,948,800	貸付株式数 3,400株
大建工業	182,900	2,038.00	372,750,200	
きもと	416,000	278.00	115,648,000	
凸版印刷	4,130,700	1,740.00	7,187,418,000	
大日本印刷	3,212,000	2,377.00	7,634,924,000	
共同印刷	83,800	2,704.00	226,595,200	
N I S S H A	557,700	1,586.00	884,512,200	貸付株式数 21,300株
光村印刷	23,600	1,638.00	38,656,800	貸付株式数 11,400株
藤森工業	243,800	4,020.00	980,076,000	貸付株式数 500株
ヴィア・ホールディングス	329,300	189.00	62,237,700	貸付株式数 241,400株
TAKARA & COMPANY	133,200	1,800.00	239,760,000	貸付株式数 98,500株
前澤化成工業	172,700	1,260.00	217,602,000	貸付株式数 110,900株
未来工業	97,300	1,679.00	163,366,700	
アシックス	2,402,900	2,512.00	6,036,084,800	貸付株式数 1,438,000株
ツツミ	67,800	2,357.00	159,804,600	
ウェーブロックHLDGS	93,900	691.00	64,884,900	貸付株式数 82,700株
ジェイ エス ピー	159,100	1,616.00	257,105,600	貸付株式数 69,100株
ニチハ	377,900	2,803.00	1,059,253,700	
ローランド	211,900	5,200.00	1,101,880,000	貸付株式数 55,800株 (11,000株)
エフピコ	499,500	4,020.00	2,007,990,000	貸付株式数 10,900株
小松ウオール工業	82,800	1,976.00	163,612,800	
ヤマハ	1,616,100	5,890.00	9,518,829,000	
河合楽器	76,100	3,995.00	304,019,500	

クリナップ	252,700	535.00	135,194,500		
ピジヨン	1,744,900	3,230.00	5,636,027,000	貸付株式数	846,100株
天馬	203,500	2,580.00	525,030,000	貸付株式数	3,600株
オリバー	57,400	3,775.00	216,685,000	貸付株式数	8,800株 (1,800株)
兼松サステック	17,500	1,799.00	31,482,500	貸付株式数	100株
キングジム	218,900	885.00	193,726,500	貸付株式数	50,700株
象印マホービン	735,100	1,554.00	1,142,345,400	貸付株式数	400株
リンテック	581,800	2,351.00	1,367,811,800		
信越ポリマー	418,300	1,019.00	426,247,700		
東リ	676,600	236.00	159,677,600		
イトーキ	539,300	343.00	184,979,900	貸付株式数	17,700株
任天堂	1,555,400	63,290.00	98,441,266,000		
三菱鉛筆	447,500	1,384.00	619,340,000		
松風	124,600	2,010.00	250,446,000	貸付株式数	2,200株
タカラスタンダード	561,400	1,546.00	867,924,400		
コクヨ	1,303,400	1,764.00	2,299,197,600		
ナカバヤシ	267,200	581.00	155,243,200	貸付株式数	2,800株
ニフコ	997,800	3,810.00	3,801,618,000		
立川ブラインド	118,300	1,308.00	154,736,400	貸付株式数	104,200株
グローブライド	131,700	4,725.00	622,282,500	貸付株式数	100株
オカムラ	933,800	1,473.00	1,375,487,400	貸付株式数	234,700株
バルカー	220,700	2,138.00	471,856,600		
MUTOHホールディングス	34,100	1,590.00	54,219,000	貸付株式数	29,400株
伊藤忠	18,718,000	3,184.00	59,598,112,000		
丸紅	26,390,200	946.30	24,973,046,260		
スクロール	382,500	841.00	321,682,500	貸付株式数	240,800株
高島	42,200	1,777.00	74,989,400		
ヨンドシーホールディングス	246,300	1,814.00	446,788,200	貸付株式数	3,300株
三陽商会	138,500	1,098.00	152,073,000	貸付株式数	62,700株 (4,100株)
長瀬産業	1,469,600	1,635.00	2,402,796,000	貸付株式数	11,300株
ナイガイ	97,100	350.00	33,985,000	貸付株式数	16,000株
蝶理	170,900	1,739.00	297,195,100	貸付株式数	4,200株
豊田通商	2,688,500	5,090.00	13,684,465,000	貸付株式数	1,600株
オンワードホールディングス	1,598,800	360.00	575,568,000	貸付株式数	72,900株
三共生興	405,000	559.00	226,395,000		

兼 松	1,069,400	1,441.00	1,541,005,400	
美 津 濃	269,000	2,586.00	695,634,000	
ツカモトコーポレーション	44,700	1,410.00	63,027,000	貸付株式数 100株
ルックホールディングス	91,100	1,411.00	128,542,100	貸付株式数 2,300株
三井物産	21,348,300	2,519.50	53,787,041,850	
日本紙パルプ	139,500	3,610.00	503,595,000	
東京エレクトロン	1,591,600	45,840.00	72,958,944,000	
カメイ	348,900	1,124.00	392,163,600	
東都水産	30,600	5,030.00	153,918,000	貸付株式数 27,000株
OUGホールディングス	42,300	2,851.00	120,597,300	貸付株式数 1,300株
スターゼン	197,600	2,117.00	418,319,200	
セイコーHD	384,300	2,327.00	894,266,100	貸付株式数 20,200株
山 善	1,045,300	993.00	1,037,982,900	貸付株式数 31,200株
椿本興業	49,400	3,315.00	163,761,000	貸付株式数 3,400株
住友商事	16,888,800	1,469.00	24,809,647,200	
日本ユニシス	925,200	3,400.00	3,145,680,000	
内田洋行	114,300	4,810.00	549,783,000	貸付株式数 55,500株
三菱商事	16,293,500	3,063.00	49,906,990,500	
第一実業	121,700	4,350.00	529,395,000	
キャノンマーケティングJ PN	663,500	2,526.00	1,676,001,000	貸付株式数 532,800株
西華産業	140,700	1,588.00	223,431,600	貸付株式数 1,400株
佐藤商事	220,600	1,075.00	237,145,000	
菱洋エレクトロ	203,400	2,550.00	518,670,000	貸付株式数 181,700株
東京産業	241,900	643.00	155,541,700	貸付株式数 186,500株
ユアサ商事	273,500	3,005.00	821,867,500	
神鋼商事	59,800	2,308.00	138,018,400	
トルク	159,600	229.00	36,548,400	貸付株式数 8,000株
阪和興業	535,700	3,065.00	1,641,920,500	貸付株式数 600株
正栄食品	173,200	3,790.00	656,428,000	貸付株式数 119,000株
カナデン	217,100	1,030.00	223,613,000	
菱電商事	192,500	1,640.00	315,700,000	貸付株式数 44,800株
ニプロ	2,025,200	1,336.00	2,705,667,200	貸付株式数 85,000株
フルサト工業	135,300	1,886.00	255,175,800	
岩谷産業	642,300	6,390.00	4,104,297,000	
ナイス	106,000	1,941.00	205,746,000	
ニチモウ	41,600	2,050.00	85,280,000	
極東貿易	76,800	2,566.00	197,068,800	貸付株式数 6,300株
アステナホールディングス	390,500	656.00	256,168,000	
兼松エレクトロニクス	145,000	3,615.00	524,175,000	

