

【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6月14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・ノーロード TOPIXファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ダイワ・ノーロード TOPIXファンド

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または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】

ありません。

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2022年6月15日から2022年12月13日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9)【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日(くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。)までに、取得申込金額を販売会社において支払うものとします。

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12)【その他】

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

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(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。

< 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >



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

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

運用プロセス



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

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

◆ 東証株価指数（TOPIX）について

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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

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



2 購入時および換金時の手数料はありません。

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

分配方針

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

【分配方針】

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

主な投資制限

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

- ① 東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。
- ② J P X は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ③ J P X は、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ J P X は、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 本件商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ J P X は、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦ J P X は、当社または本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 以上の項目に限らず、J P X は本件商品の設定、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ません。

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2)【ファンドの沿革】

2016年3月14日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3 ）

お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないません。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3 ）	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金（ 3 ）	
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
	損益 投資	
投資対象	<p>東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。） など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）</p>	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況（2022年3月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

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

・ 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主要投資対象

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

投資態度

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

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

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

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

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

(2)【投資対象】

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

14. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

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

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

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

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

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

(3)【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

(4)【分配方針】

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

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券等（信託約款）

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

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

投資信託証券(信託約款)

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

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

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

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

同一銘柄の新株引受権証券等(信託約款)

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

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

信用取引(信託約款)

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

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

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

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

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

先物取引等(信託約款)

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

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

スワップ取引(信託約款)

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

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

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

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

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

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

金利先渡取引(信託約款)

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

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

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

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

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

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

デリバティブ取引等(信託約款)

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

有価証券の貸付け(信託約款)

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

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

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

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

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

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

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への投資は、行ないません。

信用リスク集中回避（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

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

(1) 投資方針

投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への投資には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の変動要因については、次のとおりです。

株価の変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

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

(3)その他の留意点

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

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

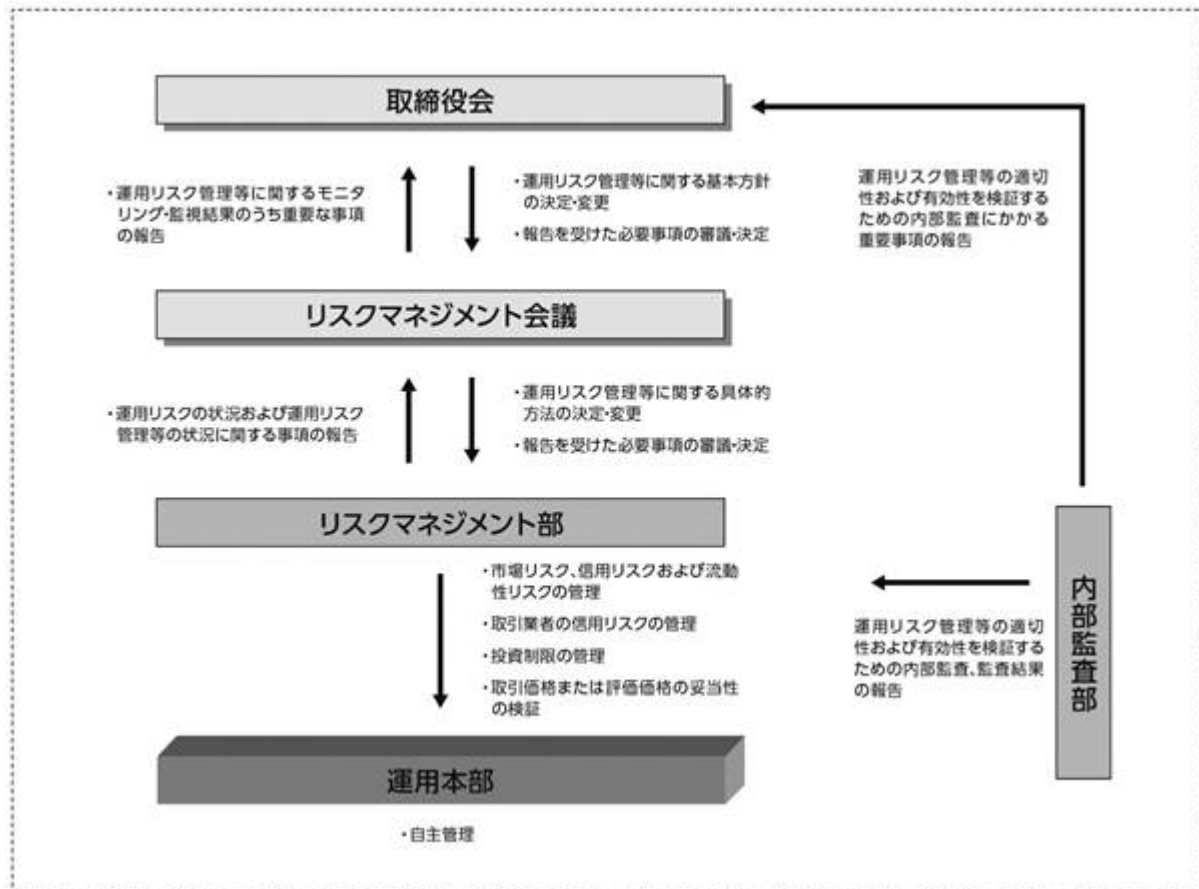
流動性リスクに関する事項

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

- ・ 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行いません。
- ・ 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。

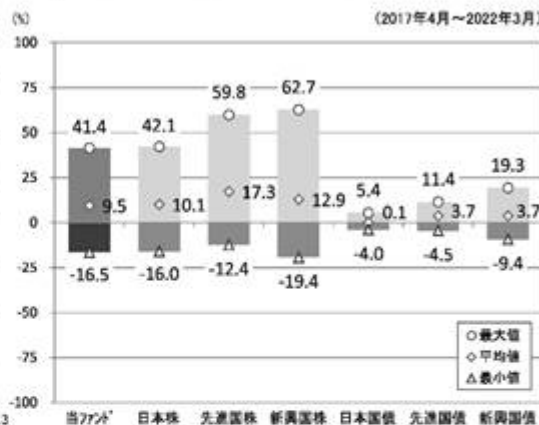
参考情報

- 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年間に於ける年間騰落率（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年間に於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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.462%（税抜0.42%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁するものとします。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.19%（税抜）	年率0.20%（税抜）	年率0.03%（税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

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

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

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

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

<注2> 収益分配金の課税について

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

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

- () 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- () 上記は、2022年3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3月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	276,689,631	99.99
内 日本	276,689,631	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	19,838	0.01
純資産総額	276,709,469	100.00

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

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

(2)【投資資産】（2022年3月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	205,916,225	1.3647 281,029,960	1.3437 276,689,631	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2016年9月20日)	20,973,537	20,973,537	0.9773	0.9773
第2計算期間末 (2017年9月19日)	59,875,242	59,875,242	1.2577	1.2577
第3計算期間末 (2018年9月19日)	139,230,873	139,230,873	1.3670	1.3670
第4計算期間末 (2019年9月19日)	166,730,681	166,730,681	1.2595	1.2595
第5計算期間末 (2020年9月23日)	177,503,691	177,503,691	1.3077	1.3077
2021年3月末日	189,078,760	-	1.5800	-
4月末日	221,634,990	-	1.5346	-
5月末日	230,939,667	-	1.5550	-
6月末日	223,402,647	-	1.5727	-
7月末日	239,945,380	-	1.5380	-
8月末日	242,311,828	-	1.5857	-
第6計算期間末 (2021年9月21日)	249,421,010	249,421,010	1.6699	1.6699
9月末日	253,294,110	-	1.6545	-
10月末日	271,251,275	-	1.6304	-
11月末日	262,897,965	-	1.5702	-
12月末日	272,049,281	-	1.6245	-
2022年1月末日	285,601,049	-	1.5459	-
2月末日	291,838,052	-	1.5385	-
3月末日	276,709,469	-	1.6037	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000

第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
2021年9月22日～ 2022年3月21日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.3
第2計算期間	28.7
第3計算期間	8.7
第4計算期間	7.9
第5計算期間	3.8
第6計算期間	27.7
2021年9月22日～ 2022年3月21日	6.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	68,189,418	47,728,670
第2計算期間	192,710,801	166,565,615
第3計算期間	151,486,100	97,241,752
第4計算期間	140,518,518	109,989,718
第5計算期間	212,075,650	208,717,903
第6計算期間	288,238,062	274,607,861
2021年9月22日～ 2022年3月21日	140,023,270	92,199,699

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2022年3月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	186,449,692,090	97.34
内 日本	186,449,692,090	97.34

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,097,618,064	2.66
純資産総額	191,547,310,154	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	5,021,970,000	2.62
内 日本	5,021,970,000	2.62

(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3月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
					また は 額面金額			
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	3,555,000	1,987.19 7,064,481,450	2,222.50 7,900,987,500	4.12
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機 器	439,700	12,354.14 5,432,116,600	12,730.00 5,597,381,000	2.92
3	キーエンス	日本	株式	電気機 器	63,600	71,315.22 4,535,648,000	57,250.00 3,641,100,000	1.90
4	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,341,500	633.82 2,751,740,940	760.30 3,300,842,450	1.72
5	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	44,500	54,129.21 2,408,750,000	63,250.00 2,814,625,000	1.47
6	リクルートホールディン グス	日本	株式	サービ ス業	517,400	6,964.34 3,603,349,800	5,414.00 2,801,203,600	1.46
7	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	720,500	3,229.02 2,326,513,610	3,545.00 2,554,172,500	1.33
8	任天堂	日本	株式	その他 製品	39,600	52,807.87 2,091,192,000	61,670.00 2,442,132,000	1.27
9	三菱商事	日本	株式	卸売業	517,700	3,548.22 1,836,915,400	4,601.00 2,381,937,700	1.24

10	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	413,000	6,286.06 2,596,143,800	5,559.00 2,295,867,000	1.20
11	信越化学	日本	株式	化学	118,000	21,045.12 2,483,325,000	18,790.00 2,217,220,000	1.16
12	日立	日本	株式	電気機器	337,500	6,418.89 2,166,377,100	6,165.00 2,080,687,500	1.09
13	KDDI	日本	株式	情報・通信業	502,100	3,778.61 1,897,244,300	4,005.00 2,010,910,500	1.05
14	ダイキン工業	日本	株式	機械	89,400	26,551.78 2,373,729,600	22,410.00 2,003,454,000	1.05
15	伊藤忠	日本	株式	卸売業	483,300	3,461.09 1,672,746,400	4,144.00 2,002,795,200	1.05
16	武田薬品	日本	株式	医薬品	551,700	3,739.48 2,063,075,000	3,498.00 1,929,846,600	1.01
17	本田技研	日本	株式	輸送用機器	552,600	3,332.48 1,841,529,000	3,487.00 1,926,916,200	1.01
18	HOYA	日本	株式	精密機器	137,000	18,310.36 2,508,519,800	14,030.00 1,922,110,000	1.00
19	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	479,200	3,929.84 1,883,182,300	3,907.00 1,872,234,400	0.98
20	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	79,200	17,436.18 1,380,946,000	23,510.00 1,861,992,000	0.97
21	三井物産	日本	株式	卸売業	536,500	2,458.93 1,319,220,900	3,328.00 1,785,472,000	0.93
22	日本電産	日本	株式	電気機器	181,900	13,208.89 2,402,697,300	9,748.00 1,773,161,200	0.93
23	村田製作所	日本	株式	電気機器	206,200	9,942.43 2,050,130,000	8,117.00 1,673,725,400	0.87
24	東京海上HD	日本	株式	保険業	228,100	6,015.41 1,372,115,800	7,128.00 1,625,896,800	0.85
25	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	270,400	5,126.48 1,386,200,400	5,813.00 1,571,835,200	0.82
26	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,042,400	1,550.21 1,615,944,550	1,428.00 1,488,547,200	0.78
27	第一三共	日本	株式	医薬品	551,500	3,008.14 1,658,992,850	2,680.00 1,478,020,000	0.77
28	SMC	日本	株式	機械	20,500	76,972.74 1,577,941,200	68,840.00 1,411,220,000	0.74
29	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	885,700	1,597.26 1,414,699,900	1,567.00 1,387,891,900	0.72

30	ファナック	日本	株式	電気機器	61,600	25,429.00 1,566,426,900	21,645.00 1,333,332,000	0.70
----	-------	----	----	------	--------	----------------------------	----------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.34%
合計	97.34%

(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	0.31%
建設業	2.15%
食料品	3.16%
繊維製品	0.43%
パルプ・紙	0.20%
化学	6.28%
医薬品	4.79%
石油・石炭製品	0.43%
ゴム製品	0.65%
ガラス・土石製品	0.72%
鉄鋼	0.82%
非鉄金属	0.79%
金属製品	0.55%
機械	5.20%
電気機器	17.61%
輸送用機器	8.15%
精密機器	2.46%
その他製品	2.36%
電気・ガス業	1.10%
陸運業	3.00%
海運業	0.62%
空運業	0.41%
倉庫・運輸関連業	0.18%
情報・通信業	8.04%
卸売業	5.95%
小売業	4.12%

銀行業	5.11%
証券、商品先物取引業	0.74%
保険業	2.18%
その他金融業	1.11%
不動産業	1.90%
サービス業	5.74%
合計	97.34%

(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 040 6月	買建	258	4,816,217,900	5,021,970,000	2.62%

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

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

(参考情報) 運用実績

●ダイワ・ノーロード TOPIXファンド

2022年3月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	16,037円
純資産総額	2.7億円



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期				
	16年9月	17年9月	18年9月	19年9月	20年9月	21年9月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円				

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

主要な資産の状況

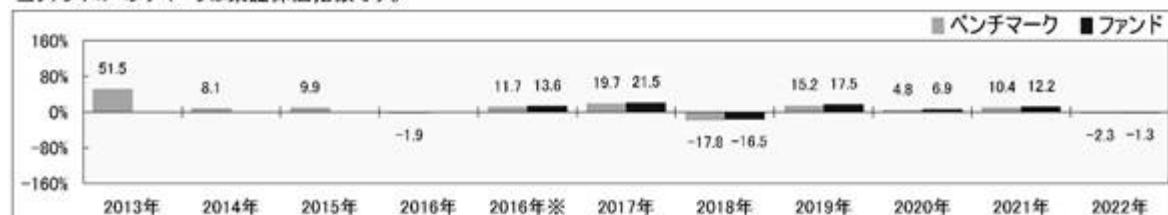
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,160	97.3%	電気機器	17.6%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.1%
国内株式先物	1	2.6%	輸送用機器	8.1%	ソニーグループ	電気機器	2.9%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	8.0%	TOPIX先物 0406月	-	2.6%
コール・ローン、その他	-	2.7%	化学	6.3%	キーエンス	電気機器	1.9%
合計	2,161	-	卸売業	5.9%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.7%
株式市場・上場別構成			サービス業	5.7%	東京エレクトロン	電気機器	1.5%
一部(東証・名証)		97.3%	機械	5.2%	リクルートホールディングス	サービス業	1.5%
二部(東証・名証)		-	銀行業	5.1%	日本電信電話	情報・通信業	1.3%
新興市場他		-	医薬品	4.8%	任天堂	その他製品	1.3%
その他		-	その他	30.5%	三菱商事	卸売業	1.2%
合計		97.3%	合計	97.3%	合計		20.1%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。



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

・2016年※は設定日(3月14日)から年末、2022年は3月31日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

お申込手数料は、ありません。

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

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

<一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額(基準価額)は、販売会社または下記にお問合せください。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合せ下さい。

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)

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2016年3月14日から2026年9月19日までとします。ただし、(5)により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

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

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

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、東証株価指数が改廃された場合、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告

書)を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書(全体版)(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書)を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

公告

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

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

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

関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

< 収益分配金および償還金にかかる請求権 >

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

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

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

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

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

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

< 換金請求権 >

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間（2020年9月24日から2021年9月21日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワ・ノーロード TOPIXファンド

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2020年9月23日現在	第6期 2021年9月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,234,937	1,632,766
親投資信託受益証券	177,491,626	249,403,536
未収入金	3,880,000	1,006,000
流動資産合計	183,606,563	252,042,302
資産合計	183,606,563	252,042,302
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,569,526	1,984,042
未払受託者報酬	31,638	37,827
未払委託者報酬	496,523	593,201
その他未払費用	5,185	6,222
流動負債合計	6,102,872	2,621,292
負債合計	6,102,872	2,621,292
純資産の部		
元本等		
元本	1 135,736,829	1 149,367,030
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	41,766,862	100,053,980
(分配準備積立金)	8,903,458	23,899,957
元本等合計	177,503,691	249,421,010
純資産合計	177,503,691	249,421,010
負債純資産合計	183,606,563	252,042,302

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2019年9月20日 至 2020年9月23日	自	2020年9月24日 至 2021年9月21日
営業収益				
受取利息		1		-
有価証券売買等損益		15,506,223		53,434,910
営業収益合計		15,506,224		53,434,910
営業費用				
支払利息		231		150
受託者報酬		58,112		67,489
委託者報酬		911,870		1,058,616
その他費用		9,513		11,084
営業費用合計		979,726		1,137,339
営業利益		14,526,498		52,297,571
経常利益		14,526,498		52,297,571
当期純利益		14,526,498		52,297,571
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		5,620,846		29,587,034
期首剰余金又は期首欠損金()		34,351,599		41,766,862
剰余金増加額又は欠損金減少額		50,945,640		147,246,523
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		50,945,640		147,246,523
剰余金減少額又は欠損金増加額		52,436,029		111,669,942
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		52,436,029		111,669,942
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		41,766,862		100,053,980

(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6期	
	自 2020年9月24日	至 2021年9月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2020年9月19日から2020年9月22日までが休日のため、前計算期間末日を2020年9月23日としており、2021年9月19日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2021年9月21日としております。このため、当計算期間は363日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2020年9月23日現在	2021年9月21日現在
1. 1 期首元本額	132,379,082円	135,736,829円
期中追加設定元本額	212,075,650円	288,238,062円
期中一部解約元本額	208,717,903円	274,607,861円
2. 計算期間末日における受益権の総数	135,736,829口	149,367,030口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	自 2019年9月20日 至 2020年9月23日	自 2020年9月24日 至 2021年9月21日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(8,532,819円)、投資信託約款に規定される収益調整金(32,863,527円)及び分配準備積立金(370,639円)より分配対象額は41,766,985円(1万口当たり3,077.06円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(22,710,598円)、投資信託約款に規定される収益調整金(76,154,108円)及び分配準備積立金(1,189,359円)より分配対象額は100,054,065円(1万口当たり6,698.54円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2020年9月24日 至 2021年9月21日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2021年9月21日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2020年9月23日現在	2021年9月21日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	9,927,278	27,824,722
合計	9,927,278	27,824,722

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第5期	第6期
2020年9月23日現在	2021年9月21日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2020年9月24日
至 2021年9月21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5期	第6期
	2020年9月23日現在	2021年9月21日現在
1口当たり純資産額	1.3077円	1.6699円
（1万口当たり純資産額）	（13,077円）	（16,699円）

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	178,771,082	249,403,536	
親投資信託受益証券 合計			249,403,536	
合計			249,403,536	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2020年9月23日現在	2021年9月21日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,181,037,878	11,388,192,763

株式	2 3	155,810,906,285	189,973,468,640
派生商品評価勘定		6,670,250	277,800
未収配当金		64,970,916	69,858,959
未収利息		1,190,061	581,660
その他未収収益	4	4,324,627	3,470,064
差入委託証拠金		33,660,000	-
流動資産合計		172,102,760,017	201,435,849,886
資産合計		172,102,760,017	201,435,849,886
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,550	3,815,650
前受金		8,410,000	34,675,000
未払金		5,600	79,161,000
未払解約金		157,714,320	229,583,550
受入担保金		15,187,919,669	8,605,893,975
その他未払費用		89,578	-
流動負債合計		15,354,140,717	8,953,129,175
負債合計		15,354,140,717	8,953,129,175
純資産の部			
元本等			
元本	1	144,273,817,223	137,972,449,571
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,474,802,077	54,510,271,140
元本等合計		156,748,619,300	192,482,720,711
純資産合計		156,748,619,300	192,482,720,711
負債純資産合計		172,102,760,017	201,435,849,886

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年9月24日 至 2021年9月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年9月23日現在	2021年9月21日現在
1. 1 期首	2019年9月20日	2020年9月24日
期首元本額	139,218,477,453円	144,273,817,223円
期中追加設定元本額	38,212,962,099円	20,154,777,070円
期中一部解約元本額	33,157,622,329円	26,456,144,722円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックス	3,314,021,528円	2,989,191,828円
ファンド		

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	6,818,474,579円	5,882,696,138円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドVA2	2,657,999円	925,539円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	46,604,616円	25,469,299円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	686,480,990円	429,078,400円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	36,922,244円	23,164,900円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	975,609,786円	721,398,709円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	115,509,117円	212,609,568円
D-I's TOPIXイン デックス	50,828,888円	50,045,732円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	12,744,127円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	22,523,341円	112,275,070円
iFree TOPIXイン デックス	1,984,833,386円	4,271,085,355円
iFree 8資産バランス	2,612,918,610円	3,194,833,049円
iFree 年金バランス	111,316,445円	442,601,861円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,911,437,637円	65,726,059,110円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,014,014,018円	2,904,866,842円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,718,178,204円	3,951,974,309円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,338,684,763円	3,760,977,295円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	5,125,140,712円	5,858,241,088円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	12,676,182円	- 円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	49,637,084円	50,696,932円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	35,161,355円	51,725,840円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	742,243,077円	1,353,026,496円
ダイワつみたてインデックス バランス30	11,325,834円	9,628,593円
ダイワつみたてインデックス バランス50	7,141,239円	8,568,294円
ダイワつみたてインデックス バランス70	10,260,361円	17,409,216円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	146,259,723円	113,101,715円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	156,097,901円	130,262,046円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	8,172,743,694円	6,161,189,519円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	711,092,768円	559,246,637円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	105,455,426円	80,610,399円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	194,955,500円	146,638,577円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	163,360,908円	178,771,082円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,589,328,266円	10,294,148,277円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	8,840,247,711円	2,512,120,167円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,003,637,126円	2,644,643,973円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,325,135,081円	1,211,577,472円
ダイワライフスタイル25	188,604,645円	153,686,797円
ダイワライフスタイル50	670,194,395円	617,422,037円
ダイワライフスタイル75	532,629,983円	487,367,793円

	DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)	11,706,727,974円	10,633,113,617円
計		144,273,817,223円	137,972,449,571円
2.	期末日における受益権の総数	144,273,817,223口	137,972,449,571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 14,558,387,700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 8,131,613,200円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 535,300,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 949,460,000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2,755,075円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分2,759,549円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年9月24日 至 2021年9月21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	2021年9月21日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2020年9月23日現在	2021年9月21日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	3,811,271,063	36,459,373,632
合計	3,811,271,063	36,459,373,632

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年9月20日から2020年9月23日まで、及び2020年9月24日から2021年9月21日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

	2020年9月23日 現在	2021年9月21日 現在

種類	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	906,100,500	-	912,800,000	6,699,500	1,791,775,000	-	1,788,285,000	3,490,000
合計	906,100,500	-	912,800,000	6,699,500	1,791,775,000	-	1,788,285,000	3,490,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2020年9月23日現在	2021年9月21日現在
1口当たり純資産額	1.0865円	1.3951円
(1万口当たり純資産額)	(10,865円)	(13,951円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,100	3,050.00	9,455,000	貸付株式数 200株
日本水産	84,300	642.00	54,120,600	
マルハニチロ	14,000	2,654.00	37,156,000	
ハウスイ	500	942.00	471,000	貸付株式数 200株
カネコ種苗	2,700	1,542.00	4,163,400	
サカタのタネ	10,800	3,620.00	39,096,000	
ホクト	7,900	1,978.00	15,626,200	貸付株式数 2,500株
ホクリヨウ	2,300	757.00	1,741,100	貸付株式数 300株

ヒノキヤグループ	2,300	2,370.00	5,451,000		
ショーボンドHD	13,200	5,060.00	66,792,000	貸付株式数	2,000株
ミライト・ホールディングス	31,900	2,304.00	73,497,600		
タマホーム	5,900	2,804.00	16,543,600	貸付株式数	2,200株
サンヨーホームズ	1,500	742.00	1,113,000	貸付株式数	300株
日本アクア	4,400	586.00	2,578,400	貸付株式数	1,400株
ファーストコーポレーション	3,200	805.00	2,576,000		
ベステラ	1,900	1,450.00	2,755,000		
キャンディル	1,700	622.00	1,057,400	貸付株式数	200株
スペースバリューHD	11,500	847.00	9,740,500	貸付株式数	4,200株
住石ホールディングス	21,600	139.00	3,002,400	貸付株式数	6,300株
日鉄鉱業	2,100	6,580.00	13,818,000		
三井松島HLDGS	3,600	1,405.00	5,058,000		
INPEX	367,200	788.00	289,353,600	貸付株式数	131,500株
石油資源開発	12,400	1,965.00	24,366,000		
K&Oエナジーグループ	4,300	1,378.00	5,925,400		
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,657.00	2,982,600		
第一カッター興業	2,300	1,324.00	3,045,200		
明豊ファシリティワークス	3,300	913.00	3,012,900	貸付株式数	500株
安藤・間	58,400	812.00	47,420,800		
東急建設	29,000	800.00	23,200,000		
コムシスホールディングス	32,600	2,986.00	97,343,600		
ビーアールホールディングス	12,500	484.00	6,050,000	貸付株式数	300株
高松コンストラクションGP	5,700	2,061.00	11,747,700	貸付株式数	2,100株
東建コーポレーション	2,800	10,380.00	29,064,000		
ソネック	1,000	1,130.00	1,130,000	貸付株式数	200株 (100株)
ヤマウラ	4,100	933.00	3,825,300	貸付株式数	1,500株
オリエンタル白石	32,300	268.00	8,656,400		
大成建設	65,400	3,600.00	235,440,000		
大林組	209,000	936.00	195,624,000		
清水建設	197,800	846.00	167,338,800		
飛鳥建設	5,700	1,126.00	6,418,200	貸付株式数	500株
長谷工コーポレーション	68,600	1,500.00	102,900,000		
松井建設	7,800	796.00	6,208,800		

銭高組	900	4,400.00	3,960,000	
鹿島建設	153,900	1,466.00	225,617,400	
不動テトラ	5,100	1,794.00	9,149,400	貸付株式数 2,000株
大末建設	2,500	985.00	2,462,500	
鉄建建設	3,900	1,829.00	7,133,100	
西松建設	15,500	3,565.00	55,257,500	
三井住友建設	51,700	486.00	25,126,200	貸付株式数 800株
大豊建設	5,000	3,820.00	19,100,000	貸付株式数 1,800株
前田建設	53,400	873.00	46,618,200	
佐田建設	5,100	484.00	2,468,400	
ナカノフード建設	5,000	358.00	1,790,000	
奥村組	11,500	3,125.00	35,937,500	
東鉄工業	8,500	2,530.00	21,505,000	貸付株式数 400株
イチケン	1,500	1,936.00	2,904,000	
富士ピー・エス	2,400	592.00	1,420,800	貸付株式数 900株
浅沼組	2,600	4,620.00	12,012,000	
戸田建設	86,100	825.00	71,032,500	
熊谷組	9,900	2,766.00	27,383,400	
北野建設	1,200	2,190.00	2,628,000	貸付株式数 400株
植木組	1,800	1,537.00	2,766,600	貸付株式数 700株
矢作建設	9,300	833.00	7,746,900	
ピーエス三菱	6,800	660.00	4,488,000	貸付株式数 1,300株
日本ハウスHLDGS	14,700	438.00	6,438,600	貸付株式数 5,600株
大東建託	23,000	13,060.00	300,380,000	
新日本建設	8,400	912.00	7,660,800	
NIPPO	17,700	3,990.00	70,623,000	
東亜道路	1,300	4,615.00	5,999,500	
前田道路	13,200	1,995.00	26,334,000	
日本道路	2,100	8,500.00	17,850,000	
東亜建設	6,000	2,437.00	14,622,000	貸付株式数 2,600株
日本国土開発	20,000	607.00	12,140,000	
若築建設	3,600	2,128.00	7,660,800	貸付株式数 1,400株
東洋建設	24,200	573.00	13,866,600	
五洋建設	90,100	759.00	68,385,900	
世紀東急	10,200	867.00	8,843,400	
福田組	2,400	5,080.00	12,192,000	
日本ドライケミカル	1,600	2,326.00	3,721,600	貸付株式数 600株
住友林業	54,400	2,212.00	120,332,800	貸付株式数 19,200株
日本基礎技術	6,300	608.00	3,830,400	貸付株式数 1,200株
巴コーポレーション	8,400	489.00	4,107,600	

大和ハウス	194,300	3,800.00	738,340,000	
ライト工業	12,200	1,954.00	23,838,800	
積水ハウス	227,900	2,375.50	541,376,450	
日特建設	5,300	735.00	3,895,500	
北陸電気工事	3,400	1,358.00	4,617,200	
ユアテック	12,100	743.00	8,990,300	
日本リーテック	4,400	1,787.00	7,862,800	貸付株式数 1,700株
四電工	1,200	3,545.00	4,254,000	
中電工	10,100	2,348.00	23,714,800	
関電工	34,900	946.00	33,015,400	
きんでん	42,200	1,960.00	82,712,000	
東京エネシス	6,700	1,091.00	7,309,700	
トーエネック	2,000	3,750.00	7,500,000	
住友電設	5,900	2,373.00	14,000,700	
日本電設工業	11,100	1,867.00	20,723,700	貸付株式数 2,400株
協和エクシオ	32,300	2,831.00	91,441,300	
新日本空調	5,400	2,546.00	13,748,400	貸付株式数 1,400株
日本工営	3,800	3,460.00	13,148,000	
九電工	14,800	3,980.00	58,904,000	
三機工業	15,500	1,540.00	23,870,000	
日揮ホールディングス	70,100	980.00	68,698,000	
中外炉工業	2,400	1,853.00	4,447,200	
ヤマト	6,800	784.00	5,331,200	貸付株式数 1,700株
太平電業	4,900	2,915.00	14,283,500	
高砂熱学	18,700	2,186.00	40,878,200	
三晃金属	900	2,310.00	2,079,000	
NEC ネットエスアイ	22,300	2,201.00	49,082,300	
朝日工業社	1,400	3,535.00	4,949,000	
明星工業	13,100	770.00	10,087,000	
大気社	10,100	3,355.00	33,885,500	貸付株式数 3,500株
ダイダン	4,600	2,722.00	12,521,200	
日比谷総合設備	6,700	1,969.00	13,192,300	貸付株式数 2,300株
ニッポン	19,500	1,670.00	32,565,000	貸付株式数 7,700株
日清製粉G本社	76,200	1,926.00	146,761,200	
日東富士製粉	500	6,780.00	3,390,000	
昭和産業	5,900	2,835.00	16,726,500	
鳥越製粉	6,400	786.00	5,030,400	貸付株式数 200株
中部飼料	8,400	1,161.00	9,752,400	貸付株式数 3,100株
フィード・ワン	9,300	779.00	7,244,700	
東洋精糖	1,500	1,197.00	1,795,500	

日本甜菜糖	3,500	1,676.00	5,866,000		
D M三井製糖ホールディ	5,100	2,036.00	10,383,600	貸付株式数	400株
塩水港精糖	10,300	225.00	2,317,500	貸付株式数	900株
日新製糖	3,100	1,757.00	5,446,700		
L I F U L L	22,500	365.00	8,212,500	貸付株式数	8,500株
ミクシィ	16,500	2,640.00	43,560,000	貸付株式数	3,200株
ジェイエシーリクルート メント	5,500	2,127.00	11,698,500	貸付株式数	500株
日本M & Aセンター	105,500	3,590.00	378,745,000		
メンバーズ	2,400	3,450.00	8,280,000	貸付株式数	700株
中広	1,100	402.00	442,200	貸付株式数	300株
U Tグループ	9,400	3,090.00	29,046,000	貸付株式数	3,700株
アイティメディア	2,500	2,364.00	5,910,000	貸付株式数	200株
タケエイ	7,500	1,890.00	14,175,000		
E・Jホールディングス	3,500	1,358.00	4,753,000		
夢真ビーネックスグルー フ	17,600	1,335.00	23,496,000		
コシダカホールディングス	18,600	583.00	10,843,800	貸付株式数	6,800株
アルトナー	1,600	866.00	1,385,600	貸付株式数	100株
パソナグループ	7,300	3,335.00	24,345,500	貸付株式数	1,600株
C D S	1,500	1,631.00	2,446,500	貸付株式数	100株
リンクアンドモチベーシ ョン	14,500	1,106.00	16,037,000		
G C A	8,200	1,395.00	11,439,000		
エス・エム・エス	22,200	4,240.00	94,128,000		
サニーサイドアップG	2,000	783.00	1,566,000	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	64,200	2,726.00	175,009,200		
リニカル	3,700	801.00	2,963,700	貸付株式数	1,400株
クックパッド	21,700	235.00	5,099,500	貸付株式数	8,000株
エスクリ	3,000	557.00	1,671,000	貸付株式数	700株
アイ・ケイ・ケイ	3,100	689.00	2,135,900	貸付株式数	1,200株
森永製菓	15,700	4,225.00	66,332,500		
中村屋	1,600	3,945.00	6,312,000		
江崎グリコ	18,400	4,380.00	80,592,000	貸付株式数	4,800株
名糖産業	3,200	1,795.00	5,744,000	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	3,800	2,431.00	9,237,800		
不二家	4,100	2,436.00	9,987,600	貸付株式数	1,600株
山崎製パン	50,700	1,999.00	101,349,300	貸付株式数	19,800株
第一屋製パン	1,800	801.00	1,441,800	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,100	5,590.00	6,149,000		
亀田製菓	3,800	4,600.00	17,480,000	貸付株式数	1,000株

寿スピリッツ	6,600	7,170.00	47,322,000	貸付株式数	1,100株
カルビー	30,600	2,854.00	87,332,400		
森永乳業	12,600	7,160.00	90,216,000		
六甲バター	4,500	1,703.00	7,663,500	貸付株式数	200株
ヤクルト	46,400	5,820.00	270,048,000		
明治ホールディングス	44,200	7,330.00	323,986,000		
雪印メグミルク	16,000	2,347.00	37,552,000	貸付株式数	6,400株
プリマハム	9,600	3,040.00	29,184,000	貸付株式数	1,200株
日本ハム	25,700	4,380.00	112,566,000		
林兼産業	2,800	609.00	1,705,200		
丸大食品	6,400	1,801.00	11,526,400	貸付株式数	2,500株
S Foods	6,000	3,150.00	18,900,000	貸付株式数	1,600株
柿安本店	2,200	2,680.00	5,896,000	貸付株式数	300株
伊藤ハム米久HLDGS	42,800	762.00	32,613,600	貸付株式数	1,300株
学情	2,800	1,262.00	3,533,600	貸付株式数	1,000株
スタジオアリス	3,400	2,361.00	8,027,400	貸付株式数	900株
クロスキャット	1,800	1,414.00	2,545,200	貸付株式数	600株
シミックホールディングス	3,600	1,501.00	5,403,600		
エプロ	1,500	891.00	1,336,500		
システナ	24,000	2,390.00	57,360,000	貸付株式数	4,600株
NJS	1,600	1,970.00	3,152,000		
デジタルアーツ	3,900	9,260.00	36,114,000		
日鉄ソリューションズ	9,700	3,995.00	38,751,500		
総合警備保障	25,400	5,080.00	129,032,000		
キューブシステム	3,800	1,102.00	4,187,600	貸付株式数	1,300株
いちご	74,300	352.00	26,153,600	貸付株式数	15,000株
WOW WORLD	1,700	1,754.00	2,981,800	貸付株式数	300株
日本駐車場開発	73,500	162.00	11,907,000		
コア	2,600	1,559.00	4,053,400	貸付株式数	200株
カカココム	47,800	3,705.00	177,099,000		
アイロムグループ	2,400	2,180.00	5,232,000	貸付株式数	900株
セントケア・ホールディング	5,200	1,003.00	5,215,600	貸付株式数	1,800株
サイネックス	1,800	674.00	1,213,200	貸付株式数	400株
ルネサンス	4,200	1,166.00	4,897,200	貸付株式数	1,600株
ディップ	10,400	4,085.00	42,484,000		
SBSホールディングス	5,400	4,245.00	22,923,000		
デジタルホールディングス	4,900	1,759.00	8,619,100	貸付株式数	1,700株
新日本科学	8,100	920.00	7,452,000		
キャリアデザインセンター	1,600	1,210.00	1,936,000	貸付株式数	600株

ベネフィット・ワン	23,500	5,510.00	129,485,000		
エムスリー	113,600	8,588.00	975,596,800		
ツカダ・グローバルHOLD	4,900	354.00	1,734,600	貸付株式数	700株
プラス	1,400	817.00	1,143,800	貸付株式数	300株
アウトソーシング	37,400	2,005.00	74,987,000	貸付株式数	14,000株
ウェルネット	6,300	527.00	3,320,100	貸付株式数	2,500株
ワールドホールディングス	2,600	2,794.00	7,264,400	貸付株式数	800株
ディー・エヌ・エー	27,800	1,984.00	55,155,200		
博報堂DYHLDGS	89,100	1,907.00	169,913,700		
ぐるなび	11,100	523.00	5,805,300	貸付株式数	4,300株
タカミヤ	7,500	496.00	3,720,000		
ジャパンベストレスキューS	5,000	1,268.00	6,340,000		
ファンコミュニケーションズ	16,400	438.00	7,183,200	貸付株式数	6,300株
ライク	1,900	1,824.00	3,465,600		
ビジネス・ブレークスルー	3,000	439.00	1,317,000	貸付株式数	1,000株
エスプール	19,100	1,054.00	20,131,400		
WDBホールディングス	3,000	3,640.00	10,920,000		
手間いらず	1,000	5,850.00	5,850,000	貸付株式数	300株
ティア	3,600	508.00	1,828,800	貸付株式数	700株
CDG	500	1,570.00	785,000	貸付株式数	200株
バリューコマース	5,300	4,850.00	25,705,000	貸付株式数	1,500株
インフォマート	71,500	1,072.00	76,648,000		
サッポロホールディングス	22,800	2,519.00	57,433,200		
アサヒグループホールディングン	158,600	5,485.00	869,921,000		
麒麟HD	247,600	2,049.00	507,332,400	貸付株式数	112,200株
宝ホールディングス	50,200	1,565.00	78,563,000		
オエノンホールディングス	19,900	393.00	7,820,700		
養命酒	2,300	1,883.00	4,330,900	貸付株式数	800株
コカ・コーラボトラーズJHD	47,200	1,632.00	77,030,400	貸付株式数	9,000株
サントリー食品インター	45,200	4,890.00	221,028,000	貸付株式数	18,000株
ダイドーグループHD	3,800	5,880.00	22,344,000	貸付株式数	1,500株
伊藤園	20,500	7,740.00	158,670,000	貸付株式数	8,100株
キーコーヒー	6,900	2,259.00	15,587,100	貸付株式数	2,700株
ユニカフェ	2,500	1,092.00	2,730,000		
ジャパンフーズ	1,000	1,258.00	1,258,000		

日清オイリオグループ	8,500	3,140.00	26,690,000	貸付株式数	3,200株
不二製油グループ	16,500	2,657.00	43,840,500		
かどや製油	700	4,280.00	2,996,000	貸付株式数	200株
J - オイルミルズ	6,200	1,852.00	11,482,400	貸付株式数	2,400株
ローソン	16,600	5,730.00	95,118,000		
サンエー	4,800	4,045.00	19,416,000		
カワチ薬品	4,600	2,327.00	10,704,200	貸付株式数	800株
エービーシー・マート	10,300	5,850.00	60,255,000		
ハードオフコーポレーション	2,500	781.00	1,952,500	貸付株式数	200株
高千穂交易	2,500	1,237.00	3,092,500	貸付株式数	1,000株
アスクル	11,200	1,716.00	19,219,200	貸付株式数	4,200株
ゲオホールディングス	8,900	1,227.00	10,920,300	貸付株式数	3,500株
アダストリア	9,400	1,982.00	18,630,800	貸付株式数	3,500株
ジーフット	3,000	408.00	1,224,000	貸付株式数	1,600株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	413.00	413,000	貸付株式数	300株
オルバヘルスケアHLDGS	1,100	1,596.00	1,755,600		
伊藤忠食品	1,600	5,460.00	8,736,000		
くら寿司	7,100	3,985.00	28,293,500	貸付株式数	2,800株
キャンドウ	3,600	1,909.00	6,872,400	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,800	1,181.00	6,849,800		
パルグループHLDGS	5,900	1,747.00	10,307,300		
JALUX	1,700	1,797.00	3,054,900	貸付株式数	700株
エディオン	27,500	1,077.00	29,617,500	貸付株式数	11,000株
あらた	5,100	4,580.00	23,358,000		
サーラコーポレーション	13,600	653.00	8,880,800	貸付株式数	5,400株
ワッツ	3,400	889.00	3,022,600	貸付株式数	1,200株
トーメンデバイス	900	5,490.00	4,941,000	貸付株式数	300株
ハローズ	2,700	3,015.00	8,140,500	貸付株式数	100株
J Pホールディングス	18,800	280.00	5,264,000	貸付株式数	6,900株
フジオフードG本社	5,600	1,393.00	7,800,800	貸付株式数	2,200株 (100株)
あみやき亭	1,300	2,925.00	3,802,500	貸付株式数	500株
東京エレクトロンデバイス	2,200	8,580.00	18,876,000		
ひらまつ	12,700	213.00	2,705,100	貸付株式数	200株
フィールズ	5,900	525.00	3,097,500	貸付株式数	200株
双日	367,400	354.00	130,059,600		

アルフレッサホールディングス	68,600	1,749.00	119,981,400	
大黒天物産	2,200	6,890.00	15,158,000	貸付株式数 800株
ハニーズホールディングス	5,000	1,128.00	5,640,000	
ファーマライズHD	1,500	812.00	1,218,000	貸付株式数 600株
キッコーマン	48,500	9,520.00	461,720,000	
味の素	160,300	3,464.00	555,279,200	
キューピー	37,800	2,803.00	105,953,400	貸付株式数 14,700株
ハウス食品G本社	25,100	3,725.00	93,497,500	貸付株式数 400株
カゴメ	25,400	3,010.00	76,454,000	貸付株式数 10,400株
焼津水産化工	3,100	1,032.00	3,199,200	貸付株式数 700株
アリアケジャパン	6,200	6,720.00	41,664,000	
ピエトロ	900	1,823.00	1,640,700	貸付株式数 300株
エバラ食品工業	1,700	2,610.00	4,437,000	
やまみ	800	1,996.00	1,596,800	
ニチレイ	32,100	2,980.00	95,658,000	
横浜冷凍	17,400	924.00	16,077,600	貸付株式数 6,900株
東洋水産	34,700	5,260.00	182,522,000	
イトアンドHLDGS	2,300	2,299.00	5,287,700	貸付株式数 100株
大冷	1,100	2,006.00	2,206,600	貸付株式数 300株
ヨシムラ・フード・HLDGS	4,000	763.00	3,052,000	貸付株式数 1,400株
日清食品HD	26,400	9,230.00	243,672,000	
永谷園ホールディングス	3,500	2,177.00	7,619,500	
一正蒲鉾	2,800	946.00	2,648,800	
フジッコ	7,500	1,949.00	14,617,500	
ロックフィールド	7,500	1,706.00	12,795,000	貸付株式数 2,900株
日本たばこ産業	360,400	2,164.00	779,905,600	貸付株式数 150,400株
ケンコーマヨネーズ	4,000	1,678.00	6,712,000	貸付株式数 1,600株
わらべや日洋HD	4,600	2,562.00	11,785,200	貸付株式数 1,600株
なとり	4,100	1,996.00	8,183,600	
イフジ産業	1,500	955.00	1,432,500	貸付株式数 400株
ピクルスコーポレーション	3,400	2,198.00	7,473,200	
北の達人コーポ	24,000	486.00	11,664,000	貸付株式数 9,400株 (2,500株)
ユーグレナ	35,300	873.00	30,816,900	貸付株式数 13,400株
スター・マイカ・HLDGS	3,500	1,509.00	5,281,500	貸付株式数 1,300株
ADワークスグループ	13,100	160.00	2,096,000	貸付株式数 5,200株

