

## 【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】	2024年6月12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】	佐竹 優子 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワ・ノーロード TOPIXファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

ダイワ・ノーロード TOPIXファンド

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5)【申込手数料】

ありません。

### (6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

### (7)【申込期間】

2024年6月13日から2024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ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

#### 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	
		その他資産 ( )	特殊型
		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	年12回 (毎月)	オセアニア		
公債	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ( )
社債	その他 ( )	アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ( )		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券) (株式 一般)				
資産複合 ( )				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

##### (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。

- 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

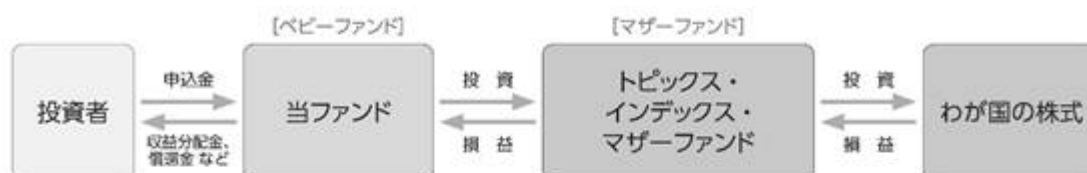
東証株価指数 (TOPIX) は、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークであり、日本経済の動向を示すバロメーターとして経済指標、ETFの連動指標などに用いられています。



## ファンドの仕組み

### ●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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がをめぐっ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せん。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金（ 3 ）	
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないません。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
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せん。）</p>	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、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（2024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。

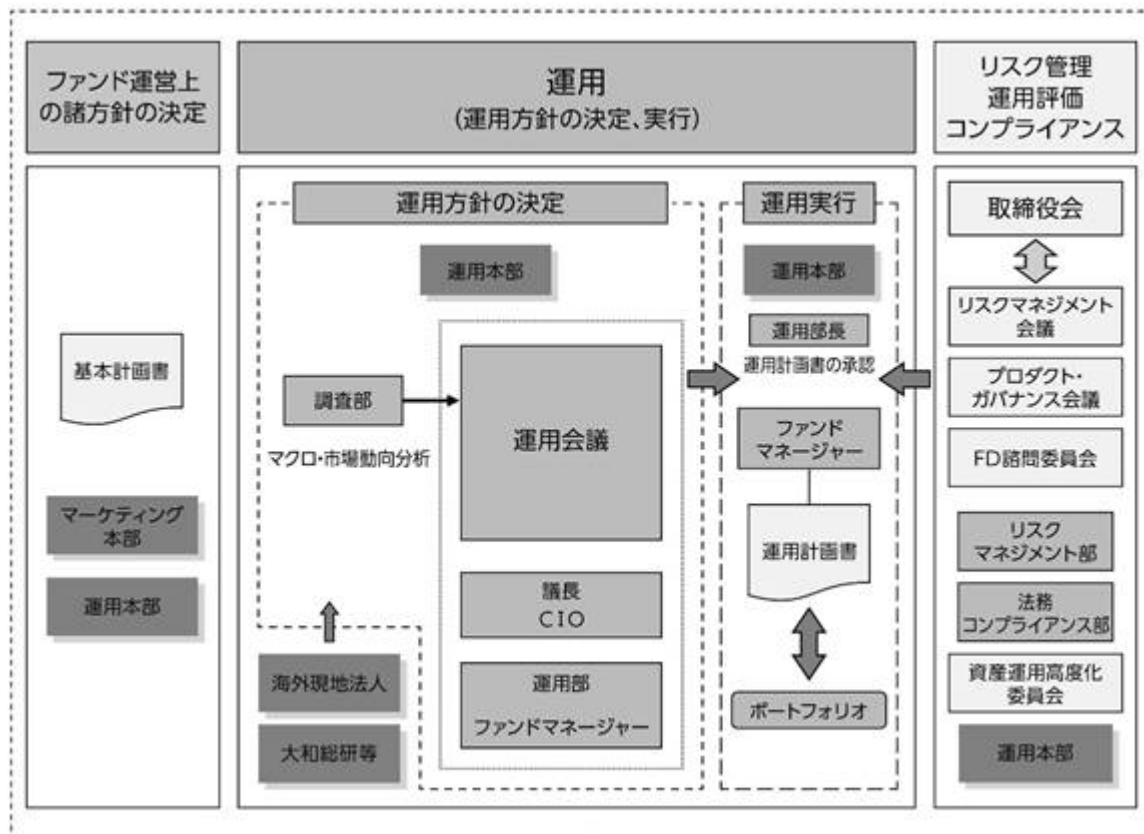
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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。

二．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、プロダクト・ガバナンス会議、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．プロダクト・ガバナンス会議

経営会議の分科会として、運用状況・商品性およびこれらの開示の適切性について検証結果の報告を行ない、対応方針を審議・決定したうえでその実行状況を確認します。加えて、その他当社が運用するプロダクトの品質の維持・向上に関する事項の審議・決定・報告を行ないます。

ハ．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。

ニ．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2024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ます。

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

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券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券の新株予約権(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(以下本ハ.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. 前ハ.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。

へ．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。

へ．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ます。

### 3【投資リスク】

#### (1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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。

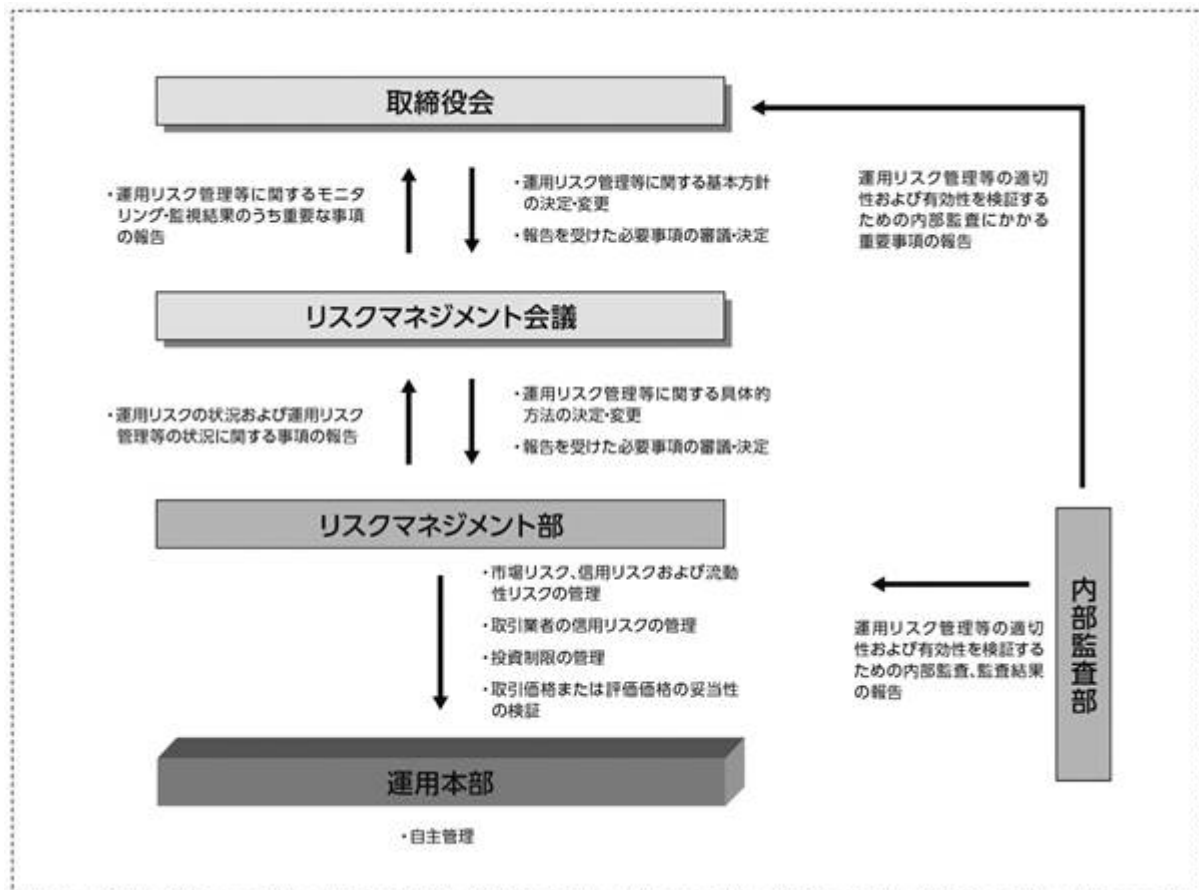
## 流動性リスクに関する事項

- 当ファンドは、大量の解約が発生し短時間で解約資金を手当てする必要がある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、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

## (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



## 流動性リスクに対する管理体制

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

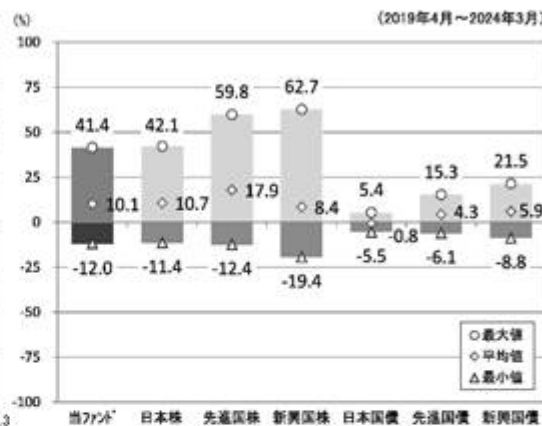
## 参考情報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

### ※資産クラスについて

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

### ※指数について

●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・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾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）」について

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、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無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。

当ファンドは、NISAの対象ではありません。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、2024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】（2024年3月29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	461,098,005	99.99
内 日本	461,098,005	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	32,491	0.01
純資産総額	461,130,496	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】（2024年3月29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	229,584,747	1.7394 399,345,921	2.0084 461,098,005	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
第7計算期間末 (2022年9月20日)	298,114,186	298,114,186	1.6050	1.6050
2023年3月末日	301,824,016	-	1.6882	-
4月末日	298,968,502	-	1.7331	-
5月末日	311,987,045	-	1.7944	-
6月末日	345,069,155	-	1.9293	-
7月末日	347,509,034	-	1.9573	-
8月末日	350,279,250	-	1.9648	-
第8計算期間末 (2023年9月19日)	366,642,411	366,642,411	2.0473	2.0473
9月末日	396,360,525	-	1.9744	-
10月末日	437,992,383	-	1.9144	-
11月末日	403,777,739	-	2.0174	-
12月末日	392,009,383	-	2.0123	-
2024年1月末日	426,321,481	-	2.1686	-
2月末日	450,932,795	-	2.2744	-
3月末日	461,130,496	-	2.3742	-

【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
第8計算期間	0.0000
2023年9月20日～ 2024年3月19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
第8計算期間	27.6
2023年9月20日～ 2024年3月19日	14.2

## (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
第8計算期間	182,247,923	188,909,055
2023年9月20日～ 2024年3月19日	137,235,458	124,938,061

(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 (2024年3月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		336,050,229,900	97.37
	内 日本	336,050,229,900	97.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		9,077,446,723	2.63
純資産総額		345,127,676,623	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)		8,919,400,000	2.58
	内 日本	8,919,400,000	2.58

(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 (2024年3月29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	4,711,400	2,885.28 13,593,718,967	3,792.00 17,865,628,800	5.18
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	5,145,600	1,325.80 6,822,046,393	1,557.00 8,011,699,200	2.32
3	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	606,900	12,825.30 7,783,676,956	12,985.00 7,880,596,500	2.28
4	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	181,600	21,153.50 3,841,476,729	39,570.00 7,185,912,000	2.08
5	三菱商事	日本	株式	卸売業	1,770,600	2,531.42 4,482,147,706	3,487.00 6,174,082,200	1.79
6	キーエンス	日本	株式	電気機器	85,800	58,023.71 4,978,434,474	69,540.00 5,966,532,000	1.73

7	日立	日本	株式	電気機器	416,400	9,994.81 4,161,841,280	13,905.00 5,790,042,000	1.68
8	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	600,700	7,599.97 4,565,306,427	8,909.00 5,351,636,300	1.55
9	信越化学	日本	株式	化学	770,600	4,663.23 3,593,491,343	6,584.00 5,073,630,400	1.47
10	三井物産	日本	株式	卸売業	681,900	5,794.83 3,951,499,861	7,106.00 4,845,581,400	1.40
11	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	25,594,500	180.75 4,626,345,660	179.80 4,601,891,100	1.33
12	任天堂	日本	株式	その他製品	541,700	6,501.03 3,521,613,330	8,196.00 4,439,773,200	1.29
13	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	652,900	5,092.02 3,324,581,864	6,707.00 4,379,000,300	1.27
14	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,092,000	1,790.49 3,745,714,726	1,891.00 3,955,972,000	1.15
15	伊藤忠	日本	株式	卸売業	608,000	5,739.71 3,489,748,552	6,466.00 3,931,328,000	1.14
16	東京海上HD	日本	株式	保険業	835,200	3,593.99 3,001,700,784	4,703.00 3,927,945,600	1.14
17	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	424,500	6,524.86 2,769,803,857	8,962.00 3,804,369,000	1.10
18	第一三共	日本	株式	医薬品	749,700	4,070.42 3,051,596,870	4,777.00 3,581,316,900	1.04
19	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,140,500	2,677.94 3,054,193,469	3,046.00 3,473,963,000	1.01
20	武田薬品	日本	株式	医薬品	761,200	4,791.02 3,646,929,290	4,184.00 3,184,860,800	0.92
21	HOYA	日本	株式	精密機器	168,900	16,161.26 2,729,638,001	18,740.00 3,165,186,000	0.92
22	KDDI	日本	株式	情報・通信業	665,100	4,721.49 3,140,269,520	4,482.00 2,980,978,200	0.86
23	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,384,900	1,762.65 2,441,101,035	1,951.00 2,701,939,900	0.78
24	三菱電機	日本	株式	電気機器	964,300	1,923.44 1,854,781,777	2,512.00 2,422,321,600	0.70
25	ディスコ	日本	株式	機械	41,700	26,996.48 1,125,753,317	57,190.00 2,384,823,000	0.69
26	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	466,800	5,110.20 2,385,445,352	4,849.00 2,263,513,200	0.66



27	村田製作所	日本	株式	電気機器	780,600	2,765.81 2,158,996,240	2,824.00 2,204,414,400	0.64
28	S M C	日本	株式	機械	25,900	70,228.14 1,818,909,005	84,830.00 2,197,097,000	0.64
29	三菱重工業	日本	株式	機械	1,515,000	881.19 1,335,013,224	1,448.50 2,194,477,500	0.64
30	ダイキン工業	日本	株式	機械	103,500	24,755.46 2,562,190,969	20,600.00 2,132,100,000	0.62

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.37%
合計	97.37%

(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	0.35%
建設業	2.03%
食料品	2.99%
繊維製品	0.35%
パルプ・紙	0.16%
化学	5.56%
医薬品	4.15%
石油・石炭製品	0.50%
ゴム製品	0.67%
ガラス・土石製品	0.67%
鉄鋼	0.91%
非鉄金属	0.69%
金属製品	0.50%
機械	5.47%
電気機器	16.94%
輸送用機器	9.27%
精密機器	2.16%
その他製品	2.22%
電気・ガス業	1.37%
陸運業	2.43%

海運業	0.68%
空運業	0.39%
倉庫・運輸関連業	0.13%
情報・通信業	7.05%
卸売業	7.23%
小売業	4.12%
銀行業	7.21%
証券、商品先物取引業	0.91%
保険業	2.65%
その他金融業	1.17%
不動産業	2.05%
サービス業	4.31%
合計	97.37%

(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 0606月	買建	322	8,803,829,700	8,919,400,000	2.58%

(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

2024年3月29日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	23,742円
純資産総額	4.6億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	4.4%
3カ月間	18.0%
6カ月間	20.2%
1年間	40.6%
3年間	50.3%
5年間	91.3%
設定来	137.4%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円								設定来分配金合計額: 0円	
	第1期 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	第8期 23年9月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円		

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	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	2,125	97.4%	電気機器	16.9%	トヨタ自動車	輸送用機器	5.2%
国内株式先物	1	2.6%	輸送用機器	9.3%	TOPIX 先物 0606月	-	2.6%
不動産投資信託等	-	-	卸売業	7.2%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.3%
コール・ローン、その他	-	2.6%	銀行業	7.2%	ソニーグループ	電気機器	2.3%
合計	2,126	-	情報・通信業	7.1%	東京エレクトロン	電気機器	2.1%
株式市場・上場別構成			化学	5.6%	三菱商事	卸売業	1.8%
東証プライム市場		96.9%	機械	5.5%	キーエンス	電気機器	1.7%
東証スタンダード市場		0.4%	サービス業	4.3%	日立	電気機器	1.7%
東証グロース市場		0.0%	医薬品	4.1%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.6%
地方市場・その他		-	その他	30.2%	信越化学	化学	1.5%
合計		97.4%	合計	97.4%	合計		22.7%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数(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、2024年は3月29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	0.47%	0.46%	0.01%

※対象期間は2022年9月21日～2023年9月19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。

（2024年11月4日まで）

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。

（2024年11月5日以降）

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分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。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

(2024年11月4日まで)

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

(2024年11月5日以降)

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分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、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

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わせください。

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の一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所上場株式：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）

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

#### 信託約款の変更等

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



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

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日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8期計算期間(2022年9月21日から2023年9月19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7期 2022年9月20日現在	第8期 2023年9月19日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	861,931	1,796,010
親投資信託受益証券	298,093,602	366,616,722
未収入金	-	3,408,000
流動資産合計	298,955,533	371,820,732
資産合計	298,955,533	371,820,732
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	99,679	4,407,631
未払受託者報酬	48,054	54,368
未払委託者報酬	685,653	707,341
その他未払費用	7,961	8,981
流動負債合計	841,347	5,178,321
負債合計	841,347	5,178,321
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	185,745,220	179,084,088
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	112,368,966	187,558,323
（分配準備積立金）	8,044,136	61,548,984
元本等合計	298,114,186	366,642,411
純資産合計	298,114,186	366,642,411
負債純資産合計	298,955,533	371,820,732

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自	2021年9月22日 至 2022年9月20日	自	2022年9月21日 至 2023年9月19日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		2,811,934		82,859,120
<b>営業収益合計</b>		<b>2,811,934</b>		<b>82,859,120</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		75		389
受託者報酬		93,199		101,708
委託者報酬		1,393,640		1,323,252
その他費用		15,345		16,785
<b>営業費用合計</b>		<b>1,502,259</b>		<b>1,442,134</b>
営業利益又は営業損失( )		4,314,193		81,416,986
経常利益又は経常損失( )		4,314,193		81,416,986
当期純利益又は当期純損失( )		4,314,193		81,416,986
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( )		5,538,133		22,670,383
期首剰余金又は期首欠損金( )		100,053,980		112,368,966
剰余金増加額又は欠損金減少額		151,172,082		135,097,272
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		151,172,082		135,097,272
剰余金減少額又は欠損金増加額		140,081,036		118,654,518
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		140,081,036		118,654,518
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		112,368,966		187,558,323

## (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8期	
	自2022年9月21日 至2023年9月19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  2022年9月19日が休日のため、前計算期間末日を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7期	第8期
	2022年9月20日現在	2023年9月19日現在
1. 1 期首元本額	149,367,030円	185,745,220円
期中追加設定元本額	260,199,112円	182,247,923円
期中一部解約元本額	223,820,922円	188,909,055円
2. 計算期間末日における受益権の総数	185,745,220口	179,084,088口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第7期	第8期
	自2021年9月22日 至2022年9月20日	自2022年9月21日 至2023年9月19日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(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>	<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(58,746,862円)、投資信託約款に規定される収益調整金(126,009,628円)及び分配準備積立金(2,802,122円)より分配対象額は187,558,612円(1万口当たり10,473.21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8期 自2022年9月21日 至2023年9月19日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期
	2023年9月19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7期	第8期
	2022年9月20日現在	2023年9月19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	694,455	66,569,805
合計	694,455	66,569,805

## (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7期	第8期
2022年9月20日現在	2023年9月19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8期
自2022年9月21日
至2023年9月19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7期	第8期
	2022年9月20日現在	2023年9月19日現在
1口当たり純資産額	1.6050円	2.0473円
(1万口当たり純資産額)	(16,050円)	(20,473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	212,211,578	366,616,722	
親投資信託受益証券 合計			366,616,722	
合計			366,616,722	

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

	2022年9月20日現在 金額 (円)	2023年9月19日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		14,544,002,321	11,709,990,572
株式	2 3	190,358,800,810	275,855,624,477
派生商品評価勘定		58,409,600	88,278,700
未収入金		-	181,217,500
未収配当金		85,377,722	104,117,646
未収利息		402,872	307,903
その他未収収益	4	5,697,768	3,770,506
差入委託証拠金		66,270,000	-
流動資産合計		205,118,961,093	287,943,307,304
資産合計		205,118,961,093	287,943,307,304
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		741,000	-
前受金		30,755,000	77,080,000
未払解約金		37,544,320	205,524,850
受入担保金		8,030,704,184	7,693,967,745
流動負債合計		8,099,744,504	7,976,572,595
負債合計		8,099,744,504	7,976,572,595
純資産の部			
元本等			
元本	1	146,161,636,928	162,050,849,324
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		50,857,579,661	117,915,885,385
元本等合計		197,019,216,589	279,966,734,709
純資産合計		197,019,216,589	279,966,734,709
負債純資産合計		205,118,961,093	287,943,307,304

## 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9月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年9月20日現在	2023年9月19日現在
1. 1 期首	2021年9月22日	2022年9月21日
期首元本額	137,972,449,571円	146,161,636,928円
期中追加設定元本額	21,891,192,489円	30,161,540,525円
期中一部解約元本額	13,702,005,132円	14,272,328,129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	2,913,315,600円	2,794,966,122円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	5,057,552,549円	4,428,862,186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	919,050円	912,624円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	22,914,284円	15,316,355円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	306,153,651円	195,111,007円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	20,861,610円	13,274,124円

ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	620,077,228円	424,964,925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)	424,026,190円	622,708,014円
D-I's TOPIXインデックス	31,216,024円	13,696,084円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	209,861,004円	240,356,411円
iFree TOPIXインデックス	6,024,963,119円	6,974,634,748円
iFree 8資産バランス	4,243,393,048円	4,552,782,635円
iFree 年金バランス	754,549,149円	936,907,657円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	760,330円
DCダイワ日本株式インデックス	68,855,675,811円	70,157,904,335円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,261,884,393円	3,126,510,144円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,664,787,412円	4,815,356,904円
ダイワ・ライフ・バランス70	4,626,300,873円	5,437,485,538円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,602,474,346円	7,253,536,469円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	59,540,051円	52,146,342円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	69,149,114円	73,459,968円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,398,708,347円	4,348,979,651円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,198,543円	13,296,558円
ダイワつみたてインデックスバランス50	10,134,564円	11,248,003円
ダイワつみたてインデックスバランス70	25,524,777円	27,586,525円
ダイワ国内株式インデックス(ラップ専用)	964,722,382円	9,143,218,019円
ダイワ世界バランスファンド40VA	80,584,476円	57,636,044円
ダイワ世界バランスファンド60VA	44,620,861円	22,132,245円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,365,977,076円	3,969,119,137円

	ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	495,127,448円	388,963,668円
	ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	70,111,584円	51,746,439円
	ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	105,903,266円	77,438,203円
	ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	221,137,687円	212,211,578円
	ダイワファンドラップTOPIXインデックス	11,537,778,484円	12,214,211,018円
	ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	1,659,502,574円	5,470,175,649円
	ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス	3,228,157,904円	3,439,985,992円
	ダイワ・インデックスセレクトTOPIX	1,206,704,313円	1,173,613,678円
	ダイワライフスタイル25	134,931,541円	111,863,051円
	ダイワライフスタイル50	556,481,026円	498,094,602円
	ダイワライフスタイル75	423,712,951円	412,932,475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)	8,850,002,618円	8,274,743,867円
計		146,161,636,928円	162,050,849,324円
2.	期末日における受益権の総数	146,161,636,928口	162,050,849,324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 7,650,814,500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 7,366,861,130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 846,840,000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 1,199,260,000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2022年9月21日 至2023年9月19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	<p>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。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>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。</p>
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	<p>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。</p> <p>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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年9月19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</p>

