

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2025年2月13日提出
【計算期間】	第3計算期間 (自 2023年11月21日 至 2024年11月20日)
【ファンド名】	ダイワ国内株式インデックス(ラップ専用)
【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
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【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	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般		日本		日経225
大型株	年2回	北米	ファミリー ファンド	
中小型株	年4回	欧州		
債券	年6回 (隔月)	アジア		TOPIX
一般		オセアニア		
公債	年12回 (毎月)	中南米		
社債		アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ()
その他債券 クレジット属性 ()	日々	中近東 (中東)		
不動産投信	その他 ()	エマージング		
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、2,500億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 当ファンドは、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。

- ・当ファンドの購入の申込みを行なう投資者は、販売会社と投資一任契約の資産を管理する口座に関する契約および投資一任契約を締結する必要があります。

2 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^(注)を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるTOPIX（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

TOPIXは、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・ベンチマークです。浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

・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、ファンドの特色2.の運用が行なわれないことがあります。

分配方針

毎年11月20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。

（注）第1計算期間は、2022年11月20日（休業日の場合翌営業日）までとします。

〔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。
- 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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ざして運用を行ないます。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2021年11月19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 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。

< 委託会社の概況（2024年11月末日現在） >

・ 資本金の額 414億2,454万1,896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
- 2024年10月 1日 株式会社かんぼ生命保険と資本業務提携

・ 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	% 80.00
株式会社かんぼ生命保険	東京都千代田区大手町二丁目3番1号	株 652,132	% 20.00

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。

二．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および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに前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、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

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

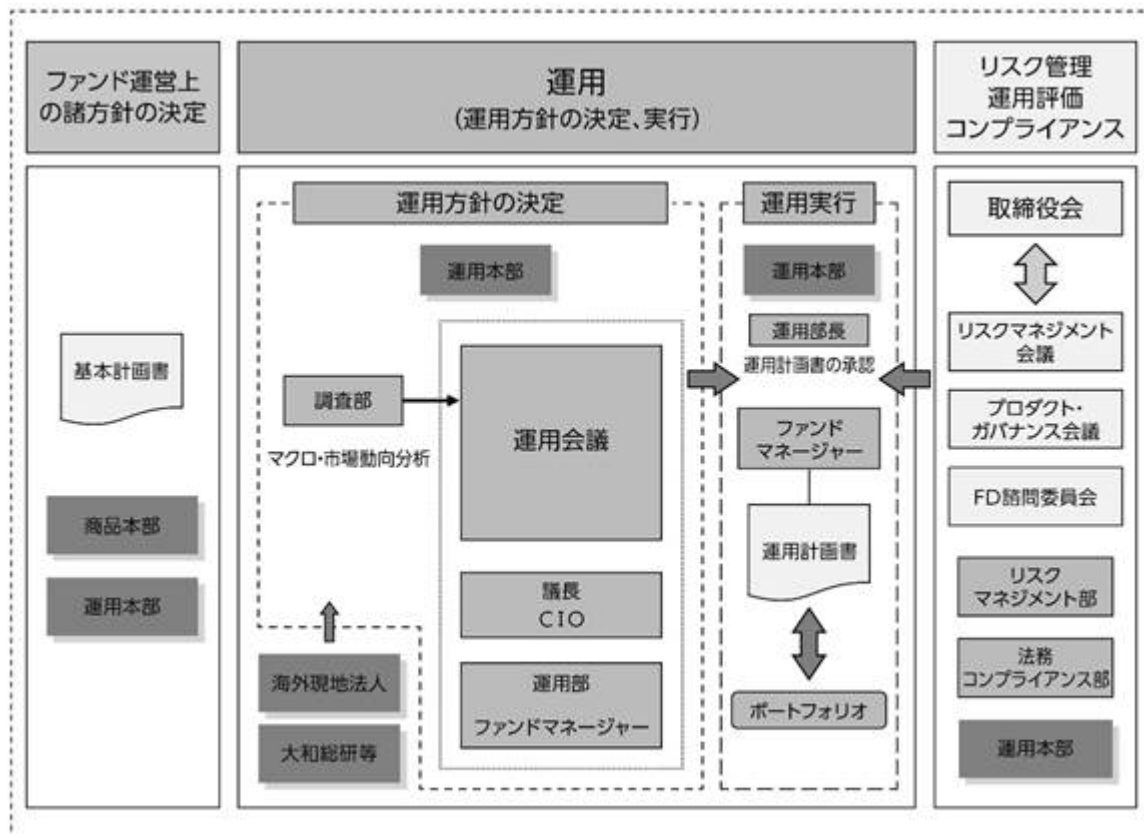
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO (Chief Investment Officer) (1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．Deputy-CIO (0~5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー (0~5名程度)

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

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10～20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。

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11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

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。

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、

信用取引(信託約款)

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

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。))の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債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。

ニ．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。

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

デリバティブ取引等(信託約款)

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

有価証券の貸付け(信託約款)

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

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

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

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

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

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

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への投資は、行ないません。

信用リスク集中回避（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

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

(1) 投資方針

投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への投資には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の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あるときは、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付け、ご換金の申込みを取消することがあります。

ご換金の申込み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け付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

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

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

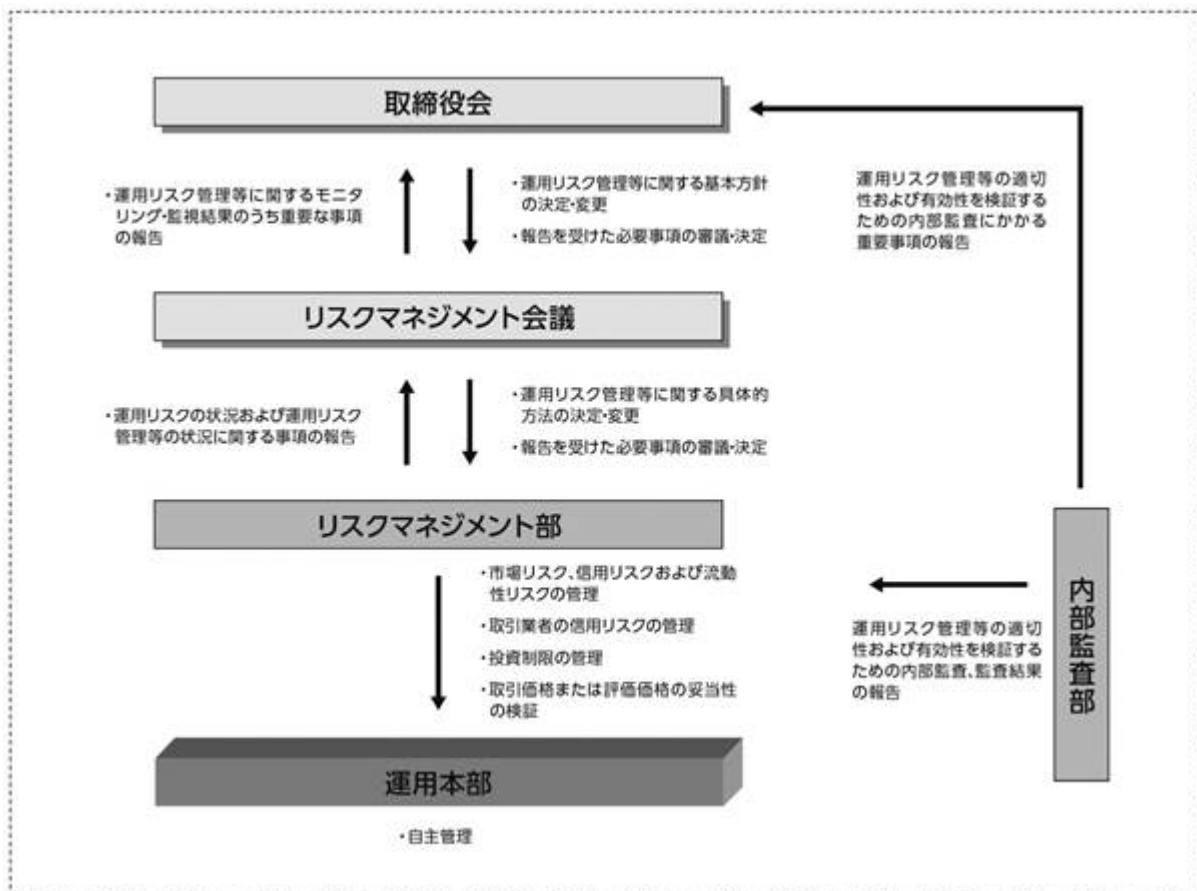
流動性リスクに関する事項

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

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受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。

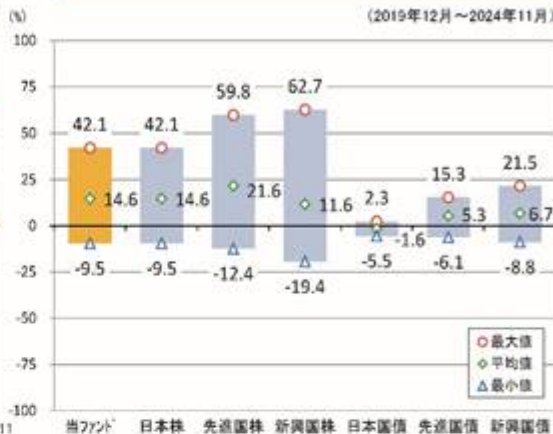
参考情報

- 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年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

日本株：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」）が発売した指数です。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認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

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0.088%（税抜0.08%）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します。

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

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0.05%（税抜）	年率0.01%（税抜）	年率0.02%（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11月末日現在のものですので、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11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	46,099,699,495	99.99
内 日本	46,099,699,495	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,072,718	0.01
純資産総額	46,102,772,213	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11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	23,415,125,709	1.9817 46,403,009,021	1.9688 46,099,699,495	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 (2022年11月21日)	2,475,730,253	2,475,730,253	0.9944	0.9944
第2計算期間末 (2023年11月20日)	18,539,698,963	18,539,698,963	1.2251	1.2251
2023年11月末日	19,248,647,199	-	1.2263	-
12月末日	21,366,990,294	-	1.2236	-
2024年1月末日	24,668,962,756	-	1.3191	-
2月末日	27,272,829,314	-	1.3838	-
3月末日	29,339,076,365	-	1.4450	-
4月末日	31,121,844,957	-	1.4321	-
5月末日	34,665,335,785	-	1.4483	-
6月末日	37,879,395,539	-	1.4692	-
7月末日	39,833,096,674	-	1.4612	-
8月末日	40,774,770,788	-	1.4191	-
9月末日	40,820,801,919	-	1.3969	-
10月末日	43,953,583,309	-	1.4231	-
第3計算期間末 (2024年11月20日)	45,643,196,107	45,643,196,107	1.4250	1.4250
11月末日	46,102,772,213	-	1.4156	-

【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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.6
第2計算期間	23.2
第3計算期間	16.3

(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	2,497,411,371	8,689,291
第2計算期間	13,509,487,342	865,419,427
第3計算期間	19,150,672,079	2,254,612,325

(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11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	386,441,571,580	96.98
内 日本	386,441,571,580	96.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,036,862,571	3.02
純資産総額	398,478,434,151	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)	11,894,760,000	2.99
内 日本	11,894,760,000	2.99

(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11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	5,357,700	2,613.52 14,002,497,343	2,551.50 13,670,171,550	3.43

2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	6,510,000	1,465.39 9,539,742,848	1,792.00 11,665,920,000	2.93
3	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3,529,500	2,647.75 9,345,242,114	3,007.00 10,613,206,500	2.66
4	日立	日本	株式	電気機器	2,621,200	3,691.57 9,676,350,382	3,751.00 9,832,121,200	2.47
5	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	808,400	9,238.05 7,468,039,972	10,385.00 8,395,234,000	2.11
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,070,800	3,004.90 6,222,550,616	3,686.00 7,632,968,800	1.92
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	100,800	67,322.88 6,786,146,427	64,720.00 6,523,776,000	1.64
8	任天堂	日本	株式	その他製 品	636,300	7,694.32 4,895,899,516	8,810.00 5,605,803,000	1.41
9	東京海上HD	日本	株式	保険業	969,100	5,218.49 5,057,245,639	5,564.00 5,392,072,400	1.35
10	伊藤忠	日本	株式	卸売業	716,800	7,671.05 5,498,615,332	7,384.00 5,292,851,200	1.33
11	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,339,800	2,861.08 3,833,278,876	3,784.00 5,069,803,200	1.27
12	信越化学	日本	株式	化学	905,300	5,759.99 5,214,519,085	5,554.00 5,028,036,200	1.26
13	三菱商事	日本	株式	卸売業	1,970,800	2,881.50 5,678,872,980	2,525.50 4,977,255,400	1.25
14	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	213,300	23,078.31 4,922,605,255	23,310.00 4,972,023,000	1.25
15	三井物産	日本	株式	卸売業	1,566,800	2,948.76 4,620,118,717	3,136.00 4,913,484,800	1.23
16	日本電信電話	日本	株式	情報・通信 業	30,067,400	150.17 4,515,305,675	153.40 4,612,339,160	1.16
17	第一三共	日本	株式	医薬品	954,000	4,946.64 4,719,099,405	4,749.00 4,530,546,000	1.14
18	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	498,600	8,437.73 4,207,055,021	8,936.00 4,455,489,600	1.12
19	三菱重工業	日本	株式	機械	1,780,100	1,878.02 3,343,068,954	2,197.50 3,911,769,750	0.98
20	HOYA	日本	株式	精密機器	196,900	19,287.41 3,797,691,897	19,260.00 3,792,294,000	0.95
21	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	743,500	4,816.04 3,580,732,437	4,950.00 3,680,325,000	0.92

22	武田薬品	日本	株式	医薬品	899,400	4,262.42 3,833,621,739	4,083.00 3,672,250,200	0.92
23	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	16,175,000	197.15 3,188,914,278	193.10 3,123,392,500	0.78
24	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,388,000	1,542.14 3,682,637,047	1,291.50 3,084,102,000	0.77
25	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	1,178,000	2,171.53 2,558,070,508	2,604.00 3,067,512,000	0.77
26	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	60,000	46,143.69 2,768,621,799	51,110.00 3,066,600,000	0.77
27	富士通	日本	株式	電気機器	936,700	2,918.30 2,733,573,190	2,866.00 2,684,582,200	0.67
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,035,400	2,258.94 2,338,909,022	2,547.00 2,637,163,800	0.66
29	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	317,600	6,520.96 2,071,059,586	8,240.00 2,617,024,000	0.66
30	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	603,000	4,100.98 2,472,895,699	4,219.00 2,544,057,000	0.64

(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	96.98%
合計	96.98%

(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	0.25%
建設業	2.11%
食料品	3.07%
繊維製品	0.40%
パルプ・紙	0.13%
化学	5.18%
医薬品	4.45%
石油・石炭製品	0.53%
ゴム製品	0.56%
ガラス・土石製品	0.65%

鉄鋼	0.80%
非鉄金属	0.80%
金属製品	0.48%
機械	5.38%
電気機器	16.81%
輸送用機器	6.74%
精密機器	2.35%
その他製品	2.54%
電気・ガス業	1.26%
陸運業	2.31%
海運業	0.63%
空運業	0.34%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.41%
卸売業	6.54%
小売業	4.51%
銀行業	8.53%
証券、商品先物取引業	0.86%
保険業	3.21%
その他金融業	1.19%
不動産業	1.73%
サービス業	4.99%
合計	96.98%

(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 0612月	買建	444	11,887,991,350	11,894,760,000	2.99%

(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

●ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）

2024年11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	14,156円
純資産総額	461億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.5%
3カ月間	-0.2%
6カ月間	-2.3%
1年間	15.4%
3年間	49.5%
5年間	-
設定来	41.6%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：0円

設定来分配金合計額：0円

決算期	第1期 22年11月	第2期 23年11月	第3期 24年11月						
分配金	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	2,099	97.0%	電気機器	16.8%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.4%
国内株式先物	1	3.0%	銀行業	8.5%	TOPIX 先物 0612月	-	3.0%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	7.4%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.9%
コール・ローン、その他		3.0%	輸送用機器	6.7%	ソニーグループ	電気機器	2.7%
合計	2,100	-	卸売業	6.5%	日立	電気機器	2.5%
株式 市場・上場別構成			機械	5.4%	リクルートホールディングス	サービス業	2.1%
東証プライム市場		96.6%	化学	5.2%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.9%
東証スタンダード市場		0.4%	サービス業	5.0%	キーエンス	電気機器	1.6%
東証グロス市場		0.0%	小売業	4.5%	任天堂	その他製品	1.4%
地方市場・その他		-	その他	30.9%	東京海上HD	保険業	1.4%
合計		97.0%	合計	97.0%	合計		22.9%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数（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。

・2021年※は設定日(11月19日)から年末、2024年は11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
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	0.09%	0.09%	0.01%

※対象期間は2023年11月21日～2024年11月20日です。

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

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（当初自己設定については1万口当たり1万円）です。

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

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、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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

2【換金（解約）手続等】

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） 0120-106338（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るほか、すでに受け付けた一部解約請求を取消することができるものとします。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、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、当該計算日の基準価額とします。

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

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） 0120-106338（営業日の9:00～17:00）

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。ただし、第1計算期間は、2021年11月19日から2022年11月20日までとします。

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

(5)【その他】

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

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

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

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

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

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

公告

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

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

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

関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

< 収益分配金および償還金にかかる請求権 >

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

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

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

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

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

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

< 換金請求権 >

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2023年11月21日から2024年11月20日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2023年11月20日現在	第3期 2024年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,685,091	38,491,376
親投資信託受益証券	18,538,373,960	45,640,009,021
流動資産合計	18,555,059,051	45,678,500,397
資産合計	18,555,059,051	45,678,500,397
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,309,216	16,795,167
未払受託者報酬	1,423,483	4,355,086
未払委託者報酬	4,270,537	13,065,345
その他未払費用	356,852	1,088,692
流動負債合計	15,360,088	35,304,290
負債合計	15,360,088	35,304,290
純資産の部		
元本等		
元本	1 15,133,789,995	1 32,029,849,749
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,405,908,968	13,613,346,358
（分配準備積立金）	1,874,777,979	5,206,932,017
元本等合計	18,539,698,963	45,643,196,107
純資産合計	18,539,698,963	45,643,196,107
負債純資産合計	18,555,059,051	45,678,500,397

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	2022年11月22日 至 2023年11月20日	自	2023年11月21日 至 2024年11月20日
営業収益				
受取利息		6		37,592
有価証券売買等損益		1,890,995,047		3,857,435,061
営業収益合計		1,890,995,053		3,857,472,653
営業費用				
支払利息		2,699		494
受託者報酬		1,900,781		7,154,144
委託者報酬		5,702,531		21,462,631
その他費用		475,024		1,788,366
営業費用合計		8,081,035		30,405,635
営業利益又は営業損失（ ）		1,882,914,018		3,827,067,018
経常利益又は経常損失（ ）		1,882,914,018		3,827,067,018
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,882,914,018		3,827,067,018
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（ ）		82,201,389		319,077,701
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		13,991,827		3,405,908,968
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,666,739,767		7,303,832,477
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,666,739,767		7,303,832,477
剰余金減少額又は欠損金増加額		47,551,601		604,384,404
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		47,551,601		604,384,404
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,405,908,968		13,613,346,358

(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3期
	自2023年11月21日 至2024年11月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第2期	第3期
	2023年11月20日現在	2024年11月20日現在
1. 1 期首元本額	2,489,722,080円	15,133,789,995円
期中追加設定元本額	13,509,487,342円	19,150,672,079円
期中一部解約元本額	865,419,427円	2,254,612,325円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	15,133,789,995口	32,029,849,749口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第2期	第3期
	自2022年11月22日 至2023年11月20日	自2023年11月21日 至2024年11月20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(1,800,715,200円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,531,133,585円)及び分配準備積立金(74,062,779円)より分配対象額は3,405,911,564円(1万口当たり2,250.53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(36,901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(3,507,950,044円)、投資信託約款に規定される収益調整金(8,406,414,341円)及び分配準備積立金(1,698,945,072円)より分配対象額は13,613,346,358円(1万口当たり4,250.21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3期 自2023年11月21日 至2024年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、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3期
	2024年11月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2023年11月20日現在	2024年11月20日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,888,293,318	3,816,612,889
合計	1,888,293,318	3,816,612,889

(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2期	第3期
2023年11月20日現在	2024年11月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第3期
自2023年11月21日
至2024年11月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第2期	第3期
	2023年11月20日現在	2024年11月20日現在
1口当たり純資産額	1.2251円	1.4250円
(1万口当たり純資産額)	(12,251円)	(14,250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	23,029,573,631	45,640,009,021	
親投資信託受益証券 合計			45,640,009,021	
合計			45,640,009,021	

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

	2023年11月20日現在 金額(円)	2024年11月20日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		8,954,313,464	20,312,016,534
株式	2 3	278,108,182,520	384,156,091,640
派生商品評価勘定		148,607,200	139,161,050
未収入金		638,900	-
未収配当金		2,471,233,890	3,573,554,407
未収利息		365,614	-
その他未収収益	4	14,014,080	75,685,167
差入委託証拠金		2,603,898	91,212,301
流動資産合計		289,699,959,566	408,347,721,099
資産合計		289,699,959,566	408,347,721,099
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		166,650	29,671,850
前受金		202,155,000	130,366,000
未払解約金		384,028,650	133,930,660
未払利息		-	1,870,590
受入担保金		5,959,223,444	14,043,219,947
流動負債合計		6,545,573,744	14,339,059,047
負債合計		6,545,573,744	14,339,059,047
純資産の部			
元本等			
元本	1	166,353,435,368	198,812,906,143
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		116,800,950,454	195,195,755,909
元本等合計		283,154,385,822	394,008,662,052
純資産合計		283,154,385,822	394,008,662,052
負債純資産合計		289,699,959,566	408,347,721,099

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11月21日 至2024年11月20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	2023年11月20日現在	2024年11月20日現在
1. 1 期首	2022年11月22日	2023年11月21日
期首元本額	147,633,560,743円	166,353,435,368円
期中追加設定元本額	32,875,826,761円	50,693,712,160円
期中一部解約元本額	14,155,952,136円	18,234,241,385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	2,810,125,294円	2,769,917,939円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	4,384,926,309円	3,755,912,957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	911,517円	905,139円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	15,316,355円	8,959,470円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	192,250,160円	137,820,361円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	13,274,124円	11,283,120円

ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	421,803,430円	315,341,218円
国内株式ファンド(適格機関投 資家専用)	336,354,758円	1,174,935,771円
日本株式インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用)	673,213,445円	847,603,875円
アセット・アロケーションファ ンド(リスク判断付き)2023-07 (適格機関投資家専用)	-円	1,591,364,318円
D-I's TOPIXインデッ クス	13,685,749円	11,683,115円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	249,713,476円	248,829,775円
iFree TOPIXインデッ クス	7,229,902,333円	9,822,433,510円
iFree 8資産バランス	4,607,659,200円	5,180,258,790円
iFree 年金バランス	1,001,236,912円	1,214,955,699円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	629,069円	4,153,763円
DCダイワ日本株式インデッ クス	70,707,175,887円	73,276,099,677円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,140,058,702円	2,985,324,543円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,920,435,081円	5,187,368,914円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,634,914,496円	6,214,539,653円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	7,338,943,213円	7,880,410,427円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	54,968,866円	49,493,420円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	75,537,629円	76,512,165円
ダイワつみたてインデックス日 本株式	4,735,371,247円	6,502,458,583円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	12,447,223円	12,342,314円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	11,476,267円	13,971,554円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	29,639,674円	53,645,158円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	10,891,471,688円	23,029,573,631円

ダイワ世界バランスファンド4 0VA	55,447,664円	47,104,361円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	20,876,356円	20,075,740円
ダイワ・バランスファンド35 VA	3,848,794,734円	3,025,997,528円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	361,068,308円	282,773,057円
ダイワ国内バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	51,746,439円	40,356,490円
ダイワ国内バランスファンド3 0VA(適格機関投資家専用)	74,582,249円	56,621,541円
ダイワ・ノーロードTOPIX ファンド	231,176,915円	238,930,836円
ダイワファンドラップTOPI Xインデックス	12,316,608,311円	15,313,369,018円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	6,179,852,894円	14,243,509,634円
ダイワファンドラップオンライ ンTOPIXインデックス	3,363,149,775円	3,513,656,834円
スタイル9(4資産分散・保守 型)	-円	806,602円
スタイル9(4資産分散・ balan ス型)	-円	5,737,270円
スタイル9(4資産分散・積極 型)	-円	8,239,894円
スタイル9(6資産分散・保守 型)	-円	343,194円
スタイル9(6資産分散・ balan ス型)	-円	10,660,072円
スタイル9(6資産分散・積極 型)	-円	12,204,341円
スタイル9(8資産分散・保守 型)	-円	547,367円
スタイル9(8資産分散・ balan ス型)	-円	8,585,117円
スタイル9(8資産分散・積極 型)	-円	25,992,262円
ダイワ国内株式インデックス (投資一任専用)	-円	5,000,297円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,169,182,749円	996,476,769円

	ダイワライフスタイル2 5	109,529,252円	93,485,414円
	ダイワライフスタイル5 0	486,006,757円	433,990,568円
	ダイワライフスタイル7 5	405,762,165円	378,931,500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）	8,176,208,696円	7,671,411,578円
計		166,353,435,368円	198,812,906,143円
2.	期末日における受益権の総数	166,353,435,368口	198,812,906,143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 5,695,206,590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 13,402,300,940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 1,215,980,000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 961,655,000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2023年11月21日 至2024年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、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。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年11月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年11月20日現在	2024年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	6,157,497,091	10,793,719,759
合計	6,157,497,091	10,793,719,759

(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	2023年11月20日現在				2024年11月20日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数 先物取引								
買建	4,565,760,000	-	4,714,310,000	148,550,000	10,064,864,000	-	10,174,560,000	109,696,000
合計	4,565,760,000	-	4,714,310,000	148,550,000	10,064,864,000	-	10,174,560,000	109,696,000

(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)

	2023年11月20日現在	2024年11月20日現在
1口当たり純資産額	1.7021円	1.9818円
(1万口当たり純資産額)	(17,021円)	(19,818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	6,100	3,980.00	24,278,000	
ニッスイ	140,700	916.70	128,979,690	
マルハニチロ	21,300	3,059.00	65,156,700	
雪国まいたけ	12,900	1,039.00	13,403,100	
カネコ種苗	3,900	1,388.00	5,413,200	
サカタのタネ	15,700	3,405.00	53,458,500	
ホクト	12,800	1,708.00	21,862,400	

ホクリヨウ	300	1,050.00	315,000	貸付株式数	200株
ショーボンドHD	18,900	5,221.00	98,676,900		
ミライト・ワン	46,100	2,189.50	100,935,950		
タマホーム	8,600	3,685.00	31,691,000	貸付株式数	3,400株
サンヨーホームズ	200	711.00	142,200	貸付株式数	100株 (100株)
日本アクア	800	799.00	639,200		
ファーストコーポレーション	500	818.00	409,000	貸付株式数	400株
ベステラ	400	964.00	385,600	貸付株式数	300株 (300株)
キャンディル	1,900	551.00	1,046,900	貸付株式数	100株
住石ホールディングス	15,300	842.00	12,882,600	貸付株式数	7,500株
日鉄鉱業	5,500	4,220.00	23,210,000		
三井松島HLDGS	6,800	3,565.00	24,242,000	貸付株式数	2,600株
I N P E X	421,600	2,020.00	851,632,000		
石油資源開発	76,500	1,093.00	83,614,500	貸付株式数	29,800株
K&Oエナジーグループ	6,300	3,025.00	19,057,500		
リョーサン菱洋HD	17,700	2,350.00	41,595,000		
ダイセキ環境ソリューション	400	1,224.00	489,600	貸付株式数	300株
第一カッター興業	3,900	1,437.00	5,604,300		
明豊ファシリティワークス	600	874.00	524,400		
安藤・間	79,900	1,191.00	95,160,900		
東急建設	42,600	698.00	29,734,800		
コムシスホールディングス	49,100	3,303.00	162,177,300		
ビーアールホールディングス	27,700	342.00	9,473,400		
高松コンストラクションGP	10,100	2,668.00	26,946,800		
東建コーポレーション	3,400	10,860.00	36,924,000		
ソネック	200	852.00	170,400	貸付株式数	100株
ヤマウラ	6,900	1,155.00	7,969,500	貸付株式数	2,300株
オリエンタル白石	50,400	385.00	19,404,000		
大成建設	88,500	6,835.00	604,897,500		
大林組	321,300	2,072.00	665,733,600		
清水建設	275,900	1,171.00	323,078,900		
長谷工コーポレーション	88,300	1,891.50	167,019,450	貸付株式数	4,000株
松井建設	8,900	855.00	7,609,500	貸付株式数	3,400株
銭高組	100	3,450.00	345,000		
鹿島建設	216,000	2,695.00	582,120,000		

不動テトラ	6,700	2,105.00	14,103,500	
大末建設	500	1,685.00	842,500	
鉄建建設	6,600	2,262.00	14,929,200	
西松建設	15,300	5,017.00	76,760,100	
三井住友建設	76,900	368.00	28,299,200	
大豊建設	2,600	3,425.00	8,905,000	
佐田建設	700	908.00	635,600	
ナカノフドー建設	900	592.00	532,800	
奥村組	17,000	3,970.00	67,490,000	
東鉄工業	11,200	3,115.00	34,888,000	
イチケン	300	2,523.00	756,900	
富士ピー・エス	500	407.00	203,500	貸付株式数 400株
浅沼組	38,100	659.00	25,107,900	貸付株式数 5,700株
戸田建設	119,600	992.00	118,643,200	貸付株式数 17,600株
熊谷組	15,700	3,610.00	56,677,000	
北野建設	200	4,010.00	802,000	
植木組	900	1,560.00	1,404,000	
矢作建設	13,000	1,497.00	19,461,000	
ピーエス・コンストラクション	9,200	1,046.00	9,623,200	
日本ハウスHLDGS	20,300	324.00	6,577,200	貸付株式数 8,100株
大東建託	33,300	17,260.00	574,758,000	
新日本建設	13,400	1,509.00	20,220,600	
サムティホールディングス	19,000	3,295.00	62,605,000	
東亜道路	17,400	1,250.00	21,750,000	貸付株式数 5,200株
日本道路	10,600	1,666.00	17,659,600	
東亜建設	29,900	1,146.00	34,265,400	
日本国土開発	27,100	509.00	13,793,900	貸付株式数 10,400株
若築建設	3,200	3,570.00	11,424,000	
東洋建設	28,500	1,301.00	37,078,500	
五洋建設	128,600	622.40	80,040,640	
世紀東急	14,800	1,553.00	22,984,400	貸付株式数 5,500株
福田組	3,600	5,280.00	19,008,000	貸付株式数 1,400株
日本ドライケミカル	300	3,785.00	1,135,500	貸付株式数 100株
住友林業	84,200	5,426.00	456,869,200	
日本基礎技術	700	592.00	414,400	
巴コーポレーション	2,000	953.00	1,906,000	
大和ハウス	294,000	4,671.00	1,373,274,000	
ライト工業	20,900	2,152.00	44,976,800	
積水ハウス	295,800	3,547.00	1,049,202,600	

日特建設	11,600	996.00	11,553,600	
北陸電気工事	7,800	1,117.00	8,712,600	
ユアテック	19,800	1,493.00	29,561,400	
日本リーテック	8,600	1,119.00	9,623,400	貸付株式数 2,900株
四電工	13,000	1,497.00	19,461,000	
中電工	16,100	3,435.00	55,303,500	
関電工	54,300	2,274.00	123,478,200	
きんでん	68,600	3,075.00	210,945,000	
東京エネシス	10,200	1,011.00	10,312,200	
トーエネック	17,700	921.00	16,301,700	
住友電設	8,300	4,835.00	40,130,500	
日本電設工業	19,600	1,804.00	35,358,400	
エクシオグループ	105,500	1,800.00	189,900,000	貸付株式数 41,300株
新日本空調	6,200	3,915.00	24,273,000	
九電工	21,400	5,185.00	110,959,000	貸付株式数 4,800株
三機工業	21,500	2,991.00	64,306,500	
日揮ホールディングス	96,100	1,307.50	125,650,750	
中外炉工業	3,100	2,850.00	8,835,000	
ヤマト	1,600	1,077.00	1,723,200	貸付株式数 400株
太平電業	6,100	4,965.00	30,286,500	貸付株式数 700株
高砂熱学	23,700	6,045.00	143,266,500	
三晃金属	300	4,330.00	1,299,000	
NECネットエスアイ	37,900	3,290.00	124,691,000	
朝日工業社	10,100	1,807.00	18,250,700	
明星工業	17,900	1,300.00	23,270,000	
大気社	13,000	4,925.00	64,025,000	
ダイダン	13,300	3,550.00	47,215,000	
日比谷総合設備	8,100	3,750.00	30,375,000	
ニッポン	33,200	2,138.00	70,981,600	貸付株式数 12,000株
日清製粉G本社	102,500	1,840.00	188,600,000	
日東富士製粉	1,800	6,520.00	11,736,000	
昭和産業	8,900	2,790.00	24,831,000	
鳥越製粉	1,600	677.00	1,083,200	
中部飼料	14,100	1,323.00	18,654,300	
フィード・ワン	15,100	819.00	12,366,900	
東洋精糖	200	1,394.00	278,800	
日本甜菜糖	5,300	2,409.00	12,767,700	貸付株式数 2,100株
DM三井製糖ホールディ	9,800	3,175.00	31,115,000	
塩水港精糖	2,300	294.00	676,200	貸付株式数 200株
ウェルネオシュガー	6,300	2,216.00	13,960,800	

L I F U L L	24,400	164.00	4,001,600	
M I X I	19,100	2,848.00	54,396,800	
ジェイエイシーリクルート メント	36,100	692.00	24,981,200	
日本M&Aセンターホールデ メンバーズ	150,600	636.80	95,902,080	
中広	200	427.00	85,400	
U T グループ	13,400	2,001.00	26,813,400	貸付株式数 5,200株
アイティメディア	5,300	1,539.00	8,156,700	貸付株式数 100株
ケアネット	20,700	653.00	13,517,100	貸付株式数 3,400株
E・Jホールディングス	5,800	1,730.00	10,034,000	
オープンアップグループ	30,700	1,801.00	55,290,700	
コシダカホールディングス	30,500	1,178.00	35,929,000	貸付株式数 11,100株
アルトナー	500	1,879.00	939,500	貸付株式数 400株
パソナグループ	12,400	1,953.00	24,217,200	
C D S	300	1,814.00	544,200	
リンクアンドモチベーショ ン	25,400	551.00	13,995,400	貸付株式数 9,600株
エス・エム・エス	39,000	1,593.00	62,127,000	
サニーサイドアップG	400	538.00	215,200	
パーソルホールディングス	954,500	232.70	222,112,150	
リニカル	800	344.00	275,200	
クックパッド	27,300	163.00	4,449,900	貸付株式数 10,900株
エスクリ	500	197.00	98,500	貸付株式数 200株 (100株)
アイ・ケイ・ケイホール ディンク	800	721.00	576,800	貸付株式数 400株 (400株)
森永製菓	41,400	2,726.00	112,856,400	
中村屋	2,400	3,165.00	7,596,000	
江崎グリコ	28,400	4,350.00	123,540,000	
名糖産業	4,500	1,928.00	8,676,000	貸付株式数 1,400株
井村屋グループ	5,600	2,410.00	13,496,000	
不二家	6,700	2,668.00	17,875,600	貸付株式数 2,600株
山崎製パン	65,700	2,862.50	188,066,250	
第一屋製パン	500	578.00	289,000	貸付株式数 200株
モロゾフ	3,200	4,455.00	14,256,000	貸付株式数 1,000株
亀田製菓	6,300	4,130.00	26,019,000	貸付株式数 2,400株
寿スピリッツ	58,000	1,970.00	114,260,000	貸付株式数 23,200株
カルビー	45,100	3,067.00	138,321,700	貸付株式数 3,000株
森永乳業	38,000	2,939.00	111,682,000	貸付株式数 13,000株

六甲バター	7,800	1,409.00	10,990,200	貸付株式数	2,500株
ヤクルト	140,200	3,019.00	423,263,800	貸付株式数	54,600株
明治ホールディングス	131,300	3,317.00	435,522,100		
雪印メグミルク	26,700	2,757.00	73,611,900		
プリマハム	13,700	2,193.00	30,044,100		
日本ハム	42,400	5,031.00	213,314,400		
林兼産業	400	463.00	185,200	貸付株式数	300株
丸大食品	10,300	1,748.00	18,004,400	貸付株式数	3,700株
S Foods	11,200	2,650.00	29,680,000	貸付株式数	4,300株
柿安本店	3,700	2,761.00	10,215,700	貸付株式数	1,200株
伊藤ハム米久HLDGS	15,400	3,785.00	58,289,000		
学情	5,100	1,724.00	8,792,400	貸付株式数	100株
スタジオアリス	5,000	2,086.00	10,430,000	貸付株式数	2,000株 (800株)
クロスキャット	5,600	1,118.00	6,260,800	貸付株式数	1,600株
エプコ	300	780.00	234,000	貸付株式数	100株
システナ	142,500	347.00	49,447,500	貸付株式数	42,600株
N J S	2,500	3,550.00	8,875,000	貸付株式数	1,000株
デジタルアーツ	6,300	5,930.00	37,359,000	貸付株式数	2,500株
日鉄ソリューションズ	34,000	4,216.00	143,344,000	貸付株式数	13,600株
総合警備保障	170,900	1,099.50	187,904,550	貸付株式数	68,300株
キューブシステム	5,100	1,048.00	5,344,800	貸付株式数	1,600株
いちご	84,700	388.00	32,863,600		
日本駐車場開発	115,600	223.00	25,778,800		
コア	4,300	1,830.00	7,869,000		
カカクコム	73,800	2,318.00	171,068,400	貸付株式数	29,500株
アイロムグループ	4,000	2,609.00	10,436,000		
セントケア・ホールディング	6,400	720.00	4,608,000	貸付株式数	2,000株
サイネックス	200	743.00	148,600	貸付株式数	100株
ルネサンス	7,800	1,003.00	7,823,400	貸付株式数	2,700株
ディップ	17,800	2,556.00	45,496,800	貸付株式数	6,800株
SBSホールディングス	8,700	2,400.00	20,880,000		
デジタルホールディングス	5,100	1,246.00	6,354,600		
新日本科学	10,700	1,450.00	15,515,000	貸付株式数	3,600株
キャリアデザインセンター	200	1,882.00	376,400		
エムスリー	202,100	1,376.50	278,190,650	貸付株式数	47,600株
ツカダ・グローバルHOLD	900	405.00	364,500	貸付株式数	600株
プラス	200	545.00	109,000	貸付株式数	100株

ウェルネット	1,000	880.00	880,000	
ワールドホールディングス	4,000	2,099.00	8,396,000	貸付株式数 1,600株
ディー・エヌ・エー	40,800	2,469.00	100,735,200	
博報堂D Y HLDGS	116,000	1,140.50	132,298,000	貸付株式数 49,700株
ぐるなび	18,600	312.00	5,803,200	
タカミヤ	13,500	435.00	5,872,500	
ファンコミュニケーションズ	14,000	417.00	5,838,000	
ライク	3,700	1,446.00	5,350,200	貸付株式数 1,400株 (1,200株)
A o b a B B T	500	318.00	159,000	貸付株式数 400株
エスプール	32,300	353.00	11,401,900	
WDBホールディングス	5,100	1,664.00	8,486,400	貸付株式数 1,800株
手間いらず	1,600	3,230.00	5,168,000	貸付株式数 600株
ティア	800	432.00	345,600	貸付株式数 200株
アドウェイズ	12,200	322.00	3,928,400	
バリューコマース	9,000	1,118.00	10,062,000	
インフォマート	96,700	283.00	27,366,100	貸付株式数 36,800株
サッポロホールディングス	32,300	8,239.00	266,119,700	
アサヒグループホールディングン	736,400	1,618.50	1,191,863,400	
麒麟HD	408,800	2,100.50	858,684,400	
シマダヤ	2,800	1,400.00	3,920,000	
宝ホールディングス	66,900	1,216.50	81,383,850	貸付株式数 9,300株
オエノンホールディングス	32,600	415.00	13,529,000	
養命酒	3,300	2,470.00	8,151,000	
飛島ホールディングス	11,200	1,577.00	17,662,400	
コカ・コーラボトラーズJHD	69,400	2,429.00	168,572,600	
サントリー食品インター	69,200	5,076.00	351,259,200	
ダイドーグループHD	11,300	2,946.00	33,289,800	貸付株式数 4,100株
伊藤園	33,100	3,111.00	102,974,100	
キーコーヒー	11,200	2,036.00	22,803,200	貸付株式数 4,200株
ユニカフェ	400	949.00	379,600	貸付株式数 300株
日清オイリオグループ	14,000	5,120.00	71,680,000	
不二製油グループ	19,700	3,474.00	68,437,800	
かどや製油	100	3,590.00	359,000	
J - オイルミルズ	11,600	2,135.00	24,766,000	
サンエー	17,400	2,802.00	48,754,800	貸付株式数 2,600株
カワチ薬品	8,000	2,468.00	19,744,000	
エービーシー・マート	46,000	3,073.00	141,358,000	

ハードオフコーポレーション	4,100	1,807.00	7,408,700	
高千穂交易	4,100	3,845.00	15,764,500	貸付株式数 1,600株
アスクル	25,000	1,875.00	46,875,000	貸付株式数 9,700株
ゲオホールディングス	11,900	1,466.00	17,445,400	
アダストリア	14,500	3,430.00	49,735,000	
ジーフット	1,000	283.00	283,000	貸付株式数 900株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	527.00	105,400	貸付株式数 100株
オルバヘルスケアHLDGS	1,100	2,037.00	2,240,700	
伊藤忠食品	2,500	6,980.00	17,450,000	
くら寿司	12,400	3,845.00	47,678,000	貸付株式数 200株
キャンドウ	3,700	3,245.00	12,006,500	貸付株式数 1,400株
エレマテック	9,400	2,396.00	22,522,400	
IKホールディングス	400	379.00	151,600	貸付株式数 300株
パルグループHLDGS	24,000	2,918.00	70,032,000	
エディオン	45,600	1,812.00	82,627,200	
あらた	16,000	3,010.00	48,160,000	貸付株式数 2,900株
サーラコーポレーション	21,600	800.00	17,280,000	貸付株式数 8,600株
ワッツ	500	675.00	337,500	貸付株式数 400株
トーメンデバイス	1,500	6,730.00	10,095,000	貸付株式数 500株
ハローズ	4,100	4,125.00	16,912,500	
JPホールディングス	26,100	643.00	16,782,300	貸付株式数 10,400株
フジオフードG本社	11,600	1,329.00	15,416,400	貸付株式数 4,600株 (300株)
あみやき亭	7,500	1,623.00	12,172,500	貸付株式数 3,000株
東京エレクトロデバイス	10,500	3,060.00	32,130,000	
ひらまつ	2,700	170.00	459,000	貸付株式数 2,000株
円谷フィールズホールディ	17,000	2,145.00	36,465,000	貸付株式数 6,800株
双日	117,400	3,080.00	361,592,000	
アルフレッサホールディングス	98,000	2,249.00	220,402,000	
大黒天物産	3,200	10,160.00	32,512,000	貸付株式数 1,200株
ハニーズホールディングス	9,200	1,626.00	14,959,200	貸付株式数 3,300株
ファーマライズHD	300	617.00	185,100	貸付株式数 100株
キッコーマン	325,300	1,677.00	545,528,100	
味の素	230,300	6,255.00	1,440,526,500	貸付株式数 32,600株
ブルドックソ - ス	5,300	1,820.00	9,646,000	
キューピー	53,000	3,528.00	186,984,000	貸付株式数 14,100株
ハウス食品G本社	33,400	2,842.00	94,922,800	

カゴメ	42,300	3,002.00	126,984,600	
アリアケジャパン	9,900	5,320.00	52,668,000	貸付株式数 3,500株
ピエトロ	200	1,757.00	351,400	貸付株式数 100株
エバラ食品工業	2,700	2,876.00	7,765,200	
やまみ	200	3,680.00	736,000	貸付株式数 100株
ニチレイ	40,000	4,084.00	163,360,000	
横浜冷凍	26,700	813.00	21,707,100	
東洋水産	45,400	10,315.00	468,301,000	
イトアンドHLDGS	4,900	2,112.00	10,348,800	貸付株式数 1,600株
大冷	200	1,910.00	382,000	
ヨシムラ・フード・HLDGS	5,400	1,442.00	7,786,800	貸付株式数 800株
日清食品HD	126,400	3,804.00	480,825,600	貸付株式数 50,500株
一正蒲鉾	500	743.00	371,500	貸付株式数 200株 (200株)
フジッコ	10,300	1,711.00	17,623,300	貸付株式数 3,800株
ロックフィールド	12,200	1,463.00	17,848,600	貸付株式数 4,700株
日本たばこ産業	595,800	4,196.00	2,499,976,800	
ケンコーマヨネーズ	6,300	2,252.00	14,187,600	貸付株式数 2,400株
わらべや日洋HD	6,800	2,017.00	13,715,600	貸付株式数 400株
なとり	6,500	2,120.00	13,780,000	
イフジ産業	200	1,526.00	305,200	貸付株式数 100株
ファーマフーズ	13,200	951.00	12,553,200	貸付株式数 5,200株
北の達人コーポ	42,200	151.00	6,372,200	貸付株式数 16,800株 (1,300株)
ユーグレナ	59,600	428.00	25,508,800	貸付株式数 23,800株 (600株)
紀文食品	8,900	1,115.00	9,923,500	貸付株式数 1,700株
ピクルスホールディングス	6,400	1,052.00	6,732,800	貸付株式数 1,900株
スター・マイカ・HLDGS	9,900	678.00	6,712,200	
SREホールディングス	3,600	3,315.00	11,934,000	貸付株式数 1,600株
ADワークスグループ	2,700	203.00	548,100	貸付株式数 100株
片倉工業	9,000	1,993.00	17,937,000	
グンゼ	7,200	5,120.00	36,864,000	
ヒューリック	228,000	1,432.50	326,610,000	
神栄	300	1,523.00	456,900	
ラサ商事	5,700	1,408.00	8,025,600	貸付株式数 900株
アルペン	8,500	2,001.00	17,008,500	貸付株式数 3,400株
ハブ	400	737.00	294,800	貸付株式数 300株

