

DCダイワ日本株式インデックス

追加型投信／国内／株式／インデックス型

※課税上は株式投資信託として取扱われます。

投資信託説明書(請求目論見書)

2020年2月22日

本文書は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

本文書にかかる「DCダイワ日本株式インデックス」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により、有価証券届出書を2020年2月21日に関東財務局長に提出しており、2020年2月22日にその届出の効力が生じております。

発行者名	大和証券投資信託委託株式会社
代表者の役職氏名	取締役社長 松下 浩一
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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当ありません。

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更します。2020年4月1日以降、「大和投資信託」「大和証券投資信託委託株式会社」など当社名を表す記載につきましては、「大和アセットマネジメント株式会社」とお読み替え下さい。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

第一部 証券情報

(1) ファンドの名称

DCダイワ日本株式インデックス

(2) 内国投資信託受益証券の形態等

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 発行（売出）価額の総額

5,000億円を上限とします。

(4) 発行（売出）価格

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせるにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 申込手数料

① 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、販売会社または委託会社に問合わせるにより知ることができます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

② 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。）が課されません。

③ 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。

(6) 申込単位

1円以上1円単位とします。

(7) 申込期間

2020年2月22日から2020年8月26日まで（継続申込期間）
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 申込取扱場所

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 払込期日

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとしします。販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

(10) 払込取扱場所

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

(11) 振替機関に関する事項

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) その他

- ① 当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により取得の申込みを行なう場合に限り取得できます。
- ② 受益権の取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとしします。
- ③ 委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（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。
- ④ 当ファンドは、積立投資専用です。
イ. 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。）を締結するものとしします。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとしします（以下同じ）。
ロ. 収益分配金は、自動的に再投資されます。
- ⑤ 振替受益権について
ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に

記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

◆投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

⑥ 取得申込金額に利息は付きません。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(1) ファンドの目的及び基本的性格

当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なうことを基本とします。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式 一般））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	投資形態	ファミリーファンド
	対象インデックス	TOPIX

(注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」…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
- ・「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
- ・「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
- ・「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

(注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「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
- ・「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
- ・「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
- ・「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

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	年12回 (毎月)	オセアニア		
公債	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ()
社債	その他 ()	アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ()		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))				
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※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、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1

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

- 東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。
 - (a) 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。
 - (b) ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。
 - (c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

運用プロセス



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

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

■ 東証株価指数（TOPIX）について

◆ 東証株価指数（TOPIX）とは

株式市場の動向を表す指標には、東証株価指数、日経平均株価、日経500種株価等があります。このうち、東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所の第1部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするものです。

TOPIXは、1968年1月4日（基準時）の時価総額を100として1969年7月1日から東京証券取引所が算出・公表しています（注1参照）。

◆ 東証株価指数（TOPIX）の特徴

東証第1部上場の全銘柄を対象としているため、市場全体の動きを確実に表します。

なお、新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します（注2参照）。

（注1） TOPIXの算出方法：

$$\text{毎日の指数} = \text{当日の時価総額} \div \text{基準時の時価総額} \times 100$$

（注2） 基準時の時価総額の修正方法：

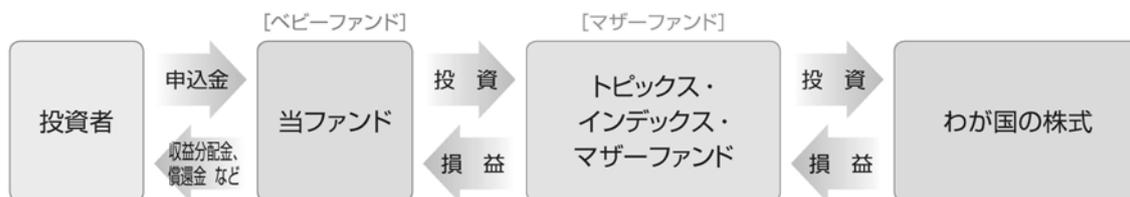
$$\text{修正後の基準時価総額} = \text{修正前日の基準時価総額} \times (\text{修正前日の時価総額} \pm \text{修正額}) \div \text{修正前日の時価総額}$$

- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利、ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。
- ② (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの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 (株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIX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 (株)東京証券取引所は、TOPIX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、(株)東京証券取引所は、TOPIX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 本件インデックスファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ (株)東京証券取引所は、本件インデックスファンドの購入者または公衆に対し、本件インデックスファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦ (株)東京証券取引所は、当社または本件インデックスファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、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、(株)東京証券取引所は本件インデックスファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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



- 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

2

当ファンドは、確定拠出年金制度を利用する場合、またはこれに類する前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により購入の申込みを行なう場合に限り購入できます。

3

毎年11月30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いません。収益分配金は、自動的に再投資されます。

〈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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

●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）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いません。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

2003年1月27日 信託契約締結、当初設定、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	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す。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③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
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など
↓運用指図 ↑↓※2	損益↑↓信託金（※3）	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社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。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
	損益↑↓投資	
投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。） など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）	

（注）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經由して、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（2019年11月末日現在）>

- ・資本金の額 151億7,427万2,500円
- ・沿革
 - 1959年12月12日 設立登記
 - 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)
- ・大株主の状況

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

2 投資方針

(1) 投資方針

① 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。

② 投資態度

イ. 投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

ロ. 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

ニ. 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

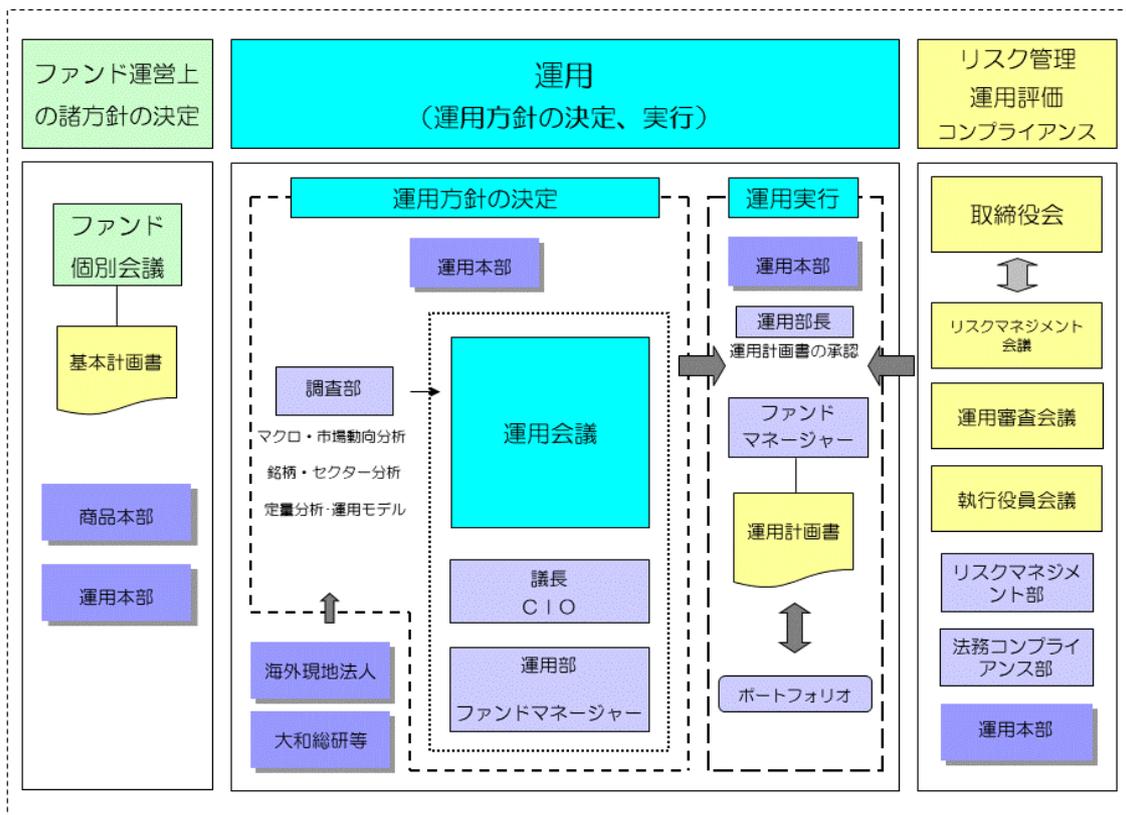
- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産(本邦通貨表示のものに限ります。)の種類は、次に掲げるものとします。
1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをい、後掲(5)②に定めるものに限ります。）
 - ハ. 約束手形
 - ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ. 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、大和証券投資信託委託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. コマーシャルペーパーおよび短期社債等
 2. 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。）
 3. 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
- ③ 委託会社は、信託金を、前②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せん。）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

※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

① 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。



② 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経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・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。

③ 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。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的確な状況報告

- ・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承認します。
- ホ. 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。

④ 運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30~40名程度です。

イ. 運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績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. 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。

ハ. 執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守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。

⑤ 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2019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

毎計算期末に、次の方針に基づいて分配します。

- 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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 投資制限

① 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。

② 先物取引等（信託約款）

委託会社は、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に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。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。）。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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。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より支弁します。

<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

① 投資対象

東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

② 投資態度

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

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

ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

① 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。

- ② 委託会社は、信託金を、前①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せん。）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

- ① 株式への投資には、制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資は、行ないません。

3 投資リスク

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 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。

② 株価指数先物取引の利用に伴うリスク

株価指数先物の価格は、対象指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します（売建てている場合は逆の結果となります。）。ファンドで行なっている株価指数先物取引について損失が発生した場合、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。

③ 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) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止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できます。ただし、受益者がある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。

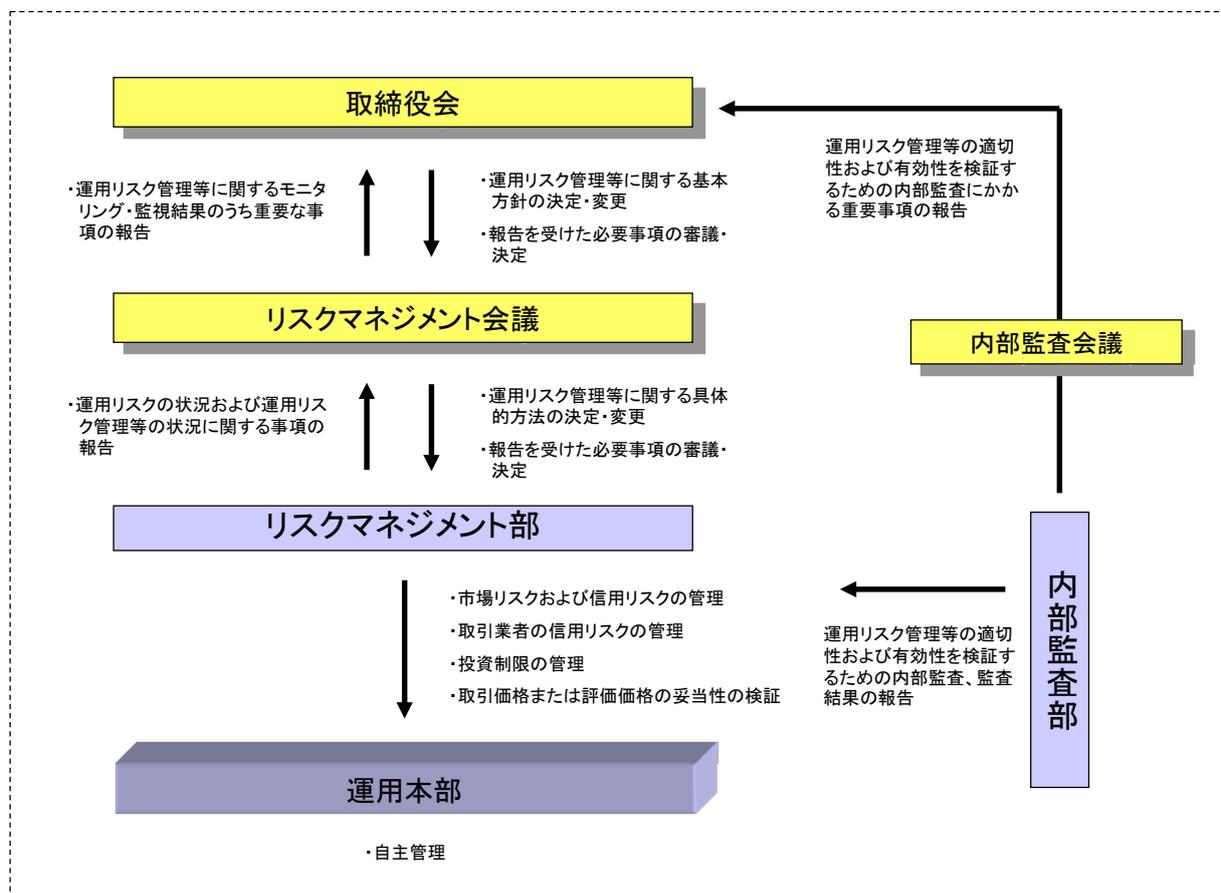
(3) その他の留意点

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。

(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

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策(コンティンジェンシー・プラン)を定めています。

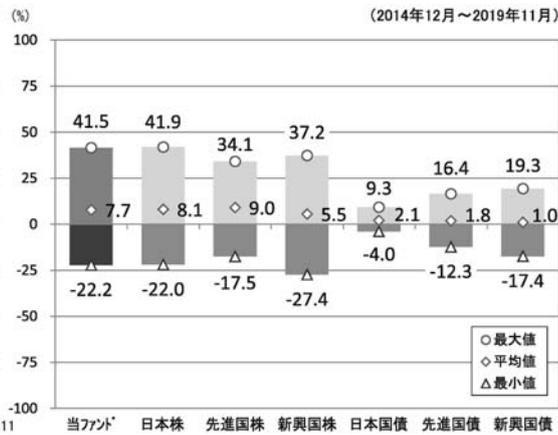
参 考 情 報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- ※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
- ※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
 - ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
 - ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
 - ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

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

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス— 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

- ① 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、販売会社または委託会社に問合わせることでより知ることができます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

- ② 申込手数料には、消費税等が課されます。
- ③ 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

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3) 信託報酬等

- ① 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 0.682%（税抜 0.62%）以内（有価証券届出書提出日現在、年率 0.275%（税抜 0.25%））を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の 6 か月終了日（6 か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。
- ② 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。
- ③ 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（有価証券届出書提出日現在）。

委託会社	販売会社	受託会社
年率 0.09% （税抜）	年率 0.12% （税抜）	年率 0.04% （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。

- ④ 前③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

- ① 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。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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および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。

受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

前払退職金等の積立てを目的とした定時定額購入等により受益権を取得した場合、上記にかかわらず、次の取扱いとなります。

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。

<注1>個別元本について

- ① 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。
- ② 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。
ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。
- ③ 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。

<注2>収益分配金の課税について

- ① 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。
 - ② 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、2019年11月末現在のものですので、税法または確定拠出年金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 (2019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	72,142,645,401	99.99
内 日本	72,142,645,401	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,091,750	0.01
純資産総額	72,147,737,151	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 (2019年11月29日現在)

① 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	65,281,554,069	1.0533 68,761,698,493	1.1051 72,142,645,401	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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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

① 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7計算期間末 (2009年11月30日)	22,197,411,154	22,197,411,154	1.0622	1.0622
第8計算期間末 (2010年11月30日)	25,555,883,098	25,555,883,098	1.1084	1.1084
第9計算期間末 (2011年11月30日)	24,177,954,974	24,177,954,974	0.9573	0.9573
第10計算期間末 (2012年11月30日)	28,164,446,865	28,164,446,865	1.0494	1.0494
第11計算期間末 (2013年12月2日)	45,294,346,724	45,294,346,724	1.7181	1.7181
第12計算期間末 (2014年12月1日)	50,829,621,260	50,829,621,260	1.9730	1.9730
第13計算期間末 (2015年11月30日)	57,404,914,294	57,404,914,294	2.2302	2.2302
第14計算期間末 (2016年11月30日)	57,003,477,005	57,003,477,005	2.1126	2.1126
第15計算期間末 (2017年11月30日)	67,558,051,699	67,558,051,699	2.6238	2.6238
第16計算期間末 (2018年11月30日)	69,264,493,765	69,264,493,765	2.4857	2.4857
2018年12月末日	62,126,574,026	—	2.2306	—
2019年1月末日	65,923,403,450	—	2.3400	—
2月末日	67,239,184,789	—	2.4001	—
3月末日	67,221,615,054	—	2.4017	—
4月末日	67,557,498,213	—	2.4411	—
5月末日	63,628,364,324	—	2.2818	—
6月末日	65,424,504,973	—	2.3437	—
7月末日	66,270,162,865	—	2.3645	—
8月末日	64,515,685,988	—	2.2842	—
9月末日	67,744,141,622	—	2.4216	—
10月末日	71,149,797,714	—	2.5420	—
11月末日	72,147,737,151	—	2.5909	—

② 分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

	1口当たり分配金(円)
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000

③ 収益率の推移

	収益率(%)
第7計算期間	3.1
第8計算期間	4.3
第9計算期間	△13.6
第10計算期間	9.6
第11計算期間	63.7
第12計算期間	14.8
第13計算期間	13.0
第14計算期間	△5.3
第15計算期間	24.2
第16計算期間	△5.3

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第7計算期間	5,428,627,508	2,851,557,801
第8計算期間	5,084,050,851	2,924,597,492
第9計算期間	5,987,607,804	3,789,251,109
第10計算期間	5,522,945,007	3,939,767,684
第11計算期間	8,883,287,293	9,359,729,031
第12計算期間	6,645,370,985	7,245,362,528
第13計算期間	7,715,628,600	7,738,797,562
第14計算期間	6,667,631,688	5,423,871,842
第15計算期間	6,173,599,760	7,408,064,686
第16計算期間	6,643,294,461	4,526,289,678

(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 (2019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	160,131,659,270	98.26
内 日本	160,131,659,270	98.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,841,155,735	1.74
純資産総額	162,972,815,005	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)	3,122,480,000	1.92
内 日本	3,122,480,000	1.92

(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 (2019年11月29日現在)

① 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	744,400	7,378.21 5,492,345,754	7,638.00 5,685,727,200	3.49
2	ソニー	日本	株式	電気機器	422,200	6,387.36 2,696,747,091	6,904.00 2,914,868,800	1.79
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,535,800	565.41 2,564,611,998	578.10 2,622,145,980	1.61
4	武田薬品	日本	株式	医薬品	555,700	3,773.00 2,096,659,472	4,455.00 2,475,643,500	1.52
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	438,100	5,278.04 2,312,312,145	5,527.00 2,421,378,700	1.49
6	キーエンス	日本	株式	電気機器	60,500	33,525.42 2,028,288,028	37,440.00 2,265,120,000	1.39
7	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	520,100	4,587.63 2,386,028,969	4,253.00 2,211,985,300	1.36
8	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	455,600	3,791.00 1,727,180,051	3,989.00 1,817,388,400	1.12

	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 (%)
9	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	457,200	3,436.49 1,571,163,261	3,962.00 1,811,426,400	1.11
10	任天堂	日本	株式	その他製品	41,000	42,016.42 1,722,673,263	42,350.00 1,736,350,000	1.07
11	本田技研	日本	株式	輸送用機器	525,900	2,891.70 1,520,745,672	3,067.00 1,612,935,300	0.99
12	KDDI	日本	株式	情報・通信業	488,500	2,877.18 1,405,502,885	3,139.00 1,533,401,500	0.94
13	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	8,953,100	168.50 1,508,645,444	169.20 1,514,864,520	0.93
14	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	484,100	2,817.30 1,363,858,195	3,003.00 1,453,752,300	0.89
15	東京海上HD	日本	株式	保険業	235,600	5,893.97 1,388,621,383	5,952.00 1,402,291,200	0.86
16	日立	日本	株式	電気機器	320,900	4,085.15 1,310,926,693	4,300.00 1,379,870,000	0.85
17	花王	日本	株式	化学	159,900	7,979.32 1,275,894,026	8,612.00 1,377,058,800	0.84
18	信越化学	日本	株式	化学	115,000	11,839.09 1,361,495,754	11,710.00 1,346,650,000	0.83
19	HOYA	日本	株式	精密機器	134,400	8,892.81 1,195,194,299	9,990.00 1,342,656,000	0.82
20	ダイキン工業	日本	株式	機械	85,100	14,512.14 1,234,983,908	15,745.00 1,339,899,500	0.82
21	ファナック	日本	株式	電気機器	63,500	20,500.80 1,301,801,302	20,905.00 1,327,467,500	0.81
22	三菱商事	日本	株式	卸売業	461,500	2,781.65 1,283,734,572	2,866.00 1,322,659,000	0.81
23	第一三共	日本	株式	医薬品	191,100	7,110.44 1,358,806,452	6,862.00 1,311,328,200	0.80
24	日本電産	日本	株式	電気機器	80,300	15,360.72 1,233,465,899	16,190.00 1,300,057,000	0.80
25	村田製作所	日本	株式	電気機器	196,200	5,099.78 1,000,578,075	6,344.00 1,244,692,800	0.76
26	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	55,500	22,500.94 1,248,802,703	22,095.00 1,226,272,500	0.75
27	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	117,500	10,512.51 1,235,220,261	10,070.00 1,183,225,000	0.73
28	三井物産	日本	株式	卸売業	578,000	1,839.48 1,063,224,334	1,939.50 1,121,031,000	0.69
29	伊藤忠	日本	株式	卸売業	460,000	2,302.26 1,059,042,957	2,388.00 1,098,480,000	0.67
30	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	587,300	1,541.37 905,251,915	1,867.50 1,096,782,750	0.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.26%
合計	98.26%

(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	0.10%
鉱業	0.27%
建設業	2.73%
食料品	3.84%
繊維製品	0.58%
パルプ・紙	0.24%
化学	7.04%
医薬品	5.92%
石油・石炭製品	0.49%
ゴム製品	0.75%
ガラス・土石製品	0.83%
鉄鋼	0.76%
非鉄金属	0.75%
金属製品	0.57%
機械	5.03%
電気機器	13.97%
輸送用機器	7.69%
精密機器	2.31%
その他製品	2.29%
電気・ガス業	1.52%
陸運業	4.48%
海運業	0.17%
空運業	0.51%
倉庫・運輸関連業	0.18%
情報・通信業	8.40%
卸売業	4.87%
小売業	4.59%
銀行業	5.76%
証券、商品先物取引業	0.82%
保険業	2.25%
その他金融業	1.15%
不動産業	2.34%
サービス業	5.05%
合計	98.26%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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 2019年12月	買建	184	3,036,163,990	3,122,480,000	1.92%

(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

●DCダイワ日本株式インデックス

2019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	25,909円
純資産総額	721億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.9%
3カ月間	13.4%
6カ月間	13.5%
1年間	4.2%
3年間	22.6%
5年間	32.4%
設定来	159.1%



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

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円												設定来分配金合計額: 0円												
	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	
	07年11月	08年12月	09年11月	10年11月	11年11月	12年11月	13年12月	14年12月	15年11月	16年11月	17年11月	18年11月													
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	

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

主要な資産の状況

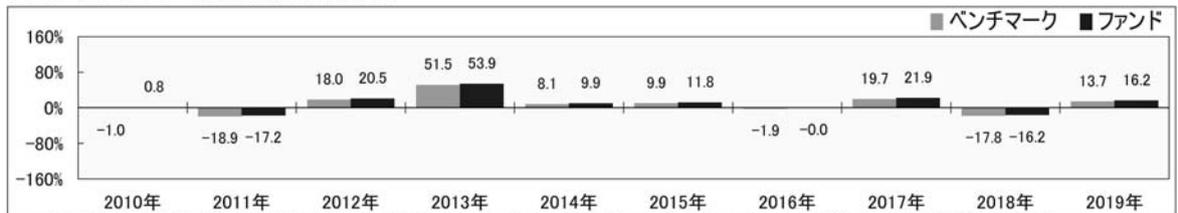
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,130	98.2%	電気機器	14.0%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.5%
国内株式先物	1	1.9%	情報・通信業	8.4%	TOPIX先物 0112月	-	1.9%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	7.7%	ソニー	電気機器	1.8%
コール・ローン、その他	-	1.8%	化学	7.0%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.6%
合計	2,131	-	医薬品	5.9%	武田薬品	医薬品	1.5%
株式市場・上場別構成			銀行業	5.8%	日本電信電話	情報・通信業	1.5%
一部(東証・名証)		98.2%	サービス業	5.0%	キーエンス	電気機器	1.4%
二部(東証・名証)		-	機械	5.0%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.4%
新興市場他		-	卸売業	4.9%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.1%
その他		-	その他	34.5%	リクルートホールディングス	サービス業	1.1%
合計		98.2%	合計	98.2%	合計		16.8%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。