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	2022年9月20日現在	2023年9月19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	9,854,133,695	51,873,340,027
合計	9,854,133,695	51,873,340,027

(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	2022年9月20日現在				2023年9月19日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
株値指数								
先物取引								
買建	6,644,620,000	-	6,702,480,000	57,860,000	3,916,380,000	-	4,004,750,000	88,370,000
合計	6,644,620,000	-	6,702,480,000	57,860,000	3,916,380,000	-	4,004,750,000	88,370,000

## (注)

## 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

## 2. 株値指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

## 4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2022年9月20日現在	2023年9月19日現在
1口当たり純資産額	1.3480円	1.7276円

(1万口当たり純資産額)	(13,480円)	(17,276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	4,300.0	4,065.00	17,479,500	
ニッスイ	112,200.0	763.80	85,698,360	
マルハニチロ	16,700.0	2,650.00	44,255,000	
雪国まいたけ	9,600.0	926.00	8,889,600	貸付株式数 3,700株
カネコ種苗	3,500.0	1,522.00	5,327,000	
サカタのタネ	12,800.0	4,460.00	57,088,000	貸付株式数 400株
ホクト	9,900.0	1,854.00	18,354,600	
ホクリヨウ	1,100.0	1,088.00	1,196,800	貸付株式数 400株
ショーボンドHD	15,300.0	5,920.00	90,576,000	
ミライト・ワン	37,100.0	2,056.00	76,277,600	
タマホーム	7,000.0	3,610.00	25,270,000	貸付株式数 2,600株
サンヨーホームズ	900.0	729.00	656,100	貸付株式数 300株
日本アクア	3,000.0	1,041.00	3,123,000	
ファーストコーポレーション	1,900.0	794.00	1,508,600	貸付株式数 700株
ベステラ	1,700.0	983.00	1,671,100	貸付株式数 600株
キャンディル	1,400.0	623.00	872,200	貸付株式数 700株
住石ホールディングス	11,600.0	455.00	5,278,000	貸付株式数 5,100株
日鉄鉱業	4,500.0	5,580.00	25,110,000	
三井松島HLDGS	5,100.0	2,950.00	15,045,000	貸付株式数 2,000株
INPEX	414,500.0	2,358.00	977,391,000	
石油資源開発	13,000.0	5,910.00	76,830,000	
K&Oエナジーグループ	5,100.0	2,681.00	13,673,100	
ダイセキ環境ソリューション	1,500.0	1,262.00	1,893,000	
第一カッター興業	2,800.0	1,302.00	3,645,600	
明豊ファシリティワークス	3,000.0	743.00	2,229,000	
安藤・間	64,600.0	1,270.00	82,042,000	
東急建設	31,100.0	847.00	26,341,700	
コムシスホールディングス	35,500.0	3,265.00	115,907,500	



ピーアールホールディングス	18,200.0	385.00	7,007,000	
高松コンストラクションG P	7,200.0	2,770.00	19,944,000	
東建コーポレーション	3,200.0	8,050.00	25,760,000	
ソネック	800.0	1,013.00	810,400	貸付株式数 300株 (100株)
ヤマウラ	5,500.0	1,269.00	6,979,500	貸付株式数 200株
オリエンタル白石	39,200.0	337.00	13,210,400	
大成建設	73,300.0	5,360.00	392,888,000	
大林組	279,800.0	1,413.00	395,357,400	
清水建設	221,800.0	1,055.00	233,999,000	
飛鳥建設	8,600.0	1,433.00	12,323,800	
長谷工コーポレーション	80,700.0	1,974.00	159,301,800	
松井建設	7,100.0	795.00	5,644,500	
銭高組	600.0	4,035.00	2,421,000	貸付株式数 200株
鹿島建設	173,600.0	2,596.00	450,665,600	
不動テトラ	5,500.0	2,054.00	11,297,000	貸付株式数 1,300株
大末建設	1,900.0	1,559.00	2,962,100	
鉄建建設	5,500.0	2,247.00	12,358,500	
西松建設	13,200.0	3,898.00	51,453,600	
三井住友建設	62,300.0	427.00	26,602,100	
大豊建設	3,200.0	4,135.00	13,232,000	貸付株式数 700株
佐田建設	3,300.0	509.00	1,679,700	
ナカノフドー建設	3,600.0	419.00	1,508,400	
奥村組	12,600.0	4,705.00	59,283,000	
東鉄工業	10,800.0	3,035.00	32,778,000	
イチケン	1,100.0	2,150.00	2,365,000	
富士ピー・エス	2,300.0	478.00	1,099,400	貸付株式数 900株 (500株)
浅沼組	6,100.0	3,705.00	22,600,500	
戸田建設	96,100.0	845.10	81,214,110	
熊谷組	12,900.0	3,495.00	45,085,500	
北野建設	1,000.0	3,045.00	3,045,000	
植木組	1,500.0	1,580.00	2,370,000	
矢作建設	10,500.0	1,366.00	14,343,000	
ピーエス三菱	10,300.0	875.00	9,012,500	
日本ハウスHLDGS	16,300.0	377.00	6,145,100	貸付株式数 6,500株
大東建託	28,800.0	16,295.00	469,296,000	
新日本建設	10,900.0	1,271.00	13,853,900	

東亜道路	3,100.0	5,300.00	16,430,000	
日本道路	1,600.0	9,740.00	15,584,000	
東亜建設	6,700.0	3,815.00	25,560,500	貸付株式数 2,400株
日本国土開発	21,900.0	667.00	14,607,300	
若築建設	3,500.0	3,170.00	11,095,000	
東洋建設	25,300.0	1,183.00	29,929,900	貸付株式数 9,400株
五洋建設	111,100.0	950.00	105,545,000	
世紀東急	10,100.0	1,708.00	17,250,800	貸付株式数 4,000株
福田組	2,900.0	4,910.00	14,239,000	貸付株式数 800株
日本ドライケミカル	1,300.0	2,283.00	2,967,900	貸付株式数 400株
住友林業	67,700.0	4,270.00	289,079,000	
日本基礎技術	3,100.0	513.00	1,590,300	
巴コーポレーション	6,000.0	582.00	3,492,000	
大和ハウス	216,600.0	4,201.00	909,936,600	
ライト工業	14,600.0	2,072.00	30,251,200	
積水ハウス	237,600.0	3,124.00	742,262,400	
日特建設	7,600.0	1,149.00	8,732,400	
北陸電気工事	5,500.0	1,062.00	5,841,000	
ユアテック	17,500.0	1,016.00	17,780,000	
日本リーテック	6,900.0	1,389.00	9,584,100	
四電工	3,300.0	3,020.00	9,966,000	
中電工	12,300.0	2,530.00	31,119,000	
関電工	43,200.0	1,374.00	59,356,800	
きんでん	55,400.0	2,244.00	124,317,600	貸付株式数 300株
東京エネシス	7,600.0	1,033.00	7,850,800	
トーエネック	2,600.0	4,405.00	11,453,000	
住友電設	7,500.0	2,904.00	21,780,000	
日本電設工業	12,900.0	2,338.00	30,160,200	
エクシオグループ	36,200.0	3,204.00	115,984,800	
新日本空調	4,200.0	2,510.00	10,542,000	
九電工	19,100.0	4,660.00	89,006,000	
三機工業	17,600.0	1,661.00	29,233,600	
日揮ホールディングス	77,400.0	2,250.50	174,188,700	
中外炉工業	2,500.0	2,222.00	5,555,000	
ヤマト	4,400.0	992.00	4,364,800	
太平電業	4,800.0	4,085.00	19,608,000	
高砂熱学	19,000.0	2,954.00	56,126,000	貸付株式数 5,300株
三晃金属	600.0	4,330.00	2,598,000	
NECネットエスアイ	26,800.0	1,997.00	53,519,600	
朝日工業社	3,300.0	2,562.00	8,454,600	

明星工業	13,600.0	1,062.00	14,443,200	
大 気 社	9,100.0	4,810.00	43,771,000	
ダイダン	5,300.0	3,090.00	16,377,000	
日比谷総合設備	6,400.0	2,359.00	15,097,600	
ニッポン	21,300.0	2,180.00	46,434,000	
日清製粉G本社	72,800.0	1,965.50	143,088,400	
日東富士製粉	1,400.0	5,000.00	7,000,000	
昭和産業	6,900.0	3,125.00	21,562,500	
鳥越製粉	4,800.0	687.00	3,297,600	貸付株式数 200株
中部飼料	11,000.0	1,168.00	12,848,000	
フィード・ワン	11,600.0	827.00	9,593,200	
東洋精糖	1,000.0	2,233.00	2,233,000	
日本甜菜糖	4,600.0	1,955.00	8,993,000	
D M三井製糖ホールディ	7,800.0	3,125.00	24,375,000	
塩水港精糖	6,400.0	266.00	1,702,400	
ウェルネオシュガー	4,100.0	2,124.00	8,708,400	貸付株式数 1,400株
L I F U L L	27,900.0	236.00	6,584,400	貸付株式数 10,900株
M I X I	18,600.0	2,430.00	45,198,000	
ジェイエイシーリクルート メント	7,500.0	2,491.00	18,682,500	
日本M & Aセンターホール デ	141,100.0	767.50	108,294,250	
メンバーズ	2,400.0	1,235.00	2,964,000	貸付株式数 900株
中広	1,100.0	445.00	489,500	貸付株式数 400株
U Tグループ	12,100.0	2,266.00	27,418,600	
アイティメディア	3,000.0	1,205.00	3,615,000	貸付株式数 1,200株
E・Jホールディングス	5,000.0	1,774.00	8,870,000	貸付株式数 1,400株
オープンアップグループ	24,700.0	1,880.00	46,436,000	貸付株式数 9,600株
コシダカホールディングス	24,600.0	1,260.00	30,996,000	
アルトナー	1,400.0	1,811.00	2,535,400	貸付株式数 500株
パソナグループ	10,100.0	1,683.00	16,998,300	
C D S	1,400.0	1,753.00	2,454,200	
リンクアンドモチベーショ ン	23,800.0	461.00	10,971,800	貸付株式数 9,200株
エス・エム・エス	31,500.0	2,574.50	81,096,750	
サニーサイドアップG	1,700.0	817.00	1,388,900	貸付株式数 400株
パーソルホールディングス	90,700.0	2,504.00	227,112,800	
リニカル	3,200.0	704.00	2,252,800	
クックパッド	21,900.0	151.00	3,306,900	貸付株式数 1,700株
エスクリ	2,200.0	338.00	743,600	貸付株式数 1,200株

アイ・ケイ・ケイホールディング	2,600.0	700.00	1,820,000	貸付株式数	1,300株
森永製菓	14,000.0	5,382.00	75,348,000		
中村屋	1,900.0	3,130.00	5,947,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	22,500.0	4,089.00	92,002,500		
名糖産業	3,100.0	1,670.00	5,177,000	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	4,300.0	2,325.00	9,997,500		
不二家	5,400.0	2,525.00	13,635,000	貸付株式数	2,000株
山崎製パン	52,700.0	2,852.50	150,326,750		
第一屋製パン	1,000.0	438.00	438,000	貸付株式数	300株
モロゾフ	2,500.0	3,715.00	9,287,500		
亀田製菓	5,000.0	4,350.00	21,750,000		
寿スピリッツ	8,400.0	11,740.00	98,616,000		
カルビー	36,000.0	2,979.00	107,244,000		
森永乳業	14,300.0	5,861.00	83,812,300		
六甲バター	5,800.0	1,389.00	8,056,200	貸付株式数	2,000株
ヤクルト	56,200.0	7,581.00	426,052,200		
明治ホールディングス	96,500.0	3,737.00	360,620,500		
雪印メグミルク	19,100.0	2,329.00	44,483,900		
プリマハム	10,600.0	2,520.00	26,712,000		
日本ハム	30,800.0	4,595.00	141,526,000		
林兼産業	1,600.0	557.00	891,200	貸付株式数	600株
丸大食品	7,900.0	1,703.00	13,453,700	貸付株式数	3,000株
S Foods	8,700.0	3,435.00	29,884,500		
柿安本店	3,200.0	2,497.00	7,990,400	貸付株式数	800株
伊藤ハム米久HLDGS	60,300.0	820.00	49,446,000		
学情	4,200.0	1,972.00	8,282,400	貸付株式数	200株
スタジオアリス	4,000.0	2,093.00	8,372,000	貸付株式数	1,500株
クロスキャット	4,600.0	1,015.00	4,669,000	貸付株式数	1,700株
シミックホールディングス	4,100.0	1,782.00	7,306,200	貸付株式数	1,500株
エプロ	1,800.0	748.00	1,346,400	貸付株式数	500株
システナ	134,700.0	278.00	37,446,600		
NJS	1,900.0	3,000.00	5,700,000		
デジタルアーツ	5,100.0	4,735.00	24,148,500		
日鉄ソリューションズ	13,700.0	4,290.00	58,773,000		
総合警備保障	152,800.0	924.70	141,294,160		
キューブシステム	4,700.0	1,202.00	5,649,400	貸付株式数	1,800株
いちご	90,700.0	327.00	29,658,900		
日本駐車場開発	83,200.0	210.00	17,472,000		
コア	3,500.0	1,780.00	6,230,000	貸付株式数	600株

カカクコム	60,300.0	1,621.50	97,776,450		
アイロムグループ	3,000.0	1,906.00	5,718,000	貸付株式数	1,100株
セントケア・ホールディング	5,100.0	830.00	4,233,000	貸付株式数	2,000株
サイネックス	900.0	697.00	627,300	貸付株式数	300株
ルネサンス	5,600.0	930.00	5,208,000	貸付株式数	2,200株
ディップ	14,400.0	3,725.00	53,640,000	貸付株式数	5,700株
SBSホールディングス	7,100.0	2,864.00	20,334,400		
デジタルホールディングス	4,200.0	1,049.00	4,405,800		
新日本科学	8,700.0	1,865.00	16,225,500	貸付株式数	3,400株
キャリアデザインセンター	1,200.0	2,080.00	2,496,000		
ベネフィット・ワン	38,100.0	1,131.00	43,091,100		
エムスリー	162,300.0	2,814.50	456,793,350		
ツカダ・グローバルHOLD	3,400.0	435.00	1,479,000	貸付株式数	600株
プラス	600.0	718.00	430,800	貸付株式数	200株
アウトソーシング	52,800.0	1,182.50	62,436,000		
ウェルネット	4,400.0	578.00	2,543,200	貸付株式数	1,600株
ワールドホールディングス	3,800.0	2,424.00	9,211,200	貸付株式数	400株
ディー・エヌ・エー	32,800.0	1,541.00	50,544,800		
博報堂DYHLDGS	104,900.0	1,315.00	137,943,500		
ぐるなび	15,000.0	331.00	4,965,000		
タカミヤ	11,400.0	523.00	5,962,200		
ジャパンベストレスキュー	4,200.0	735.00	3,087,000		
ファンコミュニケーションズ	12,400.0	402.00	4,984,800		
ライク	3,100.0	1,554.00	4,817,400	貸付株式数	1,200株
ビジネス・ブレークスルー	2,000.0	399.00	798,000	貸付株式数	800株
エスプール	23,700.0	467.00	11,067,900		
WDBホールディングス	4,300.0	2,111.00	9,077,300		
手間いらず	1,300.0	2,841.00	3,693,300	貸付株式数	500株
ティア	3,100.0	470.00	1,457,000	貸付株式数	1,100株
CDG	700.0	1,320.00	924,000	貸付株式数	200株
アドウェイズ	11,200.0	557.00	6,238,400		
バリューコマース	7,100.0	1,259.00	8,938,900		
インフォマート	85,300.0	473.00	40,346,900		
サッポロホールディングス	25,900.0	4,716.00	122,144,400	貸付株式数	6,000株
アサヒグループホールディ	181,900.0	5,927.00	1,078,121,300	貸付株式数	72,700株

キリンHD	327,900.0	2,137.00	700,722,300	貸付株式数	131,100株
宝ホールディングス	53,800.0	1,257.00	67,626,600		
オエノンホールディングス	23,500.0	451.00	10,598,500		
養命酒	2,600.0	1,913.00	4,973,800	貸付株式数	1,000株
コカ・コーラボトラーズJHD	61,700.0	2,067.00	127,533,900		
サントリー食品インター	55,400.0	4,708.00	260,823,200		
ダイドーグループHD	4,500.0	5,760.00	25,920,000	貸付株式数	1,500株
伊藤園	26,700.0	4,906.00	130,990,200	貸付株式数	10,600株
キーコーヒー	8,800.0	2,033.00	17,890,400	貸付株式数	3,500株 (100株)
ユニカフェ	1,700.0	954.00	1,621,800	貸付株式数	700株
ジャパンフーズ	800.0	1,122.00	897,600		
日清オイリオグループ	11,100.0	4,375.00	48,562,500		
不二製油グループ	18,300.0	2,330.00	42,639,000		
かどや製油	600.0	3,520.00	2,112,000		
J-オイルミルズ	8,100.0	1,843.00	14,928,300		
ローソン	21,000.0	6,803.00	142,863,000		
サンエー	6,400.0	4,890.00	31,296,000	貸付株式数	1,300株
カワチ薬品	6,600.0	2,328.00	15,364,800		
エービーシー・マート	37,100.0	2,758.00	102,321,800		
ハードオフコーポレーション	2,300.0	1,526.00	3,509,800		
高千穂交易	2,000.0	3,315.00	6,630,000	貸付株式数	1,000株
アスクル	17,500.0	1,893.00	33,127,500	貸付株式数	6,800株
ゲオホールディングス	8,300.0	2,507.00	20,808,100	貸付株式数	3,200株
アダストリア	10,200.0	2,878.00	29,355,600	貸付株式数	3,600株
ジーフット	3,700.0	288.00	1,065,600	貸付株式数	1,200株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800.0	864.00	691,200	貸付株式数	200株
オルバヘルスケアHLDGS	800.0	1,775.00	1,420,000		
伊藤忠食品	1,900.0	6,620.00	12,578,000		
くら寿司	9,900.0	3,465.00	34,303,500	貸付株式数	3,300株 (200株)
キャンドウ	3,000.0	2,733.00	8,199,000	貸付株式数	1,100株
エレマテック	7,600.0	1,935.00	14,706,000		
IKホールディングス	1,700.0	391.00	664,700	貸付株式数	600株
パルグループHLDGS	16,600.0	2,013.00	33,415,800		
エディオン	33,700.0	1,500.00	50,550,000	貸付株式数	7,400株

あらた	6,500.0	5,860.00	38,090,000	
サーラコーポレーション	17,800.0	779.00	13,866,200	
ワッツ	2,700.0	608.00	1,641,600	貸付株式数 1,000株
トーメンデバイス	1,200.0	5,080.00	6,096,000	貸付株式数 400株
ハローズ	3,800.0	4,255.00	16,169,000	貸付株式数 400株
J Pホールディングス	23,500.0	338.00	7,943,000	貸付株式数 8,800株
フジオフードG本社	9,600.0	1,405.00	13,488,000	貸付株式数 2,900株 (100株)
あみやき亭	2,100.0	3,645.00	7,654,500	貸付株式数 600株
東京エレクトロニクスデバイス	3,100.0	10,450.00	32,395,000	
ひらまつ	12,200.0	272.00	3,318,400	貸付株式数 5,200株
円谷フィールズホールディ	14,500.0	2,106.00	30,537,000	貸付株式数 5,800株
双日	84,300.0	3,522.00	296,904,600	
アルフレッサホールディン グス	84,900.0	2,601.50	220,867,350	
大黒天物産	2,600.0	6,760.00	17,576,000	
ハニーズホールディングス	6,700.0	1,651.00	11,061,700	貸付株式数 2,100株
ファーマライズHD	1,200.0	654.00	784,800	貸付株式数 500株
キッコーマン	52,200.0	8,460.00	441,612,000	
味の素	190,000.0	5,850.00	1,111,500,000	
ブルドックソ - ス	4,200.0	2,100.00	8,820,000	貸付株式数 1,600株
キューピー	42,300.0	2,463.50	104,206,050	貸付株式数 16,900株
ハウス食品G本社	24,100.0	3,166.00	76,300,600	
カゴメ	33,900.0	3,318.00	112,480,200	貸付株式数 13,000株
焼津水産化工	2,000.0	1,243.00	2,486,000	
アリアケジャパン	6,900.0	5,090.00	35,121,000	
ピエトロ	700.0	1,865.00	1,305,500	
エバラ食品工業	2,100.0	3,040.00	6,384,000	貸付株式数 200株
やまみ	500.0	1,947.00	973,500	貸付株式数 200株
ニチレイ	36,100.0	3,560.00	128,516,000	
横浜冷凍	23,000.0	1,354.00	31,142,000	
東洋水産	39,800.0	5,947.00	236,690,600	
イトアンドHLDGS	3,500.0	2,130.00	7,455,000	貸付株式数 1,300株
大冷	700.0	2,044.00	1,430,800	
ヨシムラ・フード・HLD GS	5,000.0	1,318.00	6,590,000	貸付株式数 2,000株
日清食品HD	27,700.0	12,475.00	345,557,500	
永谷園ホールディングス	3,900.0	2,324.00	9,063,600	
一正蒲鉾	2,200.0	782.00	1,720,400	貸付株式数 300株
フジッコ	8,100.0	1,960.00	15,876,000	

ロックフィールド	8,800.0	1,636.00	14,396,800	貸付株式数	3,500株
日本たばこ産業	478,300.0	3,384.00	1,618,567,200	貸付株式数	191,300株
ケンコーマヨネーズ	5,400.0	1,459.00	7,878,600		
わらべや日洋HD	5,800.0	2,917.00	16,918,600		
なとり	4,900.0	1,998.00	9,790,200		
イフジ産業	900.0	1,616.00	1,454,400	貸付株式数	300株
ファーマフーズ	11,300.0	1,555.00	17,571,500	貸付株式数	4,500株
北の達人コーポ	34,000.0	246.00	8,364,000	貸付株式数	13,100株 (1,100株)
ユーグレナ	49,000.0	810.00	39,690,000	貸付株式数	19,100株
紀文食品	6,200.0	1,218.00	7,551,600	貸付株式数	2,400株
ピクルスホールディングス	4,600.0	1,284.00	5,906,400	貸付株式数	1,200株
スター・マイカ・HLDGS	9,200.0	657.00	6,044,400		
SREホールディングス	3,900.0	3,155.00	12,304,500	貸付株式数	1,500株
ADワークスグループ	13,400.0	256.00	3,430,400	貸付株式数	2,800株
片倉工業	7,300.0	1,812.00	13,227,600	貸付株式数	2,600株
グンゼ	5,700.0	4,645.00	26,476,500		
ヒューリック	183,700.0	1,388.50	255,067,450		
神栄	700.0	1,647.00	1,152,900		
ラサ商事	2,500.0	1,628.00	4,070,000	貸付株式数	900株
アルペン	7,100.0	1,932.00	13,717,200	貸付株式数	2,700株
ハブ	1,900.0	849.00	1,613,100		
ラクーンホールディングス	6,600.0	743.00	4,903,800	貸付株式数	1,000株
クオールホールディングス	11,600.0	1,928.00	22,364,800		
アルコニックス	11,000.0	1,414.00	15,554,000		
神戸物産	65,500.0	3,648.00	238,944,000	貸付株式数	26,100株
ソリトンシステムズ	4,100.0	1,159.00	4,751,900		
ジンスホールディングス	5,000.0	3,165.00	15,825,000	貸付株式数	1,800株
ビックカメラ	45,200.0	1,087.00	49,132,400	貸付株式数	17,600株
DCMホールディングス	49,300.0	1,248.00	61,526,400		
ペッパーフードサービス	18,400.0	115.00	2,116,000	貸付株式数	4,800株
ハイパー	1,200.0	358.00	429,600	貸付株式数	400株
Monotaro	120,000.0	1,591.00	190,920,000		
東京一番フーズ	1,400.0	555.00	777,000	貸付株式数	600株
DDグループ	3,700.0	1,770.00	6,549,000	貸付株式数	1,000株
あいホールディングス	13,600.0	2,461.00	33,469,600		
ディー・ブイエックス	1,500.0	1,022.00	1,533,000	貸付株式数	200株