ラクーンホールディングス	7,500	682.00	5,115,000	貸付株式数	400株
クオールホールディングス	13,000	1,439.00	18,707,000		
アルコニックス	14,700	1,438.00	21,138,600		
神戸物産	81,300	3,529.00	286,907,700		
ソリトンシステムズ	5,000	1,184.00	5,920,000		
ジンスホールディングス	8,000	6,390.00	51,120,000	貸付株式数	3,200株
ビックカメラ	63,100	1,653.00	104,304,300	貸付株式数	25,200株
DCMホールディングス	54,300	1,413.00	76,725,900	貸付株式数	11,200株
ペッパーフードサービス	30,700	186.00	5,710,200	貸付株式数	12,200株
ハイパー	300	293.00	87,900		
MonotaRO	149,100	2,482.00	370,066,200	貸付株式数	58,200株
東京一番フーズ	300	504.00	151,200		
DDグループ	800	1,314.00	1,051,200	貸付株式数	700株
あいホールディングス	16,800	2,161.00	36,304,800		
ディーブイエックス	1,300	922.00	1,198,600		
きちりホールディングス	400	902.00	360,800	貸付株式数	300株
J. フロント リテイリング	120,800	1,710.50	206,628,400		
ドトール・日レスHD	18,500	2,238.00	41,403,000		
マツキヨココカラ&カンパニー	185,100	2,080.00	385,008,000	貸付株式数	60,900株
ブロンコビリー	6,000	3,680.00	22,080,000	貸付株式数	2,400株
ZOZO	78,300	4,675.00	366,052,500		
トレジャー・ファクトリー	7,100	1,277.00	9,066,700	貸付株式数	2,800株
物語コーポレーション	18,400	3,435.00	63,204,000	貸付株式数	7,200株
三越伊勢丹HD	159,700	2,240.00	357,728,000	貸付株式数	66,400株
東洋紡	43,400	936.00	40,622,400	貸付株式数	17,200株
ユニチカ	32,400	242.00	7,840,800	貸付株式数	11,100株
富士紡ホールディングス	4,000	5,110.00	20,440,000		
日清紡ホールディングス	74,800	892.00	66,721,600		
倉敷紡績	7,100	5,350.00	37,985,000	貸付株式数	2,600株
ダイワボウHD	46,600	3,182.00	148,281,200		
シキボウ	7,000	999.00	6,993,000	貸付株式数	1,800株
日東紡績	11,200	5,680.00	63,616,000		
トヨタ紡織	42,000	1,992.00	83,664,000		
マクニカホールディングス	81,200	1,756.00	142,587,200	貸付株式数	9,400株
Hamee	4,200	1,080.00	4,536,000		
マーケットエンタープライズ	100	915.00	91,500		
ラクト・ジャパン	4,500	2,788.00	12,546,000	貸付株式数	1,600株

ウエルシアHD	53,900	1,867.00	100,631,300		
クリエイトSDH	14,500	2,881.00	41,774,500	貸付株式数	5,600株
グリムス	4,400	2,566.00	11,290,400	貸付株式数	1,700株
バイタルKSKHD	14,400	1,154.00	16,617,600		
八洲電機	8,300	1,606.00	13,329,800	貸付株式数	3,200株
メディアスホールディングス	7,400	780.00	5,772,000	貸付株式数	2,300株
レスター	8,800	2,431.00	21,392,800		
ジオリーブグループ	300	1,064.00	319,200		
丸善CHI HD	1,700	316.00	537,200	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
大光	600	623.00	373,800	貸付株式数	500株
OCHIホールディングス	300	1,291.00	387,300		
TOKAIホールディングス	55,800	920.00	51,336,000	貸付株式数	22,300株
黒谷	300	554.00	166,200	貸付株式数	100株
ミサワ	200	683.00	136,600		
ティーライフ	200	1,221.00	244,200	貸付株式数	100株
Cominix	200	861.00	172,200		
エー・ピーホールディングス	300	931.00	279,300	貸付株式数	200株
三洋貿易	10,600	1,527.00	16,186,200		
チムニー	400	1,239.00	495,600	貸付株式数	300株
シュッピン	10,300	1,001.00	10,310,300	貸付株式数	3,700株
ビューティガレージ	3,200	1,460.00	4,672,000	貸付株式数	1,200株
オイシックス・ラ・大地	17,000	1,615.00	27,455,000	貸付株式数	6,300株
ウイン・パートナーズ	10,000	1,225.00	12,250,000	貸付株式数	2,300株
ネクステージ	24,000	1,491.00	35,784,000	貸付株式数	9,400株
ジョイフル本田	29,000	1,809.00	52,461,000	貸付株式数	11,600株
エターナルホスピタリティ グル	3,900	3,270.00	12,753,000		
ホットランド	7,900	2,073.00	16,376,700	貸付株式数	3,000株 (200株)
すかいらくHD	144,000	2,228.50	320,904,000	貸付株式数	57,600株
SFPホールディングス	5,800	1,907.00	11,060,600	貸付株式数	2,300株
綿半ホールディングス	8,000	1,556.00	12,448,000	貸付株式数	3,200株
日本毛織	25,600	1,276.00	32,665,600	貸付株式数	2,700株
ダイトウボウ	2,000	101.00	202,000	貸付株式数	1,800株
トーア紡コーポレーション	500	415.00	207,500	貸付株式数	100株
ダイドーリミテッド	1,100	834.00	917,400	貸付株式数	1,000株

ヨシックスホールディングス	3,400	3,125.00	10,625,000		
ユナイテッド・スーパーマーケ	33,500	814.00	27,269,000	貸付株式数	13,400株 (300株)
野村不動産HLDGS	61,500	3,789.00	233,023,500		
三重交通グループHD	20,500	482.00	9,881,000	貸付株式数	7,600株
地主	8,600	2,094.00	18,008,400	貸付株式数	3,400株
プレサンスコーポレーション	12,900	1,822.00	23,503,800	貸付株式数	4,900株
フィル・カンパニー	1,900	867.00	1,647,300		
ハウスコム	200	1,382.00	276,400	貸付株式数	100株
JPMC	5,500	1,170.00	6,435,000		
サンセイランディック	400	960.00	384,000	貸付株式数	300株
エストラスト	100	684.00	68,400		
フージャースHD	14,700	1,018.00	14,964,600		
オープンハウスグループ	35,900	5,742.00	206,137,800	貸付株式数	13,600株
東急不動産HD	295,000	963.30	284,173,500	貸付株式数	6,700株
飯田GHD	93,600	2,199.00	205,826,400		
イーグランド	200	1,363.00	272,600	貸付株式数	100株
帝国繊維	11,000	2,514.00	27,654,000	貸付株式数	3,900株
日本コークス工業	100,200	98.00	9,819,600	貸付株式数	40,000株
ゴルフダイジェスト・オン	6,000	405.00	2,430,000	貸付株式数	2,400株
ミタチ産業	400	1,128.00	451,200	貸付株式数	300株
B E E N O S	6,600	3,340.00	22,044,000	貸付株式数	2,400株
あさひ	8,600	1,500.00	12,900,000		
日本調剤	6,900	1,359.00	9,377,100	貸付株式数	2,600株
コスモス薬品	17,700	6,767.00	119,775,900		
シップヘルスケアHD	42,200	2,146.00	90,561,200		
トーエル	500	762.00	381,000	貸付株式数	100株
ソフトクリエイイトHD	7,100	2,217.00	15,740,700		
セブン&アイ・HLDGS	1,161,600	2,597.00	3,016,675,200		
クリエイイト・レストランツ・ホール	79,200	1,151.00	91,159,200	貸付株式数	31,600株
明治電機工業	3,800	1,398.00	5,312,400		
ツルハホールディングス	22,000	8,068.00	177,496,000		
デリカフーズHLDGS	500	503.00	251,500		
スターティアホールディングス	400	2,259.00	903,600	貸付株式数	300株
サンマルクホールディングス	8,300	2,399.00	19,911,700		

フェリシモ	300	842.00	252,600	
トリドールホールディングス	29,500	3,507.00	103,456,500	貸付株式数 11,800株
帝人	96,000	1,325.00	127,200,000	
東レ	728,600	921.80	671,623,480	
クラレ	145,300	1,965.50	285,587,150	
旭化成	673,600	1,098.00	739,612,800	
TOKYO BASE	11,100	285.00	3,163,500	貸付株式数 4,400株
稲葉製作所	5,600	1,782.00	9,979,200	貸付株式数 700株
宮地エンジニアリングG	12,900	1,892.00	24,406,800	
トーカロ	29,600	1,797.00	53,191,200	
アルファCO	400	1,070.00	428,000	
SUMCO	195,500	1,257.00	245,743,500	貸付株式数 78,200株
川田テクノロジーズ	7,000	2,672.00	18,704,000	
RS TECHNOLOGIES	7,900	3,485.00	27,531,500	
ジェイテックコーポレーション	400	1,402.00	560,800	
信和	800	762.00	609,600	貸付株式数 700株
ビーロット	700	1,490.00	1,043,000	貸付株式数 600株
ファーストブラザーズ	300	1,145.00	343,500	
AND DOホールディングス	5,800	1,001.00	5,805,800	貸付株式数 300株
シーアールイー	4,300	1,207.00	5,190,100	
ケイアイスター不動産	5,200	4,345.00	22,594,000	貸付株式数 2,000株
アグレ都市デザイン	300	1,572.00	471,600	貸付株式数 200株
ジェイ・エス・ビー	4,000	2,650.00	10,600,000	
ロードスターキャピタル	5,500	2,448.00	13,464,000	
イノベーションホールディング	400	940.00	376,000	貸付株式数 200株
グローバルリンクマネジメント	200	2,592.00	518,400	貸付株式数 100株
フェイスネットワーク	400	1,689.00	675,600	貸付株式数 300株
霞ヶ関キャピタル	4,000	12,480.00	49,920,000	貸付株式数 800株
住江織物	300	2,020.00	606,000	貸付株式数 200株 (200株)
日本フェルト	600	472.00	283,200	
イチカワ	100	1,535.00	153,500	
エコナックホールディングス	1,100	115.00	126,500	貸付株式数 1,000株
日東製網	200	1,447.00	289,400	貸付株式数 100株
芦森工業	200	2,500.00	500,000	

アツギ	800	983.00	786,400	
ウイルプラスHLDGS	200	989.00	197,800	
JMホールディングス	7,700	2,678.00	20,620,600	
コメダホールディングス	27,400	2,852.00	78,144,800	
サツドラホールディングス	500	795.00	397,500	貸付株式数 400株
アレンザホールディングス	7,700	1,062.00	8,177,400	貸付株式数 3,000株 (1,200株)
串カツ田中HLDGS	3,100	1,547.00	4,795,700	貸付株式数 1,200株 (300株)
パロックジャパン	12,300	775.00	9,532,500	貸付株式数 4,900株
クスリのアオキHLDGS	35,100	3,186.00	111,828,600	
ダイニック	400	748.00	299,200	
共和レザー	700	639.00	447,300	
ピーバンドットコム	200	361.00	72,200	貸付株式数 100株
力の源HD	7,800	1,085.00	8,463,000	貸付株式数 3,100株
FOOD&LIFE COMPAN	56,300	3,106.00	174,867,800	
アセンテック	4,000	651.00	2,604,000	
セーレン	19,000	2,724.00	51,756,000	
ソトー	300	686.00	205,800	貸付株式数 100株
東海染工	100	687.00	68,700	
小松マテーレ	14,600	775.00	11,315,000	
ワコールホールディングス	20,800	4,716.00	98,092,800	
ホギメディカル	13,900	4,570.00	63,523,000	貸付株式数 5,300株
クラウドディアHLDGS	300	339.00	101,700	貸付株式数 200株
T S Iホールディングス	32,900	862.00	28,359,800	貸付株式数 12,600株
マツオカコーポレーション	300	1,868.00	560,400	
ワールド	15,500	1,918.00	29,729,000	貸付株式数 4,300株
T I S	105,400	3,850.00	405,790,000	貸付株式数 28,500株
テクミラホールディングス	600	319.00	191,400	貸付株式数 500株
グリー	32,600	421.00	13,724,600	
GMOペパボ	1,200	1,531.00	1,837,200	貸付株式数 200株
コーエーテクモHD	74,800	1,638.00	122,522,400	貸付株式数 29,900株
三菱総合研究所	4,900	4,330.00	21,217,000	
ボルテージ	300	227.00	68,100	貸付株式数 100株
電算	100	1,423.00	142,300	
A G S	500	821.00	410,500	貸付株式数 400株
ファインデックス	7,700	809.00	6,229,300	貸付株式数 3,000株
ブレインパッド	8,200	1,011.00	8,290,200	
K L a b	24,400	182.00	4,440,800	貸付株式数 6,100株

ポールトゥウィンホール ディン	13,800	452.00	6,237,600	
ネクソン	219,100	2,145.00	469,969,500	
アイスタイル	33,100	450.00	14,895,000	貸付株式数 13,200株
エムアップホールディング ス	12,100	1,528.00	18,488,800	
エイチーム	6,500	657.00	4,270,500	貸付株式数 400株
エニグモ	10,800	294.00	3,175,200	貸付株式数 4,600株
テクノスジャパン	1,000	738.00	738,000	
e n i s h	1,500	171.00	256,500	貸付株式数 800株
コロプラ	33,300	478.00	15,917,400	
オルトプラス	1,100	100.00	110,000	貸付株式数 900株
ブロードリーフ	39,700	670.00	26,599,000	貸付株式数 7,100株
クロス・マーケティングG	500	677.00	338,500	貸付株式数 400株
デジタルハーツHLDGS	6,900	811.00	5,595,900	貸付株式数 2,300株
メディアドゥ	4,400	1,324.00	5,825,600	貸付株式数 1,500株
じげん	24,800	531.00	13,168,800	
バイキューブ	13,400	225.00	3,015,000	貸付株式数 5,300株
エンカレッジ・テクノロジ	300	564.00	169,200	貸付株式数 200株
サイバーリンクス	500	744.00	372,000	貸付株式数 400株
ディー・エル・イー	4,300	121.00	520,300	
フィックスターズ	10,000	1,684.00	16,840,000	貸付株式数 4,000株
CARTA HOLDINGS	5,500	1,448.00	7,964,000	貸付株式数 2,100株
オプティム	10,300	680.00	7,004,000	貸付株式数 3,900株
セレス	4,500	2,259.00	10,165,500	貸付株式数 1,800株
S H I F T	6,600	15,180.00	100,188,000	貸付株式数 2,500株
特種東海製紙	4,700	3,530.00	16,591,000	貸付株式数 300株
ティーガイア	10,200	2,659.00	27,121,800	
セック	1,700	4,180.00	7,106,000	
テクマトリックス	21,400	2,472.00	52,900,800	
プロシップ	4,300	1,491.00	6,411,300	貸付株式数 700株
ガンホー・オンライン・エ ンター	24,700	3,085.00	76,199,500	
GMOペイメントゲートウェイ	22,800	7,638.00	174,146,400	貸付株式数 8,600株
ザッパラス	200	393.00	78,600	貸付株式数 100株
システムリサーチ	6,700	1,428.00	9,567,600	貸付株式数 700株
インターネットイニシア ティブ	54,400	2,992.50	162,792,000	
さくらインターネット	15,600	4,705.00	73,398,000	貸付株式数 6,200株

GMOグローバルサインHD	3,000	2,630.00	7,890,000	貸付株式数	200株
SRAホールディングス	5,600	4,190.00	23,464,000		
システムインテグレータ	400	313.00	125,200	貸付株式数	200株
朝日ネット	10,500	632.00	6,636,000		
e B A S E	13,700	661.00	9,055,700	貸付株式数	4,800株
アバントグループ	12,400	2,113.00	26,201,200		
アドソル日進	4,100	2,082.00	8,536,200		
ODKソリューションズ	300	563.00	168,900	貸付株式数	200株
フリービット	4,400	1,371.00	6,032,400		
コムチュア	13,200	2,236.00	29,515,200		
アステリア	7,600	503.00	3,822,800	貸付株式数	2,700株
アイル	5,500	3,105.00	17,077,500	貸付株式数	1,900株
王子ホールディングス	374,500	558.10	209,008,450		
日本製紙	50,600	841.00	42,554,600	貸付株式数	21,400株
三菱製紙	1,500	486.00	729,000	貸付株式数	1,400株
北越コーポレーション	55,700	1,565.00	87,170,500	貸付株式数	22,200株
中越パルプ	400	1,421.00	568,400	貸付株式数	300株
巴川コーポレーション	400	742.00	296,800	貸付株式数	300株
大王製紙	49,100	801.00	39,329,100		
阿波製紙	300	469.00	140,700	貸付株式数	200株
マークライنز	5,800	2,386.00	13,838,800		
メディカル・データ・ビジ	13,100	437.00	5,724,700	貸付株式数	4,700株
g u m i	15,800	357.00	5,640,600	貸付株式数	6,300株
ショーケース	300	356.00	106,800	貸付株式数	200株
モバイルファクトリー	300	958.00	287,400	貸付株式数	200株
テラスカイ	3,800	1,948.00	7,402,400	貸付株式数	1,500株
デジタル・インフォメー ション	5,100	2,125.00	10,837,500		
PCIホールディングス	400	933.00	373,200	貸付株式数	100株
アイビーシー	200	600.00	120,000		
ネオジャパン	2,600	1,887.00	4,906,200		
P R T I M E S	2,000	1,552.00	3,104,000	貸付株式数	700株
ラクス	47,200	1,958.00	92,417,600		
ランドコンピュータ	500	658.00	329,000		
ダブルスタンダード	3,600	1,577.00	5,677,200	貸付株式数	1,000株
オープンドア	6,800	684.00	4,651,200	貸付株式数	2,700株
マイネット	400	344.00	137,600	貸付株式数	100株
アカツキ	4,800	2,438.00	11,702,400		
ベネフィットジャパン	100	1,118.00	111,800		

UBICOMホールディングス	3,100	1,323.00	4,101,300	貸付株式数	100株
カナミックネットワーク	12,200	500.00	6,100,000		
ノムラシステムコーポレーション	1,200	116.00	139,200		
レンゴー	89,200	894.10	79,753,720		
トーモク	5,600	2,264.00	12,678,400		
ザ・パック	7,200	3,550.00	25,560,000		
チェンジホールディングス	24,700	1,340.00	33,098,000		
シンクロ・フード	700	417.00	291,900	貸付株式数	200株
オークネット	4,500	2,520.00	11,340,000	貸付株式数	1,800株
キャピタル・アセット・プラン	200	748.00	149,600		
セグエグループ	1,000	608.00	608,000	貸付株式数	900株
エイトレッド	200	1,514.00	302,800		
マクロミル	19,400	1,187.00	23,027,800		
ビーグリー	200	1,325.00	265,000		
オロ	4,200	2,415.00	10,143,000	貸付株式数	1,600株
ユーザーローカル	4,200	2,051.00	8,614,200	貸付株式数	1,600株
テモナ	300	190.00	57,000	貸付株式数	200株
ニーズウェル	1,200	290.00	348,000	貸付株式数	900株
マネーフォワード	24,400	4,406.00	107,506,400	貸付株式数	7,500株
サインポスト	500	453.00	226,500	貸付株式数	400株
レゾナック・ホールディング	89,500	3,780.00	338,310,000		
住友化学	800,700	378.50	303,064,950		
住友精化	4,600	4,740.00	21,804,000		
日産化学	51,200	5,419.00	277,452,800		
ラサ工業	3,500	2,681.00	9,383,500		
クレハ	20,500	2,753.00	56,436,500	貸付株式数	4,800株
多木化学	3,800	3,510.00	13,338,000	貸付株式数	1,500株
テイカ	7,100	1,613.00	11,452,300	貸付株式数	1,000株
石原産業	16,600	1,431.00	23,754,600		
片倉コープアグリ	300	978.00	293,400	貸付株式数	200株
日本曹達	21,000	2,656.00	55,776,000		
東ソー	133,000	2,083.50	277,105,500		
トクヤマ	32,300	2,659.00	85,885,700		
セントラル硝子	12,500	3,370.00	42,125,000		
東亜合成	47,800	1,511.50	72,249,700		
大阪ソーダ	34,600	1,509.00	52,211,400	貸付株式数	2,600株
関東電化	21,200	995.00	21,094,000	貸付株式数	8,400株

