年金ダイワ日本株式インデックス

追加型投信／国内／株式／インデックス型

※課税上は株式投資信託として取扱われます。

投資信託説明書（請求目論見書）

2025年2月22日

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

本文書にかかる「年金ダイワ日本株式インデックス」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により、有価証券届出書を2025年2月21日に関東財務局長に提出しており、2025年2月22日にその届出の効力が生じております。

発行者名	大和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

◇TSM0372220250222◇

第一部【証券情報】

⑴【ファンドの名称】

年金ダイワ日本株式インデックス

⑵【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

⑶【発行（売出）価額の総額】

5,000 億円を上限とします。

⑷【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/

⑸【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

⑹【申込単位】

1 円以上 1 円単位とします。

⑺【申込期間】

2025 年 2 月 22 日から 2025 年 8 月 26 日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

⑻【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、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 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	インデックス型 特殊型

（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 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 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	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	日経225 TOPIX その他 （　　）

（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
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＲＦ
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成 12 年政令 480 号）第 12 条第 1 号および第 2 号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和 32 年法律第 26 号）第 9 条の 4 の 2 に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

（注 2）属性区分の定義

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

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

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

＜信託金の限度額＞

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

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

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

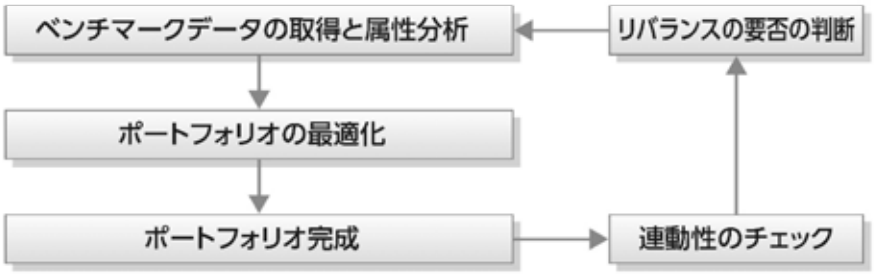
●東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数（配当込み）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。

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

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

(c) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

運用プロセス



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

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

■ 東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）について

TOPIXは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

① 配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。

② ＪＰＸは、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。

③ ＪＰＸは、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

④ ＪＰＸは、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

⑤ 本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。

⑥ ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。

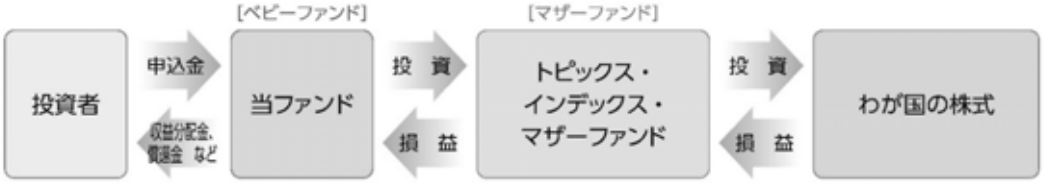
⑦ ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

⑧ 以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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。



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

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

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

3 毎年11月30日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。収益分配金は、自動的に再投資されます。

〈分配方針〉

①分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

②原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

●外貨建資産への投資は、行ないません。

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2)【ファンドの沿革】

2006年10月27日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金(※3)	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金(※3)	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など
↓運用指図　↑↓※2	損益↑↓信託金(※3)	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行	信託契約(※2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など
	損益↑↓投資	
投資対象	東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）	

（注）収益分配金は、自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

※3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託

が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

＜委託会社の概況（2024 年 12 月末日現在）＞

・資本金の額　414 億 2,454 万 1,896 円

・沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第 29 条の登録を受けたものとみなされる。 （金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第 352 号）
2020年 4月 1日	大和アセットマネジメント株式会社に商号変更
2024年10月 1日	株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携

・大株主の状況

名　称	住　所	所有株式数	比率
		株	%
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	2,608,525	80.00
		株	%
株式会社かんぽ生命保険	東京都千代田区大手町二丁目 3 番 1 号	652,132	20.00

２【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

トピックス・インデックス・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

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

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

色＞をご参照下さい。

(2)【投資対象】

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第 3 条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
   イ．有価証券
   ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、後掲(5)②に定めるものに限ります。）
   ハ．約束手形
   ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第 22 条第 1 項第 6 号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
   イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたトピックス・インデックス・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
3. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

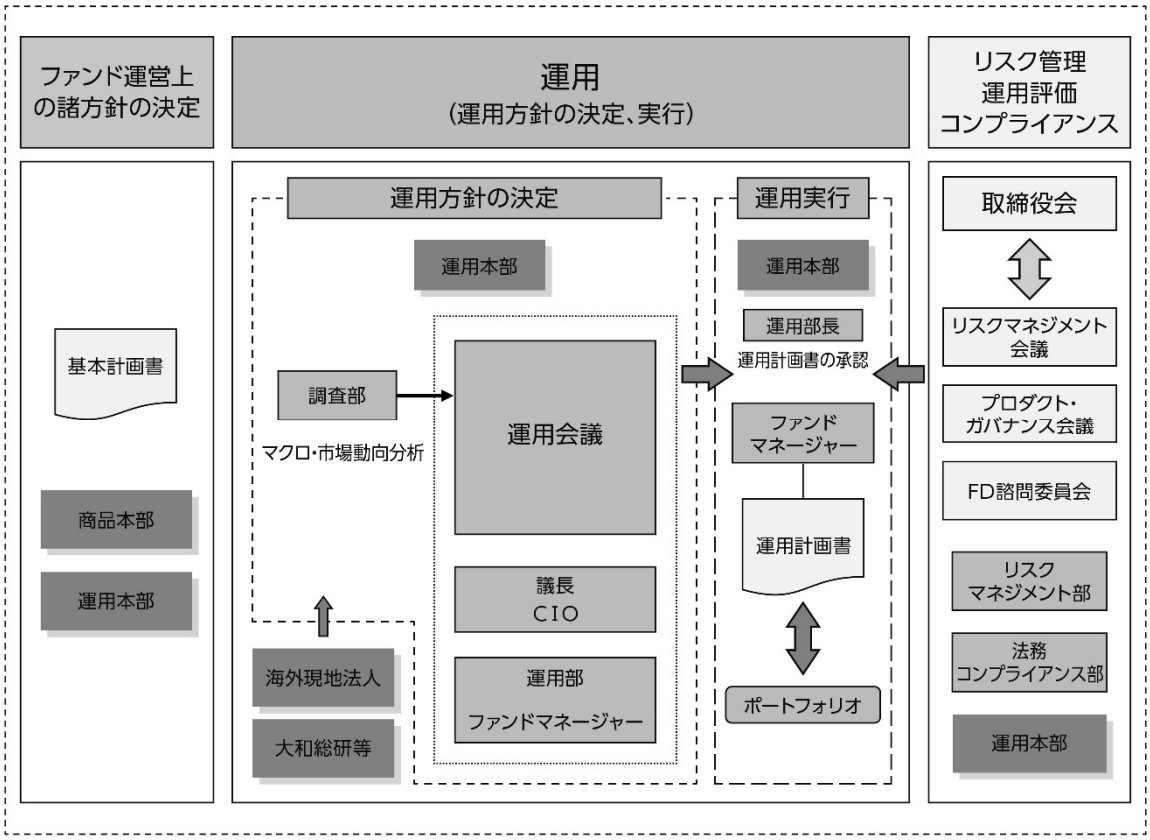
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの

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

(3)【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1 名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5 名程度）

CIO を補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5 名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に 1 名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は10～20名程度です。

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

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

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12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

②　原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

②　先物取引等（信託約款）

委託会社は、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

③　デリバティブ取引等（信託約款）

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

せん。

④　外貨建資産（信託約款）
外貨建資産への投資は、行ないません。

⑤　信用リスク集中回避（信託約款）
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

⑥　資金の借入れ（信託約款）
イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
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　主要投資対象
東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。
②　投資態度
投資成果を東証株価指数（配当込み）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。
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 株式への投資には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資は、行ないません。

３【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 株価指数先物取引の利用に伴うリスク

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

③ その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

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

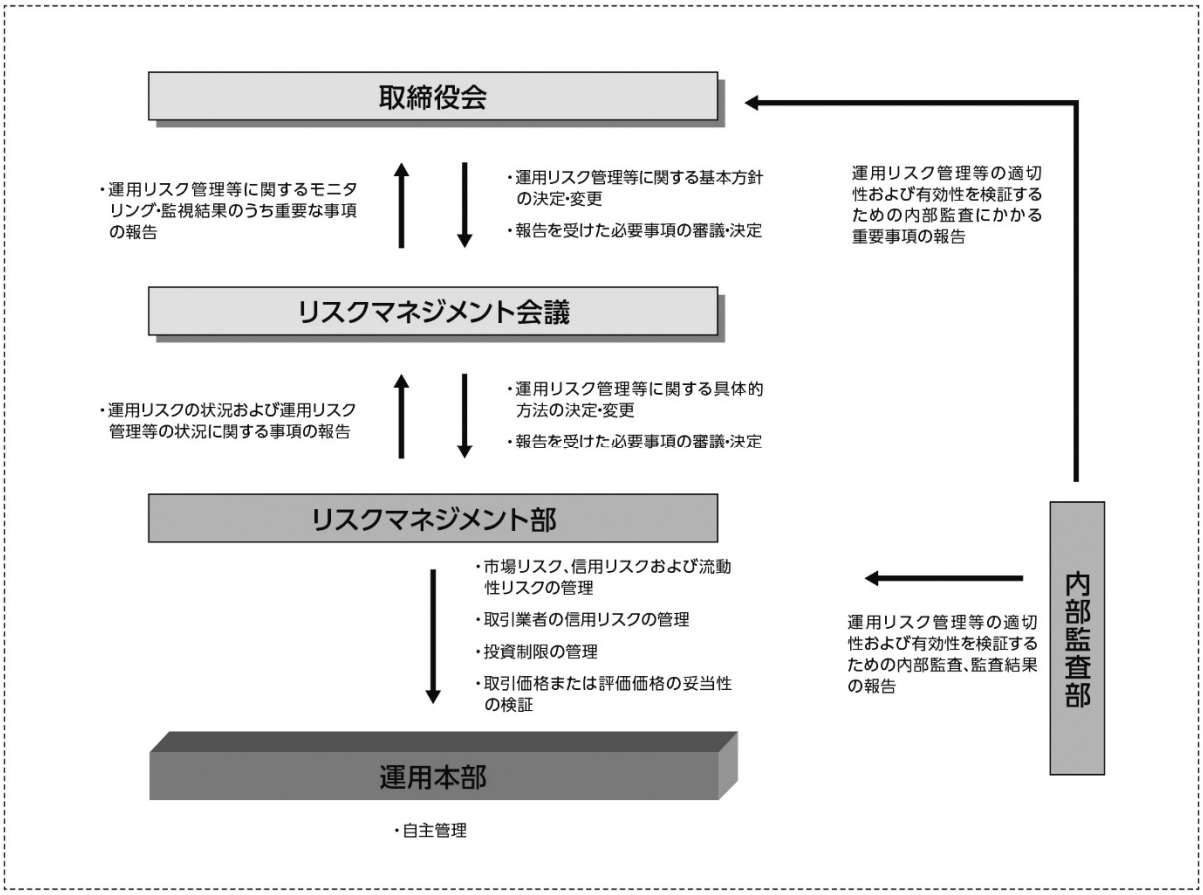
※　流動性リスクに関する事項

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

　これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付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・検証などを行ないます。

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

参　考　情　報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

※資産クラスについて
日 本 株：配当込みTOPIX
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
日本国債：NOMURA-BPI国債
先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス― エマージング・マーケッツ 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。ＪＰＸ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― エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

４【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 0.187%（税抜 0.17%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の６か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

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

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

④ 前③の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料に

かかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

（※）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」について

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

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

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

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

い。

＜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 12 月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（※）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

(1) 【投資状況】 (2024 年 12 月 30 日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		21,803,203,687	99.99
	内 日本	21,803,203,687	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,522,907	0.01
純資産総額		21,804,726,594	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 12 月 30 日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	10,645,575,747	1.9940 21,227,326,904	2.0481 21,803,203,687	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9計算期間末 (2015年11月30日)	3,284,114,505	3,284,114,505	1.1167	1.1167
第10計算期間末 (2016年11月30日)	3,429,044,358	3,429,044,358	1.0586	1.0586
第11計算期間末 (2017年11月30日)	4,489,487,993	4,489,487,993	1.3159	1.3159
第12計算期間末 (2018年11月30日)	4,891,529,530	4,891,529,530	1.2477	1.2477
第13計算期間末 (2019年12月2日)	5,415,434,147	5,415,434,147	1.3133	1.3133
第14計算期間末 (2020年11月30日)	6,072,922,364	6,072,922,364	1.3752	1.3752
第15計算期間末 (2021年11月30日)	7,907,146,515	7,907,146,515	1.5408	1.5408
第16計算期間末 (2022年11月30日)	9,355,818,012	9,355,818,012	1.6272	1.6272
第17計算期間末 (2023年11月30日)	12,546,636,126	12,546,636,126	1.9915	1.9915
2023年12月末日	12,586,595,962	－	1.9869	－
2024年1月末日	13,694,503,163	－	2.1418	－
2月末日	14,475,775,257	－	2.2467	－
3月末日	15,137,736,437	－	2.3459	－
4月末日	15,126,392,666	－	2.3247	－
5月末日	15,585,288,156	－	2.3508	－
6月末日	15,857,208,332	－	2.3846	－
7月末日	15,845,171,521	－	2.3713	－
8月末日	15,542,722,732	－	2.3028	－
9月末日	15,383,232,017	－	2.2666	－
10月末日	15,616,911,959	－	2.3089	－
11月末日	20,888,513,484	－	2.2967	－
第18計算期間末 (2024年12月2日)	21,145,363,355	21,145,363,355	2.3257	2.3257
12月末日	21,804,726,594	－	2.3888	－

② 【分配の推移】

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

	1口当たり分配金(円)
第 11 計算期間	0.0000
第 12 計算期間	0.0000
第 13 計算期間	0.0000
第 14 計算期間	0.0000
第 15 計算期間	0.0000
第 16 計算期間	0.0000
第 17 計算期間	0.0000
第 18 計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第 9 計算期間	13.1
第 10 計算期間	△5.2
第 11 計算期間	24.3
第 12 計算期間	△5.2
第 13 計算期間	5.3
第 14 計算期間	4.7
第 15 計算期間	12.0
第 16 計算期間	5.6
第 17 計算期間	22.4
第 18 計算期間	16.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第 9 計算期間	1,113,060,946	686,945,413
第 10 計算期間	592,567,249	294,482,357
第 11 計算期間	555,224,223	382,658,267
第 12 計算期間	864,718,416	355,993,412
第 13 計算期間	845,172,273	642,014,957
第 14 計算期間	901,570,410	609,088,808
第 15 計算期間	1,190,448,845	474,624,259
第 16 計算期間	1,194,983,326	577,135,775
第 17 計算期間	1,201,437,954	651,027,989
第 18 計算期間	3,639,143,321	847,167,251

（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 12 月 30 日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		409,408,926,410	98.05
	内　日本	409,408,926,410	98.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		8,135,524,843	1.95
純資産総額		417,544,451,253	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)		7,885,795,000	1.89
	内　日本	7,885,795,000	1.89

(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 12 月 30 日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	5,475,100	2,614.96 14,317,206,091	3,146.00 17,224,664,600	4.13
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3,606,800	2,660.14 9,594,618,914	3,369.00 12,151,309,200	2.91
3	三菱 UFJ フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	6,507,000	1,472.17 9,579,455,766	1,846.00 12,011,922,000	2.88
4	日　立	日本	株式	電気機器	2,678,700	3,698.65 9,907,589,002	3,937.00 10,546,041,900	2.53
5	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	826,100	9,284.68 7,670,075,400	11,145.00 9,206,884,500	2.21
6	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	2,116,100	3,021.75 6,394,328,172	3,764.00 7,965,000,400	1.91
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	103,000	67,273.86 6,929,208,002	64,630.00 6,656,890,000	1.59
8	任 天 堂	日本	株式	その他製品	650,200	7,726.52 5,023,788,446	9,264.00 6,023,452,800	1.44

	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	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	732,500	7,670.91 5,618,945,172	7,832.00 5,736,940,000	1.37
10	東京海上HD	日本	株式	保険業	990,400	5,229.36 5,179,159,357	5,728.00 5,673,011,200	1.36
11	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,369,200	2,881.87 3,945,857,046	3,873.00 5,302,911,600	1.27
12	三井物産	日本	株式	卸売業	1,601,100	2,952.90 4,727,902,127	3,311.00 5,301,242,100	1.27
13	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	218,000	23,096.03 5,034,934,623	24,185.00 5,272,330,000	1.26
14	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,014,000	2,874.32 5,788,881,262	2,604.00 5,244,456,000	1.26
15	信越化学	日本	株式	化学	925,100	5,754.48 5,323,474,405	5,296.00 4,899,329,600	1.17
16	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	30,726,100	150.32 4,618,884,547	158.00 4,854,723,800	1.16
17	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	509,600	8,455.19 4,308,768,959	9,185.00 4,680,676,000	1.12
18	第一三共	日本	株式	医薬品	974,900	4,939.02 4,815,051,829	4,352.00 4,242,764,800	1.02
19	三菱重工業	日本	株式	機械	1,819,100	1,887.13 3,432,895,554	2,223.00 4,043,859,300	0.97
20	HOYA	日本	株式	精密機器	201,200	19,309.43 3,885,058,431	19,815.00 3,986,778,000	0.95
21	武田薬品	日本	株式	医薬品	919,100	4,259.69 3,915,088,494	4,181.00 3,842,757,100	0.92
22	KDDI	日本	株式	情報・通信業	759,800	4,819.52 3,661,874,722	5,042.00 3,830,911,600	0.92
23	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,440,300	1,537.30 3,751,478,321	1,535.00 3,745,860,500	0.90
24	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	61,300	46,295.58 2,837,919,286	53,820.00 3,299,166,000	0.79
25	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	16,532,600	197.23 3,260,784,168	198.90 3,288,334,140	0.79
26	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	1,203,800	2,180.17 2,624,496,192	2,487.00 2,993,850,600	0.72
27	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	324,600	6,563.78 2,130,603,490	9,198.00 2,985,670,800	0.72
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,058,100	2,266.72 2,398,426,554	2,687.00 2,843,114,700	0.68
29	富 士 通	日本	株式	電気機器	957,200	2,914.77 2,790,024,240	2,799.50 2,679,681,400	0.64
30	キヤノン	日本	株式	電気機器	513,700	4,759.83 2,445,127,571	5,161.00 2,651,205,700	0.63

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.05%
合計	98.05%

（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	0.24%
建設業	2.11%
食料品	2.99%
繊維製品	0.40%
パルプ・紙	0.13%
化学	5.05%
医薬品	4.26%
石油・石炭製品	0.54%
ゴム製品	0.56%
ガラス・土石製品	0.65%
鉄鋼	0.80%
非鉄金属	0.82%
金属製品	0.48%
機械	5.45%
電気機器	17.28%
輸送用機器	7.74%
精密機器	2.35%
その他製品	2.61%
電気・ガス業	1.23%
陸運業	2.20%
海運業	0.68%
空運業	0.33%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.33%
卸売業	6.68%
小売業	4.51%
銀行業	8.39%
証券、商品先物取引業	0.87%
保険業	3.22%
その他金融業	1.18%
不動産業	1.73%
サービス業	5.04%
合計	98.05%

（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 0703 月	買建	283	7,766,705,650	7,885,795,000	1.89%

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

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

（参考情報）運用実績

●年金ダイワ日本株式インデックス

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	23,888円
純資産総額	218億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.0%
3カ月間	5.4%
6カ月間	0.2%
1年間	20.2%
3年間	49.8%
5年間	80.9%
設定来	138.9%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：0円

決算期	第 7 期 13年12月	第 8 期 14年12月	第 9 期 15年11月	第 10 期 16年11月	第 11 期 17年11月	第 12 期 18年11月	第 13 期 19年12月	第 14 期 20年11月	第 15 期 21年11月	第 16 期 22年11月	第 17 期 23年11月	第 18 期 24年12月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式	2,090	98.0%
国内株式先物	1	1.9%
不動産投資信託等	－	－
コール・ローン、その他		2.0%
合計	2,091	－

株式 市場・上場別構成	比率
東証プライム市場	97.7%
東証スタンダード市場	0.4%
東証グロース市場	0.0%
地方市場・その他	－
合計	98.0%

株式東証33業種別構成	比率
電気機器	17.3%
銀行業	8.4%
輸送用機器	7.7%
情報・通信業	7.3%
卸売業	6.7%
機械	5.4%
化学	5.0%
サービス業	5.0%
小売業	4.5%
その他	30.6%
合計	98.0%

組入上位10銘柄	業種名	比率
トヨタ自動車	輸送用機器	4.1%
ソニーグループ	電気機器	2.9%
三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.9%
日 立	電気機器	2.5%
リクルートホールディングス	サービス業	2.2%
三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.9%
TOPIX　先物 0703月	－	1.9%
キーエンス	電気機器	1.6%
任 天 堂	その他製品	1.4%
伊 藤 忠	卸売業	1.4%
合計		22.8%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数（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。
・2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率（①＋②）	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
年金ダイワ日本株式インデックス	0.19%	0.19%	0.00%

※対象期間は2023年12月1日～2024年12月2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）をご覧下さい。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権の取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって、受益権の取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

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

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。

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

２【換金（解約）手続等】

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。

＜一部解約＞

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	https://www.daiwa-am.co.jp/

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、当該計算日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から

起算して4営業日目から受益者に支払います。

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

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

３【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。ただし、第1計算期間は2006年10月27日から2007年11月30日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前 1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前 2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前 3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の 2 分の 1 を超えるときは、前 1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 前 3.から前 5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前 3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の 4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

