

## 【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】	2023年6月13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】

2023年6月14日から2023年12月12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）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。

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 >

**1** わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数(TOPIX)(配当込み)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(配当込み)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。
- 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。
  - ポートフォリオは、東証株価指数(配当込み)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(配当込み)との連動性を維持するよう構築します。
  - 株式の組入比率は、高位を保ちます。

#### 運用プロセス



ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるTOPIX(配当込み)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

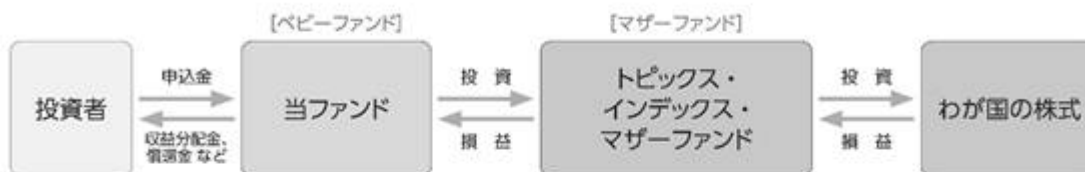
東証株価指数(TOPIX)は、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークであり、日本経済の動向を示すパラメーターとして経済指標、ETFの連動指標などに用いられています。



## 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、分配を行なわないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 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 配当込み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）（配当込み）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</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 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。

## &lt; 委託会社の概況（2023年3月末日現在） &gt;

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

## ・ 沿革

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

## ・ 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## 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）（配当込み）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) (1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35～45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2023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（配当込み）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。

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

ロ．ポートフォリオは、東証株価指数（配当込み）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（配当込み）との連動性を維持するよう構築します。

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

#### (2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

### (3) 主な投資制限

#### 株式

株式への投資には、制限を設けません。

#### 先物取引等

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

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

#### スワップ取引

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

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

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

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

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

## 3【投資リスク】

### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

## (2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受付を中止すること、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。

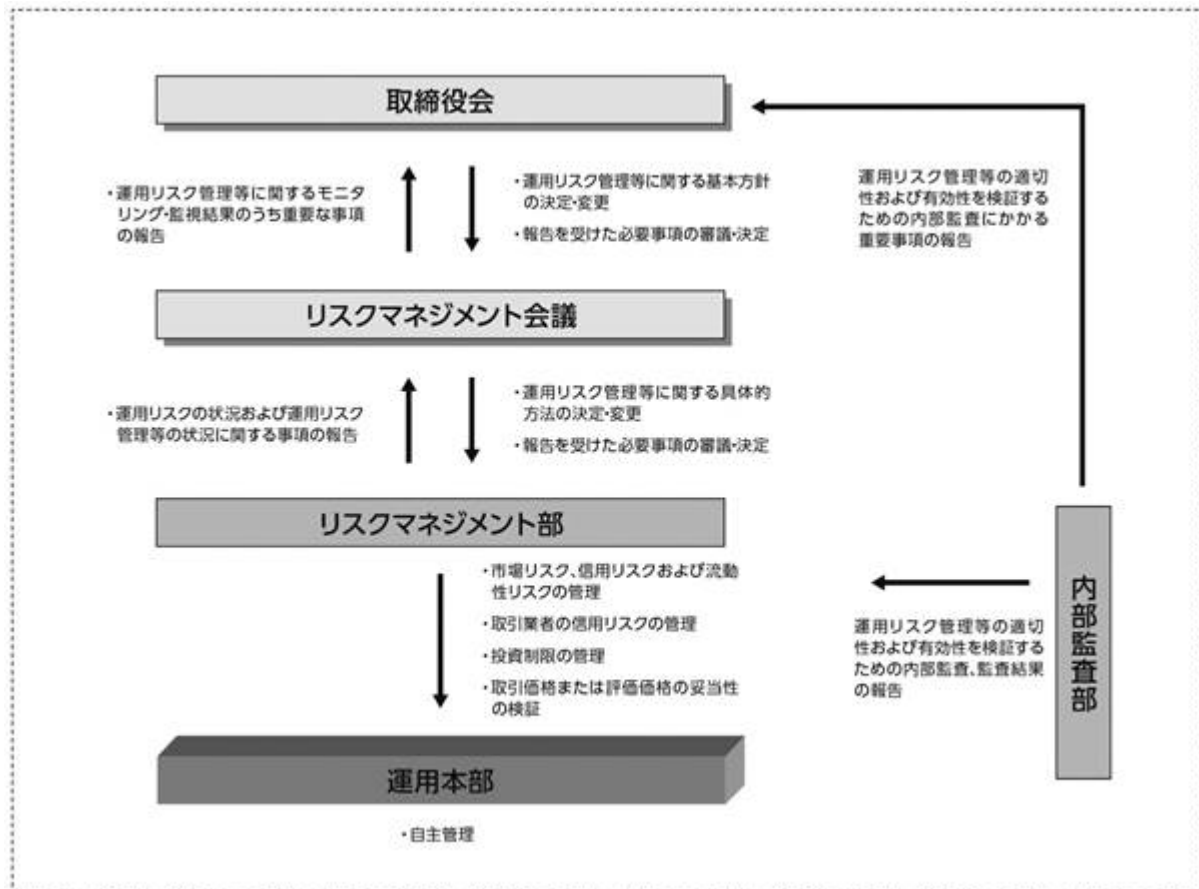
### 流動性リスクに関する事項

- 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。



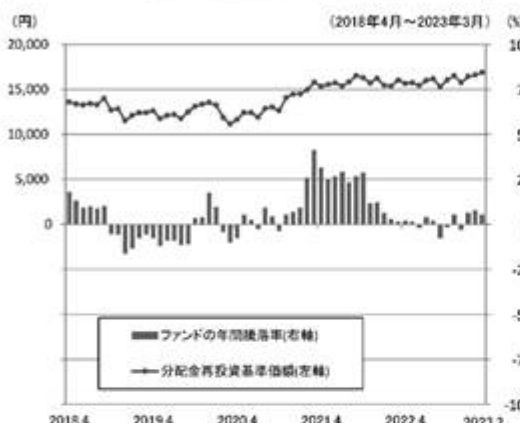
## 流動性リスクに対する管理体制

- ・ 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。

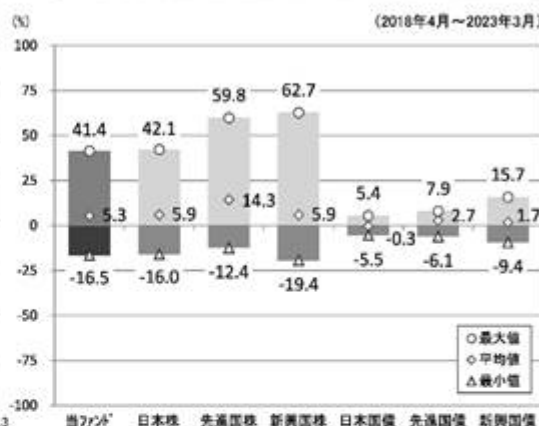
## 参考情報

- 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：配当込みTOPIX  
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）  
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）  
 日本国債：NOMURA-BPI国債  
 先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）  
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

### ※指数について

●配当込み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「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準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P X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.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[ <https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html> ] ●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット 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、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、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）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」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「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」の適用対象です。毎年、一定額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一定期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、2023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】（2023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	301,802,720	99.99
内 日本	301,802,720	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	21,296	0.01
純資産総額	301,824,016	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】（2023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 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	212,327,790	1.3458 285,761,241	1.4214 301,802,720	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
第6計算期間末 (2021年9月21日)	249,421,010	249,421,010	1.6699	1.6699
2022年3月末日	276,709,469	-	1.6037	-
4月末日	311,676,710	-	1.5647	-
5月末日	316,474,872	-	1.5757	-
6月末日	285,023,255	-	1.5429	-
7月末日	280,105,789	-	1.5997	-
8月末日	289,414,701	-	1.6184	-
第7計算期間末 (2022年9月20日)	298,114,186	298,114,186	1.6050	1.6050
9月末日	304,394,799	-	1.5290	-
10月末日	293,264,774	-	1.6061	-
11月末日	278,979,965	-	1.6529	-
12月末日	290,021,952	-	1.5769	-
2023年1月末日	287,241,223	-	1.6457	-
2月末日	290,156,748	-	1.6606	-
3月末日	301,824,016	-	1.6882	-

【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
第7計算期間	0.0000
2022年9月21日～ 2023年3月20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
第7計算期間	3.9
2022年9月21日～ 2023年3月20日	0.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第7計算期間	260,199,112	223,820,922
2022年9月21日～ 2023年3月20日	82,723,184	88,276,712

(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 (2023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	210,740,552,220	97.25
内 日本	210,740,552,220	97.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,967,883,960	2.75
純資産総額	216,708,436,180	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)	5,810,150,000	2.68
内 日本	5,810,150,000	2.68

(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 (2023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 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4,027,200	2,036.91 8,203,049,440	1,880.00 7,571,136,000	3.49
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	518,800	10,379.49 5,384,881,438	11,985.00 6,217,818,000	2.87
3	キーエンス	日本	株式	電気機器	73,400	51,552.03 3,783,919,711	64,450.00 4,730,630,000	2.18
4	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,522,300	738.83 3,341,214,526	847.90 3,834,458,170	1.77
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	942,500	3,918.14 3,692,848,023	3,962.00 3,734,185,000	1.72
6	第一三共	日本	株式	医薬品	640,800	4,236.18 2,714,550,039	4,822.00 3,089,937,600	1.43
7	武田薬品	日本	株式	医薬品	651,000	3,856.44 2,510,545,072	4,350.00 2,831,850,000	1.31
8	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	527,900	4,395.62 2,320,451,138	5,298.00 2,796,814,200	1.29

9	日立	日本	株式	電気機器	360,200	6,731.97 2,424,855,969	7,252.00 2,612,170,400	1.21
10	信越化学	日本	株式	化学	610,500	3,194.82 1,950,441,338	4,275.00 2,609,887,500	1.20
11	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	155,100	13,756.68 2,133,661,636	16,040.00 2,487,804,000	1.15
12	任天堂	日本	株式	その他製品	463,000	6,138.91 2,842,316,588	5,131.00 2,375,653,000	1.10
13	三井物産	日本	株式	卸売業	567,800	3,344.06 1,898,757,891	4,116.00 2,337,064,800	1.08
14	KDDI	日本	株式	情報・通信業	568,400	4,351.49 2,473,391,802	4,093.00 2,326,461,200	1.07
15	三菱商事	日本	株式	卸売業	485,200	4,377.45 2,123,940,632	4,751.00 2,305,185,200	1.06
16	HOYA	日本	株式	精密機器	156,600	14,439.88 2,261,285,426	14,560.00 2,280,096,000	1.05
17	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	425,300	5,512.67 2,344,542,758	5,182.00 2,203,904,600	1.02
18	本田技研	日本	株式	輸送用機器	596,200	3,532.86 2,106,293,372	3,510.00 2,092,662,000	0.97
19	ダイキン工業	日本	株式	機械	88,400	24,016.95 2,123,099,038	23,655.00 2,091,102,000	0.96
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	478,200	3,818.37 1,825,947,259	4,301.00 2,056,738,200	0.95
21	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	558,200	4,374.09 2,441,621,775	3,650.00 2,037,430,000	0.94
22	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,044,600	1,675.69 1,750,435,109	1,878.00 1,961,758,800	0.91
23	東京海上HD	日本	株式	保険業	727,400	2,637.84 1,918,770,419	2,547.00 1,852,687,800	0.85
24	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,181,700	1,503.06 1,776,169,313	1,529.00 1,806,819,300	0.83
25	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	399,000	4,066.38 1,622,485,871	4,528.00 1,806,672,000	0.83
26	村田製作所	日本	株式	電気機器	222,500	7,391.20 1,644,543,068	8,040.00 1,788,900,000	0.83
27	ファナック	日本	株式	電気機器	360,000	4,355.15 1,567,856,185	4,760.00 1,713,600,000	0.79
28	S M C	日本	株式	機械	24,000	63,215.24 1,517,165,886	69,830.00 1,675,920,000	0.77



29	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	267,400	5,975.50 1,597,848,968	5,975.00 1,597,715,000	0.74
30	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	475,500	2,432.16 1,156,495,235	2,798.00 1,330,449,000	0.61

(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	97.25%
合計	97.25%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.29%
建設業	1.91%
食料品	3.44%
繊維製品	0.46%
パルプ・紙	0.17%
化学	6.14%
医薬品	5.41%
石油・石炭製品	0.45%
ゴム製品	0.76%
ガラス・土石製品	0.71%
鉄鋼	0.91%
非鉄金属	0.72%
金属製品	0.56%
機械	5.27%
電気機器	17.56%
輸送用機器	7.26%
精密機器	2.52%
その他製品	2.19%
電気・ガス業	1.18%
陸運業	2.88%
海運業	0.59%
空運業	0.48%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	8.41%

卸売業	6.02%
小売業	4.42%
銀行業	5.76%
証券、商品先物取引業	0.72%
保険業	2.09%
その他金融業	1.06%
不動産業	1.78%
サービス業	4.93%
合計	97.25%

(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 050 6月	買建	290	5,758,765,700	5,810,150,000	2.68%

(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

2023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	16,882円
純資産総額	3.0億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.7%
3カ月間	7.1%
6カ月間	10.4%
1年間	5.3%
3年間	51.1%
5年間	28.4%
設定来	68.8%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円							設定来分配金合計額: 0円		
	第1期 16年9月	第2期 17年9月	第3期 18年9月	第4期 19年9月	第5期 20年9月	第6期 21年9月	第7期 22年9月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成		銘柄数		比率		株式東証33業種別構成		比率		組入上位10銘柄		業種名		比率	
国内株式	2,140	97.2%	電気機器	17.6%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.5%								
国内株式先物	1	2.7%	情報・通信業	8.4%	ソニーグループ	電気機器	2.9%								
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	7.3%	TOPIX先物 0506月	-	2.7%								
コール・ローン、その他	-	2.8%	化学	6.1%	キーエンス	電気機器	2.2%								
合計	2,141	-	卸売業	6.0%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.8%								
株式 市場・上場別構成			銀行業	5.8%	日本電信電話	情報・通信業	1.7%								
東証プライム市場	96.7%		医薬品	5.4%	第一三共	医薬品	1.4%								
東証スタンダード市場	0.5%		機械	5.3%	武田薬品	医薬品	1.3%								
東証グロス市場	-		サービス業	4.9%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.3%								
地方市場・その他	-		その他	30.5%	日立	電気機器	1.2%								
合計	97.2%		合計	97.2%	合計		19.9%								

※先物の種玉がある場合は、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(TOPIX)(配当込み)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、2023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。

## (参考情報) ファンドの総経費率

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
ダイワ・ノーロード TOPIXファンド	0.53%	0.53%	0.01%

※対象期間は2021年9月22日～2022年9月20日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。)を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。



## 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（配当込み）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)を計算期間の末日および償還時に作成し、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ます。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

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

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

< 換金請求権 >

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（2021年9月22日から2022年9月20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6期 2021年9月21日現在	第7期 2022年9月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,632,766	861,931
親投資信託受益証券	249,403,536	298,093,602
未収入金	1,006,000	-
流動資産合計	252,042,302	298,955,533
資産合計	252,042,302	298,955,533
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,984,042	99,679
未払受託者報酬	37,827	48,054
未払委託者報酬	593,201	685,653
その他未払費用	6,222	7,961
流動負債合計	2,621,292	841,347
負債合計	2,621,292	841,347
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,149,367,030	1,185,745,220
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	100,053,980	112,368,966
（分配準備積立金）	23,899,957	8,044,136
元本等合計	249,421,010	298,114,186
純資産合計	249,421,010	298,114,186
負債純資産合計	252,042,302	298,955,533

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自	2020年9月24日 至 2021年9月21日	自	2021年9月22日 至 2022年9月20日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		53,434,910		2,811,934
<b>営業収益合計</b>		<b>53,434,910</b>		<b>2,811,934</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		150		75
受託者報酬		67,489		93,199
委託者報酬		1,058,616		1,393,640
その他費用		11,084		15,345
<b>営業費用合計</b>		<b>1,137,339</b>		<b>1,502,259</b>
営業利益又は営業損失（ ）		52,297,571		4,314,193
経常利益又は経常損失（ ）		52,297,571		4,314,193
当期純利益又は当期純損失（ ）		52,297,571		4,314,193
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		29,587,034		5,538,133
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		41,766,862		100,053,980
剰余金増加額又は欠損金減少額		147,246,523		151,172,082
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		147,246,523		151,172,082
剰余金減少額又は欠損金増加額		111,669,942		140,081,036
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		111,669,942		140,081,036
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		100,053,980		112,368,966

## (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7期	
	自 2021年9月22日	至 2022年9月20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  2021年9月19日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2021年9月21日としており、2022年9月19日が休日のため、当計算期間末日を2022年9月20日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第6期	第7期
	2021年9月21日現在	2022年9月20日現在
1. 1 期首元本額	135,736,829円	149,367,030円
期中追加設定元本額	288,238,062円	260,199,112円
期中一部解約元本額	274,607,861円	223,820,922円
2. 計算期間末日における受益権の総数	149,367,030口	185,745,220口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第6期	第7期
	自 2020年9月24日 至 2021年9月21日	自 2021年9月22日 至 2022年9月20日

<p>1 分配金の計算過程</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(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>	<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(1,223,953円)、投資信託約款に規定される収益調整金(104,324,879円)及び分配準備積立金(6,820,183円)より分配対象額は112,369,015円(1万口当たり6,049.63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7期 自 2021年9月22日 至 2022年9月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第7期
	2022年9月20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6期	第7期
	2021年9月21日現在	2022年9月20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	27,824,722	694,455
合計	27,824,722	694,455

## （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6期	第7期
2021年9月21日現在	2022年9月20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7期
自 2021年9月22日
至 2022年9月20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6期	第7期
	2021年9月21日現在	2022年9月20日現在
1口当たり純資産額	1.6699円	1.6050円
（1万口当たり純資産額）	（16,699円）	（16,050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	221,137,687	298,093,602	
親投資信託受益証券 合計			298,093,602	
合計			298,093,602	

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

	2021年9月21日現在	2022年9月20日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,388,192,763	14,544,002,321
株式	2 3 189,973,468,640	190,358,800,810

派生商品評価勘定		277,800	58,409,600
未収配当金		69,858,959	85,377,722
未収利息		581,660	402,872
その他未収収益	4	3,470,064	5,697,768
差入委託証拠金		-	66,270,000
流動資産合計		201,435,849,886	205,118,961,093
資産合計		201,435,849,886	205,118,961,093
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,815,650	741,000
前受金		34,675,000	30,755,000
未払金		79,161,000	-
未払解約金		229,583,550	37,544,320
受入担保金		8,605,893,975	8,030,704,184
流動負債合計		8,953,129,175	8,099,744,504
負債合計		8,953,129,175	8,099,744,504
純資産の部			
元本等			
元本	1	137,972,449,571	146,161,636,928
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		54,510,271,140	50,857,579,661
元本等合計		192,482,720,711	197,019,216,589
純資産合計		192,482,720,711	197,019,216,589
負債純資産合計		201,435,849,886	205,118,961,093

## 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9月20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	2021年9月21日現在	2022年9月20日現在
1. 1 期首	2020年9月24日	2021年9月22日
期首元本額	144,273,817,223円	137,972,449,571円
期中追加設定元本額	20,154,777,070円	21,891,192,489円
期中一部解約元本額	26,456,144,722円	13,702,005,132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	2,989,191,828円	2,913,315,600円
ファンド		

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	5,882,696,138円	5,057,552,549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	925,539円	919,050円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	25,469,299円	22,914,284円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	429,078,400円	306,153,651円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	23,164,900円	20,861,610円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	721,398,709円	620,077,228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)	212,609,568円	424,026,190円
D-I's TOPIXイン デックス	50,045,732円	31,216,024円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	112,275,070円	209,861,004円
iFree TOPIXイン デックス	4,271,085,355円	6,024,963,119円
iFree 8資産バランス	3,194,833,049円	4,243,393,048円
iFree 年金バランス	442,601,861円	754,549,149円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,726,059,110円	68,855,675,811円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,904,866,842円	3,261,884,393円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,951,974,309円	4,664,787,412円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,760,977,295円	4,626,300,873円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	5,858,241,088円	6,602,474,346円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	50,696,932円	59,540,051円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	51,725,840円	69,149,114円

ダイワつみたてインデックス 日本株式	1,353,026,496円	2,398,708,347円
ダイワつみたてインデックス バランス30	9,628,593円	12,198,543円
ダイワつみたてインデックス バランス50	8,568,294円	10,134,564円
ダイワつみたてインデックス バランス70	17,409,216円	25,524,777円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	- 円	964,722,382円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	113,101,715円	80,584,476円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	130,262,046円	44,620,861円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	6,161,189,519円	5,365,977,076円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	559,246,637円	495,127,448円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	80,610,399円	70,111,584円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	146,638,577円	105,903,266円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	178,771,082円	221,137,687円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,294,148,277円	11,537,778,484円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	2,512,120,167円	1,659,502,574円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,644,643,973円	3,228,157,904円
ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,211,577,472円	1,206,704,313円
ダイワライフスタイル25	153,686,797円	134,931,541円
ダイワライフスタイル50	617,422,037円	556,481,026円
ダイワライフスタイル75	487,367,793円	423,712,951円
DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)	10,633,113,617円	8,850,002,618円

計	137,972,449,571円	146,161,636,928円
2. 期末日における受益権の総数	137,972,449,571口	146,161,636,928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 8,131,613,200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 7,650,814,500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 949,460,000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 846,840,000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2,759,549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5,125,370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 2021年9月22日 至 2022年9月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。  デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年9月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2021年9月21日現在	2022年9月20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	36,459,373,632	9,854,133,695
合計	36,459,373,632	9,854,133,695

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年9月24日から2021年9月21日まで、及び2021年9月22日から2022年9月20日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	2021年9月21日 現在				2022年9月20日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)

市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,791,775,000	-	1,788,285,000	3,490,000	6,644,620,000	-	6,702,480,000	57,860,000
合計	1,791,775,000	-	1,788,285,000	3,490,000	6,644,620,000	-	6,702,480,000	57,860,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	2021年9月21日現在	2022年9月20日現在
1口当たり純資産額	1.3951円	1.3480円
(1万口当たり純資産額)	(13,951円)	(13,480円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極 洋	3,300	3,670.00	12,111,000	
日本水産	96,700	546.00	52,798,200	
マル八二チ口	13,800	2,416.00	33,340,800	
雪国まいたけ	7,500	996.00	7,470,000	貸付株式数 200株
カネコ種苗	3,000	1,549.00	4,647,000	
サカタのタネ	11,300	4,845.00	54,748,500	貸付株式数 4,400株
ホクト	7,900	1,915.00	15,128,500	貸付株式数 400株
ホクリヨウ	1,300	609.00	791,700	貸付株式数 200株
ショーボンドHD	12,100	6,290.00	76,109,000	
ミライト・ワン	33,500	1,534.00	51,389,000	
タマホーム	6,300	2,374.00	14,956,200	貸付株式数 2,500株
サンヨーホームズ	1,800	692.00	1,245,600	貸付株式数 400株