SUN ASTERISK	6,900	663.00	4,574,700	貸付株式数	2,600株
デンカ	36,600	2,072.00	75,835,200		
イビデン	57,600	4,678.00	269,452,800	貸付株式数	23,000株
信越化学	893,300	5,620.00	5,020,346,000		
日本カ - バイド	5,100	1,660.00	8,466,000		
電算システムHD	4,300	2,484.00	10,681,200	貸付株式数	1,600株
堺化学	6,900	2,557.00	17,643,300		
第一稀元素化学工	10,600	729.00	7,727,400	貸付株式数	4,200株
エア・ウォーター	94,300	1,860.00	175,398,000		
日本酸素HLDGS	96,700	4,385.00	424,029,500	貸付株式数	36,800株
日本化学工業	3,700	2,392.00	8,850,400		
東邦アセチレン	1,100	349.00	383,900		
日本パ - カライジング	44,300	1,258.00	55,729,400		
高压ガス	14,100	801.00	11,294,100		
チタン工業	200	845.00	169,000	貸付株式数	100株
四国化成ホールディング	11,200	2,102.00	23,542,400		
戸田工業	2,200	1,505.00	3,311,000	貸付株式数	600株
ステラ ケミファ	5,300	3,870.00	20,511,000	貸付株式数	2,100株
保土谷化学	3,200	3,730.00	11,936,000		
日本触媒	63,500	1,855.50	117,824,250		
大日精化	6,900	2,838.00	19,582,200		
カネカ	24,700	3,418.00	84,424,600		
協和キリン	120,500	2,528.00	304,624,000		
APPIER GROUP	30,300	1,462.00	44,298,600	貸付株式数	11,500株
三菱瓦斯化学	81,000	2,871.00	232,551,000		
三井化学	89,700	3,408.00	305,697,600	貸付株式数	21,600株
東京応化工業	47,400	3,500.00	165,900,000		
大阪有機化学	8,400	2,770.00	23,268,000	貸付株式数	3,300株
三菱ケミカルグループ	728,200	846.10	616,130,020		
KHネオケム	17,900	2,044.00	36,587,600	貸付株式数	7,100株
ビジョナル	11,800	7,874.00	92,913,200	貸付株式数	4,600株
ダイセル	113,700	1,323.50	150,481,950		
住友ベ - クライト	31,500	3,820.00	120,330,000		
積水化学	198,500	2,343.50	465,184,750		
日本ゼオン	76,900	1,423.00	109,428,700		
アイカ工業	24,800	3,341.00	82,856,800		
UBE	51,400	2,326.50	119,582,100	貸付株式数	10,400株
積水樹脂	13,400	2,120.00	28,408,000	貸付株式数	2,000株
旭有機材	6,600	4,300.00	28,380,000	貸付株式数	2,600株

ニチバン	6,000	1,929.00	11,574,000	貸付株式数	800株
リケンテクノス	18,300	1,081.00	19,782,300		
大倉工業	4,500	3,120.00	14,040,000	貸付株式数	1,800株
積水化成成品	13,700	360.00	4,932,000	貸付株式数	5,400株
群栄化学	2,300	2,709.00	6,230,700		
タイガース ポリマー	500	673.00	336,500		
ミライアル	400	1,462.00	584,800	貸付株式数	300株
ダイキアクシス	500	718.00	359,000	貸付株式数	300株 (300株)
ダイキョーニシカワ	21,700	627.00	13,605,900		
竹本容器	400	860.00	344,000		
森六ホールディングス	5,400	2,073.00	11,194,200		
恵和	6,400	1,029.00	6,585,600	貸付株式数	2,500株
日本化薬	69,000	1,237.50	85,387,500	貸付株式数	15,900株
カーリット	9,900	1,262.00	12,493,800	貸付株式数	3,900株
ソルクシーズ	900	307.00	276,300	貸付株式数	600株
CLホールディングス	2,400	862.00	2,068,800	貸付株式数	900株
プレステージ・インター	47,600	667.00	31,749,200		
フェイス	300	1,215.00	364,500	貸付株式数	200株
プロトコーポレーション	10,600	1,357.00	14,384,200		
ハイマックス	3,000	1,356.00	4,068,000		
アミューズ	6,100	1,357.00	8,277,700	貸付株式数	2,400株
野村総合研究所	216,200	4,498.00	972,467,600	貸付株式数	82,300株
ドリームインキュベータ	2,400	2,974.00	7,137,600	貸付株式数	100株
クイック	6,900	2,001.00	13,806,900		
T A C	500	193.00	96,500	貸付株式数	300株
C E ホールディングス	500	579.00	289,500		
日本システム技術	9,100	1,850.00	16,835,000		
電通グループ	110,600	3,692.00	408,335,200		
インテージホールディングス	11,100	1,592.00	17,671,200	貸付株式数	4,300株
テイクアンドギヴニーズ	4,800	799.00	3,835,200	貸付株式数	800株
東邦システムサイエンス	4,500	1,415.00	6,367,500	貸付株式数	1,500株
ぴあ	3,400	3,085.00	10,489,000	貸付株式数	1,300株
イオンファンタジー	4,400	2,962.00	13,032,800	貸付株式数	1,700株
ソースネクスト	50,300	199.00	10,009,700	貸付株式数	20,100株
シーティーエス	13,800	928.00	12,806,400		
NEXYZ.GROUP	300	710.00	213,000		

メディカルシステムネット ワーク	10,100	415.00	4,191,500	
日本精化	6,500	2,511.00	16,321,500	貸付株式数 1,600株
扶桑化学工業	9,200	3,450.00	31,740,000	
トリケミカル	10,900	2,831.00	30,857,900	貸付株式数 4,300株
シンプレクスHD	19,500	2,553.00	49,783,500	
HEROZ	3,800	1,031.00	3,917,800	貸付株式数 1,500株
ラクスル	24,200	1,158.00	28,023,600	
メルカリ	48,700	2,045.00	99,591,500	貸付株式数 19,400株
I P S	2,900	2,724.00	7,899,600	
F I G	1,300	295.00	383,500	貸付株式数 1,200株
システムサポート	3,800	1,860.00	7,068,000	
A D E K A	34,800	2,832.00	98,553,600	
日油	117,300	2,322.50	272,429,250	
ミヨシ油脂	600	1,443.00	865,800	
新日本理化	1,600	189.00	302,400	貸付株式数 1,500株
ハリマ化成グループ	7,600	870.00	6,612,000	
イーソル	6,500	689.00	4,478,500	貸付株式数 2,100株
東海ソフト	200	1,323.00	264,600	
ウイングアーク1ST	10,300	3,305.00	34,041,500	
ヒト・コミュニケーション ズHD	3,200	833.00	2,665,600	貸付株式数 1,200株
サーバーワークス	1,700	2,284.00	3,882,800	貸付株式数 600株
東名	200	2,434.00	486,800	
ヴィッツ	100	796.00	79,600	
トビラシステムズ	300	765.00	229,500	
S a n s a n	32,800	1,975.00	64,780,000	貸付株式数 12,800株
LINK-Uグループ	200	480.00	96,000	
ギフトィ	8,600	1,297.00	11,154,200	貸付株式数 3,400株
花王	242,500	6,243.00	1,513,927,500	
第一工業製薬	3,600	3,695.00	13,302,000	
石原ケミカル	4,200	2,442.00	10,256,400	貸付株式数 1,600株
日華化学	400	1,134.00	453,600	
ニイタカ	200	1,930.00	386,000	貸付株式数 100株
三洋化成	6,000	3,995.00	23,970,000	
メドレー	10,900	4,280.00	46,652,000	貸付株式数 2,600株
ベース	4,800	3,215.00	15,432,000	貸付株式数 1,000株
J M D C	12,100	4,200.00	50,820,000	貸付株式数 6,000株
武田薬品	887,500	4,182.00	3,711,525,000	
アステラス製薬	874,900	1,572.50	1,375,780,250	

住友ファーマ	88,700	593.00	52,599,100	
塩野義製薬	331,200	2,059.50	682,106,400	
わかもと製薬	1,300	234.00	304,200	貸付株式数 500株
日本新薬	26,200	4,018.00	105,271,600	
中外製薬	312,300	6,384.00	1,993,723,200	
科研製薬	17,100	4,435.00	75,838,500	
エーザイ	132,400	4,645.00	614,998,000	
理研ビタミン	8,900	2,526.00	22,481,400	
ロート製薬	105,300	2,718.00	286,205,400	
小野薬品	204,100	1,745.00	356,154,500	貸付株式数 79,600株
久光製薬	22,100	4,234.00	93,571,400	貸付株式数 8,400株
有機合成薬品	900	265.00	238,500	
持田製薬	12,500	3,260.00	40,750,000	
参天製薬	189,600	1,666.50	315,968,400	
扶桑薬品	3,800	2,613.00	9,929,400	
日本ケミファ	100	1,501.00	150,100	
ツムラ	34,300	4,887.00	167,624,100	
テルモ	666,400	3,063.00	2,041,183,200	貸付株式数 86,500株
HUGグループHD	29,800	2,446.50	72,905,700	貸付株式数 9,400株
キッセイ薬品工業	16,500	3,705.00	61,132,500	
生化学工業	18,800	813.00	15,284,400	
栄研化学	16,000	2,098.00	33,568,000	貸付株式数 3,800株
鳥居薬品	5,300	4,755.00	25,201,500	
JCRファーマ	33,900	638.00	21,628,200	
東和薬品	13,400	2,827.00	37,881,800	
富士製薬工業	7,300	1,420.00	10,366,000	
ゼリア新薬工業	15,500	2,216.00	34,348,000	
ネクセラファーマ	46,800	1,120.00	52,416,000	貸付株式数 17,800株
第一三共	941,400	4,502.00	4,238,182,800	
杏林製薬	21,400	1,467.00	31,393,800	貸付株式数 8,500株
大幸薬品	22,100	360.00	7,956,000	貸付株式数 8,800株
ダイト	7,400	2,070.00	15,318,000	
大塚ホールディングス	249,000	9,000.00	2,241,000,000	
ペプチドリーム	48,400	2,556.00	123,710,400	貸付株式数 1,200株
大日本塗料	10,800	1,145.00	12,366,000	
日本ペイントHOLD	440,700	998.70	440,127,090	
関西ペイント	83,400	2,113.50	176,265,900	
神東塗料	900	133.00	119,700	貸付株式数 800株
中国塗料	22,500	2,489.00	56,002,500	
日本特殊塗料	800	1,242.00	993,600	

藤倉化成	12,300	519.00	6,383,700	
太陽ホールディングス	17,300	4,130.00	71,449,000	貸付株式数 6,900株
D I C	35,300	3,203.00	113,065,900	
サカティンクス	22,200	1,525.00	33,855,000	
ARTIENCE	17,800	3,110.00	55,358,000	
アルプス技研	8,700	2,568.00	22,341,600	
サニックス	14,200	275.00	3,905,000	
日本空調サービス	10,900	1,020.00	11,118,000	
オリエンタルランド	608,600	3,510.00	2,136,186,000	
フォーカスシステムズ	6,500	1,086.00	7,059,000	
ダスキン	22,100	3,840.00	84,864,000	
パーク24	76,600	1,868.50	143,127,100	
明光ネットワークジャパン	12,100	715.00	8,651,500	貸付株式数 4,600株
ファルコホールディングス	4,000	2,281.00	9,124,000	
クレスコ	16,200	1,214.00	19,666,800	
フジ・メディア・HD	95,600	1,701.50	162,663,400	
秀英予備校	200	296.00	59,200	
田谷	200	342.00	68,400	
ラウンドワン	96,300	1,009.00	97,166,700	
リゾートトラスト	40,400	2,921.00	118,008,400	貸付株式数 11,000株
オービック	185,100	4,865.00	900,511,500	
ジャストシステム	14,300	3,280.00	46,904,000	
T D Cソフト	16,600	1,278.00	21,214,800	貸付株式数 6,200株
L I N Eヤフー	1,595,900	414.10	660,862,190	
ビー・エム・エル	12,500	2,804.00	35,050,000	
トレンドマイクロ	52,400	8,035.00	421,034,000	
IDホールディングス	6,600	1,627.00	10,738,200	
リソー教育	63,300	286.00	18,103,800	
日本オラクル	19,100	15,080.00	288,028,000	貸付株式数 6,700株
早稲田アカデミー	5,500	1,829.00	10,059,500	貸付株式数 2,100株 (900株)
アルファシステムズ	3,100	3,410.00	10,571,000	
フューチャー	24,700	1,933.00	47,745,100	
CAC HOLDINGS	6,000	1,728.00	10,368,000	
トーセ	300	620.00	186,000	貸付株式数 200株
ユー・エス・エス	210,000	1,380.00	289,800,000	
オービックビジネスC	16,800	6,985.00	117,348,000	貸付株式数 5,500株
アイティフォー	11,500	1,394.00	16,031,000	
東京個別指導学院	11,800	399.00	4,708,200	貸付株式数 400株
東計電算	2,700	4,535.00	12,244,500	

サイバーエージェント	226,200	1,020.50	230,837,100	
楽天グループ	720,700	876.30	631,549,410	貸付株式数 297,500株
エックスネット	200	1,402.00	280,400	貸付株式数 100株
クリーク・アンド・リバー社	5,000	1,569.00	7,845,000	
SBIグローバルアセット	19,500	626.00	12,207,000	
テー・オー・ダブリュー	19,600	308.00	6,036,800	
大塚商会	113,000	3,631.00	410,303,000	
サイボウズ	13,700	2,029.00	27,797,300	貸付株式数 5,200株
山田コンサルティングGP	5,100	2,024.00	10,322,400	
セントラルスポーツ	3,700	2,413.00	8,928,100	貸付株式数 1,400株
パラカ	3,000	1,766.00	5,298,000	
電通総研	9,700	5,220.00	50,634,000	
A C C E S S	10,300	1,329.00	13,688,700	貸付株式数 4,100株
デジタルガレージ	16,000	3,585.00	57,360,000	
イーエムシステムズ	16,200	723.00	11,712,600	
ウェザーニューズ	3,000	5,900.00	17,700,000	貸付株式数 900株
C I J	24,200	435.00	10,527,000	
ビジネスエンジニアリング	2,300	4,010.00	9,223,000	貸付株式数 500株
日本エンタープライズ	1,100	107.00	117,700	
WOWOW	7,300	988.00	7,212,400	貸付株式数 2,900株
スカラ	9,000	459.00	4,131,000	貸付株式数 3,600株
インテリジェント ウェイブ	600	1,080.00	648,000	
フルキャストホールディングス	8,300	1,441.00	11,960,300	
エン・ジャパン	16,600	2,056.00	34,129,600	
セルソース	6,500	1,146.00	7,449,000	貸付株式数 2,500株
あすか製薬HD	9,100	2,042.00	18,582,200	
サイワグループHD	58,800	1,947.00	114,483,600	貸付株式数 22,800株
富士フイルムHLDGS	602,900	3,271.00	1,972,085,900	
コニカミノルタ	224,400	687.40	154,252,560	
資生堂	208,300	2,740.50	570,846,150	
ライオン	126,900	1,822.00	231,211,800	
高砂香料	6,600	5,830.00	38,478,000	
マンダム	19,300	1,239.00	23,912,700	
ミルボン	15,900	3,420.00	54,378,000	
コーセー	20,300	6,720.00	136,416,000	
コタ	9,900	1,639.00	16,226,100	
シーボン	200	1,147.00	229,400	貸付株式数 100株
ポーラ・オルビスHD	51,000	1,373.00	70,023,000	貸付株式数 1,300株

ノエビアホールディングス	8,700	4,955.00	43,108,500		
アジュバンホールディング	300	823.00	246,900	貸付株式数	200株 (200株)
新日本製薬	5,600	1,850.00	10,360,000	貸付株式数	2,100株
アクシーシア	6,400	550.00	3,520,000	貸付株式数	2,500株
エステー	7,900	1,499.00	11,842,100	貸付株式数	1,200株
アグロカネショウ	3,400	1,895.00	6,443,000		
コニシ	31,300	1,340.00	41,942,000	貸付株式数	12,500株
長谷川香料	18,900	3,120.00	58,968,000	貸付株式数	1,700株
小林製薬	26,100	5,714.00	149,135,400		
荒川化学工業	9,000	1,118.00	10,062,000		
メック	8,200	3,185.00	26,117,000	貸付株式数	3,200株
日本高純度化学	2,400	3,400.00	8,160,000		
タカラバイオ	31,400	1,074.00	33,723,600		
JCU	11,000	3,730.00	41,030,000		
新田ゼラチン	1,000	750.00	750,000	貸付株式数	700株
OATアグリオ	4,000	2,046.00	8,184,000	貸付株式数	1,600株
デクセリアルズ	87,400	2,413.00	210,896,200	貸付株式数	9,400株
アース製薬	9,000	5,500.00	49,500,000		
北興化学	8,900	1,307.00	11,632,300		
大成ラミック	2,800	2,560.00	7,168,000		
クミアイ化学	39,300	808.00	31,754,400	貸付株式数	8,800株
日本農薬	14,900	704.00	10,489,600		
富士興産	300	1,434.00	430,200		
ニチレキグループ	11,300	2,409.00	27,221,700		
ユシロ化学	5,100	2,162.00	11,026,200		
ピーピー・カストロール	500	886.00	443,000	貸付株式数	400株
富士石油	25,500	293.00	7,471,500	貸付株式数	10,200株
MORESCO	400	1,257.00	502,800		
出光興産	466,500	1,009.50	470,931,750		
ENEOSホールディングス	1,692,800	790.50	1,338,158,400		
コスモエネルギーHLDGS	32,900	6,728.00	221,351,200		
テスホールディングス	21,200	286.00	6,063,200	貸付株式数	8,000株
インフロニアHD	100,800	1,219.50	122,925,600		
横浜ゴム	50,500	3,047.00	153,873,500		
TOYO TIRE	57,500	2,411.00	138,632,500		
ブリヂストン	292,000	5,397.00	1,575,924,000		
住友ゴム	98,000	1,796.00	176,008,000		
藤倉コンポジット	9,400	1,555.00	14,617,000		
オカモト	5,200	5,350.00	27,820,000		

アキレス	5,300	1,485.00	7,870,500	貸付株式数	1,100株
フコク	5,800	1,800.00	10,440,000	貸付株式数	2,100株
ニッタ	9,700	3,620.00	35,114,000	貸付株式数	1,000株
クリエートメディック	2,200	906.00	1,993,200		
住友理工	19,300	1,603.00	30,937,900		
三ツ星ベルト	13,600	4,180.00	56,848,000	貸付株式数	2,900株
バンドー化学	14,600	1,783.00	26,031,800		
A G C	96,800	4,641.00	449,248,800		
日本板硝子	49,800	336.00	16,732,800	貸付株式数	18,500株
石塚硝子	200	2,474.00	494,800	貸付株式数	100株
有沢製作所	14,600	1,492.00	21,783,200		
日本山村硝子	500	1,641.00	820,500		
日本電気硝子	36,600	3,441.00	125,940,600		
オハラ	4,600	1,239.00	5,699,400	貸付株式数	100株
住友大阪セメント	17,700	3,198.00	56,604,600	貸付株式数	6,100株
太平洋セメント	61,600	3,435.00	211,596,000		
リソルホールディングス	200	4,995.00	999,000		
日本ヒューム	9,100	1,258.00	11,447,800	貸付株式数	3,200株
日本コンクリート	21,700	379.00	8,224,300	貸付株式数	7,700株 (300株)
三谷セキサン	4,300	5,930.00	25,499,000	貸付株式数	700株
アジアパイルHD	15,400	781.00	12,027,400		
東海カーボン	91,500	934.60	85,515,900		
日本カーボン	5,600	4,380.00	24,528,000		
東洋炭素	7,000	4,650.00	32,550,000	貸付株式数	2,800株
ノリタケ	10,800	3,835.00	41,418,000		
TOTO	72,300	4,043.00	292,308,900	貸付株式数	25,000株
日本碍子	115,500	2,015.50	232,790,250		
日本特殊陶業	81,900	4,883.00	399,917,700		
ダントーホールディングス	400	327.00	130,800	貸付株式数	200株
MARUWA	4,100	44,440.00	182,204,000	貸付株式数	1,400株
品川リフラクトリーズ	12,000	1,654.00	19,848,000		
黒崎播磨	6,600	2,428.00	16,024,800		
ヨータイ	5,000	1,558.00	7,790,000		
東京窯業	1,300	419.00	544,700		
ニッカトー	500	486.00	243,000		
フジインコーポレーテッド	26,700	2,376.00	63,439,200		
クニミネ工業	400	1,005.00	402,000	貸付株式数	300株
エーアンドエーマテリアル	300	1,190.00	357,000		

ニチアス	25,100	5,930.00	148,843,000	
日本製鉄	519,600	3,115.00	1,618,554,000	
神戸製鋼所	206,500	1,620.50	334,633,250	貸付株式数 60,300株
中山製鋼所	21,000	728.00	15,288,000	貸付株式数 8,400株
合同製鐵	5,700	3,840.00	21,888,000	貸付株式数 2,200株
J F Eホールディングス	309,500	1,747.50	540,851,250	
東京製鐵	28,500	1,454.00	41,439,000	貸付株式数 10,700株
共英製鋼	10,000	1,759.00	17,590,000	
大和工業	19,300	8,123.00	156,773,900	
東京鐵鋼	4,500	6,460.00	29,070,000	貸付株式数 1,700株
大阪製鐵	4,600	3,020.00	13,892,000	貸付株式数 1,800株
淀川製鋼所	9,400	5,210.00	48,974,000	貸付株式数 3,700株
中部鋼鈑	6,600	2,173.00	14,341,800	貸付株式数 2,600株
丸一鋼管	31,000	3,333.00	103,323,000	貸付株式数 1,800株
モリ工業	2,500	4,805.00	12,012,500	
大同特殊鋼	64,300	1,179.50	75,841,850	
日本高周波	500	393.00	196,500	貸付株式数 400株
日本冶金工	6,900	4,015.00	27,703,500	
山陽特殊製鋼	9,900	1,866.00	18,473,400	貸付株式数 2,400株
愛知製鋼	5,800	4,595.00	26,651,000	
日本金属	300	652.00	195,600	貸付株式数 200株
ミガロホールディングス	400	1,615.00	646,000	貸付株式数 300株
大平洋金属	9,200	1,420.00	13,064,000	貸付株式数 2,200株
新日本電工	59,800	290.00	17,342,000	
栗本鉄工所	4,700	4,050.00	19,035,000	
虹 技	200	1,169.00	233,800	貸付株式数 100株
日本鑄鉄管	200	1,101.00	220,200	貸付株式数 100株
日本製鋼所	30,500	6,690.00	204,045,000	貸付株式数 12,200株
三菱製鋼	7,400	1,383.00	10,234,200	
日亜鋼業	1,100	301.00	331,100	
日本精線	7,900	1,293.00	10,214,700	
エンビプロHD	9,900	429.00	4,247,100	貸付株式数 3,900株 (1,400株)
大紀アルミニウム	14,300	1,060.00	15,158,000	貸付株式数 4,900株
日本軽金属HD	30,000	1,522.00	45,660,000	
三井金属	25,700	4,659.00	119,736,300	貸付株式数 10,200株
東邦亜鉛	7,900	791.00	6,248,900	貸付株式数 3,100株
三菱マテリアル	73,500	2,431.50	178,715,250	貸付株式数 26,200株
住友鉱山	129,800	3,863.00	501,417,400	貸付株式数 34,700株