・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。
 ・2019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。

第2 管理及び運営

1 申込（販売）手続等

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、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。）を結んだ受益権の取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって、受益権の取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

お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、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。

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

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、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。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

2 換金（解約）手続等

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

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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。

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、

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、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の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の実行の請求

を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、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の実行の請求を受付けたものとして、当該計算日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の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。

一部解約の実行の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

- ・東京証券取引所第一部上場株式：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、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
(営業日の9:00～17:00)
- ・委託会社のホームページ
アドレス <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)①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12月1日から翌年11月30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

① 信託の終了

1. 委託会社は、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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前 2. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前 3. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の 2 分の 1 を超えるときは、前 1. の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前 3. から前 5. までの規定は、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 3. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 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。
8. 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、②の 4. に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 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。

② 信託約款の変更

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

の理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知られた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。

⑤ 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。

⑥ 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。

① 収益分配金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。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。

② 償還金にかかる請求権

受益者は、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。

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。

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、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。

③ 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17期計算期間（2018年12月1日から2019年12月2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。

独立監査人の監査報告書

2019年12月27日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 深井 康治 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

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DCダイワ日本株式インデックスの2018年12月1日から2019年12月2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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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、DCダイワ日本株式インデックスの2019年12月2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すべ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。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

1 財務諸表

DCダイワ日本株式インデックス

(1) 貸借対照表

	第16期	第17期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	55,928,463	—
コール・ローン	108,767,849	218,629,541
親投資信託受益証券	69,260,185,124	72,737,778,591
未収入金	—	50,700,000
流動資産合計	69,424,881,436	73,007,108,132
資産合計	69,424,881,436	73,007,108,132
負債の部		
流動負債		
未払解約金	65,277,337	170,573,698
未払受託者報酬	15,042,107	14,810,919
未払委託者報酬	78,971,234	77,757,521
その他未払費用	1,096,993	1,131,115
流動負債合計	160,387,671	264,273,253
負債合計	160,387,671	264,273,253
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	27,865,639,043	27,827,282,837
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	41,398,854,722	44,915,552,042
(分配準備積立金)	17,175,109,929	15,380,826,609
元本等合計	69,264,493,765	72,742,834,879
純資産合計	69,264,493,765	72,742,834,879
負債純資産合計	69,424,881,436	73,007,108,132

(2) 損益及び剰余金計算書

	第16期	第17期
	自2017年12月1日 至2018年11月30日	自2018年12月1日 至2019年12月2日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	36	150
有価証券売買等損益	△3,500,173,560	3,862,472,467
営業収益合計	△3,500,173,524	3,862,472,617
営業費用		
支払利息	79,088	62,841
受託者報酬	29,869,451	29,019,683
委託者報酬	156,814,937	152,353,804
その他費用	2,167,594	2,190,466
営業費用合計	188,931,070	183,626,794
営業利益又は営業損失(△)	△3,689,104,594	3,678,845,823
経常利益又は経常損失(△)	△3,689,104,594	3,678,845,823
当期純利益又は当期純損失(△)	△3,689,104,594	3,678,845,823
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)	△117,746,425	△399,738,797
期首剰余金又は期首欠損金(△)	41,809,417,439	41,398,854,722
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,505,420,030	7,062,917,553
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	10,505,420,030	7,062,917,553
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,344,624,578	7,624,804,853
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	7,344,624,578	7,624,804,853
分配金 ※1	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	41,398,854,722	44,915,552,042

(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 17 期	
	自 2018 年 12 月 1 日 至 2019 年 12 月 2 日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019 年 11 月 30 日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を 2019 年 12 月 2 日としております。このため、当計算期間は 367 日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第 16 期	第 17 期
	2018 年 11 月 30 日現在	2019 年 12 月 2 日現在
1. ※1 期首元本額	25,748,634,260 円	27,865,639,043 円
期中追加設定元本額	6,643,294,461 円	5,137,982,396 円
期中一部解約元本額	4,526,289,678 円	5,176,338,602 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	27,865,639,043 口	27,827,282,837 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第 16 期	第 17 期
	自 2017 年 12 月 1 日 至 2018 年 11 月 30 日	自 2018 年 12 月 1 日 至 2019 年 12 月 2 日
※1 分配金の計算過程	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 (0 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (31,417,690,266 円) 及び分配準備積立金 (17,175,109,929 円) より分配対象額は 48,592,800,195 円 (1 万口当たり 17,438.25 円) であり、分配を行っておりません。	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 (1,111,454,723 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (34,256,547,807 円) 及び分配準備積立金 (14,269,371,886 円) より分配対象額は 49,637,374,416 円 (1 万口当たり 17,837.66 円) であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 17 期	
	自 2018 年 12 月 1 日 至 2019 年 12 月 2 日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。	

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 17 期	
	2019 年 12 月 2 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 16 期	第 17 期
	2018 年 11 月 30 日現在	2019 年 12 月 2 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	△3,484,564,156	4,024,403,608
合計	△3,484,564,156	4,024,403,608

(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16期 2018年11月30日現在	第17期 2019年12月2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17期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2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16期 2018年11月30日現在	第17期 2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	2,4857円	2,6141円
(1万口当たり純資産額)	(24,857円)	(26,141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	65,235,675,867	72,737,778,591	
親投資信託受益証券 合計			72,737,778,591	
合計			72,737,778,591	

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

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	5,748,360,758	—
コール・ローン	11,179,224,344	15,866,424,459
株式 ※2※3	140,729,270,900	162,602,439,840
派生商品評価勘定	26,461,940	76,885,750
未収入金	76,903,429	44,835,510
未収配当金	875,753,046	717,704,956
未収利息	1,251,373	1,374,718
前払金	21,520,000	—
その他未収収益 ※4	30,930,674	32,184,457
差入委託証拠金	—	39,360,000
流動資産合計	158,689,676,464	179,381,209,690
資産合計	158,689,676,464	179,381,209,690
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,672,420	—
前受金	—	86,417,200
未払金	1,030,901,154	1,370,527,390
未払解約金	23,803,900	123,739,000
受入担保金	15,009,839,092	13,103,577,689
その他未払費用	174,575	10,575
流動負債合計	16,072,391,141	14,684,271,854
負債合計	16,072,391,141	14,684,271,854
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	134,890,694,102	147,704,616,967
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,726,591,221	16,992,320,869
元本等合計	142,617,285,323	164,696,937,836
純資産合計	142,617,285,323	164,696,937,836
負債純資産合計	158,689,676,464	179,381,209,690

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. ※1 期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	128,627,233,302円	134,890,694,102円
期中追加設定元本額	18,705,077,077円	33,001,020,844円
期中一部解約元本額	12,441,616,277円	20,187,097,979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	4,208,196,163円	3,765,431,907円
ダイワ・トピックス・インデ ックスファンドVA	8,873,990,627円	7,517,011,572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	50,893,960 円	5,764,295 円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	65,059,832 円	59,609,321 円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,060,778,978 円	777,014,581 円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	59,055,392 円	46,976,403 円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,449,339,094 円	1,145,153,691 円
日本株式インデックスファン ド (FOFs 用) (適格機関投資 家専用)	4,513,952 円	46,927,453 円
D-I's TOPIXインデ ックス	39,579,272 円	50,758,188 円
為替ヘッジ付米国債プラス 日本株式ファンド	19,750,054 円	16,362,055 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2050	687,039 円	7,650,621 円
iFree TOPIXイン デックス	766,287,386 円	1,290,732,581 円
iFree 8資産バランス	1,279,701,333 円	1,996,082,570 円
iFree 年金バランス	18,821,903 円	64,246,554 円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,506,653,858 円	65,235,675,867 円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,604,113,138 円	2,856,480,263 円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,907,019,868 円	3,215,288,075 円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,813,203,474 円	2,971,577,942 円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,626,136,087 円	4,856,558,312 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2020	15,110,700 円	13,563,401 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2030	52,614,491 円	55,375,861 円
DCダイワ・ターゲットイヤ ー2040	16,862,669 円	24,888,377 円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	9,822,989 円	266,294,654 円
ダイワつみたてインデックス バランス30	—円	431,467 円
ダイワつみたてインデックス バランス50	—円	315,899 円
ダイワつみたてインデックス バランス70	—円	2,320,710 円

ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	350,718円	—円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	359,201円	—円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA (国内株式型)	712,052円	—円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	4,149,572円	—円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	4,912,940円	—円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA (国内株式型)	9,756,807円	—円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	184,587,297円	150,205,619円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	162,072,230円	158,266,050円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,658,927,568円	8,647,121,514円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	11,433,435円	—円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	14,487,998円	—円
ダイワ・バランスファンド2 5VA (適格機関投資家専用)	823,275,779円	730,190,060円
ダイワ国内バランスファンド 25VA (適格機関投資家専 用)	129,734,372円	124,454,938円
ダイワ国内バランスファンド 30VA (適格機関投資家専 用)	221,128,598円	216,391,069円
ダイワ・ノーロード TOP I Xファンド	140,301,263円	152,878,769円
ダイワファンドラップ TO PIXインデックス	8,504,620,250円	10,075,963,979円
ダイワTOP IXインデック ス (ダイワSMA専用)	292,440,998円	13,126,419,796円
ダイワファンドラップオンラ イン TOP IXインデック ス	1,905,520,921円	2,555,624,273円
ダイワ・インデックスセレクト TOP IX	1,400,114,800円	1,351,353,152円
ダイワライフスタイル25	181,369,214円	182,799,162円
ダイワライフスタイル50	649,148,174円	662,351,711円
ダイワライフスタイル75	544,757,466円	530,142,751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)	13,598,340,190円	12,751,961,504円
計	134,890,694,102円	147,704,616,967円
2. 期末日における受益権の総数	134,890,694,102口	147,704,616,967口

3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 14,441,000,290 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 12,524,034,910 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 680,300,000 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 565,900,000 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 28,279,195 円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分 29,453,875 円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月2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	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	△9,360,479,994	8,993,918,872
合計	△9,360,479,994	8,993,918,872

(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(2018年9月20日から2018年11月30日まで、及び2019年9月20日から2019年12月2日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	2018年11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,849,310,000	—	1,868,160,000	18,850,000	2,308,972,800	—	2,385,935,000	76,962,200
合計	1,849,310,000	—	1,868,160,000	18,850,000	2,308,972,800	—	2,385,935,000	76,962,200

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0573円 (10,573円)	1.1150円 (11,150円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,300	2,905.00	9,586,500	貸付株式数 100株
日本水産	91,300	666.00	60,805,800	
マルハニチロ	13,200	2,938.00	38,781,600	
ハウスイ	600	870.00	522,000	貸付株式数 200株
カネコ種苗	2,800	1,522.00	4,261,600	
サカタのタネ	10,900	3,535.00	38,531,500	
ホクト	7,000	2,001.00	14,007,000	貸付株式数 2,400株
ホクリヨウ	1,400	680.00	952,000	
ヒノキヤグループ	2,300	2,233.00	5,135,900	貸付株式数 800株 (200株)
ショーボンドHD	13,000	4,260.00	55,380,000	貸付株式数 100株
ミライト・ホールディングス	27,200	1,638.00	44,553,600	貸付株式数 10,600株
タマホーム	4,400	1,842.00	8,104,800	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
サンヨーホームズ	900	679.00	611,100	
日本アクア	3,600	657.00	2,365,200	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
ファーストコーポレーション	2,800	673.00	1,884,400	貸付株式数 1,000株
ベストテラ	1,600	1,258.00	2,012,800	
スペースバリューHD	11,100	515.00	5,716,500	
住石ホールディングス	18,400	150.00	2,760,000	貸付株式数 7,100株
日鉄鉱業	2,100	4,570.00	9,597,000	
三井松島HLDGS	3,500	1,203.00	4,210,500	
国際石油開発帝石	366,200	1,061.50	388,721,300	
石油資源開発	11,900	2,839.00	33,784,100	
K&Oエナジーグループ	4,400	1,577.00	6,938,800	
ダイセキ環境ソリューション	1,700	1,000.00	1,700,000	
第一カッター興業	1,100	1,827.00	2,009,700	
安藤・間	54,400	905.00	49,232,000	
東急建設	26,800	784.00	21,011,200	
コムシスホールディングス	32,400	3,190.00	103,356,000	
ミサワホーム	6,300	1,198.00	7,547,400	
ビーアールホールディングス	10,000	484.00	4,840,000	
高松コンストラクションGP	5,700	2,733.00	15,578,100	
東建コーポレーション	2,800	7,300.00	20,440,000	
ソネック	900	807.00	726,300	貸付株式数 100株
ヤマウラ	3,900	879.00	3,428,100	
大成建設	70,300	4,345.00	305,453,500	
大林組	210,700	1,180.00	248,626,000	
清水建設	213,900	1,065.00	227,803,500	

飛島建設	6,100	1,470.00	8,967,000	
長谷工コーポレーション	81,600	1,428.00	116,524,800	
松井建設	8,300	782.00	6,490,600	
銭高組	900	4,005.00	3,604,500	貸付株式数 100株
鹿島建設	165,500	1,460.00	241,630,000	
不動テトラ	5,500	1,543.00	8,486,500	
大末建設	2,500	964.00	2,410,000	
鉄建建設	4,600	2,846.00	13,091,600	貸付株式数 1,600株
西松建設	16,300	2,434.00	39,674,200	
三井住友建設	51,200	610.00	31,232,000	貸付株式数 2,100株
大豊建設	4,800	2,999.00	14,395,200	
前田建設	52,900	994.00	52,582,600	貸付株式数 20,600株
佐田建設	4,600	411.00	1,890,600	貸付株式数 1,600株
ナカノフドー建設	5,800	476.00	2,760,800	貸付株式数 1,200株
奥村組	11,400	3,095.00	35,283,000	貸付株式数 100株
東鉄工業	9,000	3,275.00	29,475,000	
イチケン	1,500	1,788.00	2,682,000	
富士ピー・エス	3,100	580.00	1,798,000	
浅沼組	2,400	4,375.00	10,500,000	
戸田建設	87,600	682.00	59,743,200	貸付株式数 33,200株
熊谷組	9,800	3,275.00	32,095,000	貸付株式数 2,500株
北野建設	1,300	2,606.00	3,387,800	貸付株式数 100株
植木組	900	2,545.00	2,290,500	
矢作建設	9,300	764.00	7,105,200	
ピーエス三菱	6,900	699.00	4,823,100	貸付株式数 3,000株
日本ハウスHLDGS	14,400	482.00	6,940,800	
大東建託	25,300	13,355.00	337,881,500	貸付株式数 10,300株
新日本建設	9,000	928.00	8,352,000	貸付株式数 200株
NIPPPO	17,500	2,256.00	39,480,000	
東亜道路	1,300	3,455.00	4,491,500	貸付株式数 300株
前田道路	22,300	2,602.00	58,024,600	
日本道路	2,000	7,010.00	14,020,000	
東亜建設	6,600	1,577.00	10,408,200	貸付株式数 2,500株
日本国土開発	12,300	626.00	7,699,800	貸付株式数 4,800株
若築建設	3,800	1,701.00	6,463,800	
東洋建設	23,700	504.00	11,944,800	
五洋建設	83,600	637.00	53,253,200	貸付株式数 32,600株
世紀東急	10,100	884.00	8,928,400	
福田組	2,400	4,825.00	11,580,000	貸付株式数 600株
日本ドライケミカル	1,600	1,462.00	2,339,200	貸付株式数 200株
住友林業	53,500	1,594.00	85,279,000	
日本基礎技術	7,000	403.00	2,821,000	
巴コーポレーション	9,300	399.00	3,710,700	貸付株式数 100株
大和ハウス	208,600	3,395.00	708,197,000	
ライト工業	12,100	1,587.00	19,202,700	
積水ハウス	230,500	2,394.50	551,932,250	
日特建設	5,500	788.00	4,334,000	貸付株式数 2,400株
北陸電気工事	3,700	1,048.00	3,877,600	貸付株式数 500株
ユアテック	12,100	677.00	8,191,700	貸付株式数 500株
四電工	1,100	2,785.00	3,063,500	

中電工	8,500	2,582.00	21,947,000	
関電工	30,000	1,054.00	31,620,000	
きんでん	50,100	1,659.00	83,115,900	
東京エネシス	7,000	938.00	6,566,000	
トーエネック	2,100	3,640.00	7,644,000	
住友電設	6,000	2,469.00	14,814,000	
日本電設工業	11,600	2,268.00	26,308,800	
協和エクシオ	32,000	2,877.00	92,064,000	貸付株式数 10,900株
新日本空調	5,600	2,242.00	12,555,200	
日本工営	4,300	3,380.00	14,534,000	貸付株式数 100株
九電工	14,800	3,545.00	52,466,000	
三機工業	15,200	1,480.00	22,496,000	
日揮ホールディングス	64,900	1,622.00	105,267,800	貸付株式数 3,300株
中外炉工業	2,300	1,708.00	3,928,400	
ヤマト	6,700	722.00	4,837,400	
太平電業	5,100	2,333.00	11,898,300	
高砂熱学	18,300	1,901.00	34,788,300	
三晃金属	900	2,630.00	2,367,000	
NECネッツエスアイ	6,200	3,445.00	21,359,000	
朝日工業社	1,400	3,470.00	4,858,000	貸付株式数 100株
明星工業	13,600	930.00	12,648,000	貸付株式数 400株
大気社	10,300	3,705.00	38,161,500	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
ダイダン	5,000	2,632.00	13,160,000	
日比谷総合設備	6,800	1,949.00	13,253,200	貸付株式数 1,000株
東芝プラントシステム	16,100	2,664.00	42,890,400	
日本製粉	19,800	1,716.00	33,976,800	
日清製粉G本社	76,200	2,058.00	156,819,600	
日東富士製粉	500	6,360.00	3,180,000	貸付株式数 100株
昭和産業	6,200	3,230.00	20,026,000	貸付株式数 2,100株
鳥越製粉	6,000	945.00	5,670,000	貸付株式数 100株
中部飼料	8,200	1,390.00	11,398,000	
フィード・ワン	45,400	170.00	7,718,000	
東洋精糖	1,100	1,136.00	1,249,600	
日本甜菜糖	3,500	2,040.00	7,140,000	
三井製糖	5,900	2,320.00	13,688,000	
塩水港精糖	7,300	220.00	1,606,000	貸付株式数 2,800株
日新製糖	3,200	2,019.00	6,460,800	貸付株式数 400株
LIFULL	22,400	555.00	12,432,000	貸付株式数 7,900株
ジェイエイシーリクルートメント	4,300	2,092.00	8,995,600	貸付株式数 1,300株
日本M&Aセンター	48,500	3,750.00	181,875,000	貸付株式数 1,300株
メンバーズ	1,900	2,358.00	4,480,200	貸付株式数 500株
中広	600	546.00	327,600	
アイティメディア	1,900	791.00	1,502,900	貸付株式数 300株
タケエイ	6,200	1,283.00	7,954,600	
E・Jホールディングス	800	1,432.00	1,145,600	
トラスト・テック	7,100	1,353.00	9,606,300	
コシダカホールディングス	15,500	1,609.00	24,939,500	貸付株式数 200株
アルトナー	1,600	754.00	1,206,400	

パソナグループ	7,800	1,707.00	13,314,600	貸付株式数	1,200株
CDS	1,600	1,510.00	2,416,000	貸付株式数	600株
リンクアンドモチベーション	14,200	726.00	10,309,200	貸付株式数	5,000株
GCA	7,700	953.00	7,338,100		
エス・エム・エス	20,000	3,005.00	60,100,000		
サニーサイドアップ	1,400	1,138.00	1,593,200		
パーソルホールディングス	64,200	2,034.00	130,582,800		
リニカル	3,100	1,180.00	3,658,000	貸付株式数	1,200株 (600株)
クックパッド	22,400	372.00	8,332,800		
エスクリ	2,000	802.00	1,604,000		
アイ・ケイ・ケイ	3,100	723.00	2,241,300	貸付株式数	1,100株
森永製菓	15,800	5,610.00	88,638,000		
中村屋	1,800	4,470.00	8,046,000		
江崎グリコ	20,000	5,090.00	101,800,000	貸付株式数	4,600株
名糖産業	3,200	1,315.00	4,208,000		
井村屋グループ	2,900	2,058.00	5,968,200	貸付株式数	500株
不二家	3,800	2,214.00	8,413,200		
山崎製パン	50,600	2,036.00	103,021,600	貸付株式数	11,500株
第一屋製パン	1,200	995.00	1,194,000	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,100	4,970.00	5,467,000		
亀田製菓	3,800	5,030.00	19,114,000		
寿スピリッツ	6,500	7,660.00	49,790,000		
カルビー	30,700	3,560.00	109,292,000		
森永乳業	12,500	4,635.00	57,937,500		
六甲バター	4,500	1,808.00	8,136,000		
ヤクルト	46,400	6,530.00	302,992,000		
明治ホールディングス	44,600	7,530.00	335,838,000		
雪印メグミルク	16,300	2,666.00	43,455,800		
プリマハム	10,600	2,554.00	27,072,400	貸付株式数	2,700株
日本ハム	25,800	4,650.00	119,970,000		
林兼産業	2,300	729.00	1,676,700		
丸大食品	7,200	2,341.00	16,855,200	貸付株式数	2,500株
S Foods	5,400	3,005.00	16,227,000		
伊藤ハム米久HLDGS	43,400	718.00	31,161,200	貸付株式数	2,100株
学情	2,300	1,589.00	3,654,700	貸付株式数	900株 (900株)
スタジオアリス	3,200	1,949.00	6,236,800	貸付株式数	900株
クロスキャット	1,700	1,000.00	1,700,000		
シミックホールディングス	3,600	1,818.00	6,544,800		
システナ	23,500	1,756.00	41,266,000		
NJS	1,400	1,728.00	2,419,200		
デジタルアーツ	3,200	6,320.00	20,224,000	貸付株式数	1,200株
日鉄ソリューションズ	9,900	3,810.00	37,719,000		
総合警備保障	25,600	5,810.00	148,736,000		
キューブシステム	3,500	798.00	2,793,000		
いちご	84,300	439.00	37,007,700		
エイジア	1,200	1,319.00	1,582,800	貸付株式数	400株
日本駐車場開発	72,400	166.00	12,018,400	貸付株式数	5,700株
コア	2,800	1,445.00	4,046,000	貸付株式数	100株

カカクコム	48,100	2,654.00	127,657,400		
アイロムグループ	2,300	1,456.00	3,348,800	貸付株式数	800株
セントケア・ホールディング	4,400	516.00	2,270,400		
サイネックス	1,100	683.00	751,300	貸付株式数	200株
ルネサンス	3,600	1,746.00	6,285,600		
ディップ	9,000	3,115.00	28,035,000	貸付株式数	3,800株
SBSホールディングス	5,800	1,967.00	11,408,600	貸付株式数	2,200株
オプトホールディング	3,500	1,783.00	6,240,500	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
新日本科学	6,900	786.00	5,423,400		
ツクイ	15,100	568.00	8,576,800		
キャリアデザインセンター	1,600	1,331.00	2,129,600		
ベネフィット・ワン	17,600	2,425.00	42,680,000	貸付株式数	6,800株
エムスリー	141,600	3,055.00	432,588,000	貸付株式数	55,300株
ツカダ・グローバルHOLD	4,200	637.00	2,675,400	貸付株式数	1,500株
プラス	700	695.00	486,500	貸付株式数	100株
アウトソーシング	36,700	1,202.00	44,113,400	貸付株式数	13,300株
ウェルネット	6,000	821.00	4,926,000	貸付株式数	700株
ワールドホールディングス	2,100	1,969.00	4,134,900	貸付株式数	600株
ディー・エヌ・エー	31,500	1,780.00	56,070,000		
博報堂DYHLDGS	89,300	1,788.00	159,668,400		
ぐるなび	11,100	1,045.00	11,599,500	貸付株式数	1,500株
タカミヤ	6,900	723.00	4,988,700	貸付株式数	2,600株
ジャパンベストレスキューS	4,400	1,081.00	4,756,400	貸付株式数	1,500株
ファンコミュニケーションズ	17,700	505.00	8,938,500	貸付株式数	500株
ライク	2,500	1,697.00	4,242,500	貸付株式数	900株
ビジネス・ブレークスルー	2,700	346.00	934,200		
エスプール	12,400	711.00	8,816,400		
WDBホールディングス	2,900	2,534.00	7,348,600		
ティア	3,700	596.00	2,205,200		
CDG	700	1,417.00	991,900	貸付株式数	200株 (200株)
バリューコマース	3,600	2,001.00	7,203,600	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
インフォマート	35,200	1,940.00	68,288,000	貸付株式数	13,400株
サッポロホールディングス	23,100	2,679.00	61,884,900		
アサヒグループホールディン	141,300	5,266.00	744,085,800	貸付株式数	52,100株
麒麟HD	286,100	2,441.50	698,513,150		
宝ホールディングス	50,500	1,074.00	54,237,000		
オエノンホールディングス	17,800	405.00	7,209,000	貸付株式数	6,800株
養命酒	2,100	2,000.00	4,200,000		
コカ・コーラボトラーズJHD	47,300	2,646.00	125,155,800	貸付株式数	18,800株
サントリー食品インター	45,100	4,755.00	214,450,500		
ダイドーグループHD	3,500	4,635.00	16,222,500	貸付株式数	1,300株
伊藤園	20,500	5,540.00	113,570,000	貸付株式数	8,000株
キーコーヒー	6,600	2,399.00	15,833,400		
ユニカフェ	1,700	1,034.00	1,757,800	貸付株式数	600株
ジャパンフーズ	1,000	1,238.00	1,238,000		
日清オイリオグループ	8,700	3,920.00	34,104,000		