日本アクア	4,200	668.00	2,805,600	貸付株式数	100株
ファーストコーポレーション	2,600	734.00	1,908,400	貸付株式数	300株
ベステラ	2,100	1,007.00	2,114,700	貸付株式数	800株
キャンディル	1,500	596.00	894,000	貸付株式数	700株
住石ホールディングス	18,600	234.00	4,352,400	貸付株式数	7,100株
日鉄鉱業	2,000	5,840.00	11,680,000		
三井松島HLDGS	4,400	3,335.00	14,674,000	貸付株式数	1,700株
INPEX	329,600	1,507.00	496,707,200	貸付株式数	146,700株
石油資源開発	12,300	3,745.00	46,063,500		
K&Oエナジーグループ	4,000	1,663.00	6,652,000	貸付株式数	100株
ダイセキ環境ソリューション	2,000	911.00	1,822,000	貸付株式数	700株
第一カッター興業	2,200	1,274.00	2,802,800		
明豊ファシリティワークス	3,400	674.00	2,291,600	貸付株式数	1,200株
安藤・間	47,200	893.00	42,149,600		
東急建設	28,000	676.00	18,928,000		
コムシスホールディングス	33,400	2,569.00	85,804,600		
ビーアールホールディングス	12,800	351.00	4,492,800	貸付株式数	5,100株
高松コンストラクションGP	6,900	1,920.00	13,248,000		
東建コーポレーション	2,900	8,200.00	23,780,000	貸付株式数	1,100株
ソネック	1,100	1,023.00	1,125,300	貸付株式数	400株 (100株)
ヤマウラ	4,800	970.00	4,656,000	貸付株式数	1,800株
オリエンタル白石	35,000	253.00	8,855,000		
大成建設	66,600	4,305.00	286,713,000		
大林組	222,600	984.00	219,038,400		
清水建設	205,900	763.00	157,101,700		
飛島建設	6,200	1,073.00	6,652,600		
長谷工コーポレーション	64,300	1,654.00	106,352,200		
松井建設	8,000	581.00	4,648,000	貸付株式数	600株
銭高組	900	3,170.00	2,853,000	貸付株式数	300株
鹿島建設	163,100	1,491.00	243,182,100		
不動テトラ	5,000	1,544.00	7,720,000	貸付株式数	200株
大末建設	2,600	1,552.00	4,035,200	貸付株式数	100株
鉄建建設	4,700	1,800.00	8,460,000		
西松建設	14,500	4,180.00	60,610,000	貸付株式数	5,700株
三井住友建設	53,500	455.00	24,342,500	貸付株式数	400株

大豊建設	3,500	4,330.00	15,155,000	貸付株式数	1,000株
佐田建設	4,900	423.00	2,072,700	貸付株式数	1,900株
ナカノフドー建設	5,400	301.00	1,625,400	貸付株式数	1,500株
奥村組	11,800	2,984.00	35,211,200		
東鉄工業	9,500	2,387.00	22,676,500		
イチケン	1,700	1,815.00	3,085,500	貸付株式数	200株
富士ピー・エス	3,500	469.00	1,641,500	貸付株式数	1,300株 (200株)
浅沼組	5,200	2,729.00	14,190,800	貸付株式数	200株
戸田建設	91,800	769.00	70,594,200		
熊谷組	11,800	2,604.00	30,727,200		
北野建設	1,400	2,356.00	3,298,400	貸付株式数	500株
植木組	2,100	1,251.00	2,627,100	貸付株式数	800株
矢作建設	10,100	769.00	7,766,900		
ピーエス三菱	7,800	644.00	5,023,200		
日本ハウスHLDGS	12,600	460.00	5,796,000	貸付株式数	5,700株
大東建託	24,600	14,780.00	363,588,000		
新日本建設	10,500	717.00	7,528,500		
東亜道路	1,300	6,010.00	7,813,000		
日本道路	2,100	5,950.00	12,495,000		
東亜建設	5,300	2,433.00	12,894,900		
日本国土開発	18,800	619.00	11,637,200	貸付株式数	800株
若築建設	3,800	2,170.00	8,246,000	貸付株式数	1,400株
東洋建設	27,100	862.00	23,360,200		
五洋建設	88,200	734.00	64,738,800	貸付株式数	700株
世紀東急	10,800	760.00	8,208,000	貸付株式数	200株
福田組	2,400	4,945.00	11,868,000	貸付株式数	800株
日本ドライケミカル	1,700	1,508.00	2,563,600	貸付株式数	600株
住友林業	47,800	2,351.00	112,377,800	貸付株式数	13,300株
日本基礎技術	5,900	485.00	2,861,500	貸付株式数	2,300株
巴コーポレーション	9,600	407.00	3,907,200	貸付株式数	200株
大和ハウス	189,700	3,115.00	590,915,500		
ライト工業	13,200	1,948.00	25,713,600		
積水ハウス	227,600	2,515.00	572,414,000		
日特建設	5,100	969.00	4,941,900		
北陸電気工事	4,100	735.00	3,013,500		
ユアテック	13,900	742.00	10,313,800		
日本リーテック	4,600	817.00	3,758,200		
四電工	2,300	1,871.00	4,303,300		
中電工	9,200	2,160.00	19,872,000		

関電工	39,100	858.00	33,547,800	
きんでん	48,800	1,542.00	75,249,600	
東京エネシス	7,000	1,002.00	7,014,000	
トーエネック	2,400	3,520.00	8,448,000	
住友電設	5,900	2,676.00	15,788,400	
日本電設工業	10,200	1,822.00	18,584,400	
エクシオグループ	33,000	2,177.00	71,841,000	
新日本空調	5,200	1,841.00	9,573,200	貸付株式数 1,400株
日本工営	4,600	3,675.00	16,905,000	
九電工	15,200	2,871.00	43,639,200	
三機工業	15,600	1,680.00	26,208,000	
日揮ホールディングス	67,900	1,964.00	133,355,600	
中外炉工業	2,200	1,594.00	3,506,800	貸付株式数 700株
ヤマト	5,900	785.00	4,631,500	貸付株式数 2,100株
太平電業	4,300	3,410.00	14,663,000	貸付株式数 200株
高砂熱学	18,200	1,682.00	30,612,400	
三晃金属	1,000	2,716.00	2,716,000	貸付株式数 200株
NEC ネットエスアイ	24,800	1,610.00	39,928,000	
朝日工業社	2,900	1,807.00	5,240,300	
明星工業	12,000	727.00	8,724,000	
大気社	10,000	3,315.00	33,150,000	
ダイダン	4,400	2,245.00	9,878,000	
日比谷総合設備	6,400	1,874.00	11,993,600	
ニッポン	18,600	1,553.00	28,885,800	
日清製粉G本社	72,300	1,446.00	104,545,800	
日東富士製粉	1,100	4,555.00	5,010,500	
昭和産業	6,000	2,504.00	15,024,000	
鳥越製粉	5,400	660.00	3,564,000	貸付株式数 1,300株
中部飼料	7,800	1,083.00	8,447,400	貸付株式数 3,100株
フィード・ワン	8,900	697.00	6,203,300	
東洋精糖	1,000	873.00	873,000	
日本甜菜糖	3,900	1,610.00	6,279,000	貸付株式数 1,000株
DM三井製糖ホールディ	6,100	1,893.00	11,547,300	
塩水港精糖	7,900	202.00	1,595,800	貸付株式数 3,200株
日新製糖	3,500	1,739.00	6,086,500	
LIFULL	22,500	167.00	3,757,500	貸付株式数 3,400株
ミクシィ	16,700	2,397.00	40,029,900	
ジェイエイシーリクルート メント	6,000	2,090.00	12,540,000	

日本M & A センターホール デ	119,800	1,738.00	208,212,400		
メンバーズ	1,900	2,557.00	4,858,300	貸付株式数	700株
中広	1,100	401.00	441,100	貸付株式数	400株
UTグループ	10,500	2,663.00	27,961,500		
アイティメディア	3,400	1,630.00	5,542,000	貸付株式数	1,200株
E・Jホールディングス	4,200	1,298.00	5,451,600	貸付株式数	1,600株
夢真ビーネックスグルー フ	23,900	1,678.00	40,104,200		
コシダカホールディングス	19,500	896.00	17,472,000	貸付株式数	6,100株
アルトナー	1,900	987.00	1,875,300		
パソナグループ	7,900	1,996.00	15,768,400		
CDS	1,900	1,691.00	3,212,900	貸付株式数	700株
リンクアンドモチベーシ ョン	18,900	713.00	13,475,700	貸付株式数	7,500株
エス・エム・エス	24,900	3,010.00	74,949,000		
サニーサイドアップG	2,500	598.00	1,495,000	貸付株式数	100株
パーソルホールディングス	73,100	2,783.00	203,437,300		
リニカル	4,200	725.00	3,045,000	貸付株式数	700株
クックパッド	17,700	210.00	3,717,000	貸付株式数	5,200株
エスクリ	3,500	369.00	1,291,500	貸付株式数	1,300株
アイ・ケイ・ケイホール ディンク	3,700	633.00	2,342,100	貸付株式数	1,400株
森永製菓	15,500	3,845.00	59,597,500		
中村屋	1,600	3,150.00	5,040,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	17,900	3,465.00	62,023,500	貸付株式数	7,100株 (1,700株)
名糖産業	2,800	1,649.00	4,617,200	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	3,800	2,249.00	8,546,200	貸付株式数	1,500株
不二家	4,400	2,430.00	10,692,000		
山崎製パン	42,000	1,627.00	68,334,000		
第一屋製パン	600	449.00	269,400	貸付株式数	300株
モロゾフ	2,300	3,665.00	8,429,500		
亀田製菓	4,000	4,490.00	17,960,000	貸付株式数	1,500株
寿スピリッツ	6,700	8,270.00	55,409,000	貸付株式数	2,600株
カルビー	35,000	2,965.00	103,775,000		
森永乳業	13,000	4,120.00	53,560,000		
六甲バター	4,500	1,436.00	6,462,000	貸付株式数	1,600株
ヤクルト	48,800	8,220.00	401,136,000		
明治ホールディングス	42,300	6,440.00	272,412,000		
雪印メグミルク	16,900	1,671.00	28,239,900		

プリマハム	9,600	2,111.00	20,265,600	
日本ハム	26,900	3,900.00	104,910,000	
林兼産業	1,700	460.00	782,000	貸付株式数 400株
丸大食品	6,800	1,478.00	10,050,400	貸付株式数 2,600株
S Foods	6,900	2,952.00	20,368,800	貸付株式数 2,700株
柿安本店	2,700	2,290.00	6,183,000	貸付株式数 900株
伊藤ハム米久HLDGS	48,500	669.00	32,446,500	
学情	3,000	1,389.00	4,167,000	貸付株式数 1,100株
スタジオアリス	3,300	2,183.00	7,203,900	貸付株式数 1,300株 (100株)
クロスキャット	4,100	1,315.00	5,391,500	貸付株式数 1,600株
シミックホールディングス	3,700	1,588.00	5,875,600	貸付株式数 1,400株
エプコ	1,600	634.00	1,014,400	貸付株式数 600株
システナ	107,000	420.00	44,940,000	
NJS	1,300	1,975.00	2,567,500	貸付株式数 500株
デジタルアーツ	4,000	6,630.00	26,520,000	
日鉄ソリューションズ	13,000	3,560.00	46,280,000	
総合警備保障	26,700	3,630.00	96,921,000	
キューブシステム	3,900	1,019.00	3,974,100	貸付株式数 1,500株 (200株)
いちご	84,400	305.00	25,742,000	
WOW WORLD	1,000	866.00	866,000	
日本駐車場開発	75,800	196.00	14,856,800	貸付株式数 30,000株
コア	3,100	1,395.00	4,324,500	貸付株式数 900株
カカクコム	53,600	2,612.00	140,003,200	
アイロムグループ	2,700	2,420.00	6,534,000	
セントケア・ホールディング	4,800	831.00	3,988,800	
サイネックス	1,200	596.00	715,200	貸付株式数 200株
ルネサンス	5,100	994.00	5,069,400	貸付株式数 1,900株
ディップ	12,900	3,900.00	50,310,000	貸付株式数 4,000株
SBSホールディングス	5,600	2,969.00	16,626,400	
デジタルホールディングス	5,100	1,288.00	6,568,800	貸付株式数 1,800株
新日本科学	9,000	2,573.00	23,157,000	貸付株式数 3,100株
キャリアデザインセンター	1,600	1,455.00	2,328,000	
ベネフィット・ワン	26,400	2,101.00	55,466,400	
エムスリー	128,900	4,328.00	557,879,200	
ツカダ・グローバルHOLD	4,600	368.00	1,692,800	貸付株式数 1,800株
プラス	1,000	910.00	910,000	

アウトソーシング	38,900	1,275.00	49,597,500		
ウェルネット	6,700	592.00	3,966,400	貸付株式数	2,500株
ワールドホールディングス	2,900	2,749.00	7,972,100	貸付株式数	1,000株
ディー・エヌ・エー	27,900	1,937.00	54,042,300		
博報堂D Y H L D G S	92,400	1,130.00	104,412,000		
ぐるなび	10,600	460.00	4,876,000	貸付株式数	100株
タカミヤ	8,800	412.00	3,625,600		
ジャパンベストレスキュー S	4,100	729.00	2,988,900		
ファンコミュニケーションズ	12,800	419.00	5,363,200	貸付株式数	5,100株
ライク	2,400	2,191.00	5,258,400		
ビジネス・ブレークスルー	2,500	403.00	1,007,500	貸付株式数	1,000株
エスプール	18,800	1,023.00	19,232,400	貸付株式数	700株
W D B ホールディングス	3,400	2,623.00	8,918,200		
手間いらず	1,100	5,260.00	5,786,000	貸付株式数	400株
ティア	4,100	437.00	1,791,700	貸付株式数	1,600株
C D G	600	1,258.00	754,800	貸付株式数	200株
アドウェイズ	9,000	740.00	6,660,000	貸付株式数	4,300株
バリューコマース	4,900	2,298.00	11,260,200	貸付株式数	2,200株
インフォマート	67,800	433.00	29,357,400		
サッポロホールディングス	20,700	3,195.00	66,136,500		
アサヒグループホールディ ン	144,400	4,750.00	685,900,000	貸付株式数	63,600株
キリンHD	282,100	2,280.50	643,329,050	貸付株式数	112,800株
宝ホールディングス	42,700	1,080.00	46,116,000		
オエノンホールディングス	17,500	280.00	4,900,000	貸付株式数	6,500株
養命酒	2,000	1,818.00	3,636,000	貸付株式数	700株
コカ・コーラボトラーズJ HD	48,900	1,432.00	70,024,800	貸付株式数	19,500株
サントリー食品インター	44,000	5,150.00	226,600,000	貸付株式数	18,000株
ダイドーグループHD	3,900	4,825.00	18,817,500	貸付株式数	1,500株
伊藤園	23,300	5,940.00	138,402,000	貸付株式数	9,300株
キーコーヒー	7,000	2,109.00	14,763,000	貸付株式数	2,700株
ユニカフェ	2,000	918.00	1,836,000	貸付株式数	800株
ジャパンフーズ	1,100	1,101.00	1,211,100	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	8,700	3,185.00	27,709,500		
不二製油グループ	16,600	2,415.00	40,089,000	貸付株式数	100株
かどや製油	700	3,585.00	2,509,500	貸付株式数	200株
J - オイルミルズ	6,800	1,554.00	10,567,200		

ローソン	16,700	4,720.00	78,824,000	貸付株式数	6,600株
サンエー	5,100	4,310.00	21,981,000	貸付株式数	600株
カワチ薬品	5,800	2,105.00	12,209,000	貸付株式数	2,300株
エービーシー・マート	11,800	6,400.00	75,520,000		
ハードオフコーポレーション	3,200	1,307.00	4,182,400	貸付株式数	100株
高千穂交易	2,700	2,178.00	5,880,600	貸付株式数	1,000株
アスクル	16,200	1,660.00	26,892,000	貸付株式数	4,200株
ゲオホールディングス	9,100	1,708.00	15,542,800		
アダストリア	8,200	2,196.00	18,007,200	貸付株式数	3,600株
ジーフット	4,900	303.00	1,484,700	貸付株式数	1,900株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	394.00	315,200	貸付株式数	300株
オルバヘルスケアHLDGS	1,200	1,421.00	1,705,200	貸付株式数	100株
伊藤忠食品	1,500	4,970.00	7,455,000		
くら寿司	7,900	3,080.00	24,332,000	貸付株式数	3,100株
キャンドウ	2,400	2,226.00	5,342,400	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,900	1,362.00	8,035,800		
アイケイ	2,300	417.00	959,100	貸付株式数	900株
パルグループHLDGS	6,700	2,405.00	16,113,500	貸付株式数	300株
エディオン	34,400	1,193.00	41,039,200	貸付株式数	7,100株
あらた	5,500	4,220.00	23,210,000	貸付株式数	1,900株
サーラコーポレーション	14,400	753.00	10,843,200	貸付株式数	300株
ワッツ	3,600	690.00	2,484,000	貸付株式数	1,400株
トーメンデバイス	1,100	5,720.00	6,292,000	貸付株式数	400株
ハローズ	3,400	2,947.00	10,019,800	貸付株式数	700株
J Pホールディングス	17,900	278.00	4,976,200	貸付株式数	1,600株
フジオフードG本社	5,700	1,344.00	7,660,800	貸付株式数	2,200株
あみやき亭	1,800	2,923.00	5,261,400	貸付株式数	600株
東京エレクトロンデバイス	2,200	5,560.00	12,232,000	貸付株式数	200株
ひらまつ	15,500	188.00	2,914,000	貸付株式数	6,200株
フィールズ	6,600	1,558.00	10,282,800	貸付株式数	2,600株
双日	77,200	2,349.00	181,342,800		
アルフレッサホールディングス	78,100	1,719.00	134,253,900		
大黒天物産	2,400	5,760.00	13,824,000	貸付株式数	900株
ハニーズホールディングス	6,100	1,237.00	7,545,700	貸付株式数	2,200株
ファーマライズHD	1,300	646.00	839,800	貸付株式数	500株
キッコーマン	46,000	8,270.00	380,420,000		

味の素	152,900	3,977.00	608,083,300		
ブルドックソ - ス	2,800	1,844.00	5,163,200	貸付株式数	1,100株
キューピー	33,600	2,262.00	76,003,200	貸付株式数	13,400株
ハウス食品G本社	24,000	2,908.00	69,792,000		
カゴメ	29,200	2,973.00	86,811,600	貸付株式数	11,500株
焼津水産化工	3,100	871.00	2,700,100	貸付株式数	1,200株
アリアケジャパン	7,000	4,775.00	33,425,000		
ピエトロ	900	1,781.00	1,602,900	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,700	3,095.00	5,261,500	貸付株式数	500株
やまみ	700	1,419.00	993,300		
ニチレイ	28,600	2,372.00	67,839,200		
横浜冷凍	18,700	916.00	17,129,200	貸付株式数	6,900株
東洋水産	34,300	5,900.00	202,370,000	貸付株式数	1,100株
イトアンドHLDGS	3,000	2,221.00	6,663,000	貸付株式数	1,100株
大冷	600	1,906.00	1,143,600	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,800	485.00	1,843,000	貸付株式数	1,500株
日清食品HD	24,800	9,860.00	244,528,000		
永谷園ホールディングス	3,300	1,972.00	6,507,600		
一正蒲鉾	3,000	765.00	2,295,000	貸付株式数	1,000株
フジッコ	7,100	1,908.00	13,546,800		
ロックフィールド	7,700	1,508.00	11,611,600	貸付株式数	2,900株
日本たばこ産業	411,200	2,413.50	992,431,200	貸付株式数	144,800株
ケンコーマヨネーズ	3,900	1,556.00	6,068,400		
わらべや日洋HD	4,700	2,233.00	10,495,100		
なとり	4,300	2,024.00	8,703,200	貸付株式数	1,500株
イフジ産業	1,200	902.00	1,082,400	貸付株式数	400株
ファーマフーズ	9,700	1,262.00	12,241,400	貸付株式数	3,800株
北の達人コーポ	27,100	253.00	6,856,300	貸付株式数	10,700株 (2,600株)
ユーグレナ	40,200	891.00	35,818,200	貸付株式数	16,000株
紀文食品	5,900	981.00	5,787,900	貸付株式数	2,300株
ピクルスホールディングス	3,700	1,060.00	3,922,000		
スター・マイカ・HLDGS	3,400	1,575.00	5,355,000	貸付株式数	1,100株
SREホールディングス	1,900	2,974.00	5,650,600	貸付株式数	700株
ADワークスグループ	21,200	156.00	3,307,200	貸付株式数	6,300株 (1,000株)
片倉工業	6,000	2,016.00	12,096,000	貸付株式数	800株



グンゼ	4,400	3,905.00	17,182,000	貸付株式数	600株
ヒューリック	147,000	1,100.00	161,700,000	貸付株式数	63,100株
神栄	1,100	835.00	918,500	貸付株式数	400株
ラサ商事	3,000	984.00	2,952,000		
アルペン	5,500	2,130.00	11,715,000	貸付株式数	2,200株
ハブ	2,400	594.00	1,425,600	貸付株式数	900株
ラクーンホールディングス	6,400	1,177.00	7,532,800	貸付株式数	2,500株
クオールホールディングス	9,300	1,244.00	11,569,200	貸付株式数	1,200株
アルコニックス	9,700	1,373.00	13,318,100		
神戸物産	51,900	3,570.00	185,283,000	貸付株式数	20,700株
ソリトンシステムズ	3,300	1,102.00	3,636,600	貸付株式数	1,400株
ジンスホールディングス	4,000	4,495.00	17,980,000	貸付株式数	1,500株
ビックカメラ	44,500	1,188.00	52,866,000	貸付株式数	17,800株
DCMホールディングス	44,500	1,049.00	46,680,500		
ペッパーフードサービス	14,100	233.00	3,285,300	貸付株式数	5,500株
ハイパー	1,500	441.00	661,500	貸付株式数	500株
MonotaRO	95,100	2,255.00	214,450,500		
東京一番フーズ	1,100	595.00	654,500	貸付株式数	600株
DDホールディングス	4,100	617.00	2,529,700	貸付株式数	1,400株
あいホールディングス	10,700	2,184.00	23,368,800	貸付株式数	4,200株
ディーブイエックス	2,400	880.00	2,112,000	貸付株式数	1,000株
きちりホールディングス	1,800	339.00	610,200	貸付株式数	700株
アークランドサービスHD	5,500	2,110.00	11,605,000	貸付株式数	2,200株 (100株)
J. フロントリテイリング	83,600	1,203.00	100,570,800		
ドトール・日レスHD	11,900	1,709.00	20,337,100		
マツキヨココカラ&カンパニー	44,100	5,990.00	264,159,000		
ブロンコビリー	3,500	2,455.00	8,592,500	貸付株式数	1,400株
ZOZO	51,800	3,065.00	158,767,000		
トレジャー・ファクトリー	2,200	1,908.00	4,197,600	貸付株式数	700株
物語コーポレーション	3,700	7,070.00	26,159,000	貸付株式数	1,300株
三越伊勢丹HD	113,200	1,229.00	139,122,800		
東洋紡	29,400	1,109.00	32,604,600		
ユニチカ	20,900	293.00	6,123,700	貸付株式数	8,300株
富士紡ホールディングス	3,000	3,415.00	10,245,000		
日清紡ホールディングス	52,200	1,079.00	56,323,800		
倉敷紡績	5,300	2,168.00	11,490,400		
ダイワボウHD	32,000	1,954.00	62,528,000		