三愛石油	658,900	1,326.00	873,701,400	貸付株式数	31,200株
稲畑産業	642,900	1,648.00	1,059,499,200		
G S I クレオス	131,000	934.00	122,354,000	貸付株式数	97,000株
明和産業	246,700	469.00	115,702,300		
クワザワホールディングス	95,100	615.00	58,486,500	貸付株式数	700株
キムラタン	1,488,000	23.00	34,224,000	貸付株式数	403,200株 (5,000株)
ヤマエ久野	194,800	1,155.00	224,994,000	貸付株式数	400株
ゴ - ルドウイン	440,400	6,150.00	2,708,460,000	貸付株式数	15,500株
ユニ・チャ - ム	5,762,000	4,363.00	25,139,606,000	貸付株式数	2,002,100株
デサント	454,400	2,998.00	1,362,291,200	貸付株式数	352,600株
キ ン グ	141,200	481.00	67,917,200	貸付株式数	500株
ワ キ タ	526,800	1,009.00	531,541,200	貸付株式数	200株
ヤマトインタ - ナショナル	233,600	346.00	80,825,600	貸付株式数	161,000株
東邦ホールディングス	858,600	1,827.00	1,568,662,200		
サンゲツ	719,400	1,563.00	1,124,422,200	貸付株式数	200株
ミツウロコグループ	394,500	1,242.00	489,969,000	貸付株式数	11,100株
シナネンホールディングス	99,100	3,095.00	306,714,500	貸付株式数	9,000株
伊藤忠エネクス	591,600	987.00	583,909,200		
サンリオ	751,500	1,993.00	1,497,739,500	貸付株式数	300,000株
サンワ テクノス	176,100	1,273.00	224,175,300		
リョーサン	295,300	2,063.00	609,203,900	貸付株式数	12,200株
新光商事	360,800	761.00	274,568,800		
トーホー	120,900	1,579.00	190,901,100	貸付株式数	82,000株
三信電気	143,500	2,146.00	307,951,000		
東陽テクニカ	264,100	1,087.00	287,076,700		
モスフード サービス	378,100	3,105.00	1,174,000,500	貸付株式数	52,900株
加賀電子	242,100	2,875.00	696,037,500	貸付株式数	3,900株
三益半導体	209,600	2,540.00	532,384,000	貸付株式数	5,200株
都築電気	119,200	1,622.00	193,342,400	貸付株式数	16,400株
ソーダニツカ	254,800	541.00	137,846,800		
立花エレテック	197,500	1,458.00	287,955,000	貸付株式数	177,000株
木曽路	349,800	2,370.00	829,026,000	貸付株式数	180,200株
S R S ホールディングス	347,600	808.00	280,860,800	貸付株式数	278,000株
千 趣 会	483,200	365.00	176,368,000	貸付株式数	392,000株 (30,000株)
タカキユー	206,400	133.00	27,451,200	貸付株式数	80,800株
リテールパートナーズ	324,700	1,136.00	368,859,200	貸付株式数	292,000株
ケーヨー	494,700	825.00	408,127,500	貸付株式数	900株
上新電機	307,100	2,607.00	800,609,700	貸付株式数	1,300株

日本瓦斯	1,300,800	1,807.00	2,350,545,600	貸付株式数	220,000株
ロイヤルホールディングス	467,300	2,060.00	962,638,000	貸付株式数	322,600株 (28,800株)
東 天 紅	19,500	1,111.00	21,664,500	貸付株式数	400株
いなげや	298,300	1,442.00	430,148,600	貸付株式数	18,400株
チヨダ	260,600	858.00	223,594,800	貸付株式数	6,600株
ライフコーポレーション	250,300	3,165.00	792,199,500	貸付株式数	21,600株
リンガーハット	329,900	2,330.00	768,667,000	貸付株式数	197,000株 (2,400株)
M r M a x H D	367,600	623.00	229,014,800	貸付株式数	21,000株
テナライド	246,600	335.00	82,611,000	貸付株式数	211,900株
A O K Iホールディングス	517,800	658.00	340,712,400	貸付株式数	4,400株
オークワ	419,900	1,062.00	445,933,800	貸付株式数	18,000株
コメリ	413,200	2,559.00	1,057,378,800	貸付株式数	13,300株
青山商事	595,200	739.00	439,852,800	貸付株式数	278,600株
しまむら	311,400	10,130.00	3,154,482,000	貸付株式数	7,700株
はせがわ	141,700	276.00	39,109,200	貸付株式数	11,500株
高 島 屋	1,949,600	1,251.00	2,438,949,600	貸付株式数	5,500株
松 屋	584,400	984.00	575,049,600	貸付株式数	49,600株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	1,267,500	933.00	1,182,577,500		
近鉄百貨店	102,400	3,110.00	318,464,000	貸付株式数	20,500株
丸井グループ	2,264,600	2,046.00	4,633,371,600		
クレディセゾン	1,564,700	1,322.00	2,068,533,400		
アクシアル リテイリング	221,900	3,680.00	816,592,000		
井 筒 屋	135,700	221.00	29,989,700	貸付株式数	87,000株
イオン	10,299,300	2,919.00	30,063,656,700	貸付株式数	1,725,000株
イ ズ ミ	544,100	4,005.00	2,179,120,500		
フォーバル	93,600	936.00	87,609,600	貸付株式数	100株
平 和 堂	494,000	2,012.00	993,928,000	貸付株式数	441,200株
フ ジ	323,100	1,921.00	620,675,100	貸付株式数	290,000株
ヤオコー	303,800	6,050.00	1,837,990,000	貸付株式数	273,000株
ゼビオホールディングス	323,400	977.00	315,961,800	貸付株式数	8,900株
ケーズホールディングス	2,278,100	1,225.00	2,790,672,500	貸付株式数	13,700株
P A L T A C	429,000	5,200.00	2,230,800,000		
三谷産業	351,800	372.00	130,869,600	貸付株式数	215,000株
O L Y M P I Cグループ	138,000	761.00	105,018,000	貸付株式数	108,800株
日産東京販売H D	393,600	237.00	93,283,200		
新生銀行	2,185,600	1,439.00	3,145,078,400		
あおぞら銀行	1,596,800	2,470.00	3,944,096,000		