不二製油グループ	16,500	3,075.00	50,737,500	貸付株式数	6,000株
かどや製油	700	3,815.00	2,670,500	貸付株式数	100株
J-オイルミルズ	3,500	4,365.00	15,277,500		
ローソン	16,700	6,080.00	101,536,000		
サンエー	5,500	5,050.00	27,775,000	貸付株式数	100株
カワチ薬品	5,100	2,305.00	11,755,500	貸付株式数	700株
エービーシー・マート	10,300	7,460.00	76,838,000		
ハードオフコーポレーション	2,600	810.00	2,106,000		
高千穂交易	2,500	1,093.00	2,732,500	貸付株式数	800株
アスクル	6,900	3,005.00	20,734,500	貸付株式数	1,800株 (100株)
ゲオホールディングス	11,900	1,318.00	15,684,200	貸付株式数	4,600株
アダストリア	9,200	2,536.00	23,331,200		
ジーフット	4,100	622.00	2,550,200	貸付株式数	1,500株
シー・ヴィ・エス・ペリエリア	1,100	671.00	738,100		
伊藤忠食品	1,700	5,220.00	8,874,000		
くら寿司	3,400	4,885.00	16,609,000		
キャンドウ	3,100	1,635.00	5,068,500	貸付株式数	800株 (600株)
エレマテック	6,100	1,057.00	6,447,700		
パルグループHLDGS	3,400	3,575.00	12,155,000		
JALUX	1,900	2,521.00	4,789,900	貸付株式数	700株
エディオン	30,400	1,187.00	36,084,800	貸付株式数	6,000株
あらた	5,300	4,315.00	22,869,500		
サーラコーポレーション	13,500	623.00	8,410,500	貸付株式数	3,200株
ワッツ	2,900	616.00	1,786,400	貸付株式数	500株 (400株)
トーマンデバイス	1,000	2,825.00	2,825,000	貸付株式数	200株
ハローズ	2,500	2,580.00	6,450,000		
J Pホールディングス	20,100	294.00	5,909,400	貸付株式数	7,800株
フジオフードシステム	2,800	3,570.00	9,996,000	貸付株式数	1,000株
あみやき亭	1,400	3,645.00	5,103,000		
東京エレクトロンデバイス	2,400	2,255.00	5,412,000		
ひらまつ	12,100	305.00	3,690,500	貸付株式数	4,700株
フィールズ	5,100	499.00	2,544,900		
双日	366,300	351.00	128,571,300		
アルフレッサホールディングス	73,500	2,303.00	169,270,500		
大黒天物産	1,600	3,210.00	5,136,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	5,800	1,390.00	8,062,000	貸付株式数	100株
ファーマライズHD	1,500	634.00	951,000		
キッコーマン	48,500	5,600.00	271,600,000		
味の素	149,000	1,836.00	273,564,000		
キューピー	37,500	2,456.00	92,100,000	貸付株式数	14,600株
ハウス食品G本社	25,200	3,840.00	96,768,000	貸付株式数	5,100株
カゴメ	25,600	2,688.00	68,812,800		
焼津水産化工	3,200	1,052.00	3,366,400		
アリアケジャパン	6,200	7,880.00	48,856,000	貸付株式数	1,700株
ピエトロ	900	1,640.00	1,476,000		

エバラ食品工業	1,600	2,186.00	3,497,600		
やまみ	300	2,158.00	647,400		
ニチレイ	32,100	2,581.00	82,850,100		
横浜冷凍	18,600	1,080.00	20,088,000	貸付株式数	600株
東洋水産	34,700	4,745.00	164,651,500		
イトアアンド	2,300	1,785.00	4,105,500		
大冷	900	1,969.00	1,772,100		
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,700	1,207.00	4,465,900	貸付株式数	200株
日清食品HD	28,700	8,230.00	236,201,000		
永谷園ホールディングス	3,300	2,152.00	7,101,600		
一正蒲鉾	2,600	1,063.00	2,763,800	貸付株式数	800株 (800株)
フジッコ	7,300	2,011.00	14,680,300		
ロックフィールド	7,300	1,480.00	10,804,000	貸付株式数	2,800株
日本たばこ産業	389,500	2,516.50	980,176,750	貸付株式数	8,100株
ケンコーマヨネーズ	3,800	2,602.00	9,887,600	貸付株式数	1,400株
わらべや日洋HD	4,400	1,819.00	8,003,600		
なとり	3,800	1,700.00	6,460,000		
イフジ産業	1,200	778.00	933,600	貸付株式数	100株
ピクルスコーポレーション	1,500	2,785.00	4,177,500	貸付株式数	100株
北の達人コーポ	23,500	704.00	16,544,000	貸付株式数	9,200株
ユーグレナ	28,800	836.00	24,076,800	貸付株式数	11,200株 (5,200株)
片倉工業	9,500	1,378.00	13,091,000	貸付株式数	700株
グンゼ	4,800	5,200.00	24,960,000	貸付株式数	1,500株
ヒューリック	141,600	1,254.00	177,566,400	貸付株式数	49,500株
神栄	1,000	746.00	746,000	貸付株式数	100株
ラサ商事	3,500	890.00	3,115,000		
アルペン	5,000	1,840.00	9,200,000	貸付株式数	1,600株
ハブ	1,900	1,033.00	1,962,700	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	3,200	703.00	2,249,600		
クオールホールディングス	9,800	1,584.00	15,523,200		
アルコニックス	7,000	1,447.00	10,129,000		
神戸物産	22,800	3,390.00	77,292,000	貸付株式数	8,900株
ソリトンシステムズ	2,900	1,099.00	3,187,100		
ジンズホールディングス	3,500	6,720.00	23,520,000	貸付株式数	100株
ビックカメラ	39,300	1,213.00	47,670,900		
DCMホールディングス	35,800	1,069.00	38,270,200	貸付株式数	13,100株
ペッパーフードサービス	5,300	1,322.00	7,006,600	貸付株式数	2,000株 (300株)
Monotaro	47,100	3,085.00	145,303,500	貸付株式数	18,200株 (2,500株)
東京一番フーズ	1,600	626.00	1,001,600		
DDホールディングス	2,600	1,567.00	4,074,200	貸付株式数	1,000株
あいホールディングス	9,500	1,997.00	18,971,500		
ディービーエックス	2,300	954.00	2,194,200	貸付株式数	900株
きちりホールディングス	1,700	848.00	1,441,600	貸付株式数	600株
アークランドサービスHD	4,800	1,871.00	8,980,800		
J. フロントリテイリン	79,100	1,473.00	116,514,300	貸付株式数	22,700株

グ				
ドトール・日レスHD	10,500	2,233.00	23,446,500	
マツモトキヨシHL DGS	27,400	4,200.00	115,080,000	貸付株式数 10,400株
ブロンコビリー	3,400	2,741.00	9,319,400	貸付株式数 1,300株
ZOZO	45,500	2,206.00	100,373,000	貸付株式数 27,400株
トレジャー・ファクトリー	1,900	1,120.00	2,128,000	貸付株式数 600株
物語コーポレーション	1,600	8,630.00	13,808,000	貸付株式数 600株 (100株)
ココカラファイン	6,900	6,440.00	44,436,000	貸付株式数 200株
三越伊勢丹HD	115,700	990.00	114,543,000	
東洋紡	26,000	1,622.00	42,172,000	
ユニチカ	19,300	376.00	7,256,800	貸付株式数 7,200株
富士紡ホールディングス	3,200	3,480.00	11,136,000	
日清紡ホールディングス	44,800	1,019.00	45,651,200	
倉敷紡績	6,700	2,582.00	17,299,400	貸付株式数 400株
ダイワボウHD	5,600	5,580.00	31,248,000	貸付株式数 600株
シキボウ	3,400	941.00	3,199,400	
日東紡績	10,000	4,100.00	41,000,000	
トヨタ紡織	19,600	1,726.00	33,829,600	貸付株式数 8,600株
マクニカ・富士エレHL DGS	15,800	1,874.00	29,609,200	
H a m e e	2,000	1,398.00	2,796,000	
ラクト・ジャパン	2,500	3,480.00	8,700,000	貸付株式数 1,000株 (500株)
ウエルシアHD	19,700	6,790.00	133,763,000	貸付株式数 7,600株
クリエイトSDH	9,700	2,676.00	25,957,200	
バイタルKSKHD	12,400	1,108.00	13,739,200	貸付株式数 4,800株
八洲電機	5,100	882.00	4,498,200	
メディアスホールディングス	3,800	830.00	3,154,000	貸付株式数 100株
レスターホールディングス	6,900	2,036.00	14,048,400	貸付株式数 2,600株
ジューテックHD	1,500	1,087.00	1,630,500	貸付株式数 500株
丸善CHI HD	7,600	376.00	2,857,600	貸付株式数 2,000株
大光	2,800	693.00	1,940,400	貸付株式数 1,000株
OCHIホールディングス	1,900	1,401.00	2,661,900	
TOKAIホールディングス	35,000	1,108.00	38,780,000	貸付株式数 1,400株
黒谷	1,500	450.00	675,000	
ミサワ	1,300	842.00	1,094,600	貸付株式数 400株
ティーライフ	900	869.00	782,100	貸付株式数 300株
C o m i n i x	1,100	820.00	902,000	
エー・ピーカンパニー	1,200	517.00	620,400	
三洋貿易	3,300	2,352.00	7,761,600	
チムニー	2,000	2,308.00	4,616,000	貸付株式数 700株
シュッピン	4,500	1,167.00	5,251,500	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ビューティガレージ	1,100	2,095.00	2,304,500	貸付株式数 400株
ウイン・パートナーズ	4,800	1,486.00	7,132,800	
ネクステージ	9,500	1,195.00	11,352,500	貸付株式数 3,400株
ジョイフル本田	19,300	1,463.00	28,235,900	貸付株式数 5,400株
鳥貴族	2,200	1,897.00	4,173,400	貸付株式数 900株
キリン堂ホールディングス	2,600	2,059.00	5,353,400	

ホットランド	4,400	1,353.00	5,953,200	貸付株式数	1,700株
すかいらーくHD	74,200	2,217.00	164,501,400	貸付株式数	29,000株 (2,800株)
SFPホールディングス	2,800	2,200.00	6,160,000		
綿半ホールディングス	2,500	2,015.00	5,037,500	貸付株式数	100株
日本毛織	21,600	1,075.00	23,220,000	貸付株式数	2,700株
ダイトウボウ	11,500	85.00	977,500	貸付株式数	2,900株
トーア紡コーポレーション	2,600	581.00	1,510,600	貸付株式数	100株
ダイドーリミテッド	8,500	280.00	2,380,000		
ヨシックス	1,100	2,864.00	3,150,400	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパーマ- ケ	19,300	981.00	18,933,300		
三栄建築設計	2,700	1,625.00	4,387,500	貸付株式数	300株
野村不動産HLDGS	40,200	2,653.00	106,650,600		
三重交通グループHD	13,500	604.00	8,154,000	貸付株式数	3,500株
サムティ	9,400	2,028.00	19,063,200		
エー・ディー・ワークス	121,800	31.00	3,775,800		
日本商業開発	4,200	1,606.00	6,745,200	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーション	10,700	1,756.00	18,789,200		
ユニゾホールディングス	10,000	4,900.00	49,000,000	貸付株式数	3,600株
日本管理センター	4,400	1,319.00	5,803,600		
サンセイランディック	2,000	882.00	1,764,000	貸付株式数	500株 (500株)
エストラスト	900	805.00	724,500	貸付株式数	300株
フージャースHD	13,300	707.00	9,403,100	貸付株式数	4,900株
オープンハウス	19,200	2,920.00	56,064,000	貸付株式数	7,500株
東急不動産HD	180,400	744.00	134,217,600		
飯田GHD	55,300	1,953.00	108,000,900		
イーランド	1,100	808.00	888,800		
帝国繊維	7,400	2,042.00	15,110,800		
日本コークス工業	58,200	81.00	4,714,200		
ゴルフダイジェスト・オン	3,000	684.00	2,052,000	貸付株式数	1,100株
ミタチ産業	2,000	751.00	1,502,000	貸付株式数	200株
BEENOS	2,300	1,539.00	3,539,700	貸付株式数	900株
あさひ	4,900	1,263.00	6,188,700	貸付株式数	1,900株
日本調剤	2,000	3,780.00	7,560,000		
コスモス薬品	2,900	22,250.00	64,525,000	貸付株式数	1,100株
シップヘルスケアHD	10,600	4,580.00	48,548,000		
トーエル	3,200	793.00	2,537,600	貸付株式数	100株
ソフトクリエイトHD	2,900	1,784.00	5,173,600	貸付株式数	200株
オンリー	1,100	801.00	881,100		
セブン&アイ・HLDGS	259,000	4,113.00	1,065,267,000	貸付株式数	106,600株
クリエイト・レストランツ・ ホール	17,800	1,841.00	32,769,800	貸付株式数	2,700株
明治電機工業	2,100	1,560.00	3,276,000		
ツルハホールディングス	14,400	13,070.00	188,208,000	貸付株式数	5,600株
デリカフーズHLDGS	2,400	689.00	1,653,600	貸付株式数	200株
スターティアホールディング ス	1,500	595.00	892,500	貸付株式数	400株
サンマルクホールディングス	5,200	2,332.00	12,126,400		

フェリシモ	1,400	1,038.00	1,453,200	
トリドールホールディングス	8,200	2,879.00	23,607,800	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
帝人	53,700	2,096.00	112,555,200	貸付株式数 21,000株
東レ	476,500	738.00	351,657,000	
クラレ	103,500	1,348.00	139,518,000	
旭化成	436,200	1,224.50	534,126,900	
サカイオーベックス	1,700	1,855.00	3,153,500	
TOKYO BASE	5,900	717.00	4,230,300	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
稲葉製作所	3,700	1,431.00	5,294,700	
宮地エンジニアリングG	2,000	2,085.00	4,170,000	貸付株式数 700株
トーカロ	18,400	1,112.00	20,460,800	
アルファCO	2,300	1,311.00	3,015,300	
SUMCO	79,600	1,691.00	134,603,600	貸付株式数 30,800株
川田テクノロジーズ	1,400	6,850.00	9,590,000	
RS TECHNOLOGIES	1,900	3,715.00	7,058,500	貸付株式数 700株 (400株)
信和	2,800	1,100.00	3,080,000	貸付株式数 100株
ビーロット	1,500	2,031.00	3,046,500	貸付株式数 600株
ファーストブラザーズ	1,500	1,278.00	1,917,000	貸付株式数 100株
ハウストゥ	3,700	1,619.00	5,990,300	貸付株式数 800株
シーアールイー	1,800	1,066.00	1,918,800	貸付株式数 100株
プロパティエージェント	1,000	1,156.00	1,156,000	貸付株式数 300株
ケイアイスター不動産	2,100	1,996.00	4,191,600	
アグレ都市デザイン	1,100	532.00	585,200	
ジェイ・エス・ビー	700	4,620.00	3,234,000	
テンポイノベーション	700	2,146.00	1,502,200	貸付株式数 100株
グローバルリンクマネジメント	1,100	679.00	746,900	
住江織物	1,900	2,852.00	5,418,800	貸付株式数 700株
日本フェルト	3,700	499.00	1,846,300	
イチカワ	900	1,479.00	1,331,100	貸付株式数 100株
エコナックホールディングス	11,400	133.00	1,516,200	貸付株式数 200株
日東製網	800	1,632.00	1,305,600	
芦森工業	1,400	1,392.00	1,948,800	
アツギ	5,400	829.00	4,476,600	
ウイルプラスHLDGS	1,100	933.00	1,026,300	
ジャパンミート	3,300	2,165.00	7,144,500	
コメダホールディングス	14,400	2,125.00	30,600,000	貸付株式数 400株
サツドラホールディングス	1,000	1,773.00	1,773,000	貸付株式数 300株
デファクトスタンダード	600	447.00	268,200	
アレンザホールディングス	3,300	878.00	2,897,400	貸付株式数 900株
串カツ田中HLDGS	1,000	2,366.00	2,366,000	貸付株式数 300株
バロックジャパン	4,600	946.00	4,351,600	貸付株式数 1,700株
クスリのアオキHLDGS	6,600	8,290.00	54,714,000	貸付株式数 2,500株
ダイニク	2,500	768.00	1,920,000	
共和レザー	3,600	803.00	2,890,800	貸付株式数 1,200株
力の源HD	3,000	872.00	2,616,000	
スシローグローバルHLDGS	7,300	8,560.00	62,488,000	

LIXILビバ	6,500	1,917.00	12,460,500	
セーレン	16,200	1,560.00	25,272,000	
ソトー	2,600	973.00	2,529,800	貸付株式数 1,000株
東海染工	900	1,128.00	1,015,200	
小松マテーレ	10,800	830.00	8,964,000	
ワコールホールディングス	17,200	3,085.00	53,062,000	
ホギメディカル	7,500	3,610.00	27,075,000	
レナウン	16,900	115.00	1,943,500	貸付株式数 500株
クラウドシアHLDGS	1,700	488.00	829,600	
T S Iホールディングス	22,000	553.00	12,166,000	
マツオカコーポレーション	1,900	2,197.00	4,174,300	
ワールド	9,300	2,766.00	25,723,800	
T I S	22,000	6,610.00	145,420,000	
ネオス	2,600	828.00	2,152,800	貸付株式数 1,000株
電算システム	2,500	2,985.00	7,462,500	貸付株式数 900株
グリー	45,500	523.00	23,796,500	
コーエーテクモHD	13,500	2,684.00	36,234,000	
三菱総合研究所	2,800	4,190.00	11,732,000	
ボルテージ	1,300	533.00	692,900	貸付株式数 400株
電算	700	2,175.00	1,522,500	貸付株式数 100株 (100株)
AGS	3,700	795.00	2,941,500	
ファインデックス	5,500	1,194.00	6,567,000	
ブレインパッド	1,300	5,750.00	7,475,000	貸付株式数 400株
KL a b	12,700	850.00	10,795,000	貸付株式数 4,900株
ポールトゥワイン・ピットクル	8,000	1,074.00	8,592,000	
イーブックイニシアティブ	900	2,054.00	1,848,600	貸付株式数 300株
ネクソン	187,700	1,501.00	281,737,700	貸付株式数 73,400株
アイスタイル	17,000	809.00	13,753,000	貸付株式数 6,000株
エムアップ	1,900	2,585.00	4,911,500	貸付株式数 800株
エイチーム	4,500	1,138.00	5,121,000	貸付株式数 1,700株
エニグモ	4,600	1,057.00	4,862,200	貸付株式数 1,800株
テクノスジャパン	5,100	525.00	2,677,500	貸付株式数 2,000株
e n i s h	2,900	637.00	1,847,300	貸付株式数 1,100株
コプロラ	21,600	1,273.00	27,496,800	貸付株式数 8,400株 (4,500株)
オルトプラス	4,900	820.00	4,018,000	貸付株式数 1,700株
ブロードリーフ	32,700	709.00	23,184,300	貸付株式数 12,700株
クロス・マーケティングG	2,900	369.00	1,070,100	貸付株式数 500株
デジタルハーツHLDGS	3,500	1,022.00	3,577,000	貸付株式数 1,300株
システム情報	3,300	1,114.00	3,676,200	貸付株式数 1,200株
メディアドゥHLDGS	2,200	3,760.00	8,272,000	貸付株式数 800株
じげん	16,300	554.00	9,030,200	
ブイキューブ	4,000	547.00	2,188,000	貸付株式数 400株
エンカレッジ・テクノロジー	1,100	816.00	897,600	貸付株式数 400株
サイバーリンクス	1,000	1,295.00	1,295,000	貸付株式数 300株
ディー・エル・イー	4,300	183.00	786,900	
フィックスターズ	7,000	1,628.00	11,396,000	貸付株式数 2,700株
CARTA HOLDING	3,200	1,362.00	4,358,400	貸付株式数 800株

S					
オブティム	1,700	3,485.00	5,924,500	貸付株式数	1,000株
セレス	2,100	1,219.00	2,559,900		
特種東海製紙	4,200	4,055.00	17,031,000	貸付株式数	500株
ティーガイア	5,900	2,619.00	15,452,100	貸付株式数	1,700株
セック	1,000	3,885.00	3,885,000	貸付株式数	400株
日本アジアグループ	6,900	384.00	2,649,600		
豆蔵ホールディングス	4,500	1,443.00	6,493,500		
テクマトリックス	4,600	2,325.00	10,695,000		
プロシップ	1,900	1,305.00	2,479,500		
ガンホー・オンライン・エンター	15,900	2,397.00	38,112,300	貸付株式数	6,200株
GMOペイメントゲートウェイ	10,900	7,910.00	86,219,000	貸付株式数	4,200株
ザッパラス	3,500	425.00	1,487,500	貸付株式数	1,300株
システムリサーチ	1,700	1,829.00	3,109,300		
インターネットイニシアティブ	9,800	2,553.00	25,019,400		
さくらインターネット	7,000	664.00	4,648,000		
ヴィンクス	1,900	1,261.00	2,395,900	貸付株式数	700株
GMOクラウド	1,200	2,917.00	3,500,400	貸付株式数	400株
SRAホールディングス	3,500	2,546.00	8,911,000		
MINORIソリューションズ	1,200	2,696.00	3,235,200		
システムインテグレータ	2,100	884.00	1,856,400		
朝日ネット	4,600	618.00	2,842,800	貸付株式数	300株
eBASE	3,900	1,197.00	4,668,300		
アバント	4,700	1,036.00	4,869,200		
アドソル日進	2,300	2,385.00	5,485,500	貸付株式数	900株
フリービット	3,900	933.00	3,638,700	貸付株式数	1,500株
コムチュア	7,400	2,402.00	17,774,800		
サイバーコム	1,200	2,125.00	2,550,000		
アステリア	4,100	647.00	2,652,700		
アイル	2,300	1,628.00	3,744,400		
王子ホールディングス	275,100	632.00	173,863,200		
日本製紙	29,100	1,935.00	56,308,500		
三菱製紙	7,500	508.00	3,810,000		
北越コーポレーション	43,600	569.00	24,808,400		
中越パルプ	2,800	1,646.00	4,608,800		
巴川製紙	2,000	929.00	1,858,000	貸付株式数	800株
大王製紙	28,900	1,494.00	43,176,600	貸付株式数	11,200株
阿波製紙	1,700	618.00	1,050,600	貸付株式数	400株 (100株)
マークラインズ	3,300	2,090.00	6,897,000		
メディカル・データ・ビジ	5,000	984.00	4,920,000		
gumi	8,400	721.00	6,056,400	貸付株式数	3,000株
ショーケース	1,500	673.00	1,009,500	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,500	1,396.00	2,094,000		
テラスカイ	2,400	2,851.00	6,842,400		