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

③ 反対者の買取請求権

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

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち

重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤　公告

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

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

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

⑥　関係法人との契約の更改

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

４【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金にかかる請求権＞

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

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

＜償還金にかかる請求権＞

受益者は、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

＜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 18 期計算期間(2023 年 12 月 1 日から 2024 年 12 月 2 日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2025年1月24日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	秋山　範之
指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	竹内　知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金ダイワ日本株式インデックスの2023年12月1日から2024年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金ダイワ日本株式インデックスの2024年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

年金ダイワ日本株式インデックス

(1)【貸借対照表】

	第17期 2023年11月30日現在 金　額（円）	第18期 2024年12月2日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	15,012,546	24,255,804
親投資信託受益証券	12,545,712,973	21,143,877,141
未収入金	6,300,000	7,400,000
流動資産合計	12,567,025,519	21,175,532,945
資産合計	12,567,025,519	21,175,532,945
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,933,155	15,041,249
未払受託者報酬	1,963,901	2,593,410
未払委託者報酬	9,165,110	12,102,783
その他未払費用	327,227	432,148
流動負債合計	20,389,393	30,169,590
負債合計	20,389,393	30,169,590
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	6,300,117,509	9,092,093,579
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,246,518,617	12,053,269,776
（分配準備積立金）	4,095,174,347	5,633,988,280
元本等合計	12,546,636,126	21,145,363,355
純資産合計	12,546,636,126	21,145,363,355
負債純資産合計	12,567,025,519	21,175,532,945

(2)【損益及び剰余金計算書】

	第17期 自2022年12月1日 至2023年11月30日 金　額（円）	第18期 自2023年12月1日 至2024年12月2日 金　額（円）
営業収益		
受取利息	1	21,211
有価証券売買等損益	2,224,503,437	2,263,864,168
営業収益合計	2,224,503,438	2,263,885,379
営業費用		
支払利息	3,726	255
受託者報酬	3,538,764	4,910,178
委託者報酬	16,514,694	22,914,540
その他費用	589,623	818,194
営業費用合計	20,646,807	28,643,167
営業利益又は営業損失（△）	2,203,856,631	2,235,242,212
経常利益又は経常損失（△）	2,203,856,631	2,235,242,212
当期純利益又は当期純損失（△）	2,203,856,631	2,235,242,212
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（△）	102,276,054	201,691,006
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,606,110,468	6,246,518,617
剰余金増加額又は欠損金減少額	953,043,416	4,633,364,100
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	953,043,416	4,633,364,100
剰余金減少額又は欠損金増加額	414,215,844	860,164,147
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	414,215,844	860,164,147
分配金　※1	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,246,518,617	12,053,269,776

(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18期 自2023年12月1日 至2024年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年12月2日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第17期 2023年11月30日現在	第18期 2024年12月2日現在
1. ※1 期首元本額	5,749,707,544円	6,300,117,509円
期中追加設定元本額	1,201,437,954円	3,639,143,321円
期中一部解約元本額	651,027,989円	847,167,251円
2. 計算期間末日における受益権の総数	6,300,117,509口	9,092,093,579口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第17期 自2022年12月1日 至2023年11月30日	第18期 自2023年12月1日 至2024年12月2日
※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（2,101,582,148円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,342,748,433円）及び分配準備積立金（1,993,592,199円）より分配対象額は8,437,922,780円（1万口当たり13,393.28円）であり、分配を行っておりません。	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（20,542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（2,033,527,532円）、投資信託約款に規定される収益調整金（8,576,852,630円）及び分配準備積立金（3,600,440,206円）より分配対象額は14,210,840,910円（1万口当たり15,629.89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18期 自2023年12月1日 至2024年12月2日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、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18期 2024年12月2日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第17期 2023年11月30日現在	第18期 2024年12月2日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,178,579,291	2,178,509,918
合計	2,178,579,291	2,178,509,918

（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 17 期 2023 年 11 月 30 日現在	第 18 期 2024 年 12 月 2 日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第 18 期 自 2023 年 12 月 1 日 至 2024 年 12 月 2 日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1 口当たり情報）

	第 17 期 2023 年 11 月 30 日現在	第 18 期 2024 年 12 月 2 日現在
１口当たり純資産額 （1 万口当たり純資産額）	1.9915 円 （19,915 円）	2.3257 円 （23,257 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	10,605,345,409	21,143,877,141	
親投資信託受益証券　合計			21,143,877,141	
合計			21,143,877,141	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2023年11月30日現在 金　額（円）	2024年12月2日現在 金　額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		11,318,400,016	25,585,460,365
株式	※2※3	278,401,688,320	391,517,177,670
派生商品評価勘定		145,283,800	176,529,100
未収入金		17,079,700	62,700,000
未収配当金		1,959,196,490	2,027,187,340
未収利息		550,242	－
その他未収収益	※4	13,627,126	37,026,196
差入委託証拠金		53,472,780	284,044,537
流動資産合計		291,909,298,474	419,690,125,208
資産合計		291,909,298,474	419,690,125,208
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,249,200	20,967,200
前受金		129,325,000	17,562,000
未払金		20,441,625	444,285,079
未払解約金		105,766,530	46,343,940
未払利息		－	3,063,770
受入担保金		7,260,574,102	15,559,156,640
流動負債合計		7,517,356,457	16,091,378,629
負債合計		7,517,356,457	16,091,378,629
純資産の部			
元本等			
元本	※1	166,904,971,223	202,433,131,578
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		117,486,970,794	201,165,615,001
元本等合計		284,391,942,017	403,598,746,579
純資産合計		284,391,942,017	403,598,746,579
負債純資産合計		291,909,298,474	419,690,125,208

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 12 月 1 日 至 2024 年 12 月 2 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	2023 年 11 月 30 日現在	2024 年 12 月 2 日現在
1.　※1　期首	2022 年 12 月 1 日	2023 年 12 月 1 日
期首元本額	147,745,976,638 円	166,904,971,223 円
期中追加設定元本額	33,173,755,669 円	53,547,584,471 円
期中一部解約元本額	14,014,761,084 円	18,019,424,116 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	2,805,574,007 円	2,769,295,099 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	4,373,834,835 円	3,756,385,932 円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	911,362 円	904,928 円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	15,019,052 円	8,959,470 円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	192,250,160 円	133,303,700 円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	13,126,071 円	11,283,120 円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	414,927,130 円	308,944,173 円

区分	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	335,163,355円	1,175,871,836円
日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	677,458,015円	863,762,165円
アセット・アロケーションファンド（リスク判断付き）2023-07（適格機関投資家専用）	-円	1,591,364,318円
Ｄ－Ｉ’ｓ ＴＯＰＩＸインデックス	13,684,283円	11,681,440円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	248,960,497円	249,887,779円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	7,247,259,131円	9,987,610,465円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	4,606,729,135円	5,194,586,600円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	999,756,008円	1,226,436,928円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	638,850円	4,267,029円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	70,849,239,578円	73,323,264,253円
ダイワ・ライフ・バランス３０	3,130,739,193円	2,984,565,474円
ダイワ・ライフ・バランス５０	4,922,236,693円	5,200,504,890円
ダイワ・ライフ・バランス７０	5,657,702,841円	6,246,948,097円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,362,939,711円	10,605,345,409円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	54,910,538円	50,268,884円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	75,461,317円	76,509,117円
ダイワつみたてインデックス日本株式	4,784,147,220円	6,548,376,674円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	12,447,223円	12,566,747円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	11,579,092円	14,112,652円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	29,768,814円	74,843,139円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	11,296,011,297円	23,412,332,129円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	54,608,372円	47,104,361円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	20,876,356円	19,806,181円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,793,959,218円	3,013,743,783円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	350,586,677円	280,960,285円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	51,746,439円	39,319,630円

区分	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	73,719,521円	55,931,105円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	236,956,098円	243,752,682円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	12,428,283,316円	15,501,409,759円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	6,094,958,950円	14,241,732,223円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,354,073,654円	3,514,898,479円
スタイル９（4資産分散・保守型）	−円	835,518円
スタイル９（4資産分散・バランス型）	−円	6,046,890円
スタイル９（4資産分散・積極型）	−円	8,560,607円
スタイル９（6資産分散・保守型）	−円	362,454円
スタイル９（6資産分散・バランス型）	−円	11,046,182円
スタイル９（6資産分散・積極型）	−円	12,686,752円
スタイル９（8資産分散・保守型）	−円	560,029円
スタイル９（8資産分散・バランス型）	−円	8,978,957円
スタイル９（8資産分散・積極型）	−円	27,048,309円
ダイワ国内株式インデックス（投資一任専用）	−円	5,000,018円
ダイワ・インデックスセレクトＴＯＰＩＸ	1,171,702,165円	994,378,310円
ダイワライフスタイル２５	108,414,945円	93,262,550円
ダイワライフスタイル５０	483,952,477円	433,705,855円
ダイワライフスタイル７５	404,489,561円	379,825,506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）	8,144,168,066円	7,647,992,706円
計	166,904,971,223円	202,433,131,578円
2. 期末日における受益権の総数	166,904,971,223口	202,433,131,578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 6,909,195,160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 14,884,104,090円

区分	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　1,209,560,000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　997,940,000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 2023年12月1日 至 2024年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引

区分	2024年12月2日現在
	デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2023年11月30日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024年12月2日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△5,884,432,916	13,137,588,921
合計	△5,884,432,916	13,137,588,921

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

（デリバティブ取引に関する注記）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2023年11月30日現在				2024年12月2日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	5,273,120,000	－	5,417,280,000	144,160,000	12,908,783,000	－	13,064,610,000	155,827,000
合計	5,273,120,000	－	5,417,280,000	144,160,000	12,908,783,000	－	13,064,610,000	155,827,000

