

# iFree TOPIX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6月13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「iFree TOPIX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6月12日に関東財務局長に提出しており、2024年6月13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】

i F r e e T O P I X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】

10兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

### (6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

### (7)【申込期間】

2024年6月13日から2024年12月12日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

### (8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

**(9)【払込期日】**

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日(くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。)までに、取得申込代金(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ます。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

**(11)【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

**(12)【その他】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

##### (注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象	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、2,500 億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。



**SIMPLE & EASY**

インデックスファンドってなに？

**FREE & LOW**

費用はどれくらいかかるのかな？

これらの質問については、以降でご説明します。

## ファンドの目的・特色

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。







# インデックス ファンドってなに？



## 「インデックス」とは

いふなれば「市場のモノサシ」です。

マーケット（市場）を構成する個々の価格データからマーケット全体の動向がわかるように情報会社等が計算したもので、「〇〇指数」「〇〇インデックス」などと呼ばれます。

インデックスの動きを確認することにより、マーケットのおおよその動きを読み取ることができます。

インデックス	マーケット	
		一般に インデックスの上昇時はマーケットは好調 インデックスの下落時はマーケットは低調 と考えられます。



当ファンドの対象インデックスは、「東証株価指数(TOPIX) (配当込み)」です。

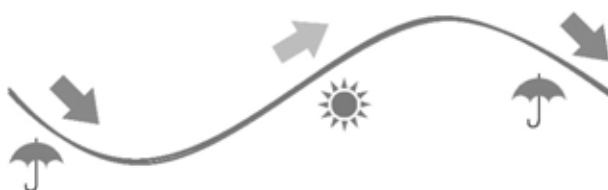
## 「インデックスファンド」とは

マーケットと同じような動きをめざすファンドです。

インデックスファンドを購入するとマーケットが好調ならば、その分じぶんのおかねが増えることが期待できます。

「インデックスファンドを購入すること」は、「マーケットの成長そのものを買うこと」ということができます。

— インデックス(マーケット)の動き — ファンド(じぶんのおかね)の値動き



当ファンドは、インデックスの動きに連動した値動きをめざすインデックスファンドです。

※上記は、将来の投資成果を示唆あるいは保証するものではありません。



# 費用はどれくらいかかるのかな？



## ファンドへの投資にかかる主な費用は

購入時	保有期間中	売却時
<b>購入時手数料</b>	<b>運用管理費用 (信託報酬)</b>	<b>換金時手数料 信託財産留保額</b>
購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供等に対するものです。	ファンドの運用・管理等に対するものです。	換金する際に必要な費用等です。
当ファンドは	当ファンドは	当ファンドは
<b>無料</b>	<b>低水準</b>	<b>無料</b>

当ファンドは、費用を低く抑えたファンドです。

※上記は主な費用であり、他にも費用・税金がかかります。

— Aさんの場合 —



### 運用管理費用っていくらくらい？

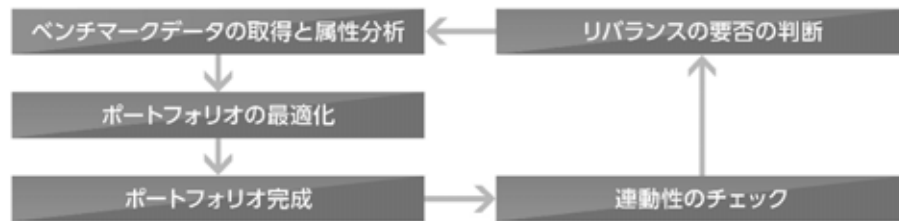
Aさんは当ファンドを10万円分保有しています。  
当ファンドの運用管理費用の料率は年率0.154%(税込)です。  
1年間ファンドの値段(基準価額)が変わらなかったと仮定した場合の1年間にかかる費用はおおよそ…

Aさんの保有残高	×	運用管理費用の料率	÷	1年間にかかる運用管理費用
10万円		0.154%		154円(税込)

※上記の運用管理費用は簡便に計算した概算値です。

運用プロセス

- 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。



- ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用いてポートフォリオを構築します。ベンチマークであるTOPIX(配当込み)への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行なっています。
- (注)ポートフォリオ理論に基づき、株価変動に影響を与える複数の要素からポートフォリオのリスクを分析するモデルです。このモデルを用いることにより、さまざまな制約条件下で指数に最も連動すると推定されるポートフォリオを構築することができます。

ファンドの仕組みなど

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



- マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- 安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。
  - (a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
  - (b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク(市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。)を減じる目的
- 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、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、「ファンドの特色」の運用が行なわれないことがあります。

## 分配方針

毎年9月19日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

(注)第1計算期間は、2017年9月19日(休業日の場合翌営業日)までとします。

[分配方針]

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 主な投資制限

- ・ マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ・ 株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への投資は、行ないません。

- ① 配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社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。

### ● 基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2016年9月8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せん。 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せん。 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せん。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 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せん。）	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

<委託会社の概況（2024年3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. 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
  - ロ. マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
  - ハ. 安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行いません。
    - (a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
    - (b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的
  - ニ. 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。
  - ホ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用

が行なわれないことがあります。

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

## (2) 【投資対象】

- 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) ⑧、⑨および⑩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、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
  1. 株券または新株引受権証券
  2. 国債証券
  3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1. から前11. までの証券または証書の性質を有するもの
  13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  14. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前14.の証券のうち投資法人債券ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券（新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

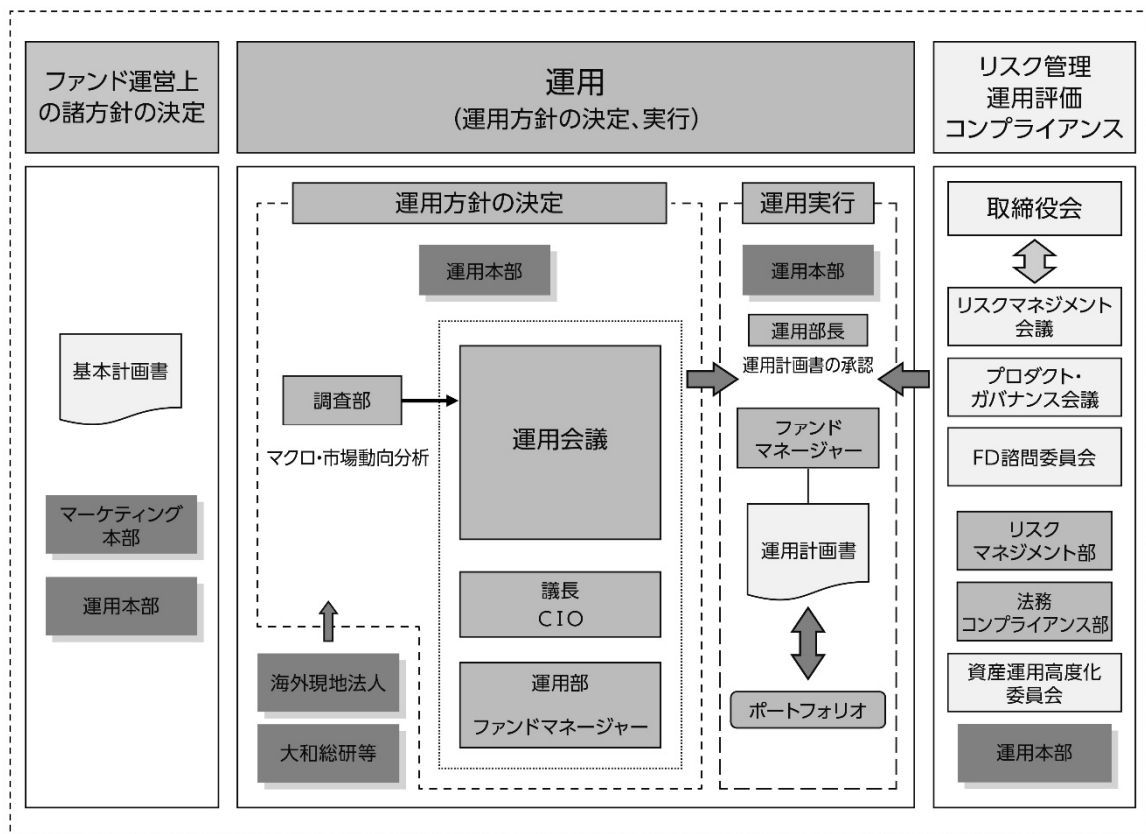
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
  1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

### (3) 【運用体制】

- 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が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2024年3月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行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 株式（信託約款）  
株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ③ 新株引受権証券等（信託約款）  
イ. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。  
ロ. 前イ. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

④ 投資信託証券（信託約款）

- イ. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ロ. 前イ. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤ 投資する株式等の範囲（信託約款）

- イ. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ロ. 前イ. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとし、

⑥ 同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

- イ. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ロ. 前イ. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑦ 信用取引（信託約款）

- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができるものとし、
- ロ. 前イ. の信用取引の指図は、次の1. から6. までに掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1. から6. までに掲げる株券数の合計数を超えないものとし、
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑧ 先物取引等（信託約款）

- イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融

商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。) ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします (以下同じ。)

ロ。委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

⑨ スワップ取引 (信託約款)

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

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

ハ。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額 (以下本ハ. において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。) が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ。前ハ. においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

⑩ 金利先渡取引 (信託約款)

イ。委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ。金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額 (以下本ハ. において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。) が、信託財産にかかる保有金利商品 (信託財産が 1 年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の 1. から 4. までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。) の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額 (以下本ハ. において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。) を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ。前ハ. においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額と

は、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ. 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

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

⑪ 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。

⑫ 有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑬ 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。

⑭ 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。

⑮ 資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

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

(1) 投資方針

① 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す。

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

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

ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

株式への投資には、制限を設けません。

② 先物取引等

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

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

③ スワップ取引

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

ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超え

ないものとしします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

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

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

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

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

#### (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

① 金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付け、ご換金の申込みの受付を中止すること、すでに受付けた取得申込みを取消すことがあります。

② ご換金の申込みの受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

#### (3) その他の留意点

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

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

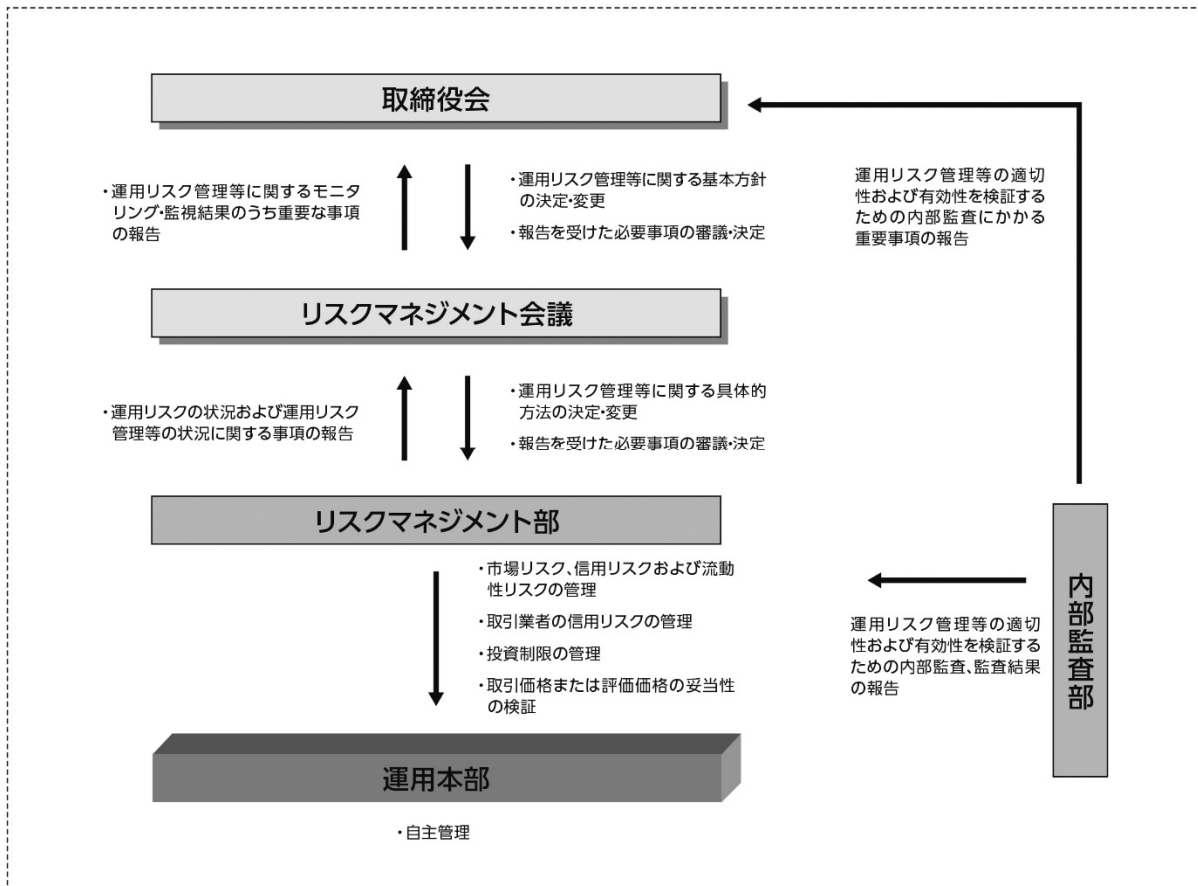
※ 流動性リスクに関する事項

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

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



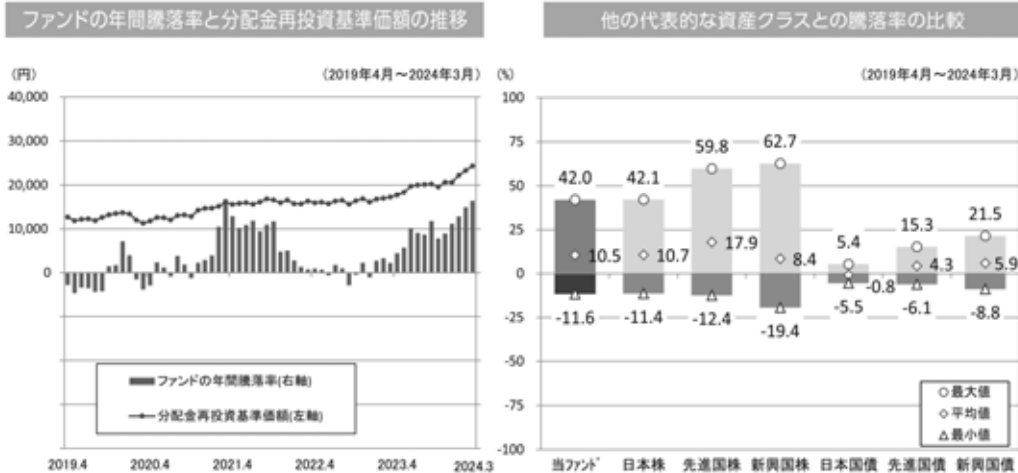
※ 流動性リスクに対する管理体制

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



## 参考情報

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



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

### ※資産クラスについて

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

### ※指数について

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

### (2)【換金（解約）手数料】

- 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 0.154%（税抜 0.14%）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 0.042%（税抜）	年率 0.08%（税抜）	年率 0.018%（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。

### ① 個人の投資者に対する課税

#### イ. 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税 15%および地方税 5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%および地方税 5%）となります。

#### ロ. 解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税 15%および地方税 5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%および地方税 5%）となります。

#### ハ. 損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

### ※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

### ② 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収（※）され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。  
※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

- ③ 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、前②にかかわらず所得税がかかりません。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。

<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、2024年3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】 (2024年3月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	15,320,762,530	99.99
内 日本	15,320,762,530	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,056,856	0.01
純資産総額	15,321,819,386	100.00

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

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

### (2) 【投資資産】 (2024年3月29日現在)

#### 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	7,628,342,228	1.7325 13,216,435,115	2.0084 15,320,762,530	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1計算期間末 (2017年9月19日)	225,442,051	225,442,051	1.2601	1.2601
第2計算期間末 (2018年9月19日)	703,954,766	703,954,766	1.3744	1.3744
第3計算期間末 (2019年9月19日)	1,291,192,279	1,291,192,279	1.2710	1.2710
第4計算期間末 (2020年9月23日)	2,156,675,995	2,156,675,995	1.3249	1.3249
第5計算期間末 (2021年9月21日)	5,959,015,788	5,959,015,788	1.6985	1.6985
第6計算期間末 (2022年9月20日)	8,122,218,861	8,122,218,861	1.6386	1.6386
2023年3月末日	9,381,989,122	—	1.7264	—
4月末日	9,603,064,824	—	1.7726	—
5月末日	10,064,078,548	—	1.8359	—
6月末日	10,968,753,904	—	1.9744	—
7月末日	11,243,842,331	—	2.0036	—
8月末日	11,489,075,470	—	2.0119	—
第7計算期間末 (2023年9月19日)	12,050,222,989	12,050,222,989	2.0966	2.0966
9月末日	11,779,903,874	—	2.0222	—
10月末日	11,790,177,668	—	1.9612	—
11月末日	12,349,433,476	—	2.0672	—
12月末日	12,398,742,841	—	2.0625	—
2024年1月末日	13,477,789,684	—	2.2234	—
2月末日	14,542,292,854	—	2.3323	—
3月末日	15,321,819,386	—	2.4354	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
2023年9月20日～ 2024年3月19日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1 計算期間	26.0
第2 計算期間	9.1
第3 計算期間	△7.5
第4 計算期間	4.2
第5 計算期間	28.2
第6 計算期間	△3.5
第7 計算期間	28.0
2023年9月20日～ 2024年3月19日	14.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1 計算期間	296,928,017	119,013,453
第2 計算期間	598,163,642	264,884,388
第3 計算期間	822,530,973	318,840,117
第4 計算期間	1,115,515,332	503,633,277
第5 計算期間	3,025,564,561	1,144,993,077
第6 計算期間	3,241,772,381	1,793,260,223
第7 計算期間	2,745,337,030	1,954,791,440
2023年9月20日～ 2024年3月19日	1,645,761,597	1,127,062,690

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド  
トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年3月29日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		336,050,229,900	97.37
	内 日本	336,050,229,900	97.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		9,077,446,723	2.63
純資産総額		345,127,676,623	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		8,919,400,000	2.58
	内 日本	8,919,400,000	2.58

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年3月29日現在)

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	4,711,400	2,885.28 13,593,718,967	3,792.00 17,865,628,800	5.18
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	5,145,600	1,325.80 6,822,046,393	1,557.00 8,011,699,200	2.32
3	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	606,900	12,825.30 7,783,676,956	12,985.00 7,880,596,500	2.28
4	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	181,600	21,153.50 3,841,476,729	39,570.00 7,185,912,000	2.08
5	三菱商事	日本	株式	卸売業	1,770,600	2,531.42 4,482,147,706	3,487.00 6,174,082,200	1.79
6	キーエンス	日本	株式	電気機器	85,800	58,023.71 4,978,434,474	69,540.00 5,966,532,000	1.73
7	日立	日本	株式	電気機器	416,400	9,994.81 4,161,841,280	13,905.00 5,790,042,000	1.68
8	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	600,700	7,599.97 4,565,306,427	8,909.00 5,351,636,300	1.55



	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	信越化学	日本	株式	化学	770,600	4,663.23 3,593,491,343	6,584.00 5,073,630,400	1.47
10	三井物産	日本	株式	卸売業	681,900	5,794.83 3,951,499,861	7,106.00 4,845,581,400	1.40
11	日本電信電話	日本	株式	情報・通信 業	25,594,500	180.75 4,626,345,660	179.80 4,601,891,100	1.33
12	任天堂	日本	株式	その他製 品	541,700	6,501.03 3,521,613,330	8,196.00 4,439,773,200	1.29
13	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	652,900	5,092.02 3,324,581,864	6,707.00 4,379,000,300	1.27
14	本田技研	日本	株式	輸送用機 器	2,092,000	1,790.49 3,745,714,726	1,891.00 3,955,972,000	1.15
15	伊藤忠	日本	株式	卸売業	608,000	5,739.71 3,489,748,552	6,466.00 3,931,328,000	1.14
16	東京海上HD	日本	株式	保険業	835,200	3,593.99 3,001,700,784	4,703.00 3,927,945,600	1.14
17	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	424,500	6,524.86 2,769,803,857	8,962.00 3,804,369,000	1.10
18	第一三共	日本	株式	医薬品	749,700	4,070.42 3,051,596,870	4,777.00 3,581,316,900	1.04
19	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,140,500	2,677.94 3,054,193,469	3,046.00 3,473,963,000	1.01
20	武田薬品	日本	株式	医薬品	761,200	4,791.02 3,646,929,290	4,184.00 3,184,860,800	0.92
21	HOYA	日本	株式	精密機器	168,900	16,161.26 2,729,638,001	18,740.00 3,165,186,000	0.92
22	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	665,100	4,721.49 3,140,269,520	4,482.00 2,980,978,200	0.86
23	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信 業	1,384,900	1,762.65 2,441,101,035	1,951.00 2,701,939,900	0.78
24	三菱電機	日本	株式	電気機器	964,300	1,923.44 1,854,781,777	2,512.00 2,422,321,600	0.70
25	ディスコ	日本	株式	機械	41,700	26,996.48 1,125,753,317	57,190.00 2,384,823,000	0.69
26	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	466,800	5,110.20 2,385,445,352	4,849.00 2,263,513,200	0.66
27	村田製作所	日本	株式	電気機器	780,600	2,765.81 2,158,996,240	2,824.00 2,204,414,400	0.64
28	SMC	日本	株式	機械	25,900	70,228.14 1,818,909,005	84,830.00 2,197,097,000	0.64
29	三菱重工業	日本	株式	機械	1,515,000	881.19 1,335,013,224	1,448.50 2,194,477,500	0.64
30	ダイキン工業	日本	株式	機械	103,500	24,755.46 2,562,190,969	20,600.00 2,132,100,000	0.62

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.37%
合計	97.37%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.35%
建設業	2.03%
食料品	2.99%
繊維製品	0.35%
パルプ・紙	0.16%
化学	5.56%
医薬品	4.15%
石油・石炭製品	0.50%
ゴム製品	0.67%
ガラス・土石製品	0.67%
鉄鋼	0.91%
非鉄金属	0.69%
金属製品	0.50%
機械	5.47%
電気機器	16.94%
輸送用機器	9.27%
精密機器	2.16%
その他製品	2.22%
電気・ガス業	1.37%
陸運業	2.43%
海運業	0.68%
空運業	0.39%
倉庫・運輸関連業	0.13%
情報・通信業	7.05%
卸売業	7.23%
小売業	4.12%
銀行業	7.21%
証券、商品先物取引業	0.91%
保険業	2.65%
その他金融業	1.17%
不動産業	2.05%
サービス業	4.31%
合計	97.37%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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

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

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(参考情報) 運用実績

●iFree TOPIXインデックス

2024年3月29日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	24,354円
純資産総額	153億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.4%
3カ月間	18.1%
6カ月間	20.4%
1年間	41.1%
3年間	51.8%
5年間	94.8%
設定来	143.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円							設定来分配金合計額: 0円		
	第1期 17年9月	第2期 18年9月	第3期 19年9月	第4期 20年9月	第5期 21年9月	第6期 22年9月	第7期 23年9月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

主要な資産の状況

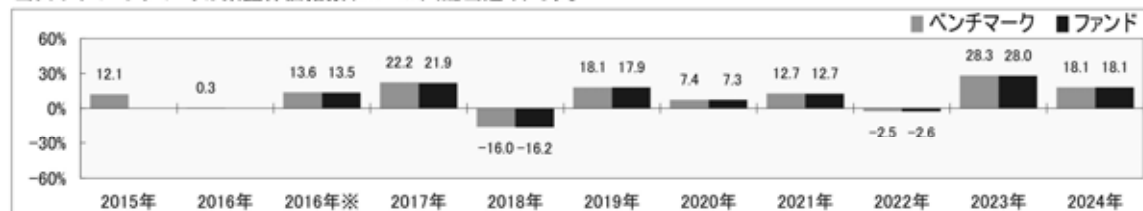
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,125	97.4%	電気機器	16.9%	トヨタ自動車	輸送用機器	5.2%
国内株式先物	1	2.6%	輸送用機器	9.3%	TOPIX 先物 0606月	-	2.6%
不動産投資信託等	-	-	卸売業	7.2%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.3%
コール・ローン、その他		2.6%	銀行業	7.2%	ソニーグループ	電気機器	2.3%
合計	2,126	-	情報・通信業	7.1%	東京エレクトロン	電気機器	2.1%
株式 市場・上場別構成			化学	5.6%	三菱商事	卸売業	1.8%
東証プライム市場		96.9%	機械	5.5%	キーエンス	電気機器	1.7%
東証スタンダード市場		0.4%	サービス業	4.3%	日立	電気機器	1.7%
東証グロース市場		0.0%	医薬品	4.1%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.6%
地方市場・その他		-	その他	30.2%	信越化学	化学	1.5%
合計		97.4%	合計	97.4%	合計		22.7%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数(TOPIX)(配当込み)です。