片倉工業	8,800	1,581.00	13,912,800	貸付株式数	2,900株
グンゼ	4,800	4,385.00	21,048,000		
ヒューリック	139,700	1,334.00	186,359,800	貸付株式数	54,800株
神栄	1,200	1,080.00	1,296,000		
ラサ商事	3,300	965.00	3,184,500	貸付株式数	200株
アルペン	5,300	3,310.00	17,543,000	貸付株式数	2,000株
ハブ	2,100	724.00	1,520,400	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	5,000	1,519.00	7,595,000	貸付株式数	1,800株
クオールホールディングス	8,800	1,617.00	14,229,600		
アルコニックス	7,200	1,686.00	12,139,200		
神戸物産	51,600	4,050.00	208,980,000	貸付株式数	20,500株
ソリトンシステムズ	3,600	1,547.00	5,569,200		
ジンスホールディングス	4,600	8,130.00	37,398,000	貸付株式数	1,800株
ビックカメラ	38,500	1,064.00	40,964,000	貸付株式数	15,400株
DCMホールディングス	40,700	1,133.00	46,113,100		
ペッパーフードサービス	9,200	371.00	3,413,200	貸付株式数	3,500株 (300株)
ハイパー	1,600	544.00	870,400		
MonotaRO	84,200	2,518.00	212,015,600	貸付株式数	32,800株
東京一番フーズ	1,600	596.00	953,600	貸付株式数	600株
DDホールディングス	3,400	500.00	1,700,000	貸付株式数	1,300株
あいホールディングス	9,300	2,401.00	22,329,300		
ディー・ブイエックス	2,100	1,129.00	2,370,900	貸付株式数	800株
きちりホールディングス	1,400	642.00	898,800	貸付株式数	500株 (500株)
アークランドサービスHD	5,500	2,367.00	13,018,500	貸付株式数	2,100株
J.フロントリテイリング	79,400	1,014.00	80,511,600		
ドトール・日レスHD	10,400	1,697.00	17,648,800		
マツモトキヨシHLDGS	27,500	5,160.00	141,900,000		
ブロンコビリー	3,600	2,551.00	9,183,600	貸付株式数	1,400株
ZOZO	39,200	4,250.00	166,600,000		
トレジャー・ファクトリー	2,100	983.00	2,064,300		
物語コーポレーション	3,700	7,490.00	27,713,000	貸付株式数	1,400株
ココカラファイン	5,900	8,700.00	51,330,000		
三越伊勢丹HD	116,500	799.00	93,083,500		
東洋紡	25,600	1,396.00	35,737,600		
ユニチカ	18,500	386.00	7,141,000		
富士紡ホールディングス	3,200	4,520.00	14,464,000		
日清紡ホールディングス	40,400	837.00	33,814,800		

倉敷紡績	5,600	2,037.00	11,407,200	貸付株式数	2,200株
ダイワボウHD	30,300	1,974.00	59,812,200		
シキボウ	3,700	944.00	3,492,800	貸付株式数	1,400株
日東紡績	10,000	3,725.00	37,250,000		
トヨタ紡織	19,800	2,013.00	39,857,400		
マクニカ・富士エレHLDGS	16,000	2,789.00	44,624,000	貸付株式数	1,400株
Hamee	1,900	1,323.00	2,513,700	貸付株式数	900株
ラクト・ジャパン	3,000	2,844.00	8,532,000	貸付株式数	1,100株
ウエルシアHD	35,200	4,145.00	145,904,000		
クリエイトSDH	9,700	3,900.00	37,830,000	貸付株式数	3,800株
バイタルKSKHD	11,300	836.00	9,446,800	貸付株式数	500株
八洲電機	4,600	1,080.00	4,968,000	貸付株式数	1,800株
メディアスホールディングス	3,900	939.00	3,662,100	貸付株式数	1,400株
レスターホールディングス	6,500	1,943.00	12,629,500		
ジューテックHD	1,400	1,121.00	1,569,400	貸付株式数	300株
丸善CHIHD	5,100	385.00	1,963,500	貸付株式数	2,500株
大光	3,000	708.00	2,124,000	貸付株式数	1,100株
OCHIホールディングス	1,900	1,312.00	2,492,800	貸付株式数	200株
TOKAIホールディングス	31,500	930.00	29,295,000		
黒谷	2,400	796.00	1,910,400	貸付株式数	700株
ミサワ	1,900	675.00	1,282,500		
ティーライフ	1,400	1,515.00	2,121,000	貸付株式数	300株
Cominix	1,300	723.00	939,900	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,700	448.00	761,600	貸付株式数	500株
三洋貿易	6,900	1,223.00	8,438,700		
チムニー	2,100	1,511.00	3,173,100	貸付株式数	800株
シュッピン	4,800	1,271.00	6,100,800		
ビューティガレージ	1,200	3,635.00	4,362,000	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	9,000	5,070.00	45,630,000	貸付株式数	3,300株
ウイン・パートナーズ	4,600	991.00	4,558,600		
ネクステージ	13,700	2,360.00	32,332,000		
ジョイフル本田	18,600	1,577.00	29,332,200	貸付株式数	7,400株
鳥貴族ホールディングス	2,600	2,138.00	5,558,800		
ホットランド	4,600	1,357.00	6,242,200	貸付株式数	1,800株 (200株)
すかいらくHD	92,600	1,588.00	147,048,800	貸付株式数	22,600株

S F Pホールディングス	2,900	1,440.00	4,176,000	貸付株式数	1,500株
綿半ホールディングス	4,900	1,301.00	6,374,900	貸付株式数	1,400株
日本毛織	20,200	1,043.00	21,068,600	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	12,100	100.00	1,210,000	貸付株式数	3,700株
トーア紡コーポレーション	2,300	433.00	995,900	貸付株式数	100株
ガイドーリミテッド	7,600	172.00	1,307,200	貸付株式数	3,000株
ヨシックスホールディングス	1,300	2,287.00	2,973,100	貸付株式数	500株
ユナイテッド・スーパーマーケ	19,000	1,156.00	21,964,000	貸付株式数	7,400株
三栄建築設計	3,000	1,969.00	5,907,000		
野村不動産HLDGS	38,300	2,874.00	110,074,200		
三重交通グループHD	12,800	528.00	6,758,400	貸付株式数	5,100株
サムティ	9,700	2,347.00	22,765,900	貸付株式数	3,700株
日本商業開発	4,600	1,750.00	8,050,000	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーション	11,000	1,874.00	20,614,000	貸付株式数	4,300株
フィル・カンパニー	1,300	3,020.00	3,926,000	貸付株式数	400株
ハウスコム	1,200	1,280.00	1,536,000		
日本管理センター	3,700	1,255.00	4,643,500		
サンセイランディック	2,000	828.00	1,656,000	貸付株式数	700株
エストラスト	1,100	663.00	729,300		
フージャースHD	10,400	696.00	7,238,400	貸付株式数	500株
オープンハウス	21,200	6,560.00	139,072,000		
東急不動産HD	180,400	664.00	119,785,600		
飯田GHD	55,300	2,895.00	160,093,500		
イーグランド	1,300	1,646.00	2,139,800		
帝国繊維	7,600	2,095.00	15,922,000	貸付株式数	1,600株
日本コークス工業	58,300	132.00	7,695,600		
ゴルフダイジェスト・オン	3,900	1,400.00	5,460,000	貸付株式数	1,300株
ミタチ産業	1,100	876.00	963,600	貸付株式数	600株
B E E N O S	3,600	2,995.00	10,782,000	貸付株式数	1,300株
あさひ	5,000	1,410.00	7,050,000	貸付株式数	2,000株
日本調剤	4,200	1,743.00	7,320,600	貸付株式数	1,600株
コスモス薬品	6,700	20,410.00	136,747,000	貸付株式数	2,600株
シップヘルスケアHD	23,500	2,910.00	68,385,000		
トーエル	3,100	911.00	2,824,100		
ソフトクリエイイトHD	2,700	3,480.00	9,396,000		
オンリー	1,100	764.00	840,400		
セブン&アイ・HLDGS	258,800	5,124.00	1,326,091,200		

クリエイト・レストランツ・ホール	36,200	913.00	33,050,600	貸付株式数	14,200株
明治電機工業	2,100	1,385.00	2,908,500	貸付株式数	300株
ツルハホールディングス	14,500	14,000.00	203,000,000		
デリカフーズHLDGS	3,500	674.00	2,359,000	貸付株式数	1,100株
スターティアホールディングス	1,600	1,828.00	2,924,800	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,100	1,580.00	8,058,000	貸付株式数	300株
フェリシモ	1,700	1,685.00	2,864,500	貸付株式数	500株
トリドールホールディングス	16,600	2,606.00	43,259,600	貸付株式数	6,500株
帝人	61,600	1,624.00	100,038,400		
東レ	476,300	727.30	346,412,990		
クラレ	96,300	1,057.00	101,789,100	貸付株式数	37,600株
旭化成	435,400	1,243.50	541,419,900		
TOKYO BASE	6,900	626.00	4,319,400	貸付株式数	2,400株
稲葉製作所	4,900	1,410.00	6,909,000	貸付株式数	1,300株
宮地エンジニアリングG	2,300	2,629.00	6,046,700		
トーカロ	16,700	1,452.00	24,248,400		
アルファCO	2,200	1,296.00	2,851,200		
SUMCO	84,600	2,385.00	201,771,000	貸付株式数	33,800株
川田テクノロジーズ	1,300	3,780.00	4,914,000		
RS TECHNOLOGIES	2,200	6,170.00	13,574,000		
信和	3,500	720.00	2,520,000		
ビーロット	4,700	542.00	2,547,400		
ファーストブラザーズ	1,200	1,032.00	1,238,400	貸付株式数	400株
ハウスドゥ	3,300	996.00	3,286,800	貸付株式数	700株
シーアールイー	1,900	2,412.00	4,582,800	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	1,400	3,210.00	4,494,000	貸付株式数	400株
ケイアイスター不動産	2,300	5,560.00	12,788,000	貸付株式数	800株
アグレ都市デザイン	1,700	1,181.00	2,007,700	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,400	3,070.00	4,298,000		
テンポイノベーション	2,200	914.00	2,010,800	貸付株式数	600株
グローバルリンクマネジメント	1,300	941.00	1,223,300	貸付株式数	400株
住江織物	1,400	1,887.00	2,641,800	貸付株式数	200株
日本フエルト	3,000	467.00	1,401,000		
イチカワ	800	1,433.00	1,146,400		

エコナックホールディングス	13,500	89.00	1,201,500	貸付株式数	900株
日東製網	900	1,490.00	1,341,000		
芦森工業	1,200	1,049.00	1,258,800		
アツギ	5,200	645.00	3,354,000	貸付株式数	800株
ウイルプラスHLDGS	1,200	1,089.00	1,306,800	貸付株式数	400株
JMホールディングス	4,900	2,182.00	10,691,800		
コマダホールディングス	14,600	2,149.00	31,375,400	貸付株式数	5,700株
サツドラホールディングス	900	2,223.00	2,000,700		
アレンザホールディングス	4,900	1,460.00	7,154,000	貸付株式数	500株 (300株)
串カツ田中HLDGS	1,900	2,255.00	4,284,500	貸付株式数	700株
バロックジャパン	4,900	872.00	4,272,800	貸付株式数	1,800株
クスリのアオキHLDGS	6,600	8,490.00	56,034,000	貸付株式数	2,600株
ダイニック	2,500	782.00	1,955,000	貸付株式数	500株
共和レザー	3,300	709.00	2,339,700		
ピーバンドットコム	1,200	715.00	858,000	貸付株式数	300株
力の源HD	2,300	611.00	1,405,300	貸付株式数	900株
FOOD & LIFE COMPANY	38,900	5,030.00	195,667,000		
アセンテック	2,000	1,250.00	2,500,000	貸付株式数	600株
セーレン	16,400	2,100.00	34,440,000	貸付株式数	6,300株
ソトー	1,800	821.00	1,477,800	貸付株式数	700株
東海染工	800	1,136.00	908,800	貸付株式数	100株
小松マテーレ	10,500	1,023.00	10,741,500		
ワコールホールディングス	16,300	2,289.00	37,310,700		
ホギメディカル	8,700	3,285.00	28,579,500	貸付株式数	3,100株
クラウディアHLDGS	2,100	283.00	594,300	貸付株式数	600株
TSIホールディングス	19,700	337.00	6,638,900	貸付株式数	7,700株
マツオカコーポレーション	2,000	1,450.00	2,900,000	貸付株式数	800株
ワールド	8,500	1,422.00	12,087,000	貸付株式数	2,400株
TIS	66,300	3,170.00	210,171,000		
JNSホールディングス	4,300	512.00	2,201,600	貸付株式数	1,200株
グリー	42,600	642.00	27,349,200	貸付株式数	4,100株
コーエーテクモHD	17,900	5,880.00	105,252,000		
三菱総合研究所	2,800	4,435.00	12,418,000		
ボルテージ	3,100	451.00	1,398,100	貸付株式数	400株
電算	800	2,581.00	2,064,800	貸付株式数	200株
AGS	3,100	994.00	3,081,400		
ファインデックス	6,100	1,053.00	6,423,300	貸付株式数	2,100株

ブレインパッド	1,900	6,080.00	11,552,000	
K L a b	12,000	608.00	7,296,000	貸付株式数 4,800株
ポルトウウィン・ピット クル	8,900	1,022.00	9,095,800	
イーブックイニシアティブ	1,300	4,075.00	5,297,500	貸付株式数 400株
ネクソン	148,600	1,748.00	259,752,800	
アイスタイル	21,600	452.00	9,763,200	貸付株式数 100株
エムアップホールディング ス	2,000	3,365.00	6,730,000	貸付株式数 600株
エイチーム	5,100	1,458.00	7,435,800	貸付株式数 1,700株
エニグモ	6,500	1,295.00	8,417,500	
テクノスジャパン	5,300	622.00	3,296,600	貸付株式数 1,000株
e n i s h	3,900	454.00	1,770,600	貸付株式数 1,500株
コロプラ	21,300	829.00	17,657,700	貸付株式数 1,900株
オルトプラス	5,100	420.00	2,142,000	貸付株式数 400株
ブロードリーフ	33,800	575.00	19,435,000	貸付株式数 12,500株
クロス・マーケティングG	3,300	888.00	2,930,400	貸付株式数 1,100株
デジタルハーツHLDGS	3,400	2,250.00	7,650,000	貸付株式数 500株
システム情報	5,400	1,024.00	5,529,600	貸付株式数 1,900株
メディアドゥ	2,800	5,000.00	14,000,000	貸付株式数 1,000株
じげん	17,000	411.00	6,987,000	
ブイキューブ	7,000	1,653.00	11,571,000	貸付株式数 2,600株
エンカレッジ・テクノロジー	1,100	613.00	674,300	貸付株式数 400株
サイバーリンクス	2,600	1,441.00	3,746,600	貸付株式数 800株
ディー・エル・イー	4,300	293.00	1,259,900	
フィックスターズ	7,100	801.00	5,687,100	貸付株式数 2,700株
CARTA HOLDIN GS	3,000	2,535.00	7,605,000	貸付株式数 1,200株
オプティム	5,000	1,962.00	9,810,000	貸付株式数 1,800株
セレス	2,600	2,705.00	7,033,000	貸付株式数 600株
S H I F T	3,400	27,330.00	92,922,000	
特種東海製紙	3,900	4,685.00	18,271,500	
ティーガイア	6,700	2,025.00	13,567,500	貸付株式数 2,700株
セック	1,000	2,442.00	2,442,000	貸付株式数 300株
テクマトリックス	11,100	2,020.00	22,422,000	
プロシップ	2,200	1,673.00	3,680,600	
ガンホー・オンライン・エ ンター	17,800	2,133.00	37,967,400	
GMOペイメントゲート ウェイ	12,900	15,270.00	196,983,000	

ザッパラス	4,100	522.00	2,140,200		
システムリサーチ	2,100	2,086.00	4,380,600	貸付株式数	700株
インターネットイニシア ティブ	18,000	3,970.00	71,460,000		
さくらインターネット	7,800	628.00	4,898,400	貸付株式数	2,800株
ヴィンクス	1,900	986.00	1,873,400	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインH D	1,600	4,630.00	7,408,000	貸付株式数	500株 (400株)
S R Aホールディングス	3,600	2,961.00	10,659,600		
システムインテグレータ	1,800	632.00	1,137,600	貸付株式数	700株
朝日ネット	6,000	755.00	4,530,000		
e B A S E	8,600	834.00	7,172,400	貸付株式数	3,100株
アバント	7,700	1,553.00	11,958,100		
アドソル日進	2,700	2,284.00	6,166,800	貸付株式数	900株
フリービット	4,700	1,166.00	5,480,200	貸付株式数	1,500株
コムチュア	6,200	3,210.00	19,902,000	貸付株式数	900株
サイバーコム	1,100	1,332.00	1,465,200	貸付株式数	400株
アステリア	5,200	705.00	3,666,000	貸付株式数	200株
アイル	3,900	1,933.00	7,538,700		
王子ホールディングス	297,600	582.00	173,203,200		
日本製紙	29,500	1,227.00	36,196,500	貸付株式数	11,300株
三菱製紙	7,800	380.00	2,964,000		
北越コーポレーション	48,700	666.00	32,434,200	貸付株式数	19,300株
中越パルプ	2,300	1,234.00	2,838,200		
巴川製紙	2,100	894.00	1,877,400	貸付株式数	300株
大王製紙	31,800	2,187.00	69,546,600		
阿波製紙	1,600	418.00	668,800		
マークライنز	3,600	3,055.00	10,998,000		
メディカル・データ・ピジ	8,900	1,590.00	14,151,000	貸付株式数	3,300株
g u m i	9,500	819.00	7,780,500	貸付株式数	3,600株
ショーケース	1,900	652.00	1,238,800	貸付株式数	500株
モバイルファクトリー	2,100	1,042.00	2,188,200	貸付株式数	500株
テラスカイ	2,500	2,160.00	5,400,000	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメー ション	3,400	2,045.00	6,953,000		
P C Iホールディングス	3,600	1,128.00	4,060,800	貸付株式数	1,100株 (100株)
パイブドHD	1,600	2,524.00	4,038,400	貸付株式数	500株
アイビーシー	1,400	885.00	1,239,000	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,700	1,699.00	2,888,300	貸付株式数	400株

P R T I M E S	1,800	3,050.00	5,490,000	貸付株式数	500株
ラクス	20,400	4,645.00	94,758,000		
ランドコンピュータ	1,000	1,309.00	1,309,000		
ダブルスタンダード	1,000	7,830.00	7,830,000	貸付株式数	100株
オープンドア	4,300	2,343.00	10,074,900	貸付株式数	1,500株
マイネット	2,600	647.00	1,682,200	貸付株式数	900株
アカツキ	2,900	3,230.00	9,367,000		
ベネフィットジャパン	700	2,344.00	1,640,800		
UBICOMホールディングス	2,000	2,893.00	5,786,000	貸付株式数	600株
カナミックネットワーク	7,500	632.00	4,740,000	貸付株式数	700株
ノムラシステムコーポレーション	3,900	287.00	1,119,300	貸付株式数	1,300株
レンゴー	68,300	906.00	61,879,800		
トーモク	4,100	1,949.00	7,990,900	貸付株式数	200株
ザ・パック	4,800	3,095.00	14,856,000	貸付株式数	1,000株
チェンジ	12,600	2,250.00	28,350,000		
シンクロ・フード	5,200	398.00	2,069,600	貸付株式数	1,500株
オークネット	3,900	2,275.00	8,872,500	貸付株式数	800株
セグエグループ	2,000	822.00	1,644,000		
エイトレッド	1,600	2,560.00	4,096,000	貸付株式数	500株
マクロミル	13,500	803.00	10,840,500	貸付株式数	1,700株
ビーグリー	1,700	1,421.00	2,415,700		
オロ	2,300	3,985.00	9,165,500		
ユーザーローカル	2,700	2,011.00	5,429,700	貸付株式数	700株
テモナ	2,000	809.00	1,618,000	貸付株式数	500株
ニーズウェル	1,800	781.00	1,405,800	貸付株式数	300株
サインポスト	1,800	1,380.00	2,484,000	貸付株式数	600株
昭和電工	47,000	2,721.00	127,887,000	貸付株式数	400株
住友化学	518,100	591.00	306,197,100		
住友精化	3,200	3,690.00	11,808,000		
日産化学	36,000	6,920.00	249,120,000		
ラサ工業	2,200	1,956.00	4,303,200	貸付株式数	300株
クレハ	5,600	7,960.00	44,576,000		
多木化学	2,600	7,000.00	18,200,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,600	1,394.00	6,412,400		
石原産業	12,100	1,328.00	16,068,800		
片倉コープアグリ	1,600	1,228.00	1,964,800	貸付株式数	600株
日本曹達	9,100	3,600.00	32,760,000		
東ソー	101,600	2,081.00	211,429,600		

トクヤマ	19,300	2,214.00	42,730,200	
セントラル硝子	12,000	2,211.00	26,532,000	
東亜合成	39,000	1,346.00	52,494,000	貸付株式数 6,800株
大阪ソーダ	6,400	2,810.00	17,984,000	
関東電化	15,000	1,085.00	16,275,000	
デンカ	24,000	4,045.00	97,080,000	
イビデン	32,600	6,670.00	217,442,000	
信越化学	121,600	21,150.00	2,571,840,000	
日本カ - バイド	2,200	1,443.00	3,174,600	
電算システムHD	2,900	2,955.00	8,569,500	
堺 化 学	4,400	2,392.00	10,524,800	
第一稀元素化学工	7,300	1,627.00	11,877,100	
エア・ウォーター	67,300	1,808.00	121,678,400	
日本酸素HLDGS	54,300	2,877.00	156,221,100	
日本化学工業	1,900	3,310.00	6,289,000	
東邦アセチレン	1,200	1,362.00	1,634,400	貸付株式数 300株
日本パ - カライジング	32,000	1,225.00	39,200,000	
高压ガス	9,800	802.00	7,859,600	
チタン工業	900	1,940.00	1,746,000	貸付株式数 300株
四国化成	8,000	1,431.00	11,448,000	
戸田工業	1,500	3,315.00	4,972,500	
ステラ ケミファ	3,500	3,010.00	10,535,000	貸付株式数 1,400株
保土谷化学	1,900	5,180.00	9,842,000	
日本触媒	11,700	5,940.00	69,498,000	
大日精化	5,000	2,822.00	14,110,000	
カネカ	17,000	4,765.00	81,005,000	
協和キリン	79,000	4,130.00	326,270,000	
三菱瓦斯化学	65,800	2,353.00	154,827,400	
三井化学	57,000	3,940.00	224,580,000	
J S R	66,300	4,335.00	287,410,500	
東京応化工業	11,400	7,690.00	87,666,000	貸付株式数 4,400株
大阪有機化学	6,100	4,155.00	25,345,500	
三菱ケミカルHLDGS	439,100	1,032.00	453,151,200	
KHネオケム	11,100	3,165.00	35,131,500	貸付株式数 400株
ダイセル	88,500	891.00	78,853,500	
住友ベ - クライト	10,400	5,360.00	55,744,000	
積水化学	137,300	2,011.00	276,110,300	
日本ゼオン	59,300	1,584.00	93,931,200	
アイカ工業	18,200	3,880.00	70,616,000	
宇部興産	33,100	2,288.00	75,732,800	