シキボウ	4,200	891.00	3,742,200	貸付株式数	100株
日東紡績	9,500	2,467.00	23,436,500		
トヨタ紡織	26,800	1,965.00	52,662,000		
マクニカホールディングス	17,800	2,825.00	50,285,000		
H a m e e	2,700	959.00	2,589,300	貸付株式数	1,000株
マーケットエンタープライズ	800	918.00	734,400	貸付株式数	300株
ラクト・ジャパン	2,600	2,188.00	5,688,800	貸付株式数	1,000株 (400株)
ウエルシアHD	39,800	3,040.00	120,992,000	貸付株式数	15,900株
クリエイトSDH	11,000	3,125.00	34,375,000	貸付株式数	3,700株
グリムス	3,300	1,692.00	5,583,600	貸付株式数	1,300株 (100株)
バイタルKSKHD	11,800	660.00	7,788,000		
八洲電機	5,500	1,005.00	5,527,500	貸付株式数	2,100株
メディアスホールディングス	4,100	700.00	2,870,000	貸付株式数	1,500株
レスターホールディングス	7,100	2,007.00	14,249,700	貸付株式数	1,600株
ジューテックHD	1,600	1,091.00	1,745,600		
丸善CHI HD	8,200	341.00	2,796,200	貸付株式数	3,200株
大光	3,300	701.00	2,313,300	貸付株式数	1,100株
OCHIホールディングス	1,500	1,243.00	1,864,500	貸付株式数	700株
TOKAIホールディングス	36,300	886.00	32,161,800		
黒谷	2,100	564.00	1,184,400	貸付株式数	700株
ミサワ	1,400	589.00	824,600	貸付株式数	500株
ティーライフ	1,000	1,235.00	1,235,000	貸付株式数	400株
Cominix	800	722.00	577,600	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,300	454.00	590,200	貸付株式数	500株
三洋貿易	7,000	1,075.00	7,525,000	貸付株式数	200株
チムニー	2,400	1,235.00	2,964,000	貸付株式数	900株
シュッピン	6,200	1,270.00	7,874,000	貸付株式数	2,400株
ビューティガレージ	1,200	2,853.00	3,423,600	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	10,800	1,750.00	18,900,000	貸付株式数	4,300株
ウイン・パートナーズ	5,300	951.00	5,040,300	貸付株式数	2,100株
ネクステージ	15,300	3,280.00	50,184,000		
ジョイフル本田	21,500	1,761.00	37,861,500	貸付株式数	8,600株
鳥貴族ホールディングス	2,500	2,446.00	6,115,000	貸付株式数	900株

ホットランド	5,000	1,338.00	6,690,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
すかいらーくHD	91,900	1,539.00	141,434,100	貸付株式数 36,700株
SFPホールディングス	3,800	1,719.00	6,532,200	貸付株式数 1,500株 (100株)
綿半ホールディングス	5,200	1,400.00	7,280,000	貸付株式数 1,400株
日本毛織	18,600	1,096.00	20,385,600	貸付株式数 8,000株
ダイトウボウ	16,500	86.00	1,419,000	貸付株式数 5,500株
トーア紡コーポレーション	2,300	344.00	791,200	貸付株式数 900株
ダイドーリミテッド	12,600	146.00	1,839,600	貸付株式数 5,000株 (1,000株)
ヨシックスホールディングス	1,500	2,269.00	3,403,500	貸付株式数 600株
ユナイテッド・スーパー マーケ	22,000	1,060.00	23,320,000	貸付株式数 8,800株
三栄建築設計	3,300	1,658.00	5,471,400	
野村不動産HLDGS	39,300	3,605.00	141,676,500	
三重交通グループHD	15,800	491.00	7,757,800	貸付株式数 6,200株 (900株)
サムティ	10,400	2,298.00	23,899,200	貸付株式数 4,100株
地主	5,100	2,046.00	10,434,600	貸付株式数 1,700株
プレサンスコーポレ ーション	8,400	1,545.00	12,978,000	貸付株式数 3,200株
フィル・カンパニー	1,100	1,208.00	1,328,800	貸付株式数 400株
ハウスコム	2,000	939.00	1,878,000	貸付株式数 500株
JPMC	3,800	1,007.00	3,826,600	貸付株式数 1,200株
サンセイランディック	3,200	825.00	2,640,000	
エストラスト	2,800	546.00	1,528,800	貸付株式数 100株
フージャースHD	10,000	813.00	8,130,000	貸付株式数 100株
オープンハウスグループ	24,000	5,270.00	126,480,000	
東急不動産HD	205,300	795.00	163,213,500	
飯田GHD	61,800	2,167.00	133,920,600	
イーランド	1,300	1,673.00	2,174,900	貸付株式数 400株
帝国繊維	7,200	1,618.00	11,649,600	貸付株式数 2,900株
日本コークス工業	64,700	95.00	6,146,500	貸付株式数 23,300株
ゴルフダイジェスト・オン	3,000	1,985.00	5,955,000	貸付株式数 1,500株
ミタチ産業	2,100	828.00	1,738,800	貸付株式数 700株
B E E N O S	3,800	2,524.00	9,591,200	貸付株式数 1,500株
あさひ	6,200	1,332.00	8,258,400	貸付株式数 2,200株
日本調剤	4,700	1,283.00	6,030,100	貸付株式数 1,800株

コスモス薬品	7,600	14,120.00	107,312,000	貸付株式数	3,000株
シップヘルスケアHD	21,600	2,631.00	56,829,600		
トーエル	3,400	733.00	2,492,200	貸付株式数	1,300株
ソフトクリエイトHD	3,300	3,410.00	11,253,000	貸付株式数	1,300株
セブン&アイ・HLDGS	252,400	5,990.00	1,511,876,000		
クリエイト・レストラン ツ・ホール	50,600	939.00	47,513,400	貸付株式数	20,200株
明治電機工業	2,200	1,056.00	2,323,200	貸付株式数	600株
ツルハホールディングス	16,400	8,130.00	133,332,000		
デリカフーズHLDGS	2,800	518.00	1,450,400	貸付株式数	1,100株
スターティアホールディング ス	1,700	997.00	1,694,900	貸付株式数	600株
サンマルクホールディング ス	6,000	1,628.00	9,768,000		
フェリシモ	1,600	1,023.00	1,636,800	貸付株式数	600株
トリドールホールディング ス	18,700	3,100.00	57,970,000	貸付株式数	7,400株
帝人	66,100	1,477.00	97,629,700		
東レ	464,900	770.70	358,298,430		
クラレ	101,200	1,077.00	108,992,400		
旭化成	463,000	1,012.50	468,787,500		
TOKYO BASE	7,000	355.00	2,485,000	貸付株式数	2,800株
稲葉製作所	3,900	1,367.00	5,331,300	貸付株式数	1,500株
宮地エンジニアリングG	2,200	3,255.00	7,161,000		
トーカロ	19,300	1,259.00	24,298,700		
アルファCO	2,700	943.00	2,546,100	貸付株式数	900株
SUMCO	124,700	1,853.00	231,069,100	貸付株式数	33,200株
川田テクノロジーズ	1,500	3,730.00	5,595,000		
RS TECHNOLOG IES	2,100	6,660.00	13,986,000		
ジェイテックコーポレー ション	1,000	1,582.00	1,582,000	貸付株式数	300株
信和	4,700	809.00	3,802,300	貸付株式数	100株
ビーロット	6,000	557.00	3,342,000	貸付株式数	2,000株
ファーストブラザーズ	1,500	853.00	1,279,500	貸付株式数	600株
AND DOホールディン グス	4,200	885.00	3,717,000	貸付株式数	1,400株
シーアールイー	3,000	1,491.00	4,473,000	貸付株式数	1,100株
プロパティエージェン ト	900	1,569.00	1,412,100	貸付株式数	400株
ケイアイスター不動産	3,400	4,825.00	16,405,000		

アグレ都市デザイン	1,300	1,514.00	1,968,200	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,700	3,740.00	6,358,000		
ロードスターキャピタル	2,800	1,764.00	4,939,200	貸付株式数	1,000株
テンポイノベーション	2,600	938.00	2,438,800	貸付株式数	800株
グローバルリンクマネジメン ト	1,600	932.00	1,491,200	貸付株式数	500株
フェイスネットワーク	1,200	1,388.00	1,665,600	貸付株式数	300株
住江織物	1,300	1,753.00	2,278,900		
日本フェルト	4,100	411.00	1,685,100	貸付株式数	1,700株
イチカワ	900	1,360.00	1,224,000	貸付株式数	100株
エコナックホールディング ス	13,900	89.00	1,237,100	貸付株式数	300株
日東製網	700	1,313.00	919,100	貸付株式数	100株
芦森工業	1,600	1,022.00	1,635,200	貸付株式数	500株
アツギ	5,300	392.00	2,077,600	貸付株式数	2,100株
ウイルプラスHLDGS	1,500	1,107.00	1,660,500	貸付株式数	400株
JMホールディングス	5,600	1,694.00	9,486,400		
コメダホールディングス	16,300	2,386.00	38,891,800	貸付株式数	6,500株
サツドラホールディングス	3,100	651.00	2,018,100	貸付株式数	1,300株
アレンザホールディングス	4,800	982.00	4,713,600	貸付株式数	2,000株
串カツ田中HLDGS	1,800	1,794.00	3,229,200	貸付株式数	700株
パロックジャパン	5,200	791.00	4,113,200	貸付株式数	2,000株
クスリのアオキHLDGS	6,700	6,640.00	44,488,000		
ダイニック	2,100	603.00	1,266,300	貸付株式数	900株
共和レザー	4,100	536.00	2,197,600	貸付株式数	1,000株
ピーバンドットコム	1,100	510.00	561,000	貸付株式数	400株
力の源HD	4,400	796.00	3,502,400	貸付株式数	1,600株
FOOD & LIFE CO MPAN	38,500	2,390.00	92,015,000		
アセンテック	2,500	587.00	1,467,500	貸付株式数	900株
セーレン	13,800	2,098.00	28,952,400	貸付株式数	5,400株
ソトー	2,800	716.00	2,004,800	貸付株式数	1,100株
東海染工	800	1,115.00	892,000	貸付株式数	300株
小松マテーレ	11,300	823.00	9,299,900		
ワコールホールディングス	15,300	2,282.00	34,914,600		
ホギメディカル	9,300	3,395.00	31,573,500		
クラウドディアHLDGS	2,000	289.00	578,000	貸付株式数	700株
TSIホールディングス	22,800	420.00	9,576,000	貸付株式数	9,100株
マツオカコーポレーション	2,100	980.00	2,058,000	貸付株式数	800株
ワールド	9,900	1,428.00	14,137,200		

T I S	65,600	4,095.00	268,632,000		
J N Sホールディングス	3,600	390.00	1,404,000	貸付株式数	1,400株
グリー	34,300	860.00	29,498,000	貸付株式数	13,500株
G M Oペパボ	900	1,803.00	1,622,700	貸付株式数	300株
コーエーテクモHD	23,900	4,640.00	110,896,000		
三菱総合研究所	3,100	4,365.00	13,531,500		
ボルテージ	2,100	307.00	644,700	貸付株式数	800株
電算	700	1,860.00	1,302,000	貸付株式数	200株
A G S	3,000	673.00	2,019,000	貸付株式数	1,200株
ファインデックス	5,100	584.00	2,978,400	貸付株式数	2,200株
ブレインパッド	6,400	957.00	6,124,800		
K L a b	12,000	437.00	5,244,000	貸付株式数	4,700株
ポールトゥウィンホール ディン	10,900	942.00	10,267,800	貸付株式数	200株
ネクソン	171,300	2,574.00	440,926,200		
アイスタイル	19,400	520.00	10,088,000	貸付株式数	7,700株
エムアップホールディング ス	8,700	1,636.00	14,233,200		
エイチーム	4,700	805.00	3,783,500		
エニグモ	8,100	518.00	4,195,800	貸付株式数	3,100株
テクノスジャパン	5,800	447.00	2,592,600	貸付株式数	200株
e n i s h	5,600	425.00	2,380,000	貸付株式数	2,100株
コロプラ	24,800	690.00	17,112,000	貸付株式数	500株
オルトプラス	5,600	300.00	1,680,000	貸付株式数	2,000株
ブロードリーフ	37,200	517.00	19,232,400	貸付株式数	12,800株
クロス・マーケティングG	2,900	865.00	2,508,500	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツH L D G S	3,400	1,933.00	6,572,200	貸付株式数	1,300株
システム情報	5,600	964.00	5,398,400	貸付株式数	2,200株
メディアドゥ	2,500	1,914.00	4,785,000		
じげん	21,400	343.00	7,340,200	貸付株式数	1,300株
ブイキューブ	7,600	1,033.00	7,850,800	貸付株式数	3,000株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジ	1,700	511.00	868,700	貸付株式数	600株
サイバーリンクス	2,300	1,143.00	2,628,900	貸付株式数	1,000株
ディー・エル・イー	4,300	330.00	1,419,000		
フィックスターズ	7,300	1,081.00	7,891,300		
C A R T A H O L D I N G S	3,100	1,729.00	5,359,900	貸付株式数	1,200株
オプティム	5,200	859.00	4,466,800	貸付株式数	2,000株 (1,800株)

セレス	2,500	1,011.00	2,527,500	貸付株式数	1,100株
S H I F T	4,700	19,920.00	93,624,000	貸付株式数	1,800株
特種東海製紙	3,900	3,050.00	11,895,000		
ティーガイア	6,600	1,682.00	11,101,200	貸付株式数	2,200株
セック	1,100	2,163.00	2,379,300	貸付株式数	400株
テクマトリックス	12,700	1,597.00	20,281,900	貸付株式数	3,900株
プロシップ	2,500	1,446.00	3,615,000	貸付株式数	800株
ガンホー・オンライン・エンター	19,500	2,246.00	43,797,000	貸付株式数	7,400株
GMOペイメントゲートウェイ	14,500	10,520.00	152,540,000		
ザッパラス	2,400	315.00	756,000	貸付株式数	900株
システムリサーチ	2,100	1,880.00	3,948,000	貸付株式数	800株
インターネットイニシアティブ	20,000	4,775.00	95,500,000		
さくらインターネット	7,800	549.00	4,282,200	貸付株式数	3,100株
ヴィンクス	2,200	1,514.00	3,330,800		
GMOグローバルサインHD	2,000	4,815.00	9,630,000	貸付株式数	600株
S R Aホールディングス	3,600	3,080.00	11,088,000		
システムインテグレータ	2,400	432.00	1,036,800	貸付株式数	900株
朝日ネット	6,600	616.00	4,065,600		
e B A S E	8,900	546.00	4,859,400	貸付株式数	3,500株
アバント	8,000	1,343.00	10,744,000		
アドソル日進	2,600	1,476.00	3,837,600	貸付株式数	1,000株
ODKソリューションズ	1,500	631.00	946,500	貸付株式数	600株
フリービット	3,800	882.00	3,351,600	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
コムチュア	8,400	2,307.00	19,378,800	貸付株式数	800株
サイバーコム	1,200	1,373.00	1,647,600		
アステリア	5,500	829.00	4,559,500	貸付株式数	2,100株
アイル	3,600	1,860.00	6,696,000	貸付株式数	1,400株
王子ホールディングス	289,100	551.00	159,294,100		
日本製紙	30,000	874.00	26,220,000	貸付株式数	7,100株
三菱製紙	9,600	296.00	2,841,600	貸付株式数	2,600株
北越コーポレーション	44,600	758.00	33,806,800		
中越パルプ	2,300	942.00	2,166,600	貸付株式数	900株
巴川製紙	2,300	798.00	1,835,400	貸付株式数	800株
大王製紙	31,900	1,191.00	37,992,900		
阿波製紙	1,400	301.00	421,400	貸付株式数	500株

マークラインズ	3,400	2,430.00	8,262,000	貸付株式数	100株
メディカル・データ・ビジ	9,500	996.00	9,462,000		
g u m i	10,500	898.00	9,429,000	貸付株式数	4,100株
ショーケース	1,600	388.00	620,800	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,600	909.00	1,454,400	貸付株式数	500株
テラスカイ	2,700	1,975.00	5,332,500	貸付株式数	1,000株 (100株)
デジタル・インフォメー ション	3,300	1,520.00	5,016,000		
P C Iホールディングス	2,800	945.00	2,646,000	貸付株式数	300株
アイビーシー	1,200	451.00	541,200	貸付株式数	400株
ネオジャパン	2,100	997.00	2,093,700	貸付株式数	800株
P R T I M E S	1,600	2,440.00	3,904,000	貸付株式数	600株
ラクス	34,400	1,509.00	51,909,600	貸付株式数	13,700株
ランドコンピュータ	1,700	842.00	1,431,400		
ダブルスタンダード	2,300	2,327.00	5,352,100	貸付株式数	900株
オープンドア	4,500	2,240.00	10,080,000	貸付株式数	1,700株
マイネット	2,300	486.00	1,117,800	貸付株式数	900株
アカツキ	3,400	2,242.00	7,622,800		
ベネフィットジャパン	600	1,569.00	941,400	貸付株式数	200株
U B I C O Mホールディン グス	2,000	2,313.00	4,626,000	貸付株式数	700株
カナミックネットワーク	9,300	520.00	4,836,000	貸付株式数	3,700株
ノムラシステムコーポレー ション	7,000	128.00	896,000	貸付株式数	2,900株
レンゴー	58,300	855.00	49,846,500		
トーモク	3,600	1,524.00	5,486,400		
ザ・パック	4,800	2,333.00	11,198,400		
チェンジ	15,600	1,859.00	29,000,400		
シンクロ・フード	4,100	467.00	1,914,700	貸付株式数	1,500株
オークネット	3,300	2,194.00	7,240,200	貸付株式数	1,500株
キャピタル・アセット・ブ ラン	1,400	713.00	998,200	貸付株式数	500株
セグエグループ	1,600	671.00	1,073,600	貸付株式数	700株
エイトレッド	1,000	1,802.00	1,802,000	貸付株式数	500株
マクロミル	14,400	1,090.00	15,696,000	貸付株式数	300株
ビーグリー	1,200	1,365.00	1,638,000	貸付株式数	600株
オロ	1,900	1,601.00	3,041,900	貸付株式数	800株
ユーザーローカル	2,200	1,591.00	3,500,200	貸付株式数	900株
テモナ	1,300	319.00	414,700	貸付株式数	500株



ニーズウェル	2,300	653.00	1,501,900	貸付株式数	800株
マネーフォワード	15,300	3,370.00	51,561,000	貸付株式数	6,100株
サインポスト	2,500	842.00	2,105,000	貸付株式数	300株
昭和電工	61,400	2,169.00	133,176,600		
住友化学	510,700	539.00	275,267,300		
住友精化	3,000	3,270.00	9,810,000	貸付株式数	400株
日産化学	33,700	6,780.00	228,486,000		
ラサ工業	2,600	2,384.00	6,198,400	貸付株式数	800株
クレハ	5,400	9,300.00	50,220,000	貸付株式数	700株
多木化学	2,500	5,070.00	12,675,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,300	1,270.00	5,461,000		
石原産業	13,400	1,064.00	14,257,600	貸付株式数	400株
片倉コープアグリ	1,700	1,217.00	2,068,900		
日本曹達	8,200	4,530.00	37,146,000	貸付株式数	900株
東ソー	92,700	1,721.00	159,536,700		
トクヤマ	22,300	1,841.00	41,054,300		
セントラル硝子	11,300	3,430.00	38,759,000	貸付株式数	100株
東亜合成	32,600	1,109.00	36,153,400	貸付株式数	700株
大阪ソーダ	5,800	3,865.00	22,417,000		
関東電化	13,700	992.00	13,590,400	貸付株式数	100株
デンカ	25,200	3,320.00	83,664,000		
イビデン	36,800	4,505.00	165,784,000		
信越化学	118,700	15,875.00	1,884,362,500		
日本カ-バイド	2,900	1,289.00	3,738,100	貸付株式数	900株
電算システムHD	3,100	2,258.00	6,999,800		
堺化学	4,800	1,940.00	9,312,000	貸付株式数	1,700株
第一稀元素化学工	6,300	1,374.00	8,656,200	貸付株式数	2,400株
エア・ウォーター	59,900	1,754.00	105,064,600		
日本酸素HLDGS	61,600	2,455.00	151,228,000		
日本化学工業	2,100	1,984.00	4,166,400		
東邦アセチレン	1,500	1,143.00	1,714,500	貸付株式数	500株
日本パ-カラijing	31,500	973.00	30,649,500		
高圧ガス	10,600	660.00	6,996,000		
チタン工業	900	1,614.00	1,452,600	貸付株式数	300株
四国化成	8,500	1,273.00	10,820,500		
戸田工業	1,600	3,005.00	4,808,000	貸付株式数	600株
ステラケミファ	3,800	2,706.00	10,282,800		
保土谷化学	2,000	3,205.00	6,410,000		
日本触媒	10,700	5,630.00	60,241,000		
大日精化	5,400	1,763.00	9,520,200		

カネカ	16,100	3,900.00	62,790,000	
協和キリン	76,900	3,190.00	245,311,000	
三菱瓦斯化学	58,900	2,066.00	121,687,400	
三井化学	58,200	3,060.00	178,092,000	
J S R	69,700	3,015.00	210,145,500	
東京応化工業	11,100	6,480.00	71,928,000	貸付株式数 200株
大阪有機化学	4,800	2,247.00	10,785,600	貸付株式数 2,000株
三菱ケミカルグループ	464,600	711.50	330,562,900	
K H ネオケム	10,600	2,604.00	27,602,400	貸付株式数 4,300株
ダイセル	100,300	900.00	90,270,000	
住友ベークライト	10,600	4,215.00	44,679,000	
積水化学	143,000	1,889.00	270,127,000	
日本ゼオン	56,300	1,365.00	76,849,500	
アイカ工業	17,600	3,195.00	56,232,000	
U B E	35,100	2,045.00	71,779,500	
積水樹脂	10,400	1,710.00	17,784,000	
タキロンシーアイ	16,400	533.00	8,741,200	
旭有機材	4,300	2,296.00	9,872,800	
ニチバン	4,000	1,621.00	6,484,000	貸付株式数 1,500株
リケンテクノス	15,200	526.00	7,995,200	
大倉工業	3,000	1,768.00	5,304,000	貸付株式数 1,300株
積水化成成品	7,700	412.00	3,172,400	
群栄化学	1,500	2,454.00	3,681,000	
タイガース ポリマー	4,100	422.00	1,730,200	
ミライアル	2,400	1,747.00	4,192,800	貸付株式数 800株
ダイキアクシス	2,300	670.00	1,541,000	貸付株式数 900株
ダイキョーニシカワ	15,700	577.00	9,058,900	
竹本容器	2,500	756.00	1,890,000	貸付株式数 900株
森六ホールディングス	3,700	1,796.00	6,645,200	
恵和	2,100	3,940.00	8,274,000	
日本化薬	52,500	1,210.00	63,525,000	
カーリットホールディングス	6,400	679.00	4,345,600	貸付株式数 2,500株
ソルクシーズ	6,000	364.00	2,184,000	貸付株式数 2,300株
C L ホールディングス	1,800	887.00	1,596,600	貸付株式数 600株
プレステージ・インター	27,500	669.00	18,397,500	
フェイス	1,900	555.00	1,054,500	貸付株式数 700株
プロトコーポレーション	8,100	1,082.00	8,764,200	貸付株式数 1,400株
ハイマックス	2,000	1,330.00	2,660,000	貸付株式数 700株
アミューズ	4,000	1,826.00	7,304,000	

野村総合研究所	130,400	3,580.00	466,832,000		
ドリームインキュベータ	2,300	1,949.00	4,482,700	貸付株式数	800株
サイバネットシステム	5,300	969.00	5,135,700		
クイック	4,600	1,838.00	8,454,800		
T A C	3,900	206.00	803,400	貸付株式数	1,500株 (400株)
C Eホールディングス	3,700	495.00	1,831,500	貸付株式数	1,400株
日本システム技術	1,400	2,493.00	3,490,200	貸付株式数	100株
電通グループ	68,400	4,260.00	291,384,000		
インテージホールディングス	8,600	1,621.00	13,940,600		
テイクアンドギヴニーズ	3,500	1,599.00	5,596,500	貸付株式数	1,300株
東邦システムサイエンス	1,900	1,021.00	1,939,900	貸付株式数	700株
ぴあ	2,200	3,435.00	7,557,000	貸付株式数	900株
イオンファンタジー	2,900	3,760.00	10,904,000	貸付株式数	1,100株
ソースネクスト	32,700	270.00	8,829,000	貸付株式数	12,900株
シーティーエス	8,300	731.00	6,067,300	貸付株式数	3,200株
ネクシーズグループ	2,200	706.00	1,553,200	貸付株式数	800株
インフォコム	8,100	1,936.00	15,681,600		
メディカルシステムネットワーク	6,500	410.00	2,665,000	貸付株式数	300株
日本精化	4,800	1,934.00	9,283,200	貸付株式数	2,100株
扶桑化学工業	5,900	3,460.00	20,414,000		
トリケミカル	7,700	2,153.00	16,578,100		
シンプレクスHD	11,900	1,990.00	23,681,000	貸付株式数	400株
HEROZ	2,200	1,117.00	2,457,400	貸付株式数	800株 (700株)
ラクスル	8,900	2,748.00	24,457,200	貸付株式数	3,500株
メルカリ	28,500	2,152.00	61,332,000		
I P S	2,100	2,990.00	6,279,000		
F I G	8,300	399.00	3,311,700	貸付株式数	3,200株 (1,300株)
システムサポート	2,600	1,432.00	3,723,200	貸付株式数	1,000株
A D E K A	29,500	2,289.00	67,525,500		
日油	21,600	5,180.00	111,888,000		
ミヨシ油脂	2,300	992.00	2,281,600	貸付株式数	1,000株
新日本理化	10,700	240.00	2,568,000	貸付株式数	4,200株
ハリマ化成グループ	5,000	928.00	4,640,000	貸付株式数	100株
イーソル	4,100	598.00	2,451,800	貸付株式数	1,800株