DOWAホールディングス	27,700	4,544.00	125,868,800	貸付株式数	11,000株
古河機金	13,500	1,607.00	21,694,500		
エス・サイエンス	6,800	22.00	149,600	貸付株式数	6,400株
大阪チタニウム	17,700	1,999.00	35,382,300	貸付株式数	7,000株
東邦チタニウム	21,000	1,032.00	21,672,000	貸付株式数	8,400株
U A C J	14,300	5,550.00	79,365,000		
C K サンエツ	2,400	3,710.00	8,904,000	貸付株式数	500株
古河電工	34,400	6,055.00	208,292,000		
住友電工	354,600	2,886.00	1,023,375,600		
フジクラ	110,200	5,643.00	621,858,600		
S W C C	13,700	7,430.00	101,791,000	貸付株式数	5,400株
カナレ電気	200	1,412.00	282,400		
平河ビューテック	6,400	1,532.00	9,804,800	貸付株式数	1,500株
いよぎんホールディング	128,800	1,540.50	198,416,400		
しずおかフィナンシャル	216,700	1,315.00	284,960,500		
ちゅうぎんフィナンシャ	82,900	1,566.00	129,821,400		
楽天銀行	45,400	3,987.00	181,009,800	貸付株式数	9,300株
京都フィナンシャルG	123,600	2,220.00	274,392,000	貸付株式数	33,000株
リョービ	10,800	1,967.00	21,243,600		
アーレステイ	1,200	532.00	638,400		
AREホールディングス	41,100	1,773.00	72,870,300		
東洋製罐グループHD	65,400	2,249.50	147,117,300		
ホッカンホールディングス	5,400	1,718.00	9,277,200		
コロナ	5,600	941.00	5,269,600		
横河ブリッジHLDGS	18,700	2,775.00	51,892,500		
駒井ハルテック	500	1,558.00	779,000		
高田機工	800	1,032.00	825,600		
三和ホールディングス	102,100	4,433.00	452,609,300		
文化シヤッタ -	26,600	1,855.00	49,343,000		
三協立山	12,600	726.00	9,147,600	貸付株式数	4,900株
アルインコ	7,600	959.00	7,288,400	貸付株式数	1,100株
東洋シヤッタ -	300	781.00	234,300		
L I X I L	149,000	1,762.00	262,538,000	貸付株式数	61,000株
日本フィルコン	800	545.00	436,000	貸付株式数	700株
ノーリツ	14,100	1,715.00	24,181,500		
長府製作所	11,200	1,918.00	21,481,600		
リンナイ	54,300	3,155.00	171,316,500	貸付株式数	20,800株
ユニプレス	17,700	1,013.00	17,930,100	貸付株式数	7,000株
ダイニチ工業	600	618.00	370,800		

日東精工	14,500	593.00	8,598,500	貸付株式数	2,600株
三洋工業	100	2,881.00	288,100		
岡 部	17,900	799.00	14,302,100		
ジーテクト	11,200	1,589.00	17,796,800		
東 プ レ	18,100	1,979.00	35,819,900	貸付株式数	2,300株
高周波熱錬	16,200	987.00	15,989,400	貸付株式数	2,600株
東京製綱	6,500	1,260.00	8,190,000	貸付株式数	2,400株
サンコール	11,100	337.00	3,740,700		
モリテックスチル	1,000	176.00	176,000	貸付株式数	400株
パイオラックス	13,700	2,472.00	33,866,400	貸付株式数	700株
エイチワン	10,300	1,015.00	10,454,500		
日本発条	90,700	1,812.00	164,348,400	貸付株式数	36,200株
中央発條	6,500	1,238.00	8,047,000		
アドバネクス	100	787.00	78,700		
三浦工業	46,600	3,777.00	176,008,200		
タ ク マ	33,600	1,591.00	53,457,600		
テクノプロ・ホールディング	59,300	2,743.50	162,689,550		
アトラグループ	400	129.00	51,600	貸付株式数	200株
アイ・アールジャパンHD	5,300	826.00	4,377,800	貸付株式数	2,000株
K e e P e r 技研	6,300	4,300.00	27,090,000	貸付株式数	2,500株
樂待	400	702.00	280,800	貸付株式数	300株
三機サービス	400	917.00	366,800	貸付株式数	100株
G u n o s y	7,900	723.00	5,711,700	貸付株式数	3,100株
デザインワン・ジャパン	600	121.00	72,600	貸付株式数	200株
イー・ガーディアン	4,800	1,801.00	8,644,800		
リブセンス	600	152.00	91,200	貸付株式数	500株
ジャパンマテリアル	31,200	1,610.00	50,232,000		
ベクトル	14,100	940.00	13,254,000		
ウチヤマホールディングス	600	312.00	187,200	貸付株式数	500株 (400株)
チャームケアコーポレーション	8,500	1,220.00	10,370,000		
キャリアリンク	3,700	2,567.00	9,497,900		
I B J	7,700	615.00	4,735,500	貸付株式数	2,200株
アサンテ	4,900	1,650.00	8,085,000	貸付株式数	1,800株
バリューHR	8,900	1,838.00	16,358,200	貸付株式数	3,500株 (400株)
M&Aキャピタルパートナー	8,300	2,499.00	20,741,700		
ライドオンエクスプレスHD	4,000	998.00	3,992,000		

ERIホールディングス	400	1,936.00	774,400	貸付株式数	300株
アピスト	200	3,065.00	613,000	貸付株式数	100株
シグマクシス・ホールディング	14,900	1,848.00	27,535,200		
シグマクシス・ホールディング					
ウィルグループ	8,400	964.00	8,097,600		
エスクローA J	1,400	141.00	197,400		
メドピア	8,000	498.00	3,984,000	貸付株式数	3,200株
レアジョブ	300	391.00	117,300		
リクルートホールディングス	797,700	9,565.00	7,630,000,500		
エラン	13,300	719.00	9,562,700		
ツガミ	21,300	1,380.00	29,394,000		
オークマ	17,700	3,025.00	53,542,500		
芝浦機械	13,200	3,920.00	51,744,000	貸付株式数	5,100株
アマダ	140,100	1,451.00	203,285,100		
アイダエンジニア	22,000	793.00	17,446,000		
F U J I	43,800	2,229.50	97,652,100		
牧野フライス	11,100	6,360.00	70,596,000		
オーエスジー	44,000	1,782.00	78,408,000		
ダイジェット	200	722.00	144,400	貸付株式数	100株
旭ダイヤモンド	24,500	816.00	19,992,000		
DMG森精機	63,400	2,665.50	168,992,700		
ソディック	25,800	724.00	18,679,200		
ディスコ	48,400	42,310.00	2,047,804,000		
日東工器	3,800	2,699.00	10,256,200	貸付株式数	1,700株
日進工具	8,200	762.00	6,248,400		
パンチ工業	1,200	403.00	483,600	貸付株式数	1,100株
富士ダイス	7,300	761.00	5,555,300	貸付株式数	1,900株
土木管理総合試験	500	303.00	151,500		
日本郵政	1,138,800	1,472.50	1,676,883,000		
ベルシステム24HLDGS	10,700	1,285.00	13,749,500		
鎌倉新書	8,500	521.00	4,428,500	貸付株式数	3,300株 (1,700株)
S M N	400	352.00	140,800		
一蔵	200	414.00	82,800	貸付株式数	100株
グローバルキッズCOMP	200	709.00	141,800		
エアトリ	7,300	1,041.00	7,599,300	貸付株式数	2,900株
アトラエ	7,000	778.00	5,446,000	貸付株式数	2,800株
ストライク	5,100	3,790.00	19,329,000	貸付株式数	1,800株

ソラスト	27,800	472.00	13,121,600	
セラク	3,000	1,293.00	3,879,000	貸付株式数 1,100株
インソース	22,000	1,020.00	22,440,000	
豊田自動織機	84,900	11,555.00	981,019,500	
豊和工業	700	1,143.00	800,100	
石川製作所	300	1,546.00	463,800	貸付株式数 200株
リケンNPR	12,600	2,422.00	30,517,200	貸付株式数 5,000株
東洋機械金属	1,000	641.00	641,000	
津田駒工業	300	366.00	109,800	貸付株式数 200株
エンシュウ	300	605.00	181,500	
島精機製作所	15,600	1,084.00	16,910,400	貸付株式数 6,200株
オプトラン	16,600	1,859.00	30,859,400	
イワキポンプ	6,600	2,750.00	18,150,000	貸付株式数 1,800株
フリーー	9,300	1,132.00	10,527,600	貸付株式数 3,700株
ヤマシンフィルタ	21,100	570.00	12,027,000	貸付株式数 8,200株
日阪製作所	11,900	964.00	11,471,600	
やまびこ	16,500	2,521.00	41,596,500	
野村マイクロ・サイエンス	16,600	1,848.00	30,676,800	貸付株式数 6,600株 (100株)
平田機工	4,800	5,160.00	24,768,000	貸付株式数 1,900株
PEGASUS	10,800	445.00	4,806,000	
マルマエ	4,400	1,590.00	6,996,000	貸付株式数 1,700株
タツモ	7,200	2,797.00	20,138,400	貸付株式数 2,800株
ナブテスコ	63,400	2,376.00	150,638,400	
三井海洋開発	12,700	3,305.00	41,973,500	
レオン自動機	10,600	1,415.00	14,999,000	
SMC	30,100	66,500.00	2,001,650,000	
ホソカワミクロン	7,000	3,930.00	27,510,000	
ユニオンツール	4,400	5,880.00	25,872,000	貸付株式数 1,700株
瑞光	6,300	1,236.00	7,786,800	貸付株式数 2,700株
オイレス工業	13,500	2,312.00	31,212,000	
日精エーエスビー	3,400	5,190.00	17,646,000	
サト - ホールディングス	12,600	2,129.00	26,825,400	
技研製作所	9,200	1,761.00	16,201,200	貸付株式数 3,600株
日本エアータック	4,600	1,245.00	5,727,000	
カワタ	400	803.00	321,200	
日精樹脂工業	6,500	951.00	6,181,500	
オカダアイヨン	400	1,890.00	756,000	
ワイエイシイホールディングス	5,200	1,960.00	10,192,000	貸付株式数 2,000株

小松製作所	507,300	4,075.00	2,067,247,500	
住友重機械	59,700	3,227.00	192,651,900	
日立建機	40,200	3,371.00	135,514,200	貸付株式数 16,000株
日工	14,500	705.00	10,222,500	
巴工業	3,900	3,870.00	15,093,000	貸付株式数 300株
井関農機	9,200	970.00	8,924,000	貸付株式数 3,500株
TOWA	30,700	1,610.00	49,427,000	貸付株式数 12,600株
丸山製作所	200	2,071.00	414,200	
北川鉄工所	3,900	1,215.00	4,738,500	
シンニッタン	1,400	202.00	282,800	
ローツェ	52,600	1,808.00	95,100,800	貸付株式数 17,100株
タカキタ	400	395.00	158,000	貸付株式数 100株
クボタ	525,300	1,921.00	1,009,101,300	
荏原実業	4,700	4,405.00	20,703,500	
東洋エンジニア	14,300	675.00	9,652,500	
三菱化工機	3,500	3,240.00	11,340,000	
月島ホールディングス	13,200	1,471.00	19,417,200	
帝国電機製作所	6,700	2,740.00	18,358,000	
東京機械	300	346.00	103,800	
新東工業	22,000	960.00	21,120,000	貸付株式数 2,800株
渋谷工業	9,600	3,955.00	37,968,000	
アイチ コーポレーション	16,400	1,190.00	19,516,000	
小森コーポレーション	24,400	1,125.00	27,450,000	
鶴見製作所	7,600	3,670.00	27,892,000	貸付株式数 100株
日本ギア工業	500	475.00	237,500	貸付株式数 300株
酒井重工業	3,900	2,426.00	9,461,400	
荏原製作所	206,600	2,322.00	479,725,200	
西島製作所	8,500	2,454.00	20,859,000	貸付株式数 3,400株
北越工業	9,900	1,723.00	17,057,700	貸付株式数 3,900株
ダイキン工業	130,800	18,305.00	2,394,294,000	
オルガノ	15,500	8,530.00	132,215,000	貸付株式数 600株
ト - ヨ - カネツ	3,700	4,095.00	15,151,500	
栗田工業	56,200	6,069.00	341,077,800	
椿本チエイン	45,600	1,898.00	86,548,800	
大同工業	500	766.00	383,000	
日機装	26,800	996.00	26,692,800	
木村化工機	7,500	961.00	7,207,500	
レイズネクスト	13,800	1,480.00	20,424,000	
アネスト岩田	16,700	1,494.00	24,949,800	

ダイフク	169,700	3,228.00	547,791,600		
サムコ	2,300	2,929.00	6,736,700	貸付株式数	900株
加藤製作所	600	1,274.00	764,400		
油研工業	200	2,495.00	499,000		
タダノ	58,100	1,167.00	67,802,700	貸付株式数	4,600株
フジテック	32,200	5,837.00	187,951,400		
C K D	28,000	2,564.00	71,792,000		
平和	33,200	2,113.00	70,151,600		
理想科学工業	8,000	3,545.00	28,360,000	貸付株式数	3,000株
S A N K Y O	116,000	2,130.50	247,138,000		
日本金銭機械	11,900	1,017.00	12,102,300	貸付株式数	4,700株
マースグループHLDGS	6,700	3,290.00	22,043,000	貸付株式数	2,200株
フクシマガリレイ	7,300	5,280.00	38,544,000		
オーイズミ	400	353.00	141,200	貸付株式数	100株
ダイコク電機	4,400	3,390.00	14,916,000	貸付株式数	1,700株
竹内製作所	18,200	4,830.00	87,906,000	貸付株式数	200株
ア マ ノ	28,400	4,256.00	120,870,400	貸付株式数	10,800株
J U K I	15,200	398.00	6,049,600	貸付株式数	5,900株
サンデン	2,000	151.00	302,000	貸付株式数	1,700株
ジャノメ	8,500	1,028.00	8,738,000		
ブラザー工業	134,200	2,706.50	363,212,300		
マックス	12,300	3,355.00	41,266,500	貸付株式数	2,700株
モリタホールディングス	15,300	2,071.00	31,686,300		
グローリー	26,200	2,599.00	68,093,800		
新晃工業	10,000	4,005.00	40,050,000	貸付株式数	1,500株
大和冷機工業	15,000	1,455.00	21,825,000		
セガサミーホールディングス	89,700	2,686.00	240,934,200		
T P R	12,600	2,423.00	30,529,800	貸付株式数	1,000株
ツバキ・ナカシマ	24,500	527.00	12,911,500	貸付株式数	9,400株
ホシザキ	64,600	6,010.00	388,246,000		
大豊工業	8,500	603.00	5,125,500	貸付株式数	3,400株
日本精工	185,900	670.40	124,627,360		
N T N	238,900	243.40	58,148,260	貸付株式数	95,200株
ジェイテクト	89,800	1,070.00	96,086,000		
不二越	7,300	3,185.00	23,250,500	貸付株式数	2,900株
ミネベアミツミ	174,700	2,509.50	438,409,650		
日本トムソン	26,700	475.00	12,682,500		
T H K	58,200	3,437.00	200,033,400		

ユーシン精機	9,000	661.00	5,949,000	
前澤給装工業	7,000	1,307.00	9,149,000	
イーグル工業	10,800	1,978.00	21,362,400	貸付株式数 4,100株
前澤工業	700	1,165.00	815,500	
P I L L A R	9,300	4,690.00	43,617,000	
キット	33,700	1,102.00	37,137,400	
日立	2,586,500	3,816.00	9,870,084,000	
三菱電機	1,021,600	2,621.00	2,677,613,600	
富士電機	61,100	8,511.00	520,022,100	
東洋電機製造	400	1,097.00	438,800	
安川電機	109,100	4,170.00	454,947,000	貸付株式数 8,200株
シンフォニア テクノロジー	9,900	6,080.00	60,192,000	貸付株式数 2,500株
明電舎	16,900	4,180.00	70,642,000	貸付株式数 6,600株
オリジン	200	1,139.00	227,800	
山洋電気	4,300	8,340.00	35,862,000	貸付株式数 1,600株
デンヨー	7,500	2,625.00	19,687,500	
PHCホールディングス	19,100	958.00	18,297,800	貸付株式数 7,500株
KOKUSAI ELECTRIC	70,300	2,277.00	160,073,100	貸付株式数 27,700株
ソシオネクスト	100,100	2,426.50	242,892,650	
ベイカレント	75,100	5,542.00	416,204,200	
ORCHESTRA HLDGS	2,200	862.00	1,896,400	
アイモバイル	12,700	514.00	6,527,800	
ディスラプターズ	700	164.00	114,800	貸付株式数 200株
M S - J a p a n	5,400	1,030.00	5,562,000	貸付株式数 500株
船場	800	1,303.00	1,042,400	
ジャパンエレベーターSHD	39,700	2,730.00	108,381,000	
フルテック	200	1,165.00	233,000	貸付株式数 100株 (100株)
グリーンズ	400	1,768.00	707,200	
ツナググループHLDGS	300	610.00	183,000	貸付株式数 100株
GAMEWITH	500	227.00	113,500	貸付株式数 400株
MS&CONSULTING	100	466.00	46,600	
エル・ティー・エス	1,300	2,410.00	3,133,000	貸付株式数 500株
ミダックホールディングス	6,300	1,662.00	10,470,600	貸付株式数 2,400株
キュービーネットHLDGS	5,700	1,006.00	5,734,200	
オープングループ	15,800	210.00	3,318,000	貸付株式数 5,200株
三桜工業	13,700	756.00	10,357,200	
マキタ	125,000	4,672.00	584,000,000	
東芝テック	15,100	3,615.00	54,586,500	

芝浦メカトロニクス	7,300	8,300.00	60,590,000	
マブチモーター	43,200	2,215.50	95,709,600	
ニデック	443,400	2,916.50	1,293,176,100	
ユーエムシーエレクトロニクス	6,200	348.00	2,157,600	貸付株式数 2,200株
トレックス・セミコンダクター	4,600	1,293.00	5,947,800	
東光高岳	5,300	2,012.00	10,663,600	
ダブル・スコープ	30,100	325.00	9,782,500	貸付株式数 12,000株
宮越ホールディングス	4,400	1,870.00	8,228,000	貸付株式数 1,700株
ダイヘン	9,500	7,160.00	68,020,000	
ヤーマン	19,100	756.00	14,439,600	貸付株式数 7,600株 (200株)
JVCケンウッド	79,200	1,485.00	117,612,000	
ミマキエンジニアリング	8,300	1,515.00	12,574,500	
I - P E X	5,400	2,944.00	15,897,600	
大崎電気	21,000	799.00	16,779,000	
オムロン	92,100	5,099.00	469,617,900	貸付株式数 36,800株
日東工業	13,200	2,926.00	38,623,200	貸付株式数 5,200株
I D E C	15,700	2,498.00	39,218,600	
正興電機製作所	400	1,199.00	479,600	貸付株式数 100株
不二電機工業	300	1,119.00	335,700	貸付株式数 200株
ジーエス・ユアサ コーポ	44,900	2,701.00	121,274,900	貸付株式数 17,900株
サクサ	300	2,712.00	813,600	
メルコホールディングス	2,300	2,206.00	5,073,800	
テクノメディカ	2,500	1,820.00	4,550,000	貸付株式数 900株
ダイヤモンドエレクトリック HD	4,000	560.00	2,240,000	貸付株式数 1,400株
日本電気	142,100	12,360.00	1,756,356,000	
富士通	924,400	2,793.00	2,581,849,200	
沖電気	49,200	953.00	46,887,600	
電気興業	4,000	1,739.00	6,956,000	
サンケン電気	10,200	5,730.00	58,446,000	
ナカヨ	200	1,116.00	223,200	
アイホン	6,000	2,782.00	16,692,000	
ルネサスエレクトロニクス	765,500	2,028.50	1,552,816,750	
セイコーエプソン	128,900	2,680.00	345,452,000	貸付株式数 49,100株
ワコム	70,600	693.00	48,925,800	
アルバック	22,100	6,264.00	138,434,400	
アクセル	4,900	1,290.00	6,321,000	

E I Z O	12,800	2,218.00	28,390,400	
ジャパンディスプレイ	61,700	19.00	1,172,300	
日本信号	22,300	901.00	20,092,300	
京三製作所	22,800	530.00	12,084,000	
能美防災	13,300	2,960.00	39,368,000	
ホーチキ	6,300	2,419.00	15,239,700	
星和電機	500	522.00	261,000	
エレコム	23,800	1,445.00	34,391,000	
パナソニック ホールディング	1,186,800	1,524.50	1,809,276,600	
シャープ	145,100	1,012.00	146,841,200	貸付株式数 58,000株
アンリツ	72,400	1,162.50	84,165,000	貸付株式数 28,300株
富士通ゼネラル	28,400	2,021.00	57,396,400	
ソニーグループ	3,482,400	3,018.00	10,509,883,200	
T D K	867,300	1,918.50	1,663,915,050	
帝国通信工業	4,300	3,030.00	13,029,000	
タムラ製作所	39,100	514.00	20,097,400	
アルプスアルパイン	81,400	1,534.00	124,867,600	貸付株式数 2,200株
池上通信機	400	637.00	254,800	
日本電波工業	9,200	958.00	8,813,600	貸付株式数 3,600株
鈴木	5,200	1,816.00	9,443,200	
メイコー	9,900	8,720.00	86,328,000	
日本トリム	2,200	3,385.00	7,447,000	
フオスタ - 電機	10,100	1,819.00	18,371,900	
S M K	2,400	2,350.00	5,640,000	
ヨコオ	8,800	1,519.00	13,367,200	
ティアック	1,700	85.00	144,500	貸付株式数 1,600株
ホシデン	24,500	2,266.00	55,517,000	
ヒロセ電機	14,500	17,715.00	256,867,500	
日本航空電子	25,800	2,690.00	69,402,000	
T O A	9,900	921.00	9,117,900	
マクセル	19,900	1,700.00	33,830,000	
古野電気	11,900	2,799.00	33,308,100	
スミダコーポレーション	13,200	943.00	12,447,600	
アイコム	3,800	2,749.00	10,446,200	貸付株式数 300株
リオン	4,600	2,401.00	11,044,600	
横河電機	110,500	3,400.00	375,700,000	
新電元工業	3,800	2,530.00	9,614,000	貸付株式数 1,400株
アズビル	273,100	1,219.50	333,045,450	
東亜ディーケーケー	2,100	734.00	1,541,400	