デジタル・インフォメーション	2,900	1,694.00	4,912,600		
PCIホールディングス	1,300	2,223.00	2,889,900	貸付株式数	500株
パイプドHD	800	1,884.00	1,507,200	貸付株式数	400株
アイビーシー	1,200	1,257.00	1,508,400		
ネオジャパン	1,200	1,035.00	1,242,000	貸付株式数	400株
PR TIMES	600	2,462.00	1,477,200	貸付株式数	200株
ランドコンピュータ	1,000	1,074.00	1,074,000		
ダブルスタンダード	800	5,500.00	4,400,000		
オープンドア	3,300	1,784.00	5,887,200	貸付株式数	1,200株
マイネット	2,100	587.00	1,232,700		
アカツキ	2,300	6,420.00	14,766,000	貸付株式数	900株
ベネフィットジャパン	500	1,485.00	742,500	貸付株式数	100株 (100株)
UBICOMホールディングス	1,400	1,259.00	1,762,600	貸付株式数	500株
LINE	15,100	5,140.00	77,614,000	貸付株式数	7,100株 (2,100株)
カナミックネットワーク	4,000	726.00	2,904,000		
ノムラシステムコーポレーション	1,400	558.00	781,200	貸付株式数	500株
レンゴー	62,200	826.00	51,377,200		
トーモク	4,100	1,780.00	7,298,000	貸付株式数	1,400株
ザ・パック	5,000	3,910.00	19,550,000		
チェンジ	1,300	2,516.00	3,270,800	貸付株式数	500株
シンクロ・フード	2,800	531.00	1,486,800		
オークネット	4,100	1,345.00	5,514,500	貸付株式数	1,500株
セグエグループ	1,100	857.00	942,700		
エイトレッド	800	1,513.00	1,210,400	貸付株式数	200株 (200株)
AOI TYO HOLDINGS	6,700	691.00	4,629,700		
マクロミル	11,800	1,025.00	12,095,000		
ビーグリー	1,300	1,283.00	1,667,900	貸付株式数	400株
オロ	1,700	4,295.00	7,301,500	貸付株式数	600株
テモナ	800	480.00	384,000	貸付株式数	300株
ニーズウェル	800	693.00	554,400		
サインポスト	1,000	1,833.00	1,833,000	貸付株式数	300株
昭和電工	46,800	2,965.00	138,762,000	貸付株式数	16,400株
住友化学	482,900	503.00	242,898,700		
住友精化	2,900	3,490.00	10,121,000		
日産化学	36,800	4,440.00	163,392,000		
ラサ工業	2,300	1,524.00	3,505,200	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,600	6,550.00	36,680,000		
多木化学	1,900	4,550.00	8,645,000	貸付株式数	700株
テイカ	4,800	1,954.00	9,379,200		
石原産業	11,800	1,184.00	13,971,200		
片倉コープアグリ	1,700	1,184.00	2,012,800		
日本曹達	9,700	2,956.00	28,673,200	貸付株式数	800株
東ソー	101,600	1,659.00	168,554,400		
トクヤマ	19,000	2,976.00	56,544,000		

セントラル硝子	13,400	2,697.00	36,139,800	
東亜合成	41,100	1,275.00	52,402,500	貸付株式数 200株
大阪ソーダ	6,600	3,050.00	20,130,000	
関東電化	15,500	1,053.00	16,321,500	
デンカ	24,000	3,295.00	79,080,000	
イビデン	41,100	2,579.00	105,996,900	
信越化学	115,000	11,905.00	1,369,075,000	
日本カーバイド	2,200	1,487.00	3,271,400	
堺化学	4,200	2,514.00	10,558,800	
第一稀元素化学工	7,100	873.00	6,198,300	
エア・ウォーター	53,800	1,752.00	94,257,600	貸付株式数 21,000株
大陽日酸	63,200	2,450.00	154,840,000	貸付株式数 1,000株
日本化学工業	2,000	3,190.00	6,380,000	貸付株式数 800株
東邦アセチレン	1,000	1,354.00	1,354,000	
日本パーカライジング	33,000	1,167.00	38,511,000	
高压ガス	10,300	803.00	8,270,900	
チタン工業	800	2,678.00	2,142,400	貸付株式数 300株
四国化成	10,100	1,294.00	13,069,400	
戸田工業	1,500	2,214.00	3,321,000	貸付株式数 500株
ステラケミファ	3,600	3,235.00	11,646,000	貸付株式数 1,400株
保土谷化学	2,400	3,900.00	9,360,000	
日本触媒	10,200	6,870.00	70,074,000	
大日精化	5,800	3,230.00	18,734,000	
カネカ	17,000	3,565.00	60,605,000	貸付株式数 6,600株
協和キリン	67,500	2,341.00	158,017,500	
三菱瓦斯化学	62,000	1,724.00	106,888,000	
三井化学	59,600	2,650.00	157,940,000	
JSR	61,200	1,930.00	118,116,000	
東京応化工業	11,300	4,075.00	46,047,500	
大阪有機化学	6,000	1,399.00	8,394,000	貸付株式数 700株
三菱ケミカルHLDGS	439,800	818.50	359,976,300	
KHネオケム	11,600	2,514.00	29,162,400	貸付株式数 4,500株
ダイセル	89,900	1,090.00	97,991,000	
住友ベークライト	10,300	4,350.00	44,805,000	貸付株式数 100株
積水化学	141,400	1,920.00	271,488,000	
日本ゼオン	59,300	1,405.00	83,316,500	
アイカ工業	19,700	3,520.00	69,344,000	
宇部興産	33,200	2,404.00	79,812,800	
積水樹脂	11,800	2,286.00	26,974,800	貸付株式数 100株
タキロンシーアイ	14,300	676.00	9,666,800	
旭有機材	3,700	1,720.00	6,364,000	
日立化成	30,400	4,015.00	122,056,000	
ニチバン	3,500	1,946.00	6,811,000	
リケンテクノス	16,400	510.00	8,364,000	
大倉工業	3,100	1,945.00	6,029,500	
積水化成成品	8,800	800.00	7,040,000	
群栄化学	1,500	2,499.00	3,748,500	
タイガースポリマー	3,400	596.00	2,026,400	
ミライアル	2,300	1,377.00	3,167,100	
ダイキアクシス	2,300	999.00	2,297,700	貸付株式数 900株

ダイキョーニシカワ	13,800	864.00	11,923,200	貸付株式数	1,600株
竹本容器	2,300	1,040.00	2,392,000	貸付株式数	900株
森六ホールディングス	3,500	2,379.00	8,326,500	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
日本化薬	40,600	1,388.00	56,352,800		
カーリットホールディングス	7,000	630.00	4,410,000	貸付株式数	600株
E P Sホールディングス	9,700	1,437.00	13,938,900		
ソルクシーズ	2,800	951.00	2,662,800	貸付株式数	1,000株
レグス	1,600	1,468.00	2,348,800	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	24,000	924.00	22,176,000		
フェイス	2,300	864.00	1,987,200		
プロトコーポレーション	5,900	1,041.00	6,141,900		
ハイマックス	800	1,902.00	1,521,600		
アミューズ	3,500	3,120.00	10,920,000		
野村総合研究所	110,200	2,309.00	254,451,800	貸付株式数	43,100株
ドリームインキュベータ	1,900	1,670.00	3,173,000		
サイバネットシステム	4,700	784.00	3,684,800		
クイック	4,000	1,683.00	6,732,000		
T A C	4,100	228.00	934,800	貸付株式数	1,200株
C Eホールディングス	3,800	468.00	1,778,400		
ケネディクス	61,000	586.00	35,746,000		
日本システム技術	1,100	1,263.00	1,389,300	貸付株式数	400株
電通	66,200	4,045.00	267,779,000	貸付株式数	20,700株
インテージホールディングス	8,200	964.00	7,904,800		
テイクアンドギヴニーズ	2,500	1,330.00	3,325,000		
東邦システムサイエンス	1,700	950.00	1,615,000	貸付株式数	200株
ぴあ	1,800	4,820.00	8,676,000	貸付株式数	400株 (400株)
イオンファンタジー	2,500	3,160.00	7,900,000	貸付株式数	200株
ソースネクスト	31,300	491.00	15,368,300	貸付株式数	9,100株
シーティーエス	7,300	753.00	5,496,900	貸付株式数	600株
ネクシーズグループ	2,200	1,882.00	4,140,400		
インフォコム	7,200	2,468.00	17,769,600		
メディカルシステムネットワ ーク	6,400	576.00	3,686,400		
日本精化	5,200	1,248.00	6,489,600	貸付株式数	1,900株
扶桑化学工業	6,600	3,075.00	20,295,000	貸付株式数	2,600株
トリケミカル	1,500	7,800.00	11,700,000	貸付株式数	500株
ラクスル	3,500	3,665.00	12,827,500	貸付株式数	1,300株
F I G	7,100	313.00	2,222,300	貸付株式数	2,700株
ADEKA	30,200	1,670.00	50,434,000		
日油	24,700	3,730.00	92,131,000		
ミヨシ油脂	2,500	1,291.00	3,227,500		
新日本理化	10,800	214.00	2,311,200	貸付株式数	1,100株
ハリマ化成グループ	5,400	1,244.00	6,717,600	貸付株式数	600株
アルテリア・ネットワークス	7,300	1,627.00	11,877,100		
ヒト・コミュニケーションズ HD	1,500	1,600.00	2,400,000		
花 王	160,900	8,708.00	1,401,117,200	貸付株式数	59,400株
第一工業製薬	2,400	3,725.00	8,940,000		

石原ケミカル	1,800	1,885.00	3,393,000	
日華化学	2,200	889.00	1,955,800	貸付株式数 800株
ニイタカ	1,000	1,705.00	1,705,000	貸付株式数 200株
三洋化成	3,900	5,490.00	21,411,000	
武田薬品	559,300	4,491.00	2,511,816,300	
アステラス製薬	591,200	1,898.00	1,122,097,600	
大日本住友製薬	49,800	2,123.00	105,725,400	
塩野義製薬	85,900	6,517.00	559,810,300	
田辺三菱製薬	80,900	2,003.00	162,042,700	
わかもと製薬	8,200	274.00	2,246,800	貸付株式数 900株
あすか製薬	7,600	1,322.00	10,047,200	
日本新薬	17,600	9,960.00	175,296,000	貸付株式数 6,800株
ビオフェルミン製薬	1,200	2,331.00	2,797,200	
中外製薬	70,000	9,813.00	686,910,000	
科研製薬	11,500	5,970.00	68,655,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
エーザイ	80,500	8,072.00	649,796,000	
理研ビタミン	3,200	4,065.00	13,008,000	
ロート製薬	34,500	3,505.00	120,922,500	
小野薬品	157,400	2,457.50	386,810,500	
久光製薬	19,800	5,410.00	107,118,000	
有機合成薬品	5,000	307.00	1,535,000	貸付株式数 1,900株
持田製薬	9,300	4,475.00	41,617,500	貸付株式数 3,600株
参天製薬	125,100	2,064.00	258,206,400	
扶桑薬品	2,400	2,103.00	5,047,200	
日本ケミファ	900	2,972.00	2,674,800	
ツムラ	20,800	3,195.00	66,456,000	
日医工	19,000	1,350.00	25,650,000	
テルモ	190,200	3,910.00	743,682,000	貸付株式数 68,400株
みらかホールディングス	17,900	2,751.00	49,242,900	
キッセイ薬品工業	11,800	3,050.00	35,990,000	
生化学工業	13,000	1,271.00	16,523,000	貸付株式数 2,000株
栄研化学	11,800	1,988.00	23,458,400	貸付株式数 2,700株
日水製薬	2,900	1,308.00	3,793,200	
鳥居薬品	4,200	2,851.00	11,974,200	
JCRファーマ	4,700	9,350.00	43,945,000	
東和薬品	8,600	2,839.00	24,415,400	貸付株式数 3,300株
富士製薬工業	4,500	1,410.00	6,345,000	
沢井製薬	13,800	6,530.00	90,114,000	
ゼリア新薬工業	12,100	2,178.00	26,353,800	貸付株式数 2,600株
第一三共	192,400	7,012.00	1,349,108,800	
キョーリン製薬HD	14,700	1,879.00	27,621,300	
大幸薬品	2,700	3,370.00	9,099,000	
ダイト	3,900	3,175.00	12,382,500	
大塚ホールディングス	128,000	4,839.00	619,392,000	
大正製薬HD	14,200	8,180.00	116,156,000	
ペプチドリーム	34,000	5,110.00	173,740,000	貸付株式数 13,200株
大日本塗料	7,400	1,166.00	8,628,400	
日本ペイントHOLD	54,300	5,880.00	319,284,000	貸付株式数 20,000株
関西ペイント	73,900	2,797.00	206,698,300	貸付株式数 9,800株

神東塗料	5,000	205.00	1,025,000	貸付株式数	1,100株
中国塗料	18,600	1,034.00	19,232,400		
日本特殊塗料	4,900	1,376.00	6,742,400		
藤倉化成	8,800	572.00	5,033,600		
太陽ホールディングス	4,800	4,175.00	20,040,000		
D I C	27,700	2,998.00	83,044,600		
サカタインクス	14,300	1,197.00	17,117,100		
東洋インキSCホールディング	13,800	2,681.00	36,997,800	貸付株式数	100株
T&K TOKA	5,000	1,002.00	5,010,000		
アルプス技研	5,700	1,825.00	10,402,500		
サニックス	11,300	379.00	4,282,700	貸付株式数	4,400株 (4,200株)
ダイオーズ	1,200	1,352.00	1,622,400	貸付株式数	300株
日本空調サービス	6,700	783.00	5,246,100		
オリエンタルランド	68,300	15,180.00	1,036,794,000		
フォーカスシステムズ	4,000	902.00	3,608,000	貸付株式数	100株
ダスキン	16,500	3,050.00	50,325,000		
パーク24	35,600	2,575.00	91,670,000	貸付株式数	13,900株
明光ネットワークジャパン	7,500	1,031.00	7,732,500	貸付株式数	2,800株
ファルコホールディングス	3,500	1,763.00	6,170,500	貸付株式数	100株
クレスコ	2,000	3,580.00	7,160,000		
フジ・メディア・HD	63,600	1,497.00	95,209,200		
秀英予備校	1,400	468.00	655,200	貸付株式数	600株
田谷	1,200	609.00	730,800		
ラウンドワン	17,900	1,107.00	19,815,300		
リゾートトラスト	29,400	1,846.00	54,272,400		
オービック	22,900	14,610.00	334,569,000		
ジャストシステム	10,700	5,660.00	60,562,000		
TDCソフト	5,800	899.00	5,214,200		
Zホールディングス	905,700	383.00	346,883,100	貸付株式数	1,500株
ビー・エム・エル	8,300	3,205.00	26,601,500		
ワタベウェディング	1,000	591.00	591,000		
トレンドマイクロ	29,300	6,000.00	175,800,000		
りらいあコミュニケーション	11,600	1,417.00	16,437,200		
IDホールディングス	2,500	1,440.00	3,600,000		
リソー教育	29,300	413.00	12,100,900		
日本オラクル	13,400	10,030.00	134,402,000		
早稲田アカデミー	2,100	966.00	2,028,600		
アルファシステムズ	2,100	2,804.00	5,888,400	貸付株式数	800株
フューチャー	8,000	1,845.00	14,760,000		
CAC HOLDINGS	4,300	1,572.00	6,759,600		
SBテクノロジー	2,400	1,991.00	4,778,400	貸付株式数	400株
トーセ	1,800	936.00	1,684,800	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	71,900	2,131.00	153,218,900	貸付株式数	1,000株
オービックビジネスC	6,700	4,890.00	32,763,000	貸付株式数	1,100株
伊藤忠テクノソリューション	30,000	2,951.00	88,530,000		
アイティフォー	8,000	879.00	7,032,000		
東京個別指導学院	2,300	724.00	1,665,200		
東計電算	1,000	3,640.00	3,640,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	36,900	3,830.00	141,327,000	貸付株式数	14,400株

楽天	299,400	942.00	282,034,800	貸付株式数	96,000株
エックスネット	1,000	964.00	964,000		
クリーク・アンド・リバー社	3,300	1,125.00	3,712,500		
テー・オー・ダブリュー	5,600	840.00	4,704,000		
大塚商会	35,700	4,420.00	157,794,000		
サイボウズ	7,700	1,198.00	9,224,600		
ソフトブレーン	3,800	567.00	2,154,600	貸付株式数	1,500株
山田コンサルティングGP	3,100	1,826.00	5,660,600	貸付株式数	1,200株 (1,100株)
セントラルスポーツ	2,400	3,270.00	7,848,000	貸付株式数	200株
パラカ	1,700	2,033.00	3,456,100		
電通国際情報S	4,100	4,205.00	17,240,500		
デジタルガレージ	11,900	4,135.00	49,206,500	貸付株式数	3,700株
イーエムシステムズ	4,600	2,058.00	9,466,800	貸付株式数	1,800株
ウェザーニューズ	2,200	3,440.00	7,568,000	貸付株式数	800株 (700株)
C I J	4,900	1,005.00	4,924,500	貸付株式数	1,900株
ビジネスエンジニアリング	700	3,035.00	2,124,500	貸付株式数	100株
日本エンタープライズ	6,600	232.00	1,531,200	貸付株式数	2,400株
WOWOW	3,200	2,701.00	8,643,200		
スカラ	4,600	787.00	3,620,200		
インテリジェント ウェイブ	2,400	746.00	1,790,400	貸付株式数	900株
フルキャストホールディングス	6,400	2,485.00	15,904,000		
エン・ジャパン	11,400	5,120.00	58,368,000		
富士フイルムHLDGS	128,900	5,182.00	667,959,800		
コニカミノルタ	146,900	726.00	106,649,400		
資生堂	133,600	8,019.00	1,071,338,400		
ライオン	87,400	2,204.00	192,629,600		
高砂香料	4,200	2,582.00	10,844,400		
マンダム	15,100	3,035.00	45,828,500	貸付株式数	5,900株 (2,900株)
ミルボン	9,000	6,310.00	56,790,000	貸付株式数	100株
ファンケル	27,200	2,934.00	79,804,800	貸付株式数	2,200株
コーセー	12,600	17,630.00	222,138,000	貸付株式数	4,900株
コタ	3,500	1,387.00	4,854,500	貸付株式数	1,300株
シーボン	900	2,519.00	2,267,100		
ポーラ・オルビスHD	28,700	2,722.00	78,121,400		
ノエビアホールディングス	6,400	6,280.00	40,192,000		
アジュバンコスメジャパン	1,500	952.00	1,428,000	貸付株式数	400株
エステー	4,300	1,736.00	7,464,800		
アグロカネショウ	2,100	1,435.00	3,013,500	貸付株式数	800株
コニシ	10,900	1,487.00	16,208,300		
長谷川香料	8,800	1,982.00	17,441,600		
星光PMC	3,800	1,072.00	4,073,600	貸付株式数	1,400株
小林製菓	18,800	9,040.00	169,952,000	貸付株式数	700株
荒川化学工業	6,000	1,581.00	9,486,000		
メック	4,600	1,625.00	7,475,000	貸付株式数	1,800株 (1,500株)
日本高純度化学	1,800	2,585.00	4,653,000	貸付株式数	300株

タカラバイオ	17,600	2,154.00	37,910,400		
JCU	8,100	2,952.00	23,911,200	貸付株式数	500株
新田ゼラチン	4,200	704.00	2,956,800	貸付株式数	300株
OATアグリオ	1,100	1,579.00	1,736,900	貸付株式数	400株
デクセリアルズ	17,200	1,095.00	18,834,000		
アース製薬	5,100	5,700.00	29,070,000	貸付株式数	1,900株
北興化学	6,800	588.00	3,998,400		
大成ラミック	2,200	2,850.00	6,270,000		
クミアイ化学	27,700	1,027.00	28,447,900	貸付株式数	1,300株
日本農薬	11,900	588.00	6,997,200	貸付株式数	4,600株
富士興産	2,000	743.00	1,486,000	貸付株式数	400株 (300株)
ニチレキ	7,900	1,300.00	10,270,000		
ユシロ化学	3,700	1,375.00	5,087,500		
ビーピー・カストロール	2,400	1,549.00	3,717,600		
富士石油	17,900	238.00	4,260,200	貸付株式数	7,000株
MORESCO	2,400	1,371.00	3,290,400		
出光興産	75,600	2,966.00	224,229,600		
JXTGホールディングス	1,042,600	487.60	508,371,760		
コスモエネルギーHLDGS	19,500	2,394.00	46,683,000	貸付株式数	2,700株
横浜ゴム	39,000	2,303.00	89,817,000		
TOYO TIRE	38,600	1,580.00	60,988,000	貸付株式数	12,400株
ブリヂストン	206,600	4,421.00	913,378,600		
住友ゴム	60,400	1,412.00	85,284,800		
藤倉コンポジット	5,800	473.00	2,743,400		
オカモト	4,100	4,180.00	17,138,000		
アキレス	4,600	1,826.00	8,399,600		
フコク	3,000	714.00	2,142,000		
ニッタ	7,600	3,195.00	24,282,000		
クリエートメディック	2,200	1,066.00	2,345,200		
住友理工	13,000	1,023.00	13,299,000		
三ツ星ベルト	8,800	2,111.00	18,576,800		
バンドー化学	11,800	926.00	10,926,800		
AGC	66,400	4,075.00	270,580,000		
日本板硝子	32,200	649.00	20,897,800	貸付株式数	9,300株
石塚硝子	1,300	2,287.00	2,973,100		
有沢製作所	10,500	998.00	10,479,000	貸付株式数	4,000株
日本山村硝子	2,800	1,283.00	3,592,400		
日本電気硝子	27,000	2,380.00	64,260,000		
オハラ	2,700	1,461.00	3,944,700	貸付株式数	200株
住友大阪セメント	12,700	4,690.00	59,563,000		
太平洋セメント	42,500	3,240.00	137,700,000		
リソルホールディングス	700	4,125.00	2,887,500	貸付株式数	200株
日本ヒューム	6,800	821.00	5,582,800	貸付株式数	200株
日本コンクリート	14,300	272.00	3,889,600	貸付株式数	3,900株
三谷セキサン	3,100	3,590.00	11,129,000		
アジアパイルHD	9,500	550.00	5,225,000	貸付株式数	2,900株
東海カーボン	70,400	1,089.00	76,665,600	貸付株式数	27,500株 (100株)
日本カーボン	3,500	4,285.00	14,997,500	貸付株式数	1,300株

東洋炭素	3,900	2,427.00	9,465,300	貸付株式数	1,400株
ノリタケ	3,700	4,760.00	17,612,000		
TOTO	48,000	4,785.00	229,680,000		
日本碍子	81,900	1,857.00	152,088,300	貸付株式数	100株
日本特殊陶業	52,300	2,228.00	116,524,400	貸付株式数	10,100株
ダントーホールディングス	5,400	115.00	621,000		
MARUWA	2,600	7,550.00	19,630,000		
品川リフクトリーズ	1,800	3,220.00	5,796,000	貸付株式数	600株
黒崎播磨	1,300	5,820.00	7,566,000		
ヨータイ	5,300	694.00	3,678,200		
イソライト	3,400	694.00	2,359,600		
東京窯業	8,500	341.00	2,898,500	貸付株式数	3,300株
ニッカトー	3,000	762.00	2,286,000		
フジミインコーポレーテッド	6,000	2,889.00	17,334,000		
クニミネ工業	2,800	1,195.00	3,346,000		
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,272.00	1,399,200		
ニチアス	18,400	2,611.00	48,042,400		
日本製鉄	297,500	1,628.50	484,478,750		
神戸製鋼所	121,800	569.00	69,304,200	貸付株式数	47,500株
中山製鋼所	9,200	497.00	4,572,400		
合同製鐵	3,600	2,634.00	9,482,400		
JFEホールディングス	179,600	1,412.00	253,595,200		
東京製鐵	32,300	836.00	27,002,800		
共英製鋼	7,500	2,100.00	15,750,000		
大和工業	14,100	2,755.00	38,845,500		
東京鐵鋼	2,700	1,532.00	4,136,400	貸付株式数	600株
大阪製鐵	3,500	1,449.00	5,071,500		
淀川製鋼所	9,000	2,129.00	19,161,000		
丸一鋼管	21,600	3,180.00	68,688,000		
モリ工業	2,000	2,504.00	5,008,000		
大同特殊鋼	10,900	4,965.00	54,118,500	貸付株式数	4,200株
日本高周波	2,400	432.00	1,036,800		
日本冶金工	5,500	2,330.00	12,815,000		
山陽特殊製鋼	4,800	1,497.00	7,185,600		
愛知製鋼	3,700	3,640.00	13,468,000		
日立金属	71,600	1,537.00	110,049,200		
日本金属	1,600	968.00	1,548,800		
大平洋金属	4,500	2,418.00	10,881,000	貸付株式数	1,700株
新日本電工	42,400	181.00	7,674,400	貸付株式数	16,700株
栗本鉄工所	3,300	1,981.00	6,537,300		
虹 技	1,000	1,450.00	1,450,000	貸付株式数	300株
日本鑄鉄管	700	1,376.00	963,200	貸付株式数	200株
日本製鋼所	20,200	2,265.00	45,753,000		
三菱製鋼	4,900	1,140.00	5,586,000		
日亜鋼業	9,600	342.00	3,283,200		
日本精線	1,100	2,995.00	3,294,500		
エンビプロHD	2,500	762.00	1,905,000	貸付株式数	500株
大紀アルミニウム	10,800	783.00	8,456,400		
日本軽金属HD	168,200	227.00	38,181,400		
三井金属	17,900	2,761.00	49,421,900		