（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）

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7039円 （17,039円）	1.9937円 （19,937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	5,900	3,970.00	23,423,000	
ニッスイ	141,300	938.90	132,666,570	
マルハニチロ	21,000	3,012.00	63,252,000	
雪国まいたけ	12,000	1,040.00	12,480,000	
カネコ種苗	4,000	1,374.00	5,496,000	
サカタのタネ	15,700	3,410.00	53,537,000	
ホクト	12,600	1,742.00	21,949,200	
ホクリヨウ	300	1,100.00	330,000	貸付株式数 200株
ショーボンドＨＤ	18,600	5,185.00	96,441,000	
ミライト・ワン	46,200	2,149.00	99,283,800	貸付株式数 6,300株
タマホーム	8,900	3,605.00	32,084,500	貸付株式数 3,400株
サンヨーホームズ	200	710.00	142,000	貸付株式数 100株 (100株)
日本アクア	800	783.00	626,400	
ファーストコーポレーション	500	806.00	403,000	貸付株式数 400株
ベステラ	400	998.00	399,200	貸付株式数 300株 (300株)
キャンディル	300	551.00	165,300	貸付株式数 100株
住石ホールディングス	15,500	842.00	13,051,000	貸付株式数 7,500株
日鉄鉱業	5,700	4,180.00	23,826,000	
三井松島HLDGS	6,900	3,435.00	23,701,500	貸付株式数 2,700株
ＩＮＰＥＸ	427,100	1,991.50	850,569,650	
石油資源開発	77,500	1,091.00	84,552,500	
K&Oエナジーグループ	6,400	3,360.00	21,504,000	
リョーサン菱洋HD	18,000	2,276.00	40,968,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,263.00	505,200	貸付株式数 300株
第一カッター興業	4,100	1,446.00	5,928,600	
明豊ファシリティワークス	600	858.00	514,800	
安藤・間	81,900	1,163.00	95,249,700	
東急建設	44,300	690.00	30,567,000	
コムシスホールディングス	50,100	3,296.00	165,129,600	
ビーアールホールディングス	20,700	336.00	6,955,200	
高松コンストラクションGP	10,500	2,626.00	27,573,000	
東建コーポレーション	3,600	11,090.00	39,924,000	
ソネック	200	835.00	167,000	貸付株式数 100株
ヤマウラ	7,200	1,167.00	8,402,400	貸付株式数 2,300株
オリエンタル白石	52,300	386.00	20,187,800	
大成建設	89,700	6,623.00	594,083,100	
大 林 組	326,300	2,141.00	698,608,300	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
清水建設	280,300	1,190.50	333,697,150	
長谷工コーポレーシヨン	90,700	2,022.50	183,440,750	貸付株式数 4,000株
松井建設	9,200	844.00	7,764,800	貸付株式数 3,400株
錢 高 組	100	3,790.00	379,000	
鹿島建設	219,200	2,762.50	605,540,000	
不動テトラ	6,200	2,042.00	12,660,400	貸付株式数 2,400株
大末建設	500	1,588.00	794,000	
鉄建建設	6,500	2,261.00	14,696,500	
西松建設	15,800	5,085.00	80,343,000	
三井住友建設	79,700	405.00	32,278,500	
大豊建設	2,700	3,315.00	8,950,500	
佐田建設	700	971.00	679,700	
ナカノフドー建設	900	659.00	593,100	
奥 村 組	17,500	3,855.00	67,462,500	貸付株式数 6,800株
東鉄工業	10,900	3,200.00	34,880,000	
イチケン	300	2,540.00	762,000	
富士ピー・エス	500	402.00	201,000	貸付株式数 400株
淺沼組	39,600	642.00	25,423,200	
戸田建設	121,600	936.80	113,914,880	貸付株式数 17,600株
熊 谷 組	16,300	3,580.00	58,354,000	
北野建設	200	4,080.00	816,000	
植 木 組	300	1,536.00	460,800	
矢作建設	13,400	1,477.00	19,791,800	
ピーエス・コンストラクション	7,200	1,042.00	7,502,400	
日本ハウスHLDGS	21,100	335.00	7,068,500	貸付株式数 8,100株
大東建託	33,800	16,880.00	570,544,000	
新日本建設	13,900	1,510.00	20,989,000	
東亜道路	17,100	1,279.00	21,870,900	貸付株式数 5,200株
日本道路	9,900	1,743.00	17,255,700	
東亜建設	29,800	1,178.00	35,104,400	
日本国土開発	28,100	507.00	14,246,700	貸付株式数 10,800株
若築建設	2,900	3,640.00	10,556,000	
東洋建設	28,500	1,279.00	36,451,500	
五洋建設	129,400	616.50	79,775,100	
世紀東急	14,100	1,506.00	21,234,600	貸付株式数 5,500株
福 田 組	3,700	5,290.00	19,573,000	貸付株式数 1,400株
日本ドライケミカル	300	3,855.00	1,156,500	貸付株式数 100株
住友林業	85,400	5,640.00	481,656,000	
日本基礎技術	800	597.00	477,600	
巴コーポレーション	1,200	1,026.00	1,231,200	
大和ハウス	298,300	4,743.00	1,414,836,900	
ライト工業	20,100	2,188.00	43,978,800	
積水ハウス	299,900	3,584.00	1,074,841,600	
日特建設	9,400	989.00	9,296,600	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
北陸電気工事	6,800	1,103.00	7,500,400	
ユアテック	19,100	1,423.00	27,179,300	
日本リーテック	7,700	1,141.00	8,785,700	貸付株式数 2,900株
四電工	12,400	1,475.00	18,290,000	
中電工	15,300	3,370.00	51,561,000	
関 電 工	54,200	2,223.00	120,486,600	
きんでん	68,700	3,098.00	212,832,600	
東京エネシス	10,500	1,046.00	10,983,000	
トーエネック	16,400	966.00	15,842,400	
住友電設	8,100	4,810.00	38,961,000	
日本電設工業	18,600	1,903.00	35,395,800	
エクシオグループ	104,700	1,741.00	182,282,700	貸付株式数 41,300株
新日本空調	6,400	3,945.00	25,248,000	
九電工	21,400	5,182.00	110,894,800	
三機工業	20,600	2,836.00	58,421,600	
日揮ホールディングス	97,800	1,300.50	127,188,900	
中外炉工業	3,200	3,285.00	10,512,000	
ヤマト	1,000	1,198.00	1,198,000	貸付株式数 400株
太平電業	6,300	4,975.00	31,342,500	貸付株式数 700株
高砂熱学	23,800	6,000.00	142,800,000	
三晃金属	100	4,330.00	433,000	
NECネッツエスアイ	37,900	3,255.00	123,364,500	
朝日工業社	9,200	1,939.00	17,838,800	
明星工業	17,000	1,335.00	22,695,000	
大 氣 社	12,700	4,720.00	59,944,000	
ダイダン	13,000	3,600.00	46,800,000	
日比谷総合設備	8,100	3,975.00	32,197,500	
ニップン	32,700	2,130.00	69,651,000	貸付株式数 12,000株
日清製粉Ｇ本社	103,200	1,843.50	190,249,200	
日東富士製粉	1,800	6,570.00	11,826,000	
昭和産業	8,400	2,787.00	23,410,800	
鳥越製粉	1,000	687.00	687,000	
中部飼料	13,700	1,312.00	17,974,400	
フィード・ワン	14,500	799.00	11,585,500	
東洋精糖	200	1,436.00	287,200	
日本甜菜糖	5,200	2,386.00	12,407,200	貸付株式数 2,100株
DM三井製糖ホールディ	9,800	3,190.00	31,262,000	
塩水港精糖	1,500	304.00	456,000	貸付株式数 200株
ウェルネオシュガー	5,900	2,158.00	12,732,200	
ＬＩＦＵＬＬ	25,300	190.00	4,807,000	
ＭＩＸＩ	19,500	2,793.00	54,463,500	
ジェイエイシーリクルートメント	37,400	692.00	25,880,800	
日本M&Aセンターホールデ	152,400	635.40	96,834,960	
メンバーズ	4,000	1,035.00	4,140,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
中広	200	436.00	87,200	
ＵＴグループ	13,500	2,033.00	27,445,500	貸付株式数 5,200株
アイティメディア	5,600	1,505.00	8,428,000	貸付株式数 100株
ケアネット	21,200	589.00	12,486,800	貸付株式数 3,400株
E・Ｊホールディングス	6,100	1,663.00	10,144,300	
オープンアップグループ	31,100	1,811.00	56,322,100	
コシダカホールディングス	31,400	1,133.00	35,576,200	貸付株式数 12,200株
アルトナー	500	1,867.00	933,500	貸付株式数 400株
パソナグループ	12,600	1,965.00	24,759,000	貸付株式数 2,200株
ＣＤＳ	300	1,825.00	547,500	
リンクアンドモチベーション	25,500	547.00	13,948,500	貸付株式数 9,600株
エス・エム・エス	39,600	1,678.00	66,448,800	
サニーサイドアップＧ	400	575.00	230,000	
パーソルホールディングス	966,800	232.40	224,684,320	
リニカル	800	344.00	275,200	
クックパッド	28,300	158.00	4,471,400	貸付株式数 10,900株
エスクリ	500	187.00	93,500	貸付株式数 200株 (100株)
アイ・ケイ・ケイホールディンク	800	722.00	577,600	貸付株式数 400株 (400株)
森永製菓	41,500	2,783.00	115,494,500	
中 村 屋	2,500	3,195.00	7,987,500	
江崎グリコ	28,400	4,427.00	125,726,800	
名糖産業	4,400	1,935.00	8,514,000	貸付株式数 1,400株
井村屋グループ	5,400	2,420.00	13,068,000	
不 二 家	6,800	2,671.00	18,162,800	貸付株式数 2,600株
山崎製パン	66,400	2,832.00	188,044,800	
第一屋製パン	300	586.00	175,800	貸付株式数 200株
モロゾフ	3,200	4,430.00	14,176,000	貸付株式数 1,000株
亀田製菓	6,300	4,175.00	26,302,500	貸付株式数 2,400株
寿スピリッツ	58,700	2,148.00	126,087,600	貸付株式数 23,200株
カルビー	45,400	3,170.00	143,918,000	貸付株式数 3,000株
森永乳業	38,100	2,932.00	111,709,200	
六甲バター	7,300	1,393.00	10,168,900	貸付株式数 2,200株
ヤクルト	141,800	3,078.00	436,460,400	貸付株式数 1,400株
明治ホールディングス	132,700	3,206.00	425,436,200	
雪印メグミルク	26,700	2,736.00	73,051,200	
プリマハム	13,300	2,173.00	28,900,900	
日本ハム	42,700	5,146.00	219,734,200	
林兼産業	400	463.00	185,200	貸付株式数 300株
丸大食品	10,000	1,707.00	17,070,000	貸付株式数 3,700株
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	10,900	2,656.00	28,950,400	貸付株式数 4,300株
柿安本店	3,900	2,759.00	10,760,100	貸付株式数 1,200株
伊藤ハム米久HLDGS	15,200	3,790.00	57,608,000	
学情	5,300	1,761.00	9,333,300	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
スタジオアリス	5,200	2,090.00	10,868,000	貸付株式数 1,800株 (800株)
クロスキャット	5,800	1,063.00	6,165,400	貸付株式数 1,600株
エプコ	300	783.00	234,900	
システナ	144,500	356.00	51,442,000	
ＮＪＳ	2,600	3,685.00	9,581,000	貸付株式数 1,000株
デジタルアーツ	6,400	5,920.00	37,888,000	貸付株式数 2,500株
日鉄ソリューションズ	34,500	4,115.00	141,967,500	貸付株式数 13,600株
綜合警備保障	173,100	1,133.50	196,208,850	貸付株式数 68,300株
キューブシステム	5,300	1,039.00	5,506,700	貸付株式数 1,600株
いちご	84,000	367.00	30,828,000	
日本駐車場開発	118,100	224.00	26,454,400	
コア	4,500	1,813.00	8,158,500	
カカクコム	74,700	2,499.50	186,712,650	貸付株式数 29,500株
アイロムグループ	4,200	2,573.00	10,806,600	
セントケア・ホールディング	6,600	741.00	4,890,600	貸付株式数 2,000株
サイネックス	200	739.00	147,800	貸付株式数 100株
ルネサンス	8,100	1,019.00	8,253,900	貸付株式数 2,700株
ディップ	18,100	2,528.00	45,756,800	貸付株式数 6,800株
SBSホールディングス	9,000	2,472.00	22,248,000	
デジタルホールディングス	5,300	1,242.00	6,582,600	
新日本科学	11,000	1,617.00	17,787,000	貸付株式数 4,200株
キャリアデザインセンター	200	1,808.00	361,600	
エムスリー	204,800	1,491.00	305,356,800	貸付株式数 80,800株
ツカダ・グローバルHOLD	900	444.00	399,600	貸付株式数 600株
ブラス	200	537.00	107,400	貸付株式数 100株
ウェルネット	1,000	864.00	864,000	
ワールドホールディングス	4,100	2,087.00	8,556,700	貸付株式数 1,600株
ディー・エヌ・エー	41,400	2,437.50	100,912,500	
博報堂ＤＹHLDGS	117,500	1,142.50	134,243,750	貸付株式数 49,700株
ぐるなび	19,200	312.00	5,990,400	貸付株式数 7,400株
タカミヤ	14,000	414.00	5,796,000	
ファンコミュニケーションズ	14,500	417.00	6,046,500	
ライク	3,900	1,381.00	5,385,900	貸付株式数 1,400株 (1,200株)
Ａｏｂａ‐ＢＢＴ	500	317.00	158,500	貸付株式数 400株
エスプール	32,700	315.00	10,300,500	貸付株式数 12,900株
WDBホールディングス	5,300	1,684.00	8,925,200	貸付株式数 1,800株
手間いらず	1,700	3,450.00	5,865,000	貸付株式数 600株
ティア	800	427.00	341,600	貸付株式数 300株
アドウェイズ	12,700	320.00	4,064,000	
バリューコマース	9,100	1,137.00	10,346,700	
インフォマート	97,900	279.00	27,314,100	貸付株式数 1,800株
サッポロホールディングス	32,700	8,855.00	289,558,500	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
アサヒグループホールディン	745,200	1,615.00	1,203,498,000	
キリンＨＤ	413,400	2,113.50	873,720,900	
シマダヤ	2,900	1,437.00	4,167,300	
宝ホールディングス	66,900	1,289.50	86,267,550	貸付株式数 9,300 株
オエノンホールディングス	32,100	414.00	13,289,400	
養 命 酒	3,300	2,516.00	8,302,800	
飛島ホールディングス	10,100	1,566.00	15,816,600	
コカ・コーラボトラーズ JHD	70,000	2,429.00	170,030,000	
サントリー食品インター	69,900	5,132.00	358,726,800	
ダイドーグループ HD	11,200	3,465.00	38,808,000	貸付株式数 4,300 株
伊 藤 園	33,200	3,300.00	109,560,000	
キーコーヒー	11,100	2,063.00	22,899,300	貸付株式数 4,200 株
ユニカフェ	400	945.00	378,000	貸付株式数 300 株
日清オイリオグループ	14,000	5,030.00	70,420,000	
不二製油グループ	19,800	3,517.00	69,636,600	
かどや製油	100	3,585.00	358,500	
Ｊ－オイルミルズ	11,400	2,168.00	24,715,200	
サンエー	18,100	2,722.00	49,268,200	貸付株式数 2,600 株
カワチ薬品	8,300	2,539.00	21,073,700	
エービーシー・マート	46,700	3,117.00	145,563,900	
ハードオフコーポレーション	4,200	1,789.00	7,513,800	
高千穂交易	4,200	3,815.00	16,023,000	貸付株式数 1,600 株
アスクル	25,200	1,863.00	46,947,600	貸付株式数 200 株
ゲオホールディングス	12,000	1,620.00	19,440,000	
アダストリア	14,700	3,665.00	53,875,500	
ジーフット	1,000	283.00	283,000	貸付株式数 900 株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	200	522.00	104,400	貸付株式数 100 株
オルバヘルスケア HLDGS	200	1,958.00	391,600	
伊藤忠食品	2,400	6,980.00	16,752,000	
くら寿司	12,500	3,880.00	48,500,000	貸付株式数 200 株
キャンドゥ	3,800	3,335.00	12,673,000	貸付株式数 1,400 株
エレマテック	9,400	2,396.00	22,522,400	
IK ホールディングス	400	382.00	152,800	貸付株式数 300 株
パルグループ HLDGS	24,400	3,250.00	79,300,000	
エディオン	46,400	1,799.00	83,473,600	
あらた	16,300	3,040.00	49,552,000	貸付株式数 2,900 株
サーラコーポレーション	22,400	803.00	17,987,200	貸付株式数 8,400 株
ワッツ	500	678.00	339,000	貸付株式数 400 株
トーメンデバイス	1,500	6,680.00	10,020,000	貸付株式数 500 株
ハローズ	4,200	4,045.00	16,989,000	
JP ホールディングス	26,500	627.00	16,615,500	貸付株式数 10,400 株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
フジオフードＧ本社	12,000	1,207.00	14,484,000	貸付株式数 4,600株 (300株)
あみやき亭	7,700	1,622.00	12,489,400	貸付株式数 3,000株
東京エレクトロンデバイス	10,600	3,110.00	32,966,000	
ひらまつ	2,700	168.00	453,600	貸付株式数 1,000株
円谷フィールズホールディ	17,300	2,195.00	37,973,500	貸付株式数 6,800株
双日	118,700	3,084.00	366,070,800	
アルフレッサホールディングス	99,400	2,189.50	217,636,300	
大黒天物産	3,300	9,870.00	32,571,000	貸付株式数 1,200株
ハニーズホールディングス	9,500	1,650.00	15,675,000	貸付株式数 3,300株
ファーマライズHD	300	601.00	180,300	貸付株式数 100株
キッコーマン	328,800	1,640.00	539,232,000	貸付株式数 14,500株
味 の 素	229,900	6,360.00	1,462,164,000	貸付株式数 32,600株
ブルドックソース	5,300	1,841.00	9,757,300	
キユーピー	53,300	3,480.00	185,484,000	貸付株式数 14,100株
ハウス食品Ｇ本社	33,400	2,851.50	95,240,100	
カ ゴ メ	42,500	2,985.00	126,862,500	
アリアケジャパン	9,900	5,460.00	54,054,000	貸付株式数 3,900株
ピエトロ	200	1,742.00	348,400	貸付株式数 100株
エバラ食品工業	2,700	2,855.00	7,708,500	
やまみ	200	4,010.00	802,000	貸付株式数 100株
ニチレイ	40,400	4,278.00	172,831,200	
横浜冷凍	26,800	804.00	21,547,200	
東洋水産	46,000	10,745.00	494,270,000	
イートアンドHLDGS	5,100	2,133.00	10,878,300	貸付株式数 1,900株
大冷	200	1,900.00	380,000	
ヨシムラ・フード・HLDGS	5,400	1,333.00	7,198,200	貸付株式数 800株
日清食品ＨＤ	127,900	4,014.00	513,390,600	貸付株式数 50,500株
一正蒲鉾	500	734.00	367,000	貸付株式数 200株 (200株)
フジッコ	10,200	1,718.00	17,523,600	貸付株式数 3,800株
ロックフィールド	12,100	1,491.00	18,041,100	貸付株式数 4,700株
日本たばこ産業	603,000	4,221.00	2,545,263,000	
ケンコーマヨネーズ	6,200	2,129.00	13,199,800	
わらべや日洋HD	6,600	1,987.00	13,114,200	貸付株式数 400株
なとり	6,200	2,112.00	13,094,400	
イフジ産業	200	1,658.00	331,600	貸付株式数 100株
ファーマフーズ	13,200	984.00	12,988,800	貸付株式数 5,200株
北の達人コーポ	42,700	145.00	6,191,500	貸付株式数 16,800株 (1,300株)
ユーグレナ	61,700	400.00	24,680,000	貸付株式数 23,800株 (600株)
紀文食品	8,600	1,100.00	9,460,000	貸付株式数 1,700株
ピックルスホールディングス	5,800	1,032.00	5,985,600	貸付株式数 1,900株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
スター・マイカ・HLDGS	10,300	674.00	6,942,200	
SRE ホールディングス	3,700	3,295.00	12,191,500	貸付株式数 1,600 株
AD ワークスグループ	2,700	210.00	567,000	貸付株式数 100 株
片倉工業	9,300	1,992.00	18,525,600	貸付株式数 3,600 株
グ ン ゼ	7,200	5,180.00	37,296,000	
ヒューリック	231,500	1,390.00	321,785,000	
神 栄	200	1,580.00	316,000	
ラサ商事	5,900	1,348.00	7,953,200	貸付株式数 900 株
アルペン	8,800	2,006.00	17,652,800	貸付株式数 3,400 株
ハブ	400	731.00	292,400	貸付株式数 300 株
ラクーンホールディングス	7,500	690.00	5,175,000	貸付株式数 400 株
クオールホールディングス	13,200	1,474.00	19,456,800	
アルコニックス	15,200	1,474.00	22,404,800	
神戸物産	82,500	3,708.00	305,910,000	
ソリトンシステムズ	5,200	1,158.00	6,021,600	
ジンズホールディングス	8,100	6,010.00	48,681,000	貸付株式数 3,200 株
ビックカメラ	63,800	1,664.00	106,163,200	貸付株式数 25,200 株
DCM ホールディングス	55,200	1,410.00	77,832,000	貸付株式数 11,200 株
ペッパーフードサービス	31,500	197.00	6,205,500	貸付株式数 12,200 株
ハイパー	300	287.00	86,100	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	151,200	2,670.50	403,779,600	
東京一番フーズ	300	500.00	150,000	
ＤＤグループ	800	1,300.00	1,040,000	貸付株式数 700 株
あい ホールディングス	17,100	2,098.00	35,875,800	
ディーブイエックス	200	883.00	176,600	
きちりホールディングス	400	889.00	355,600	貸付株式数 300 株
J. フロント リテイリング	122,400	1,803.00	220,687,200	
ドトール・日レスＨＤ	18,900	2,274.00	42,978,600	
マツキヨココカラ&カンパニー	188,000	2,124.50	399,406,000	貸付株式数 60,900 株
ブロンコビリー	6,300	3,850.00	24,255,000	貸付株式数 2,400 株
ＺＯＺＯ	79,300	4,740.00	375,882,000	
トレジャー・ファクトリー	7,300	1,283.00	9,365,900	貸付株式数 2,800 株
物語コーポレーション	19,000	3,585.00	68,115,000	貸付株式数 7,200 株
三越伊勢丹ＨＤ	161,800	2,167.50	350,701,500	貸付株式数 66,400 株
東洋紡	43,600	927.00	40,417,200	貸付株式数 17,200 株
ユニチカ	32,700	194.00	6,343,800	貸付株式数 12,900 株
富士紡ホールディングス	4,000	5,450.00	21,800,000	
日清紡ホールディングス	76,500	877.40	67,121,100	
倉敷紡績	7,200	5,670.00	40,824,000	
ダイワボウＨＤ	47,200	3,084.00	145,564,800	
シキボウ	7,200	993.00	7,149,600	貸付株式数 1,800 株
日東紡績	11,400	5,840.00	66,576,000	
トヨタ紡織	42,400	1,918.00	81,323,200	
マクニカホールディングス	82,600	1,784.00	147,358,400	貸付株式数 13,300 株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
Ｈａｍｅｅ	4,300	1,072.00	4,609,600	
マーケットエンタープライズ	100	831.00	83,100	
ラクト・ジャパン	4,500	2,903.00	13,063,500	貸付株式数 1,700株
ウエルシアＨＤ	55,300	1,924.00	106,397,200	
クリエイトＳＤＨ	15,100	2,874.00	43,397,400	貸付株式数 5,600株
グリムス	4,500	2,681.00	12,064,500	貸付株式数 1,700株
バイタルＫＳＫHD	14,700	1,233.00	18,125,100	
八洲電機	8,600	1,591.00	13,682,600	貸付株式数 3,200株
メディアスホールディングス	6,200	785.00	4,867,000	貸付株式数 2,300株
レスター	9,100	2,380.00	21,658,000	
ジオリーブグループ	300	1,051.00	315,300	
丸善CHI HD	1,700	319.00	542,300	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
大光	600	585.00	351,000	貸付株式数 500株
OCHIホールディングス	300	1,306.00	391,800	
TOKAIホールディングス	57,900	918.00	53,152,200	貸付株式数 22,300株
黒谷	300	553.00	165,900	貸付株式数 100株
ミサワ	200	682.00	136,400	
ティーライフ	200	1,203.00	240,600	貸付株式数 100株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	200	874.00	174,800	
エー・ピーホールディングス	300	929.00	278,700	貸付株式数 200株
三洋貿易	10,900	1,530.00	16,677,000	
チムニー	400	1,241.00	496,400	貸付株式数 300株
シュッピン	10,500	1,008.00	10,584,000	貸付株式数 3,700株
ビューティガレージ	3,400	1,393.00	4,736,200	貸付株式数 1,200株
オイシックス・ラ・大地	17,200	1,516.00	26,075,200	貸付株式数 6,800株
ウイン・パートナーズ	7,800	1,237.00	9,648,600	貸付株式数 2,300株
ネクステージ	24,400	1,396.00	34,062,400	貸付株式数 9,600株
ジョイフル本田	29,600	1,796.00	53,161,600	貸付株式数 11,600株
エターナルホスピタリティグル	3,900	3,250.00	12,675,000	
ホットランド	8,200	2,134.00	17,498,800	貸付株式数 3,000株 (200株)
すかいらーくHD	145,800	2,305.00	336,069,000	貸付株式数 57,600株
SFPホールディングス	6,000	1,917.00	11,502,000	貸付株式数 2,300株
綿半ホールディングス	8,300	1,522.00	12,632,600	貸付株式数 3,200株
日本毛織	25,900	1,258.00	32,582,200	
ダイトウボウ	2,000	102.00	204,000	貸付株式数 1,800株
トーア紡コーポレーション	500	410.00	205,000	貸付株式数 100株
ダイドーリミテツド	1,100	883.00	971,300	貸付株式数 1,000株
ヨシックスホールディングス	3,500	3,170.00	11,095,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ユナイテッド・スーパーマーケ	45,258	850.00	38,469,300	貸付株式数 13,400株 (300株)
野村不動産HLDGS	62,200	3,745.00	232,939,000	
三重交通グループHD	21,200	499.00	10,578,800	貸付株式数 7,600株
地主	8,800	2,130.00	18,744,000	貸付株式数 3,400株
プレサンスコーポレーション	13,200	1,860.00	24,552,000	貸付株式数 4,900株
フィル・カンパニー	2,000	1,008.00	2,016,000	貸付株式数 700株
ハウスコム	200	1,330.00	266,000	貸付株式数 100株
ＪＰＭＣ	5,700	1,159.00	6,606,300	
サンセイランディック	400	953.00	381,200	貸付株式数 300株
エストラスト	100	690.00	69,000	
フージャースHD	15,300	1,012.00	15,483,600	
オープンハウスグループ	36,400	5,550.00	202,020,000	貸付株式数 13,600株
東急不動産ＨＤ	298,400	995.80	297,146,720	貸付株式数 6,700株
飯田ＧＨＤ	95,100	2,258.00	214,735,800	
イーグランド	200	1,370.00	274,000	貸付株式数 100株
帝国繊維	11,400	2,456.00	27,998,400	貸付株式数 4,400株
日本コークス工業	102,600	95.00	9,747,000	貸付株式数 40,000株
ゴルフダイジェスト・オン	6,200	394.00	2,442,800	貸付株式数 2,400株
ミタチ産業	400	1,189.00	475,600	貸付株式数 300株
ＢＥＥＮＯＳ	6,700	3,655.00	24,488,500	貸付株式数 2,400株
あさひ	8,900	1,581.00	14,070,900	
日本調剤	7,000	1,437.00	10,059,000	貸付株式数 2,300株
コスモス薬品	18,100	7,442.00	134,700,200	
シップヘルスケアHD	42,200	2,204.00	93,008,800	