三菱UFJフィナンシャルG	183,322,500	586.80	107,573,643,000	貸付株式数	10,148,700株
りそなホールディングス	30,927,000	415.50	12,850,168,500		
三井住友トラストHD	5,065,400	3,506.00	17,759,292,400		
三井住友フィナンシャルG	18,546,000	3,716.00	68,916,936,000		
千葉銀行	8,945,000	637.00	5,697,965,000		
群馬銀行	5,516,500	343.00	1,892,159,500		
武蔵野銀行	399,300	1,651.00	659,244,300	貸付株式数	11,900株
千葉興業銀行	682,500	251.00	171,307,500		
筑波銀行	1,114,500	170.00	189,465,000	貸付株式数	21,200株
七十七銀行	840,900	1,147.00	964,512,300	貸付株式数	25,200株
青森銀行	207,600	2,024.00	420,182,400	貸付株式数	25,000株 (10,000株)
秋田銀行	160,400	1,387.00	222,474,800		
山形銀行	301,200	844.00	254,212,800		
岩手銀行	175,700	1,668.00	293,067,600	貸付株式数	900株
東邦銀行	2,396,700	207.00	496,116,900	貸付株式数	275,000株
東北銀行	128,500	998.00	128,243,000		
みちのく銀行	172,200	916.00	157,735,200		
ふくおかフィナンシャルG	2,419,000	1,851.00	4,477,569,000		
静岡銀行	6,527,500	822.00	5,365,605,000		
十六銀行	336,000	1,922.00	645,792,000		
スルガ銀行	2,350,300	325.00	763,847,500		
八十二銀行	6,037,200	352.00	2,125,094,400	貸付株式数	102,500株
山梨中央銀行	311,100	802.00	249,502,200		
大垣共立銀行	529,300	1,829.00	968,089,700	貸付株式数	3,900株
福井銀行	229,100	1,364.00	312,492,400	貸付株式数	77,900株 (8,600株)
北國銀行	249,000	2,094.00	521,406,000		
清水銀行	110,600	1,508.00	166,784,800	貸付株式数	200株
富山銀行	51,700	2,214.00	114,463,800	貸付株式数	15,000株 (15,000株)
滋賀銀行	537,400	1,905.00	1,023,747,000		
南都銀行	390,100	1,835.00	715,833,500		
百五銀行	2,412,000	301.00	726,012,000	貸付株式数	210,500株
京都銀行	959,800	4,795.00	4,602,241,000	貸付株式数	25,500株
紀陽銀行	949,000	1,448.00	1,374,152,000	貸付株式数	8,000株
ほくほくフィナンシャルG	1,784,200	788.00	1,405,949,600	貸付株式数	2,600株
山陰合同銀行	1,688,600	535.00	903,401,000	貸付株式数	3,100株

中国銀行	2,306,500	851.00	1,962,831,500	
鳥取銀行	85,300	1,106.00	94,341,800	貸付株式数 2,300株
伊予銀行	3,551,300	534.00	1,896,394,200	貸付株式数 546,800株
百十四銀行	284,700	1,475.00	419,932,500	貸付株式数 39,800株
四国銀行	380,100	694.00	263,789,400	貸付株式数 96,800株
阿波銀行	410,500	1,992.00	817,716,000	貸付株式数 17,400株
大分銀行	154,300	1,673.00	258,143,900	
宮崎銀行	167,500	1,983.00	332,152,500	
佐賀銀行	151,900	1,359.00	206,432,100	
沖縄銀行	245,400	2,463.00	604,420,200	貸付株式数 7,400株
琉球銀行	581,900	709.00	412,567,100	貸付株式数 6,000株
セブン銀行	8,955,200	233.00	2,086,561,600	貸付株式数 1,028,500株
みずほフィナンシャルG	36,415,600	1,560.00	56,808,336,000	貸付株式数 39,500株
高知銀行	97,300	805.00	78,326,500	貸付株式数 1,300株
山口フィナンシャルG	3,345,700	627.00	2,097,753,900	貸付株式数 1,100株
芙蓉総合リース	281,100	6,950.00	1,953,645,000	貸付株式数 3,300株
みずほリース	413,500	3,565.00	1,474,127,500	貸付株式数 288,200株
東京センチュリー	622,800	5,540.00	3,450,312,000	貸付株式数 10,000株
SBIホールディングス	3,302,900	2,584.00	8,534,693,600	貸付株式数 46,200株
日本証券金融	1,134,000	798.00	904,932,000	貸付株式数 133,000株
アイフル	4,497,700	371.00	1,668,646,700	貸付株式数 58,600株
日本アジア投資	226,300	278.00	62,911,400	貸付株式数 1,300株
長野銀行	87,900	1,080.00	94,932,000	
名古屋銀行	215,600	2,400.00	517,440,000	貸付株式数 1,000株
北洋銀行	4,040,400	234.00	945,453,600	貸付株式数 161,700株
愛知銀行	90,100	2,759.00	248,585,900	貸付株式数 200株
中京銀行	96,400	1,376.00	132,646,400	貸付株式数 1,800株
大光銀行	91,900	1,280.00	117,632,000	
愛媛銀行	374,200	758.00	283,643,600	
トマト銀行	103,500	1,025.00	106,087,500	貸付株式数 2,600株
京葉銀行	1,142,900	405.00	462,874,500	
栃木銀行	1,294,600	171.00	221,376,600	貸付株式数 5,600株
北日本銀行	83,500	1,639.00	136,856,500	貸付株式数 200株
東和銀行	470,600	491.00	231,064,600	貸付株式数 20,100株
福島銀行	307,100	233.00	71,554,300	貸付株式数 142,300株
大東銀行	128,700	600.00	77,220,000	貸付株式数 2,800株
リコーリース	210,800	3,440.00	725,152,000	貸付株式数 189,000株 (58,000株)