東邦亜鉛	3,400	2,135.00	7,259,000	
三菱マテリアル	43,900	2,952.00	129,592,800	
住友鉱山	84,900	3,301.00	280,254,900	
DOWAホールディングス	16,800	3,950.00	66,360,000	
古河機金	11,800	1,516.00	17,888,800	
エス・サイエンス	29,700	51.00	1,514,700	
大阪チタニウム	6,900	1,573.00	10,853,700	
東邦チタニウム	11,900	970.00	11,543,000	貸付株式数 4,600株
UACJ	10,100	2,487.00	25,118,700	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
CKサンエツ	1,400	3,005.00	4,207,000	
古河電工	20,700	3,030.00	62,721,000	
住友電工	248,400	1,674.50	415,945,800	
フジクラ	80,300	459.00	36,857,700	
昭和電線HLDGS	7,700	1,015.00	7,815,500	
東京特殊電線	1,000	2,237.00	2,237,000	
タツタ電線	13,200	587.00	7,748,400	
カナレ電気	1,100	1,879.00	2,066,900	貸付株式数 400株
平河ヒューテック	2,500	1,354.00	3,385,000	
リョービ	8,200	2,103.00	17,244,600	
アーレステイ	8,700	534.00	4,645,800	
アサヒHD	11,700	2,607.00	30,501,900	
東洋製罐グループHD	42,300	1,942.00	82,146,600	
ホッカンホールディングス	3,600	1,960.00	7,056,000	
コロナ	3,700	1,190.00	4,403,000	
横河ブリッジHLDGS	12,400	1,891.00	23,448,400	
OSJB HD	33,300	271.00	9,024,300	
駒井ハルテック	1,200	1,695.00	2,034,000	
高田機工	600	2,587.00	1,552,200	貸付株式数 200株
三和ホールディングス	63,700	1,220.00	77,714,000	
文化シヤッター	19,600	971.00	19,031,600	貸付株式数 7,600株
三協立山	9,200	1,248.00	11,481,600	
アルインコ	4,800	1,197.00	5,745,600	
東洋シヤッター	1,600	756.00	1,209,600	
LIXILグループ	98,100	1,885.00	184,918,500	
日本ファイルコン	5,000	530.00	2,650,000	貸付株式数 1,900株
ノーリツ	13,800	1,408.00	19,430,400	
長府製作所	6,800	2,461.00	16,734,800	
リンナイ	12,900	8,430.00	108,747,000	
ユニプレス	13,000	1,688.00	21,944,000	
ダイニチ工業	3,500	687.00	2,404,500	
日東精工	9,100	654.00	5,951,400	貸付株式数 1,600株
三洋工業	900	2,039.00	1,835,100	
岡 部	13,500	926.00	12,501,000	貸付株式数 200株
ジーテクト	8,300	1,736.00	14,408,800	
東 プ レ	12,400	1,729.00	21,439,600	
高周波熱錬	12,700	887.00	11,264,900	貸付株式数 1,000株
東京製綱	4,800	1,156.00	5,548,800	
サンコール	3,700	489.00	1,809,300	
モリテックスチル	5,200	429.00	2,230,800	

パイオラックス	9,800	2,216.00	21,716,800	貸付株式数	500株
エイチワン	6,500	845.00	5,492,500	貸付株式数	600株
日本発条	71,300	982.00	70,016,600	貸付株式数	21,500株
中央発條	800	2,916.00	2,332,800		
アドバネクス	900	1,652.00	1,486,800		
三浦工業	28,700	3,695.00	106,046,500		
タクマ	22,500	1,278.00	28,755,000		
テクノプロ・ホールディング	12,900	7,480.00	96,492,000		
アトラ	1,500	392.00	588,000	貸付株式数	500株
インターワークス	1,300	522.00	678,600		
アイ・アールジャパンHD	2,600	4,210.00	10,946,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
Keepertech 技研	2,300	1,369.00	3,148,700		
ファーストロジック	1,500	636.00	954,000	貸付株式数	400株
三機サービス	1,400	1,025.00	1,435,000	貸付株式数	100株
Gunosy	4,500	1,658.00	7,461,000	貸付株式数	1,700株
デザインワン・ジャパン	1,200	342.00	410,400	貸付株式数	400株
イー・ガーディアン	3,200	2,244.00	7,180,800	貸付株式数	1,200株
リブセンス	4,100	310.00	1,271,000	貸付株式数	1,600株 (300株)
ジャパンマテリアル	19,800	1,510.00	29,898,000	貸付株式数	2,600株
ベクトル	8,000	1,139.00	9,112,000	貸付株式数	3,100株
ウチヤマホールディングス	3,200	554.00	1,772,800		
チャームケアコーポレーション	2,100	1,953.00	4,101,300	貸付株式数	800株 (100株)
ライクキッズ	1,500	884.00	1,326,000	貸付株式数	500株
キャリアリンク	2,100	559.00	1,173,900	貸付株式数	800株
IBJ	4,300	1,076.00	4,626,800		
アサンテ	2,600	2,027.00	5,270,200	貸付株式数	900株
N・フィールド	4,400	703.00	3,093,200	貸付株式数	1,700株
バリューHR	1,300	3,505.00	4,556,500	貸付株式数	400株
M&Aキャピタルパートナー	4,600	4,300.00	19,780,000		
ライドオンエクスプレスHD	2,400	1,942.00	4,660,800		
ERIホールディングス	1,800	800.00	1,440,000		
アビスト	1,000	2,688.00	2,688,000	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス	4,400	2,251.00	9,904,400	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ウィルグループ	4,200	1,157.00	4,859,400	貸付株式数	1,500株
エスクローAJ	8,700	239.00	2,079,300	貸付株式数	3,400株
リクルートホールディングス	460,100	3,978.00	1,830,277,800		
エラン	3,800	1,710.00	6,498,000	貸付株式数	1,400株
ツガミ	13,700	1,131.00	15,494,700	貸付株式数	5,300株
オークマ	7,700	6,150.00	47,355,000		
東芝機械	7,500	2,801.00	21,007,500		
アマダホールディングス	84,300	1,247.00	105,122,100		
アイダエンジニア	17,900	1,002.00	17,935,800		
滝澤鉄工所	2,000	1,397.00	2,794,000		
FUJI	28,500	1,947.00	55,489,500	貸付株式数	11,000株
牧野フライス	7,800	5,410.00	42,198,000		

オーエスジー	30,700	2,257.00	69,289,900	貸付株式数	12,000株
ダイジェット	700	1,471.00	1,029,700		
旭ダイヤモンド	17,300	656.00	11,348,800		
DMG森精機	42,100	1,753.00	73,801,300	貸付株式数	16,400株
ソディック	15,600	1,022.00	15,943,200	貸付株式数	300株
ディスコ	9,000	23,550.00	211,950,000		
日東工器	3,600	2,227.00	8,017,200		
日進工具	1,900	2,325.00	4,417,500		
パンチ工業	5,900	574.00	3,386,600		
富士ダイス	2,900	662.00	1,919,800		
土木管理総合試験	2,800	447.00	1,251,600	貸付株式数	1,000株
ネットマーケティング	2,300	1,068.00	2,456,400		
日本郵政	526,400	1,036.50	545,613,600		
ベルシステム24HLDGS	10,800	1,719.00	18,565,200	貸付株式数	1,000株
鎌倉新書	4,800	1,928.00	9,254,400	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
SMN	1,000	911.00	911,000		
一蔵	700	750.00	525,000		
LITALICO	2,200	2,682.00	5,900,400	貸付株式数	500株
グローバルキッズCOMP	900	755.00	679,500	貸付株式数	300株
エボラブルアジア	2,900	2,203.00	6,388,700		
アトラエ	1,700	3,835.00	6,519,500	貸付株式数	600株
ストライク	2,400	4,380.00	10,512,000		
ソラスト	17,700	1,307.00	23,133,900	貸付株式数	6,900株
セラク	2,000	796.00	1,592,000	貸付株式数	700株
インソース	3,100	3,435.00	10,648,500	貸付株式数	1,000株
豊田自動織機	54,400	6,470.00	351,968,000		
豊和工業	3,600	748.00	2,692,800	貸付株式数	300株
OKK	2,800	678.00	1,898,400	貸付株式数	500株
石川製作所	1,600	1,347.00	2,155,200	貸付株式数	600株
東洋機械金属	4,700	573.00	2,693,100		
津田駒工業	1,300	1,295.00	1,683,500		
エンシュウ	1,600	1,366.00	2,185,600	貸付株式数	300株
島精機製作所	10,700	2,779.00	29,735,300	貸付株式数	4,100株
オプトラン	7,400	2,933.00	21,704,200	貸付株式数	2,600株
NCホールディングス	2,000	614.00	1,228,000	貸付株式数	700株
イワキポンプ	3,100	1,146.00	3,552,600		
フリュー	6,400	1,050.00	6,720,000		
ヤマシンフィルタ	14,400	876.00	12,614,400	貸付株式数	4,100株 (2,100株)
日阪製作所	8,100	1,000.00	8,100,000		
やまびこ	12,900	1,141.00	14,718,900	貸付株式数	2,700株
平田機工	3,100	7,970.00	24,707,000	貸付株式数	1,200株
ペガサスミシン製造	6,700	513.00	3,437,100		
マルマエ	2,700	1,043.00	2,816,100	貸付株式数	1,000株
タツモ	3,100	1,198.00	3,713,800	貸付株式数	1,200株
ナブテスコ	39,200	3,410.00	133,672,000		
三井海洋開発	7,100	2,497.00	17,728,700		
レオン自動機	6,500	1,657.00	10,770,500	貸付株式数	100株
SMC	21,100	49,930.00	1,053,523,000		

ヤマハモーターロボHLDG S	5,800	564.00	3,271,200	貸付株式数	1,800株
ホソカワミクロン	2,300	4,515.00	10,384,500		
ユニオンツール	2,500	3,290.00	8,225,000		
オイレス工業	8,600	1,692.00	14,551,200		
日精エーエスピー	2,200	4,895.00	10,769,000	貸付株式数	800株
サトーホールディングス	9,500	3,370.00	32,015,000		
技研製作所	5,800	4,440.00	25,752,000		
日本エアテック	2,100	707.00	1,484,700		
カワタ	1,900	1,144.00	2,173,600	貸付株式数	700株
日精樹脂工業	5,500	1,026.00	5,643,000		
オカダアイヨン	2,100	1,239.00	2,601,900	貸付株式数	200株
ワイエイシイホールディング ス	2,900	715.00	2,073,500	貸付株式数	1,100株
小松製作所	304,400	2,587.00	787,482,800	貸付株式数	117,000株
住友重機械	38,400	3,165.00	121,536,000		
日立建機	26,900	2,951.00	79,381,900	貸付株式数	7,600株
日工	9,100	751.00	6,834,100		
巴工業	2,800	2,282.00	6,389,600		
井関農機	6,700	1,657.00	11,101,900	貸付株式数	2,400株
TOWA	6,800	1,150.00	7,820,000	貸付株式数	2,100株
丸山製作所	1,500	1,238.00	1,857,000		
北川鉄工所	3,000	2,268.00	6,804,000	貸付株式数	100株
シンニッタン	10,300	446.00	4,593,800		
ローツェ	2,900	3,925.00	11,382,500	貸付株式数	1,100株
タカキタ	2,300	556.00	1,278,800	貸付株式数	800株
クボタ	356,600	1,725.50	615,313,300		
荏原実業	1,700	2,266.00	3,852,200		
東洋エンジニア	8,900	722.00	6,425,800	貸付株式数	900株 (700株)
三菱化工機	2,300	1,906.00	4,383,800	貸付株式数	100株
月島機械	12,400	1,706.00	21,154,400		
帝国電機製作所	5,500	1,322.00	7,271,000		
東京機械	2,700	371.00	1,001,700	貸付株式数	400株
新東工業	15,800	1,038.00	16,400,400	貸付株式数	700株
渋谷工業	5,900	3,160.00	18,644,000	貸付株式数	2,200株
アイチコーポレーション	11,500	723.00	8,314,500	貸付株式数	4,400株
小森コーポレーション	16,900	1,161.00	19,620,900	貸付株式数	6,200株
鶴見製作所	5,200	2,056.00	10,691,200		
住友精密	1,000	3,450.00	3,450,000		
日本ギア工業	2,000	414.00	828,000	貸付株式数	700株
酒井重工業	1,300	3,065.00	3,984,500		
荏原製作所	29,600	3,345.00	99,012,000		
石井鉄工所	900	2,539.00	2,285,100		
西島製作所	6,700	962.00	6,445,400	貸付株式数	900株
北越工業	6,900	1,278.00	8,818,200	貸付株式数	400株
ダイキン工業	85,600	15,770.00	1,349,912,000		
オルガノ	2,400	6,540.00	15,696,000	貸付株式数	700株
トーヨーカネツ	2,900	2,284.00	6,623,600		
栗田工業	36,300	3,135.00	113,800,500		

椿本チエイン	9,600	3,820.00	36,672,000		
大同工業	3,200	837.00	2,678,400		
日機装	20,100	1,348.00	27,094,800		
木村化工機	5,500	623.00	3,426,500	貸付株式数	2,100株
レイズネクスト	11,300	1,242.00	14,034,600		
アネスト岩田	10,400	1,016.00	10,566,400	貸付株式数	4,000株
ダイフク	34,300	6,590.00	226,037,000	貸付株式数	13,400株
サムコ	1,800	1,216.00	2,188,800		
加藤製作所	3,700	1,841.00	6,811,700		
油研工業	1,100	1,700.00	1,870,000		
タダノ	32,400	1,091.00	35,348,400	貸付株式数	12,600株
フジテック	24,400	1,745.00	42,578,000		
CKD	18,700	1,855.00	34,688,500	貸付株式数	2,700株
キトー	5,100	1,651.00	8,420,100		
平和	18,800	2,269.00	42,657,200		
理想科学工業	5,900	1,893.00	11,168,700		
SANKYO	15,000	3,720.00	55,800,000		
日本金銭機械	7,400	929.00	6,874,600	貸付株式数	600株
マースグループHLDGS	4,300	2,036.00	8,754,800	貸付株式数	200株
福島工業	4,200	3,500.00	14,700,000		
オーイズミ	2,800	575.00	1,610,000	貸付株式数	500株
ダイコク電機	3,100	1,682.00	5,214,200		
竹内製作所	11,200	1,692.00	18,950,400		
アマノ	17,600	3,285.00	57,816,000		
JUKI	9,300	914.00	8,500,200	貸付株式数	2,700株
サンデンホールディングス	8,800	766.00	6,740,800	貸付株式数	2,900株 (2,900株)
蛇の目ミシン	6,300	409.00	2,576,700		
ブラザー工業	82,100	2,201.00	180,702,100	貸付株式数	32,100株
マックス	10,200	2,106.00	21,481,200		
モリタホールディングス	11,700	1,756.00	20,545,200		
グローリー	18,600	3,330.00	61,938,000		
新晃工業	6,300	1,891.00	11,913,300		
大和冷機工業	9,700	1,292.00	12,532,400		
セガサミーホールディングス	66,700	1,585.00	105,719,500		
日本ピストンリング	2,500	1,441.00	3,602,500		
リケン	3,100	4,295.00	13,314,500	貸付株式数	300株
TPR	9,100	2,091.00	19,028,100	貸付株式数	2,700株
ツバキ・ナカシマ	13,700	1,716.00	23,509,200		
ホシザキ	19,700	9,610.00	189,317,000		
大豊工業	5,500	874.00	4,807,000	貸付株式数	800株
日本精工	126,600	1,077.00	136,348,200		
N T N	155,700	346.00	53,872,200		
ジェイテクト	64,400	1,384.00	89,129,600		
不二越	6,200	5,140.00	31,868,000	貸付株式数	2,400株
ミネベアミツミ	124,700	2,159.00	269,227,300		
日本トムソン	19,800	499.00	9,880,200		
T H K	39,100	3,120.00	121,992,000		
ユーシン精機	5,200	1,059.00	5,506,800		
前澤給装工業	2,400	2,147.00	5,152,800		

イーグル工業	8,400	1,086.00	9,122,400	貸付株式数	2,000株
前澤工業	4,400	391.00	1,720,400	貸付株式数	600株
日本ピラー工業	6,800	1,512.00	10,281,600		
キッツ	27,200	762.00	20,726,400	貸付株式数	400株
日立	323,000	4,309.00	1,391,807,000		
三菱電機	672,200	1,534.50	1,031,490,900		
富士電機	40,500	3,425.00	138,712,500		
東洋電機製造	2,600	1,565.00	4,069,000	貸付株式数	500株
安川電機	72,300	4,065.00	293,899,500	貸付株式数	29,900株
シンフォニアテクノロジー	8,700	1,377.00	11,979,900		
明電舎	12,400	2,148.00	26,635,200		
オリジン	1,800	1,517.00	2,730,600	貸付株式数	200株
山洋電気	3,200	5,460.00	17,472,000		
デンヨー	5,700	2,090.00	11,913,000		
ペイカレントコンサルティング	3,900	5,960.00	23,244,000	貸付株式数	1,200株
ORCHESTRA HLDGS	1,300	1,118.00	1,453,400	貸付株式数	400株
アイモバイル	2,000	713.00	1,426,000	貸付株式数	700株
キャリアインデックス	2,600	434.00	1,128,400	貸付株式数	1,000株
MS-Japan	2,100	1,512.00	3,175,200	貸付株式数	100株
船場	1,000	1,146.00	1,146,000		
グレイステクノロジー	2,900	2,961.00	8,586,900	貸付株式数	1,100株
ジャパンエレベーターSHD	6,800	2,933.00	19,944,400		
フルテック	900	1,395.00	1,255,500	貸付株式数	300株 (300株)
グリーンズ	2,400	1,222.00	2,932,800	貸付株式数	900株
ツナググループHLDGS	800	618.00	494,400		
ソウルドアウト	1,000	1,775.00	1,775,000		
MS&CONSULTING	900	1,067.00	960,300		
日総工産	4,300	1,083.00	4,656,900		
キュービーネットHLDGS	3,900	2,498.00	9,742,200	貸付株式数	1,500株
RPAホールディングス	3,600	1,253.00	4,510,800	貸付株式数	1,400株
三桜工業	8,500	1,340.00	11,390,000	貸付株式数	3,300株
マキタ	87,600	3,705.00	324,558,000		
東芝テック	8,400	4,460.00	37,464,000		
芝浦メカトロニクス	1,200	3,970.00	4,764,000	貸付株式数	400株
マブチモーター	18,500	4,225.00	78,162,500	貸付株式数	2,000株
日本電産	80,900	16,325.00	1,320,692,500	貸付株式数	31,600株
ユーエムシーエレクトロニクス	4,000	548.00	2,192,000	貸付株式数	1,500株
トレックス・セミコンダクター	3,900	1,469.00	5,729,100	貸付株式数	200株
東光高岳	3,700	1,197.00	4,428,900		
ダブル・スコープ	10,100	833.00	8,413,300	貸付株式数	3,800株 (100株)
宮越ホールディングス	2,500	1,028.00	2,570,000	貸付株式数	900株
ダイヘン	7,400	3,695.00	27,343,000		
ヤーマン	9,800	702.00	6,879,600	貸付株式数	3,800株
JVCケンウッド	54,900	275.00	15,097,500		
ミマキエンジニアリング	6,000	528.00	3,168,000		

第一精工	2,400	2,645.00	6,348,000	貸付株式数	900株 (500株)
日新電機	15,800	1,152.00	18,201,600		
大崎電気	13,300	745.00	9,908,500		
オムロン	62,500	6,540.00	408,750,000		
日東工業	9,900	2,504.00	24,789,600		
I D E C	9,700	2,365.00	22,940,500	貸付株式数	2,400株
正興電機製作所	1,600	832.00	1,331,200	貸付株式数	600株
不二電機工業	800	1,275.00	1,020,000	貸付株式数	300株 (200株)
ジーエス・ユアサ コーポ	22,400	2,304.00	51,609,600		
サクサホールディングス	1,500	1,978.00	2,967,000		
メルコホールディングス	2,300	3,100.00	7,130,000	貸付株式数	600株
テクノメディカ	1,500	2,101.00	3,151,500	貸付株式数	200株
日本電気	81,500	4,440.00	361,860,000	貸付株式数	13,200株
富士通	64,800	10,050.00	651,240,000		
沖電気	27,300	1,530.00	41,769,000		
岩崎通信機	2,900	805.00	2,334,500		
電気興業	3,200	3,115.00	9,968,000		
サンケン電気	7,300	3,170.00	23,141,000	貸付株式数	2,800株
ナカヨ	1,300	1,675.00	2,177,500		
アイホン	3,800	1,906.00	7,242,800		
ルネサスエレクトロニクス	320,700	719.00	230,583,300		
セイコーエプソン	83,400	1,662.00	138,610,800	貸付株式数	1,400株
ワコム	45,300	448.00	20,294,400		
アルバック	13,400	4,300.00	57,620,000	貸付株式数	200株
アクセル	2,800	706.00	1,976,800	貸付株式数	900株
E I Z O	5,200	4,180.00	21,736,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	71.00	4,380,700	貸付株式数	55,600株
日本信号	17,100	1,304.00	22,298,400		
京三製作所	15,800	516.00	8,152,800	貸付株式数	300株
能美防災	8,900	2,383.00	21,208,700		
ホーチキ	4,900	1,667.00	8,168,300		
星和電機	3,400	558.00	1,897,200		
エレコム	7,300	4,145.00	30,258,500		
パナソニック	768,000	1,032.00	792,576,000		
シャープ	77,800	1,656.00	128,836,800	貸付株式数	30,400株
アンリツ	43,300	2,072.00	89,717,600	貸付株式数	16,900株
富士通ゼネラル	18,300	2,107.00	38,558,100	貸付株式数	7,300株
ソニー※	424,900	6,998.00	2,973,450,200		
T D K	32,400	11,690.00	378,756,000		
帝国通信工業	3,000	1,205.00	3,615,000	貸付株式数	400株
タムラ製作所	22,300	660.00	14,718,000	貸付株式数	2,800株
アルプスアルパイン	59,500	2,487.00	147,976,500		
池上通信機	2,100	1,046.00	2,196,600	貸付株式数	900株
日本電波工業	6,000	668.00	4,008,000	貸付株式数	2,000株
鈴木	3,600	816.00	2,937,600	貸付株式数	1,400株
日本トリム	900	4,960.00	4,464,000	貸付株式数	200株 (200株)
ローランド ディー. ジー.	3,700	2,175.00	8,047,500	貸付株式数	1,400株

フオスター電機	7,000	2,023.00	14,161,000	
S M K	1,700	2,979.00	5,064,300	
ヨコオ	4,300	3,255.00	13,996,500	貸付株式数 600株
ティアック	4,900	231.00	1,131,900	貸付株式数 1,800株
ホシデン	18,300	1,318.00	24,119,400	
ヒロセ電機	10,400	13,710.00	142,584,000	
日本航空電子	15,400	2,104.00	32,401,600	
T O A	7,200	1,100.00	7,920,000	貸付株式数 300株
マクセルホールディングス	14,500	1,494.00	21,663,000	
古野電気	8,700	1,263.00	10,988,100	
ユニデンホールディングス	1,800	1,837.00	3,306,600	
スミダコーポレーション	5,100	1,325.00	6,757,500	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
アイコム	3,700	2,588.00	9,575,600	
リオン	2,800	2,964.00	8,299,200	貸付株式数 400株
本多通信工業	5,700	545.00	3,106,500	
船井電機	6,800	740.00	5,032,000	貸付株式数 2,600株 (1,800株)
横河電機	61,700	2,014.00	124,263,800	
新電元工業	2,400	3,685.00	8,844,000	
アズビル	42,400	3,185.00	135,044,000	貸付株式数 1,000株
東亜ディーケーケー	3,300	860.00	2,838,000	貸付株式数 1,200株
日本光電工業	27,800	2,969.00	82,538,200	
チノール	2,300	1,422.00	3,270,600	
共和電業	7,000	443.00	3,101,000	
日本電子材料	2,700	868.00	2,343,600	
堀場製作所	13,300	7,350.00	97,755,000	
アドバンテスト	50,000	5,320.00	266,000,000	貸付株式数 7,700株
小野測器	2,800	537.00	1,503,600	
エスペック	5,900	2,132.00	12,578,800	
キーエンス	60,900	37,970.00	2,312,373,000	
日置電機	3,500	3,740.00	13,090,000	貸付株式数 200株
シスメックス	48,000	7,761.00	372,528,000	
日本マイクロニクス	11,700	1,154.00	13,501,800	
メガチップス	6,300	2,462.00	15,510,600	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,500	3,885.00	13,597,500	
IMAGICA GROUP	5,600	644.00	3,606,400	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
澤藤電機	800	2,133.00	1,706,400	貸付株式数 300株
デンソー	148,000	4,953.00	733,044,000	
原田工業	3,200	975.00	3,120,000	
コーセル	8,100	1,251.00	10,133,100	貸付株式数 3,200株
イリソ電子工業	5,600	5,300.00	29,680,000	貸付株式数 2,200株
オブテックスグループ	11,000	1,622.00	17,842,000	貸付株式数 1,800株
千代田インテグレ	3,100	2,395.00	7,424,500	
アイ・オー・データ	2,500	1,022.00	2,555,000	
レーザーテック	13,800	9,580.00	132,204,000	貸付株式数 4,900株
スタンレー電気	47,400	3,105.00	147,177,000	
岩崎電気	2,600	1,425.00	3,705,000	貸付株式数 200株