トーエル	500	771.00	385,500	貸付株式数 100株
ソフトクリエイトHD	7,300	2,227.00	16,257,100	
セブン&アイ・HLDGS	1,178,000	2,606.00	3,069,868,000	
クリエイト・レストランツ・ホール	80,200	1,176.00	94,315,200	貸付株式数 31,600株
明治電機工業	4,000	1,385.00	5,540,000	
ツルハホールディングス	22,400	8,248.00	184,755,200	
デリカフーズHLDGS	500	499.00	249,500	
スターティアホールディングス	400	2,181.00	872,400	貸付株式数 300株
サンマルクホールディングス	8,600	2,532.00	21,775,200	
フェリシモ	300	838.00	251,400	
トリドールホールディングス	30,000	3,717.00	111,510,000	貸付株式数 11,800株
帝 人	97,000	1,321.00	128,137,000	
東 レ	737,900	962.70	710,376,330	
ク ラ レ	147,100	2,075.50	305,306,050	
旭 化 成	683,000	1,067.50	729,102,500	
TOKYO BASE	11,400	286.00	3,260,400	貸付株式数 4,400株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
稲葉製作所	5,800	1,760.00	10,208,000	貸付株式数 700株
宮地エンジニアリングＧ	12,500	1,881.00	23,512,500	貸付株式数 3,300株
トーカロ	30,000	1,773.00	53,190,000	
アルファCO	400	1,048.00	419,200	
ＳＵＭＣＯ	198,000	1,201.50	237,897,000	貸付株式数 78,200株
川田テクノロジーズ	6,700	2,702.00	18,103,400	
RS TECHNOLOGIES	8,000	3,275.00	26,200,000	
ジェイテックコーポレーション	200	1,360.00	272,000	
信和	800	749.00	599,200	貸付株式数 700株
ビーロット	700	1,506.00	1,054,200	貸付株式数 600株
ファーストブラザーズ	300	999.00	299,700	
AND DOホールディングス	6,000	988.00	5,928,000	貸付株式数 300株
シーアールイー	4,400	1,217.00	5,354,800	
ケイアイスター不動産	5,400	4,235.00	22,869,000	貸付株式数 300株
アグレ都市デザイン	300	1,590.00	477,000	貸付株式数 200株
ジェイ・エス・ビー	4,100	2,749.00	11,270,900	
ロードスターキャピタル	5,700	2,502.00	14,261,400	
イノベーションホールディンク	400	925.00	370,000	貸付株式数 200株
グロバルリンクマネジメント	200	2,860.00	572,000	貸付株式数 100株
フェイスネットワーク	400	1,650.00	660,000	貸付株式数 300株
霞ヶ関キャピタル	4,100	12,360.00	50,676,000	貸付株式数 1,600株
ＳＵＭＩＮＯＥ	300	1,967.00	590,100	貸付株式数 200株 (200株)
日本フエルト	600	478.00	286,800	
イチカワ	100	1,535.00	153,500	
エコナックホールディングス	1,100	115.00	126,500	貸付株式数 1,000株
日東製網	200	1,466.00	293,200	貸付株式数 100株
芦森工業	200	2,472.00	494,400	
アツギ	800	995.00	796,000	
ウイルプラスHLDGS	200	973.00	194,600	
JMホールディングス	7,700	2,694.00	20,743,800	
コメダホールディングス	27,900	2,873.00	80,156,700	
サツドラホールディングス	500	778.00	389,000	貸付株式数 400株
アレンザホールディングス	8,000	1,068.00	8,544,000	貸付株式数 3,000株 (1,200株)
串カツ田中HLDGS	3,200	1,431.00	4,579,200	貸付株式数 1,200株 (300株)
バロックジャパン	12,400	785.00	9,734,000	貸付株式数 4,900株
クスリのアオキHLDGS	35,600	3,435.00	122,286,000	
ダイニック	400	749.00	299,600	
共和レザー	700	635.00	444,500	
ピーバンドットコム	200	429.00	85,800	貸付株式数 100株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
力の源HD	8,000	1,016.00	8,128,000	貸付株式数 3,100株
FOOD&LIFE COMPAN	56,900	3,437.00	195,565,300	
アセンテック	4,100	850.00	3,485,000	
セーレン	19,500	2,774.00	54,093,000	
ソトー	300	677.00	203,100	貸付株式数 100株
東海染工	100	694.00	69,400	
小松マテーレ	14,600	794.00	11,592,400	
ワコールホールディングス	20,900	5,091.00	106,401,900	
ホギメディカル	13,600	4,785.00	65,076,000	貸付株式数 5,300株
クラウディアHLDGS	300	341.00	102,300	貸付株式数 200株
ＴＳＩホールディングス	31,900	890.00	28,391,000	貸付株式数 12,600株
マツオカコーポレーション	300	1,914.00	574,200	
ワールド	15,600	2,239.00	34,928,400	貸付株式数 3,800株
ＴＩＳ	106,800	3,690.00	394,092,000	貸付株式数 28,500株
テクミラホールディングス	600	315.00	189,000	貸付株式数 500株
グリー	33,900	428.00	14,509,200	
ＧＭＯペパボ	1,200	1,600.00	1,920,000	貸付株式数 200株
コーエーテクモＨＤ	76,000	1,760.50	133,798,000	貸付株式数 29,900株
三菱総合研究所	5,000	4,370.00	21,850,000	
ボルテージ	300	229.00	68,700	貸付株式数 100株
電算	100	1,420.00	142,000	
ＡＧＳ	500	803.00	401,500	貸付株式数 400株
ファインデックス	8,000	781.00	6,248,000	貸付株式数 3,000株
ブレインパッド	8,400	1,016.00	8,534,400	
ＫＬａｂ	25,500	174.00	4,437,000	貸付株式数 6,100株
ポールトゥウィンホールディン	14,400	466.00	6,710,400	
ネクソン	222,100	2,111.50	468,964,150	
アイスタイル	33,800	422.00	14,263,600	貸付株式数 13,200株
エムアップホールディングス	12,400	1,623.00	20,125,200	
エイチーム	6,700	657.00	4,401,900	貸付株式数 400株
エニグモ	11,300	304.00	3,435,200	貸付株式数 4,600株
テクノスジャパン	1,000	747.00	747,000	
ｅｎｉｓｈ	1,500	160.00	240,000	貸付株式数 800株
コロプラ	34,300	463.00	15,880,900	貸付株式数 13,300株
オルトプラス	1,100	88.00	96,800	貸付株式数 900株
ブロードリーフ	40,600	696.00	28,257,600	
クロス・マーケティングG	500	654.00	327,000	貸付株式数 400株
デジタルハーツHLDGS	7,200	809.00	5,824,800	
メディアドゥ	4,600	1,333.00	6,131,800	貸付株式数 1,500株
じげん	25,300	523.00	13,231,900	
ブイキューブ	13,900	222.00	3,085,800	貸付株式数 5,300株
エンカレッジ・テクノロジ	300	584.00	175,200	貸付株式数 200株
サイバーリンクス	500	743.00	371,500	貸付株式数 400株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ディー・エル・イー	4,300	124.00	533,200	
フィックスターズ	10,100	1,626.00	16,422,600	貸付株式数 4,000株
CARTA HOLDINGS	5,700	1,475.00	8,407,500	貸付株式数 2,200株
オプティム	10,400	720.00	7,488,000	貸付株式数 3,900株
セレス	4,600	2,456.00	11,297,600	貸付株式数 1,800株
ＳＨＩＦＴ	6,700	17,435.00	116,814,500	貸付株式数 2,500株
特種東海製紙	4,900	3,530.00	17,297,000	貸付株式数 300株
セック	1,700	4,150.00	7,055,000	
テクマトリックス	21,800	2,441.00	53,213,800	
プロシップ	4,400	1,539.00	6,771,600	貸付株式数 700株
ガンホー・オンライン・エンター	25,100	2,984.00	74,898,400	
GMOペイメントゲートウェイ	23,100	7,926.00	183,090,600	貸付株式数 8,600株
ザッパラス	200	402.00	80,400	貸付株式数 100株
システムリサーチ	6,900	1,378.00	9,508,200	貸付株式数 700株
インターネットイニシアティブ	55,200	3,061.00	168,967,200	
さくらインターネット	15,800	4,525.00	71,495,000	貸付株式数 3,300株
GMOグローバルサインHD	3,100	2,498.00	7,743,800	貸付株式数 200株
SRAホールディングス	5,700	4,330.00	24,681,000	
システムインテグレータ	400	306.00	122,400	貸付株式数 200株
朝日ネット	10,900	625.00	6,812,500	
ｅＢＡＳＥ	14,200	681.00	9,670,200	貸付株式数 4,800株
アバントグループ	12,800	2,007.00	25,689,600	
アドソル日進	4,300	2,130.00	9,159,000	
ODKソリューションズ	300	549.00	164,700	貸付株式数 200株
フリービット	4,400	1,410.00	6,204,000	
コムチュア	13,400	2,186.00	29,292,400	
アステリア	7,900	505.00	3,989,500	貸付株式数 3,000株
アイル	5,700	3,270.00	18,639,000	貸付株式数 1,900株
王子ホールディングス	382,300	553.10	211,450,130	
日本製紙	52,600	861.00	45,288,600	貸付株式数 21,400株
三菱製紙	1,500	477.00	715,500	貸付株式数 1,400株
北越コーポレーション	56,700	1,518.00	86,070,600	貸付株式数 22,200株
中越パルプ	500	1,500.00	750,000	貸付株式数 300株
巴川コーポレーション	400	715.00	286,000	貸付株式数 300株
大王製紙	51,000	829.00	42,279,000	
阿波製紙	300	462.00	138,600	貸付株式数 200株
マークラインズ	6,000	2,405.00	14,430,000	
メディカル・データ・ビジ	12,100	444.00	5,372,400	貸付株式数 4,700株
ｇｕｍｉ	16,400	358.00	5,871,200	貸付株式数 6,300株
ショーケース	300	369.00	110,700	
モバイルファクトリー	300	935.00	280,500	貸付株式数 200株
テラスカイ	3,900	1,975.00	7,702,500	貸付株式数 1,500株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
デジタル・インフォメーション	5,300	2,173.00	11,516,900	
PCI ホールディングス	400	938.00	375,200	
アイビーシー	200	627.00	125,400	
ネオジャパン	2,700	1,875.00	5,062,500	
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	2,000	1,598.00	3,196,000	貸付株式数 700 株
ラクス	47,800	2,069.00	98,898,200	
ランドコンピュータ	500	671.00	335,500	
ダブルスタンダード	3,600	1,674.00	6,026,400	貸付株式数 1,000 株
オープンドア	7,100	691.00	4,906,100	貸付株式数 2,700 株
マイネット	400	348.00	139,200	貸付株式数 100 株
アカツキ	4,900	2,448.00	11,995,200	
ベネフィットジャパン	100	1,095.00	109,500	
UBICOM ホールディングス	3,200	1,281.00	4,099,200	
カナミックネットワーク	12,700	493.00	6,261,100	
ノムラシステムコーポレーション	1,200	119.00	142,800	
レンゴー	91,900	885.50	81,377,450	
トーモク	5,800	2,199.00	12,754,200	貸付株式数 700 株
ザ・パック	7,500	3,595.00	26,962,500	貸付株式数 1,100 株
チェンジホールディングス	25,100	1,340.00	33,634,000	
シンクロ・フード	700	419.00	293,300	貸付株式数 200 株
オークネット	4,700	2,687.00	12,628,900	貸付株式数 1,800 株
キャピタル・アセット・プラン	200	750.00	150,000	
セグエグループ	1,000	628.00	628,000	貸付株式数 900 株
エイトレッド	200	1,589.00	317,800	
マクロミル	19,400	1,196.00	23,202,400	
ビーグリー	200	1,317.00	263,400	
オロ	4,300	2,388.00	10,268,400	貸付株式数 1,600 株
ユーザーローカル	4,300	2,020.00	8,686,000	貸付株式数 1,500 株
テモナ	300	183.00	54,900	貸付株式数 200 株
ニーズウェル	1,200	298.00	357,600	貸付株式数 900 株
マネーフォワード	24,800	4,926.00	122,164,800	
サインポスト	500	445.00	222,500	貸付株式数 400 株
レゾナック・ホールディング	90,600	4,055.00	367,383,000	
住友化学	812,000	370.00	300,440,000	
住友精化	4,700	4,690.00	22,043,000	
日産化学	51,900	5,195.00	269,620,500	
ラサ工業	3,600	2,684.00	9,662,400	
クレハ	20,900	2,813.00	58,791,700	貸付株式数 4,800 株
多木化学	3,900	3,455.00	13,474,500	貸付株式数 1,500 株
テイカ	7,400	1,628.00	12,047,200	貸付株式数 1,000 株
石原産業	16,700	1,458.00	24,348,600	
片倉コープアグリ	300	965.00	289,500	貸付株式数 200 株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日本曹達	21,400	2,702.00	57,822,800	
東ソー	134,800	2,071.00	279,170,800	
トクヤマ	32,600	2,680.50	87,384,300	
セントラル硝子	12,700	3,300.00	41,910,000	
東亜合成	48,500	1,530.00	74,205,000	
大阪ソーダ	35,300	1,469.00	51,855,700	貸付株式数 2,600 株
関東電化	21,700	1,057.00	22,936,900	貸付株式数 8,400 株
SUN ASTERISK	7,200	711.00	5,119,200	貸付株式数 2,700 株
デンカ	36,700	2,126.50	78,042,550	
イビデン	58,400	4,344.00	253,689,600	貸付株式数 23,000 株
信越化学	905,300	5,546.00	5,020,793,800	
日本カーバイド	5,300	1,652.00	8,755,600	
電算システムＨＤ	4,500	2,465.00	11,092,500	貸付株式数 1,600 株
堺 化 学	7,000	2,641.00	18,487,000	
第一稀元素化学工	11,000	710.00	7,810,000	貸付株式数 4,200 株
エア・ウォーター	95,300	1,861.00	177,353,300	
日本酸素 HLDGS	97,900	4,361.00	426,941,900	
日本化学工業	3,700	2,403.00	8,891,100	
東邦アセチレン	1,100	359.00	394,900	
日本パーカライジング	45,000	1,279.00	57,555,000	
高圧ガス	14,700	796.00	11,701,200	
チタン工業	200	846.00	169,200	貸付株式数 100 株
四国化成ホールディンク	11,400	2,049.00	23,358,600	
戸田工業	2,300	1,410.00	3,243,000	貸付株式数 600 株
ステラ ケミファ	5,500	3,970.00	21,835,000	
保土谷化学	3,200	3,850.00	12,320,000	
日本触媒	64,700	1,824.00	118,012,800	
大日精化	7,000	2,883.00	20,181,000	
カネカ	24,900	3,496.00	87,050,400	
協和キリン	118,900	2,478.50	294,693,650	
APPIER GROUP	30,800	1,438.00	44,290,400	貸付株式数 12,100 株
三菱瓦斯化学	81,900	2,832.00	231,940,800	貸付株式数 32,300 株
三井化学	90,800	3,450.00	313,260,000	貸付株式数 21,600 株
東京応化工業	48,200	3,547.00	170,965,400	
大阪有機化学	8,400	2,662.00	22,360,800	貸付株式数 3,300 株
三菱ケミカルグループ	738,000	793.20	585,381,600	
ＫＨネオケム	18,200	2,054.00	37,382,800	貸付株式数 7,100 株
ビジョナル	12,000	7,884.00	94,608,000	貸付株式数 4,600 株
ダイセル	114,800	1,372.00	157,505,600	
住友ベークライト	31,800	3,673.00	116,801,400	
積水化学	201,000	2,408.50	484,108,500	
日本ゼオン	77,900	1,405.50	109,488,450	
アイカ工業	25,500	3,259.00	83,104,500	
ＵＢＥ	52,000	2,415.00	125,580,000	貸付株式数 12,000 株
積水樹脂	13,800	2,108.00	29,090,400	貸付株式数 2,000 株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
旭有機材	6,700	4,285.00	28,709,500	貸付株式数 2,600株
ニチバン	6,300	1,925.00	12,127,500	貸付株式数 800株
リケンテクノス	18,900	1,073.00	20,279,700	
大倉工業	4,700	3,090.00	14,523,000	貸付株式数 1,800株
積水化成品	14,200	363.00	5,154,600	貸付株式数 5,400株
群栄化学	2,400	2,686.00	6,446,400	
タイガース ポリマー	600	675.00	405,000	
ミライアル	400	1,423.00	569,200	貸付株式数 300株
ダイキアクシス	500	727.00	363,500	貸付株式数 300株 (300株)
ダイキョーニシカワ	22,300	610.00	13,603,000	
竹本容器	400	838.00	335,200	
森六ホールディングス	5,600	1,974.00	11,054,400	
恵和	6,500	989.00	6,428,500	貸付株式数 2,500株
日本化薬	70,700	1,278.50	90,389,950	貸付株式数 15,900株
カーリット	10,000	1,319.00	13,190,000	貸付株式数 3,900株
ソルクシーズ	900	313.00	281,700	貸付株式数 600株
CLホールディングス	2,500	837.00	2,092,500	貸付株式数 900株
プレステージ・インター	48,500	673.00	32,640,500	
フェイス	300	1,216.00	364,800	貸付株式数 200株
プロトコーポレーション	11,100	1,322.00	14,674,200	
ハイマックス	3,200	1,379.00	4,412,800	
アミューズ	6,300	1,370.00	8,631,000	貸付株式数 2,400株
野村総合研究所	219,100	4,570.00	1,001,287,000	貸付株式数 86,400株
ドリームインキュベータ	2,500	3,140.00	7,850,000	貸付株式数 100株
クイック	7,200	2,011.00	14,479,200	
ＴＡＣ	500	184.00	92,000	貸付株式数 300株
ＣＥホールディングス	500	563.00	281,500	
日本システム技術	9,400	1,921.00	18,057,400	
電通グループ	110,200	3,890.00	428,678,000	
インテージホールディングス	11,400	1,627.00	18,547,800	貸付株式数 4,300株
テイクアンドギヴニーズ	5,000	923.00	4,615,000	貸付株式数 800株
東邦システムサイエンス	4,700	1,434.00	6,739,800	貸付株式数 1,500株
ぴあ	3,500	3,100.00	10,850,000	貸付株式数 1,300株
イオンファンタジー	4,500	3,050.00	13,725,000	貸付株式数 1,700株
ソースネクスト	51,200	188.00	9,625,600	貸付株式数 20,100株
シーティーエス	14,200	886.00	12,581,200	
NEXYZ.GROUP	400	792.00	316,800	
メディカルシステムネットワーク	10,400	420.00	4,368,000	
日本精化	6,700	2,484.00	16,642,800	貸付株式数 1,600株
扶桑化学工業	9,400	3,410.00	32,054,000	
トリケミカル	11,000	2,801.00	30,811,000	貸付株式数 4,200株
シンプレクスＨＤ	19,800	2,508.00	49,658,400	
ＨＥＲＯＺ	4,000	1,014.00	4,056,000	貸付株式数 1,500株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ラクスル	24,500	1,124.00	27,538,000	
メルカリ	49,400	1,925.50	95,119,700	貸付株式数　19,400株
ＩＰＳ	2,900	2,657.00	7,705,300	
ＦＩＧ	1,300	301.00	391,300	貸付株式数　1,200株
システムサポート	3,900	1,810.00	7,059,000	
ＡＤＥＫＡ	35,200	2,720.00	95,744,000	
日油	118,800	2,260.00	268,488,000	
ミヨシ油脂	400	1,600.00	640,000	
新日本理化	1,600	199.00	318,400	貸付株式数　1,500株
ハリマ化成グループ	7,900	855.00	6,754,500	
イーソル	6,800	645.00	4,386,000	貸付株式数　2,100株
東海ソフト	200	1,320.00	264,000	
ウイングアーク1ST	10,500	3,400.00	35,700,000	
ヒト・コミュニケーションズHD	3,400	852.00	2,896,800	貸付株式数　1,200株
サーバーワークス	1,800	2,316.00	4,168,800	貸付株式数　600株
東名	200	2,403.00	480,600	
ヴィッツ	100	810.00	81,000	
トビラシステムズ	300	763.00	228,900	
Ｓａｎｓａｎ	33,300	2,135.00	71,095,500	貸付株式数　13,100株
LINK-Uグループ	200	470.00	94,000	
ギフティ	8,900	1,395.00	12,415,500	貸付株式数　2,800株
花 王	245,800	6,530.00	1,605,074,000	
第一工業製薬	3,600	3,800.00	13,680,000	
石原ケミカル	4,400	2,588.00	11,387,200	貸付株式数　1,600株
日華化学	500	1,158.00	579,000	
ニイタカ	200	1,855.00	371,000	貸付株式数　100株
三洋化成	6,200	3,950.00	24,490,000	
メドレー	11,100	4,370.00	48,507,000	貸付株式数　4,300株
ベース	5,000	3,260.00	16,300,000	貸付株式数　1,000株
ＪＭＤＣ	12,300	4,150.00	51,045,000	貸付株式数　6,000株
武田薬品	899,400	4,119.00	3,704,628,600	
アステラス製薬	886,700	1,584.00	1,404,532,800	
住友ファーマ	90,000	571.00	51,390,000	
塩野義製薬	335,300	2,123.50	712,009,550	
わかもと製薬	1,300	239.00	310,700	貸付株式数　500株
日本新薬	26,500	4,345.00	115,142,500	
中外製薬	316,400	6,605.00	2,089,822,000	
科研製薬	17,300	4,317.00	74,684,100	
エーザイ	134,100	4,641.00	622,358,100	
理研ビタミン	8,600	2,487.00	21,388,200	
ロート製薬	106,800	2,908.00	310,574,400	
小野薬品	206,800	1,733.00	358,384,400	
久光製薬	22,500	4,234.00	95,265,000	貸付株式数　8,400株
有機合成薬品	900	262.00	235,800	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
持田製薬	12,700	3,385.00	42,989,500	
参天製薬	192,100	1,705.00	327,530,500	
扶桑薬品	3,900	2,595.00	10,120,500	
日本ケミファ	100	1,533.00	153,300	
ツムラ	34,700	4,890.00	169,683,000	
テ ル モ	674,200	3,068.00	2,068,445,600	貸付株式数 86,500株
ＨＵグループＨＤ	30,300	2,448.50	74,189,550	貸付株式数 9,400株
キッセイ薬品工業	16,700	3,700.00	61,790,000	
生化学工業	19,300	801.00	15,459,300	
栄研化学	16,000	2,187.00	34,992,000	貸付株式数 3,800株
鳥居薬品	5,400	4,730.00	25,542,000	
ＪＣＲファーマ	34,200	739.00	25,273,800	
東和薬品	13,600	2,797.00	38,039,200	
富士製薬工業	7,500	1,635.00	12,262,500	貸付株式数 2,900株
ゼリア新薬工業	16,000	2,323.00	37,168,000	
ネクセラファーマ	47,400	1,128.00	53,467,200	貸付株式数 17,800株
第一三共	954,000	4,871.00	4,646,934,000	
杏林製薬	21,900	1,472.00	32,236,800	貸付株式数 8,500株
大幸薬品	22,900	359.00	8,221,100	貸付株式数 8,800株
ダイト	7,500	2,090.00	15,675,000	
大塚ホールディングス	252,300	8,849.00	2,232,602,700	
ペプチドリーム	49,000	2,984.50	146,240,500	貸付株式数 1,200株
大日本塗料	11,200	1,137.00	12,734,400	
日本ペイントHOLD	446,700	1,042.50	465,684,750	
関西ペイント	84,500	2,142.50	181,041,250	
神東塗料	900	129.00	116,100	貸付株式数 800株
中国塗料	22,800	2,340.00	53,352,000	
日本特殊塗料	800	1,249.00	999,200	
藤倉化成	12,800	524.00	6,707,200	
太陽ホールディングス	17,600	4,255.00	74,888,000	
ＤＩＣ	35,900	3,275.00	117,572,500	
サカタインクス	22,500	1,528.00	34,380,000	
ARTIENCE	18,100	3,170.00	57,377,000	
アルプス技研	9,000	2,565.00	23,085,000	
サニックス	14,800	262.00	3,877,600	
日本空調サービス	11,100	1,006.00	11,166,600	
オリエンタルランド	616,800	3,488.00	2,151,398,400	貸付株式数 61,900株
フォーカスシステムズ	6,800	1,097.00	7,459,600	
ダスキン	22,600	3,750.00	84,750,000	
パーク２４	77,400	1,795.00	138,933,000	
明光ネットワークジャパン	12,600	720.00	9,072,000	貸付株式数 4,400株
ファルコホールディングス	4,200	2,250.00	9,450,000	
クレスコ	16,600	1,240.00	20,584,000	
フジ・メディア・HD	97,100	1,732.50	168,225,750	
秀英予備校	200	264.00	52,800	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
田谷	200	333.00	66,600	
ラウンドワン	97,800	1,079.00	105,526,200	
リゾートトラスト	40,900	3,050.00	124,745,000	貸付株式数　11,000株
オービック	187,700	4,937.00	926,674,900	
ジャストシステム	14,500	3,500.00	50,750,000	
ＴＤＣソフト	17,000	1,320.00	22,440,000	
ＬＩＮＥヤフー	1,617,100	418.30	676,432,930	
ビー・エム・エル	12,800	2,833.00	36,262,400	
トレンドマイクロ	53,100	8,315.00	441,526,500	
ID ホールディングス	6,800	1,636.00	11,124,800	
リソー教育	64,800	292.00	18,921,600	
日本オラクル	19,300	15,250.00	294,325,000	貸付株式数　6,700株
早稲田アカデミー	5,700	1,835.00	10,459,500	貸付株式数　2,100株 (900株)
アルファシステムズ	3,200	3,460.00	11,072,000	
フューチャー	25,200	1,898.00	47,829,600	
CAC HOLDINGS	6,200	1,736.00	10,763,200	
トーセ	300	615.00	184,500	貸付株式数　200株
ユー・エス・エス	213,100	1,393.00	296,848,300	
オービックビジネスＣ	17,100	7,178.00	122,743,800	貸付株式数　5,500株
アイティフォー	11,900	1,400.00	16,660,000	
東京個別指導学院	12,300	390.00	4,797,000	貸付株式数　400株
東計電算	2,800	4,340.00	12,152,000	
サイバーエージェント	229,000	1,029.50	235,755,500	
楽天グループ	730,000	847.20	618,456,000	貸付株式数　297,500株
エックスネット	200	1,449.00	289,800	貸付株式数　100株
クリーク・アンド・リバー社	5,200	1,591.00	8,273,200	
SBI グローバルアセット	20,300	672.00	13,641,600	
テー・オー・ダブリュー	20,300	312.00	6,333,600	
大塚商会	114,600	3,763.00	431,239,800	貸付株式数　45,200株
サイボウズ	13,900	2,144.00	29,801,600	貸付株式数　5,200株
山田コンサルティング GP	5,200	2,031.00	10,561,200	
セントラルスポーツ	3,900	2,414.00	9,414,600	貸付株式数　1,400株
パラカ	3,100	1,779.00	5,514,900	
電通総研	9,800	5,400.00	52,920,000	
ＡＣＣＥＳＳ	10,500	947.00	9,943,500	貸付株式数　4,100株
デジタルガレージ	16,200	3,775.00	61,155,000	
イーエムシステムズ	16,900	724.00	12,235,600	
ウェザーニューズ	6,200	2,897.00	17,961,400	貸付株式数　1,800株
ＣＩＪ	25,200	448.00	11,289,600	
ビジネスエンジニアリング	2,400	3,855.00	9,252,000	貸付株式数　500株
日本エンタープライズ	1,100	105.00	115,500	
ＷＯＷＯＷ	7,600	993.00	7,546,800	貸付株式数　2,900株
スカラ	9,400	443.00	4,164,200	貸付株式数　3,600株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
インテリジェント ウェイブ	600	1,098.00	658,800	
フルキャストホールディングス	8,500	1,462.00	12,427,000	
エン・ジャパン	16,900	2,076.00	35,084,400	
セルソース	6,700	1,085.00	7,269,500	貸付株式数 2,500株
あすか製薬ＨＤ	9,200	2,000.00	18,400,000	
サワイグループHD	59,500	2,154.00	128,163,000	貸付株式数 14,200株
富士フイルムHLDGS	609,500	3,403.00	2,074,128,500	
コニカミノルタ	227,300	661.50	150,358,950	
資 生 堂	211,100	2,666.50	562,898,150	
ライオン	128,600	1,794.00	230,708,400	
高砂香料	6,800	5,460.00	37,128,000	
