

年金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)

2024年2月23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「年金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2024年2月22日に関東財務局長に提出しており、2024年2月23日にその届出の効力が生じております。

発行者名	大和アセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	取締役社長 小松 幹太
本店の所在の場所	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
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】

年金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もありません。

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

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、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

2024 年 2 月 23 日から 2024 年 8 月 23 日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（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】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、投資成果を東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象	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。）

地域		において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	MR F（マネー・リザーブ・ファンド）	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMR F
	E T F	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによるもの	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの

	る属性	
	不動産投信	目論見書等において、主として不動産投信（リート）に投資する旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信（リート）以外に投資する旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの
	資産複合 資産配 分固定型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
	資産複合 資産配 分変更型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
決算頻度	年1回	目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
	年2回	目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
	年4回	目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの
	年6回（隔月）	目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
	年12回（毎月）	目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
	日々	目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの
	その他	上記属性にあてはまらないすべてのもの
投資対象 地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東（中東）	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行わない旨の記載があ

		るものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
対象イン デックス	日経 225	目論見書等において、日経 225 に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	TOPIX	目論見書等において、TOPIX に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型 ／絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス <http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

<信託金の限度額>

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、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。

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

●東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数（配当込み）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。

- (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（配当込み）における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数（配当込み）との連動性を維持するよう構築します。
- (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（配当込み）への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。

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

■ 東証株価指数（TOPIX）について

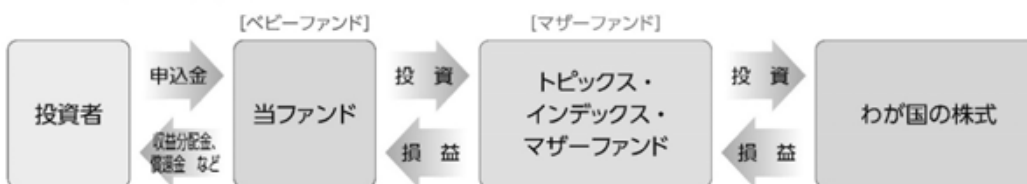
東証株価指数（TOPIX）は、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークであり、日本経済の動向を示すバロメーターとして経済指標、ETFの連動指標などに用いられています。

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

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。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への投資は、行ないません。

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、投資成果を東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2006年10月27日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金(※3)	
お取扱窓口	販売会社	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	大和アセットマネジメント株式会社	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： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 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経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

<委託会社の概況（2023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 大和証券投資信託委託株式会社として設立
 - 1960年 2月17日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
 - 1960年 4月 1日 営業開始
 - 1985年11月 8日 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
 - 1995年 5月31日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
 - 1995年 9月14日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
 - 2007年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。
(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号)
 - 2020年 4月 1日 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更
- ・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- 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）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行な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。

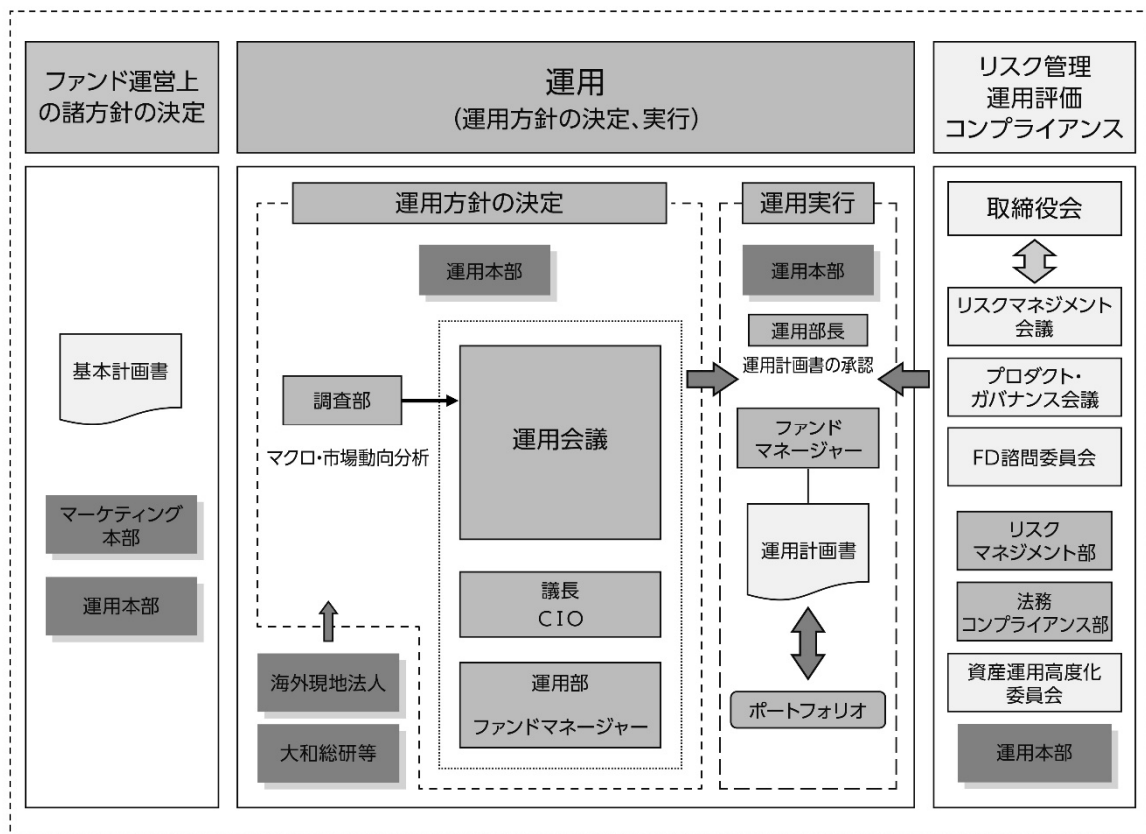
(2) 【投資対象】

- 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、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたトピックス・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
- 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商品担当役員の決裁により決定します。

ロ. 基本的な運用方針の決定

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

ハ. 運用計画書の作成・承認

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

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。

- 基本的な運用方針の決定
- その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ. Deputy-CIO (0~5 名程度)

CIO を補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ. インベストメント・オフィサー (0~5 名程度)

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

ニ. 運用部長 (各運用部に 1 名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ. 運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ. ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議、FD 諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は 35~45 名程度です。

イ. リスクマネジメント会議

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

ロ. プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ. FD 諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、ファンド組成・運用に関わる会議体等に対する牽制に資する事項について、取締役会に意見を述べます。

ニ. 資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

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 2023 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】

① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

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、

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

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

ニ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

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

(1) 投資方針

① 主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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す。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 主な投資制限

- 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せよう、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) 換金性等が制限される場合

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。

金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、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、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

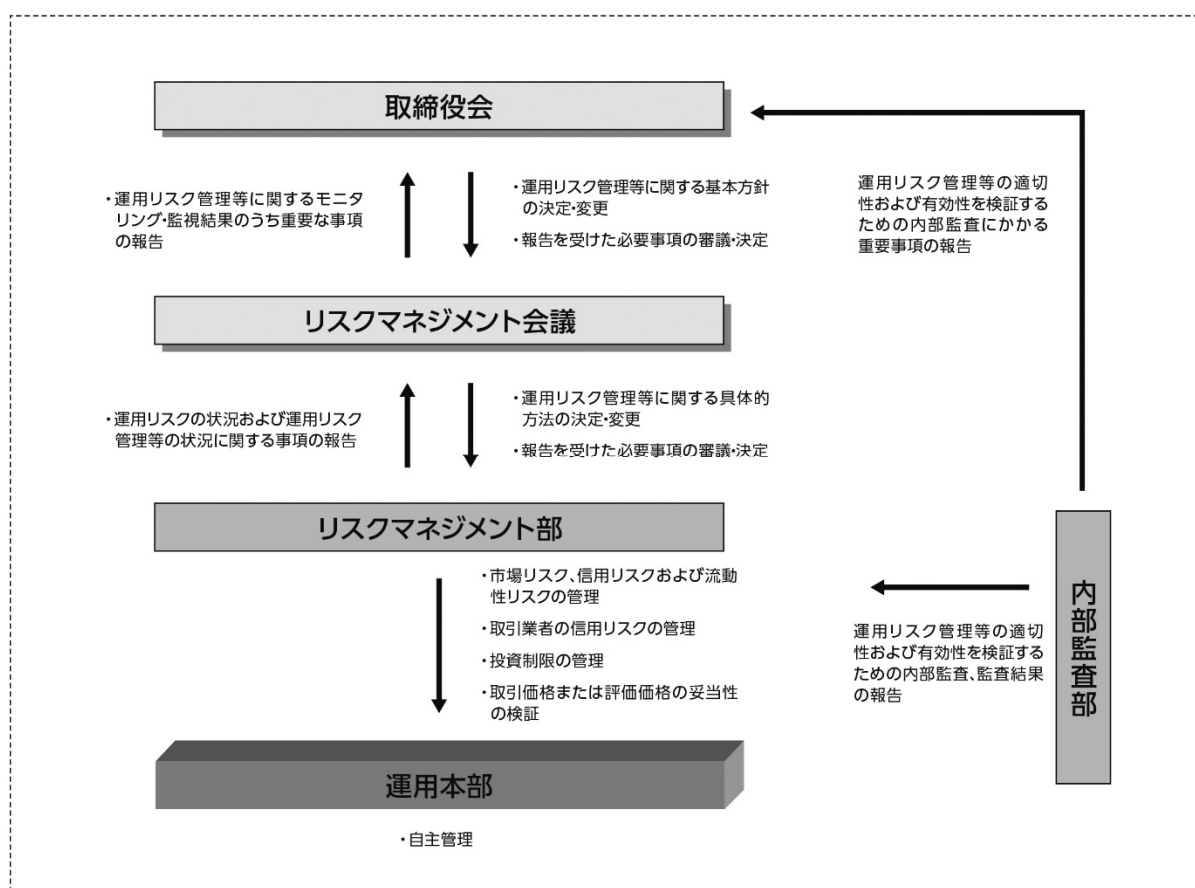
※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映することができないことについては、＜ファンドの特色＞の「●基準価額の動きに関する留意点」をご参照下さい。

※ 流動性リスクに関する事項

- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。
- これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※ 流動性リスクに対する管理体制

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

- ・ 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

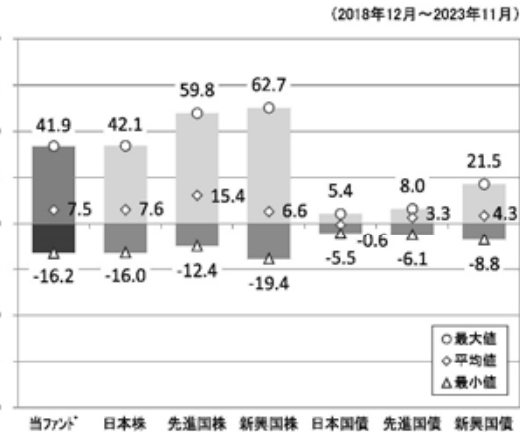
参 考 情 報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

※資産クラスについて

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

※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる商標または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる商標または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドに基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>] ●NOMURA-BPI 国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI 国債の知的財産権とその他一切の権利は同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。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 0.187%（税抜 0.17%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 か月終了日（6 か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
- 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。

委託会社	販売会社	受託会社
年率 0.08% (税抜)	年率 0.06% (税抜)	年率 0.03% (税抜)

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

- 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、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。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

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

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

当ファンドは、NISAの対象ではありません。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

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。
- 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。
- ④ 個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

<注2>収益分配金の課税について

- 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、2023年11月末日現在のもので、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】 (2023年11月30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	12,545,712,973	99.99
内 日本	12,545,712,973	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	923,153	0.01
純資産総額	12,546,636,126	100.00

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

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

(2) 【投資資産】 (2023年11月30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	7,362,939,711	1.4080 10,367,133,682	1.7039 12,545,712,973	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8計算期間末 (2014年12月1日)	2,482,297,091	2,482,297,091	0.9870	0.9870
第9計算期間末 (2015年11月30日)	3,284,114,505	3,284,114,505	1.1167	1.1167
第10計算期間末 (2016年11月30日)	3,429,044,358	3,429,044,358	1.0586	1.0586
第11計算期間末 (2017年11月30日)	4,489,487,993	4,489,487,993	1.3159	1.3159
第12計算期間末 (2018年11月30日)	4,891,529,530	4,891,529,530	1.2477	1.2477
第13計算期間末 (2019年12月2日)	5,415,434,147	5,415,434,147	1.3133	1.3133
第14計算期間末 (2020年11月30日)	6,072,922,364	6,072,922,364	1.3752	1.3752
第15計算期間末 (2021年11月30日)	7,907,146,515	7,907,146,515	1.5408	1.5408
第16計算期間末 (2022年11月30日)	9,355,818,012	9,355,818,012	1.6272	1.6272
2022年12月末日	8,984,411,474	—	1.5527	—
2023年1月末日	9,438,303,514	—	1.6209	—
2月末日	9,596,361,624	—	1.6359	—
3月末日	9,805,965,296	—	1.6635	—
4月末日	10,086,815,279	—	1.7080	—
5月末日	10,736,558,423	—	1.7689	—
6月末日	11,653,732,783	—	1.9023	—
7月末日	11,907,051,620	—	1.9304	—
8月末日	12,041,008,669	—	1.9383	—
9月末日	12,181,762,842	—	1.9482	—
10月末日	11,918,891,359	—	1.8894	—
第17計算期間末 (2023年11月30日)	12,546,636,126	12,546,636,126	1.9915	1.9915

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000

	1口当たり分配金(円)
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
第17計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第8計算期間	14.9
第9計算期間	13.1
第10計算期間	△5.2
第11計算期間	24.3
第12計算期間	△5.2
第13計算期間	5.3
第14計算期間	4.7
第15計算期間	12.0
第16計算期間	5.6
第17計算期間	22.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第8計算期間	894,786,317	478,329,687
第9計算期間	1,113,060,946	686,945,413
第10計算期間	592,567,249	294,482,357
第11計算期間	555,224,223	382,658,267
第12計算期間	864,718,416	355,993,412
第13計算期間	845,172,273	642,014,957
第14計算期間	901,570,410	609,088,808
第15計算期間	1,190,448,845	474,624,259
第16計算期間	1,194,983,326	577,135,775
第17計算期間	1,201,437,954	651,027,989

(参考) マザーファンド
トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	278,401,688,320	97.89
内 日本	278,401,688,320	97.89
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,990,253,697	2.11
純資産総額	284,391,942,017	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	5,417,280,000	1.90
内 日本	5,417,280,000	1.90

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

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

(注3) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(2) 投資資産 (2023年11月30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	4,533,800	2,876.73 13,042,539,717	2,794.50 12,669,704,100	4.46
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	584,000	12,808.89 7,480,396,692	12,820.00 7,486,880,000	2.63
3	三菱 UFJ フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	5,094,300	1,323.05 6,740,060,153	1,255.00 6,393,346,500	2.25
4	キーエンス	日本	株式	電気機器	82,600	57,683.61 4,764,666,474	63,350.00 5,232,710,000	1.84
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	24,635,400	180.88 4,456,210,950	173.10 4,264,387,740	1.50
6	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	174,800	20,765.47 3,629,805,085	24,025.00 4,199,570,000	1.48
7	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	578,500	7,595.45 4,393,970,772	7,258.00 4,198,753,000	1.48
8	日立	日本	株式	電気機器	405,600	9,929.40 4,027,366,640	10,285.00 4,171,596,000	1.47

	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	三菱商事	日本	株式	卸売業	577,100	7,608.83 4,391,056,274	6,886.00 3,973,910,600	1.40
10	信越化学	日本	株式	化学	750,000	4,632.00 3,474,003,957	5,212.00 3,909,000,000	1.37
11	任天堂	日本	株式	その他製 品	521,300	6,447.28 3,360,970,130	6,912.00 3,603,225,600	1.27
12	三井物産	日本	株式	卸売業	658,200	5,790.66 3,811,413,072	5,392.00 3,549,014,400	1.25
13	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	628,400	5,053.85 3,175,845,316	5,505.00 3,459,342,000	1.22
14	伊藤忠	日本	株式	卸売業	587,300	5,724.76 3,362,153,833	5,738.00 3,369,927,400	1.18
15	武田薬品	日本	株式	医薬品	732,900	4,810.06 3,525,298,400	4,165.00 3,052,528,500	1.07
16	本田技研	日本	株式	輸送用機 器	2,013,700	1,796.18 3,616,984,342	1,509.00 3,038,673,300	1.07
17	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	640,000	4,727.72 3,025,745,720	4,625.00 2,960,000,000	1.04
18	東京海上HD	日本	株式	保険業	801,900	3,581.39 2,871,921,106	3,648.00 2,925,331,200	1.03
19	第一三共	日本	株式	医薬品	721,400	4,055.46 2,925,610,840	4,000.00 2,885,600,000	1.01
20	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,098,500	2,678.40 2,942,232,972	2,512.00 2,759,432,000	0.97
21	HOYA	日本	株式	精密機器	164,000	16,074.47 2,636,213,812	16,665.00 2,733,060,000	0.96
22	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	408,500	6,493.12 2,652,439,755	6,020.00 2,459,170,000	0.86
23	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信 業	1,332,400	1,757.90 2,342,237,633	1,798.50 2,396,321,400	0.84
24	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	449,200	5,103.35 2,292,426,452	5,025.00 2,257,230,000	0.79
25	ダイキン工業	日本	株式	機械	99,600	24,850.11 2,475,070,969	22,155.00 2,206,638,000	0.78
26	村田製作所	日本	株式	電気機器	751,300	2,758.30 2,072,311,750	2,883.50 2,166,373,550	0.76
27	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	494,200	3,391.37 1,676,016,473	3,801.00 1,878,454,200	0.66
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	928,300	1,912.98 1,775,825,503	2,009.00 1,864,954,700	0.66
29	SMC	日本	株式	機械	25,000	69,725.69 1,743,142,483	74,450.00 1,861,250,000	0.65
30	丸紅	日本	株式	卸売業	728,400	2,508.44 1,827,153,619	2,307.00 1,680,418,800	0.59

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.89%
合計	97.89%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.36%
建設業	2.03%
食料品	3.37%
繊維製品	0.41%
パルプ・紙	0.17%
化学	5.86%
医薬品	4.66%
石油・石炭製品	0.47%
ゴム製品	0.71%
ガラス・土石製品	0.67%
鉄鋼	0.96%
非鉄金属	0.67%
金属製品	0.52%
機械	5.11%
電気機器	16.93%
輸送用機器	8.49%
精密機器	2.28%
その他製品	2.25%
電気・ガス業	1.35%
陸運業	2.72%
海運業	0.74%
空運業	0.44%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.51%
卸売業	6.88%
小売業	4.19%
銀行業	7.04%
証券、商品先物取引業	0.78%
保険業	2.38%
その他金融業	1.13%
不動産業	1.89%
サービス業	4.70%
合計	97.89%

(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 051 2月	買建	228	5,287,607,750	5,417,280,000	1.90%

(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

● 年金ダイワ日本株式インデックス

2023年11月30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	19,915円
純資産総額	125億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	5.4%
3か月間	2.7%
6か月間	12.6%
1年間	22.4%
3年間	44.8%
5年間	59.6%
設定来	99.2%



※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6期 12年11月	第7期 13年12月	第8期 14年12月	第9期 15年11月	第10期 16年11月	第11期 17年11月	第12期 18年11月	第13期 19年12月	第14期 20年11月	第15期 21年11月	第16期 22年11月	第17期 23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

※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

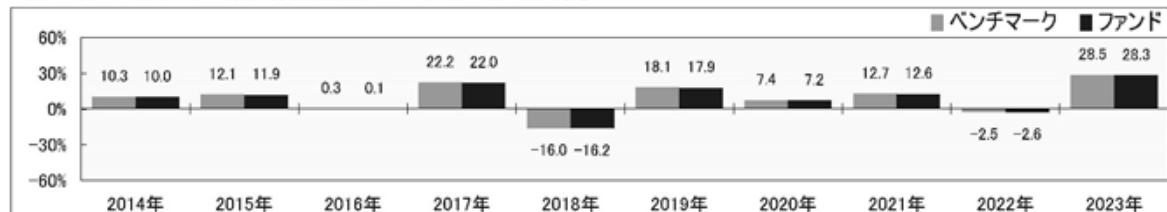
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	2,135	97.9%	電気機器	16.9%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.5%
国内株式先物	1	1.9%	輸送用機器	8.5%	ソニーグループ	電気機器	2.6%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	7.5%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.2%
コール・ローン、その他	-	2.1%	銀行業	7.0%	TOPIX先物 0512月	-	1.9%
合計	2,136	-	卸売業	6.9%	キーエンス	電気機器	1.8%
株式 市場・上場別構成			化学	5.9%	日本電信電話	情報・通信業	1.5%
東証プライム市場		97.3%	機械	5.1%	東京エレクトロン	電気機器	1.5%
東証スタンダード市場		0.6%	サービス業	4.7%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.5%
東証グロース市場		0.0%	医薬品	4.7%	日立	電気機器	1.5%
地方市場・その他		-	その他	30.7%	三菱商事	卸売業	1.4%
合計		97.9%	合計	97.9%	合計		20.4%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数(TOPIX)(配当込み)です。



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

・2023年は11月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(参考情報) ファンドの総経費率

	総経費率 (①+②)	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
年金ダイワ日本株式インデックス	0.19%	0.19%	0.01%

※対象期間は2022年12月1日～2023年11月30日です。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

当ファンドは、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時までには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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、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時までには受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、1口単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）

0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約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することができます。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

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

基準価額は、原則として委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）

0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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。ただし、第1計算期間は2006年10月27日から2007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、公告を行ないません。

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、公告を行ないません。
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、公告を行ないません。
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、公告を行ないません。
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）を計算期間の末日および償還時に作成し、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。

<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。

<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、）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。

<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(2022年12月1日から2023年11月30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

2024年1月26日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金ダイワ日本株式インデックスの2022年12月1日から2023年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金ダイワ日本株式インデックスの2023年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

年金ダイワ日本株式インデックス

(1) 【貸借対照表】

	第 16 期 2022 年 11 月 30 日現在 金 額 (円)	第 17 期 2023 年 11 月 30 日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,167,423	15,012,546
親投資信託受益証券	9,355,159,536	12,545,712,973
未収入金	2,070,000	6,300,000
流動資産合計	9,367,396,959	12,567,025,519
資産合計	9,367,396,959	12,567,025,519
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,072,635	8,933,155
未払受託者報酬	1,458,207	1,963,901
未払委託者報酬	6,805,158	9,165,110
その他未払費用	242,947	327,227
流動負債合計	11,578,947	20,389,393
負債合計	11,578,947	20,389,393
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	5,749,707,544	6,300,117,509
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	3,606,110,468	6,246,518,617
(分配準備積立金)	2,221,491,460	4,095,174,347
元本等合計	9,355,818,012	12,546,636,126
純資産合計	9,355,818,012	12,546,636,126
負債純資産合計	9,367,396,959	12,567,025,519