積水樹脂	10,200	2,194.00	22,378,800	貸付株式数	300株
タキロンシーアイ	13,800	671.00	9,259,800		
旭有機材	3,600	1,563.00	5,626,800		
ニチバン	3,200	1,835.00	5,872,000	貸付株式数	1,200株
リケンテクノス	16,200	588.00	9,525,600		
大倉工業	3,500	2,260.00	7,910,000	貸付株式数	100株
積水化成製品	7,900	615.00	4,858,500		
群栄化学	1,400	3,160.00	4,424,000		
タイガース ポリマー	2,200	435.00	957,000		
ミライアル	1,900	1,635.00	3,106,500	貸付株式数	700株
ダイキアクシス	2,600	946.00	2,459,600	貸付株式数	900株
ダイキョーニシカワ	13,700	671.00	9,192,700	貸付株式数	400株
竹本容器	2,900	935.00	2,711,500		
森六ホールディングス	3,500	2,164.00	7,574,000		
日本化薬	39,900	1,281.00	51,111,900		
カーリットホールディングス	6,300	930.00	5,859,000	貸付株式数	300株
ソルクシーズ	3,000	1,103.00	3,309,000		
レグス	1,700	2,124.00	3,610,800	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	23,600	778.00	18,360,800		
フェイス	2,500	704.00	1,760,000		
プロトコーポレーション	8,100	1,569.00	12,708,900	貸付株式数	1,300株
ハイマックス	2,200	1,113.00	2,448,600	貸付株式数	700株
アミューズ	3,500	2,377.00	8,319,500		
野村総合研究所	114,800	4,495.00	516,026,000		
ドリームインキュベータ	2,100	849.00	1,782,900		
サイバネットシステム	5,300	649.00	3,439,700	貸付株式数	1,800株
クイック	3,900	1,395.00	5,440,500	貸付株式数	500株
T A C	4,000	243.00	972,000	貸付株式数	200株
C E ホールディングス	3,800	627.00	2,382,600	貸付株式数	1,400株
日本システム技術	1,200	1,813.00	2,175,600		
電通グループ	66,200	4,200.00	278,040,000		
インテージホールディングス	8,800	1,641.00	14,440,800		
テイクアンドギヴニーズ	3,400	1,011.00	3,437,400	貸付株式数	300株
東邦システムサイエンス	1,400	1,065.00	1,491,000	貸付株式数	600株
びあ	1,900	3,520.00	6,688,000	貸付株式数	700株
イオンファンタジー	2,500	2,039.00	5,097,500	貸付株式数	900株
ソースネクスト	33,400	245.00	8,183,000	貸付株式数	8,300株
シーティーエス	7,300	801.00	5,847,300	貸付株式数	2,600株

ネクシィーズグループ	2,300	890.00	2,047,000	貸付株式数	800株
インフォコム	6,600	2,529.00	16,691,400		
メディカルシステムネット ワーク	6,200	768.00	4,761,600	貸付株式数	700株
日本精化	4,800	2,542.00	12,201,600	貸付株式数	500株
扶桑化学工業	5,300	5,270.00	27,931,000		
トリケミカル	6,400	3,690.00	23,616,000	貸付株式数	2,300株
HEROZ	2,000	2,033.00	4,066,000	貸付株式数	700株 (700株)
ラクスル	7,400	6,480.00	47,952,000	貸付株式数	2,400株
FIG	6,800	290.00	1,972,000	貸付株式数	2,700株
システムサポート	1,900	1,337.00	2,540,300		
ADEKA	30,200	2,643.00	79,818,600		
日油	24,900	6,740.00	167,826,000		
ミヨシ油脂	2,300	1,339.00	3,079,700		
新日本理化	13,000	365.00	4,745,000	貸付株式数	3,300株
ハリマ化成グループ	4,700	955.00	4,488,500		
イーソル	4,000	1,017.00	4,068,000	貸付株式数	1,600株
アルテリア・ネットワークス	7,800	1,763.00	13,751,400	貸付株式数	700株
東海ソフト	1,300	1,322.00	1,718,600	貸付株式数	400株
ヒト・コミュニケーションズHD	1,900	1,957.00	3,718,300	貸付株式数	500株
トピラスシステムズ	1,600	1,338.00	2,140,800	貸付株式数	100株
Sansan	6,000	12,590.00	75,540,000	貸付株式数	400株
花王	148,300	6,683.00	991,088,900	貸付株式数	62,200株
第一工業製薬	2,300	3,330.00	7,659,000		
石原ケミカル	1,700	3,000.00	5,100,000		
日華化学	2,700	1,051.00	2,837,700	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,500	2,422.00	3,633,000	貸付株式数	500株
三洋化成	3,900	6,020.00	23,478,000		
武田薬品	558,400	3,759.00	2,099,025,600		
アステラス製薬	581,900	1,876.00	1,091,644,400		
大日本住友製薬	50,200	2,057.00	103,261,400		
塩野義製薬	84,300	7,371.00	621,375,300		
わかもと製薬	8,500	344.00	2,924,000	貸付株式数	3,100株
日本新薬	19,100	9,630.00	183,933,000		
中外製薬	210,100	4,129.00	867,502,900	貸付株式数	82,400株
科研製薬	11,300	4,815.00	54,409,500		
エーザイ	74,400	8,379.00	623,397,600		

理研ビタミン	6,400	1,933.00	12,371,200	
ロート製薬	31,800	3,495.00	111,141,000	
小野薬品	153,700	2,663.00	409,303,100	
久光製薬	19,400	4,345.00	84,293,000	貸付株式数 7,700株
有機合成薬品	5,700	324.00	1,846,800	貸付株式数 2,000株
持田製薬	9,200	3,550.00	32,660,000	
参天製薬	117,000	1,620.00	189,540,000	
扶桑薬品	2,100	2,653.00	5,571,300	
日本ケミファ	800	2,345.00	1,876,000	貸付株式数 300株
ツムラ	22,500	3,825.00	86,062,500	
日医工	19,000	908.00	17,252,000	貸付株式数 7,600株
テルモ	205,800	5,316.00	1,094,032,800	
HUグループHD	18,100	3,225.00	58,372,500	
キッセイ薬品工業	11,500	2,518.00	28,957,000	
生化学工業	11,500	1,125.00	12,937,500	
栄研化学	12,000	2,249.00	26,988,000	
日水製薬	2,500	1,022.00	2,555,000	
鳥居薬品	4,200	3,050.00	12,810,000	
JCRファーマ	19,300	2,946.00	56,857,800	貸付株式数 1,500株
東和薬品	9,800	3,330.00	32,634,000	
富士製薬工業	4,500	1,203.00	5,413,500	
ゼリア新薬工業	12,100	2,183.00	26,414,300	貸付株式数 4,900株
第一三共	527,700	3,020.00	1,593,654,000	
キョーリン製薬HD	14,800	1,862.00	27,557,600	
大幸薬品	10,500	946.00	9,933,000	貸付株式数 4,000株 (700株)
ダイト	4,300	3,495.00	15,028,500	
大塚ホールディングス	139,000	4,857.00	675,123,000	貸付株式数 54,600株
大正製薬HD	16,800	6,740.00	113,232,000	
ペプチドリーム	35,400	3,785.00	133,989,000	
大日本塗料	7,000	884.00	6,188,000	
日本ペイントHOLD	247,600	1,305.00	323,118,000	貸付株式数 5,700株
関西ペイント	74,000	2,939.00	217,486,000	
神東塗料	5,800	197.00	1,142,600	
中国塗料	16,400	898.00	14,727,200	
日本特殊塗料	4,900	1,085.00	5,316,500	
藤倉化成	8,200	561.00	4,600,200	
太陽ホールディングス	4,900	6,050.00	29,645,000	
DIC	27,200	3,290.00	89,488,000	貸付株式数 10,600株
サカティンクス	13,700	1,218.00	16,686,600	

東洋インキSCホールディングン	13,300	2,122.00	28,222,600	
T & K TOKA	4,600	882.00	4,057,200	
アルプス技研	5,500	2,077.00	11,423,500	貸付株式数 100株
サニックス	10,800	331.00	3,574,800	貸付株式数 4,000株
ダイオーズ	800	1,126.00	900,800	貸付株式数 400株
日本空調サービス	6,300	828.00	5,216,400	
オリエンタルランド	68,100	17,255.00	1,175,065,500	
フォーカスシステムズ	5,600	1,035.00	5,796,000	
ダスキン	14,500	2,688.00	38,976,000	貸付株式数 1,700株
パーク24	35,800	1,803.00	64,547,400	貸付株式数 14,200株
明光ネットワークジャパン	8,100	622.00	5,038,200	貸付株式数 3,000株
ファルコホールディングス	2,900	1,811.00	5,251,900	貸付株式数 1,100株
クレスコ	4,700	2,156.00	10,133,200	
フジ・メディア・HD	68,500	1,191.00	81,583,500	
秀英予備校	2,000	431.00	862,000	貸付株式数 600株
田谷	1,500	575.00	862,500	貸付株式数 600株
ラウンドワン	22,700	1,385.00	31,439,500	貸付株式数 8,700株
リゾートトラスト	29,800	2,063.00	61,477,400	貸付株式数 11,200株
オービック	20,800	23,270.00	484,016,000	
ジャストシステム	9,500	7,080.00	67,260,000	
TDCソフト	5,900	1,453.00	8,572,700	貸付株式数 1,900株
Zホールディングス	869,700	734.50	638,794,650	
ビー・エム・エル	8,400	4,430.00	37,212,000	
トレンドマイクロ	35,300	6,210.00	219,213,000	
りらいあコミュニケーション	9,900	1,244.00	12,315,600	
IDホールディングス	3,600	961.00	3,459,600	
リソー教育	34,200	429.00	14,671,800	
日本オラクル	13,500	9,370.00	126,495,000	
早稲田アカデミー	2,800	978.00	2,738,400	貸付株式数 1,000株
アルファシステムズ	1,900	4,265.00	8,103,500	貸付株式数 600株
フューチャー	7,900	2,805.00	22,159,500	貸付株式数 400株
CAC HOLDINGS	4,100	1,760.00	7,216,000	貸付株式数 1,500株
SBテクノロジー	2,800	3,050.00	8,540,000	
トーセ	1,700	787.00	1,337,900	貸付株式数 600株
ユー・エス・エス	71,500	2,001.00	143,071,500	
オービックビジネスC	6,500	5,780.00	37,570,000	貸付株式数 2,500株
伊藤忠テクノソリューションズ	30,500	3,765.00	114,832,500	
アイティフォー	8,800	871.00	7,664,800	貸付株式数 1,200株
東京個別指導学院	5,700	660.00	3,762,000	貸付株式数 900株

東計電算	900	4,870.00	4,383,000	
サイバーエージェント	159,100	2,193.00	348,906,300	
楽天グループ	330,200	1,110.00	366,522,000	貸付株式数 129,100株
エックスネット	1,600	1,036.00	1,657,600	貸付株式数 100株
クリーク・アンド・リバー社	3,500	1,839.00	6,436,500	貸付株式数 1,000株
テー・オー・ダブリュー	10,800	343.00	3,704,400	貸付株式数 4,200株
大塚商会	35,900	5,910.00	212,169,000	貸付株式数 13,900株
サイボウズ	9,200	2,544.00	23,404,800	
山田コンサルティングG P	3,600	1,148.00	4,132,800	貸付株式数 1,000株
セントラルスポーツ	2,400	2,588.00	6,211,200	貸付株式数 900株
パラカ	1,600	1,840.00	2,944,000	貸付株式数 600株
電通国際情報S	9,800	4,470.00	43,806,000	
A C C E S S	8,400	1,024.00	8,601,600	貸付株式数 800株
デジタルガレージ	10,900	5,000.00	54,500,000	貸付株式数 400株
イーエムシステムズ	11,700	830.00	9,711,000	貸付株式数 4,200株
ウェザーニューズ	2,100	6,660.00	13,986,000	
C I J	4,000	875.00	3,500,000	
ビジネスエンジニアリング	800	3,645.00	2,916,000	貸付株式数 200株
日本エンタープライズ	8,400	215.00	1,806,000	貸付株式数 2,700株
WOWOW	3,300	2,472.00	8,157,600	貸付株式数 1,200株
スカラ	6,500	759.00	4,933,500	貸付株式数 2,300株
インテリジェント ウェイブ	3,700	634.00	2,345,800	
フルキャストホールディングス	5,700	2,232.00	12,722,400	貸付株式数 2,100株
エン・ジャパン	11,500	4,080.00	46,920,000	
あすか製薬HD	7,800	1,098.00	8,564,400	貸付株式数 600株
サワイグループHD	14,800	5,180.00	76,664,000	
富士フイルムH L D G S	118,100	9,694.00	1,144,861,400	
コニカミノルタ	137,200	601.00	82,457,200	
資 生 堂	125,300	7,638.00	957,041,400	
ライオン	81,100	1,845.00	149,629,500	貸付株式数 34,300株
高砂香料	4,200	3,040.00	12,768,000	
マンダム	14,500	1,601.00	23,214,500	貸付株式数 5,300株
ミルボン	8,500	6,860.00	58,310,000	
ファンケル	24,700	3,825.00	94,477,500	
コーセー	12,800	12,900.00	165,120,000	
コタ	4,700	1,699.00	7,985,300	貸付株式数 300株
シーボン	800	1,898.00	1,518,400	

ポーラ・オルビスHD	28,900	2,590.00	74,851,000	
ノエビアホールディングス	5,600	5,990.00	33,544,000	
アジュバンホールディング	1,900	1,068.00	2,029,200	貸付株式数 500株
エステー	4,200	1,828.00	7,677,600	
アグロカネショウ	2,500	1,555.00	3,887,500	貸付株式数 900株
コニシ	10,900	1,803.00	19,652,700	貸付株式数 700株
長谷川香料	11,500	2,866.00	32,959,000	貸付株式数 4,600株
星光PMC	3,800	877.00	3,332,600	
小林製薬	18,800	9,100.00	171,080,000	
荒川化学工業	5,000	1,291.00	6,455,000	貸付株式数 1,500株
メック	5,200	3,605.00	18,746,000	
日本高純度化学	2,000	3,070.00	6,140,000	貸付株式数 100株
タカラバイオ	17,700	3,245.00	57,436,500	
JCU	7,500	4,740.00	35,550,000	
新田ゼラチン	4,000	658.00	2,632,000	貸付株式数 900株
OATアグリオ	1,200	1,895.00	2,274,000	
デクセリアルズ	19,600	2,287.00	44,825,200	
アース製薬	5,600	6,990.00	39,144,000	
北興化学	6,400	1,188.00	7,603,200	
大成ラミック	2,400	2,898.00	6,955,200	
クミアイ化学	27,100	940.00	25,474,000	
日本農薬	12,100	560.00	6,776,000	
富士興産	2,100	1,058.00	2,221,800	
ニチレキ	7,700	1,372.00	10,564,400	
ユシロ化学	3,400	1,223.00	4,158,200	
ピーピー・カストロール	2,400	1,385.00	3,324,000	
富士石油	18,900	259.00	4,895,100	貸付株式数 3,700株
MORESCO	2,100	1,221.00	2,564,100	
出光興産	73,900	2,891.00	213,644,900	
ENEOSホールディングス	1,004,400	460.10	462,124,440	
コスモエネルギーHLDGS	21,300	2,372.00	50,523,600	
横浜ゴム	39,200	1,984.00	77,772,800	
TOYO TIRE	35,700	1,978.00	70,614,600	
ブリヂストン	193,500	5,303.00	1,026,130,500	貸付株式数 77,300株
住友ゴム	60,900	1,406.00	85,625,400	
藤倉コンポジット	6,200	804.00	4,984,800	
オカモト	3,900	4,440.00	17,316,000	
アキレス	4,500	1,384.00	6,228,000	貸付株式数 400株

フコク	3,100	1,062.00	3,292,200	
ニッタ	6,800	2,835.00	19,278,000	
クリエートメディック	1,800	998.00	1,796,400	
住友理工	13,300	748.00	9,948,400	
三ツ星ベルト	7,700	2,081.00	16,023,700	
バンドー化学	11,100	962.00	10,678,200	
A G C	61,700	5,700.00	351,690,000	貸付株式数 24,600株
日本板硝子	34,600	575.00	19,895,000	
石塚硝子	1,000	2,262.00	2,262,000	貸付株式数 400株
有沢製作所	9,000	907.00	8,163,000	
日本山村硝子	2,400	917.00	2,200,800	
日本電気硝子	26,900	2,408.00	64,775,200	貸付株式数 10,500株
オハラ	2,800	1,561.00	4,370,800	貸付株式数 1,000株
住友大阪セメント	11,900	3,155.00	37,544,500	
太平洋セメント	38,000	2,450.00	93,100,000	
リソルホールディングス	700	4,130.00	2,891,000	
日本ヒューム	5,600	752.00	4,211,200	
日本コンクリート	15,000	311.00	4,665,000	
三谷セキサン	3,100	6,890.00	21,359,000	
アジアパイルHD	9,600	501.00	4,809,600	
東海カーボン	56,900	1,534.00	87,284,600	
日本カーボン	3,700	4,255.00	15,743,500	貸付株式数 1,200株
東洋炭素	4,600	3,030.00	13,938,000	貸付株式数 1,100株
ノリタケ	3,700	4,605.00	17,038,500	
TOTO	47,900	5,580.00	267,282,000	
日本碍子	73,300	1,884.00	138,097,200	
日本特殊陶業	51,500	1,797.00	92,545,500	
ダントーホールディングス	6,200	260.00	1,612,000	貸付株式数 1,800株
MARUWA	2,400	11,820.00	28,368,000	
品川リフラクトリーズ	1,500	3,990.00	5,985,000	
黒崎播磨	1,100	5,020.00	5,522,000	
ヨータイ	5,000	1,371.00	6,855,000	
イソライト	3,000	802.00	2,406,000	
東京窯業	7,700	347.00	2,671,900	貸付株式数 1,500株
ニッカトー	2,900	722.00	2,093,800	貸付株式数 1,100株
フジインコーポレーテッド	5,500	6,750.00	37,125,000	
クニミネ工業	2,200	1,132.00	2,490,400	
エーアンドエーマテリアル	900	1,011.00	909,900	
ニチアス	16,900	2,889.00	48,824,100	

日本製鉄	317,000	2,056.50	651,910,500	
神戸製鋼所	122,500	685.00	83,912,500	
中山製鋼所	8,400	435.00	3,654,000	
合同製鐵	3,500	1,540.00	5,390,000	貸付株式数 1,300株
J F Eホールディングス	192,400	1,762.00	339,008,800	
東京製鐵	26,200	1,203.00	31,518,600	
共英製鋼	7,400	1,418.00	10,493,200	貸付株式数 2,000株
大和工業	14,100	3,810.00	53,721,000	
東京鐵鋼	2,700	1,616.00	4,363,200	
大阪製鐵	3,300	1,127.00	3,719,100	貸付株式数 700株
淀川製鋼所	8,400	2,511.00	21,092,400	貸付株式数 400株
丸一鋼管	21,400	2,766.00	59,192,400	
モリ工業	1,900	2,471.00	4,694,900	
大同特殊鋼	11,000	4,960.00	54,560,000	貸付株式数 4,100株
日本高周波	2,300	411.00	945,300	
日本冶金工	5,100	2,735.00	13,948,500	
山陽特殊製鋼	7,800	1,736.00	13,540,800	
愛知製鋼	3,800	2,730.00	10,374,000	
日立金属	63,100	2,152.00	135,791,200	
日本金属	1,700	1,098.00	1,866,600	貸付株式数 600株
大平洋金属	4,500	1,894.00	8,523,000	
新日本電工	44,300	328.00	14,530,400	貸付株式数 6,900株
栗本鉄工所	2,900	1,691.00	4,903,900	
虹 技	800	1,149.00	919,200	貸付株式数 200株
日本鑄鉄管	700	1,215.00	850,500	貸付株式数 200株
日本製鋼所	20,300	2,957.00	60,027,100	
三菱製鋼	5,000	1,290.00	6,450,000	
日亜鋼業	8,800	318.00	2,798,400	
日本精線	1,000	5,010.00	5,010,000	貸付株式数 100株
エンビプロHD	3,200	1,783.00	5,705,600	貸付株式数 100株
大紀アルミニウム	10,100	1,848.00	18,664,800	
日本軽金属HD	17,700	2,016.00	35,683,200	
三井金属	18,000	3,280.00	59,040,000	
東邦亜鉛	3,600	2,869.00	10,328,400	
三菱マテリアル	43,600	2,239.00	97,620,400	
住友鉱山	85,000	4,141.00	351,985,000	
DOWAホールディングス	17,000	4,575.00	77,775,000	
古河機金	10,300	1,246.00	12,833,800	貸付株式数 900株
エス・サイエンス	35,400	35.00	1,239,000	貸付株式数 7,000株