アルテリア・ネットワークス	7,000	1,277.00	8,939,000	貸付株式数	100株
東海ソフト	1,200	919.00	1,102,800	貸付株式数	400株
ウイングアーク1ST	5,700	1,875.00	10,687,500	貸付株式数	100株
ヒト・コミュニケーションズHD	1,700	1,693.00	2,878,100	貸付株式数	600株
サーバーワークス	1,300	2,415.00	3,139,500	貸付株式数	500株
東名	600	1,085.00	651,000	貸付株式数	200株
ヴィッツ	700	1,046.00	732,200	貸付株式数	200株
トピラスシステムズ	1,900	975.00	1,852,500	貸付株式数	600株
Sansan	23,700	1,373.00	32,540,100	貸付株式数	9,400株
Link-U	1,300	705.00	916,500	貸付株式数	500株
ギフトィ	6,800	2,310.00	15,708,000	貸付株式数	2,700株
花王	157,900	6,077.00	959,558,300	貸付株式数	63,100株
第一工業製薬	2,500	2,105.00	5,262,500		
石原ケミカル	3,500	1,291.00	4,518,500		
日華化学	2,900	864.00	2,505,600	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	2,395.00	3,353,000	貸付株式数	500株
三洋化成	4,500	4,550.00	20,475,000		
ベース	1,100	6,970.00	7,667,000	貸付株式数	400株
JMDC	9,400	5,400.00	50,760,000	貸付株式数	3,700株
武田薬品	600,800	3,842.00	2,308,273,600		
アステラス製薬	653,600	1,979.00	1,293,474,400		
住友ファーマ	47,300	1,027.00	48,577,100		
塩野義製薬	88,800	6,970.00	618,936,000		
わかもと製薬	7,600	236.00	1,793,600	貸付株式数	2,900株
日本新薬	16,700	7,460.00	124,582,000		
中外製薬	199,200	3,497.00	696,602,400		
科研製薬	11,000	3,855.00	42,405,000	貸付株式数	500株
エーザイ	84,500	6,030.00	509,535,000		
理研ビタミン	5,300	1,719.00	9,110,700		
ロート製薬	36,500	4,370.00	159,505,000		
小野薬品	147,400	3,402.00	501,454,800		
久光製薬	16,200	3,390.00	54,918,000	貸付株式数	6,400株
有機合成薬品	5,000	312.00	1,560,000	貸付株式数	500株
持田製薬	8,600	3,395.00	29,197,000	貸付株式数	100株
参天製薬	133,200	979.00	130,402,800		
扶桑薬品	2,500	1,993.00	4,982,500	貸付株式数	100株
日本ケミファ	800	1,829.00	1,463,200	貸付株式数	300株
ツムラ	21,800	3,115.00	67,907,000		

日医工	22,000	433.00	9,526,000	貸付株式数	8,800株
テ ル モ	216,300	4,318.00	933,983,400		
H UグループHD	19,100	2,709.00	51,741,900		
キッセイ薬品工業	11,100	2,508.00	27,838,800		
生化学工業	13,700	875.00	11,987,500		
栄研化学	11,400	1,778.00	20,269,200		
鳥居薬品	3,400	2,811.00	9,557,400	貸付株式数	100株
J C Rファーマ	21,500	2,119.00	45,558,500		
東和薬品	11,000	2,176.00	23,936,000		
富士製薬工業	4,000	1,037.00	4,148,000		
ゼリア新薬工業	11,300	2,040.00	23,052,000	貸付株式数	4,900株
第一三共	554,600	4,201.00	2,329,874,600		
キョーリン製薬HD	13,800	1,759.00	24,274,200	貸付株式数	100株
大幸薬品	11,600	615.00	7,134,000	貸付株式数	4,600株
ダイト	4,800	2,585.00	12,408,000	貸付株式数	100株
大塚ホールディングス	145,600	4,546.00	661,897,600		
大正製薬HD	14,200	5,200.00	73,840,000		
ペプチドリーム	30,900	1,631.00	50,397,900		
大日本塗料	8,400	720.00	6,048,000	貸付株式数	3,300株
日本ペイントHOLD	281,300	1,073.00	301,834,900		
関西ペイント	64,700	2,137.00	138,263,900		
神東塗料	4,700	138.00	648,600	貸付株式数	2,100株
中国塗料	15,900	883.00	14,039,700	貸付株式数	6,000株
日本特殊塗料	4,600	969.00	4,457,400		
藤倉化成	9,300	444.00	4,129,200	貸付株式数	2,200株
太陽ホールディングス	10,900	2,637.00	28,743,300		
D I C	24,800	2,513.00	62,322,400	貸付株式数	11,000株
サカタインクス	14,000	996.00	13,944,000		
東洋インキS Cホールディ ン	12,300	1,914.00	23,542,200	貸付株式数	5,600株
T & K T O K A	6,100	976.00	5,953,600		
アルプス技研	5,700	1,827.00	10,413,900		
サニックス	12,800	256.00	3,276,800	貸付株式数	5,000株 (5,000株)
ダイオーズ	1,600	1,499.00	2,398,400	貸付株式数	500株
日本空調サービス	7,200	752.00	5,414,400	貸付株式数	700株
オリエンタルランド	77,700	20,320.00	1,578,864,000		
フォーカスシステムズ	4,500	977.00	4,396,500	貸付株式数	100株
ダスキン	15,700	2,844.00	44,650,800		
パーク24	48,700	2,069.00	100,760,300	貸付株式数	5,500株

明光ネットワークジャパン	8,500	607.00	5,159,500	貸付株式数	3,300株
ファルコホールディングス	3,300	1,748.00	5,768,400	貸付株式数	400株
クレスコ	5,500	1,764.00	9,702,000		
フジ・メディア・HD	66,200	1,112.00	73,614,400		
秀英予備校	1,600	446.00	713,600	貸付株式数	800株
田谷	1,300	549.00	713,700	貸付株式数	600株
ラウンドワン	20,500	2,068.00	42,394,000		
リゾートトラスト	31,000	2,406.00	74,586,000		
オービック	23,600	19,870.00	468,932,000		
ジャストシステム	10,700	3,325.00	35,577,500		
TDCソフト	5,900	1,209.00	7,133,100		
Zホールディングス	1,081,400	406.00	439,048,400		
ビー・エム・エル	9,300	3,375.00	31,387,500		
トレンドマイクロ	36,800	8,140.00	299,552,000		
りらいあコミュニケーション	10,700	989.00	10,582,300		
IDホールディングス	4,500	878.00	3,951,000	貸付株式数	100株
リソー教育	33,800	326.00	11,018,800	貸付株式数	200株
日本オラクル	12,200	8,030.00	97,966,000		
早稲田アカデミー	4,100	1,071.00	4,391,100	貸付株式数	1,600株
アルファシステムズ	2,000	4,340.00	8,680,000	貸付株式数	500株
フューチャー	15,900	1,617.00	25,710,300		
CAC HOLDINGS	4,100	1,439.00	5,899,900	貸付株式数	100株
SBテクノロジー	3,200	2,409.00	7,708,800		
トーセ	2,000	764.00	1,528,000	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	81,800	2,425.00	198,365,000		
オービックビジネスC	7,200	4,665.00	33,588,000		
伊藤忠テクノソリューションズ	34,100	3,415.00	116,451,500		
アイティフォー	9,200	768.00	7,065,600	貸付株式数	200株
東京個別指導学院	6,600	563.00	3,715,800	貸付株式数	2,500株
東計電算	900	6,100.00	5,490,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	155,900	1,292.00	201,422,800		
楽天グループ	301,200	644.00	193,972,800	貸付株式数	134,800株
エックスネット	1,100	1,003.00	1,103,300	貸付株式数	400株
クリーク・アンド・リバー社	3,900	2,475.00	9,652,500	貸付株式数	500株
モーニングスター	12,500	471.00	5,887,500	貸付株式数	4,800株
テー・オー・ダブリュー	13,100	312.00	4,087,200	貸付株式数	5,200株
大塚商会	36,100	4,465.00	161,186,500	貸付株式数	14,400株
サイボウズ	8,700	1,405.00	12,223,500	貸付株式数	3,400株
山田コンサルティングGP	3,900	1,252.00	4,882,800	貸付株式数	700株

セントラルスポーツ	2,700	2,542.00	6,863,400	貸付株式数	1,000株
パラカ	2,000	1,925.00	3,850,000	貸付株式数	600株
電通国際情報S	7,700	4,465.00	34,380,500	貸付株式数	3,800株
A C C E S S	8,600	739.00	6,355,400	貸付株式数	3,300株
デジタルガレージ	12,400	3,700.00	45,880,000		
イーエムシステムズ	10,700	844.00	9,030,800	貸付株式数	4,200株
ウェザーニューズ	2,300	7,900.00	18,170,000		
C I J	5,600	762.00	4,267,200	貸付株式数	700株
ビジネスエンジニアリング	1,700	2,122.00	3,607,400	貸付株式数	600株
日本エンタープライズ	7,300	154.00	1,124,200	貸付株式数	2,800株
WOWOW	2,800	1,360.00	3,808,000	貸付株式数	1,100株
スカラ	6,200	712.00	4,414,400	貸付株式数	2,400株
インテリジェント ウェイ ブ	4,000	720.00	2,880,000		
フルキャストホールディン グス	6,300	2,615.00	16,474,500		
エン・ジャパン	13,000	2,385.00	31,005,000		
あすか製薬HD	7,200	1,125.00	8,100,000		
サワイグループHD	14,600	4,060.00	59,276,000		
富士フイルムHLDGS	134,300	6,847.00	919,552,100		
コニカミノルタ	155,200	492.00	76,358,400		
資 生 堂	132,900	5,171.00	687,225,900		
ライオン	76,500	1,622.00	124,083,000	貸付株式数	32,500株
高砂香料	4,300	2,713.00	11,665,900		
マンダム	14,900	1,541.00	22,960,900		
ミルボン	9,400	6,400.00	60,160,000	貸付株式数	3,600株
ファンケル	30,900	2,860.00	88,374,000		
コーセー	12,900	14,520.00	187,308,000	貸付株式数	5,100株
コタ	5,300	1,536.00	8,140,800		
シーボン	1,000	1,660.00	1,660,000	貸付株式数	400株
ポーラ・オルビスHD	32,700	1,625.00	53,137,500	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	5,600	5,840.00	32,704,000		
アジュバンホールディング	1,700	956.00	1,625,200	貸付株式数	600株
新日本製薬	3,700	1,635.00	6,049,500	貸付株式数	1,400株 (500株)
エステー	4,800	1,551.00	7,444,800	貸付株式数	300株
アグロカネショウ	2,600	1,355.00	3,523,000	貸付株式数	1,000株
コ ニ シ	11,600	1,605.00	18,618,000	貸付株式数	400株
長谷川香料	13,200	3,155.00	41,646,000	貸付株式数	500株
星光PMC	3,500	548.00	1,918,000	貸付株式数	1,400株

小林製薬	19,500	8,340.00	162,630,000	貸付株式数	7,800株
荒川化学工業	5,400	1,035.00	5,589,000		
メック	5,200	2,344.00	12,188,800		
日本高純度化学	1,700	2,380.00	4,046,000		
タカラバイオ	20,000	1,788.00	35,760,000		
J C U	7,800	3,140.00	24,492,000		
新田ゼラチン	4,400	888.00	3,907,200	貸付株式数	1,500株
O A T アグリオ	2,900	1,848.00	5,359,200	貸付株式数	1,100株
デクセリアルズ	19,900	3,910.00	77,809,000	貸付株式数	1,700株
アース製薬	5,800	5,270.00	30,566,000	貸付株式数	700株
北興化学	6,500	960.00	6,240,000	貸付株式数	100株
大成ラミック	2,000	2,905.00	5,810,000		
クミアイ化学	25,400	1,026.00	26,060,400		
日本農薬	13,500	858.00	11,583,000		
富士興産	1,900	1,204.00	2,287,600		
ニチレキ	8,500	1,313.00	11,160,500	貸付株式数	700株
ユシロ化学	3,200	868.00	2,777,600	貸付株式数	100株
ピーピー・カストロール	2,600	1,091.00	2,836,600	貸付株式数	100株
富士石油	16,700	322.00	5,377,400		
M O R E S C O	2,700	1,099.00	2,967,300	貸付株式数	1,000株
出光興産	77,800	3,435.00	267,243,000		
E N E O S ホールディングス	1,149,600	505.40	581,007,840		
コスモエネルギーH L D G S	30,200	4,000.00	120,800,000	貸付株式数	12,000株
テスホールディングス	6,700	1,052.00	7,048,400	貸付株式数	2,600株
インフロニアH D	83,600	1,019.00	85,188,400		
横浜ゴム	36,300	2,340.00	84,942,000		
T O Y O T I R E	36,700	1,699.00	62,353,300	貸付株式数	14,500株
ブリヂストン	203,300	5,095.00	1,035,813,500		
住友ゴム	62,500	1,226.00	76,625,000	貸付株式数	5,600株
藤倉コンポジット	6,300	931.00	5,865,300	貸付株式数	2,500株
オカモト	3,500	3,865.00	13,527,500		
アキレス	4,800	1,318.00	6,326,400	貸付株式数	800株
フ コ ク	3,500	984.00	3,444,000	貸付株式数	100株
ニッタ	7,200	2,931.00	21,103,200		
クリエートメディック	2,500	905.00	2,262,500	貸付株式数	1,000株
住友理工	14,900	581.00	8,656,900		
三ツ星ベルト	9,400	3,300.00	31,020,000		
バンドー化学	12,500	1,043.00	13,037,500	貸付株式数	100株



A G C	64,800	4,765.00	308,772,000	貸付株式数	25,900株
日本板硝子	34,700	577.00	20,021,900		
石塚硝子	1,200	1,572.00	1,886,400	貸付株式数	400株
有沢製作所	10,300	1,322.00	13,616,600	貸付株式数	2,900株
日本山村硝子	2,200	605.00	1,331,000	貸付株式数	500株
日本電気硝子	26,000	2,622.00	68,172,000		
オハラ	3,000	1,385.00	4,155,000	貸付株式数	1,200株
住友大阪セメント	11,500	3,495.00	40,192,500		
太平洋セメント	43,500	2,148.00	93,438,000		
リソルホールディングス	800	4,585.00	3,668,000	貸付株式数	300株
日本ヒユ-ム	7,100	653.00	4,636,300	貸付株式数	2,400株
日本コンクリ-ト	13,600	268.00	3,644,800	貸付株式数	400株
三谷セキサン	3,100	3,740.00	11,594,000		
アジアパイルHD	11,300	512.00	5,785,600	貸付株式数	200株
東海カーボン	53,300	1,053.00	56,124,900		
日本カーボン	3,700	4,085.00	15,114,500	貸付株式数	300株
東洋炭素	4,100	3,495.00	14,329,500		
ノリタケ	3,900	4,075.00	15,892,500		
T O T O	46,200	4,940.00	228,228,000		
日本碍子	75,300	2,007.00	151,127,100		
日本特殊陶業	53,400	2,943.00	157,156,200		
ダントーホールディングス	5,100	323.00	1,647,300	貸付株式数	2,000株
M A R U W A	2,600	18,000.00	46,800,000		
品川リフラクトリーズ	1,800	3,990.00	7,182,000		
黒崎播磨	1,300	4,965.00	6,454,500		
ヨータイ	4,900	1,409.00	6,904,100	貸付株式数	100株
東京窯業	8,000	271.00	2,168,000	貸付株式数	2,800株
ニッカトー	3,500	446.00	1,561,000	貸付株式数	1,300株
フジインコーポレーテッド	6,100	6,230.00	38,003,000		
クニミネ工業	2,400	820.00	1,968,000	貸付株式数	900株
エーアンドエーマテリアル	1,200	868.00	1,041,600	貸付株式数	400株
ニチアス	16,100	2,378.00	38,285,800	貸付株式数	800株
日本製鉄	315,700	2,251.00	710,640,700		
神戸製鋼所	131,900	646.00	85,207,400		
中山製鋼所	10,900	632.00	6,888,800		
合同製鐵	3,600	1,824.00	6,566,400		
J F E ホールディングス	175,000	1,470.00	257,250,000		
東京製鐵	22,200	1,302.00	28,904,400		
共英製鋼	7,400	1,545.00	11,433,000		

大和工業	12,400	4,550.00	56,420,000	貸付株式数	100株
東京鐵鋼	2,900	1,343.00	3,894,700	貸付株式数	1,100株
大阪製鐵	4,100	1,205.00	4,940,500	貸付株式数	1,400株
淀川製鋼所	8,200	2,487.00	20,393,400	貸付株式数	400株
丸一鋼管	21,900	2,997.00	65,634,300		
モリ工業	1,900	2,671.00	5,074,900		
大同特殊鋼	10,300	3,835.00	39,500,500		
日本高周波	2,900	321.00	930,900	貸付株式数	1,100株
日本冶金工	5,200	2,905.00	15,106,000		
山陽特殊製鋼	6,500	2,023.00	13,149,500		
愛知製鋼	4,200	2,178.00	9,147,600		
日立金属	71,500	2,174.00	155,441,000		
日本金属	2,000	996.00	1,992,000	貸付株式数	700株
大平洋金属	4,700	2,450.00	11,515,000		
新日本電工	42,000	352.00	14,784,000	貸付株式数	1,000株
栗本鉄工所	3,000	1,624.00	4,872,000	貸付株式数	100株
虹 技	1,000	937.00	937,000	貸付株式数	100株
日本鑄鉄管	800	971.00	776,800	貸付株式数	300株
日本製鋼所	19,400	3,045.00	59,073,000		
三菱製鋼	4,800	990.00	4,752,000	貸付株式数	100株
日亜鋼業	8,700	243.00	2,114,100		
日本精線	1,200	4,650.00	5,580,000	貸付株式数	400株
エンビプロHD	5,000	882.00	4,410,000	貸付株式数	1,900株
大紀アルミニウム	9,300	1,311.00	12,192,300		
日本軽金属HD	19,200	1,619.00	31,084,800		
三井金属	20,400	3,175.00	64,770,000		
東邦亜鉛	3,900	2,413.00	9,410,700		
三菱マテリアル	43,600	2,049.00	89,336,400		
住友鋳山	82,900	4,390.00	363,931,000		
DOWAホールディングス	17,600	5,460.00	96,096,000		
古河機金	11,100	1,249.00	13,863,900	貸付株式数	300株
エス・サイエンス	37,200	25.00	930,000	貸付株式数	13,600株
大阪チタニウム	8,800	3,185.00	28,028,000	貸付株式数	1,100株
東邦チタニウム	13,600	2,473.00	33,632,800	貸付株式数	5,400株
UACJ	10,300	2,400.00	24,720,000		
CKサンエツ	1,400	4,020.00	5,628,000	貸付株式数	500株
古河電工	21,800	2,485.00	54,173,000		
住友電工	263,800	1,624.00	428,411,200		
フジクラ	84,500	969.00	81,880,500		
昭和電線HLDGS	6,600	1,866.00	12,315,600	貸付株式数	100株

東京特殊電線	1,000	2,222.00	2,222,000	貸付株式数	400株
タツタ電線	13,600	456.00	6,201,600	貸付株式数	500株
カナレ電気	1,100	1,443.00	1,587,300	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	4,300	1,092.00	4,695,600	貸付株式数	1,600株
リョービ	7,100	1,313.00	9,322,300		
アーレステイ	8,000	403.00	3,224,000	貸付株式数	200株
アサヒHD	30,200	2,124.00	64,144,800		
東洋製罐グループHD	38,500	1,807.00	69,569,500		
ホッカンホールディングス	3,300	1,325.00	4,372,500	貸付株式数	1,400株
コロナ	3,400	844.00	2,869,600	貸付株式数	300株
横河ブリッジHLDGS	10,800	1,950.00	21,060,000		
駒井ハルテック	1,200	1,672.00	2,006,400	貸付株式数	400株
高田機工	600	2,401.00	1,440,600	貸付株式数	200株
三和ホールディングス	71,200	1,352.00	96,262,400		
文化シャツタ -	22,400	1,051.00	23,542,400	貸付株式数	8,800株
三協立山	9,100	616.00	5,605,600	貸付株式数	100株
アルインコ	5,500	891.00	4,900,500	貸付株式数	1,800株
東洋シャツタ -	1,600	543.00	868,800	貸付株式数	200株
LIXIL	119,000	2,329.00	277,151,000		
日本フィルコン	4,800	468.00	2,246,400	貸付株式数	2,100株
ノーリツ	9,700	1,557.00	15,102,900	貸付株式数	200株
長府製作所	6,700	2,043.00	13,688,100	貸付株式数	200株
リンナイ	13,100	10,590.00	138,729,000		
ユニプレス	12,700	984.00	12,496,800		
ダイニチ工業	3,800	636.00	2,416,800	貸付株式数	1,300株
日東精工	9,600	534.00	5,126,400	貸付株式数	3,800株
三洋工業	800	1,701.00	1,360,800	貸付株式数	200株
岡 部	10,700	671.00	7,179,700		
ジーテクト	8,400	1,383.00	11,617,200		
東 プ レ	11,600	1,234.00	14,314,400		
高周波熱錬	11,400	689.00	7,854,600		
東京製綱	4,700	945.00	4,441,500	貸付株式数	100株
サンコール	6,600	747.00	4,930,200		
モリテックスチル	5,900	266.00	1,569,400	貸付株式数	2,300株
パイオラックス	10,000	1,955.00	19,550,000		
エイチワン	6,800	603.00	4,100,400		
日本発条	63,900	941.00	60,129,900	貸付株式数	100株
中央発條	3,600	697.00	2,509,200		
アドバネクス	1,000	1,218.00	1,218,000	貸付株式数	400株
三浦工業	29,700	2,860.00	84,942,000		