マンダム	20,000	1,286.00	25,720,000	
ミルボン	16,200	3,460.00	56,052,000	
コーセー	20,600	6,636.00	136,701,600	貸付株式数 8,100株
コタ	10,200	1,610.00	16,422,000	
シーボン	200	1,117.00	223,400	貸付株式数 100株
ポーラ・オルビスHD	51,800	1,382.00	71,587,600	貸付株式数 19,100株
ノエビアホールディングス	9,000	4,925.00	44,325,000	
アジュバンホールディング	300	821.00	246,300	貸付株式数 200株 (200株)
新日本製薬	5,800	1,929.00	11,188,200	貸付株式数 2,100株
アクシージア	6,700	557.00	3,731,900	貸付株式数 2,500株
エステー	8,200	1,491.00	12,226,200	
アグロカネショウ	3,400	1,896.00	6,446,400	
コ ニ シ	31,800	1,357.00	43,152,600	貸付株式数 12,500株
長谷川香料	19,300	3,300.00	63,690,000	貸付株式数 1,700株
小林製薬	26,500	5,905.00	156,482,500	
荒川化学工業	9,300	1,114.00	10,360,200	
メック	8,300	3,365.00	27,929,500	貸付株式数 3,200株
日本高純度化学	2,500	3,250.00	8,125,000	
タカラバイオ	31,800	1,034.00	32,881,200	
ＪＣＵ	11,200	3,995.00	44,744,000	
新田ゼラチン	800	749.00	599,200	貸付株式数 700株
ＯＡＴアグリオ	4,200	2,017.00	8,471,400	貸付株式数 1,600株
デクセリアルズ	88,500	2,439.00	215,851,500	貸付株式数 14,700株
アース製薬	9,200	5,440.00	50,048,000	
北興化学	9,000	1,311.00	11,799,000	
大成ラミック	2,900	2,505.00	7,264,500	
クミアイ化学	40,200	789.00	31,717,800	貸付株式数 6,900株
日本農薬	15,400	675.00	10,395,000	
富士興産	300	1,392.00	417,600	
ニチレキグループ	10,700	2,410.00	25,787,000	
ユシロ化学	5,200	2,090.00	10,868,000	
ビーピー・カストロール	500	882.00	441,000	貸付株式数 400株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
富士石油	26,500	292.00	7,738,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	400	1,269.00	507,600	
出光興産	472,400	1,004.50	474,525,800	
ENEOS ホールディングス	1,714,600	819.70	1,405,457,620	
コスモエネルギーHLDGS	33,300	6,557.00	218,348,100	
テスホールディングス	21,200	276.00	5,851,200	貸付株式数 8,000 株
インフロニアＨＤ	103,600	1,207.50	125,097,000	
横浜ゴム	51,100	3,047.00	155,701,700	
TOYO TIRE	58,100	2,353.50	136,738,350	
ブリヂストン	295,900	5,356.00	1,584,840,400	貸付株式数 116,800 株
住友ゴム	99,100	1,643.00	162,821,300	
藤倉コンポジット	9,700	1,472.00	14,278,400	
オカモト	5,400	5,510.00	29,754,000	
アキレス	5,500	1,444.00	7,942,000	貸付株式数 2,100 株
フ コ ク	6,000	1,719.00	10,314,000	貸付株式数 2,100 株
ニッタ	9,900	3,545.00	35,095,500	貸付株式数 1,000 株
クリエートメディック	400	908.00	363,200	
住友理工	19,600	1,541.00	30,203,600	
三ツ星ベルト	14,100	4,100.00	57,810,000	貸付株式数 2,900 株
バンドー化学	15,000	1,807.00	27,105,000	
ＡＧＣ	98,300	4,709.00	462,894,700	
日本板硝子	51,700	334.00	17,267,800	貸付株式数 19,900 株
石塚硝子	200	2,400.00	480,000	貸付株式数 100 株
有沢製作所	15,200	1,441.00	21,903,200	
日本山村硝子	500	1,684.00	842,000	
日本電気硝子	37,500	3,419.00	128,212,500	
オハラ	4,800	1,205.00	5,784,000	貸付株式数 1,800 株
住友大阪セメント	18,100	3,340.00	60,454,000	貸付株式数 6,100 株
太平洋セメント	62,400	3,818.00	238,243,200	
リソルホールディングス	200	5,010.00	1,002,000	
日本ヒューム	8,800	1,303.00	11,466,400	貸付株式数 3,200 株
日本コンクリート	19,600	381.00	7,467,600	貸付株式数 7,400 株
三谷セキサン	4,200	5,670.00	23,814,000	貸付株式数 700 株
アジアパイルＨＤ	14,400	835.00	12,024,000	
東海カーボン	93,300	907.80	84,697,740	貸付株式数 36,600 株
日本カーボン	5,800	4,420.00	25,636,000	
東洋炭素	7,100	4,415.00	31,346,500	貸付株式数 2,800 株
ノリタケ	11,200	3,740.00	41,888,000	
ＴＯＴＯ	73,400	4,018.00	294,921,200	貸付株式数 25,000 株
日本碍子	117,600	1,971.50	231,848,400	
日本特殊陶業	82,600	4,647.00	383,842,200	
ダントーホールディングス	400	309.00	123,600	貸付株式数 200 株
ＭＡＲＵＷＡ	4,200	43,490.00	182,658,000	貸付株式数 1,400 株
品川リフラクトリーズ	12,400	1,666.00	20,658,400	貸付株式数 3,500 株
黒崎播磨	6,900	2,350.00	16,215,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ヨータイ	5,200	1,550.00	8,060,000	
東京窯業	1,300	410.00	533,000	
ニッカトー	500	517.00	258,500	
フジミインコーポレーテッド	27,200	2,372.00	64,518,400	
クニミネ工業	400	1,008.00	403,200	貸付株式数 300株
エーアンドエーマテリアル	300	1,243.00	372,900	
ニチアス	25,600	5,895.00	150,912,000	
日本製鉄	526,600	3,060.00	1,611,396,000	
神戸製鋼所	209,100	1,557.50	325,673,250	貸付株式数 60,300株
中山製鋼所	21,400	726.00	15,536,400	貸付株式数 8,400株
合同製鐵	5,800	3,815.00	22,127,000	貸付株式数 2,200株
ＪＦＥホールディングス	313,300	1,711.50	536,212,950	貸付株式数 49,700株
東京製鐵	29,000	1,477.00	42,833,000	貸付株式数 11,400株
共英製鋼	10,200	1,733.00	17,676,600	
大和工業	19,600	7,730.00	151,508,000	
東京鐵鋼	4,600	6,370.00	29,302,000	貸付株式数 1,700株
大阪製鐵	4,800	3,380.00	16,224,000	貸付株式数 1,800株
淀川製鋼所	9,600	5,200.00	49,920,000	貸付株式数 3,700株
中部鋼鈑	6,800	2,174.00	14,783,200	貸付株式数 2,600株
丸一鋼管	31,700	3,235.00	102,549,500	
モリ工業	2,600	4,680.00	12,168,000	
大同特殊鋼	65,500	1,170.00	76,635,000	
日本高周波	500	374.00	187,000	貸付株式数 400株
日本冶金工	7,000	3,940.00	27,580,000	
山陽特殊製鋼	10,300	1,812.00	18,663,600	
愛知製鋼	6,000	4,800.00	28,800,000	
日本金属	300	651.00	195,300	貸付株式数 200株
ミガロホールディングス	400	1,625.00	650,000	貸付株式数 300株
大平洋金属	9,600	1,409.00	13,526,400	貸付株式数 2,200株
新日本電工	62,100	289.00	17,946,900	
栗本鉄工所	4,800	4,115.00	19,752,000	
虹 技	200	1,166.00	233,200	貸付株式数 100株
日本鋳鉄管	200	1,100.00	220,000	貸付株式数 100株
日本製鋼所	30,800	6,549.00	201,709,200	
三菱製鋼	7,700	1,389.00	10,695,300	
日亜鋼業	1,100	301.00	331,100	
日本精線	8,200	1,273.00	10,438,600	
エンビプロＨＤ	10,200	414.00	4,222,800	貸付株式数 3,900株 (1,400株)
大紀アルミニウム	14,800	1,061.00	15,702,800	貸付株式数 4,900株
日本軽金属ＨＤ	30,400	1,529.00	46,481,600	
三井金属	26,000	4,811.00	125,086,000	
東邦亜鉛	8,200	826.00	6,773,200	貸付株式数 3,100株
三菱マテリアル	74,300	2,426.00	180,251,800	貸付株式数 26,200株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
住友鉱山	131,500	3,707.00	487,470,500	貸付株式数　34,700株
DOWAホールディングス	28,000	4,499.00	125,972,000	貸付株式数　11,000株
古河機金	13,700	1,580.00	21,646,000	
エス・サイエンス	6,800	22.00	149,600	貸付株式数　6,400株
大阪チタニウム	18,000	2,001.00	36,018,000	貸付株式数　7,000株
東邦チタニウム	21,500	1,074.00	23,091,000	貸付株式数　8,200株
ＵＡＣＪ	14,600	5,450.00	79,570,000	
ＣＫサンエツ	2,500	3,725.00	9,312,500	貸付株式数　500株
古河電工	34,600	6,418.00	222,062,800	
住友電工	359,100	2,949.00	1,058,985,900	
フジクラ	111,500	5,662.00	631,313,000	
ＳＷＣＣ	13,900	7,900.00	109,810,000	貸付株式数　5,400株
カナレ電気	200	1,422.00	284,400	
平河ヒューテック	6,600	1,490.00	9,834,000	貸付株式数　1,500株
いよぎんホールディンク	129,900	1,592.00	206,800,800	
しずおかフィナンシャルク	218,600	1,367.00	298,826,200	
ちゅうぎんフィナンシャ	83,600	1,693.50	141,576,600	
楽天銀行	46,000	4,466.00	205,436,000	貸付株式数　9,300株
京都フィナンシャルＧ	124,900	2,369.00	295,888,100	貸付株式数　33,000株
リョービ	11,100	2,150.00	23,865,000	
アーレステイ	1,200	513.00	615,600	
AREホールディングス	42,100	1,723.00	72,538,300	
東洋製罐グループHD	66,300	2,389.00	158,390,700	
ホッカンホールディングス	5,600	1,703.00	9,536,800	
コロナ	5,800	940.00	5,452,000	
横河ブリッジHLDGS	17,900	2,758.00	49,368,200	
駒井ハルテック	200	1,552.00	310,400	
高田機工	300	1,002.00	300,600	
三和ホールディングス	102,700	4,553.00	467,593,100	
文化シヤツター	27,200	1,858.00	50,537,600	
三協立山	13,100	699.00	9,156,900	貸付株式数　3,500株
アルインコ	7,900	973.00	7,686,700	貸付株式数　1,100株
東洋シヤツター	300	781.00	234,300	
ＬＩＸＩＬ	151,600	1,703.00	258,174,800	
日本フイルコン	800	499.00	399,200	貸付株式数　700株
ノーリツ	14,600	1,708.00	24,936,800	
長府製作所	11,600	1,896.00	21,993,600	
リンナイ	55,300	3,186.00	176,185,800	貸付株式数　20,800株
ユニプレス	18,100	969.00	17,538,900	貸付株式数　7,000株
ダイニチ工業	600	617.00	370,200	
日東精工	15,100	617.00	9,316,700	
三洋工業	100	2,869.00	286,900	
岡　部	18,600	788.00	14,656,800	
ジーテクト	11,600	1,577.00	18,293,200	
東　プ　レ	18,300	1,892.00	34,623,600	貸付株式数　2,300株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
高周波熱錬	15,400	974.00	14,999,600	貸付株式数 5,400株
東京製綱	6,100	1,241.00	7,570,100	貸付株式数 2,400株
サンコール	11,600	304.00	3,526,400	貸付株式数 4,400株
モリテックスチル	1,000	165.00	165,000	貸付株式数 400株
パイオラックス	14,000	2,442.00	34,188,000	貸付株式数 700株
エイチワン	10,700	1,019.00	10,903,300	
日本発条	92,000	1,740.00	160,080,000	貸付株式数 36,200株
中央発條	6,700	1,320.00	8,844,000	
アドバネクス	100	772.00	77,200	
三浦工業	47,200	3,841.00	181,295,200	
タ ク マ	34,400	1,643.00	56,519,200	
テクノプロ・ホールディング	60,200	2,788.50	167,867,700	
アトラグループ	400	131.00	52,400	貸付株式数 200株
アイ・アールジャパンHD	5,400	790.00	4,266,000	貸付株式数 2,000株
ＫｅｅＰｅｒ技研	6,400	4,255.00	27,232,000	貸付株式数 2,500株
楽待	400	705.00	282,000	貸付株式数 300株
三機サービス	200	939.00	187,800	貸付株式数 100株
Ｇｕｎｏｓｙ	8,200	699.00	5,731,800	貸付株式数 300株
デザインワン・ジャパン	600	113.00	67,800	貸付株式数 200株
イー・ガーディアン	4,900	1,835.00	8,991,500	
リブセンス	600	151.00	90,600	貸付株式数 500株
ジャパンマテリアル	31,700	1,655.00	52,463,500	
ベクトル	14,100	975.00	13,747,500	
ウチヤマホールディングス	600	314.00	188,400	貸付株式数 500株 (400株)
チャームケアコーポレーション	8,600	1,290.00	11,094,000	
キャリアリンク	3,800	2,461.00	9,351,800	
ＩＢＪ	7,900	622.00	4,913,800	貸付株式数 2,200株
アサンテ	5,100	1,641.00	8,369,100	貸付株式数 1,800株
バリューＨＲ	9,300	1,932.00	17,967,600	貸付株式数 3,500株 (400株)
M&Aキャピタルパートナー	8,400	2,628.00	22,075,200	
ライドオンエクスプレスHD	4,100	997.00	4,087,700	
ERIホールディングス	400	2,135.00	854,000	貸付株式数 300株
アビスト	200	3,025.00	605,000	貸付株式数 100株
シグマクシス・ホールディンク	30,200	920.00	27,784,000	
ウィルグループ	8,700	959.00	8,343,300	
エスクローＡＪ	1,400	142.00	198,800	
メドピア	8,300	486.00	4,033,800	貸付株式数 3,200株
レアジョブ	300	392.00	117,600	
リクルートホールディングス	808,400	10,620.00	8,585,208,000	※
エラン	13,700	676.00	9,261,200	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ツ ガ ミ	21,700	1,363.00	29,577,100	
オークマ	17,800	3,155.00	56,159,000	
芝浦機械	13,100	3,445.00	45,129,500	貸付株式数 3,700株
アマダ	141,400	1,455.00	205,737,000	
アイダエンジニア	22,800	783.00	17,852,400	
ＦＵＪＩ	44,200	2,171.00	95,958,200	
牧野フライス	11,300	6,640.00	75,032,000	
オーエスジー	44,900	1,769.00	79,428,100	
ダイジェット	200	700.00	140,000	貸付株式数 100株
旭ダイヤモンド	25,400	806.00	20,472,400	
DMG森精機	64,200	2,573.50	165,218,700	
ソデイツク	26,800	719.00	19,269,200	
ディスコ	49,000	41,330.00	2,025,170,000	
日東工器	3,900	2,705.00	10,549,500	貸付株式数 1,700株
日進工具	8,500	740.00	6,290,000	
パンチ工業	1,200	398.00	477,600	貸付株式数 1,100株
冨士ダイス	7,500	773.00	5,797,500	貸付株式数 1,900株
土木管理総合試験	500	307.00	153,500	
日本郵政	1,160,400	1,545.00	1,792,818,000	
ベルシステム24HLDGS	11,100	1,243.00	13,797,300	
鎌倉新書	8,800	535.00	4,708,000	貸付株式数 2,100株 (1,700株)
ＳＭＮ	300	318.00	95,400	
一蔵	200	401.00	80,200	貸付株式数 100株
グローバルキッズCOMP	200	701.00	140,200	
エアトリ	7,600	1,085.00	8,246,000	貸付株式数 2,900株
アトラエ	7,300	880.00	6,424,000	貸付株式数 2,800株
ストライク	5,100	3,860.00	19,686,000	貸付株式数 1,800株
ソラスト	28,500	466.00	13,281,000	
セラク	3,100	1,317.00	4,082,700	貸付株式数 1,100株
インソース	22,500	1,073.00	24,142,500	
豊田自動織機	86,000	11,255.00	967,930,000	
豊和工業	700	1,095.00	766,500	
石川製作所	300	1,400.00	420,000	貸付株式数 200株
リケンＮＰＲ	12,800	2,400.00	30,720,000	貸付株式数 5,000株
東洋機械金属	1,000	640.00	640,000	
津田駒工業	300	350.00	105,000	貸付株式数 200株
エンシュウ	300	568.00	170,400	
島精機製作所	16,200	1,062.00	17,204,400	貸付株式数 6,200株
オプトラン	16,700	1,857.00	31,011,900	
イワキポンプ	6,800	2,631.00	17,890,800	貸付株式数 800株
フリュー	9,600	1,089.00	10,454,400	
ヤマシンフィルタ	21,500	599.00	12,878,500	貸付株式数 8,400株
日阪製作所	12,300	995.00	12,238,500	
やまびこ	16,600	2,514.00	41,732,400	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
野村マイクロ・サイエンス	16,800	1,757.00	29,517,600	貸付株式数 6,600株 (100株)
平田機工	4,900	5,200.00	25,480,000	貸付株式数 600株
ＰＥＧＡＳＵＳ	11,200	433.00	4,849,600	
マルマエ	4,400	1,591.00	7,000,400	貸付株式数 1,700株
タツモ	7,300	2,562.00	18,702,600	貸付株式数 2,800株
ナブテスコ	63,900	2,434.50	155,564,550	
三井海洋開発	12,900	3,175.00	40,957,500	
レオン自動機	10,700	1,415.00	15,140,500	
ＳＭＣ	30,500	64,590.00	1,969,995,000	
ホソカワミクロン	7,100	3,935.00	27,938,500	
ユニオンツール	4,500	5,320.00	23,940,000	
瑞 光	6,500	1,252.00	8,138,000	貸付株式数 2,700株
オイレス工業	13,800	2,376.00	32,788,800	
日精エーエスビー	3,500	5,070.00	17,745,000	
サトーホールディングス	12,700	2,230.00	28,321,000	
技研製作所	9,600	1,731.00	16,617,600	貸付株式数 3,600株
日本エアーテック	4,800	1,229.00	5,899,200	
カ ワ タ	400	798.00	319,200	
日精樹脂工業	6,700	910.00	6,097,000	
オカダアイヨン	400	1,830.00	732,000	
ワイエイシイホールディングス	5,100	1,914.00	9,761,400	貸付株式数 2,000株
小松製作所	501,800	4,066.00	2,040,318,800	
住友重機械	60,200	3,249.00	195,589,800	
日立建機	40,500	3,383.00	137,011,500	貸付株式数 16,000株
日 工	15,100	707.00	10,675,700	
巴工業	4,000	3,810.00	15,240,000	
井関農機	9,500	946.00	8,987,000	貸付株式数 3,500株
ＴＯＷＡ	31,200	1,587.00	49,514,400	貸付株式数 12,600株
丸山製作所	200	2,026.00	405,200	
北川鉄工所	4,000	1,204.00	4,816,000	
シンニッタン	1,400	200.00	280,000	
ローツェ	53,200	1,663.00	88,471,600	貸付株式数 17,100株
タカキタ	400	389.00	155,600	貸付株式数 100株
クボタ	532,200	1,871.50	996,012,300	
荏原実業	4,900	4,330.00	21,217,000	
東洋エンジニア	14,500	713.00	10,338,500	貸付株式数 5,700株
三菱化工機	3,600	3,200.00	11,520,000	
月島ホールディングス	13,800	1,494.00	20,617,200	
帝国電機製作所	7,000	2,760.00	19,320,000	
東京機械	300	356.00	106,800	
新東工業	22,600	922.00	20,837,200	貸付株式数 4,500株
渋谷工業	9,500	3,895.00	37,002,500	
アイチ コーポレーション	16,900	1,382.00	23,355,800	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
小森コーポレーション	25,100	1,132.00	28,413,200	
鶴見製作所	7,800	3,575.00	27,885,000	
日本ギア工業	500	460.00	230,000	貸付株式数 300株
酒井重工業	4,000	2,371.00	9,484,000	
荏原製作所	209,000	2,264.50	473,280,500	
酉島製作所	8,800	2,400.00	21,120,000	
北越工業	10,200	1,689.00	17,227,800	貸付株式数 3,900株
ダイキン工業	132,600	18,170.00	2,409,342,000	
オルガノ	15,700	8,860.00	139,102,000	貸付株式数 600株
トーヨーカネツ	3,800	4,160.00	15,808,000	
栗田工業	56,900	5,706.00	324,671,400	貸付株式数 3,000株
椿本チエイン	46,100	1,892.00	87,221,200	
大同工業	500	737.00	368,500	
日 機 装	26,100	953.00	24,873,300	
木村化工機	7,800	966.00	7,534,800	
レイズネクスト	14,300	1,524.00	21,793,200	
アネスト岩田	17,300	1,408.00	24,358,400	
ダイフク	171,800	3,221.00	553,367,800	
サムコ	2,400	2,855.00	6,852,000	貸付株式数 900株
加藤製作所	700	1,327.00	928,900	
油研工業	200	2,539.00	507,800	
タダノ	58,600	1,153.50	67,595,100	貸付株式数 4,600株
フジテック	32,700	5,824.00	190,444,800	
ＣＫＤ	28,200	2,486.00	70,105,200	
平和	33,900	2,095.00	71,020,500	
理想科学工業	8,100	3,450.00	27,945,000	貸付株式数 3,000株
ＳＡＮＫＹＯ	117,600	2,130.50	250,546,800	
日本金銭機械	12,300	1,022.00	12,570,600	貸付株式数 4,700株
マースグループHLDGS	6,900	3,245.00	22,390,500	貸付株式数 2,200株
フクシマガリレイ	7,500	5,500.00	41,250,000	
オーイズミ	400	336.00	134,400	貸付株式数 100株
ダイコク電機	4,500	3,295.00	14,827,500	貸付株式数 1,700株
竹内製作所	18,500	4,850.00	89,725,000	貸付株式数 7,200株
ア マ ノ	28,900	4,312.00	124,616,800	
ＪＵＫＩ	15,800	385.00	6,083,000	貸付株式数 5,900株
サンデン	2,000	149.00	298,000	貸付株式数 1,700株
ジャノメ	8,800	1,076.00	9,468,800	
ブラザー工業	136,000	2,664.00	362,304,000	
マックス	12,500	3,440.00	43,000,000	貸付株式数 2,700株
モリタホールディングス	15,900	2,138.00	33,994,200	
グローリー	26,700	2,523.50	67,377,450	
新晃工業	30,900	1,439.00	44,465,100	貸付株式数 4,500株
大和冷機工業	15,600	1,487.00	23,197,200	
セガサミーホールディングス	90,900	2,635.00	239,521,500	貸付株式数 35,800株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ＴＰＲ	12,900	2,331.00	30,069,900	貸付株式数　1,000株
ツバキ・ナカシマ	25,100	524.00	13,152,400	
ホシザキ	65,500	6,154.00	403,087,000	
大豊工業	8,800	611.00	5,376,800	貸付株式数　3,400株
日本精工	188,400	666.30	125,530,920	
Ｎ Ｔ Ｎ	240,800	239.60	57,695,680	貸付株式数　95,200株
ジェイテクト	90,600	1,058.00	95,854,800	
不 二 越	7,500	3,095.00	23,212,500	貸付株式数　2,900株
ミネベアミツミ	177,100	2,469.00	437,259,900	
日本トムソン	27,700	486.00	13,462,200	
Ｔ Ｈ Ｋ	58,700	3,682.00	216,133,400	
ユーシン精機	9,400	670.00	6,298,000	
前澤給装工業	7,300	1,348.00	9,840,400	
イーグル工業	11,300	1,916.00	21,650,800	貸付株式数　4,100株
前澤工業	700	1,184.00	828,800	
ＰＩＬＬＡＲ	9,400	4,395.00	41,313,000	
キッツ	34,100	1,111.00	37,885,100	
日 立	2,621,200	3,946.00	10,343,255,200	※
三菱電機	1,035,400	2,568.50	2,659,424,900	
富士電機	61,900	8,692.00	538,034,800	
東洋電機製造	400	1,078.00	431,200	
安川電機	110,600	3,963.00	438,307,800	貸付株式数　8,200株
シンフォニア テクノロジー	10,100	5,850.00	59,085,000	
明 電 舎	17,200	4,005.00	68,886,000	
オリジン	200	1,153.00	230,600	
山洋電気	4,400	8,320.00	36,608,000	
デンヨー	7,800	2,748.00	21,434,400	
PHCホールディングス	19,000	923.00	17,537,000	貸付株式数　7,100株
KOKUSAI ELECTRIC	71,300	2,500.00	178,250,000	貸付株式数　28,100株
ソシオネクスト	101,400	2,479.00	251,370,600	貸付株式数　10,900株
ベイカレント	76,100	5,633.00	428,671,300	
ORCHESTRA HLDGS	2,300	813.00	1,869,900	
アイモバイル	13,100	538.00	7,047,800	
ディスラプターズ	700	155.00	108,500	貸付株式数　200株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	5,700	1,054.00	6,007,800	貸付株式数　500株
船場	200	1,302.00	260,400	
ジャパンエレベーターSHD	40,300	2,770.00	111,631,000	
フルテック	200	1,187.00	237,400	貸付株式数　100株 (100株)
グリーンズ	400	1,811.00	724,400	
ツナググループHLDGS	300	641.00	192,300	貸付株式数　100株
GAMEWITH	500	220.00	110,000	貸付株式数　400株
MS&CONSULTING	100	452.00	45,200	
エル・ティー・エス	1,400	2,394.00	3,351,600	貸付株式数　500株
ミダックホールディングス	6,300	1,673.00	10,539,900	貸付株式数　2,400株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
キュービーネット HLDGS	5,900	1,018.00	6,006,200	
オープングループ	16,400	197.00	3,230,800	貸付株式数 5,200 株
三桜工業	14,000	728.00	10,192,000	貸付株式数 5,400 株
マキタ	126,600	4,700.00	595,020,000	
東芝テック	15,200	3,635.00	55,252,000	
芝浦メカトロニクス	7,400	7,790.00	57,646,000	
マブチモーター	44,700	2,224.00	99,412,800	
ニデック	449,500	2,748.50	1,235,450,750	
ユーエムシーエレクトロニクス	6,400	324.00	2,073,600	貸付株式数 2,200 株
トレックス・セミコンダクター	4,800	1,287.00	6,177,600	
東光高岳	5,500	2,003.00	11,016,500	貸付株式数 2,100 株
ダブル・スコープ	31,200	284.00	8,860,800	貸付株式数 12,000 株
宮越ホールディングス	4,500	1,871.00	8,419,500	貸付株式数 1,700 株
ダイヘン	9,700	7,050.00	68,385,000	
ヤーマン	19,800	766.00	15,166,800	貸付株式数 7,600 株 (200 株)
ＪＶＣケンウッド	80,400	1,499.00	120,519,600	
ミマキエンジニアリング	8,500	1,456.00	12,376,000	
Ｉ－ＰＥＸ	5,400	2,944.00	15,897,600	
大崎電気	21,800	765.00	16,677,000	
オムロン	93,300	4,741.00	442,335,300	貸付株式数 9,300 株
日東工業	13,700	2,829.00	38,757,300	貸付株式数 5,200 株
ＩＤＥＣ	15,000	2,423.00	36,345,000	
正興電機製作所	400	1,216.00	486,400	貸付株式数 100 株
不二電機工業	300	1,139.00	341,700	貸付株式数 200 株
ジーエス・ユアサ コーポ	45,400	2,587.00	117,449,800	貸付株式数 17,900 株
サクサ	300	2,830.00	849,000	
メルコホールディングス	2,300	2,196.00	5,050,800	
テクノメディカ	2,000	1,802.00	3,604,000	貸付株式数 900 株
ダイヤモンドエレクトリク HD	4,100	529.00	2,168,900	貸付株式数 1,600 株
日本電気	144,000	13,060.00	1,880,640,000	
富 士 通	936,700	2,863.00	2,681,772,100	
沖 電 気	49,300	938.00	46,243,400	
電気興業	4,100	1,677.00	6,875,700	
サンケン電気	10,400	6,300.00	65,520,000	貸付株式数 1,800 株
ナカヨ	200	1,131.00	226,200	
アイホン	6,200	2,709.00	16,795,800	
ルネサスエレクトロニクス	775,500	2,017.50	1,564,571,250	
セイコーエプソン	130,600	2,750.00	359,150,000	貸付株式数 49,100 株
ワコム	71,500	713.00	50,979,500	
アルバック	22,300	6,299.00	140,467,700	