大阪チタニウム	6,700	789.00	5,286,300	貸付株式数 2,600株 (100株)
東邦チタニウム	12,500	1,190.00	14,875,000	貸付株式数 2,300株
U A C J	10,000	2,867.00	28,670,000	
C Kサンエツ	1,400	3,300.00	4,620,000	
古河電工	20,600	2,405.00	49,543,000	
住友電工	230,900	1,492.50	344,618,250	
フジクラ	80,700	687.00	55,440,900	
昭和電線H L D G S	6,700	2,309.00	15,470,300	
東京特殊電線	700	2,951.00	2,065,700	貸付株式数 400株
タツタ電線	12,500	543.00	6,787,500	
カナレ電気	900	1,769.00	1,592,100	貸付株式数 400株
平河ヒューテック	3,700	1,249.00	4,621,300	
リョービ	7,800	1,298.00	10,124,400	貸付株式数 3,000株
アーレステイ	8,100	460.00	3,726,000	
アサヒHD	25,600	2,130.00	54,528,000	
東洋製罐グループHD	42,400	1,345.00	57,028,000	
ホッカンホールディングス	3,100	1,463.00	4,535,300	
コロナ	3,700	921.00	3,407,700	
横河ブリッジH L D G S	11,600	2,478.00	28,744,800	
駒井ハルテック	1,400	1,779.00	2,490,600	
高田機工	600	2,942.00	1,765,200	貸付株式数 200株
三和ホールディングス	62,700	1,511.00	94,739,700	
文化シャツタ -	20,200	1,183.00	23,896,600	貸付株式数 7,700株
三協立山	8,700	794.00	6,907,800	
アルインコ	4,400	1,033.00	4,545,200	貸付株式数 100株
東洋シャツタ -	1,700	675.00	1,147,500	
L I X I L	91,300	3,150.00	287,595,000	
日本フィルコン	4,200	523.00	2,196,600	
ノーリツ	13,600	1,876.00	25,513,600	貸付株式数 1,500株
長府製作所	6,500	2,169.00	14,098,500	
リンナイ	12,900	13,050.00	168,345,000	
ユニプレス	10,600	927.00	9,826,200	
ダイニチ工業	3,800	787.00	2,990,600	
日東精工	8,600	684.00	5,882,400	
三洋工業	700	1,903.00	1,332,100	貸付株式数 100株
岡 部	12,200	702.00	8,564,400	貸付株式数 3,900株
ジーテクト	7,900	1,502.00	11,865,800	
東 プ レ	12,300	1,375.00	16,912,500	
高周波熱錬	11,800	682.00	8,047,600	貸付株式数 4,200株

東京製綱	2,900	990.00	2,871,000	
サンコール	5,400	475.00	2,565,000	
モリテックスチル	5,400	457.00	2,467,800	貸付株式数 2,100株
パイオラックス	9,300	1,581.00	14,703,300	貸付株式数 800株
エイチワン	6,400	743.00	4,755,200	
日本発条	66,500	811.00	53,931,500	
中央発條	4,400	1,125.00	4,950,000	貸付株式数 900株
アドバネクス	1,100	1,376.00	1,513,600	貸付株式数 300株
三浦工業	28,800	5,000.00	144,000,000	
タクマ	22,900	1,631.00	37,349,900	
テクノプロ・ホールディング	38,600	3,340.00	128,924,000	貸付株式数 9,100株
アトラグループ	1,900	311.00	590,900	貸付株式数 600株
インターワークス	1,600	407.00	651,200	
アイ・アールジャパンHD	2,700	13,750.00	37,125,000	貸付株式数 1,000株
K e e P e r 技研	4,400	3,815.00	16,786,000	
ファーストロジック	2,200	765.00	1,683,000	
三機サービス	1,500	1,133.00	1,699,500	貸付株式数 400株
G u n o s y	4,800	728.00	3,494,400	貸付株式数 400株
デザインワン・ジャパン	3,500	239.00	836,500	貸付株式数 700株
イー・ガーディアン	3,200	3,220.00	10,304,000	
リブセンス	6,600	204.00	1,346,400	貸付株式数 100株 (100株)
ジャパンマテリアル	19,100	1,340.00	25,594,000	貸付株式数 7,600株
ベクトル	8,300	1,103.00	9,154,900	貸付株式数 1,900株
ウチヤマホールディングス	3,000	343.00	1,029,000	
チャームケアコーポレー	5,400	1,652.00	8,920,800	貸付株式数 1,900株
キャリアリンク	2,500	1,860.00	4,650,000	貸付株式数 800株
I B J	5,900	1,086.00	6,407,400	貸付株式数 2,000株
アサンテ	2,600	1,805.00	4,693,000	貸付株式数 900株
バリューHR	2,700	1,785.00	4,819,500	
M & A キャピタルパート	5,500	5,770.00	31,735,000	貸付株式数 2,100株
ライドオンエクスプレスH	2,600	1,634.00	4,248,400	貸付株式数 900株
E R I ホールディングス	1,800	1,133.00	2,039,400	貸付株式数 500株
アビスト	1,100	3,045.00	3,349,500	貸付株式数 300株 (300株)
シグマクシス	3,800	2,889.00	10,978,200	

ウィルグループ	4,700	1,306.00	6,138,200	貸付株式数	1,600株
エスクロー A J	10,300	238.00	2,451,400	貸付株式数	3,800株
リクルートホールディングス	459,600	6,983.00	3,209,386,800		
エラン	9,700	1,232.00	11,950,400		
ツガミ	14,300	1,942.00	27,770,600		
オークマ	7,600	5,640.00	42,864,000		
芝浦機械	6,800	2,785.00	18,938,000		
アマダ	97,100	1,201.00	116,617,100		
アイダエンジニア	16,900	1,124.00	18,995,600		
滝澤鉄工所	1,800	1,149.00	2,068,200		
F U J I	26,400	3,055.00	80,652,000		
牧野フライス	7,700	4,460.00	34,342,000	貸付株式数	1,700株
オーエスジー	30,300	2,047.00	62,024,100		
ダイジェット	700	1,263.00	884,100		
旭ダイヤモンド	16,300	654.00	10,660,200		
D M G 森精機	39,700	2,126.00	84,402,200	貸付株式数	2,300株
ソデイツク	16,100	943.00	15,182,300		
ディスコ	9,000	33,700.00	303,300,000		
日東工器	3,200	2,049.00	6,556,800		
日進工具	5,100	1,464.00	7,466,400	貸付株式数	600株
パンチ工業	5,800	628.00	3,642,400		
富士ダイス	2,800	686.00	1,920,800		
土木管理総合試験	3,400	366.00	1,244,400	貸付株式数	1,100株
ネットマーケティング	4,600	462.00	2,125,200	貸付株式数	1,200株
日本郵政	484,900	966.80	468,801,320		
ベルシステム 2 4 H L D G S	10,900	1,675.00	18,257,500	貸付株式数	4,300株
鎌倉新書	6,900	850.00	5,865,000	貸付株式数	2,500株 (1,800株)
S M N	2,100	677.00	1,421,700	貸付株式数	400株
一蔵	900	410.00	369,000		
グローバルキッズCOMP	1,700	755.00	1,283,500	貸付株式数	400株
エアトリ	4,600	3,310.00	15,226,000	貸付株式数	1,600株
アトラエ	4,900	2,546.00	12,475,400	貸付株式数	400株
ストライク	2,600	4,185.00	10,881,000	貸付株式数	900株
ソラスト	16,200	1,548.00	25,077,600	貸付株式数	3,400株
セラク	2,600	2,353.00	6,117,800	貸付株式数	700株
インソース	6,700	2,079.00	13,929,300	貸付株式数	2,400株
豊田自動織機	54,300	9,550.00	518,565,000		

豊和工業	3,800	841.00	3,195,800	貸付株式数	1,400株
OKK	2,900	417.00	1,209,300		
石川製作所	1,800	1,635.00	2,943,000	貸付株式数	600株
東洋機械金属	3,900	518.00	2,020,200		
津田駒工業	1,300	843.00	1,095,900		
エンシュウ	1,400	803.00	1,124,200	貸付株式数	400株
島精機製作所	9,400	2,424.00	22,785,600	貸付株式数	3,700株
オプトラン	8,300	2,318.00	19,239,400	貸付株式数	2,100株
NCホールディングス	2,700	1,400.00	3,780,000	貸付株式数	100株
イワキポンプ	4,000	1,031.00	4,124,000	貸付株式数	1,100株
フリーー	6,800	1,840.00	12,512,000		
ヤマシンフィルタ	13,800	687.00	9,480,600	貸付株式数	5,200株
日阪製作所	8,100	926.00	7,500,600		
やまびこ	12,600	1,304.00	16,430,400		
平田機工	3,000	7,020.00	21,060,000		
ペガサスミシン製造	6,600	451.00	2,976,600	貸付株式数	600株
マルマエ	2,900	2,174.00	6,304,600	貸付株式数	1,000株
タツモ	3,100	1,615.00	5,006,500		
ナプテスコ	39,000	4,665.00	181,935,000		
三井海洋開発	7,300	1,719.00	12,548,700	貸付株式数	2,500株
レオン自動機	6,300	1,569.00	9,884,700	貸付株式数	2,000株
SMC	19,600	77,330.00	1,515,668,000		
ホソカワミクロン	2,300	7,280.00	16,744,000		
ユニオンツール	2,600	4,015.00	10,439,000	貸付株式数	600株
オイレス工業	8,900	1,728.00	15,379,200	貸付株式数	3,500株
日精エーエスピー	2,200	4,150.00	9,130,000		
サト - ホールディングス	8,600	2,805.00	24,123,000		
技研製作所	5,900	4,845.00	28,585,500		
日本エアーテック	3,200	1,281.00	4,099,200	貸付株式数	900株
カワタ	1,800	1,009.00	1,816,200	貸付株式数	700株
日精樹脂工業	5,500	1,188.00	6,534,000	貸付株式数	500株
オカダアイヨン	2,100	1,373.00	2,883,300	貸付株式数	400株
ワイエイシイホールディングス	2,800	910.00	2,548,000		
小松製作所	304,000	2,714.50	825,208,000		
住友重機械	38,500	3,025.00	116,462,500		
日立建機	31,600	3,190.00	100,804,000		
日工	10,100	686.00	6,928,600	貸付株式数	2,600株
巴工業	2,600	2,516.00	6,541,600	貸付株式数	1,000株
井関農機	6,300	1,735.00	10,930,500		

TOWA	6,300	2,793.00	17,595,900	
丸山製作所	1,300	1,647.00	2,141,100	
北川鉄工所	2,700	1,656.00	4,471,200	
シンニッタン	8,500	249.00	2,116,500	貸付株式数 2,600株
ローツェ	3,100	9,020.00	27,962,000	
タカキタ	2,200	703.00	1,546,600	貸付株式数 800株
クボタ	327,400	2,419.00	791,980,600	
荏原実業	3,400	2,892.00	9,832,800	
東洋エンジニア	9,100	887.00	8,071,700	貸付株式数 3,100株
三菱化工機	2,300	2,455.00	5,646,500	貸付株式数 700株
月島機械	11,800	1,211.00	14,289,800	貸付株式数 700株
帝国電機製作所	4,500	1,446.00	6,507,000	
東京機械	3,400	1,977.00	6,721,800	貸付株式数 1,000株
新東工業	15,300	794.00	12,148,200	貸付株式数 1,100株
渋谷工業	5,900	3,245.00	19,145,500	貸付株式数 300株
アイチ コーポレーション	11,200	786.00	8,803,200	貸付株式数 3,800株
小森コーポレーション	16,800	900.00	15,120,000	貸付株式数 3,600株
鶴見製作所	5,000	1,845.00	9,225,000	
住友精密	900	2,531.00	2,277,900	
日本ギア工業	2,400	317.00	760,800	貸付株式数 900株
酒井重工業	1,100	2,606.00	2,866,600	
荏原製作所	28,000	5,820.00	162,960,000	貸付株式数 10,900株
石井鉄工所	900	3,110.00	2,799,000	貸付株式数 100株
西島製作所	6,600	949.00	6,263,400	
北越工業	6,800	1,037.00	7,051,600	
ダイキン工業	85,500	26,680.00	2,281,140,000	
オルガノ	2,300	6,970.00	16,031,000	
ト - ヨ - カネツ	2,600	2,693.00	7,001,800	貸付株式数 300株
栗田工業	36,700	5,880.00	215,796,000	貸付株式数 6,800株
椿本チエイン	9,600	3,625.00	34,800,000	
大同工業	3,300	1,104.00	3,643,200	
日 機 装	21,500	967.00	20,790,500	
木村化工機	6,300	751.00	4,731,300	貸付株式数 2,200株
レイズネクスト	11,100	1,235.00	13,708,500	貸付株式数 4,300株
アネスト岩田	10,900	975.00	10,627,500	貸付株式数 3,500株
ダイフク	37,000	11,140.00	412,180,000	
サムコ	1,700	2,965.00	5,040,500	貸付株式数 700株
加藤製作所	3,400	907.00	3,083,800	
油研工業	900	1,790.00	1,611,000	貸付株式数 300株
タダノ	32,700	1,197.00	39,141,900	

フジテック	23,300	2,864.00	66,731,200	貸付株式数	8,800株
C K D	15,700	2,527.00	39,673,900		
キトー	5,600	1,845.00	10,332,000		
平和	18,300	2,065.00	37,789,500	貸付株式数	7,100株
理想科学工業	5,000	2,507.00	12,535,000		
S A N K Y O	16,000	2,801.00	44,816,000	貸付株式数	5,800株
日本金銭機械	6,600	642.00	4,237,200	貸付株式数	2,600株
マースグループH L D G S	3,800	1,690.00	6,422,000		
フクシマガリレイ	4,700	5,150.00	24,205,000		
オーイズミ	2,300	384.00	883,200		
ダイコク電機	2,600	1,318.00	3,426,800	貸付株式数	1,000株
竹内製作所	11,600	2,616.00	30,345,600		
ア マ ノ	17,600	3,000.00	52,800,000	貸付株式数	4,700株
J U K I	9,200	838.00	7,709,600	貸付株式数	2,800株
サンデンホールディングス	9,200	296.00	2,723,200		
蛇の目ミシン	6,500	758.00	4,927,000	貸付株式数	1,000株
ブラザー工業	81,600	2,546.00	207,753,600		
マックス	8,800	1,987.00	17,485,600	貸付株式数	400株
モリタホールディングス	10,200	1,592.00	16,238,400	貸付株式数	200株
グローリー	16,900	2,543.00	42,976,700		
新晃工業	6,300	2,278.00	14,351,400		
大和冷機工業	10,900	1,284.00	13,995,600		
セガサミーホールディングス	60,800	1,595.00	96,976,000		
日本ピストンリング	2,700	1,475.00	3,982,500		
リ ケ ン	2,900	2,903.00	8,418,700	貸付株式数	600株
T P R	8,600	1,535.00	13,201,000	貸付株式数	3,300株
ツバキ・ナカシマ	15,000	1,517.00	22,755,000	貸付株式数	5,400株
ホシザキ	19,600	10,620.00	208,152,000		
大豊工業	6,000	851.00	5,106,000		
日本精工	138,000	757.00	104,466,000		
N T N	154,300	250.00	38,575,000		
ジェイテクト	64,700	961.00	62,176,700		
不 二 越	6,000	4,570.00	27,420,000	貸付株式数	2,200株
ミネベアミツミ	115,700	2,943.00	340,505,100		
日本トムソン	18,600	550.00	10,230,000		
T H K	39,000	2,587.00	100,893,000	貸付株式数	16,400株
ユーシン精機	4,300	833.00	3,581,900		
前澤給装工業	4,700	1,062.00	4,991,400	貸付株式数	300株
イーグル工業	8,100	1,275.00	10,327,500		

前澤工業	4,900	811.00	3,973,900		
日本ピラ - 工業	7,300	2,777.00	20,272,100	貸付株式数	2,600株
キッツ	22,600	849.00	19,187,400	貸付株式数	2,000株
日立	322,900	6,443.00	2,080,444,700		
東芝	133,000	4,730.00	629,090,000	貸付株式数	51,100株
三菱電機	670,300	1,576.50	1,056,727,950		
富士電機	40,600	5,130.00	208,278,000		
東洋電機製造	2,400	1,194.00	2,865,600		
安川電機	72,200	5,870.00	423,814,000	貸付株式数	3,100株
シンフォニアテクノロジー	8,600	1,229.00	10,569,400	貸付株式数	2,000株
明電舎	11,300	2,519.00	28,464,700		
オリジン	1,600	1,350.00	2,160,000		
山洋電気	3,300	7,300.00	24,090,000		
デンヨー	5,600	2,285.00	12,796,000		
ベイクレントコンサルティング	4,200	61,600.00	258,720,000		
ORCHESTRA HLDGS	1,600	3,870.00	6,192,000	貸付株式数	200株
アイモバイル	2,600	1,385.00	3,601,000		
キャリアインデックス	3,200	1,014.00	3,244,800	貸付株式数	500株
MS - Japan	3,000	1,063.00	3,189,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
船場	900	826.00	743,400		
グレイステクノロジー	7,200	1,068.00	7,689,600	貸付株式数	2,500株
ジャパニーズエレベーターSHD	19,100	2,641.00	50,443,100		
フルテック	900	1,467.00	1,320,300	貸付株式数	300株
グリーンズ	2,800	550.00	1,540,000	貸付株式数	900株
ツナググループHLDGS	2,100	301.00	632,100	貸付株式数	500株
GAMEWITH	2,400	545.00	1,308,000	貸付株式数	600株
ソウルドアウト	1,600	1,616.00	2,585,600	貸付株式数	600株
MS&CONSULTING	1,300	603.00	783,900		
ミダックホールディングス	2,900	5,890.00	17,081,000	貸付株式数	1,100株
日総工産	5,300	721.00	3,821,300	貸付株式数	1,500株
キュービーネットHLDGS	3,000	1,871.00	5,613,000		
RPAホールディングス	8,800	603.00	5,306,400	貸付株式数	3,000株
三桜工業	9,500	1,062.00	10,089,000		

マキタ	87,600	6,830.00	598,308,000	
東芝テック	7,200	4,725.00	34,020,000	
芝浦メカトロニクス	1,300	7,420.00	9,646,000	貸付株式数 100株
マブチモーター	15,700	3,840.00	60,288,000	
日本電産	161,600	13,345.00	2,156,552,000	
ユーエムシーエレクトロニクス	3,900	776.00	3,026,400	貸付株式数 1,300株
トレックス・セミコンダクター	3,800	2,668.00	10,138,400	貸付株式数 600株
東光高岳	3,400	1,504.00	5,113,600	貸付株式数 1,300株
ダブル・スコープ	19,300	900.00	17,370,000	貸付株式数 7,700株
宮越ホールディングス	2,700	1,286.00	3,472,200	貸付株式数 1,000株
ダイヘン	7,400	5,070.00	37,518,000	
ヤーマン	11,500	1,436.00	16,514,000	貸付株式数 4,300株
JVCケンウッド	60,100	210.00	12,621,000	
ミマキエンジニアリング	6,200	905.00	5,611,000	
I - P E X	3,200	2,061.00	6,595,200	貸付株式数 300株
日新電機	15,800	1,422.00	22,467,600	
大崎電気	13,200	562.00	7,418,400	貸付株式数 1,600株
オムロン	55,800	11,480.00	640,584,000	
日東工業	9,800	1,761.00	17,257,800	
I D E C	9,200	2,270.00	20,884,000	
正興電機製作所	2,500	1,434.00	3,585,000	貸付株式数 800株
不二電機工業	1,000	1,276.00	1,276,000	
ジーエス・ユアサ コーポ	24,400	2,584.00	63,049,600	
サクサホールディングス	1,500	1,414.00	2,121,000	貸付株式数 100株
メルコホールディングス	2,400	4,960.00	11,904,000	
テクノメディカ	1,400	1,700.00	2,380,000	貸付株式数 500株
ダイヤモンドエレクトリックHD	2,000	2,368.00	4,736,000	貸付株式数 800株
日本電気	85,500	6,220.00	531,810,000	
富士通	60,500	21,030.00	1,272,315,000	
沖電気	27,100	983.00	26,639,300	
岩崎通信機	2,900	909.00	2,636,100	貸付株式数 1,100株
電気興業	3,100	2,588.00	8,022,800	貸付株式数 100株
サンケン電気	7,500	6,870.00	51,525,000	
ナカヨ	1,100	1,437.00	1,580,700	貸付株式数 200株
アイホン	4,300	2,351.00	10,109,300	
ルネサスエレクトロニクス	362,200	1,372.00	496,938,400	
セイコーエプソン	83,400	2,279.00	190,068,600	

ワコム	49,200	736.00	36,211,200	貸付株式数	19,100株
アルバック	12,500	6,520.00	81,500,000		
アクセル	2,800	773.00	2,164,400	貸付株式数	1,100株
E I Z O	5,800	4,270.00	24,766,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	37.00	2,282,900		
日本信号	15,500	1,005.00	15,577,500		
京三製作所	13,400	535.00	7,169,000		
能美防災	8,800	2,112.00	18,585,600	貸付株式数	500株
ホーチキ	4,600	1,205.00	5,543,000		
星和電機	3,400	526.00	1,788,400		
エレコム	15,600	1,860.00	29,016,000		
パナソニック	715,600	1,384.50	990,748,200		
シャープ	89,600	1,386.00	124,185,600	貸付株式数	29,400株
アンリツ	40,900	2,032.00	83,108,800	貸付株式数	16,000株
富士通ゼネラル	20,800	2,912.00	60,569,600		
ソニーグループ	420,600	12,340.00	5,190,204,000		
T D K	32,500	12,460.00	404,950,000		
帝国通信工業	2,700	1,599.00	4,317,300	貸付株式数	800株
タムラ製作所	25,200	748.00	18,849,600	貸付株式数	9,600株
アルプスアルパイン	54,700	1,213.00	66,351,100		
池上通信機	2,400	807.00	1,936,800	貸付株式数	800株
日本電波工業	7,100	901.00	6,397,100	貸付株式数	2,300株
鈴木	3,100	868.00	2,690,800	貸付株式数	1,200株
日本トリム	1,600	3,785.00	6,056,000		
ローランド ディー . ジー .	4,000	3,100.00	12,400,000	貸付株式数	1,000株
フオスタ - 電機	6,600	934.00	6,164,400		
S M K	1,600	2,391.00	3,825,600	貸付株式数	600株
ヨコオ	5,500	2,574.00	14,157,000		
ティアック	5,200	117.00	608,400	貸付株式数	1,700株 (300株)
ホシデン	18,000	953.00	17,154,000		
ヒロセ電機	10,400	19,670.00	204,568,000		
日本航空電子	15,800	1,666.00	26,322,800		
T O A	7,400	871.00	6,445,400		
マクセルホールディングス	13,100	1,324.00	17,344,400		
古野電気	8,500	1,161.00	9,868,500	貸付株式数	3,400株
ユニデンホールディングス	1,800	2,830.00	5,094,000	貸付株式数	600株
スミダコーポレーション	6,200	1,221.00	7,570,200		
アイコム	2,800	2,449.00	6,857,200		