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第16期 自2021年12月1日 至2022年11月30日 金額(円)	第17期 自2022年12月1日 至2023年11月30日 金額(円)
営業収益		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	515,973,188	2,224,503,437
営業収益合計	515,973,188	2,224,503,438
営業費用		
支払利息	2,251	3,726
受託者報酬	2,785,278	3,538,764
委託者報酬	12,998,309	16,514,694
その他費用	464,040	589,623
営業費用合計	16,249,878	20,646,807
営業利益又は営業損失(△)	499,723,310	2,203,856,631
経常利益又は経常損失(△)	499,723,310	2,203,856,631
当期純利益又は当期純損失(△)	499,723,310	2,203,856,631
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)	8,383,142	102,276,054
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,775,286,522	3,606,110,468
剰余金増加額又は欠損金減少額	651,334,109	953,043,416
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	651,334,109	953,043,416
剰余金減少額又は欠損金増加額	311,850,331	414,215,844
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	311,850,331	414,215,844
分配金	※1	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,606,110,468	6,246,518,617

(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 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 16 期 2022 年 11 月 30 日現在	第 17 期 2023 年 11 月 30 日現在
1. ※1 期首元本額	5,131,859,993 円	5,749,707,544 円
期中追加設定元本額	1,194,983,326 円	1,201,437,954 円
期中一部解約元本額	577,135,775 円	651,027,989 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	5,749,707,544 口	6,300,117,509 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 16 期 自 2021 年 12 月 1 日 至 2022 年 11 月 30 日	第 17 期 自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 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 (491,340,924 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (3,561,281,191 円) 及び分配準備積立金 (1,730,150,536 円) より分配対象額は 5,782,772,651 円 (1 万口当たり 10,057.51 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 (2,101,582,148 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (4,342,748,433 円) 及び分配準備積立金 (1,993,592,199 円) より分配対象額は 8,437,922,780 円 (1 万口当たり 13,393.28 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 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 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。

区分	第 17 期 自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日
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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 17 期 2023 年 11 月 30 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 2022 年 11 月 30 日現在	第 17 期 2023 年 11 月 30 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	509,169,047	2,178,579,291
合計	509,169,047	2,178,579,291

(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 2022 年 11 月 30 日現在	第 17 期 2023 年 11 月 30 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2022年12月1日
至2023年11月30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 2022年11月30日現在	第17期 2023年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6272円 (16,272円)	1.9915円 (19,915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	7,362,939,711	12,545,712,973	
親投資信託受益証券 合計			12,545,712,973	
合計			12,545,712,973	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年11月30日現在 金額(円)	2023年11月30日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,597,232,619	11,318,400,016
株式 ※2※3	199,365,246,780	278,401,688,320
派生商品評価勘定	252,089,300	145,283,800
未収入金	22,308,117	17,079,700
未収配当金	1,574,706,818	1,959,196,490
未収利息	656,842	550,242
その他未収収益 ※4	15,277,058	13,627,126
差入委託証拠金	13,280,000	53,472,780
流動資産合計	213,840,797,534	291,909,298,474
資産合計	213,840,797,534	291,909,298,474
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,899,900	1,249,200
前受金	257,225,000	129,325,000
未払金	-	20,441,625
未払解約金	298,031,030	105,766,530
受入担保金	7,992,907,366	7,260,574,102
流動負債合計	8,550,063,296	7,517,356,457
負債合計	8,550,063,296	7,517,356,457
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	147,745,976,638	166,904,971,223
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	57,544,757,600	117,486,970,794
元本等合計	205,290,734,238	284,391,942,017
純資産合計	205,290,734,238	284,391,942,017
負債純資産合計	213,840,797,534	291,909,298,474

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 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。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022 年 11 月 30 日現在	2023 年 11 月 30 日現在
1. ※1 期首	2021 年 12 月 1 日	2022 年 12 月 1 日
期首元本額	139,094,932,448 円	147,745,976,638 円
期中追加設定元本額	22,455,105,001 円	33,173,755,669 円
期中一部解約元本額	13,804,060,811 円	14,014,761,084 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックスファンド	2,868,987,712 円	2,805,574,007 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	4,779,931,786 円	4,373,834,835 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	917,791 円	911,362 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	22,001,280 円	15,019,052 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	283,754,331 円	192,250,160 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	20,586,631 円	13,126,071 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	571,049,427 円	414,927,130 円

区分	2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	-円	335,163,355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）	461,873,574円	677,458,015円
D-I's TOPIXインデックス	29,463,339円	13,684,283円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	216,770,163円	248,960,497円
iFree TOPIXインデックス	6,249,961,543円	7,247,259,131円
iFree 8資産バランス	4,259,741,459円	4,606,729,135円
iFree 年金バランス	788,377,659円	999,756,008円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	638,850円
DCダイワ日本株式インデックス	69,173,293,158円	70,849,239,578円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,306,033,755円	3,130,739,193円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,756,270,267円	4,922,236,693円
ダイワ・ライフ・バランス70	4,672,940,801円	5,657,702,841円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,732,752,455円	7,362,939,711円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	57,574,140円	54,910,538円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	70,614,624円	75,461,317円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,701,356,905円	4,784,147,220円
ダイワつみたてインデックスバランス30	11,751,428円	12,447,223円
ダイワつみたてインデックスバランス50	10,416,225円	11,579,092円
ダイワつみたてインデックスバランス70	26,427,874円	29,768,814円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	1,913,542,032円	11,296,011,297円
ダイワ世界バランスファンド40VA	79,912,966円	54,608,372円
ダイワ世界バランスファンド60VA	34,293,201円	20,876,356円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,068,797,182円	3,793,959,218円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	454,578,946円	350,586,677円
ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	62,260,889円	51,746,439円
ダイワ国内バランスファンド30VA（適格機関投資家専用）	104,389,988円	73,719,521円
ダイワ・ノーロード TOPIX ファンド	200,763,198円	236,956,098円

区分	2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	11,679,378,364 円	12,428,283,316 円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	1,850,371,567 円	6,094,958,950 円
ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	3,206,509,611 円	3,354,073,654 円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,201,006,985 円	1,171,702,165 円
ダイワライフスタイル25	135,418,737 円	108,414,945 円
ダイワライフスタイル50	552,924,023 円	483,952,477 円
ダイワライフスタイル75	422,585,053 円	404,489,561 円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス (確定拠出年金専用ファンド)	8,706,395,569 円	8,144,168,066 円
計	147,745,976,638 円	166,904,971,223 円
2. 期末日における受益権の総数	147,745,976,638 口	166,904,971,223 口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,569,896,520 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 6,909,195,160 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 902,690,000 円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 1,209,560,000 円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年12月1日 至2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。

区分	自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 11 月 30 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	2022 年 11 月 30 日現在	2023 年 11 月 30 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	4, 104, 712, 548	△5, 884, 432, 916
合計	4, 104, 712, 548	△5, 884, 432, 916

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2022 年 11 月 30 日現在				2023 年 11 月 30 日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								

種類	2022年11月30日現在				2023年11月30日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
株価指数 先物取引								
買建	5,560,450,000	-	5,810,800,000	250,350,000	5,273,120,000	-	5,417,280,000	144,160,000
合計	5,560,450,000	-	5,810,800,000	250,350,000	5,273,120,000	-	5,417,280,000	144,160,000