アクセル	5,100	1,285.00	6,553,500	
ＥＩＺＯ	13,300	2,183.00	29,033,900	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ジャパンディスプレイ	61,700	20.00	1,234,000	
日本信号	23,200	913.00	21,181,600	
京三製作所	23,700	529.00	12,537,300	
能美防災	13,800	2,962.00	40,875,600	
ホーチキ	6,500	2,373.00	15,424,500	
星和電機	500	537.00	268,500	
エレコム	24,300	1,446.00	35,137,800	
パナソニック ホールディンク	1,202,600	1,453.00	1,747,377,800	
シャープ	147,100	951.90	140,024,490	貸付株式数 58,000株
アンリツ	71,700	1,159.50	83,136,150	貸付株式数 28,300株
富士通ゼネラル	28,900	2,053.00	59,331,700	
ソニーグループ	3,529,500	3,014.00	10,637,913,000	
Ｔ Ｄ Ｋ	879,200	2,009.50	1,766,752,400	
帝国通信工業	4,500	2,964.00	13,338,000	貸付株式数 1,600株
タムラ製作所	40,600	506.00	20,543,600	
アルプスアルパイン	82,600	1,539.50	127,162,700	貸付株式数 18,400株
池上通信機	400	633.00	253,200	
日本電波工業	9,600	925.00	8,880,000	貸付株式数 3,600株
鈴木	5,400	1,947.00	10,513,800	
メイコー	10,100	9,300.00	93,930,000	
日本トリム	2,300	3,675.00	8,452,500	
フオスター電機	10,400	1,441.00	14,986,400	
Ｓ Ｍ Ｋ	2,400	2,468.00	5,923,200	
ヨコオ	9,000	1,676.00	15,084,000	
ティアック	1,700	83.00	141,100	貸付株式数 1,600株
ホシデン	25,500	2,363.00	60,256,500	
ヒロセ電機	14,800	18,045.00	267,066,000	
日本航空電子	26,500	2,615.00	69,297,500	
Ｔ Ｏ Ａ	10,300	919.00	9,465,700	
マクセル	20,600	1,728.00	35,596,800	
古野電気	12,000	2,544.00	30,528,000	
スミダコーポレーション	13,700	982.00	13,453,400	
アイコム	3,900	2,676.00	10,436,400	貸付株式数 300株
リオン	4,200	2,571.00	10,798,200	
横河電機	111,400	3,415.00	380,431,000	
新電元工業	3,900	2,406.00	9,383,400	貸付株式数 1,500株
アズビル	277,300	1,218.00	337,751,400	
東亜ディーケーケー	500	722.00	361,000	
日本光電工業	90,200	2,103.50	189,735,700	貸付株式数 31,500株
チ ノ ー	4,200	2,051.00	8,614,200	貸付株式数 1,300株
共和電業	1,200	426.00	511,200	
日本電子材料	6,200	2,088.00	12,945,600	
堀場製作所	19,100	8,639.00	165,004,900	
アドバンテスト	317,600	8,421.00	2,674,509,600	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
小野測器	500	570.00	285,000	貸付株式数 200株
エスペック	9,000	2,619.00	23,571,000	
キーエンス	100,800	65,260.00	6,578,208,000	
日置電機	5,300	7,570.00	40,121,000	貸付株式数 800株
シスメックス	260,900	3,149.00	821,574,100	
日本マイクロニクス	16,600	3,805.00	63,163,000	
メガチップス	7,800	6,170.00	48,126,000	
OBARA GROUP	6,300	4,155.00	26,176,500	貸付株式数 2,400株
IMAGICA GROUP	10,100	504.00	5,090,400	貸付株式数 3,400株
澤藤電機	100	926.00	92,600	
デンソー	1,069,100	2,167.50	2,317,274,250	
原田工業	600	534.00	320,400	
コーセル	10,800	1,196.00	12,916,800	貸付株式数 4,100株
イリソ電子工業	10,200	2,643.00	26,958,600	
オプテックスグループ	18,500	1,932.00	35,742,000	
千代田インテグレ	3,500	3,585.00	12,547,500	
レーザーテック	46,200	16,305.00	753,291,000	
スタンレー電気	63,100	2,539.00	160,210,900	貸付株式数 20,700株
ウシオ電機	44,600	2,039.50	90,961,700	
岡谷電機	900	222.00	199,800	貸付株式数 800株
ヘリオステクノＨ	1,200	952.00	1,142,400	
エノモト	400	1,457.00	582,800	
日本セラミック	9,200	2,631.00	24,205,200	貸付株式数 3,500株
遠藤照明	600	1,412.00	847,200	
古河電池	7,400	1,370.00	10,138,000	貸付株式数 2,400株
山一電機	8,200	2,304.00	18,892,800	貸付株式数 1,900株
図 研	9,200	4,370.00	40,204,000	
日本電子	23,300	5,270.00	122,791,000	貸付株式数 9,500株
カ シ オ	80,600	1,152.50	92,891,500	
ファナック	487,700	3,930.00	1,916,661,000	
日本シイエムケイ	29,500	412.00	12,154,000	貸付株式数 11,300株
エンプラス	2,900	5,230.00	15,167,000	貸付株式数 200株 (100株)
大真空	12,300	526.00	6,469,800	貸付株式数 2,100株
ロ ー ム	182,600	1,412.50	257,922,500	貸付株式数 72,000株
浜松ホトニクス	161,800	1,824.00	295,123,200	貸付株式数 13,400株
三井ハイテック	44,600	770.00	34,342,000	貸付株式数 17,400株
新光電気工業	35,700	5,277.00	188,388,900	
京 セ ラ	626,200	1,486.00	930,533,200	
協栄産業	100	2,225.00	222,500	
太陽誘電	44,200	2,170.50	95,936,100	
村田製作所	900,300	2,494.50	2,245,798,350	
双葉電子工業	19,200	458.00	8,793,600	
日東電工	319,600	2,407.50	769,437,000	
北陸電気工業	400	1,565.00	626,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
東海理化電機	28,400	2,089.00	59,327,600	
ニチコン	26,500	1,042.00	27,613,000	
日本ケミコン	12,400	1,088.00	13,491,200	貸付株式数 4,700株
ＫＯＡ	16,800	973.00	16,346,400	貸付株式数 6,400株
三井Ｅ＆Ｓ	54,400	1,522.00	82,796,800	貸付株式数 21,500株
カナデビア	83,400	948.00	79,063,200	
三菱重工業	1,780,100	2,246.00	3,998,104,600	
川崎重工業	75,900	5,588.00	424,129,200	
ＩＨＩ	81,600	7,960.00	649,536,000	
名村造船所	28,800	1,538.00	44,294,400	貸付株式数 11,300株
サノヤスホールディングス	1,600	167.00	267,200	貸付株式数 1,500株
スプリックス	300	820.00	246,000	貸付株式数 100株
マネジメントソリューションズ	5,100	1,749.00	8,919,900	貸付株式数 2,000株
プロレド・パートナーズ	2,500	527.00	1,317,500	貸付株式数 1,000株
AND FACTORY	300	227.00	68,100	
テノ.ホールディングス	100	499.00	49,900	
フロンティア・マネジメント	3,100	787.00	2,439,700	
ピアラ	200	256.00	51,200	
コプロ・ホールディングス	500	1,781.00	890,500	
ギークス	300	411.00	123,300	
アンビスホールディングス	22,200	883.00	19,602,600	貸付株式数 8,700株
カーブスホールディングス	28,300	813.00	23,007,900	
フォーラムエンジニアリング	12,100	977.00	11,821,700	
FAST FITNESS JAP	3,500	1,405.00	4,917,500	
日本車輌	3,900	2,244.00	8,751,600	
三菱ロジスネクスト	16,100	1,155.00	18,595,500	貸付株式数 6,300株
近畿車輌	200	1,440.00	288,000	
一家ホールディングス	300	665.00	199,500	貸付株式数 200株
フルサト・マルカHD	8,500	2,298.00	19,533,000	貸付株式数 3,200株
ヤマエグループHD	11,500	2,066.00	23,759,000	貸付株式数 4,500株
ジャパンクラフトホールディ	900	139.00	125,100	貸付株式数 800株
ＦＰＧ	35,400	2,916.00	103,226,400	
島根銀行	300	496.00	148,800	貸付株式数 200株
じもとホールディングス	1,000	310.00	310,000	貸付株式数 900株
全国保証	26,000	5,383.00	139,958,000	
めぶきフィナンシャルＧ	498,300	670.60	334,159,980	貸付株式数 90,000株
ジャパンインベストメントA	16,100	1,080.00	17,388,000	貸付株式数 6,300株
東京きらぼしFG	12,700	4,395.00	55,816,500	
九州フィナンシャルＧ	174,600	751.40	131,194,440	
かんぽ生命保険	115,500	3,198.00	369,369,000	
ゆうちょ銀行	818,100	1,464.00	1,197,698,400	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
あんしん保証	500	156.00	78,000	貸付株式数 100株
富山第一銀行	31,500	1,152.00	36,288,000	貸付株式数 12,400株
コンコルディア・フィナンシャル	528,100	931.90	492,136,390	貸付株式数 208,800株
ジェイリース	7,400	1,375.00	10,175,000	
西日本フィナンシャルHD	61,100	2,047.00	125,071,700	
イントラスト	400	797.00	318,800	
日本モーゲージサービス	600	428.00	256,800	貸付株式数 100株
Ｃａｓａ	400	855.00	342,000	貸付株式数 300株
ＳＢＩアルヒ	10,100	822.00	8,302,200	貸付株式数 3,800株
プレミアグループ	16,800	2,647.00	44,469,600	
日産自動車	1,259,800	360.40	454,031,920	貸付株式数 499,000株
いすゞ自動車	311,300	2,027.50	631,160,750	
トヨタ自動車	5,357,700	2,611.00	13,988,954,700	※
日野自動車	151,600	405.10	61,413,160	
三菱自動車工業	393,100	393.50	154,684,850	貸付株式数 155,200株
エフテック	800	493.00	394,400	貸付株式数 700株
レシップホールディングス	600	497.00	298,200	
ＧＭＢ	300	1,024.00	307,200	貸付株式数 200株
ファルテック	200	432.00	86,400	
武蔵精密工業	24,700	3,340.00	82,498,000	
日産車体	15,300	1,111.00	16,998,300	
新明和工業	29,000	1,299.00	37,671,000	
極東開発工業	13,600	2,302.00	31,307,200	
トピー工業	8,200	1,906.00	15,629,200	貸付株式数 3,100株
ティラド	2,200	3,400.00	7,480,000	
タチエス	18,600	1,704.00	31,694,400	
Ｎ Ｏ Ｋ	39,200	2,255.00	88,396,000	貸付株式数 15,000株
フタバ産業	30,400	664.00	20,185,600	
カヤバ	17,200	2,475.00	42,570,000	
市光工業	18,200	402.00	7,316,400	
大同メタル工業	19,700	475.00	9,357,500	
プレス工業	39,400	530.00	20,882,000	貸付株式数 8,300株
ミクニ	1,400	314.00	439,600	
太平洋工業	23,100	1,297.00	29,960,700	貸付株式数 9,100株
河西工業	1,900	118.00	224,200	貸付株式数 1,700株
アイシン	213,400	1,596.00	340,586,400	
マ ツ ダ	309,600	971.50	300,776,400	
今仙電機製作所	700	498.00	348,600	貸付株式数 600株
本田技研	2,388,000	1,302.00	3,109,176,000	
スズキ	814,500	1,626.00	1,324,377,000	
SUBARU	303,900	2,470.50	750,784,950	
安永	600	491.00	294,600	貸付株式数 500株
ヤマハ発動機	425,500	1,312.00	558,256,000	貸付株式数 38,300株
小糸製作所	104,400	1,943.50	202,901,400	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ＴＢＫ	1,300	265.00	344,500	貸付株式数 500株
エクセディ	16,500	4,460.00	73,590,000	
ミツバ	18,900	849.00	16,046,100	
豊田合成	28,900	2,480.50	71,686,450	貸付株式数 7,400株
愛三工業	19,100	1,332.00	25,441,200	
盟和産業	200	1,217.00	243,400	
日本プラスト	900	344.00	309,600	
ヨ ロ ズ	10,400	1,154.00	12,001,600	貸付株式数 3,500株
エフ・シー・シー	17,700	2,998.00	53,064,600	
新家工業	200	4,590.00	918,000	
シマノ	43,800	21,450.00	939,510,000	
テイ・エス テック	41,000	1,658.00	67,978,000	
３３ＦＧ	8,900	2,093.00	18,627,700	貸付株式数 3,500株
第四北越フィナンシャルＧ	31,200	2,867.00	89,450,400	貸付株式数 2,400株
ひろぎんHLDGS	139,700	1,163.00	162,471,100	貸付株式数 53,700株
マーキュリアホールディングス	500	895.00	447,500	貸付株式数 300株 (300株)
おきなわＦＧ	7,800	2,474.00	19,297,200	
ダイレクトマケティングミクス	12,500	262.00	3,275,000	
ポピンズ	1,900	1,280.00	2,432,000	
LITALICO	9,400	944.00	8,873,600	貸付株式数 700株
コンフィデンス・インターワーク	200	1,589.00	317,800	貸付株式数 100株
十六ＦＧ	13,900	4,400.00	61,160,000	
北國ＦＨＤ	9,700	5,300.00	51,410,000	
ネットプロＨＤ	33,000	422.00	13,926,000	貸付株式数 300株
プロクレアホールディングス	11,300	1,797.00	20,306,100	貸付株式数 1,500株
あいちフィナンシャルグル	18,500	2,482.00	45,917,000	
ジャムコ	6,100	1,381.00	8,424,100	貸付株式数 2,300株
小 野 建	11,700	1,486.00	17,386,200	貸付株式数 2,400株
はるやまHLDGS	500	599.00	299,500	貸付株式数 400株
南 陽	500	1,106.00	553,000	
ノ ジ マ	34,800	2,341.00	81,466,800	貸付株式数 11,300株
佐鳥電機	7,400	1,820.00	13,468,000	
カッパ・クリエイト	16,800	1,575.00	26,460,000	貸付株式数 6,400株
エコートレーディング	300	924.00	277,200	貸付株式数 100株
伯東	6,100	4,345.00	26,504,500	貸付株式数 2,300株
コンドーテック	8,200	1,379.00	11,307,800	貸付株式数 1,000株
中山福	600	363.00	217,800	
ライトオン	900	209.00	188,100	貸付株式数 800株
ナガイレーベン	13,500	2,125.00	28,687,500	貸付株式数 2,600株
三菱食品	9,800	4,790.00	46,942,000	
良品計画	127,000	3,119.00	396,113,000	
パリミキホールディングス	1,600	294.00	470,400	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
松田産業	8,100	3,080.00	24,948,000	
第一興商	41,300	1,855.00	76,611,500	貸付株式数 16,300株
メディパルHD	115,700	2,429.50	281,093,150	
アドヴァングループ	9,100	967.00	8,799,700	貸付株式数 3,500株
ＳＰＫ	4,300	2,024.00	8,703,200	
萩原電気HLDGS	4,600	3,155.00	14,513,000	
アルビス	3,500	2,602.00	9,107,000	
アズワン	33,100	2,704.50	89,518,950	
スズデン	4,600	1,838.00	8,454,800	
尾家産業	300	1,968.00	590,400	
シモジマ	7,100	1,285.00	9,123,500	
ドウシシャ	9,900	2,103.00	20,819,700	
小津産業	300	1,652.00	495,600	貸付株式数 200株
コナカ	1,400	241.00	337,400	
高速	6,300	2,425.00	15,277,500	
ハウス ローゼ	100	1,451.00	145,100	
G-7ホールディングス	11,600	1,439.00	16,692,400	
たけびし	4,500	2,093.00	9,418,500	貸付株式数 1,700株
イオン北海道	26,300	864.00	22,723,200	貸付株式数 10,100株
コ ジ マ	20,600	1,089.00	22,433,400	貸付株式数 7,900株 (2,100株)
ヒマラヤ	400	848.00	339,200	貸付株式数 300株
コーナン商事	11,800	3,590.00	42,362,000	
ネットワンシステムズ	41,800	4,489.00	187,640,200	
エコス	4,000	2,008.00	8,032,000	貸付株式数 1,400株
ワタミ	12,900	1,015.00	13,093,500	貸付株式数 4,400株
マルシェ	400	203.00	81,200	貸付株式数 300株
リックス	2,400	2,760.00	6,624,000	
システムソフト	35,200	58.00	2,041,600	貸付株式数 1,500株
パンパシフィックHD	215,400	3,796.00	817,658,400	
丸文	9,500	1,058.00	10,051,000	
西松屋チェーン	23,600	2,340.00	55,224,000	貸付株式数 8,200株
ゼンショーホールディングス	60,600	9,099.00	551,399,400	
ハピネット	8,200	4,240.00	34,768,000	貸付株式数 3,400株
幸楽苑	7,900	1,308.00	10,333,200	貸付株式数 2,700株
ハークスレイ	400	677.00	270,800	
橋本総業HLDGS	4,200	1,187.00	4,985,400	貸付株式数 1,500株
日本ライフライン	28,600	1,315.00	37,609,000	
サイゼリヤ	15,800	5,240.00	82,792,000	貸付株式数 6,000株
タカショー	8,600	450.00	3,870,000	貸付株式数 3,300株
ＶＴホールディングス	41,600	474.00	19,718,400	
アルゴグラフィックス	9,300	5,230.00	48,639,000	貸付株式数 2,800株
魚力	3,700	2,397.00	8,868,900	貸付株式数 1,300株
ＩＤＯＭ	36,300	1,120.00	40,656,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
日本エム・ディ・エム	8,000	611.00	4,888,000	
ポプラ	400	210.00	84,000	貸付株式数 300株 (100株)
フジ・コーポレーション	4,900	1,973.00	9,667,700	
ユナイテッドアローズ	11,400	2,568.00	29,275,200	
進和	6,500	2,812.00	18,278,000	貸付株式数 2,300株
エスケイジャパン	300	643.00	192,900	
ダイトロン	4,600	2,729.00	12,553,400	
ハイデイ日高	17,300	2,801.00	48,457,300	貸付株式数 6,300株
シークス	15,200	1,133.00	17,221,600	貸付株式数 5,800株
京都きもの友禅HD	600	72.00	43,200	
コロワイド	60,200	1,689.50	101,707,900	貸付株式数 10,700株
田中商事	300	671.00	201,300	
オーハシテクニカ	5,100	1,944.00	9,914,400	
壱番屋	42,100	1,011.00	42,563,100	貸付株式数 6,600株
白銅	3,000	2,301.00	6,903,000	貸付株式数 1,000株
トップカルチャー	400	135.00	54,000	貸付株式数 200株
ＰＬＡＮＴ	300	1,534.00	460,200	貸付株式数 200株
スギホールディングス	57,300	2,510.00	143,823,000	
ダイコー通産	100	1,231.00	123,100	
薬王堂ホールディングス	5,200	2,053.00	10,675,600	
島津製作所	145,100	4,233.00	614,208,300	貸付株式数 100株
Ｊ Ｍ Ｓ	9,300	438.00	4,073,400	
クボテック	400	212.00	84,800	貸付株式数 300株
長野計器	6,600	2,410.00	15,906,000	貸付株式数 2,600株
ブイ・テクノロジー	4,900	2,218.00	10,868,200	
スター精密	17,200	1,829.00	31,458,800	
東京計器	7,100	3,315.00	23,536,500	貸付株式数 600株
愛知時計	4,800	1,978.00	9,494,400	
インターアクション	6,100	997.00	6,081,700	貸付株式数 1,200株
オーバル	1,100	366.00	402,600	貸付株式数 1,000株
東京精密	20,700	7,245.00	149,971,500	
マニー	40,300	1,731.00	69,759,300	貸付株式数 15,900株
ニコン	159,000	1,782.00	283,338,000	貸付株式数 54,800株
トプコン	57,200	1,602.50	91,663,000	
オリンパス	577,000	2,344.00	1,352,488,000	
理研計器	14,300	3,755.00	53,696,500	貸付株式数 5,600株
SCREENホールディングス	42,100	9,784.00	411,906,400	
キヤノン電子	9,500	2,478.00	23,541,000	
タムロン	13,900	4,285.00	59,561,500	
ＨＯＹＡ	196,900	19,525.00	3,844,472,500	
シ ー ド	900	480.00	432,000	
ノーリツ鋼機	9,500	4,360.00	41,420,000	
A&Dホロンホールディングス	12,600	1,915.00	24,129,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
朝日インテック	122,900	2,609.00	320,646,100	貸付株式数　6,100株
キヤノン	502,700	4,904.00	2,465,240,800	
リ コ ー	265,500	1,738.50	461,571,750	
シチズン時計	92,700	886.00	82,132,200	
リズム	300	3,730.00	1,119,000	貸付株式数　200株
大研医器	1,000	505.00	505,000	
メニコン	37,600	1,520.00	57,152,000	貸付株式数　9,800株
シンシア	100	533.00	53,300	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	1,600	152.00	243,200	
中本パックス	400	1,707.00	682,800	
パラマウントベッドHD	23,300	2,531.00	58,972,300	
トランザクション	6,600	2,242.00	14,797,200	貸付株式数　2,500株
粧美堂	300	515.00	154,500	貸付株式数　200株
ニホンフラッシュ	8,500	830.00	7,055,000	
前田工繊	18,000	1,800.00	32,400,000	
永大産業	1,300	209.00	271,700	
アートネイチャー	10,400	811.00	8,434,400	
フルヤ金属	9,600	3,435.00	32,976,000	
バンダイナムコHLDGS	273,600	3,179.00	869,774,400	
アイフィスジャパン	300	568.00	170,400	貸付株式数　100株
ＳＨＯＥＩ	28,300	2,396.00	67,806,800	貸付株式数　100株
フランスベッドHLDGS	14,500	1,249.00	18,110,500	貸付株式数　5,500株
マーベラス	18,800	572.00	10,753,600	貸付株式数　7,200株
パイロットコーポレーション	15,800	4,790.00	75,682,000	
萩原工業	6,700	1,371.00	9,185,700	貸付株式数　1,200株
エイベックス	19,000	1,509.00	28,671,000	
フジシールインターナショナル	22,700	2,504.00	56,840,800	貸付株式数　1,800株
タカラトミー	42,300	4,225.00	178,717,500	貸付株式数　16,500株
広済堂ホールディングス	38,000	572.00	21,736,000	貸付株式数　14,900株
エステールホールディングス	200	601.00	120,200	
レック	12,900	1,267.00	16,344,300	貸付株式数　4,300株
タカノ	400	693.00	277,200	
三光合成	12,700	581.00	7,378,700	
プロネクサス	10,400	1,246.00	12,958,400	
ホクシン	900	100.00	90,000	
ウッドワン	400	807.00	322,800	貸付株式数　300株
き も と	1,800	288.00	518,400	
TOPPANホールディングス	132,100	4,034.00	532,891,400	
大日本印刷	209,000	2,251.00	470,459,000	
共同印刷	2,800	4,055.00	11,354,000	
ＮＩＳＳＨＡ	17,300	1,629.00	28,181,700	
光村印刷	100	1,448.00	144,800	
ＺＡＣＲＯＳ	8,000	4,125.00	33,000,000	貸付株式数　3,000株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ヴィア・ホールディングス	2,300	128.00	294,400	
TAKARA & COMPANY	5,900	2,715.00	16,018,500	
前澤化成工業	7,100	1,784.00	12,666,400	貸付株式数 2,500株
未来工業	3,600	3,950.00	14,220,000	貸付株式数 1,300株
アシックス	372,100	3,134.00	1,166,161,400	
ツ ツ ミ	2,400	2,082.00	4,996,800	
ウェーブロック HLDGS	400	641.00	256,400	
ジェイ エス ピー	8,300	2,104.00	17,463,200	貸付株式数 2,300株
ニ チ ハ	12,700	2,885.00	36,639,500	貸付株式数 4,300株
ローランド	7,400	3,810.00	28,194,000	
エフピコ	22,300	2,743.00	61,168,900	
小松ウオール工業	7,400	1,503.00	11,122,200	
ヤマハ	184,200	1,105.00	203,541,000	
河合楽器	3,100	2,861.00	8,869,100	
クリナップ	9,900	688.00	6,811,200	
ピジョン	64,200	1,477.00	94,823,400	
天馬	8,400	3,010.00	25,284,000	貸付株式数 2,100株
キングジム	8,900	848.00	7,547,200	貸付株式数 3,400株 (200株)
象印マホービン	30,100	1,534.00	46,173,400	
リンテック	20,200	3,020.00	61,004,000	貸付株式数 5,300株
信越ポリマー	21,800	1,670.00	36,406,000	
東 リ	2,900	457.00	1,325,300	
イトーキ	20,100	1,572.00	31,597,200	
任 天 堂	636,300	8,855.00	5,634,436,500	
三菱鉛筆	14,000	2,400.00	33,600,000	貸付株式数 5,400株
松 風	10,100	2,028.00	20,482,800	
タカラスタンダード	23,200	1,635.00	37,932,000	
コ ク ヨ	50,400	2,825.00	142,380,000	
ナカバヤシ	10,900	510.00	5,559,000	
ニ フ コ	37,800	3,568.00	134,870,400	
立川ブラインド	4,700	1,355.00	6,368,500	貸付株式数 1,800株
グローブライド	10,000	1,900.00	19,000,000	貸付株式数 3,000株
オカムラ	30,300	1,960.00	59,388,000	
バルカー	7,700	3,305.00	25,448,500	
MUTOH ホールディングス	200	2,432.00	486,400	
伊 藤 忠	716,800	7,502.00	5,377,433,600	
丸 紅	876,300	2,282.00	1,999,716,600	
スクロール	15,900	1,025.00	16,297,500	
高 島	800	1,224.00	979,200	貸付株式数 600株
ヨンドシーホールディングス	10,100	1,844.00	18,624,400	貸付株式数 3,800株
三陽商会	5,200	2,728.00	14,185,600	
長瀬産業	47,600	3,083.00	146,750,800	
ナイガイ	400	238.00	95,200	貸付株式数 300株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
蝶 理	5,700	3,925.00	22,372,500	貸付株式数 1,900株
豊田通商	320,300	2,648.50	848,314,550	
オンワードホールディングス	65,500	529.00	34,649,500	
三共生興	13,900	606.00	8,423,400	
兼 松	44,600	2,524.50	112,592,700	
美 津 濃	10,000	8,380.00	83,800,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,088.00	217,600	
ルックホールディングス	3,200	2,560.00	8,192,000	
三井物産	1,566,800	3,197.00	5,009,059,600	
日本紙パルプ	51,000	651.00	33,201,000	
東京エレクトロン	213,300	23,640.00	5,042,412,000	
カメイ	11,300	1,842.00	20,814,600	
東都水産	100	5,490.00	549,000	
OUGホールディングス	200	2,619.00	523,800	
スターゼン	7,400	2,837.00	20,993,800	
セイコーグループ	15,600	4,190.00	65,364,000	
山 善	35,900	1,306.00	46,885,400	貸付株式数 13,600株
椿本興業	5,900	1,918.00	11,316,200	貸付株式数 2,400株
住友商事	639,000	3,264.00	2,085,696,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	34,100	4,630.00	157,883,000	
内田洋行	4,300	6,950.00	29,885,000	
三菱商事	1,970,800	2,565.00	5,055,102,000	※
第一実業	10,000	2,430.00	24,300,000	貸付株式数 3,200株
キヤノンマーケティングJPN	20,900	4,843.00	101,218,700	
西華産業	5,100	4,840.00	24,684,000	
佐藤商事	7,400	1,383.00	10,234,200	
東京産業	10,800	720.00	7,776,000	貸付株式数 3,200株
ユアサ商事	9,200	4,325.00	39,790,000	
神鋼商事	2,300	6,000.00	13,800,000	
トルク	800	212.00	169,600	
阪和興業	17,600	4,840.00	85,184,000	
正栄食品	7,100	4,270.00	30,317,000	貸付株式数 2,800株 (1,100株)
カナデン	8,000	1,430.00	11,440,000	
ＲＹＯＤＥＮ	8,600	2,318.00	19,934,800	
ニプロ	84,000	1,379.00	115,836,000	貸付株式数 32,100株