きちりホールディングス	1,400.0	885.00	1,239,000	貸付株式数	500株
J. フロント リテイリング	105,100.0	1,584.00	166,478,400		
ドトール・日レスHD	15,100.0	2,366.00	35,726,600		
マツキヨココカラ&カンパニー	51,300.0	8,249.00	423,173,700		
ブロンコビリー	5,000.0	3,035.00	15,175,000	貸付株式数	1,900株
ZOZO	55,900.0	2,896.00	161,886,400		
トレジャー・ファクトリー	3,500.0	1,334.00	4,669,000	貸付株式数	1,400株
物語コーポレーション	14,100.0	4,355.00	61,405,500		
三越伊勢丹HD	142,400.0	1,731.00	246,494,400		
東洋紡	34,700.0	1,118.50	38,811,950		
ユニチカ	24,100.0	213.00	5,133,300	貸付株式数	4,800株
富士紡ホールディングス	3,100.0	3,765.00	11,671,500		
日清紡ホールディングス	60,600.0	1,103.50	66,872,100	貸付株式数	20,400株
倉敷紡績	6,000.0	2,572.00	15,432,000		
ダイワボウHD	34,600.0	2,990.50	103,471,300		
シキボウ	2,900.0	1,112.00	3,224,800		
日東紡績	9,000.0	3,575.00	32,175,000		
トヨタ紡織	33,700.0	2,905.50	97,915,350		
マクニカホールディングス	20,000.0	6,570.00	131,400,000		
Hamee	2,900.0	925.00	2,682,500	貸付株式数	1,100株
マーケットエンタープライズ	600.0	1,228.00	736,800	貸付株式数	200株
ラクト・ジャパン	3,300.0	2,163.00	7,137,900	貸付株式数	500株
ウエルシアHD	43,800.0	2,649.00	116,026,200		
クリエイトSDH	13,900.0	3,515.00	48,858,500	貸付株式数	5,100株
グリムス	3,600.0	2,264.00	8,150,400		
バイタルKSKHD	10,500.0	1,005.00	10,552,500		
八洲電機	6,900.0	1,313.00	9,059,700	貸付株式数	2,700株
メディアスホールディングス	5,400.0	777.00	4,195,800	貸付株式数	1,800株
レスターホールディングス	8,100.0	2,528.00	20,476,800		
ジオリーブグループ	1,300.0	1,274.00	1,656,200	貸付株式数	500株
丸善CHI HD	7,300.0	345.00	2,518,500		
大光	2,300.0	673.00	1,547,900	貸付株式数	1,100株
OCHIホールディングス	1,200.0	1,457.00	1,748,400		
TOKAIホールディングス	41,600.0	941.00	39,145,600	貸付株式数	16,600株
黒谷	1,500.0	609.00	913,500	貸付株式数	600株

ミサワ	1,000.0	610.00	610,000		
ティーライフ	800.0	1,409.00	1,127,200	貸付株式数	100株
Cominix	1,100.0	883.00	971,300	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,200.0	1,019.00	1,222,800	貸付株式数	500株
三洋貿易	9,500.0	1,419.00	13,480,500		
チムニー	1,800.0	1,516.00	2,728,800	貸付株式数	700株
シュッピン	6,300.0	1,117.00	7,037,100	貸付株式数	2,300株
ビューティガレージ	1,300.0	5,300.00	6,890,000	貸付株式数	500株
オイシックス・ラ・大地	11,400.0	1,662.00	18,946,800	貸付株式数	4,500株
ウイン・パートナーズ	6,100.0	1,122.00	6,844,200	貸付株式数	500株
ネクステージ	19,300.0	2,102.00	40,568,600	貸付株式数	7,300株
ジョイフル本田	24,700.0	1,759.00	43,447,300	貸付株式数	1,500株
鳥貴族ホールディングス	3,100.0	3,340.00	10,354,000	貸付株式数	1,100株
ホットランド	6,500.0	1,687.00	10,965,500		
すかいらーくHD	115,700.0	2,042.50	236,317,250	貸付株式数	100株
SFPホールディングス	4,700.0	2,271.00	10,673,700	貸付株式数	1,600株
綿半ホールディングス	6,500.0	1,374.00	8,931,000	貸付株式数	1,500株
日本毛織	21,100.0	1,375.00	29,012,500	貸付株式数	1,600株
ダイトウボウ	8,500.0	95.00	807,500	貸付株式数	5,300株
トーア紡コーポレーション	2,000.0	462.00	924,000	貸付株式数	400株
ダイドーリミテッド	7,600.0	312.00	2,371,200	貸付株式数	3,700株
ヨシックスホールディングス	1,100.0	2,808.00	3,088,800	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパー マーケ	27,400.0	1,118.00	30,633,200	貸付株式数	10,000株
三栄建築設計	3,700.0	2,022.00	7,481,400		
野村不動産HLDGS	49,300.0	3,961.00	195,277,300		
三重交通グループHD	16,800.0	610.00	10,248,000	貸付株式数	6,700株
サムティ	12,600.0	2,418.00	30,466,800	貸付株式数	4,600株
地主	6,000.0	1,925.00	11,550,000	貸付株式数	2,300株
プレサンスコーポレーション	12,500.0	1,980.00	24,750,000	貸付株式数	4,900株
フィル・カンパニー	1,300.0	730.00	949,000	貸付株式数	500株
ハウスコム	800.0	938.00	750,400	貸付株式数	300株
JPMC	4,500.0	1,166.00	5,247,000		
サンセイランディック	1,600.0	1,071.00	1,713,600	貸付株式数	500株
エストラスト	700.0	649.00	454,300	貸付株式数	200株
フージャースHD	12,200.0	1,176.00	14,347,200		
オープンハウスグループ	28,800.0	5,231.00	150,652,800		

東急不動産HD	236,700.0	981.90	232,415,730	
飯田GH D	67,100.0	2,656.00	178,217,600	
イーグランド	800.0	1,603.00	1,282,400	
帝国繊維	9,000.0	1,968.00	17,712,000	貸付株式数 3,100株
日本コークス工業	72,400.0	129.00	9,339,600	
ゴルフダイジェスト・オン	3,800.0	726.00	2,758,800	貸付株式数 1,500株
ミタチ産業	1,400.0	1,160.00	1,624,000	貸付株式数 600株
B E E N O S	3,500.0	1,600.00	5,600,000	貸付株式数 1,600株
あさひ	7,300.0	1,292.00	9,431,600	
日本調剤	5,700.0	1,506.00	8,584,200	貸付株式数 2,100株
コスモス薬品	8,400.0	15,790.00	132,636,000	貸付株式数 3,200株
シップヘルスケアHD	30,400.0	2,347.00	71,348,800	
トーエル	2,400.0	770.00	1,848,000	貸付株式数 1,300株
ソフトクリエイイトHD	6,600.0	1,708.00	11,272,800	
セブン&アイ・H L D G S	291,500.0	6,071.00	1,769,696,500	
クリエイイト・レストラン ツ・ホール	63,700.0	1,167.00	74,337,900	貸付株式数 24,800株 (900株)
明治電機工業	3,200.0	1,530.00	4,896,000	貸付株式数 1,200株
ツルハホールディングス	17,800.0	10,365.00	184,497,000	貸付株式数 7,100株
デリカフーズH L D G S	2,200.0	680.00	1,496,000	貸付株式数 900株
スターティアホールディング ス	1,100.0	1,698.00	1,867,800	貸付株式数 400株
サンマルクホールディング ス	6,900.0	1,908.00	13,165,200	
フェリシモ	1,400.0	1,008.00	1,411,200	貸付株式数 400株
トリドールホールディング ス	21,100.0	3,825.00	80,707,500	貸付株式数 8,400株
帝 人	77,000.0	1,612.00	124,124,000	
東 レ	536,400.0	837.50	449,235,000	
ク ラ レ	116,700.0	1,736.00	202,591,200	
旭 化 成	499,700.0	1,002.50	500,949,250	
T O K Y O B A S E	8,800.0	338.00	2,974,400	貸付株式数 3,300株
稲葉製作所	4,200.0	1,579.00	6,631,800	貸付株式数 1,700株
宮地エンジニアリングG	2,300.0	6,280.00	14,444,000	貸付株式数 800株
トーカロ	21,900.0	1,433.00	31,382,700	
アルファCO	2,000.0	1,585.00	3,170,000	
S U M C O	146,600.0	1,984.50	290,927,700	
川田テクノロジーズ	1,900.0	6,310.00	11,989,000	
R S T E C H N O L O G I E S	5,500.0	2,486.00	13,673,000	

ジェイテックコーポレーション	700.0	2,697.00	1,887,900		
信和	3,000.0	800.00	2,400,000	貸付株式数	1,100株
ビーロッド	3,600.0	886.00	3,189,600		
ファーストブラザーズ	1,000.0	1,213.00	1,213,000	貸付株式数	400株 (400株)
AND DOホールディングス	4,700.0	1,032.00	4,850,400	貸付株式数	1,700株
シーアールイー	4,400.0	1,556.00	6,846,400	貸付株式数	400株 (200株)
プロパティエージェント	700.0	1,465.00	1,025,500		
ケイアイスター不動産	3,800.0	4,895.00	18,601,000		
アグレ都市デザイン	900.0	1,573.00	1,415,700	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,900.0	5,610.00	10,659,000		
ロードスターキャピタル	5,100.0	1,856.00	9,465,600	貸付株式数	2,000株
テンポイノベーション	1,600.0	1,227.00	1,963,200	貸付株式数	400株
グローバルリンクマネジメント	1,000.0	2,063.00	2,063,000	貸付株式数	400株
フェイスネットワーク	1,400.0	1,467.00	2,053,800	貸付株式数	600株
住江織物	1,100.0	2,312.00	2,543,200	貸付株式数	400株
日本フェルト	2,900.0	440.00	1,276,000		
イチカワ	700.0	1,546.00	1,082,200		
エコナックホールディングス	9,200.0	83.00	763,600		
日東製網	500.0	1,535.00	767,500	貸付株式数	100株
芦森工業	1,000.0	2,258.00	2,258,000		
アツギ	3,000.0	449.00	1,347,000		
ウイルプラスHLDGS	900.0	1,226.00	1,103,400	貸付株式数	400株
JMホールディングス	6,400.0	1,954.00	12,505,600	貸付株式数	2,400株
コメダホールディングス	20,800.0	2,969.00	61,755,200		
サツドラホールディングス	2,700.0	819.00	2,211,300	貸付株式数	1,100株
アレンザホールディングス	6,600.0	1,008.00	6,652,800	貸付株式数	900株
串カツ田中HLDGS	2,300.0	1,630.00	3,749,000	貸付株式数	900株
パロックジャパン	5,400.0	851.00	4,595,400	貸付株式数	2,000株
クスリのアオキHLDGS	7,600.0	8,814.00	66,986,400		
ダイニック	1,300.0	827.00	1,075,100		
共和レザー	3,000.0	677.00	2,031,000		
ピーバンドットコム	800.0	455.00	364,000	貸付株式数	300株
力の源HD	3,300.0	2,234.00	7,372,200	貸付株式数	1,200株

FOOD & LIFE COMPANY	45,100.0	2,663.00	120,101,300	
アセンテック	2,800.0	539.00	1,509,200	貸付株式数 100株
セーレン	15,400.0	2,362.00	36,374,800	貸付株式数 6,000株
ソトー	1,600.0	788.00	1,260,800	貸付株式数 100株
東海染工	500.0	1,095.00	547,500	
小松マテーレ	11,500.0	771.00	8,866,500	
ワコールホールディングス	14,600.0	3,310.00	48,326,000	
ホギメディカル	10,700.0	3,255.00	34,828,500	貸付株式数 4,200株
クラウディアHLDGS	1,300.0	554.00	720,200	貸付株式数 500株
TSIホールディングス	26,900.0	825.00	22,192,500	貸付株式数 10,500株
マツオカコーポレーション	1,400.0	1,627.00	2,277,800	
ワールド	10,400.0	1,713.00	17,815,200	
TIS	87,700.0	3,453.00	302,828,100	
JNSホールディングス	2,400.0	443.00	1,063,200	貸付株式数 1,000株
グリー	21,400.0	586.00	12,540,400	
GMOベパボ	1,000.0	1,360.00	1,360,000	貸付株式数 400株
コーエーテクモHD	50,200.0	2,226.50	111,770,300	貸付株式数 16,700株
三菱総合研究所	4,000.0	5,070.00	20,280,000	
ボルテージ	1,500.0	288.00	432,000	貸付株式数 800株
電算	600.0	1,589.00	953,400	貸付株式数 200株
AGS	2,200.0	740.00	1,628,000	貸付株式数 800株
ファインデックス	6,300.0	736.00	4,636,800	
ブレインパッド	6,000.0	879.00	5,274,000	貸付株式数 2,400株
KLab	14,700.0	282.00	4,145,400	貸付株式数 5,700株
ポルトゥウィンホールディング	13,800.0	573.00	7,907,400	
ネクソン	178,800.0	2,916.00	521,380,800	
アイスタイル	23,700.0	488.00	11,565,600	貸付株式数 9,400株 (4,200株)
エムアップホールディングス	9,800.0	1,224.00	11,995,200	
エイチーム	4,600.0	607.00	2,792,200	
エニグモ	10,400.0	381.00	3,962,400	貸付株式数 4,000株
テクノスジャパン	4,500.0	720.00	3,240,000	
enish	4,200.0	232.00	974,400	貸付株式数 1,700株
コロプラ	31,100.0	661.00	20,557,100	
オルトプラス	4,400.0	217.00	954,800	貸付株式数 2,100株
ブロードリーフ	38,000.0	510.00	19,380,000	

クロス・マーケティングG	3,300.0	722.00	2,382,600	貸付株式数	1,400株
デジタルハーツHLDGS	5,000.0	1,068.00	5,340,000		
システム情報	6,300.0	760.00	4,788,000	貸付株式数	2,500株
メディアドゥ	3,100.0	1,168.00	3,620,800		
じげん	23,500.0	556.00	13,066,000	貸付株式数	2,900株
ブイキューブ	9,500.0	408.00	3,876,000	貸付株式数	3,800株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジー	1,200.0	513.00	615,600	貸付株式数	600株
サイバーリンクス	2,000.0	807.00	1,614,000	貸付株式数	1,000株
ディー・エル・イー	4,300.0	253.00	1,087,900		
フィックスターズ	9,000.0	1,200.00	10,800,000		
CARTAHOLDINGS	3,700.0	1,262.00	4,669,400	貸付株式数	1,400株
オプティム	6,600.0	853.00	5,629,800		
セレス	3,300.0	969.00	3,197,700	貸付株式数	1,200株
SHIFT	5,300.0	27,025.00	143,232,500		
特種東海製紙	3,600.0	3,550.00	12,780,000	貸付株式数	600株
ティーガイア	8,500.0	1,817.00	15,444,500		
セック	700.0	3,490.00	2,443,000		
テクマトリックス	14,600.0	1,562.00	22,805,200		
プロシップ	3,500.0	1,288.00	4,508,000	貸付株式数	1,200株
ガンホー・オンライン・エンター	20,900.0	2,387.00	49,888,300		
GMOペイメントゲートウェイ	16,000.0	8,427.00	134,832,000		
ザッパラス	1,400.0	477.00	667,800	貸付株式数	700株
システムリサーチ	2,500.0	2,696.00	6,740,000	貸付株式数	900株
インターネットイニシアティブ	43,700.0	2,444.50	106,824,650		
さくらインターネット	9,000.0	1,309.00	11,781,000	貸付株式数	3,600株
ヴィンクス	1,300.0	1,303.00	1,693,900		
GMOグローバルサインHD	2,400.0	2,791.00	6,698,400	貸付株式数	900株
SRAホールディングス	4,100.0	3,635.00	14,903,500		
システムインテグレータ	1,500.0	428.00	642,000		
朝日ネット	8,400.0	639.00	5,367,600		
eBASE	11,300.0	681.00	7,695,300		
アバントグループ	10,100.0	1,322.00	13,352,200		
アドソル日進	3,300.0	1,748.00	5,768,400		
ODKソリューションズ	1,100.0	604.00	664,400	貸付株式数	600株

フリービット	4,200.0	1,251.00	5,254,200	
コムチュア	10,600.0	2,428.00	25,736,800	
サイバーコム	800.0	1,343.00	1,074,400	貸付株式数 400株
アステリア	6,200.0	754.00	4,674,800	貸付株式数 1,900株
アイル	3,700.0	3,655.00	13,523,500	
王子ホールディングス	333,700.0	677.60	226,115,120	
日本製紙	41,700.0	1,424.00	59,380,800	
三菱製紙	6,400.0	578.00	3,699,200	貸付株式数 2,500株
北越コーポレーション	50,600.0	1,073.00	54,293,800	貸付株式数 20,200株
中越パルプ	2,200.0	1,517.00	3,337,400	貸付株式数 300株
巴川製紙	1,700.0	681.00	1,157,700	貸付株式数 700株
大王製紙	35,300.0	1,309.50	46,225,350	
阿波製紙	1,300.0	527.00	685,100	貸付株式数 600株
マークラインズ	4,400.0	3,045.00	13,398,000	
メディカル・データ・ビジ	9,500.0	809.00	7,685,500	貸付株式数 4,400株
g u m i	11,800.0	523.00	6,171,400	貸付株式数 4,700株
ショーケース	1,200.0	372.00	446,400	貸付株式数 500株
モバイルファクトリー	1,100.0	803.00	883,300	貸付株式数 500株
テラスカイ	3,500.0	2,021.00	7,073,500	貸付株式数 1,200株
デジタル・インフォメー ション	4,600.0	1,810.00	8,326,000	
P C Iホールディングス	2,000.0	1,100.00	2,200,000	貸付株式数 200株
アイビーシー	800.0	605.00	484,000	貸付株式数 400株
ネオジャパン	2,700.0	1,020.00	2,754,000	貸付株式数 1,000株
P R T I M E S	2,000.0	1,790.00	3,580,000	貸付株式数 400株
ラクス	37,900.0	2,203.50	83,512,650	
ランドコンピュータ	1,300.0	1,228.00	1,596,400	
ダブルスタンダード	3,300.0	1,421.00	4,689,300	貸付株式数 1,200株
オープンドア	5,600.0	1,022.00	5,723,200	貸付株式数 2,200株
マイネット	1,700.0	355.00	603,500	貸付株式数 600株
アカツキ	3,800.0	2,317.00	8,804,600	
ベネフィットジャパン	300.0	1,224.00	367,200	貸付株式数 200株
U B I C O Mホールディン グス	2,500.0	1,297.00	3,242,500	貸付株式数 1,000株
カナミックネットワーク	8,600.0	507.00	4,360,200	
ノムラシステムコーポレー ション	5,700.0	117.00	666,900	貸付株式数 2,900株
レンゴー	72,900.0	1,055.50	76,945,950	
トーモク	4,600.0	2,536.00	11,665,600	
ザ・パック	6,000.0	3,285.00	19,710,000	

チェンジホールディングス	19,600.0	1,898.00	37,200,800	
シンクロ・フード	3,300.0	614.00	2,026,200	貸付株式数 1,300株
オークネット	3,100.0	1,806.00	5,598,600	貸付株式数 1,500株
キャピタル・アセット・プラン	1,000.0	888.00	888,000	貸付株式数 500株
セグエグループ	1,700.0	959.00	1,630,300	貸付株式数 700株
エイトレッド	800.0	1,473.00	1,178,400	貸付株式数 400株
マクロミル	15,900.0	779.00	12,386,100	
ビーグリー	1,100.0	1,111.00	1,222,100	
オロ	2,900.0	1,926.00	5,585,400	
ユーザーローカル	2,900.0	1,841.00	5,338,900	貸付株式数 1,100株
テモナ	1,200.0	299.00	358,800	貸付株式数 500株
ニーズウェル	2,900.0	714.00	2,070,600	貸付株式数 1,200株
マネーフォワード	17,800.0	5,138.00	91,456,400	貸付株式数 6,700株
サインポスト	2,200.0	483.00	1,062,600	貸付株式数 800株
レゾナック・ホールディング	77,400.0	2,548.50	197,253,900	貸付株式数 30,900株
住友化学	594,000.0	434.00	257,796,000	
住友精化	3,400.0	4,810.00	16,354,000	
日産化学	37,800.0	6,686.00	252,730,800	
ラサ工業	3,100.0	2,120.00	6,572,000	
クレハ	6,400.0	8,710.00	55,744,000	
多木化学	3,100.0	3,805.00	11,795,500	貸付株式数 1,200株
テイカ	5,400.0	1,410.00	7,614,000	
石原産業	14,500.0	1,561.00	22,634,500	
片倉コープアグリ	1,100.0	1,202.00	1,322,200	貸付株式数 400株
日本曹達	8,600.0	5,760.00	49,536,000	
東ソー	106,900.0	2,028.00	216,793,200	
トクヤマ	25,900.0	2,494.50	64,607,550	
セントラル硝子	12,900.0	3,125.00	40,312,500	
東亜合成	40,200.0	1,388.00	55,797,600	
大阪ソーダ	4,800.0	6,560.00	31,488,000	貸付株式数 500株
関東電化	15,500.0	912.00	14,136,000	
SUN A S T E R I S K	5,700.0	1,422.00	8,105,400	
デンカ	29,100.0	2,893.00	84,186,300	
イビデン	46,300.0	8,040.00	372,252,000	
信越化学	665,600.0	4,647.00	3,093,043,200	
日本カ-パイド	2,000.0	1,784.00	3,568,000	
電算システムHD	3,500.0	3,010.00	10,535,000	
堺 化 学	6,100.0	2,148.00	13,102,800	



第一稀元素化学工	7,300.0	980.00	7,154,000	貸付株式数	800株
エア・ウォーター	75,600.0	1,905.50	144,055,800		
日本酸素HLDGS	77,700.0	3,608.00	280,341,600		
日本化学工業	2,700.0	1,995.00	5,386,500		
東邦アセチレン	1,100.0	1,634.00	1,797,400		
日本パ・ライジング	39,700.0	1,184.00	47,004,800	貸付株式数	1,900株
高圧ガス	11,700.0	789.00	9,231,300		
チタン工業	600.0	1,413.00	847,800	貸付株式数	200株
四国化成ホールディング	10,200.0	1,527.00	15,575,400		
戸田工業	1,800.0	2,023.00	3,641,400	貸付株式数	700株
ステラ ケミファ	4,700.0	3,220.00	15,134,000		
保土谷化学	2,300.0	3,270.00	7,521,000		
日本触媒	12,200.0	5,670.00	69,174,000		
大日精化	5,600.0	2,411.00	13,501,600		
カネカ	18,300.0	4,222.00	77,262,600		
協和キリン	96,800.0	2,702.00	261,553,600		
APPIER GROUP	27,400.0	1,705.00	46,717,000		
三菱瓦斯化学	59,800.0	2,150.00	128,570,000		
三井化学	66,000.0	3,959.00	261,294,000		
JSR	74,700.0	4,048.00	302,385,600		
東京応化工業	12,700.0	9,173.00	116,497,100		
大阪有機化学	6,700.0	2,567.00	17,198,900		
三菱ケミカルグループ	540,400.0	980.80	530,024,320		
KHネオケム	12,200.0	2,403.00	29,316,600		
ダイセル	111,600.0	1,322.50	147,591,000		
住友ベークライト	11,900.0	6,526.00	77,659,400		
積水化学	162,200.0	2,271.50	368,437,300		
日本ゼオン	48,000.0	1,723.50	82,728,000		
アイカ工業	20,100.0	3,455.00	69,445,500		
UBE	41,300.0	2,694.50	111,282,850		
積水樹脂	11,000.0	2,369.00	26,059,000		
タキロンシーアイ	17,100.0	589.00	10,071,900		
旭有機材	5,300.0	3,845.00	20,378,500		
ニチパン	4,900.0	1,918.00	9,398,200		
リケンテクノス	17,300.0	758.00	13,113,400		
大倉工業	3,700.0	2,638.00	9,760,600	貸付株式数	1,300株
積水化成品	11,300.0	488.00	5,514,400		
群栄化学	1,900.0	3,490.00	6,631,000		
タイガース ポリマー	2,400.0	775.00	1,860,000		
ミライアル	1,600.0	1,397.00	2,235,200	貸付株式数	600株