日本光電工業	89,700	2,184.50	195,949,650	貸付株式数	31,500株
チノー	4,500	2,216.00	9,972,000	貸付株式数	1,300株
共和電業	5,200	421.00	2,189,200		
日本電子材料	6,100	2,038.00	12,431,800		
堀場製作所	19,000	8,103.00	153,957,000		
アドバンテスト	313,500	9,541.00	2,991,103,500		
小野測器	2,000	554.00	1,108,000		
エスペック	9,900	2,661.00	26,343,900		
キーエンス	99,600	64,880.00	6,462,048,000		
日置電機	5,300	7,920.00	41,976,000	貸付株式数	2,000株
シスメックス	257,800	3,072.00	791,961,600		
日本マイクロニクス	16,400	3,710.00	60,844,000	貸付株式数	6,500株
メガチップス	7,700	5,580.00	42,966,000		
OBARA GROUP	6,100	4,050.00	24,705,000	貸付株式数	1,800株
IMAGICA GROUP	9,700	486.00	4,714,200	貸付株式数	3,400株
澤藤電機	100	956.00	95,600		
デンソー	1,055,500	2,294.00	2,421,317,000		
原田工業	600	539.00	323,400		
コーセル	10,400	1,181.00	12,282,400	貸付株式数	4,000株
イリソ電子工業	10,000	2,650.00	26,500,000		
オブテックスグループ	17,800	1,722.00	30,651,600		
千代田インテグレ	3,400	3,505.00	11,917,000		
レーザーテック	45,600	17,420.00	794,352,000		
スタンレー電気	62,200	2,588.50	161,004,700	貸付株式数	20,700株
ウシオ電機	43,300	2,075.00	89,847,500		
岡谷電機	900	228.00	205,200	貸付株式数	800株
ヘリオステクノH	1,200	956.00	1,147,200		
エノモト	300	1,474.00	442,200		
日本セラミック	8,900	2,659.00	23,665,100	貸付株式数	3,500株
遠藤照明	500	1,359.00	679,500		
古河電池	7,100	1,368.00	9,712,800	貸付株式数	2,400株
山一電機	7,900	2,580.00	20,382,000	貸付株式数	1,900株
函研	9,000	4,230.00	38,070,000		
日本電子	23,300	5,695.00	132,693,500	貸付株式数	9,500株
カシオ	79,500	1,082.50	86,058,750		
ファナック	482,100	4,072.00	1,963,111,200		
日本シイエムケイ	28,400	452.00	12,836,800		
エンプラス	2,900	5,390.00	15,631,000	貸付株式数	1,100株 (100株)

大真空	11,800	526.00	6,206,800	貸付株式数	4,700株
ローム	180,000	1,448.50	260,730,000	貸付株式数	72,000株
浜松ホトニクス	159,600	1,745.00	278,502,000	貸付株式数	53,800株
三井ハイテック	43,600	768.00	33,484,800	貸付株式数	17,400株
新光電気工業	35,100	5,220.00	183,222,000		
京セラ	617,400	1,473.00	909,430,200		
協栄産業	100	2,198.00	219,800		
太陽誘電	43,500	2,153.50	93,677,250		
村田製作所	888,200	2,561.00	2,274,680,200		
双葉電子工業	18,500	469.00	8,676,500		
日東電工	315,800	2,463.50	777,973,300		
北陸電気工業	400	1,590.00	636,000		
東海理化電機	28,000	2,117.00	59,276,000		
ニチコン	25,500	1,079.00	27,514,500		
日本ケミコン	11,900	1,137.00	13,530,300	貸付株式数	4,700株
K O A	16,200	1,003.00	16,248,600		
三井E & S	53,800	1,558.00	83,820,400	貸付株式数	21,500株
カナデビア	82,300	940.00	77,362,000		
三菱重工業	1,756,600	2,384.00	4,187,734,400		
川崎重工業	75,000	6,411.00	480,825,000		
I H I	80,600	9,079.00	731,767,400		
名村造船所	28,400	1,738.00	49,359,200	貸付株式数	11,300株
サノヤスホールディングス	1,600	170.00	272,000	貸付株式数	1,500株
スプリックス	300	786.00	235,800	貸付株式数	100株
マネジメントソリューションズ	5,000	1,890.00	9,450,000		
プロレド・パートナーズ	2,500	472.00	1,180,000	貸付株式数	1,000株
AND FACTORY	300	231.00	69,300	貸付株式数	200株
テノ.ホールディングス	100	534.00	53,400		
フロンティア・マネジメント	3,000	740.00	2,220,000		
ピアラ	200	274.00	54,800		
コプロ・ホールディングス	400	1,800.00	720,000	貸付株式数	200株
ギークス	300	406.00	121,800		
アンビスホールディングス	21,800	976.00	21,276,800	貸付株式数	3,800株
カーブスホールディングス	27,900	781.00	21,789,900		
フォーラムエンジニアリング	11,700	972.00	11,372,400		
FAST FITNESS JAP	3,500	1,393.00	4,875,500		
日本車輛	4,000	2,267.00	9,068,000		

三菱ロジスネクスト	16,000	1,294.00	20,704,000	貸付株式数	6,300株
近畿車輛	200	1,350.00	270,000		
一家ホールディングス	300	667.00	200,100	貸付株式数	200株
フルサト・マルカHD	8,200	2,241.00	18,376,200		
ヤマエグループHD	11,400	2,137.00	24,361,800	貸付株式数	4,500株
ジャパングラフトホール ディ	900	141.00	126,900	貸付株式数	800株
F P G	35,100	2,988.00	104,878,800		
島根銀行	300	489.00	146,700	貸付株式数	200株
じもとホールディングス	1,000	296.00	296,000	貸付株式数	900株
全国保証	25,800	5,415.00	139,707,000		
めぶきフィナンシャルG	493,600	652.50	322,074,000	貸付株式数	90,000株
ジャパンインベストメントA	16,100	1,121.00	18,048,100	貸付株式数	5,500株
東京きらぼしFG	12,600	4,055.00	51,093,000		
九州フィナンシャルG	173,100	716.00	123,939,600		
かんぽ生命保険	111,300	3,075.00	342,247,500		
ゆうちょ銀行	807,900	1,452.50	1,173,474,750		
あんしん保証	500	165.00	82,500	貸付株式数	100株
富山第一銀行	31,300	1,079.00	33,772,700	貸付株式数	12,400株
コンコルディア・フィナン シャル	522,600	868.00	453,616,800		
ジェイリース	7,300	1,313.00	9,584,900		
西日本フィナンシャルHD	60,600	1,978.00	119,866,800		
イントラスト	400	796.00	318,400		
日本モーゲージサービス	600	421.00	252,600	貸付株式数	200株
C a s a	400	860.00	344,000	貸付株式数	300株
S B I アルヒ	9,700	820.00	7,954,000	貸付株式数	200株
プレミアグループ	16,600	2,518.00	41,798,800		
日産自動車	1,310,300	419.40	549,539,820	貸付株式数	510,600株
いすゞ自動車	307,300	1,973.00	606,302,900		
トヨタ自動車	5,287,100	2,698.50	14,267,239,350		
日野自動車	149,600	413.00	61,784,800		
三菱自動車工業	388,100	447.10	173,519,510	貸付株式数	155,200株
エフテック	800	505.00	404,000	貸付株式数	700株
レシップホールディングス	600	515.00	309,000		
G M B	300	1,024.00	307,200	貸付株式数	200株
ファルテック	200	433.00	86,600		
武蔵精密工業	24,400	3,425.00	83,570,000		
日産車体	14,900	1,088.00	16,211,200		
新明和工業	28,600	1,320.00	37,752,000		

極東開発工業	13,400	2,286.00	30,632,400	
トピー工業	7,900	1,896.00	14,978,400	貸付株式数 3,100株
ティラド	2,200	3,455.00	7,601,000	
タチエス	18,300	1,719.00	31,457,700	
N O K	38,200	2,278.00	87,019,600	貸付株式数 15,000株
フタバ産業	29,700	646.00	19,186,200	
カヤバ	8,400	5,040.00	42,336,000	
市光工業	17,800	432.00	7,689,600	
大同メタル工業	19,000	481.00	9,139,000	
プレス工業	38,000	548.00	20,824,000	貸付株式数 8,300株
ミクニ	1,400	320.00	448,000	
太平洋工業	22,900	1,346.00	30,823,400	貸付株式数 9,100株
河西工業	1,900	135.00	256,500	貸付株式数 1,700株
アイシン	210,900	1,628.00	343,345,200	
マ ッ ダ	305,900	1,006.00	307,735,400	
今仙電機製作所	700	504.00	352,800	貸付株式数 600株
本田技研	2,358,000	1,364.50	3,217,491,000	
スズキ	804,000	1,656.50	1,331,826,000	
SUBARU	309,000	2,486.50	768,328,500	
安永	600	512.00	307,200	貸付株式数 500株
ヤマハ発動機	420,600	1,358.00	571,174,800	
小糸製作所	103,100	1,967.50	202,849,250	
T B K	1,300	277.00	360,100	
エクセディ	16,200	4,410.00	71,442,000	
ミツバ	18,600	836.00	15,549,600	
豊田合成	28,700	2,553.50	73,285,450	
愛三工業	18,700	1,438.00	26,890,600	
盟和産業	200	1,157.00	231,400	
日本プラスト	900	362.00	325,800	
ヨ ロ ズ	10,000	1,178.00	11,780,000	貸付株式数 3,500株
エフ・シー・シー	17,200	3,065.00	52,718,000	
新家工業	200	4,465.00	893,000	
シマノ	43,200	20,655.00	892,296,000	
テイ・エス テック	39,900	1,706.00	68,069,400	
3 3 F G	9,000	2,012.00	18,108,000	貸付株式数 3,500株
第四北越フィナンシャルG	31,100	2,714.00	84,405,400	貸付株式数 2,400株
ひろぎんHLDGS	138,900	1,139.50	158,276,550	貸付株式数 53,700株
マーキュリアホールディングス	500	850.00	425,000	貸付株式数 300株 (300株)

おきなわFG	8,100	2,430.00	19,683,000	
ダイレクトマーケティングミクス	12,100	285.00	3,448,500	
ポピンズ	1,800	1,278.00	2,300,400	
LITALICO	9,200	929.00	8,546,800	貸付株式数 1,700株
コンフィデンス・インターワーク	200	1,640.00	328,000	貸付株式数 100株
十六FG	14,000	4,225.00	59,150,000	
北國FHD	9,600	5,030.00	48,288,000	
ネットプロHD	33,000	440.00	14,520,000	貸付株式数 13,000株
プロクリアホールディングス	11,000	1,806.00	19,866,000	貸付株式数 1,500株
あいちフィナンシャルグル	18,300	2,388.00	43,700,400	貸付株式数 7,300株
ジャムコ	5,900	1,359.00	8,018,100	貸付株式数 2,300株
小野建	11,300	1,443.00	16,305,900	貸付株式数 2,400株
はるやまHLDGS	500	566.00	283,000	貸付株式数 400株
南陽	500	1,120.00	560,000	
ノジマ	34,300	2,282.00	78,272,600	
佐鳥電機	7,200	1,859.00	13,384,800	貸付株式数 2,800株
カップ・クリエイト	16,200	1,573.00	25,482,600	貸付株式数 6,400株
エコートレーディング	200	910.00	182,000	貸付株式数 100株
伯東	5,900	4,465.00	26,343,500	貸付株式数 2,300株
コンドーテック	7,900	1,375.00	10,862,500	貸付株式数 1,000株
中山福	600	367.00	220,200	
ライトオン	900	210.00	189,000	貸付株式数 800株
ナガイレーベン	13,500	2,181.00	29,443,500	貸付株式数 2,600株
三菱食品	10,000	4,840.00	48,400,000	
良品計画	125,400	3,023.00	379,084,200	貸付株式数 47,700株
バリミキホールディングス	1,600	302.00	483,200	
松田産業	8,000	3,005.00	24,040,000	
第一興商	40,800	1,870.00	76,296,000	貸付株式数 16,300株
メディパルHD	114,100	2,462.50	280,971,250	
アドヴァングループ	8,800	934.00	8,219,200	貸付株式数 3,400株
SPK	4,200	2,026.00	8,509,200	
萩原電気HLDGS	4,400	3,265.00	14,366,000	
アルビス	3,400	2,625.00	8,925,000	
アズワン	32,600	2,792.00	91,019,200	
スズデン	4,400	1,794.00	7,893,600	
尾家産業	300	1,995.00	598,500	
シモジマ	6,900	1,284.00	8,859,600	

ドウシシャ	9,500	2,123.00	20,168,500	
小津産業	300	1,655.00	496,500	貸付株式数 200株
コナカ	1,400	247.00	345,800	
高速	6,100	2,422.00	14,774,200	
ハウス ローゼ	100	1,453.00	145,300	
G-7ホールディングス	11,400	1,449.00	16,518,600	
たけびし	4,400	2,083.00	9,165,200	貸付株式数 1,400株
イオン北海道	25,300	865.00	21,884,500	
コジマ	20,300	1,037.00	21,051,100	貸付株式数 8,100株 (2,100株)
ヒマラヤ	400	853.00	341,200	貸付株式数 300株
コーナン商事	11,700	3,610.00	42,237,000	
ネットワンシステムズ	41,800	4,492.00	187,765,600	
エコス	3,800	2,035.00	7,733,000	貸付株式数 1,400株
ワタミ	12,600	1,017.00	12,814,200	貸付株式数 4,400株
マルシェ	400	202.00	80,800	貸付株式数 300株
リックス	2,400	2,766.00	6,638,400	
システムソフト	34,400	60.00	2,064,000	貸付株式数 1,500株
パンパシフィックHD	212,400	3,733.00	792,889,200	
丸文	9,500	1,060.00	10,070,000	
西松屋チェーン	23,300	2,217.00	51,656,100	貸付株式数 8,200株
ゼンショーホールディングス	59,800	9,092.00	543,701,600	
ハピネット	7,900	4,060.00	32,074,000	貸付株式数 3,400株
幸楽苑	7,600	1,316.00	10,001,600	貸付株式数 2,700株
ハークスレイ	400	680.00	272,000	
橋本総業HLDGS	4,100	1,161.00	4,760,100	貸付株式数 1,500株
日本ライフライン	30,000	1,264.00	37,920,000	
サイゼリヤ	15,500	5,260.00	81,530,000	貸付株式数 6,000株
タカショー	8,300	478.00	3,967,400	貸付株式数 3,300株
V Tホールディングス	40,000	458.00	18,320,000	
アルゴグラフィックス	9,100	5,100.00	46,410,000	貸付株式数 3,500株
魚力	3,600	2,389.00	8,600,400	貸付株式数 1,300株
I D O M	35,700	1,064.00	37,984,800	
日本エム・ディ・エム	9,200	611.00	5,621,200	
ポプラ	400	219.00	87,600	貸付株式数 300株 (100株)
フジ・コーポレーション	4,700	1,933.00	9,085,100	
ユナイテッドアローズ	11,300	2,378.00	26,871,400	

進和	6,300	2,859.00	18,011,700	貸付株式数	2,300株
エスケイジャパン	300	635.00	190,500		
ダイترون	4,500	2,789.00	12,550,500		
ハイデイ日高	16,900	2,755.00	46,559,500	貸付株式数	6,300株
シークス	14,600	1,132.00	16,527,200		
京都きもの友禅HD	600	77.00	46,200		
コロワイド	59,300	1,714.50	101,669,850	貸付株式数	21,100株
田中商事	300	667.00	200,100		
オーハシテクニカ	4,900	1,923.00	9,422,700	貸付株式数	1,000株
壱番屋	41,100	1,010.00	41,511,000	貸付株式数	6,600株
白銅	2,900	2,308.00	6,693,200	貸付株式数	1,000株
トップカルチャー	400	140.00	56,000	貸付株式数	200株
P L A N T	300	1,545.00	463,500	貸付株式数	200株
スギホールディングス	56,100	2,542.00	142,606,200		
ダイコー通産	100	1,226.00	122,600		
薬王堂ホールディングス	5,000	2,040.00	10,200,000		
島津製作所	143,900	4,270.00	614,453,000	貸付株式数	100株
J M S	13,900	446.00	6,199,400		
クボテック	800	216.00	172,800	貸付株式数	300株
長野計器	6,900	2,577.00	17,781,300	貸付株式数	2,600株
ブイ・テクノロジー	5,400	2,158.00	11,653,200		
スター精密	17,100	1,854.00	31,703,400		
東京計器	7,300	3,745.00	27,338,500	貸付株式数	2,900株
愛知時計	4,600	1,984.00	9,126,400		
インターアクション	5,800	1,006.00	5,834,800	貸付株式数	2,200株
オーバル	2,900	369.00	1,070,100	貸付株式数	1,000株
東京精密	20,500	7,714.00	158,137,000		
マニー	40,800	1,765.00	72,012,000	貸付株式数	15,900株
ニコン	157,100	1,891.50	297,154,650	貸付株式数	54,800株
トプコン	57,300	1,522.00	87,210,600		
オリンパス	570,300	2,517.50	1,435,730,250		
理研計器	14,300	3,765.00	53,839,500		
SCREENホールディングス	41,600	9,227.00	383,843,200		
キヤノン電子	9,200	2,511.00	23,101,200		
タムロン	13,800	4,420.00	60,996,000		
H O Y A	195,900	19,920.00	3,902,328,000		
シード	3,100	464.00	1,438,400	貸付株式数	400株
ノーリツ鋼機	9,700	4,140.00	40,158,000		
A&Dホロンホールディングス	13,000	1,970.00	25,610,000		

朝日インテック	121,800	2,559.50	311,747,100	貸付株式数	6,100株
キヤノン	496,200	4,994.00	2,478,022,800		
リコー	262,200	1,637.00	429,221,400		
シチズン時計	90,900	902.00	81,991,800		
リズム	300	3,585.00	1,075,500	貸付株式数	200株
大研医器	5,100	499.00	2,544,900		
メニコン	37,000	1,604.00	59,348,000		
シンシア	100	523.00	52,300		
KYORITSU	1,600	147.00	235,200		
中本パックス	400	1,665.00	666,000		
パラマウントベッドHD	24,000	2,548.00	61,152,000		
トランザクション	6,400	2,286.00	14,630,400	貸付株式数	2,500株
粧美堂	300	506.00	151,800	貸付株式数	200株
ニホンフラッシュ	8,200	855.00	7,011,000		
前田工織	17,300	1,864.00	32,247,200		
永大産業	1,300	213.00	276,900		
アートネイチャー	10,000	843.00	8,430,000		
フルヤ金属	9,400	3,500.00	32,900,000		
バンダイナムコHLDGS	269,900	3,131.00	845,056,900		
アイフィスジャパン	300	580.00	174,000		
SHOEI	27,700	2,368.00	65,593,600	貸付株式数	10,900株
フランスベッドHLDGS	13,900	1,231.00	17,110,900	貸付株式数	4,900株
マーベラス	18,100	581.00	10,516,100	貸付株式数	7,200株
パイロットコーポレーション	15,500	4,938.00	76,539,000		
萩原工業	6,800	1,408.00	9,574,400	貸付株式数	1,200株
エイベックス	18,600	1,506.00	28,011,600		
フジシールインターナショナル	22,400	2,423.00	54,275,200	貸付株式数	1,800株
タカラトミー	41,700	4,104.00	171,136,800	貸付株式数	16,500株
広済堂ホールディングス	37,300	454.00	16,934,200	貸付株式数	14,900株
エステールホールディングス	200	601.00	120,200		
レック	12,600	1,206.00	15,195,600	貸付株式数	4,300株
タカノ	400	713.00	285,200		
三光合成	12,300	619.00	7,613,700		
プロネクサス	10,100	1,270.00	12,827,000		
ホクシン	900	101.00	90,900		
ウッドワン	400	827.00	330,800	貸付株式数	300株
きもと	1,800	297.00	534,600		

TOPPANホールディングス	130,400	4,078.00	531,771,200	
大日本印刷	206,300	2,395.00	494,088,500	
共同印刷	2,800	4,010.00	11,228,000	
N I S S H A	16,900	1,673.00	28,273,700	
光村印刷	100	1,465.00	146,500	
Z A C R O S	7,700	4,035.00	31,069,500	貸付株式数 3,000株
ヴィア・ホールディングス	2,300	136.00	312,800	貸付株式数 300株
TAKARA & COMPANY	5,700	2,650.00	15,105,000	貸付株式数 2,200株
前澤化成工業	6,900	1,795.00	12,385,500	貸付株式数 2,500株
未来工業	3,500	3,720.00	13,020,000	貸付株式数 1,400株
アシックス	367,400	2,901.00	1,065,827,400	
ツ ツ ミ	2,300	2,090.00	4,807,000	
ウェーブロックHLDGS	400	634.00	253,600	
ジェイ エス ピー	8,000	2,055.00	16,440,000	貸付株式数 2,300株
ニ チ ハ	12,200	2,946.00	35,941,200	貸付株式数 4,300株
ローランド	7,200	3,995.00	28,764,000	
エフピコ	22,000	2,574.00	56,628,000	
小松ウオール工業	7,100	1,506.00	10,692,600	
ヤマハ	181,700	1,092.50	198,507,250	
河合楽器	2,900	3,070.00	8,903,000	
クリナップ	9,500	695.00	6,602,500	
ピジヨン	63,300	1,452.50	91,943,250	
天馬	8,200	3,005.00	24,641,000	貸付株式数 2,100株
キングジム	8,500	847.00	7,199,500	貸付株式数 3,400株 (200株)
象印マホービン	29,400	1,633.00	48,010,200	貸付株式数 7,600株
リンテック	20,000	3,060.00	61,200,000	貸付株式数 5,300株
信越ポリマー	21,000	1,639.00	34,419,000	
東 リ	2,900	446.00	1,293,400	
イトーキ	19,800	1,599.00	31,660,200	
任 天 堂	627,900	8,226.00	5,165,105,400	
三菱鉛筆	13,700	2,526.00	34,606,200	貸付株式数 5,400株
松 風	10,500	2,067.00	21,703,500	
タカラスタンダ - ド	22,300	1,644.00	36,661,200	
コ ク ヨ	49,300	2,814.50	138,754,850	
ナカバヤシ	10,400	514.00	5,345,600	
ニ フ コ	37,300	3,681.00	137,301,300	
立川ブラインド	4,500	1,353.00	6,088,500	貸付株式数 1,800株
グロープライド	9,600	1,913.00	18,364,800	貸付株式数 3,000株

オカムラ	29,800	1,972.00	58,765,600	
バルカー	7,500	3,305.00	24,787,500	
MUTOHホールディングス	200	2,455.00	491,000	
伊藤忠	707,500	7,697.00	5,445,627,500	
丸紅	873,000	2,398.50	2,093,890,500	
スクロール	15,600	1,056.00	16,473,600	
高島	800	1,212.00	969,600	貸付株式数 600株
ヨンドシーホールディングス	10,000	1,812.00	18,120,000	貸付株式数 3,800株
三陽商会	5,200	2,650.00	13,780,000	
長瀬産業	47,300	3,185.00	150,650,500	
ナイガイ	400	242.00	96,800	貸付株式数 300株
蝶理	5,700	3,895.00	22,201,500	貸付株式数 2,200株
豊田通商	316,400	2,702.50	855,071,000	
オンワードホールディングス	65,300	517.00	33,760,100	
三共生興	13,900	575.00	7,992,500	
兼松	44,200	2,750.00	121,550,000	
美津濃	9,900	7,670.00	75,933,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,078.00	215,600	
ルックホールディングス	3,200	2,567.00	8,214,400	
三井物産	1,576,600	3,276.00	5,164,941,600	
日本紙パルプ	49,100	638.00	31,325,800	
東京エレクトロン	210,500	21,870.00	4,603,635,000	
カメイ	11,100	1,852.00	20,557,200	
東都水産	100	5,570.00	557,000	
OUGホールディングス	300	2,552.00	765,600	
スターゼン	7,700	2,787.00	21,459,900	
セイコーグループ	15,400	4,335.00	66,759,000	
山善	34,800	1,300.00	45,240,000	貸付株式数 12,400株
椿本興業	5,800	1,892.00	10,973,600	貸付株式数 2,400株
住友商事	631,000	3,258.00	2,055,798,000	
B I P R O G Y	33,700	4,328.00	145,853,600	
内田洋行	4,300	6,800.00	29,240,000	
三菱商事	2,020,700	2,661.50	5,378,093,050	
第一実業	9,900	2,504.00	24,789,600	貸付株式数 3,200株
キヤノンマーケティングJPN	20,700	4,750.00	98,325,000	
西華産業	5,000	4,830.00	24,150,000	
佐藤商事	7,100	1,410.00	10,011,000	
東京産業	10,400	707.00	7,352,800	貸付株式数 3,200株