- (注)
1. 時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場
場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も
近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
 2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
 3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
 4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2022年11月30日現在	2023年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.3895円	1.7039円
(1万口当たり純資産額)	(13,895円)	(17,039円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極 洋	4,500	3,830.00	17,235,000	
ニッスイ	116,200	737.40	85,685,880	
マルハニチロ	17,400	2,840.00	49,416,000	
雪国まいたけ	10,100	950.00	9,595,000	
カネコ種苗	3,700	1,422.00	5,261,400	
サカタのタネ	13,200	3,985.00	52,602,000	
ホクト	9,400	1,754.00	16,487,600	
ホクリヨウ	1,100	1,147.00	1,261,700	貸付株式数 400株
ショーボンドHD	15,800	6,025.00	95,195,000	
ミライト・ワン	38,300	1,846.50	70,720,950	
タマホーム	7,300	3,480.00	25,404,000	貸付株式数 2,900株
サンヨーホームズ	800	724.00	579,200	
日本アクア	2,600	935.00	2,431,000	
ファーストコーポレーション	1,600	738.00	1,180,800	貸付株式数 700株
ベステラ	1,500	1,036.00	1,554,000	貸付株式数 600株 (600株)
キャンディル	1,100	579.00	636,900	貸付株式数 700株
住石ホールディングス	11,400	772.00	8,800,800	貸付株式数 5,100株
日鉄鉱業	4,600	5,650.00	25,990,000	
三井松島HLDGS	6,900	2,818.00	19,444,200	貸付株式数 2,700株
INPEX	428,200	2,090.00	894,938,000	貸付株式数 171,000株
石油資源開発	13,400	5,690.00	76,246,000	
K&Oエナジーグループ	5,200	2,189.00	11,382,800	
ダイセキ環境ソリューション	1,300	1,023.00	1,329,900	
第一カッター興業	2,900	1,307.00	3,790,300	
明豊ファシリティワークス	2,300	805.00	1,851,500	
安藤・間	67,000	1,092.00	73,164,000	
東急建設	36,200	788.00	28,525,600	
コムシスホールディングス	37,000	3,207.00	118,659,000	
ビーアールホールディングス	16,900	359.00	6,067,100	
高松コンストラクションGP	8,600	2,637.00	22,678,200	
東建コーポレーション	3,300	8,100.00	26,730,000	
ソネック	700	952.00	666,400	
ヤマウラ	5,800	1,438.00	8,340,400	貸付株式数 200株
オリエンタル白石	42,500	330.00	14,025,000	
大成建設	75,800	5,031.00	381,349,800	
大林組	289,700	1,247.50	361,400,750	
清水建設	229,700	971.60	223,176,520	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
飛島建設	8,300	1,299.00	10,781,700	
長谷工コーポレーション	74,300	1,818.50	135,114,550	貸付株式数 28,500 株
松井建設	7,500	775.00	5,812,500	
銭高組	700	3,850.00	2,695,000	貸付株式数 200 株
鹿島建設	179,600	2,336.50	419,635,400	
不動テトラ	5,600	2,189.00	12,258,400	
大末建設	1,800	1,352.00	2,433,600	
鉄建建設	5,800	1,953.00	11,327,400	
西松建設	15,400	3,914.00	60,275,600	
三井住友建設	60,100	398.00	23,919,800	
大豊建設	2,800	3,650.00	10,220,000	貸付株式数 700 株
佐田建設	2,800	656.00	1,836,800	
ナカノフドー建設	3,300	452.00	1,491,600	
奥村組	13,100	4,515.00	59,146,500	
東鉄工業	10,000	2,902.00	29,020,000	
イチケン	1,100	2,300.00	2,530,000	
富士ピー・エス	2,000	445.00	890,000	
浅沼組	5,900	3,695.00	21,800,500	
戸田建設	109,600	844.30	92,535,280	
熊谷組	13,500	3,400.00	45,900,000	
北野建設	800	3,100.00	2,480,000	
植木組	1,300	1,456.00	1,892,800	
矢作建設	11,000	1,286.00	14,146,000	
ピーエス三菱	10,200	941.00	9,598,200	
日本ハウスHLDGS	17,100	326.00	5,574,600	貸付株式数 6,800 株
大東建託	29,800	16,300.00	485,740,000	
新日本建設	11,400	1,111.00	12,665,400	
東亜道路	3,200	6,690.00	21,408,000	
日本道路	9,500	1,897.00	18,021,500	
東亜建設	6,200	3,575.00	22,165,000	貸付株式数 2,400 株
日本国土開発	22,800	589.00	13,429,200	
若築建設	2,800	2,946.00	8,248,800	
東洋建設	20,300	1,330.00	26,999,000	
五洋建設	114,900	810.40	93,114,960	
世紀東急	10,400	1,664.00	17,305,600	貸付株式数 4,100 株
福田組	3,000	5,220.00	15,660,000	貸付株式数 1,200 株
日本ドライケミカル	1,100	2,578.00	2,835,800	貸付株式数 100 株
住友林業	70,000	3,774.00	264,180,000	
日本基礎技術	2,700	450.00	1,215,000	
巴コーポレーション	5,700	560.00	3,192,000	
大和ハウス	224,000	4,199.00	940,576,000	
ライト工業	16,700	1,980.00	33,066,000	
積水ハウス	245,700	3,029.00	744,225,300	
日特建設	7,700	1,028.00	7,915,600	
北陸電気工事	5,500	945.00	5,197,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ユアテック	17,700	1,003.00	17,753,100	
日本リーテック	6,300	1,257.00	7,919,100	
四電工	3,400	2,908.00	9,887,200	
中電工	12,500	2,431.00	30,387,500	
関電工	50,700	1,328.00	67,329,600	
きんでん	57,000	2,219.50	126,511,500	
東京エネシス	8,100	965.00	7,816,500	
トーエネック	2,600	4,245.00	11,037,000	
住友電設	7,700	2,557.00	19,688,900	
日本電設工業	15,200	2,024.00	30,764,800	
エクシオグループ	40,700	3,118.00	126,902,600	
新日本空調	5,200	2,235.00	11,622,000	
九電工	17,500	4,663.00	81,602,500	
三機工業	17,500	1,750.00	30,625,000	
日揮ホールディングス	80,200	1,661.50	133,252,300	
中外炉工業	2,700	2,239.00	6,045,300	
ヤマト	3,700	941.00	3,481,700	
太平電業	5,000	3,875.00	19,375,000	
高砂熱学	21,700	2,999.00	65,078,300	
三晃金属	600	4,700.00	2,820,000	
NEC ネットズエスアイ	32,300	2,159.00	69,735,700	
朝日工業社	3,800	2,798.00	10,632,400	
明星工業	15,700	1,120.00	17,584,000	
大気社	9,300	4,230.00	39,339,000	
ダイダン	10,600	1,480.00	15,688,000	
日比谷総合設備	5,800	2,358.00	13,676,400	
ニッポン	24,600	2,274.00	55,940,400	
日清製粉G本社	75,300	2,048.50	154,252,050	
日東富士製粉	1,500	4,720.00	7,080,000	
昭和産業	8,000	3,060.00	24,480,000	
鳥越製粉	4,600	715.00	3,289,000	貸付株式数 1,800 株
中部飼料	11,600	1,085.00	12,586,000	
フィード・ワン	12,200	792.00	9,662,400	
東洋精糖	900	2,018.00	1,816,200	
日本甜菜糖	4,900	2,013.00	9,863,700	
DM三井製糖ホールディ	8,200	3,020.00	24,764,000	
塩水港精糖	6,700	234.00	1,567,800	
ウェルネオシュガー	4,200	2,064.00	8,668,800	貸付株式数 1,400 株
LIFULL	29,000	196.00	5,684,000	貸付株式数 10,900 株
MIXI	18,200	2,417.00	43,989,400	
ジェイエイシーリクルート メント	7,600	2,661.00	20,223,600	
日本M&Aセンターホール デ	135,300	685.20	92,707,560	
メンバーズ	2,900	1,100.00	3,190,000	貸付株式数 900 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
中広	700	412.00	288,400	
UTグループ	11,200	2,215.00	24,808,000	
アイティメディア	3,200	972.00	3,110,400	貸付株式数 1,200株
E・Jホールディングス	5,000	1,605.00	8,025,000	貸付株式数 1,900株
オープンアップグループ	25,500	2,159.00	55,054,500	貸付株式数 9,600株
コシダカホールディングス	25,400	1,043.00	26,492,200	
アルトナー	2,000	1,807.00	3,614,000	貸付株式数 500株
パソナグループ	10,200	2,345.00	23,919,000	
CDS	1,200	1,732.00	2,078,400	
リンクアンドモチベーション	24,400	586.00	14,298,400	貸付株式数 9,100株
エス・エム・エス	29,700	2,810.00	83,457,000	
サニーサイドアップG	1,400	619.00	866,600	貸付株式数 100株
パーソルホールディングス	864,100	254.80	220,172,680	
リニカル	3,000	530.00	1,590,000	
クックパッド	23,100	119.00	2,748,900	貸付株式数 1,700株
エスクリ	1,900	283.00	537,700	貸付株式数 1,200株
アイ・ケイ・ケイホールディング	2,400	678.00	1,627,200	貸付株式数 900株
森永製菓	17,500	5,277.00	92,347,500	
中村屋	2,100	3,070.00	6,447,000	貸付株式数 600株
江崎グリコ	23,400	4,079.00	95,448,600	
名糖産業	3,400	1,635.00	5,559,000	貸付株式数 1,200株
井村屋グループ	5,000	2,319.00	11,595,000	
不二家	5,600	2,501.00	14,005,600	貸付株式数 2,200株
山崎製パン	54,500	3,235.00	176,307,500	
第一屋製パン	1,000	695.00	695,000	
モロゾフ	2,700	3,885.00	10,489,500	
亀田製菓	4,700	3,885.00	18,259,500	
寿スピリッツ	38,400	2,348.00	90,163,200	
カルビー	37,300	2,769.00	103,283,700	
森永乳業	29,600	2,760.00	81,696,000	
六甲バター	6,200	1,384.00	8,580,800	貸付株式数 2,300株
ヤクルト	116,300	3,303.00	384,138,900	
明治ホールディングス	99,800	3,423.00	341,615,400	
雪印メグミルク	19,800	2,163.00	42,827,400	
プリマハム	11,100	2,250.00	24,975,000	
日本ハム	35,100	4,394.00	154,229,400	
林兼産業	1,900	599.00	1,138,100	貸付株式数 600株
丸大食品	8,400	1,617.00	13,582,800	
S Foods	9,000	3,205.00	28,845,000	
柿安本店	3,100	2,476.00	7,675,600	貸付株式数 800株
伊藤ハム米久HLDGS	12,500	3,950.00	49,375,000	
学情	4,300	2,021.00	8,690,300	貸付株式数 200株
スタジオアリス	4,200	2,064.00	8,668,800	貸付株式数 1,600株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
クロスキャット	5,200	1,127.00	5,860,400	貸付株式数 500株
シミックホールディングス	4,100	2,644.00	10,840,400	
エプコ	1,300	810.00	1,053,000	貸付株式数 100株
システナ	125,500	296.00	37,148,000	
N J S	1,800	2,827.00	5,088,600	貸付株式数 700株
デジタルアーツ	5,200	4,815.00	25,038,000	
日鉄ソリューションズ	14,100	4,645.00	65,494,500	
総合警備保障	141,800	856.80	121,494,240	
キューブシステム	4,400	1,112.00	4,892,800	貸付株式数 1,800株
いちご	93,900	351.00	32,958,900	
日本駐車場開発	86,000	204.00	17,544,000	
コア	3,700	1,779.00	6,582,300	
カカコム	56,100	1,677.50	94,107,750	
アイロムグループ	3,400	2,031.00	6,905,400	貸付株式数 1,100株
セントケア・ホールディング	6,100	936.00	5,709,600	貸付株式数 2,000株
サイネックス	800	838.00	670,400	
ルネサンス	6,600	865.00	5,709,000	貸付株式数 2,600株
ディップ	13,000	3,170.00	41,210,000	
S B Sホールディングス	7,300	2,507.00	18,301,100	
デジタルホールディングス	4,500	1,265.00	5,692,500	
新日本科学	7,700	1,647.00	12,681,900	貸付株式数 3,300株
キャリアデザインセンター	1,000	2,015.00	2,015,000	
ベネフィット・ワン	29,500	1,515.00	44,692,500	
エムスリー	167,700	2,445.50	410,110,350	
ツカダ・グローバルHOLD	3,100	384.00	1,190,400	貸付株式数 600株
プラス	500	698.00	349,000	貸付株式数 200株
アウトソーシング	54,500	1,200.00	65,400,000	
ウェルネット	3,600	565.00	2,034,000	貸付株式数 1,600株
ワールドホールディングス	3,800	2,711.00	10,301,800	貸付株式数 400株
ディー・エヌ・エー	30,100	1,504.00	45,270,400	
博報堂DYHLDGS	108,300	1,115.50	120,808,650	
ぐるなび	16,000	294.00	4,704,000	
タカミヤ	11,400	456.00	5,198,400	
ジャパンベストレスキュー	4,100	997.00	4,087,700	
ファンコミュニケーションズ	11,900	417.00	4,962,300	
ライク	3,100	1,364.00	4,228,400	貸付株式数 100株
A o b a - B B T	1,700	424.00	720,800	貸付株式数 800株
エスプール	24,400	397.00	9,686,800	貸付株式数 9,700株
WDBホールディングス	4,300	2,313.00	9,945,900	
手間いらず	1,400	2,496.00	3,494,400	
ティア	2,700	460.00	1,242,000	貸付株式数 1,100株
CDG	500	1,249.00	624,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アドウェイズ	11,700	551.00	6,446,700	貸付株式数 4,600 株
バリューコマース	7,500	1,386.00	10,395,000	
インフォマート	88,100	441.00	38,852,100	
サッポロホールディングス	26,800	5,766.00	154,528,800	
アサヒグループホールディングン	187,900	5,455.00	1,024,994,500	貸付株式数 75,000 株
麒麟HD	338,900	2,087.00	707,284,300	貸付株式数 135,200 株
宝ホールディングス	55,700	1,215.00	67,675,500	
オエノンホールディングス	24,500	374.00	9,163,000	
養命酒	2,800	1,873.00	5,244,400	貸付株式数 700 株
コカ・コーラボトラーズJHD	63,900	2,025.50	129,429,450	
サントリー食品インター	57,300	4,648.00	266,330,400	
ダイドーグループHD	4,700	5,980.00	28,106,000	貸付株式数 1,500 株
伊藤園	27,600	4,495.00	124,062,000	
キーコーヒー	9,300	2,068.00	19,232,400	
ユニカフェ	1,700	957.00	1,626,900	貸付株式数 700 株
ジャパンフーズ	900	1,169.00	1,052,100	
日清オイリオグループ	11,500	4,185.00	48,127,500	
不二製油グループ	19,000	2,322.00	44,118,000	
かどや製油	600	3,560.00	2,136,000	
J-オイルミルズ	9,600	1,973.00	18,940,800	
ローソン	18,600	7,321.00	136,170,600	
サンエー	6,600	4,600.00	30,360,000	貸付株式数 1,300 株
カワチ薬品	6,800	2,551.00	17,346,800	
エービーシー・マート	38,200	2,440.50	93,227,100	
ハードオフコーポレーション	2,700	1,530.00	4,131,000	
高千穂交易	2,400	3,400.00	8,160,000	貸付株式数 1,000 株
アスクル	18,000	2,159.00	38,862,000	貸付株式数 7,200 株
ゲオホールディングス	9,800	2,347.00	23,000,600	貸付株式数 3,200 株
アダストリア	10,500	3,800.00	39,900,000	貸付株式数 3,600 株
ジフット	3,800	288.00	1,094,400	貸付株式数 1,200 株
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	600	688.00	412,800	貸付株式数 200 株
オルパヘルスケアHLDGS	700	1,757.00	1,229,900	
伊藤忠食品	2,000	7,160.00	14,320,000	
くら寿司	10,200	3,675.00	37,485,000	貸付株式数 2,800 株
キャンドゥ	3,100	2,619.00	8,118,900	貸付株式数 1,100 株
エレマテック	7,800	1,767.00	13,782,600	
IKホールディングス	1,500	340.00	510,000	貸付株式数 300 株
パルグループHLDGS	17,100	2,336.00	39,945,600	
エディオン	34,500	1,485.00	51,232,500	貸付株式数 13,800 株
あらた	6,700	6,250.00	41,875,000	
サーラコーポレーション	18,200	711.00	12,940,200	貸付株式数 7,000 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ワッツ	2,300	578.00	1,329,400	貸付株式数 1,000株
トーメンデバイス	1,300	5,300.00	6,890,000	
ハローズ	3,900	4,145.00	16,165,500	貸付株式数 400株
J Pホールディングス	21,700	391.00	8,484,700	貸付株式数 1,200株
フジオフードG本社	9,700	1,444.00	14,006,800	貸付株式数 3,800株 (100株)
あみやき亭	2,100	3,660.00	7,686,000	貸付株式数 600株
東京エレクトロデバイス	8,700	4,875.00	42,412,500	
ひらまつ	11,300	248.00	2,802,400	貸付株式数 5,200株
円谷フィールズホールディ	15,000	1,126.00	16,890,000	貸付株式数 5,400株
双日	97,300	3,293.00	320,408,900	
アルフレッサホールディン グス	87,700	2,377.50	208,506,750	
大黒天物産	2,700	6,160.00	16,632,000	貸付株式数 1,000株
ハニーズホールディングス	6,900	1,672.00	11,536,800	貸付株式数 2,600株
ファーマライズHD	1,000	640.00	640,000	貸付株式数 500株
キッコーマン	53,900	9,065.00	488,603,500	
味の素	193,200	5,526.00	1,067,623,200	
ブルドックソース	4,400	2,092.00	9,204,800	
キューピー	43,900	2,580.00	113,262,000	
ハウス食品G本社	28,100	3,229.00	90,734,900	
カゴメ	35,100	3,177.00	111,512,700	
焼津水産化工	2,000	1,170.00	2,340,000	
アリアケジャパン	8,100	4,615.00	37,381,500	
ピエトロ	600	1,823.00	1,093,800	
エバラ食品工業	2,000	2,834.00	5,668,000	貸付株式数 200株
やまみ	500	3,105.00	1,552,500	
ニチレイ	37,300	3,224.00	120,255,200	
横浜冷凍	23,900	1,109.00	26,505,100	
東洋水産	41,100	7,870.00	323,457,000	
イトアンドHLDGS	3,700	2,045.00	7,566,500	貸付株式数 1,400株 (100株)
大冷	800	1,928.00	1,542,400	
ヨシムラ・フード・HLD GS	3,700	1,114.00	4,121,800	貸付株式数 1,800株
日清食品HD	28,600	14,665.00	419,419,000	
永谷園ホールディングス	4,100	2,169.00	8,892,900	
一正蒲鉾	2,200	738.00	1,623,600	貸付株式数 300株
フジッコ	8,600	1,936.00	16,649,600	
ロックフィールド	9,300	1,591.00	14,796,300	貸付株式数 1,500株
日本たばこ産業	494,200	3,801.00	1,878,454,200	貸付株式数 197,300株
ケンコーマヨネーズ	5,700	1,615.00	9,205,500	
わらべや日洋HD	5,500	3,485.00	19,167,500	
なとり	5,300	2,035.00	10,785,500	
イフジ産業	900	1,342.00	1,207,800	貸付株式数 200株
ファーマフーズ	11,700	1,283.00	15,011,100	貸付株式数 4,600株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
北の達人コーポ	34,800	208.00	7,238,400	貸付株式数 13,900株 (1,300株)
ユーグレナ	50,500	746.00	37,673,000	貸付株式数 20,200株
紀文食品	7,200	1,152.00	8,294,400	貸付株式数 100株
ピクルスホールディングス	4,900	1,207.00	5,914,300	貸付株式数 1,200株
スター・マイカ・HLDG S	9,400	607.00	5,705,800	
SREホールディングス	3,500	2,774.00	9,709,000	貸付株式数 1,500株
ADワークスグループ	11,600	246.00	2,853,600	貸付株式数 2,800株
片倉工業	7,600	1,677.00	12,745,200	貸付株式数 2,600株
グンゼ	5,900	4,800.00	28,320,000	
ヒューリック	189,800	1,468.00	278,626,400	貸付株式数 75,700株
神栄	700	1,781.00	1,246,700	
ラサ商事	3,100	1,509.00	4,677,900	貸付株式数 900株
アルペン	7,100	1,950.00	13,845,000	貸付株式数 2,800株
ハブ	1,500	720.00	1,080,000	
ラクーンホールディングス	6,900	681.00	4,698,900	貸付株式数 2,600株
クオールホールディングス	12,000	1,706.00	20,472,000	
アルコニックス	11,600	1,320.00	15,312,000	
神戸物産	67,600	3,904.00	263,910,400	
ソリトンシステムズ	4,200	1,276.00	5,359,200	
ジンズホールディングス	5,200	4,695.00	24,414,000	貸付株式数 2,000株
ビックカメラ	46,400	1,221.00	56,654,400	貸付株式数 18,000株
DCMホールディングス	46,100	1,279.00	58,961,900	
ペッパーフードサービス	19,900	109.00	2,169,100	貸付株式数 200株
ハイパー	1,100	346.00	380,600	貸付株式数 400株
Monotaro	123,800	1,493.00	184,833,400	
東京一番フーズ	1,100	501.00	551,100	
DDグループ	3,100	1,333.00	4,132,300	貸付株式数 1,200株
あいホールディングス	14,000	2,472.00	34,608,000	
ディービーエックス	1,300	1,017.00	1,322,100	
きちりホールディングス	1,100	1,025.00	1,127,500	貸付株式数 500株
J. フロントリテイリング	100,300	1,354.50	135,856,350	
ドトール・日レスHD	15,500	2,195.00	34,022,500	
マツキヨココカラ&カンパニー	158,900	2,553.50	405,751,150	
ブロンコビリー	5,100	3,160.00	16,116,000	貸付株式数 1,900株
ZOZO	57,700	3,125.00	180,312,500	
トレジャー・ファクトリー	4,200	1,263.00	5,304,600	貸付株式数 1,600株
物語コーポレーション	14,600	3,880.00	56,648,000	
三越伊勢丹HD	147,200	1,671.00	245,971,200	
東洋紡	35,700	1,052.00	37,556,400	
ユニチカ	26,900	183.00	4,922,700	
富士紡ホールディングス	3,600	3,690.00	13,284,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日清紡ホールディングス	62,700	1,086.50	68,123,550	
倉敷紡績	6,200	2,557.00	15,853,400	
ダイワボウHD	38,700	2,909.50	112,597,650	
シキボウ	3,700	1,093.00	4,044,100	
日東紡績	10,500	4,495.00	47,197,500	
トヨタ紡織	34,800	2,550.00	88,740,000	
マクニカホールディングス	20,700	7,313.00	151,379,100	
H a m e e	3,000	1,014.00	3,042,000	
マーケットエンタープライズ	500	1,202.00	601,000	貸付株式数 200株
ラクト・ジャパン	3,400	1,951.00	6,633,400	貸付株式数 1,300株
ウエルシアHD	45,300	2,584.00	117,055,200	貸付株式数 18,100株
クリエイトSDH	14,400	3,060.00	44,064,000	貸付株式数 5,100株
グリムス	3,700	2,106.00	7,792,200	
バイタルKSKHD	13,200	1,071.00	14,137,200	
八洲電機	7,000	1,271.00	8,897,000	貸付株式数 200株
メディアスホールディングス	5,500	772.00	4,246,000	
レスターホールディングス	7,400	2,683.00	19,854,200	
ジオリーブグループ	1,100	1,245.00	1,369,500	貸付株式数 500株
丸善CHI HD	5,600	329.00	1,842,400	
大光	2,300	638.00	1,467,400	貸付株式数 1,100株
OCHIホールディングス	1,100	1,425.00	1,567,500	
TOKAIホールディングス	47,300	941.00	44,509,300	
黒谷	1,300	583.00	757,900	
ミサワ	1,000	634.00	634,000	
ティーライフ	700	1,417.00	991,900	貸付株式数 100株
C o m i n i x	900	789.00	710,100	
エー・ピーホールディングス	1,100	903.00	993,300	貸付株式数 500株
三洋貿易	9,900	1,313.00	12,998,700	
チムニー	1,500	1,387.00	2,080,500	貸付株式数 700株
シュッピン	7,900	1,238.00	9,780,200	貸付株式数 3,100株
ビューティガレージ	2,700	2,520.00	6,804,000	
オイシックス・ラ・大地	11,700	1,393.00	16,298,100	貸付株式数 4,600株
ウイン・パートナーズ	5,500	1,192.00	6,556,000	貸付株式数 500株
ネクステージ	19,900	2,289.00	45,551,100	貸付株式数 7,500株
ジョイフル本田	25,400	1,792.00	45,516,800	貸付株式数 1,500株
鳥貴族ホールディングス	3,200	2,838.00	9,081,600	貸付株式数 1,200株 (100株)
ホットランド	6,600	1,972.00	13,015,200	貸付株式数 2,500株
すかいらくHD	119,400	2,180.50	260,351,700	貸付株式数 47,700株
SFPホールディングス	4,800	2,233.00	10,718,400	貸付株式数 1,900株
綿半ホールディングス	6,600	1,370.00	9,042,000	
日本毛織	21,800	1,295.00	28,231,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ダイトウボウ	7,300	88.00	642,400	貸付株式数 5,300 株
トーア紡コーポレーション	1,800	460.00	828,000	貸付株式数 400 株
ダイドーリミテッド	6,600	400.00	2,640,000	貸付株式数 3,700 株
ヨシックスホールディングス	1,600	3,040.00	4,864,000	
ユナイテッド・スーパーマ ーケ	24,200	1,011.00	24,466,200	貸付株式数 10,900 株
野村不動産HLDGS	45,300	3,604.00	163,261,200	
三重交通グループHD	17,100	572.00	9,781,200	貸付株式数 2,700 株
サムティ	13,000	2,342.00	30,446,000	貸付株式数 5,000 株
地主	6,200	2,306.00	14,297,200	貸付株式数 2,300 株
プレサンスコーポレーショ ン	12,900	1,504.00	19,401,600	貸付株式数 5,100 株
フィル・カンパニー	1,300	596.00	774,800	貸付株式数 500 株
ハウコム	700	890.00	623,000	貸付株式数 300 株
JPMC	4,600	1,123.00	5,165,800	
サンセイランディック	1,300	1,062.00	1,380,600	貸付株式数 500 株
エストラスト	500	641.00	320,500	貸付株式数 200 株
フージャースHD	12,500	1,058.00	13,225,000	
オープンハウスグループ	29,800	4,128.00	123,014,400	
東急不動産HD	244,600	914.00	223,564,400	
飯田GHD	78,000	2,210.00	172,380,000	
イーランド	700	1,499.00	1,049,300	貸付株式数 300 株
帝国繊維	9,300	2,029.00	18,869,700	貸付株式数 3,600 株
日本コークス工業	83,800	122.00	10,223,600	
ゴルフダイジェスト・オン	3,900	677.00	2,640,300	貸付株式数 1,500 株
ミタチ産業	1,200	1,158.00	1,389,600	貸付株式数 600 株
BEENOS	3,600	1,495.00	5,382,000	貸付株式数 1,600 株
あさひ	8,100	1,317.00	10,667,700	
日本調剤	5,900	1,288.00	7,599,200	貸付株式数 200 株
コスモス薬品	8,600	15,650.00	134,590,000	貸付株式数 3,400 株
シップヘルスケアHD	31,400	2,087.50	65,547,500	
トーエル	2,100	702.00	1,474,200	貸付株式数 900 株
ソフトクリエイトHD	6,800	1,695.00	11,526,000	
セブン&アイ・HLDGS	301,100	5,495.00	1,654,544,500	