タクマ	21,700	1,300.00	28,210,000		
テクノプロ・ホールディング	43,800	2,986.00	130,786,800	貸付株式数	17,400株
アトラグループ	1,900	189.00	359,100	貸付株式数	600株
インターワークス	2,500	379.00	947,500	貸付株式数	800株
アイ・アールジャパンHD	3,400	2,102.00	7,146,800	貸付株式数	1,300株
Keepers 技研	4,700	3,885.00	18,259,500		
ファーストロジック	1,100	875.00	962,500	貸付株式数	100株
三機サービス	1,200	917.00	1,100,400	貸付株式数	400株
Gunosy	4,100	765.00	3,136,500	貸付株式数	1,600株
デザインワン・ジャパン	2,300	173.00	397,900	貸付株式数	900株 (100株)
イー・ガーディアン	2,500	2,918.00	7,295,000		
リブセンス	3,700	258.00	954,600	貸付株式数	2,400株 (2,400株)
ジャパンマテリアル	22,500	1,944.00	43,740,000		
ベクトル	10,200	1,100.00	11,220,000		
ウチヤマホールディングス	3,700	298.00	1,102,600	貸付株式数	1,400株
チャームケアコーポレーション	5,500	1,107.00	6,088,500	貸付株式数	2,100株
キャリアリンク	2,700	2,223.00	6,002,100	貸付株式数	1,000株
I B J	3,900	942.00	3,673,800	貸付株式数	2,000株
アサンテ	3,100	1,610.00	4,991,000	貸付株式数	1,200株
バリューHR	5,700	1,473.00	8,396,100	貸付株式数	2,000株
M & A キャピタルパートナー	6,000	3,860.00	23,160,000	貸付株式数	2,400株
ライドオンエクスプレスHD	2,900	1,107.00	3,210,300	貸付株式数	1,100株
ERIホールディングス	2,100	1,100.00	2,310,000	貸付株式数	800株
アビスト	1,100	2,955.00	3,250,500	貸付株式数	400株
シグマクシス・ホールディング	8,800	1,194.00	10,507,200		
ウィルグループ	5,400	1,410.00	7,614,000		
エスクローAJ	8,100	169.00	1,368,900		
メドピア	5,100	1,404.00	7,160,400	貸付株式数	2,000株
レアジョブ	1,400	746.00	1,044,400	貸付株式数	500株
リクルートホールディングス	523,300	4,403.00	2,304,089,900		
エラン	8,600	1,106.00	9,511,600		
ツガミ	15,400	1,188.00	18,295,200		

オークマ	7,200	5,140.00	37,008,000		
芝浦機械	8,600	2,896.00	24,905,600		
アマダ	119,300	1,076.00	128,366,800		
アイダエンジニア	16,500	830.00	13,695,000	貸付株式数	400株
滝澤鉄工所	2,300	1,148.00	2,640,400	貸付株式数	900株
F U J I	30,100	1,981.00	59,628,100		
牧野フライス	7,700	4,460.00	34,342,000	貸付株式数	100株
オーエスジー	30,700	1,893.00	58,115,100		
ダイジェット	900	865.00	778,500		
旭ダイヤモンド	18,900	745.00	14,080,500		
D M G 森精機	38,900	1,758.00	68,386,200	貸付株式数	16,600株
ソディック	17,800	781.00	13,901,800	貸付株式数	400株
ディスコ	11,100	34,200.00	379,620,000		
日東工器	3,700	1,610.00	5,957,000		
日進工具	6,000	1,131.00	6,786,000	貸付株式数	1,200株
パンチ工業	6,400	431.00	2,758,400	貸付株式数	2,500株
富士ダイス	3,900	603.00	2,351,700	貸付株式数	1,200株
土木管理総合試験	3,200	308.00	985,600	貸付株式数	100株
ネットマーケティング	3,600	898.00	3,232,800	貸付株式数	1,300株
日本郵政	797,500	998.60	796,383,500		
ベルシステム24HLDGS	10,500	1,394.00	14,637,000	貸付株式数	4,100株
鎌倉新書	8,400	868.00	7,291,200	貸付株式数	3,300株 (1,400株)
S M N	1,700	531.00	902,700	貸付株式数	600株
一蔵	1,000	465.00	465,000	貸付株式数	400株
グローバルキッズCOMP	1,100	672.00	739,200		
エアトリ	4,200	3,020.00	12,684,000	貸付株式数	1,600株
アトラエ	5,100	1,506.00	7,680,600		
ストライク	3,200	4,100.00	13,120,000	貸付株式数	1,200株
ソラスト	18,000	906.00	16,308,000		
セラク	2,300	1,088.00	2,502,400	貸付株式数	900株
インソース	8,100	2,842.00	23,020,200	貸付株式数	3,200株
豊田自動織機	54,100	7,360.00	398,176,000		
豊和工業	4,000	820.00	3,280,000	貸付株式数	1,300株
ニデックオーケーケー	2,900	1,167.00	3,384,300	貸付株式数	1,100株
石川製作所	2,100	1,374.00	2,885,400	貸付株式数	800株
東洋機械金属	5,000	583.00	2,915,000	貸付株式数	800株
津田駒工業	1,200	486.00	583,200	貸付株式数	400株
エンシュウ	1,900	770.00	1,463,000	貸付株式数	400株

島精機製作所	11,100	2,138.00	23,731,800	
オプトラン	9,500	2,356.00	22,382,000	
NCホールディングス	2,100	1,829.00	3,840,900	
イワキポンプ	4,900	1,320.00	6,468,000	
フリー	6,800	1,048.00	7,126,400	貸付株式数 900株
ヤマシンフィルタ	11,800	336.00	3,964,800	貸付株式数 4,700株
日阪製作所	7,500	835.00	6,262,500	貸付株式数 200株
やまびこ	10,500	1,148.00	12,054,000	
野村マイクロ・サイエンス	2,400	3,665.00	8,796,000	貸付株式数 800株
平田機工	3,300	4,515.00	14,899,500	
ペガサスミシン製造	7,700	930.00	7,161,000	
マルマエ	3,100	1,986.00	6,156,600	貸付株式数 1,200株 (900株)
タツモ	3,500	1,402.00	4,907,000	貸付株式数 1,300株
ナプテスコ	40,300	3,140.00	126,542,000	貸付株式数 15,100株
三井海洋開発	8,000	1,467.00	11,736,000	
レオン自動機	8,100	1,176.00	9,525,600	貸付株式数 1,700株
S M C	22,400	63,200.00	1,415,680,000	
ホソカワミクロン	4,900	2,564.00	12,563,600	
ユニオンツール	2,800	3,530.00	9,884,000	貸付株式数 1,100株
オイレス工業	9,700	1,506.00	14,608,200	貸付株式数 3,900株
日精エーエスビー	2,900	4,035.00	11,701,500	
サト - ホールディングス	9,900	1,909.00	18,899,100	
技研製作所	6,700	3,355.00	22,478,500	
日本エアーテック	3,200	1,063.00	3,401,600	貸付株式数 1,200株
カワタ	2,400	883.00	2,119,200	
日精樹脂工業	4,600	959.00	4,411,400	
オカダアイヨン	2,400	1,446.00	3,470,400	貸付株式数 900株
ワイエイシイホールディングス	3,000	1,377.00	4,131,000	貸付株式数 1,100株
小松製作所	346,500	2,814.00	975,051,000	
住友重機械	40,900	2,902.00	118,691,800	
日立建機	30,600	2,928.00	89,596,800	
日工	9,300	637.00	5,924,100	貸付株式数 200株
巴工業	2,700	2,486.00	6,712,200	貸付株式数 1,200株
井関農機	6,000	1,237.00	7,422,000	
T O W A	6,600	1,787.00	11,794,200	貸付株式数 2,500株
丸山製作所	1,200	1,545.00	1,854,000	貸付株式数 400株
北川鉄工所	3,000	1,299.00	3,897,000	
シンニッタン	8,700	219.00	1,905,300	貸付株式数 300株

ローツエ	3,800	8,210.00	31,198,000	
タカキタ	2,500	530.00	1,325,000	貸付株式数 1,000株 (100株)
クボタ	341,800	2,160.50	738,458,900	
荏原実業	3,200	2,207.00	7,062,400	
東洋エンジニア	10,100	635.00	6,413,500	
三菱化工機	2,200	2,168.00	4,769,600	貸付株式数 800株
月島機械	11,900	919.00	10,936,100	貸付株式数 4,000株
帝国電機製作所	4,900	1,972.00	9,662,800	
東京機械	3,100	670.00	2,077,000	
新東工業	14,200	707.00	10,039,400	
渋谷工業	6,000	2,427.00	14,562,000	貸付株式数 500株
アイチ コーポレーション	10,700	809.00	8,656,300	貸付株式数 100株
小森コーポレーション	17,400	735.00	12,789,000	
鶴見製作所	5,400	2,325.00	12,555,000	貸付株式数 100株
住友精密	1,200	2,649.00	3,178,800	
日本ギア工業	3,400	382.00	1,298,800	貸付株式数 700株
酒井重工業	1,200	3,035.00	3,642,000	
荏原製作所	26,200	5,110.00	133,882,000	貸付株式数 11,100株
石井鉄工所	1,000	2,789.00	2,789,000	貸付株式数 300株
西島製作所	6,300	1,360.00	8,568,000	
北越工業	6,500	1,000.00	6,500,000	
ダイキン工業	83,500	24,095.00	2,011,932,500	
オルガノ	2,200	9,070.00	19,954,000	
ト - ヨ - カネツ	2,600	2,510.00	6,526,000	
栗田工業	38,600	5,470.00	211,142,000	
椿本チエイン	10,000	3,285.00	32,850,000	
大同工業	3,000	713.00	2,139,000	貸付株式数 1,200株
日 機 装	15,800	1,009.00	15,942,200	貸付株式数 400株
木村化工機	5,900	718.00	4,236,200	貸付株式数 2,300株
レイズネクスト	10,300	1,169.00	12,040,700	
アネスト岩田	11,800	895.00	10,561,000	貸付株式数 400株
ダイフク	36,100	7,310.00	263,891,000	
サムコ	2,100	3,275.00	6,877,500	貸付株式数 700株
加藤製作所	3,500	748.00	2,618,000	貸付株式数 1,000株
油研工業	1,200	1,782.00	2,138,400	貸付株式数 300株
タダノ	36,900	902.00	33,283,800	貸付株式数 2,000株
フジテック	23,500	2,908.00	68,338,000	
C K D	19,300	1,868.00	36,052,400	貸付株式数 1,000株
キトー	5,800	2,700.00	15,660,000	

平和	21,300	2,174.00	46,306,200	
理想科学工業	6,400	2,403.00	15,379,200	貸付株式数 200株
SANKYO	15,800	4,120.00	65,096,000	
日本金銭機械	7,900	655.00	5,174,500	貸付株式数 700株
マースグループHLDGS	4,900	1,665.00	8,158,500	貸付株式数 100株
フクシマガリレイ	4,700	3,710.00	17,437,000	
オーイズミ	2,800	394.00	1,103,200	貸付株式数 100株
ダイコク電機	3,500	1,321.00	4,623,500	貸付株式数 1,100株
竹内製作所	11,700	2,680.00	31,356,000	
アマノ	20,100	2,490.00	50,049,000	
JUKI	10,000	698.00	6,980,000	
サンデン	11,100	260.00	2,886,000	貸付株式数 4,200株
ジャノメ	6,600	690.00	4,554,000	貸付株式数 800株
ブラザー工業	87,200	2,607.00	227,330,400	
マックス	9,000	1,993.00	17,937,000	
モリタホールディングス	12,300	1,306.00	16,063,800	
グローリー	18,100	2,312.00	41,847,200	
新晃工業	7,100	1,565.00	11,111,500	
大和冷機工業	9,800	1,104.00	10,819,200	
セガサミーホールディングス	68,700	1,973.00	135,545,100	
日本ピストンリング	2,900	1,268.00	3,677,200	
リケン	2,900	2,419.00	7,015,100	
TPR	8,600	1,290.00	11,094,000	
ツバキ・ナカシマ	15,800	1,217.00	19,228,600	
ホシザキ	41,200	3,905.00	160,886,000	貸付株式数 16,400株
大豊工業	6,200	706.00	4,377,200	
日本精工	130,800	777.00	101,631,600	
NTN	139,700	287.00	40,093,900	
ジェイテクト	65,200	1,028.00	67,025,600	
不二越	4,700	3,700.00	17,390,000	貸付株式数 200株
ミネベアミツミ	121,600	2,431.00	295,609,600	
日本トムソン	17,500	576.00	10,080,000	
THK	37,000	2,656.00	98,272,000	貸付株式数 14,800株
ユーシン精機	5,700	719.00	4,098,300	
前澤給装工業	4,900	907.00	4,444,300	貸付株式数 200株
イーグル工業	8,400	1,201.00	10,088,400	
前澤工業	4,600	614.00	2,824,400	
日本ピラ - 工業	6,500	2,516.00	16,354,000	
キッツ	23,400	831.00	19,445,400	



日立	367,700	6,728.00	2,473,885,600		
東芝	133,600	5,101.00	681,493,600		
三菱電機	713,300	1,387.50	989,703,750		
富士電機	42,500	5,840.00	248,200,000		
東洋電機製造	2,300	883.00	2,030,900	貸付株式数	500株
安川電機	75,900	4,495.00	341,170,500		
シンフォニアテクノロジー	7,700	1,432.00	11,026,400	貸付株式数	100株
明電舎	10,900	2,011.00	21,919,900		
オリジン	1,900	1,385.00	2,631,500	貸付株式数	700株
山洋電気	2,800	5,140.00	14,392,000		
デンヨー	5,300	1,505.00	7,976,500		
PHCホールディングス	11,800	1,575.00	18,585,000		
ベイカレントコンサルティング	5,200	40,450.00	210,340,000	貸付株式数	2,000株
ORCHESTRA HOLDINGS	1,400	2,565.00	3,591,000	貸付株式数	400株
アイモバイル	3,600	1,263.00	4,546,800	貸付株式数	1,400株
キャリアインデックス	2,500	396.00	990,000	貸付株式数	100株
MS - Japan	3,000	897.00	2,691,000	貸付株式数	1,100株 (100株)
船場	900	726.00	653,400	貸付株式数	200株
ジャパンエレベーターSHD	23,100	1,942.00	44,860,200		
フルテック	1,100	1,168.00	1,284,800	貸付株式数	300株
グリーンズ	2,700	844.00	2,278,800	貸付株式数	1,000株
ツナググループHLDGS	2,300	342.00	786,600	貸付株式数	700株
GAMEWITH	2,200	370.00	814,000	貸付株式数	800株
MS&CONSULTING	1,200	621.00	745,200	貸付株式数	300株
ウェルビー	4,800	749.00	3,595,200	貸付株式数	1,800株
エル・ティー・エス	800	3,200.00	2,560,000		
ミダックホールディングス	3,300	3,430.00	11,319,000	貸付株式数	1,300株
日総工産	5,700	582.00	3,317,400	貸付株式数	2,100株
キュービーネットHLDGS	3,400	1,447.00	4,919,800		
RPAホールディングス	10,200	296.00	3,019,200	貸付株式数	4,000株
三桜工業	10,700	730.00	7,811,000		
マキタ	86,400	3,030.00	261,792,000		
東芝テック	8,200	4,020.00	32,964,000		

芝浦メカトロニクス	1,400	10,680.00	14,952,000	貸付株式数	500株
マブチモーター	15,900	4,070.00	64,713,000	貸付株式数	400株
日本電産	169,800	9,184.00	1,559,443,200		
ユーエムシーエレクトロニクス	2,600	484.00	1,258,400		
トレックス・セミコンダクター	3,300	2,781.00	9,177,300	貸付株式数	1,300株
東光高岳	4,300	1,898.00	8,161,400	貸付株式数	1,200株
ダブル・スコープ	21,000	1,979.00	41,559,000	貸付株式数	8,700株 (100株)
宮越ホールディングス	3,100	922.00	2,858,200	貸付株式数	1,100株
ダイヘン	7,000	4,055.00	28,385,000		
ヤーマン	12,500	1,254.00	15,675,000	貸付株式数	4,900株
JVCケンウッド	62,600	202.00	12,645,200	貸付株式数	1,400株
ミマキエンジニアリング	6,800	699.00	4,753,200		
I - P E X	3,700	1,329.00	4,917,300	貸付株式数	400株
日新電機	17,800	1,395.00	24,831,000		
大崎電気	12,500	541.00	6,762,500	貸付株式数	100株
オムロン	63,600	7,000.00	445,200,000		
日東工業	9,700	2,602.00	25,239,400	貸付株式数	100株
I D E C	9,500	3,025.00	28,737,500	貸付株式数	100株
正興電機製作所	2,600	1,019.00	2,649,400	貸付株式数	900株
不二電機工業	1,500	1,109.00	1,663,500	貸付株式数	500株 (100株)
ジーエス・ユアサ コーポ	23,000	2,486.00	57,178,000		
サクサホールディングス	1,700	1,262.00	2,145,400	貸付株式数	600株
メルコホールディングス	2,100	3,200.00	6,720,000	貸付株式数	600株
テクノメディカ	1,700	1,614.00	2,743,800	貸付株式数	600株
ダイヤモンドエレクトリックHD	2,100	1,236.00	2,595,600	貸付株式数	800株
日本電気	90,700	4,870.00	441,709,000		
富士通	68,800	16,035.00	1,103,208,000		
沖電気	29,100	725.00	21,097,500		
岩崎通信機	2,900	746.00	2,163,400	貸付株式数	1,100株
電気興業	3,700	2,344.00	8,672,800		
サンケン電気	6,600	4,860.00	32,076,000		
ナカヨ	1,200	1,061.00	1,273,200	貸付株式数	300株
アイホン	3,400	2,021.00	6,871,400		
ルネサスエレクトロニクス	417,200	1,336.00	557,379,200	貸付株式数	166,700株
セイコーエプソン	85,400	2,144.00	183,097,600		

ワコム	58,600	762.00	44,653,200	貸付株式数	23,300株
アルバック	15,200	5,680.00	86,336,000		
アクセル	3,000	944.00	2,832,000	貸付株式数	1,100株
E I Z O	5,200	3,835.00	19,942,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	48.00	2,961,600		
日本信号	16,300	949.00	15,468,700	貸付株式数	6,300株
京三製作所	15,100	426.00	6,432,600	貸付株式数	4,200株
能美防災	8,700	1,598.00	13,902,600		
ホーチキ	4,800	1,340.00	6,432,000	貸付株式数	1,300株
星和電機	3,100	443.00	1,373,300	貸付株式数	1,300株
エレコム	17,500	1,592.00	27,860,000		
パナソニック ホールディ ンク	815,400	1,114.50	908,763,300		
シャープ	72,600	945.00	68,607,000	貸付株式数	28,900株
アンリツ	48,400	1,632.00	78,988,800		
富士通ゼネラル	20,700	2,960.00	61,272,000		
ソニーグループ	478,900	10,355.00	4,959,009,500		
T D K	110,700	5,100.00	564,570,000		
帝国通信工業	3,300	1,432.00	4,725,600	貸付株式数	100株
タムラ製作所	27,600	684.00	18,878,400	貸付株式数	10,900株
アルプスアルパイン	62,600	1,233.00	77,185,800		
池上通信機	2,300	587.00	1,350,100	貸付株式数	800株
日本電波工業	7,700	1,474.00	11,349,800	貸付株式数	2,300株
鈴木	3,800	884.00	3,359,200	貸付株式数	100株
メイコー	8,300	2,923.00	24,260,900		
日本トリム	1,500	2,366.00	3,549,000		
ローランド ディー . ジー .	3,600	3,200.00	11,520,000	貸付株式数	700株
フオスタ - 電機	7,200	783.00	5,637,600		
S M K	1,700	2,440.00	4,148,000	貸付株式数	600株
ヨコオ	5,200	2,130.00	11,076,000		
ティアック	12,600	113.00	1,423,800	貸付株式数	4,000株
ホシデン	17,000	1,622.00	27,574,000		
ヒロセ電機	10,600	20,170.00	213,802,000		
日本航空電子	15,400	2,389.00	36,790,600		
T O A	8,300	808.00	6,706,400	貸付株式数	100株
マクセル	14,000	1,491.00	20,874,000		
古野電気	9,200	1,137.00	10,460,400	貸付株式数	400株
スミダコーポレーション	5,800	1,065.00	6,177,000		
アイコム	2,400	2,623.00	6,295,200	貸付株式数	1,000株

リオン	2,700	2,043.00	5,516,100	
本多通信工業	2,800	705.00	1,974,000	
横河電機	70,200	2,336.00	163,987,200	
新電元工業	2,700	3,900.00	10,530,000	貸付株式数 100株
アズビル	44,300	3,965.00	175,649,500	
東亜ディーケーケー	3,900	843.00	3,287,700	貸付株式数 1,500株
日本光電工業	29,400	2,993.00	87,994,200	
チノール	2,400	1,646.00	3,950,400	貸付株式数 900株
共和電業	7,000	340.00	2,380,000	貸付株式数 3,400株
日本電子材料	3,600	1,490.00	5,364,000	貸付株式数 1,300株
堀場製作所	14,100	6,040.00	85,164,000	貸付株式数 4,900株
アドバンテスト	56,800	7,410.00	420,888,000	
小野測器	2,700	406.00	1,096,200	貸付株式数 700株
エスベック	5,700	1,783.00	10,163,100	
キーエンス	69,300	51,190.00	3,547,467,000	
日置電機	3,300	6,620.00	21,846,000	貸付株式数 1,000株
シスメックス	54,700	8,211.00	449,141,700	
日本マイクロニクス	10,500	1,361.00	14,290,500	
メガチップス	6,800	2,622.00	17,829,600	
OBARA GROUP	3,000	3,295.00	9,885,000	貸付株式数 1,400株
IMAGICA GROUP	5,400	936.00	5,054,400	貸付株式数 800株
澤藤電機	1,000	1,142.00	1,142,000	貸付株式数 300株
デンソー	149,600	7,425.00	1,110,780,000	
原田工業	3,600	780.00	2,808,000	貸付株式数 1,200株 (1,000株)
コーセル	8,500	850.00	7,225,000	
イリソ電子工業	6,400	4,185.00	26,784,000	貸付株式数 2,400株
オプテックスグループ	11,700	2,102.00	24,593,400	貸付株式数 400株
千代田インテグレ	2,600	2,212.00	5,751,200	貸付株式数 100株
レーザーテック	31,300	17,485.00	547,280,500	
スタンレー電気	49,300	2,563.00	126,355,900	
岩崎電気	2,500	2,519.00	6,297,500	
ウシオ電機	36,300	1,617.00	58,697,100	
岡谷電機	5,300	246.00	1,303,800	貸付株式数 2,100株
ヘリオステクノH	7,200	379.00	2,728,800	貸付株式数 2,800株
エノモト	2,100	1,489.00	3,126,900	貸付株式数 800株
日本セラミック	6,400	2,632.00	16,844,800	
遠藤照明	3,500	771.00	2,698,500	貸付株式数 100株
古河電池	5,400	1,169.00	6,312,600	貸付株式数 2,100株

双信電機	3,800	417.00	1,584,600	貸付株式数	1,500株
山一電機	5,000	2,019.00	10,095,000		
函 研	5,000	3,610.00	18,050,000	貸付株式数	1,700株
日本電子	14,700	5,410.00	79,527,000		
カ シ オ	47,300	1,344.00	63,571,200		
ファナック	67,100	21,805.00	1,463,115,500		
日本シイエムケイ	13,600	475.00	6,460,000	貸付株式数	5,500株
エンプラス	1,900	4,460.00	8,474,000		
大真空	9,500	957.00	9,091,500	貸付株式数	3,800株 (100株)
ロ - ム	31,800	10,640.00	338,352,000		
浜松ホトニクス	50,900	6,340.00	322,706,000		
三井ハイテック	6,600	7,970.00	52,602,000	貸付株式数	2,600株
新光電気工業	22,500	3,655.00	82,237,500	貸付株式数	100株
京 セ ラ	107,500	8,093.00	869,997,500		
協栄産業	900	1,469.00	1,322,100		
太陽誘電	34,000	4,145.00	140,930,000		
村田製作所	208,500	7,393.00	1,541,440,500		
双葉電子工業	12,700	643.00	8,166,100		
日東電工	46,200	8,640.00	399,168,000		
北陸電気工業	2,800	1,090.00	3,052,000	貸付株式数	1,100株
東海理化電機	20,300	1,522.00	30,896,600		
ニチコン	20,300	1,471.00	29,861,300	貸付株式数	100株
日本ケミコン	7,200	1,969.00	14,176,800		
K O A	10,600	2,413.00	25,577,800	貸付株式数	3,800株
三井E & S H D	21,700	410.00	8,897,000		
日立造船	60,700	872.00	52,930,400		
三菱重工業	112,200	5,191.00	582,430,200		
川崎重工業	51,900	2,467.00	128,037,300		
I H I	47,800	3,475.00	166,105,000		
名村造船所	20,000	650.00	13,000,000	貸付株式数	7,900株 (7,500株)
サノヤスホールディングス	9,700	123.00	1,193,100	貸付株式数	3,800株
スプリックス	2,500	980.00	2,450,000	貸付株式数	800株
マネジメントソリューションズ	3,600	2,702.00	9,727,200	貸付株式数	1,400株
プロレド・パートナーズ	1,600	566.00	905,600	貸付株式数	600株
A N D F A C T O R Y	1,700	364.00	618,800	貸付株式数	800株
テノ・ホールディングス	800	544.00	435,200	貸付株式数	300株