イオンフィナンシャルサー ビス	1,640,200	1,375.00	2,255,275,000		
アコム	5,387,300	462.00	2,488,932,600	貸付株式数	950,500株
ジャックス	295,900	2,554.00	755,728,600	貸付株式数	3,200株
オリコ	7,250,600	144.00	1,044,086,400	貸付株式数	46,400株
オリックス	16,269,300	1,860.50	30,269,032,650		
三菱HCキャピタル	9,270,200	588.00	5,450,877,600	貸付株式数	162,100株
ジャフコグループ	383,500	6,260.00	2,400,710,000	貸付株式数	227,700株
九州リースサービス	131,500	646.00	84,949,000	貸付株式数	33,300株
トモニホールディングス	2,072,100	293.00	607,125,300	貸付株式数	30,900株
大和証券G本社	20,070,200	562.80	11,295,508,560		
野村ホールディングス	40,917,100	542.30	22,189,343,330		
岡三証券グループ	2,283,900	406.00	927,263,400	貸付株式数	125,300株
丸三証券	796,200	600.00	477,720,000	貸付株式数	432,000株 (29,500株)
東洋証券	884,300	155.00	137,066,500	貸付株式数	13,400株
東海東京HD	2,858,200	384.00	1,097,548,800	貸付株式数	265,000株
光世証券	64,100	572.00	36,665,200	貸付株式数	34,600株
水戸証券	715,700	291.00	208,268,700	貸付株式数	127,100株
いちよし証券	536,900	580.00	311,402,000	貸付株式数	135,300株
松井証券	1,312,400	808.00	1,060,419,200		
SOMPOホールディング ス	4,724,900	4,292.00	20,279,270,800		
日本取引所グループ	7,240,400	2,428.00	17,579,691,200		
マネックスG	2,403,700	717.00	1,723,452,900	貸付株式数	1,929,000株
極東証券	359,500	810.00	291,195,000	貸付株式数	12,900株
岩井コスモホールディング	274,300	1,623.00	445,188,900		
藍澤證券	481,300	993.00	477,930,900	貸付株式数	7,100株
フィデアホール	2,602,300	119.00	309,673,700	貸付株式数	13,600株
池田泉州HD	3,082,200	159.00	490,069,800	貸付株式数	231,100株
アニコムホールディング ス	754,100	882.00	665,116,200	貸付株式数	91,600株
MS&AD	6,508,300	3,249.00	21,145,466,700		
マネーパートナーズGP	285,200	224.00	63,884,800	貸付株式数	8,600株
スパークス・グループ	1,237,700	244.00	301,998,800	貸付株式数	45,500株
小林洋行	76,700	267.00	20,478,900	貸付株式数	2,000株
第一生命HLDGS	13,191,300	1,914.50	25,254,743,850		
東京海上HD	8,826,100	5,078.00	44,818,935,800		
アドバンテッジリスクマネ	131,300	1,079.00	141,672,700	貸付株式数	10,500株
イー・ギャランティ	314,200	2,299.00	722,345,800	貸付株式数	99,600株

アサックス	139,200	681.00	94,795,200	貸付株式数	105,400株
NECキャピタルソリューション	109,100	2,122.00	231,510,200		
T&Dホールディングス	8,011,100	1,382.00	11,071,340,200	貸付株式数	1,500株
アドバンスクリエイト	128,100	954.00	122,207,400	貸付株式数	115,000株 (700株)
三井不動産	12,216,400	2,617.50	31,976,427,000		
三菱地所	17,608,000	1,752.00	30,849,216,000		
平和不動産	459,100	3,730.00	1,712,443,000		
東京建物	2,647,100	1,632.00	4,320,067,200		
ダイビル	679,500	1,441.00	979,159,500		
京阪神ビルディング	462,400	1,409.00	651,521,600	貸付株式数	3,100株
住友不動産	6,025,300	3,776.00	22,751,532,800	貸付株式数	100株
太平洋興発	105,100	633.00	66,528,300	貸付株式数	1,200株
テオーシー	526,000	652.00	342,952,000	貸付株式数	114,900株
東京楽天地	44,000	4,140.00	182,160,000	貸付株式数	39,000株
レオパレス21	2,223,400	148.00	329,063,200	貸付株式数	328,300株
スターツコーポレーション	318,900	2,862.00	912,691,800	貸付株式数	12,200株
フジ住宅	310,900	631.00	196,177,900	貸付株式数	1,100株
空港施設	268,200	573.00	153,678,600	貸付株式数	7,800株
明和地所	126,100	611.00	77,047,100		
ゴールドクレスト	241,500	1,632.00	394,128,000	貸付株式数	57,100株 (45,000株)
リログループ	1,419,500	2,424.00	3,440,868,000	貸付株式数	88,100株
エスリード	104,400	1,586.00	165,578,400	貸付株式数	91,700株
日神グループHLDGS	396,200	454.00	179,874,800	貸付株式数	349,400株
日本エスコ	485,800	760.00	369,208,000	貸付株式数	437,000株
タカラレーベン	1,123,000	340.00	381,820,000	貸付株式数	69,700株
AVANTIA	138,200	898.00	124,103,600	貸付株式数	113,000株 (700株)
イオンモール	1,343,900	1,680.00	2,257,752,000	貸付株式数	40,000株
毎日コムネット	91,200	723.00	65,937,600	貸付株式数	19,000株
ファースト住建	114,100	1,160.00	132,356,000	貸付株式数	2,000株 (1,000株)
ランド	14,589,500	12.00	175,074,000	貸付株式数	846,500株
カチタス	663,600	3,180.00	2,110,248,000	貸付株式数	1,200株
東祥	161,700	1,934.00	312,727,800	貸付株式数	145,000株
トーセイ	369,700	1,208.00	446,597,600	貸付株式数	49,100株 (14,000株)
穴吹興産	58,400	1,954.00	114,113,600	貸付株式数	49,300株