岩谷産業	105,900	1,863.00	197,291,700	貸付株式数 41,800株
ナイス	2,500	1,541.00	3,852,500	
ニチモウ	400	1,898.00	759,200	
極東貿易	6,400	1,580.00	10,112,000	
アステナホールディングス	20,100	486.00	9,768,600	貸付株式数 7,700株
三愛オブリ	24,900	1,911.00	47,583,900	
稲畑産業	28,900	3,250.00	93,925,000	
ＧＳＩクレオス	5,700	2,090.00	11,913,000	貸付株式数 2,100株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
明和産業	15,200	633.00	9,621,600	
クワザワホールディングス	400	630.00	252,000	貸付株式数 300株
ゴールドウイン	17,900	8,835.00	158,146,500	貸付株式数 3,100株
ユニ・チヤーム	210,600	3,916.00	824,709,600	
キ ン グ	400	723.00	289,200	
ワ キ タ	15,700	1,572.00	24,680,400	
ヤマトインターナシヨナル	800	323.00	258,400	
東邦ホールディングス	28,800	4,284.00	123,379,200	貸付株式数 10,100株
サンゲツ	26,800	2,899.00	77,693,200	
ミツウロコグループ	13,600	1,672.00	22,739,200	
シナネンホールディングス	3,000	6,390.00	19,170,000	貸付株式数 1,100株
伊藤忠エネクス	26,400	1,646.00	43,454,400	
サンリオ	86,600	5,018.00	434,558,800	貸付株式数 34,100株
サンワ テクノス	4,800	2,197.00	10,545,600	
新光商事	14,300	1,000.00	14,300,000	貸付株式数 4,800株
トーホー	4,600	2,792.00	12,843,200	貸付株式数 100株 (100株)
三信電気	4,300	1,888.00	8,118,400	
東陽テクニカ	9,800	1,440.00	14,112,000	
モスフード サービス	15,700	3,615.00	56,755,500	貸付株式数 5,000株
加賀電子	21,600	2,633.00	56,872,800	貸付株式数 2,500株
都築電気	6,100	2,464.00	15,030,400	
ソーダニツカ	10,400	1,120.00	11,648,000	
立花エレテック	6,400	2,625.00	16,800,000	
木曽路	16,100	2,057.00	33,117,700	貸付株式数 6,200株
SRSホールディングス	17,600	1,124.00	19,782,400	貸付株式数 6,600株
千 趣 会	21,600	303.00	6,544,800	貸付株式数 900株
タカキユー	900	129.00	116,100	貸付株式数 700株
リテールパートナーズ	15,800	1,251.00	19,765,800	貸付株式数 5,500株
上新電機	10,600	2,295.00	24,327,000	
日本瓦斯	51,000	2,058.50	104,983,500	
ロイヤルホールディングス	18,800	2,435.00	45,778,000	貸付株式数 7,200株
東 天 紅	100	857.00	85,700	
チヨダ	10,200	1,426.00	14,545,200	
ライフコーポレーション	11,200	3,375.00	37,800,000	貸付株式数 1,800株
リンガーハツト	13,800	2,209.00	30,484,200	貸付株式数 5,300株
ＭｒＭａｘＨＤ	13,400	684.00	9,165,600	
テンアライド	1,900	268.00	509,200	貸付株式数 1,600株
AOKIホールディングス	22,900	1,244.00	28,487,600	
オークワ	17,000	922.00	15,674,000	貸付株式数 6,500株
コメリ	14,400	3,220.00	46,368,000	
青山商事	22,800	2,265.00	51,642,000	
しまむら	25,000	8,519.00	212,975,000	貸付株式数 3,100株
はせがわ	600	305.00	183,000	
高 島 屋	148,200	1,218.00	180,507,600	貸付株式数 58,500株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
松 屋	18,100	877.00	15,873,700	貸付株式数 7,000 株
エイチ・ツー・オーリテイリング	51,900	2,093.50	108,652,650	貸付株式数 16,500 株
近鉄百貨店	6,100	2,028.00	12,370,800	貸付株式数 1,600 株
丸井グループ	70,800	2,443.00	172,964,400	
クレディセゾン	62,900	3,608.00	226,943,200	貸付株式数 12,900 株
アクシアル リテイリング	29,100	900.00	26,190,000	
井 筒 屋	500	409.00	204,500	貸付株式数 200 株
イオン	394,300	3,618.00	1,426,577,400	貸付株式数 89,000 株
イ ズ ミ	16,200	3,137.00	50,819,400	貸付株式数 2,300 株
フオーバル	4,200	1,356.00	5,695,200	貸付株式数 1,000 株
平 和 堂	17,500	2,286.00	40,005,000	貸付株式数 6,500 株
フ ジ	19,600	2,038.00	39,944,800	貸付株式数 7,500 株
ヤオコー	12,600	9,175.00	115,605,000	貸付株式数 3,800 株
ゼビオホールディングス	14,400	1,117.00	16,084,800	
ケーズホールディングス	71,600	1,412.50	101,135,000	貸付株式数 26,400 株
ＰＡＬＴＡＣ	16,600	4,337.00	71,994,200	貸付株式数 3,900 株
三谷産業	18,600	317.00	5,896,200	
OLYMPIC グループ	600	461.00	276,600	貸付株式数 500 株
日産東京販売ＨＤ	1,700	430.00	731,000	
あおぞら銀行	68,500	2,480.50	169,914,250	貸付株式数 17,900 株
三菱 UFJ フィナンシャル G	6,510,000	1,826.50	11,890,515,000	
りそなホールディングス	1,225,900	1,297.50	1,590,605,250	
三井住友トラストグルー	353,400	3,800.00	1,342,920,000	
三井住友フィナンシャル G	2,070,800	3,823.00	7,916,668,400	
千葉銀行	307,400	1,292.00	397,160,800	
群馬銀行	172,400	1,112.50	191,795,000	貸付株式数 46,700 株
武蔵野銀行	15,100	2,977.00	44,952,700	
千葉興業銀行	23,500	1,429.00	33,581,500	貸付株式数 5,200 株
筑波銀行	43,400	245.00	10,633,000	貸付株式数 17,200 株
七十七銀行	31,800	4,525.00	143,895,000	
秋田銀行	6,700	2,144.00	14,364,800	
山形銀行	11,000	982.00	10,802,000	
岩手銀行	6,300	2,689.00	16,940,700	
東邦銀行	85,600	281.00	24,053,600	貸付株式数 32,900 株
東北銀行	600	1,123.00	673,800	
ふくおかフィナンシャル G	86,400	4,266.00	368,582,400	
スルガ銀行	63,000	1,059.00	66,717,000	
八十二銀行	232,400	1,044.00	242,625,600	
山梨中央銀行	11,100	1,826.00	20,268,600	
大垣共立銀行	18,900	1,901.00	35,928,900	
福井銀行	8,900	1,883.00	16,758,700	貸付株式数 1,900 株
清水銀行	4,000	1,500.00	6,000,000	貸付株式数 1,100 株
富山銀行	200	1,535.00	307,000	貸付株式数 100 株
滋賀銀行	15,000	3,895.00	58,425,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
南都銀行	14,900	3,180.00	47,382,000	
百五銀行	93,400	628.00	58,655,200	貸付株式数 33,700 株
紀陽銀行	35,500	2,112.00	74,976,000	
ほくほくフィナンシャルＧ	55,800	1,878.50	104,820,300	貸付株式数 22,000 株
山陰合同銀行	62,100	1,257.00	78,059,700	貸付株式数 7,000 株
鳥取銀行	400	1,232.00	492,800	貸付株式数 100 株
百十四銀行	9,700	3,165.00	30,700,500	
四国銀行	14,600	1,113.00	16,249,800	
阿波銀行	13,900	2,885.00	40,101,500	
大分銀行	6,000	3,150.00	18,900,000	
宮崎銀行	6,500	3,075.00	19,987,500	
佐賀銀行	5,800	2,142.00	12,423,600	
琉球銀行	22,700	1,031.00	23,403,700	貸付株式数 8,900 株
セブン銀行	355,500	329.70	117,208,350	貸付株式数 122,000 株
みずほフィナンシャルＧ	1,339,800	3,879.00	5,197,084,200	
高知銀行	400	862.00	344,800	
山口フィナンシャルＧ	97,300	1,641.00	159,669,300	貸付株式数 12,200 株
芙蓉総合リース	9,100	11,280.00	102,648,000	貸付株式数 3,300 株
みずほリース	74,600	1,005.00	74,973,000	
東京センチュリー	74,200	1,521.50	112,895,300	貸付株式数 29,300 株
SBI ホールディングス	159,700	3,908.00	624,107,600	
日本証券金融	36,500	2,106.00	76,869,000	
アイフル	164,400	330.00	54,252,000	
日本アジア投資	700	215.00	150,500	貸付株式数 600 株
名古屋銀行	6,200	6,460.00	40,052,000	
北洋銀行	135,400	466.00	63,096,400	
大光銀行	400	1,427.00	570,800	貸付株式数 200 株
愛媛銀行	14,500	1,052.00	15,254,000	
トマト銀行	400	1,135.00	454,000	貸付株式数 100 株
京葉銀行	44,600	816.00	36,393,600	
栃木銀行	45,500	282.00	12,831,000	
北日本銀行	3,500	2,848.00	9,968,000	
東和銀行	18,200	649.00	11,811,800	
福島銀行	1,200	221.00	265,200	貸付株式数 1,100 株
大東銀行	500	708.00	354,000	貸付株式数 100 株
リコーリース	9,400	5,180.00	48,692,000	貸付株式数 3,200 株
イオンフィナンシャルサービス	57,000	1,282.00	73,074,000	
ア コ ム	236,200	385.00	90,937,000	
ジャックス	11,900	3,755.00	44,684,500	貸付株式数 4,700 株
オ リ コ	32,400	832.00	26,956,800	貸付株式数 5,600 株
オリックス	595,300	3,419.00	2,035,330,700	
三菱 HC キャピタル	497,600	1,020.00	507,552,000	
ジャフコ グループ	29,600	2,116.50	62,648,400	貸付株式数 10,800 株
九州 リースサービス	400	1,045.00	418,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
トモニホールディングス	94,800	459.00	43,513,200	
大和証券Ｇ本社	709,800	1,026.50	728,609,700	
野村ホールディングス	1,669,300	921.40	1,538,093,020	
岡三証券グループ	78,400	644.00	50,489,600	貸付株式数 17,200 株
丸三証券	33,000	983.00	32,439,000	貸付株式数 8,000 株
東洋証券	29,600	614.00	18,174,400	
東海東京ＨＤ	117,900	483.00	56,945,700	
光世証券	300	423.00	126,900	貸付株式数 200 株
水戸証券	27,200	553.00	15,041,600	
いちよし証券	20,000	1,002.00	20,040,000	
松井証券	68,400	816.00	55,814,400	
SOMPO ホールディングス	485,300	4,101.00	1,990,215,300	
日本取引所グループ	590,500	1,842.00	1,087,701,000	
マネックスＧ	97,200	1,050.00	102,060,000	
極東証券	12,400	1,387.00	17,198,800	貸付株式数 4,800 株
岩井コスモホールディング	11,300	2,275.00	25,707,500	
アイザワ証券グループ	14,300	1,781.00	25,468,300	貸付株式数 5,500 株
フィデアホール	10,300	1,412.00	14,543,600	貸付株式数 3,900 株
池田泉州ＨＤ	137,700	404.00	55,630,800	
アニコム ホールディングス	33,700	678.00	22,848,600	
ＭＳ＆ＡＤ	727,400	3,438.00	2,500,801,200	
マネーパートナーズ GP	1,100	474.00	521,400	
スパークス・グループ	11,100	1,451.00	16,106,100	
小林洋行	500	270.00	135,000	貸付株式数 100 株
第一生命 HLDGS	466,800	4,305.00	2,009,574,000	
東京海上ＨＤ	969,100	5,709.00	5,532,591,900	
アドバンテッジリスクマネ	600	683.00	409,800	
イー・ギャランティ	16,200	1,675.00	27,135,000	
アサックス	400	714.00	285,600	貸付株式数 300 株
NEC キャピタルソリューション	4,900	3,700.00	18,130,000	
T&D ホールディングス	266,500	2,902.00	773,383,000	
アドバンスクリエイト	7,800	622.00	4,851,600	貸付株式数 2,900 株
三井不動産	1,377,600	1,266.00	1,744,041,600	
三菱地所	575,000	2,113.50	1,215,262,500	
平和不動産	16,100	4,265.00	68,666,500	
東京建物	86,700	2,581.00	223,772,700	
京阪神ビルディング	16,700	1,549.00	25,868,300	
住友不動産	161,500	4,674.00	754,851,000	
太平洋興発	400	713.00	285,200	貸付株式数 200 株
テーオーシー	17,700	654.00	11,575,800	
スターツコーポレーション	16,300	3,740.00	60,962,000	
フジ住宅	12,500	784.00	9,800,000	
空港施設	14,000	579.00	8,106,000	
明和地所	8,000	1,013.00	8,104,000	貸付株式数 2,800 株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ゴールドクレスト	6,700	3,160.00	21,172,000	貸付株式数　1,500株
リログループ	57,700	1,844.50	106,427,650	
エスリード	4,700	4,340.00	20,398,000	貸付株式数　1,200株
日神グループHLDGS	15,900	529.00	8,411,100	貸付株式数　5,200株
日本エスコン	26,000	978.00	25,428,000	貸付株式数　3,800株
MIRARTHホールディング	58,200	509.00	29,623,800	
ＡＶＡＮＴＩＡ	600	770.00	462,000	貸付株式数　500株
イオンモール	60,000	2,030.00	121,800,000	
毎日コムネット	400	708.00	283,200	貸付株式数　100株
ファースト住建	500	988.00	494,000	貸付株式数　400株
ランド	640,600	9.00	5,765,400	貸付株式数　119,600株
カチタス	26,700	2,128.00	56,817,600	
東祥	8,700	627.00	5,454,900	
トーセイ	16,500	2,430.00	40,095,000	貸付株式数　6,200株
穴吹興産	300	1,994.00	598,200	貸付株式数　200株
サンフロンティア不動産	16,500	1,857.00	30,640,500	
インテリックス	300	714.00	214,200	
ランドビジネス	400	203.00	81,200	貸付株式数　300株
サンネクスタグループ	400	1,003.00	401,200	貸付株式数　100株
グランディハウス	9,300	550.00	5,115,000	貸付株式数　2,900株
東武鉄道	106,200	2,572.00	273,146,400	
相鉄ホールディングス	33,300	2,444.00	81,385,200	貸付株式数　13,000株
東急	282,600	1,725.50	487,626,300	
京浜急行	124,700	1,340.00	167,098,000	
小田急電鉄	166,700	1,584.50	264,136,150	貸付株式数　65,700株
京王電鉄	53,300	3,916.00	208,722,800	
京成電鉄	58,500	4,523.00	264,595,500	貸付株式数　24,400株
富士急行	12,400	2,300.00	28,520,000	
東日本旅客鉄道	555,800	2,935.50	1,631,550,900	
西日本旅客鉄道	257,500	2,842.00	731,815,000	
東海旅客鉄道	388,200	3,099.00	1,203,031,800	
東京地下鉄	168,500	1,677.50	282,658,750	
西武ホールディングス	109,700	3,042.00	333,707,400	貸付株式数　22,000株
鴻池運輸	17,200	3,000.00	51,600,000	貸付株式数　1,600株
西日本鉄道	29,200	2,277.50	66,503,000	貸付株式数　11,400株
ハマキョウレックス	34,400	1,293.00	44,479,200	
サカイ引越センター	12,800	2,369.00	30,323,200	
近鉄グループHLDGS	107,800	3,174.00	342,157,200	
阪急阪神HLDGS	134,200	4,150.00	556,930,000	貸付株式数　50,400株
南海電鉄	44,900	2,425.50	108,904,950	貸付株式数　7,900株
京阪ホールディングス	55,500	3,438.00	190,809,000	貸付株式数　7,500株
神戸電鉄	2,700	2,360.00	6,372,000	貸付株式数　1,000株
名古屋鉄道	111,200	1,732.50	192,654,000	貸付株式数　33,000株
山陽電鉄	7,600	2,020.00	15,352,000	貸付株式数　2,700株
トランコム	1,200	10,250.00	12,300,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ヤマトホールディングス	122,300	1,712.50	209,438,750	
山 九	24,300	5,164.00	125,485,200	
日 新	6,900	4,360.00	30,084,000	
丸 運	700	471.00	329,700	貸付株式数 600株
丸全昭和運輸	6,200	6,490.00	40,238,000	貸付株式数 2,100株
センコーグループHLDGS	59,200	1,503.00	88,977,600	貸付株式数 23,300株
トナミホールディングス	2,200	5,440.00	11,968,000	
ニッコンホールディングス	57,200	1,996.00	114,171,200	貸付株式数 22,400株
日石輸送	100	2,898.00	289,800	
福山通運	10,800	3,795.00	40,986,000	
セイノーホールディングス	49,500	2,450.00	121,275,000	貸付株式数 21,800株
神奈川中央交通	2,800	3,800.00	10,640,000	
AZ-COM丸和ホールディ	31,200	1,008.00	31,449,600	貸付株式数 12,200株
日本郵船	208,500	4,835.00	1,008,097,500	
商船三井	191,300	5,153.00	985,768,900	
川崎汽船	229,000	2,012.00	460,748,000	
NSユナイテッド海運	6,300	4,035.00	25,420,500	貸付株式数 2,400株
明海グループ	1,200	662.00	794,400	貸付株式数 900株
飯野海運	36,900	1,115.00	41,143,500	貸付株式数 600株
共栄タンカー	200	1,082.00	216,400	貸付株式数 100株
九州旅客鉄道	77,100	3,961.00	305,393,100	
SGホールディングス	169,000	1,462.50	247,162,500	貸付株式数 9,100株
NIPPON EXPRESS	36,100	7,728.00	278,980,800	
ID&E ホールディングス	6,000	6,480.00	38,880,000	
日本航空	230,700	2,519.50	581,248,650	
ANAホールディングス	273,800	2,924.00	800,591,200	
ビーウィズ	2,100	1,502.00	3,154,200	貸付株式数 800株
TREホールディングス	23,800	1,635.00	38,913,000	
人・夢・技術グループ	4,300	1,495.00	6,428,500	
西本WISMETTAC HD	6,300	1,927.00	12,140,100	貸付株式数 600株
シルバーライフ	2,900	736.00	2,134,400	貸付株式数 500株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	100	2,330.00	233,000	
GENKY DRUGSTORES	9,300	3,100.00	28,830,000	
コーア商事HLDGS	7,900	602.00	4,755,800	貸付株式数 2,100株
KPPグループホールディン	22,100	650.00	14,365,000	
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,274.00	254,800	貸付株式数 100株
ブックオフＧＨＤ	7,700	1,439.00	11,080,300	貸付株式数 2,900株
ギフトホールディングス	5,300	3,310.00	17,543,000	貸付株式数 1,500株
三菱倉庫	105,000	1,104.00	115,920,000	
三井倉庫HOLD	10,400	7,510.00	78,104,000	
住友倉庫	29,900	2,727.00	81,537,300	
渋沢倉庫	4,600	3,080.00	14,168,000	
ヤマタネ	4,300	3,685.00	15,845,500	
東陽倉庫	300	1,468.00	440,400	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
乾汽船	12,800	1,544.00	19,763,200	貸付株式数 4,500 株
日本トランスシティ	20,200	1,036.00	20,927,200	
ケイヒン	200	1,946.00	389,200	
中央倉庫	5,900	1,556.00	9,180,400	貸付株式数 2,100 株
川西倉庫	200	1,049.00	209,800	貸付株式数 100 株
安田倉庫	6,900	1,737.00	11,985,300	貸付株式数 2,400 株
ファイズホールディングス	200	943.00	188,600	
ＮＩＳＳＯＨＤ	9,000	766.00	6,894,000	貸付株式数 3,400 株
大栄環境	22,600	3,080.00	69,608,000	貸付株式数 5,500 株
日本管財ホールディンク	10,900	2,568.00	27,991,200	
東洋埠頭	300	1,255.00	376,500	
上 組	46,500	3,372.00	156,798,000	
サンリツ	300	780.00	234,000	
キムラユニティー	500	1,445.00	722,500	
キユーソー流通システム	6,700	2,414.00	16,173,800	貸付株式数 1,800 株
東海運	600	320.00	192,000	貸付株式数 500 株
エーアイテイー	6,300	1,740.00	10,962,000	
内外トランスライン	4,000	2,804.00	11,216,000	貸付株式数 1,500 株
ショーエイコーポ	400	572.00	228,800	貸付株式数 300 株
日本コンセプト	3,700	1,795.00	6,641,500	
TBS ホールディングス	50,800	3,820.00	194,056,000	貸付株式数 19,100 株
日本テレビ HLDS	89,500	2,500.00	223,750,000	貸付株式数 7,700 株
朝日放送グループ HD	9,500	616.00	5,852,000	貸付株式数 3,100 株
テレビ朝日ＨＤ	24,500	2,213.00	54,218,500	
スカパーJSATHD	78,500	886.00	69,551,000	
テレビ東京ＨＤ	6,200	3,045.00	18,879,000	貸付株式数 2,400 株
日本ＢＳ放送	400	887.00	354,800	貸付株式数 300 株
ビジョン	15,100	1,420.00	21,442,000	貸付株式数 5,800 株
スマートバリュー	300	300.00	90,000	貸付株式数 200 株
U-NEXT HOLDINGS	33,900	1,661.00	56,307,900	貸付株式数 12,500 株
ワイヤレスゲート	500	215.00	107,500	
日本通信	81,400	138.00	11,233,200	貸付株式数 33,900 株
クロップス	100	986.00	98,600	
日本電信電話	30,067,400	155.20	4,666,460,480	貸付株式数 5,224,500 株
ＫＤＤＩ	743,500	4,957.00	3,685,529,500	
ソフトバンク	16,175,000	195.00	3,154,125,000	
光通信	11,700	33,060.00	386,802,000	貸付株式数 400 株
エムティーアイ	6,900	1,280.00	8,832,000	貸付株式数 2,000 株
GMO インターネットグループ	32,900	2,606.00	85,737,400	
ファイバーゲート	5,400	937.00	5,059,800	貸付株式数 1,700 株
アイドママーケティングコミュ	300	225.00	67,500	貸付株式数 200 株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	53,400	4,384.00	234,105,600	貸付株式数 9,300 株
学研ホールディングス	18,500	1,026.00	18,981,000	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ゼンリン	17,300	810.00	14,013,000	
昭文社ホールディングス	500	394.00	197,000	
インプレスホールディングス	1,100	138.00	151,800	貸付株式数 1,000株
東京電力ＨＤ	847,900	542.30	459,816,170	貸付株式数 326,500株
中部電力	371,400	1,611.00	598,325,400	
関西電力	505,600	1,995.50	1,008,924,800	貸付株式数 167,500株
中国電力	175,100	961.30	168,323,630	
北陸電力	103,100	904.40	93,243,640	貸付株式数 38,700株
東北電力	265,300	1,256.00	333,216,800	
四国電力	93,900	1,255.00	117,844,500	
九州電力	232,300	1,529.50	355,302,850	
北海道電力	105,500	873.80	92,185,900	貸付株式数 41,500株
沖縄電力	25,700	956.00	24,569,200	貸付株式数 9,000株
電源開発	75,900	2,522.50	191,457,750	
エフオン	7,300	409.00	2,985,700	
イーレックス	19,600	626.00	12,269,600	貸付株式数 7,600株
レノバ	27,500	786.00	21,615,000	貸付株式数 10,700株
東京瓦斯	190,500	4,521.00	861,250,500	
大阪瓦斯	198,000	3,297.00	652,806,000	
東邦瓦斯	39,700	3,814.00	151,415,800	貸付株式数 15,600株
北海道瓦斯	30,100	540.00	16,254,000	貸付株式数 5,000株
広島ガス	21,300	375.00	7,987,500	
西部ガス HLDGS	10,500	1,735.00	18,217,500	貸付株式数 4,000株
静岡ガス	23,000	1,017.00	23,391,000	
メタウォーター	13,800	1,790.00	24,702,000	
アイネット	6,100	1,615.00	9,851,500	貸付株式数 2,300株
松 竹	5,800	10,700.00	62,060,000	貸付株式数 1,500株
東 宝	63,300	6,535.00	413,665,500	
エイチ・アイ・エス	33,100	1,790.00	59,249,000	貸付株式数 5,300株
東 映	16,700	6,300.00	105,210,000	貸付株式数 6,500株
ラックランド	4,300	1,898.00	8,161,400	貸付株式数 1,200株
NTT データグループ	264,300	2,879.50	761,051,850	
共立メンテナンス	32,500	2,747.00	89,277,500	貸付株式数 12,800株 (600株)
イチネンホールディングス	10,100	1,877.00	18,957,700	
建設技術研究所	5,300	4,855.00	25,731,500	貸付株式数 1,600株
スペース	7,500	1,143.00	8,572,500	
アインホールディングス	14,700	5,020.00	73,794,000	貸付株式数 4,300株
燦ホールディングス	8,700	1,037.00	9,021,900	
ピー・シー・エー	6,600	2,142.00	14,137,200	
スバル興業	4,000	2,935.00	11,740,000	貸付株式数 600株
東京テアトル	400	1,086.00	434,400	貸付株式数 200株
タナベコンサルティンググル	4,500	1,198.00	5,391,000	貸付株式数 1,100株
ビジネスＢ太田昭和	4,300	2,095.00	9,008,500	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ナ ガ ワ	2,800	6,120.00	17,136,000	貸付株式数 700 株
東京都競馬	7,600	4,285.00	32,566,000	貸付株式数 3,000 株
カナモト	16,100	2,922.00	47,044,200	
ＤＴＳ	18,300	4,240.00	77,592,000	
スクウェア・エニックス・HD	50,800	6,040.00	306,832,000	
シーイーシー	12,800	2,042.00	26,137,600	
カプコン	200,900	3,510.00	705,159,000	
ニシオホールディングス	8,600	3,720.00	31,992,000	
アイ・エス・ビー	4,700	1,388.00	6,523,600	貸付株式数 1,200 株
アゴーラ ホスピタリティーG	7,200	45.00	324,000	貸付株式数 6,800 株
日本空港ビルデング	35,100	5,099.00	178,974,900	貸付株式数 8,300 株
トランス・コスモス	13,200	3,435.00	45,342,000	
乃村工藝社	45,200	775.00	35,030,000	
ＳＣＳＫ	82,500	3,043.00	251,047,500	
藤田観光	4,600	8,930.00	41,078,000	貸付株式数 1,000 株
KNT-CT ホールディングス	6,200	1,200.00	7,440,000	貸付株式数 1,000 株
トーカイ	9,200	2,190.00	20,148,000	
白 洋 舎	200	2,244.00	448,800	貸付株式数 100 株
セコム	211,000	5,256.00	1,109,016,000	
ＮＳＷ	4,500	3,080.00	13,860,000	
セントラル警備保障	5,600	2,687.00	15,047,200	
アイネス	7,900	1,731.00	13,674,900	
丹青社	21,900	808.00	17,695,200	
メイテックグループホールデ	38,200	2,823.50	107,857,700	
ＴＫＣ	18,000	3,875.00	69,750,000	貸付株式数 3,500 株
富士ソフト	26,300	9,568.00	251,638,400	
応用地質	9,700	2,410.00	23,377,000	
船井総研ホールディン	20,700	2,401.00	49,700,700	貸付株式数 6,600 株
ＮＳＤ	38,900	3,430.00	133,427,000	貸付株式数 9,400 株
進学会ホールディングス	400	201.00	80,400	貸付株式数 200 株 (200 株)
丸紅建材リース	100	2,900.00	290,000	
オ オ バ	800	989.00	791,200	
コナミグループ	37,900	14,960.00	566,984,000	
いであ	300	2,498.00	749,400	
学 究 社	4,100	1,916.00	7,855,600	
イオンディライト	11,100	4,495.00	49,894,500	
ナック	10,500	579.00	6,079,500	貸付株式数 2,400 株
福井コンピュータ HLDS	7,000	2,901.00	20,307,000	
ダイセキ	25,000	3,945.00	98,625,000	貸付株式数 2,600 株
ステップ	3,800	2,027.00	7,702,600	
泉州電業	7,300	5,160.00	37,668,000	貸付株式数 2,800 株
GENKI GLOBAL DIN	6,000	3,700.00	22,200,000	貸付株式数 200 株