フロンティア・マネジメント	2,200	1,267.00	2,787,400		
ピアラ	1,200	712.00	854,400	貸付株式数	400株
コプロ・ホールディングス	1,500	897.00	1,345,500	貸付株式数	100株
ギークス	1,300	858.00	1,115,400	貸付株式数	500株
カーブスホールディングス	20,000	832.00	16,640,000	貸付株式数	8,000株
フォーラムエンジニアリング	4,500	915.00	4,117,500		
FAST FITNESS JAP	1,300	1,565.00	2,034,500	貸付株式数	500株
日本車輛	2,400	2,102.00	5,044,800	貸付株式数	900株
三菱ロジスネクスト	10,100	785.00	7,928,500	貸付株式数	200株
近畿車輛	1,200	987.00	1,184,400	貸付株式数	400株
一家ホールディングス	1,800	777.00	1,398,600	貸付株式数	600株
フルサト・マルカHD	6,700	3,295.00	22,076,500	貸付株式数	2,600株
ヤマエグループHD	4,300	1,602.00	6,888,600	貸付株式数	100株
藤久ホールディングス	2,400	680.00	1,632,000	貸付株式数	900株
FPG	25,500	1,340.00	34,170,000	貸付株式数	2,900株
島根銀行	2,100	464.00	974,400	貸付株式数	200株
じもとホールディングス	4,900	514.00	2,518,600	貸付株式数	1,900株
全国保証	18,000	4,725.00	85,050,000	貸付株式数	7,200株
めぶきフィナンシャルG	311,100	286.00	88,974,600		
ジャパンインベストメントA	5,100	1,383.00	7,053,300	貸付株式数	2,300株
東京きらぼしFG	8,800	2,286.00	20,116,800		
九州フィナンシャルG	132,100	385.00	50,858,500		
かんぼ生命保険	75,800	2,287.00	173,354,600		
ゆうちょ銀行	177,800	1,047.00	186,156,600	貸付株式数	71,100株
あんしん保証	3,400	262.00	890,800	貸付株式数	1,200株
富山第一銀行	17,200	442.00	7,602,400	貸付株式数	400株
コンコルディア・フィナンシャル	373,200	467.00	174,284,400		
ジェイリース	2,600	2,565.00	6,669,000	貸付株式数	1,000株
西日本フィナンシャルHD	39,700	773.00	30,688,100		
イントラスト	3,300	624.00	2,059,200	貸付株式数	100株
日本モーゲージサービス	4,200	907.00	3,809,400	貸付株式数	1,600株
Casa	2,700	830.00	2,241,000	貸付株式数	800株
アルヒ	11,100	1,400.00	15,540,000	貸付株式数	1,700株
プレミアグループ	11,400	1,946.00	22,184,400		
日産自動車	901,800	537.70	484,897,860		

いすゞ自動車	221,400	1,789.00	396,084,600		
トヨタ自動車	3,485,100	2,048.50	7,139,227,350		
日野自動車	95,400	659.00	62,868,600		
三菱自動車工業	283,500	612.00	173,502,000	貸付株式数	101,400株
エフテック	4,700	529.00	2,486,300	貸付株式数	1,500株
レシップホールディングス	2,900	515.00	1,493,500	貸付株式数	700株
G M B	1,400	703.00	984,200	貸付株式数	300株
ファルテック	1,600	594.00	950,400	貸付株式数	200株
武蔵精密工業	17,000	1,710.00	29,070,000	貸付株式数	600株
日産車体	11,400	800.00	9,120,000	貸付株式数	4,100株
新明和工業	20,000	1,039.00	20,780,000		
極東開発工業	12,400	1,382.00	17,136,800		
トピー工業	5,900	1,400.00	8,260,000		
ティラド	2,100	2,719.00	5,709,900		
タチエス	12,600	1,235.00	15,561,000	貸付株式数	300株
N O K	28,900	1,261.00	36,442,900	貸付株式数	3,900株
フタバ産業	17,100	345.00	5,899,500		
K Y B	6,700	3,415.00	22,880,500		
市光工業	9,600	403.00	3,868,800		
大同メタル工業	14,700	517.00	7,599,900		
プレス工業	34,700	431.00	14,955,700	貸付株式数	10,800株
ミクニ	9,300	327.00	3,041,100	貸付株式数	200株
太平洋工業	14,700	1,093.00	16,067,100		
河西工業	9,200	212.00	1,950,400	貸付株式数	1,400株
アイシン	56,000	4,080.00	228,480,000		
マ ッ ダ	225,100	1,206.00	271,470,600		
今仙電機製作所	5,200	568.00	2,953,600	貸付株式数	1,900株
本田技研	558,900	3,545.00	1,981,300,500		
スズキ	151,500	4,989.00	755,833,500		
S U B A R U	201,000	2,549.00	512,349,000		
安永	3,100	726.00	2,250,600	貸付株式数	1,200株
ヤマハ発動機	99,700	2,930.00	292,121,000		
小糸製作所	38,200	4,665.00	178,203,000		
T B K	7,300	304.00	2,219,200	貸付株式数	2,200株
エクセディ	11,600	1,815.00	21,054,000		
ミツバ	11,700	421.00	4,925,700	貸付株式数	100株
豊田合成	21,700	2,400.00	52,080,000		
愛三工業	12,200	737.00	8,991,400		
盟和産業	1,100	986.00	1,084,600	貸付株式数	400株
日本プラスト	5,400	460.00	2,484,000	貸付株式数	600株

ヨロズ	5,900	877.00	5,174,300	貸付株式数	200株
エフ・シー・シー	12,800	1,466.00	18,764,800	貸付株式数	4,500株
新家工業	1,500	1,700.00	2,550,000	貸付株式数	600株
シマノ	26,000	24,550.00	638,300,000	貸付株式数	10,400株
テイ・エス テック	32,500	1,553.00	50,472,500		
33FG	5,900	1,486.00	8,767,400		
第四北越フィナンシャルG	10,600	2,727.00	28,906,200		
ひろぎんHLDGS	96,500	628.00	60,602,000		
マーキュリアホールディングス	4,500	637.00	2,866,500	貸付株式数	900株
おきなわFG	6,300	2,193.00	13,815,900	貸付株式数	2,400株
ダイレクトマーケティングミクス	7,400	1,591.00	11,773,400		
ポピンズ	900	1,747.00	1,572,300	貸付株式数	600株
LITALICO	5,900	2,844.00	16,779,600		
十六FG	8,800	2,483.00	21,850,400		
北國FHD	6,300	4,870.00	30,681,000	貸付株式数	600株
ネットプロHD	22,900	460.00	10,534,000	貸付株式数	9,100株
プロクレアホールディングス	7,900	2,200.00	17,380,000		
ジャムコ	4,600	1,385.00	6,371,000	貸付株式数	1,600株
小野建	6,900	1,484.00	10,239,600		
はるやまHLDGS	3,100	408.00	1,264,800	貸付株式数	1,200株
南陽	1,400	1,885.00	2,639,000		
ノジマ	12,200	2,710.00	33,062,000		
佐鳥電機	4,800	1,238.00	5,942,400	貸付株式数	100株
カップ・クリエイト	10,600	1,448.00	15,348,800	貸付株式数	4,200株
エコトレーディング	1,000	537.00	537,000	貸付株式数	500株
伯東	4,400	3,475.00	15,290,000		
コンドーテック	5,500	1,019.00	5,604,500	貸付株式数	2,100株
中山福	3,300	312.00	1,029,600	貸付株式数	1,300株
ライトオン	5,700	694.00	3,955,800	貸付株式数	700株
ナガイレーベン	9,100	1,959.00	17,826,900	貸付株式数	3,600株
三菱食品	7,300	3,335.00	24,345,500		
良品計画	86,700	1,284.00	111,322,800		
パリミキホールディングス	9,100	252.00	2,293,200	貸付株式数	3,600株
松田産業	5,500	2,253.00	12,391,500		
第一興商	14,300	4,150.00	59,345,000		
メディパルHD	69,700	1,870.00	130,339,000		
アドヴァングループ	6,300	857.00	5,399,100	貸付株式数	100株



S P K	2,900	1,387.00	4,022,300	貸付株式数	100株
萩原電気H L D G S	2,400	2,224.00	5,337,600	貸付株式数	100株
アルビス	2,100	2,359.00	4,953,900	貸付株式数	800株
アズワン	10,800	5,990.00	64,692,000		
スズデン	2,300	2,009.00	4,620,700		
尾家産業	1,700	857.00	1,456,900	貸付株式数	600株
シモジマ	4,400	1,110.00	4,884,000	貸付株式数	1,700株
ドウシシャ	7,200	1,489.00	10,720,800	貸付株式数	1,900株
小津産業	1,700	1,764.00	2,998,800	貸付株式数	500株 (100株)
コナカ	7,900	348.00	2,749,200	貸付株式数	3,100株
高速	3,800	1,536.00	5,836,800		
ハウス ローゼ	800	1,619.00	1,295,200	貸付株式数	300株
G - 7ホールディングス	8,300	1,472.00	12,217,600		
たけびし	2,600	1,500.00	3,900,000	貸付株式数	1,000株
イオン北海道	9,800	1,168.00	11,446,400	貸付株式数	4,600株
コジマ	12,900	638.00	8,230,200	貸付株式数	5,000株
ヒマラヤ	2,400	972.00	2,332,800	貸付株式数	900株
コーナン商事	10,700	3,345.00	35,791,500		
ネットワンシステムズ	27,700	2,934.00	81,271,800		
エコス	2,500	1,811.00	4,527,500	貸付株式数	1,000株
ワタミ	9,000	920.00	8,280,000	貸付株式数	3,600株
マルシェ	2,100	455.00	955,500	貸付株式数	900株
リックス	1,600	2,138.00	3,420,800	貸付株式数	600株
システムソフト	22,600	103.00	2,327,800	貸付株式数	5,600株
パンパシフィックHD	150,500	2,690.00	404,845,000		
丸文	5,900	835.00	4,926,500	貸付株式数	1,300株
西松屋チェーン	14,900	1,519.00	22,633,100	貸付株式数	5,900株
ゼンショーホールディングス	36,800	3,635.00	133,768,000	貸付株式数	14,700株
ハピネット	5,500	1,620.00	8,910,000		
幸楽苑ホールディングス	4,400	1,060.00	4,664,000	貸付株式数	1,700株
ハークスレイ	3,100	499.00	1,546,900	貸付株式数	1,000株
橋本総業H L D G S	1,300	2,019.00	2,624,700		
日本ライフライン	22,400	995.00	22,288,000		
サイゼリヤ	11,200	2,682.00	30,038,400	貸付株式数	3,700株
タカショー	5,900	675.00	3,982,500	貸付株式数	2,300株
V Tホールディングス	28,800	503.00	14,486,400		
アルゴグラフィックス	5,800	3,940.00	22,852,000		
魚力	2,000	2,190.00	4,380,000	貸付株式数	800株

I D O M	22,900	912.00	20,884,800	貸付株式数	9,000株
日本エム・ディ・エム	4,400	1,285.00	5,654,000	貸付株式数	1,700株
ポプラ	1,800	145.00	261,000	貸付株式数	700株 (200株)
フジ・コーポレーション	4,100	1,252.00	5,133,200	貸付株式数	1,400株
ユナイテッドアローズ	8,000	1,958.00	15,664,000	貸付株式数	2,800株
進和	4,500	2,193.00	9,868,500	貸付株式数	1,800株
エスケイジャパン	1,900	540.00	1,026,000		
ダイトロン	2,600	2,107.00	5,478,200	貸付株式数	100株
ハイデイ日高	11,000	2,113.00	23,243,000	貸付株式数	4,200株
シークス	9,600	1,145.00	10,992,000		
Y U - W A C R E A T I O N H	3,900	207.00	807,300	貸付株式数	500株
コロワイド	31,000	1,917.00	59,427,000	貸付株式数	12,400株 (2,300株)
ピーシーデポコーポ	8,400	274.00	2,301,600	貸付株式数	3,100株
田中商事	1,900	567.00	1,077,300	貸付株式数	600株
オーハシテクニカ	3,600	1,421.00	5,115,600	貸付株式数	100株
壱番屋	5,300	4,520.00	23,956,000	貸付株式数	2,100株
白銅	2,400	2,576.00	6,182,400	貸付株式数	900株
トップカルチャー	1,500	209.00	313,500	貸付株式数	600株
P L A N T	1,800	647.00	1,164,600	貸付株式数	600株
スギホールディングス	15,000	6,010.00	90,150,000	貸付株式数	6,000株
ダイコー通産	900	1,098.00	988,200	貸付株式数	300株
薬王堂ホールディングス	3,800	2,419.00	9,192,200	貸付株式数	900株
島津製作所	91,300	3,865.00	352,874,500		
J M S	5,900	554.00	3,268,600	貸付株式数	2,200株
クボテック	2,000	236.00	472,000	貸付株式数	800株
長野計器	5,100	1,070.00	5,457,000	貸付株式数	100株
ブイ・テクノロジー	3,300	2,834.00	9,352,200		
スター精密	12,400	1,759.00	21,811,600	貸付株式数	300株
東京計器	4,900	1,233.00	6,041,700	貸付株式数	1,900株
愛知時計	2,800	1,436.00	4,020,800	貸付株式数	100株
インターアクション	3,800	1,687.00	6,410,600	貸付株式数	1,400株
オーバル	7,400	448.00	3,315,200	貸付株式数	2,900株
東京精密	11,900	4,675.00	55,632,500		
マニー	28,000	1,825.00	51,100,000	貸付株式数	11,100株
ニコン	107,900	1,484.00	160,123,600		
トプコン	36,000	1,806.00	65,016,000		
オリンパス	366,200	2,974.50	1,089,261,900		

理研計器	5,100	4,285.00	21,853,500	貸付株式数	2,100株
S C R E E Nホールディングス	12,100	9,010.00	109,021,000		
キヤノン電子	7,000	1,617.00	11,319,000		
タムロン	4,800	3,105.00	14,904,000		
H O Y A	147,600	14,485.00	2,137,986,000		
シ ー ド	3,600	553.00	1,990,800	貸付株式数	1,300株
ノーリツ鋼機	6,000	2,491.00	14,946,000		
A & Dホロンホールディングス	8,700	901.00	7,838,700	貸付株式数	100株
朝日インテック	83,900	2,412.00	202,366,800	貸付株式数	33,500株
キヤノン	348,300	3,322.00	1,157,052,600		
リ コ ー	181,900	1,139.00	207,184,100		
シチズン時計	74,900	620.00	46,438,000		
リズム	2,500	1,461.00	3,652,500	貸付株式数	900株
大研医器	6,100	474.00	2,891,400	貸付株式数	1,100株
メニコン	23,600	3,010.00	71,036,000	貸付株式数	1,200株
シンシア	700	451.00	315,700	貸付株式数	200株
中本パックス	2,200	1,569.00	3,451,800	貸付株式数	700株
スノーピーク	10,900	2,214.00	24,132,600	貸付株式数	4,300株 (100株)
パラマウントベッドHD	14,700	2,589.00	38,058,300		
トランザクション	4,800	1,062.00	5,097,600	貸付株式数	1,100株
粧美堂	1,500	426.00	639,000	貸付株式数	600株
ニホンフラッシュ	6,000	965.00	5,790,000	貸付株式数	1,000株
前田工織	6,800	3,295.00	22,406,000	貸付株式数	2,700株
永大産業	7,500	244.00	1,830,000	貸付株式数	2,300株
アートネイチャー	6,400	741.00	4,742,400	貸付株式数	100株
バンダイナムコHLDGS	63,200	9,928.00	627,449,600		
アイフィスジャパン	2,200	597.00	1,313,400	貸付株式数	700株
共立印刷	10,100	133.00	1,343,300	貸付株式数	4,100株
S H O E I	6,700	5,360.00	35,912,000		
フランスベッドHLDGS	10,000	913.00	9,130,000	貸付株式数	3,400株
マーベラス	11,800	676.00	7,976,800	貸付株式数	1,000株
パイロットコーポレーション	10,000	5,390.00	53,900,000		
萩原工業	4,100	1,050.00	4,305,000	貸付株式数	1,600株
エイベックス	13,000	1,588.00	20,644,000	貸付株式数	4,500株
フジシールインターナショナル	15,800	1,526.00	24,110,800		

タカラトミー	31,600	1,316.00	41,585,600	貸付株式数	3,000株
広済堂ホールディングス	4,800	1,254.00	6,019,200	貸付株式数	1,800株
エステールホールディングス	1,400	627.00	877,800	貸付株式数	700株
レック	8,800	823.00	7,242,400	貸付株式数	400株
タカノ	2,800	750.00	2,100,000	貸付株式数	1,000株
三光合成	8,700	487.00	4,236,900		
プロネクサス	5,800	971.00	5,631,800	貸付株式数	2,300株
ホクシン	5,600	146.00	817,600	貸付株式数	2,000株
ウッドワン	2,300	1,167.00	2,684,100	貸付株式数	800株
大建工業	3,800	1,920.00	7,296,000		
きもと	11,500	255.00	2,932,500	貸付株式数	300株
凸版印刷	99,600	2,259.00	224,996,400		
大日本印刷	82,800	3,025.00	250,470,000		
共同印刷	1,900	2,529.00	4,805,100	貸付株式数	700株
N I S S H A	12,100	1,861.00	22,518,100		
光村印刷	400	1,229.00	491,600	貸付株式数	200株
藤森工業	5,900	3,390.00	20,001,000		
ヴィア・ホールディングス	9,500	139.00	1,320,500	貸付株式数	3,800株
TAKARA & COMPANY	4,400	2,109.00	9,279,600	貸付株式数	100株
前澤化成工業	4,300	1,313.00	5,645,900	貸付株式数	1,700株
未来工業	2,700	1,485.00	4,009,500	貸付株式数	500株
アシックス	58,600	2,627.00	153,942,200	貸付株式数	23,400株
ツツミ	1,900	1,992.00	3,784,800	貸付株式数	700株
ウェーブロックHLDGS	3,000	615.00	1,845,000	貸付株式数	1,200株
ジェイエスピー	4,500	1,462.00	6,579,000	貸付株式数	1,400株
ニチハ	9,800	2,847.00	27,900,600		
ローランド	4,600	4,175.00	19,205,000	貸付株式数	100株
エフピコ	14,100	3,440.00	48,504,000		
小松ウオール工業	2,300	1,900.00	4,370,000		
ヤマハ	44,400	5,180.00	229,992,000		
河合楽器	1,900	2,720.00	5,168,000	貸付株式数	700株
クリナップ	7,300	604.00	4,409,200		
ビジョン	40,500	2,118.00	85,779,000	貸付株式数	18,400株
天馬	5,900	2,082.00	12,283,800	貸付株式数	2,200株
兼松サステック	400	1,610.00	644,000	貸付株式数	100株
キングジム	5,600	916.00	5,129,600	貸付株式数	2,200株
象印マホービン	18,900	1,618.00	30,580,200	貸付株式数	2,200株
リンテック	14,600	2,323.00	33,915,800		

信越ポリマー	13,800	1,269.00	17,512,200		
東リ	17,200	201.00	3,457,200	貸付株式数	4,900株
イトーキ	12,700	435.00	5,524,500	貸付株式数	400株
任天堂	43,200	61,830.00	2,671,056,000		
三菱鉛筆	9,300	1,411.00	13,122,300	貸付株式数	1,300株
松風	2,600	2,237.00	5,816,200	貸付株式数	1,200株
タカラスタンダード	12,300	1,322.00	16,260,600	貸付株式数	100株
コクヨ	30,600	1,829.00	55,967,400	貸付株式数	12,900株
ナカバヤシ	5,500	510.00	2,805,000	貸付株式数	2,200株
ニフコ	25,500	3,145.00	80,197,500		
立川プラインド	2,900	1,043.00	3,024,700	貸付株式数	1,000株
グロープライド	5,700	2,546.00	14,512,200		
オカムラ	21,500	1,368.00	29,412,000		
バルカー	6,200	2,663.00	16,510,600		
MUTOHホールディングス	1,000	1,930.00	1,930,000	貸付株式数	300株
伊藤忠	451,300	3,804.00	1,716,745,200		
丸紅	652,200	1,414.50	922,536,900		
スクロール	11,600	741.00	8,595,600	貸付株式数	4,600株
高島	1,000	2,615.00	2,615,000		
ヨンドシーホールディングス	6,400	1,783.00	11,411,200	貸付株式数	2,500株
三陽商会	3,400	946.00	3,216,400	貸付株式数	800株
長瀬産業	34,200	2,055.00	70,281,000		
ナイガイ	2,300	255.00	586,500	貸付株式数	900株
蝶理	4,200	2,031.00	8,530,200		
豊田通商	67,100	4,935.00	331,138,500		
オンワードホールディングス	41,600	299.00	12,438,400	貸付株式数	16,100株
三共生興	10,100	474.00	4,787,400	貸付株式数	3,900株
兼松	26,000	1,499.00	38,974,000		
美津濃	6,300	2,749.00	17,318,700		
ツカモトコーポレーション	1,100	1,053.00	1,158,300	貸付株式数	400株
ルックホールディングス	2,100	2,187.00	4,592,700	貸付株式数	800株
三井物産	545,600	3,317.00	1,809,755,200		
日本紙パルプ	3,600	4,490.00	16,164,000		
東京エレクトロン	48,500	41,040.00	1,990,440,000		
カメイ	8,000	1,114.00	8,912,000	貸付株式数	400株
東都水産	400	4,950.00	1,980,000	貸付株式数	100株
OUGホールディングス	1,000	2,876.00	2,876,000	貸付株式数	300株

スターゼン	5,000	2,108.00	10,540,000	貸付株式数	1,900株
セイコーHD	10,900	3,020.00	32,918,000		
山 善	27,200	923.00	25,105,600	貸付株式数	11,600株
椿本興業	1,200	3,700.00	4,440,000	貸付株式数	400株
住友商事	445,500	1,973.00	878,971,500		
B I P R O G Y	23,400	3,185.00	74,529,000		
内田洋行	3,000	4,345.00	13,035,000		
三菱商事	493,700	4,369.00	2,156,975,300		
第一実業	2,900	3,845.00	11,150,500	貸付株式数	100株
キヤノンマーケティングJ PN	15,500	3,195.00	49,522,500	貸付株式数	5,300株
西華産業	3,100	1,645.00	5,099,500	貸付株式数	1,200株
佐藤商事	5,000	1,162.00	5,810,000		
菱洋エレクトロ	4,400	2,243.00	9,869,200	貸付株式数	1,700株
東京産業	6,300	793.00	4,995,900	貸付株式数	1,800株
ユアサ商事	6,000	3,615.00	21,690,000		
神鋼商事	1,700	4,130.00	7,021,000		
トルク	1,900	221.00	419,900	貸付株式数	1,100株
阪和興業	13,000	3,665.00	47,645,000		
正栄食品	4,500	4,300.00	19,350,000	貸付株式数	1,800株
カナデン	6,100	1,079.00	6,581,900	貸付株式数	2,400株
菱電商事	5,800	1,627.00	9,436,600	貸付株式数	2,300株
ニプロ	53,000	1,103.00	58,459,000		
岩谷産業	16,700	5,500.00	91,850,000		
ナイス	2,500	1,564.00	3,910,000		
ニチモウ	900	2,675.00	2,407,500		
極東貿易	4,400	1,327.00	5,838,800	貸付株式数	1,700株
アステナホールディングス	11,600	438.00	5,080,800		
兼松エレクトロニクス	4,100	4,060.00	16,646,000		
三愛オブリ	16,800	1,127.00	18,933,600		
稲畑産業	15,100	2,542.00	38,384,200	貸付株式数	2,000株
G S I クレオス	3,600	1,491.00	5,367,600	貸付株式数	1,400株
明和産業	7,000	795.00	5,565,000	貸付株式数	2,800株
クワザワホールディングス	2,600	423.00	1,099,800	貸付株式数	1,000株
ゴ - ルドウイン	12,400	8,160.00	101,184,000		
ユニ・チャ - ム	132,600	4,716.00	625,341,600		
デサント	12,800	3,610.00	46,208,000		
キ ン グ	3,700	414.00	1,531,800	貸付株式数	1,300株
ワ キ タ	13,700	1,129.00	15,467,300	貸付株式数	300株
ヤマトインタ - ナショナル	5,500	261.00	1,435,500	貸付株式数	2,300株