サンフロンティア不動産	329,100	1,073.00	353,124,300	貸付株式数	900株
エフ・ジェー・ネクスト	263,000	1,021.00	268,523,000	貸付株式数	49,100株
インテリックス	60,300	706.00	42,571,800	貸付株式数	11,700株
ランドビジネス	113,000	327.00	36,951,000		
サンネクスタグループ	84,600	985.00	83,331,000	貸付株式数	400株
グランディハウス	181,900	426.00	77,489,400		
東武鉄道	2,832,400	2,903.00	8,222,457,200		
相鉄ホールディングス	931,500	2,191.00	2,040,916,500	貸付株式数	81,200株
東急	6,853,900	1,580.00	10,829,162,000		
京浜急行	3,490,000	1,387.00	4,840,630,000	貸付株式数	88,000株
小田急電鉄	4,352,800	2,816.00	12,257,484,800		
京王電鉄	1,518,500	6,510.00	9,885,435,000		
京成電鉄	2,036,500	3,605.00	7,341,582,500		
富士急行	370,500	5,080.00	1,882,140,000	貸付株式数	330,100株
新京成電鉄	69,800	2,111.00	147,347,800	貸付株式数	61,000株
東日本旅客鉄道	4,783,000	8,111.00	38,794,913,000		
西日本旅客鉄道	2,421,500	6,542.00	15,841,453,000		
東海旅客鉄道	2,259,600	17,325.00	39,147,570,000		
西武ホールディングス	3,275,000	1,357.00	4,444,175,000	貸付株式数	84,000株
鴻池運輸	432,500	1,201.00	519,432,500	貸付株式数	700株
西日本鉄道	753,300	2,692.00	2,027,883,600	貸付株式数	34,000株
ハマキョウレックス	208,400	3,125.00	651,250,000		
サカイ引越センター	125,100	5,600.00	700,560,000	貸付株式数	52,400株
近鉄グループHLDGS	2,573,900	3,965.00	10,205,513,500	貸付株式数	101,500株
阪急阪神HLDGS	3,432,600	3,475.00	11,928,285,000		
南海電鉄	1,220,000	2,386.00	2,910,920,000	貸付株式数	846,000株
京阪ホールディングス	1,146,000	3,350.00	3,839,100,000	貸付株式数	432,500株
神戸電鉄	61,300	3,495.00	214,243,500	貸付株式数	54,900株 (3,000株)
名古屋鉄道	2,116,000	2,046.00	4,329,336,000	貸付株式数	77,000株
山陽電鉄	183,800	1,902.00	349,587,600	貸付株式数	32,500株
アルプス物流	179,700	952.00	171,074,400		
トランコム	78,400	8,090.00	634,256,000	貸付株式数	1,200株
日本通運	890,900	8,120.00	7,234,108,000		
ヤマトホールディングス	3,606,400	3,295.00	11,883,088,000		
山 九	660,300	4,860.00	3,209,058,000		
日 新	205,200	1,437.00	294,872,400	貸付株式数	300株
丸 運	146,700	271.00	39,755,700	貸付株式数	32,700株
丸全昭和運輸	208,600	3,180.00	663,348,000	貸付株式数	2,000株

センコーグループHLDGS	1,419,500	1,070.00	1,518,865,000	貸付株式数	760,600株
トナミホールディングス	61,800	4,810.00	297,258,000		
ニッコンホールディングス	863,700	2,373.00	2,049,560,100	貸付株式数	11,500株
日石輸送	28,100	2,576.00	72,385,600	貸付株式数	1,100株
福山通運	329,400	4,000.00	1,317,600,000	貸付株式数	16,500株
セイノーホールディングス	1,927,600	1,365.00	2,631,174,000	貸付株式数	118,400株
エスライン	70,200	917.00	64,373,400		
神奈川中央交通	63,800	3,500.00	223,300,000	貸付株式数	56,000株
日立物流	565,800	4,480.00	2,534,784,000		
丸和運輸機関	543,300	1,489.00	808,973,700	貸付株式数	465,100株 (35,200株)
C&Fロジホールディングス	260,100	1,556.00	404,715,600	貸付株式数	62,100株
日本郵船	2,152,200	5,340.00	11,492,748,000		
商船三井	1,526,700	5,030.00	7,679,301,000		
川崎汽船	792,600	3,650.00	2,892,990,000		
NSユニテッド海運	121,400	2,251.00	273,271,400	貸付株式数	100株
明治海運	273,300	478.00	130,637,400	貸付株式数	55,600株
飯野海運	1,194,500	424.00	506,468,000		
共栄タンカー	45,200	870.00	39,324,000	貸付株式数	700株
九州旅客鉄道	1,990,700	2,606.00	5,187,764,200		
SGホールディングス	4,862,800	2,889.00	14,048,629,200		
日本航空	6,270,000	2,483.00	15,568,410,000		
ANAホールディングス	6,946,300	2,743.00	19,053,700,900		
パスコ	49,900	1,518.00	75,748,200		
西本WISMETTACHD	60,600	2,700.00	163,620,000	貸付株式数	1,600株
シルバーライフ	54,500	2,010.00	109,545,000	貸付株式数	49,000株 (7,600株)
ヤマシタヘルスケアHLDGS	23,700	1,987.00	47,091,900	貸付株式数	2,100株
一家ダイニングプロジ	54,300	592.00	32,145,600	貸付株式数	33,700株
GENKY DRUGSTORES	117,600	4,040.00	475,104,000	貸付株式数	105,000株 (2,000株)
コア商事HLDGS	200,500	646.00	129,523,000	貸付株式数	140,800株
国際紙パルプ商事	570,000	255.00	145,350,000	貸付株式数	500株
ナルミヤ・インターナショナル	51,300	1,180.00	60,534,000		
ブックオフGHD	156,100	968.00	151,104,800	貸付株式数	140,000株

ギフト	33,600	2,354.00	79,094,400	貸付株式数	30,000株
三菱倉庫	890,500	3,215.00	2,862,957,500		
三井倉庫HOLD	272,900	2,544.00	694,257,600	貸付株式数	10,200株
住友倉庫	909,000	1,557.00	1,415,313,000	貸付株式数	17,200株
渋沢倉庫	141,300	2,108.00	297,860,400	貸付株式数	3,100株
ヤマタネ	114,900	1,512.00	173,728,800		
東陽倉庫	431,400	310.00	133,734,000	貸付株式数	2,800株
乾汽船	176,100	1,211.00	213,257,100		
日本トランスシティ	566,400	532.00	301,324,800	貸付株式数	6,400株
ケイヒン	49,700	1,356.00	67,393,200	貸付株式数	100株
中央倉庫	156,900	1,006.00	157,841,400	貸付株式数	100株
川西倉庫	47,100	1,144.00	53,882,400	貸付株式数	42,000株
安田倉庫	211,200	942.00	198,950,400		
ファイズホールディングス	45,700	796.00	36,377,200	貸付株式数	22,100株
東洋埠頭	78,400	1,462.00	114,620,800	貸付株式数	600株
宇徳	183,200	525.00	96,180,000		
上組	1,415,700	2,241.00	3,172,583,700		
サンリツ	65,900	755.00	49,754,500		
キムラユニティー	68,800	1,286.00	88,476,800	貸付株式数	59,200株
キューソー流通システム	64,200	1,708.00	109,653,600	貸付株式数	53,700株
近鉄エクスプレス	486,100	2,477.00	1,204,069,700	貸付株式数	17,900株
東海運	146,500	304.00	44,536,000		
エーアイティー	161,500	1,063.00	171,674,500	貸付株式数	20,100株
内外トランスライン	90,300	1,910.00	172,473,000	貸付株式数	200株
ショーエイコーポ	59,600	957.00	57,037,200	貸付株式数	53,000株
日本コンセプト	82,000	1,813.00	148,666,000	貸付株式数	21,400株
TBSホールディングス	1,768,900	1,681.00	2,973,520,900		
日本テレビHLD S	2,226,000	1,241.00	2,762,466,000		
朝日放送グループHD	264,700	701.00	185,554,700		
テレビ朝日HD	824,200	1,696.00	1,397,843,200	貸付株式数	157,500株
スカパーJ S A T H D	1,755,100	411.00	721,346,100		
テレビ東京HD	190,800	2,134.00	407,167,200		
日本BS放送	90,200	1,089.00	98,227,800	貸付株式数	81,000株
ビジョン	331,000	1,065.00	352,515,000		
スマートバリュー	69,300	667.00	46,223,100	貸付株式数	62,000株
USEN-NEXT H L D G S	253,400	2,770.00	701,918,000	貸付株式数	61,600株
ワイヤレスゲート	109,200	431.00	47,065,200	貸付株式数	81,000株
コネクシオ	151,100	1,524.00	230,276,400		
日本通信	2,355,900	219.00	515,942,100	貸付株式数	202,700株