ダイキアクシス	2,200.0	737.00	1,621,400	貸付株式数	700株
ダイキョーニシカワ	17,700.0	865.00	15,310,500		
竹本容器	2,000.0	815.00	1,630,000		
森六ホールディングス	4,100.0	2,408.00	9,872,800		
恵和	5,800.0	1,299.00	7,534,200	貸付株式数	2,300株
日本化薬	61,200.0	1,308.50	80,080,200		
カーリットホールディングス	7,200.0	997.00	7,178,400	貸付株式数	100株
ソルクシーズ	4,200.0	425.00	1,785,000		
CLホールディングス	2,100.0	833.00	1,749,300	貸付株式数	800株
プレステージ・インター	34,900.0	632.00	22,056,800		
フェイス	1,500.0	501.00	751,500	貸付株式数	300株
プロトコーポレーション	10,000.0	1,223.00	12,230,000		
ハイマックス	2,500.0	1,453.00	3,632,500		
アミューズ	4,400.0	1,621.00	7,132,400		
野村総合研究所	159,700.0	4,274.00	682,557,800		
ドリームインキュベータ	2,500.0	3,020.00	7,550,000	貸付株式数	900株
サイバネットシステム	5,700.0	762.00	4,343,400		
クイック	6,300.0	2,142.00	13,494,600	貸付株式数	2,000株
TAC	2,600.0	201.00	522,600	貸付株式数	1,000株
CEホールディングス	2,700.0	585.00	1,579,500		
日本システム技術	2,200.0	2,233.00	4,912,600		
電通グループ	80,800.0	4,418.00	356,974,400		
インテージホールディングス	9,100.0	2,195.00	19,974,500		
テイクアンドギヴニーズ	2,100.0	1,000.00	2,100,000		
東邦システムサイエンス	2,100.0	1,388.00	2,914,800		
ぴあ	2,700.0	3,875.00	10,462,500	貸付株式数	1,000株
イオンファンタジー	3,500.0	3,180.00	11,130,000	貸付株式数	1,400株
ソースネクスト	40,600.0	192.00	7,795,200	貸付株式数	16,200株
シーティーエス	9,300.0	698.00	6,491,400		
ネクシーズグループ	1,800.0	815.00	1,467,000	貸付株式数	600株
インフォコム	10,300.0	2,872.00	29,581,600		
メディカルシステムネットワーク	7,500.0	403.00	3,022,500		
日本精化	4,600.0	2,594.00	11,932,400	貸付株式数	1,600株
扶桑化学工業	7,400.0	3,990.00	29,526,000		
トリケミカル	10,700.0	3,070.00	32,849,000	貸付株式数	4,100株
シンプレクスHD	13,700.0	2,748.00	37,647,600		
HEROZ	2,700.0	1,522.00	4,109,400	貸付株式数	1,000株

ラクスル	19,300.0	1,398.00	26,981,400	貸付株式数	7,600株
メルカリ	48,500.0	3,186.00	154,521,000	貸付株式数	18,800株
I P S	2,600.0	2,479.00	6,445,400	貸付株式数	1,000株
F I G	6,100.0	307.00	1,872,700	貸付株式数	2,800株
システムサポート	3,100.0	2,169.00	6,723,900	貸付株式数	1,100株
A D E K A	27,900.0	2,786.00	77,729,400		
日油	24,800.0	6,577.00	163,109,600		
ミヨシ油脂	2,000.0	1,195.00	2,390,000		
新日本理化	7,200.0	233.00	1,677,600	貸付株式数	2,800株
ハリマ化成グループ	3,800.0	867.00	3,294,600		
イーソル	5,800.0	756.00	4,384,800	貸付株式数	2,200株
東海ソフト	800.0	1,093.00	874,400		
ウイングアーク1ST	8,300.0	2,614.00	21,696,200		
ヒト・コミュニケーションズHD	2,200.0	1,400.00	3,080,000	貸付株式数	800株
サーバーワークス	1,600.0	3,740.00	5,984,000	貸付株式数	300株
東名	400.0	2,419.00	967,600	貸付株式数	100株
ヴィッツ	500.0	1,153.00	576,500	貸付株式数	200株
トビラシステムズ	1,500.0	970.00	1,455,000	貸付株式数	100株
S a n s a n	26,200.0	1,331.50	34,885,300		
L i n k - U	1,200.0	862.00	1,034,400	貸付株式数	500株
ギフトィ	7,000.0	1,463.00	10,241,000	貸付株式数	3,000株
花 王	181,100.0	5,623.00	1,018,325,300		
第一工業製薬	2,900.0	1,755.00	5,089,500		
石原ケミカル	3,600.0	1,711.00	6,159,600	貸付株式数	1,400株
日華化学	2,100.0	905.00	1,900,500	貸付株式数	900株
ニイタカ	1,000.0	2,005.00	2,005,000	貸付株式数	500株
三洋化成	4,900.0	4,200.00	20,580,000		
メドレー	10,800.0	4,950.00	53,460,000		
ベース	2,700.0	4,515.00	12,190,500	貸付株式数	1,000株
J M D C	13,300.0	5,480.00	72,884,000		
武田薬品	709,500.0	4,829.00	3,426,175,500		
アステラス製薬	757,300.0	2,198.00	1,664,545,400		
住友ファーマ	59,500.0	552.50	32,873,750		
塩野義製薬	101,100.0	6,744.00	681,818,400		
わかもと製薬	4,900.0	229.00	1,122,100		
日本新薬	18,900.0	6,647.00	125,628,300		
中外製薬	251,000.0	4,458.00	1,118,958,000		
科研製薬	13,700.0	3,616.00	49,539,200		
エーザイ	97,500.0	8,934.00	871,065,000		

理研ビタミン	6,800.0	2,328.00	15,830,400	
ロート製薬	77,700.0	4,093.00	318,026,100	
小野薬品	154,700.0	2,926.50	452,729,550	
久光製薬	17,800.0	5,332.00	94,909,600	貸付株式数 4,500株
有機合成薬品	3,800.0	298.00	1,132,400	貸付株式数 600株
持田製薬	9,200.0	3,435.00	31,602,000	
参天製薬	146,100.0	1,431.00	209,069,100	
扶桑薬品	2,500.0	2,041.00	5,102,500	
日本ケミファ	500.0	1,920.00	960,000	貸付株式数 200株
ツムラ	25,200.0	2,783.00	70,131,600	
テルモ	245,900.0	4,325.00	1,063,517,500	
HUグループHD	24,000.0	2,640.00	63,360,000	
キッセイ薬品工業	11,800.0	3,460.00	40,828,000	
生化学工業	15,300.0	832.00	12,729,600	
栄研化学	13,000.0	1,426.00	18,538,000	
鳥居薬品	4,300.0	3,860.00	16,598,000	
JCRファーマ	27,100.0	1,452.00	39,349,200	貸付株式数 9,900株
東和薬品	12,300.0	2,894.00	35,596,200	
富士製薬工業	5,900.0	1,219.00	7,192,100	
ゼリア新薬工業	11,100.0	2,372.00	26,329,200	
そーせいグループ	25,800.0	1,606.00	41,434,800	貸付株式数 10,000株
第一三共	698,400.0	4,055.00	2,832,012,000	
杏林製薬	17,400.0	1,834.00	31,911,600	
大幸薬品	15,900.0	355.00	5,644,500	貸付株式数 6,300株
ダイト	6,000.0	2,424.00	14,544,000	
大塚ホールディングス	166,800.0	5,570.00	929,076,000	
大正製薬HD	17,800.0	6,233.00	110,947,400	
ペプチドリーム	38,900.0	1,657.00	64,457,300	貸付株式数 13,400株
大日本塗料	9,800.0	1,001.00	9,809,800	貸付株式数 2,300株
日本ペイントHOLD	425,200.0	1,116.50	474,735,800	
関西ペイント	64,200.0	2,218.00	142,395,600	
神東塗料	4,300.0	134.00	576,200	貸付株式数 1,800株
中国塗料	13,200.0	1,440.00	19,008,000	
日本特殊塗料	3,400.0	1,467.00	4,987,800	
藤倉化成	10,800.0	500.00	5,400,000	
太陽ホールディングス	12,200.0	2,631.00	32,098,200	貸付株式数 2,000株
DIC	31,400.0	2,512.00	78,876,800	貸付株式数 12,500株
サカタインクス	17,800.0	1,391.00	24,759,800	貸付株式数 4,700株
東洋インキSCホールディングン	17,500.0	2,417.00	42,297,500	

T & K T O K A	7,200.0	1,430.00	10,296,000	
アルプス技研	7,900.0	2,640.00	20,856,000	
サニックス	13,300.0	336.00	4,468,800	
日本空調サービス	9,400.0	805.00	7,567,000	
オリエンタルランド	434,800.0	5,101.00	2,217,914,800	
フォーカスシステムズ	5,800.0	992.00	5,753,600	
ダスキン	18,200.0	3,372.00	61,370,400	
パーク24	51,100.0	2,022.50	103,349,750	
明光ネットワークジャパン	9,700.0	648.00	6,285,600	貸付株式数 3,800株
ファルコホールディングス	3,700.0	1,991.00	7,366,700	貸付株式数 400株
クレスコ	6,200.0	1,871.00	11,600,200	
フジ・メディア・HD	77,100.0	1,621.00	124,979,100	貸付株式数 10,100株
秀英予備校	1,200.0	408.00	489,600	貸付株式数 500株
田谷	900.0	479.00	431,100	
ラウンドワン	68,600.0	585.00	40,131,000	貸付株式数 26,700株
リゾートトラスト	32,500.0	2,328.50	75,676,250	
オービック	26,800.0	24,100.00	645,880,000	
ジャストシステム	11,500.0	2,919.50	33,574,250	
TDCソフト	6,700.0	1,785.00	11,959,500	
Zホールディングス	1,140,700.0	440.70	502,706,490	
ビー・エム・エル	10,200.0	2,862.00	29,192,400	
トレンドマイクロ	37,900.0	5,894.00	223,382,600	
IDホールディングス	5,400.0	1,415.00	7,641,000	
リソー教育	37,100.0	246.00	9,126,600	
日本オラクル	15,300.0	9,855.00	150,781,500	
早稲田アカデミー	4,400.0	1,514.00	6,661,600	貸付株式数 1,700株
アルファシステムズ	2,500.0	2,975.00	7,437,500	貸付株式数 900株
フューチャー	17,100.0	1,471.00	25,154,100	
CAC HOLDINGS	4,300.0	1,786.00	7,679,800	
S Bテクノロジー	3,400.0	2,300.00	7,820,000	
トーセ	1,500.0	737.00	1,105,500	貸付株式数 100株
ユー・エス・エス	84,600.0	2,501.00	211,584,600	
オービックビジネスC	15,800.0	5,970.00	94,326,000	
アイティフォー	10,500.0	1,109.00	11,644,500	
東京個別指導学院	9,500.0	490.00	4,655,000	貸付株式数 3,100株
東計電算	1,100.0	6,530.00	7,183,000	貸付株式数 300株
サイバーエージェント	181,500.0	828.60	150,390,900	
楽天グループ	703,200.0	620.10	436,054,320	貸付株式数 281,200株
エクスネット	700.0	1,092.00	764,400	貸付株式数 300株

クリーク・アンド・リバー社	4,900.0	2,196.00	10,760,400	
SBIグローバルアセット	13,800.0	574.00	7,921,200	
テー・オー・ダブリュー	17,400.0	313.00	5,446,200	
大塚商会	39,800.0	6,157.00	245,048,600	貸付株式数 3,600株
サイボウズ	11,000.0	2,048.00	22,528,000	
山田コンサルティングG P	4,200.0	1,665.00	6,993,000	
セントラルスポーツ	3,000.0	2,475.00	7,425,000	貸付株式数 1,100株
バラカ	2,700.0	2,095.00	5,656,500	
電通国際情報S	9,700.0	5,630.00	54,611,000	
A C C E S S	9,400.0	807.00	7,585,800	
デジタルガレージ	14,200.0	3,745.00	53,179,000	
イーエムシステムズ	13,300.0	750.00	9,975,000	
ウェザーニューズ	2,500.0	6,430.00	16,075,000	貸付株式数 100株
C I J	13,200.0	563.00	7,431,600	貸付株式数 100株
ビジネスエンジニアリング	1,100.0	3,530.00	3,883,000	
日本エンタープライズ	5,400.0	132.00	712,800	貸付株式数 2,100株
WOWOW	6,000.0	1,159.00	6,954,000	貸付株式数 2,300株
スカラ	7,300.0	778.00	5,679,400	
インテリジェント ウェイブ	2,800.0	881.00	2,466,800	
フルキャストホールディングス	7,900.0	1,981.00	15,649,900	
エン・ジャパン	14,900.0	2,439.00	36,341,100	貸付株式数 5,700株
あすか製薬HD	8,200.0	1,659.00	13,603,800	
サイワグループHD	18,300.0	4,601.00	84,198,300	
富士フイルムHLDGS	153,800.0	9,113.00	1,401,579,400	
コニカミノルタ	180,300.0	501.30	90,384,390	
資生堂	167,400.0	5,702.00	954,514,800	
ライオン	104,900.0	1,471.00	154,307,900	貸付株式数 40,800株
高砂香料	5,400.0	3,045.00	16,443,000	
マンダム	17,300.0	1,437.00	24,860,100	
ミルボン	10,900.0	4,715.00	51,393,500	貸付株式数 4,300株
ファンケル	35,100.0	2,436.00	85,503,600	
コーセー	16,300.0	11,920.00	194,296,000	
コタ	7,300.0	1,630.00	11,899,000	
シーボン	700.0	1,546.00	1,082,200	
ポーラ・オルビスHD	41,100.0	1,816.50	74,658,150	
ノエビアホールディングス	7,100.0	5,700.00	40,470,000	
アジュバンホールディング	1,300.0	943.00	1,225,900	

新日本製薬	4,600.0	1,583.00	7,281,800	貸付株式数	1,800株
アクシージア	4,100.0	1,192.00	4,887,200		
エステー	6,100.0	1,537.00	9,375,700		
アグロカネショウ	3,200.0	1,425.00	4,560,000	貸付株式数	300株 (300株)
コニシ	13,400.0	2,642.00	35,402,800	貸付株式数	800株
長谷川香料	15,300.0	3,435.00	52,555,500		
星光PMC	3,200.0	1,067.00	3,414,400		
小林製薬	23,300.0	6,946.00	161,841,800		
荒川化学工業	6,800.0	1,075.00	7,310,000		
メック	6,600.0	3,770.00	24,882,000	貸付株式数	2,500株
日本高純度化学	2,000.0	2,611.00	5,222,000		
タカラバイオ	21,600.0	1,418.00	30,628,800		
JCU	9,000.0	3,260.00	29,340,000		
新田ゼラチン	3,300.0	718.00	2,369,400	貸付株式数	1,500株
OATアグリオ	2,000.0	1,820.00	3,640,000		
デクセリアルズ	21,900.0	3,734.00	81,774,600		
アース製薬	7,300.0	4,935.00	36,025,500	貸付株式数	2,600株
北興化学	8,100.0	971.00	7,865,100		
大成ラミック	2,500.0	3,220.00	8,050,000		
クミアイ化学	31,900.0	1,133.00	36,142,700		
日本農薬	14,700.0	695.00	10,216,500		
富士興産	1,300.0	1,947.00	2,531,100		
ニチレキ	9,500.0	2,059.00	19,560,500		
ユシロ化学	4,200.0	1,716.00	7,207,200		
ビーピー・カストロール	2,000.0	918.00	1,836,000		
富士石油	16,300.0	381.00	6,210,300	貸付株式数	6,000株
MORESCO	1,700.0	1,212.00	2,060,400	貸付株式数	200株
出光興産	89,100.0	3,655.00	325,660,500		
ENEOSホールディングス	1,360,200.0	637.60	867,263,520		
コスモエネルギーHLDGS	31,700.0	5,830.00	184,811,000		
テスホールディングス	16,900.0	505.00	8,534,500		
インフロンニアHD	81,800.0	1,623.00	132,761,400		
横浜ゴム	40,600.0	3,303.00	134,101,800		
TOYO TIRE	46,100.0	2,415.50	111,354,550		
ブリヂストン	234,700.0	6,111.00	1,434,251,700		
住友ゴム	78,600.0	1,707.50	134,209,500	貸付株式数	30,600株
藤倉コンポジット	3,800.0	1,194.00	4,537,200		

オカモト	4,300.0	5,070.00	21,801,000	
アキレス	5,000.0	1,510.00	7,550,000	貸付株式数 1,100株
フコク	4,200.0	1,540.00	6,468,000	
ニッタ	8,200.0	3,530.00	28,946,000	
クリエートメディック	1,700.0	928.00	1,577,600	
住友理工	15,600.0	1,183.00	18,454,800	
三ツ星ベルト	11,700.0	5,000.00	58,500,000	貸付株式数 3,600株
バンドー化学	11,900.0	1,719.00	20,456,100	
A G C	74,800.0	5,380.00	402,424,000	
日本板硝子	40,900.0	834.00	34,110,600	
石塚硝子	800.0	2,742.00	2,193,600	貸付株式数 500株
有沢製作所	13,000.0	1,079.00	14,027,000	貸付株式数 4,700株
日本山村硝子	2,000.0	1,779.00	3,558,000	
日本電気硝子	32,800.0	2,699.50	88,543,600	
オハラ	3,800.0	1,259.00	4,784,200	貸付株式数 1,500株
住友大阪セメント	11,300.0	3,911.00	44,194,300	
太平洋セメント	51,100.0	2,833.50	144,791,850	
リソルホールディングス	500.0	4,860.00	2,430,000	貸付株式数 200株
日本ヒユ-ム	7,100.0	903.00	6,411,300	貸付株式数 2,700株
日本コンクリ-ト	15,700.0	347.00	5,447,900	
三谷セキサン	3,400.0	5,140.00	17,476,000	
アジアパイルHD	12,600.0	697.00	8,782,200	
東海カーボン	74,000.0	1,219.00	90,206,000	
日本カーボン	4,300.0	4,595.00	19,758,500	
東洋炭素	5,700.0	5,690.00	32,433,000	貸付株式数 1,800株
ノリタケ	4,000.0	6,570.00	26,280,000	
TOTO	52,800.0	3,965.00	209,352,000	
日本碍子	93,200.0	2,033.50	189,522,200	
日本特殊陶業	61,000.0	3,587.00	218,807,000	
ダントーホールディングス	3,500.0	852.00	2,982,000	貸付株式数 2,000株
MARUWA	3,000.0	24,140.00	72,420,000	
品川リフラクトリーズ	2,300.0	8,470.00	19,481,000	
黒崎播磨	1,600.0	10,220.00	16,352,000	
ヨータイ	4,300.0	1,553.00	6,677,900	
東京窯業	5,000.0	350.00	1,750,000	貸付株式数 1,900株
ニッカトー	2,400.0	641.00	1,538,400	
フジインコーポレーテッド	19,200.0	3,115.00	59,808,000	
クニミネ工業	1,600.0	1,088.00	1,740,800	貸付株式数 900株
エーアンドエーマテリアル	1,000.0	1,200.00	1,200,000	



ニチアス	20,100.0	3,120.00	62,712,000	
日本製鉄	369,300.0	3,750.00	1,384,875,000	
神戸製鋼所	165,900.0	2,160.00	358,344,000	
中山製鋼所	17,000.0	988.00	16,796,000	貸付株式数 6,400株
合同製鐵	4,100.0	5,130.00	21,033,000	
J F Eホールディングス	220,400.0	2,314.50	510,115,800	貸付株式数 88,100株
東京製鐵	23,200.0	1,805.00	41,876,000	
共英製鋼	9,400.0	2,206.00	20,736,400	
大和工業	13,600.0	7,456.00	101,401,600	
東京鐵鋼	3,900.0	3,955.00	15,424,500	貸付株式数 1,100株
大阪製鐵	3,800.0	1,888.00	7,174,400	貸付株式数 400株
淀川製鋼所	9,400.0	3,945.00	37,083,000	貸付株式数 3,700株
中部鋼鈹	6,800.0	2,255.00	15,334,000	
丸一鋼管	25,100.0	3,803.00	95,455,300	
モリ工業	1,300.0	4,105.00	5,336,500	
大同特殊鋼	10,400.0	6,463.00	67,215,200	
日本高周波	1,800.0	700.00	1,260,000	貸付株式数 900株
日本冶金工	6,000.0	5,080.00	30,480,000	
山陽特殊製鋼	8,100.0	3,085.00	24,988,500	
愛知製鋼	4,800.0	4,375.00	21,000,000	
日本金属	1,200.0	934.00	1,120,800	貸付株式数 400株
大平洋金属	5,800.0	1,502.00	8,711,600	貸付株式数 2,300株
新日本電工	40,900.0	305.00	12,474,500	貸付株式数 6,600株
栗本鉄工所	3,900.0	2,849.00	11,111,100	
虹 技	600.0	1,602.00	961,200	
日本鑄鉄管	500.0	1,206.00	603,000	貸付株式数 100株
日本製鋼所	22,200.0	3,031.00	67,288,200	
三菱製鋼	5,200.0	1,627.00	8,460,400	
日亜鋼業	5,400.0	316.00	1,706,400	
日本精線	1,100.0	4,990.00	5,489,000	貸付株式数 100株
エンビプロHD	3,900.0	640.00	2,496,000	貸付株式数 1,600株
大紀アルミニウム	11,700.0	1,525.00	17,842,500	
日本軽金属HD	22,200.0	1,797.00	39,893,400	
三井金属	24,000.0	4,069.00	97,656,000	
東邦亜鉛	4,900.0	1,744.00	8,545,600	
三菱マテリアル	55,100.0	2,632.00	145,023,200	
住友鉱山	95,600.0	4,748.00	453,908,800	
D O W Aホールディングス	18,500.0	4,996.00	92,426,000	貸付株式数 2,200株
古河機金	12,100.0	1,813.00	21,937,300	
エス・サイエンス	32,200.0	23.00	740,600	貸付株式数 15,200株

大阪チタニウム	12,100.0	3,245.00	39,264,500	貸付株式数	4,100株
東邦チタニウム	14,900.0	1,950.00	29,055,000	貸付株式数	5,900株
U A C J	11,600.0	3,350.00	38,860,000		
C K サンエツ	2,000.0	3,805.00	7,610,000	貸付株式数	100株
古河電工	27,500.0	2,623.00	72,132,500		
住友電工	284,800.0	1,865.00	531,152,000		
フジクラ	88,500.0	1,249.50	110,580,750		
S W C C	9,200.0	2,187.00	20,120,400		
タツタ電線	16,800.0	701.00	11,776,800	貸付株式数	900株
カナレ電気	900.0	1,467.00	1,320,300	貸付株式数	300株
平河ビューテック	4,700.0	1,466.00	6,890,200	貸付株式数	1,600株
いよぎんホールディング	93,700.0	1,120.50	104,990,850		
しずおかフィナンシャル	175,000.0	1,275.50	223,212,500		
ちゅうぎんフィナンシャ	66,400.0	1,166.00	77,422,400		
楽天銀行	27,300.0	2,151.00	58,722,300	貸付株式数	10,900株
リョービ	8,800.0	3,280.00	28,864,000	貸付株式数	3,000株
アールステイ	6,100.0	907.00	5,532,700		
A R E ホールディングス	33,400.0	1,957.00	65,363,800		
東洋製罐グループHD	49,200.0	2,802.00	137,858,400		
ホッカンホールディングス	4,400.0	1,598.00	7,031,200		
コロナ	4,500.0	944.00	4,248,000		
横河ブリッジH L D G S	10,400.0	2,884.00	29,993,600		
駒井ハルテック	900.0	1,927.00	1,734,300		
高田機工	500.0	3,355.00	1,677,500		
三和ホールディングス	75,700.0	2,126.00	160,938,200		
文化シヤッタ -	23,200.0	1,157.00	26,842,400	貸付株式数	400株
三協立山	9,300.0	947.00	8,807,100	貸付株式数	3,500株
アルインコ	6,100.0	1,092.00	6,661,200	貸付株式数	1,600株
東洋シヤッタ -	1,200.0	654.00	784,800	貸付株式数	300株
L I X I L	120,000.0	1,838.00	220,560,000	貸付株式数	29,900株
日本ファイルコン	3,500.0	488.00	1,708,000		
ノーリツ	13,300.0	1,619.00	21,532,700		
長府製作所	8,100.0	2,126.00	17,220,600		
リンナイ	44,700.0	2,831.50	126,568,050		
ユニプレス	14,300.0	1,288.00	18,418,400	貸付株式数	1,500株
ダイニチ工業	2,700.0	745.00	2,011,500		
日東精工	12,000.0	567.00	6,804,000		
三洋工業	600.0	2,167.00	1,300,200		
岡 部	14,400.0	760.00	10,944,000		