東邦ホールディングス	20,400	1,916.00	39,086,400	
サンゲツ	18,100	1,639.00	29,665,900	
ミツウロコグループ	8,400	1,028.00	8,635,200	貸付株式数 900株
シナネンホールディングス	2,500	3,745.00	9,362,500	貸付株式数 100株
伊藤忠エネクス	16,500	1,071.00	17,671,500	
サンリオ	21,200	3,720.00	78,864,000	貸付株式数 8,400株
サンワ テクノス	3,800	1,355.00	5,149,000	貸付株式数 1,500株
リョーサン	7,700	2,339.00	18,010,300	
新光商事	9,800	954.00	9,349,200	
トーホー	2,900	1,519.00	4,405,100	貸付株式数 1,200株
三信電気	2,800	1,761.00	4,930,800	
東陽テクニカ	7,300	1,301.00	9,497,300	
モスフード サービス	9,900	3,155.00	31,234,500	貸付株式数 3,900株
加賀電子	6,100	4,120.00	25,132,000	
三益半導体	5,900	2,047.00	12,077,300	
都築電気	3,400	1,315.00	4,471,000	貸付株式数 1,300株
ソーダニツカ	5,800	615.00	3,567,000	
立花エレテック	4,800	1,628.00	7,814,400	貸付株式数 1,800株
木曽路	10,200	2,159.00	22,021,800	貸付株式数 4,000株 (1,200株)
S R S ホールディングス	10,900	880.00	9,592,000	貸付株式数 4,300株 (1,100株)
千 趣 会	12,200	393.00	4,794,600	貸付株式数 4,800株
タカキュー	3,900	82.00	319,800	貸付株式数 2,200株
リテールパートナーズ	10,000	1,088.00	10,880,000	貸付株式数 3,900株
ケーヨー	13,700	896.00	12,275,200	貸付株式数 5,500株
上新電機	7,200	1,933.00	13,917,600	貸付株式数 2,800株
日本瓦斯	36,000	2,255.00	81,180,000	
ロイヤルホールディングス	12,800	2,191.00	28,044,800	貸付株式数 4,900株
東 天 紅	500	824.00	412,000	貸付株式数 100株
いなげや	7,300	1,204.00	8,789,200	貸付株式数 2,900株
チヨダ	6,600	800.00	5,280,000	貸付株式数 2,500株
ライフコーポレーション	5,900	2,692.00	15,882,800	
リンガーハット	8,700	2,206.00	19,192,200	貸付株式数 3,400株
Mr Max HD	9,300	625.00	5,812,500	
テンアライド	7,200	289.00	2,080,800	貸付株式数 2,900株
A O K I ホールディングス	14,900	731.00	10,891,900	貸付株式数 2,400株
オークワ	10,500	944.00	9,912,000	貸付株式数 200株
コメリ	11,600	2,641.00	30,635,600	
青山商事	14,600	951.00	13,884,600	貸付株式数 100株

しまむら	8,800	12,310.00	108,328,000		
はせがわ	3,400	366.00	1,244,400	貸付株式数	600株
高島屋	50,600	1,702.00	86,121,200	貸付株式数	20,200株
松屋	12,700	1,063.00	13,500,100	貸付株式数	1,700株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	32,800	1,142.00	37,457,600	貸付株式数	12,100株
近鉄百貨店	2,100	2,360.00	4,956,000	貸付株式数	900株
丸井グループ	54,400	2,509.00	136,489,600		
クレディセゾン	44,200	1,778.00	78,587,600		
アクシアルリテイリング	5,000	3,340.00	16,700,000	貸付株式数	1,700株
井筒屋	3,700	370.00	1,369,000	貸付株式数	1,400株
イオン	248,200	2,695.50	669,023,100	貸付株式数	99,200株
イズミ	11,900	3,080.00	36,652,000	貸付株式数	1,300株
フオーバル	2,700	1,005.00	2,713,500	貸付株式数	1,000株
平和堂	11,100	2,013.00	22,344,300	貸付株式数	5,200株
フジ	16,500	1,882.00	31,053,000	貸付株式数	6,600株
ヤオコー	8,500	6,560.00	55,760,000	貸付株式数	3,400株
ゼビオホールディングス	10,300	1,000.00	10,300,000		
ケーズホールディングス	64,000	1,226.00	78,464,000		
PALTAC	10,600	4,310.00	45,686,000	貸付株式数	100株
三谷産業	11,500	308.00	3,542,000	貸付株式数	4,600株
OLYMPICグループ	3,500	578.00	2,023,000	貸付株式数	1,300株
日産東京販売HD	12,500	286.00	3,575,000		
新生銀行	49,200	1,960.00	96,432,000		
あおぞら銀行	42,000	2,753.00	115,626,000		
三菱UFJフィナンシャル G	4,412,500	733.80	3,237,892,500		
りそなホールディングス	797,900	553.50	441,637,650		
三井住友トラストHD	124,700	4,331.00	540,075,700		
三井住友フィナンシャルG	489,100	4,356.00	2,130,519,600		
千葉銀行	213,000	791.00	168,483,000		
群馬銀行	121,200	410.00	49,692,000		
武蔵野銀行	9,500	1,750.00	16,625,000	貸付株式数	200株
千葉興業銀行	16,100	284.00	4,572,400	貸付株式数	4,500株
筑波銀行	29,800	194.00	5,781,200	貸付株式数	2,500株
七十七銀行	20,100	1,865.00	37,486,500		
秋田銀行	4,400	1,692.00	7,444,800		
山形銀行	7,000	989.00	6,923,000		
岩手銀行	4,700	1,890.00	8,883,000		



東邦銀行	55,100	208.00	11,460,800	貸付株式数	1,200株
東北銀行	3,300	973.00	3,210,900	貸付株式数	1,300株
ふくおかフィナンシャルG	54,400	2,667.00	145,084,800		
静岡銀行	155,400	888.00	137,995,200		
スルガ銀行	63,000	386.00	24,318,000		
八十二銀行	139,400	504.00	70,257,600		
山梨中央銀行	7,600	1,165.00	8,854,000	貸付株式数	800株
大垣共立銀行	12,900	1,766.00	22,781,400		
福井銀行	5,700	1,448.00	8,253,600	貸付株式数	100株
清水銀行	2,500	1,480.00	3,700,000	貸付株式数	200株
富山銀行	1,200	1,751.00	2,101,200	貸付株式数	400株
滋賀銀行	12,300	2,660.00	32,718,000	貸付株式数	1,200株
南都銀行	10,200	2,117.00	21,593,400	貸付株式数	100株
百五銀行	63,000	330.00	20,790,000		
京都銀行	23,400	5,490.00	128,466,000		
紀陽銀行	22,300	1,512.00	33,717,600		
ほくほくフィナンシャルG	42,800	877.00	37,535,600	貸付株式数	900株
山陰合同銀行	41,700	711.00	29,648,700	貸付株式数	3,600株
中国銀行	53,100	955.00	50,710,500		
鳥取銀行	2,400	1,125.00	2,700,000	貸付株式数	100株
伊予銀行	84,800	737.00	62,497,600		
百十四銀行	7,000	1,693.00	11,851,000		
四国銀行	9,500	873.00	8,293,500	貸付株式数	3,300株
阿波銀行	10,000	1,930.00	19,300,000	貸付株式数	400株
大分銀行	4,000	1,901.00	7,604,000		
宮崎銀行	4,100	2,248.00	9,216,800	貸付株式数	100株
佐賀銀行	3,700	1,550.00	5,735,000	貸付株式数	200株
琉球銀行	15,900	791.00	12,576,900	貸付株式数	1,900株
セブン銀行	225,000	265.00	59,625,000		
みずほフィナンシャルG	903,800	1,670.00	1,509,346,000		
高知銀行	2,400	660.00	1,584,000	貸付株式数	900株
山口フィナンシャルG	75,500	802.00	60,551,000		
芙蓉総合リース	6,500	8,270.00	53,755,000		
みずほリース	9,200	3,280.00	30,176,000		
東京センチュリー	11,700	4,905.00	57,388,500		
SBIホールディングス	93,100	2,684.00	249,880,400		
日本証券金融	29,600	820.00	24,272,000		
アイフル	126,700	393.00	49,793,100	貸付株式数	2,900株
日本アジア投資	6,600	231.00	1,524,600	貸付株式数	100株
長野銀行	2,300	1,232.00	2,833,600	貸付株式数	800株

名古屋銀行	4,600	3,120.00	14,352,000	
北洋銀行	95,300	234.00	22,300,200	
愛知銀行	2,400	5,690.00	13,656,000	
中京銀行	2,400	1,891.00	4,538,400	
大光銀行	2,200	1,370.00	3,014,000	貸付株式数 400株
愛媛銀行	9,900	878.00	8,692,200	
トマト銀行	2,000	1,035.00	2,070,000	
京葉銀行	32,300	511.00	16,505,300	貸付株式数 8,400株
栃木銀行	34,000	281.00	9,554,000	
北日本銀行	2,100	1,763.00	3,702,300	貸付株式数 800株
東和銀行	12,400	529.00	6,559,600	貸付株式数 300株
福島銀行	8,200	213.00	1,746,600	貸付株式数 2,800株
大東銀行	3,200	634.00	2,028,800	貸付株式数 1,300株
リコーリース	6,700	3,615.00	24,220,500	
イオンフィナンシャルサー ビス	41,100	1,512.00	62,143,200	貸付株式数 16,400株
アコム	149,500	328.00	49,036,000	
ジャックス	7,500	3,820.00	28,650,000	
オリコ	204,100	118.00	24,083,800	
オリックス	447,800	2,262.00	1,012,923,600	
三菱HCキャピタル	243,200	681.00	165,619,200	
ジャフコグループ	26,100	2,176.00	56,793,600	貸付株式数 10,400株
九州リースサービス	3,300	608.00	2,006,400	貸付株式数 1,300株
トモニホールディングス	55,500	319.00	17,704,500	
大和証券G本社	483,600	616.30	298,042,680	
野村ホールディングス	1,151,100	505.50	581,881,050	
岡三証券グループ	53,900	335.00	18,056,500	貸付株式数 1,600株
丸三証券	22,200	459.00	10,189,800	貸付株式数 6,700株
東洋証券	23,000	266.00	6,118,000	貸付株式数 8,600株
東海東京HD	73,500	377.00	27,709,500	
光世証券	1,600	416.00	665,600	貸付株式数 500株
水戸証券	17,500	249.00	4,357,500	貸付株式数 400株
いちよし証券	12,600	640.00	8,064,000	貸付株式数 100株
松井証券	36,900	804.00	29,667,600	
SOMPOホールディング ス	107,300	6,110.00	655,603,000	
日本取引所グループ	175,500	2,046.00	359,073,000	
マネックスG	63,500	477.00	30,289,500	貸付株式数 25,200株
極東証券	8,500	686.00	5,831,000	
岩井コスモホールディング	7,000	1,250.00	8,750,000	貸付株式数 200株

アイザワ証券グループ	10,000	651.00	6,510,000	貸付株式数	100株
フィデアホール	6,800	1,333.00	9,064,400	貸付株式数	200株
池田泉州HD	78,800	220.00	17,336,000		
アニコムホールディングス	23,200	634.00	14,708,800	貸付株式数	400株
MS&AD	155,100	4,196.00	650,799,600		
マネーパートナーズGP	8,500	268.00	2,278,000		
スパークス・グループ	35,700	305.00	10,888,500		
小林洋行	2,400	215.00	516,000	貸付株式数	400株
第一生命HLDGS	367,200	2,452.50	900,558,000		
東京海上HD	209,800	7,899.00	1,657,210,200		
アドバンテッジリスクマネ	3,900	476.00	1,856,400	貸付株式数	1,100株
イー・ギャランティ	11,200	2,403.00	26,913,600		
アサックス	3,500	597.00	2,089,500	貸付株式数	1,500株
NECキャピタルソリューション	3,100	2,102.00	6,516,200		
T&Dホールディングス	167,700	1,523.00	255,407,100		
アドバンスクリエイト	3,700	1,086.00	4,018,200	貸付株式数	1,400株
三井不動産	294,600	2,930.00	863,178,000		
三菱地所	429,900	1,957.00	841,314,300		
平和不動産	12,100	4,050.00	49,005,000		
東京建物	60,000	2,133.00	127,980,000		
京阪神ビルディング	10,200	1,302.00	13,280,400		
住友不動産	135,800	3,528.00	479,102,400		
太平洋興発	2,600	681.00	1,770,600	貸付株式数	1,000株
テーオーシー	12,200	746.00	9,101,200	貸付株式数	200株
東京楽天地	1,300	4,060.00	5,278,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	10,500	2,734.00	28,707,000		
フジ住宅	9,600	653.00	6,268,800		
空港施設	8,700	553.00	4,811,100	貸付株式数	600株
明和地所	4,100	620.00	2,542,000	貸付株式数	300株
ゴールドクレスト	6,600	1,781.00	11,754,600		
リログループ	40,100	2,276.00	91,267,600	貸付株式数	200株
エスリード	3,400	1,741.00	5,919,400	貸付株式数	1,100株
日神グループHLDGS	13,500	437.00	5,899,500	貸付株式数	4,600株
日本エスコン	14,700	811.00	11,921,700	貸付株式数	4,900株
タカラレーベン	32,800	394.00	12,923,200		
AVANTIA	4,200	803.00	3,372,600	貸付株式数	1,300株
イオンモール	38,600	1,685.00	65,041,000		
毎日コムネット	3,400	628.00	2,135,200	貸付株式数	1,000株

ファースト住建	3,400	1,103.00	3,750,200	貸付株式数	1,100株
ランド	437,900	10.00	4,379,000	貸付株式数	159,800株
カチタス	18,800	3,380.00	63,544,000		
東祥	5,500	1,247.00	6,858,500	貸付株式数	1,500株
トーセイ	10,800	1,447.00	15,627,600	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,800	2,069.00	3,724,200	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	11,300	1,181.00	13,345,300		
インテリックス	2,500	566.00	1,415,000	貸付株式数	600株
ランドビジネス	3,700	231.00	854,700	貸付株式数	1,100株
サンネクスタグループ	3,000	941.00	2,823,000	貸付株式数	900株
グランディハウス	5,800	560.00	3,248,000	貸付株式数	1,900株
東武鉄道	69,800	3,415.00	238,367,000		
相鉄ホールディングス	22,900	2,424.00	55,509,600		
東急	178,000	1,710.00	304,380,000		
京浜急行	85,300	1,499.00	127,864,700	貸付株式数	9,700株
小田急電鉄	96,200	1,911.00	183,838,200		
京王電鉄	33,600	5,460.00	183,456,000		
京成電鉄	46,500	4,080.00	189,720,000		
富士急行	7,800	4,540.00	35,412,000	貸付株式数	3,100株
東日本旅客鉄道	116,600	7,624.00	888,958,400		
西日本旅客鉄道	81,100	5,715.00	463,486,500		
東海旅客鉄道	53,800	17,100.00	919,980,000		
西武ホールディングス	92,400	1,552.00	143,404,800		
鴻池運輸	10,700	1,442.00	15,429,400		
西日本鉄道	18,300	2,942.00	53,838,600		
ハマキョウレックス	5,000	3,245.00	16,225,000		
サカイ引越センター	3,500	4,915.00	17,202,500	貸付株式数	1,200株
近鉄グループHLDGS	68,000	4,880.00	331,840,000		
阪急阪神HLDGS	84,400	4,360.00	367,984,000		
南海電鉄	30,300	2,899.00	87,839,700	貸付株式数	11,500株
京阪ホールディングス	28,300	3,720.00	105,276,000		
神戸電鉄	1,700	3,405.00	5,788,500	貸付株式数	600株
名古屋鉄道	70,000	2,279.00	159,530,000	貸付株式数	1,700株
山陽電鉄	5,200	2,208.00	11,481,600	貸付株式数	2,000株
アルプス物流	5,100	1,123.00	5,727,300		
トランコム	2,000	8,310.00	16,620,000	貸付株式数	700株
ヤマトホールディングス	99,100	2,165.00	214,551,500		
山九	17,600	4,245.00	74,712,000		
日新	5,300	1,869.00	9,905,700		
丸運	3,000	220.00	660,000	貸付株式数	1,400株

丸全昭和運輸	4,900	3,110.00	15,239,000	貸付株式数	1,500株
センコーグループHLDGS	33,400	995.00	33,233,000	貸付株式数	3,500株
トナミホールディングス	1,400	3,740.00	5,236,000		
ニッコンホールディングス	21,800	2,426.00	52,886,800		
日石輸送	800	2,378.00	1,902,400	貸付株式数	200株
福山通運	9,300	3,365.00	31,294,500	貸付株式数	400株
セイノーホールディングス	39,500	1,163.00	45,938,500	貸付株式数	6,500株
エスライン	2,000	801.00	1,602,000	貸付株式数	700株
神奈川中央交通	1,800	3,515.00	6,327,000	貸付株式数	700株
日立物流	13,300	8,780.00	116,774,000		
丸和運輸機関	12,200	1,533.00	18,702,600	貸付株式数	2,400株 (2,400株)
C & F ロジホールディングス	6,100	1,193.00	7,277,300		
日本郵船	60,600	9,600.00	581,760,000		
商船三井	111,700	3,280.00	366,376,000	貸付株式数	44,600株
川崎汽船	22,300	7,380.00	164,574,000	貸付株式数	600株
NSユニテッド海運	3,400	4,335.00	14,739,000	貸付株式数	1,400株
明治海運	6,900	736.00	5,078,400	貸付株式数	3,000株
飯野海運	28,600	733.00	20,963,800		
共栄タンカー	1,300	879.00	1,142,700	貸付株式数	400株
九州旅客鉄道	48,700	3,145.00	153,161,500		
SGホールディングス	121,500	2,070.00	251,505,000		
NIPPON EXPRESS	23,600	7,240.00	170,864,000		
日本航空	155,700	2,698.00	420,078,600		
ANAホールディングス	172,300	2,788.50	480,458,550		
ビーウィズ	2,000	1,385.00	2,770,000	貸付株式数	800株 (800株)
パスコ	1,400	1,305.00	1,827,000	貸付株式数	500株
TREホールディングス	13,700	1,716.00	23,509,200	貸付株式数	3,600株
人・夢・技術グループ	2,900	2,685.00	7,786,500	貸付株式数	100株
西本WISMETTACHD	1,700	4,015.00	6,825,500	貸付株式数	600株
シルバーライフ	1,600	1,259.00	2,014,400	貸付株式数	600株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	700	1,501.00	1,050,700	貸付株式数	200株
GENKY DRUGSTORES	3,300	3,660.00	12,078,000	貸付株式数	200株

コア商事HLDGS	4,800	649.00	3,115,200	貸付株式数	1,900株
国際紙パルプ商事	14,100	690.00	9,729,000	貸付株式数	5,500株
ナルミヤ・インターナショナル	1,700	857.00	1,456,900	貸付株式数	600株
ブックオフGHD	4,500	1,042.00	4,689,000	貸付株式数	1,800株
ギフトホールディングス	1,400	3,760.00	5,264,000	貸付株式数	400株
三菱倉庫	17,500	3,575.00	62,562,500		
三井倉庫HOLD	7,100	3,345.00	23,749,500		
住友倉庫	21,300	2,141.00	45,603,300	貸付株式数	8,100株
渋沢倉庫	3,500	2,071.00	7,248,500	貸付株式数	700株
ヤマタネ	3,100	1,602.00	4,966,200	貸付株式数	1,100株
東陽倉庫	10,100	272.00	2,747,200	貸付株式数	3,700株
乾汽船	4,400	1,771.00	7,792,400	貸付株式数	1,700株
日本トランスシティ	12,800	505.00	6,464,000		
ケイヒン	1,200	1,439.00	1,726,800	貸付株式数	400株
中央倉庫	3,600	942.00	3,391,200	貸付株式数	1,400株
川西倉庫	1,300	1,035.00	1,345,500	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,900	920.00	4,508,000		
ファイズホールディングス	1,600	1,004.00	1,606,400	貸付株式数	600株
東洋埠頭	1,800	1,218.00	2,192,400		
上組	34,400	2,778.00	95,563,200		
サンリツ	1,600	672.00	1,075,200	貸付株式数	600株
キムラユニティー	3,800	804.00	3,055,200	貸付株式数	1,400株
キューソー流通システム	4,200	1,387.00	5,825,400	貸付株式数	1,300株
東海運	4,100	268.00	1,098,800	貸付株式数	1,500株
エーアイティー	4,500	1,535.00	6,907,500	貸付株式数	1,600株
内外トランスライン	2,300	2,240.00	5,152,000	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	2,000	577.00	1,154,000	貸付株式数	800株
日本コンセプト	2,000	1,725.00	3,450,000	貸付株式数	700株
TBSホールディングス	36,600	1,640.00	60,024,000		
日本テレビHLD S	62,800	1,194.00	74,983,200		
朝日放送グループHD	6,100	644.00	3,928,400	貸付株式数	2,500株
テレビ朝日HD	18,000	1,442.00	25,956,000		
スカパーJSATHD	63,500	544.00	34,544,000		
テレビ東京HD	4,600	1,946.00	8,951,600	貸付株式数	100株
日本BS放送	2,400	936.00	2,246,400	貸付株式数	900株
ビジョン	8,400	1,420.00	11,928,000	貸付株式数	3,300株
スマートバリュー	1,700	465.00	790,500		
USEN-NEXT HLDGS	5,700	2,078.00	11,844,600	貸付株式数	2,500株

ワイヤレスゲート	3,200	283.00	905,600	貸付株式数 1,200株 (100株)
コネクシオ	5,300	1,244.00	6,593,200	
日本通信	62,600	220.00	13,772,000	貸付株式数 24,600株
クロップス	1,600	900.00	1,440,000	
日本電信電話	840,900	3,915.00	3,292,123,500	
KDDI	546,900	4,372.00	2,391,046,800	
ソフトバンク	1,135,700	1,503.00	1,706,957,100	
光通信	8,600	17,870.00	153,682,000	
エムティーアイ	5,900	504.00	2,973,600	
GMOインターネットグループ	23,600	2,639.00	62,280,400	
ファイバーゲート	3,400	928.00	3,155,200	貸付株式数 1,300株
アйдママーケティングコミュ	1,700	292.00	496,400	貸付株式数 600株
KADOKAWA	40,400	2,789.00	112,675,600	
学研ホールディングス	10,600	958.00	10,154,800	貸付株式数 2,600株
ゼンリン	12,500	920.00	11,500,000	貸付株式数 700株
昭文社ホールディングス	3,300	312.00	1,029,600	貸付株式数 1,300株
インプレスホールディングス	6,200	208.00	1,289,600	貸付株式数 2,400株
東京電力HD	572,500	484.00	277,090,000	貸付株式数 105,400株
中部電力	215,800	1,413.00	304,925,400	
関西電力	267,200	1,306.00	348,963,200	
中国電力	110,200	773.00	85,184,600	
北陸電力	64,600	497.00	32,106,200	
東北電力	167,100	693.00	115,800,300	
四国電力	63,700	787.00	50,131,900	
九州電力	146,600	803.00	117,719,800	貸付株式数 5,200株
北海道電力	66,100	512.00	33,843,200	
沖縄電力	16,100	1,098.00	17,677,800	貸付株式数 400株
電源開発	56,500	2,124.00	120,006,000	
エフオン	4,600	643.00	2,957,800	貸付株式数 1,800株
イーレックス	9,900	2,864.00	28,353,600	貸付株式数 4,000株
レノバ	15,000	3,585.00	53,775,000	貸付株式数 5,900株
東京瓦斯	136,100	2,592.00	352,771,200	
大阪瓦斯	128,600	2,306.00	296,551,600	
東邦瓦斯	30,000	3,030.00	90,900,000	
北海道瓦斯	3,700	1,663.00	6,153,100	貸付株式数 400株
広島ガス	12,700	332.00	4,216,400	貸付株式数 1,600株