クリエイト・レストラン ツ・ホール	59,100	1,045.00	61,759,500	貸付株式数 23,900 株
明治電機工業	3,400	1,430.00	4,862,000	
ツルハホールディングス	18,300	12,440.00	227,652,000	
デリカフーズHLDGS	2,400	594.00	1,425,600	
スターティアホールディン グス	1,200	1,334.00	1,600,800	貸付株式数 400 株
サンマルクホールディン グス	6,900	1,998.00	13,786,200	
フェリシモ	1,100	913.00	1,004,300	貸付株式数 400 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
トリドールホールディングス	24,400	4,151.00	101,284,400	貸付株式数 6,400株
帝人	79,500	1,345.50	106,967,250	
東レ	554,300	767.10	425,203,530	
クラレ	120,500	1,504.50	181,292,250	
旭化成	559,600	1,026.50	574,429,400	
TOKYO BASE	10,400	271.00	2,818,400	貸付株式数 4,100株
稲葉製作所	4,400	1,486.00	6,538,400	貸付株式数 1,700株
宮地エンジニアリングG	4,300	3,185.00	13,695,500	貸付株式数 1,600株
トーカロ	24,600	1,438.00	35,374,800	
アルファCO	1,700	1,483.00	2,521,100	
SUMCO	151,400	2,216.50	335,578,100	
川田テクノロジーズ	2,000	7,000.00	14,000,000	
RS TECHNOLOGIES	5,700	2,862.00	16,313,400	
ジェイテックコーポレーション	600	2,040.00	1,224,000	貸付株式数 200株
信和	3,100	740.00	2,294,000	貸付株式数 1,100株
ビーロット	3,200	1,007.00	3,222,400	貸付株式数 1,200株
ファーストブラザーズ	1,000	1,008.00	1,008,000	貸付株式数 400株 (400株)
AND DOホールディングス	4,900	1,045.00	5,120,500	貸付株式数 1,700株
シーアールイー	4,500	1,576.00	7,092,000	貸付株式数 400株 (200株)
ケイアイスター不動産	3,900	3,490.00	13,611,000	貸付株式数 1,500株
アグレ都市デザイン	800	1,509.00	1,207,200	
ジェイ・エス・ビー	4,000	2,561.00	10,244,000	
ロードスターキャピタル	5,300	2,200.00	11,660,000	
テンポイノベーション	1,300	1,114.00	1,448,200	貸付株式数 600株
グローバルリンクマネジメント	800	2,471.00	1,976,800	貸付株式数 400株
フェイスネットワーク	1,200	1,390.00	1,668,000	貸付株式数 600株
霞ヶ関キャピタル	1,900	9,120.00	17,328,000	
住江織物	900	2,247.00	2,022,300	
日本フェルト	2,700	423.00	1,142,100	
イチカワ	600	1,627.00	976,200	
エコナックホールディングス	4,300	143.00	614,900	
日東製網	500	1,472.00	736,000	貸付株式数 100株
芦森工業	900	2,202.00	1,981,800	
アツギ	3,100	467.00	1,447,700	
ウイルプラスHLDGS	800	1,090.00	872,000	貸付株式数 400株
JMホールディングス	6,500	2,077.00	13,500,500	
コマダホールディングス	21,300	2,767.00	58,937,100	
サツドラホールディングス	2,100	771.00	1,619,100	貸付株式数 1,100株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アレンザホールディングス	6,400	1,014.00	6,489,600	貸付株式数 700株
串カツ田中HLDGS	2,300	1,625.00	3,737,500	貸付株式数 900株
バロックジャパン	6,800	820.00	5,576,000	貸付株式数 2,700株
クスリのアオキHLDGS	23,400	3,422.00	80,074,800	
ダイニック	1,400	725.00	1,015,000	
共和レザー	2,600	728.00	1,892,800	
ピーバンドットコム	600	378.00	226,800	貸付株式数 200株
力の源HD	3,900	1,568.00	6,115,200	貸付株式数 1,500株
FOOD&LIFE COMPANY	46,600	2,863.00	133,415,800	
アセンテック	3,400	575.00	1,955,000	貸付株式数 100株
セーレン	15,900	2,320.00	36,888,000	貸付株式数 6,300株
ソトー	1,400	705.00	987,000	貸付株式数 100株
東海染工	400	942.00	376,800	
小松マテーレ	12,000	780.00	9,360,000	
ワコールホールディングス	16,900	3,255.00	55,009,500	
ホギメディカル	10,900	3,425.00	37,332,500	
クラウドディアHLDGS	1,000	407.00	407,000	貸付株式数 500株
TSIホールディングス	27,800	774.00	21,517,200	貸付株式数 9,800株
マツオカコーポレーション	1,400	1,518.00	2,125,200	
ワールド	11,700	1,630.00	19,071,000	
TIS	90,600	3,127.00	283,306,200	
テクミラホールディングス	2,100	471.00	989,100	貸付株式数 700株
グリー	22,100	568.00	12,552,800	
GMOペパボ	1,000	1,351.00	1,351,000	貸付株式数 400株
コーエーテクモHD	51,800	1,810.50	93,783,900	貸付株式数 16,700株
三菱総合研究所	4,100	4,805.00	19,700,500	
ボルテージ	1,300	263.00	341,900	貸付株式数 600株
電算	500	1,518.00	759,000	貸付株式数 200株
AGS	1,900	750.00	1,425,000	
ファインデックス	6,600	952.00	6,283,200	
ブレインパッド	6,200	1,024.00	6,348,800	貸付株式数 2,200株
KL a b	15,300	278.00	4,253,400	貸付株式数 5,700株
ポールトゥウィンホールディングン	14,100	535.00	7,543,500	
ネクソン	185,000	3,198.00	591,630,000	
アイスタイル	24,500	438.00	10,731,000	貸付株式数 9,800株 (4,000株)
エムアップホールディングス	10,100	1,018.00	10,281,800	
エイチーム	4,900	684.00	3,351,600	
エニグモ	10,600	383.00	4,059,800	貸付株式数 3,800株
テクノスジャパン	4,100	638.00	2,615,800	
enish	4,000	181.00	724,000	貸付株式数 1,600株
コロプラ	32,000	609.00	19,488,000	
オルトプラス	3,800	165.00	627,000	貸付株式数 1,500株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ブロードリーフ	39,300	566.00	22,243,800	
クロス・マーケティングG	2,700	567.00	1,530,900	貸付株式数 1,000株
デジタルハーツHLDGS	5,200	1,000.00	5,200,000	貸付株式数 2,000株
メディアドゥ	3,700	1,516.00	5,609,200	
じげん	24,100	538.00	12,965,800	
ブイキューブ	9,900	331.00	3,276,900	貸付株式数 3,800株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジー	1,000	519.00	519,000	貸付株式数 600株
サイバーリンクス	1,800	729.00	1,312,200	貸付株式数 1,000株
ディー・エル・イー	4,300	223.00	958,900	
フィックスターズ	9,300	1,356.00	12,610,800	
CARTA HOLDINGS	3,900	1,312.00	5,116,800	貸付株式数 1,400株
オプティム	8,400	846.00	7,106,400	貸付株式数 2,600株
セレス	3,300	915.00	3,019,500	貸付株式数 1,300株
SHIFT	5,500	34,440.00	189,420,000	
特種東海製紙	4,500	3,715.00	16,717,500	
ティーガイア	8,600	1,835.00	15,781,000	
セック	900	4,345.00	3,910,500	
テクマトリックス	15,100	1,735.00	26,198,500	
プロシップ	4,000	1,321.00	5,284,000	貸付株式数 1,200株
ガンホー・オンライン・エンター	21,500	2,292.00	49,278,000	
GMOペイメントゲートウェイ	16,500	8,707.00	143,665,500	
ザッパラス	1,200	488.00	585,600	貸付株式数 700株
システムリサーチ	2,800	3,590.00	10,052,000	貸付株式数 900株
インターネットイニシアティブ	39,600	2,657.00	105,217,200	
さくらインターネット	9,300	1,791.00	16,656,300	貸付株式数 3,700株
ヴィンクス	1,100	2,015.00	2,216,500	
GMOグローバルサインHD	2,500	2,491.00	6,227,500	貸付株式数 1,000株
SRAホールディングス	4,200	3,595.00	15,099,000	
システムインテグレータ	1,300	401.00	521,300	
朝日ネット	8,800	627.00	5,517,600	
eBASE	11,700	806.00	9,430,200	
アバントグループ	10,400	1,488.00	15,475,200	
アドソル日進	3,500	1,606.00	5,621,000	
ODKソリューションズ	900	575.00	517,500	貸付株式数 600株
フリービット	4,300	1,189.00	5,112,700	
コムチュア	11,900	2,015.00	23,978,500	
サイバーコム	700	1,900.00	1,330,000	
アステリア	6,500	727.00	4,725,500	貸付株式数 2,400株
アイル	3,900	3,570.00	13,923,000	
王子ホールディングス	344,500	549.20	189,199,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本製紙	46,600	1,337.00	62,304,200	
三菱製紙	6,200	530.00	3,286,000	貸付株式数 2,400 株
北越コーポレーション	40,600	1,409.00	57,205,400	貸付株式数 16,200 株
中越パルプ	1,900	1,726.00	3,279,400	貸付株式数 300 株
巴川製紙	1,300	744.00	967,200	貸付株式数 700 株
大王製紙	36,400	1,047.50	38,129,000	
阿波製紙	1,200	400.00	480,000	貸付株式数 400 株
マークラインズ	4,500	2,765.00	12,442,500	
メディカル・データ・ビジ	9,800	694.00	6,801,200	貸付株式数 4,400 株
g u m i	12,200	416.00	5,075,200	貸付株式数 4,800 株
ショーケース	1,000	399.00	399,000	貸付株式数 500 株
モバイルファクトリー	1,000	725.00	725,000	貸付株式数 400 株
テラスカイ	3,600	1,566.00	5,637,600	貸付株式数 1,400 株
デジタル・インフォメーシ ョン	4,800	1,636.00	7,852,800	
P C I ホールディングス	1,800	1,039.00	1,870,200	貸付株式数 200 株
アイビーシー	700	503.00	352,100	貸付株式数 200 株
ネオジャパン	2,700	1,038.00	2,802,600	貸付株式数 900 株
P R T I M E S	1,700	1,716.00	2,917,200	貸付株式数 600 株
ラクス	39,100	2,665.00	104,201,500	
ランドコンピュータ	2,200	928.00	2,041,600	
ダブルスタンダード	2,500	1,504.00	3,760,000	貸付株式数 1,200 株
オープンドア	4,900	723.00	3,542,700	貸付株式数 2,200 株
マイネット	1,400	307.00	429,800	貸付株式数 600 株
アカツキ	4,000	2,312.00	9,248,000	
ベネフィットジャパン	300	1,199.00	359,700	貸付株式数 200 株
U B I C O M ホールディン グス	2,600	1,709.00	4,443,400	
カナミックネットワーク	8,800	388.00	3,414,400	
ノムラシステムコーポレー ション	4,900	118.00	578,200	貸付株式数 2,800 株
レンゴー	75,200	935.50	70,349,600	
トーモク	4,700	2,174.00	10,217,800	
ザ・バック	6,100	3,215.00	19,611,500	貸付株式数 2,400 株
チェンジホールディングス	18,000	1,560.00	28,080,000	
シンクロ・フード	2,900	721.00	2,090,900	貸付株式数 1,300 株
オークネット	3,300	1,841.00	6,075,300	貸付株式数 1,500 株
キャピタル・アセット・プ ラン	900	724.00	651,600	
セグエグループ	1,400	916.00	1,282,400	貸付株式数 500 株
エイトレッド	700	1,378.00	964,600	
マクロミル	16,300	792.00	12,909,600	
ビーグリー	900	1,214.00	1,092,600	
オロ	3,000	2,494.00	7,482,000	貸付株式数 1,200 株
ユーザーローカル	3,000	1,722.00	5,166,000	貸付株式数 1,200 株
テモナ	1,000	239.00	239,000	貸付株式数 200 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ニーズウェル	2,500	729.00	1,822,500	貸付株式数 1,200株
マネーフワード	18,400	4,542.00	83,572,800	貸付株式数 6,700株
サインポスト	1,800	453.00	815,400	貸付株式数 800株
レゾナック・ホールディング	79,900	2,760.00	220,524,000	
住友化学	613,600	377.50	231,634,000	
住友精化	3,900	5,050.00	19,695,000	
日産化学	38,900	5,393.00	209,787,700	
ラサ工業	3,200	2,132.00	6,822,400	
クレハ	6,000	8,650.00	51,900,000	
多木化学	3,200	3,160.00	10,112,000	貸付株式数 1,200株
テイカ	7,100	1,325.00	9,407,500	
石原産業	13,700	1,373.00	18,810,100	
片倉コープアグリ	1,100	1,139.00	1,252,900	貸付株式数 400株
日本曹達	9,800	5,340.00	52,332,000	
東ソー	110,500	1,967.00	217,353,500	
トクヤマ	26,700	2,401.00	64,106,700	
セントラル硝子	8,800	2,719.00	23,927,200	
東亜合成	41,400	1,360.00	56,304,000	
大阪ソーダ	5,800	9,720.00	56,376,000	貸付株式数 2,300株
関東電化	16,000	830.00	13,280,000	
SUN ASTERISK	5,900	997.00	5,882,300	貸付株式数 2,300株
デンカ	30,100	2,645.00	79,614,500	
イビデン	43,500	7,071.00	307,588,500	
信越化学	750,000	5,212.00	3,909,000,000	
日本カーバイド	3,100	1,515.00	4,696,500	
電算システムHD	3,700	2,779.00	10,282,300	
堺化学	6,300	1,885.00	11,875,500	
第一稀元素化学工	9,000	995.00	8,955,000	貸付株式数 800株
エア・ウォーター	78,000	1,941.50	151,437,000	
日本酸素HLDGS	80,200	3,883.00	311,416,600	
日本化学工業	3,000	2,029.00	6,087,000	
東邦アセチレン	1,000	1,877.00	1,877,000	
日本パーカラライジング	36,900	1,154.00	42,582,600	貸付株式数 1,900株
高圧ガス	11,800	809.00	9,546,200	
チタン工業	600	1,288.00	772,800	貸付株式数 200株
四国化成ホールディング	10,600	1,747.00	18,518,200	
戸田工業	1,900	1,632.00	3,100,800	貸付株式数 600株
ステラ ケミファ	4,500	3,245.00	14,602,500	
保土谷化学	2,600	3,600.00	9,360,000	
日本触媒	12,600	5,351.00	67,422,600	
大日精化	5,800	2,217.00	12,858,600	
カネカ	21,000	3,713.00	77,973,000	
協和キリン	100,100	2,437.00	243,943,700	
APPIER GROUP	28,300	1,640.00	46,412,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
三菱瓦斯化学	61,800	2,337.50	144,457,500	
三井化学	68,200	4,328.00	295,169,600	
J S R	90,100	4,069.00	366,616,900	
東京応化工業	13,200	9,163.00	120,951,600	
大阪有機化学	6,900	2,669.00	18,416,100	
三菱ケミカルグループ	604,700	968.50	585,651,950	
KHネオケム	12,600	2,290.00	28,854,000	
ダイセル	106,300	1,421.00	151,052,300	
住友ベークライト	12,300	7,061.00	86,850,300	
積水化学	167,700	2,100.50	352,253,850	
日本ゼオン	56,700	1,374.00	77,905,800	
アイカ工業	20,800	3,325.00	69,160,000	
U B E	39,400	2,323.50	91,545,900	
積水樹脂	12,300	2,506.00	30,823,800	
タキロンシーアイ	20,900	589.00	12,310,100	
旭有機材	5,500	4,240.00	23,320,000	
ニチバン	4,400	1,758.00	7,735,200	
リケンテクノス	17,700	868.00	15,363,600	
大倉工業	3,800	2,818.00	10,708,400	貸付株式数 1,500株 (100株)
積水化成品	11,600	483.00	5,602,800	
群栄化学	1,900	3,085.00	5,861,500	
タイガース ポリマー	2,100	916.00	1,923,600	
ミライアル	1,600	1,519.00	2,430,400	貸付株式数 600株
ダイキアクシス	1,900	774.00	1,470,600	貸付株式数 700株
ダイキョーニシカワ	18,400	770.00	14,168,000	
竹本容器	1,700	794.00	1,349,800	
森六ホールディングス	4,700	2,960.00	13,912,000	
恵和	6,000	1,360.00	8,160,000	貸付株式数 2,300株
日本化薬	63,100	1,350.00	85,185,000	
カーリットホールディングス	9,000	945.00	8,505,000	貸付株式数 100株
ソルクシーズ	3,600	419.00	1,508,400	
C Lホールディングス	2,000	850.00	1,700,000	貸付株式数 800株
プレステージ・インター	39,700	651.00	25,844,700	
フェイス	1,300	489.00	635,700	貸付株式数 300株
プロトコーポレーション	9,000	1,340.00	12,060,000	
ハイマックス	2,500	1,420.00	3,550,000	
アミューズ	5,200	1,509.00	7,846,800	
野村総合研究所	183,500	4,152.00	761,892,000	
ドリームインキュベータ	2,800	3,230.00	9,044,000	貸付株式数 100株
サイバネットシステム	5,900	1,092.00	6,442,800	
クイック	5,900	2,257.00	13,316,300	
T A C	2,200	202.00	444,400	貸付株式数 200株
C Eホールディングス	2,400	620.00	1,488,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本システム技術	2,700	2,708.00	7,311,600	
電通グループ	83,400	3,985.00	332,349,000	
インテージホールディングス	9,300	1,640.00	15,252,000	
テイクアンドギヴニーズ	2,900	1,144.00	3,317,600	貸付株式数 800株
東邦システムサイエンス	2,700	1,216.00	3,283,200	
ぴあ	2,900	3,315.00	9,613,500	貸付株式数 1,100株
イオンファンタジー	3,000	2,602.00	7,806,000	貸付株式数 1,300株
ソースネクスト	38,000	187.00	7,106,000	貸付株式数 15,800株
シーティーエス	10,600	667.00	7,070,200	
ネクシィーズグループ	1,400	709.00	992,600	貸付株式数 500株
インフォコム	10,700	2,452.00	26,236,400	
メディカルシステムネットワーク	9,300	650.00	6,045,000	
日本精化	5,500	2,675.00	14,712,500	貸付株式数 1,600株
扶桑化学工業	8,700	4,385.00	38,149,500	
トリケミカル	10,000	3,510.00	35,100,000	
シンプレクスHD	12,400	2,620.00	32,488,000	
HEROZ	2,800	1,379.00	3,861,200	貸付株式数 1,100株
ラクスル	19,900	1,430.00	28,457,000	貸付株式数 2,900株
メルカリ	50,200	2,829.50	142,040,900	
I P S	2,300	2,016.00	4,636,800	貸付株式数 900株
F I G	5,200	353.00	1,835,600	貸付株式数 2,800株
システムサポート	3,200	1,885.00	6,032,000	貸付株式数 1,100株
A D E K A	28,900	2,869.50	82,928,550	
日油	25,600	6,845.00	175,232,000	
ミヨシ油脂	1,800	1,465.00	2,637,000	貸付株式数 600株
新日本理化	6,200	195.00	1,209,000	貸付株式数 2,800株
ハリマ化成グループ	4,400	795.00	3,498,000	
イーソル	6,000	608.00	3,648,000	貸付株式数 2,300株
東海ソフト	700	1,153.00	807,100	
ウイングアーク1ST	8,600	3,285.00	28,251,000	
ヒト・コミュニケーションズHD	2,200	1,363.00	2,998,600	貸付株式数 800株
サーバーワークス	1,700	3,555.00	6,043,500	貸付株式数 300株
東名	400	1,781.00	712,400	貸付株式数 100株
ヴィッツ	500	940.00	470,000	貸付株式数 100株
トビラシステムズ	1,300	887.00	1,153,100	貸付株式数 100株
S a n s a n	27,100	1,546.00	41,896,600	
L i n k - U	1,100	753.00	828,300	貸付株式数 500株
ギフトィ	7,200	1,899.00	13,672,800	貸付株式数 3,000株
花王	187,000	5,696.00	1,065,152,000	
第一工業製薬	3,300	1,874.00	6,184,200	
石原ケミカル	3,700	1,981.00	7,329,700	
日華化学	1,800	985.00	1,773,000	貸付株式数 900株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ニイタカ	800	1,999.00	1,599,200	貸付株式数 300株 (300株)
三洋化成	5,100	4,285.00	21,853,500	
メドレー	11,100	4,425.00	49,117,500	
ベース	2,800	3,330.00	9,324,000	貸付株式数 1,100株
JMDC	14,100	4,314.00	60,827,400	
武田薬品	732,900	4,165.00	3,052,528,500	
アステラス製薬	726,500	1,797.50	1,305,883,750	
住友ファーマ	61,400	468.00	28,735,200	
塩野義製薬	104,400	6,978.00	728,503,200	
わかもと製薬	4,700	199.00	935,300	
日本新薬	21,700	5,331.00	115,682,700	
中外製薬	259,200	5,218.00	1,352,505,600	
科研製薬	14,200	3,378.00	47,967,600	
エーザイ	100,700	7,672.00	772,570,400	
理研ビタミン	7,100	2,253.00	15,996,300	
ロート製薬	80,200	3,090.00	247,818,000	
小野薬品	175,800	2,721.00	478,351,800	
久光製薬	18,400	4,618.00	84,971,200	
有機合成薬品	3,600	289.00	1,040,400	貸付株式数 600株
持田製薬	9,500	3,355.00	31,872,500	
参天製薬	150,900	1,399.00	211,109,100	
扶桑薬品	2,900	1,907.00	5,530,300	
日本ケミファ	500	1,622.00	811,000	
ツムラ	26,000	2,795.00	72,670,000	
テルモ	230,900	4,718.00	1,089,386,200	
HUグループHD	24,800	2,569.00	63,711,200	
キッセイ薬品工業	13,700	3,055.00	41,853,500	
生化学工業	13,900	792.00	11,008,800	
栄研化学	16,100	1,647.00	26,516,700	
鳥居薬品	4,400	3,660.00	16,104,000	
JCRファーマ	28,000	1,324.00	37,072,000	貸付株式数 9,900株
東和薬品	12,700	2,470.00	31,369,000	
富士製薬工業	6,000	1,560.00	9,360,000	
ゼリア新薬工業	11,400	2,026.00	23,096,400	
そーせいグループ	26,700	1,389.00	37,086,300	貸付株式数 10,600株
第一三共	721,400	4,000.00	2,885,600,000	
杏林製薬	17,800	1,828.00	32,538,400	
大幸薬品	17,000	301.00	5,117,000	貸付株式数 6,800株
ダイト	6,300	1,945.00	12,253,500	
大塚ホールディングス	172,300	5,689.00	980,214,700	
大正製薬HD	18,400	8,689.00	159,877,600	
ペプチドリーム	40,100	1,266.50	50,786,650	
大日本塗料	9,200	981.00	9,025,200	貸付株式数 2,300株
日本ペイントHOLD	439,200	1,104.50	485,096,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
関西ペイント	81,100	2,252.00	182,637,200	
神東塗料	3,800	128.00	486,400	貸付株式数 1,800株
中国塗料	17,000	1,541.00	26,197,000	
日本特殊塗料	3,300	1,269.00	4,187,700	
藤倉化成	10,100	446.00	4,504,600	
太陽ホールディングス	14,400	2,990.00	43,056,000	貸付株式数 2,000株
D I C	32,300	2,433.50	78,602,050	
サカタインクス	18,400	1,307.00	24,048,800	貸付株式数 4,700株
東洋インキSCホールディングン	18,000	2,667.00	48,006,000	
T&K TOKA	7,900	1,442.00	11,391,800	
アルプス技研	8,000	2,726.00	21,808,000	
サニックス	13,600	384.00	5,222,400	
日本空調サービス	8,900	801.00	7,128,900	
オリエンタルランド	449,200	5,025.00	2,257,230,000	
フォーカスシステムズ	5,500	991.00	5,450,500	
ダスキン	18,900	3,258.00	61,576,200	
パーク24	52,800	1,802.50	95,172,000	
明光ネットワークジャパン	10,300	717.00	7,385,100	貸付株式数 3,700株
ファルコホールディングス	3,800	2,117.00	8,044,600	
クレスコ	6,800	1,910.00	12,988,000	
フジ・メディア・HD	79,500	1,524.00	121,158,000	
秀英予備校	1,000	343.00	343,000	
田谷	800	414.00	331,200	貸付株式数 100株 (100株)
ラウンドワン	79,900	590.00	47,141,000	
リゾートトラスト	36,900	2,250.50	83,043,450	
オービック	27,700	22,695.00	628,651,500	
ジャストシステム	11,900	3,330.00	39,627,000	
TDCソフト	7,800	2,099.00	16,372,200	
L I N Eヤフー	1,178,900	430.60	507,634,340	
ビー・エム・エル	10,400	2,933.00	30,503,200	
トレンドマイクロ	39,200	7,514.00	294,548,800	
I Dホールディングス	5,600	1,531.00	8,573,600	
リソー教育	43,500	241.00	10,483,500	
日本オラル	15,800	11,435.00	180,673,000	
早稲田アカデミー	4,700	1,584.00	7,444,800	貸付株式数 1,700株
アルファシステムズ	2,200	2,794.00	6,146,800	
フューチャー	17,700	1,804.00	31,930,800	
CAC HOLDINGS	4,400	1,788.00	7,867,200	
S Bテクノロジー	3,500	2,494.00	8,729,000	
トーセ	1,300	715.00	929,500	貸付株式数 100株
ユー・エス・エス	95,200	2,893.00	275,413,600	
オービックビジネスC	11,600	6,759.00	78,404,400	
アイティフォー	10,600	1,164.00	12,338,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
東京個別指導学院	10,100	480.00	4,848,000	貸付株式数 1,500株
東計電算	1,100	7,050.00	7,755,000	貸付株式数 300株
サイバーエージェント	187,600	894.60	167,826,960	
楽天グループ	726,900	585.70	425,745,330	貸付株式数 290,300株
エックスネット	600	1,064.00	638,400	貸付株式数 300株
クリーク・アンド・リバー社	4,300	2,093.00	8,999,900	
SBIグローバルアセット	16,400	557.00	9,134,800	
テー・オー・ダブリュー	16,900	324.00	5,475,600	
大塚商会	41,100	6,035.00	248,038,500	
サイボウズ	11,400	2,082.00	23,734,800	
山田コンサルティングGP	3,700	1,850.00	6,845,000	
セントラルスポーツ	3,200	2,454.00	7,852,800	貸付株式数 1,200株
パラカ	2,900	1,934.00	5,608,600	
電通国際情報S	10,100	4,920.00	49,692,000	
ACCESS	8,600	731.00	6,286,600	
デジタルガレージ	13,200	3,095.00	40,854,000	
イーエムシステムズ	13,800	711.00	9,811,800	
ウェザーニューズ	2,600	5,870.00	15,262,000	貸付株式数 900株
C I J	13,700	618.00	8,466,600	
ビジネスエンジニアリング	1,400	4,420.00	6,188,000	
日本エンタープライズ	4,700	124.00	582,800	貸付株式数 2,100株
WOWOW	6,100	1,089.00	6,642,900	貸付株式数 2,300株
スカラ	7,800	765.00	5,967,000	
インテリジェント ウェイブ	2,400	1,029.00	2,469,600	貸付株式数 1,100株
フルキャストホールディングス	8,100	1,917.00	15,527,700	
エン・ジャパン	13,800	2,588.00	35,714,400	
セルソース	2,300	1,598.00	3,675,400	
あすか製薬HD	8,500	1,821.00	15,478,500	
サワイグループHD	18,900	4,918.00	92,950,200	
富士フイルムHLDGS	153,700	8,660.00	1,331,042,000	
コニカミノルタ	186,200	467.90	87,122,980	
資生堂	172,900	3,966.00	685,721,400	
ライオン	108,400	1,294.00	140,269,600	
高砂香料	6,200	3,515.00	21,793,000	貸付株式数 2,100株
マンダム	17,900	1,274.00	22,804,600	
ミルボン	11,200	3,696.00	41,395,200	
ファンケル	36,200	2,277.00	82,427,400	
コーセー	16,800	10,465.00	175,812,000	
コタ	7,400	1,572.00	11,632,800	