リオン	2,900	2,850.00	8,265,000	
本多通信工業	4,400	494.00	2,173,600	貸付株式数 1,700株
横河電機	66,600	1,968.00	131,068,800	
新電元工業	2,700	4,135.00	11,164,500	
アズビル	45,600	5,120.00	233,472,000	
東亜ディーケーケー	2,800	1,013.00	2,836,400	貸付株式数 1,100株
日本光電工業	27,800	3,930.00	109,254,000	
チノール	1,800	1,492.00	2,685,600	
共和電業	6,600	391.00	2,580,600	
日本電子材料	2,900	1,926.00	5,585,400	貸付株式数 1,100株
堀場製作所	12,300	8,220.00	101,106,000	
アドバンテスト	50,000	11,100.00	555,000,000	
小野測器	2,500	547.00	1,367,500	
エスベック	5,800	2,367.00	13,728,600	
キーエンス	65,900	71,630.00	4,720,417,000	
日置電機	3,300	9,770.00	32,241,000	貸付株式数 400株
シスメックス	52,400	14,690.00	769,756,000	
日本マイクロニクス	11,500	1,536.00	17,664,000	貸付株式数 4,100株
メガチップス	6,700	3,465.00	23,215,500	貸付株式数 2,600株
OBARA GROUP	3,700	4,145.00	15,336,500	貸付株式数 1,400株
IMAGICA GROUP	5,400	553.00	2,986,200	貸付株式数 2,100株 (2,000株)
澤藤電機	800	2,050.00	1,640,000	貸付株式数 200株 (200株)
デンソー	147,800	7,740.00	1,143,972,000	
原田工業	2,700	963.00	2,600,100	貸付株式数 1,100株
コーセル	8,200	996.00	8,167,200	貸付株式数 2,900株
イリソ電子工業	5,700	4,750.00	27,075,000	貸付株式数 2,200株
オプテックスグループ	11,100	1,571.00	17,438,100	
千代田インテグレ	2,700	2,184.00	5,896,800	
アイ・オー・データ	2,400	919.00	2,205,600	貸付株式数 900株
レーザーテック	29,600	28,510.00	843,896,000	貸付株式数 11,500株
スタンレー電気	46,900	2,872.00	134,696,800	
岩崎電気	2,400	2,048.00	4,915,200	
ウシオ電機	35,000	2,147.00	75,145,000	
岡谷電機	4,600	363.00	1,669,800	貸付株式数 400株
ヘリオステクノH	6,200	336.00	2,083,200	貸付株式数 800株
エノモト	2,100	1,860.00	3,906,000	貸付株式数 700株
日本セラミック	6,700	3,065.00	20,535,500	貸付株式数 2,000株
遠藤照明	3,300	1,017.00	3,356,100	

古河電池	4,900	1,552.00	7,604,800	貸付株式数	1,900株
双信電機	3,300	863.00	2,847,900		
山一電機	4,500	1,689.00	7,600,500		
図 研	4,600	4,265.00	19,619,000		
日本電子	12,400	9,040.00	112,096,000	貸付株式数	4,800株
カ シ オ	54,000	1,813.00	97,902,000		
ファナック	58,900	25,575.00	1,506,367,500		
日本シイエムケイ	13,900	451.00	6,268,900	貸付株式数	5,500株
エンプラス	3,100	3,205.00	9,935,500		
大真空	2,500	4,040.00	10,100,000	貸付株式数	800株
ロ - ム	27,900	11,210.00	312,759,000		
浜松ホトニクス	48,300	7,020.00	339,066,000		
三井ハイテック	6,700	8,530.00	57,151,000		
新光電気工業	22,900	3,935.00	90,111,500		
京 セ ラ	102,000	6,996.00	713,592,000		
協栄産業	700	1,468.00	1,027,600	貸付株式数	200株
太陽誘電	30,000	7,390.00	221,700,000		
村田製作所	197,200	10,015.00	1,974,958,000		
双葉電子工業	10,800	818.00	8,834,400	貸付株式数	3,900株
日東電工	40,500	8,310.00	336,555,000		
北陸電気工業	2,200	1,055.00	2,321,000		
東海理化電機	17,500	1,651.00	28,892,500		
ニチコン	21,800	1,092.00	23,805,600	貸付株式数	400株
日本ケミコン	7,000	2,226.00	15,582,000		
K O A	9,600	1,778.00	17,068,800		
三井E & S H D	21,700	485.00	10,524,500		
日立造船	54,600	920.00	50,232,000		
三菱重工業	105,700	2,993.00	316,360,100		
川崎重工業	52,700	2,446.00	128,904,200		
I H I	45,300	2,569.00	116,375,700		
名村造船所	21,900	241.00	5,277,900	貸付株式数	8,100株
サノヤスホールディングス	9,800	141.00	1,381,800	貸付株式数	400株
スプリックス	2,100	957.00	2,009,700	貸付株式数	600株
マネジメントソリューションズ	3,400	3,120.00	10,608,000	貸付株式数	1,200株
プロレド・パートナーズ	1,700	1,867.00	3,173,900	貸付株式数	500株
AND FACTORY	1,900	504.00	957,600	貸付株式数	500株
ギークス	1,500	1,531.00	2,296,500	貸付株式数	400株
カーブスホールディングス	18,200	895.00	16,289,000	貸付株式数	7,000株

フォーラムエンジニアリング	4,700	936.00	4,399,200	貸付株式数	1,500株
日本車輛	2,200	2,100.00	4,620,000		
三菱ロジスネクスト	9,100	1,151.00	10,474,100	貸付株式数	3,400株
近畿車輛	1,000	1,154.00	1,154,000	貸付株式数	400株
F P G	22,700	707.00	16,048,900	貸付株式数	6,000株
島根銀行	3,000	615.00	1,845,000	貸付株式数	500株
じもとホールディングス	4,300	709.00	3,048,700		
全国保証	17,200	5,520.00	94,944,000	貸付株式数	6,700株
めぶきフィナンシャルG	344,100	251.00	86,369,100		
東京きらぼしF G	8,800	1,575.00	13,860,000		
九州フィナンシャルG	134,900	420.00	56,658,000		
かんぼ生命保険	82,400	2,078.00	171,227,200		
ゆうちょ銀行	187,200	958.00	179,337,600	貸付株式数	73,200株
富山第一銀行	14,700	300.00	4,410,000		
コンコルディア・フィナンシャル	402,800	444.00	178,843,200		
ジェイリース	2,500	2,048.00	5,120,000	貸付株式数	800株
西日本フィナンシャルH D	43,300	715.00	30,959,500		
イントラスト	2,700	710.00	1,917,000	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	3,700	1,046.00	3,870,200	貸付株式数	1,200株
C a s a	2,100	969.00	2,034,900	貸付株式数	900株
アルヒ	10,100	1,305.00	13,180,500	貸付株式数	3,800株
プレミアグループ	3,400	3,470.00	11,798,000		
日産自動車	790,600	556.30	439,810,780		
いすゞ自動車	178,900	1,479.00	264,593,100		
トヨタ自動車	680,100	9,929.00	6,752,712,900		
日野自動車	84,600	1,013.00	85,699,800		
三菱自動車工業	250,800	279.00	69,973,200	貸付株式数	77,000株
エフテック	5,300	633.00	3,354,900		
レシップホールディングス	2,900	599.00	1,737,100	貸付株式数	500株
G M B	1,600	909.00	1,454,400	貸付株式数	400株
ファルテック	1,400	741.00	1,037,400		
武蔵精密工業	15,400	1,933.00	29,768,200		
日産車体	9,300	795.00	7,393,500	貸付株式数	3,700株
新明和工業	19,500	958.00	18,681,000		
極東開発工業	11,600	1,739.00	20,172,400		
トピー工業	5,400	1,249.00	6,744,600	貸付株式数	1,500株
ティラド	2,200	3,250.00	7,150,000		
タチエス	10,500	1,308.00	13,734,000		

N O K	32,400	1,365.00	44,226,000	
フタバ産業	16,100	479.00	7,711,900	
K Y B	7,700	3,040.00	23,408,000	貸付株式数 100株
市光工業	9,800	628.00	6,154,400	貸付株式数 2,300株
大同メタル工業	13,000	629.00	8,177,000	貸付株式数 2,600株
プレス工業	32,600	346.00	11,279,600	
ミクニ	7,900	330.00	2,607,000	
太平洋工業	14,100	1,207.00	17,018,700	
河西工業	9,400	384.00	3,609,600	
アイシン	49,200	4,180.00	205,656,000	
マ ッ ダ	211,900	935.00	198,126,500	
今仙電機製作所	5,600	728.00	4,076,800	
本田技研	528,200	3,338.00	1,763,131,600	
スズキ	133,100	5,086.00	676,946,600	
S U B A R U	192,000	2,057.00	394,944,000	
安永	3,200	1,197.00	3,830,400	貸付株式数 1,200株
ヤマハ発動機	87,800	3,085.00	270,863,000	貸付株式数 34,400株
小糸製作所	40,100	6,820.00	273,482,000	
T B K	7,400	419.00	3,100,600	
エクセディ	9,100	1,750.00	15,925,000	貸付株式数 400株
ミツバ	12,700	671.00	8,521,700	
豊田合成	22,000	2,293.00	50,446,000	
愛三工業	10,600	845.00	8,957,000	貸付株式数 1,400株
盟和産業	1,100	1,049.00	1,153,900	貸付株式数 300株
日本プラスト	5,100	667.00	3,401,700	貸付株式数 2,000株
ヨ ロ ズ	5,500	1,238.00	6,809,000	貸付株式数 100株
エフ・シー・シー	10,500	1,562.00	16,401,000	貸付株式数 4,200株
新家工業	1,600	1,551.00	2,481,600	
シマノ	27,100	34,300.00	929,530,000	貸付株式数 700株 (700株)
テイ・エス テック	30,800	1,453.00	44,752,400	
3 3 F G	5,600	1,494.00	8,366,400	
第四北越フィナンシャルG	10,700	2,602.00	27,841,400	貸付株式数 400株
ひろぎんH L D G S	98,700	652.00	64,352,400	貸付株式数 12,400株
マーキュリアホールディングス	3,200	757.00	2,422,400	
L I T A L I C O	2,800	7,180.00	20,104,000	
ジャムコ	4,300	985.00	4,235,500	貸付株式数 1,500株
小 野 建	5,500	1,742.00	9,581,000	貸付株式数 2,200株
はるやまH L D G S	2,300	601.00	1,382,300	貸付株式数 400株

南陽	1,200	2,075.00	2,490,000	貸付株式数	400株
ノジマ	11,700	2,871.00	33,590,700	貸付株式数	4,600株
佐島電機	4,000	917.00	3,668,000		
カップ・クリエイト	9,100	1,406.00	12,794,600	貸付株式数	3,600株
エコトレーディング	1,900	671.00	1,274,900		
伯東	4,400	1,972.00	8,676,800		
コンドーテック	4,800	1,035.00	4,968,000		
中山福	4,300	428.00	1,840,400	貸付株式数	700株
ライトオン	4,600	729.00	3,353,400	貸付株式数	300株
ナガイレーベン	8,400	2,739.00	23,007,600		
三菱食品	7,000	2,931.00	20,517,000		
良品計画	76,200	2,567.00	195,605,400		
三城ホールディングス	7,900	268.00	2,117,200	貸付株式数	2,800株
松田産業	5,200	3,035.00	15,782,000		
第一興商	12,900	3,815.00	49,213,500	貸付株式数	5,000株
メディパルHD	66,200	2,201.00	145,706,200		
アドヴァングループ	6,600	977.00	6,448,200	貸付株式数	1,500株
S P K	2,900	1,402.00	4,065,800		
萩原電気HLDGS	2,400	2,313.00	5,551,200		
アルビス	1,900	2,485.00	4,721,500	貸付株式数	600株
アズワン	4,800	17,650.00	84,720,000		
スズデン	2,200	1,622.00	3,568,400	貸付株式数	300株
尾家産業	2,000	1,151.00	2,302,000	貸付株式数	700株
シモジマ	4,200	1,305.00	5,481,000		
ドウシシャ	6,200	1,781.00	11,042,200		
小津産業	1,700	1,997.00	3,394,900	貸付株式数	500株
コナカ	7,800	368.00	2,870,400		
高速	3,500	1,616.00	5,656,000		
ハウスローゼ	600	1,681.00	1,008,600	貸付株式数	200株
G-7ホールディングス	3,900	4,290.00	16,731,000		
たけびし	2,200	1,738.00	3,823,600	貸付株式数	800株
イオン北海道	8,900	1,300.00	11,570,000		
コジマ	12,300	662.00	8,142,600	貸付株式数	4,500株
ヒマラヤ	2,200	1,400.00	3,080,000		
コーナン商事	9,600	3,730.00	35,808,000		
ネットワンシステムズ	27,100	3,910.00	105,961,000		
エコス	2,500	1,975.00	4,937,500		
ワタミ	8,900	1,011.00	8,997,900	貸付株式数	3,400株
マルシェ	1,500	494.00	741,000	貸付株式数	600株
リックス	1,300	1,530.00	1,989,000		

システムソフト	18,400	170.00	3,128,000	貸付株式数	5,300株
パンパシフィックHD	132,500	2,033.00	269,372,500		
丸文	5,600	784.00	4,390,400		
西松屋チェーン	14,900	1,415.00	21,083,500	貸付株式数	5,800株
ゼンショーホールディングス	35,400	2,822.00	99,898,800	貸付株式数	14,100株
ハピネット	6,000	1,498.00	8,988,000	貸付株式数	100株
幸楽苑ホールディングス	4,100	1,515.00	6,211,500	貸付株式数	1,500株
ハークスレイ	1,000	1,026.00	1,026,000		
橋本総業HLDGS	1,600	2,283.00	3,652,800	貸付株式数	500株
日本ライフライン	21,300	1,380.00	29,394,000		
サイゼリヤ	10,200	2,779.00	28,345,800	貸付株式数	3,800株
タカショー	5,100	933.00	4,758,300	貸付株式数	1,700株
VTホールディングス	25,200	571.00	14,389,200	貸付株式数	9,500株
マルカ	2,300	2,919.00	6,713,700		
アルゴグラフィックス	5,300	3,390.00	17,967,000		
魚力	1,900	2,219.00	4,216,100	貸付株式数	700株
IDOM	22,700	1,007.00	22,858,900		
日本エム・ディ・エム	4,000	2,267.00	9,068,000		
ポプラ	3,100	222.00	688,200	貸付株式数	600株
フジ・コーポレーション	3,400	1,234.00	4,195,600		
ユナイテッドアローズ	7,700	1,952.00	15,030,400	貸付株式数	1,100株
進和	3,800	2,487.00	9,450,600	貸付株式数	1,500株
エスケイジャパン	2,600	491.00	1,276,600	貸付株式数	400株
ダイトロン	2,800	2,429.00	6,801,200		
ハイデイ日高	9,500	1,741.00	16,539,500	貸付株式数	3,800株
シークス	9,400	1,219.00	11,458,600	貸付株式数	3,700株
京都きもの友禅	4,300	257.00	1,105,100		
コロワイド	22,000	1,728.00	38,016,000	貸付株式数	8,700株
ピーシーデポコーポ	7,400	474.00	3,507,600	貸付株式数	3,500株
田中商事	1,700	676.00	1,149,200	貸付株式数	500株
オーハシテクニカ	3,400	1,573.00	5,348,200		
壺番屋	4,400	4,690.00	20,636,000	貸付株式数	1,700株
白銅	2,300	3,405.00	7,831,500	貸付株式数	900株
トップカルチャー	2,500	342.00	855,000	貸付株式数	900株
PLANT	1,600	739.00	1,182,400	貸付株式数	600株
スギホールディングス	13,300	8,740.00	116,242,000	貸付株式数	5,200株
ダイコー通産	900	1,257.00	1,131,300	貸付株式数	300株
薬王堂ホールディングス	2,800	2,533.00	7,092,400	貸付株式数	400株
島津製作所	86,500	5,350.00	462,775,000		

J M S	5,900	842.00	4,967,800	貸付株式数	2,100株
クボテック	1,800	303.00	545,400	貸付株式数	600株
長野計器	5,100	1,170.00	5,967,000		
ブイ・テクノロジー	3,100	4,695.00	14,554,500	貸付株式数	400株
スター精密	10,400	1,644.00	17,097,600	貸付株式数	1,400株
東京計器	4,100	1,051.00	4,309,100		
愛知時計	700	4,800.00	3,360,000		
インターアクション	3,500	2,822.00	9,877,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
オーバル	6,600	270.00	1,782,000		
東京精密	11,400	4,780.00	54,492,000		
マニー	26,700	2,257.00	60,261,900		
ニコン	102,700	1,314.00	134,947,800		
トプコン	34,000	2,063.00	70,142,000		
オリンパス	352,100	2,326.00	818,984,600		
理研計器	5,900	3,075.00	18,142,500	貸付株式数	600株
S C R E E Nホールディング グス	11,700	10,210.00	119,457,000		
キヤノン電子	6,200	1,642.00	10,180,400		
タムロン	5,600	2,781.00	15,573,600	貸付株式数	2,000株
H O Y A	131,000	18,415.00	2,412,365,000		
シード	2,400	685.00	1,644,000	貸付株式数	900株 (900株)
ノーリツ鋼機	6,200	2,750.00	17,050,000		
エー・アンド・デイ	5,800	1,061.00	6,153,800	貸付株式数	2,100株
朝日インテック	72,200	3,240.00	233,928,000	貸付株式数	1,300株
キヤノン	333,600	2,688.00	896,716,800	貸付株式数	141,500株
リコー	171,600	1,101.00	188,931,600		
シチズン時計	85,200	525.00	44,730,000		
リズム	1,900	1,491.00	2,832,900		
大研医器	4,800	620.00	2,976,000		
メニコン	10,500	9,100.00	95,550,000	貸付株式数	4,000株
シンシア	1,400	673.00	942,200		
中本パックス	1,600	1,910.00	3,056,000	貸付株式数	100株
スノーピーク	4,500	6,050.00	27,225,000	貸付株式数	1,700株
パラマウントベッドHD	12,500	2,267.00	28,337,500	貸付株式数	300株
トランザクション	4,500	1,210.00	5,445,000	貸付株式数	1,000株
粧美堂	2,300	428.00	984,400	貸付株式数	800株
ニホンフラッシュ	5,700	1,175.00	6,697,500	貸付株式数	400株
前田工織	7,600	3,445.00	26,182,000	貸付株式数	2,500株

永大産業	8,600	308.00	2,648,800	
アートネイチャー	6,300	746.00	4,699,800	
バンダイナムコHLDGS	55,500	8,883.00	493,006,500	
アイフィスジャパン	1,800	719.00	1,294,200	
共立印刷	8,200	178.00	1,459,600	貸付株式数 1,200株
SHOEI	6,500	5,250.00	34,125,000	
フランスベッドHLDGS	9,800	955.00	9,359,000	貸付株式数 3,400株
マーベラス	10,400	701.00	7,290,400	貸付株式数 400株
パイロットコーポレーション	11,100	4,420.00	49,062,000	
萩原工業	3,800	1,638.00	6,224,400	貸付株式数 1,500株
エイベックス	11,700	1,503.00	17,585,100	
トッパン・フォームズ	11,900	1,034.00	12,304,600	
フジシールインターナショナル	13,700	2,612.00	35,784,400	貸付株式数 5,400株
タカラトミー	30,300	1,181.00	35,784,300	
廣済堂	5,200	1,660.00	8,632,000	貸付株式数 1,800株
エステールホールディングス	4,000	660.00	2,640,000	貸付株式数 700株
レック	7,800	1,114.00	8,689,200	
タカノ	2,100	831.00	1,745,100	貸付株式数 800株
三光合成	7,200	458.00	3,297,600	
プロネクサス	5,300	1,092.00	5,787,600	
ホクシン	6,900	169.00	1,166,100	
ウッドワン	2,500	1,148.00	2,870,000	
大建工業	4,500	2,367.00	10,651,500	
きもと	12,700	254.00	3,225,800	貸付株式数 3,900株
凸版印刷	101,300	1,992.00	201,789,600	
大日本印刷	79,000	2,759.00	217,961,000	
共同印刷	2,000	2,782.00	5,564,000	
NISSHA	13,800	1,832.00	25,281,600	貸付株式数 3,400株
光村印刷	600	1,718.00	1,030,800	貸付株式数 200株
藤森工業	6,000	4,930.00	29,580,000	
ヴィア・ホールディングス	7,600	198.00	1,504,800	貸付株式数 3,200株
TAKARA & COMPANY	3,300	1,830.00	6,039,000	貸付株式数 1,300株
前澤化成工業	4,500	1,304.00	5,868,000	貸付株式数 1,600株
未来工業	2,500	1,654.00	4,135,000	
アシックス	59,700	2,559.00	152,772,300	貸付株式数 21,500株
ツツミ	2,100	2,359.00	4,953,900	貸付株式数 600株