ジーテクト	9,200.0	1,918.00	17,645,600	
東 プ レ	14,500.0	1,847.00	26,781,500	
高周波熱錬	12,800.0	1,074.00	13,747,200	貸付株式数 2,600株
東京製綱	4,900.0	1,384.00	6,781,600	
サンコール	4,800.0	510.00	2,448,000	
モリテックスチル	4,000.0	320.00	1,280,000	貸付株式数 2,300株
パイオラックス	11,400.0	2,469.00	28,146,600	
エイチワン	8,400.0	888.00	7,459,200	
日本発条	73,000.0	1,183.50	86,395,500	
中央発條	6,100.0	769.00	4,690,900	
アドバネクス	700.0	1,099.00	769,300	貸付株式数 400株
三浦工業	33,700.0	3,231.00	108,884,700	
タ ク マ	24,600.0	1,615.00	39,729,000	
テクノプロ・ホールディング グ	48,700.0	3,234.00	157,495,800	貸付株式数 18,900株
アトラグループ	1,600.0	244.00	390,400	貸付株式数 600株
アイ・アールジャパンHD	4,300.0	2,400.00	10,320,000	貸付株式数 1,600株
K e e P e r 技研	5,100.0	5,830.00	29,733,000	
ファーストロジック	1,200.0	530.00	636,000	
三機サービス	800.0	1,077.00	861,600	貸付株式数 400株
G u n o s y	6,500.0	612.00	3,978,000	貸付株式数 1,600株
デザインワン・ジャパン	1,300.0	168.00	218,400	貸付株式数 500株
イー・ガーディアン	3,000.0	2,644.00	7,932,000	貸付株式数 1,100株
リブセンス	2,500.0	347.00	867,500	貸付株式数 1,000株
ジャパンマテリアル	25,100.0	2,355.00	59,110,500	
ベクトル	13,000.0	1,296.00	16,848,000	
ウチヤマホールディングス	2,300.0	374.00	860,200	貸付株式数 200株
チャームケアコーポレー ション	6,800.0	1,118.00	7,602,400	
キャリアリンク	3,000.0	2,498.00	7,494,000	貸付株式数 1,100株
I B J	6,200.0	622.00	3,856,400	貸付株式数 2,400株
アサンテ	4,300.0	1,644.00	7,069,200	貸付株式数 1,500株
バリューHR	7,100.0	1,274.00	9,045,400	貸付株式数 2,800株
M & A キャピタルパート ナー	6,600.0	2,794.00	18,440,400	貸付株式数 2,500株
ライドオンエクスプレスH D	3,000.0	1,004.00	3,012,000	貸付株式数 900株
E R I ホールディングス	1,400.0	2,319.00	3,246,600	
アピスト	900.0	3,570.00	3,213,000	貸付株式数 400株

シグマクシス・ホールディング	12,500.0	1,540.00	19,250,000	
ウィルグループ	7,000.0	1,118.00	7,826,000	
エスクローA J	6,700.0	146.00	978,200	貸付株式数 2,900株
メドピア	7,200.0	1,012.00	7,286,400	貸付株式数 2,700株
レアジョブ	1,000.0	1,031.00	1,031,000	貸付株式数 400株
リクルートホールディングス	608,400.0	5,062.00	3,079,720,800	
エラン	10,800.0	843.00	9,104,400	
ツガミ	17,900.0	1,221.00	21,855,900	
オークマ	8,100.0	7,103.00	57,534,300	
芝浦機械	8,100.0	4,170.00	33,777,000	
アマダ	128,900.0	1,620.50	208,882,450	
アイダエンジニア	16,600.0	1,036.00	17,197,600	
TAKISAWA	1,400.0	2,592.00	3,628,800	
FUJII	35,100.0	2,479.50	87,030,450	
牧野フライス	8,900.0	6,960.00	61,944,000	
オーエスジー	35,600.0	1,851.00	65,895,600	
ダイジェット	500.0	950.00	475,000	貸付株式数 200株
旭ダイヤモンド	22,500.0	930.00	20,925,000	
D M G 森精機	49,000.0	2,753.00	134,897,000	貸付株式数 19,500株
ソデイツク	19,700.0	769.00	15,149,300	貸付株式数 2,500株
ディスコ	38,900.0	26,340.00	1,024,626,000	
日東工器	3,900.0	2,060.00	8,034,000	
日進工具	6,700.0	1,089.00	7,296,300	
パンチ工業	4,800.0	460.00	2,208,000	貸付株式数 2,100株
富士ダイス	2,500.0	661.00	1,652,500	貸付株式数 1,100株
土木管理総合試験	3,200.0	342.00	1,094,400	貸付株式数 100株
日本郵政	988,900.0	1,267.00	1,252,936,300	
ベルシステム24HLDGS	11,200.0	1,640.00	18,368,000	
鎌倉新書	9,300.0	654.00	6,082,200	貸付株式数 3,600株 (1,300株)
S M N	1,300.0	415.00	539,500	貸付株式数 500株
一蔵	700.0	589.00	412,300	貸付株式数 200株
グローバルキッズCOMP	1,000.0	697.00	697,000	
エアトリ	6,000.0	2,167.00	13,002,000	貸付株式数 2,300株
アトラエ	4,900.0	1,111.00	5,443,900	
ストライク	3,500.0	3,440.00	12,040,000	貸付株式数 1,300株
ソラスト	22,500.0	636.00	14,310,000	

セラク	2,500.0	1,299.00	3,247,500	貸付株式数	900株
インソース	17,900.0	1,017.00	18,204,300	貸付株式数	6,900株
豊田自動織機	58,400.0	12,595.00	735,548,000		
豊和工業	2,900.0	805.00	2,334,500	貸付株式数	1,100株
石川製作所	1,300.0	1,282.00	1,666,600	貸付株式数	100株
東洋機械金属	3,700.0	736.00	2,723,200		
津田駒工業	1,000.0	437.00	437,000	貸付株式数	400株
エンシュウ	1,100.0	815.00	896,500	貸付株式数	400株
島精機製作所	12,800.0	1,945.00	24,896,000		
オプトラン	13,300.0	1,861.00	24,751,300		
NCホールディングス	1,100.0	1,645.00	1,809,500		
イワキポンプ	5,400.0	1,970.00	10,638,000		
フリーー	8,400.0	1,687.00	14,170,800		
ヤマシンフィルタ	19,300.0	359.00	6,928,700	貸付株式数	200株
日阪製作所	7,800.0	1,006.00	7,846,800		
やまびこ	13,200.0	1,527.00	20,156,400		
野村マイクロ・サイエンス	2,700.0	6,150.00	16,605,000		
平田機工	3,900.0	7,670.00	29,913,000		
PEGASUS	8,900.0	630.00	5,607,000	貸付株式数	3,300株
マルマエ	3,500.0	1,729.00	6,051,500	貸付株式数	1,400株
タツモ	4,900.0	2,973.00	14,567,700		
ナプテスコ	50,700.0	2,770.00	140,439,000		
三井海洋開発	10,100.0	2,090.00	21,109,000		
レオン自動機	8,500.0	1,403.00	11,925,500		
S M C	26,200.0	69,550.00	1,822,210,000		
ホソカワミクロン	5,200.0	4,400.00	22,880,000	貸付株式数	900株
ユニオンツール	3,500.0	3,700.00	12,950,000		
瑞 光	5,800.0	1,365.00	7,917,000	貸付株式数	2,200株
オイレス工業	11,300.0	2,089.00	23,605,700	貸付株式数	3,600株
日精エーエスビー	3,200.0	4,660.00	14,912,000		
サト - ホールディングス	11,500.0	2,136.00	24,564,000		
技研製作所	7,600.0	2,068.00	15,716,800	貸付株式数	1,300株
日本エアーテック	3,800.0	1,300.00	4,940,000		
カ ワ タ	1,500.0	1,106.00	1,659,000		
日精樹脂工業	6,000.0	1,065.00	6,390,000		
オカダアイヨン	1,700.0	2,097.00	3,564,900	貸付株式数	800株
ワイエイシイホールディングス	2,300.0	2,812.00	6,467,600	貸付株式数	900株
小松製作所	378,300.0	4,509.00	1,705,754,700		
住友重機械	47,800.0	3,936.00	188,140,800		

日立建機	32,200.0	4,914.00	158,230,800	
日 工	12,100.0	697.00	8,433,700	
巴工業	3,100.0	3,095.00	9,594,500	貸付株式数 1,200株
井関農機	7,600.0	1,214.00	9,226,400	
TOWA	8,200.0	3,520.00	28,864,000	
丸山製作所	900.0	2,392.00	2,152,800	
北川鉄工所	3,200.0	1,562.00	4,998,400	
シンニッタン	5,800.0	253.00	1,467,400	
ローツェ	4,200.0	10,560.00	44,352,000	貸付株式数 1,600株
タカキタ	1,500.0	502.00	753,000	貸付株式数 800株
クボタ	423,700.0	2,405.50	1,019,210,350	
荏原実業	4,100.0	2,981.00	12,222,100	
東洋エンジニア	10,100.0	696.00	7,029,600	
三菱化工機	2,500.0	2,855.00	7,137,500	
月島ホールディングス	10,700.0	1,398.00	14,958,600	
帝国電機製作所	5,700.0	2,700.00	15,390,000	
東京機械	1,200.0	408.00	489,600	
新東工業	16,300.0	1,156.00	18,842,800	
渋谷工業	7,600.0	2,619.00	19,904,400	
アイチ コーポレーション	11,300.0	1,000.00	11,300,000	
小森コーポレーション	18,700.0	1,140.00	21,318,000	
鶴見製作所	6,200.0	3,275.00	20,305,000	
日本ギア工業	1,800.0	400.00	720,000	貸付株式数 800株
酒井重工業	900.0	5,440.00	4,896,000	
荏原製作所	33,100.0	7,365.00	243,781,500	
石井鉄工所	600.0	3,070.00	1,842,000	
西島製作所	6,900.0	2,007.00	13,848,300	
北越工業	8,100.0	2,169.00	17,568,900	貸付株式数 900株
ダイキン工業	96,400.0	24,915.00	2,401,806,000	
オルガノ	11,100.0	3,965.00	44,011,500	
ト - ヨ - カネツ	3,000.0	3,535.00	10,605,000	
栗田工業	45,100.0	5,495.00	247,824,500	
椿本チエイン	11,500.0	4,060.00	46,690,000	
大同工業	2,100.0	772.00	1,621,200	貸付株式数 900株
日 機 装	18,600.0	1,038.00	19,306,800	
木村化工機	6,000.0	772.00	4,632,000	貸付株式数 100株 (100株)
レイズネクスト	11,000.0	1,550.00	17,050,000	
アネスト岩田	13,700.0	1,225.00	16,782,500	貸付株式数 100株
ダイフク	124,900.0	2,857.50	356,901,750	貸付株式数 48,600株

サムコ	2,200.0	4,465.00	9,823,000	
加藤製作所	2,600.0	1,286.00	3,343,600	
油研工業	800.0	2,334.00	1,867,200	
タダノ	46,500.0	1,328.00	61,752,000	貸付株式数 3,800株
フジテック	28,300.0	3,676.00	104,030,800	
C K D	22,400.0	2,120.00	47,488,000	
平和	26,800.0	2,270.00	60,836,000	
理想科学工業	6,400.0	2,448.00	15,667,200	
S A N K Y O	15,900.0	6,603.00	104,987,700	
日本金銭機械	8,900.0	1,019.00	9,069,100	貸付株式数 3,300株
マースグループH L D G S	4,600.0	2,958.00	13,606,800	
フクシマガリレイ	5,900.0	5,200.00	30,680,000	
オーイズミ	2,000.0	419.00	838,000	貸付株式数 1,000株
ダイコク電機	4,400.0	5,780.00	25,432,000	貸付株式数 1,700株
竹内製作所	14,700.0	5,130.00	75,411,000	
ア マ ノ	22,900.0	3,398.00	77,814,200	
J U K I	12,500.0	639.00	7,987,500	
サンデン	7,800.0	195.00	1,521,000	貸付株式数 4,200株
ジャノメ	8,100.0	723.00	5,856,300	
ブラザー工業	107,900.0	2,535.00	273,526,500	
マックス	9,900.0	2,781.00	27,531,900	
モリタホールディングス	14,000.0	1,690.00	23,660,000	
グローリー	19,400.0	3,214.00	62,351,600	
新晃工業	8,200.0	2,098.00	17,203,600	
大和冷機工業	12,400.0	1,474.00	18,277,600	
セガサミーホールディングス	64,900.0	2,778.50	180,324,650	
日本ピストンリング	1,800.0	1,801.00	3,241,800	
リ ケ ン	3,200.0	3,550.00	11,360,000	
T P R	9,200.0	1,938.00	17,829,600	
ツバキ・ナカシマ	16,200.0	819.00	13,267,800	貸付株式数 1,900株
ホシザキ	47,700.0	5,775.00	275,467,500	
大豊工業	6,900.0	970.00	6,693,000	
日本精工	148,400.0	881.30	130,784,920	
N T N	159,400.0	295.30	47,070,820	貸付株式数 63,600株
ジェイテクト	71,900.0	1,506.00	108,281,400	
不 二 越	6,000.0	4,225.00	25,350,000	
ミネベアミツミ	140,500.0	2,482.50	348,791,250	
日本トムソン	19,800.0	579.00	11,464,200	
T H K	46,600.0	2,725.00	126,985,000	

ユーシン精機	6,300.0	703.00	4,428,900	
前澤給装工業	5,500.0	1,244.00	6,842,000	貸付株式数 1,000株
イーグル工業	8,900.0	1,838.00	16,358,200	
前澤工業	3,000.0	1,044.00	3,132,000	
日本ピラ - 工業	7,500.0	4,110.00	30,825,000	
キット	27,100.0	1,092.00	29,593,200	
日立	392,600.0	9,947.00	3,905,192,200	
東芝	151,400.0	4,593.00	695,380,200	
三菱電機	834,400.0	1,930.50	1,610,809,200	
富士電機	49,100.0	6,953.00	341,392,300	
東洋電機製造	1,800.0	1,038.00	1,868,400	
安川電機	95,700.0	5,761.00	551,327,700	
シンフォニアテクノロジー	8,900.0	1,642.00	14,613,800	
明電舎	12,300.0	2,271.00	27,933,300	
オリジン	1,200.0	1,301.00	1,561,200	
山洋電気	3,500.0	6,920.00	24,220,000	
デンヨー	6,200.0	2,180.00	13,516,000	
PHCホールディングス	11,300.0	1,567.00	17,707,100	
ソシオネクスト	11,600.0	14,830.00	172,028,000	
ベイクレントコンサルティング	65,100.0	4,970.00	323,547,000	
ORCHESTRA HOLDINGS	1,700.0	1,054.00	1,791,800	
アイモバイル	3,600.0	1,306.00	4,701,600	
キャリアインデックス	1,800.0	295.00	531,000	貸付株式数 700株
MS - Japan	1,900.0	1,195.00	2,270,500	貸付株式数 600株
船場	1,200.0	936.00	1,123,200	貸付株式数 200株
ジャパニーズエレベーターSHD	29,300.0	2,157.00	63,200,100	
フルテック	800.0	1,217.00	973,600	
グリーンズ	1,800.0	1,707.00	3,072,600	貸付株式数 700株
ツナググループHOLDINGS	1,500.0	855.00	1,282,500	貸付株式数 600株
GAMEWITH	1,600.0	327.00	523,200	貸付株式数 600株
MS&CONSULTING	800.0	695.00	556,000	貸付株式数 100株
ウェルビー	6,000.0	586.00	3,516,000	貸付株式数 2,300株
エル・ティー・エス	900.0	3,810.00	3,429,000	
ミダックホールディングス	5,000.0	1,835.00	9,175,000	貸付株式数 1,900株
日総工産	6,300.0	765.00	4,819,500	



キュービーネットHLDGS	3,900.0	1,531.00	5,970,900	
RPAホールディングス	11,100.0	340.00	3,774,000	
三桜工業	12,200.0	1,004.00	12,248,800	
マキタ	100,400.0	4,015.00	403,106,000	
東芝テック	11,700.0	3,490.00	40,833,000	
芝浦メカトロニクス	1,400.0	21,100.00	29,540,000	貸付株式数 200株
マブチモーター	20,000.0	4,628.00	92,560,000	
ニデック	196,400.0	7,333.00	1,440,201,200	
ユーエムシーエレクトロニクス	5,900.0	517.00	3,050,300	貸付株式数 2,200株
トレックス・セミコンダクター	3,800.0	2,237.00	8,500,600	貸付株式数 1,400株
東光高岳	4,900.0	2,192.00	10,740,800	
ダブル・スコープ	23,100.0	1,122.00	25,918,200	貸付株式数 9,200株
宮越ホールディングス	3,600.0	1,209.00	4,352,400	貸付株式数 1,400株
ダイヘン	7,300.0	5,260.00	38,398,000	
ヤーマン	13,900.0	1,063.00	14,775,700	貸付株式数 5,500株
JVCケンウッド	73,500.0	667.00	49,024,500	
ミマキエンジニアリング	7,600.0	797.00	6,057,200	
I-PEX	5,600.0	1,605.00	8,988,000	貸付株式数 900株
大崎電気	19,200.0	701.00	13,459,200	
オムロン	74,000.0	6,905.00	510,970,000	
日東工業	10,900.0	3,880.00	42,292,000	
IDEC	11,900.0	3,095.00	36,830,500	
正興電機製作所	1,800.0	1,134.00	2,041,200	
不二電機工業	1,000.0	1,128.00	1,128,000	貸付株式数 600株 (100株)
ジーエス・ユアサコーポ	26,500.0	2,714.50	71,934,250	
サクサホールディングス	1,100.0	2,508.00	2,758,800	
メルコホールディングス	2,000.0	3,210.00	6,420,000	
テクノメディカ	1,900.0	2,116.00	4,020,400	貸付株式数 700株
ダイヤモンドエレクトリックHD	2,700.0	863.00	2,330,100	貸付株式数 1,000株
日本電気	114,200.0	8,400.00	959,280,000	
富士通	80,400.0	18,665.00	1,500,666,000	
沖電気	36,500.0	1,120.00	40,880,000	
岩崎通信機	2,300.0	837.00	1,925,100	
電気興業	3,200.0	2,528.00	8,089,600	
サンケン電気	7,500.0	9,370.00	70,275,000	

ナカヨ	800.0	1,289.00	1,031,200	貸付株式数	300株
アイホン	4,800.0	3,135.00	15,048,000		
ルネサスエレクトロニクス	526,900.0	2,264.50	1,193,165,050		
セイコーエプソン	103,600.0	2,402.50	248,899,000		
ワコム	61,400.0	619.00	38,006,600	貸付株式数	22,600株
アルバック	19,200.0	5,474.00	105,100,800		
アクセル	2,000.0	1,882.00	3,764,000		
E I Z O	5,900.0	5,170.00	30,503,000		
ジャパンディスプレイ	61,700.0	40.00	2,468,000		
日本信号	18,500.0	972.00	17,982,000		
京三製作所	17,100.0	503.00	8,601,300		
能美防災	10,900.0	1,856.00	20,230,400		
ホーチキ	6,100.0	1,667.00	10,168,700		
星和電機	2,400.0	498.00	1,195,200	貸付株式数	1,000株
エレコム	19,300.0	1,801.00	34,759,300		
パナソニック ホールディング	953,600.0	1,784.00	1,701,222,400		
シャープ	97,200.0	938.50	91,222,200	貸付株式数	38,800株 (1,200株)
アンリツ	56,900.0	1,102.50	62,732,250		
富士通ゼネラル	22,900.0	2,817.50	64,520,750		
ソニーグループ	565,400.0	12,805.00	7,239,947,000		
T D K	127,800.0	5,678.00	725,648,400		
帝国通信工業	3,600.0	1,919.00	6,908,400		
タムラ製作所	34,600.0	582.00	20,137,200	貸付株式数	1,500株
アルプスアルパイン	72,100.0	1,297.00	93,513,700		
池上通信機	1,700.0	792.00	1,346,400	貸付株式数	700株
日本電波工業	9,700.0	1,417.00	13,744,900	貸付株式数	900株
鈴木	4,300.0	1,173.00	5,043,900		
メイコー	8,800.0	3,510.00	30,888,000		
日本トリム	1,800.0	3,115.00	5,607,000		
ローランド ディー . ジー .	4,400.0	3,480.00	15,312,000		
フオスタ - 電機	7,500.0	977.00	7,327,500		
S M K	1,900.0	2,546.00	4,837,400		
ヨコオ	6,400.0	1,656.00	10,598,400		
ティアック	8,100.0	114.00	923,400	貸付株式数	3,200株
ホシデン	18,800.0	1,957.00	36,791,600		
ヒロセ電機	13,000.0	17,540.00	228,020,000		
日本航空電子	16,500.0	3,065.00	50,572,500		

T O A	9,200.0	1,220.00	11,224,000	
マクセル	16,400.0	1,711.00	28,060,400	
古野電気	10,500.0	1,392.00	14,616,000	
スミダコーポレーション	10,800.0	1,506.00	16,264,800	
アイコム	3,100.0	3,435.00	10,648,500	貸付株式数 1,000株
リオン	3,300.0	2,301.00	7,593,300	
横河電機	88,300.0	2,999.00	264,811,700	
新電元工業	3,100.0	3,165.00	9,811,500	
アズビル	55,900.0	4,820.00	269,438,000	
東亜ディーケーケー	2,400.0	880.00	2,112,000	貸付株式数 1,100株
日本光電工業	36,900.0	3,863.00	142,544,700	
チノール	3,300.0	2,076.00	6,850,800	貸付株式数 1,100株
共和電業	4,900.0	370.00	1,813,000	
日本電子材料	5,300.0	1,484.00	7,865,200	
堀場製作所	15,300.0	7,975.00	122,017,500	貸付株式数 1,500株
アドバンテスト	63,000.0	15,955.00	1,005,165,000	
小野測器	2,100.0	462.00	970,200	
エスペック	6,400.0	2,435.00	15,584,000	
キーエンス	80,000.0	57,610.00	4,608,800,000	
日置電機	3,800.0	7,420.00	28,196,000	
シスメックス	69,000.0	7,682.00	530,058,000	
日本マイクロニクス	14,400.0	1,986.00	28,598,400	
メガチップス	6,600.0	4,125.00	27,225,000	貸付株式数 400株
OBARA GROUP	4,400.0	4,145.00	18,238,000	貸付株式数 1,400株
IMAGICA GROUP	6,600.0	598.00	3,946,800	貸付株式数 2,600株
澤藤電機	600.0	1,278.00	766,800	貸付株式数 300株
デンソー	164,900.0	10,285.00	1,695,996,500	
原田工業	2,300.0	844.00	1,941,200	貸付株式数 500株
コーセル	9,600.0	1,287.00	12,355,200	
イリソ電子工業	7,300.0	4,330.00	31,609,000	貸付株式数 2,700株
オプテックスグループ	14,700.0	1,694.00	24,901,800	
千代田インテグレ	3,100.0	2,848.00	8,828,800	
レーザーテック	36,600.0	21,635.00	791,841,000	
スタンレー電気	56,300.0	2,482.50	139,764,750	
ウシオ電機	40,600.0	1,847.00	74,988,200	
岡谷電機	4,000.0	324.00	1,296,000	貸付株式数 1,900株
ヘリオステクノH	4,900.0	424.00	2,077,600	貸付株式数 2,300株
エノモト	1,300.0	1,729.00	2,247,700	貸付株式数 600株
日本セラミック	6,500.0	2,608.00	16,952,000	