シーボン	600	1,493.00	895,800	
ポーラ・オルビスHD	42,400	1,558.50	66,080,400	
ノエビアホールディングス	7,400	5,220.00	38,628,000	
アジュバンホールディング	1,100	929.00	1,021,900	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
新日本製薬	4,700	1,575.00	7,402,500	貸付株式数 1,700 株
アクシージア	4,200	1,017.00	4,271,400	貸付株式数 1,600 株
エステー	6,200	1,517.00	9,405,400	
アグロカネショウ	3,300	1,348.00	4,448,400	
コニシ	13,800	2,582.00	35,631,600	
長谷川香料	15,800	3,220.00	50,876,000	
小林製薬	24,100	6,820.00	164,362,000	貸付株式数 9,600 株
荒川化学工業	6,900	1,018.00	7,024,200	
メック	6,800	4,045.00	27,506,000	貸付株式数 2,600 株
日本高純度化学	1,800	2,500.00	4,500,000	
タカラバイオ	22,300	1,222.00	27,250,600	
JCU	9,300	3,950.00	36,735,000	
新田ゼラチン	3,300	784.00	2,587,200	貸付株式数 1,500 株
OATアグリオ	2,400	1,926.00	4,622,400	
デクセリアルズ	20,800	4,633.00	96,366,400	
アース製薬	7,500	4,780.00	35,850,000	
北興化学	8,400	975.00	8,190,000	
大成ラミック	2,400	2,934.00	7,041,600	
クミアイ化学	32,900	1,089.00	35,828,100	
日本農薬	15,200	598.00	9,089,600	
富士興産	1,300	1,838.00	2,389,400	
ニチレキ	10,700	2,286.00	24,460,200	
ユシロ化学	4,300	1,718.00	7,387,400	
ビーピー・カストロール	1,700	894.00	1,519,800	
富士石油	24,100	365.00	8,796,500	貸付株式数 6,000 株
MORESCO	1,600	1,318.00	2,108,800	
出光興産	92,000	4,056.00	373,152,000	
ENEOSホールディングス	1,311,200	584.40	766,265,280	
コスモエネルギーHLDGS	24,600	5,635.00	138,621,000	
テスホールディングス	17,500	442.00	7,735,000	貸付株式数 6,700 株
インフロニアHD	93,300	1,561.50	145,687,950	
横浜ゴム	41,900	3,289.00	137,809,100	
TOYO TIRE	47,600	2,454.50	116,834,200	
ブリヂストン	242,400	6,098.00	1,478,155,200	貸付株式数 96,800 株
住友ゴム	81,200	1,709.50	138,811,400	
藤倉コンポジット	5,600	1,415.00	7,924,000	
オカモト	3,900	5,450.00	21,255,000	
アキレス	5,200	1,557.00	8,096,400	
フコク	4,300	1,402.00	6,028,600	
ニッタ	8,400	3,745.00	31,458,000	
クリエートメディック	1,500	914.00	1,371,000	
住友理工	12,900	1,034.00	13,338,600	
三ツ星ベルト	10,100	4,465.00	45,096,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
バンドー化学	12,300	1,560.00	19,188,000	
A G C	77,200	5,370.00	414,564,000	
日本板硝子	39,500	644.00	25,438,000	
石塚硝子	800	3,365.00	2,692,000	貸付株式数 300株
有沢製作所	14,500	1,095.00	15,877,500	
日本山村硝子	1,700	1,507.00	2,561,900	貸付株式数 600株
日本電気硝子	33,800	3,120.00	105,456,000	
オハラ	3,900	1,314.00	5,124,600	貸付株式数 1,400株
住友大阪セメント	13,800	3,608.00	49,790,400	
太平洋セメント	49,000	2,777.50	136,097,500	
リソルホールディングス	400	5,420.00	2,168,000	
日本ヒューム	7,200	949.00	6,832,800	貸付株式数 100株
日本コンクリート	15,800	323.00	5,103,400	
三谷セキサン	3,500	4,390.00	15,365,000	
アジアパイルHD	11,800	704.00	8,307,200	
東海カーボン	76,400	1,094.00	83,581,600	
日本カーボン	4,400	4,645.00	20,438,000	
東洋炭素	5,800	4,590.00	26,622,000	
ノリタケ	4,600	6,940.00	31,924,000	
T O T O	54,700	3,797.00	207,695,900	
日本碍子	96,300	1,804.00	173,725,200	
日本特殊陶業	69,400	3,433.00	238,250,200	
ダントーホールディングス	3,000	959.00	2,877,000	貸付株式数 2,000株
MARUWA	3,100	29,770.00	92,287,000	
品川リフラクトリーズ	10,200	1,705.00	17,391,000	
黒崎播磨	1,700	11,230.00	19,091,000	
ヨータイ	5,100	1,456.00	7,425,600	
東京窯業	4,800	421.00	2,020,800	
ニッカトー	2,100	571.00	1,199,100	
フジミインコーポレーテッド	22,200	2,929.00	65,023,800	
クニミネ工業	1,300	983.00	1,277,900	貸付株式数 900株
エーアンドエーマテリアル	900	1,263.00	1,136,700	
ニチアス	20,900	3,155.00	65,939,500	
日本製鉄	381,500	3,457.00	1,318,845,500	
神戸製鋼所	171,300	1,731.50	296,605,950	
中山製鋼所	19,500	843.00	16,438,500	
合同製鐵	4,800	4,560.00	21,888,000	
J F Eホールディングス	236,900	2,180.00	516,442,000	
東京製鐵	23,900	1,794.00	42,876,600	
共英製鋼	9,700	2,080.00	20,176,000	
大和工業	16,100	7,462.00	120,138,200	
東京鐵鋼	3,800	3,960.00	15,048,000	貸付株式数 1,100株
大阪製鐵	3,900	1,907.00	7,437,300	貸付株式数 400株
淀川製鋼所	9,600	3,905.00	37,488,000	貸付株式数 3,700株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
中部鋼鈑	5,600	1,964.00	10,998,400	
丸一鋼管	25,900	3,821.00	98,963,900	
モリ工業	1,500	4,185.00	6,277,500	
大同特殊鋼	10,700	6,827.00	73,048,900	
日本高周波	1,800	563.00	1,013,400	貸付株式数 900株
日本冶金工	6,200	4,180.00	25,916,000	
山陽特殊製鋼	8,400	2,616.00	21,974,400	
愛知製鋼	4,900	3,435.00	16,831,500	
日本金属	1,200	913.00	1,095,600	貸付株式数 400株
ミガロホールディングス	700	1,320.00	924,000	
大平洋金属	7,300	1,234.00	9,008,200	貸付株式数 2,200株
新日本電工	42,300	303.00	12,816,900	
栗本鉄工所	3,900	3,340.00	13,026,000	
虹 技	600	1,142.00	685,200	
日本鑄鉄管	500	1,096.00	548,000	貸付株式数 200株
日本製鋼所	23,000	2,553.50	58,730,500	
三菱製鋼	6,300	1,539.00	9,695,700	
日亜鋼業	4,700	308.00	1,447,600	
日本精線	1,300	4,705.00	6,116,500	貸付株式数 100株
エンビプロHD	4,500	631.00	2,839,500	貸付株式数 1,600株
大紀アルミニウム	10,700	1,207.00	12,914,900	
日本軽金属HD	24,800	1,689.00	41,887,200	
三井金属	24,800	4,540.00	112,592,000	
東邦亜鉛	5,400	1,198.00	6,469,200	貸付株式数 2,100株
三菱マテリアル	60,900	2,434.00	148,230,600	
住友鉱山	98,800	4,292.00	424,049,600	
DOWAホールディングス	21,000	5,256.00	110,376,000	貸付株式数 2,200株
古河機金	11,200	1,872.00	20,966,400	
エス・サイエンス	27,700	22.00	609,400	貸付株式数 15,200株
大阪チタニウム	14,800	2,902.00	42,949,600	貸付株式数 5,900株
東邦チタニウム	17,600	1,831.00	32,225,600	貸付株式数 7,000株
UACJ	11,900	3,465.00	41,233,500	
CKサンエツ	2,000	3,695.00	7,390,000	貸付株式数 100株
古河電工	28,400	2,378.50	67,549,400	
住友電工	318,800	1,834.00	584,679,200	
フジクラ	100,500	1,138.50	114,419,250	
SWCC	9,500	2,681.00	25,469,500	
タツタ電線	15,000	683.00	10,245,000	貸付株式数 900株
カナレ電気	800	1,591.00	1,272,800	貸付株式数 100株
平河ヒューテック	5,400	1,364.00	7,365,600	貸付株式数 1,600株
いよぎんホールディング	96,800	955.80	92,521,440	
しずおかフィナンシャル	180,800	1,196.00	216,236,800	
ちゅうぎんフィナンシャ	68,500	1,059.00	72,541,500	
楽天銀行	28,400	2,558.00	72,647,200	貸付株式数 11,200株
京都フィナンシャルG	25,800	8,849.00	228,304,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
リョービ	9,100	2,915.00	26,526,500	貸付株式数 3,500株
アーレステイ	5,200	817.00	4,248,400	貸付株式数 2,000株
AREホールディングス	31,800	1,909.00	60,706,200	
東洋製罐グループHD	50,800	2,294.50	116,560,600	
ホッカンホールディングス	4,200	1,575.00	6,615,000	
コロナ	4,600	924.00	4,250,400	
横河ブリッジHLDGS	13,400	2,724.00	36,501,600	
駒井ハルテック	800	2,216.00	1,772,800	
高田機工	300	3,350.00	1,005,000	
三和ホールディングス	85,600	2,121.00	181,557,600	
文化シヤッター	22,200	1,380.00	30,636,000	貸付株式数 400株
三協立山	9,700	818.00	7,934,600	貸付株式数 3,500株
アルインコ	6,400	1,022.00	6,540,800	貸付株式数 1,600株
東洋シヤッター	1,100	716.00	787,600	貸付株式数 300株
LIXIL	133,000	1,805.50	240,131,500	
日本フィルコン	3,000	469.00	1,407,000	
ノーリツ	14,100	1,498.00	21,121,800	
長府製作所	8,400	2,102.00	17,656,800	
リンナイ	41,700	3,005.00	125,308,500	
ユニプレス	14,800	990.00	14,652,000	
ダイニチ工業	2,300	735.00	1,690,500	
日東精工	12,300	564.00	6,937,200	
三洋工業	500	2,215.00	1,107,500	
岡 部	15,100	703.00	10,615,300	
ジーテクト	10,800	1,744.00	18,835,200	
東 プ レ	15,000	2,002.00	30,030,000	
高周波熱錬	13,100	1,003.00	13,139,300	貸付株式数 2,600株
東京製綱	5,500	1,380.00	7,590,000	
サンコール	6,500	475.00	3,087,500	貸付株式数 2,600株
モリテックスチル	4,100	295.00	1,209,500	貸付株式数 1,600株
パイオラックス	10,600	2,265.00	24,009,000	
エイチワン	8,600	768.00	6,604,800	
日本発条	75,400	1,125.00	84,825,000	
中央発條	6,300	722.00	4,548,600	
アドバネクス	600	929.00	557,400	貸付株式数 400株
三浦工業	34,800	2,866.00	99,736,800	
タ ク マ	28,200	1,632.00	46,022,400	
テクノプロ・ホールディング	50,200	3,434.00	172,386,800	
アトラグループ	1,400	196.00	274,400	貸付株式数 600株
アイ・アールジャパンHD	4,400	1,565.00	6,886,000	貸付株式数 1,700株
Keep 技研	5,200	5,880.00	30,576,000	
ファーストロジック	1,100	505.00	555,500	
三機サービス	700	1,117.00	781,900	
Gunosy	6,800	696.00	4,732,800	貸付株式数 1,200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
デザインワン・ジャパン	1,300	147.00	191,100	貸付株式数 500株
イー・ガーディアン	3,200	1,539.00	4,924,800	
リブセンス	2,100	270.00	567,000	貸付株式数 1,000株
ジャパンマテリアル	25,900	2,597.00	67,262,300	
ベクトル	10,400	1,093.00	11,367,200	貸付株式数 4,100株
ウチヤマホールディングス	2,000	354.00	708,000	貸付株式数 200株
チャームケアコーポレーション	7,100	1,199.00	8,512,900	
キャリアリンク	3,100	2,188.00	6,782,800	貸付株式数 1,200株
I B J	6,500	739.00	4,803,500	貸付株式数 2,600株
アサンテ	4,100	1,616.00	6,625,600	貸付株式数 1,600株
バリューHR	7,400	1,498.00	11,085,200	貸付株式数 2,800株
M&Aキャピタルパートナー	6,900	2,267.00	15,642,300	貸付株式数 2,700株
ライドオンエクスプレスHD	3,300	1,017.00	3,356,100	
ERIホールディングス	1,200	1,723.00	2,067,600	
アビスト	700	3,040.00	2,128,000	
シグマクシス・ホールディング	11,400	1,326.00	15,116,400	
ウィルグループ	7,100	1,119.00	7,944,900	
エスクローAJ	5,500	142.00	781,000	貸付株式数 2,200株
メドピア	7,400	768.00	5,683,200	貸付株式数 2,900株
レアジョブ	900	967.00	870,300	
リクルートホールディングス	628,400	5,505.00	3,459,342,000	
エラン	11,200	1,019.00	11,412,800	
ツガミ	18,500	1,230.00	22,755,000	
オークマ	7,300	6,194.00	45,216,200	
芝浦機械	8,300	3,815.00	31,664,500	
アマダ	133,200	1,482.50	197,469,000	
アイダエンジニア	19,300	870.00	16,791,000	
FUJI	39,300	2,506.00	98,485,800	
牧野フライス	9,200	5,800.00	53,360,000	
オーエスジー	36,800	1,841.00	67,748,800	
ダイジェット	500	884.00	442,000	貸付株式数 200株
旭ダイヤモンド	20,000	919.00	18,380,000	
DMG森精機	50,600	2,656.50	134,418,900	貸付株式数 17,500株
ソディック	20,500	751.00	15,395,500	
ディスコ	40,100	32,090.00	1,286,809,000	
日東工器	4,000	1,862.00	7,448,000	
日進工具	7,700	1,030.00	7,931,000	
パンチ工業	4,600	428.00	1,968,800	貸付株式数 2,100株
富士ダイス	4,300	655.00	2,816,500	貸付株式数 1,100株
土木管理総合試験	2,100	323.00	678,300	貸付株式数 100株
日本郵政	995,500	1,304.50	1,298,629,750	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ベルシステム24HLDGS	9,000	1,664.00	14,976,000	
鎌倉新書	7,200	583.00	4,197,600	貸付株式数 3,700株 (1,300株)
SMN	900	293.00	263,700	
一蔵	600	589.00	353,400	貸付株式数 200株
グローバルキッズCOMP	900	634.00	570,600	
エアトリ	6,200	1,571.00	9,740,200	貸付株式数 2,400株
アトラエ	5,000	717.00	3,585,000	
ストライク	3,600	3,880.00	13,968,000	
ソラスト	23,400	587.00	13,735,800	
セラク	2,600	1,339.00	3,481,400	貸付株式数 1,000株
インソース	18,400	955.00	17,572,000	貸付株式数 4,800株
豊田自動織機	70,400	12,715.00	895,136,000	
豊和工業	2,500	775.00	1,937,500	貸付株式数 1,100株
石川製作所	1,200	1,203.00	1,443,600	貸付株式数 400株
リケンNPR	9,100	1,960.00	17,836,000	
東洋機械金属	3,900	667.00	2,601,300	
津田駒工業	800	356.00	284,800	貸付株式数 400株
エンシュウ	1,100	689.00	757,900	貸付株式数 400株
島精機製作所	13,300	1,534.00	20,402,200	
オプトラン	13,700	1,627.00	22,289,900	
NCホールディングス	1,100	1,902.00	2,092,200	
イワキポンプ	5,600	2,057.00	11,519,200	
フリー	7,900	1,232.00	9,732,800	
ヤマシンフィルタ	20,000	345.00	6,900,000	貸付株式数 200株
日阪製作所	9,100	957.00	8,708,700	
やまびこ	13,700	1,486.00	20,358,200	
野村マイクロ・サイエンス	2,800	11,430.00	32,004,000	
平田機工	4,000	6,380.00	25,520,000	
PEGASUS	9,200	478.00	4,397,600	貸付株式数 100株
マルマエ	3,600	1,826.00	6,573,600	貸付株式数 1,400株
タツモ	5,000	3,640.00	18,200,000	貸付株式数 2,000株
ナブテスコ	52,400	2,767.50	145,017,000	
三井海洋開発	10,600	1,907.00	20,214,200	
レオン自動機	9,700	1,562.00	15,151,400	
SMC	25,000	74,450.00	1,861,250,000	
ホソカワミクロン	5,400	4,250.00	22,950,000	
ユニオンツール	3,700	3,385.00	12,524,500	
瑞光	6,000	1,433.00	8,598,000	貸付株式数 2,300株
オイレス工業	11,300	1,954.00	22,080,200	貸付株式数 3,600株
日精エーエスビー	3,300	4,985.00	16,450,500	
サトーホールディングス	11,900	2,039.00	24,264,100	
技研製作所	7,900	1,858.00	14,678,200	貸付株式数 1,300株
日本エアテック	3,900	1,400.00	5,460,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
カワタ	1,500	1,090.00	1,635,000	
日精樹脂工業	6,200	1,084.00	6,720,800	
オカダアイヨン	1,600	2,320.00	3,712,000	貸付株式数 800株
ワイエイシイホールディングス	2,700	2,530.00	6,831,000	貸付株式数 800株
小松製作所	391,000	3,772.00	1,474,852,000	
住友重機械	49,400	3,529.00	174,332,600	
日立建機	33,300	3,835.00	127,705,500	
日工	12,300	673.00	8,277,900	
巴工業	3,300	2,876.00	9,490,800	貸付株式数 1,200株
井関農機	7,900	1,106.00	8,737,400	
TOWA	9,300	7,060.00	65,658,000	貸付株式数 3,700株
丸山製作所	800	2,531.00	2,024,800	
北川鉄工所	3,300	1,316.00	4,342,800	
シンニッタン	5,800	251.00	1,455,800	
ローツェ	4,400	14,560.00	64,064,000	貸付株式数 1,700株
タカキタ	1,500	478.00	717,000	貸付株式数 600株
クボタ	437,800	2,119.00	927,698,200	
荏原実業	4,400	2,952.00	12,988,800	
東洋エンジニア	12,000	706.00	8,472,000	
三菱化工機	3,000	3,285.00	9,855,000	
月島ホールディングス	11,300	1,328.00	15,006,400	
帝国電機製作所	5,900	3,015.00	17,788,500	
東京機械	1,200	440.00	528,000	
新東工業	16,900	1,087.00	18,370,300	
渋谷工業	7,900	2,537.00	20,042,300	
アイチ コーポレーション	11,600	933.00	10,822,800	
小森コーポレーション	21,100	1,169.00	24,665,900	
鶴見製作所	6,400	3,565.00	22,816,000	
日本ギア工業	1,800	491.00	883,800	貸付株式数 600株
酒井重工業	1,200	5,870.00	7,044,000	
荏原製作所	34,200	8,371.00	286,288,200	
石井鉄工所	500	2,729.00	1,364,500	
西島製作所	7,200	2,197.00	15,818,400	貸付株式数 2,500株
北越工業	8,400	2,249.00	18,891,600	貸付株式数 900株
ダイキン工業	99,600	22,155.00	2,206,638,000	
オルガノ	10,000	6,060.00	60,600,000	
トーヨーカネツ	3,200	3,715.00	11,888,000	
栗田工業	46,700	5,238.00	244,614,600	
椿本チエイン	11,900	3,775.00	44,922,500	
大同工業	2,000	737.00	1,474,000	
日機装	19,200	1,006.00	19,315,200	
木村化工機	6,400	716.00	4,582,400	
レイズネクスト	11,700	1,388.00	16,239,600	
アネスト岩田	12,900	1,094.00	14,112,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ダイフク	140,800	2,783.00	391,846,400	
サムコ	2,200	4,785.00	10,527,000	貸付株式数 800 株
加藤製作所	2,400	1,247.00	2,992,800	
油研工業	800	2,120.00	1,696,000	
タダノ	48,100	1,154.50	55,531,450	
フジテック	19,500	3,429.00	66,865,500	
CKD	23,100	2,409.00	55,647,900	
平和	24,600	2,104.00	51,758,400	
理想科学工業	6,700	2,761.00	18,498,700	
SANKYO	20,500	6,388.00	130,954,000	
日本金銭機械	10,100	1,121.00	11,322,100	貸付株式数 3,300 株
マースグループHLDGS	4,200	2,383.00	10,008,600	
フクシマガリレイ	5,400	4,900.00	26,460,000	
オーイズミ	1,700	397.00	674,900	貸付株式数 1,000 株
ダイコク電機	4,100	3,455.00	14,165,500	貸付株式数 1,700 株
竹内製作所	15,100	4,325.00	65,307,500	
アマノ	23,700	3,147.00	74,583,900	
JUKI	13,000	505.00	6,565,000	貸付株式数 1,900 株
サンデン	6,700	168.00	1,125,600	貸付株式数 4,200 株
ジャノメ	8,400	717.00	6,022,800	
ブラザー工業	111,500	2,496.00	278,304,000	
マックス	11,700	2,814.00	32,923,800	
モリタホールディングス	14,500	1,526.00	22,127,000	
グローリー	20,000	2,770.00	55,400,000	
新晃工業	8,400	2,479.00	20,823,600	
大和冷機工業	12,700	1,442.00	18,313,400	
セガサミーホールディングス	74,500	2,147.50	159,988,750	
TPR	10,600	1,729.00	18,327,400	
ツバキ・ナカシマ	16,700	742.00	12,391,400	貸付株式数 6,400 株
ホンザキ	49,200	4,709.00	231,682,800	
大豊工業	7,200	873.00	6,285,600	
日本精工	154,500	775.10	119,752,950	
NTN	181,000	276.90	50,118,900	
ジェイテクト	74,300	1,355.50	100,713,650	
不二越	6,200	3,785.00	23,467,000	
ミネベアミツミ	145,100	2,813.00	408,166,300	
日本トムソン	22,800	590.00	13,452,000	
THK	48,100	2,953.50	142,063,350	
ユーシン精機	6,600	672.00	4,435,200	
前澤給装工業	6,300	1,291.00	8,133,300	貸付株式数 1,000 株
イーグル工業	9,200	1,657.00	15,244,400	
前澤工業	2,600	979.00	2,545,400	
日本ピラー工業	7,700	4,600.00	35,420,000	
キッツ	27,900	1,143.00	31,889,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日立	405,600	10,285.00	4,171,596,000	
三菱電機	928,300	2,009.00	1,864,954,700	
富士電機	50,700	6,201.00	314,390,700	
東洋電機製造	1,500	936.00	1,404,000	
安川電機	90,600	5,673.00	513,973,800	
シンフォニアテクノロジー	9,200	2,064.00	18,988,800	
明電舎	15,500	2,447.00	37,928,500	
オリジン	1,000	1,216.00	1,216,000	
山洋電気	3,600	6,090.00	21,924,000	
デンヨー	6,400	2,160.00	13,824,000	
PHCホールディングス	15,500	1,485.00	23,017,500	
ソシオネクスト	12,100	13,250.00	160,325,000	
ベイカレントコンサルティング	62,400	4,976.00	310,502,400	
ORCHESTRA HOLDINGS	1,800	1,278.00	2,300,400	
アイモバイル	11,300	459.00	5,186,700	
キャリアインデックス	1,600	233.00	372,800	貸付株式数 200株
MS-Japan	2,700	1,253.00	3,383,100	貸付株式数 600株
船場	1,000	895.00	895,000	貸付株式数 200株
ジャパンエレベーターSHD	27,500	2,350.00	64,625,000	
フルテック	600	1,235.00	741,000	
グリーンズ	1,700	1,941.00	3,299,700	貸付株式数 700株
ツナググループHLDGS	1,300	855.00	1,111,500	貸付株式数 100株
GAMEWITH	1,400	302.00	422,800	貸付株式数 600株
MS&CONSULTING	600	687.00	412,200	貸付株式数 100株
ウェルビー	4,200	745.00	3,129,000	
エル・ティー・エス	1,000	3,885.00	3,885,000	貸付株式数 300株
ミダックホールディングス	5,100	1,752.00	8,935,200	貸付株式数 1,800株
キュービーネットHLDGS	4,000	1,521.00	6,084,000	
RPAホールディングス	11,500	302.00	3,473,000	
三桜工業	12,600	873.00	10,999,800	
マキタ	95,100	3,924.00	373,172,400	
東芝テック	10,700	2,909.00	31,126,300	
芝浦メカトロニクス	4,700	6,700.00	31,490,000	貸付株式数 1,800株
マブチモーター	20,700	4,648.00	96,213,600	
ニデック	184,100	5,604.00	1,031,696,400	
ユーエムシーエレクトロニクス	5,200	383.00	1,991,600	貸付株式数 2,200株
トレックス・セミコンダクター	4,300	2,004.00	8,617,200	貸付株式数 1,700株
東光高岳	5,000	2,069.00	10,345,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ダブル・スコープ	23,900	920.00	21,988,000	貸付株式数 9,500株
宮越ホールディングス	3,700	1,246.00	4,610,200	貸付株式数 1,400株
ダイヘン	8,400	5,830.00	48,972,000	
ヤーマン	14,400	1,061.00	15,278,400	貸付株式数 5,700株 (500株)
JVCケンウッド	65,800	767.00	50,468,600	
ミマキエンジニアリング	7,900	969.00	7,655,100	
IPEX	5,700	1,824.00	10,396,800	貸付株式数 900株
大崎電気	18,300	657.00	12,023,100	
オムロン	63,700	6,199.00	394,876,300	
日東工業	11,200	3,590.00	40,208,000	
IDEC	12,300	2,825.00	34,747,500	
正興電機製作所	1,500	1,141.00	1,711,500	
不二電機工業	900	1,132.00	1,018,800	貸付株式数 400株
ジーエス・ユアサコーポ	27,400	2,173.50	59,553,900	貸付株式数 10,900株
サクサホールディングス	1,100	2,700.00	2,970,000	
メルコホールディングス	2,600	3,460.00	8,996,000	
テクノメディカ	2,000	2,435.00	4,870,000	貸付株式数 500株
ダイヤモンドエレクトリック HD	3,100	714.00	2,213,400	貸付株式数 1,200株
日本電気	109,500	8,240.00	902,280,000	
富士通	76,700	21,120.00	1,619,904,000	
沖電気	37,700	956.00	36,041,200	
岩崎通信機	2,100	756.00	1,587,600	
電気興業	3,700	2,418.00	8,946,600	
サンケン電気	7,700	7,555.00	58,173,500	
ナカヨ	700	1,203.00	842,100	貸付株式数 300株
アイホン	4,500	2,768.00	12,456,000	
ルネサスエレクトロニクス	544,300	2,603.50	1,417,085,050	
セイコーエプソン	107,000	2,198.00	235,186,000	
ワコム	63,400	688.00	43,619,200	貸付株式数 22,600株
アルバック	19,800	6,508.00	128,858,400	
アクセル	2,900	2,110.00	6,119,000	貸付株式数 800株
EIZO	6,100	4,875.00	29,737,500	
ジャパンディスプレイ	61,700	29.00	1,789,300	
日本信号	18,900	957.00	18,087,300	
京三製作所	17,500	476.00	8,330,000	
能美防災	11,300	1,885.00	21,300,500	
ホーチキ	6,200	1,653.00	10,248,600	
星和電機	2,000	486.00	972,000	貸付株式数 1,000株
エレコム	19,900	1,624.00	32,317,600	
パナソニックホールディ ング	985,200	1,530.00	1,507,356,000	
シャープ	140,600	925.60	130,139,360	貸付株式数 56,100株 (1,200株)
アンリツ	58,700	1,283.50	75,341,450	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
富士通ゼネラル	23,600	2,710.00	63,956,000	
ソニーグループ	584,000	12,820.00	7,486,880,000	※
T D K	132,100	6,870.00	907,527,000	
帝国通信工業	3,600	1,964.00	7,070,400	
タムラ製作所	33,200	569.00	18,890,800	貸付株式数 1,500 株
アルプスアルパイン	74,500	1,295.50	96,514,750	
池上通信機	1,400	928.00	1,299,200	貸付株式数 700 株