ウェーブロックHLDGS	2,300	707.00	1,626,100	貸付株式数	900株
ジェイ エス ピー	4,300	1,673.00	7,193,900	貸付株式数	1,400株
ニチハ	9,200	3,375.00	31,050,000	貸付株式数	1,900株
エフピコ	12,500	4,280.00	53,500,000	貸付株式数	2,200株
小松ウオール工業	2,200	1,987.00	4,371,400		
ヤマハ	39,900	7,270.00	290,073,000		
河合楽器	2,000	3,910.00	7,820,000		
クリナップ	6,000	598.00	3,588,000		
ビジョン	40,800	2,871.00	117,136,800	貸付株式数	16,600株
天馬	5,200	3,000.00	15,600,000		
兼松サステック	600	1,811.00	1,086,600		
キングジム	5,600	894.00	5,006,400		
象印マホービン	17,900	1,875.00	33,562,500	貸付株式数	7,100株
リンテック	14,000	2,675.00	37,450,000		
信越ポリマー	9,900	1,077.00	10,662,300		
東リ	14,700	240.00	3,528,000		
イトーキ	12,900	396.00	5,108,400	貸付株式数	5,100株
任天堂	38,500	52,660.00	2,027,410,000		
三菱鉛筆	10,600	1,508.00	15,984,800	貸付株式数	400株
松風	3,200	2,198.00	7,033,600	貸付株式数	1,200株
タカラスタンダ-ド	13,200	1,665.00	21,978,000		
コクヨ	32,500	2,005.00	65,162,500		
ナカバヤシ	5,800	607.00	3,520,600		
ニフコ	25,000	3,625.00	90,625,000		
立川ブラインド	3,100	1,330.00	4,123,000	貸付株式数	1,100株
グローブライド	3,400	9,460.00	32,164,000		
オカムラ	23,600	1,697.00	40,049,200		
バルカー	5,300	2,285.00	12,110,500		
MUTOHホールディングス	900	1,666.00	1,499,400		
伊藤忠	462,500	3,455.00	1,597,937,500		
丸紅	652,200	924.40	602,893,680		
スクロール	9,900	884.00	8,751,600	貸付株式数	3,500株
高島	1,000	1,901.00	1,901,000		
ヨンドシーホールディングス	6,200	1,831.00	11,352,200		
三陽商会	4,000	947.00	3,788,000	貸付株式数	500株
長瀬産業	35,800	1,964.00	70,311,200		
ナイガイ	3,200	352.00	1,126,400		
蝶理	4,300	1,955.00	8,406,500		

豊田通商	66,200	4,775.00	316,105,000	
オンワ - ドホールディングス	41,800	323.00	13,501,400	貸付株式数 1,400株
三共生興	9,200	546.00	5,023,200	
兼 松	26,100	1,444.00	37,688,400	
美 津 濃	6,800	2,750.00	18,700,000	
ツカモトコーポレーション	1,400	1,424.00	1,993,600	
ルックホールディングス	2,300	1,388.00	3,192,400	
三井物産	527,900	2,445.00	1,290,715,500	
日本紙パルプ	3,300	3,890.00	12,837,000	
東京エレクトロン	39,300	54,070.00	2,124,951,000	
カメイ	8,100	1,249.00	10,116,900	
東都水産	400	7,080.00	2,832,000	
OU Gホールディングス	1,000	2,935.00	2,935,000	貸付株式数 400株
スターゼン	5,000	2,241.00	11,205,000	
セイコーHD	9,700	2,204.00	21,378,800	
山 善	25,000	1,132.00	28,300,000	貸付株式数 6,300株
椿本興業	1,200	3,915.00	4,698,000	
住友商事	416,200	1,600.00	665,920,000	
日本ユニシス	23,100	3,020.00	69,762,000	
内田洋行	2,900	5,750.00	16,675,000	
三菱商事	402,700	3,532.00	1,422,336,400	
第一実業	3,200	5,070.00	16,224,000	
キャノンマーケティングJ PN	16,300	2,577.00	42,005,100	
西華産業	3,300	1,665.00	5,494,500	貸付株式数 600株
佐藤商事	5,100	1,213.00	6,186,300	
菱洋エレクトロ	5,100	2,380.00	12,138,000	貸付株式数 1,900株
東京産業	6,600	756.00	4,989,600	貸付株式数 100株
ユアサ商事	6,600	3,115.00	20,559,000	貸付株式数 200株
神鋼商事	1,500	3,390.00	5,085,000	
トルク	3,900	230.00	897,000	貸付株式数 1,100株
阪和興業	13,300	3,590.00	47,747,000	
正栄食品	4,200	4,405.00	18,501,000	貸付株式数 1,600株
カナデン	5,300	1,060.00	5,618,000	
菱電商事	4,700	1,836.00	8,629,200	貸付株式数 1,600株
ニプロ	49,800	1,186.00	59,062,800	
フルサト工業	3,400	2,280.00	7,752,000	
岩谷産業	16,100	6,650.00	107,065,000	
ナイス	2,500	1,970.00	4,925,000	

ニチモウ	1,000	2,076.00	2,076,000	貸付株式数	200株
極東貿易	2,100	2,718.00	5,707,800	貸付株式数	700株
アステナホールディングス	10,800	620.00	6,696,000		
兼松エレクトロニクス	3,600	4,035.00	14,526,000		
三愛石油	16,200	1,511.00	24,478,200		
稲畑産業	16,000	1,755.00	28,080,000		
G S Iクレオス	3,600	1,053.00	3,790,800	貸付株式数	1,200株
明和産業	5,900	1,156.00	6,820,400	貸付株式数	1,800株
クワザワホールディングス	2,500	652.00	1,630,000		
ヤマエ久野	4,600	1,260.00	5,796,000		
ゴ-ルドウイン	11,000	7,330.00	80,630,000		
ユニ・チャ-ム	129,400	4,952.00	640,788,800		
デサント	11,400	3,850.00	43,890,000	貸付株式数	4,200株
キ ン グ	3,400	512.00	1,740,800	貸付株式数	700株
ワ キ タ	13,000	1,088.00	14,144,000		
ヤマトインタ-ナショナル	5,800	329.00	1,908,200	貸付株式数	2,200株
東邦ホールディングス	20,800	1,900.00	39,520,000		
サンゲツ	17,500	1,637.00	28,647,500		
ミツウロコグループ	9,900	1,455.00	14,404,500	貸付株式数	2,600株
シナネンホールディングス	2,500	3,710.00	9,275,000	貸付株式数	900株
伊藤忠エネクス	14,900	1,044.00	15,555,600		
サンリオ	19,100	2,501.00	47,769,100	貸付株式数	6,900株
サンワ テクノス	4,400	1,487.00	6,542,800		
リョ-サン	6,800	2,342.00	15,925,600		
新光商事	9,100	898.00	8,171,800		
トーホ-	3,000	1,741.00	5,223,000	貸付株式数	1,100株
三信電気	4,100	1,719.00	7,047,900		
東陽テクニカ	6,900	1,291.00	8,907,900	貸付株式数	300株
モスフード サービス	9,000	3,315.00	29,835,000	貸付株式数	3,600株
加賀電子	6,200	3,210.00	19,902,000		
三益半導体	5,000	2,595.00	12,975,000		
ソーダニツカ	6,300	657.00	4,139,100		
立花エレテック	4,600	1,591.00	7,318,600	貸付株式数	1,800株
木曽路	8,300	2,479.00	20,575,700	貸付株式数	3,300株 (600株)
S R Sホールディングス	8,200	840.00	6,888,000	貸付株式数	3,200株
千 趣 会	11,800	392.00	4,625,600	貸付株式数	4,700株
タカキユー	7,300	132.00	963,600	貸付株式数	1,700株
リテールパートナーズ	7,900	1,299.00	10,262,100	貸付株式数	3,000株
ケーヨー	11,900	849.00	10,103,100		

上新電機	7,400	2,622.00	19,402,800	
日本瓦斯	32,600	1,692.00	55,159,200	
ロイヤルホールディングス	11,600	2,139.00	24,812,400	貸付株式数 4,500株
東 天 紅	500	1,115.00	557,500	
いなげや	7,300	1,448.00	10,570,400	
チヨダ	6,400	821.00	5,254,400	貸付株式数 2,100株
ライフコーポレーション	6,200	4,785.00	29,667,000	
リンガーハット	7,900	2,412.00	19,054,800	貸付株式数 3,100株
Mr Max HD	8,800	686.00	6,036,800	貸付株式数 3,500株
テンアライド	5,300	328.00	1,738,400	貸付株式数 2,300株
A O K Iホールディングス	13,300	686.00	9,123,800	貸付株式数 2,600株
オークワ	10,000	1,217.00	12,170,000	
コメリ	10,000	2,725.00	27,250,000	
青山商事	15,300	795.00	12,163,500	貸付株式数 5,800株
しまむら	7,700	10,010.00	77,077,000	
はせがわ	3,300	268.00	884,400	貸付株式数 600株
高 島 屋	49,200	1,158.00	56,973,600	
松 屋	14,400	1,122.00	16,156,800	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	32,500	945.00	30,712,500	貸付株式数 12,400株
近鉄百貨店	2,500	2,603.00	6,507,500	貸付株式数 1,000株
丸井グループ	56,400	2,093.00	118,045,200	
クレディセゾン	38,900	1,357.00	52,787,300	
アクシアル リテイリング	5,300	4,090.00	21,677,000	貸付株式数 400株
井 筒 屋	3,700	267.00	987,900	貸付株式数 1,200株
イオン	254,200	3,018.00	767,175,600	
イ ズ ミ	13,500	3,590.00	48,465,000	貸付株式数 300株
フオーバル	2,200	1,107.00	2,435,400	
平 和 堂	12,000	2,307.00	27,684,000	貸付株式数 5,200株
フ ジ	7,900	2,268.00	17,917,200	貸付株式数 3,100株
ヤオコー	7,500	7,210.00	54,075,000	貸付株式数 200株
ゼビオホールディングス	7,400	1,158.00	8,569,200	貸付株式数 300株
ケースホールディングス	56,600	1,197.00	67,750,200	貸付株式数 22,500株
P A L T A C	10,700	5,130.00	54,891,000	
三谷産業	9,400	388.00	3,647,200	貸付株式数 3,500株
O L Y M P I Cグループ	3,600	799.00	2,876,400	貸付株式数 700株
日産東京販売HD	8,900	244.00	2,171,600	
新生銀行	54,700	1,886.00	103,164,200	
あおぞら銀行	39,500	2,734.00	107,993,000	

三菱UFJフィナンシャルG	4,527,400	632.50	2,863,580,500	
りそなホールディングス	768,700	443.90	341,225,930	
三井住友トラストHD	125,200	3,830.00	479,516,000	
三井住友フィナンシャルG	457,600	3,929.00	1,797,910,400	
千葉銀行	221,200	713.00	157,715,600	
群馬銀行	136,600	362.00	49,449,200	
武蔵野銀行	9,700	1,885.00	18,284,500	貸付株式数 3,500株
千葉興業銀行	16,600	280.00	4,648,000	
筑波銀行	29,100	181.00	5,267,100	
七十七銀行	20,500	1,272.00	26,076,000	貸付株式数 2,800株
青森銀行	5,100	2,181.00	11,123,100	貸付株式数 100株
秋田銀行	4,000	1,495.00	5,980,000	
山形銀行	7,000	892.00	6,244,000	
岩手銀行	4,200	1,765.00	7,413,000	貸付株式数 800株
東邦銀行	56,700	216.00	12,247,200	貸付株式数 2,200株
東北銀行	3,300	1,036.00	3,418,800	
みちのく銀行	4,500	888.00	3,996,000	
ふくおかフィナンシャルG	60,100	2,016.00	121,161,600	
静岡銀行	161,800	928.00	150,150,400	
十六銀行	8,300	2,203.00	18,284,900	
スルガ銀行	63,000	383.00	24,129,000	
八十二銀行	148,500	397.00	58,954,500	
山梨中央銀行	7,400	858.00	6,349,200	
大垣共立銀行	12,900	1,941.00	25,038,900	
福井銀行	5,900	1,690.00	9,971,000	
北國銀行	6,200	2,114.00	13,106,800	
清水銀行	2,500	1,693.00	4,232,500	貸付株式数 100株
富山銀行	1,300	2,305.00	2,996,500	
滋賀銀行	13,200	1,893.00	24,987,600	
南都銀行	9,300	2,040.00	18,972,000	
百五銀行	59,300	336.00	19,924,800	
京都銀行	23,900	5,020.00	119,978,000	
紀陽銀行	23,000	1,591.00	36,593,000	
ほくほくフィナンシャルG	44,200	839.00	37,083,800	
山陰合同銀行	41,000	564.00	23,124,000	
中国銀行	56,000	890.00	49,840,000	
鳥取銀行	2,200	1,150.00	2,530,000	
伊予銀行	88,200	585.00	51,597,000	貸付株式数 1,800株

百十四銀行	6,500	1,600.00	10,400,000	
四国銀行	9,300	746.00	6,937,800	貸付株式数 3,600株
阿波銀行	9,900	2,219.00	21,968,100	
大分銀行	3,700	1,862.00	6,889,400	
宮崎銀行	4,100	2,133.00	8,745,300	
佐賀銀行	3,800	1,505.00	5,719,000	
沖縄銀行	5,800	2,868.00	16,634,400	
琉球銀行	13,600	795.00	10,812,000	貸付株式数 900株
セブン銀行	221,900	256.00	56,806,400	
みずほフィナンシャルG	898,700	1,602.00	1,439,717,400	
高知銀行	2,500	841.00	2,102,500	
山口フィナンシャルG	82,600	665.00	54,929,000	
芙蓉総合リース	6,800	7,930.00	53,924,000	
みずほリース	10,500	3,655.00	38,377,500	貸付株式数 3,900株
東京センチュリー	15,300	6,500.00	99,450,000	貸付株式数 600株
SBIホールディングス	81,800	2,778.00	227,240,400	
日本証券金融	29,000	942.00	27,318,000	
アイフル	113,800	360.00	40,968,000	
日本アジア投資	6,100	249.00	1,518,900	
長野銀行	2,400	1,172.00	2,812,800	
名古屋銀行	5,200	2,772.00	14,414,400	貸付株式数 200株
北洋銀行	101,200	264.00	26,716,800	
愛知銀行	2,300	3,660.00	8,418,000	貸付株式数 100株
中京銀行	2,600	1,405.00	3,653,000	
大光銀行	2,200	1,590.00	3,498,000	
愛媛銀行	8,900	800.00	7,120,000	
トマト銀行	2,300	1,116.00	2,566,800	
京葉銀行	25,700	455.00	11,693,500	貸付株式数 6,300株
栃木銀行	31,600	185.00	5,846,000	
北日本銀行	1,900	1,611.00	3,060,900	貸付株式数 700株
東和銀行	12,200	555.00	6,771,000	
福島銀行	7,700	252.00	1,940,400	
大東銀行	3,000	685.00	2,055,000	
リコーリース	5,200	3,765.00	19,578,000	貸付株式数 2,000株
イオンフィナンシャルサー ビス	40,400	1,307.00	52,802,800	
アコム	129,800	421.00	54,645,800	貸付株式数 23,100株
ジャックス	7,700	3,050.00	23,485,000	
オリコ	179,600	153.00	27,478,800	
オリックス	401,500	2,118.50	850,577,750	

三菱HCキャピタル	227,000	594.00	134,838,000	
ジャフコグループ	8,700	7,290.00	63,423,000	貸付株式数 3,300株
九州リースサービス	3,000	614.00	1,842,000	
トモニホールディングス	48,200	335.00	16,147,000	貸付株式数 1,300株
大和証券G本社	495,500	667.70	330,845,350	
野村ホールディングス	1,013,000	551.10	558,264,300	
岡三証券グループ	53,900	417.00	22,476,300	貸付株式数 15,500株
丸三証券	19,600	651.00	12,759,600	
東洋証券	21,500	168.00	3,612,000	
東海東京HD	68,800	425.00	29,240,000	
光世証券	1,800	605.00	1,089,000	貸付株式数 600株
水戸証券	17,800	313.00	5,571,400	貸付株式数 1,800株
いちよし証券	13,300	716.00	9,522,800	貸付株式数 5,100株
松井証券	32,200	833.00	26,822,600	
SOMPOホールディングス	116,600	5,078.00	592,094,800	
日本取引所グループ	178,700	2,908.00	519,659,600	
マネックスG	60,400	570.00	34,428,000	貸付株式数 23,700株
極東証券	8,500	871.00	7,403,500	貸付株式数 3,300株
岩井コスモホールディング	7,700	1,444.00	11,118,800	
藍澤證券	11,900	1,157.00	13,768,300	貸付株式数 2,300株
フィデアホール	66,200	128.00	8,473,600	
池田泉州HD	74,800	169.00	12,641,200	貸付株式数 6,400株
アニコムホールディングス	19,500	906.00	17,667,000	貸付株式数 400株
MS&AD	160,300	3,837.00	615,071,100	
マネーパートナーズGP	9,100	219.00	1,992,900	
スパークス・グループ	31,600	294.00	9,290,400	貸付株式数 3,600株
小林洋行	4,100	274.00	1,123,400	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	326,200	2,358.50	769,342,700	
東京海上HD	218,100	6,000.00	1,308,600,000	
アドバンテッジリスクマネ	3,600	1,120.00	4,032,000	
イー・ギャランティ	8,000	2,518.00	20,144,000	
アサックス	3,900	713.00	2,780,700	貸付株式数 1,400株
NECキャピタルソリューション	2,800	2,148.00	6,014,400	
T&Dホールディングス	198,300	1,540.00	305,382,000	
アドバンスクリエイト	3,400	1,114.00	3,787,600	貸付株式数 1,200株
三井不動産	301,500	2,522.50	760,533,750	
三菱地所	433,900	1,730.50	750,863,950	

平和不動産	11,500	4,095.00	47,092,500	
東京建物	65,400	1,699.00	111,114,600	
ダイビル	16,900	1,556.00	26,296,400	
京阪神ビルディング	10,500	1,472.00	15,456,000	
住友不動産	148,900	3,888.00	578,923,200	
太平洋興発	2,600	669.00	1,739,400	貸付株式数 900株
テーオーシー	12,100	663.00	8,022,300	貸付株式数 3,900株
東京楽天地	1,000	4,125.00	4,125,000	貸付株式数 400株
スターツコーポレーション	7,700	2,849.00	21,937,300	
フジ住宅	7,700	718.00	5,528,600	
空港施設	7,200	598.00	4,305,600	貸付株式数 1,300株
明和地所	3,400	611.00	2,077,400	
ゴールドクレスト	5,800	1,722.00	9,987,600	貸付株式数 2,300株
リログループ	35,200	2,155.00	75,856,000	貸付株式数 13,700株
エスリード	2,500	1,670.00	4,175,000	貸付株式数 1,000株
日神グループHLDGS	9,300	511.00	4,752,300	貸付株式数 4,100株
日本エスコ	13,100	796.00	10,427,600	
タカラレーベン	29,300	322.00	9,434,600	貸付株式数 10,600株
AVANTIA	3,600	883.00	3,178,800	貸付株式数 700株
イオンモール	33,100	1,682.00	55,674,200	
毎日コムネット	2,700	768.00	2,073,600	
ファースト住建	2,900	1,332.00	3,862,800	貸付株式数 900株
ランド	371,200	12.00	4,454,400	貸付株式数 119,600株
カチタス	16,400	4,055.00	66,502,000	
東祥	4,300	1,785.00	7,675,500	貸付株式数 1,500株
トーセイ	9,300	1,145.00	10,648,500	貸付株式数 3,600株
穴吹興産	1,800	2,038.00	3,668,400	貸付株式数 600株
サンフロンティア不動産	8,100	1,134.00	9,185,400	
インテリックス	2,000	771.00	1,542,000	
ランドビジネス	2,900	270.00	783,000	貸付株式数 800株
サンネクスタグループ	2,300	1,017.00	2,339,100	貸付株式数 800株
グランディハウス	5,200	486.00	2,527,200	
東武鉄道	69,500	2,978.00	206,971,000	
相鉄ホールディングス	22,600	2,234.00	50,488,400	貸付株式数 8,700株
東急	168,300	1,608.00	270,626,400	
京浜急行	86,000	1,354.00	116,444,000	
小田急電鉄	107,300	2,575.00	276,297,500	
京王電鉄	37,400	5,990.00	224,026,000	
京成電鉄	50,500	3,555.00	179,527,500	
富士急行	9,200	4,580.00	42,136,000	貸付株式数 3,600株

新京成電鉄	1,900	2,180.00	4,142,000	貸付株式数	600株
東日本旅客鉄道	118,200	7,088.00	837,801,600		
西日本旅客鉄道	75,000	5,192.00	389,400,000		
東海旅客鉄道	55,800	16,365.00	913,167,000		
西武ホールディングス	81,300	1,333.00	108,372,900		
鴻池運輸	10,400	1,368.00	14,227,200		
西日本鉄道	18,400	2,871.00	52,826,400	貸付株式数	7,100株
ハマキョウレックス	5,000	3,455.00	17,275,000		
サカイ引越センター	3,200	4,940.00	15,808,000	貸付株式数	1,200株
近鉄グループHLDGS	63,400	3,730.00	236,482,000	貸付株式数	100株
阪急阪神HLDGS	84,000	3,520.00	295,680,000		
南海電鉄	29,800	2,387.00	71,132,600	貸付株式数	11,500株
京阪ホールディングス	28,300	3,120.00	88,296,000		
神戸電鉄	1,500	3,615.00	5,422,500	貸付株式数	600株
名古屋鉄道	52,300	2,044.00	106,901,200		
山陽電鉄	4,400	2,064.00	9,081,600	貸付株式数	1,700株
トランコム	2,000	8,700.00	17,400,000		
日本通運	22,000	8,120.00	178,640,000		
ヤマトホールディングス	89,100	2,914.00	259,637,400		
山 九	16,200	5,350.00	86,670,000		
日 新	4,900	1,728.00	8,467,200		
丸 運	4,300	276.00	1,186,800	貸付株式数	400株
丸全昭和運輸	5,200	3,680.00	19,136,000		
センコーグループHLDGS	36,200	1,050.00	38,010,000	貸付株式数	7,400株
トナミホールディングス	1,500	5,250.00	7,875,000		
ニッコンホールディングス	21,300	2,459.00	52,376,700		
日石輸送	600	2,671.00	1,602,600		
福山通運	8,100	5,030.00	40,743,000		
セイノーホールディングス	47,600	1,379.00	65,640,400	貸付株式数	2,300株
エスライン	1,300	947.00	1,231,100		
神奈川中央交通	1,500	3,610.00	5,415,000	貸付株式数	600株
日立物流	13,400	4,990.00	66,866,000		
丸和運輸機関	13,800	1,678.00	23,156,400	貸付株式数	5,200株
C & F ロジホールディングス	6,300	1,936.00	12,196,800		
日本郵船	53,400	10,060.00	537,204,000		
商船三井	37,900	9,190.00	348,301,000		
川崎汽船	19,800	7,310.00	144,738,000		
NSユニテッド海運	3,200	5,030.00	16,096,000	貸付株式数	1,100株