遠藤照明	2,400.0	1,277.00	3,064,800	
古河電池	5,900.0	999.00	5,894,100	
双信電機	2,100.0	348.00	730,800	貸付株式数 900株
山一電機	6,500.0	1,765.00	11,472,500	
図 研	6,900.0	4,180.00	28,842,000	
日本電子	20,000.0	4,641.00	92,820,000	
カ シ オ	59,600.0	1,281.50	76,377,400	
ファナック	389,800.0	4,049.00	1,578,300,200	
日本シイエムケイ	16,900.0	667.00	11,272,300	
エンプラス	2,300.0	10,040.00	23,092,000	貸付株式数 900株
大真空	9,700.0	782.00	7,585,400	貸付株式数 2,400株
ロ - ム	36,900.0	11,385.00	420,106,500	
浜松ホトニクス	64,100.0	6,601.00	423,124,100	
三井ハイテック	8,300.0	8,090.00	67,147,000	貸付株式数 3,000株
新光電気工業	28,300.0	5,847.00	165,470,100	
京 セ ラ	124,200.0	7,745.00	961,929,000	
協栄産業	500.0	2,324.00	1,162,000	貸付株式数 200株
太陽誘電	38,900.0	4,270.00	166,103,000	
村田製作所	242,400.0	8,268.00	2,004,163,200	
双葉電子工業	15,100.0	558.00	8,425,800	
日東電工	58,200.0	10,160.00	591,312,000	
北陸電気工業	2,000.0	1,505.00	3,010,000	
東海理化電機	22,500.0	2,463.00	55,417,500	
ニチコン	16,300.0	1,362.00	22,200,600	
日本ケミコン	7,900.0	1,462.00	11,549,800	
K O A	12,100.0	1,845.00	22,324,500	貸付株式数 3,800株
三井E & S	21,700.0	631.00	13,692,700	
日立造船	65,800.0	900.00	59,220,000	
三菱重工業	141,200.0	8,789.00	1,241,006,800	
川崎重工業	60,200.0	3,918.00	235,863,600	
I H I	50,900.0	3,234.00	164,610,600	
名村造船所	13,700.0	969.00	13,275,300	貸付株式数 7,200株
サノヤスホールディングス	7,400.0	143.00	1,058,200	貸付株式数 3,600株
スプリックス	1,500.0	850.00	1,275,000	
マネジメントソリューションズ	3,500.0	3,110.00	10,885,000	貸付株式数 1,100株
プロレド・パートナーズ	2,100.0	484.00	1,016,400	貸付株式数 200株
AND FACTORY	1,600.0	367.00	587,200	貸付株式数 500株
テノ・ホールディングス	700.0	616.00	431,200	貸付株式数 200株

フロンティア・マネジメン ト	2,100.0	1,341.00	2,816,100		
ピアラ	1,100.0	420.00	462,000	貸付株式数	400株
コプロ・ホールディングス	900.0	2,504.00	2,253,600	貸付株式数	100株
ギークス	700.0	728.00	509,600	貸付株式数	400株
アンビスホールディングス	8,800.0	2,865.00	25,212,000		
カープスホールディングス	22,500.0	737.00	16,582,500		
フォーラムエンジニアリン グ	4,900.0	1,304.00	6,389,600		
F A S T F I T N E S S J A P	2,800.0	1,364.00	3,819,200		
日本車輛	3,100.0	2,198.00	6,813,800	貸付株式数	300株
三菱ロジスネクスト	12,800.0	1,410.00	18,048,000		
近畿車輛	800.0	2,073.00	1,658,400	貸付株式数	300株
一家ホールディングス	1,300.0	708.00	920,400	貸付株式数	600株
フルサト・マルカHD	7,600.0	2,790.00	21,204,000		
ヤマエグループHD	4,800.0	3,775.00	18,120,000		
ジャパンクラフトホール ディ	3,400.0	227.00	771,800	貸付株式数	1,800株
F P G	26,600.0	1,502.00	39,953,200		
島根銀行	1,800.0	595.00	1,071,000	貸付株式数	800株
じもとホールディングス	4,600.0	456.00	2,097,600		
全国保証	20,600.0	5,005.00	103,103,000		
めぶきフィナンシャルG	390,800.0	434.50	169,802,600		
ジャパンインベストメント A	6,400.0	1,869.00	11,961,600		
東京きらぼしFG	10,100.0	4,725.00	47,722,500		
九州フィナンシャルG	138,600.0	807.60	111,933,360	貸付株式数	36,400株
かんぼ生命保険	91,700.0	2,625.00	240,712,500		
ゆうちょ銀行	216,300.0	1,321.00	285,732,300		
あんしん保証	2,500.0	297.00	742,500	貸付株式数	1,100株
富山第一銀行	25,000.0	1,038.00	25,950,000	貸付株式数	9,400株
コンコルディア・フィナン シャル	422,500.0	726.30	306,861,750		
ジェイリース	1,700.0	2,174.00	3,695,800	貸付株式数	600株
西日本フィナンシャルHD	48,900.0	1,735.00	84,841,500		
イントラスト	2,000.0	910.00	1,820,000		
日本モーゲージサービス	2,800.0	575.00	1,610,000	貸付株式数	1,200株
C a s a	2,000.0	881.00	1,762,000	貸付株式数	700株

アルヒ	9,700.0	947.00	9,185,900	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
プレミアグループ	13,200.0	1,589.00	20,974,800	
日産自動車	1,135,600.0	710.10	806,389,560	
いすゞ自動車	232,400.0	2,023.50	470,261,400	
トヨタ自動車	4,389,200.0	2,880.00	12,640,896,000	
日野自動車	103,000.0	612.00	63,036,000	
三菱自動車工業	311,900.0	662.60	206,664,940	
エフテック	3,700.0	883.00	3,267,100	
レシップホールディングス	2,100.0	568.00	1,192,800	
G M B	1,000.0	2,160.00	2,160,000	貸付株式数 400株
ファルテック	800.0	585.00	468,000	貸付株式数 200株
武蔵精密工業	19,500.0	1,703.00	33,208,500	
日産車体	14,100.0	923.00	13,014,300	貸付株式数 3,700株
新明和工業	25,100.0	1,327.00	33,307,700	
極東開発工業	13,200.0	1,878.00	24,789,600	
トピー工業	6,500.0	2,711.00	17,621,500	
ティラド	2,000.0	2,321.00	4,642,000	
タチエス	12,600.0	1,861.00	23,448,600	
N O K	31,000.0	2,134.00	66,154,000	
フタバ産業	21,400.0	800.00	17,120,000	
K Y B	7,700.0	5,120.00	39,424,000	
市光工業	14,400.0	590.00	8,496,000	
大同メタル工業	15,500.0	585.00	9,067,500	
プレス工業	35,700.0	723.00	25,811,100	
ミクニ	6,100.0	512.00	3,123,200	
太平洋工業	18,300.0	1,562.00	28,584,600	
河西工業	7,000.0	298.00	2,086,000	貸付株式数 2,700株
アイシン	61,600.0	5,908.00	363,932,800	
マ ッ ダ	264,400.0	1,852.50	489,801,000	
今仙電機製作所	3,300.0	679.00	2,240,700	
本田技研	649,800.0	5,407.00	3,513,468,600	
スズキ	146,800.0	6,291.00	923,518,800	
S U B A R U	252,900.0	3,094.00	782,472,600	
安永	2,300.0	860.00	1,978,000	貸付株式数 1,200株
ヤマハ発動機	115,200.0	4,127.00	475,430,400	
小糸製作所	96,100.0	2,347.00	225,546,700	貸付株式数 11,100株
T B K	5,100.0	473.00	2,412,300	
エクセディ	13,100.0	2,802.00	36,706,200	

ミツバ	15,000.0	811.00	12,165,000	
豊田合成	23,300.0	3,475.00	80,967,500	
愛三工業	13,200.0	1,403.00	18,519,600	
盟和産業	700.0	1,040.00	728,000	貸付株式数 300株
日本プラスト	4,100.0	509.00	2,086,900	
ヨロズ	7,500.0	990.00	7,425,000	貸付株式数 2,700株
エフ・シー・シー	14,200.0	1,978.00	28,087,600	
新家工業	1,200.0	2,867.00	3,440,400	
シマノ	32,400.0	20,470.00	663,228,000	貸付株式数 12,600株
テイ・エス テック	36,600.0	1,785.50	65,349,300	貸付株式数 12,500株
33FG	7,000.0	1,980.00	13,860,000	
第四北越フィナンシャルG	12,400.0	4,025.00	49,910,000	
ひろぎんHLDGS	102,700.0	986.50	101,313,550	
マーキュリアホールディングス	2,700.0	798.00	2,154,600	貸付株式数 1,000株
おきなわFG	7,200.0	2,553.00	18,381,600	
ダイレクトマーケティングミクス	8,500.0	522.00	4,437,000	
ポピンズ	1,200.0	1,273.00	1,527,600	
LITALICO	6,400.0	2,125.00	13,600,000	
コンフィデンス・インターワーク	300.5	1,614.00	485,007	貸付株式数 100株
十六FG	10,200.0	4,045.00	41,259,000	
北國FHD	8,300.0	5,890.00	48,887,000	
ネットプロHD	26,000.0	392.00	10,192,000	
プロクレアホールディングス	9,600.0	2,089.00	20,054,400	
あいちフィナンシャルグル	11,000.0	2,648.00	29,128,000	
ジャムコ	2,900.0	1,641.00	4,758,900	貸付株式数 500株
小野建	8,300.0	1,786.00	14,823,800	
はるやまHLDGS	2,600.0	528.00	1,372,800	貸付株式数 1,100株
南陽	1,000.0	2,288.00	2,288,000	貸付株式数 500株
ノジマ	27,600.0	1,313.00	36,238,800	貸付株式数 11,000株
佐島電機	3,500.0	1,804.00	6,314,000	
カップ・クリエイト	13,400.0	1,578.00	21,145,200	貸付株式数 5,300株
エコトレーディング	1,100.0	1,392.00	1,531,200	
伯東	4,800.0	5,470.00	26,256,000	
コンドーテック	6,300.0	1,200.00	7,560,000	貸付株式数 2,200株
中山福	2,900.0	360.00	1,044,000	
ライトオン	4,400.0	513.00	2,257,200	貸付株式数 1,700株

ナガイレーベン	10,700.0	2,307.00	24,684,900	貸付株式数	200株
三菱食品	7,800.0	4,135.00	32,253,000		
良品計画	92,400.0	1,952.50	180,411,000		
バリミキホールディングス	7,300.0	387.00	2,825,100	貸付株式数	2,600株
松田産業	6,400.0	2,334.00	14,937,600		
第一興商	32,700.0	2,630.00	86,001,000		
メディパルHD	80,900.0	2,644.00	213,899,600		
アドヴァングループ	7,800.0	1,053.00	8,213,400		
S P K	3,700.0	2,090.00	7,733,000		
萩原電気HLDGS	3,500.0	4,235.00	14,822,500		
アルビス	2,900.0	2,460.00	7,134,000	貸付株式数	1,100株
アズワン	12,100.0	5,831.00	70,555,100		
スズデン	2,900.0	2,346.00	6,803,400		
尾家産業	1,300.0	2,021.00	2,627,300	貸付株式数	300株
シモジマ	5,800.0	1,232.00	7,145,600	貸付株式数	200株
ドウシシャ	8,900.0	2,358.00	20,986,200		
小津産業	1,200.0	1,636.00	1,963,200	貸付株式数	600株
コナカ	6,500.0	462.00	3,003,000		
高速	4,400.0	2,099.00	9,235,600		
ハウス ローゼ	800.0	1,619.00	1,295,200		
G - 7ホールディングス	10,600.0	1,302.00	13,801,200		
たけびし	3,300.0	1,953.00	6,444,900	貸付株式数	1,200株
イオン北海道	12,400.0	871.00	10,800,400	貸付株式数	4,600株
コジマ	14,300.0	635.00	9,080,500	貸付株式数	5,400株
ヒマラヤ	2,000.0	946.00	1,892,000	貸付株式数	900株
コーナン商事	11,500.0	3,595.00	41,342,500		
ネットワンシステムズ	29,900.0	2,789.50	83,406,050		
エコス	3,100.0	2,086.00	6,466,600		
ワタミ	10,200.0	1,156.00	11,791,200	貸付株式数	3,900株
マルシェ	1,900.0	297.00	564,300	貸付株式数	800株
リックス	1,200.0	3,330.00	3,996,000		
システムソフト	27,200.0	77.00	2,094,400	貸付株式数	1,500株
パンパシフィックHD	170,700.0	3,101.00	529,340,700		
丸文	7,600.0	1,243.00	9,446,800		
西松屋チェーン	18,800.0	1,649.00	31,001,200	貸付株式数	7,200株
ゼンショーホールディングス	46,300.0	6,599.00	305,533,700	貸付株式数	18,500株
ハピネット	7,200.0	2,596.00	18,691,200		
幸楽苑ホールディングス	5,600.0	1,038.00	5,812,800	貸付株式数	2,200株
ハークスレイ	2,000.0	771.00	1,542,000		



橋本総業HLDGS	3,300.0	1,175.00	3,877,500	
日本ライフライン	24,800.0	1,229.00	30,479,200	
サイゼリヤ	12,500.0	4,655.00	58,187,500	貸付株式数 4,400株
タカショー	7,300.0	649.00	4,737,700	貸付株式数 2,800株
VTホールディングス	32,000.0	529.00	16,928,000	
アルゴグラフィックス	7,300.0	3,525.00	25,732,500	
魚力	2,700.0	2,215.00	5,980,500	貸付株式数 1,000株
IDOM	25,600.0	740.00	18,944,000	貸付株式数 10,200株
日本エム・ディ・エム	4,700.0	765.00	3,595,500	
ポプラ	1,400.0	224.00	313,600	貸付株式数 200株
フジ・コーポレーション	4,200.0	2,057.00	8,639,400	
ユナイテッドアローズ	9,100.0	2,045.00	18,609,500	貸付株式数 1,000株
進和	5,200.0	2,447.00	12,724,400	貸付株式数 2,000株
エスケイジャパン	1,300.0	712.00	925,600	
ダイترون	3,300.0	3,105.00	10,246,500	
ハイデイ日高	12,600.0	2,876.00	36,237,600	貸付株式数 4,700株
シークス	12,100.0	1,571.00	19,009,100	貸付株式数 4,100株
YU-WA CREATI ON H	4,000.0	185.00	740,000	
コロワイド	39,000.0	2,514.50	98,065,500	貸付株式数 15,500株
田中商事	1,500.0	727.00	1,090,500	貸付株式数 100株
オーハシテクニカ	4,100.0	1,730.00	7,093,000	貸付株式数 1,600株
吉番屋	6,700.0	5,490.00	36,783,000	貸付株式数 1,300株
白銅	3,000.0	2,446.00	7,338,000	貸付株式数 1,100株
トップカルチャー	2,200.0	191.00	420,200	貸付株式数 600株
PLANT	1,300.0	810.00	1,053,000	
スギホールディングス	17,000.0	6,309.00	107,253,000	
ダイコー通産	600.0	1,210.00	726,000	貸付株式数 200株
薬王堂ホールディングス	4,800.0	2,758.00	13,238,400	
島津製作所	97,300.0	4,152.00	403,989,600	
JMS	7,300.0	555.00	4,051,500	
クボテック	1,200.0	268.00	321,600	貸付株式数 400株
長野計器	5,800.0	2,632.00	15,265,600	
ブイ・テクノロジー	3,900.0	2,232.00	8,704,800	
スター精密	15,300.0	1,919.00	29,360,700	
東京計器	6,100.0	1,537.00	9,375,700	貸付株式数 1,800株
愛知時計	3,000.0	1,769.00	5,307,000	
インターアクション	3,800.0	1,044.00	3,967,200	貸付株式数 1,200株
オーバル	4,600.0	423.00	1,945,800	貸付株式数 400株

東京精密	17,600.0	7,340.00	129,184,000	
マニー	32,000.0	1,897.00	60,704,000	
ニコン	115,600.0	1,644.50	190,104,200	
トプコン	42,100.0	1,763.00	74,222,300	
オリンパス	492,000.0	2,082.00	1,024,344,000	
理研計器	5,000.0	5,900.00	29,500,000	
S C R E E Nホールディングス	13,700.0	13,935.00	190,909,500	
キヤノン電子	8,800.0	1,885.00	16,588,000	貸付株式数 1,200株
タムロン	4,900.0	4,395.00	21,535,500	
H O Y A	169,400.0	16,095.00	2,726,493,000	
シード	2,600.0	814.00	2,116,400	
ノーリツ鋼機	7,600.0	3,275.00	24,890,000	
A & Dホロンホールディングス	11,700.0	1,743.00	20,393,100	
朝日インテック	89,300.0	2,915.00	260,309,500	
キヤノン	398,700.0	3,684.00	1,468,810,800	貸付株式数 159,400株
リコー	200,400.0	1,339.50	268,435,800	
シチズン時計	73,500.0	953.00	70,045,500	
リズム	1,600.0	1,814.00	2,902,400	
大研医器	3,900.0	550.00	2,145,000	
メニコン	27,500.0	2,058.50	56,608,750	
シンシア	600.0	551.00	330,600	貸付株式数 200株
K Y O R I T S U	7,700.0	201.00	1,547,700	
中本パックス	1,800.0	1,654.00	2,977,200	貸付株式数 100株
スノーピーク	11,400.0	1,380.00	15,732,000	貸付株式数 4,800株 (100株)
パラマウントベッドHD	18,400.0	2,424.00	44,601,600	
トランザクション	5,300.0	1,942.00	10,292,600	貸付株式数 1,900株
粧美堂	1,500.0	524.00	786,000	貸付株式数 600株
ニホンフラッシュ	7,300.0	908.00	6,628,400	
前田工織	6,700.0	3,065.00	20,535,500	貸付株式数 2,400株
永大産業	5,500.0	231.00	1,270,500	
アートネイチャー	8,000.0	839.00	6,712,000	
バンダイナムコHLDGS	219,000.0	3,264.00	714,816,000	
アイフィスジャパン	1,400.0	613.00	858,200	貸付株式数 400株
S H O E I	18,000.0	2,459.00	44,262,000	
フランスベッドHLDGS	9,000.0	1,245.00	11,205,000	貸付株式数 3,400株
マーベラス	12,800.0	731.00	9,356,800	

パイロットコーポレーション	11,200.0	5,072.00	56,806,400	
萩原工業	5,300.0	1,861.00	9,863,300	貸付株式数 2,100株 (500株)
エイベックス	13,600.0	1,499.00	20,386,400	
フジシールインターナショナル	16,200.0	1,808.00	29,289,600	
タカラトミー	36,400.0	2,303.00	83,829,200	
広済堂ホールディングス	3,600.0	2,859.00	10,292,400	
エステールホールディングス	1,200.0	645.00	774,000	貸付株式数 700株
レック	11,400.0	967.00	11,023,800	
タカノ	1,900.0	919.00	1,746,100	貸付株式数 800株
三光合成	10,100.0	706.00	7,130,600	
プロネクス	6,900.0	1,164.00	8,031,600	
ホクシン	4,000.0	132.00	528,000	貸付株式数 2,000株
ウッドワン	1,700.0	1,088.00	1,849,600	貸付株式数 600株
大建工業	4,700.0	3,045.00	14,311,500	
きもと	7,700.0	192.00	1,478,400	
凸版印刷	98,300.0	3,837.00	377,177,100	
大日本印刷	87,400.0	4,064.00	355,193,600	
共同印刷	2,300.0	3,360.00	7,728,000	
N I S S H A	13,800.0	1,716.00	23,680,800	
光村印刷	600.0	1,396.00	837,600	貸付株式数 200株
藤森工業	6,300.0	3,965.00	24,979,500	
ヴィア・ホールディングス	9,000.0	104.00	936,000	貸付株式数 300株
TAKARA & COMPANY	5,200.0	2,524.00	13,124,800	
前澤化成工業	5,000.0	1,535.00	7,675,000	貸付株式数 1,800株
未来工業	2,800.0	3,315.00	9,282,000	
アシックス	68,100.0	5,672.00	386,263,200	
ツツミ	1,400.0	2,444.00	3,421,600	貸付株式数 600株
ウェーブロックHLDGS	1,700.0	675.00	1,147,500	貸付株式数 1,200株
ジェイエスピー	5,600.0	2,067.00	11,575,200	貸付株式数 1,400株
ニチハ	9,900.0	3,135.00	31,036,500	
ローランド	5,900.0	4,030.00	23,777,000	
エフピコ	15,200.0	2,607.50	39,634,000	
小松ウオール工業	2,900.0	3,080.00	8,932,000	
ヤマハ	50,400.0	4,315.00	217,476,000	
河合楽器	2,200.0	3,570.00	7,854,000	

クリナップ	8,700.0	735.00	6,394,500	
ビジョン	50,900.0	1,693.50	86,199,150	
天馬	6,500.0	2,623.00	17,049,500	
キングジム	6,900.0	883.00	6,092,700	貸付株式数 2,700株
象印マホービン	21,700.0	1,843.00	39,993,100	
リンテック	16,100.0	2,477.00	39,879,700	
信越ポリマー	14,800.0	1,366.00	20,216,800	
東リ	11,700.0	342.00	4,001,400	
イトーキ	16,400.0	1,464.00	24,009,600	
任天堂	504,700.0	6,451.00	3,255,819,700	
三菱鉛筆	11,300.0	1,980.00	22,374,000	
松風	3,600.0	2,234.00	8,042,400	
タカラスタンダ-ド	14,300.0	1,907.00	27,270,100	
コクヨ	34,600.0	2,416.00	83,593,600	
ナカバヤシ	8,500.0	531.00	4,513,500	
ニフコ	28,900.0	4,215.00	121,813,500	
立川ブラインド	3,600.0	1,473.00	5,302,800	
グローブライド	6,400.0	2,069.00	13,241,600	
オカムラ	24,000.0	2,319.00	55,656,000	
バルカー	6,700.0	4,320.00	28,944,000	
MUTOHホールディングス	700.0	2,020.00	1,414,000	
伊藤忠	521,100.0	5,757.00	2,999,972,700	
丸紅	660,000.0	2,539.00	1,675,740,000	
スクロール	12,600.0	1,039.00	13,091,400	貸付株式数 1,600株
高島	900.0	4,020.00	3,618,000	
ヨンドシーホールディングス	7,200.0	1,872.00	13,478,400	貸付株式数 100株
三陽商会	2,000.0	2,121.00	4,242,000	貸付株式数 200株
長瀬産業	38,800.0	2,550.00	98,940,000	
ナイガイ	1,700.0	289.00	491,300	貸付株式数 500株
蝶理	4,600.0	3,085.00	14,191,000	
豊田通商	74,100.0	9,186.00	680,682,600	
オンワ-ドホールディングス	51,900.0	550.00	28,545,000	
三共生興	11,700.0	806.00	9,430,200	
兼松	32,800.0	2,231.00	73,176,800	
美津濃	7,900.0	4,860.00	38,394,000	
ツカモトコーポレーション	800.0	1,288.00	1,030,400	
ルックホールディングス	1,700.0	2,077.00	3,530,900	貸付株式数 800株

三井物産	600,200.0	5,832.00	3,500,366,400	
日本紙パルプ	4,500.0	5,160.00	23,220,000	
東京エレクトロン	169,200.0	20,750.00	3,510,900,000	
カメイ	9,000.0	1,559.00	14,031,000	
東都水産	300.0	6,570.00	1,971,000	貸付株式数 100株
OUGホールディングス	800.0	2,525.00	2,020,000	
スターゼン	6,500.0	2,650.00	17,225,000	
セイコーグループ	12,400.0	2,759.00	34,211,600	
山 善	22,800.0	1,235.00	28,158,000	
椿本興業	1,400.0	5,440.00	7,616,000	貸付株式数 500株
住友商事	511,800.0	3,216.00	1,645,948,800	
B I P R O G Y	29,500.0	3,839.00	113,250,500	
内田洋行	3,400.0	6,850.00	23,290,000	
三菱商事	515,600.0	7,688.00	3,963,932,800	
第一実業	3,000.0	5,950.00	17,850,000	
キヤノンマーケティングJ P N	19,600.0	3,850.00	75,460,000	
西華産業	3,200.0	2,200.00	7,040,000	
佐藤商事	5,900.0	1,599.00	9,434,100	
菱洋エレクトロ	7,200.0	3,335.00	24,012,000	貸付株式数 1,200株
東京産業	7,500.0	884.00	6,630,000	
ユアサ商事	7,300.0	4,320.00	31,536,000	
神鋼商事	2,100.0	6,170.00	12,957,000	
トルク	2,900.0	281.00	814,900	貸付株式数 1,100株
阪和興業	15,200.0	5,060.00	76,912,000	
正栄食品	5,600.0	5,130.00	28,728,000	貸付株式数 1,900株 (100株)
カナデン	5,600.0	1,386.00	7,761,600	貸付株式数 2,200株
R Y O D E N	6,800.0	2,417.00	16,435,600	貸付株式数 2,400株
ニプロ	66,600.0	1,227.00	81,718,200	貸付株式数 22,400株
岩谷産業	19,200.0	7,923.00	152,121,600	
ナイス	2,500.0	1,523.00	3,807,500	
ニチモウ	700.0	4,275.00	2,992,500	
極東貿易	5,000.0	1,976.00	9,880,000	貸付株式数 400株
アステナホールディングス	15,800.0	484.00	7,647,200	貸付株式数 5,100株
三愛オブリ	22,400.0	1,828.00	40,947,200	
稲畑産業	16,700.0	3,280.00	54,776,000	
G S I クレオス	4,900.0	2,338.00	11,456,200	貸付株式数 1,900株
明和産業	11,200.0	679.00	7,604,800	貸付株式数 4,300株
クワザワホールディングス	1,800.0	570.00	1,026,000	貸付株式数 1,000株