日本電波工業	10,000	1,250.00	12,500,000	貸付株式数 200 株
鈴木	4,500	1,234.00	5,553,000	
メイコー	8,300	4,355.00	36,146,500	
日本トリム	1,900	3,105.00	5,899,500	
ローランド ディー. ジー.	4,600	3,615.00	16,629,000	
フオスター電機	6,200	1,112.00	6,894,400	
S M K	2,200	2,516.00	5,535,200	
ヨコオ	7,400	1,566.00	11,588,400	
ティアック	7,400	102.00	754,800	貸付株式数 2,800 株
ホシデン	19,000	1,808.00	34,352,000	
ヒロセ電機	12,300	16,550.00	203,565,000	
日本航空電子	19,900	2,947.00	58,645,300	
T O A	9,500	1,050.00	9,975,000	
マクセル	18,400	1,658.00	30,507,200	
古野電気	10,800	1,810.00	19,548,000	
スミダコーポレーション	11,200	1,182.00	13,238,400	
アイコム	3,200	3,260.00	10,432,000	貸付株式数 1,000 株
リオン	3,400	2,229.00	7,578,600	
横河電機	91,200	2,801.00	255,451,200	
新電元工業	3,200	3,055.00	9,776,000	
アズビル	57,700	4,772.00	275,344,400	
東亜ディーケーケー	2,100	880.00	1,848,000	
日本光電工業	35,400	3,712.00	131,404,800	
チノール	3,400	2,066.00	7,024,400	貸付株式数 1,100 株
共和電業	4,200	435.00	1,827,000	
日本電子材料	5,100	1,572.00	8,017,200	
堀場製作所	15,800	9,957.00	157,320,600	
アドバンテスト	236,500	4,681.00	1,107,056,500	
小野測器	1,800	454.00	817,200	
エスペック	6,600	2,362.00	15,589,200	
キーエンス	82,600	63,350.00	5,232,710,000	※
日置電機	3,900	6,560.00	25,584,000	
シスメックス	71,200	8,181.00	582,487,200	
日本マイクロニクス	14,800	3,835.00	56,758,000	
メガチップス	6,500	4,230.00	27,495,000	
O B A R A G R O U P	4,500	3,700.00	16,650,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
IMAGICA GROUP	8,300	627.00	5,204,100	貸付株式数 1,300株
澤藤電機	500	1,259.00	629,500	貸付株式数 300株
デンソー	681,300	2,314.00	1,576,528,200	
原田工業	2,000	782.00	1,564,000	貸付株式数 500株
コーセル	9,900	1,264.00	12,513,600	
イリソ電子工業	7,600	3,975.00	30,210,000	
オプテックスグループ	15,200	1,712.00	26,022,400	
千代田インテグレ	3,200	3,040.00	9,728,000	
レーザーテック	37,800	33,040.00	1,248,912,000	
スタンレー電気	52,900	2,736.00	144,734,400	
ウシオ電機	42,000	1,905.00	80,010,000	
岡谷電機	3,400	299.00	1,016,600	貸付株式数 1,600株
ヘリオステクノH	4,600	500.00	2,300,000	貸付株式数 2,300株
エノモト	1,200	1,585.00	1,902,000	貸付株式数 600株
日本セラミック	6,700	2,934.00	19,657,800	
遠藤照明	2,100	1,285.00	2,698,500	
古河電池	6,100	892.00	5,441,200	
双信電機	1,800	327.00	588,600	貸付株式数 900株
山一電機	7,400	1,895.00	14,023,000	
凶研	7,200	4,240.00	30,528,000	
日本電子	20,700	5,862.00	121,343,400	
カシオ	59,700	1,249.00	74,565,300	
ファナック	402,600	4,114.00	1,656,296,400	
日本シイエムケイ	17,500	751.00	13,142,500	
エンプラス	2,400	13,340.00	32,016,000	貸付株式数 900株
大真空	12,300	848.00	10,430,400	貸付株式数 2,100株
ローム	152,700	2,825.50	431,453,850	
浜松ホトニクス	66,300	5,856.00	388,252,800	
三井ハイテック	7,300	7,399.00	54,012,700	貸付株式数 3,000株
新光電気工業	29,200	5,519.00	161,154,800	
京セラ	128,300	8,190.00	1,050,777,000	
協栄産業	500	2,477.00	1,238,500	貸付株式数 200株
太陽誘電	40,200	3,834.00	154,126,800	
村田製作所	751,300	2,883.50	2,166,373,550	
双葉電子工業	15,700	553.00	8,682,100	
日東電工	53,200	10,515.00	559,398,000	
北陸電気工業	1,700	1,402.00	2,383,400	
東海理化電機	23,300	2,478.00	57,737,400	
ニチコン	21,700	1,471.00	31,920,700	
日本ケミコン	8,800	1,385.00	12,188,000	
KOA	12,500	1,619.00	20,237,500	貸付株式数 3,800株
三井E&S	21,700	543.00	11,783,100	
日立造船	73,600	901.00	66,313,600	
三菱重工業	145,900	8,268.00	1,206,301,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
川崎重工業	67,400	3,363.00	226,666,200	
I H I	62,100	2,856.00	177,357,600	
名村造船所	18,000	1,029.00	18,522,000	貸付株式数 1,700 株
サノヤスホールディングス	7,400	138.00	1,021,200	貸付株式数 1,900 株
スプリックス	1,300	790.00	1,027,000	
マネジメントソリューションズ	3,600	2,919.00	10,508,400	貸付株式数 1,400 株
プロレド・パートナーズ	2,000	383.00	766,000	貸付株式数 200 株
AND FACTORY	1,400	348.00	487,200	貸付株式数 500 株
テノ.ホールディングス	600	478.00	286,800	貸付株式数 200 株
フロンティア・マネジメント	2,100	1,565.00	3,286,500	
ピアラ	900	323.00	290,700	
コプロ・ホールディングス	1,500	1,469.00	2,203,500	貸付株式数 200 株
ギークス	600	464.00	278,400	貸付株式数 200 株
アンビスホールディングス	9,100	2,875.00	26,162,500	
カーブスホールディングス	23,100	667.00	15,407,700	
フォーラムエンジニアリング	11,600	795.00	9,222,000	
FAST FITNESS JAP	2,900	1,115.00	3,233,500	
日本車輛	2,800	2,094.00	5,863,200	貸付株式数 300 株
三菱ロジスネクスト	13,200	1,324.00	17,476,800	
近畿車輛	700	1,755.00	1,228,500	貸付株式数 300 株
一家ホールディングス	1,200	672.00	806,400	貸付株式数 600 株
フルサト・マルカHD	7,800	2,700.00	21,060,000	
ヤマエグループHD	4,900	3,465.00	16,978,500	
ジャパクラフトホールディング	2,800	178.00	498,400	貸付株式数 1,800 株
F P G	27,500	1,628.00	44,770,000	
島根銀行	1,400	514.00	719,600	貸付株式数 800 株
じもとホールディングス	4,100	557.00	2,283,700	
全国保証	21,300	4,997.00	106,436,100	
めぶきフィナンシャルG	403,900	445.00	179,735,500	
ジャパンインベストメントA	6,700	1,579.00	10,579,300	貸付株式数 2,500 株
東京きらぼしFG	10,400	4,300.00	44,720,000	
九州フィナンシャルG	157,500	832.80	131,166,000	
かんぽ生命保険	80,900	2,765.00	223,688,500	
ゆうちょ銀行	893,800	1,459.50	1,304,501,100	貸付株式数 25,200 株
あんしん保証	2,100	250.00	525,000	貸付株式数 600 株
富山第一銀行	25,800	787.00	20,304,600	
コンコルディア・フィナンシャル	436,600	693.90	302,956,740	
ジェイリース	2,100	1,867.00	3,920,700	貸付株式数 800 株
西日本フィナンシャルHD	45,900	1,633.00	74,954,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
イントラスト	1,800	851.00	1,531,800	
日本モーゲージサービス	2,700	527.00	1,422,900	貸付株式数 1,200 株
C a s a	2,000	878.00	1,756,000	貸付株式数 700 株
アルヒ	7,700	837.00	6,444,900	
プレミアグループ	13,700	1,769.00	24,235,300	
日産自動車	1,173,200	582.90	683,858,280	
いすゞ自動車	240,100	1,955.50	469,515,550	
トヨタ自動車	4,533,800	2,794.50	12,669,704,100	※
日野自動車	124,200	477.40	59,293,080	
三菱自動車工業	322,200	481.40	155,107,080	
エフテック	3,200	636.00	2,035,200	貸付株式数 1,200 株
レシップホールディングス	1,900	586.00	1,113,400	
GMB	900	1,325.00	1,192,500	貸付株式数 400 株
ファルテック	800	548.00	438,400	
武蔵精密工業	20,200	1,614.00	32,602,800	
日産車体	9,700	896.00	8,691,200	貸付株式数 400 株
新明和工業	23,800	1,184.00	28,179,200	
極東開発工業	13,700	1,900.00	26,030,000	
トピー工業	6,700	2,763.00	18,512,100	
ティラド	1,800	3,165.00	5,697,000	
タチエス	15,200	1,760.00	26,752,000	
N O K	32,100	1,885.00	60,508,500	
フタバ産業	22,100	856.00	18,917,600	
カヤバ	8,000	4,755.00	38,040,000	
市光工業	14,900	539.00	8,031,100	
大同メタル工業	16,000	579.00	9,264,000	
プレス工業	33,000	620.00	20,460,000	
ミクニ	5,800	456.00	2,644,800	
太平洋工業	18,900	1,397.00	26,403,300	貸付株式数 4,700 株
河西工業	7,200	221.00	1,591,200	貸付株式数 2,800 株
アイシン	63,700	5,451.00	347,228,700	
マ ッ ダ	273,200	1,578.50	431,246,200	
今仙電機製作所	2,800	614.00	1,719,200	
本田技研	2,013,700	1,509.00	3,038,673,300	
スズキ	151,700	6,021.00	913,385,700	
S U B A R U	261,300	2,621.00	684,867,300	
安永	2,000	708.00	1,416,000	貸付株式数 1,200 株
ヤマハ発動機	119,000	3,777.00	449,463,000	
小糸製作所	89,400	2,236.50	199,943,100	
T B K	4,900	388.00	1,901,200	
エクセディ	13,500	2,548.00	34,398,000	
ミツバ	15,400	933.00	14,368,200	
豊田合成	24,100	2,958.00	71,287,800	
愛三工業	13,600	1,312.00	17,843,200	
盟和産業	600	993.00	595,800	貸付株式数 200 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本プラスト	3,800	572.00	2,173,600	
ヨロズ	7,700	902.00	6,945,400	貸付株式数 2,700 株
エフ・シー・シー	14,700	1,828.00	26,871,600	
新家工業	1,000	2,893.00	2,893,000	
シマノ	33,500	22,755.00	762,292,500	
テイ・エス テック	29,400	1,826.00	53,684,400	
33FG	7,400	1,868.00	13,823,200	
第四北越フィナンシャルG	12,800	3,940.00	50,432,000	
ひろぎんHLDGS	115,800	927.00	107,346,600	
マーキュリアホールディングス	2,400	807.00	1,936,800	貸付株式数 100 株
おきなわFG	7,000	2,398.00	16,786,000	
ダイレクトマーケティングミクス	8,800	461.00	4,056,800	
ポピンズ	1,300	1,141.00	1,483,300	
LITALICO	6,600	2,141.00	14,130,600	
コンフィデンス・インターワーク	400	1,543.00	617,200	貸付株式数 100 株
十六FG	10,600	3,830.00	40,598,000	
北國FHD	8,600	4,530.00	38,958,000	
ネットプロHD	27,000	243.00	6,561,000	
プロクレアホールディングス	9,300	1,897.00	17,642,100	
あいちフィナンシャルグル	12,500	2,345.00	29,312,500	
ジャムコ	3,500	1,488.00	5,208,000	貸付株式数 1,300 株
小野建	8,500	1,687.00	14,339,500	
はるやまHLDGS	2,200	528.00	1,161,600	貸付株式数 1,100 株
南陽	1,000	2,058.00	2,058,000	
ノジマ	25,300	1,396.00	35,318,800	
佐鳥電機	4,200	1,964.00	8,248,800	
カップ・クリエイト	13,600	1,654.00	22,494,400	貸付株式数 5,100 株
エコートレーディング	900	1,492.00	1,342,800	貸付株式数 400 株
伯東	5,000	5,470.00	27,350,000	貸付株式数 1,900 株
コンドーテック	6,600	1,169.00	7,715,400	貸付株式数 2,200 株
中山福	2,500	357.00	892,500	
ライトオン	3,600	471.00	1,695,600	貸付株式数 1,700 株
ナガイレーベン	11,000	2,272.00	24,992,000	
三菱食品	8,100	4,860.00	39,366,000	
良品計画	95,400	2,336.50	222,902,100	
パリミキホールディングス	5,900	519.00	3,062,100	
松田産業	6,600	2,557.00	16,876,200	
第一興商	33,800	2,235.00	75,543,000	
メディパルHD	90,500	2,340.00	211,770,000	
アドヴァングループ	8,200	1,039.00	8,519,800	
SPK	3,900	1,829.00	7,133,100	
萩原電気HLDGS	3,700	4,940.00	18,278,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アルビス	2,800	2,581.00	7,226,800	貸付株式数 1,100株
アズワン	13,700	5,072.00	69,486,400	
スズデン	3,000	2,283.00	6,849,000	
尾家産業	1,200	1,890.00	2,268,000	貸付株式数 100株
シモジマ	5,900	1,262.00	7,445,800	貸付株式数 200株
ドウシシャ	8,000	2,110.00	16,880,000	
小津産業	1,100	1,600.00	1,760,000	貸付株式数 600株
コナカ	5,200	413.00	2,147,600	
高速	5,100	2,039.00	10,398,900	
ハウス ローゼ	600	1,605.00	963,000	
G-7ホールディングス	9,500	1,203.00	11,428,500	
たけびし	3,300	1,888.00	6,230,400	
イオン北海道	25,800	892.00	23,013,600	貸付株式数 4,600株
コジマ	14,200	723.00	10,266,600	貸付株式数 5,600株
ヒマラヤ	1,500	918.00	1,377,000	貸付株式数 900株
コーナン商事	10,700	3,700.00	39,590,000	
ネットワンシステムズ	33,400	2,056.00	68,670,400	
エコス	3,200	2,227.00	7,126,400	
ワタミ	9,200	1,040.00	9,568,000	貸付株式数 3,900株
マルシェ	1,700	273.00	464,100	貸付株式数 300株
リックス	1,500	3,280.00	4,920,000	
システムソフト	28,000	67.00	1,876,000	貸付株式数 1,500株
パンパシフィックHD	176,400	3,204.00	565,185,600	
丸文	7,800	1,508.00	11,762,400	
西松屋チェーン	17,200	2,157.00	37,100,400	貸付株式数 7,200株
ゼンショーホールディングス	43,000	8,214.00	353,202,000	
ハピネット	7,400	2,577.00	19,069,800	
幸楽苑ホールディングス	6,300	1,159.00	7,301,700	貸付株式数 2,500株
ハークスレイ	1,700	689.00	1,171,300	
橋本総業HLDS	3,400	1,200.00	4,080,000	
日本ライフライン	25,600	1,164.00	29,798,400	
サイゼリヤ	12,900	5,740.00	74,046,000	
タカショー	7,500	550.00	4,125,000	貸付株式数 2,900株
VTホールディングス	33,000	524.00	17,292,000	
アルゴグラフィックス	7,600	3,735.00	28,386,000	
魚力	3,000	2,205.00	6,615,000	貸付株式数 900株
IDOM	23,100	922.00	21,298,200	
日本エム・ディ・エム	6,500	703.00	4,569,500	
ポプラ	1,200	196.00	235,200	貸付株式数 200株
フジ・コーポレーション	4,300	1,600.00	6,880,000	
ユナイテッドアローズ	10,300	1,959.00	20,177,700	貸付株式数 2,900株
進和	5,400	2,499.00	13,494,600	貸付株式数 2,000株
エスケイジャパン	1,200	811.00	973,200	
ダイトロン	3,400	2,964.00	10,077,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ハイデイ日高	12,900	2,749.00	35,462,100	貸付株式数 4,700株
シークス	12,500	1,518.00	18,975,000	貸付株式数 4,900株
YU-WA CREATION H	2,700	159.00	429,300	
コロワイド	37,500	2,234.00	83,775,000	貸付株式数 15,000株
田中商事	1,300	700.00	910,000	貸付株式数 100株
オーハシテクニカ	4,600	1,748.00	8,040,800	
壺番屋	6,900	5,330.00	36,777,000	貸付株式数 100株
白銅	2,400	2,299.00	5,517,600	貸付株式数 1,100株
トップカルチャー	1,600	170.00	272,000	貸付株式数 400株
PLANT	1,100	1,430.00	1,573,000	
スギホールディングス	17,600	6,414.00	112,886,400	
ダイコー通産	500	1,194.00	597,000	貸付株式数 200株
薬王堂ホールディングス	4,200	2,711.00	11,386,200	
島津製作所	109,700	3,835.00	420,699,500	
J M S	7,500	517.00	3,877,500	
クボテック	1,200	277.00	332,400	貸付株式数 400株
長野計器	6,000	2,083.00	12,498,000	
ブイ・テクノロジー	4,400	2,657.00	11,690,800	
スター精密	15,600	1,877.00	29,281,200	
東京計器	6,300	1,762.00	11,100,600	貸付株式数 1,600株
愛知時計	3,600	2,352.00	8,467,200	
インターアクション	4,000	1,016.00	4,064,000	貸付株式数 1,200株
オーバル	4,000	486.00	1,944,000	貸付株式数 1,600株
東京精密	16,900	8,577.00	144,951,300	
マニー	33,000	2,193.00	72,369,000	
ニコン	119,400	1,424.50	170,085,300	
トプコン	40,100	1,517.00	60,831,700	
オリンパス	508,300	2,166.00	1,100,977,800	
理研計器	5,800	6,630.00	38,454,000	
SCREENホールディングス	28,200	10,770.00	303,714,000	
キヤノン電子	9,100	1,971.00	17,936,100	
タムロン	5,100	4,415.00	22,516,500	
HOYA	164,000	16,665.00	2,733,060,000	
シード	2,300	852.00	1,959,600	
ノーリツ鋼機	7,800	2,993.00	23,345,400	
A&Dホロンホールディングス	12,000	1,870.00	22,440,000	
朝日インテック	92,200	2,866.50	264,291,300	貸付株式数 22,300株
キヤノン	411,900	3,807.00	1,568,103,300	貸付株式数 159,400株
リコー	207,100	1,207.00	249,969,700	
シチズン時計	76,000	867.00	65,892,000	
リズム	1,000	2,491.00	2,491,000	貸付株式数 400株
大研医器	3,800	516.00	1,960,800	
メニコン	28,400	2,154.00	61,173,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
シンシア	500	561.00	280,500	貸付株式数 200株
KYORITSU	6,700	167.00	1,118,900	
中本パックス	1,500	1,634.00	2,451,000	貸付株式数 100株
スノーピーク	11,800	1,012.00	11,941,600	貸付株式数 4,800株 (100株)
パラマウントベッドHD	17,100	2,763.00	47,247,300	
トランザクション	5,400	2,112.00	11,404,800	貸付株式数 1,900株
粧美堂	1,200	612.00	734,400	
ニホンフラッシュ	7,700	896.00	6,899,200	
前田工織	6,900	2,959.00	20,417,100	貸付株式数 2,600株
永大産業	5,300	222.00	1,176,600	
アートネイチャー	7,400	790.00	5,846,000	
バンダイナムコHLDGS	226,200	2,943.00	665,706,600	
アイフィスジャパン	1,400	625.00	875,000	
SHOEI	18,700	1,985.00	37,119,500	
フランスベッドHLDGS	10,600	1,251.00	13,260,600	貸付株式数 3,400株
マーベラス	13,300	697.00	9,270,100	
パイロットコーポレーション	11,600	4,469.00	51,840,400	
萩原工業	5,500	1,591.00	8,750,500	貸付株式数 1,900株 (500株)
エイベックス	14,100	1,392.00	19,627,200	
フジシールインターナショナル	16,700	1,675.00	27,972,500	
タカラトミー	37,600	2,078.50	78,151,600	
広済堂ホールディングス	18,500	635.00	11,747,500	貸付株式数 1,400株
エステールホールディングス	1,000	629.00	629,000	貸付株式数 700株
レック	10,500	994.00	10,437,000	
タカノ	1,700	842.00	1,431,400	貸付株式数 800株
三光合成	10,400	540.00	5,616,000	
プロネクサス	8,500	1,209.00	10,276,500	
ホクシン	3,400	117.00	397,800	貸付株式数 2,000株
ウッドワン	1,700	982.00	1,669,400	貸付株式数 600株
きもと	7,600	191.00	1,451,600	
TOPPANホールディングス	101,500	3,464.00	351,596,000	
大日本印刷	90,300	4,153.00	375,015,900	
共同印刷	2,300	3,600.00	8,280,000	
NISSHA	14,100	1,475.00	20,797,500	
光村印刷	400	1,266.00	506,400	
藤森工業	6,500	3,885.00	25,252,500	
ヴィア・ホールディングス	7,100	215.00	1,526,500	貸付株式数 2,800株
TAKARA & COMPANY	5,300	2,460.00	13,038,000	
前澤化成工業	5,300	1,580.00	8,374,000	貸付株式数 2,000株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
未来工業	2,900	3,145.00	9,120,500	
アシックス	70,400	5,290.00	372,416,000	
ツ ツ ミ	1,900	2,144.00	4,073,600	
ウェーブロックHLDGS	1,700	644.00	1,094,800	貸付株式数 200株
ジェイ エス ピー	5,800	1,783.00	10,341,400	貸付株式数 1,400株
ニ チ ハ	10,400	2,776.00	28,870,400	
ローランド	6,100	4,540.00	27,694,000	
エフピコ	15,700	2,791.00	43,818,700	
小松ウオール工業	3,300	2,927.00	9,659,100	
ヤマハ	52,100	3,461.00	180,318,100	
河合楽器	2,500	3,155.00	7,887,500	
クリナップ	7,900	696.00	5,498,400	
ビジョン	52,600	1,659.00	87,263,400	
天馬	6,000	2,336.00	14,016,000	
キングジム	7,100	870.00	6,177,000	貸付株式数 2,200株
象印マホービン	22,400	1,556.00	34,854,400	
リンテック	16,600	2,494.00	41,400,400	
信越ポリマー	17,800	1,429.00	25,436,200	
東 リ	11,300	338.00	3,819,400	
イトーキ	16,900	1,320.00	22,308,000	
任 天 堂	521,300	6,912.00	3,603,225,600	
三菱鉛筆	11,700	1,888.00	22,089,600	
松 風	3,700	2,673.00	9,890,100	
タカラスタANDARD	17,300	1,777.00	30,742,100	
コ ク ヨ	33,800	2,302.50	77,824,500	
ナカバヤシ	8,700	528.00	4,593,600	
ニ フ コ	24,800	3,612.00	89,577,600	
立川ブラインド	3,800	1,484.00	5,639,200	貸付株式数 1,500株
グローブライド	7,400	2,024.00	14,977,600	
オカムラ	24,800	2,131.00	52,848,800	
バルカー	6,900	3,905.00	26,944,500	
MUTOHホールディングス	600	1,930.00	1,158,000	
伊 藤 忠	587,300	5,738.00	3,369,927,400	
丸 紅	728,400	2,307.00	1,680,418,800	
スクロール	13,000	925.00	12,025,000	
高 島	3,300	957.00	3,158,100	
ヨンドシーホールディングス	8,300	1,955.00	16,226,500	貸付株式数 100株
三陽商会	2,700	2,698.00	7,284,600	貸付株式数 200株
長瀬産業	40,000	2,323.50	92,940,000	
ナイガイ	1,500	269.00	403,500	貸付株式数 600株 (100株)
蝶 理	5,500	2,785.00	15,317,500	
豊田通商	76,500	8,190.00	626,535,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
オンワードホールディングス	48,700	501.00	24,398,700	
三共生興	12,100	742.00	8,978,200	
兼松	36,500	2,054.00	74,971,000	
美津濃	8,200	4,045.00	33,169,000	
ツカモトコーポレーション	700	1,223.00	856,100	
ルックホールディングス	2,000	2,483.00	4,966,000	貸付株式数 800株
三井物産	658,200	5,392.00	3,549,014,400	
日本紙パルプ	4,200	4,995.00	20,979,000	
東京エレクトロン	174,800	24,025.00	4,199,570,000	
カメイ	9,300	1,705.00	15,856,500	
東都水産	300	6,860.00	2,058,000	貸付株式数 100株
OUGホールディングス	900	2,390.00	2,151,000	
スターゼン	6,200	2,463.00	15,270,600	
セイコーグループ	11,500	2,505.00	28,807,500	
山善	26,500	1,200.00	31,800,000	
椿本興業	1,800	6,040.00	10,872,000	
住友商事	528,900	3,100.00	1,639,590,000	
BIPROGY	27,100	4,273.00	115,798,300	
内田洋行	3,500	7,200.00	25,200,000	
三菱商事	577,100	6,886.00	3,973,910,600	
第一実業	8,200	1,916.00	15,711,200	
キャノンマーケティングJPN	20,200	3,731.00	75,366,200	
西華産業	3,500	2,677.00	9,369,500	
佐藤商事	6,000	1,524.00	9,144,000	
菱洋エレクトロ	8,300	3,710.00	30,793,000	
東京産業	8,100	869.00	7,038,900	
ユアサ商事	6,800	4,430.00	30,124,000	
神鋼商事	2,200	5,710.00	12,562,000	
トルク	2,500	287.00	717,500	貸付株式数 1,000株
阪和興業	15,700	4,560.00	71,592,000	
正栄食品	5,800	4,515.00	26,187,000	貸付株式数 2,100株
カナデン	6,600	1,473.00	9,721,800	
RYODEN	7,000	2,606.00	18,242,000	貸付株式数 2,400株
ニプロ	68,700	1,118.00	76,806,600	
岩谷産業	19,900	7,106.00	141,409,400	
ナイス	2,500	1,619.00	4,047,500	
ニチモウ	800	4,095.00	3,276,000	
極東貿易	5,200	1,888.00	9,817,600	貸付株式数 400株
アステナホールディングス	16,400	497.00	8,150,800	貸付株式数 5,100株
三愛オブリ	21,000	1,617.00	33,957,000	
稲畑産業	17,300	3,165.00	54,754,500	
GSIクレオス	4,700	2,052.00	9,644,400	
明和産業	10,300	659.00	6,787,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
クワザワホールディングス	1,700	689.00	1,171,300	
ゴールドウイン	14,600	11,535.00	168,411,000	
ユニ・チャーム	172,500	4,763.00	821,617,500	
デサント	14,300	4,255.00	60,846,500	
キング	1,700	674.00	1,145,800	
ワキタ	14,500	1,485.00	21,532,500	
ヤマトインターナショナル	3,500	300.00	1,050,000	
東邦ホールディングス	24,100	3,230.00	77,843,000	貸付株式数 7,900 株
サンゲツ	20,100	2,868.00	57,646,800	
ミツウロコグループ	11,100	1,312.00	14,563,200	
シナネンホールディングス	2,400	4,065.00	9,756,000	
伊藤忠エネクス	21,600	1,528.00	33,004,800	
サンリオ	24,800	6,069.00	150,511,200	
サンワ テクノス	4,500	2,233.00	10,048,500	
リョーサン	6,200	4,945.00	30,659,000	
新光商事	11,700	1,208.00	14,133,600	
トーホー	3,400	3,095.00	10,523,000	貸付株式数 1,100 株
三信電気	3,500	2,296.00	8,036,000	
東陽テクニカ	8,800	1,388.00	12,214,400	
モスフード サービス	12,700	3,335.00	42,354,500	
加賀電子	8,000	6,630.00	53,040,000	
三益半導体	6,600	2,776.00	18,321,600	
都築電気	4,300	2,093.00	8,999,900	貸付株式数 1,600 株
ソーダニツカ	6,500	1,034.00	6,721,000	