クロップス	48,600	879.00	42,719,400	貸付株式数	3,200株
日本電信電話	31,190,300	2,849.50	88,876,759,850		
KDDI	21,381,900	3,450.00	73,767,555,000		
ソフトバンク	24,230,500	1,449.00	35,109,994,500		
光通信	314,200	20,470.00	6,431,674,000	貸付株式数	139,100株
エムティーアイ	258,200	663.00	171,186,600	貸付株式数	176,600株
GMOインターネット	944,000	2,886.00	2,724,384,000	貸付株式数	91,000株
ファイバーゲート	86,500	1,422.00	123,003,000	貸付株式数	75,300株 (4,800株)
アイドママーケティングコ ミュ	68,500	399.00	27,331,500	貸付株式数	61,000株
KADOKAWA	690,100	4,230.00	2,919,123,000		
学研ホールディングス	376,600	1,284.00	483,554,400	貸付株式数	25,000株
ゼンリン	483,500	1,119.00	541,036,500	貸付株式数	19,700株
昭文社ホールディングス	107,400	482.00	51,766,800	貸付株式数	76,100株
インプレスホールディング ス	220,600	243.00	53,605,800	貸付株式数	198,000株
東京電力HD	23,050,000	321.00	7,399,050,000		
中部電力	8,314,000	1,334.00	11,090,876,000		
関西電力	10,294,800	1,052.50	10,835,277,000	貸付株式数	1,900株
中国電力	3,919,800	1,019.00	3,994,276,200	貸付株式数	1,763,000株
北陸電力	2,484,500	611.00	1,518,029,500	貸付株式数	12,300株
東北電力	6,364,400	864.00	5,498,841,600		
四国電力	2,258,800	745.00	1,682,806,000		
九州電力	6,001,200	844.00	5,065,012,800	貸付株式数	139,900株
北海道電力	2,543,100	509.00	1,294,437,900		
沖縄電力	528,400	1,427.00	754,026,800		
電源開発	2,162,200	1,620.00	3,502,764,000	貸付株式数	32,700株
エフオン	164,400	949.00	156,015,600	貸付株式数	147,000株
イーレックス	399,200	2,886.00	1,152,091,200	貸付株式数	317,000株
レノバ	461,900	4,860.00	2,244,834,000	貸付株式数	415,000株
東京瓦斯	5,226,100	2,054.00	10,734,409,400		
大阪瓦斯	4,921,900	2,016.00	9,922,550,400		
東邦瓦斯	1,336,500	5,500.00	7,350,750,000	貸付株式数	71,600株
北海道瓦斯	146,000	1,550.00	226,300,000		
広島ガス	560,300	369.00	206,750,700	貸付株式数	600株
西部ガスHLDGS	305,900	2,450.00	749,455,000		
静岡ガス	771,500	1,036.00	799,274,000		
メタウォーター	305,700	2,014.00	615,679,800	貸付株式数	9,400株
アイネット	137,100	1,444.00	197,972,400	貸付株式数	12,200株

松竹	176,500	12,620.00	2,227,430,000	貸付株式数	105,000株
東宝	1,573,600	4,605.00	7,246,428,000		
エイチ・アイ・エス	412,700	2,583.00	1,066,004,100	貸付株式数	371,000株 (30,000株)
東映	87,300	19,820.00	1,730,286,000	貸付株式数	7,300株
ラックランド	73,800	2,668.00	196,898,400	貸付株式数	66,000株
NTTデータ	7,100,000	1,719.00	12,204,900,000		
共立メンテナンス	430,200	3,825.00	1,645,515,000	貸付株式数	297,000株
イチネンホールディングス	269,900	1,204.00	324,959,600	貸付株式数	6,000株
建設技術研究所	167,300	2,239.00	374,584,700		
スペース	168,400	902.00	151,896,800		
長大	103,300	1,932.00	199,575,600		
アインホールディングス	388,600	6,390.00	2,483,154,000	貸付株式数	23,400株
燦ホールディングス	113,000	1,223.00	138,199,000		
ピー・シー・エー	39,000	3,725.00	145,275,000	貸付株式数	26,200株
スバル興業	15,700	8,030.00	126,071,000	貸付株式数	14,000株
東京テアトル	101,500	1,250.00	126,875,000	貸付株式数	60,000株
タナベ経営	49,900	1,415.00	70,608,500	貸付株式数	100株
ビジネスB太田昭和	91,200	1,760.00	160,512,000	貸付株式数	2,500株
ナガワ	82,900	8,530.00	707,137,000	貸付株式数	74,000株
東京都競馬	170,000	4,515.00	767,550,000		
常磐興産	104,100	1,408.00	146,572,800	貸付株式数	50,700株
カナモト	457,700	2,529.00	1,157,523,300	貸付株式数	294,000株
DTS	553,200	2,613.00	1,445,511,600		
スクウェア・エニックス・HD	1,137,300	5,220.00	5,936,706,000	貸付株式数	139,000株
シーイーシー	285,500	1,613.00	460,511,500	貸付株式数	3,700株
カプコン	2,285,700	3,065.00	7,005,670,500	貸付株式数	78,600株
西尾レントオール	239,500	3,030.00	725,685,000	貸付株式数	19,800株
アイ・エス・ビー	122,900	1,479.00	181,769,100		
アゴーラホスピタリティーG	1,426,100	25.00	35,652,500	貸付株式数	46,600株
日本空港ビルデング	931,200	5,200.00	4,842,240,000	貸付株式数	98,500株
トランス・コスモス	247,000	3,115.00	769,405,000	貸付株式数	60,600株
乃村工藝社	1,112,800	884.00	983,715,200	貸付株式数	229,400株
ジャステック	169,800	1,228.00	208,514,400		
SCSK	615,300	6,640.00	4,085,592,000		
藤田観光	103,100	2,325.00	239,707,500	貸付株式数	82,600株 (4,200株)