ゴ - ルドウイン	14,200.0	10,840.00	153,928,000	
ユニ・チャ - ム	167,000.0	5,505.00	919,335,000	
デサント	13,800.0	3,815.00	52,647,000	
キ ン グ	2,300.0	677.00	1,557,100	貸付株式数 100株
ワ キ タ	15,600.0	1,451.00	22,635,600	
ヤマトインタ - ナショナル	4,100.0	290.00	1,189,000	
東邦ホールディングス	21,100.0	3,136.00	66,169,600	貸付株式数 7,900株
サンゲツ	21,200.0	3,120.00	66,144,000	
ミツウロコグループ	10,800.0	1,387.00	14,979,600	
シナネンホールディングス	2,700.0	4,125.00	11,137,500	
伊藤忠エネクス	21,000.0	1,578.00	33,138,000	
サンリオ	24,000.0	7,237.00	173,688,000	
サンワ テクノス	4,300.0	2,297.00	9,877,100	
リョーサン	9,000.0	4,360.00	39,240,000	
新光商事	11,400.0	1,261.00	14,375,400	
トーホー	3,600.0	3,585.00	12,906,000	貸付株式数 1,100株
三信電気	3,400.0	2,255.00	7,667,000	
東陽テクニカ	8,500.0	1,339.00	11,381,500	
モスフード サービス	12,500.0	3,345.00	41,812,500	貸付株式数 4,800株
加賀電子	6,900.0	6,740.00	46,506,000	
三益半導体	6,400.0	2,793.00	17,875,200	
都築電気	4,200.0	2,340.00	9,828,000	貸付株式数 1,600株
ソーダニツカ	4,100.0	1,089.00	4,464,900	
立花エレテック	6,200.0	2,936.00	18,203,200	貸付株式数 2,000株
木曽路	12,900.0	2,541.00	32,778,900	貸付株式数 5,100株
S R S ホールディングス	14,100.0	1,066.00	15,030,600	貸付株式数 5,500株
千 趣 会	16,000.0	410.00	6,560,000	貸付株式数 6,200株
タカキュー	4,200.0	93.00	390,600	貸付株式数 600株
リテールパートナーズ	12,500.0	1,747.00	21,837,500	貸付株式数 4,200株
ケーヨー	13,900.0	871.00	12,106,900	
上新電機	7,700.0	2,340.00	18,018,000	
日本瓦斯	44,800.0	2,312.00	103,577,600	
ロイヤルホールディングス	14,900.0	2,684.00	39,991,600	貸付株式数 5,900株
東 天 紅	500.0	850.00	425,000	
いなげや	8,200.0	1,501.00	12,308,200	
チヨダ	8,300.0	959.00	7,959,700	貸付株式数 1,300株
ライフコーポレーション	7,400.0	3,720.00	27,528,000	
リンガーハット	11,000.0	2,349.00	25,839,000	貸付株式数 4,300株
M r M a x H D	12,200.0	637.00	7,771,400	

テナライド	6,700.0	328.00	2,197,600	貸付株式数	3,100株
A O K Iホールディングス	15,600.0	1,052.00	16,411,200		
オークワ	13,400.0	909.00	12,180,600	貸付株式数	200株
コメリ	13,100.0	3,125.00	40,937,500	貸付株式数	5,000株
青山商事	18,100.0	1,696.00	30,697,600		
しまむら	9,900.0	14,955.00	148,054,500		
はせがわ	2,900.0	353.00	1,023,700		
高島屋	63,700.0	2,207.50	140,617,750		
松屋	14,300.0	1,049.00	15,000,700		
エイチ・ツー・オーリテイ リング	41,100.0	1,823.00	74,925,300		
近鉄百貨店	3,600.0	2,933.00	10,558,800	貸付株式数	100株 (100株)
丸井グループ	62,300.0	2,614.50	162,883,350	貸付株式数	14,100株
クレディセゾン	49,900.0	2,489.50	124,226,050		
アクシアル リテイリング	5,800.0	3,795.00	22,011,000		
井筒屋	2,600.0	382.00	993,200	貸付株式数	700株
イオン	286,700.0	3,035.00	870,134,500		
イズミ	12,800.0	4,014.00	51,379,200		
フォーバル	3,300.0	1,243.00	4,101,900	貸付株式数	1,200株
平和堂	14,100.0	2,500.00	35,250,000	貸付株式数	5,200株
フジ	13,000.0	1,825.00	23,725,000	貸付株式数	4,800株
ヤオコー	9,600.0	7,852.00	75,379,200	貸付株式数	3,800株
ゼビオホールディングス	11,600.0	1,020.00	11,832,000	貸付株式数	2,500株
ケーズホールディングス	60,000.0	1,409.50	84,570,000		
P A L T A C	13,300.0	4,856.00	64,584,800		
三谷産業	14,400.0	339.00	4,881,600		
O L Y M P I Cグループ	2,000.0	535.00	1,070,000	貸付株式数	100株
日産東京販売HD	7,200.0	478.00	3,441,600		
あおぞら銀行	49,500.0	3,194.00	158,103,000	貸付株式数	19,800株 (600株)
三菱UFJフィナンシャル G	4,930,300.0	1,324.50	6,530,182,350		
りそなホールディングス	988,500.0	877.40	867,309,900		
三井住友トラストHD	141,400.0	6,001.00	848,541,400		
三井住友フィナンシャルG	559,500.0	7,600.00	4,252,200,000		
千葉銀行	219,400.0	1,154.50	253,297,300		
群馬銀行	152,800.0	743.90	113,667,920		
武蔵野銀行	10,100.0	2,921.00	29,502,100		
千葉興業銀行	12,300.0	921.00	11,328,300		

筑波銀行	34,500.0	290.00	10,005,000	
七十七銀行	25,200.0	3,380.00	85,176,000	
秋田銀行	5,300.0	2,148.00	11,384,400	
山形銀行	8,700.0	1,217.00	10,587,900	
岩手銀行	5,400.0	2,835.00	15,309,000	
東邦銀行	62,300.0	293.00	18,253,900	貸付株式数 7,900株
東北銀行	2,500.0	1,227.00	3,067,500	
ふくおかフィナンシャルG	62,900.0	3,806.00	239,397,400	
スルガ銀行	63,000.0	652.00	41,076,000	
八十二銀行	166,300.0	905.80	150,634,540	
山梨中央銀行	8,100.0	1,723.00	13,956,300	
大垣共立銀行	15,000.0	2,231.00	33,465,000	
福井銀行	7,000.0	1,675.00	11,725,000	貸付株式数 1,500株
清水銀行	3,100.0	1,709.00	5,297,900	
富山銀行	800.0	1,916.00	1,532,800	
滋賀銀行	13,100.0	3,580.00	46,898,000	
南都銀行	11,900.0	2,881.00	34,283,900	
百五銀行	74,100.0	579.00	42,903,900	
京都銀行	24,900.0	8,687.00	216,306,300	
紀陽銀行	28,200.0	1,606.00	45,289,200	貸付株式数 7,100株
ほくほくフィナンシャルG	50,000.0	1,614.50	80,725,000	
山陰合同銀行	49,300.0	1,024.00	50,483,200	
鳥取銀行	1,700.0	1,439.00	2,446,300	
百十四銀行	7,200.0	2,612.00	18,806,400	
四国銀行	12,500.0	1,053.00	13,162,500	
阿波銀行	11,100.0	2,421.00	26,873,100	
大分銀行	4,700.0	2,814.00	13,225,800	
宮崎銀行	5,100.0	2,938.00	14,983,800	
佐賀銀行	4,600.0	2,119.00	9,747,400	
琉球銀行	18,000.0	1,167.00	21,006,000	
セブン銀行	282,100.0	326.00	91,964,600	
みずほフィナンシャルG	1,138,500.0	2,683.00	3,054,595,500	
高知銀行	1,800.0	1,139.00	2,050,200	
山口フィナンシャルG	77,300.0	1,394.50	107,794,850	
芙蓉総合リース	7,200.0	12,930.00	93,096,000	
みずほリース	11,700.0	5,120.00	59,904,000	
東京センチュリー	14,700.0	6,325.00	92,977,500	
SBIホールディングス	114,100.0	3,356.00	382,919,600	
日本証券金融	28,900.0	1,573.00	45,459,700	
アイフル	130,100.0	369.00	48,006,900	



日本アジア投資	4,100.0	275.00	1,127,500	
名古屋銀行	5,200.0	5,180.00	26,936,000	
北洋銀行	119,300.0	394.00	47,004,200	
大光銀行	1,500.0	1,400.00	2,100,000	貸付株式数 300株
愛媛銀行	10,600.0	1,032.00	10,939,200	
トマト銀行	1,700.0	1,302.00	2,213,400	
京葉銀行	36,100.0	716.00	25,847,600	
栃木銀行	36,000.0	345.00	12,420,000	
北日本銀行	2,700.0	2,452.00	6,620,400	貸付株式数 300株
東和銀行	14,400.0	657.00	9,460,800	
福島銀行	5,400.0	258.00	1,393,200	
大東銀行	2,000.0	756.00	1,512,000	貸付株式数 500株
リコーリース	7,400.0	4,685.00	34,669,000	貸付株式数 400株
イオンフィナンシャルサー ビス	45,200.0	1,338.00	60,477,600	
ア コ ム	140,100.0	370.60	51,921,060	
ジャックス	8,400.0	5,370.00	45,108,000	
オ リ コ	20,300.0	1,201.00	24,380,300	
オリックス	516,800.0	2,985.00	1,542,648,000	
三菱H C キャピタル	306,600.0	1,075.00	329,595,000	
ジャフコ グループ	26,200.0	1,785.50	46,780,100	貸付株式数 10,400株
九州 リースサービス	2,400.0	922.00	2,212,800	貸付株式数 1,200株
トモニホールディングス	63,900.0	478.00	30,544,200	
大和証券G本社	548,400.0	913.50	500,963,400	
野村ホールディングス	1,418,800.0	652.30	925,483,240	
岡三証券グループ	69,100.0	697.00	48,162,700	貸付株式数 20,900株
丸三証券	26,100.0	650.00	16,965,000	
東洋証券	26,000.0	372.00	9,672,000	
東海東京H D	85,700.0	502.00	43,021,400	
光世証券	1,200.0	671.00	805,200	貸付株式数 200株
水戸証券	21,000.0	483.00	10,143,000	
いちよし証券	14,400.0	779.00	11,217,600	
松井証券	46,600.0	860.00	40,076,000	
S O M P O ホールディング ス	135,100.0	6,886.00	930,298,600	
日本取引所グループ	221,200.0	2,651.50	586,511,800	
マネックスG	84,800.0	584.00	49,523,200	
極東証券	9,700.0	910.00	8,827,000	
岩井コスモホールディング	9,000.0	1,865.00	16,785,000	

アイザワ証券グループ	11,300.0	1,040.00	11,752,000	
フィデアホール	8,100.0	1,708.00	13,834,800	
池田泉州HD	100,700.0	329.00	33,130,300	
アニコムホールディングス	26,800.0	650.00	17,420,000	
MS&AD	160,300.0	5,803.00	930,220,900	
マネーパートナーズGP	5,300.0	300.00	1,590,000	
スパークス・グループ	8,800.0	1,554.00	13,675,200	
小林洋行	2,200.0	239.00	525,800	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	384,700.0	3,180.00	1,223,346,000	
東京海上HD	778,200.0	3,585.00	2,789,847,000	
アドバンテッジリスクマネ	2,500.0	480.00	1,200,000	
イー・ギャランティ	12,700.0	1,948.00	24,739,600	
アサックス	2,300.0	685.00	1,575,500	貸付株式数 1,300株
NECキャピタルソリューション	3,800.0	3,490.00	13,262,000	
T&Dホールディングス	211,300.0	2,594.50	548,217,850	
アドバンスクリエイト	4,600.0	1,155.00	5,313,000	貸付株式数 1,800株
三井不動産	336,000.0	3,450.00	1,159,200,000	
三菱地所	475,100.0	2,079.50	987,970,450	
平和不動産	12,800.0	4,255.00	54,464,000	
東京建物	68,800.0	2,180.50	150,018,400	
京阪神ビルディング	13,200.0	1,408.00	18,585,600	
住友不動産	142,300.0	4,085.00	581,295,500	
太平洋興発	2,000.0	820.00	1,640,000	貸付株式数 800株
テオーシー	14,200.0	655.00	9,301,000	
東京楽天地	1,300.0	4,210.00	5,473,000	貸付株式数 500株
スターツコーポレーション	11,300.0	3,085.00	34,860,500	
フジ住宅	11,100.0	769.00	8,535,900	
空港施設	9,400.0	595.00	5,593,000	
明和地所	2,500.0	1,208.00	3,020,000	
ゴールドクレスト	7,500.0	2,208.00	16,560,000	貸付株式数 800株
リログループ	45,700.0	1,649.50	75,382,150	
エスリード	3,700.0	3,255.00	12,043,500	貸付株式数 1,200株
日神グループHLDGS	12,300.0	558.00	6,863,400	貸付株式数 4,400株
日本エスコ	14,800.0	953.00	14,104,400	
MIRARTHホールディング	39,900.0	500.00	19,950,000	
AVANTIA	3,000.0	888.00	2,664,000	貸付株式数 600株
イオンモール	40,800.0	1,836.00	74,908,800	

毎日コムネット	1,900.0	774.00	1,470,600	貸付株式数	900株
ファースト住建	2,200.0	1,231.00	2,708,200	貸付株式数	900株
ランド	473,600.0	9.00	4,262,400	貸付株式数	119,600株
カチタス	21,200.0	2,237.00	47,424,400	貸付株式数	5,000株
東祥	5,700.0	1,206.00	6,874,200	貸付株式数	2,000株
トーセイ	13,100.0	2,031.00	26,606,100		
穴吹興産	1,000.0	2,052.00	2,052,000	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	13,200.0	1,554.00	20,512,800		
インテリックス	1,300.0	539.00	700,700		
ランドビジネス	1,900.0	340.00	646,000	貸付株式数	700株
サンネクスタグループ	1,500.0	977.00	1,465,500	貸付株式数	200株
グランディハウス	4,500.0	655.00	2,947,500		
東武鉄道	87,800.0	4,106.00	360,506,800		
相鉄ホールディングス	26,400.0	2,971.00	78,434,400		
東急	224,200.0	1,840.00	412,528,000	貸付株式数	1,100株
京浜急行	90,600.0	1,358.00	123,034,800		
小田急電鉄	121,200.0	2,337.00	283,244,400		
京王電鉄	42,300.0	5,343.00	226,008,900		
京成電鉄	51,500.0	5,722.00	294,683,000		
富士急行	9,800.0	5,210.00	51,058,000	貸付株式数	3,900株
東日本旅客鉄道	135,600.0	8,826.00	1,196,805,600		
西日本旅客鉄道	102,100.0	6,570.00	670,797,000		
東海旅客鉄道	61,600.0	19,425.00	1,196,580,000		
西武ホールディングス	96,600.0	1,532.50	148,039,500		
鴻池運輸	13,600.0	2,013.00	27,376,800		
西日本鉄道	21,400.0	2,598.50	55,607,900		
ハマキョウレックス	6,200.0	4,195.00	26,009,000		
サカイ引越センター	3,800.0	5,190.00	19,722,000		
近鉄グループHLDGS	79,800.0	4,441.00	354,391,800		
阪急阪神HLDGS	106,400.0	5,334.00	567,537,600		
南海電鉄	38,100.0	2,980.50	113,557,050		
京阪ホールディングス	44,000.0	4,151.00	182,644,000		
神戸電鉄	2,100.0	3,080.00	6,468,000	貸付株式数	800株
名古屋鉄道	88,200.0	2,372.00	209,210,400		
山陽電鉄	6,000.0	2,230.00	13,380,000	貸付株式数	2,300株
アルプス物流	6,300.0	1,618.00	10,193,400	貸付株式数	2,200株
トランコム	2,300.0	7,580.00	17,434,000		
ヤマトホールディングス	102,200.0	2,544.50	260,047,900		
山 九	20,300.0	5,382.00	109,254,600		
日 新	6,100.0	2,874.00	17,531,400		

丸 運	2,500.0	268.00	670,000	貸付株式数	1,300株
丸全昭和運輸	4,900.0	4,075.00	19,967,500		
センコーグループHLDGS	42,200.0	1,108.00	46,757,600		
トナミホールディングス	1,800.0	4,965.00	8,937,000		
ニッコンホールディングス	25,500.0	3,374.00	86,037,000		
日石輸送	500.0	2,808.00	1,404,000		
福山通運	6,100.0	3,830.00	23,363,000		
セイノーホールディングス	44,900.0	2,151.50	96,602,350	貸付株式数	500株
エスライングループ本社	1,500.0	886.00	1,329,000	貸付株式数	700株
神奈川中央交通	2,200.0	3,325.00	7,315,000	貸付株式数	800株
AZ-COM丸和ホールディ	19,300.0	2,144.00	41,379,200		
C&Fロジホールディングス	7,700.0	1,449.00	11,157,300	貸付株式数	800株
日本郵船	213,500.0	4,382.00	935,557,000		
商船三井	140,700.0	4,515.00	635,260,500		
川崎汽船	60,000.0	5,560.00	333,600,000	貸付株式数	23,900株
NSユナイテッド海運	4,300.0	4,380.00	18,834,000	貸付株式数	1,700株
明治海運	5,100.0	882.00	4,498,200	貸付株式数	1,000株
飯野海運	29,300.0	1,133.00	33,196,900	貸付株式数	3,700株
共栄タンカー	900.0	877.00	789,300	貸付株式数	300株
九州旅客鉄道	56,400.0	3,258.00	183,751,200		
SGホールディングス	153,100.0	2,045.00	313,089,500		
NIPPON EXPRESS	27,100.0	7,770.00	210,567,000		
ID&Eホールディングス	4,900.0	3,570.00	17,493,000		
日本航空	196,000.0	3,011.00	590,156,000		
ANAホールディングス	217,100.0	3,266.00	709,048,600		
ピーウィズ	2,100.0	2,281.00	4,790,100	貸付株式数	800株
パスコ	1,200.0	1,728.00	2,073,600		
TREホールディングス	17,400.0	1,266.00	22,028,400		
人・夢・技術グループ	3,000.0	1,755.00	5,265,000	貸付株式数	1,200株
西本WISMETTACHD	2,200.0	5,140.00	11,308,000	貸付株式数	800株
シルバーライフ	1,600.0	1,192.00	1,907,200	貸付株式数	700株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	400.0	2,021.00	808,400		

GENKY DRUG STORES	3,700.0	5,410.00	20,017,000	貸付株式数	1,300株
コア商事HLDGS	4,600.0	722.00	3,321,200	貸付株式数	1,800株
KPPグループホールディングン	19,700.0	725.00	14,282,500		
ナルミヤ・インターナショナル	900.0	1,188.00	1,069,200	貸付株式数	600株
ブックオフGHD	3,800.0	1,250.00	4,750,000	貸付株式数	1,700株
ギフトホールディングス	3,600.0	2,393.00	8,614,800		
三菱倉庫	17,200.0	4,126.00	70,967,200		
三井倉庫HOLD	7,400.0	4,400.00	32,560,000		
住友倉庫	21,500.0	2,567.00	55,190,500	貸付株式数	8,600株
渋沢倉庫	3,200.0	3,410.00	10,912,000		
ヤマタネ	3,700.0	2,081.00	7,699,700		
東陽倉庫	6,900.0	296.00	2,042,400		
乾汽船	10,100.0	1,288.00	13,008,800	貸付株式数	4,000株
日本トランスシティ	16,000.0	699.00	11,184,000		
ケイヒン	900.0	1,998.00	1,798,200		
中央倉庫	3,800.0	1,101.00	4,183,800	貸付株式数	1,400株
川西倉庫	900.0	1,121.00	1,008,900	貸付株式数	200株
安田倉庫	5,400.0	1,091.00	5,891,400		
ファイズホールディングス	1,000.0	1,153.00	1,153,000	貸付株式数	400株
大栄環境	21,000.0	2,237.00	46,977,000		
日本管財ホールディングク	8,600.0	2,642.00	22,721,200	貸付株式数	3,300株
東洋埠頭	1,500.0	1,475.00	2,212,500		
上組	38,300.0	3,244.00	124,245,200		
サンリツ	1,200.0	746.00	895,200	貸付株式数	300株
キムラユニティー	2,600.0	1,399.00	3,637,400	貸付株式数	1,000株
キューソー流通システム	2,700.0	965.00	2,605,500	貸付株式数	1,200株
東海運	3,000.0	290.00	870,000	貸付株式数	1,400株
エーアイティー	5,000.0	1,786.00	8,930,000		
内外トランスライン	3,200.0	2,585.00	8,272,000	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	1,900.0	617.00	1,172,300	貸付株式数	600株
日本コンセプト	2,900.0	1,904.00	5,521,600		
TBSホールディングス	41,100.0	2,645.00	108,709,500		
日本テレビHLD S	71,000.0	1,413.50	100,358,500		
朝日放送グループHD	7,300.0	702.00	5,124,600	貸付株式数	2,900株
テレビ朝日HD	19,500.0	1,736.00	33,852,000		
スカパーJ S A T H D	71,000.0	744.00	52,824,000		
テレビ東京HD	5,800.0	3,075.00	17,835,000	貸付株式数	2,200株

日本BS放送	1,900.0	910.00	1,729,000	貸付株式数	800株
ビジョン	12,000.0	1,550.00	18,600,000		
スマートバリュー	1,300.0	420.00	546,000	貸付株式数	600株
USEN-NEXT HL DGS	9,000.0	3,330.00	29,970,000	貸付株式数	3,300株
ワイヤレスゲート	2,300.0	217.00	499,100	貸付株式数	100株
日本通信	73,900.0	220.00	16,258,000		
クロップス	900.0	1,110.00	999,000		
日本電信電話	25,680,600.0	181.00	4,648,188,600		
KDDI	619,500.0	4,730.00	2,930,235,000		
ソフトバンク	1,288,500.0	1,760.00	2,267,760,000		
光通信	9,400.0	23,900.00	224,660,000		
エムティーアイ	5,400.0	614.00	3,315,600	貸付株式数	2,000株
GMOインターネットグ ループ	29,600.0	2,451.00	72,549,600		
ファイバーゲート	4,300.0	1,438.00	6,183,400	貸付株式数	200株
アйдママーケティングコ ミュ	2,100.0	257.00	539,700	貸付株式数	600株
KADOKAWA	42,400.0	3,185.00	135,044,000		
学研ホールディングス	13,300.0	882.00	11,730,600	貸付株式数	2,600株
ゼンリン	13,600.0	922.00	12,539,200		
昭文社ホールディングス	2,200.0	321.00	706,200		
インプレスホールディング ス	4,600.0	186.00	855,600	貸付株式数	1,800株
東京電力HD	720,600.0	698.90	503,627,340	貸付株式数	255,600株
中部電力	294,600.0	2,097.50	617,923,500		
関西電力	308,700.0	2,344.00	723,592,800		
中国電力	127,300.0	1,039.00	132,264,700		
北陸電力	75,500.0	923.20	69,701,600		
東北電力	195,400.0	1,110.50	216,991,700		
四国電力	68,200.0	1,112.50	75,872,500		
九州電力	184,300.0	1,073.00	197,753,900		
北海道電力	77,200.0	722.50	55,777,000		
沖縄電力	18,700.0	1,246.00	23,300,200	貸付株式数	3,100株
電源開発	60,200.0	2,584.00	155,556,800		
エフオン	5,300.0	510.00	2,703,000		
イーレックス	14,200.0	847.00	12,027,400	貸付株式数	5,600株
レノバ	21,300.0	1,254.00	26,710,200	貸付株式数	8,500株
東京瓦斯	169,000.0	3,562.00	601,978,000		
大阪瓦斯	161,900.0	2,565.00	415,273,500		