ウシオ電機	38,900	1,643.00	63,912,700	貸付株式数	15,200株
岡谷電機	5,200	381.00	1,981,200	貸付株式数	1,300株
ヘリオステクノH	6,100	500.00	3,050,000	貸付株式数	1,300株
エノモト	2,000	1,155.00	2,310,000		
日本セラミック	6,800	2,861.00	19,454,800		
遠藤照明	3,400	704.00	2,393,600		
古河電池	4,800	783.00	3,758,400		
双信電機	3,200	512.00	1,638,400	貸付株式数	1,100株
山一電機	4,800	1,595.00	7,656,000	貸付株式数	100株
図研	4,400	2,510.00	11,044,000		
日本電子	13,300	3,090.00	41,097,000		
カシオ	59,500	2,080.00	123,760,000	貸付株式数	23,200株
ファナック	63,900	21,240.00	1,357,236,000		
日本シイエムケイ	15,700	658.00	10,330,600	貸付株式数	2,800株
エンプラス	3,400	3,650.00	12,410,000		
大真空	2,400	1,649.00	3,957,600	貸付株式数	300株
ローム	29,800	9,170.00	273,266,000		
浜松ホトニクス	48,200	4,455.00	214,731,000		
三井ハイテック	7,400	2,051.00	15,177,400	貸付株式数	300株 (200株)
新光電気工業	22,600	1,096.00	24,769,600		
京セラ	94,500	7,445.00	703,552,500		
協栄産業	800	1,540.00	1,232,000		
太陽誘電	29,900	2,975.00	88,952,500	貸付株式数	11,600株
村田製作所	197,500	6,529.00	1,289,477,500		
双葉電子工業	10,500	1,389.00	14,584,500		
日東電工	46,300	6,210.00	287,523,000		
北陸電気工業	2,700	1,124.00	3,034,800		
東海理化電機	17,700	2,163.00	38,285,100		
ニチコン	22,700	1,235.00	28,034,500		
日本ケミコン	5,100	2,081.00	10,613,100		
K O A	10,100	1,440.00	14,544,000		
三井E&SHD	21,700	922.00	20,007,400		
日立造船	53,300	435.00	23,185,500	貸付株式数	3,000株
三菱重工業	112,600	4,244.00	477,874,400		
川崎重工業	52,300	2,481.00	129,756,300		
I H I	48,400	2,584.00	125,065,600		
名村造船所	21,500	287.00	6,170,500	貸付株式数	8,400株
サノヤスホールディングス	8,000	181.00	1,448,000	貸付株式数	200株
スプリックス	2,200	1,260.00	2,772,000	貸付株式数	800株
日本車輛	2,400	3,175.00	7,620,000	貸付株式数	800株
三菱ロジスネクスト	10,500	1,226.00	12,873,000	貸付株式数	3,800株
近畿車輛	1,000	1,501.00	1,501,000	貸付株式数	200株
F P G	20,800	1,069.00	22,235,200		
島根銀行	1,300	704.00	915,200	貸付株式数	300株 (300株)
じもとホールディングス	45,000	107.00	4,815,000		
全国保証	18,700	4,410.00	82,467,000		
めぶきフィナンシャルG	344,400	284.00	97,809,600	貸付株式数	134,800株
東京きらぼしFG	9,000	1,532.00	13,788,000		

九州フィナンシャルG	108,900	493.00	53,687,700	貸付株式数	100株
かんぽ生命保険	23,500	1,876.00	44,086,000	貸付株式数	100株
ゆうちょ銀行	187,500	1,070.00	200,625,000		
富山第一銀行	15,900	346.00	5,501,400		
コンコルディア・フィナンシャル	389,900	447.00	174,285,300		
ジェイリース	1,800	324.00	583,200		
西日本フィナンシャルHD	45,300	856.00	38,776,800		
マーキュリアインベストメント	2,900	742.00	2,151,800	貸付株式数	1,100株
イントラスト	2,300	699.00	1,607,700		
日本モーゲージサービス	1,300	1,624.00	2,111,200		
C a s a	2,800	1,263.00	3,536,400		
アルヒ	10,500	2,515.00	26,407,500	貸付株式数	4,100株
プレミアグループ	3,600	2,336.00	8,409,600	貸付株式数	1,300株
日産自動車	792,800	688.30	545,684,240		
いすゞ自動車	194,800	1,290.50	251,389,400		
トヨタ自動車 ※	749,200	7,738.00	5,797,309,600		
日野自動車	84,000	1,102.00	92,568,000		
三菱自動車工業	249,200	496.00	123,603,200	貸付株式数	83,400株
エフテック	4,700	755.00	3,548,500		
レシップホールディングス	2,600	659.00	1,713,400		
GMB	1,200	795.00	954,000		
ファルテック	1,200	1,260.00	1,512,000		
武蔵精密工業	15,000	1,523.00	22,845,000	貸付株式数	200株
日産車体	13,100	1,138.00	14,907,800	貸付株式数	4,400株
新明和工業	18,000	1,460.00	26,280,000		
極東開発工業	12,500	1,631.00	20,387,500		
日信工業	13,500	2,224.00	30,024,000		
トピー工業	5,600	2,084.00	11,670,400		
ティラド	2,400	2,035.00	4,884,000		
タチエス	11,000	1,442.00	15,862,000		
N O K	36,100	1,729.00	62,416,900		
フタバ産業	18,800	826.00	15,528,800		
KYB	7,500	3,315.00	24,862,500	貸付株式数	100株
市光工業	10,000	868.00	8,680,000		
大同メタル工業	13,000	728.00	9,464,000		
プレス工業	33,300	444.00	14,785,200		
ミクニ	8,600	345.00	2,967,000		
太平洋工業	14,100	1,513.00	21,333,300		
ケーヒン	15,300	2,572.00	39,351,600		
河西工業	9,100	873.00	7,944,300		
アイシン精機	55,400	4,245.00	235,173,000		
マ ツ ダ	197,900	977.00	193,348,300		
今仙電機製作所	6,300	941.00	5,928,300	貸付株式数	500株
本田技研	529,300	3,104.00	1,642,947,200		
スズキ	133,200	4,755.00	633,366,000		
SUBARU	208,700	2,873.50	599,699,450		
安永	3,200	1,293.00	4,137,600	貸付株式数	1,200株
ヤマハ発動機	87,700	2,307.00	202,323,900		

ショーワ	15,700	2,277.00	35,748,900	
小糸製作所	40,300	5,700.00	229,710,000	
TBK	8,000	431.00	3,448,000	
エクセディ	9,200	2,508.00	23,073,600	
ミツバ	12,400	741.00	9,188,400	貸付株式数 2,300株
豊田合成	21,700	2,604.00	56,506,800	
愛三工業	10,600	866.00	9,179,600	
盟和産業	1,000	1,122.00	1,122,000	貸付株式数 300株
日本プラスト	5,200	718.00	3,733,600	貸付株式数 2,000株
ヨロズ	6,300	1,446.00	9,109,800	
エフ・シー・シー	11,000	2,412.00	26,532,000	
新家工業	1,500	1,443.00	2,164,500	
シマノ	25,200	17,920.00	451,584,000	貸付株式数 9,600株
テイ・エス テック	15,600	3,415.00	53,274,000	
関西みらいFG	38,800	732.00	28,401,600	貸付株式数 1,000株
33FG	6,200	1,708.00	10,589,600	
第四北越フィナンシャルG	11,500	3,005.00	34,557,500	貸付株式数 100株
ジャムコ	3,400	1,510.00	5,134,000	貸付株式数 400株
小野建	5,900	1,348.00	7,953,200	
はるやまHLDGS	3,100	846.00	2,622,600	
南陽	1,400	1,804.00	2,525,600	
ノジマ	11,800	2,281.00	26,915,800	貸付株式数 200株
佐鳥電機	4,800	915.00	4,392,000	貸付株式数 1,100株
カップ・クリエイト	9,300	1,465.00	13,624,500	貸付株式数 3,600株 (3,000株)
エコートレーディング	1,700	542.00	921,400	貸付株式数 500株
伯東	4,000	1,311.00	5,244,000	
コンドーテック	5,100	1,102.00	5,620,200	
中山福	3,800	540.00	2,052,000	貸付株式数 300株
ライトオン	4,900	633.00	3,101,700	貸付株式数 1,900株 (1,400株)
ナガイレーベン	9,600	2,561.00	24,585,600	貸付株式数 2,400株
ジーンズメイト	2,000	338.00	676,000	貸付株式数 700株
三菱食品	7,300	2,932.00	21,403,600	
良品計画	87,900	2,498.00	219,574,200	貸付株式数 32,900株
三城ホールディングス	6,900	287.00	1,980,300	貸付株式数 2,700株
松田産業	4,800	1,567.00	7,521,600	
第一興商	9,800	5,420.00	53,116,000	
メディパルHD	71,400	2,372.00	169,360,800	
アドヴァン	10,100	1,308.00	13,210,800	
SPK	1,400	2,850.00	3,990,000	
萩原電気HLDGS	2,400	2,830.00	6,792,000	貸付株式数 800株
アルビス	2,500	2,293.00	5,732,500	
アズワン	4,300	9,560.00	41,108,000	貸付株式数 1,600株
スズデン	2,300	1,464.00	3,367,200	貸付株式数 800株
尾家産業	1,900	1,347.00	2,559,300	貸付株式数 800株
シモジマ	4,000	1,240.00	4,960,000	
ドウシシャ	6,200	1,810.00	11,222,000	
小津産業	1,400	1,807.00	2,529,800	貸付株式数 500株
コナカ	7,700	406.00	3,126,200	貸付株式数 400株

高速	3,900	1,184.00	4,617,600		
ハウス ローゼ	800	1,671.00	1,336,800	貸付株式数	100株
G-7ホールディングス	1,900	4,500.00	8,550,000		
たけびし	2,300	1,461.00	3,360,300	貸付株式数	900株
イオン北海道	6,700	799.00	5,353,300	貸付株式数	200株
コジマ	11,400	459.00	5,232,600		
ヒマラヤ	2,300	836.00	1,922,800	貸付株式数	900株
コーナン商事	9,400	2,548.00	23,951,200	貸付株式数	3,300株
ネットワンシステムズ	25,100	3,150.00	79,065,000		
エコス	2,400	1,683.00	4,039,200		
ワタミ	7,800	1,312.00	10,233,600	貸付株式数	2,000株
マルシェ	1,700	781.00	1,327,700	貸付株式数	600株
リックス	1,500	1,632.00	2,448,000	貸付株式数	300株
システムソフト	15,400	112.00	1,724,800		
パンパシフィックHD	158,700	1,798.00	285,342,600		
丸文	6,000	604.00	3,624,000		
西松屋チェーン	14,500	1,005.00	14,572,500		
ゼンショーホールディングス	31,700	2,514.00	79,693,800		
ハピネット	5,500	1,432.00	7,876,000		
幸楽苑ホールディングス	4,200	2,117.00	8,891,400	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,400	1,044.00	1,461,600	貸付株式数	500株
橋本総業HLDGS	1,300	1,763.00	2,291,900	貸付株式数	200株
日本ライフライン	19,600	1,544.00	30,262,400	貸付株式数	6,300株
サイゼリヤ	10,900	2,631.00	28,677,900	貸付株式数	4,100株
タカショー	3,200	500.00	1,600,000		
エクセル	1,900	1,256.00	2,386,400	貸付株式数	900株
VTホールディングス	27,500	473.00	13,007,500	貸付株式数	800株
マルカ	2,300	2,298.00	5,285,400	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	5,600	3,335.00	18,676,000		
魚力	1,800	1,530.00	2,754,000		
IDOM	17,800	530.00	9,434,000	貸付株式数	6,900株 (2,100株)
日本エム・ディ・エム	3,900	2,327.00	9,075,300	貸付株式数	1,500株
ポプラ	1,900	531.00	1,008,900	貸付株式数	600株
フジ・コーポレーション	1,700	2,324.00	3,950,800		
ユナイテッドアローズ	6,900	3,340.00	23,046,000		
進和	3,900	2,352.00	9,172,800	貸付株式数	1,300株
エスケイジャパン	1,400	466.00	652,400		
ダイترون	2,800	1,697.00	4,751,600		
ハイデイ日高	9,500	2,187.00	20,776,500	貸付株式数	2,600株
シークス	8,400	1,554.00	13,053,600	貸付株式数	3,200株
京都きもの友禅	4,200	350.00	1,470,000	貸付株式数	1,500株
コロワイド	22,000	2,216.00	48,752,000	貸付株式数	7,900株
ピーシーデポコーポ	8,700	478.00	4,158,600	貸付株式数	3,400株
田中商事	2,100	713.00	1,497,300		
オーハシテクニカ	3,700	1,462.00	5,409,400		
壺番屋	4,700	5,280.00	24,816,000	貸付株式数	1,700株
白銅	2,300	1,448.00	3,330,400		
トップカルチャー	2,400	340.00	816,000	貸付株式数	800株

				(600株)
PLANT	1,700	656.00	1,115,200	貸付株式数 500株
スギホールディングス	13,200	6,170.00	81,444,000	貸付株式数 5,500株
薬王堂ホールディングス	2,900	2,532.00	7,342,800	貸付株式数 900株
島津製作所	80,300	3,315.00	266,194,500	
J M S	5,600	743.00	4,160,800	
クボテック	1,700	437.00	742,900	貸付株式数 600株 (100株)
長野計器	4,900	783.00	3,836,700	
ブイ・テクノロジー	3,100	6,010.00	18,631,000	貸付株式数 1,100株
スター精密	10,500	1,549.00	16,264,500	貸付株式数 3,900株
東京計器	4,200	1,015.00	4,263,000	
愛知時計	900	4,305.00	3,874,500	
インターアクション	3,600	2,502.00	9,007,200	貸付株式数 100株
オーバル	6,000	252.00	1,512,000	貸付株式数 2,300株
東京精密	12,200	3,935.00	48,007,000	貸付株式数 1,400株
マニー	26,800	2,935.00	78,658,000	貸付株式数 10,400株
ニコン	108,800	1,506.00	163,852,800	貸付株式数 40,700株
トプコン	33,900	1,471.00	49,866,900	
オリンパス	372,000	1,634.00	607,848,000	
理研計器	5,900	2,325.00	13,717,500	
SCREENホールディングス	11,700	7,600.00	88,920,000	貸付株式数 100株
キヤノン電子	7,000	2,075.00	14,525,000	
タムロン	5,400	2,529.00	13,656,600	
HOYA	135,300	10,025.00	1,356,382,500	
シード	2,900	1,079.00	3,129,100	貸付株式数 1,100株
ノーリツ鋼機	4,500	1,896.00	8,532,000	貸付株式数 1,700株
エー・アンド・デイ	6,100	803.00	4,898,300	
朝日インテック	57,000	3,195.00	182,115,000	貸付株式数 22,100株
キヤノン	361,800	3,046.00	1,102,042,800	貸付株式数 141,500株
リコー	171,100	1,124.00	192,316,400	
シチズン時計	78,700	610.00	48,007,000	貸付株式数 28,000株
リズム時計	2,100	939.00	1,971,900	
大研医器	4,600	630.00	2,898,000	
メニコン	9,200	4,350.00	40,020,000	
シンシア	800	608.00	486,400	貸付株式数 200株
中本パックス	1,700	1,490.00	2,533,000	貸付株式数 100株
スノーピーク	3,000	1,096.00	3,288,000	貸付株式数 1,200株
パラマウントベッドHD	7,100	4,310.00	30,601,000	
トランザクション	4,300	1,000.00	4,300,000	
SHO-BI	2,000	395.00	790,000	貸付株式数 300株
ニホンフラッシュ	3,100	2,819.00	8,738,900	貸付株式数 1,200株 (800株)
前田工織	7,400	1,950.00	14,430,000	貸付株式数 2,700株
永大産業	8,700	341.00	2,966,700	
アートネイチャー	7,200	773.00	5,565,600	
バンダイナムコHLDGS	69,500	6,688.00	464,816,000	
アイフィスジャパン	1,700	777.00	1,320,900	貸付株式数 100株
共立印刷	11,600	164.00	1,902,400	

SHOE I	3,200	5,060.00	16,192,000	貸付株式数	1,200株
フランスベッドHLDGS	9,500	1,022.00	9,709,000		
マーベラス	10,000	758.00	7,580,000	貸付株式数	3,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	11,700	4,270.00	49,959,000		
萩原工業	3,700	1,617.00	5,982,900	貸付株式数	300株 (300株)
エイベックス	11,400	1,334.00	15,207,600		
トッパン・フォームズ	14,400	1,162.00	16,732,800		
フジシールインターナショナル	15,100	2,487.00	37,553,700	貸付株式数	1,800株
タカラトミー	30,100	1,345.00	40,484,500		
廣済堂	4,700	880.00	4,136,000		
エステールホールディングス	1,900	679.00	1,290,100		
アーク	26,100	97.00	2,531,700		
レック	7,200	1,300.00	9,360,000	貸付株式数	2,600株
タカノ	2,600	823.00	2,139,800		
三光合成	7,600	432.00	3,283,200	貸付株式数	500株
プロネクサス	5,800	1,206.00	6,994,800		
ホクシン	4,200	172.00	722,400	貸付株式数	100株
ウッドワン	2,300	1,189.00	2,734,700		
大建工業	4,600	1,974.00	9,080,400		
きもと	11,500	191.00	2,196,500		
凸版印刷	94,800	2,178.00	206,474,400		
大日本印刷	87,900	2,940.00	258,426,000		
共同印刷	2,100	2,950.00	6,195,000	貸付株式数	200株
NISSHA	13,800	1,133.00	15,635,400	貸付株式数	5,300株 (2,200株)
光村印刷	600	1,769.00	1,061,400	貸付株式数	200株
藤森工業	6,000	3,530.00	21,180,000		
ヴィア・ホールディングス	8,100	667.00	5,402,700	貸付株式数	200株
TAKARA & COMPANY	3,200	1,702.00	5,446,400		
前澤化成工業	4,200	1,197.00	5,027,400		
未来工業	3,600	2,243.00	8,074,800		
アシックス	55,500	1,786.00	99,123,000	貸付株式数	22,800株
ツツミ	2,100	2,097.00	4,403,700		
ウェーブロックHLDGS	2,300	780.00	1,794,000	貸付株式数	400株
ジェイ エス ピー	4,000	1,905.00	7,620,000		
ニチハ	9,400	2,777.00	26,103,800		
エフピコ	7,400	6,650.00	49,210,000	貸付株式数	400株 (400株)
小松ウオール工業	2,000	2,408.00	4,816,000		
ヤマハ	40,000	6,130.00	245,200,000		
河合楽器	2,100	3,675.00	7,717,500		
クリナップ	6,200	705.00	4,371,000		
ピジョン	40,600	5,070.00	205,842,000	貸付株式数	15,800株
天馬	4,500	2,012.00	9,054,000		
兼松サステック	400	1,780.00	712,000	貸付株式数	100株
キングジム	5,600	892.00	4,995,200		

象印マホービン	19,700	1,798.00	35,420,600	貸付株式数	7,700株
リンテック	16,000	2,463.00	39,408,000		
信越ポリマー	12,000	968.00	11,616,000		
東リ	16,700	316.00	5,277,200		
イトーキ	14,300	517.00	7,393,100		
任天堂	41,200	43,240.00	1,781,488,000		
三菱鉛筆	11,100	1,737.00	19,280,700		
松風	3,000	1,700.00	5,100,000	貸付株式数	1,100株
タカラスタンダード	13,900	2,007.00	27,897,300	貸付株式数	4,700株
コクヨ	32,300	1,635.00	52,810,500		
ナカバヤシ	6,600	594.00	3,920,400		
ニフコ	24,600	3,050.00	75,030,000	貸付株式数	9,500株
立川ブラインド	2,900	1,437.00	4,167,300	貸付株式数	1,100株
グローブライド	3,000	2,703.00	8,109,000		
オカムラ	23,500	1,080.00	25,380,000	貸付株式数	7,300株
バルカー	5,400	2,624.00	14,169,600	貸付株式数	800株
MUTOHホールディングス	1,000	1,796.00	1,796,000		
伊藤忠	463,000	2,438.00	1,128,794,000	貸付株式数	127,400株
丸紅	689,400	825.20	568,892,880		
スクロール	10,100	350.00	3,535,000		
高島	1,100	1,721.00	1,893,100		
ヨンドシーホールディングス	6,700	2,613.00	17,507,100	貸付株式数	2,700株
三陽商会	3,500	1,407.00	4,924,500		
長瀬産業	37,100	1,628.00	60,398,800		
ナイガイ	2,500	441.00	1,102,500	貸付株式数	900株
蝶理	4,200	1,974.00	8,290,800	貸付株式数	100株
豊田通商	73,900	3,885.00	287,101,500		
オンワードホールディングス	39,700	643.00	25,527,100		
三共生興	10,000	601.00	6,010,000		
兼松	24,800	1,412.00	35,017,600		
美津濃	6,100	2,805.00	17,110,500		
ツカモトコーポレーション	1,200	1,084.00	1,300,800	貸付株式数	100株
ファミリーマート	52,900	2,601.00	137,592,900		
ルックホールディングス	2,200	1,233.00	2,712,600	貸付株式数	800株
三井物産	581,800	1,967.50	1,144,691,500		
日本紙パルプ	3,800	4,060.00	15,428,000		
東京エレクトロン	44,800	22,570.00	1,011,136,000		
日立ハイテクノロジーズ	23,000	7,170.00	164,910,000		
カメイ	8,600	1,227.00	10,552,200		
東都水産	900	2,662.00	2,395,800		
OUGホールディングス	1,000	2,719.00	2,719,000	貸付株式数	300株
スターゼン	2,500	4,405.00	11,012,500	貸付株式数	900株
セイコーHD	9,500	2,816.00	26,752,000	貸付株式数	3,800株
山善	25,900	1,045.00	27,065,500		
椿本興業	1,200	4,020.00	4,824,000		
住友商事	417,800	1,656.50	692,085,700		
日本ユニシス	20,600	3,595.00	74,057,000		
内田洋行	2,800	5,240.00	14,672,000		
三菱商事	464,500	2,907.50	1,350,533,750		
第一実業	3,200	3,715.00	11,888,000		