ユアサ商事	9,000	4,505.00	40,545,000	
神鋼商事	2,300	6,040.00	13,892,000	
トルク	800	217.00	173,600	
阪和興業	17,400	5,000.00	87,000,000	
正栄食品	7,100	4,435.00	31,488,500	貸付株式数 2,800株 (1,100株)
カナデン	7,700	1,450.00	11,165,000	
R Y O D E N	8,400	2,305.00	19,362,000	
ニプロ	84,300	1,382.50	116,544,750	貸付株式数 33,200株
岩谷産業	104,800	1,908.00	199,958,400	貸付株式数 41,800株
ナイス	2,500	1,591.00	3,977,500	
ニチモウ	400	1,876.00	750,400	
極東貿易	6,100	1,600.00	9,760,000	
アステナホールディングス	19,600	498.00	9,760,800	貸付株式数 7,700株
三愛オブリ	24,400	1,987.00	48,482,800	
稲畑産業	28,300	3,425.00	96,927,500	
G S I クレオス	5,500	2,078.00	11,429,000	貸付株式数 2,100株
明和産業	15,200	645.00	9,804,000	
クワザワホールディングス	400	612.00	244,800	貸付株式数 300株
ゴ-ルドウイン	17,600	8,415.00	148,104,000	貸付株式数 500株
ユニ・チャ-ム	207,700	3,782.00	785,521,400	
キング	400	727.00	290,800	
ワキタ	15,100	1,565.00	23,631,500	
ヤマトインタ-ナショナル	800	322.00	257,600	
東邦ホールディングス	28,400	4,213.00	119,649,200	貸付株式数 10,300株
サンゲツ	26,300	2,923.00	76,874,900	
ミツウロコグループ	13,200	1,663.00	21,951,600	
シナネンホールディングス	2,800	6,350.00	17,780,000	貸付株式数 1,100株
伊藤忠エネクス	25,700	1,606.00	41,274,200	
サンリオ	85,400	4,881.00	416,837,400	
サンワ テクノス	4,800	2,166.00	10,396,800	
新光商事	13,800	980.00	13,524,000	貸付株式数 4,800株
トーヨー	4,600	2,773.00	12,755,800	貸付株式数 1,600株 (100株)
三信電気	4,100	1,902.00	7,798,200	
東陽テクニカ	11,100	1,485.00	16,483,500	
モスフード サービス	15,300	3,650.00	55,845,000	貸付株式数 5,000株
加賀電子	20,900	2,749.00	57,454,100	
都築電気	5,900	2,450.00	14,455,000	
ソーダニツカ	10,000	1,138.00	11,380,000	

立花エレテック	6,100	2,601.00	15,866,100		
木曽路	15,600	2,115.00	32,994,000	貸付株式数	6,200株
SRSホールディングス	16,900	1,121.00	18,944,900	貸付株式数	6,600株
千趣会	20,800	307.00	6,385,600	貸付株式数	900株
タカキュー	900	125.00	112,500	貸付株式数	700株
リテールパートナーズ	15,200	1,225.00	18,620,000	貸付株式数	5,900株
上新電機	10,400	2,349.00	24,429,600		
日本瓦斯	49,900	2,070.00	103,293,000		
ロイヤルホールディングス	18,500	2,462.00	45,547,000	貸付株式数	7,400株
東天紅	100	867.00	86,700		
いなげや	7,100	1,155.00	8,200,500		
チヨダ	10,100	1,407.00	14,210,700		
ライフコーポレーション	10,800	3,380.00	36,504,000	貸付株式数	4,300株
リンガーハット	13,300	2,200.00	29,260,000	貸付株式数	5,300株
MrMaxHD	12,900	669.00	8,630,100		
テナライド	1,700	269.00	457,300	貸付株式数	1,600株
AOKIホールディングス	22,500	1,231.00	27,697,500		
オークワ	16,400	885.00	14,514,000	貸付株式数	6,000株
コメリ	14,100	3,250.00	45,825,000	貸付株式数	1,300株
青山商事	22,500	2,113.00	47,542,500		
しまむら	24,700	8,009.00	197,822,300		
はせがわ	600	302.00	181,200		
高島屋	146,400	1,210.00	177,144,000	貸付株式数	58,500株
松屋	17,600	868.00	15,276,800	貸付株式数	7,000株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	51,000	2,019.50	102,994,500	貸付株式数	16,500株
近鉄百貨店	5,900	2,060.00	12,154,000	貸付株式数	1,600株
丸井グループ	70,100	2,412.50	169,116,250		
クレディセゾン	62,400	3,440.00	214,656,000	貸付株式数	4,800株
アクシアルリテイリング	28,000	903.00	25,284,000		
井筒屋	500	411.00	205,500	貸付株式数	200株
イオン	388,600	3,734.00	1,451,032,400	貸付株式数	71,000株
イズミ	15,600	3,149.00	49,124,400	貸付株式数	2,300株
フォーバル	4,100	1,333.00	5,465,300	貸付株式数	1,000株
平和堂	17,200	2,200.00	37,840,000	貸付株式数	6,500株
フジ	18,900	2,052.00	38,782,800	貸付株式数	7,500株
ヤオコー	12,200	9,420.00	114,924,000	貸付株式数	3,800株
ゼビオホールディングス	14,000	1,077.00	15,078,000		
ケーズホールディングス	70,700	1,409.50	99,651,650	貸付株式数	26,400株

PALTAC	16,400	4,321.00	70,864,400	貸付株式数	3,900株
三谷産業	17,900	317.00	5,674,300		
OLYMPICグループ	600	461.00	276,600	貸付株式数	500株
日産東京販売HD	1,700	427.00	725,900		
あおぞら銀行	67,600	2,468.00	166,836,800	貸付株式数	27,000株
三菱UFJフィナンシャルG	6,424,800	1,816.00	11,667,436,800		
りそなホールディングス	1,209,900	1,220.50	1,476,682,950		
三井住友トラストグルー	349,000	3,645.00	1,272,105,000		
三井住友フィナンシャルG	2,044,000	3,615.00	7,389,060,000		
千葉銀行	304,200	1,189.50	361,845,900		
群馬銀行	174,800	1,016.00	177,596,800	貸付株式数	46,700株
武蔵野銀行	15,200	2,809.00	42,696,800		
千葉興業銀行	23,200	1,251.00	29,023,200	貸付株式数	5,200株
筑波銀行	43,400	233.00	10,112,200	貸付株式数	17,200株
七十七銀行	31,500	4,346.00	136,899,000		
秋田銀行	6,600	2,072.00	13,675,200		
山形銀行	10,600	952.00	10,091,200		
岩手銀行	6,200	2,645.00	16,399,000		
東邦銀行	85,200	270.00	23,004,000	貸付株式数	33,800株
東北銀行	600	1,113.00	667,800		
ふくおかフィナンシャルG	85,700	4,093.00	350,770,100		
スルガ銀行	63,000	1,004.00	63,252,000		
八十二銀行	229,800	987.00	226,812,600		
山梨中央銀行	11,000	1,760.00	19,360,000		
大垣共立銀行	19,100	1,855.00	35,430,500		
福井銀行	8,800	1,828.00	16,086,400	貸付株式数	2,400株
清水銀行	3,800	1,468.00	5,578,400		
富山銀行	200	1,545.00	309,000	貸付株式数	100株
滋賀銀行	14,900	3,500.00	52,150,000		
南都銀行	14,900	3,065.00	45,668,500		
百五銀行	93,300	589.00	54,953,700	貸付株式数	33,700株
紀陽銀行	35,300	2,057.00	72,612,100		
ほくほくフィナンシャルG	55,700	1,746.00	97,252,200	貸付株式数	22,000株
山陰合同銀行	62,000	1,209.00	74,958,000	貸付株式数	7,000株
鳥取銀行	400	1,216.00	486,400	貸付株式数	100株
百十四銀行	9,700	3,005.00	29,148,500		
四国銀行	14,700	1,060.00	15,582,000		
阿波銀行	14,000	2,809.00	39,326,000		
大分銀行	6,000	3,135.00	18,810,000		
宮崎銀行	6,600	2,928.00	19,324,800		

佐賀銀行	6,100	2,127.00	12,974,700	
琉球銀行	23,000	1,003.00	23,069,000	貸付株式数 8,900株
セブン銀行	351,700	336.00	118,171,200	貸付株式数 122,000株
みずほフィナンシャルG	1,322,900	3,798.00	5,024,374,200	
高知銀行	400	854.00	341,600	貸付株式数 200株
山口フィナンシャルG	96,800	1,583.00	153,234,400	貸付株式数 5,300株
芙蓉総合リース	9,100	11,090.00	100,919,000	貸付株式数 3,300株
みずほリース	75,200	1,028.00	77,305,600	
東京センチュリー	73,900	1,480.00	109,372,000	貸付株式数 29,300株
SBIホールディングス	158,400	3,553.00	562,795,200	
日本証券金融	36,100	2,044.00	73,788,400	
アイフル	164,600	325.00	53,495,000	貸付株式数 49,400株
日本アジア投資	700	217.00	151,900	貸付株式数 600株
名古屋銀行	6,200	6,210.00	38,502,000	
北洋銀行	134,500	428.00	57,566,000	
大光銀行	300	1,437.00	431,100	貸付株式数 200株
愛媛銀行	14,100	1,027.00	14,480,700	
トマト銀行	400	1,125.00	450,000	貸付株式数 100株
京葉銀行	44,600	768.00	34,252,800	
栃木銀行	45,500	267.00	12,148,500	貸付株式数 17,900株
北日本銀行	3,600	2,730.00	9,828,000	
東和銀行	17,800	626.00	11,142,800	
福島銀行	1,200	215.00	258,000	貸付株式数 1,100株
大東銀行	500	702.00	351,000	貸付株式数 100株
リコーリース	9,600	5,100.00	48,960,000	貸付株式数 3,200株
イオンフィナンシャルサー ビス	56,000	1,243.50	69,636,000	
アコム	236,600	393.60	93,125,760	
ジャックス	11,900	3,785.00	45,041,500	貸付株式数 4,700株
オリコ	33,400	835.00	27,889,000	貸付株式数 5,600株
オリックス	587,200	3,315.00	1,946,568,000	
三菱HCキャピタル	493,000	1,022.00	503,846,000	
ジャフコグループ	29,400	2,033.00	59,770,200	貸付株式数 10,800株
九州リースサービス	400	1,063.00	425,200	
トモニホールディングス	95,100	443.00	42,129,300	
大和証券G本社	702,400	1,010.00	709,424,000	
野村ホールディングス	1,651,000	932.90	1,540,217,900	
岡三証券グループ	78,500	629.00	49,376,500	貸付株式数 31,000株
丸三証券	32,900	979.00	32,209,100	貸付株式数 8,000株

東洋証券	29,300	596.00	17,462,800	
東海東京HD	119,200	469.00	55,904,800	
光世証券	300	424.00	127,200	貸付株式数 200株
水戸証券	27,600	549.00	15,152,400	
いちよし証券	20,300	859.00	17,437,700	貸付株式数 1,700株
松井証券	68,300	831.00	56,757,300	
SOMPOホールディングス	474,100	3,971.00	1,882,651,100	
日本取引所グループ	583,300	1,810.00	1,055,773,000	
マネックスG	96,700	998.00	96,506,600	
極東証券	12,300	1,341.00	16,494,300	貸付株式数 4,800株
岩井コスモホールディング	11,800	2,257.00	26,632,600	
アイザワ証券グループ	14,200	1,695.00	24,069,000	貸付株式数 5,500株
フィデアホール	9,900	1,394.00	13,800,600	貸付株式数 3,900株
池田泉州HD	137,000	358.00	49,046,000	
アニコムホールディングス	32,500	658.00	21,385,000	
MS&AD	712,300	3,518.00	2,505,871,400	
マネーパートナーズGP	1,100	474.00	521,400	
スパークス・グループ	11,400	1,374.00	15,663,600	
小林洋行	500	263.00	131,500	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	457,500	3,840.00	1,756,800,000	
東京海上HD	952,000	5,631.00	5,360,712,000	
アドバンテッジリスクマネ	600	682.00	409,200	
イー・ギャランティ	16,200	1,574.00	25,498,800	
アサックス	400	713.00	285,200	貸付株式数 300株
NECキャピタルソリューション	5,000	3,730.00	18,650,000	
T&Dホールディングス	259,700	2,427.50	630,421,750	
アドバンスクリエイト	7,500	710.00	5,325,000	貸付株式数 2,900株
三井不動産	1,359,700	1,258.50	1,711,182,450	
三菱地所	567,500	2,105.00	1,194,587,500	
平和不動産	15,800	4,100.00	64,780,000	
東京建物	85,800	2,640.50	226,554,900	
京阪神ビルディング	16,100	1,559.00	25,099,900	
住友不動産	159,400	4,683.00	746,470,200	
太平洋興発	400	720.00	288,000	貸付株式数 200株
テーオーシー	17,000	607.00	10,319,000	
スターツコーポレーション	16,000	3,705.00	59,280,000	
フジ住宅	12,000	754.00	9,048,000	
空港施設	13,500	578.00	7,803,000	

明和地所	7,700	995.00	7,661,500	貸付株式数	3,000株
ゴールドクレスト	6,500	2,900.00	18,850,000	貸付株式数	1,500株
リログループ	56,900	1,693.50	96,360,150		
エスリード	4,500	4,395.00	19,777,500	貸付株式数	1,200株
日神グループHLDGS	15,300	503.00	7,695,900	貸付株式数	5,200株
日本エスコ	25,200	995.00	25,074,000		
MIRARTHホールディング	56,900	496.00	28,222,400		
A V A N T I A	600	766.00	459,600	貸付株式数	500株
イオンモール	58,500	1,992.00	116,532,000		
毎日コムネット	400	730.00	292,000	貸付株式数	100株
ファースト住建	500	1,001.00	500,500	貸付株式数	400株
ランド	600,400	8.00	4,803,200	貸付株式数	119,600株
カチタス	26,200	2,068.00	54,181,600		
東祥	8,300	638.00	5,295,400		
トーセイ	16,100	2,343.00	37,722,300	貸付株式数	6,400株
穴吹興産	300	1,990.00	597,000	貸付株式数	200株
サンフロンティア不動産	16,400	1,880.00	30,832,000		
インテリックス	300	743.00	222,900	貸付株式数	200株
ランドビジネス	400	195.00	78,000	貸付株式数	300株
サンネクスタグループ	400	1,001.00	400,400	貸付株式数	100株
グランディハウス	8,900	556.00	4,948,400	貸付株式数	3,200株
東武鉄道	104,600	2,550.00	266,730,000		
相鉄ホールディングス	32,700	2,509.50	82,060,650	貸付株式数	8,600株
東急	278,800	1,896.50	528,744,200		
京浜急行	122,500	1,229.50	150,613,750		
小田急電鉄	164,400	1,546.50	254,244,600	貸付株式数	65,700株
京王電鉄	52,500	4,082.00	214,305,000		
京成電鉄	57,700	3,899.00	224,972,300	貸付株式数	24,400株
富士急行	12,200	2,374.00	28,962,800	貸付株式数	2,400株
東日本旅客鉄道	548,300	2,873.00	1,575,265,900		
西日本旅客鉄道	254,000	2,794.50	709,803,000		
東海旅客鉄道	383,200	3,176.00	1,217,043,200		
西武ホールディングス	108,300	3,424.00	370,819,200	貸付株式数	22,000株
鴻池運輸	16,800	2,751.00	46,216,800	貸付株式数	1,600株
西日本鉄道	28,500	2,360.50	67,274,250	貸付株式数	11,400株
ハマキョウレックス	33,500	1,232.00	41,272,000		
サカイ引越センター	12,400	2,383.00	29,549,200		
近鉄グループHLDGS	106,200	3,286.00	348,973,200		
阪急阪神HLDGS	132,200	3,985.00	526,817,000	貸付株式数	50,400株

南海電鉄	44,100	2,460.50	108,508,050	貸付株式数	7,900株
京阪ホールディングス	54,400	3,558.00	193,555,200	貸付株式数	7,500株
神戸電鉄	2,600	2,319.00	6,029,400	貸付株式数	1,000株
名古屋鉄道	109,200	1,740.50	190,062,600	貸付株式数	33,000株
山陽電鉄	7,300	2,020.00	14,746,000	貸付株式数	2,700株
トランコム	2,800	10,250.00	28,700,000		
ヤマトホールディングス	120,600	1,661.00	200,316,600		
山九	23,900	5,269.00	125,929,100		
日新	6,700	4,325.00	28,977,500		
丸運	700	506.00	354,200	貸付株式数	600株
丸全昭和運輸	6,100	6,230.00	38,003,000	貸付株式数	2,100株
センコーグループHLDGS	58,300	1,495.00	87,158,500	貸付株式数	23,300株
トナミホールディングス	2,100	5,430.00	11,403,000	貸付株式数	800株
ニッコンホールディングス	56,200	1,947.00	109,421,400		
日石輸送	100	2,778.00	277,800		
福山通運	10,500	3,470.00	36,435,000		
セイノーホールディングス	48,600	2,483.00	120,673,800	貸付株式数	21,800株
神奈川中央交通	2,700	3,570.00	9,639,000		
AZ-COM丸和ホールディ	30,600	1,070.00	32,742,000	貸付株式数	12,200株
日本郵船	205,800	5,028.00	1,034,762,400		
商船三井	188,900	5,480.00	1,035,172,000		
川崎汽船	226,000	2,175.50	491,663,000	貸付株式数	88,100株
NSユニテッド海運	6,200	4,000.00	24,800,000	貸付株式数	2,400株
明海グループ	1,200	698.00	837,600	貸付株式数	900株
飯野海運	36,100	1,166.00	42,092,600	貸付株式数	13,800株
共栄タンカー	200	1,160.00	232,000	貸付株式数	100株
九州旅客鉄道	75,900	3,914.00	297,072,600		
SGホールディングス	166,600	1,442.50	240,320,500		
NIPPON EXPRESS	35,600	7,340.00	261,304,000		
ID&E ホールディングス	6,000	4,680.00	28,080,000		
日本航空	227,500	2,402.50	546,568,750		
ANAホールディングス	270,000	2,848.00	768,960,000		
ピーウィズ	2,000	1,554.00	3,108,000	貸付株式数	800株
TREホールディングス	23,500	1,654.00	38,869,000		
人・夢・技術グループ	4,100	1,676.00	6,871,600		
西本WISMETTAC HD	6,300	1,926.00	12,133,800	貸付株式数	600株
シルバーライフ	2,800	764.00	2,139,200	貸付株式数	1,100株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	300	2,211.00	663,300		
GENKY DRUGSTORES	9,200	3,095.00	28,474,000		

コア商事HLDGS	7,600	601.00	4,567,600	貸付株式数	2,100株
KPPグループホールディング	21,500	683.00	14,684,500		
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,321.00	264,200	貸付株式数	100株
ブックオフGHD	7,600	1,499.00	11,392,400	貸付株式数	2,900株
ギフトホールディングス	5,200	3,505.00	18,226,000	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	114,200	1,054.50	120,423,900		
三井倉庫HOLD	10,200	7,500.00	76,500,000		
住友倉庫	29,100	2,750.00	80,025,000		
渋沢倉庫	4,400	3,045.00	13,398,000		
ヤマタネ	4,200	3,435.00	14,427,000		
東陽倉庫	300	1,460.00	438,000		
乾汽船	12,300	1,529.00	18,806,700	貸付株式数	4,600株
日本トランスシティ	19,700	981.00	19,325,700		
ケイヒン	200	1,940.00	388,000		
中央倉庫	5,700	1,513.00	8,624,100	貸付株式数	2,100株
川西倉庫	200	1,075.00	215,000	貸付株式数	100株
安田倉庫	6,600	1,621.00	10,698,600	貸付株式数	2,400株
ファイズホールディングス	200	965.00	193,000		
NISSOHD	8,600	762.00	6,553,200	貸付株式数	2,900株
大栄環境	22,200	3,045.00	67,599,000		
日本管財ホールディング	10,500	2,532.00	26,586,000		
東洋埠頭	300	1,245.00	373,500		
上組	45,700	3,485.00	159,264,500		
サンリツ	300	774.00	232,200		
キムラユニティー	500	1,439.00	719,500		
キューソー流通システム	6,500	2,067.00	13,435,500	貸付株式数	1,800株
東海運	600	317.00	190,200	貸付株式数	500株
エーアイティー	6,100	1,766.00	10,772,600		
内外トランスライン	3,900	2,785.00	10,861,500	貸付株式数	1,500株
ショーエイコーポ	400	568.00	227,200	貸付株式数	300株
日本コンセプト	3,500	1,768.00	6,188,000		
TBSホールディングス	50,100	3,728.00	186,772,800	貸付株式数	19,100株
日本テレビHLDS	88,000	2,270.50	199,804,000	貸付株式数	7,700株
朝日放送グループHD	9,100	609.00	5,541,900	貸付株式数	3,100株
テレビ朝日HD	23,600	2,069.00	48,828,400		
スカパーJSATHD	77,200	839.00	64,770,800		
テレビ東京HD	6,000	3,045.00	18,270,000	貸付株式数	2,300株
日本BS放送	400	885.00	354,000	貸付株式数	300株