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

・2016年※は設定日(9月8日)から年末、2024年は3月29日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(参考情報) ファンドの総経費率

	総経費率 (①+②)	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
iFree TOPIXインデックス	0.16%	0.15%	0.01%

※対象期間は2022年9月21日～2023年9月19日です。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

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

（2024年11月4日まで）

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

（2024年11月5日以降）

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

（2024年11月4日まで）

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

（2024年11月5日以降）

原則として、委託会社の各営業日の午後 3 時 30 分までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

#### <一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を 1 口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

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、一部解約請求の受け付けを中止することができます。一部解約請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、当該計算日の基準価額とします。

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

委託会社は、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。委託会社は、委託会社の指定する預金口座等の一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

（注 1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注 2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

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9月20日から翌年9月19日までとします。ただし、第1計算期間は、2016年9月8日から2017年9月19日までとします。

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

(5) 【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、東証株価指数（配当込み）が改廃された場合、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行いません。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。



## ② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行いません。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

## ③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

## 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れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
  - ・委託会社のホームページ  
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2. の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

## 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。

<収益分配金および償還金にかかる請求権>

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

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

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

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

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

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

<換金請求権>

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2022年9月21日から2023年9月19日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 独立監査人の監査報告書

2023年11月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 秋山 範之  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている i F r e e T O P I X インデックスの2022年9月21日から2023年9月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、i F r e e T O P I X インデックスの2023年9月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

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

i F r e e T O P I Xインデックス

(1) 【貸借対照表】

	第6期 2022年9月20日現在 金額(円)	第7期 2023年9月19日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,844,329	55,374,333
親投資信託受益証券	8,121,650,284	12,049,378,990
流動資産合計	8,134,494,613	12,104,753,323
資産合計	8,134,494,613	12,104,753,323
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,208,422	46,142,634
未払受託者報酬	753,029	1,041,206
未払委託者報酬	5,104,137	7,057,349
その他未払費用	210,164	289,145
流動負債合計	12,275,752	54,530,334
負債合計	12,275,752	54,530,334
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	4,956,850,371	5,747,395,961
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,165,368,490	6,302,827,028
(分配準備積立金)	539,207,112	2,625,077,385
元本等合計	8,122,218,861	12,050,222,989
純資産合計	8,122,218,861	12,050,222,989
負債純資産合計	8,134,494,613	12,104,753,323

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	第6期 自2021年9月22日 至2022年9月20日 金額(円)	第7期 自2022年9月21日 至2023年9月19日 金額(円)
営業収益		
受取利息	6	5
有価証券売買等損益	△152,620,894	2,561,385,705
営業収益合計	△152,620,888	2,561,385,710
営業費用		
支払利息	3,079	8,882
受託者報酬	1,407,015	1,886,350
委託者報酬	9,537,051	12,785,832
その他費用	390,683	523,835
営業費用合計	11,337,828	15,204,899
営業利益又は営業損失(△)	△163,958,716	2,546,180,811
経常利益又は経常損失(△)	△163,958,716	2,546,180,811
当期純利益又は当期純損失(△)	△163,958,716	2,546,180,811
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(△)	△79,056,772	236,516,886
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,450,677,575	3,165,368,490
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,010,867,283	2,096,863,981
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	2,010,867,283	2,096,863,981
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,211,274,424	1,269,069,368
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,211,274,424	1,269,069,368
分配金	※1	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,165,368,490	6,302,827,028

### (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第7期 自2022年9月21日 至2023年9月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2022年9月19日が休日のため、前計算期間末日を2022年9月20日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第6期 2022年9月20日現在	第7期 2023年9月19日現在
1. ※1 期首元本額	3,508,338,213 円	4,956,850,371 円
期中追加設定元本額	3,241,772,381 円	2,745,337,030 円
期中一部解約元本額	1,793,260,223 円	1,954,791,440 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,956,850,371 口	5,747,395,961 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第6期 自2021年9月22日 至2022年9月20日	第7期 自2022年9月21日 至2023年9月19日
※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,626,165,398円)及び分配準備積立金(539,207,112円)より分配対象額は3,165,372,510円(1万口当たり6,385.85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(2,250,726,517円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,677,757,447円)及び分配準備積立金(374,350,868円)より分配対象額は6,302,834,832円(1万口当たり10,966.42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7期 自 2022年9月21日 至 2023年9月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、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7期 2023年9月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第6期 2022年9月20日現在	第7期 2023年9月19日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	△112,111,856	2,484,489,784
合計	△112,111,856	2,484,489,784

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第6期 2022年9月20日現在	第7期 2023年9月19日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第7期 自2022年9月21日 至2023年9月19日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第6期 2022年9月20日現在	第7期 2023年9月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6386円 (16,386円)	2.0966円 (20,966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	6,974,634,748	12,049,378,990	
親投資信託受益証券 合計			12,049,378,990	
合計			12,049,378,990	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年9月20日現在 金額(円)	2023年9月19日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	14,544,002,321	11,709,990,572
株式 ※2※3	190,358,800,810	275,855,624,477
派生商品評価勘定	58,409,600	88,278,700
未収入金	-	181,217,500
未収配当金	85,377,722	104,117,646
未収利息	402,872	307,903
その他未収収益 ※4	5,697,768	3,770,506
差入委託証拠金	66,270,000	-
流動資産合計	205,118,961,093	287,943,307,304
資産合計	205,118,961,093	287,943,307,304
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	741,000	-
前受金	30,755,000	77,080,000
未払解約金	37,544,320	205,524,850
受入担保金	8,030,704,184	7,693,967,745
流動負債合計	8,099,744,504	7,976,572,595
負債合計	8,099,744,504	7,976,572,595
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	146,161,636,928	162,050,849,324
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	50,857,579,661	117,915,885,385
元本等合計	197,019,216,589	279,966,734,709
純資産合計	197,019,216,589	279,966,734,709
負債純資産合計	205,118,961,093	287,943,307,304

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 9 月 21 日 至 2023 年 9 月 19 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  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 9 月 20 日現在	2023 年 9 月 19 日現在
1. ※1 期首	2021 年 9 月 22 日	2022 年 9 月 21 日
期首元本額	137,972,449,571 円	146,161,636,928 円
期中追加設定元本額	21,891,192,489 円	30,161,540,525 円
期中一部解約元本額	13,702,005,132 円	14,272,328,129 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックスファンド	2,913,315,600 円	2,794,966,122 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	5,057,552,549 円	4,428,862,186 円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	919,050 円	912,624 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	22,914,284 円	15,316,355 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	306,153,651 円	195,111,007 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	20,861,610 円	13,274,124 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	620,077,228 円	424,964,925 円

区分	2022年9月20日現在	2023年9月19日現在
日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	424,026,190円	622,708,014円
D-I's TOPIXインデックス	31,216,024円	13,696,084円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	209,861,004円	240,356,411円
iFree TOPIXインデックス	6,024,963,119円	6,974,634,748円
iFree 8資産バランス	4,243,393,048円	4,552,782,635円
iFree 年金バランス	754,549,149円	936,907,657円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	-円	760,330円
DCダイワ日本株式インデックス	68,855,675,811円	70,157,904,335円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,261,884,393円	3,126,510,144円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,664,787,412円	4,815,356,904円
ダイワ・ライフ・バランス70	4,626,300,873円	5,437,485,538円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,602,474,346円	7,253,536,469円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	59,540,051円	52,146,342円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	69,149,114円	73,459,968円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,398,708,347円	4,348,979,651円
ダイワつみたてインデックス バランス30	12,198,543円	13,296,558円
ダイワつみたてインデックス バランス50	10,134,564円	11,248,003円
ダイワつみたてインデックス バランス70	25,524,777円	27,586,525円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	964,722,382円	9,143,218,019円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	80,584,476円	57,636,044円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	44,620,861円	22,132,245円
ダイワ・バランスファンド35 VA	5,365,977,076円	3,969,119,137円
ダイワ・バランスファンド25 VA (適格機関投資家専用)	495,127,448円	388,963,668円
ダイワ国内バランスファンド2 5VA (適格機関投資家専用)	70,111,584円	51,746,439円
ダイワ国内バランスファンド3 0VA (適格機関投資家専用)	105,903,266円	77,438,203円
ダイワ・ノーロード TOPIX ファンド	221,137,687円	212,211,578円
ダイワファンドラップ TOPIX インデックス	11,537,778,484円	12,214,211,018円

区分	2022年9月20日現在	2023年9月19日現在
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	1,659,502,574円	5,470,175,649円
ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	3,228,157,904円	3,439,985,992円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,206,704,313円	1,173,613,678円
ダイワライフスタイル25	134,931,541円	111,863,051円
ダイワライフスタイル50	556,481,026円	498,094,602円
ダイワライフスタイル75	423,712,951円	412,932,475円
DC・ダイワ・トピックス・イン デックス(確定拠出年金専用 ファンド)	8,850,002,618円	8,274,743,867円
計	146,161,636,928円	162,050,849,324円
2. 期末日における受益権の総数	146,161,636,928口	162,050,849,324口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,650,814,500円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,366,861,130円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 846,840,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 1,199,260,000円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年9月21日 至2023年9月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	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 9 月 21 日 至 2023 年 9 月 19 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 9 月 19 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)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 9 月 20 日現在	2023 年 9 月 19 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	△9,854,133,695	51,873,340,027
合計	△9,854,133,695	51,873,340,027

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 株式関連

種類	2022 年 9 月 20 日現在				2023 年 9 月 19 日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								



種類	2022年9月20日現在				2023年9月19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		
買建	6,644,620,000	-	6,702,480,000	57,860,000	3,916,380,000	-	4,004,750,000	88,370,000
合計	6,644,620,000	-	6,702,480,000	57,860,000	3,916,380,000	-	4,004,750,000	88,370,000

(注)

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2022年9月20日現在	2023年9月19日現在
1口当たり純資産額	1.3480円	1.7276円
(1万口当たり純資産額)	(13,480円)	(17,276円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極 洋	4,300.0	4,065.00	17,479,500	
ニッスイ	112,200.0	763.80	85,698,360	
マルハニチロ	16,700.0	2,650.00	44,255,000	
雪国まいたけ	9,600.0	926.00	8,889,600	貸付株式数 3,700 株
カネコ種苗	3,500.0	1,522.00	5,327,000	
サカタのタネ	12,800.0	4,460.00	57,088,000	貸付株式数 400 株
ホクト	9,900.0	1,854.00	18,354,600	
ホクリヨウ	1,100.0	1,088.00	1,196,800	貸付株式数 400 株
ショーボンドHD	15,300.0	5,920.00	90,576,000	
ミライト・ワン	37,100.0	2,056.00	76,277,600	
タマホーム	7,000.0	3,610.00	25,270,000	貸付株式数 2,600 株
サンヨーホームズ	900.0	729.00	656,100	貸付株式数 300 株
日本アクア	3,000.0	1,041.00	3,123,000	
ファーストコーポレーション	1,900.0	794.00	1,508,600	貸付株式数 700 株
ベステラ	1,700.0	983.00	1,671,100	貸付株式数 600 株
キャンディル	1,400.0	623.00	872,200	貸付株式数 700 株
住石ホールディングス	11,600.0	455.00	5,278,000	貸付株式数 5,100 株
日鉄鉱業	4,500.0	5,580.00	25,110,000	
三井松島HLDGS	5,100.0	2,950.00	15,045,000	貸付株式数 2,000 株
INPEX	414,500.0	2,358.00	977,391,000	
石油資源開発	13,000.0	5,910.00	76,830,000	
K&Oエナジーグループ	5,100.0	2,681.00	13,673,100	
ダイセキ環境ソリューション	1,500.0	1,262.00	1,893,000	
第一カッター興業	2,800.0	1,302.00	3,645,600	
明豊ファシリティワークス	3,000.0	743.00	2,229,000	
安藤・間	64,600.0	1,270.00	82,042,000	
東急建設	31,100.0	847.00	26,341,700	
コムシスホールディングス	35,500.0	3,265.00	115,907,500	
ビーアールホールディングス	18,200.0	385.00	7,007,000	
高松コンストラクションGP	7,200.0	2,770.00	19,944,000	
東建コーポレーション	3,200.0	8,050.00	25,760,000	
ソネック	800.0	1,013.00	810,400	貸付株式数 300 株 (100 株)
ヤマウラ	5,500.0	1,269.00	6,979,500	貸付株式数 200 株
オリエンタル白石	39,200.0	337.00	13,210,400	
大成建設	73,300.0	5,360.00	392,888,000	
大 林 組	279,800.0	1,413.00	395,357,400	
清水建設	221,800.0	1,055.00	233,999,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
飛島建設	8,600.0	1,433.00	12,323,800	
長谷工コーポレーション	80,700.0	1,974.00	159,301,800	
松井建設	7,100.0	795.00	5,644,500	
銭高組	600.0	4,035.00	2,421,000	貸付株式数 200株
鹿島建設	173,600.0	2,596.00	450,665,600	
不動テトラ	5,500.0	2,054.00	11,297,000	貸付株式数 1,300株
大末建設	1,900.0	1,559.00	2,962,100	
鉄建建設	5,500.0	2,247.00	12,358,500	
西松建設	13,200.0	3,898.00	51,453,600	
三井住友建設	62,300.0	427.00	26,602,100	
大豊建設	3,200.0	4,135.00	13,232,000	貸付株式数 700株
佐田建設	3,300.0	509.00	1,679,700	
ナカノフドー建設	3,600.0	419.00	1,508,400	
奥村組	12,600.0	4,705.00	59,283,000	
東鉄工業	10,800.0	3,035.00	32,778,000	
イチケン	1,100.0	2,150.00	2,365,000	
富士ピー・エス	2,300.0	478.00	1,099,400	貸付株式数 900株 (500株)
浅沼組	6,100.0	3,705.00	22,600,500	
戸田建設	96,100.0	845.10	81,214,110	
熊谷組	12,900.0	3,495.00	45,085,500	
北野建設	1,000.0	3,045.00	3,045,000	
植木組	1,500.0	1,580.00	2,370,000	
矢作建設	10,500.0	1,366.00	14,343,000	
ピーエス三菱	10,300.0	875.00	9,012,500	
日本ハウスHLDGS	16,300.0	377.00	6,145,100	貸付株式数 6,500株
大東建託	28,800.0	16,295.00	469,296,000	
新日本建設	10,900.0	1,271.00	13,853,900	
東亜道路	3,100.0	5,300.00	16,430,000	
日本道路	1,600.0	9,740.00	15,584,000	
東亜建設	6,700.0	3,815.00	25,560,500	貸付株式数 2,400株
日本国土開発	21,900.0	667.00	14,607,300	
若築建設	3,500.0	3,170.00	11,095,000	
東洋建設	25,300.0	1,183.00	29,929,900	貸付株式数 9,400株
五洋建設	111,100.0	950.00	105,545,000	
世紀東急	10,100.0	1,708.00	17,250,800	貸付株式数 4,000株
福田組	2,900.0	4,910.00	14,239,000	貸付株式数 800株
日本ドライケミカル	1,300.0	2,283.00	2,967,900	貸付株式数 400株
住友林業	67,700.0	4,270.00	289,079,000	
日本基礎技術	3,100.0	513.00	1,590,300	
巴コーポレーション	6,000.0	582.00	3,492,000	
大和ハウス	216,600.0	4,201.00	909,936,600	
ライト工業	14,600.0	2,072.00	30,251,200	
積水ハウス	237,600.0	3,124.00	742,262,400	
日特建設	7,600.0	1,149.00	8,732,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
北陸電気工事	5,500.0	1,062.00	5,841,000	
ユアテック	17,500.0	1,016.00	17,780,000	
日本リーテック	6,900.0	1,389.00	9,584,100	
四電工	3,300.0	3,020.00	9,966,000	
中電工	12,300.0	2,530.00	31,119,000	
関電工	43,200.0	1,374.00	59,356,800	
きんでん	55,400.0	2,244.00	124,317,600	貸付株式数 300株
東京エネシス	7,600.0	1,033.00	7,850,800	
トーエネック	2,600.0	4,405.00	11,453,000	
住友電設	7,500.0	2,904.00	21,780,000	
日本電設工業	12,900.0	2,338.00	30,160,200	
エクシオグループ	36,200.0	3,204.00	115,984,800	
新日本空調	4,200.0	2,510.00	10,542,000	
九電工	19,100.0	4,660.00	89,006,000	
三機工業	17,600.0	1,661.00	29,233,600	
日揮ホールディングス	77,400.0	2,250.50	174,188,700	
中外炉工業	2,500.0	2,222.00	5,555,000	
ヤマト	4,400.0	992.00	4,364,800	
太平電業	4,800.0	4,085.00	19,608,000	
高砂熱学	19,000.0	2,954.00	56,126,000	貸付株式数 5,300株
三晃金属	600.0	4,330.00	2,598,000	
NEC ネットエスアイ	26,800.0	1,997.00	53,519,600	
朝日工業社	3,300.0	2,562.00	8,454,600	
明星工業	13,600.0	1,062.00	14,443,200	
大気社	9,100.0	4,810.00	43,771,000	
ダイダン	5,300.0	3,090.00	16,377,000	
日比谷総合設備	6,400.0	2,359.00	15,097,600	
ニッポン	21,300.0	2,180.00	46,434,000	
日清製粉G本社	72,800.0	1,965.50	143,088,400	
日東富士製粉	1,400.0	5,000.00	7,000,000	
昭和産業	6,900.0	3,125.00	21,562,500	
鳥越製粉	4,800.0	687.00	3,297,600	貸付株式数 200株
中部飼料	11,000.0	1,168.00	12,848,000	
フィード・ワン	11,600.0	827.00	9,593,200	
東洋精糖	1,000.0	2,233.00	2,233,000	
日本甜菜糖	4,600.0	1,955.00	8,993,000	
DM三井製糖ホールディ	7,800.0	3,125.00	24,375,000	
塩水港精糖	6,400.0	266.00	1,702,400	
ウエルネオシュガー	4,100.0	2,124.00	8,708,400	貸付株式数 1,400株
LIFULL	27,900.0	236.00	6,584,400	貸付株式数 10,900株
MIXI	18,600.0	2,430.00	45,198,000	
ジェイエイシーリクルートメント	7,500.0	2,491.00	18,682,500	
日本M&Aセンターホールデ	141,100.0	767.50	108,294,250	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考	
		単価	金額		
メンバーズ	2,400.0	1,235.00	2,964,000	貸付株式数	900株
中広	1,100.0	445.00	489,500	貸付株式数	400株
UTグループ	12,100.0	2,266.00	27,418,600		
アイティメディア	3,000.0	1,205.00	3,615,000	貸付株式数	1,200株
E・Jホールディングス	5,000.0	1,774.00	8,870,000	貸付株式数	1,400株
オープンアップグループ	24,700.0	1,880.00	46,436,000	貸付株式数	9,600株
コシダカホールディングス	24,600.0	1,260.00	30,996,000		
アルトナー	1,400.0	1,811.00	2,535,400	貸付株式数	500株
パソナグループ	10,100.0	1,683.00	16,998,300		
CDS	1,400.0	1,753.00	2,454,200		
リンクアンドモチベーション	23,800.0	461.00	10,971,800	貸付株式数	9,200株
エス・エム・エス	31,500.0	2,574.50	81,096,750		
サニーサイドアップG	1,700.0	817.00	1,388,900	貸付株式数	400株
パーソルホールディングス	90,700.0	2,504.00	227,112,800		
リニカル	3,200.0	704.00	2,252,800		
クックパッド	21,900.0	151.00	3,306,900	貸付株式数	1,700株
エスクリ	2,200.0	338.00	743,600	貸付株式数	1,200株
アイ・ケイ・ケイホールディング	2,600.0	700.00	1,820,000	貸付株式数	1,300株
森永製菓	14,000.0	5,382.00	75,348,000		
中村屋	1,900.0	3,130.00	5,947,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	22,500.0	4,089.00	92,002,500		
名糖産業	3,100.0	1,670.00	5,177,000	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	4,300.0	2,325.00	9,997,500		
不二家	5,400.0	2,525.00	13,635,000	貸付株式数	2,000株
山崎製パン	52,700.0	2,852.50	150,326,750		
第一屋製パン	1,000.0	438.00	438,000	貸付株式数	300株
モロゾフ	2,500.0	3,715.00	9,287,500		
亀田製菓	5,000.0	4,350.00	21,750,000		
寿スピリッツ	8,400.0	11,740.00	98,616,000		
カルビー	36,000.0	2,979.00	107,244,000		
森永乳業	14,300.0	5,861.00	83,812,300		
六甲バター	5,800.0	1,389.00	8,056,200	貸付株式数	2,000株
ヤクルト	56,200.0	7,581.00	426,052,200		
明治ホールディングス	96,500.0	3,737.00	360,620,500		
雪印メグミルク	19,100.0	2,329.00	44,483,900		
プリマハム	10,600.0	2,520.00	26,712,000		
日本ハム	30,800.0	4,595.00	141,526,000		
林兼産業	1,600.0	557.00	891,200	貸付株式数	600株
丸大食品	7,900.0	1,703.00	13,453,700	貸付株式数	3,000株
S Foods	8,700.0	3,435.00	29,884,500		
柿安本店	3,200.0	2,497.00	7,990,400	貸付株式数	800株
伊藤ハム米久HLDGS	60,300.0	820.00	49,446,000		
学情	4,200.0	1,972.00	8,282,400	貸付株式数	200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
スタジオアリス	4,000.0	2,093.00	8,372,000	貸付株式数 1,500株
クロスキャット	4,600.0	1,015.00	4,669,000	貸付株式数 1,700株
シミックホールディングス	4,100.0	1,782.00	7,306,200	貸付株式数 1,500株
エプロ	1,800.0	748.00	1,346,400	貸付株式数 500株
システナ	134,700.0	278.00	37,446,600	
N J S	1,900.0	3,000.00	5,700,000	
デジタルアーツ	5,100.0	4,735.00	24,148,500	
日鉄ソリューションズ	13,700.0	4,290.00	58,773,000	
総合警備保障	152,800.0	924.70	141,294,160	
キューブシステム	4,700.0	1,202.00	5,649,400	貸付株式数 1,800株
いちご	90,700.0	327.00	29,658,900	
日本駐車場開発	83,200.0	210.00	17,472,000	
コア	3,500.0	1,780.00	6,230,000	貸付株式数 600株
カカコム	60,300.0	1,621.50	97,776,450	
アイロムグループ	3,000.0	1,906.00	5,718,000	貸付株式数 1,100株
セントケア・ホールディング	5,100.0	830.00	4,233,000	貸付株式数 2,000株
サイネックス	900.0	697.00	627,300	貸付株式数 300株
ルネサンス	5,600.0	930.00	5,208,000	貸付株式数 2,200株
ディップ	14,400.0	3,725.00	53,640,000	貸付株式数 5,700株
S B Sホールディングス	7,100.0	2,864.00	20,334,400	
デジタルホールディングス	4,200.0	1,049.00	4,405,800	
新日本科学	8,700.0	1,865.00	16,225,500	貸付株式数 3,400株
キャリアデザインセンター	1,200.0	2,080.00	2,496,000	
ベネフィット・ワン	38,100.0	1,131.00	43,091,100	
エムスリー	162,300.0	2,814.50	456,793,350	
ツカダ・グローバルHOLD	3,400.0	435.00	1,479,000	貸付株式数 600株
プラス	600.0	718.00	430,800	貸付株式数 200株
アウトソーシング	52,800.0	1,182.50	62,436,000	
ウェルネット	4,400.0	578.00	2,543,200	貸付株式数 1,600株
ワールドホールディングス	3,800.0	2,424.00	9,211,200	貸付株式数 400株
ディー・エヌ・エー	32,800.0	1,541.00	50,544,800	
博報堂DYHLDGS	104,900.0	1,315.00	137,943,500	
ぐるなび	15,000.0	331.00	4,965,000	
タカミヤ	11,400.0	523.00	5,962,200	
ジャパンベストレスキュー	4,200.0	735.00	3,087,000	
ファンコミュニケーションズ	12,400.0	402.00	4,984,800	
ライク	3,100.0	1,554.00	4,817,400	貸付株式数 1,200株
ビジネス・ブレークスルー	2,000.0	399.00	798,000	貸付株式数 800株
エスプール	23,700.0	467.00	11,067,900	
WDBホールディングス	4,300.0	2,111.00	9,077,300	
手間いらず	1,300.0	2,841.00	3,693,300	貸付株式数 500株
ティア	3,100.0	470.00	1,457,000	貸付株式数 1,100株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
CDG	700.0	1,320.00	924,000	貸付株式数 200株
アドウェイズ	11,200.0	557.00	6,238,400	
バリューコマース	7,100.0	1,259.00	8,938,900	
インフォマート	85,300.0	473.00	40,346,900	
サッポロホールディングス	25,900.0	4,716.00	122,144,400	貸付株式数 6,000株
アサヒグループホールディングン	181,900.0	5,927.00	1,078,121,300	貸付株式数 72,700株
麒麟HD	327,900.0	2,137.00	700,722,300	貸付株式数 131,100株
宝ホールディングス	53,800.0	1,257.00	67,626,600	
オエノンホールディングス	23,500.0	451.00	10,598,500	
養命酒	2,600.0	1,913.00	4,973,800	貸付株式数 1,000株
コカ・コーラボトラーズJHD	61,700.0	2,067.00	127,533,900	
サントリー食品インター	55,400.0	4,708.00	260,823,200	
ダイドーグループHD	4,500.0	5,760.00	25,920,000	貸付株式数 1,500株
伊藤園	26,700.0	4,906.00	130,990,200	貸付株式数 10,600株
キーコーヒー	8,800.0	2,033.00	17,890,400	貸付株式数 3,500株 (100株)
ユニカフェ	1,700.0	954.00	1,621,800	貸付株式数 700株
ジャパンフーズ	800.0	1,122.00	897,600	
日清オイリオグループ	11,100.0	4,375.00	48,562,500	
不二製油グループ	18,300.0	2,330.00	42,639,000	
かどや製油	600.0	3,520.00	2,112,000	
J-オイルミルズ	8,100.0	1,843.00	14,928,300	
ローソン	21,000.0	6,803.00	142,863,000	
サンエー	6,400.0	4,890.00	31,296,000	貸付株式数 1,300株
カワチ薬品	6,600.0	2,328.00	15,364,800	
エービーシー・マート	37,100.0	2,758.00	102,321,800	
ハードオフコーポレーション	2,300.0	1,526.00	3,509,800	
高千穂交易	2,000.0	3,315.00	6,630,000	貸付株式数 1,000株
アスクル	17,500.0	1,893.00	33,127,500	貸付株式数 6,800株
ゲオホールディングス	8,300.0	2,507.00	20,808,100	貸付株式数 3,200株
アダストリア	10,200.0	2,878.00	29,355,600	貸付株式数 3,600株
ジーフット	3,700.0	288.00	1,065,600	貸付株式数 1,200株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800.0	864.00	691,200	貸付株式数 200株
オルバヘルスケアHLDGS	800.0	1,775.00	1,420,000	
伊藤忠食品	1,900.0	6,620.00	12,578,000	
くら寿司	9,900.0	3,465.00	34,303,500	貸付株式数 3,300株 (200株)
キャンドウ	3,000.0	2,733.00	8,199,000	貸付株式数 1,100株
エレマテック	7,600.0	1,935.00	14,706,000	
IKホールディングス	1,700.0	391.00	664,700	貸付株式数 600株
パルグループHLDGS	16,600.0	2,013.00	33,415,800	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
エディオン	33,700.0	1,500.00	50,550,000	貸付株式数 7,400 株
あらた	6,500.0	5,860.00	38,090,000	
サーラコーポレーション	17,800.0	779.00	13,866,200	
ワッツ	2,700.0	608.00	1,641,600	貸付株式数 1,000 株
トーメンデバイス	1,200.0	5,080.00	6,096,000	貸付株式数 400 株
ハローズ	3,800.0	4,255.00	16,169,000	貸付株式数 400 株
J Pホールディングス	23,500.0	338.00	7,943,000	貸付株式数 8,800 株
フジオフードG本社	9,600.0	1,405.00	13,488,000	貸付株式数 2,900 株 (100 株)
あみやき亭	2,100.0	3,645.00	7,654,500	貸付株式数 600 株
東京エレクトロデバイス	3,100.0	10,450.00	32,395,000	
ひらまつ	12,200.0	272.00	3,318,400	貸付株式数 5,200 株
円谷フィールズホールディ	14,500.0	2,106.00	30,537,000	貸付株式数 5,800 株
双日	84,300.0	3,522.00	296,904,600	
アルフレッサホールディン グス	84,900.0	2,601.50	220,867,350	
大黒天物産	2,600.0	6,760.00	17,576,000	
ハニーズホールディングス	6,700.0	1,651.00	11,061,700	貸付株式数 2,100 株
ファーマライズHD	1,200.0	654.00	784,800	貸付株式数 500 株
キッコーマン	52,200.0	8,460.00	441,612,000	
味の素	190,000.0	5,850.00	1,111,500,000	
ブルドックソース	4,200.0	2,100.00	8,820,000	貸付株式数 1,600 株
キューピー	42,300.0	2,463.50	104,206,050	貸付株式数 16,900 株
ハウス食品G本社	24,100.0	3,166.00	76,300,600	
カゴメ	33,900.0	3,318.00	112,480,200	貸付株式数 13,000 株
焼津水産化工	2,000.0	1,243.00	2,486,000	
アリアケジャパン	6,900.0	5,090.00	35,121,000	
ピエトロ	700.0	1,865.00	1,305,500	
エバラ食品工業	2,100.0	3,040.00	6,384,000	貸付株式数 200 株
やまみ	500.0	1,947.00	973,500	貸付株式数 200 株
ニチレイ	36,100.0	3,560.00	128,516,000	
横浜冷凍	23,000.0	1,354.00	31,142,000	
東洋水産	39,800.0	5,947.00	236,690,600	
イトアンドHLDGS	3,500.0	2,130.00	7,455,000	貸付株式数 1,300 株
大冷	700.0	2,044.00	1,430,800	
ヨシムラ・フード・HLD GS	5,000.0	1,318.00	6,590,000	貸付株式数 2,000 株
日清食品HD	27,700.0	12,475.00	345,557,500	
永谷園ホールディングス	3,900.0	2,324.00	9,063,600	
一正蒲鉾	2,200.0	782.00	1,720,400	貸付株式数 300 株
フジッコ	8,100.0	1,960.00	15,876,000	
ロックフィールド	8,800.0	1,636.00	14,396,800	貸付株式数 3,500 株
日本たばこ産業	478,300.0	3,384.00	1,618,567,200	貸付株式数 191,300 株
ケンコーマヨネーズ	5,400.0	1,459.00	7,878,600	
わらべや日洋HD	5,800.0	2,917.00	16,918,600	
なとり	4,900.0	1,998.00	9,790,200	



銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
イフジ産業	900.0	1,616.00	1,454,400	貸付株式数 300株
ファーマフーズ	11,300.0	1,555.00	17,571,500	貸付株式数 4,500株
北の達人コーポ	34,000.0	246.00	8,364,000	貸付株式数 13,100株 (1,100株)
ユウグレナ	49,000.0	810.00	39,690,000	貸付株式数 19,100株
紀文食品	6,200.0	1,218.00	7,551,600	貸付株式数 2,400株
ピクルスホールディングス	4,600.0	1,284.00	5,906,400	貸付株式数 1,200株
スター・マイカ・HLDG S	9,200.0	657.00	6,044,400	
SREホールディングス	3,900.0	3,155.00	12,304,500	貸付株式数 1,500株
ADワークスグループ	13,400.0	256.00	3,430,400	貸付株式数 2,800株
片倉工業	7,300.0	1,812.00	13,227,600	貸付株式数 2,600株
グンゼ	5,700.0	4,645.00	26,476,500	
ヒューリック	183,700.0	1,388.50	255,067,450	
神栄	700.0	1,647.00	1,152,900	
ラサ商事	2,500.0	1,628.00	4,070,000	貸付株式数 900株
アルペン	7,100.0	1,932.00	13,717,200	貸付株式数 2,700株
ハブ	1,900.0	849.00	1,613,100	
ラクーンホールディングス	6,600.0	743.00	4,903,800	貸付株式数 1,000株
クオールホールディングス	11,600.0	1,928.00	22,364,800	
アルコニックス	11,000.0	1,414.00	15,554,000	
神戸物産	65,500.0	3,648.00	238,944,000	貸付株式数 26,100株
ソリトンシステムズ	4,100.0	1,159.00	4,751,900	
ジズホールディングス	5,000.0	3,165.00	15,825,000	貸付株式数 1,800株
ビックカメラ	45,200.0	1,087.00	49,132,400	貸付株式数 17,600株
DCMホールディングス	49,300.0	1,248.00	61,526,400	
ペッパーフードサービス	18,400.0	115.00	2,116,000	貸付株式数 4,800株
ハイパー	1,200.0	358.00	429,600	貸付株式数 400株
Monotaro	120,000.0	1,591.00	190,920,000	
東京一番フーズ	1,400.0	555.00	777,000	貸付株式数 600株
DDグループ	3,700.0	1,770.00	6,549,000	貸付株式数 1,000株
あいホールディングス	13,600.0	2,461.00	33,469,600	
ディーブイエックス	1,500.0	1,022.00	1,533,000	貸付株式数 200株
きちりホールディングス	1,400.0	885.00	1,239,000	貸付株式数 500株
J. フロントリテイリング	105,100.0	1,584.00	166,478,400	
ドトール・日レスHD	15,100.0	2,366.00	35,726,600	
マツキヨココカラ&カンパニー	51,300.0	8,249.00	423,173,700	
ブロンコビリー	5,000.0	3,035.00	15,175,000	貸付株式数 1,900株
ZOZO	55,900.0	2,896.00	161,886,400	
トレジャー・ファクトリー	3,500.0	1,334.00	4,669,000	貸付株式数 1,400株
物語コーポレーション	14,100.0	4,355.00	61,405,500	
三越伊勢丹HD	142,400.0	1,731.00	246,494,400	
東洋紡	34,700.0	1,118.50	38,811,950	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ユニチカ	24,100.0	213.00	5,133,300	貸付株式数 4,800株
富士紡ホールディングス	3,100.0	3,765.00	11,671,500	
日清紡ホールディングス	60,600.0	1,103.50	66,872,100	貸付株式数 20,400株
倉敷紡績	6,000.0	2,572.00	15,432,000	
ダイワボウHD	34,600.0	2,990.50	103,471,300	
シキボウ	2,900.0	1,112.00	3,224,800	
日東紡績	9,000.0	3,575.00	32,175,000	
トヨタ紡織	33,700.0	2,905.50	97,915,350	
マクニカホールディングス	20,000.0	6,570.00	131,400,000	
H a m e e	2,900.0	925.00	2,682,500	貸付株式数 1,100株
マーケットエンタープライズ	600.0	1,228.00	736,800	貸付株式数 200株
ラクト・ジャパン	3,300.0	2,163.00	7,137,900	貸付株式数 500株
ウエルシアHD	43,800.0	2,649.00	116,026,200	
クリエイトSDH	13,900.0	3,515.00	48,858,500	貸付株式数 5,100株
グリムス	3,600.0	2,264.00	8,150,400	
バイタルKSKHD	10,500.0	1,005.00	10,552,500	
八洲電機	6,900.0	1,313.00	9,059,700	貸付株式数 2,700株
メディアスホールディングス	5,400.0	777.00	4,195,800	貸付株式数 1,800株
レスターホールディングス	8,100.0	2,528.00	20,476,800	
ジオリープグループ	1,300.0	1,274.00	1,656,200	貸付株式数 500株
丸善CHI HD	7,300.0	345.00	2,518,500	
大光	2,300.0	673.00	1,547,900	貸付株式数 1,100株
OCHIホールディングス	1,200.0	1,457.00	1,748,400	
TOKAIホールディングス	41,600.0	941.00	39,145,600	貸付株式数 16,600株
黒谷	1,500.0	609.00	913,500	貸付株式数 600株
ミサワ	1,000.0	610.00	610,000	
ティーライフ	800.0	1,409.00	1,127,200	貸付株式数 100株
Cominix	1,100.0	883.00	971,300	貸付株式数 400株
エー・ピーホールディングス	1,200.0	1,019.00	1,222,800	貸付株式数 500株
三洋貿易	9,500.0	1,419.00	13,480,500	
チムニー	1,800.0	1,516.00	2,728,800	貸付株式数 700株
シュッピン	6,300.0	1,117.00	7,037,100	貸付株式数 2,300株
ビューティガレージ	1,300.0	5,300.00	6,890,000	貸付株式数 500株
オイシックス・ラ・大地	11,400.0	1,662.00	18,946,800	貸付株式数 4,500株
ウイン・パートナーズ	6,100.0	1,122.00	6,844,200	貸付株式数 500株
ネクステージ	19,300.0	2,102.00	40,568,600	貸付株式数 7,300株
ジョイフル本田	24,700.0	1,759.00	43,447,300	貸付株式数 1,500株
鳥貴族ホールディングス	3,100.0	3,340.00	10,354,000	貸付株式数 1,100株
ホットランド	6,500.0	1,687.00	10,965,500	
すかいらくHD	115,700.0	2,042.50	236,317,250	貸付株式数 100株
SFPホールディングス	4,700.0	2,271.00	10,673,700	貸付株式数 1,600株
綿半ホールディングス	6,500.0	1,374.00	8,931,000	貸付株式数 1,500株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考	
		単価	金額		
日本毛織	21,100.0	1,375.00	29,012,500	貸付株式数	1,600株
ダイトウボウ	8,500.0	95.00	807,500	貸付株式数	5,300株
トーア紡コーポレーション	2,000.0	462.00	924,000	貸付株式数	400株
ダイドーリミテッド	7,600.0	312.00	2,371,200	貸付株式数	3,700株
ヨシックスホールディングス	1,100.0	2,808.00	3,088,800	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパーマ ーケ	27,400.0	1,118.00	30,633,200	貸付株式数	10,000株
三栄建築設計	3,700.0	2,022.00	7,481,400		
野村不動産HLDGS	49,300.0	3,961.00	195,277,300		
三重交通グループHD	16,800.0	610.00	10,248,000	貸付株式数	6,700株
サムティ	12,600.0	2,418.00	30,466,800	貸付株式数	4,600株
地主	6,000.0	1,925.00	11,550,000	貸付株式数	2,300株
プレサンスコーポレーショ ン	12,500.0	1,980.00	24,750,000	貸付株式数	4,900株
フィル・カンパニー	1,300.0	730.00	949,000	貸付株式数	500株
ハウスコム	800.0	938.00	750,400	貸付株式数	300株
JPMC	4,500.0	1,166.00	5,247,000		
サンセイランディック	1,600.0	1,071.00	1,713,600	貸付株式数	500株
エストラスト	700.0	649.00	454,300	貸付株式数	200株
フージャースHD	12,200.0	1,176.00	14,347,200		
オープンハウスグループ	28,800.0	5,231.00	150,652,800		
東急不動産HD	236,700.0	981.90	232,415,730		
飯田GHD	67,100.0	2,656.00	178,217,600		
イーランド	800.0	1,603.00	1,282,400		
帝国繊維	9,000.0	1,968.00	17,712,000	貸付株式数	3,100株
日本コークス工業	72,400.0	129.00	9,339,600		
ゴルフダイジェスト・オン	3,800.0	726.00	2,758,800	貸付株式数	1,500株
ミタチ産業	1,400.0	1,160.00	1,624,000	貸付株式数	600株
BEENOS	3,500.0	1,600.00	5,600,000	貸付株式数	1,600株
あさひ	7,300.0	1,292.00	9,431,600		
日本調剤	5,700.0	1,506.00	8,584,200	貸付株式数	2,100株
コスモス薬品	8,400.0	15,790.00	132,636,000	貸付株式数	3,200株
シップヘルスケアHD	30,400.0	2,347.00	71,348,800		
トーエル	2,400.0	770.00	1,848,000	貸付株式数	1,300株
ソフトクリエイトHD	6,600.0	1,708.00	11,272,800		
セブン&アイ・HLDGS	291,500.0	6,071.00	1,769,696,500		
クリエイト・レストラン ツ・ホール	63,700.0	1,167.00	74,337,900	貸付株式数	24,800株 (900株)
明治電機工業	3,200.0	1,530.00	4,896,000	貸付株式数	1,200株
ツルハホールディングス	17,800.0	10,365.00	184,497,000	貸付株式数	7,100株
デリカフーズHLDGS	2,200.0	680.00	1,496,000	貸付株式数	900株
スターティアホールディン グス	1,100.0	1,698.00	1,867,800	貸付株式数	400株
サンマルクホールディン グス	6,900.0	1,908.00	13,165,200		

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
フェリシモ	1,400.0	1,008.00	1,411,200	貸付株式数 400株
トリドールホールディングス	21,100.0	3,825.00	80,707,500	貸付株式数 8,400株
帝人	77,000.0	1,612.00	124,124,000	
東レ	536,400.0	837.50	449,235,000	
クラレ	116,700.0	1,736.00	202,591,200	
旭化成	499,700.0	1,002.50	500,949,250	
TOKYO BASE	8,800.0	338.00	2,974,400	貸付株式数 3,300株
稲葉製作所	4,200.0	1,579.00	6,631,800	貸付株式数 1,700株
宮地エンジニアリングG	2,300.0	6,280.00	14,444,000	貸付株式数 800株
トーカロ	21,900.0	1,433.00	31,382,700	
アルファCO	2,000.0	1,585.00	3,170,000	
SUMCO	146,600.0	1,984.50	290,927,700	
川田テクノロジーズ	1,900.0	6,310.00	11,989,000	
RS TECHNOLOGIES	5,500.0	2,486.00	13,673,000	
ジェイテックコーポレーション	700.0	2,697.00	1,887,900	
信和	3,000.0	800.00	2,400,000	貸付株式数 1,100株
ビーロット	3,600.0	886.00	3,189,600	
ファーストブラザーズ	1,000.0	1,213.00	1,213,000	貸付株式数 400株 (400株)
AND DOホールディングス	4,700.0	1,032.00	4,850,400	貸付株式数 1,700株
シーアールイー	4,400.0	1,556.00	6,846,400	貸付株式数 400株 (200株)
プロパティエージェント	700.0	1,465.00	1,025,500	
ケイアイスター不動産	3,800.0	4,895.00	18,601,000	
アグレ都市デザイン	900.0	1,573.00	1,415,700	貸付株式数 400株
ジェイ・エス・ビー	1,900.0	5,610.00	10,659,000	
ロードスターキャピタル	5,100.0	1,856.00	9,465,600	貸付株式数 2,000株
テンポイノベーション	1,600.0	1,227.00	1,963,200	貸付株式数 400株
グローバルリンクマネジメント	1,000.0	2,063.00	2,063,000	貸付株式数 400株
フェイスネットワーク	1,400.0	1,467.00	2,053,800	貸付株式数 600株
住江織物	1,100.0	2,312.00	2,543,200	貸付株式数 400株
日本フェルト	2,900.0	440.00	1,276,000	
イチカワ	700.0	1,546.00	1,082,200	
エコナックホールディングス	9,200.0	83.00	763,600	
日東製網	500.0	1,535.00	767,500	貸付株式数 100株
芦森工業	1,000.0	2,258.00	2,258,000	
アツギ	3,000.0	449.00	1,347,000	
ウイルプラスHLDGS	900.0	1,226.00	1,103,400	貸付株式数 400株
JMホールディングス	6,400.0	1,954.00	12,505,600	貸付株式数 2,400株
コメダホールディングス	20,800.0	2,969.00	61,755,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
サツドラホールディングス	2,700.0	819.00	2,211,300	貸付株式数 1,100株
アレンザホールディングス	6,600.0	1,008.00	6,652,800	貸付株式数 900株
串カツ田中HLDGS	2,300.0	1,630.00	3,749,000	貸付株式数 900株
バロックジャパン	5,400.0	851.00	4,595,400	貸付株式数 2,000株
クスリのアオキHLDGS	7,600.0	8,814.00	66,986,400	
ダイニック	1,300.0	827.00	1,075,100	
共和レザー	3,000.0	677.00	2,031,000	
ピーバンドットコム	800.0	455.00	364,000	貸付株式数 300株
力の源HD	3,300.0	2,234.00	7,372,200	貸付株式数 1,200株
FOOD&LIFE COMPANY	45,100.0	2,663.00	120,101,300	
アセンテック	2,800.0	539.00	1,509,200	貸付株式数 100株
セーレン	15,400.0	2,362.00	36,374,800	貸付株式数 6,000株
ソトー	1,600.0	788.00	1,260,800	貸付株式数 100株
東海染工	500.0	1,095.00	547,500	
小松マテーレ	11,500.0	771.00	8,866,500	
ワコールホールディングス	14,600.0	3,310.00	48,326,000	
ホギメディカル	10,700.0	3,255.00	34,828,500	貸付株式数 4,200株
クラウドディアHLDGS	1,300.0	554.00	720,200	貸付株式数 500株
T S Iホールディングス	26,900.0	825.00	22,192,500	貸付株式数 10,500株
マツオカコーポレーション	1,400.0	1,627.00	2,277,800	
ワールド	10,400.0	1,713.00	17,815,200	
T I S	87,700.0	3,453.00	302,828,100	
J N Sホールディングス	2,400.0	443.00	1,063,200	貸付株式数 1,000株
グリー	21,400.0	586.00	12,540,400	
GMOペパボ	1,000.0	1,360.00	1,360,000	貸付株式数 400株
コーエーテクモHD	50,200.0	2,226.50	111,770,300	貸付株式数 16,700株
三菱総合研究所	4,000.0	5,070.00	20,280,000	
ボルテージ	1,500.0	288.00	432,000	貸付株式数 800株
電算	600.0	1,589.00	953,400	貸付株式数 200株
AGS	2,200.0	740.00	1,628,000	貸付株式数 800株
ファインデックス	6,300.0	736.00	4,636,800	
ブレインパッド	6,000.0	879.00	5,274,000	貸付株式数 2,400株
K L a b	14,700.0	282.00	4,145,400	貸付株式数 5,700株
ポールトゥウィンホールディング	13,800.0	573.00	7,907,400	
ネクソン	178,800.0	2,916.00	521,380,800	
アイスタイル	23,700.0	488.00	11,565,600	貸付株式数 9,400株 (4,200株)
エムアップホールディングス	9,800.0	1,224.00	11,995,200	
エイチーム	4,600.0	607.00	2,792,200	
エニグモ	10,400.0	381.00	3,962,400	貸付株式数 4,000株
テクノスジャパン	4,500.0	720.00	3,240,000	
e n i s h	4,200.0	232.00	974,400	貸付株式数 1,700株
コロプラ	31,100.0	661.00	20,557,100	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
オルトプラス	4,400.0	217.00	954,800	貸付株式数 2,100株
ブロードリーフ	38,000.0	510.00	19,380,000	
クロス・マーケティングG	3,300.0	722.00	2,382,600	貸付株式数 1,400株
デジタルハーツHLDGS	5,000.0	1,068.00	5,340,000	
システム情報	6,300.0	760.00	4,788,000	貸付株式数 2,500株
メディアドゥ	3,100.0	1,168.00	3,620,800	
じげん	23,500.0	556.00	13,066,000	貸付株式数 2,900株
ブイキューブ	9,500.0	408.00	3,876,000	貸付株式数 3,800株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジー	1,200.0	513.00	615,600	貸付株式数 600株
サイバーリンクス	2,000.0	807.00	1,614,000	貸付株式数 1,000株
ディー・エル・イー	4,300.0	253.00	1,087,900	
フィックスターズ	9,000.0	1,200.00	10,800,000	
CARTA HOLDINGS	3,700.0	1,262.00	4,669,400	貸付株式数 1,400株
オプティム	6,600.0	853.00	5,629,800	
セレス	3,300.0	969.00	3,197,700	貸付株式数 1,200株
SHIFT	5,300.0	27,025.00	143,232,500	
特種東海製紙	3,600.0	3,550.00	12,780,000	貸付株式数 600株
ティーガイア	8,500.0	1,817.00	15,444,500	
セック	700.0	3,490.00	2,443,000	
テクマトリックス	14,600.0	1,562.00	22,805,200	
プロシップ	3,500.0	1,288.00	4,508,000	貸付株式数 1,200株
ガンホー・オンライン・エンター	20,900.0	2,387.00	49,888,300	
GMOペイメントゲートウェイ	16,000.0	8,427.00	134,832,000	
ザッパラス	1,400.0	477.00	667,800	貸付株式数 700株
システムリサーチ	2,500.0	2,696.00	6,740,000	貸付株式数 900株
インターネットイニシアティブ	43,700.0	2,444.50	106,824,650	
さくらインターネット	9,000.0	1,309.00	11,781,000	貸付株式数 3,600株
ヴィンクス	1,300.0	1,303.00	1,693,900	
GMOグローバルサインHD	2,400.0	2,791.00	6,698,400	貸付株式数 900株
SRAホールディングス	4,100.0	3,635.00	14,903,500	
システムインテグレータ	1,500.0	428.00	642,000	
朝日ネット	8,400.0	639.00	5,367,600	
eBASE	11,300.0	681.00	7,695,300	
アバントグループ	10,100.0	1,322.00	13,352,200	
アドソル日進	3,300.0	1,748.00	5,768,400	
ODKソリューションズ	1,100.0	604.00	664,400	貸付株式数 600株
フリービット	4,200.0	1,251.00	5,254,200	
コムチュア	10,600.0	2,428.00	25,736,800	
サイバーコム	800.0	1,343.00	1,074,400	貸付株式数 400株
アステリア	6,200.0	754.00	4,674,800	貸付株式数 1,900株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アイル	3,700.0	3,655.00	13,523,500	
王子ホールディングス	333,700.0	677.60	226,115,120	
日本製紙	41,700.0	1,424.00	59,380,800	
三菱製紙	6,400.0	578.00	3,699,200	貸付株式数 2,500 株
北越コーポレーション	50,600.0	1,073.00	54,293,800	貸付株式数 20,200 株
中越パルプ	2,200.0	1,517.00	3,337,400	貸付株式数 300 株
巴川製紙	1,700.0	681.00	1,157,700	貸付株式数 700 株
大王製紙	35,300.0	1,309.50	46,225,350	
阿波製紙	1,300.0	527.00	685,100	貸付株式数 600 株
マークライNZ	4,400.0	3,045.00	13,398,000	
メディカル・データ・ビジ	9,500.0	809.00	7,685,500	貸付株式数 4,400 株
g u m i	11,800.0	523.00	6,171,400	貸付株式数 4,700 株
ショーケース	1,200.0	372.00	446,400	貸付株式数 500 株
モバイルファクトリー	1,100.0	803.00	883,300	貸付株式数 500 株
テラスカイ	3,500.0	2,021.00	7,073,500	貸付株式数 1,200 株
デジタル・インフォメーシ ョン	4,600.0	1,810.00	8,326,000	
P C I ホールディングス	2,000.0	1,100.00	2,200,000	貸付株式数 200 株
アイビーシー	800.0	605.00	484,000	貸付株式数 400 株
ネオジャパン	2,700.0	1,020.00	2,754,000	貸付株式数 1,000 株
P R T I M E S	2,000.0	1,790.00	3,580,000	貸付株式数 400 株
ラクス	37,900.0	2,203.50	83,512,650	
ランドコンピュータ	1,300.0	1,228.00	1,596,400	
ダブルスタンダード	3,300.0	1,421.00	4,689,300	貸付株式数 1,200 株
オープンドア	5,600.0	1,022.00	5,723,200	貸付株式数 2,200 株
マイネット	1,700.0	355.00	603,500	貸付株式数 600 株
アカツキ	3,800.0	2,317.00	8,804,600	
ベネフィットジャパン	300.0	1,224.00	367,200	貸付株式数 200 株
U B I C O Mホールディン グス	2,500.0	1,297.00	3,242,500	貸付株式数 1,000 株
カナミックネットワーク	8,600.0	507.00	4,360,200	
ノムラシステムコーポレー ション	5,700.0	117.00	666,900	貸付株式数 2,900 株
レンゴー	72,900.0	1,055.50	76,945,950	
トーモク	4,600.0	2,536.00	11,665,600	
ザ・バック	6,000.0	3,285.00	19,710,000	
チェンジホールディングス	19,600.0	1,898.00	37,200,800	
シンクロ・フード	3,300.0	614.00	2,026,200	貸付株式数 1,300 株
オークネット	3,100.0	1,806.00	5,598,600	貸付株式数 1,500 株
キャピタル・アセット・プ ラン	1,000.0	888.00	888,000	貸付株式数 500 株
セグエグループ	1,700.0	959.00	1,630,300	貸付株式数 700 株
エイトレッド	800.0	1,473.00	1,178,400	貸付株式数 400 株
マクロミル	15,900.0	779.00	12,386,100	
ビーグリー	1,100.0	1,111.00	1,222,100	
オロ	2,900.0	1,926.00	5,585,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ユーザーローカル	2,900.0	1,841.00	5,338,900	貸付株式数 1,100 株
テモナ	1,200.0	299.00	358,800	貸付株式数 500 株
ニーズウェル	2,900.0	714.00	2,070,600	貸付株式数 1,200 株
マネーフォワード	17,800.0	5,138.00	91,456,400	貸付株式数 6,700 株
サインポスト	2,200.0	483.00	1,062,600	貸付株式数 800 株
レゾナック・ホールディング グ	77,400.0	2,548.50	197,253,900	貸付株式数 30,900 株
住友化学	594,000.0	434.00	257,796,000	
住友精化	3,400.0	4,810.00	16,354,000	
日産化学	37,800.0	6,686.00	252,730,800	
ラサ工業	3,100.0	2,120.00	6,572,000	
クレハ	6,400.0	8,710.00	55,744,000	
多木化学	3,100.0	3,805.00	11,795,500	貸付株式数 1,200 株
テイカ	5,400.0	1,410.00	7,614,000	
石原産業	14,500.0	1,561.00	22,634,500	
片倉コープアグリ	1,100.0	1,202.00	1,322,200	貸付株式数 400 株
日本曹達	8,600.0	5,760.00	49,536,000	
東ソー	106,900.0	2,028.00	216,793,200	
トクヤマ	25,900.0	2,494.50	64,607,550	
セントラル硝子	12,900.0	3,125.00	40,312,500	
東亜合成	40,200.0	1,388.00	55,797,600	
大阪ソーダ	4,800.0	6,560.00	31,488,000	貸付株式数 500 株
関東電化	15,500.0	912.00	14,136,000	
SUN ASTERISK	5,700.0	1,422.00	8,105,400	
デンカ	29,100.0	2,893.00	84,186,300	
イビデン	46,300.0	8,040.00	372,252,000	
信越化学	665,600.0	4,647.00	3,093,043,200	
日本カーバイド	2,000.0	1,784.00	3,568,000	
電算システムHD	3,500.0	3,010.00	10,535,000	
堺化学	6,100.0	2,148.00	13,102,800	
第一稀元素化学工	7,300.0	980.00	7,154,000	貸付株式数 800 株
エア・ウォーター	75,600.0	1,905.50	144,055,800	
日本酸素HLDGS	77,700.0	3,608.00	280,341,600	
日本化学工業	2,700.0	1,995.00	5,386,500	
東邦アセチレン	1,100.0	1,634.00	1,797,400	
日本パーカラライジング	39,700.0	1,184.00	47,004,800	貸付株式数 1,900 株
高压ガス	11,700.0	789.00	9,231,300	
チタン工業	600.0	1,413.00	847,800	貸付株式数 200 株
四国化成ホールディング	10,200.0	1,527.00	15,575,400	
戸田工業	1,800.0	2,023.00	3,641,400	貸付株式数 700 株
ステラ ケミファ	4,700.0	3,220.00	15,134,000	
保土谷化学	2,300.0	3,270.00	7,521,000	
日本触媒	12,200.0	5,670.00	69,174,000	
大日精化	5,600.0	2,411.00	13,501,600	
カネカ	18,300.0	4,222.00	77,262,600	



銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
協和キリン	96,800.0	2,702.00	261,553,600	
APPIER GROUP	27,400.0	1,705.00	46,717,000	
三菱瓦斯化学	59,800.0	2,150.00	128,570,000	
三井化学	66,000.0	3,959.00	261,294,000	
JSR	74,700.0	4,048.00	302,385,600	
東京応化工業	12,700.0	9,173.00	116,497,100	
大阪有機化学	6,700.0	2,567.00	17,198,900	
三菱ケミカルグループ	540,400.0	980.80	530,024,320	
KHネオケム	12,200.0	2,403.00	29,316,600	
ダイセル	111,600.0	1,322.50	147,591,000	
住友ベークライト	11,900.0	6,526.00	77,659,400	
積水化学	162,200.0	2,271.50	368,437,300	
日本ゼオン	48,000.0	1,723.50	82,728,000	
アイカ工業	20,100.0	3,455.00	69,445,500	
UBE	41,300.0	2,694.50	111,282,850	
積水樹脂	11,000.0	2,369.00	26,059,000	
タキロンシーアイ	17,100.0	589.00	10,071,900	
旭有機材	5,300.0	3,845.00	20,378,500	
ニチバン	4,900.0	1,918.00	9,398,200	
リケンテクノス	17,300.0	758.00	13,113,400	
大倉工業	3,700.0	2,638.00	9,760,600	貸付株式数 1,300 株
積水化成成品	11,300.0	488.00	5,514,400	
群栄化学	1,900.0	3,490.00	6,631,000	
タイガース ポリマー	2,400.0	775.00	1,860,000	
ミライアル	1,600.0	1,397.00	2,235,200	貸付株式数 600 株
ダイキアクシス	2,200.0	737.00	1,621,400	貸付株式数 700 株
ダイキョーニシカワ	17,700.0	865.00	15,310,500	
竹本容器	2,000.0	815.00	1,630,000	
森六ホールディングス	4,100.0	2,408.00	9,872,800	
恵和	5,800.0	1,299.00	7,534,200	貸付株式数 2,300 株
日本化薬	61,200.0	1,308.50	80,080,200	
カーリットホールディングス	7,200.0	997.00	7,178,400	貸付株式数 100 株
ソルクシーズ	4,200.0	425.00	1,785,000	
CLホールディングス	2,100.0	833.00	1,749,300	貸付株式数 800 株
プレステージ・インター	34,900.0	632.00	22,056,800	
フェイス	1,500.0	501.00	751,500	貸付株式数 300 株
プロトコーポレーション	10,000.0	1,223.00	12,230,000	
ハイマックス	2,500.0	1,453.00	3,632,500	
アミューズ	4,400.0	1,621.00	7,132,400	
野村総合研究所	159,700.0	4,274.00	682,557,800	
ドリームインキュベータ	2,500.0	3,020.00	7,550,000	貸付株式数 900 株
サイバネットシステム	5,700.0	762.00	4,343,400	
クイック	6,300.0	2,142.00	13,494,600	貸付株式数 2,000 株
TAC	2,600.0	201.00	522,600	貸付株式数 1,000 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
CEホールディングス	2,700.0	585.00	1,579,500	
日本システム技術	2,200.0	2,233.00	4,912,600	
電通グループ	80,800.0	4,418.00	356,974,400	
インテージホールディングス	9,100.0	2,195.00	19,974,500	
テイクアンドグヴィニーズ	2,100.0	1,000.00	2,100,000	
東邦システムサイエンス	2,100.0	1,388.00	2,914,800	
びあ	2,700.0	3,875.00	10,462,500	貸付株式数 1,000 株
イオンファンタジー	3,500.0	3,180.00	11,130,000	貸付株式数 1,400 株
ソースネクスト	40,600.0	192.00	7,795,200	貸付株式数 16,200 株
シーティーエス	9,300.0	698.00	6,491,400	
ネクシィーズグループ	1,800.0	815.00	1,467,000	貸付株式数 600 株
インフォコム	10,300.0	2,872.00	29,581,600	
メディカルシステムネットワーク	7,500.0	403.00	3,022,500	
日本精化	4,600.0	2,594.00	11,932,400	貸付株式数 1,600 株
扶桑化学工業	7,400.0	3,990.00	29,526,000	
トリケミカル	10,700.0	3,070.00	32,849,000	貸付株式数 4,100 株
シンプレクスHD	13,700.0	2,748.00	37,647,600	
HEROZ	2,700.0	1,522.00	4,109,400	貸付株式数 1,000 株
ラクスル	19,300.0	1,398.00	26,981,400	貸付株式数 7,600 株
メルカリ	48,500.0	3,186.00	154,521,000	貸付株式数 18,800 株
I P S	2,600.0	2,479.00	6,445,400	貸付株式数 1,000 株
F I G	6,100.0	307.00	1,872,700	貸付株式数 2,800 株
システムサポート	3,100.0	2,169.00	6,723,900	貸付株式数 1,100 株
ADEKA	27,900.0	2,786.00	77,729,400	
日油	24,800.0	6,577.00	163,109,600	
ミヨシ油脂	2,000.0	1,195.00	2,390,000	
新日本理化	7,200.0	233.00	1,677,600	貸付株式数 2,800 株
ハリマ化成グループ	3,800.0	867.00	3,294,600	
イーソル	5,800.0	756.00	4,384,800	貸付株式数 2,200 株
東海ソフト	800.0	1,093.00	874,400	
ウイングアーク1ST	8,300.0	2,614.00	21,696,200	
ヒト・コミュニケーションズHD	2,200.0	1,400.00	3,080,000	貸付株式数 800 株
サーバーワークス	1,600.0	3,740.00	5,984,000	貸付株式数 300 株
東名	400.0	2,419.00	967,600	貸付株式数 100 株
ヴィッツ	500.0	1,153.00	576,500	貸付株式数 200 株
トビラシステムズ	1,500.0	970.00	1,455,000	貸付株式数 100 株
S a n s a n	26,200.0	1,331.50	34,885,300	
L i n k - U	1,200.0	862.00	1,034,400	貸付株式数 500 株
ギフティ	7,000.0	1,463.00	10,241,000	貸付株式数 3,000 株
花 王	181,100.0	5,623.00	1,018,325,300	
第一工業製薬	2,900.0	1,755.00	5,089,500	
石原ケミカル	3,600.0	1,711.00	6,159,600	貸付株式数 1,400 株
日華化学	2,100.0	905.00	1,900,500	貸付株式数 900 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ニイタカ	1,000.0	2,005.00	2,005,000	貸付株式数 500株
三洋化成	4,900.0	4,200.00	20,580,000	
メドレー	10,800.0	4,950.00	53,460,000	
ベース	2,700.0	4,515.00	12,190,500	貸付株式数 1,000株
JMDC	13,300.0	5,480.00	72,884,000	
武田薬品	709,500.0	4,829.00	3,426,175,500	
アステラス製薬	757,300.0	2,198.00	1,664,545,400	
住友ファーマ	59,500.0	552.50	32,873,750	
塩野義製薬	101,100.0	6,744.00	681,818,400	
わかもと製薬	4,900.0	229.00	1,122,100	
日本新薬	18,900.0	6,647.00	125,628,300	
中外製薬	251,000.0	4,458.00	1,118,958,000	
科研製薬	13,700.0	3,616.00	49,539,200	
エーザイ	97,500.0	8,934.00	871,065,000	
理研ビタミン	6,800.0	2,328.00	15,830,400	
ロート製薬	77,700.0	4,093.00	318,026,100	
小野薬品	154,700.0	2,926.50	452,729,550	
久光製薬	17,800.0	5,332.00	94,909,600	貸付株式数 4,500株
有機合成薬品	3,800.0	298.00	1,132,400	貸付株式数 600株
持田製薬	9,200.0	3,435.00	31,602,000	
参天製薬	146,100.0	1,431.00	209,069,100	
扶桑薬品	2,500.0	2,041.00	5,102,500	
日本ケミファ	500.0	1,920.00	960,000	貸付株式数 200株
ツムラ	25,200.0	2,783.00	70,131,600	
テ ル モ	245,900.0	4,325.00	1,063,517,500	
HUグループHD	24,000.0	2,640.00	63,360,000	
キッセイ薬品工業	11,800.0	3,460.00	40,828,000	
生化学工業	15,300.0	832.00	12,729,600	
栄研化学	13,000.0	1,426.00	18,538,000	
鳥居薬品	4,300.0	3,860.00	16,598,000	
JCRファーマ	27,100.0	1,452.00	39,349,200	貸付株式数 9,900株
東和薬品	12,300.0	2,894.00	35,596,200	
富士製薬工業	5,900.0	1,219.00	7,192,100	
ゼリア新薬工業	11,100.0	2,372.00	26,329,200	
そーせいグループ	25,800.0	1,606.00	41,434,800	貸付株式数 10,000株
第一三共	698,400.0	4,055.00	2,832,012,000	
杏林製薬	17,400.0	1,834.00	31,911,600	
大幸薬品	15,900.0	355.00	5,644,500	貸付株式数 6,300株
ダイト	6,000.0	2,424.00	14,544,000	
大塚ホールディングス	166,800.0	5,570.00	929,076,000	
大正製薬HD	17,800.0	6,233.00	110,947,400	
ペプチドリーム	38,900.0	1,657.00	64,457,300	貸付株式数 13,400株
大日本塗料	9,800.0	1,001.00	9,809,800	貸付株式数 2,300株
日本ペイントHOLD	425,200.0	1,116.50	474,735,800	
関西ペイント	64,200.0	2,218.00	142,395,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
神東塗料	4,300.0	134.00	576,200	貸付株式数 1,800株
中国塗料	13,200.0	1,440.00	19,008,000	
日本特殊塗料	3,400.0	1,467.00	4,987,800	
藤倉化成	10,800.0	500.00	5,400,000	
太陽ホールディングス	12,200.0	2,631.00	32,098,200	貸付株式数 2,000株
D I C	31,400.0	2,512.00	78,876,800	貸付株式数 12,500株
サカタインクス	17,800.0	1,391.00	24,759,800	貸付株式数 4,700株
東洋インキSCホールディングン	17,500.0	2,417.00	42,297,500	
T&K TOKA	7,200.0	1,430.00	10,296,000	
アルプス技研	7,900.0	2,640.00	20,856,000	
サニックス	13,300.0	336.00	4,468,800	
日本空調サービス	9,400.0	805.00	7,567,000	
オリエンタルランド	434,800.0	5,101.00	2,217,914,800	
フォーカスシステムズ	5,800.0	992.00	5,753,600	
ダスキン	18,200.0	3,372.00	61,370,400	
パーク24	51,100.0	2,022.50	103,349,750	
明光ネットワークジャパン	9,700.0	648.00	6,285,600	貸付株式数 3,800株
ファルコホールディングス	3,700.0	1,991.00	7,366,700	貸付株式数 400株
クレスコ	6,200.0	1,871.00	11,600,200	
フジ・メディア・HD	77,100.0	1,621.00	124,979,100	貸付株式数 10,100株
秀英予備校	1,200.0	408.00	489,600	貸付株式数 500株
田谷	900.0	479.00	431,100	
ラウンドワン	68,600.0	585.00	40,131,000	貸付株式数 26,700株
リゾートトラスト	32,500.0	2,328.50	75,676,250	
オービック	26,800.0	24,100.00	645,880,000	
ジャストシステム	11,500.0	2,919.50	33,574,250	
TDCソフト	6,700.0	1,785.00	11,959,500	
Zホールディングス	1,140,700.0	440.70	502,706,490	
ビー・エム・エル	10,200.0	2,862.00	29,192,400	
トレンドマイクロ	37,900.0	5,894.00	223,382,600	
IDホールディングス	5,400.0	1,415.00	7,641,000	
リソー教育	37,100.0	246.00	9,126,600	
日本オラクル	15,300.0	9,855.00	150,781,500	
早稲田アカデミー	4,400.0	1,514.00	6,661,600	貸付株式数 1,700株
アルファシステムズ	2,500.0	2,975.00	7,437,500	貸付株式数 900株
フューチャー	17,100.0	1,471.00	25,154,100	
CAC HOLDINGS	4,300.0	1,786.00	7,679,800	
S Bテクノロジー	3,400.0	2,300.00	7,820,000	
トーセ	1,500.0	737.00	1,105,500	貸付株式数 100株
ユー・エス・エス	84,600.0	2,501.00	211,584,600	
オービックビジネスC	15,800.0	5,970.00	94,326,000	
アイティフォー	10,500.0	1,109.00	11,644,500	
東京個別指導学院	9,500.0	490.00	4,655,000	貸付株式数 3,100株
東計電算	1,100.0	6,530.00	7,183,000	貸付株式数 300株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
サイバーエージェント	181,500.0	828.60	150,390,900	
楽天グループ	703,200.0	620.10	436,054,320	貸付株式数 281,200 株
エックスネット	700.0	1,092.00	764,400	貸付株式数 300 株
クリーク・アンド・リバー社	4,900.0	2,196.00	10,760,400	
SBIグローバルアセット	13,800.0	574.00	7,921,200	
テー・オー・ダブリュー	17,400.0	313.00	5,446,200	
大塚商会	39,800.0	6,157.00	245,048,600	貸付株式数 3,600 株
サイボウズ	11,000.0	2,048.00	22,528,000	
山田コンサルティングGP	4,200.0	1,665.00	6,993,000	
セントラルスポーツ	3,000.0	2,475.00	7,425,000	貸付株式数 1,100 株
パラカ	2,700.0	2,095.00	5,656,500	
電通国際情報S	9,700.0	5,630.00	54,611,000	
ACCESS	9,400.0	807.00	7,585,800	
デジタルガレージ	14,200.0	3,745.00	53,179,000	
イーエムシステムズ	13,300.0	750.00	9,975,000	
ウェザーニューズ	2,500.0	6,430.00	16,075,000	貸付株式数 100 株
C I J	13,200.0	563.00	7,431,600	貸付株式数 100 株
ビジネスエンジニアリング	1,100.0	3,530.00	3,883,000	
日本エンタープライズ	5,400.0	132.00	712,800	貸付株式数 2,100 株
WOWOW	6,000.0	1,159.00	6,954,000	貸付株式数 2,300 株
スカラ	7,300.0	778.00	5,679,400	
インテリジェント ウェイブ	2,800.0	881.00	2,466,800	
フルキャストホールディングス	7,900.0	1,981.00	15,649,900	
エン・ジャパン	14,900.0	2,439.00	36,341,100	貸付株式数 5,700 株
あすか製薬HD	8,200.0	1,659.00	13,603,800	
サワイグループHD	18,300.0	4,601.00	84,198,300	
富士フイルムHLDGS	153,800.0	9,113.00	1,401,579,400	
コニカミノルタ	180,300.0	501.30	90,384,390	
資生堂	167,400.0	5,702.00	954,514,800	
ライオン	104,900.0	1,471.00	154,307,900	貸付株式数 40,800 株
高砂香料	5,400.0	3,045.00	16,443,000	
マンダム	17,300.0	1,437.00	24,860,100	
ミルボン	10,900.0	4,715.00	51,393,500	貸付株式数 4,300 株
ファンケル	35,100.0	2,436.00	85,503,600	
コーセー	16,300.0	11,920.00	194,296,000	
コタ	7,300.0	1,630.00	11,899,000	
シーボン	700.0	1,546.00	1,082,200	
ポーラ・オルビスHD	41,100.0	1,816.50	74,658,150	
ノエビアホールディングス	7,100.0	5,700.00	40,470,000	
アジュバンホールディング	1,300.0	943.00	1,225,900	
新日本製薬	4,600.0	1,583.00	7,281,800	貸付株式数 1,800 株
アクシージア	4,100.0	1,192.00	4,887,200	
エステー	6,100.0	1,537.00	9,375,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アグロカネショウ	3,200.0	1,425.00	4,560,000	貸付株式数 300株 (300株)
コニシ	13,400.0	2,642.00	35,402,800	貸付株式数 800株
長谷川香料	15,300.0	3,435.00	52,555,500	
星光PMC	3,200.0	1,067.00	3,414,400	
小林製薬	23,300.0	6,946.00	161,841,800	
荒川化学工業	6,800.0	1,075.00	7,310,000	
メック	6,600.0	3,770.00	24,882,000	貸付株式数 2,500株
日本高純度化学	2,000.0	2,611.00	5,222,000	
タカラバイオ	21,600.0	1,418.00	30,628,800	
JCU	9,000.0	3,260.00	29,340,000	
新田ゼラチン	3,300.0	718.00	2,369,400	貸付株式数 1,500株
OATアグリオ	2,000.0	1,820.00	3,640,000	
デクセリアルズ	21,900.0	3,734.00	81,774,600	
アース製薬	7,300.0	4,935.00	36,025,500	貸付株式数 2,600株
北興化学	8,100.0	971.00	7,865,100	
大成ラミック	2,500.0	3,220.00	8,050,000	
クミアイ化学	31,900.0	1,133.00	36,142,700	
日本農薬	14,700.0	695.00	10,216,500	
富士興産	1,300.0	1,947.00	2,531,100	
ニチレキ	9,500.0	2,059.00	19,560,500	
ユシロ化学	4,200.0	1,716.00	7,207,200	
ビーピー・カストロール	2,000.0	918.00	1,836,000	
富士石油	16,300.0	381.00	6,210,300	貸付株式数 6,000株
MORESCO	1,700.0	1,212.00	2,060,400	貸付株式数 200株
出光興産	89,100.0	3,655.00	325,660,500	
ENEOSホールディングス	1,360,200.0	637.60	867,263,520	
コスモエネルギーHLDGS	31,700.0	5,830.00	184,811,000	
テスホールディングス	16,900.0	505.00	8,534,500	
インフロニアHD	81,800.0	1,623.00	132,761,400	
横浜ゴム	40,600.0	3,303.00	134,101,800	
TOYO TIRE	46,100.0	2,415.50	111,354,550	
ブリヂストン	234,700.0	6,111.00	1,434,251,700	
住友ゴム	78,600.0	1,707.50	134,209,500	貸付株式数 30,600株
藤倉コンポジット	3,800.0	1,194.00	4,537,200	
オカモト	4,300.0	5,070.00	21,801,000	
アキレス	5,000.0	1,510.00	7,550,000	貸付株式数 1,100株
フコク	4,200.0	1,540.00	6,468,000	
ニッタ	8,200.0	3,530.00	28,946,000	
クリエートメディック	1,700.0	928.00	1,577,600	
住友理工	15,600.0	1,183.00	18,454,800	
三ツ星ベルト	11,700.0	5,000.00	58,500,000	貸付株式数 3,600株
バンドー化学	11,900.0	1,719.00	20,456,100	
AGC	74,800.0	5,380.00	402,424,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本板硝子	40,900.0	834.00	34,110,600	
石塚硝子	800.0	2,742.00	2,193,600	貸付株式数 500株
有沢製作所	13,000.0	1,079.00	14,027,000	貸付株式数 4,700株
日本山村硝子	2,000.0	1,779.00	3,558,000	
日本電気硝子	32,800.0	2,699.50	88,543,600	
オハラ	3,800.0	1,259.00	4,784,200	貸付株式数 1,500株
住友大阪セメント	11,300.0	3,911.00	44,194,300	
太平洋セメント	51,100.0	2,833.50	144,791,850	
リソルホールディングス	500.0	4,860.00	2,430,000	貸付株式数 200株
日本ヒューム	7,100.0	903.00	6,411,300	貸付株式数 2,700株
日本コンクリート	15,700.0	347.00	5,447,900	
三谷セキサン	3,400.0	5,140.00	17,476,000	
アジアパイルHD	12,600.0	697.00	8,782,200	
東海カーボン	74,000.0	1,219.00	90,206,000	
日本カーボン	4,300.0	4,595.00	19,758,500	
東洋炭素	5,700.0	5,690.00	32,433,000	貸付株式数 1,800株
ノリタケ	4,000.0	6,570.00	26,280,000	
TOTO	52,800.0	3,965.00	209,352,000	
日本碍子	93,200.0	2,033.50	189,522,200	
日本特殊陶業	61,000.0	3,587.00	218,807,000	
ダントーホールディングス	3,500.0	852.00	2,982,000	貸付株式数 2,000株
MARUWA	3,000.0	24,140.00	72,420,000	
品川リフラクトリーズ	2,300.0	8,470.00	19,481,000	
黒崎播磨	1,600.0	10,220.00	16,352,000	
ヨータイ	4,300.0	1,553.00	6,677,900	
東京窯業	5,000.0	350.00	1,750,000	貸付株式数 1,900株
ニッカトー	2,400.0	641.00	1,538,400	
フジミインコーポレーテッド	19,200.0	3,115.00	59,808,000	
クニミネ工業	1,600.0	1,088.00	1,740,800	貸付株式数 900株
エーアンドエーマテリアル	1,000.0	1,200.00	1,200,000	
ニチアス	20,100.0	3,120.00	62,712,000	
日本製鉄	369,300.0	3,750.00	1,384,875,000	
神戸製鋼所	165,900.0	2,160.00	358,344,000	
中山製鋼所	17,000.0	988.00	16,796,000	貸付株式数 6,400株
合同製鐵	4,100.0	5,130.00	21,033,000	
JFEホールディングス	220,400.0	2,314.50	510,115,800	貸付株式数 88,100株
東京製鐵	23,200.0	1,805.00	41,876,000	
共英製鋼	9,400.0	2,206.00	20,736,400	
大和工業	13,600.0	7,456.00	101,401,600	
東京鐵鋼	3,900.0	3,955.00	15,424,500	貸付株式数 1,100株
大阪製鐵	3,800.0	1,888.00	7,174,400	貸付株式数 400株
淀川製鋼所	9,400.0	3,945.00	37,083,000	貸付株式数 3,700株
中部鋼鈑	6,800.0	2,255.00	15,334,000	
丸一鋼管	25,100.0	3,803.00	95,455,300	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
モリ工業	1,300.0	4,105.00	5,336,500	
大同特殊鋼	10,400.0	6,463.00	67,215,200	
日本高周波	1,800.0	700.00	1,260,000	貸付株式数 900株
日本冶金工	6,000.0	5,080.00	30,480,000	
山陽特殊製鋼	8,100.0	3,085.00	24,988,500	
愛知製鋼	4,800.0	4,375.00	21,000,000	
日本金属	1,200.0	934.00	1,120,800	貸付株式数 400株
大平洋金属	5,800.0	1,502.00	8,711,600	貸付株式数 2,300株
新日本電工	40,900.0	305.00	12,474,500	貸付株式数 6,600株
栗本鉄工所	3,900.0	2,849.00	11,111,100	
虹 技	600.0	1,602.00	961,200	
日本鑄鉄管	500.0	1,206.00	603,000	貸付株式数 100株
日本製鋼所	22,200.0	3,031.00	67,288,200	
三菱製鋼	5,200.0	1,627.00	8,460,400	
日亜鋼業	5,400.0	316.00	1,706,400	
日本精線	1,100.0	4,990.00	5,489,000	貸付株式数 100株
エンビプロHD	3,900.0	640.00	2,496,000	貸付株式数 1,600株
大紀アルミニウム	11,700.0	1,525.00	17,842,500	
日本軽金属HD	22,200.0	1,797.00	39,893,400	
三井金属	24,000.0	4,069.00	97,656,000	
東邦亜鉛	4,900.0	1,744.00	8,545,600	
三菱マテリアル	55,100.0	2,632.00	145,023,200	
住友鋁山	95,600.0	4,748.00	453,908,800	
DOWAホールディングス	18,500.0	4,996.00	92,426,000	貸付株式数 2,200株
古河機金	12,100.0	1,813.00	21,937,300	
エス・サイエンス	32,200.0	23.00	740,600	貸付株式数 15,200株
大阪チタニウム	12,100.0	3,245.00	39,264,500	貸付株式数 4,100株
東邦チタニウム	14,900.0	1,950.00	29,055,000	貸付株式数 5,900株
UACJ	11,600.0	3,350.00	38,860,000	
CKサンエツ	2,000.0	3,805.00	7,610,000	貸付株式数 100株
古河電工	27,500.0	2,623.00	72,132,500	
住友電工	284,800.0	1,865.00	531,152,000	
フジクラ	88,500.0	1,249.50	110,580,750	
SWCC	9,200.0	2,187.00	20,120,400	
タツタ電線	16,800.0	701.00	11,776,800	貸付株式数 900株
カナレ電気	900.0	1,467.00	1,320,300	貸付株式数 300株
平河ヒューテック	4,700.0	1,466.00	6,890,200	貸付株式数 1,600株
いよぎんホールディング	93,700.0	1,120.50	104,990,850	
しずおかフィナンシャル	175,000.0	1,275.50	223,212,500	
ちゅうぎんフィナンシャ	66,400.0	1,166.00	77,422,400	
楽天銀行	27,300.0	2,151.00	58,722,300	貸付株式数 10,900株
リョービ	8,800.0	3,280.00	28,864,000	貸付株式数 3,000株
アーレステイ	6,100.0	907.00	5,532,700	
AREホールディングス	33,400.0	1,957.00	65,363,800	
東洋製罐グループHD	49,200.0	2,802.00	137,858,400	



銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ホッカンホールディングス	4,400.0	1,598.00	7,031,200	
コロナ	4,500.0	944.00	4,248,000	
横河ブリッジHLDGS	10,400.0	2,884.00	29,993,600	
駒井ハルテック	900.0	1,927.00	1,734,300	
高田機工	500.0	3,355.00	1,677,500	
三和ホールディングス	75,700.0	2,126.00	160,938,200	
文化シヤッター	23,200.0	1,157.00	26,842,400	貸付株式数 400 株
三協立山	9,300.0	947.00	8,807,100	貸付株式数 3,500 株
アルインコ	6,100.0	1,092.00	6,661,200	貸付株式数 1,600 株
東洋シヤッター	1,200.0	654.00	784,800	貸付株式数 300 株
L I X I L	120,000.0	1,838.00	220,560,000	貸付株式数 29,900 株
日本ファイルコン	3,500.0	488.00	1,708,000	
ノーリツ	13,300.0	1,619.00	21,532,700	
長府製作所	8,100.0	2,126.00	17,220,600	
リンナイ	44,700.0	2,831.50	126,568,050	
ユニプレス	14,300.0	1,288.00	18,418,400	貸付株式数 1,500 株
ダイニチ工業	2,700.0	745.00	2,011,500	
日東精工	12,000.0	567.00	6,804,000	
三洋工業	600.0	2,167.00	1,300,200	
岡 部	14,400.0	760.00	10,944,000	
ジーテクト	9,200.0	1,918.00	17,645,600	
東 プ レ	14,500.0	1,847.00	26,781,500	
高周波熱錬	12,800.0	1,074.00	13,747,200	貸付株式数 2,600 株
東京製綱	4,900.0	1,384.00	6,781,600	
サンコール	4,800.0	510.00	2,448,000	
モリテックスチル	4,000.0	320.00	1,280,000	貸付株式数 2,300 株
パイオラックス	11,400.0	2,469.00	28,146,600	
エイチワン	8,400.0	888.00	7,459,200	
日本発条	73,000.0	1,183.50	86,395,500	
中央発條	6,100.0	769.00	4,690,900	
アドバネクス	700.0	1,099.00	769,300	貸付株式数 400 株
三浦工業	33,700.0	3,231.00	108,884,700	
タ ク マ	24,600.0	1,615.00	39,729,000	
テクノプロ・ホールディング	48,700.0	3,234.00	157,495,800	貸付株式数 18,900 株
アトラグループ	1,600.0	244.00	390,400	貸付株式数 600 株
アイ・アールジャパンHD	4,300.0	2,400.00	10,320,000	貸付株式数 1,600 株
K e e P e r 技研	5,100.0	5,830.00	29,733,000	
ファーストロジック	1,200.0	530.00	636,000	
三機サービス	800.0	1,077.00	861,600	貸付株式数 400 株
G u n o s y	6,500.0	612.00	3,978,000	貸付株式数 1,600 株
デザインワン・ジャパン	1,300.0	168.00	218,400	貸付株式数 500 株
イー・ガーディアン	3,000.0	2,644.00	7,932,000	貸付株式数 1,100 株
リブセンス	2,500.0	347.00	867,500	貸付株式数 1,000 株
ジャパンマテリアル	25,100.0	2,355.00	59,110,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ベクトル	13,000.0	1,296.00	16,848,000	
ウチヤマホールディングス	2,300.0	374.00	860,200	貸付株式数 200株
チャームケアコーポレーション	6,800.0	1,118.00	7,602,400	
キャリアリンク	3,000.0	2,498.00	7,494,000	貸付株式数 1,100株
I B J	6,200.0	622.00	3,856,400	貸付株式数 2,400株
アサンテ	4,300.0	1,644.00	7,069,200	貸付株式数 1,500株
バリューHR	7,100.0	1,274.00	9,045,400	貸付株式数 2,800株
M&Aキャピタルパートナー	6,600.0	2,794.00	18,440,400	貸付株式数 2,500株
ライドオンエクスプレスHD	3,000.0	1,004.00	3,012,000	貸付株式数 900株
E R Iホールディングス	1,400.0	2,319.00	3,246,600	
アビスト	900.0	3,570.00	3,213,000	貸付株式数 400株
シグマシス・ホールディング	12,500.0	1,540.00	19,250,000	
ウィルグループ	7,000.0	1,118.00	7,826,000	
エスクローAJ	6,700.0	146.00	978,200	貸付株式数 2,900株
メドピア	7,200.0	1,012.00	7,286,400	貸付株式数 2,700株
レアジョブ	1,000.0	1,031.00	1,031,000	貸付株式数 400株
リクルートホールディングス	608,400.0	5,062.00	3,079,720,800	
エラン	10,800.0	843.00	9,104,400	
ツガミ	17,900.0	1,221.00	21,855,900	
オークマ	8,100.0	7,103.00	57,534,300	
芝浦機械	8,100.0	4,170.00	33,777,000	
アマダ	128,900.0	1,620.50	208,882,450	
アイダエンジニア	16,600.0	1,036.00	17,197,600	
TAKISAWA	1,400.0	2,592.00	3,628,800	
FUJI	35,100.0	2,479.50	87,030,450	
牧野フライス	8,900.0	6,960.00	61,944,000	
オーエスジー	35,600.0	1,851.00	65,895,600	
ダイジェット	500.0	950.00	475,000	貸付株式数 200株
旭ダイヤモンド	22,500.0	930.00	20,925,000	
DMG森精機	49,000.0	2,753.00	134,897,000	貸付株式数 19,500株
ソディック	19,700.0	769.00	15,149,300	貸付株式数 2,500株
ディスコ	38,900.0	26,340.00	1,024,626,000	
日東工器	3,900.0	2,060.00	8,034,000	
日進工具	6,700.0	1,089.00	7,296,300	
パンチ工業	4,800.0	460.00	2,208,000	貸付株式数 2,100株
富士ダイス	2,500.0	661.00	1,652,500	貸付株式数 1,100株
土木管理総合試験	3,200.0	342.00	1,094,400	貸付株式数 100株
日本郵政	988,900.0	1,267.00	1,252,936,300	
ベルシステム24HLDGS	11,200.0	1,640.00	18,368,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
鎌倉新書	9,300.0	654.00	6,082,200	貸付株式数 3,600株 (1,300株)
SMN	1,300.0	415.00	539,500	貸付株式数 500株
一蔵	700.0	589.00	412,300	貸付株式数 200株
グローバルキッズCOMP	1,000.0	697.00	697,000	
エアトリ	6,000.0	2,167.00	13,002,000	貸付株式数 2,300株
アトラエ	4,900.0	1,111.00	5,443,900	
ストライク	3,500.0	3,440.00	12,040,000	貸付株式数 1,300株
ソラスト	22,500.0	636.00	14,310,000	
セラク	2,500.0	1,299.00	3,247,500	貸付株式数 900株
インソース	17,900.0	1,017.00	18,204,300	貸付株式数 6,900株
豊田自動織機	58,400.0	12,595.00	735,548,000	
豊和工業	2,900.0	805.00	2,334,500	貸付株式数 1,100株
石川製作所	1,300.0	1,282.00	1,666,600	貸付株式数 100株
東洋機械金属	3,700.0	736.00	2,723,200	
津田駒工業	1,000.0	437.00	437,000	貸付株式数 400株
エンシュウ	1,100.0	815.00	896,500	貸付株式数 400株
島精機製作所	12,800.0	1,945.00	24,896,000	
オプトラン	13,300.0	1,861.00	24,751,300	
NCホールディングス	1,100.0	1,645.00	1,809,500	
イワキポンプ	5,400.0	1,970.00	10,638,000	
フリー	8,400.0	1,687.00	14,170,800	
ヤマシンフィルタ	19,300.0	359.00	6,928,700	貸付株式数 200株
日阪製作所	7,800.0	1,006.00	7,846,800	
やまびこ	13,200.0	1,527.00	20,156,400	
野村マイクロ・サイエンス	2,700.0	6,150.00	16,605,000	
平田機工	3,900.0	7,670.00	29,913,000	
PEGASUS	8,900.0	630.00	5,607,000	貸付株式数 3,300株
マルマエ	3,500.0	1,729.00	6,051,500	貸付株式数 1,400株
タツモ	4,900.0	2,973.00	14,567,700	
ナブテスコ	50,700.0	2,770.00	140,439,000	
三井海洋開発	10,100.0	2,090.00	21,109,000	
レオン自動機	8,500.0	1,403.00	11,925,500	
SMC	26,200.0	69,550.00	1,822,210,000	
ホソカワミクロン	5,200.0	4,400.00	22,880,000	貸付株式数 900株
ユニオンツール	3,500.0	3,700.00	12,950,000	
瑞光	5,800.0	1,365.00	7,917,000	貸付株式数 2,200株
オイレス工業	11,300.0	2,089.00	23,605,700	貸付株式数 3,600株
日精エーエスビー	3,200.0	4,660.00	14,912,000	
サトーホールディングス	11,500.0	2,136.00	24,564,000	
技研製作所	7,600.0	2,068.00	15,716,800	貸付株式数 1,300株
日本エアージェック	3,800.0	1,300.00	4,940,000	
カワタ	1,500.0	1,106.00	1,659,000	
日精樹脂工業	6,000.0	1,065.00	6,390,000	
オカダアイヨン	1,700.0	2,097.00	3,564,900	貸付株式数 800株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ワイエイシイホールディングス	2,300.0	2,812.00	6,467,600	貸付株式数 900株
小松製作所	378,300.0	4,509.00	1,705,754,700	
住友重機械	47,800.0	3,936.00	188,140,800	
日立建機	32,200.0	4,914.00	158,230,800	
日工	12,100.0	697.00	8,433,700	
巴工業	3,100.0	3,095.00	9,594,500	貸付株式数 1,200株
井関農機	7,600.0	1,214.00	9,226,400	
TOWA	8,200.0	3,520.00	28,864,000	
丸山製作所	900.0	2,392.00	2,152,800	
北川鉄工所	3,200.0	1,562.00	4,998,400	
シンニッタン	5,800.0	253.00	1,467,400	
ローツェ	4,200.0	10,560.00	44,352,000	貸付株式数 1,600株
タカキタ	1,500.0	502.00	753,000	貸付株式数 800株
クボタ	423,700.0	2,405.50	1,019,210,350	
荏原実業	4,100.0	2,981.00	12,222,100	
東洋エンジニア	10,100.0	696.00	7,029,600	
三菱化工機	2,500.0	2,855.00	7,137,500	
月島ホールディングス	10,700.0	1,398.00	14,958,600	
帝国電機製作所	5,700.0	2,700.00	15,390,000	
東京機械	1,200.0	408.00	489,600	
新東工業	16,300.0	1,156.00	18,842,800	
渋谷工業	7,600.0	2,619.00	19,904,400	
アイチ コーポレーション	11,300.0	1,000.00	11,300,000	
小森コーポレーション	18,700.0	1,140.00	21,318,000	
鶴見製作所	6,200.0	3,275.00	20,305,000	
日本ギア工業	1,800.0	400.00	720,000	貸付株式数 800株
酒井重工業	900.0	5,440.00	4,896,000	
荏原製作所	33,100.0	7,365.00	243,781,500	
石井鉄工所	600.0	3,070.00	1,842,000	
西島製作所	6,900.0	2,007.00	13,848,300	
北越工業	8,100.0	2,169.00	17,568,900	貸付株式数 900株
ダイキン工業	96,400.0	24,915.00	2,401,806,000	
オルガノ	11,100.0	3,965.00	44,011,500	
トーヨーカネツ	3,000.0	3,535.00	10,605,000	
栗田工業	45,100.0	5,495.00	247,824,500	
椿本チエイン	11,500.0	4,060.00	46,690,000	
大同工業	2,100.0	772.00	1,621,200	貸付株式数 900株
日機装	18,600.0	1,038.00	19,306,800	
木村化工機	6,000.0	772.00	4,632,000	貸付株式数 100株 (100株)
レイズネクスト	11,000.0	1,550.00	17,050,000	
アネスト岩田	13,700.0	1,225.00	16,782,500	貸付株式数 100株
ダイフク	124,900.0	2,857.50	356,901,750	貸付株式数 48,600株
サムコ	2,200.0	4,465.00	9,823,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
加藤製作所	2,600.0	1,286.00	3,343,600	
油研工業	800.0	2,334.00	1,867,200	
タダノ	46,500.0	1,328.00	61,752,000	貸付株式数 3,800 株
フジテック	28,300.0	3,676.00	104,030,800	
CKD	22,400.0	2,120.00	47,488,000	
平和	26,800.0	2,270.00	60,836,000	
理想科学工業	6,400.0	2,448.00	15,667,200	
SANKYO	15,900.0	6,603.00	104,987,700	
日本金銭機械	8,900.0	1,019.00	9,069,100	貸付株式数 3,300 株
マースグループHLDGS	4,600.0	2,958.00	13,606,800	
フクシマガリレイ	5,900.0	5,200.00	30,680,000	
オーイズミ	2,000.0	419.00	838,000	貸付株式数 1,000 株
ダイコク電機	4,400.0	5,780.00	25,432,000	貸付株式数 1,700 株
竹内製作所	14,700.0	5,130.00	75,411,000	
アマノ	22,900.0	3,398.00	77,814,200	
JUKI	12,500.0	639.00	7,987,500	
サンデン	7,800.0	195.00	1,521,000	貸付株式数 4,200 株
ジャノメ	8,100.0	723.00	5,856,300	
ブラザー工業	107,900.0	2,535.00	273,526,500	
マックス	9,900.0	2,781.00	27,531,900	
モリタホールディングス	14,000.0	1,690.00	23,660,000	
グローリー	19,400.0	3,214.00	62,351,600	
新晃工業	8,200.0	2,098.00	17,203,600	
大和冷機工業	12,400.0	1,474.00	18,277,600	
セガサミーホールディングス	64,900.0	2,778.50	180,324,650	
日本ピストンリング	1,800.0	1,801.00	3,241,800	
リケン	3,200.0	3,550.00	11,360,000	
TPR	9,200.0	1,938.00	17,829,600	
ツバキ・ナカシマ	16,200.0	819.00	13,267,800	貸付株式数 1,900 株
ホンザキ	47,700.0	5,775.00	275,467,500	
大豊工業	6,900.0	970.00	6,693,000	
日本精工	148,400.0	881.30	130,784,920	
NTN	159,400.0	295.30	47,070,820	貸付株式数 63,600 株
ジェイテクト	71,900.0	1,506.00	108,281,400	
不二越	6,000.0	4,225.00	25,350,000	
ミネベアミツミ	140,500.0	2,482.50	348,791,250	
日本トムソン	19,800.0	579.00	11,464,200	
THK	46,600.0	2,725.00	126,985,000	
ユーシン精機	6,300.0	703.00	4,428,900	
前澤給装工業	5,500.0	1,244.00	6,842,000	貸付株式数 1,000 株
イーグル工業	8,900.0	1,838.00	16,358,200	
前澤工業	3,000.0	1,044.00	3,132,000	
日本ピラー工業	7,500.0	4,110.00	30,825,000	
キッツ	27,100.0	1,092.00	29,593,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日立	392,600.0	9,947.00	3,905,192,200	
東芝	151,400.0	4,593.00	695,380,200	
三菱電機	834,400.0	1,930.50	1,610,809,200	
富士電機	49,100.0	6,953.00	341,392,300	
東洋電機製造	1,800.0	1,038.00	1,868,400	
安川電機	95,700.0	5,761.00	551,327,700	
シンフォニアテクノロジー	8,900.0	1,642.00	14,613,800	
明電舎	12,300.0	2,271.00	27,933,300	
オリジン	1,200.0	1,301.00	1,561,200	
山洋電気	3,500.0	6,920.00	24,220,000	
デンヨー	6,200.0	2,180.00	13,516,000	
PHCホールディングス	11,300.0	1,567.00	17,707,100	
ソシオネクスト	11,600.0	14,830.00	172,028,000	
ベイカレントコンサルティング	65,100.0	4,970.00	323,547,000	
ORCHESTRA HLDGS	1,700.0	1,054.00	1,791,800	
アイモバイル	3,600.0	1,306.00	4,701,600	
キャリアインデックス	1,800.0	295.00	531,000	貸付株式数 700株
MS-Japan	1,900.0	1,195.00	2,270,500	貸付株式数 600株
船場	1,200.0	936.00	1,123,200	貸付株式数 200株
ジャパンエレベーターSHD	29,300.0	2,157.00	63,200,100	
フルテック	800.0	1,217.00	973,600	
グリーンズ	1,800.0	1,707.00	3,072,600	貸付株式数 700株
ツナググループHLDGS	1,500.0	855.00	1,282,500	貸付株式数 600株
GAMEWITH	1,600.0	327.00	523,200	貸付株式数 600株
MS&CONSULTING	800.0	695.00	556,000	貸付株式数 100株
ウェルビー	6,000.0	586.00	3,516,000	貸付株式数 2,300株
エル・ティー・エス	900.0	3,810.00	3,429,000	
ミダックホールディングス	5,000.0	1,835.00	9,175,000	貸付株式数 1,900株
日総工産	6,300.0	765.00	4,819,500	
キュービーネットHLDGS	3,900.0	1,531.00	5,970,900	
RPAホールディングス	11,100.0	340.00	3,774,000	
三桜工業	12,200.0	1,004.00	12,248,800	
マキタ	100,400.0	4,015.00	403,106,000	
東芝テック	11,700.0	3,490.00	40,833,000	
芝浦メカトロニクス	1,400.0	21,100.00	29,540,000	貸付株式数 200株
マブチモーター	20,000.0	4,628.00	92,560,000	
ニデック	196,400.0	7,333.00	1,440,201,200	
ユーエムシーエレクトロニクス	5,900.0	517.00	3,050,300	貸付株式数 2,200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
トレックス・セミコンダクター	3,800.0	2,237.00	8,500,600	貸付株式数 1,400 株
東光高岳	4,900.0	2,192.00	10,740,800	
ダブル・スコープ	23,100.0	1,122.00	25,918,200	貸付株式数 9,200 株
宮越ホールディングス	3,600.0	1,209.00	4,352,400	貸付株式数 1,400 株
ダイヘン	7,300.0	5,260.00	38,398,000	
ヤーマン	13,900.0	1,063.00	14,775,700	貸付株式数 5,500 株
JVCケンウッド	73,500.0	667.00	49,024,500	
ミマキエンジニアリング	7,600.0	797.00	6,057,200	
I-PEX	5,600.0	1,605.00	8,988,000	貸付株式数 900 株
大崎電気	19,200.0	701.00	13,459,200	
オムロン	74,000.0	6,905.00	510,970,000	
日東工業	10,900.0	3,880.00	42,292,000	
IDEC	11,900.0	3,095.00	36,830,500	
正興電機製作所	1,800.0	1,134.00	2,041,200	
不二電機工業	1,000.0	1,128.00	1,128,000	貸付株式数 600 株 (100 株)
ジーエス・ユアサ コーポ	26,500.0	2,714.50	71,934,250	
サクサホールディングス	1,100.0	2,508.00	2,758,800	
メルコホールディングス	2,000.0	3,210.00	6,420,000	
テクノメディカ	1,900.0	2,116.00	4,020,400	貸付株式数 700 株
ダイヤモンドエレクトリックHD	2,700.0	863.00	2,330,100	貸付株式数 1,000 株
日本電気	114,200.0	8,400.00	959,280,000	
富士通	80,400.0	18,665.00	1,500,666,000	
沖電気	36,500.0	1,120.00	40,880,000	
岩崎通信機	2,300.0	837.00	1,925,100	
電気興業	3,200.0	2,528.00	8,089,600	
サンケン電気	7,500.0	9,370.00	70,275,000	
ナカヨ	800.0	1,289.00	1,031,200	貸付株式数 300 株
アイホン	4,800.0	3,135.00	15,048,000	
ルネサスエレクトロニクス	526,900.0	2,264.50	1,193,165,050	
セイコーエプソン	103,600.0	2,402.50	248,899,000	
ワコム	61,400.0	619.00	38,006,600	貸付株式数 22,600 株
アルバック	19,200.0	5,474.00	105,100,800	
アクセル	2,000.0	1,882.00	3,764,000	
EIZO	5,900.0	5,170.00	30,503,000	
ジャパンディスプレイ	61,700.0	40.00	2,468,000	
日本信号	18,500.0	972.00	17,982,000	
京三製作所	17,100.0	503.00	8,601,300	
能美防災	10,900.0	1,856.00	20,230,400	
ホーチキ	6,100.0	1,667.00	10,168,700	
星和電機	2,400.0	498.00	1,195,200	貸付株式数 1,000 株
エレコム	19,300.0	1,801.00	34,759,300	
パナソニック ホールディング	953,600.0	1,784.00	1,701,222,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
シャープ	97,200.0	938.50	91,222,200	貸付株式数 38,800株 (1,200株)
アンリツ	56,900.0	1,102.50	62,732,250	
富士通ゼネラル	22,900.0	2,817.50	64,520,750	
ソニーグループ	565,400.0	12,805.00	7,239,947,000	※
T D K	127,800.0	5,678.00	725,648,400	
帝国通信工業	3,600.0	1,919.00	6,908,400	
タムラ製作所	34,600.0	582.00	20,137,200	貸付株式数 1,500株
アルプスアルパイン	72,100.0	1,297.00	93,513,700	
池上通信機	1,700.0	792.00	1,346,400	貸付株式数 700株
日本電波工業	9,700.0	1,417.00	13,744,900	貸付株式数 900株
鈴木	4,300.0	1,173.00	5,043,900	
メイコー	8,800.0	3,510.00	30,888,000	
日本トリム	1,800.0	3,115.00	5,607,000	
ローランド ディー. ジー.	4,400.0	3,480.00	15,312,000	
フオスター電機	7,500.0	977.00	7,327,500	
S M K	1,900.0	2,546.00	4,837,400	
ヨコオ	6,400.0	1,656.00	10,598,400	
ティアック	8,100.0	114.00	923,400	貸付株式数 3,200株
ホシデン	18,800.0	1,957.00	36,791,600	
ヒロセ電機	13,000.0	17,540.00	228,020,000	
日本航空電子	16,500.0	3,065.00	50,572,500	
T O A	9,200.0	1,220.00	11,224,000	
マクセル	16,400.0	1,711.00	28,060,400	
古野電気	10,500.0	1,392.00	14,616,000	
スミダコーポレーション	10,800.0	1,506.00	16,264,800	
アイコム	3,100.0	3,435.00	10,648,500	貸付株式数 1,000株
リオン	3,300.0	2,301.00	7,593,300	
横河電機	88,300.0	2,999.00	264,811,700	
新電元工業	3,100.0	3,165.00	9,811,500	
アズビル	55,900.0	4,820.00	269,438,000	
東亜ディーケーケー	2,400.0	880.00	2,112,000	貸付株式数 1,100株
日本光電工業	36,900.0	3,863.00	142,544,700	
チノール	3,300.0	2,076.00	6,850,800	貸付株式数 1,100株
共和電業	4,900.0	370.00	1,813,000	
日本電子材料	5,300.0	1,484.00	7,865,200	
堀場製作所	15,300.0	7,975.00	122,017,500	貸付株式数 1,500株
アドバンテスト	63,000.0	15,955.00	1,005,165,000	
小野測器	2,100.0	462.00	970,200	
エスペック	6,400.0	2,435.00	15,584,000	
キーエンス	80,000.0	57,610.00	4,608,800,000	※
日置電機	3,800.0	7,420.00	28,196,000	
シスメックス	69,000.0	7,682.00	530,058,000	
日本マイクロニクス	14,400.0	1,986.00	28,598,400	



銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
メガチップス	6,600.0	4,125.00	27,225,000	貸付株式数 400株
OBARA GROUP	4,400.0	4,145.00	18,238,000	貸付株式数 1,400株
IMAGICA GROUP	6,600.0	598.00	3,946,800	貸付株式数 2,600株
澤藤電機	600.0	1,278.00	766,800	貸付株式数 300株
デンソー	164,900.0	10,285.00	1,695,996,500	
原田工業	2,300.0	844.00	1,941,200	貸付株式数 500株
コーセル	9,600.0	1,287.00	12,355,200	
イリソ電子工業	7,300.0	4,330.00	31,609,000	貸付株式数 2,700株
オプテックスグループ	14,700.0	1,694.00	24,901,800	
千代田インテグレ	3,100.0	2,848.00	8,828,800	
レーザーテック	36,600.0	21,635.00	791,841,000	
スタンレー電気	56,300.0	2,482.50	139,764,750	
ウシオ電機	40,600.0	1,847.00	74,988,200	
岡谷電機	4,000.0	324.00	1,296,000	貸付株式数 1,900株
ヘリオステクノH	4,900.0	424.00	2,077,600	貸付株式数 2,300株
エノモト	1,300.0	1,729.00	2,247,700	貸付株式数 600株
日本セラミック	6,500.0	2,608.00	16,952,000	
遠藤照明	2,400.0	1,277.00	3,064,800	
古河電池	5,900.0	999.00	5,894,100	
双信電機	2,100.0	348.00	730,800	貸付株式数 900株
山一電機	6,500.0	1,765.00	11,472,500	
図研	6,900.0	4,180.00	28,842,000	
日本電子	20,000.0	4,641.00	92,820,000	
カシオ	59,600.0	1,281.50	76,377,400	
ファナック	389,800.0	4,049.00	1,578,300,200	
日本シイエムケイ	16,900.0	667.00	11,272,300	
エンプラス	2,300.0	10,040.00	23,092,000	貸付株式数 900株
大真空	9,700.0	782.00	7,585,400	貸付株式数 2,400株
ローム	36,900.0	11,385.00	420,106,500	
浜松ホトニクス	64,100.0	6,601.00	423,124,100	
三井ハイテック	8,300.0	8,090.00	67,147,000	貸付株式数 3,000株
新光電気工業	28,300.0	5,847.00	165,470,100	
京セラ	124,200.0	7,745.00	961,929,000	
協栄産業	500.0	2,324.00	1,162,000	貸付株式数 200株
太陽誘電	38,900.0	4,270.00	166,103,000	
村田製作所	242,400.0	8,268.00	2,004,163,200	
双葉電子工業	15,100.0	558.00	8,425,800	
日東電工	58,200.0	10,160.00	591,312,000	
北陸電気工業	2,000.0	1,505.00	3,010,000	
東海理化電機	22,500.0	2,463.00	55,417,500	
ニチコン	16,300.0	1,362.00	22,200,600	
日本ケミコン	7,900.0	1,462.00	11,549,800	
K O A	12,100.0	1,845.00	22,324,500	貸付株式数 3,800株
三井E&S	21,700.0	631.00	13,692,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日立造船	65,800.0	900.00	59,220,000	
三菱重工業	141,200.0	8,789.00	1,241,006,800	
川崎重工業	60,200.0	3,918.00	235,863,600	
I H I	50,900.0	3,234.00	164,610,600	
名村造船所	13,700.0	969.00	13,275,300	貸付株式数 7,200 株
サノヤスホールディングス	7,400.0	143.00	1,058,200	貸付株式数 3,600 株
スプリックス	1,500.0	850.00	1,275,000	
マネジメントソリューションズ	3,500.0	3,110.00	10,885,000	貸付株式数 1,100 株
プロレド・パートナーズ	2,100.0	484.00	1,016,400	貸付株式数 200 株
AND FACTORY	1,600.0	367.00	587,200	貸付株式数 500 株
テノ.ホールディングス	700.0	616.00	431,200	貸付株式数 200 株
フロンティア・マネジメント	2,100.0	1,341.00	2,816,100	
ピアラ	1,100.0	420.00	462,000	貸付株式数 400 株
コプロ・ホールディングス	900.0	2,504.00	2,253,600	貸付株式数 100 株
ギークス	700.0	728.00	509,600	貸付株式数 400 株
アンビスホールディングス	8,800.0	2,865.00	25,212,000	
カーブスホールディングス	22,500.0	737.00	16,582,500	
フォーラムエンジニアリング	4,900.0	1,304.00	6,389,600	
FAST FITNESS JAP	2,800.0	1,364.00	3,819,200	
日本車輛	3,100.0	2,198.00	6,813,800	貸付株式数 300 株
三菱ロジスネクスト	12,800.0	1,410.00	18,048,000	
近畿車輛	800.0	2,073.00	1,658,400	貸付株式数 300 株
一家ホールディングス	1,300.0	708.00	920,400	貸付株式数 600 株
フルサト・マルカHD	7,600.0	2,790.00	21,204,000	
ヤマエグループHD	4,800.0	3,775.00	18,120,000	
ジャパクラフトホールディング	3,400.0	227.00	771,800	貸付株式数 1,800 株
F P G	26,600.0	1,502.00	39,953,200	
島根銀行	1,800.0	595.00	1,071,000	貸付株式数 800 株
じもとホールディングス	4,600.0	456.00	2,097,600	
全国保証	20,600.0	5,005.00	103,103,000	
めぶきフィナンシャルG	390,800.0	434.50	169,802,600	
ジャパンインベストメントA	6,400.0	1,869.00	11,961,600	
東京きらぼしFG	10,100.0	4,725.00	47,722,500	
九州フィナンシャルG	138,600.0	807.60	111,933,360	貸付株式数 36,400 株
かんぽ生命保険	91,700.0	2,625.00	240,712,500	
ゆうちょ銀行	216,300.0	1,321.00	285,732,300	
あんしん保証	2,500.0	297.00	742,500	貸付株式数 1,100 株
富山第一銀行	25,000.0	1,038.00	25,950,000	貸付株式数 9,400 株
コンコルディア・フィナンシャル	422,500.0	726.30	306,861,750	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ジェイリース	1,700.0	2,174.00	3,695,800	貸付株式数 600株
西日本フィナンシャルHD	48,900.0	1,735.00	84,841,500	
イントラスト	2,000.0	910.00	1,820,000	
日本モーゲージサービス	2,800.0	575.00	1,610,000	貸付株式数 1,200株
C a s a	2,000.0	881.00	1,762,000	貸付株式数 700株
アルヒ	9,700.0	947.00	9,185,900	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
プレミアグループ	13,200.0	1,589.00	20,974,800	
日産自動車	1,135,600.0	710.10	806,389,560	
いすゞ自動車	232,400.0	2,023.50	470,261,400	
トヨタ自動車	4,389,200.0	2,880.00	12,640,896,000	
日野自動車	103,000.0	612.00	63,036,000	
三菱自動車工業	311,900.0	662.60	206,664,940	
エフテック	3,700.0	883.00	3,267,100	
レシップホールディングス	2,100.0	568.00	1,192,800	
GMB	1,000.0	2,160.00	2,160,000	貸付株式数 400株
ファルテック	800.0	585.00	468,000	貸付株式数 200株
武蔵精密工業	19,500.0	1,703.00	33,208,500	
日産車体	14,100.0	923.00	13,014,300	貸付株式数 3,700株
新明和工業	25,100.0	1,327.00	33,307,700	
極東開発工業	13,200.0	1,878.00	24,789,600	
トピー工業	6,500.0	2,711.00	17,621,500	
ティラド	2,000.0	2,321.00	4,642,000	
タチエス	12,600.0	1,861.00	23,448,600	
N O K	31,000.0	2,134.00	66,154,000	
フタバ産業	21,400.0	800.00	17,120,000	
K Y B	7,700.0	5,120.00	39,424,000	
市光工業	14,400.0	590.00	8,496,000	
大同メタル工業	15,500.0	585.00	9,067,500	
プレス工業	35,700.0	723.00	25,811,100	
ミクニ	6,100.0	512.00	3,123,200	
太平洋工業	18,300.0	1,562.00	28,584,600	
河西工業	7,000.0	298.00	2,086,000	貸付株式数 2,700株
アイシン	61,600.0	5,908.00	363,932,800	
マ ツ ダ	264,400.0	1,852.50	489,801,000	
今仙電機製作所	3,300.0	679.00	2,240,700	
本田技研	649,800.0	5,407.00	3,513,468,600	※
スズキ	146,800.0	6,291.00	923,518,800	
S U B A R U	252,900.0	3,094.00	782,472,600	
安永	2,300.0	860.00	1,978,000	貸付株式数 1,200株
ヤマハ発動機	115,200.0	4,127.00	475,430,400	
小糸製作所	96,100.0	2,347.00	225,546,700	貸付株式数 11,100株
T B K	5,100.0	473.00	2,412,300	
エクセディ	13,100.0	2,802.00	36,706,200	
ミツバ	15,000.0	811.00	12,165,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
豊田合成	23,300.0	3,475.00	80,967,500	
愛三工業	13,200.0	1,403.00	18,519,600	
盟和産業	700.0	1,040.00	728,000	貸付株式数 300株
日本プラスト	4,100.0	509.00	2,086,900	
ヨロズ	7,500.0	990.00	7,425,000	貸付株式数 2,700株
エフ・シー・シー	14,200.0	1,978.00	28,087,600	
新家工業	1,200.0	2,867.00	3,440,400	
シマノ	32,400.0	20,470.00	663,228,000	貸付株式数 12,600株
テイ・エス テック	36,600.0	1,785.50	65,349,300	貸付株式数 12,500株
33FG	7,000.0	1,980.00	13,860,000	
第四北越フィナンシャルG	12,400.0	4,025.00	49,910,000	
ひろぎんHLDGS	102,700.0	986.50	101,313,550	
マーキュリアホールディングス	2,700.0	798.00	2,154,600	貸付株式数 1,000株
おきなわFG	7,200.0	2,553.00	18,381,600	
ダイレクトマーケティングミクス	8,500.0	522.00	4,437,000	
ポピンズ	1,200.0	1,273.00	1,527,600	
LITALICO	6,400.0	2,125.00	13,600,000	
コンフィデンス・インターワーク	300.5	1,614.00	485,007	貸付株式数 100株
十六FG	10,200.0	4,045.00	41,259,000	
北國FHD	8,300.0	5,890.00	48,887,000	
ネットプロHD	26,000.0	392.00	10,192,000	
プロクレアホールディングス	9,600.0	2,089.00	20,054,400	
あいちフィナンシャルグル	11,000.0	2,648.00	29,128,000	
ジャムコ	2,900.0	1,641.00	4,758,900	貸付株式数 500株
小野建	8,300.0	1,786.00	14,823,800	
はるやまHLDGS	2,600.0	528.00	1,372,800	貸付株式数 1,100株
南陽	1,000.0	2,288.00	2,288,000	貸付株式数 500株
ノジマ	27,600.0	1,313.00	36,238,800	貸付株式数 11,000株
佐鳥電機	3,500.0	1,804.00	6,314,000	
カップ・クリエイト	13,400.0	1,578.00	21,145,200	貸付株式数 5,300株
エコートレーディング	1,100.0	1,392.00	1,531,200	
伯東	4,800.0	5,470.00	26,256,000	
コンドーテック	6,300.0	1,200.00	7,560,000	貸付株式数 2,200株
中山福	2,900.0	360.00	1,044,000	
ライトオン	4,400.0	513.00	2,257,200	貸付株式数 1,700株
ナガイレーベン	10,700.0	2,307.00	24,684,900	貸付株式数 200株
三菱食品	7,800.0	4,135.00	32,253,000	
良品計画	92,400.0	1,952.50	180,411,000	
パリミキホールディングス	7,300.0	387.00	2,825,100	貸付株式数 2,600株
松田産業	6,400.0	2,334.00	14,937,600	
第一興商	32,700.0	2,630.00	86,001,000	
メディパルHD	80,900.0	2,644.00	213,899,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アドヴァングループ	7,800.0	1,053.00	8,213,400	
S P K	3,700.0	2,090.00	7,733,000	
萩原電気HLDGS	3,500.0	4,235.00	14,822,500	
アルビス	2,900.0	2,460.00	7,134,000	貸付株式数 1,100 株
アズワン	12,100.0	5,831.00	70,555,100	
スズデン	2,900.0	2,346.00	6,803,400	
尾家産業	1,300.0	2,021.00	2,627,300	貸付株式数 300 株
シモジマ	5,800.0	1,232.00	7,145,600	貸付株式数 200 株
ドウシシャ	8,900.0	2,358.00	20,986,200	
小津産業	1,200.0	1,636.00	1,963,200	貸付株式数 600 株
コナカ	6,500.0	462.00	3,003,000	
高速	4,400.0	2,099.00	9,235,600	
ハウス ローゼ	800.0	1,619.00	1,295,200	
G-7ホールディングス	10,600.0	1,302.00	13,801,200	
たけびし	3,300.0	1,953.00	6,444,900	貸付株式数 1,200 株
イオン北海道	12,400.0	871.00	10,800,400	貸付株式数 4,600 株
コジマ	14,300.0	635.00	9,080,500	貸付株式数 5,400 株
ヒマラヤ	2,000.0	946.00	1,892,000	貸付株式数 900 株
コーナン商事	11,500.0	3,595.00	41,342,500	
ネットワンシステムズ	29,900.0	2,789.50	83,406,050	
エコス	3,100.0	2,086.00	6,466,600	
ワタミ	10,200.0	1,156.00	11,791,200	貸付株式数 3,900 株
マルシェ	1,900.0	297.00	564,300	貸付株式数 800 株
リックス	1,200.0	3,330.00	3,996,000	
システムソフト	27,200.0	77.00	2,094,400	貸付株式数 1,500 株
パンパシフィックHD	170,700.0	3,101.00	529,340,700	
丸文	7,600.0	1,243.00	9,446,800	
西松屋チェーン	18,800.0	1,649.00	31,001,200	貸付株式数 7,200 株
ゼンショーホールディングス	46,300.0	6,599.00	305,533,700	貸付株式数 18,500 株
ハピネット	7,200.0	2,596.00	18,691,200	
幸楽苑ホールディングス	5,600.0	1,038.00	5,812,800	貸付株式数 2,200 株
ハークスレイ	2,000.0	771.00	1,542,000	
橋本総業HLDGS	3,300.0	1,175.00	3,877,500	
日本ライフライン	24,800.0	1,229.00	30,479,200	
サイゼリヤ	12,500.0	4,655.00	58,187,500	貸付株式数 4,400 株
タカショー	7,300.0	649.00	4,737,700	貸付株式数 2,800 株
VTホールディングス	32,000.0	529.00	16,928,000	
アルゴグラフィックス	7,300.0	3,525.00	25,732,500	
魚力	2,700.0	2,215.00	5,980,500	貸付株式数 1,000 株
IDOM	25,600.0	740.00	18,944,000	貸付株式数 10,200 株
日本エム・ディ・エム	4,700.0	765.00	3,595,500	
ポプラ	1,400.0	224.00	313,600	貸付株式数 200 株
フジ・コーポレーション	4,200.0	2,057.00	8,639,400	
ユナイテッドアローズ	9,100.0	2,045.00	18,609,500	貸付株式数 1,000 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
進和	5,200.0	2,447.00	12,724,400	貸付株式数 2,000株
エスケイジャパン	1,300.0	712.00	925,600	
ダイトロン	3,300.0	3,105.00	10,246,500	
ハイデイ日高	12,600.0	2,876.00	36,237,600	貸付株式数 4,700株
シークス	12,100.0	1,571.00	19,009,100	貸付株式数 4,100株
YU-WA CREATI ON H	4,000.0	185.00	740,000	
コロワイド	39,000.0	2,514.50	98,065,500	貸付株式数 15,500株
田中商事	1,500.0	727.00	1,090,500	貸付株式数 100株
オーハシテクニカ	4,100.0	1,730.00	7,093,000	貸付株式数 1,600株
壺番屋	6,700.0	5,490.00	36,783,000	貸付株式数 1,300株
白銅	3,000.0	2,446.00	7,338,000	貸付株式数 1,100株
トップカルチャー	2,200.0	191.00	420,200	貸付株式数 600株
PLANT	1,300.0	810.00	1,053,000	
スギホールディングス	17,000.0	6,309.00	107,253,000	
ダイコー通産	600.0	1,210.00	726,000	貸付株式数 200株
薬王堂ホールディングス	4,800.0	2,758.00	13,238,400	
島津製作所	97,300.0	4,152.00	403,989,600	
J M S	7,300.0	555.00	4,051,500	
クボテック	1,200.0	268.00	321,600	貸付株式数 400株
長野計器	5,800.0	2,632.00	15,265,600	
ブイ・テクノロジー	3,900.0	2,232.00	8,704,800	
スター精密	15,300.0	1,919.00	29,360,700	
東京計器	6,100.0	1,537.00	9,375,700	貸付株式数 1,800株
愛知時計	3,000.0	1,769.00	5,307,000	
インターアクション	3,800.0	1,044.00	3,967,200	貸付株式数 1,200株
オーバル	4,600.0	423.00	1,945,800	貸付株式数 400株
東京精密	17,600.0	7,340.00	129,184,000	
マニー	32,000.0	1,897.00	60,704,000	
ニコン	115,600.0	1,644.50	190,104,200	
トプコン	42,100.0	1,763.00	74,222,300	
オリンパス	492,000.0	2,082.00	1,024,344,000	
理研計器	5,000.0	5,900.00	29,500,000	
SCREENホールディン グス	13,700.0	13,935.00	190,909,500	
キヤノン電子	8,800.0	1,885.00	16,588,000	貸付株式数 1,200株
タムロン	4,900.0	4,395.00	21,535,500	
HOYA	169,400.0	16,095.00	2,726,493,000	
シード	2,600.0	814.00	2,116,400	
ノーリツ鋼機	7,600.0	3,275.00	24,890,000	
A&Dホロンホールディン グス	11,700.0	1,743.00	20,393,100	
朝日インテック	89,300.0	2,915.00	260,309,500	
キヤノン	398,700.0	3,684.00	1,468,810,800	貸付株式数 159,400株
リコー	200,400.0	1,339.50	268,435,800	
シチズン時計	73,500.0	953.00	70,045,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
リズム	1,600.0	1,814.00	2,902,400	
大研医器	3,900.0	550.00	2,145,000	
メニコン	27,500.0	2,058.50	56,608,750	
シンシア	600.0	551.00	330,600	貸付株式数 200株
KYORITSU	7,700.0	201.00	1,547,700	
中本パックス	1,800.0	1,654.00	2,977,200	貸付株式数 100株
スノーピーク	11,400.0	1,380.00	15,732,000	貸付株式数 4,800株 (100株)
パラマウントベッドHD	18,400.0	2,424.00	44,601,600	
トランザクション	5,300.0	1,942.00	10,292,600	貸付株式数 1,900株
粧美堂	1,500.0	524.00	786,000	貸付株式数 600株
ニホンフラッシュ	7,300.0	908.00	6,628,400	
前田工織	6,700.0	3,065.00	20,535,500	貸付株式数 2,400株
永大産業	5,500.0	231.00	1,270,500	
アートネイチャー	8,000.0	839.00	6,712,000	
バンダイナムコHLDGS	219,000.0	3,264.00	714,816,000	
アイフィスジャパン	1,400.0	613.00	858,200	貸付株式数 400株
SHOEI	18,000.0	2,459.00	44,262,000	
フランスベッドHLDGS	9,000.0	1,245.00	11,205,000	貸付株式数 3,400株
マーベラス	12,800.0	731.00	9,356,800	
パイロットコーポレーション	11,200.0	5,072.00	56,806,400	
萩原工業	5,300.0	1,861.00	9,863,300	貸付株式数 2,100株 (500株)
エイベックス	13,600.0	1,499.00	20,386,400	
フジシールインターナショナル	16,200.0	1,808.00	29,289,600	
タカラトミー	36,400.0	2,303.00	83,829,200	
広済堂ホールディングス	3,600.0	2,859.00	10,292,400	
エステールホールディングス	1,200.0	645.00	774,000	貸付株式数 700株
レック	11,400.0	967.00	11,023,800	
タカノ	1,900.0	919.00	1,746,100	貸付株式数 800株
三光合成	10,100.0	706.00	7,130,600	
プロネクス	6,900.0	1,164.00	8,031,600	
ホクシン	4,000.0	132.00	528,000	貸付株式数 2,000株
ウッドワン	1,700.0	1,088.00	1,849,600	貸付株式数 600株
大建工業	4,700.0	3,045.00	14,311,500	
きもと	7,700.0	192.00	1,478,400	
凸版印刷	98,300.0	3,837.00	377,177,100	
大日本印刷	87,400.0	4,064.00	355,193,600	
共同印刷	2,300.0	3,360.00	7,728,000	
NISSHA	13,800.0	1,716.00	23,680,800	
光村印刷	600.0	1,396.00	837,600	貸付株式数 200株
藤森工業	6,300.0	3,965.00	24,979,500	
ヴィア・ホールディングス	9,000.0	104.00	936,000	貸付株式数 300株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
TAKARA & COMPANY	5,200.0	2,524.00	13,124,800	
前澤化成工業	5,000.0	1,535.00	7,675,000	貸付株式数 1,800株
未来工業	2,800.0	3,315.00	9,282,000	
アシックス	68,100.0	5,672.00	386,263,200	
ツツミ	1,400.0	2,444.00	3,421,600	貸付株式数 600株
ウェーブロックHLDGS	1,700.0	675.00	1,147,500	貸付株式数 1,200株
ジェイ エス ピー	5,600.0	2,067.00	11,575,200	貸付株式数 1,400株
ニチハ	9,900.0	3,135.00	31,036,500	
ローランド	5,900.0	4,030.00	23,777,000	
エフピコ	15,200.0	2,607.50	39,634,000	
小松ウオール工業	2,900.0	3,080.00	8,932,000	
ヤマハ	50,400.0	4,315.00	217,476,000	
河合楽器	2,200.0	3,570.00	7,854,000	
クリナップ	8,700.0	735.00	6,394,500	
ビジョン	50,900.0	1,693.50	86,199,150	
天馬	6,500.0	2,623.00	17,049,500	
キングジム	6,900.0	883.00	6,092,700	貸付株式数 2,700株
象印マホービン	21,700.0	1,843.00	39,993,100	
リンテック	16,100.0	2,477.00	39,879,700	
信越ポリマー	14,800.0	1,366.00	20,216,800	
東リ	11,700.0	342.00	4,001,400	
イトーキ	16,400.0	1,464.00	24,009,600	
任天堂	504,700.0	6,451.00	3,255,819,700	
三菱鉛筆	11,300.0	1,980.00	22,374,000	
松風	3,600.0	2,234.00	8,042,400	
タカラスタンダード	14,300.0	1,907.00	27,270,100	
コクヨ	34,600.0	2,416.00	83,593,600	
ナカバヤシ	8,500.0	531.00	4,513,500	
ニフコ	28,900.0	4,215.00	121,813,500	
立川ブラインド	3,600.0	1,473.00	5,302,800	
グローブライド	6,400.0	2,069.00	13,241,600	
オカムラ	24,000.0	2,319.00	55,656,000	
バルカー	6,700.0	4,320.00	28,944,000	
MUTOHホールディングス	700.0	2,020.00	1,414,000	
伊藤忠	521,100.0	5,757.00	2,999,972,700	
丸紅	660,000.0	2,539.00	1,675,740,000	
スクロール	12,600.0	1,039.00	13,091,400	貸付株式数 1,600株
高島	900.0	4,020.00	3,618,000	
ヨンドシーホールディングス	7,200.0	1,872.00	13,478,400	貸付株式数 100株
三陽商会	2,000.0	2,121.00	4,242,000	貸付株式数 200株
長瀬産業	38,800.0	2,550.00	98,940,000	
ナイガイ	1,700.0	289.00	491,300	貸付株式数 500株
蝶理	4,600.0	3,085.00	14,191,000	



銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
豊田通商	74,100.0	9,186.00	680,682,600	
オンワードホールディングス	51,900.0	550.00	28,545,000	
三共生興	11,700.0	806.00	9,430,200	
兼 松	32,800.0	2,231.00	73,176,800	
美 津 濃	7,900.0	4,860.00	38,394,000	
ツカモトコーポレーション	800.0	1,288.00	1,030,400	
ルックホールディングス	1,700.0	2,077.00	3,530,900	貸付株式数 800 株
三井物産	600,200.0	5,832.00	3,500,366,400	
日本紙パルプ	4,500.0	5,160.00	23,220,000	
東京エレクトロン	169,200.0	20,750.00	3,510,900,000	
カメイ	9,000.0	1,559.00	14,031,000	
東都水産	300.0	6,570.00	1,971,000	貸付株式数 100 株
OUGホールディングス	800.0	2,525.00	2,020,000	
スターゼン	6,500.0	2,650.00	17,225,000	
セイコーグループ	12,400.0	2,759.00	34,211,600	
山 善	22,800.0	1,235.00	28,158,000	
椿本興業	1,400.0	5,440.00	7,616,000	貸付株式数 500 株
住友商事	511,800.0	3,216.00	1,645,948,800	
B I P R O G Y	29,500.0	3,839.00	113,250,500	
内田洋行	3,400.0	6,850.00	23,290,000	
三菱商事	515,600.0	7,688.00	3,963,932,800	
第一実業	3,000.0	5,950.00	17,850,000	
キャノンマーケティング J P N	19,600.0	3,850.00	75,460,000	
西華産業	3,200.0	2,200.00	7,040,000	
佐藤商事	5,900.0	1,599.00	9,434,100	
菱洋エレクトロ	7,200.0	3,335.00	24,012,000	貸付株式数 1,200 株
東京産業	7,500.0	884.00	6,630,000	
ユアサ商事	7,300.0	4,320.00	31,536,000	
神鋼商事	2,100.0	6,170.00	12,957,000	
トルク	2,900.0	281.00	814,900	貸付株式数 1,100 株
阪和興業	15,200.0	5,060.00	76,912,000	
正栄食品	5,600.0	5,130.00	28,728,000	貸付株式数 1,900 株 (100 株)
カナデン	5,600.0	1,386.00	7,761,600	貸付株式数 2,200 株
R Y O D E N	6,800.0	2,417.00	16,435,600	貸付株式数 2,400 株
ニプロ	66,600.0	1,227.00	81,718,200	貸付株式数 22,400 株
岩谷産業	19,200.0	7,923.00	152,121,600	
ナイス	2,500.0	1,523.00	3,807,500	
ニチモウ	700.0	4,275.00	2,992,500	
極東貿易	5,000.0	1,976.00	9,880,000	貸付株式数 400 株
アステナホールディングス	15,800.0	484.00	7,647,200	貸付株式数 5,100 株
三愛オブリ	22,400.0	1,828.00	40,947,200	
稲畑産業	16,700.0	3,280.00	54,776,000	
G S I クレオス	4,900.0	2,338.00	11,456,200	貸付株式数 1,900 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
明和産業	11,200.0	679.00	7,604,800	貸付株式数 4,300株
クワザワホールディングス	1,800.0	570.00	1,026,000	貸付株式数 1,000株
ゴールドウイン	14,200.0	10,840.00	153,928,000	
ユニ・チャーム	167,000.0	5,505.00	919,335,000	
デサント	13,800.0	3,815.00	52,647,000	
キング	2,300.0	677.00	1,557,100	貸付株式数 100株
ワキタ	15,600.0	1,451.00	22,635,600	
ヤマトインターナショナル	4,100.0	290.00	1,189,000	
東邦ホールディングス	21,100.0	3,136.00	66,169,600	貸付株式数 7,900株
サンゲツ	21,200.0	3,120.00	66,144,000	
ミツウロコグループ	10,800.0	1,387.00	14,979,600	
シナネンホールディングス	2,700.0	4,125.00	11,137,500	
伊藤忠エネクス	21,000.0	1,578.00	33,138,000	
サンリオ	24,000.0	7,237.00	173,688,000	
サンワテクノス	4,300.0	2,297.00	9,877,100	
リョーサン	9,000.0	4,360.00	39,240,000	
新光商事	11,400.0	1,261.00	14,375,400	
トーホー	3,600.0	3,585.00	12,906,000	貸付株式数 1,100株
三信電気	3,400.0	2,255.00	7,667,000	
東陽テクニカ	8,500.0	1,339.00	11,381,500	
モスフードサービス	12,500.0	3,345.00	41,812,500	貸付株式数 4,800株
加賀電子	6,900.0	6,740.00	46,506,000	
三益半導体	6,400.0	2,793.00	17,875,200	
都築電気	4,200.0	2,340.00	9,828,000	貸付株式数 1,600株
ソーダニツカ	4,100.0	1,089.00	4,464,900	
立花エレテック	6,200.0	2,936.00	18,203,200	貸付株式数 2,000株
木曽路	12,900.0	2,541.00	32,778,900	貸付株式数 5,100株
SRSホールディングス	14,100.0	1,066.00	15,030,600	貸付株式数 5,500株
千趣会	16,000.0	410.00	6,560,000	貸付株式数 6,200株
タカキュー	4,200.0	93.00	390,600	貸付株式数 600株
リテールパートナーズ	12,500.0	1,747.00	21,837,500	貸付株式数 4,200株
ケーヨー	13,900.0	871.00	12,106,900	
上新電機	7,700.0	2,340.00	18,018,000	
日本瓦斯	44,800.0	2,312.00	103,577,600	
ロイヤルホールディングス	14,900.0	2,684.00	39,991,600	貸付株式数 5,900株
東天紅	500.0	850.00	425,000	
いなげや	8,200.0	1,501.00	12,308,200	
チヨダ	8,300.0	959.00	7,959,700	貸付株式数 1,300株
ライフコーポレーション	7,400.0	3,720.00	27,528,000	
リンガーハット	11,000.0	2,349.00	25,839,000	貸付株式数 4,300株
MrMaxHD	12,200.0	637.00	7,771,400	
テンアライド	6,700.0	328.00	2,197,600	貸付株式数 3,100株
AOKIホールディングス	15,600.0	1,052.00	16,411,200	
オークワ	13,400.0	909.00	12,180,600	貸付株式数 200株
コメリ	13,100.0	3,125.00	40,937,500	貸付株式数 5,000株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
青山商事	18,100.0	1,696.00	30,697,600	
しまむら	9,900.0	14,955.00	148,054,500	
はせがわ	2,900.0	353.00	1,023,700	
高島屋	63,700.0	2,207.50	140,617,750	
松屋	14,300.0	1,049.00	15,000,700	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	41,100.0	1,823.00	74,925,300	
近鉄百貨店	3,600.0	2,933.00	10,558,800	貸付株式数 100株 (100株)
丸井グループ	62,300.0	2,614.50	162,883,350	貸付株式数 14,100株
クレディセゾン	49,900.0	2,489.50	124,226,050	
アクシアル リテイリング	5,800.0	3,795.00	22,011,000	
井筒屋	2,600.0	382.00	993,200	貸付株式数 700株
イオン	286,700.0	3,035.00	870,134,500	
イズミ	12,800.0	4,014.00	51,379,200	
フォーバル	3,300.0	1,243.00	4,101,900	貸付株式数 1,200株
平和堂	14,100.0	2,500.00	35,250,000	貸付株式数 5,200株
フジ	13,000.0	1,825.00	23,725,000	貸付株式数 4,800株
ヤオコー	9,600.0	7,852.00	75,379,200	貸付株式数 3,800株
ゼビオホールディングス	11,600.0	1,020.00	11,832,000	貸付株式数 2,500株
ケーズホールディングス	60,000.0	1,409.50	84,570,000	
PAL TAC	13,300.0	4,856.00	64,584,800	
三谷産業	14,400.0	339.00	4,881,600	
OLYMPICグループ	2,000.0	535.00	1,070,000	貸付株式数 100株
日産東京販売HD	7,200.0	478.00	3,441,600	
あおぞら銀行	49,500.0	3,194.00	158,103,000	貸付株式数 19,800株 (600株)
三菱UFJフィナンシャル G	4,930,300.0	1,324.50	6,530,182,350	※
りそなホールディングス	988,500.0	877.40	867,309,900	
三井住友トラストHD	141,400.0	6,001.00	848,541,400	
三井住友フィナンシャルG	559,500.0	7,600.00	4,252,200,000	※
千葉銀行	219,400.0	1,154.50	253,297,300	
群馬銀行	152,800.0	743.90	113,667,920	
武蔵野銀行	10,100.0	2,921.00	29,502,100	
千葉興業銀行	12,300.0	921.00	11,328,300	
筑波銀行	34,500.0	290.00	10,005,000	
七十七銀行	25,200.0	3,380.00	85,176,000	
秋田銀行	5,300.0	2,148.00	11,384,400	
山形銀行	8,700.0	1,217.00	10,587,900	
岩手銀行	5,400.0	2,835.00	15,309,000	
東邦銀行	62,300.0	293.00	18,253,900	貸付株式数 7,900株
東北銀行	2,500.0	1,227.00	3,067,500	
ふくおかフィナンシャルG	62,900.0	3,806.00	239,397,400	
スルガ銀行	63,000.0	652.00	41,076,000	
八十二銀行	166,300.0	905.80	150,634,540	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
山梨中央銀行	8,100.0	1,723.00	13,956,300	
大垣共立銀行	15,000.0	2,231.00	33,465,000	
福井銀行	7,000.0	1,675.00	11,725,000	貸付株式数 1,500 株
清水銀行	3,100.0	1,709.00	5,297,900	
富山銀行	800.0	1,916.00	1,532,800	
滋賀銀行	13,100.0	3,580.00	46,898,000	
南都銀行	11,900.0	2,881.00	34,283,900	
百五銀行	74,100.0	579.00	42,903,900	
京都銀行	24,900.0	8,687.00	216,306,300	
紀陽銀行	28,200.0	1,606.00	45,289,200	貸付株式数 7,100 株
ほくほくフィナンシャルG	50,000.0	1,614.50	80,725,000	
山陰合同銀行	49,300.0	1,024.00	50,483,200	
鳥取銀行	1,700.0	1,439.00	2,446,300	
百十四銀行	7,200.0	2,612.00	18,806,400	
四国銀行	12,500.0	1,053.00	13,162,500	
阿波銀行	11,100.0	2,421.00	26,873,100	
大分銀行	4,700.0	2,814.00	13,225,800	
宮崎銀行	5,100.0	2,938.00	14,983,800	
佐賀銀行	4,600.0	2,119.00	9,747,400	
琉球銀行	18,000.0	1,167.00	21,006,000	
セブン銀行	282,100.0	326.00	91,964,600	
みずほフィナンシャルG	1,138,500.0	2,683.00	3,054,595,500	
高知銀行	1,800.0	1,139.00	2,050,200	
山口フィナンシャルG	77,300.0	1,394.50	107,794,850	
芙蓉総合リース	7,200.0	12,930.00	93,096,000	
みずほリース	11,700.0	5,120.00	59,904,000	
東京センチュリー	14,700.0	6,325.00	92,977,500	
SBIホールディングス	114,100.0	3,356.00	382,919,600	
日本証券金融	28,900.0	1,573.00	45,459,700	
アイフル	130,100.0	369.00	48,006,900	
日本アジア投資	4,100.0	275.00	1,127,500	
名古屋銀行	5,200.0	5,180.00	26,936,000	
北洋銀行	119,300.0	394.00	47,004,200	
大光銀行	1,500.0	1,400.00	2,100,000	貸付株式数 300 株
愛媛銀行	10,600.0	1,032.00	10,939,200	
トマト銀行	1,700.0	1,302.00	2,213,400	
京葉銀行	36,100.0	716.00	25,847,600	
栃木銀行	36,000.0	345.00	12,420,000	
北日本銀行	2,700.0	2,452.00	6,620,400	貸付株式数 300 株
東和銀行	14,400.0	657.00	9,460,800	
福島銀行	5,400.0	258.00	1,393,200	
大東銀行	2,000.0	756.00	1,512,000	貸付株式数 500 株
リコーリース	7,400.0	4,685.00	34,669,000	貸付株式数 400 株
イオンフィナンシャルサー ビス	45,200.0	1,338.00	60,477,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アコム	140,100.0	370.60	51,921,060	
ジャックス	8,400.0	5,370.00	45,108,000	
オリコ	20,300.0	1,201.00	24,380,300	
オリックス	516,800.0	2,985.00	1,542,648,000	
三菱HCキャピタル	306,600.0	1,075.00	329,595,000	
ジャフコグループ	26,200.0	1,785.50	46,780,100	貸付株式数 10,400 株
九州リースサービス	2,400.0	922.00	2,212,800	貸付株式数 1,200 株
トモニホールディングス	63,900.0	478.00	30,544,200	
大和証券G本社	548,400.0	913.50	500,963,400	
野村ホールディングス	1,418,800.0	652.30	925,483,240	
岡三証券グループ	69,100.0	697.00	48,162,700	貸付株式数 20,900 株
丸三証券	26,100.0	650.00	16,965,000	
東洋証券	26,000.0	372.00	9,672,000	
東海東京HD	85,700.0	502.00	43,021,400	
光世証券	1,200.0	671.00	805,200	貸付株式数 200 株
水戸証券	21,000.0	483.00	10,143,000	
いちよし証券	14,400.0	779.00	11,217,600	
松井証券	46,600.0	860.00	40,076,000	
SOMP Oホールディングス	135,100.0	6,886.00	930,298,600	
日本取引所グループ	221,200.0	2,651.50	586,511,800	
マネックスG	84,800.0	584.00	49,523,200	
極東証券	9,700.0	910.00	8,827,000	
岩井コスモホールディング	9,000.0	1,865.00	16,785,000	
アイザワ証券グループ	11,300.0	1,040.00	11,752,000	
フィデアホール	8,100.0	1,708.00	13,834,800	
池田泉州HD	100,700.0	329.00	33,130,300	
アニコムホールディングス	26,800.0	650.00	17,420,000	
MS&AD	160,300.0	5,803.00	930,220,900	
マネーパートナーズGP	5,300.0	300.00	1,590,000	
スパークス・グループ	8,800.0	1,554.00	13,675,200	
小林洋行	2,200.0	239.00	525,800	貸付株式数 100 株
第一生命HLDGS	384,700.0	3,180.00	1,223,346,000	
東京海上HD	778,200.0	3,585.00	2,789,847,000	
アドバンテッジリスクマネ	2,500.0	480.00	1,200,000	
イー・ギャランティ	12,700.0	1,948.00	24,739,600	
アサックス	2,300.0	685.00	1,575,500	貸付株式数 1,300 株
NECキャピタルソリューション	3,800.0	3,490.00	13,262,000	
T&Dホールディングス	211,300.0	2,594.50	548,217,850	
アドバンスクリエイト	4,600.0	1,155.00	5,313,000	貸付株式数 1,800 株
三井不動産	336,000.0	3,450.00	1,159,200,000	
三菱地所	475,100.0	2,079.50	987,970,450	
平和不動産	12,800.0	4,255.00	54,464,000	
東京建物	68,800.0	2,180.50	150,018,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
京阪神ビルディング	13,200.0	1,408.00	18,585,600	
住友不動産	142,300.0	4,085.00	581,295,500	
太平洋興発	2,000.0	820.00	1,640,000	貸付株式数 800株
テーオーシー	14,200.0	655.00	9,301,000	
東京楽天地	1,300.0	4,210.00	5,473,000	貸付株式数 500株
スターツコーポレーション	11,300.0	3,085.00	34,860,500	
フジ住宅	11,100.0	769.00	8,535,900	
空港施設	9,400.0	595.00	5,593,000	
明和地所	2,500.0	1,208.00	3,020,000	
ゴールドクレスト	7,500.0	2,208.00	16,560,000	貸付株式数 800株
リログループ	45,700.0	1,649.50	75,382,150	
エスリード	3,700.0	3,255.00	12,043,500	貸付株式数 1,200株
日神グループHLDGS	12,300.0	558.00	6,863,400	貸付株式数 4,400株
日本エスコン	14,800.0	953.00	14,104,400	
MIRARTHホールディング	39,900.0	500.00	19,950,000	
AVANTIA	3,000.0	888.00	2,664,000	貸付株式数 600株
イオンモール	40,800.0	1,836.00	74,908,800	
毎日コムネット	1,900.0	774.00	1,470,600	貸付株式数 900株
ファースト住建	2,200.0	1,231.00	2,708,200	貸付株式数 900株
ランド	473,600.0	9.00	4,262,400	貸付株式数 119,600株
カチタス	21,200.0	2,237.00	47,424,400	貸付株式数 5,000株
東祥	5,700.0	1,206.00	6,874,200	貸付株式数 2,000株
トーセイ	13,100.0	2,031.00	26,606,100	
穴吹興産	1,000.0	2,052.00	2,052,000	貸付株式数 600株
サンフロンティア不動産	13,200.0	1,554.00	20,512,800	
インテリックス	1,300.0	539.00	700,700	
ランドビジネス	1,900.0	340.00	646,000	貸付株式数 700株
サンネクスタグループ	1,500.0	977.00	1,465,500	貸付株式数 200株
グランディハウス	4,500.0	655.00	2,947,500	
東武鉄道	87,800.0	4,106.00	360,506,800	
相鉄ホールディングス	26,400.0	2,971.00	78,434,400	
東急	224,200.0	1,840.00	412,528,000	貸付株式数 1,100株
京浜急行	90,600.0	1,358.00	123,034,800	
小田急電鉄	121,200.0	2,337.00	283,244,400	
京王電鉄	42,300.0	5,343.00	226,008,900	
京成電鉄	51,500.0	5,722.00	294,683,000	
富士急行	9,800.0	5,210.00	51,058,000	貸付株式数 3,900株
東日本旅客鉄道	135,600.0	8,826.00	1,196,805,600	
西日本旅客鉄道	102,100.0	6,570.00	670,797,000	
東海旅客鉄道	61,600.0	19,425.00	1,196,580,000	
西武ホールディングス	96,600.0	1,532.50	148,039,500	
鴻池運輸	13,600.0	2,013.00	27,376,800	
西日本鉄道	21,400.0	2,598.50	55,607,900	
ハマキョウレックス	6,200.0	4,195.00	26,009,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
サカイ引越センター	3,800.0	5,190.00	19,722,000	
近鉄グループHLDGS	79,800.0	4,441.00	354,391,800	
阪急阪神HLDGS	106,400.0	5,334.00	567,537,600	
南海電鉄	38,100.0	2,980.50	113,557,050	
京阪ホールディングス	44,000.0	4,151.00	182,644,000	
神戸電鉄	2,100.0	3,080.00	6,468,000	貸付株式数 800株
名古屋鉄道	88,200.0	2,372.00	209,210,400	
山陽電鉄	6,000.0	2,230.00	13,380,000	貸付株式数 2,300株
アルプス物流	6,300.0	1,618.00	10,193,400	貸付株式数 2,200株
トランコム	2,300.0	7,580.00	17,434,000	
ヤマトホールディングス	102,200.0	2,544.50	260,047,900	
山九	20,300.0	5,382.00	109,254,600	
日新	6,100.0	2,874.00	17,531,400	
丸運	2,500.0	268.00	670,000	貸付株式数 1,300株
丸全昭和運輸	4,900.0	4,075.00	19,967,500	
センコーグループHLDGS	42,200.0	1,108.00	46,757,600	
トナミホールディングス	1,800.0	4,965.00	8,937,000	
ニッコンホールディングス	25,500.0	3,374.00	86,037,000	
日石輸送	500.0	2,808.00	1,404,000	
福山通運	6,100.0	3,830.00	23,363,000	
セイノーホールディングス	44,900.0	2,151.50	96,602,350	貸付株式数 500株
エスライングループ本社	1,500.0	886.00	1,329,000	貸付株式数 700株
神奈川中央交通	2,200.0	3,325.00	7,315,000	貸付株式数 800株
AZ-COM丸和ホールディング	19,300.0	2,144.00	41,379,200	
C&Fロジホールディングス	7,700.0	1,449.00	11,157,300	貸付株式数 800株
日本郵船	213,500.0	4,382.00	935,557,000	
商船三井	140,700.0	4,515.00	635,260,500	
川崎汽船	60,000.0	5,560.00	333,600,000	貸付株式数 23,900株
NSユニテッド海運	4,300.0	4,380.00	18,834,000	貸付株式数 1,700株
明治海運	5,100.0	882.00	4,498,200	貸付株式数 1,000株
飯野海運	29,300.0	1,133.00	33,196,900	貸付株式数 3,700株
共栄タンカー	900.0	877.00	789,300	貸付株式数 300株
九州旅客鉄道	56,400.0	3,258.00	183,751,200	
SGホールディングス	153,100.0	2,045.00	313,089,500	
NIPPON EXPRESS	27,100.0	7,770.00	210,567,000	
ID&Eホールディングス	4,900.0	3,570.00	17,493,000	
日本航空	196,000.0	3,011.00	590,156,000	
ANAホールディングス	217,100.0	3,266.00	709,048,600	
ビーウィズ	2,100.0	2,281.00	4,790,100	貸付株式数 800株
パスコ	1,200.0	1,728.00	2,073,600	
TREホールディングス	17,400.0	1,266.00	22,028,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
人・夢・技術グループ	3,000.0	1,755.00	5,265,000	貸付株式数 1,200株
西本WISMETTACHD	2,200.0	5,140.00	11,308,000	貸付株式数 800株
シルバーライフ	1,600.0	1,192.00	1,907,200	貸付株式数 700株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	400.0	2,021.00	808,400	
GENKY DRUGSTORES	3,700.0	5,410.00	20,017,000	貸付株式数 1,300株
コア商事HLDGS	4,600.0	722.00	3,321,200	貸付株式数 1,800株
KPPグループホールディングン	19,700.0	725.00	14,282,500	
ナルミヤ・インターナショナル	900.0	1,188.00	1,069,200	貸付株式数 600株
ブックオフGHD	3,800.0	1,250.00	4,750,000	貸付株式数 1,700株
ギフトホールディングス	3,600.0	2,393.00	8,614,800	
三菱倉庫	17,200.0	4,126.00	70,967,200	
三井倉庫HOLD	7,400.0	4,400.00	32,560,000	
住友倉庫	21,500.0	2,567.00	55,190,500	貸付株式数 8,600株
渋沢倉庫	3,200.0	3,410.00	10,912,000	
ヤマタネ	3,700.0	2,081.00	7,699,700	
東陽倉庫	6,900.0	296.00	2,042,400	
乾汽船	10,100.0	1,288.00	13,008,800	貸付株式数 4,000株
日本トランスシティ	16,000.0	699.00	11,184,000	
ケイヒン	900.0	1,998.00	1,798,200	
中央倉庫	3,800.0	1,101.00	4,183,800	貸付株式数 1,400株
川西倉庫	900.0	1,121.00	1,008,900	貸付株式数 200株
安田倉庫	5,400.0	1,091.00	5,891,400	
ファイズホールディングス	1,000.0	1,153.00	1,153,000	貸付株式数 400株
大栄環境	21,000.0	2,237.00	46,977,000	
日本管財ホールディングク	8,600.0	2,642.00	22,721,200	貸付株式数 3,300株
東洋埠頭	1,500.0	1,475.00	2,212,500	
上組	38,300.0	3,244.00	124,245,200	
サンリツ	1,200.0	746.00	895,200	貸付株式数 300株
キムラユニティー	2,600.0	1,399.00	3,637,400	貸付株式数 1,000株
キューソー流通システム	2,700.0	965.00	2,605,500	貸付株式数 1,200株
東海運	3,000.0	290.00	870,000	貸付株式数 1,400株
エーアイテイー	5,000.0	1,786.00	8,930,000	
内外トランスライン	3,200.0	2,585.00	8,272,000	貸付株式数 900株
ショーエイコーポ	1,900.0	617.00	1,172,300	貸付株式数 600株
日本コンセプト	2,900.0	1,904.00	5,521,600	
TBSホールディングス	41,100.0	2,645.00	108,709,500	
日本テレビHLD S	71,000.0	1,413.50	100,358,500	
朝日放送グループHD	7,300.0	702.00	5,124,600	貸付株式数 2,900株
テレビ朝日HD	19,500.0	1,736.00	33,852,000	
スカパーJSATHD	71,000.0	744.00	52,824,000	
テレビ東京HD	5,800.0	3,075.00	17,835,000	貸付株式数 2,200株



銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本BS放送	1,900.0	910.00	1,729,000	貸付株式数 800株
ビジョン	12,000.0	1,550.00	18,600,000	
スマートバリュー	1,300.0	420.00	546,000	貸付株式数 600株
USEN-NEXT HL DGS	9,000.0	3,330.00	29,970,000	貸付株式数 3,300株
ワイヤレスゲート	2,300.0	217.00	499,100	貸付株式数 100株
日本通信	73,900.0	220.00	16,258,000	
クロップス	900.0	1,110.00	999,000	
日本電信電話	25,680,600.0	181.00	4,648,188,600	
KDDI	619,500.0	4,730.00	2,930,235,000	
ソフトバンク	1,288,500.0	1,760.00	2,267,760,000	
光通信	9,400.0	23,900.00	224,660,000	
エムティーアイ	5,400.0	614.00	3,315,600	貸付株式数 2,000株
GMOインターネットグループ	29,600.0	2,451.00	72,549,600	
ファイバーゲート	4,300.0	1,438.00	6,183,400	貸付株式数 200株
アイトママーケティング コミュ	2,100.0	257.00	539,700	貸付株式数 600株
KADOKAWA	42,400.0	3,185.00	135,044,000	
学研ホールディングス	13,300.0	882.00	11,730,600	貸付株式数 2,600株
ゼンリン	13,600.0	922.00	12,539,200	
昭文社ホールディングス	2,200.0	321.00	706,200	
インプレスホールディング ス	4,600.0	186.00	855,600	貸付株式数 1,800株
東京電力HD	720,600.0	698.90	503,627,340	貸付株式数 255,600株
中部電力	294,600.0	2,097.50	617,923,500	
関西電力	308,700.0	2,344.00	723,592,800	
中国電力	127,300.0	1,039.00	132,264,700	
北陸電力	75,500.0	923.20	69,701,600	
東北電力	195,400.0	1,110.50	216,991,700	
四国電力	68,200.0	1,112.50	75,872,500	
九州電力	184,300.0	1,073.00	197,753,900	
北海道電力	77,200.0	722.50	55,777,000	
沖縄電力	18,700.0	1,246.00	23,300,200	貸付株式数 3,100株
電源開発	60,200.0	2,584.00	155,556,800	
エフオン	5,300.0	510.00	2,703,000	
イーレックス	14,200.0	847.00	12,027,400	貸付株式数 5,600株
レノバ	21,300.0	1,254.00	26,710,200	貸付株式数 8,500株
東京瓦斯	169,000.0	3,562.00	601,978,000	
大阪瓦斯	161,900.0	2,565.00	415,273,500	
東邦瓦斯	31,500.0	2,787.50	87,806,250	
北海道瓦斯	4,800.0	2,446.00	11,740,800	貸付株式数 1,000株
広島ガス	16,800.0	413.00	6,938,400	
西部ガスHLDGS	7,500.0	2,113.00	15,847,500	
静岡ガス	15,900.0	1,073.00	17,060,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
メタウォーター	9,400.0	1,926.00	18,104,400	
アイネット	4,800.0	1,761.00	8,452,800	貸付株式数 1,600株
松竹	4,600.0	10,995.00	50,577,000	
東宝	50,100.0	5,443.00	272,694,300	
エイチ・アイ・エス	23,800.0	1,776.00	42,268,800	貸付株式数 9,500株
東映	2,200.0	20,020.00	44,044,000	
ラックランド	3,800.0	3,030.00	11,514,000	貸付株式数 1,400株
NTTデータグループ	251,500.0	2,157.00	542,485,500	
共立メンテナンス	14,100.0	6,338.00	89,365,800	貸付株式数 5,600株
イチネンホールディングス	8,900.0	1,405.00	12,504,500	
建設技術研究所	4,300.0	4,670.00	20,081,000	
スペース	5,200.0	937.00	4,872,400	
アインホールディングス	11,600.0	4,601.00	53,371,600	
燦ホールディングス	3,400.0	2,141.00	7,279,400	
ピー・シー・エー	4,600.0	1,266.00	5,823,600	
スバル興業	300.0	11,920.00	3,576,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	2,000.0	1,142.00	2,284,000	貸付株式数 1,000株
タナベコンサルティンググループ	2,200.0	1,173.00	2,580,600	
ビジネスB太田昭和	3,400.0	2,149.00	7,306,600	
ナガワ	2,200.0	7,160.00	15,752,000	貸付株式数 800株
東京都競馬	6,900.0	3,970.00	27,393,000	貸付株式数 1,700株
常磐興産	1,800.0	1,363.00	2,453,400	貸付株式数 1,000株
カナモト	12,800.0	2,638.00	33,766,400	
DTS	17,100.0	3,355.00	57,370,500	
スクウェア・エニックス・HD	40,300.0	5,301.00	213,630,300	
シーイーシー	11,200.0	1,683.00	18,849,600	
カプコン	79,700.0	5,637.00	449,268,900	
ニシオホールディングス	7,600.0	3,605.00	27,398,000	貸付株式数 1,000株
アイ・エス・ビー	4,100.0	1,445.00	5,924,500	貸付株式数 1,200株
アゴーラホスピタリティーG	34,500.0	26.00	897,000	貸付株式数 15,600株
日本空港ビルデング	27,800.0	6,585.00	183,063,000	
トランス・コスモス	10,200.0	3,200.00	32,640,000	貸付株式数 3,200株
乃村工藝社	36,100.0	894.00	32,273,400	
ジャステック	4,900.0	1,485.00	7,276,500	貸付株式数 1,900株 (500株)
SCSK	65,400.0	2,659.50	173,931,300	
藤田観光	3,300.0	5,130.00	16,929,000	貸付株式数 1,100株
KNT-CTホールディングス	4,900.0	1,364.00	6,683,600	貸付株式数 1,900株
トーカイ	7,400.0	1,955.00	14,467,000	
白洋舎	800.0	2,584.00	2,067,200	貸付株式数 100株
セコム	83,700.0	10,385.00	869,224,500	
NSW	3,100.0	2,888.00	8,952,800	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
セントラル警備保障	4,500.0	3,205.00	14,422,500	貸付株式数 200株
アイネス	5,600.0	1,663.00	9,312,800	
丹青社	15,700.0	938.00	14,726,600	
メイテック	32,200.0	2,586.50	83,285,300	
TKC	12,800.0	3,665.00	46,912,000	
富士ソフト	16,100.0	4,800.00	77,280,000	貸付株式数 800株
応用地質	7,700.0	2,563.00	19,735,100	
船井総研ホールディング	17,200.0	2,744.00	47,196,800	
NSD	28,600.0	2,583.00	73,873,800	
進学会ホールディングス	1,800.0	293.00	527,400	貸付株式数 900株
丸紅建材リース	600.0	2,821.00	1,692,600	
オオバ	3,600.0	943.00	3,394,800	貸付株式数 1,300株
コナミグループ	34,300.0	8,362.00	286,816,600	
いであ	1,600.0	1,700.00	2,720,000	貸付株式数 200株
学究社	3,200.0	2,065.00	6,608,000	
ベネッセホールディングス	30,600.0	1,884.50	57,665,700	
イオンディライト	9,200.0	3,295.00	30,314,000	貸付株式数 3,200株
ナック	3,900.0	984.00	3,837,600	貸付株式数 1,200株
福井コンピュータHLDS	5,600.0	2,715.00	15,204,000	
ダイセキ	16,800.0	4,270.00	71,736,000	
ステップ	2,900.0	1,777.00	5,153,300	貸付株式数 1,100株
泉州電業	4,200.0	3,300.00	13,860,000	貸付株式数 1,600株
元気寿司	2,400.0	5,150.00	12,360,000	貸付株式数 900株
トラスコ中山	17,800.0	2,546.00	45,318,800	
ヤマダホールディングス	347,500.0	467.80	162,560,500	
オートバックスセブン	29,700.0	1,593.50	47,326,950	
モリト	6,000.0	1,375.00	8,250,000	
アークランズ	25,400.0	1,617.00	41,071,800	
ニトリホールディングス	34,200.0	17,280.00	590,976,000	
グルメ杵屋	7,000.0	1,134.00	7,938,000	貸付株式数 2,700株
愛眼	4,800.0	184.00	883,200	貸付株式数 1,800株
ケーユーホールディングス	4,900.0	1,271.00	6,227,900	
吉野家ホールディングス	33,200.0	2,893.00	96,047,600	貸付株式数 13,200株
加藤産業	10,500.0	4,265.00	44,782,500	
北恵	1,400.0	908.00	1,271,200	
イノテック	5,300.0	1,650.00	8,745,000	
イエローハット	15,100.0	1,933.00	29,188,300	
松屋フーズHLDGS	4,100.0	4,260.00	17,466,000	貸付株式数 600株
JBCホールディングス	5,800.0	2,773.00	16,083,400	
JKホールディングス	6,300.0	1,011.00	6,369,300	
サガミホールディングス	13,700.0	1,350.00	18,495,000	貸付株式数 5,200株
日伝	5,000.0	2,628.00	13,140,000	貸付株式数 1,800株
関西フードマーケット	7,600.0	1,520.00	11,552,000	
ミロク情報サービス	7,300.0	1,612.00	11,767,600	貸付株式数 2,700株
北沢産業	2,900.0	313.00	907,700	貸付株式数 1,400株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
杉本商事	3,700.0	2,290.00	8,473,000	貸付株式数 400 株
因幡電機産業	22,000.0	3,335.00	73,370,000	
王将フードサービス	5,600.0	6,990.00	39,144,000	貸付株式数 1,800 株
ミニストップ	6,100.0	1,452.00	8,857,200	貸付株式数 2,400 株
アークス	15,500.0	2,732.00	42,346,000	
バローホールディングス	16,100.0	2,201.00	35,436,100	
東 テ ク	2,800.0	5,430.00	15,204,000	
ミスミグループ本社	127,700.0	2,456.00	313,631,200	
アルテック	2,900.0	262.00	759,800	
ベ ル ク	4,200.0	6,890.00	28,938,000	
大 庄	3,100.0	1,152.00	3,571,200	貸付株式数 1,400 株
タキヒヨー	1,400.0	1,244.00	1,741,600	貸付株式数 700 株
ファーストリテイリング	38,100.0	34,740.00	1,323,594,000	貸付株式数 15,200 株
ソフトバンクグループ	395,500.0	6,497.00	2,569,563,500	
蔵王産業	900.0	2,621.00	2,358,900	
スズケン	24,800.0	4,498.00	111,550,400	
サンドラッグ	32,100.0	4,252.00	136,489,200	
サックスバーホールディング	8,100.0	943.00	7,638,300	
ジェコス	4,900.0	980.00	4,802,000	
ヤマザワ	1,000.0	1,287.00	1,287,000	
や ま や	1,300.0	3,100.00	4,030,000	貸付株式数 600 株
グローセル	6,800.0	438.00	2,978,400	
ベルーナ	20,600.0	750.00	15,450,000	
合計			275,855,624,477	

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

ソニーグループ	20,000 株
キーエンス	5,000 株
本田技研	30,000 株
三菱UFJフィナンシャルG	200,000 株
三井住友フィナンシャルG	30,000 株

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

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年9月20日から2024年3月19日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 独立監査人の中間監査報告書

2024年5月17日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 秋山 範之

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明

### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている i F r e e T O P I X インデックスの2023年9月20日から2024年3月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、i F r e e T O P I X インデックスの2024年3月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年9月20日から2024年3月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚

偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

i F r e e T O P I Xインデックス

(1) 【中間貸借対照表】

		当中間計算期間末 2024年3月19日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		62,133,496
親投資信託受益証券		15,023,567,850
未収入金		11,300,000
流動資産合計		15,097,001,346
資産合計		15,097,001,346
負債の部		
流動負債		
未払解約金		62,286,464
未払受託者報酬		1,259,570
未払委託者報酬		8,537,315
その他未払費用		349,796
流動負債合計		72,433,145
負債合計		72,433,145
純資産の部		
元本等		
元本	※1	6,266,094,868
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)		8,758,473,333
(分配準備積立金)		2,178,502,966
元本等合計		15,024,568,201
純資産合計		15,024,568,201
負債純資産合計		15,097,001,346



## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	当中間計算期間 自 2023 年 9 月 20 日 至 2024 年 3 月 19 日 金 額 (円)
営業収益	
有価証券売買等損益	1,885,088,860
営業収益合計	1,885,088,860
営業費用	
支払利息	1,834
受託者報酬	1,259,570
委託者報酬	8,537,315
その他費用	349,796
営業費用合計	10,148,515
営業利益又は営業損失 (△)	1,874,940,345
経常利益又は経常損失 (△)	1,874,940,345
中間純利益又は中間純損失 (△)	1,874,940,345
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	60,958,936
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	6,302,827,028
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,873,145,792
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,873,145,792
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,231,480,896
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,231,480,896
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	8,758,473,333

### (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自 2023 年 9 月 20 日 至 2024 年 3 月 19 日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2024 年 3 月 19 日現在
1. ※1 期首元本額	5,747,395,961 円
期中追加設定元本額	1,645,761,597 円
期中一部解約元本額	1,127,062,690 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	6,266,094,868 口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自 2023 年 9 月 20 日 至 2024 年 3 月 19 日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2024 年 3 月 19 日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2024 年 3 月 19 日現在
該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	当中間計算期間末 2024年3月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,3978円 (23,978円)

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年3月19日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,631,324,234
株式 ※2※3	334,169,891,650
派生商品評価勘定	42,231,400
未収入金	1,987,300
未収配当金	468,743,151
未収利息	448,699
その他未収収益 ※4	10,481,964
流動資産合計	347,325,108,398
資産合計	347,325,108,398
負債の部	
流動負債	
前受金	22,110,000
未払解約金	767,957,970
受入担保金	7,944,669,514
流動負債合計	8,734,737,484
負債合計	8,734,737,484
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	171,239,610,857
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	167,350,760,057
元本等合計	338,590,370,914
純資産合計	338,590,370,914
負債純資産合計	347,325,108,398

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 9 月 20 日 至 2024 年 3 月 19 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引  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	2024 年 3 月 19 日現在
1. ※1 期首	2023 年 9 月 20 日
期首元本額	162,050,849,324 円
期中追加設定元本額	17,864,946,744 円
期中一部解約元本額	8,676,185,211 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックスファンド	2,789,498,424 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	4,221,661,290 円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	909,416 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	11,494,528 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	151,871,960 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	12,849,175 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	363,379,215 円
国内株式ファンド(適格機関投資家専用)	846,585,590 円

区分	2024年3月19日現在
日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	693,478,163円
D-I's TOPIXインデックス	13,665,865円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	237,425,994円
iFree TOPIXインデックス	7,598,021,469円
iFree 8資産バランス	4,600,674,438円
iFree 年金バランス	1,026,306,017円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	2,283,463円
DCダイワ日本株式インデックス	71,302,766,180円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,053,490,173円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,955,559,058円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,831,056,196円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,503,612,571円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	46,798,488円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	72,693,139円
ダイワつみたてインデックス日本株式	5,291,356,118円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,570,720円
ダイワつみたてインデックスバランス50	12,193,693円
ダイワつみたてインデックスバランス70	30,559,223円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	14,478,388,323円
ダイワ世界バランスファンド40VA	49,260,698円
ダイワ世界バランスファンド60VA	19,683,241円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,409,714,161円
ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	335,464,120円
ダイワ国内バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	50,467,802円
ダイワ国内バランスファンド30VA (適格機関投資家専用)	61,341,451円
ダイワ・ノーロード TOPIXファンド	226,255,001円
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	12,072,910,018円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	6,625,041,182円
ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	3,198,211,191円
スタイル9 (4資産分散・保守型)	164,673円
スタイル9 (4資産分散・バランス型)	1,157,651円
スタイル9 (4資産分散・積極型)	1,552,611円
スタイル9 (6資産分散・保守型)	114,883円
スタイル9 (6資産分散・バランス型)	2,086,980円
スタイル9 (6資産分散・積極型)	2,475,932円
スタイル9 (8資産分散・保守型)	143,736円
スタイル9 (8資産分散・バランス型)	1,636,814円
スタイル9 (8資産分散・積極型)	4,867,972円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,084,838,592円
ダイワライフスタイル25	97,864,887円
ダイワライフスタイル50	458,557,070円
ダイワライフスタイル75	388,997,677円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス (確定拠出年金専用ファンド)	7,985,653,625円

区分	2024年3月19日現在
計	171,239,610,857 円
2. 期末日における受益権の総数	171,239,610,857 口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,761,759,220 円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 750,010,000 円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年3月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2024年3月19日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
株価指数 先物取引				
買建	4,087,525,000	-	4,129,840,000	42,315,000
合計	4,087,525,000	-	4,129,840,000	42,315,000

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

(1口当たり情報)

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



## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

2024年3月29日

I 資産総額	15,347,733,929 円
II 負債総額	25,914,543 円
III 純資産総額 (I - II)	15,321,819,386 円
IV 発行済数量	6,291,396,103 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	2.4354 円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

### 純資産額計算書

2024年3月29日

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

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

- (1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。
- (2) 受益者に対する特典  
ありません。
- (3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。
- (4) 受益証券の再発行  
受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- (5) 受益権の譲渡
  - ① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
  - ② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
  - ③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
- (6) 受益権の譲渡の対抗要件  
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
- (7) 受益権の再分割  
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。  
受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。
- (8) 償還金  
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）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

2024年3月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 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。

2024年3月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	87	291,304
追加型株式投資信託	798	29,461,519
株式投資信託 合計	885	29,752,823
単位型公社債投資信託	98	178,379
追加型公社債投資信託	14	1,544,340
公社債投資信託 合計	112	1,722,719
総合計	997	31,475,542

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

## 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 利息の受取 (注)	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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  本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)	13,072	未払手数料	2,663
							不動産の賃借料(注3)	1,062	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱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 通常の見取の条件と異なる条件であつ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つて、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

(i F r e e T O P I X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18条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

この投資信託は、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 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

② マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

③ 安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。

イ. 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

ロ. 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的

④ 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。

⑤ 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

#### (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 株式への投資制限

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

③ 新株引受権証券等への投資制限

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

④ 投資信託証券への投資制限

投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑥ 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。

⑦ スワップ取引の範囲

スワップ取引は、約款第23条の範囲で行ないません。

⑧ 金利先渡取引の範囲

金利先渡取引は、約款第24条の範囲で行ないません。

### 3. 収益分配方針

① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

② 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を

勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

- 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  
( i F r e e T O P I X 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、信託法(平成18年法律第108号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。
- ③ 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、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第2条第1項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。以下本条、第17条第1項、同条第2項および第28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、2,500億円を限度として信託金を追加することができます。

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ、前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46条第1項、第47条第1項、第48条第1項および第50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、受託者と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)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。
- ③ 前項の規定により受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託者が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託者が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(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、社振法の規定の適用を受け、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、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

（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、最低単位を1円単位または1口単位として委託者が定める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（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（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の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として指定販売会社が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める積立投資約款に従い積立投資契約を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応じることができるものとします。

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権の価額は、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36条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、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をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）等における取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託者が追加設定を制限する措置をとった場合には、指定販売会社は、取得申込の受付を中止することができるほか、すでに受け付けた取得申込を取消することができるものとします。

（受益権の譲渡にかかる記載または記録）

第13条 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14条 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。

(投資の対象とする資産の種類)

第15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22条、第23条および第24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16条 委託者は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたトピックス・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. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証券ならびに第12号および第17号の証券または証券のうち第1号の証券または証券の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第14号の証券のうち投資法人債券ならびに第12号および第17号の証券または証券のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

- 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
  6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。
- ④ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑤ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑥ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑦ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（利害関係人等との取引等）

- 第17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、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行なうものを含みます。）および受託者の利害関係人、第28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15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条まで、第26条、第31条から第33条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことができます。
- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行なうことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行なうことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行なう場合も同様とします。
  - ③ 委託者は、金融商品取引法、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、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取



引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。) または委託者が運用の指図を行なう他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条まで、第26条、第31条から第33条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行なうことができます。

- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行ないません。

(運用の基本方針)

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

(投資する株式等の範囲)

第19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- ② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとし、

(同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限)

第20条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(信用取引の指図範囲)

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができます。

- ② 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

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

(先物取引等の運用指図)

第22条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

- ② 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図および範囲)

第23条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本項において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④ 前項においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤ スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ⑥ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(金利先渡取引の運用指図および範囲)

第24条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③ 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本項において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかる保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本項において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④ 前項においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤ 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ⑥ 委託者は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第25条 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。

(有価証券の貸付けの指図および範囲)

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
  3. 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(信用リスク集中回避のための投資制限)

第27条 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(信託業務の委託等)

第28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

(混蔵寄託)

第29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譲渡性預金証書またはコマーシャル・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30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、すみ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31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32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、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金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33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34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。

(受託者による資金の立替え)

第35条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、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。

③ 前2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36条 この信託の計算期間は、毎年9月20日から翌年9月19日までとします。ただし、第1計算期間は、2016年9月8日から2017年9月19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等)

第37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。

③ 受託者は、前2項の報告を行なうことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行なわないこととします。

④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第38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39条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第36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14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40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、償還金および一部解約金の支払い）

第41条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため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）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、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、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、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 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）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

④ 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。

⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、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、ただし、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、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、

⑥ 収益分配金、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、

（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42条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第3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4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。

(収益分配金および償還金の時効)

第43条 受益者が、収益分配金については第41条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については第41条第3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44条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、最低単位を1口単位として委託者または指定販売会社が定める単位（積立投資契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）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 受益者が第1項の一部解約請求をするときは、委託者または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
- 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45条 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46条 委託者は、信託期間中において、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、東証株価指数（配当込み）が改廃された場合、もしくは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、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、この信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続を行なうことが困難な場合も同じとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第47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51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48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51条の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託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49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50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違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。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51条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- 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。

(信託約款の変更等)

第51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またはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ② 委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、この信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- ④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(反対受益者の受益権買取請求の不適用)

第52条 この信託は、受益者が第44条の規定による一部解約請求を行なったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第46条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行なう場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

(他の受益者の氏名等の開示の請求の制限)

第53条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第54条 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55条 委託者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56条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

## (付 則)

第 1条 この約款において「積立投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「積立投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、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41条第6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 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

2016年 9月 8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