キヤノンマーケティング J P N	18,900	2,510.00	47,439,000	貸付株式数	5,900 株
西華産業	3,700	1,409.00	5,213,300		
佐藤商事	5,400	912.00	4,924,800		
菱洋エレクトロ	6,800	2,046.00	13,912,800	貸付株式数	2,400 株
東京産業	5,900	561.00	3,309,900	貸付株式数	1,100 株
ユアサ商事	6,300	3,500.00	22,050,000		
神鋼商事	1,700	2,654.00	4,511,800		
小林産業	3,900	313.00	1,220,700		
阪和興業	12,400	2,840.00	35,216,000		
正栄食品	4,300	3,385.00	14,555,500		
カナデン	5,400	1,325.00	7,155,000		
菱電商事	4,800	1,655.00	7,944,000		
ニプロ	46,600	1,327.00	61,838,200	貸付株式数	16,700 株
フルサト工業	3,600	1,646.00	5,925,600		
岩谷産業	14,700	3,675.00	54,022,500	貸付株式数	5,600 株
すてきナイスグループ	2,500	1,090.00	2,725,000	貸付株式数	600 株
昭光通商	2,300	717.00	1,649,100	貸付株式数	200 株
ニチモウ	1,000	1,987.00	1,987,000	貸付株式数	300 株
極東貿易	1,900	2,194.00	4,168,600		
イワキ	8,600	476.00	4,093,600	貸付株式数	1,900 株
兼松エレクトロニクス	3,600	3,425.00	12,330,000		
三愛石油	16,300	1,059.00	17,261,700		
稲畑産業	14,600	1,586.00	23,155,600		
G S I クレオス	1,600	1,118.00	1,788,800	貸付株式数	300 株
明和産業	6,100	620.00	3,782,000		
クワザワ	2,400	606.00	1,454,400		
ゴールドウイン	11,900	7,940.00	94,486,000	貸付株式数	4,600 株 (3,000 株)
ユニ・チャーム	129,600	3,634.00	470,966,400	貸付株式数	51,200 株
デサント	12,800	1,810.00	23,168,000		
キング	3,100	530.00	1,643,000		
ワキタ	14,100	1,095.00	15,439,500	貸付株式数	1,900 株
ヤマトインターナショナル	4,100	396.00	1,623,600	貸付株式数	100 株
東邦ホールディングス	21,200	2,537.00	53,784,400	貸付株式数	8,300 株
サンゲツ	18,200	2,135.00	38,857,000		
ミツウロコグループ	9,700	1,420.00	13,774,000	貸付株式数	3,800 株
シナネンホールディングス	2,700	1,932.00	5,216,400		
伊藤忠エネクス	14,700	895.00	13,156,500		
サンリオ	18,600	2,234.00	41,552,400	貸付株式数	7,200 株
サンワ テクノス	4,600	1,199.00	5,515,400	貸付株式数	100 株
リョーサン	7,300	2,947.00	21,513,100		
新光商事	10,300	900.00	9,270,000		
トーヨー	3,000	1,873.00	5,619,000	貸付株式数	1,200 株 (1,200 株)
三信電気	3,500	1,700.00	5,950,000		
東陽テクニカ	7,600	1,140.00	8,664,000		
モスフード サービス	8,700	3,070.00	26,709,000	貸付株式数	3,300 株 (100 株)
加賀電子	6,600	2,468.00	16,288,800		

三益半導体	5,900	2,012.00	11,870,800		
ソーダニツカ	6,800	611.00	4,154,800		
立花エレテック	4,800	1,758.00	8,438,400		
木曾路	8,600	2,880.00	24,768,000	貸付株式数	1,700株
SRSホールディングス	7,700	1,044.00	8,038,800	貸付株式数	3,000株
千趣会	12,000	432.00	5,184,000	貸付株式数	4,600株
タカキュー	5,000	189.00	945,000	貸付株式数	1,900株 (1,600株)
ケーヨー	13,600	539.00	7,330,400	貸付株式数	2,300株
上新電機	7,800	2,465.00	19,227,000		
日本瓦斯	10,500	3,440.00	36,120,000		
ロイヤルホールディングス	11,600	2,542.00	29,487,200	貸付株式数	4,500株
東天紅	500	1,250.00	625,000		
いなげや	8,200	1,480.00	12,136,000		
島忠	13,900	3,005.00	41,769,500	貸付株式数	4,800株
チョダ	7,000	1,617.00	11,319,000		
ライフコーポレーション	5,000	2,504.00	12,520,000		
リンガーハット	8,100	2,484.00	20,120,400	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
MrMaxHD	9,100	499.00	4,540,900		
テナアライド	6,000	441.00	2,646,000	貸付株式数	2,300株
AOKIホールディングス	13,200	1,134.00	14,968,800		
オークワ	10,400	1,443.00	15,007,200	貸付株式数	900株
コメリ	10,200	2,363.00	24,102,600		
青山商事	13,700	1,677.00	22,974,900		
しまむら	7,700	8,970.00	69,069,000		
はせがわ	3,500	402.00	1,407,000	貸付株式数	100株
高島屋	48,300	1,304.00	62,983,200		
松屋	13,400	854.00	11,443,600	貸付株式数	2,500株
エイチ・ツー・オーリテイリング	31,400	1,233.00	38,716,200		
近鉄百貨店	2,500	3,610.00	9,025,000	貸付株式数	900株
パルコ	6,400	1,364.00	8,729,600		
丸井グループ	60,700	2,651.00	160,915,700	貸付株式数	21,500株
クレディセゾン	46,400	1,810.00	83,984,000		
アクシアルリテイリング	5,500	3,870.00	21,285,000		
井筒屋	3,700	241.00	891,700		
イオン	254,800	2,265.00	577,122,000	貸付株式数	90,700株
イズミ	13,500	4,270.00	57,645,000		
フオーバル	2,900	1,059.00	3,071,100		
平和堂	13,500	2,115.00	28,552,500		
フジ	8,000	1,971.00	15,768,000		
ヤオコー	7,500	5,110.00	38,325,000	貸付株式数	400株
ゼビオホールディングス	8,000	1,328.00	10,624,000		
ケーズホールディングス	63,900	1,366.00	87,287,400		
PALTAC	10,600	5,400.00	57,240,000	貸付株式数	1,300株
三谷産業	8,700	346.00	3,010,200		
OLYMPICグループ	3,400	651.00	2,213,400		
日産東京販売HD	9,800	278.00	2,724,400		
新生銀行	48,700	1,717.00	83,617,900		

あおぞら銀行	39,600	2,818.00	111,592,800	
三菱UF JフィナンシャルG ※	4,564,700	582.10	2,657,111,870	
りそなホールディングス	728,000	466.80	339,830,400	
三井住友トラストHD	125,400	4,195.00	526,053,000	
三井住友フィナンシャルG	458,600	4,008.00	1,838,068,800	
千葉銀行	227,900	624.00	142,209,600	
群馬銀行	130,200	390.00	50,778,000	
武蔵野銀行	9,800	1,961.00	19,217,800	
千葉興業銀行	18,300	344.00	6,295,200	貸付株式数 2,500株
筑波銀行	27,600	243.00	6,706,800	
七十七銀行	22,400	1,794.00	40,185,600	
青森銀行	5,200	2,831.00	14,721,200	貸付株式数 1,500株
秋田銀行	4,300	2,259.00	9,713,700	
山形銀行	7,500	1,659.00	12,442,500	
岩手銀行	4,400	2,965.00	13,046,000	
東邦銀行	59,500	278.00	16,541,000	貸付株式数 19,800株
東北銀行	3,100	1,034.00	3,205,400	
みちのく銀行	4,300	1,567.00	6,738,100	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ふくおかフィナンシャルG	55,900	2,092.00	116,942,800	貸付株式数 5,000株
静岡銀行	164,100	839.00	137,679,900	
十六銀行	8,300	2,662.00	22,094,600	
スルガ銀行	63,000	545.00	34,335,000	貸付株式数 15,200株 (7,000株)
八十二銀行	160,100	475.00	76,047,500	貸付株式数 15,000株
山梨中央銀行	7,700	1,154.00	8,885,800	
大垣共立銀行	13,100	2,550.00	33,405,000	
福井銀行	5,700	1,734.00	9,883,800	
北國銀行	6,800	3,510.00	23,868,000	
清水銀行	2,700	2,180.00	5,886,000	
富山銀行	1,300	2,641.00	3,433,300	
滋賀銀行	13,300	2,743.00	36,481,900	貸付株式数 5,100株
南都銀行	11,000	2,763.00	30,393,000	
百五銀行	60,000	354.00	21,240,000	貸付株式数 1,500株
京都銀行	23,700	4,580.00	108,546,000	
紀陽銀行	23,500	1,724.00	40,514,000	貸付株式数 2,100株
ほくほくフィナンシャルG	44,100	1,134.00	50,009,400	
広島銀行	98,100	545.00	53,464,500	
山陰合同銀行	39,400	687.00	27,067,800	
中国銀行	57,100	1,097.00	62,638,700	貸付株式数 22,300株
鳥取銀行	2,200	1,382.00	3,040,400	
伊予銀行	94,600	608.00	57,516,800	貸付株式数 2,100株
百十四銀行	7,100	2,258.00	16,031,800	
四国銀行	10,100	1,045.00	10,554,500	貸付株式数 200株
阿波銀行	10,800	2,706.00	29,224,800	貸付株式数 3,700株
大分銀行	3,800	2,854.00	10,845,200	
宮崎銀行	4,400	2,655.00	11,682,000	
佐賀銀行	4,000	1,740.00	6,960,000	
沖縄銀行	6,100	3,675.00	22,417,500	

琉球銀行	15,300	1,258.00	19,247,400	貸付株式数	2,500株
セブン銀行	221,300	341.00	75,463,300		
みずほフィナンシャルG	9,009,900	169.70	1,528,980,030		
高知銀行	2,500	933.00	2,332,500		
山口フィナンシャルG	82,800	757.00	62,679,600	貸付株式数	30,200株
芙蓉総合リース	7,000	7,230.00	50,610,000		
みずほリース	10,300	3,280.00	33,784,000		
東京センチュリー	13,300	5,990.00	79,667,000	貸付株式数	5,000株
SBIホールディングス	74,100	2,258.00	167,317,800	貸付株式数	30,300株
日本証券金融	29,200	543.00	15,855,600		
アイフル	101,100	252.00	25,477,200		
日本アジア投資	5,600	290.00	1,624,000	貸付株式数	2,100株
長野銀行	2,100	1,713.00	3,597,300		
名古屋銀行	5,300	3,390.00	17,967,000		
北洋銀行	100,000	241.00	24,100,000		
愛知銀行	2,400	3,845.00	9,228,000		
中京銀行	2,700	2,257.00	6,093,900	貸付株式数	200株
大光銀行	2,200	1,751.00	3,852,200		
愛媛銀行	9,300	1,224.00	11,383,200	貸付株式数	2,900株
トマト銀行	2,500	1,069.00	2,672,500		
京葉銀行	28,400	629.00	17,863,600	貸付株式数	4,500株
栃木銀行	31,800	231.00	7,345,800		
北日本銀行	2,100	2,195.00	4,609,500	貸付株式数	700株
東和銀行	11,700	888.00	10,389,600	貸付株式数	1,100株
福島銀行	6,200	303.00	1,878,600	貸付株式数	2,400株
大東銀行	3,400	631.00	2,145,400	貸付株式数	1,200株
リコーリース	5,200	3,910.00	20,332,000		
イオンフィナンシャルサービス	40,500	1,685.00	68,242,500		
アコム	133,000	458.00	60,914,000		
ジャックス	7,300	2,696.00	19,680,800		
オリコ	179,500	162.00	29,079,000		
日立キャピタル	15,600	2,695.00	42,042,000		
アプラスフィナンシャル	32,500	93.00	3,022,500	貸付株式数	2,400株
オリックス	414,700	1,797.50	745,423,250	貸付株式数	170,000株
三菱UFJリース	168,200	705.00	118,581,000	貸付株式数	8,500株
ジャフコ	10,200	4,230.00	43,146,000	貸付株式数	100株
九州リースサービス	3,200	602.00	1,926,400		
トモニホールディングス	51,300	419.00	21,494,700		
大和証券G本社	532,300	556.10	296,012,030		
野村ホールディングス	1,166,600	562.30	655,979,180	貸付株式数	448,200株
岡三証券グループ	56,700	406.00	23,020,200	貸付株式数	300株
丸三証券	19,700	547.00	10,775,900	貸付株式数	7,700株
東洋証券	23,600	173.00	4,082,800	貸付株式数	9,200株
東海東京HD	76,400	338.00	25,823,200	貸付株式数	29,200株
光世証券	1,600	677.00	1,083,200	貸付株式数	400株
水戸証券	19,200	283.00	5,433,600	貸付株式数	5,500株
いちよし証券	12,300	682.00	8,388,600		
松井証券	37,900	888.00	33,655,200		
SOMPOホールディングス	124,700	4,371.00	545,063,700		

だいこう証券ビジ	3,200	649.00	2,076,800		
日本取引所グループ	190,200	1,874.00	356,434,800		
マネックスG	50,100	281.00	14,078,100	貸付株式数	19,500株
極東証券	8,900	785.00	6,986,500		
岩井コスモホールディング	6,300	1,282.00	8,076,600	貸付株式数	1,200株
藍澤証券	11,900	738.00	8,782,200	貸付株式数	1,100株
フィデアホール	64,900	134.00	8,696,600		
池田泉州HD	76,600	203.00	15,549,800		
アニコム ホールディングス	5,500	3,585.00	19,717,500	貸付株式数	1,900株
MS&AD	173,400	3,560.00	617,304,000		
SONY FH	54,500	2,573.00	140,228,500		
マネーパートナーズGP	7,000	250.00	1,750,000	貸付株式数	1,900株
スパークス・グループ	22,900	249.00	5,702,100		
小林洋行	1,900	267.00	507,300		
第一生命HLDGS	375,200	1,761.50	660,914,800		
東京海上HD	237,100	6,020.00	1,427,342,000	貸付株式数	91,100株
アドバンテッジリスクマネ	3,200	990.00	3,168,000	貸付株式数	900株
イー・ギャランティ	7,100	1,416.00	10,053,600	貸付株式数	2,300株
アサックス	3,400	653.00	2,220,200	貸付株式数	1,300株
NECキャピタルソリューション	2,700	2,463.00	6,650,100		
T&Dホールディングス	205,100	1,295.00	265,604,500		
アドバンスクリエイト	1,600	1,864.00	2,982,400		
三井不動産	331,000	2,731.50	904,126,500		
三菱地所	464,500	2,010.00	933,645,000		
平和不動産	12,200	2,614.00	31,890,800		
東京建物	72,500	1,653.00	119,842,500		
ダイビル	17,100	1,172.00	20,041,200		
京阪神ビルディング	10,800	1,437.00	15,519,600	貸付株式数	1,000株
住友不動産	149,000	3,839.00	572,011,000		
太平洋興発	2,600	808.00	2,100,800	貸付株式数	200株
テーオーシー	13,000	895.00	11,635,000		
東京楽天地	1,100	6,140.00	6,754,000		
スターツコーポレーション	9,000	2,691.00	24,219,000		
フジ住宅	7,700	711.00	5,474,700		
空港施設	6,700	540.00	3,618,000		
明和地所	3,600	589.00	2,120,400		
ゴールドクレスト	5,200	2,162.00	11,242,400	貸付株式数	2,000株
リログループ	35,100	2,986.00	104,808,600	貸付株式数	13,700株
エスリード	2,600	2,171.00	5,644,600		
日神不動産	9,900	496.00	4,910,400		
日本エスコン	12,000	989.00	11,868,000	貸付株式数	1,600株
タカラレーベン	30,300	489.00	14,816,700		
サンヨーハウジ 名古屋	3,700	995.00	3,681,500	貸付株式数	800株
イオンモール	33,200	1,775.00	58,930,000		
毎日コムネット	1,400	832.00	1,164,800		
ファースト住建	2,800	1,319.00	3,693,200		
ランド	359,700	12.00	4,316,400	貸付株式数	36,900株
カチタス	8,200	4,920.00	40,344,000	貸付株式数	500株 (500株)

東祥	4,000	2,454.00	9,816,000	貸付株式数	1,500株
トーセイ	9,100	1,333.00	12,130,300	貸付株式数	100株
穴吹興産	700	3,280.00	2,296,000		
サンフロンティア不動産	9,200	1,274.00	11,720,800		
インテリックス	1,900	711.00	1,350,900		
ランドビジネス	2,800	761.00	2,130,800		
日本社宅サービス	1,700	1,107.00	1,881,900	貸付株式数	400株
グランディハウス	5,100	470.00	2,397,000	貸付株式数	300株
東武鉄道	70,900	4,055.00	287,499,500		
相鉄ホールディングス	21,500	3,040.00	65,360,000		
東急	169,500	2,177.00	369,001,500		
京浜急行	86,300	2,242.00	193,484,600		
小田急電鉄	100,000	2,708.00	270,800,000		
京王電鉄	34,900	7,060.00	246,394,000		
京成電鉄	46,800	4,535.00	212,238,000		
富士急行	9,200	4,265.00	39,238,000	貸付株式数	3,500株 (900株)
新京成電鉄	1,800	2,303.00	4,145,400		
東日本旅客鉄道	118,300	10,085.00	1,193,055,500		
西日本旅客鉄道	59,900	9,675.00	579,532,500		
東海旅客鉄道	55,900	22,245.00	1,243,495,500		
西武ホールディングス	90,200	1,930.00	174,086,000		
鴻池運輸	10,700	1,663.00	17,794,100		
西日本鉄道	18,700	2,629.00	49,162,300		
ハマキョウレックス	5,200	3,665.00	19,058,000		
サカイ引越センター	3,500	6,970.00	24,395,000	貸付株式数	100株
近鉄グループHLDGS	63,700	6,150.00	391,755,000		
阪急阪神HLDGS	84,900	4,745.00	402,850,500		
南海電鉄	30,200	3,040.00	91,808,000		
京阪ホールディングス	28,300	5,450.00	154,235,000	貸付株式数	2,200株
神戸電鉄	1,600	3,990.00	6,384,000	貸付株式数	100株
名古屋鉄道	52,400	3,495.00	183,138,000	貸付株式数	15,600株
山陽電鉄	4,600	2,248.00	10,340,800		
トランコム	1,800	7,800.00	14,040,000		
日本通運	22,500	7,010.00	157,725,000	貸付株式数	8,100株
ヤマトホールディングス	111,600	1,901.00	212,151,600		
山九	17,700	5,690.00	100,713,000		
日新	5,500	1,743.00	9,586,500		
丸運	3,600	274.00	986,400	貸付株式数	1,400株
丸全昭和運輸	5,200	3,110.00	16,172,000		
センコーグループHLDGS	35,200	917.00	32,278,400		
トナミホールディングス	1,500	5,120.00	7,680,000		
ニッコンホールディングス	22,800	2,730.00	62,244,000		
日石輸送	700	2,781.00	1,946,700		
福山通運	8,100	4,185.00	33,898,500	貸付株式数	2,600株
セイノーホールディングス	47,700	1,479.00	70,548,300		
エスライン	1,900	997.00	1,894,300	貸付株式数	100株
神奈川中央交通	1,600	4,015.00	6,424,000		
日立物流	11,700	3,110.00	36,387,000	貸付株式数	4,300株 (4,300株)

丸和運輸機関	6,700	2,570.00	17,219,000	貸付株式数	1,800株 (1,600株)
C&Fロジホールディングス	6,400	1,408.00	9,011,200		
日本郵船	53,300	1,925.00	102,602,500		
商船三井	40,300	2,942.00	118,562,600	貸付株式数	5,000株
川崎汽船	19,600	1,879.00	36,828,400	貸付株式数	7,600株
NSユニテッド海運	3,500	2,319.00	8,116,500		
明治海運	6,700	342.00	2,291,400		
飯野海運	30,400	360.00	10,944,000		
共栄タンカー	600	1,778.00	1,066,800		
九州旅客鉄道	56,800	3,780.00	214,704,000		
SGホールディングス	66,800	2,633.00	175,884,400		
日本航空	116,600	3,391.00	395,390,600		
ANAホールディングス	116,400	3,758.00	437,431,200		
パスコ	1,200	1,860.00	2,232,000		
西本WISMETTAC HD	1,200	3,915.00	4,698,000	貸付株式数	400株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	600	1,502.00	901,200		
GENKY DRUGSTORES	3,200	2,539.00	8,124,800	貸付株式数	1,200株
国際紙パルプ商事	15,700	301.00	4,725,700		
総合メディカルHD	5,800	2,065.00	11,977,000		
ブックオフGHD	3,800	1,066.00	4,050,800	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	20,200	2,835.00	57,267,000		
三井倉庫HOLD	7,300	1,999.00	14,592,700		
住友倉庫	23,500	1,510.00	35,485,000		
渋沢倉庫	3,500	2,149.00	7,521,500		
ヤマタネ	3,300	1,504.00	4,963,200	貸付株式数	1,000株
東陽倉庫	11,300	336.00	3,796,800		
乾汽船	3,700	1,148.00	4,247,600	貸付株式数	2,000株
日本トランスシティ	14,100	548.00	7,726,800	貸付株式数	1,000株
ケイヒン	1,200	1,328.00	1,593,600		
中央倉庫	3,900	1,238.00	4,828,200	貸付株式数	100株
川西倉庫	1,200	1,054.00	1,264,800		
安田倉庫	5,200	995.00	5,174,000		
ファイズホールディングス	1,300	640.00	832,000	貸付株式数	200株
東洋埠頭	1,900	1,412.00	2,682,800		
宇徳	5,400	537.00	2,899,800		
上組	36,400	2,444.00	88,961,600		
サンリツ	1,500	700.00	1,050,000	貸付株式数	500株
キムラユニティー	1,700	1,102.00	1,873,400		
キューソー流通システム	1,600	1,877.00	3,003,200	貸付株式数	600株 (300株)
近鉄エクスプレス	13,500	1,944.00	26,244,000	貸付株式数	3,500株
東海運	3,600	283.00	1,018,800	貸付株式数	100株
エアアイティー	4,500	968.00	4,356,000		
内外トランスライン	2,200	1,471.00	3,236,200	貸付株式数	800株
ショーエイコーポ	700	736.00	515,200	貸付株式数	200株
日本コンセプト	2,000	1,430.00	2,860,000	貸付株式数	200株

東京放送HD	40,100	1,750.00	70,175,000	
日本テレビHLDS	55,100	1,452.00	80,005,200	
朝日放送グループHD	6,600	749.00	4,943,400	貸付株式数 300株
テレビ朝日HD	18,100	1,769.00	32,018,900	
スカパーJ S A T H D	43,500	464.00	20,184,000	貸付株式数 1,200株
テレビ東京HD	5,400	2,303.00	12,436,200	
日本BS放送	2,200	1,084.00	2,384,800	貸付株式数 700株 (700株)
ビジョン	6,100	1,793.00	10,937,300	貸付株式数 2,200株
スマートバリュー	1,900	814.00	1,546,600	貸付株式数 700株
USEN-NEXT HLDGS	2,500	1,111.00	2,777,500	貸付株式数 900株
ワイヤレスゲート	3,100	659.00	2,042,900	貸付株式数 1,200株
コネクシオ	3,800	1,525.00	5,795,000	
日本通信	51,100	220.00	11,242,000	貸付株式数 22,900株 (1,000株)
クロップス	1,200	750.00	900,000	
日本電信電話	440,900	5,598.00	2,468,158,200	
KDDI	491,600	3,150.00	1,548,540,000	
ソフトバンク	599,600	1,483.50	889,506,600	貸付株式数 234,400株
光通信	6,800	25,880.00	175,984,000	
NTTドコモ	487,300	3,007.00	1,465,311,100	貸付株式数 190,500株
エムティーアイ	6,400	692.00	4,428,800	貸付株式数 1,100株
GMOインターネット	26,000	2,269.00	58,994,000	
ファイバーゲート	1,300	1,385.00	1,800,500	貸付株式数 400株
アйдママーケティングコミュニ	2,000	727.00	1,454,000	
KADOKAWA	17,800	1,776.00	31,612,800	
学研ホールディングス	2,200	7,490.00	16,478,000	
ゼンリン	13,100	1,907.00	24,981,700	貸付株式数 4,000株
昭文社	3,100	421.00	1,305,100	
インプレスホールディングス	5,300	183.00	969,900	
東京電力HD	536,700	483.00	259,226,100	貸付株式数 1,900株
中部電力	205,600	1,535.50	315,698,800	
関西電力	254,700	1,251.00	318,629,700	
中国電力	93,000	1,456.00	135,408,000	貸付株式数 36,300株
北陸電力	61,600	790.00	48,664,000	
東北電力	168,000	1,105.00	185,640,000	
四国電力	60,600	1,059.00	64,175,400	
九州電力	138,700	971.00	134,677,700	
北海道電力	63,000	532.00	33,516,000	
沖縄電力	12,500	2,003.00	25,037,500	
電源開発	53,500	2,678.00	143,273,000	
エフオン	3,100	785.00	2,433,500	貸付株式数 1,200株
イーレックス	9,500	1,747.00	16,596,500	貸付株式数 2,200株 (2,200株)
レノバ	11,100	1,160.00	12,876,000	
東京瓦斯	129,200	2,653.00	342,767,600	
大阪瓦斯	130,400	2,077.00	270,840,800	
東邦瓦斯	33,300	4,170.00	138,861,000	