明治海運	7,000	893.00	6,251,000	貸付株式数	2,700株
飯野海運	29,300	574.00	16,818,200		
共栄タンカー	1,200	1,084.00	1,300,800	貸付株式数	400株
九州旅客鉄道	49,500	2,490.00	123,255,000		
S Gホールディングス	120,500	3,385.00	407,892,500		
日本航空	155,400	2,499.00	388,344,600		
A N Aホールディングス	172,000	2,710.00	466,120,000		
パスコ	1,300	1,472.00	1,913,600		
西本W I S M E T T A C H D	1,500	3,800.00	5,700,000		
シルバーライフ	1,500	1,547.00	2,320,500	貸付株式数	500株
ヤマシタヘルスケアH L D G S	900	1,898.00	1,708,200	貸付株式数	200株
一家ダイニングプロジ	1,300	583.00	757,900		
G E N K Y D R U G S T O R E S	2,900	5,160.00	14,964,000		
国際紙パルプ商事	13,600	352.00	4,787,200	貸付株式数	2,400株
ナルミヤ・インターナショ ナル	1,600	1,034.00	1,654,400		
ブックオフG H D	3,700	983.00	3,637,100	貸付株式数	1,400株
三菱倉庫	22,000	3,290.00	72,380,000		
三井倉庫H O L D	6,900	2,713.00	18,719,700		
住友倉庫	22,500	1,951.00	43,897,500		
渋沢倉庫	3,400	2,428.00	8,255,200		
ヤマタネ	2,900	1,658.00	4,808,200		
東陽倉庫	9,600	354.00	3,398,400	貸付株式数	300株
乾汽船	4,500	2,680.00	12,060,000	貸付株式数	900株
日本トランスシティ	13,500	670.00	9,045,000	貸付株式数	700株
ケイヒン	1,100	1,434.00	1,577,400	貸付株式数	300株
中央倉庫	3,500	1,046.00	3,661,000		
川西倉庫	1,100	1,335.00	1,468,500	貸付株式数	400株
安田倉庫	5,000	1,001.00	5,005,000		
ファイズホールディングス	1,400	767.00	1,073,800	貸付株式数	300株
東洋埠頭	1,800	1,566.00	2,818,800		
宇徳	5,400	574.00	3,099,600		
上 組	34,900	2,402.00	83,829,800		
サンリツ	1,900	826.00	1,569,400	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,400	1,533.00	2,146,200	貸付株式数	500株
キューソー流通システム	1,500	1,868.00	2,802,000	貸付株式数	600株
近鉄エクスプレス	12,000	3,140.00	37,680,000		

東海運	4,000	351.00	1,404,000	貸付株式数	500株
エーアイティー	4,100	1,239.00	5,079,900		
内外トランスライン	2,700	2,460.00	6,642,000	貸付株式数	100株
ショーエイコーポ	2,200	851.00	1,872,200	貸付株式数	600株
日本コンセプト	2,200	2,251.00	4,952,200		
TBSホールディングス	43,600	1,710.00	74,556,000		
日本テレビHLD S	55,100	1,251.00	68,930,100	貸付株式数	1,200株
朝日放送グループHD	5,300	764.00	4,049,200	貸付株式数	2,100株
テレビ朝日HD	20,600	1,748.00	36,008,800	貸付株式数	2,500株
スカパーJ S A T H D	42,600	426.00	18,147,600		
テレビ東京HD	4,500	2,192.00	9,864,000		
日本BS放送	2,000	1,143.00	2,286,000	貸付株式数	800株
ビジョン	11,900	1,401.00	16,671,900		
スマートバリュー	2,100	701.00	1,472,100	貸付株式数	600株
USEN-NEXT H L D G S	6,800	3,720.00	25,296,000		
ワイヤレスゲート	3,100	399.00	1,236,900	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,200	1,590.00	6,678,000		
日本通信	60,900	232.00	14,128,800	貸付株式数	22,700株
クロップス	1,200	995.00	1,194,000	貸付株式数	400株
日本電信電話	770,500	3,226.00	2,485,633,000		
KDDI	528,400	3,786.00	2,000,522,400		
ソフトバンク	599,100	1,556.00	932,199,600		
光通信	7,800	19,610.00	152,958,000		
エムティーアイ	7,600	717.00	5,449,200	貸付株式数	2,500株
GMOインターネット	23,700	2,988.00	70,815,600	貸付株式数	9,000株
ファイバーゲート	2,900	1,497.00	4,341,300	貸付株式数	800株
アйдママーケティングコ ミュ	1,700	382.00	649,400	貸付株式数	600株
KADOKAWA	17,300	5,690.00	98,437,000		
学研ホールディングス	9,600	1,211.00	11,625,600	貸付株式数	3,700株
ゼンリン	11,700	1,081.00	12,647,700	貸付株式数	4,000株
昭文社ホールディングス	3,400	522.00	1,774,800	貸付株式数	600株
インプレスホールディング ス	8,900	285.00	2,536,500	貸付株式数	2,200株
東京電力HD	573,400	309.00	177,180,600		
中部電力	204,900	1,364.00	279,483,600		
関西電力	253,500	1,151.50	291,905,250		
中国電力	97,700	1,068.00	104,343,600		
北陸電力	62,400	616.00	38,438,400		

東北電力	156,400	861.00	134,660,400	
四国電力	55,100	827.00	45,567,700	
九州電力	148,500	879.00	130,531,500	
北海道電力	64,300	549.00	35,300,700	
沖縄電力	13,000	1,499.00	19,487,000	
電源開発	53,300	1,668.00	88,904,400	
エフオン	4,500	909.00	4,090,500	貸付株式数 1,500株
イーレックス	10,200	2,840.00	28,968,000	貸付株式数 3,900株
レノバ	11,700	5,490.00	64,233,000	
東京瓦斯	128,700	2,158.50	277,798,950	
大阪瓦斯	120,900	2,129.00	257,396,100	
東邦瓦斯	33,100	5,430.00	179,733,000	貸付株式数 8,700株
北海道瓦斯	3,500	1,602.00	5,607,000	貸付株式数 500株
広島ガス	11,700	400.00	4,680,000	
西部ガスHLDGS	7,400	2,564.00	18,973,600	
静岡ガス	19,300	1,295.00	24,993,500	
メタウォーター	7,900	1,926.00	15,215,400	
アイネット	3,000	1,412.00	4,236,000	貸付株式数 1,300株
松竹	4,300	12,820.00	55,126,000	貸付株式数 1,700株
東宝	38,900	5,260.00	204,614,000	
エイチ・アイ・エス	14,500	2,464.00	35,728,000	貸付株式数 5,700株
東映	2,200	21,910.00	48,202,000	貸付株式数 800株
ラックランド	1,900	2,878.00	5,468,200	貸付株式数 700株
NTTデータ	175,800	2,175.00	382,365,000	
共立メンテナンス	10,700	3,940.00	42,158,000	貸付株式数 4,200株
イチネンホールディングス	6,200	1,342.00	8,320,400	貸付株式数 500株
建設技術研究所	4,100	2,630.00	10,783,000	貸付株式数 100株
スペース	3,900	975.00	3,802,500	貸付株式数 600株
長大	2,600	2,247.00	5,842,200	
アインホールディングス	9,600	7,430.00	71,328,000	貸付株式数 1,100株
燦ホールディングス	2,700	1,453.00	3,923,100	
ピー・シー・エー	1,100	6,180.00	6,798,000	
スバル興業	400	8,310.00	3,324,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	2,300	1,296.00	2,980,800	貸付株式数 900株
タナベ経営	1,000	1,613.00	1,613,000	
ビジネスB太田昭和	2,600	1,723.00	4,479,800	
ナガワ	2,000	11,990.00	23,980,000	貸付株式数 700株
東京都競馬	5,000	4,080.00	20,400,000	
常磐興産	2,600	1,488.00	3,868,800	貸付株式数 1,000株
カナモト	11,000	2,604.00	28,644,000	貸付株式数 4,400株

D T S	14,000	2,690.00	37,660,000	
スクウェア・エニックス・HD	28,100	6,380.00	179,278,000	
シーイーシー	7,200	1,376.00	9,907,200	
カプコン	56,800	3,345.00	189,996,000	
西尾レントオール	5,800	2,959.00	17,162,200	
アイ・エス・ビー	4,100	1,276.00	5,231,600	貸付株式数 800株
アゴーラ ホスピタリティ ティーG	52,200	25.00	1,305,000	貸付株式数 5,000株
日本空港ビルデング	23,100	5,020.00	115,962,000	
トランス・コスモス	6,400	3,690.00	23,616,000	
乃村工藝社	27,700	979.00	27,118,300	貸付株式数 500株
ジャステック	4,100	1,268.00	5,198,800	
S C S K	15,300	7,480.00	114,444,000	
藤田観光	2,700	2,400.00	6,480,000	貸付株式数 1,000株
K N T - C Tホールディングス	3,800	1,409.00	5,354,200	貸付株式数 1,500株
日本管財	6,700	2,691.00	18,029,700	貸付株式数 2,600株
トーカイ	6,100	2,352.00	14,347,200	
白 洋 舎	700	2,092.00	1,464,400	貸付株式数 300株
セコム	63,100	8,400.00	530,040,000	
日本システムウエア	2,100	2,482.00	5,212,200	
セントラル警備保障	3,000	2,804.00	8,412,000	貸付株式数 1,200株
アイネス	6,800	1,585.00	10,778,000	貸付株式数 2,400株
丹青社	11,900	856.00	10,186,400	
メイテック	7,800	6,570.00	51,246,000	貸付株式数 700株
T K C	11,500	3,695.00	42,492,500	
富士ソフト	7,200	6,070.00	43,704,000	
応用地質	7,100	1,451.00	10,302,100	
船井総研ホールディング	13,100	3,015.00	39,496,500	
N S D	21,600	2,102.00	45,403,200	貸付株式数 8,400株
進学会ホールディングス	2,600	419.00	1,089,400	貸付株式数 1,000株
丸紅建材リース	500	1,899.00	949,500	貸付株式数 200株
オ オ バ	4,200	882.00	3,704,400	貸付株式数 1,800株
コナミホールディングス	24,000	6,840.00	164,160,000	
いであ	1,500	1,915.00	2,872,500	
学 究 社	1,900	1,400.00	2,660,000	貸付株式数 700株
ベネッセホールディングス	23,600	2,467.00	58,221,200	貸付株式数 9,400株
イオンディライト	7,800	3,620.00	28,236,000	
ナック	2,700	974.00	2,629,800	貸付株式数 300株

福井コンピュータH L D S	3,300	4,400.00	14,520,000		
ダイセキ	12,900	4,890.00	63,081,000	貸付株式数	5,100株
ステップ	2,300	1,901.00	4,372,300	貸付株式数	900株
日鉄物産	4,600	5,250.00	24,150,000		
泉州電業	2,000	5,080.00	10,160,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,800	2,745.00	4,941,000	貸付株式数	700株 (500株)
トラスコ中山	13,800	2,978.00	41,096,400	貸付株式数	2,400株
ヤマダホールディングス	221,000	476.00	105,196,000	貸付株式数	17,200株
オートバックスセブン	23,400	1,511.00	35,357,400	貸付株式数	9,300株
モリト	4,500	699.00	3,145,500		
アークランドサカモト	10,300	1,739.00	17,911,700		
ニトリホールディングス	26,200	22,480.00	588,976,000		
グルメ杵屋	4,100	1,017.00	4,169,700	貸付株式数	1,600株
愛眼	4,400	222.00	976,800	貸付株式数	1,700株
ケーユーホールディングス	3,400	1,023.00	3,478,200	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	21,700	2,247.00	48,759,900	貸付株式数	7,300株
加藤産業	9,300	3,500.00	32,550,000		
北恵	1,800	1,048.00	1,886,400		
イノテック	3,700	1,442.00	5,335,400		
イエローハット	12,000	1,996.00	23,952,000		
松屋フーズH L D G S	2,900	3,660.00	10,614,000	貸付株式数	100株
J B C Cホールディングス	4,200	1,666.00	6,997,200		
J Kホールディングス	5,800	845.00	4,901,000	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	8,700	1,068.00	9,291,600	貸付株式数	3,400株
日伝	5,300	2,527.00	13,393,100	貸付株式数	2,100株
関西スーパーマーケット	4,800	1,985.00	9,528,000	貸付株式数	400株
ミロク情報サービス	6,600	1,718.00	11,338,800	貸付株式数	2,600株
北沢産業	4,300	263.00	1,130,900	貸付株式数	1,000株
杉本商事	3,200	2,987.00	9,558,400		
因幡電機産業	17,500	2,833.00	49,577,500	貸付株式数	3,600株
王将フードサービス	4,100	6,100.00	25,010,000	貸付株式数	1,600株
プレナス	7,500	2,163.00	16,222,500		
ミニストップ	5,400	1,505.00	8,127,000	貸付株式数	1,900株
アークス	12,700	2,359.00	29,959,300	貸付株式数	4,100株
パローホールディングス	13,300	2,541.00	33,795,300		
東テック	2,300	2,797.00	6,433,100	貸付株式数	400株
ミスミグループ本社	82,900	4,805.00	398,334,500		
藤久	1,700	755.00	1,283,500	貸付株式数	600株
アルテック	6,300	318.00	2,003,400		

ベルク	3,200	6,210.00	19,872,000	
大庄	3,100	1,034.00	3,205,400	貸付株式数 1,400株
タキヒヨー	2,100	1,935.00	4,063,500	貸付株式数 800株
ファーストリテイリング	8,900	74,630.00	664,207,000	
ソフトバンクグループ	522,900	6,329.00	3,309,434,100	
蔵王産業	1,000	1,736.00	1,736,000	貸付株式数 200株
スズケン	28,000	3,275.00	91,700,000	
サンドラッグ	25,000	3,650.00	91,250,000	
サックスパーホールディング	5,000	569.00	2,845,000	
ジェコス	4,500	911.00	4,099,500	
ヤマザワ	1,100	1,752.00	1,927,200	貸付株式数 500株
やまや	1,200	2,542.00	3,050,400	貸付株式数 400株 (400株)
グローセル	6,400	417.00	2,668,800	貸付株式数 2,500株
ペルーナ	14,900	849.00	12,650,100	貸付株式数 5,600株
合計			189,973,468,640	

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

(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9月22日から2022年3月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

ダイワ・ノーロード TOPIXファンド

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 2022年3月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託		34,310
コール・ローン		1,293,946
親投資信託受益証券		307,013,256
未収入金		3,962,000
流動資産合計		312,303,512
資産合計		312,303,512
負債の部		
流動負債		
未払解約金		4,658,942
未払受託者報酬		44,868
未払委託者報酬		703,638
その他未払費用		7,384
流動負債合計		5,414,832
負債合計		5,414,832
純資産の部		
元本等		
元本		1,197,190,601
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		109,698,079
（分配準備積立金）		13,881,681
元本等合計		306,888,680
純資産合計		306,888,680
負債純資産合計		312,303,512

(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9月22日 至 2022年3月21日
営業収益	
有価証券売買等損益	15,816,280
営業収益合計	15,816,280
営業費用	
支払利息	49
受託者報酬	44,868
委託者報酬	703,638
その他費用	7,384
営業費用合計	755,939
営業利益又は営業損失（ ）	16,572,219
経常利益又は経常損失（ ）	16,572,219
中間純利益又は中間純損失（ ）	16,572,219
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,494,966
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	100,053,980
剰余金増加額又は欠損金減少額	82,867,410
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	82,867,410
剰余金減少額又は欠損金増加額	60,146,058
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	60,146,058
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	109,698,079

(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9月22日 至 2022年3月21日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年3月21日現在
1. 1 期首元本額	149,367,030円
期中追加設定元本額	140,023,270円
期中一部解約元本額	92,199,699円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	197,190,601口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年9月22日 至 2022年3月21日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年3月21日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年3月21日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2022年3月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5563円 (15,563円)

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年3月21日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,922,675,572
株式	2 3 182,927,101,440
派生商品評価勘定	190,076,900

未収入金		4,352,000
未収配当金		266,030,364
未収利息		501,694
その他未収収益	4	37,685,898
流動資産合計		195,348,423,868
資産合計		195,348,423,868
負債の部		
流動負債		
前受金		166,095,000
未払解約金		295,023,410
未払利息		3,507
受入担保金		9,456,008,310
流動負債合計		9,917,130,227
負債合計		9,917,130,227
純資産の部		
元本等		
元本	1	142,225,562,437
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		43,205,731,204
元本等合計		185,431,293,641
純資産合計		185,431,293,641
負債純資産合計		195,348,423,868

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年9月22日 至 2022年3月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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	2022年3月21日現在
1. 1 期首	2021年9月22日
期首元本額	137,972,449,571円
期中追加設定元本額	11,883,135,548円
期中一部解約元本額	7,630,022,682円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックス	2,992,290,448円
ファンド	
ダイワ・トピックス・イン	5,292,998,945円
デックスファンドV A	
適格機関投資家専用・ダイ	922,313円
ワ・トピックスインデックス	
ファンドV A 2	
ダイワ国内重視バランスファ	24,770,708円
ンド30VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国内重視バランスファ	365,872,561円
ンド50VA(一般投資家私	
募)	

ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	21,795,176円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	680,293,332円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	317,069,908円
D-I's TOPIXイン デックス	32,327,276円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	178,545,699円
iFree TOPIXイン デックス	5,453,825,612円
iFree 8資産バランス	3,713,232,804円
iFree 年金バランス	645,129,959円
DCダイワ日本株式インデッ クス	67,906,313,235円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,212,378,802円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	4,458,612,712円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	4,351,130,350円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	6,132,471,637円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	59,034,206円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	60,518,006円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	1,831,998,340円
ダイワつみたてインデックス バランス30	11,405,521円
ダイワつみたてインデックス バランス50	10,104,336円
ダイワつみたてインデックス バランス70	21,381,125円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	720,845円

	ダイワ世界バランスファンド 40VA	102,172,246円
	ダイワ世界バランスファンド 60VA	125,074,476円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA	5,813,286,212円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	523,940,261円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)	73,437,877円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)	137,373,400円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	235,475,730円
	ダイワファンドラップTOP PIXインデックス	10,931,165,136円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	1,834,646,055円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,760,136,321円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPPIX	1,200,250,099円
	ダイワライフスタイル25	152,217,469円
	ダイワライフスタイル50	602,691,384円
	ダイワライフスタイル75	460,866,442円
	DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)	9,497,685,473円
	計	142,225,562,437円
2.	期末日における受益権の総数	142,225,562,437口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行って おります。 株式 9,260,121,800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 897,050,000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37,097,600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	2022年3月21日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(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	2022年3月21日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	2,505,005,000	-	2,695,160,000	190,155,000
合計	2,505,005,000	-	2,695,160,000	190,155,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2022年3月21日現在
1口当たり純資産額	1.3038円
(1万口当たり純資産額)	(13,038円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年3月31日

資産総額	283,690,571円
負債総額	6,981,102円
純資産総額（ - ）	276,709,469円
発行済数量	172,546,859口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.6037円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2022年3月31日

資産総額	200,743,714,619円
負債総額	9,196,404,465円
純資産総額（ - ）	191,547,310,154円
発行済数量	142,546,971,682口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3437円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2022年3月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に於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せん。

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

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	66	208,634
追加型株式投資信託	781	21,485,357
株式投資信託 合計	847	21,693,991
単位型公社債投資信託	78	193,964
追加型公社債投資信託	14	1,434,851
公社債投資信託 合計	92	1,628,815
総合計	939	23,322,805

3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第62期事業年度（2020年4月1日から2021年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第63期事業年度に係る中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

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

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

(単位:百万円)

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

固定負債計	2,667	2,530
負債合計	16,082	17,256
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,749	10,574
利益剰余金合計	12,123	10,948
株主資本合計	38,793	37,618
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	363	947
評価・換算差額等合計	363	947
純資産合計	38,430	38,566
負債・純資産合計	54,512	55,822

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

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

(単位:百万円)

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益	利益剰余金 合計	
				剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当期変動額						
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 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
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す。

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

5. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

6. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

7. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

(会計方針の変更)

(収益認識に関する会計基準等の適用)

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

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2021年9月30日現在)
有形固定資産	307百万円

2 消費税等の取扱い

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

3 保証債務

当中間会計期間(2021年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,726百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2021年 4月 1日 至 2021年 9月30日)
有形固定資産	12百万円
無形固定資産	289百万円

2 営業外収益の主要項目

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

3 営業外費用の主要項目

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

4 特別損失の項目

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2021年 4月 1日 至 2021年 9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

合計	2,608	-	-	2,608
----	-------	---	---	-------

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2021年6月22日 定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年3月31日	2021年6月23日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、2019年7月4日公表の企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下、「2019年適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

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

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

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

(1) 2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券250百万円、投資有価証券10,621百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価格によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

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

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,677
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2021年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額（百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	85	55	30
（2）その他	7,691	5,841	1,850
小計	7,777	5,896	1,881
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,179	3,398	219
小計	3,179	3,398	219
合計	10,956	9,294	1,661

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 666百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

注記事項（セグメント情報等）に記載のとおり、単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えており、かつ、内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、セグメント情報に追加しての記載は行っておりません。

〔セグメント情報等〕

〔セグメント情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

〔関連情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

〔1株当たり情報〕

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

1株当たり中間純利益

2,456.52円

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

(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

2022年4月1日付で、定款について次の変更を致しました。

- ・ 監査役の人数の変更（4名以内から5名以内に変更）

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	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)	

(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。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行いません。

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

- ・ 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
 - ・ 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
 - ・ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
 - ・ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
 - 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
 - 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
 - ・ 使用開始日を記載することがあります。
 - ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
 - 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
 - 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
 - ・ 次の事項を記載することがあります。
 - 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
 - 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
 - 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
 - ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
 - ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
 - ・ 図案を採用することがあります。
 - ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
 - ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
 - ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

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11月5日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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・ノーロードTOPIXファンドの2020年9月24日から2021年9月21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・ノーロードTOPIXファンドの2021年9月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

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

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

利害関係

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

以上

- (注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- (注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年4月28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 公認会計士 深井 康治
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明
業務執行社員**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・ノーロード TOPIXファンドの2021年9月22日から2022年3月21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・ノーロード TOPIXファンドの2022年3月21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9月22日から2022年3月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注) 1 . 上記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。