立花エレテック	5,800	2,905.00	16,849,000	貸付株式数 2,000 株
木曽路	13,200	2,491.00	32,881,200	貸付株式数 1,500 株
SRSホールディングス	14,100	1,037.00	14,621,700	貸付株式数 5,200 株
千趣会	15,700	398.00	6,248,600	貸付株式数 6,000 株
タカキュー	3,300	80.00	264,000	貸付株式数 600 株
リテールパートナーズ	12,900	1,778.00	22,936,200	貸付株式数 1,800 株
上新電機	8,600	2,313.00	19,891,800	
日本瓦斯	46,300	2,237.00	103,573,100	
ロイヤルホールディングス	15,400	2,676.00	41,210,400	貸付株式数 6,100 株
東天紅	400	825.00	330,000	貸付株式数 100 株
いなげや	8,300	1,501.00	12,458,300	
チヨダ	8,200	843.00	6,912,600	貸付株式数 1,300 株
ライフコーポレーション	9,200	3,405.00	31,326,000	
リンガーハット	11,200	2,312.00	25,894,400	貸付株式数 4,400 株 (600 株)
MrMaxHD	10,800	628.00	6,782,400	
テンアライド	6,200	309.00	1,915,800	貸付株式数 600 株
AOKIホールディングス	18,700	1,183.00	22,122,100	
オークワ	12,400	830.00	10,292,000	貸付株式数 200 株
コメリ	13,400	3,155.00	42,277,000	貸付株式数 5,000 株
青山商事	18,700	1,581.00	29,564,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
しまむら	10,300	16,555.00	170,516,500	
はせがわ	2,200	368.00	809,600	
高島屋	60,400	1,992.50	120,347,000	
松屋	14,800	859.00	12,713,200	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	38,600	1,646.00	63,535,600	
近鉄百貨店	3,700	2,643.00	9,779,100	
丸井グループ	58,100	2,364.50	137,377,450	
クレディセゾン	51,600	2,490.50	128,509,800	
アクシアル リテイリング	5,900	3,895.00	22,980,500	
井筒屋	2,300	352.00	809,600	貸付株式数 1,000株
イオン	296,100	3,061.00	906,362,100	
イズミ	15,500	3,534.00	54,777,000	
フオーバル	3,400	1,390.00	4,726,000	貸付株式数 1,300株
平和堂	14,600	2,322.00	33,901,200	貸付株式数 5,200株
フジ	13,400	1,875.00	25,125,000	貸付株式数 3,300株
ヤオコー	9,800	8,067.00	79,056,600	貸付株式数 3,900株
ゼビオホールディングス	11,800	944.00	11,139,200	
ケーズホールディングス	61,700	1,259.50	77,711,150	
PALTAC	11,800	4,755.00	56,109,000	
三谷産業	15,000	334.00	5,010,000	
OLYMPICグループ	2,100	511.00	1,073,100	貸付株式数 100株
日産東京販売HD	7,100	438.00	3,109,800	
あおぞら銀行	58,500	3,040.00	177,840,000	貸付株式数 23,300株
三菱UFJフィナンシャル G	5,094,300	1,255.00	6,393,346,500	※
りそなホールディングス	949,400	768.50	729,613,900	
三井住友トラストHD	146,300	5,559.00	813,281,700	
三井住友フィナンシャルG	578,500	7,258.00	4,198,753,000	※
千葉銀行	226,800	1,106.50	250,954,200	
群馬銀行	157,900	747.80	118,077,620	
武蔵野銀行	11,400	2,856.00	32,558,400	
千葉興業銀行	13,500	830.00	11,205,000	
筑波銀行	35,800	267.00	9,558,600	
七十七銀行	23,700	3,430.00	81,291,000	
秋田銀行	5,500	1,977.00	10,873,500	
山形銀行	9,100	1,059.00	9,636,900	
岩手銀行	5,200	2,475.00	12,870,000	
東邦銀行	64,400	291.00	18,740,400	
東北銀行	2,200	1,163.00	2,558,600	
ふくおかフィナンシャルG	70,900	3,433.00	243,399,700	
スルガ銀行	63,000	751.00	47,313,000	
八十二銀行	174,600	801.10	139,872,060	
山梨中央銀行	9,100	1,794.00	16,325,400	
大垣共立銀行	15,600	1,897.00	29,593,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
福井銀行	7,300	1,554.00	11,344,200	
清水銀行	3,200	1,532.00	4,902,400	
富山銀行	800	1,707.00	1,365,600	
滋賀銀行	13,500	3,745.00	50,557,500	
南都銀行	12,300	2,486.00	30,577,800	
百五銀行	76,700	541.00	41,494,700	
紀陽銀行	29,200	1,591.00	46,457,200	
ほくほくフィナンシャルG	50,400	1,568.00	79,027,200	
山陰合同銀行	51,000	958.00	48,858,000	
鳥取銀行	1,600	1,325.00	2,120,000	
百十四銀行	8,000	2,597.00	20,776,000	
四国銀行	12,100	1,001.00	12,112,100	
阿波銀行	11,500	2,495.00	28,692,500	
大分銀行	4,900	2,642.00	12,945,800	
宮崎銀行	4,900	2,646.00	12,965,400	
佐賀銀行	4,800	1,875.00	9,000,000	
琉球銀行	17,400	1,119.00	19,470,600	
セブン銀行	255,400	300.30	76,696,620	
みずほフィナンシャルG	1,098,500	2,512.00	2,759,432,000	
高知銀行	1,600	964.00	1,542,400	
山口フィナンシャルG	79,900	1,298.50	103,750,150	
芙蓉総合リース	7,500	12,000.00	90,000,000	
みずほリース	13,700	4,960.00	67,952,000	
東京センチュリー	15,200	5,892.00	89,558,400	
SBIホールディングス	119,100	3,207.00	381,953,700	
日本証券金融	29,900	1,559.00	46,614,100	
アイフル	120,100	379.00	45,517,900	
日本アジア投資	3,400	236.00	802,400	
名古屋銀行	5,300	5,560.00	29,468,000	
北洋銀行	123,400	365.00	45,041,000	
大光銀行	1,500	1,308.00	1,962,000	貸付株式数 300株
愛媛銀行	11,100	1,008.00	11,188,800	
トマト銀行	1,700	1,145.00	1,946,500	
京葉銀行	34,100	701.00	23,904,100	
栃木銀行	40,700	318.00	12,942,600	
北日本銀行	2,700	2,116.00	5,713,200	
東和銀行	15,200	622.00	9,454,400	
福島銀行	5,000	252.00	1,260,000	
大東銀行	2,000	766.00	1,532,000	貸付株式数 500株
リコーリース	7,800	4,640.00	36,192,000	
イオンフィナンシャルサー ビス	47,100	1,267.00	59,675,700	
アコム	146,300	348.50	50,985,550	
ジャックス	8,700	5,370.00	46,719,000	
オリコ	26,800	1,082.00	28,997,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
オリックス	495,600	2,698.50	1,337,376,600	
三菱HCキャピタル	363,100	964.40	350,173,640	
ジャフコグループ	24,300	1,703.00	41,382,900	貸付株式数 10,400株
九州リースサービス	1,800	940.00	1,692,000	貸付株式数 1,200株
トモニホールディングス	66,100	490.00	32,389,000	
大和証券G本社	630,400	955.40	602,284,160	
野村ホールディングス	1,368,200	607.30	830,907,860	
岡三証券グループ	71,500	714.00	51,051,000	貸付株式数 24,800株
丸三証券	27,100	849.00	23,007,900	貸付株式数 10,400株
東洋証券	21,600	299.00	6,458,400	
東海東京HD	96,900	553.00	53,585,700	
光世証券	1,100	513.00	564,300	貸付株式数 200株
水戸証券	24,200	436.00	10,551,200	
いちよし証券	15,500	732.00	11,346,000	
松井証券	40,300	742.00	29,902,600	
SOMP Oホールディングス	128,000	6,757.00	864,896,000	
日本取引所グループ	212,300	3,019.00	640,933,700	
マネックスG	79,700	661.00	52,681,700	貸付株式数 33,900株
極東証券	11,300	1,033.00	11,672,900	
岩井コスモホールディング	9,400	1,760.00	16,544,000	
アイザワ証券グループ	11,800	1,198.00	14,136,400	
フィデアホール	8,500	1,468.00	12,478,000	
池田泉州HD	113,100	342.00	38,680,200	
アニコムホールディングス	27,000	603.00	16,281,000	
MS&AD	180,500	5,533.00	998,706,500	
マネーパートナーズGP	4,900	286.00	1,401,400	
スパークス・グループ	9,100	1,489.00	13,549,900	
小林洋行	2,100	233.00	489,300	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	396,200	3,081.00	1,220,692,200	
東京海上HD	801,900	3,648.00	2,925,331,200	
アドバンテッジリスクマネ	2,300	487.00	1,120,100	貸付株式数 900株
イー・ギャランティ	13,300	1,942.00	25,828,600	
アサックス	2,300	698.00	1,605,400	貸付株式数 1,300株
NECキャピタルソリューション	4,000	3,365.00	13,460,000	
T&Dホールディングス	235,400	2,186.50	514,702,100	
アドバンスクリエイト	4,600	1,002.00	4,609,200	貸付株式数 1,800株
三井不動産	376,100	3,472.00	1,305,819,200	
三菱地所	531,700	1,996.50	1,061,539,050	
平和不動産	13,200	4,035.00	53,262,000	
東京建物	71,100	2,101.50	149,416,650	
京阪神ビルディング	15,100	1,418.00	21,411,800	
住友不動産	117,700	4,174.00	491,279,800	
太平洋興発	1,800	795.00	1,431,000	貸付株式数 800株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
テーオーシー	14,500	600.00	8,700,000	
東京楽天地	1,300	4,300.00	5,590,000	貸付株式数 500株
スターツコーポレーション	11,700	2,789.00	32,631,300	
フジ住宅	10,200	715.00	7,293,000	
空港施設	11,300	565.00	6,384,500	
明和地所	4,000	1,184.00	4,736,000	
ゴールドクレスト	6,600	2,007.00	13,246,200	貸付株式数 800株
リログループ	42,600	1,553.00	66,157,800	
エスリード	3,800	3,180.00	12,084,000	貸付株式数 1,200株
日神グループHLDGS	13,000	495.00	6,435,000	貸付株式数 4,400株
日本エスコン	15,200	915.00	13,908,000	
MIRARTHホールディング	37,300	466.00	17,381,800	
AVANTIA	2,500	861.00	2,152,500	貸付株式数 900株
イオンモール	42,100	1,719.50	72,390,950	
毎日コムネット	1,600	743.00	1,188,800	貸付株式数 100株
ファースト住建	1,900	1,073.00	2,038,700	貸付株式数 900株
ランド	444,700	7.00	3,112,900	貸付株式数 171,300株
カチタス	21,900	2,150.00	47,085,000	
東祥	5,900	816.00	4,814,400	貸付株式数 2,000株
トーセイ	13,500	1,801.00	24,313,500	
穴吹興産	900	2,022.00	1,819,800	貸付株式数 600株
サンフロンティア不動産	12,000	1,560.00	18,720,000	
インテリックス	1,100	501.00	551,100	
ランドビジネス	1,600	262.00	419,200	貸付株式数 700株
サンネクスタグループ	1,300	943.00	1,225,900	貸付株式数 200株
グランディハウス	5,300	590.00	3,127,000	
東武鉄道	90,600	3,655.00	331,143,000	
相鉄ホールディングス	29,500	2,682.50	79,133,750	
東急	231,500	1,735.50	401,768,250	
京浜急行	102,100	1,262.00	128,850,200	
小田急電鉄	136,500	2,079.50	283,851,750	
京王電鉄	39,700	4,263.00	169,241,100	
京成電鉄	53,200	5,960.00	317,072,000	
富士急行	10,200	4,330.00	44,166,000	貸付株式数 3,700株
東日本旅客鉄道	151,700	7,995.00	1,212,841,500	
西日本旅客鉄道	97,900	5,847.00	572,421,300	
東海旅客鉄道	318,000	3,550.00	1,128,900,000	
西武ホールディングス	99,900	1,784.50	178,271,550	
鴻池運輸	14,000	1,969.00	27,566,000	
西日本鉄道	22,000	2,367.50	52,085,000	
ハマキョウレックス	7,000	4,005.00	28,035,000	
サカイ引越センター	9,100	2,612.00	23,769,200	
近鉄グループHLDGS	82,400	4,146.00	341,630,400	
阪急阪神HLDGS	109,900	4,471.00	491,362,900	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
南海電鉄	36,700	2,802.50	102,851,750	貸付株式数 1,300株
京阪ホールディングス	45,400	3,692.00	167,616,800	
神戸電鉄	2,200	2,938.00	6,463,600	貸付株式数 800株
名古屋鉄道	85,000	2,164.50	183,982,500	
山陽電鉄	6,100	2,123.00	12,950,300	貸付株式数 2,300株
アルプス物流	6,500	1,613.00	10,484,500	貸付株式数 2,200株
トランコム	2,400	7,560.00	18,144,000	
ヤマトホールディングス	105,600	2,628.50	277,569,600	
山 九	21,000	5,039.00	105,819,000	
日 新	6,300	2,510.00	15,813,000	
丸 運	2,600	260.00	676,000	貸付株式数 1,300株
丸全昭和運輸	5,100	3,740.00	19,074,000	
センコーグループHLDGS	43,500	1,057.00	45,979,500	
トナミホールディングス	1,800	4,630.00	8,334,000	
ニッコンホールディングス	26,400	3,217.00	84,928,800	
日石輸送	500	2,844.00	1,422,000	
福山通運	9,400	3,665.00	34,451,000	
セイノーホールディングス	46,300	2,083.00	96,442,900	
エスライングループ本社	1,300	859.00	1,116,700	貸付株式数 700株
神奈川中央交通	2,300	3,045.00	7,003,500	
AZ-COM丸和ホールディング	19,900	1,501.00	29,869,900	貸付株式数 7,900株
C&Fロジホールディングス	7,900	1,511.00	11,936,900	貸付株式数 800株
日本郵船	236,300	3,974.00	939,056,200	
商船三井	178,900	4,061.00	726,512,900	
川崎汽船	69,700	5,189.00	361,673,300	貸付株式数 27,800株
NSユニテッド海運	4,400	4,865.00	21,406,000	貸付株式数 1,500株
明海グループ	5,000	692.00	3,460,000	
飯野海運	30,200	1,223.00	36,934,600	
共栄タンカー	800	826.00	660,800	貸付株式数 200株
九州旅客鉄道	58,200	3,091.00	179,896,200	
SGホールディングス	138,400	2,137.50	295,830,000	
NIPPON EXPRESS	28,000	8,071.00	225,988,000	
ID&Eホールディングス	5,100	3,275.00	16,702,500	
日本航空	202,400	2,811.00	568,946,400	
ANAホールディングス	224,300	3,052.00	684,563,600	
ビーウィズ	2,100	2,271.00	4,769,100	貸付株式数 800株
パスコ	900	1,689.00	1,520,100	
TREホールディングス	16,200	1,122.00	18,176,400	
人・夢・技術グループ	3,200	1,854.00	5,932,800	
西本WISMETTACHD	2,200	6,190.00	13,618,000	貸付株式数 700株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
シルバーライフ	1,700	1,034.00	1,757,800	貸付株式数 600株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	400	2,122.00	848,800	
GENKY DRUG STORES	3,800	5,100.00	19,380,000	貸付株式数 1,300株
コア商事HLDGS	4,800	735.00	3,528,000	貸付株式数 1,800株
KPPグループホールディングン	22,600	709.00	16,023,400	
ナルミヤ・インターナショナル	800	1,128.00	902,400	貸付株式数 100株
ブックオフGHD	4,400	1,085.00	4,774,000	貸付株式数 1,700株
ギフトホールディングス	3,700	2,032.00	7,518,400	
三菱倉庫	20,300	4,431.00	89,949,300	
三井倉庫HOLD	7,700	4,835.00	37,229,500	
住友倉庫	22,200	2,439.00	54,145,800	
渋沢倉庫	3,700	2,833.00	10,482,100	
ヤマタネ	3,900	2,248.00	8,767,200	
東陽倉庫	1,200	1,518.00	1,821,600	
乾汽船	9,600	1,214.00	11,654,400	貸付株式数 1,800株
日本トランスシティ	16,400	622.00	10,200,800	
ケイヒン	800	1,761.00	1,408,800	
中央倉庫	4,400	1,124.00	4,945,600	貸付株式数 1,500株
川西倉庫	800	1,085.00	868,000	貸付株式数 200株
安田倉庫	5,500	1,125.00	6,187,500	
ファイズホールディングス	700	1,084.00	758,800	貸付株式数 400株
NISSOHD	7,300	786.00	5,737,800	
大栄環境	15,400	2,321.00	35,743,400	
日本管財ホールディングク	8,900	2,488.00	22,143,200	
東洋埠頭	1,300	1,375.00	1,787,500	
上組	39,500	3,239.00	127,940,500	
サンリツ	1,100	736.00	809,600	貸付株式数 300株
キムラユニティー	2,100	1,423.00	2,988,300	
キューソー流通システム	3,200	902.00	2,886,400	貸付株式数 1,200株
東海運	2,600	285.00	741,000	
エーアイテイー	5,100	1,664.00	8,486,400	
内外トランスライン	3,300	2,519.00	8,312,700	貸付株式数 1,200株
ショーエイコーポ	1,400	585.00	819,000	貸付株式数 600株
日本コンセプト	3,000	1,683.00	5,049,000	
TBSホールディングス	42,400	2,746.50	116,451,600	
日本テレビHLD S	73,200	1,441.00	105,481,200	
朝日放送グループHD	7,600	643.00	4,886,800	貸付株式数 2,600株
テレビ朝日HD	19,900	1,675.00	33,332,500	
スカパーJ SATHD	64,200	678.00	43,527,600	
テレビ東京HD	5,900	2,990.00	17,641,000	
日本BS放送	1,600	887.00	1,419,200	
ビジョン	12,500	1,162.00	14,525,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
スマートバリュー	1,100	420.00	462,000	貸付株式数 400株
USEN-NEXT HL DGS	9,300	3,775.00	35,107,500	貸付株式数 3,300株
ワイヤレスゲート	2,000	191.00	382,000	貸付株式数 100株
日本通信	81,600	227.00	18,523,200	
クロップス	600	1,001.00	600,600	
日本電信電話	24,635,400	173.10	4,264,387,740	
KDDI	640,000	4,625.00	2,960,000,000	
ソフトバンク	1,332,400	1,798.50	2,396,321,400	
光通信	8,300	22,990.00	190,817,000	
エムティーアイ	5,600	602.00	3,371,200	貸付株式数 2,000株
GMOインターネットグループ	30,600	2,376.50	72,720,900	
ファイバーゲート	4,500	961.00	4,324,500	貸付株式数 200株
アイドママーケティングコミュ	1,200	235.00	282,000	貸付株式数 600株
KADOKAWA	43,800	2,664.00	116,683,200	
学研ホールディングス	13,700	977.00	13,384,900	
ゼンリン	14,000	894.00	12,516,000	
昭文社ホールディングス	1,900	357.00	678,300	
インプレスホールディングス	4,600	182.00	837,200	貸付株式数 1,800株
東京電力HD	744,300	630.90	469,578,870	貸付株式数 255,600株
中部電力	304,300	1,827.00	555,956,100	
関西電力	318,900	1,971.00	628,551,900	
中国電力	143,500	976.40	140,113,400	
北陸電力	84,400	722.30	60,962,120	
東北電力	217,400	946.90	205,856,060	
四国電力	76,900	1,023.00	78,668,700	
九州電力	190,400	990.60	188,610,240	
北海道電力	79,700	625.80	49,876,260	
沖縄電力	21,000	1,084.00	22,764,000	
電源開発	67,800	2,297.50	155,770,500	
エフオン	5,300	476.00	2,522,800	
イーレックス	14,600	659.00	9,621,400	貸付株式数 5,800株
レノバ	22,000	1,055.00	23,210,000	貸付株式数 8,800株
東京瓦斯	174,500	3,427.00	598,011,500	
大阪瓦斯	167,200	2,880.00	481,536,000	
東邦瓦斯	35,700	2,635.50	94,087,350	
北海道瓦斯	4,900	2,261.00	11,078,900	貸付株式数 1,000株
広島ガス	17,100	374.00	6,395,400	
西部ガスHLDGS	8,500	1,873.00	15,920,500	
静岡ガス	16,400	1,020.00	16,728,000	
メタウォーター	9,900	2,049.00	20,285,100	
アイネット	5,000	1,900.00	9,500,000	
松竹	4,300	9,378.00	40,325,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
東 宝	46,100	5,131.00	236,539,100	
エイチ・アイ・エス	24,700	1,722.00	42,533,400	貸付株式数 9,800 株
東 映	2,700	17,720.00	47,844,000	
ラックランド	3,800	2,735.00	10,393,000	貸付株式数 1,500 株
NTTデータグループ	216,600	1,797.00	389,230,200	
共立メンテナンス	13,300	5,739.00	76,328,700	貸付株式数 5,300 株
イチネンホールディングス	8,900	1,543.00	13,732,700	
建設技術研究所	4,400	4,855.00	21,362,000	
スペース	5,500	907.00	4,988,500	
アインホールディングス	12,000	4,500.00	54,000,000	
燦ホールディングス	8,000	1,104.00	8,832,000	
ピー・シー・エー	4,800	1,173.00	5,630,400	
スバル興業	500	13,230.00	6,615,000	貸付株式数 100 株
東京テアトル	1,700	1,092.00	1,856,400	
タナベコンサルティンググループ	2,500	1,040.00	2,600,000	
ビジネスB太田昭和	3,200	2,138.00	6,841,600	
ナ ガ ロ	2,600	6,690.00	17,394,000	貸付株式数 1,000 株
東京都競馬	7,100	4,410.00	31,311,000	貸付株式数 2,800 株
常磐興産	1,800	1,236.00	2,224,800	貸付株式数 700 株
カナモト	13,200	2,580.00	34,056,000	
D T S	17,600	3,515.00	61,864,000	
スクウェア・エニックス・HD	37,800	5,132.00	193,989,600	
シーイーシー	10,500	1,795.00	18,847,500	
カプコン	74,000	4,983.00	368,742,000	
ニシオホールディングス	7,900	3,640.00	28,756,000	
アイ・エス・ビー	4,200	1,503.00	6,312,600	貸付株式数 1,200 株
アゴーラ ホスピタリティーG	29,800	23.00	685,400	貸付株式数 15,600 株
日本空港ビルデング	28,800	6,500.00	187,200,000	
トランス・コスモス	10,600	3,100.00	32,860,000	貸付株式数 3,200 株
乃村工藝社	37,000	840.00	31,080,000	
ジャステック	5,100	1,463.00	7,461,300	貸付株式数 1,500 株
S C S K	58,000	2,724.00	157,992,000	
藤田観光	3,400	3,970.00	13,498,000	貸付株式数 1,300 株
KNT-CTホールディングス	5,100	1,245.00	6,349,500	貸付株式数 1,900 株
トーカイ	7,500	1,915.00	14,362,500	
白 洋 舎	700	2,430.00	1,701,000	貸付株式数 100 株
セコム	86,400	10,295.00	889,488,000	
NSW	3,700	2,935.00	10,859,500	
セントラル警備保障	4,600	2,454.00	11,288,400	貸付株式数 100 株
アイネス	6,400	1,666.00	10,662,400	
丹青社	16,400	890.00	14,596,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
メイテックグループホールデ	30,600	2,867.50	87,745,500	
TKC	13,100	3,540.00	46,374,000	
富士ソフト	16,600	5,990.00	99,434,000	貸付株式数 6,600株
応用地質	7,900	2,091.00	16,518,900	
船井総研ホールディング	17,600	2,521.00	44,369,600	
NSD	29,500	2,800.00	82,600,000	
進学会ホールディングス	1,200	275.00	330,000	
丸紅建材リース	400	2,546.00	1,018,400	
オオバ	2,900	918.00	2,662,200	貸付株式数 1,300株
コナミグループ	31,000	7,315.00	226,765,000	
いであ	1,200	1,756.00	2,107,200	
学究社	3,400	1,934.00	6,575,600	
ベネッセホールディングス	28,600	2,608.00	74,588,800	
イオンディライト	9,400	3,515.00	33,041,000	貸付株式数 3,200株
ナック	3,600	985.00	3,546,000	貸付株式数 1,200株
福井コンピュータHLDS	5,100	2,643.00	13,479,300	
ダイセキ	17,300	3,920.00	67,816,000	貸付株式数 5,900株
ステップ	3,100	1,875.00	5,812,500	
泉州電業	4,400	3,395.00	14,938,000	貸付株式数 700株
元気寿司	4,900	3,190.00	15,631,000	貸付株式数 1,800株
トラスコ中山	18,300	2,377.00	43,499,100	
ヤマダホールディングス	268,600	428.50	115,095,100	
オートバックスセブン	30,300	1,545.50	46,828,650	
モリト	6,200	1,295.00	8,029,000	
アー克蘭ズ	25,900	1,648.00	42,683,200	
ニトリホールディングス	31,800	17,060.00	542,508,000	
グルメ杵屋	6,900	1,060.00	7,314,000	貸付株式数 2,500株
愛眼	3,500	172.00	602,000	貸付株式数 1,800株
ケーユーホールディングス	4,000	1,126.00	4,504,000	
吉野家ホールディングス	32,200	3,270.00	105,294,000	貸付株式数 13,200株
加藤産業	10,900	4,680.00	51,012,000	
北恵	1,200	830.00	996,000	貸付株式数 400株
イノテック	5,400	1,729.00	9,336,600	
イエローハット	13,900	1,778.00	24,714,200	
松屋フーズHLDGS	4,000	5,000.00	20,000,000	貸付株式数 200株
JBCCHホールディングス	5,500	3,175.00	17,462,500	
JKホールディングス	6,600	967.00	6,382,200	
サガミホールディングス	13,000	1,380.00	17,940,000	貸付株式数 500株
日伝	5,900	2,651.00	15,640,900	
関西フードマーケット	5,900	1,415.00	8,348,500	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
ミロク情報サービス	7,500	1,737.00	13,027,500	貸付株式数 2,700株
北沢産業	2,900	280.00	812,000	貸付株式数 1,400株
杉本商事	4,200	2,246.00	9,433,200	貸付株式数 400株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
因幡電機産業	22,600	3,280.00	74,128,000	
王将フードサービス	6,500	8,010.00	52,065,000	貸付株式数 1,500 株
ミニストップ	6,400	1,512.00	9,676,800	貸付株式数 2,400 株
アークス	16,000	2,718.00	43,488,000	
バローホールディングス	16,600	2,371.00	39,358,600	
東 テ ク	2,900	4,745.00	13,760,500	
ミスミグループ本社	131,900	2,400.00	316,560,000	
アルテック	2,500	232.00	580,000	
ベ ル ク	4,300	6,370.00	27,391,000	
大 庄	3,600	1,261.00	4,539,600	貸付株式数 1,400 株
タキヒヨー	1,200	1,018.00	1,221,600	貸付株式数 700 株
ファーストリテイリング	39,300	37,490.00	1,473,357,000	貸付株式数 15,200 株
ソフトバンクグループ	408,500	6,020.00	2,459,170,000	
蔵王産業	800	2,401.00	1,920,800	
スズケン	33,200	5,043.00	167,427,600	
サンドラッグ	29,500	4,475.00	132,012,500	
サックスパーホールディング	7,400	895.00	6,623,000	
ジェコス	5,100	1,060.00	5,406,000	
ヤマザワ	1,000	1,259.00	1,259,000	
や ま や	1,000	3,040.00	3,040,000	貸付株式数 400 株
グローセル	8,900	641.00	5,704,900	
ベルーナ	20,900	626.00	13,083,400	
合計			278,401,688,320	