KNT - CTホールディングス	138,400	1,319.00	182,549,600	貸付株式数 124,000株 (7,100株)
日本管財	277,900	2,497.00	693,916,300	貸付株式数 242,000株
トーカイ	250,800	2,390.00	599,412,000	
白洋舎	29,600	2,233.00	66,096,800	貸付株式数 24,200株
セコム	2,558,900	8,335.00	21,328,431,500	
日本システムウエア	88,100	2,247.00	197,960,700	
セントラル警備保障	125,100	2,990.00	374,049,000	貸付株式数 110,900株
アイネス	262,100	1,385.00	363,008,500	貸付株式数 9,800株
丹青社	490,400	862.00	422,724,800	貸付株式数 3,500株
メイテック	313,700	6,120.00	1,919,844,000	貸付株式数 5,700株
TKC	451,100	3,255.00	1,468,330,500	
富士ソフト	284,300	5,520.00	1,569,336,000	貸付株式数 41,400株
応用地質	292,400	1,292.00	377,780,800	
船井総研ホールディング	531,400	2,430.00	1,291,302,000	貸付株式数 20,000株
NSD	857,100	1,804.00	1,546,208,400	
進学会ホールディングス	101,500	417.00	42,325,500	貸付株式数 89,600株
丸紅建材リース	26,100	1,863.00	48,624,300	
オオバ	182,100	812.00	147,865,200	貸付株式数 132,500株
コナミホールディングス	968,500	6,300.00	6,101,550,000	
いであ	63,300	1,796.00	113,686,800	貸付株式数 53,500株
学究社	75,700	1,347.00	101,967,900	貸付株式数 67,500株
ベネッセホールディングス	951,600	2,732.00	2,599,771,200	貸付株式数 25,700株
イオンディライト	319,900	3,550.00	1,135,645,000	貸付株式数 1,100株
ナック	123,100	910.00	112,021,000	
福井コンピュータHLD S	122,300	4,115.00	503,264,500	貸付株式数 2,500株
ダイセキ	435,400	4,825.00	2,100,805,000	
ステップ	95,000	1,650.00	156,750,000	
日鉄物産	190,700	4,380.00	835,266,000	
泉州電業	75,200	3,735.00	280,872,000	貸付株式数 300株
元気寿司	75,000	2,527.00	189,525,000	貸付株式数 67,000株 (800株)
トラスコ中山	612,600	2,715.00	1,663,209,000	
ヤマダホールディングス	8,970,700	496.00	4,449,467,200	
オートバックスセブン	969,100	1,520.00	1,473,032,000	
モリト	194,800	602.00	117,269,600	貸付株式数 2,900株
アークランドサカモト	419,000	1,450.00	607,550,000	貸付株式数 2,800株
ニトリホールディングス	1,062,100	19,620.00	20,838,402,000	
グルメ杵屋	190,700	960.00	183,072,000	貸付株式数 171,000株 (8,000株)

愛 眼	213,300	225.00	47,992,500	貸付株式数	6,200株
ケーユーホールディングス	139,700	937.00	130,898,900	貸付株式数	100株
吉野家ホールディングス	879,300	2,077.00	1,826,306,100	貸付株式数	494,000株
加藤産業	386,300	3,270.00	1,263,201,000	貸付株式数	12,600株
北恵	67,600	960.00	64,896,000	貸付株式数	2,800株
イノテック	150,400	1,329.00	199,881,600		
イエローハット	505,500	1,992.00	1,006,956,000		
松屋フーズHLDGS	128,800	3,505.00	451,444,000	貸付株式数	37,400株
JBC Cホールディングス	180,100	1,441.00	259,524,100		
J Kホールディングス	241,700	792.00	191,426,400	貸付株式数	177,300株
サガミホールディングス	379,800	1,021.00	387,775,800	貸付株式数	213,000株 (1,000株)
日 伝	221,900	2,084.00	462,439,600	貸付株式数	400株
関西スーパーマーケット	202,000	974.00	196,748,000	貸付株式数	900株
ミロク情報サービス	264,300	1,651.00	436,359,300	貸付株式数	9,700株
北沢産業	180,800	246.00	44,476,800	貸付株式数	3,400株
杉本商事	134,700	2,252.00	303,344,400	貸付株式数	300株
因幡電機産業	714,000	2,578.00	1,840,692,000	貸付株式数	300株
王将フードサービス	176,900	5,790.00	1,024,251,000	貸付株式数	6,800株
プレナス	299,600	2,109.00	631,856,400	貸付株式数	2,400株
ミニストップ	198,200	1,388.00	275,101,600	貸付株式数	178,000株
アークス	510,800	2,160.00	1,103,328,000	貸付株式数	12,800株
バローホールディングス	546,500	2,109.00	1,152,568,500	貸付株式数	23,100株
東 テ ク	88,600	2,717.00	240,726,200		
ミスミグループ本社	3,357,800	3,855.00	12,944,319,000		
藤 久	62,300	721.00	44,918,300	貸付株式数	55,000株
アルテック	195,900	311.00	60,924,900		
ベ ル ク	132,100	4,955.00	654,555,500	貸付株式数	3,600株
大 庄	143,200	1,053.00	150,789,600	貸付株式数	128,000株 (1,200株)
タキヒヨー	88,200	1,832.00	161,582,400	貸付株式数	71,400株
ファーストリテイリング	358,000	79,680.00	28,525,440,000		
ソフトバンクグループ	21,160,000	7,327.00	155,039,320,000		
蔵王産業	51,600	1,497.00	77,245,200	貸付株式数	100株
スズケン	1,133,600	3,285.00	3,723,876,000	貸付株式数	26,000株
サンドラッグ	1,006,800	3,410.00	3,433,188,000	貸付株式数	38,800株
サクスパーホールディング グ	226,700	612.00	138,740,400	貸付株式数	98,100株
ジェコス	184,600	886.00	163,555,600		
ヤマザワ	62,500	1,696.00	106,000,000	貸付株式数	56,000株

やまや	54,900	2,298.00	126,160,200	貸付株式数	46,400株
グローセル	289,800	433.00	125,483,400	貸付株式数	187,400株
ベルーナ	574,300	921.00	528,930,300		
合計			7,131,149,308,360		