ビジョン	14,700	1,365.00	20,065,500	貸付株式数	5,800株
スマートバリュー	300	299.00	89,700	貸付株式数	200株
U-NEXT HOLDINGS	11,200	4,940.00	55,328,000	貸付株式数	4,200株
ワイヤレスゲート	500	230.00	115,000		
日本通信	79,700	137.00	10,918,900	貸付株式数	33,900株
クロップス	100	1,015.00	101,500		
日本電信電話	29,676,300	155.90	4,626,535,170		
K D D I	734,000	4,984.00	3,658,256,000		
ソフトバンク	15,967,300	193.70	3,092,866,010		
光通信	11,500	32,840.00	377,660,000		
エムティーアイ	6,700	1,263.00	8,462,100	貸付株式数	2,000株
GMOインターネットグループ	32,600	2,598.50	84,711,100		
ファイバーゲート	5,300	900.00	4,770,000	貸付株式数	2,000株
アイドママーケティングコ ミュ	300	225.00	67,500	貸付株式数	200株
K A D O K A W A	52,600	4,346.00	228,599,600	貸付株式数	9,300株
学研ホールディングス	17,800	998.00	17,764,400		
ゼンリン	16,600	815.00	13,529,000		
昭文社ホールディングス	500	396.00	198,000		
インプレスホールディング ス	1,100	136.00	149,600	貸付株式数	1,000株
東京電力HD	836,800	572.10	478,733,280	貸付株式数	326,500株
中部電力	366,100	1,659.50	607,542,950		
関西電力	418,900	1,886.00	790,045,400		
中国電力	172,800	1,018.00	175,910,400		
北陸電力	101,400	924.30	93,724,020	貸付株式数	38,700株
東北電力	261,900	1,266.50	331,696,350		
四国電力	92,300	1,272.50	117,451,750		
九州電力	229,100	1,473.00	337,464,300		
北海道電力	103,900	862.00	89,561,800	貸付株式数	38,200株
沖縄電力	24,800	985.00	24,428,000	貸付株式数	9,000株
電源開発	74,500	2,598.00	193,551,000		
エフオン	7,100	401.00	2,847,100		
イーレックス	19,100	646.00	12,338,600	貸付株式数	7,600株
レノバ	26,900	815.00	21,923,500	貸付株式数	10,700株
東京瓦斯	193,500	4,315.00	834,952,500		
大阪瓦斯	198,100	3,159.00	625,797,900	貸付株式数	8,400株
東邦瓦斯	39,000	3,841.00	149,799,000	貸付株式数	9,700株
北海道瓦斯	29,000	536.00	15,544,000	貸付株式数	5,000株

広島ガス	20,500	374.00	7,667,000	
西部ガスHLDGS	10,100	1,757.00	17,745,700	貸付株式数 2,600株
静岡ガス	22,100	1,017.00	22,475,700	
メタウォーター	13,400	1,777.00	23,811,800	
アイネット	6,000	1,648.00	9,888,000	貸付株式数 2,300株
松竹	5,700	10,730.00	61,161,000	貸付株式数 1,800株
東宝	62,400	6,113.00	381,451,200	
エイチ・アイ・エス	32,700	1,780.00	58,206,000	貸付株式数 13,000株
東映	16,400	5,980.00	98,072,000	貸付株式数 5,700株
ラックランド	4,200	1,936.00	8,131,200	貸付株式数 1,200株
NTTデータグループ	260,800	2,832.00	738,585,600	
共立メンテナンス	32,100	2,539.00	81,501,900	貸付株式数 12,800株 (600株)
イチネンホールディングス	9,900	1,887.00	18,681,300	
建設技術研究所	5,200	4,715.00	24,518,000	貸付株式数 1,600株
スペース	7,200	1,097.00	7,898,400	
アインホールディングス	14,500	5,003.00	72,543,500	貸付株式数 4,300株
燦ホールディングス	8,400	1,052.00	8,836,800	
ピー・シー・エー	6,400	1,958.00	12,531,200	
スバル興業	4,100	2,998.00	12,291,800	
東京テアトル	400	1,090.00	436,000	貸付株式数 200株
タナベコンサルティンググループ	4,300	1,183.00	5,086,900	貸付株式数 1,000株
ビジネスB太田昭和	4,200	2,014.00	8,458,800	
ナガワ	2,700	6,620.00	17,874,000	貸付株式数 900株
東京都競馬	7,500	4,200.00	31,500,000	貸付株式数 3,000株
カナモト	15,800	2,739.00	43,276,200	
D T S	18,000	3,995.00	71,910,000	
スクウェア・エニックス・HD	50,100	6,042.00	302,704,200	
シーイーシー	12,500	2,070.00	25,875,000	
カプコン	198,200	3,382.00	670,312,400	貸付株式数 29,400株
ニシオホールディングス	8,400	3,615.00	30,366,000	
アイ・エス・ビー	4,600	1,368.00	6,292,800	貸付株式数 1,200株
アゴーラホスピタリティーズG	7,200	47.00	338,400	貸付株式数 6,800株
日本空港ビルデング	34,600	5,409.00	187,151,400	貸付株式数 8,300株
トランス・コスモス	12,900	3,450.00	44,505,000	
乃村工藝社	44,200	770.00	34,034,000	
S C S K	81,500	2,877.50	234,516,250	

藤田観光	4,500	8,930.00	40,185,000	貸付株式数	1,000株
KNT-CTホールディングス	6,100	1,204.00	7,344,400	貸付株式数	1,000株
トーカイ	9,000	2,232.00	20,088,000		
白洋舎	200	2,258.00	451,600	貸付株式数	100株
セコム	208,200	5,145.00	1,071,189,000		
N S W	4,400	3,010.00	13,244,000		
セントラル警備保障	5,500	2,757.00	15,163,500		
アイネス	7,600	1,675.00	12,730,000		
丹青社	21,100	815.00	17,196,500		
メイテックグループホール デ	37,700	2,867.00	108,085,900		
T K C	17,700	3,835.00	67,879,500	貸付株式数	3,500株
富士ソフト	26,300	9,550.00	251,165,000		
応用地質	9,600	2,464.00	23,654,400		
船井総研ホールディン	20,400	2,346.00	47,858,400	貸付株式数	6,600株
N S D	38,300	3,377.00	129,339,100	貸付株式数	9,400株
進学会ホールディングス	400	202.00	80,800	貸付株式数	200株 (200株)
丸紅建材リース	100	2,890.00	289,000		
オオバ	800	1,027.00	821,600	貸付株式数	700株 (700株)
コナミグループ	37,400	14,500.00	542,300,000		
いであ	300	2,441.00	732,300		
学究社	4,000	1,941.00	7,764,000		
イオンディライト	10,900	4,395.00	47,905,500		
ナック	10,100	564.00	5,696,400	貸付株式数	2,400株
福井コンピュータHLDS	6,900	2,845.00	19,630,500		
ダイセキ	24,700	3,790.00	93,613,000	貸付株式数	2,600株
ステップ	3,600	2,001.00	7,203,600		
泉州電業	7,400	5,520.00	40,848,000	貸付株式数	2,800株
GENKI GLOBAL DIN	5,900	3,830.00	22,597,000	貸付株式数	200株
トラスコ中山	22,100	2,210.00	48,841,000		
ヤマダホールディングス	324,700	466.10	151,342,670	貸付株式数	63,800株
オートバックスセブン	36,500	1,431.00	52,231,500	貸付株式数	12,500株
モリト	8,400	1,511.00	12,692,400		
アーケランズ	31,200	1,679.00	52,384,800		
ニトリホールディングス	38,300	17,400.00	666,420,000		
グルメ杵屋	8,300	1,057.00	8,773,100	貸付株式数	2,500株
愛眼	800	147.00	117,600		
ケーユーホールディングス	6,000	1,102.00	6,612,000		

吉野家ホールディングス	41,100	3,157.00	129,752,700	貸付株式数 16,400株 (4,400株)
加藤産業	13,300	4,365.00	58,054,500	
北恵	300	832.00	249,600	
イノテック	7,000	1,395.00	9,765,000	
イエローハット	18,600	2,512.00	46,723,200	貸付株式数 7,400株
松屋フーズHLDGS	4,900	6,570.00	32,193,000	
JBCCホールディングス	6,600	4,840.00	31,944,000	
JKホールディングス	7,900	1,018.00	8,042,200	
サガミホールディングス	16,500	1,717.00	28,330,500	貸付株式数 6,600株 (5,400株)
日伝	5,900	2,995.00	17,670,500	貸付株式数 2,300株
ミロク情報サービス	9,000	1,876.00	16,884,000	貸付株式数 900株
北沢産業	800	352.00	281,600	貸付株式数 700株
杉本商事	9,100	1,355.00	12,330,500	貸付株式数 1,500株
因幡電機産業	28,900	3,821.00	110,426,900	
王将フードサービス	20,800	3,015.00	62,712,000	
ミニストップ	8,500	1,809.00	15,376,500	貸付株式数 3,400株 (1,200株)
アークス	17,300	2,506.00	43,353,800	
パローホールディングス	19,600	2,111.00	41,375,600	
東テク	10,500	2,465.00	25,882,500	貸付株式数 4,200株
ミスミグループ本社	158,900	2,504.50	397,965,050	
アルテック	600	224.00	134,400	
ベルク	5,100	6,690.00	34,119,000	
大庄	6,100	1,040.00	6,344,000	貸付株式数 2,400株 (200株)
タキヒヨー	300	1,217.00	365,100	貸付株式数 200株
ファーストリテイリング	59,200	49,660.00	2,939,872,000	
ソフトバンクグループ	492,200	8,646.00	4,255,561,200	
蔵王産業	200	2,444.00	488,800	
スズケン	34,700	4,850.00	168,295,000	貸付株式数 6,800株
サンドラッグ	35,000	3,445.00	120,575,000	
サクスパーホールディング グ	9,700	919.00	8,914,300	貸付株式数 3,000株
ジェコス	6,100	967.00	5,898,700	
ヤマザワ	200	1,163.00	232,600	
やまや	300	2,850.00	855,000	貸付株式数 200株
ベルーナ	25,400	726.00	18,440,400	貸付株式数 9,600株
合計			384,156,091,640	

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

リクルートホールディングス	35,000株
日立	80,000株
トヨタ自動車	60,000株
三菱商事	60,000株

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年11月29日

資産総額	46,105,423,950円
負債総額	2,651,737円
純資産総額(-)	46,102,772,213円
発行済数量	32,566,706,045口
1単位当たり純資産額(/)	1.4156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11月29日

資産総額	415,012,385,479円
負債総額	16,533,951,328円
純資産総額(-)	398,478,434,151円
発行済数量	202,398,759,470口
1単位当たり純資産額(/)	1.9688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。

第二部【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11月末日現在

資本金の額 414億2,454万1,896円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 326万657株

過去5年間における資本金の額の増減：2024年10月1日262億5,026万9,396円増加しました。

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

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	90	348,957
追加型株式投資信託	793	29,960,833
株式投資信託 合計	883	30,309,790
単位型公社債投資信託	77	152,655
追加型公社債投資信託	14	1,393,841
公社債投資信託 合計	91	1,546,496
総合計	974	31,856,286

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、「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282条及び第306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。

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65期事業年度（2023年4月1日から2024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66期事業年度に係る中間会計期間（2024年4月1日から2024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る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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,982	4,813
有価証券	346	503
前払費用	393	481
未収委託者報酬	12,525	16,513
未収収益	47	78
関係会社短期貸付金	22,100	23,400
その他	59	88
流動資産計	37,455	45,878
固定資産		
有形固定資産	1	176
建物	3	2
器具備品	193	174
無形固定資産	1,482	1,342
ソフトウェア	1,351	1,063
ソフトウェア仮勘定	131	279
投資その他の資産	13,824	13,660

投資有価証券	8,260	8,448
関係会社株式	3,475	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,066	1,021
繰延税金資産	824	524
その他	20	12
固定資産計	15,503	15,180
資産合計	52,959	61,058

(単位:百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	101	158
未払金	5,874	6,187
未払収益分配金	38	39
未払償還金	12	12
未払手数料	4,525	5,849
その他未払金	2	285
未払費用	3,987	5,035
未払法人税等	560	3,842
未払消費税等	327	872
賞与引当金	692	1,048
その他	2	1
流動負債計	11,545	17,146
固定負債		
退職給付引当金	2,276	2,227
役員退職慰労引当金	51	62
その他	0	-
固定負債計	2,329	2,289
負債合計	13,874	19,435
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495

利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,505	13,048
利益剰余金合計	11,879	13,422
株主資本合計	38,549	40,092
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	534	1,530
評価・換算差額等合計	534	1,530
純資産合計	39,084	41,623
負債・純資産合計	52,959	61,058

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	69,845	76,221
その他営業収益	559	717
営業収益計	70,405	76,939
営業費用		
支払手数料	29,405	31,497
広告宣伝費	662	947
調査費	9,638	10,709
調査費	1,469	1,700
委託調査費	8,169	9,009
委託計算費	1,783	1,783
営業雑経費	1,658	2,285
通信費	181	163
印刷費	468	514
協会費	51	51
諸会費	17	18
その他営業雑経費	939	1,538
営業費用計	43,147	47,224
一般管理費		
給料	5,788	6,601
役員報酬	317	483
給料・手当	4,369	4,543
賞与	409	527
賞与引当金繰入額	692	1,048

福利厚生費	874	969
交際費	66	96
旅費交通費	95	192
租税公課	476	508
不動産賃借料	1,300	1,269
退職給付費用	488	334
役員退職慰労引当金繰入額	38	6
固定資産減価償却費	625	478
諸経費	2,193	1,888
一般管理費計	11,946	12,346
営業利益	15,310	17,368

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	286	220
受取配当金	25	40
有価証券償還益	150	32
その他	146	93
営業外収益計	608	388
営業外費用		
有価証券償還損	2	196
投資有価証券売却損	244	1
その他	31	18
営業外費用計	277	215
経常利益	15,642	17,540
特別損失		
システム刷新関連費用	-	153
投資有価証券評価損	257	132
関係会社整理損失	229	-
特別損失計	486	286
税引前当期純利益	15,155	17,253
法人税、住民税及び事業税	4,589	5,533
法人税等調整額	248	139
法人税等合計	4,838	5,394
当期純利益	10,317	11,859

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,316	△ 10,316	△ 10,316
当期純利益	-	-	-	11,859	11,859	11,859
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,543	1,543	1,543
当期末残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,316
当期純利益	-	-	11,859
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	995	995	995
当期変動額合計	995	995	2,538
当期末残高	1,530	1,530	41,623

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の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員及び参与についても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。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」のその他に表示していた171百万円は、「受取配当金」25百万円、「その他」146百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
建物	38百万円	39百万円
器具備品	296百万円	308百万円

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
未払金	1,178百万円	236百万円

3 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（2024年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,354百万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 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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
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

(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

2024年6月19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	11,858百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,546円
基準日	2024年3月31日
効力発生日	2024年6月20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（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

当事業年度（2024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	144	8,141	-	8,285
資産合計	144	8,141	-	8,285

(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	666	666
子会社株式	1,448	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（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。

当事業年度（2024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（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。

当事業年度（2024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	144	55	89
(2) その他	6,597	4,268	2,329
小計	6,742	4,323	2,419
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,543	1,756	213
小計	1,543	1,756	213
合計	8,285	6,079	2,205

(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 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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	1,455	220	1
合計	1,455	220	1

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。

当事業年度において、証券投資信託について132百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)	当事業年度 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,399百万円	2,276百万円
勤務費用	150	138
退職給付の支払額	322	266
その他	48	78
退職給付債務の期末残高	2,276	2,227

(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 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)	当事業年度 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,276百万円	2,227百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,276	2,227
退職給付引当金	2,276	2,227
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,276	2,227

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)	当事業年度 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月31日)
勤務費用	150百万円	138百万円
その他	153	9
確定給付制度に係る退職給付費用	303	147

(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184百万円、当事業年度187百万円であります。

(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 (2023年 3月31日)	当事業年度 (2024年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	697	681
賞与引当金	182	262

投資有価証券評価損	177	204
未払事業税	114	197
関係会社株式評価損	155	155
出資金評価損	94	94
システム関連費用	68	25
その他	309	289
繰延税金資産小計	1,799	1,910
評価性引当額	459	486
繰延税金資産合計	1,339	1,424
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	356	740
連結法人間取引（譲渡益）	159	159
繰延税金負債合計	515	899
繰延税金資産の純額	824	524

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（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。

当事業年度（2024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76,221百万円、その他717百万円であります。

（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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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 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 -	22,100 -
-----	---------------	---------	---------	---------	--------------	----	------	-----------------------	-------------	----------------	-------------

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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	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)	11,100 0	関係会社短期貸付金 -	23,400 -

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 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。

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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)	2,354	-	-

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 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 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)	13,072	未払手数料	2,663
							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す。

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

(注3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。

(注4) ソフトウェアの購入・保守については、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 2023年4月1日 至 2024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)	13,749 1,030	未払手数料 長期差入保証金	3,491 1,010
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)	902	未払費用	87

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。

(注4) ソフトウェアの購入・保守については、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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,983.42円	1株当たり純資産額	15,956.63円
1株当たり当期純利益	3,955.35円	1株当たり当期純利益	4,546.57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、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,317	11,859
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)

(株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行)

2024年5月15日開催の株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を決議いたしました。条件等は次のとおりであります。

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式 652,132株
払込金額	1株につき80,506円
払込金額の総額	52,500,538,792円
増加する資本金の金額	26,250,269,396円
払込期日	2024年7月1日（予定）
資金の用途	投融資及び運転資金に充当する予定であります。
新株式発行前の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：100%
新株式発行後の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：80% 株式会社かんぽ生命保険：20%

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 (2024年9月30日)	
資産の部		
流動資産		
現金・預金		4,555
有価証券		1,271
未収委託者報酬		18,273
関係会社短期貸付金		16,900
その他		916
流動資産合計		41,916
固定資産		
有形固定資産	1	60
無形固定資産		
ソフトウェア		878
その他		346
無形固定資産合計		1,225
投資その他の資産		
投資有価証券		9,666
関係会社株式		3,414
繰延税金資産		748

その他	1,095
投資その他の資産合計	14,924
固定資産合計	16,211
資産合計	58,128

(単位:百万円)

当中間会計期間
(2024年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金	6,580
未払費用	5,540
未払法人税等	4,405
賞与引当金	910
その他	2 1,107

流動負債合計	18,545
--------	--------

固定負債

退職給付引当金	2,270
役員退職慰労引当金	55

固定負債合計	2,325
--------	-------

負債合計

負債合計	20,870
------	--------

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	8,774
---------	-------

利益剰余金合計	9,148
---------	-------

株主資本合計

株主資本合計	35,818
--------	--------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	1,438
--------------	-------

評価・換算差額等合計	1,438
------------	-------

純資産合計

純資産合計	37,257
-------	--------

負債・純資産合計

負債・純資産合計	58,128
----------	--------

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			44,508
その他営業収益			483
営業収益合計			44,992
営業費用			
支払手数料			18,092
その他営業費用			9,300
営業費用合計			27,392
一般管理費	1		6,708
営業利益			10,890
営業外収益	2		281
営業外費用	3		21
経常利益			11,150
特別利益	4		491
特別損失	5		154
税引前中間純利益			11,487
法人税、住民税及び事業税			4,086
法人税等調整額			183
中間純利益			7,584

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		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		

当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,858	11,858	11,858
中間純利益	-	-	-	7,584	7,584	7,584
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額 合計	-	-	-	4,274	4,274	4,274
当中間期末残高	15,174	11,495	374	8,774	9,148	35,818

	評価・換算差額等		純資産合計
	其他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,530	1,530	41,623
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,858
中間純利益	-	-	7,584
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	91	91	91
当中間期変動額 合計	91	91	4,365
当中間期末残高	1,438	1,438	37,257

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）其他有価証券

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、執行役員及び参与についても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．その他中間財務諸表の作成のための基本となる重要な事項

当社は株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度を適用しておりましたが、2024年10月1日の第三者割当増資により、株式会社大和証券グループ本社の100%子会社ではなくなったため、株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度から離脱しています。

（中間貸借対照表関係）

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2024年9月30日現在)
有形固定資産	358百万円

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（2024年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,340百万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 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
有形固定資産	9百万円
無形固定資産	211百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
投資有価証券売却益	184百万円
有価証券償還益	45百万円
受取配当金	27百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
為替差損	17百万円

4 特別利益の項目

	当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
投資有価証券売却益	380百万円
固定資産売却益	
美術品	83百万円
ゴルフ会員権	26百万円

5 特別損失の項目

当中間会計期間

（自 2024年4月1日

至 2024年9月30日）

固定資産売却損	
美術品	85百万円
ゴルフ会員権	15百万円
投資有価証券評価損	53百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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
2024年6月19日 定時株主総会	普通株式	11,858	4,546	2024年 3月31日	2024年 6月20日

（金融商品関係）

当中間会計期間（2024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	1,602	8,991	-	10,594
資産合計	1,602	8,991	-	10,594

(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、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

市場で取得した株式及び上場投資信託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のうちレベル1の時価を採用しているもの以外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	342
子会社株式	1,386
関連会社株式	2,027

(有価証券関係)

当中間会計期間（2024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 1,386百万円）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	123	55	67

(2) その他	6,715	4,477	2,238
小計	6,838	4,532	2,306
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,756	3,988	232
小計	3,756	3,988	232
合計	10,594	8,520	2,073

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額 342百万円)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44,508百万円、その他483百万円であります。

(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 2024年4月1日 至 2024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 2024年4月1日 至 2024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 2024年4月1日 至 2024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 2024年4月1日 至 2024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 2024年4月1日 至 2024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 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1株当たり純資産額	14,283.03円
1株当たり中間純利益	2,907.52円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
中間純利益(百万円)	7,584
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,584
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)

(株式会社かんぼ生命保険を割当先とする新株式発行)

2024年5月15日開催の株主総会及び2024年6月27日開催の臨時株主総会において、株式会社かんぼ生命保険を割当先とする新株式発行について決議し、2024年10月1日付で払込手続きが完了いたしました。

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式 652,132株

払込金額	1株につき80,506円
払込金額の総額	52,500,538,792円
増加する資本金の金額	26,250,269,396円
払込日	2024年10月1日
資金の用途	投融資及び運転資金に充当する予定であります。
新株式発行前の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：100%
新株式発行後の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：80% 株式会社かんぼ生命保険：20%

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

2024年5月15日、株式会社かんぼ生命保険と資本業務提携を締結し、本提携に基づき2024年10月1日、かんぼ生命保険を引き受け先とする第三者割当増資を実施いたしました。

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 (2024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。

(注13) 資産運用業務を行なっています。

(注14) 資産運用業務、投資助言業務および情報提供業務を行なっています。

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ないません。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）を行ないません。

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ないません。

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

(提出年月日)	(書類名)
2024年2月13日	有価証券報告書、有価証券届出書
2024年8月13日	半期報告書、有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2024年5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

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2024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。

強調事項

注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、会社は2024年5月15日開催の株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を決議している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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

2025年1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国内株式インデックス（ラップ専用）の2023年11月21日から2024年11月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）の2024年11月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月25日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	渡部 啓太
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松田 好弘

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2024年4月1日から2025年3月31日までの第66期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024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2024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（2024年4月1日から2024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。

強調事項

注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、会社は2024年10月1日付で株式会社かんぼ生命保険を割当先とする新株式発行を実施している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成

基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記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。