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

ソニーグループ	20,000 株
キーエンス	5,000 株
トヨタ自動車	60,000 株
三菱UFJフィナンシャルG	200,000 株
三井住友フィナンシャルG	30,000 株

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

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年11月30日

I 資産総額	12,567,025,519 円
II 負債総額	20,389,393 円
III 純資産総額 (I - II)	12,546,636,126 円
IV 発行済数量	6,300,117,509 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.9915 円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2023年11月30日

I 資産総額	291,909,298,474 円
II 負債総額	7,517,356,457 円
III 純資産総額 (I - II)	284,391,942,017 円
IV 発行済数量	166,904,971,223 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.7039 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た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、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2023年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、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. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年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	89	290,714
追加型株式投資信託	773	25,324,802
株式投資信託 合計	862	25,615,516
単位型公社債投資信託	101	169,041
追加型公社債投資信託	14	1,527,194
公社債投資信託 合計	115	1,696,235
総合計	977	27,311,751

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第64期事業年度（2022年4月1日から2023年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第65期事業年度に係る中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

独立監査人の監査報告書

2023年5月26日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,168	1,982
有価証券	486	346
前払費用	332	393
未収委託者報酬	13,811	12,525
未収収益	52	47
関係会社短期貸付金	24,900	22,100
その他	45	59
流動資産計	42,799	37,455
固定資産		
有形固定資産	※1	※1
建物	4	3
器具備品	198	193
無形固定資産	1,770	1,482
ソフトウェア	1,738	1,351
ソフトウェア仮勘定	31	131
投資その他の資産	16,617	13,824
投資有価証券	10,755	8,260
関係会社株式	3,705	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,067	1,066
繰延税金資産	885	824
その他	26	20
固定資産計	18,591	15,503
資産合計	61,390	52,959

(単位:百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	65	101
未払金	9,856	5,874
未払収益分配金	26	38
未払償還金	12	12
未払手数料	4,917	4,525
その他未払金	※2 4,900	※2 1,297
未払費用	4,246	3,987
未払法人税等	980	560
未払消費税等	1,016	327
賞与引当金	866	692
その他	2	2
流動負債計	17,033	11,545
固定負債		
退職給付引当金	2,399	2,276
役員退職慰労引当金	13	51
その他	1	0
固定負債計	2,415	2,329
負債合計	19,449	13,874
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	13,925	11,505
利益剰余金合計	14,299	11,879
株主資本合計	40,969	38,549
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	971	534
評価・換算差額等合計	971	534
純資産合計	41,941	39,084
負債・純資産合計	61,390	52,959

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	74,402	69,845
その他営業収益	545	559
営業収益計	74,948	70,405
営業費用		
支払手数料	31,234	29,405
広告宣伝費	650	662
調査費	9,104	9,638
調査費	1,252	1,469
委託調査費	7,851	8,169
委託計算費	1,729	1,783
営業雑経費	2,051	1,658
通信費	189	181
印刷費	468	468
協会費	46	51
諸会費	15	17
その他営業雑経費	1,331	939
営業費用計	44,768	43,147
一般管理費		
給料	5,948	5,788
役員報酬	306	317
給料・手当	4,281	4,369
賞与	493	409
賞与引当金繰入額	866	692
福利厚生費	867	874
交際費	46	66
旅費交通費	48	95
租税公課	527	476
不動産賃借料	1,300	1,300
退職給付費用	408	488
役員退職慰労引当金繰入額	10	38
固定資産減価償却費	606	625
諸経費	1,864	2,193
一般管理費計	11,628	11,946
営業利益	18,551	15,310

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：百万円)

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	947	947	38,566
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 9,388
当期純利益	-	-	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	24	24	24
当期変動額合計	24	24	3,374
当期末残高	971	971	41,941

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	971	971	41,941
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 12,737
当期純利益	-	-	10,317
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△ 436	△ 436	△ 436
当期変動額合計	△ 436	△ 436	△ 2,856
当期末残高	534	534	39,084

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	15～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(会計方針の変更に関する注記)

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。この変更による当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。

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

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建物	37百万円	38百万円
器具備品	283百万円	296百万円

※2 関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

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

3 保証債務

前事業年度(2022年3月31日)

子会社である Daiwa Asset Management(Singapore)Ltd. の債務1,900百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2023年3月31日)

子会社である Daiwa Asset Management(Singapore)Ltd. の債務2,112百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	—	—	2,608
合計	2,608	—	—	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- | | |
|------------|------------|
| ①剰余金の配当の総額 | 12,737百万円 |
| ②配当の原資 | 利益剰余金 |
| ③1株当たり配当額 | 4,883円 |
| ④基準日 | 2022年3月31日 |
| ⑤効力発生日 | 2022年6月24日 |

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	—	—	2,608
合計	2,608	—	—	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	12,737	4,883	2022年 3月31日	2022年 6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2023年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- | | |
|------------|------------|
| ①剰余金の配当の総額 | 10,316百万円 |
| ②配当の原資 | 利益剰余金 |
| ③1株当たり配当額 | 3,955円 |
| ④基準日 | 2023年3月31日 |
| ⑤効力発生日 | 2023年6月27日 |

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主にグループ通算制度における通算親法人へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係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. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

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

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

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

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

前事業年度（2022年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	66	—	—	66
資産合計	66	—	—	66

当事業年度（2023年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	57	7,882	—	7,939
資産合計	57	7,882	—	7,939

（2）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

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

(単位：百万円)

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,677	1,448
関連会社株式	2,027	2,027

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度 (2022年3月31日)

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

当事業年度 (2023年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度 (2022年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	66	55	11
(2) その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	△454
小計	3,753	4,208	△454
合計	10,575	9,180	1,395

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

当事業年度（2023年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	57	55	1
（２）その他	5,084	3,923	1,161
小計	5,141	3,978	1,163
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,798	3,190	△392
小計	2,798	3,190	△392
合計	7,939	7,168	△771

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
（１）株式	-	-	-
（２）その他 証券投資信託	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
（１）株式	-	-	-
（２）その他 証券投資信託	2,359	296	244
合計	2,359	296	244

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(注) その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度189百万円、当事業年度184百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が 69,845 百万円、その他 559 百万円であります。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付	19,000	関係会社短期貸付金	24,900
								利息の受取 (注)	0	受取利息関係会社	0

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付	17,100	関係会社短期貸付金	22,100
								利息の受取 (注)	0	受取利息関係会社	0

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,900	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁 (MAS) に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行

行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有直接100.0	経営管理	債務保証(注)	2,112	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	15,348	未払手数料	3,028
						本社ビルの管理	不動産の賃借料(注3)	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	1,065	未払費用	91

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

(注4) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	13,072	未払手数料	2,663
						本社ビルの管理	不動産の賃借料(注3)	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	883	未払費用	81

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

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

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,738	10,317
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月27日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 間瀬 友未

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 渡部 啓太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

当中間会計期間
(2023年9月30日)

負債の部		
流動負債		
未払金		5,255
未払費用		4,567
未払法人税等		2,453
賞与引当金		727
その他	※2	725
流動負債合計		13,864
固定負債		
退職給付引当金		2,228
役員退職慰労引当金		58
固定負債合計		2,287
負債合計		16,152
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,594
利益剰余金合計		6,968
株主資本合計		33,638
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		973
評価・換算差額等合計		973
純資産合計		34,612
負債・純資産合計		50,764

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		36,557
その他営業収益		322
営業収益合計		36,879
営業費用		
支払手数料		15,250
その他営業費用		7,380
営業費用合計		22,631
一般管理費	※1	6,087
営業利益		8,160
営業外収益	※2	128
営業外費用	※3	116
経常利益		8,172
特別利益		—
特別損失	※4	258
税引前中間純利益		7,914
法人税、住民税及び事業税		2,505
法人税等調整額		2
中間純利益		5,405

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日）

(単位：百万円)

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

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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおり

であります。

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

5. グループ通算制度の適用

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

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2023年9月30日現在)
有形固定資産	340百万円

※2 消費税等の取扱い

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

3 保証債務

当中間会計期間 (2023年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore) Ltd. の債務2,299百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
有形固定資産	10百万円
無形固定資産	230百万円

※2 営業外収益の主要項目

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

※3 営業外費用の主要項目

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

※4 特別損失の項目

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2023年6月26日 定時株主総会	普通株式	10,316	3,955	2023年 3月31日	2023年 6月27日

(金融商品関係)

当中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	111	7,809	—	7,921
資産合計	111	7,809	—	7,921

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

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

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,448
関連会社株式	2,027

(有価証券関係)

当中間会計期間 (2023年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
(1) 株式	111	55	56
(2) その他	5,511	3,839	1,672
小計	5,623	3,894	1,728
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	2,297	2,623	△325
小計	2,297	2,623	△325
合計	7,921	6,518	1,403

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

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が 36,557 百万円、その他 322 百万円であります。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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

[関連情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,268.89円
1株当たり中間純利益	2,072.34円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,405
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,405
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

- 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
提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。
- b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実
訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

追加型証券投資信託

(年金ダイワ日本株式インデックス)

約 款

大和アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

約款第19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、投資成果を東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行な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
(年金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、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

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40条第1項、第41条第1項、第42条第1項および第44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 この信託のすべての受益権は、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ることとし、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。

（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 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。）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。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益証券の価額は、1口につき1円に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等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30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20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、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたトピックス・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18条 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21条において同じ。)、第21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条および第17条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20条、第25条から第27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19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20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20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。

(信用リスク集中回避のための投資制限)

第20条の3 一般社団法人投資信託協会規則に定める一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21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22条 (削 除)

(混蔵寄託)

第23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24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売却等の指図)

第25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信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第26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27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、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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から支弁します。

(損益の帰属)

第28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29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30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2006年10月27日から2007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31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32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となる費用(データ処理費用、郵送料等)は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

(信託報酬等の額および支弁の方法)

第33条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第30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17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34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35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36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37条 受託者は、収益分配金については第35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38条 受益者が、信託終了による償還金について第36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39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、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、金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、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することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、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39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40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41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45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42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45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43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44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45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45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46条 第40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40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る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46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47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48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とが締結する「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35条第4項および第36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。

2006年10月27日

委託者 大和アセットマネジメント株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社