西部ガスHLDGS	7,400	1,791.00	13,253,400	貸付株式数	600株
静岡ガス	14,500	1,049.00	15,210,500	貸付株式数	300株
メタウォーター	7,800	2,009.00	15,670,200		
アイネット	3,500	1,330.00	4,655,000	貸付株式数	1,300株
松竹	4,300	12,070.00	51,901,000	貸付株式数	1,700株
東宝	44,300	5,240.00	232,132,000		
エイチ・アイ・エス	17,100	2,239.00	38,286,900	貸付株式数	7,600株
東映	2,100	17,970.00	37,737,000		
ラックランド	2,100	2,864.00	6,014,400	貸付株式数	800株
NTTデータ	199,700	1,948.00	389,015,600		
共立メンテナンス	13,000	6,030.00	78,390,000	貸付株式数	5,200株
イチネンホールディングス	7,400	1,271.00	9,405,400		
建設技術研究所	3,300	2,974.00	9,814,200	貸付株式数	300株
スペース	4,700	881.00	4,140,700	貸付株式数	1,800株
アインホールディングス	9,300	6,480.00	60,264,000	貸付株式数	3,700株 (2,000株)
燦ホールディングス	3,200	1,871.00	5,987,200	貸付株式数	100株
ピー・シー・エー	4,400	1,082.00	4,760,800	貸付株式数	1,700株
スバル興業	400	9,150.00	3,660,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	3,000	1,215.00	3,645,000	貸付株式数	1,000株
タナベ経営	2,600	648.00	1,684,800	貸付株式数	1,000株
ビジネスB太田昭和	2,500	1,471.00	3,677,500	貸付株式数	700株
ナガワ	2,100	7,500.00	15,750,000	貸付株式数	800株
東京都競馬	5,500	4,215.00	23,182,500		
常磐興産	2,500	1,258.00	3,145,000	貸付株式数	1,000株
カナモト	11,900	2,077.00	24,716,300		
DTS	13,900	3,525.00	48,997,500	貸付株式数	100株
スクウェア・エニックス・HD	34,900	6,230.00	217,427,000		
シーイーシー	8,100	1,442.00	11,680,200		
カプコン	70,700	3,705.00	261,943,500		
西尾レントオール	6,100	2,910.00	17,751,000		
アイ・エス・ビー	3,200	1,254.00	4,012,800	貸付株式数	1,200株
アゴーラホスピタリティ ティーG	42,700	23.00	982,100	貸付株式数	15,600株
日本空港ビルデング	24,400	6,100.00	148,840,000	貸付株式数	10,300株
トランス・コスモス	9,200	3,750.00	34,500,000	貸付株式数	3,200株
乃村工藝社	31,300	951.00	29,766,300	貸付株式数	700株
ジャステック	3,800	1,221.00	4,639,800	貸付株式数	400株
SCSK	51,800	2,247.00	116,394,600		



藤田観光	2,900	2,888.00	8,375,200	貸付株式数	1,000株
KNT-CTホールディングス	4,500	1,957.00	8,806,500	貸付株式数	1,800株
日本管財	7,700	2,610.00	20,097,000	貸付株式数	1,700株
トーカイ	5,800	1,881.00	10,909,800	貸付株式数	100株
白洋舎	600	1,431.00	858,600	貸付株式数	300株
セコム	72,000	8,462.00	609,264,000		
NSW	2,900	2,205.00	6,394,500		
セントラル警備保障	3,600	2,385.00	8,586,000	貸付株式数	1,400株
アイネス	6,400	1,517.00	9,708,800	貸付株式数	2,300株
丹青社	13,700	796.00	10,905,200		
メイテック	26,000	2,380.00	61,880,000		
TKC	11,400	3,495.00	39,843,000		
富士ソフト	7,200	8,080.00	58,176,000	貸付株式数	400株
応用地質	6,300	1,861.00	11,724,300		
船井総研ホールディング	13,700	2,453.00	33,606,100		
NSD	23,300	2,476.00	57,690,800		
進学会ホールディングス	2,100	315.00	661,500	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	600	1,802.00	1,081,200	貸付株式数	200株
オオバ	4,500	702.00	3,159,000	貸付株式数	1,800株
コナミグループ	27,300	6,740.00	184,002,000		
いであ	1,600	1,673.00	2,676,800	貸付株式数	600株
学究社	2,200	1,654.00	3,638,800	貸付株式数	100株
ベネッセホールディングス	24,300	2,170.00	52,731,000		
イオンディライト	8,300	2,850.00	23,655,000		
ナック	4,100	931.00	3,817,100	貸付株式数	1,300株
福井コンピュータHLDS	3,400	3,540.00	12,036,000	貸付株式数	100株
ダイセキ	13,300	4,495.00	59,783,500		
ステップ	2,700	1,826.00	4,930,200	貸付株式数	1,000株
日鉄物産	4,500	5,390.00	24,255,000		
泉州電業	1,700	5,700.00	9,690,000	貸付株式数	700株
元気寿司	2,100	3,125.00	6,562,500	貸付株式数	800株
トラスコ中山	14,100	1,979.00	27,903,900		
ヤマダホールディングス	267,200	484.00	129,324,800		
オートバックスセブン	23,400	1,443.00	33,766,200	貸付株式数	9,300株
モリト	5,000	720.00	3,600,000		
アー克蘭ズ	11,900	1,485.00	17,671,500		
ニトリホールディングス	29,900	12,795.00	382,570,500		
グルメ杵屋	6,100	1,023.00	6,240,300	貸付株式数	2,400株 (100株)

愛 眼	6,900	179.00	1,235,100	貸付株式数	2,700株
ケーユーホールディングス	4,000	1,195.00	4,780,000	貸付株式数	100株
吉野家ホールディングス	26,300	2,360.00	62,068,000	貸付株式数	10,500株
加藤産業	8,100	3,440.00	27,864,000		
北恵	1,500	730.00	1,095,000	貸付株式数	600株
イノテック	4,400	1,353.00	5,953,200		
イエローハット	12,000	1,836.00	22,032,000	貸付株式数	4,600株
松屋フーズHLDGS	3,600	3,840.00	13,824,000	貸付株式数	1,400株
JBCホールディングス	5,000	1,840.00	9,200,000		
JKホールディングス	5,200	1,009.00	5,246,800	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	11,000	1,241.00	13,651,000	貸付株式数	4,300株 (300株)
日 伝	5,000	1,777.00	8,885,000	貸付株式数	1,900株
関西フードマーケット	6,100	1,140.00	6,954,000	貸付株式数	2,400株
ミロク情報サービス	6,700	1,509.00	10,110,300		
北沢産業	3,600	215.00	774,000	貸付株式数	200株
杉本商事	3,500	1,863.00	6,520,500	貸付株式数	500株
因幡電機産業	18,500	2,735.00	50,597,500		
王将フードサービス	5,000	6,510.00	32,550,000	貸付株式数	1,700株
プレナス	8,400	1,926.00	16,178,400	貸付株式数	200株
ミニストップ	5,500	1,433.00	7,881,500	貸付株式数	2,100株
アークス	13,300	2,050.00	27,265,000	貸付株式数	5,000株
バローホールディングス	15,300	1,815.00	27,769,500		
東 テ ク	2,200	3,470.00	7,634,000		
ミスミグループ本社	94,500	3,370.00	318,465,000		
アルテック	4,200	327.00	1,373,400		
ベ ル ク	3,300	5,550.00	18,315,000	貸付株式数	700株
大 庄	3,800	1,157.00	4,396,600	貸付株式数	1,300株
タキヒヨー	1,800	819.00	1,474,200	貸付株式数	800株
ファーストリテイリング	10,100	81,990.00	828,099,000		
ソフトバンクグループ	449,800	5,517.00	2,481,546,600		
蔵王産業	1,300	1,799.00	2,338,700	貸付株式数	500株
スズケン	26,900	3,355.00	90,249,500		
サンドラッグ	28,300	3,505.00	99,191,500		
サクスパーホールディング グ	7,400	680.00	5,032,000	貸付株式数	2,700株
ジェコス	5,100	805.00	4,105,500	貸付株式数	300株
ヤマザワ	1,200	1,281.00	1,537,200	貸付株式数	600株
や ま や	1,700	2,594.00	4,409,800	貸付株式数	600株 (100株)

グローセル	8,100	417.00	3,377,700	貸付株式数	3,000株
ペルーナ	16,200	724.00	11,728,800	貸付株式数	100株
合計			190,358,800,810		

(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（2022年9月21日から2023年3月20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 2023年3月20日現在
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	893,192
親投資信託受益証券	289,516,538
未収入金	1,256,000
流動資産合計	291,665,730
資産合計	291,665,730
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	1,457,656
未払受託者報酬	47,340
未払委託者報酬	615,911
その他未払費用	7,804
流動負債合計	2,128,711
負債合計	2,128,711
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1,180,191,692
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	109,345,327
(分配準備積立金)	4,933,164
元本等合計	289,537,019
純資産合計	289,537,019
負債純資産合計	291,665,730

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2022年9月21日
	至 2023年3月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	3,599,936
営業収益合計	3,599,936
営業費用	
支払利息	88
受託者報酬	47,340
委託者報酬	615,911
その他費用	7,804
営業費用合計	671,143
営業利益又は営業損失（ ）	2,928,793
経常利益又は経常損失（ ）	2,928,793
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,928,793
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（ ）	2,474,260
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	112,368,966
剰余金増加額又は欠損金減少額	49,461,519
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	49,461,519
剰余金減少額又は欠損金増加額	52,939,691
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	52,939,691
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	109,345,327

## (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 2022年9月21日 至 2023年3月20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 2023年3月20日現在
1. 1 期首元本額	185,745,220円
期中追加設定元本額	82,723,184円
期中一部解約元本額	88,276,712円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	180,191,692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 2022年9月21日 至 2023年3月20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 2023年3月20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 2023年3月20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 2023年3月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6068円 (16,068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

	2023年3月20日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,523,390,884	
株式	2 3	200,112,821,630
未収入金	1,802,400	
未収配当金	335,742,075	
未収利息	398,108	



前払金		153,700,000
その他未収収益	4	42,397,700
流動資産合計		212,170,252,797
資産合計		212,170,252,797
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		238,461,900
未払解約金		23,946,270
受入担保金		7,012,740,840
流動負債合計		7,275,149,010
負債合計		7,275,149,010
純資産の部		
元本等		
元本	1	151,468,853,011
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		53,426,250,776
元本等合計		204,895,103,787
純資産合計		204,895,103,787
負債純資産合計		212,170,252,797

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年9月21日 至 2023年3月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2023年3月20日現在
1. 1 期首	2022年9月21日
期首元本額	146,161,636,928円
期中追加設定元本額	11,645,786,845円
期中一部解約元本額	6,338,570,762円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックス ファンド	2,962,491,168円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	4,656,661,622円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2	915,859円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	21,533,126円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	252,807,798円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	20,111,604円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	496,080,863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)	536,056,973円

D - I ' s T O P I Xイン デックス	17,070,333円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	230,414,904円
i F r e e T O P I Xイン デックス	6,571,308,111円
i F r e e 8資産バランス	4,488,551,219円
i F r e e 年金バランス	838,148,325円
D Cダイワ日本株式インデッ クス	69,914,915,841円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,299,394,851円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	4,808,226,589円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	4,756,978,983円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	6,840,404,163円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	57,098,878円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	71,776,509円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	3,129,480,850円
ダイワつみたてインデックス バランス30	12,162,241円
ダイワつみたてインデックス バランス50	10,402,168円
ダイワつみたてインデックス バランス70	26,776,717円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	3,436,670,158円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	72,720,123円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	32,498,143円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	4,675,624,119円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	441,055,931円

	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)		61,211,240円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)		96,570,768円
	ダイワ・ノーロードTOP IXファンド		214,028,638円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス		11,873,090,601円
	ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)		2,483,542,206円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス		3,146,562,802円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPIX		1,211,582,036円
	ダイワライフスタイル25		131,749,812円
	ダイワライフスタイル50		543,407,402円
	ダイワライフスタイル75		418,938,546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)		8,609,830,791円
	計		151,468,853,011円
2.	期末日における受益権の総数		151,468,853,011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 6,607,083,200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 951,870,000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41,807,673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	2023年3月20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	2023年3月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買 建	5,146,770,000	-	4,908,450,000	238,320,000
合計	5,146,770,000	-	4,908,450,000	238,320,000

（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）

	2023年3月20日現在
1口当たり純資産額	1.3527円

(1万口当たり純資産額)	
--------------	--

(13,527円)
-----------

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2023年3月31日

資産総額	309,050,388円
負債総額	7,226,372円
純資産総額（ - ）	301,824,016円
発行済数量	178,785,553口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6882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

2023年3月31日

資産総額	224,043,291,720円
負債総額	7,334,855,540円
純資産総額（ - ）	216,708,436,180円
発行済数量	152,457,614,475口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.4214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

2023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す。

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

2023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	95	342,454
追加型株式投資信託	779	21,519,615
株式投資信託 合計	874	21,862,069
単位型公社債投資信託	84	165,976
追加型公社債投資信託	14	1,365,455
公社債投資信託 合計	98	1,531,431
総合計	972	23,393,501

## 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。

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63期事業年度（2021年4月1日から2022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64期事業年度に係る中間会計期間（2022年4月1日から2022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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,860	3,168
有価証券	333	486
前払費用	237	332
未収委託者報酬	13,150	13,811
未収収益	49	52
関係会社短期貸付金	18,700	24,900
その他	207	45
流動資産計	37,539	42,799
固定資産		
有形固定資産	1	203
建物	6	4

器具備品	218	198
無形固定資産	1,937	1,770
ソフトウェア	1,882	1,738
ソフトウェア仮勘定	54	31
投資その他の資産	16,121	16,617
投資有価証券	10,159	10,755
関係会社株式	3,705	3,705
出資金	183	177
長期差入保証金	1,068	1,067
繰延税金資産	973	885
その他	30	26
固定資産計	18,283	18,591
資産合計	55,822	61,390

(単位:百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	68	65
未払金	8,405	9,856
未払収益分配金	13	26
未払償還金	39	12
未払手数料	4,734	4,917
その他未払金	2	4,900
未払費用	3,777	4,246
未払法人税等	804	980
未払消費税等	631	1,016
賞与引当金	950	866
その他	88	2
流動負債計	14,725	17,033
固定負債		
退職給付引当金	2,452	2,399
役員退職慰労引当金	74	13
その他	3	1
固定負債計	2,530	2,415
負債合計	17,256	19,449
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	10,574	13,925
利益剰余金合計	10,948	14,299
株主資本合計	37,618	40,969
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	947	971
評価・換算差額等合計	947	971
純資産合計	38,566	41,941
負債・純資産合計	55,822	61,390

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	65,487	74,402
その他営業収益	419	545
営業収益計	65,906	74,948
営業費用		
支払手数料	27,965	31,234
広告宣伝費	624	650
調査費	8,245	9,104
調査費	1,134	1,252
委託調査費	7,110	7,851
委託計算費	1,501	1,729
営業雑経費	1,870	2,051
通信費	240	189
印刷費	478	468
協会費	51	46
諸会費	14	15
その他営業雑経費	1,084	1,331
営業費用計	40,207	44,768

一般管理費		
給料	5,991	5,948
役員報酬	351	306
給料・手当	4,293	4,281
賞与	395	493
賞与引当金繰入額	950	866
福利厚生費	893	867
交際費	32	46
旅費交通費	37	48
租税公課	472	527
不動産賃借料	1,302	1,300
退職給付費用	449	408
役員退職慰労引当金繰入額	28	10
固定資産減価償却費	661	606
諸経費	1,763	1,864
一般管理費計	11,631	11,628
営業利益	14,067	18,551

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	578	327
有価証券償還益	42	40
その他	68	264
営業外収益計	689	631
営業外費用		
投資有価証券売却損	69	59
有価証券償還損	47	0
その他	24	34
営業外費用計	141	93
経常利益	14,616	19,089
特別損失		
システム刷新関連費用	547	-
関係会社整理損失	267	-
投資有価証券評価損	45	331
特別損失計	860	331
税引前当期純利益	13,756	18,757
法人税、住民税及び事業税	4,476	5,950
法人税等調整額	109	69

法人税等合計	4,366	6,019
当期純利益	9,389	12,738

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)



	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	-	-	-	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 9,388
当期純利益	-	-	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	24	24	24
当期変動額合計	24	24	3,374
当期末残高	971	971	41,941

## 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. 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。

当社は証券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。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 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、翌事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）を適用する予定であります。

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

## （会計方針の変更に関する注記）

## （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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。これによる当事業年度の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載しておりません。

## （未適用の会計基準等）

- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

## (1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

## (2) 適用予定日

2023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

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響については、現時点で評価中であります。

## （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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物	35百万円	37百万円
器具備品	259百万円	283百万円

## 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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
未払金	3,473百万円	4,694百万円

## 3 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（2022年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,900百万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 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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
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

（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

2022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	12,737百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,883円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月24日

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

（２）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。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。

前事業年度（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）2019年適用指針第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、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（2022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）	66	-	-	66
資産合計	66	-	-	66

（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486百万円、投資有価証券10,022百万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、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額によっていることからレベルを付していません。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	1,677	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（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、記載していません。

当事業年度（2022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、記載していません。

#### ２．その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度(2022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	66	55	11
(2) その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	454
小計	3,753	4,208	454
合計	10,575	9,180	1,395

(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 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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、証券投資信託について331百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

#### 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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
退職給付債務の期首残高	2,574	百万円	2,452	百万円
勤務費用	155		152	
退職給付の支払額	378		303	
その他	101		98	
退職給付債務の期末残高	2,452		2,399	

## (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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
非積立型制度の退職給付債務	2,452	百万円	2,399	百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452		2,399	
退職給付引当金	2,452		2,399	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452		2,399	

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
勤務費用	155	百万円	152	百万円
その他	108		67	
確定給付制度に係る退職給付費用	263		219	

## 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186百万円、当事業年度189百万円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	(2021年3月31日)		(2022年3月31日)	
繰延税金資産				
退職給付引当金	750		734	
賞与引当金	243		227	

未払事業税	170	213
投資有価証券評価損	128	144
システム関連費用	155	111
出資金評価損	94	94
その他	298	437
繰延税金資産小計	1,841	1,963
評価性引当額	254	356
繰延税金資産合計	1,586	1,607
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	453	562
繰延税金負債合計	612	722
繰延税金資産の純額	973	885

## 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（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。

当事業年度（2022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。

### （収益認識関係）

#### （1）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が74,402百万円、その他545百万円であります。

#### （2）収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

#### （3）顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載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 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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)	19,000  0	関係会社短期貸付金  受取利息関係会社	24,900  0

## 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 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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)	1,900	-	-

## 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 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(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  本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)	14,917	未払手数料	3,321
							不動産の賃借料(注4)	527	長期差入保証金	1,054
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)	883	未払費用	179
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)	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。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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(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 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3)	15,348 1,062	未払手数料 長期差入保証金	3,028 1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	1,065	未払費用	91

## 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) 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4) 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。

## 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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,784.79円	1株当たり純資産額	16,078.50円
1株当たり当期純利益	3,599.54円	1株当たり当期純利益	4,883.43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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益(百万円)	9,389	12,738
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 (2022年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		3,876
有価証券		498
未収委託者報酬		12,633
関係会社短期貸付金		16,600
その他		557
流動資産合計		34,165
固定資産		
有形固定資産	1	196
無形固定資産		
ソフトウェア		1,443
その他		141
無形固定資産合計		1,584
投資その他の資産		
投資有価証券		7,533
関係会社株式		3,482
繰延税金資産		887
その他		1,267
投資その他の資産合計		13,170
固定資産合計		14,950
資産合計		49,116

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2022年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		5,646

未払費用	4,193
未払法人税等	1,623
賞与引当金	486
その他	2 655
流動負債合計	12,605
固定負債	
退職給付引当金	2,344
役員退職慰労引当金	33
その他	1
固定負債合計	2,379
負債合計	14,984
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	6,692
利益剰余金合計	7,067
株主資本合計	33,737
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	394
評価・換算差額等合計	394
純資産合計	34,131
負債・純資産合計	49,116

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間
	(自 2022年4月1日
	至 2022年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	35,926
その他営業収益	281



営業収益合計		36,208
営業費用		
支払手数料		15,088
その他営業費用		6,970
営業費用合計		22,059
一般管理費	1	5,766
営業利益		8,382
営業外収益	2	579
営業外費用	3	274
経常利益		8,686
特別利益		-
特別損失	4	460
税引前中間純利益		8,226
法人税、住民税及び事業税		2,472
法人税等調整額		248
中間純利益		5,505

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,737	12,737	12,737
中間純利益	-	-	-	5,505	5,505	5,505
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	-	-	-	7,232	7,232	7,232
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,692	7,067	33,737

	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	971	971	41,941
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,737
中間純利益	-	-	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	576	576	576
当中間期変動額合計	576	576	7,809
当中間期末残高	394	394	34,131

## 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。

当社は証券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。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

#### (会計方針の変更)

##### (時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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いたしました。この変更による当中間財務諸表への影響はありません。

#### (追加情報)

##### (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、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日。以下「実務対応報告第42号」という。)に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

#### (中間貸借対照表関係)

### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2022年9月30日現在)
有形固定資産	326百万円

## 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（2022年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,122百万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 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	302百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券売却益	268百万円
有価証券償還益	149百万円
為替差益	114百万円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券売却損	244百万円

## 4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券評価損	237百万円
関係会社整理損失	222百万円

## ( 中間株主資本等変動計算書関係 )

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	12,737	4,883	2022年3月31日	2022年6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2022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。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
有価証券及び投資有価証券	57	7,306	-	7,364
資産合計	57	7,306	-	7,364

## (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

#### 有価証券及び投資有価証券

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。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。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	1,454
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2022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 1,454百万円）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	57	55	2
（2）その他	4,614	3,570	1,043
小計	4,671	3,625	1,046
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	2,692	3,171	478
小計	2,692	3,171	478
合計	7,364	6,797	567

（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〕

## （１）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が35,926百万円、その他281百万円であります。

## （２）収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

## （３）顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並び

に当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## 〔セグメント情報等〕

## 〔セグメント情報〕

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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

内国籍証券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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,084.78円
1株当たり中間純利益	2,110.46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 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,505
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,505
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 (2022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。

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

## 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**

2022年5月23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	間瀬	友未
業務執行社員			
指定有限責任社員	公認会計士	深井	康治
業務執行社員			

**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2022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。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2022年11月18日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ・ノーロードTOPIXファンドの2021年9月22日から2022年9月20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2022年9月20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。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社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**

2022年11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 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2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022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（2022年4月1日から2022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. 上記の監査報告書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**

2023年5月19日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内 知明
--------------------	-------	-------

**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2022年9月21日から2023年3月20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2023年3月20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（2022年9月21日から2023年3月20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。