北海道瓦斯	3,600	1,586.00	5,709,600	貸付株式数	400株
広島ガス	14,100	359.00	5,061,900		
西部瓦斯	7,600	2,520.00	19,152,000		
静岡ガス	19,100	928.00	17,724,800	貸付株式数	100株
メタウォーター	3,200	4,070.00	13,024,000	貸付株式数	1,000株
アイネット	3,400	1,525.00	5,185,000		
松竹	4,400	16,230.00	71,412,000	貸付株式数	1,600株
東宝	39,400	4,465.00	175,921,000	貸付株式数	14,700株
エイチ・アイ・エス	10,000	3,070.00	30,700,000	貸付株式数	3,900株
東映	2,500	17,170.00	42,925,000	貸付株式数	700株
ラックランド	1,300	2,450.00	3,185,000	貸付株式数	400株
NTTデータ	175,600	1,518.00	266,560,800		
共立メンテナンス	10,600	5,200.00	55,120,000	貸付株式数	4,100株 (1,300株)
イチネンホールディングス	7,200	1,415.00	10,188,000	貸付株式数	1,400株
建設技術研究所	4,400	2,030.00	8,932,000		
スペース	4,100	1,317.00	5,399,700		
長大	2,400	1,181.00	2,834,400		
アインホールディングス	8,900	6,880.00	61,232,000	貸付株式数	3,400株
燦ホールディングス	2,800	1,348.00	3,774,400		
ピー・シー・エー	800	4,480.00	3,584,000	貸付株式数	300株
スバル興業	400	7,880.00	3,152,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,500	1,393.00	3,482,500	貸付株式数	900株
タナベ経営	1,200	1,279.00	1,534,800	貸付株式数	100株
ビジネスB太田昭和	1,100	2,377.00	2,614,700	貸付株式数	200株
ナガワ	2,000	7,530.00	15,060,000	貸付株式数	200株
よみうりランド	1,400	4,540.00	6,356,000		
東京都競馬	4,200	3,475.00	14,595,000	貸付株式数	1,600株
常磐興産	2,600	1,667.00	4,334,200	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,500	3,165.00	33,232,500	貸付株式数	4,100株
東京ドーム	26,100	1,013.00	26,439,300	貸付株式数	8,600株
DTS	14,700	2,352.00	34,574,400		
スクウェア・エニックス・HD	28,100	5,470.00	153,707,000		
シーイーシー	7,100	2,261.00	16,053,100		
カプコン	31,100	2,623.00	81,575,300		
西尾レントオール	6,500	3,085.00	20,052,500		
アイ・エス・ビー	1,300	1,995.00	2,593,500		
アゴーラ・ホスピタリティーG	41,500	34.00	1,411,000		
日本空港ビルデング	21,200	5,830.00	123,596,000	貸付株式数	8,200株
トランス・コスモス	6,100	2,874.00	17,531,400		
乃村工藝社	27,500	1,410.00	38,775,000		
ジャステック	4,200	1,120.00	4,704,000		
SCSK	15,200	5,770.00	87,704,000		
藤田観光	2,800	2,868.00	8,030,400	貸付株式数	100株
KNT-CTホールディングス	4,000	1,511.00	6,044,000		
日本管財	6,900	1,951.00	13,461,900		
トーカイ	6,200	2,869.00	17,787,800		

白 洋 舎	700	2,864.00	2,004,800	貸付株式数	200株
セコム	68,100	9,486.00	645,996,600		
日本システムウェア	2,200	2,574.00	5,662,800		
セントラル警備保障	3,100	6,460.00	20,026,000	貸付株式数	1,200株
アイネス	6,500	1,365.00	8,872,500		
丹青社	12,100	1,232.00	14,907,200		
メイテック	7,900	5,830.00	46,057,000		
TKC	5,600	5,130.00	28,728,000		
富士ソフト	8,400	4,275.00	35,910,000		
応用地質	6,900	1,400.00	9,660,000		
船井総研ホールディング	13,300	2,546.00	33,861,800		
NSD	10,800	3,590.00	38,772,000		
進学会ホールディングス	2,500	533.00	1,332,500	貸付株式数	100株
丸紅建材リース	700	1,756.00	1,229,200	貸付株式数	200株
オ オ バ	5,000	798.00	3,990,000	貸付株式数	1,900株
コナミホールディングス	24,000	4,860.00	116,640,000	貸付株式数	800株
いであ	1,200	2,320.00	2,784,000	貸付株式数	400株
学 究 社	1,900	1,332.00	2,530,800		
ベネッセホールディングス	21,400	2,908.00	62,231,200		
イオンディライト	7,900	3,870.00	30,573,000		
ナック	3,600	1,056.00	3,801,600		
福井コンピュータHLDS	2,600	3,875.00	10,075,000	貸付株式数	900株 (800株)
ニチイ学館	9,200	1,621.00	14,913,200		
ダイセキ	10,800	3,260.00	35,208,000	貸付株式数	4,100株
ステップ	2,300	1,567.00	3,604,100		
日鉄物産	4,800	5,070.00	24,336,000		
泉州電業	2,000	2,919.00	5,838,000		
元気寿司	1,700	2,994.00	5,089,800		
トラスコ中山	13,800	2,799.00	38,626,200	貸付株式数	5,300株
ヤマダ電機	201,700	557.00	112,346,900		
オートバックスセブン	24,500	1,801.00	44,124,500	貸付株式数	2,100株
モリト	4,800	800.00	3,840,000		
アーランドサカモト	10,300	1,281.00	13,194,300		
ニトリホールディングス	28,700	17,260.00	495,362,000		
グルメ杵屋	4,700	1,195.00	5,616,500		
愛 眼	5,200	247.00	1,284,400		
ケーユーホールディングス	3,500	931.00	3,258,500		
吉野家ホールディングス	21,700	2,756.00	59,805,200	貸付株式数	6,600株 (5,200株)
加藤産業	10,400	3,665.00	38,116,000		
北恵	1,200	918.00	1,101,600		
イノテック	3,900	1,052.00	4,102,800		
イエローハット	12,500	2,004.00	25,050,000		
松屋フーズHLDGS	3,200	4,510.00	14,432,000		
JBCホールディングス	4,500	1,863.00	8,383,500	貸付株式数	300株
JKホールディングス	6,100	647.00	3,946,700		
サガミホールディングス	8,800	1,376.00	12,108,800	貸付株式数	100株
日 伝	5,900	2,096.00	12,366,400		
関西スーパーマーケット	5,500	1,086.00	5,973,000	貸付株式数	200株

ミロク情報サービス	5,800	3,385.00	19,633,000	貸付株式数	2,400株 (100株)
北沢産業	5,000	288.00	1,440,000	貸付株式数	1,100株
杉本商事	3,500	2,005.00	7,017,500	貸付株式数	400株
因幡電機産業	18,800	2,671.00	50,214,800		
王将フードサービス	4,900	6,620.00	32,438,000		
プレナス	7,400	1,936.00	14,326,400	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,900	1,472.00	7,212,800	貸付株式数	1,800株
アークス	13,600	2,284.00	31,062,400		
バローホールディングス	14,700	2,064.00	30,340,800		
東テク	2,200	2,426.00	5,337,200		
ミスミグループ本社	82,900	2,738.00	226,980,200		
藤久	500	817.00	408,500	貸付株式数	100株
アルテック	5,200	229.00	1,190,800		
ベルク	3,300	5,230.00	17,259,000		
大庄	3,500	1,605.00	5,617,500	貸付株式数	100株
タキヒヨー	2,000	1,938.00	3,876,000		
ファーストリテイリング	8,900	67,800.00	603,420,000	貸付株式数	3,300株
ソフトバンクグループ	523,500	4,236.00	2,217,546,000	貸付株式数	40,600株
蔵王産業	1,300	1,444.00	1,877,200		
スズケン	28,000	4,890.00	136,920,000		
サンドラッグ	24,900	3,870.00	96,363,000		
サックスパーホールディング	5,600	905.00	5,068,000		
ジェコス	4,600	955.00	4,393,000	貸付株式数	600株
ヤマザワ	1,500	1,666.00	2,499,000	貸付株式数	400株
やまや	1,400	2,207.00	3,089,800	貸付株式数	500株
グローセル	6,700	456.00	3,055,200		
ベルーナ	14,300	712.00	10,181,600		
合計			162,602,439,840		

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

ソニー	20,000株	トヨタ自動車	40,000株
三菱UFJフィナンシャルG	200,000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

2019年11月29日

I	資産総額	72,382,989,216 円
II	負債総額	235,252,065 円
III	純資産総額 (I - II)	72,147,737,151 円
IV	発行済数量	27,846,229,307 口
V	1 単位当たり純資産額 (III / IV)	2.5909 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

2019年11月29日

I	資産総額	178,833,434,259 円
II	負債総額	15,860,619,254 円
III	純資産総額 (I - II)	162,972,815,005 円
IV	発行済数量	147,468,131,809 口
V	1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.1051 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
 - ① 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。
 - ② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。
 - ③ 上記①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。
- (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て）に支払います。
- (9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部 委託会社等の情報

第1 委託会社等の概況

1 委託会社等の概況

a. 資本金の額

2019年11月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

① 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、役付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。

② 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. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ. 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。

ハ. 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。

ニ. 運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績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。

・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。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守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。

2019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	62	115,488
追加型株式投資信託	721	16,485,415
株式投資信託 合計	783	16,600,903
単位型公社債投資信託	27	88,797
追加型公社債投資信託	14	1,478,400
公社債投資信託 合計	41	1,567,197
総合計	824	18,168,100

3 委託会社等の経理状況

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期事業年度（2018年4月1日から2019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61期事業年度に係る中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

独立監査人の監査報告書

2019年5月24日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

小倉加奈子 

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

柴井康治 

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証券投資信託委託株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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、大和証券投資信託委託株式会社の2019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すべ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。

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

(1) 貸借対照表

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
固定資産		
有形固定資産	※1	※1
建物	213	206
器具備品	12	10
無形固定資産	200	195
ソフトウェア	2,614	2,821
ソフトウェア仮勘定	2,456	2,804
投資その他の資産	158	17
投資有価証券	15,066	12,799
関係会社株式	8,600	8,493
出資金	5,129	1,836
長期差入保証金	183	183
繰延税金資産	1,072	1,070
その他	1,078	1,183
固定資産計	34	31
資産合計	18,927	15,827
	60,337	56,709

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	※2 4,476	※2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
固定負債		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
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	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

(2) 損益計算書

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145
賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725
福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374
役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	210	215
有価証券償還益	17	133
その他	130	172
営業外収益計	359	521
営業外費用		
投資有価証券売却損	0	40
有価証券償還損	3	32
その他	25	60
営業外費用計	29	132
経常利益	18,741	16,961
特別損失		
関係会社整理損失	333	29
特別損失計	333	29
税引前当期純利益	18,407	16,931
法人税、住民税及び事業税	5,843	5,076
法人税等調整額	△106	△15
法人税等合計	5,737	5,060
当期純利益	12,670	11,870

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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	12,231	12,606	39,276
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△11,532	△11,532	△11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895

	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	264	264	39,540
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△47	△47	△47
当期変動額合計	△47	△47	1,090
当期末残高	216	216	41,112

当事業年度（自 2018年4月1日至 2019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	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△12,669	△12,669	△12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△798	△798	△798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△170	△170	△170
当期変動額合計	△170	△170	△969
当期末残高	46	46	40,142

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

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

時価のあるもの

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。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の前事業年度期首残高が480百万円増加しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 平成30年3月30日)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日)

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用)

『税効果会計に係る会計基準』の一部改正(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)等を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

(損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めておりました「有価証券償還損」は、営業外費用の総額の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、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円
器具備品	235百万円	264百万円

※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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
未払金	4,406百万円	3,788百万円

3 保証債務

前事業年度 (2018年3月31日)

子会社である Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. の債務 1,701 百万円に対して保証を行っております。

当事業年度 (2019年3月31日)

子会社である Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. の債務 1,719 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 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017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

2018年6月25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。

- ① 剰余金の配当の総額 12,669百万円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 4,857円
- ④ 基準日 2018年3月31日
- ⑤ 効力発生日 2018年6月26日

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018年 6月26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

2019年6月21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。

- ① 剰余金の配当の総額 11,868百万円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 4,550円
- ④ 基準日 2019年3月31日
- ⑤ 効力発生日 2019年6月24日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

(i) 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。

(ii) 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。

②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. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）参照のこと）。

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	28,709	28,709	—
(2) 未収委託者報酬	12,368	12,368	—
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,631	7,631	—
資産計	48,709	48,709	—
(1) 未払手数料	(5,202)	(5,202)	—
(2) その他未払金	(4,476)	(4,476)	—
(3) 未払費用 (*2)	(3,286)	(3,286)	—
負債計	(12,965)	(12,965)	—

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	28,489	28,489	—
(2) 未収委託者報酬	11,468	11,468	—
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	8,380	8,380	—
資産計	48,338	48,338	—
(1) 未払手数料	(4,610)	(4,610)	—
(2) その他未払金	(3,882)	(3,882)	—
(3) 未払費用(*2)	(2,805)	(2,805)	—
負債計	(11,298)	(11,298)	—

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	1,836
(3) 長期差入保証金	1,072	1,070

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度 (2018年3月31日)

(単位: 百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

当事業年度 (2019年3月31日)

(単位: 百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

(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 (2018年3月31日)

子会社株式 (貸借対照表計上額 5,129百万円) は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度 (2019年3月31日)

子会社株式 (貸借対照表計上額 1,836百万円) は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度（2018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	134	55	79
（2）その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,299	3,522	△223
小計	3,299	3,522	△223
合計	7,631	7,318	312

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 970百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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（2019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	87	55	32
（2）その他 証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,301	3,560	△258
小計	3,301	3,560	△258
合計	8,380	8,328	52

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 666百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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 2017年4月1日 至 2018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	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	389	86	-
(2) その他 証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,318百万円	2,350百万円
勤務費用	159	158
退職給付の支払額	△166	△171
その他	38	52
退職給付債務の期末残高	2,350	2,389

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,350 百万円	2,389 百万円
貸借対照表に計上された負債 と資産の純額	2,350	2,389
退職給付引当金	2,350	2,389
貸借対照表に計上された負債 と資産の純額	2,350	2,389

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	159 百万円	158 百万円
その他	24	41
確定給付制度に係る退職給付費用	184	199

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171百万円、当事業年度174百万円であります。

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	719	731
賞与引当金	244	182
システム関連費用	16	170
未払事業税	162	141
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	68	32
その他	297	240
繰延税金資産小計	1,602	1,592
評価性引当額	△200	△164
繰延税金資産合計	1,402	1,428
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△159	△159
その他有価証券評価差額金	△164	△85
繰延税金負債合計	△323	△244
繰延税金資産の純額	1,078	1,183

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引（譲渡益）は480百万円減少しております。

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（2018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（2019年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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子会社

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,701	—	—

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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注1)	1,719	—	—
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有) 直接91.0	経営管理	有償減資 (注2)	3,293	—	—

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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。

(注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

(イ) 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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円) (注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	—	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	—	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入 (注3)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	—	本社ビルの管理	不動産の賃借料 (注4)	1,048	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
- (注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。
- (注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。
- (注4) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円) (注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	—	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	—	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入 (注3)	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	—	本社ビルの管理	不動産の賃借料 (注4)	1,063	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
- (注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。
- (注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。
- (注4) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）		当事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	
1株当たり純資産額	15,760.66円	1株当たり純資産額	15,389.06円
1株当たり当期純利益	4,857.40円	1株当たり当期純利益	4,550.81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）「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の1株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

（注3）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）	当事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
当期純利益（百万円）	12,670	11,870
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

小倉 加奈子



指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

間瀬 友未



指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士

深井 康治



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証券投資信託委託株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019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。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

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、大和証券投資信託委託株式会社の2019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（2019年4月1日から2019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。

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

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 (2019年9月30日)
<hr/>		
資産の部		
流動資産		
現金・預金		19,529
有価証券		724
未収委託者報酬		11,175
その他		383
流動資産合計		<hr/> 31,812 <hr/>
固定資産		
有形固定資産	※1	211
無形固定資産		
ソフトウェア		2,380
その他		403
無形固定資産合計		<hr/> 2,784 <hr/>
投資その他の資産		
投資有価証券		7,928
関係会社株式		2,664
繰延税金資産		1,205
その他		1,280
投資その他の資産合計		<hr/> 13,078 <hr/>
固定資産合計		<hr/> 16,073 <hr/>
資産合計		<hr/> 47,886 <hr/>

(単位:百万円)

当中間会計期間
(2019年9月30日)

負債の部		
流動負債		
未払金		6,021
未払費用		3,486
未払法人税等		754
賞与引当金		506
その他	※2	474
流動負債合計		11,243
固定負債		
退職給付引当金		2,483
役員退職慰労引当金		128
その他		7
固定負債合計		2,619
負債合計		13,862
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,968
利益剰余金合計		7,343
株主資本合計		34,013
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		10
評価・換算差額等合計		10
純資産合計		34,023
負債・純資産合計		47,886

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		35,076
その他営業収益		309
営業収益合計		35,385
営業費用		
支払手数料		15,895
その他営業費用		6,272
営業費用合計		22,167
一般管理費	※ 1	5,954
営業利益		7,263
営業外収益	※ 2	968
営業外費用	※ 3	148
経常利益		8,083
特別利益		—
特別損失		—
税引前中間純利益		8,083
法人税、住民税及び事業税		2,313
法人税等調整額		△15
中間純利益		5,785

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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 繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△11,868	△11,868	△11,868
中間純利益	-	-	-	5,785	5,785	5,785
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	-	-	-	△6,083	△6,083	△6,083
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,968	7,343	34,013

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	46	46	40,142
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,868
中間純利益	-	-	5,785
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△35	△35	△35
当中間期変動額合計	△35	△35	△6,118
当中間期末残高	10	10	34,023

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年間)に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

- (2) 連結納税制度の適用
 連結納税制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2019年9月30日現在)
有形固定資産	310百万円

※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 (2019年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore) Ltd. の債務1,639百万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 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
有形固定資産	14百万円
無形固定資産	472百万円

※2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
受取配当金	901百万円

※3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
有価証券償還損	71百万円
為替差損	68百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019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
2019年6月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年 3月31日	2019年 6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間 (2019年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません ((注2) 参照のこと)。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	19,529	19,529	—
(2) 未収委託者報酬	11,175	11,175	—
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,986	7,986	—
資産合計	38,691	38,691	—
(1) 未払金	(5,965)	(5,965)	—
(2) 未払費用(*2)	(2,867)	(2,867)	—
負債合計	(8,833)	(8,833)	—

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負債

(1) 未払金及び(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,836
関連会社株式	827
差入保証金	1,068

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

当中間会計期間（2019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 1,836 百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 827 百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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	66	55	11
(2) その他			
証券投資信託	3,971	3,628	343
小計	4,038	3,683	354
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			
証券投資信託	3,947	4,292	△344
小計	3,947	4,292	△344
合計	7,986	7,975	10

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額 666 百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019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 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019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 2019年4月1日 至 2019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 2019年4月1日 至 2019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 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1 株当たり純資産額	13,043.35円
1 株当たり中間純利益	2,217.93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

記載しておりません。

(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 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,785
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,785
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 利害関係人との取引制限

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

- ① 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。)
- ② 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。)
- ③ 通常の見積り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④⑤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。
- ④ 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。
- ⑤ 上記③④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
2020年4月1日付で、定款について次の変更を行なう予定です。
 - ・ 商号の変更(大和アセットマネジメント株式会社に変更)
- b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実
訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

追加型証券投資信託

(DCダイワ日本株式インデックス)

約 款

大和証券投資信託委託株式会社

運用の基本方針

約款第18条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。

2. 運用方法

(1) 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。

(2) 投資態度

- ① 投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
- ② 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ③ 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。
- ④ 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時、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。

(3) 投資制限

- ① マザーファンドの受益証券への投資制限
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。
- ② 外貨建資産への投資制限
外貨建資産への投資は、行ないません。

3. 収益分配方針

- 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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
- ③ 留保益は、上記「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

追加型証券投資信託
(DCダイワ日本株式インデックス)
約 款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、大和証券投資信託委託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ます。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

③ 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行なうものとします。

(信託の目的および金額)

第2条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けま

す。

(信託金の限度額)

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 追加信託が行なわれたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第39条第1項、第40条第1項、第41条第1項および第43条第2項の規定による信託終了日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

第5条 この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

(当初の受益者)

第6条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により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。

(受益権の分割および再分割)

第7条 委託者は、第2条の規定による受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところに従い、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。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第8条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、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従って時価または一部償却原価法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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託の受益権は、2007年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受け、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といい

ます。) および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- ③ 委託者は、第7条の規定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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、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。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の2006年12月29日現在のすべての受益権(受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が2007年1月4日以降となるものを含まず)を受益者を代理して2007年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する第一種金融商品取引業者(委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。)および登録金融機関(委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。)(以下総称して「指定販売会社」といいます。)に当該申請の手続を委任することができます。

(受益権の設定にかかる受託者の通知)

第11条 受託者は、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。

(受益権の申込単位および価額)

第12条 委託者は、第7条第1項の規定により分割される受益権の取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込に応じることができます。

- ② 指定販売会社は、第7条第1項の規定により分割される受益権を別に定める積立投資約款に従って契約(以下「積立投資契約」といいます。)を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込に応じることができます。
- ③ 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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、指定販売会社は、当該取得申込の代金(第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。)の支払いと引き換えに、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。
- ④ 第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑤ 前項の規定にかかわらず、受益者が積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第29条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

(受益権の譲渡にかかる記載または記録)

第12条の2 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。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。)に社振法の規定に従い、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。

- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第12条の3 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

第13条 (削 除)

第14条 (削 除)

第15条 (削 除)

(投資の対象とする資産の種類)

第16条 この信託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、約款第19条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

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第17条 委託者は、信託金を、大和証券投資信託委託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、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. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
 2. 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。）
 3. 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
- ② 委託者は、信託金を、前項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

(受託者の自己または利害関係人等との取引)

第17条の2 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第20条において同じ。）、第20条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条ならびに第17条第1項および第2項に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行なうことができます。

- ② 前項の取扱いは、第19条、第24条から第26条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

(運用の基本方針)

第18条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行

ないます。

(先物取引等の運用指図)

第19条 委託者は、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に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。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。）。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第19条の2 委託者は、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。

(信用リスク集中回避のための投資制限)

第19条の3 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(信託業務の委託等)

第20条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限り、）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第21条 (削 除)

(混蔵寄託)

第22条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行されたコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第23条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（一部解約の請求および有価証券の売却等の指図）

第24条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第25条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第26条 委託者は、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。

② 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。

③ 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。

④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

（損益の帰属）

第27条 委託者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、すべて受益者に帰属します。

（信託終了時における受託者による資金の立替え）

第28条 信託終了日までに金額を見積ることのできる未収入金があるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

② 前項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第29条 この信託の計算期間は、毎年12月1日から翌年11月30日までとします。ただし、第1計算期間は2003年1月27日から2003年11月30日までとします。

② 前項の規定にかかわらず、前項の規定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。

（信託財産に関する報告）

第30条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

（信託事務の諸費用および監査報酬）

第31条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者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（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

② 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な費用（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。

（信託報酬等の額および支弁の方法）

第32条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第29条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産

の純資産総額に年10,000分の62以内の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6カ月終了日（6カ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。
- ③ 第1項の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。

（収益の分配方式）

第33条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

（収益分配金の再投資）

第34条 収益分配金（委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金を除きます。）は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、指定販売会社に支払われます。

- ② 指定販売会社は、積立投資契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとします。当該取得申込により増加した受益権は、第10条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金の支払いは、委託者において行なうものとします。
- ④ 収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

（償還金および一部解約金の支払い）

第35条 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。）は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、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指定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て）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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、社振法の規定に従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。

- ② 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、4営業日目から受益者に支払います。
- ③ 前2項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとします。
- ④ 償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第36条 受託者は、収益分配金については第34条に規定する交付開始前に、償還金については前条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第2項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（償還金の時効）

第37条 受益者が、信託終了による償還金について第35条第1項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属しま

す。

(信託契約の一部解約)

第38条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、1口単位をもって、委託者に一部解約請求をすることができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の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この信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、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、社振法の規定に従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 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の基準価額とします。
- ④ 2007年1月4日以降の信託契約の一部解約にかかる一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、2007年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約請求で、2007年1月4日前行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ⑤ 委託者は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約請求の受付を中止することができます。
- ⑥ 前項により一部解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約請求を撤回できます。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、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第38条の2 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、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第39条 委託者は、信託期間中において、この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、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
- ⑥ 第3項から前項までの規定は、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、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第40条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第44条の規定に従います。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第41条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第44条第4項に該当する場合を除き、当該投

資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第42条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第43条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第44条の規定に従い、新受託者を選任します。

② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第44条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第45条 第39条の規定に従い信託契約の解約を行なう場合または前条の規定に従い信託約款の変更を行なう場合において、第39条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第45条の2 委託者は、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の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第46条 委託者が受益者に対してする公告は、2008年6月30日までは日本経済新聞に掲載し、2008年7月1日以降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 2008年7月1日以降において、前項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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第47条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付 則)

第 1条 この約款において「積立投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「積立投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「積立投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第 2条 第34条第4項および第35条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定に

よるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第 3条 2006年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条（受益証券の再交付）から第15条（受益証券の再交付の費用）の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

2003年 1月27日

委託者 大和証券投資信託委託株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社