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

武田薬品	158,000株	ソニーグループ	200,000株
キーエンス	23,000株	トヨタ自動車	160,000株
本田技研	200,000株	三菱商事	125,000株
三菱UFJフィナンシャルG	800,000株	三井住友フィナンシャルG	200,000株
みずほフィナンシャルG	400,000株	東海旅客鉄道	16,200株
KDDI	100,000株		

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年7月11日から2022年1月10日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

#### 【中間財務諸表】

## ダイワ上場投信 - トピックス

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2022年1月10日現在
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	497,114,428,379
株式	2 3 7,535,120,566,770
派生商品評価勘定	727,472,250
未収配当金	8,235,938,837
未収利息	10,841,104
その他未収収益	4 2,144,586,290
差入委託証拠金	366,600,000
流動資産合計	8,043,720,433,630
<b>資産合計</b>	
8,043,720,433,630	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	46,647,500
前受金	785,938,000
未払受託者報酬	1,648,759,440
未払委託者報酬	3,324,225,631
未払利息	334,632
受入担保金	400,407,741,374
その他未払費用	509,993,147
流動負債合計	406,723,639,724
<b>負債合計</b>	
406,723,639,724	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1 4,542,073,911,250
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,094,922,882,656
（分配準備積立金）	88,592,191
元本等合計	7,636,996,793,906
<b>純資産合計</b>	
7,636,996,793,906	
<b>負債純資産合計</b>	
8,043,720,433,630	

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年7月11日 至 2022年1月10日
<b>営業収益</b>	
受取配当金	73,994,911,732
受取利息	290,836,968
有価証券売買等損益	312,034,218,879
派生商品取引等損益	557,060,750
その他収益	1,430,848,903
<b>営業収益合計</b>	<b>390,067,755,732</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	91,269,152
受託者報酬	1,648,759,440
委託者報酬	3,324,225,631
その他費用	490,506,541
<b>営業費用合計</b>	<b>5,554,760,764</b>
<b>営業利益</b>	<b>384,512,994,968</b>
<b>経常利益</b>	<b>384,512,994,968</b>
<b>中間純利益</b>	<b>384,512,994,968</b>
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,674,629,999,185
剰余金増加額又は欠損金減少額	95,664,938,353
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	95,664,938,353
剰余金減少額又は欠損金増加額	59,885,049,850
中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	59,885,049,850
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	<b>3,094,922,882,656</b>

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年7月11日 至 2022年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年1月10日現在
1. 1 期首元本額	4,485,399,882,500円
期中追加設定元本額	145,959,787,500円
期中一部交換元本額	89,285,758,750円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,633,659,129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 373,795,009,541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 8,717,650,000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2,126,681,756円が含まれております。

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	当中間計算期間 自 2021年7月11日 至 2022年1月10日
1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額3,363,694,271円が含まれております。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	当中間計算期間末			
	2022年1月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	101,181,587,000	-	101,865,225,000	683,638,000
合計	101,181,587,000	-	101,865,225,000	683,638,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として中間計算期間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、中間計算期間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)

	当中間計算期間末
	2022年1月10日現在
1口当たり純資産額	2,101.7円
(10口当たり純資産額)	(21,017円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2022年1月31日

資産総額	7,784,210,183,330円
負債総額	495,036,551,492円
純資産総額（ - ）	7,289,173,631,838円
発行済数量	3,650,445,101口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1,996.8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) 名義登録と収益分配金の支払い

受託会社は、計算期間終了日において氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。この場合、名義登録受益者が当該計算期間終了日における振替制度移行後も受益証券を保有している所有者と異なる場合であっても、委託会社および受託会社は当該所有者に対して収益分配金の支払いおよびその他損害についてその責を負わないものとします。

(3) 受益者に対する特典

ありません。

(4) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(5) 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。

(6) 受益権の譲渡

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

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

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

(7) 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。

(8) 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。

(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、交換請求の受付け、交換株式の交付等については、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

2022年1月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. 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。

2022年1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	65	192,036
追加型株式投資信託	781	20,567,313
株式投資信託 合計	846	20,759,349
単位型公社債投資信託	78	213,110
追加型公社債投資信託	14	1,441,583
公社債投資信託 合計	92	1,654,693
総合計	938	22,414,042

## 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、改政府令附則第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					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 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いません。

(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。

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

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。

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

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係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

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

## ( ) 価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等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いません。

#### 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 of 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	(株)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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	16,953	未払手数料	2,984
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,031	未払費用	224
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,061	長期差入保証金	1,054

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(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いません。

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自 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		
ソフトウェア		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

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	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
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ェアについては、社内における利用可能期間（５年間）に基づく定額法によっております。

## 3．引当金の計上基準

### （１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

### （２）退職給付引当金

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

### （３）役員退職慰労引当金

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

## 4．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せん。

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いません。

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 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。

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

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

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】

	名 称	資本金の額 (2021年03月末日現在)	事業の内容	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)	
	S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	イービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,505百万円	(注1)	
	クレディ・スイス証券株式会社	78,100百万円	(注1)	
	ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	(注1)	
	J P モルガン証券株式会社	73,272百万円	(注1)	
	シティグループ証券株式会社	96,307百万円	(注1)	
	ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	35,765百万円	(注1)	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	(注1)	
	野村証券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	B N P パリバ証券株式会社	102,025百万円	(注1)	
	みずほ証券株式会社	125,167百万円	(注1)	
	三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	(注1)	
	BofA証券株式会社	83,140百万円	(注1)	
	モルガン・スタンレーM U F G証券株式会社	62,149百万円	(注1)	
UBS SuMi TRUSTウェルス・マネジメント株式会社	5,165百万円 (2021年08月10日現在)	(注1)		

(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いません。

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)を行いません。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務等を行いません。

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

## 第3【その他】

### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

- ・ 金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
- ・ 目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」という名称を用いることがあります。
- ・ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
- ・ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
  - 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
  - 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
- ・ 使用開始日を記載することがあります。
- ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
  - 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
  - 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
- ・ 次の事項を記載することがあります。
  - 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
  - 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

- ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
  - ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
  - ・ 図案を採用することがあります。
  - ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
  - ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス(当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。)を掲載することがあります。
  - ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
- (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**

2021年8月6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 竹内 知明 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ上場投信 - トピックスの2020年7月11日から2021年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ上場投信 - トピックスの2021年7月10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。

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

## 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年2月10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 竹内 知明**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ上場投信 - トピックスの2021年7月11日から2022年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ上場投信 - トピックスの2022年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月11日から2022年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。