東邦瓦斯	31,500.0	2,787.50	87,806,250	
北海道瓦斯	4,800.0	2,446.00	11,740,800	貸付株式数 1,000株
広島ガス	16,800.0	413.00	6,938,400	
西部ガスHLDGS	7,500.0	2,113.00	15,847,500	
静岡ガス	15,900.0	1,073.00	17,060,700	
メタウォーター	9,400.0	1,926.00	18,104,400	
アイネット	4,800.0	1,761.00	8,452,800	貸付株式数 1,600株
松竹	4,600.0	10,995.00	50,577,000	
東宝	50,100.0	5,443.00	272,694,300	
エイチ・アイ・エス	23,800.0	1,776.00	42,268,800	貸付株式数 9,500株
東映	2,200.0	20,020.00	44,044,000	
ラックランド	3,800.0	3,030.00	11,514,000	貸付株式数 1,400株
NTTデータグループ	251,500.0	2,157.00	542,485,500	
共立メンテナンス	14,100.0	6,338.00	89,365,800	貸付株式数 5,600株
イチネンホールディングス	8,900.0	1,405.00	12,504,500	
建設技術研究所	4,300.0	4,670.00	20,081,000	
スペース	5,200.0	937.00	4,872,400	
アインホールディングス	11,600.0	4,601.00	53,371,600	
燦ホールディングス	3,400.0	2,141.00	7,279,400	
ピー・シー・エー	4,600.0	1,266.00	5,823,600	
スバル興業	300.0	11,920.00	3,576,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	2,000.0	1,142.00	2,284,000	貸付株式数 1,000株
タナベコンサルティンググループ	2,200.0	1,173.00	2,580,600	
ビジネスB太田昭和	3,400.0	2,149.00	7,306,600	
ナガワ	2,200.0	7,160.00	15,752,000	貸付株式数 800株
東京都競馬	6,900.0	3,970.00	27,393,000	貸付株式数 1,700株
常磐興産	1,800.0	1,363.00	2,453,400	貸付株式数 1,000株
カナモト	12,800.0	2,638.00	33,766,400	
DTS	17,100.0	3,355.00	57,370,500	
スクウェア・エニックス・HD	40,300.0	5,301.00	213,630,300	
シーイーシー	11,200.0	1,683.00	18,849,600	
カプコン	79,700.0	5,637.00	449,268,900	
ニシオホールディングス	7,600.0	3,605.00	27,398,000	貸付株式数 1,000株
アイ・エス・ビー	4,100.0	1,445.00	5,924,500	貸付株式数 1,200株
アゴーラホスピタリティーG	34,500.0	26.00	897,000	貸付株式数 15,600株
日本空港ビルデング	27,800.0	6,585.00	183,063,000	
トランス・コスモス	10,200.0	3,200.00	32,640,000	貸付株式数 3,200株

乃村工藝社	36,100.0	894.00	32,273,400		
ジャステック	4,900.0	1,485.00	7,276,500	貸付株式数	1,900株 (500株)
S C S K	65,400.0	2,659.50	173,931,300		
藤田観光	3,300.0	5,130.00	16,929,000	貸付株式数	1,100株
K N T - C Tホールディングス	4,900.0	1,364.00	6,683,600	貸付株式数	1,900株
トーカイ	7,400.0	1,955.00	14,467,000		
白 洋 舎	800.0	2,584.00	2,067,200	貸付株式数	100株
セコム	83,700.0	10,385.00	869,224,500		
N S W	3,100.0	2,888.00	8,952,800		
セントラル警備保障	4,500.0	3,205.00	14,422,500	貸付株式数	200株
アイネス	5,600.0	1,663.00	9,312,800		
丹青社	15,700.0	938.00	14,726,600		
メイテック	32,200.0	2,586.50	83,285,300		
T K C	12,800.0	3,665.00	46,912,000		
富士ソフト	16,100.0	4,800.00	77,280,000	貸付株式数	800株
応用地質	7,700.0	2,563.00	19,735,100		
船井総研ホールディング	17,200.0	2,744.00	47,196,800		
N S D	28,600.0	2,583.00	73,873,800		
進学会ホールディングス	1,800.0	293.00	527,400	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	600.0	2,821.00	1,692,600		
オ オ バ	3,600.0	943.00	3,394,800	貸付株式数	1,300株
コナミグループ	34,300.0	8,362.00	286,816,600		
いであ	1,600.0	1,700.00	2,720,000	貸付株式数	200株
学 究 社	3,200.0	2,065.00	6,608,000		
ベネッセホールディングス	30,600.0	1,884.50	57,665,700		
イオンディライト	9,200.0	3,295.00	30,314,000	貸付株式数	3,200株
ナック	3,900.0	984.00	3,837,600	貸付株式数	1,200株
福井コンピュータH L D S	5,600.0	2,715.00	15,204,000		
ダイセキ	16,800.0	4,270.00	71,736,000		
ステップ	2,900.0	1,777.00	5,153,300	貸付株式数	1,100株
泉州電業	4,200.0	3,300.00	13,860,000	貸付株式数	1,600株
元気寿司	2,400.0	5,150.00	12,360,000	貸付株式数	900株
トラスコ中山	17,800.0	2,546.00	45,318,800		
ヤマダホールディングス	347,500.0	467.80	162,560,500		
オートバックスセブン	29,700.0	1,593.50	47,326,950		
モリト	6,000.0	1,375.00	8,250,000		
アー克蘭ズ	25,400.0	1,617.00	41,071,800		
ニトリホールディングス	34,200.0	17,280.00	590,976,000		



グルメ杵屋	7,000.0	1,134.00	7,938,000	貸付株式数	2,700株
愛眼	4,800.0	184.00	883,200	貸付株式数	1,800株
ケーユーホールディングス	4,900.0	1,271.00	6,227,900		
吉野家ホールディングス	33,200.0	2,893.00	96,047,600	貸付株式数	13,200株
加藤産業	10,500.0	4,265.00	44,782,500		
北恵	1,400.0	908.00	1,271,200		
イノテック	5,300.0	1,650.00	8,745,000		
イエローハット	15,100.0	1,933.00	29,188,300		
松屋フーズHLDGS	4,100.0	4,260.00	17,466,000	貸付株式数	600株
JBCホールディングス	5,800.0	2,773.00	16,083,400		
JKホールディングス	6,300.0	1,011.00	6,369,300		
サガミホールディングス	13,700.0	1,350.00	18,495,000	貸付株式数	5,200株
日伝	5,000.0	2,628.00	13,140,000	貸付株式数	1,800株
関西フードマーケット	7,600.0	1,520.00	11,552,000		
ミロク情報サービス	7,300.0	1,612.00	11,767,600	貸付株式数	2,700株
北沢産業	2,900.0	313.00	907,700	貸付株式数	1,400株
杉本商事	3,700.0	2,290.00	8,473,000	貸付株式数	400株
因幡電機産業	22,000.0	3,335.00	73,370,000		
王将フードサービス	5,600.0	6,990.00	39,144,000	貸付株式数	1,800株
ミニストップ	6,100.0	1,452.00	8,857,200	貸付株式数	2,400株
アークス	15,500.0	2,732.00	42,346,000		
パローホールディングス	16,100.0	2,201.00	35,436,100		
東テック	2,800.0	5,430.00	15,204,000		
ミスミグループ本社	127,700.0	2,456.00	313,631,200		
アルテック	2,900.0	262.00	759,800		
ベルク	4,200.0	6,890.00	28,938,000		
大庄	3,100.0	1,152.00	3,571,200	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	1,400.0	1,244.00	1,741,600	貸付株式数	700株
ファーストリテイリング	38,100.0	34,740.00	1,323,594,000	貸付株式数	15,200株
ソフトバンクグループ	395,500.0	6,497.00	2,569,563,500		
蔵王産業	900.0	2,621.00	2,358,900		
スズケン	24,800.0	4,498.00	111,550,400		
サンドラッグ	32,100.0	4,252.00	136,489,200		
サクスパーホールディング	8,100.0	943.00	7,638,300		
ジェコス	4,900.0	980.00	4,802,000		
ヤマザワ	1,000.0	1,287.00	1,287,000		
やまや	1,300.0	3,100.00	4,030,000	貸付株式数	600株
グローセル	6,800.0	438.00	2,978,400		

ペルーナ	20,600.0	750.00	15,450,000	
合計			275,855,624,477	

(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(2023年9月20日から2024年3月19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 2024年3月19日現在
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	2,201,858
親投資信託受益証券	447,374,013
未収入金	4,537,000
流動資産合計	454,112,871
資産合計	454,112,871
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	5,749,195
未払受託者報酬	67,638
未払委託者報酬	879,792
その他未払費用	11,180
流動負債合計	6,707,805
負債合計	6,707,805
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	191,381,485
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	256,023,581
(分配準備積立金)	32,914,229
元本等合計	447,405,066
純資産合計	447,405,066
負債純資産合計	454,112,871

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年9月20日
	至 2024年3月19日
営業収益	
有価証券売買等損益	60,474,291
営業収益合計	60,474,291
営業費用	
支払利息	24
受託者報酬	67,638
委託者報酬	879,792
その他費用	11,180
営業費用合計	958,634
営業利益又は営業損失（ ）	59,515,657
経常利益又は経常損失（ ）	59,515,657
中間純利益又は中間純損失（ ）	59,515,657
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（ ）	7,686,199
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	187,558,323
剰余金増加額又は欠損金減少額	145,530,078
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	145,530,078
剰余金減少額又は欠損金増加額	128,894,278
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	128,894,278
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	256,023,581

## (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2023年9月20日 至2024年3月19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 2024年3月19日現在
1. 1 期首元本額	179,084,088円
期中追加設定元本額	137,235,458円
期中一部解約元本額	124,938,061円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	191,381,485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2023年9月20日 至2024年3月19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 2024年3月19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 2024年3月19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 2024年3月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,3378円 (23,378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

	2024年3月19日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,631,324,234
株式	23 334,169,891,650
派生商品評価勘定	42,231,400
未収入金	1,987,300
未収配当金	468,743,151
未収利息	448,699

その他未収収益	4	10,481,964
流動資産合計		347,325,108,398
資産合計		347,325,108,398
負債の部		
流動負債		
前受金		22,110,000
未払解約金		767,957,970
受入担保金		7,944,669,514
流動負債合計		8,734,737,484
負債合計		8,734,737,484
純資産の部		
元本等		
元本	1	171,239,610,857
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		167,350,760,057
元本等合計		338,590,370,914
純資産合計		338,590,370,914
負債純資産合計		347,325,108,398

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年9月20日 至2024年3月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引



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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年3月19日現在
1. 1 期首	2023年9月20日
期首元本額	162,050,849,324円
期中追加設定元本額	17,864,946,744円
期中一部解約元本額	8,676,185,211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	2,789,498,424円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	4,221,661,290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	909,416円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	11,494,528円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	151,871,960円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	12,849,175円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	363,379,215円
国内株式ファンド(適格機関投資家専用)	846,585,590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)	693,478,163円
D-I's TOPIXインデックス	13,665,865円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	237,425,994円
iFree TOPIXインデックス	7,598,021,469円
iFree 8資産バランス	4,600,674,438円
iFree 年金バランス	1,026,306,017円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	2,283,463円
DCダイワ日本株式インデックス	71,302,766,180円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,053,490,173円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,955,559,058円

ダイワ・ライフ・バランス70	5,831,056,196円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,503,612,571円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	46,798,488円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	72,693,139円
ダイワつみたてインデックス日本株式	5,291,356,118円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,570,720円
ダイワつみたてインデックスバランス50	12,193,693円
ダイワつみたてインデックスバランス70	30,559,223円
ダイワ国内株式インデックス(ラップ専用)	14,478,388,323円
ダイワ世界バランスファンド40VA	49,260,698円
ダイワ世界バランスファンド60VA	19,683,241円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,409,714,161円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	335,464,120円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	50,467,802円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	61,341,451円
ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	226,255,001円
ダイワファンドラップTOPIXインデックス	12,072,910,018円
ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	6,625,041,182円
ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス	3,198,211,191円
スタイル9(4資産分散・保守型)	164,673円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	1,157,651円
スタイル9(4資産分散・積極型)	1,552,611円
スタイル9(6資産分散・保守型)	114,883円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	2,086,980円
スタイル9(6資産分散・積極型)	2,475,932円
スタイル9(8資産分散・保守型)	143,736円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	1,636,814円
スタイル9(8資産分散・積極型)	4,867,972円
ダイワ・インデックスセレクトTOPIX	1,084,838,592円
ダイワライフスタイル25	97,864,887円
ダイワライフスタイル50	458,557,070円
ダイワライフスタイル75	388,997,677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)	7,985,653,625円
計	171,239,610,857円
2. 期末日における受益権の総数	171,239,610,857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 7,761,759,220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 750,010,000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	2024年3月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種類	2024年3月19日現在		
	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)
		うち 1年超 (円)	
市場取引			
株価指数			
先物取引			

買建	4,087,525,000	-	4,129,840,000	42,315,000
合計	4,087,525,000	-	4,129,840,000	42,315,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2024年3月19日現在
1口当たり純資産額	1.9773円
(1万口当たり純資産額)	(19,773円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2024年3月29日

資産総額	466,338,459円
負債総額	5,207,963円
純資産総額（ - ）	461,130,496円
発行済数量	194,223,149口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.3742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

2024年3月29日

資産総額	351,996,267,769円
負債総額	6,868,591,146円
純資産総額（ - ）	345,127,676,623円
発行済数量	171,840,632,066口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.0084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

2024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年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. リスクマネジメント会議



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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2024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	87	291,304
追加型株式投資信託	798	29,461,519
株式投資信託 合計	885	29,752,823
単位型公社債投資信託	98	178,379
追加型公社債投資信託	14	1,544,340
公社債投資信託 合計	112	1,722,719
総合計	997	31,475,542

## 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64期事業年度（2022年4月1日から2023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65期事業年度に係る中間会計期間（2023年4月1日から2023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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	3,168	1,982
有価証券	486	346
前払費用	332	393
未収委託者報酬	13,811	12,525
未収収益	52	47
関係会社短期貸付金	24,900	22,100
その他	45	59
<b>流動資産計</b>	<b>42,799</b>	<b>37,455</b>
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	196
建物	4	3
器具備品	198	193
無形固定資産	1,770	1,482
ソフトウェア	1,738	1,351
ソフトウェア仮勘定	31	131
投資その他の資産	16,617	13,824

投資有価証券	10,755	8,260
関係会社株式	3,705	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,067	1,066
繰延税金資産	885	824
その他	26	20
固定資産計	18,591	15,503
資産合計	61,390	52,959

(単位:百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	65	101
未払金	9,856	5,874
未払収益分配金	26	38
未払償還金	12	12
未払手数料	4,917	4,525
その他未払金	2	1,297
未払費用	4,246	3,987
未払法人税等	980	560
未払消費税等	1,016	327
賞与引当金	866	692
その他	2	2
流動負債計	17,033	11,545
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,399	2,276
役員退職慰労引当金	13	51
その他	1	0
固定負債計	2,415	2,329
負債合計	19,449	13,874
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495

利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,925	11,505
利益剰余金合計	14,299	11,879
株主資本合計	40,969	38,549
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	971	534
評価・換算差額等合計	971	534
純資産合計	41,941	39,084
負債・純資産合計	61,390	52,959

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	74,402	69,845
その他営業収益	545	559
営業収益計	74,948	70,405
営業費用		
支払手数料	31,234	29,405
広告宣伝費	650	662
調査費	9,104	9,638
調査費	1,252	1,469
委託調査費	7,851	8,169
委託計算費	1,729	1,783
営業雑経費	2,051	1,658
通信費	189	181
印刷費	468	468
協会費	46	51
諸会費	15	17
その他営業雑経費	1,331	939
営業費用計	44,768	43,147
一般管理費		
給料	5,948	5,788
役員報酬	306	317
給料・手当	4,281	4,369
賞与	493	409
賞与引当金繰入額	866	692

福利厚生費	867	874
交際費	46	66
旅費交通費	48	95
租税公課	527	476
不動産賃借料	1,300	1,300
退職給付費用	408	488
役員退職慰労引当金繰入額	10	38
固定資産減価償却費	606	625
諸経費	1,864	2,193
一般管理費計	11,628	11,946
営業利益	18,551	15,310

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	327	286
有価証券償還益	40	150
その他	264	171
営業外収益計	631	608
営業外費用		
投資有価証券売却損	59	244
有価証券償還損	0	2
その他	34	31
営業外費用計	93	277
経常利益	19,089	15,642
特別損失		
関係会社整理損失	-	229
投資有価証券評価損	331	257
特別損失計	331	486
税引前当期純利益	18,757	15,155
法人税、住民税及び事業税	5,950	4,589
法人税等調整額	69	248
法人税等合計	6,019	4,838
当期純利益	12,738	10,317

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 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		
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	14,298	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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 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		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 12,737	△ 12,737	△ 12,737
当期純利益	-	-	-	10,317	10,317	10,317
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△ 2,419	△ 2,419	△ 2,419
当期末残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 12,737
当期純利益	-	-	10,317
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△ 436	△ 436	△ 436
当期変動額合計	△ 436	△ 436	△ 2,856
当期末残高	534	534	39,084

## 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	15～18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。

## (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)

## (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。）を当事業年度の期首から適用し、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。この変更による当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載してありません。

## (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	当事業年度
(2022年3月31日)	(2023年3月31日)



建物	37百万円	38百万円
器具備品	283百万円	296百万円

## 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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
未払金	4,694百万円	1,178百万円

## 3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(2023年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,112百万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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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
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

## （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

2023年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	10,316百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,955円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023年6月27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グループ通算制度における通算親法人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。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（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
有価証券及び投資有価証券	66	-	-	66
資産合計	66	-	-	66

### 当事業年度（2023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
有価証券及び投資有価証券	57	7,882	-	7,939
資産合計	57	7,882	-	7,939

## (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

## 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。

(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	1,448
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（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、記載しておりません。

当事業年度（2023年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 1,448百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度(2023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	57	55	1
(2) その他	5,084	3,923	1,161
小計	5,141	3,978	1,163
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,798	3,190	392
小計	2,798	3,190	392
合計	7,939	7,168	771

(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 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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	2,359	296	244
合計	2,359	296	244

### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について331百万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257百万円、関係会社株式について229百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,452百万円	2,399百万円
勤務費用	152	150
退職給付の支払額	303	322
その他	98	48
退職給付債務の期末残高	2,399	2,276

### (2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,399百万円	2,276百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,399	2,276
退職給付引当金	2,399	2,276
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,399	2,276

### (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	152百万円	150百万円
その他	67	153
確定給付制度に係る退職給付費用	219	303

(注) その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

## 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189百万円、当事業年度184百万円であります。

### (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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	734	697
賞与引当金	227	182
投資有価証券評価損	144	177
関係会社株式評価損	-	155
未払事業税	213	114
出資金評価損	94	94
システム関連費用	111	68
その他	437	309
繰延税金資産小計	1,963	1,799
評価性引当額	356	459
繰延税金資産合計	1,607	1,339
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	562	356
連結法人間取引(譲渡益)	159	159
繰延税金負債合計	722	515
繰延税金資産の純額	885	824

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(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。

当事業年度(2023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。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「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)に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(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69,845百万円、その他559百万円であります。

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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)	17,100  0	関係会社短期貸付金  受取利息関係会社	22,100  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 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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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)	2,112	-	-

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 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せん。

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3) 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	証券投資信託の代行手数料 (注2)	13,072	未払手数料	2,663
						本社ビルの管理	不動産の賃借料 (注3)	1,062	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	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)	883	未払費用	81

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3) 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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,078.50円	1株当たり純資産額	14,983.42円
1株当たり当期純利益	4,883.43円	1株当たり当期純利益	3,955.35円

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

当期純利益（百万円）	12,738	10,317
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 (2023年9月30日)	
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		2,879
有価証券		110
未収委託者報酬		14,148
関係会社短期貸付金		17,800
その他		629
流動資産合計		35,568
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	184
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		1,009
その他		203
無形固定資産合計		1,213
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		8,477
関係会社株式		3,475
繰延税金資産		628
その他		1,216
投資その他の資産合計		13,797
固定資産合計		15,196
資産合計		50,764

（単位：百万円）

当中間会計期間  
(2023年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	5,255
未払費用	4,567
未払法人税等	2,453
賞与引当金	727
その他	2 725
流動負債合計	13,864
固定負債	
退職給付引当金	2,228
役員退職慰労引当金	58
固定負債合計	2,287
負債合計	16,152
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	6,594
利益剰余金合計	6,968
株主資本合計	33,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	973
評価・換算差額等合計	973
純資産合計	34,612
負債・純資産合計	50,764

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間
	(自 2023年4月1日
	至 2023年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	36,557

その他営業収益		322
営業収益合計		36,879
営業費用		
支払手数料		15,250
その他営業費用		7,380
営業費用合計		22,631
一般管理費	1	6,087
営業利益		8,160
営業外収益	2	128
営業外費用	3	116
経常利益		8,172
特別利益		-
特別損失	4	258
税引前中間純利益		7,914
法人税、住民税及び事業税		2,505
法人税等調整額		2
中間純利益		5,405

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	10,316	10,316	10,316
中間純利益	-	-	-	5,405	5,405	5,405
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	-	-	-	4,910	4,910	4,910
合計						
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,594	6,594	33,638

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	534	534	39,084
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	10,316
中間純利益	-	-	5,405
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	438	438	438
当中間期変動額合計	438	438	4,472
当中間期末残高	973	973	34,612

## 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。

### 5. グループ通算制度の適用

当社は、株式会社大和証券グループ本社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しております。

#### (中間貸借対照表関係)

#### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2023年9月30日現在)
有形固定資産	340百万円

#### 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（2023年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,299百万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 2023年 4月 1日 至 2023年 9月30日)
有形固定資産	10百万円
無形固定資産	230百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2023年 4月 1日 至 2023年 9月30日)
投資有価証券売却益	35百万円
有価証券償還益	32百万円
雑収入	32百万円
受取配当金	25百万円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2023年 4月 1日 至 2023年 9月30日)
有価証券償還損	103百万円

## 4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2023年 4月 1日 至 2023年 9月30日)
ソフトウェア除却損	153百万円
投資有価証券評価損	104百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2023年 4月 1日 至 2023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
2023年6月26日 定時株主総会	普通株式	10,316	3,955	2023年 3月31日	2023年 6月27日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2023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	111	7,809	-	7,921
資産合計	111	7,809	-	7,921

## (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。

（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	666
子会社株式	1,448
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2023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 1,448百万円）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	111	55	56
（2）その他	5,511	3,839	1,672
小計	5,623	3,894	1,728
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	2,297	2,623	325
小計	2,297	2,623	325
合計	7,921	6,518	1,403

（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36,557百万円、その他322百万円であります。

（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 2023年4月1日 至 2023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 2023年4月1日 至 2023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 2023年4月1日 至 2023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 2023年4月1日 至 2023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 2023年4月1日 至 2023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 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,268.89円
1株当たり中間純利益	2,072.34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 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,405
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,405
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

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

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

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名 称	資本金の額 (2023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**

2023年5月26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

**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2023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。

**独立監査人の監査報告書**

2023年11月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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2022年9月21日から2023年9月19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2023年9月19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**

2023年11月27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	渡部 啓太

**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2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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2023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（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

#### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係



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

以 上

(注) 1. 上記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**

2024年5月17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	秋山 範之
--------------------	-------	-------

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2023年9月20日から2024年3月19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2024年3月19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（2023年9月20日から2024年3月19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。