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
トラスコ中山	22,400	2,164.00	48,473,600	
ヤマダホールディングス	328,000	450.80	147,862,400	
オートバックスセブン	37,100	1,428.00	52,978,800	
モリト	8,500	1,485.00	12,622,500	
アークランズ	31,700	1,676.00	53,129,200	
ニトリホールディングス	38,800	19,190.00	744,572,000	
グルメ杵屋	8,600	1,064.00	9,150,400	貸付株式数 2,500株
愛 眼	800	145.00	116,000	
ケーユーホールディングス	6,200	1,132.00	7,018,400	
吉野家ホールディングス	41,700	3,235.00	134,899,500	貸付株式数 16,400株 (4,400株)
加藤産業	13,200	4,495.00	59,334,000	
北恵	300	783.00	234,900	
イノテック	7,200	1,385.00	9,972,000	
イエローハット	18,800	2,551.00	47,958,800	貸付株式数 7,400株
松屋フーズHLDGS	5,000	6,470.00	32,350,000	
JBCCホールディングス	6,700	4,720.00	31,624,000	
JKホールディングス	8,200	1,048.00	8,593,600	
サガミホールディングス	17,100	1,739.00	29,736,900	貸付株式数 5,400株 (5,400株)
日 伝	6,100	3,060.00	18,666,000	貸付株式数 2,300株
ミロク情報サービス	9,200	1,938.00	17,829,600	貸付株式数 900株
北沢産業	800	356.00	284,800	貸付株式数 700株
杉本商事	9,500	1,349.00	12,815,500	貸付株式数 1,500株
因幡電機産業	29,800	3,854.00	114,849,200	
王将フードサービス	21,100	3,015.00	63,616,500	貸付株式数 6,000株
ミニストップ	8,900	1,777.00	15,815,300	貸付株式数 3,400株 (1,200株)
アークス	17,900	2,532.00	45,322,800	
バローホールディングス	20,300	2,131.00	43,259,300	
東 テ ク	10,500	2,469.00	25,924,500	貸付株式数 4,200株
ミスミグループ本社	161,100	2,452.50	395,097,750	
アルテック	600	212.00	127,200	
ベ ル ク	5,300	6,700.00	35,510,000	
大 庄	6,400	1,041.00	6,662,400	貸付株式数 2,300株 (200株)
タキヒヨー	300	1,221.00	366,300	貸付株式数 200株
ファーストリテイリング	60,000	50,430.00	3,025,800,000	
ソフトバンクグループ	498,600	8,906.00	4,440,531,600	
蔵王産業	200	2,410.00	482,000	
スズケン	35,200	4,699.00	165,404,800	貸付株式数 6,800株
サンドラッグ	36,000	3,687.00	132,732,000	
サックスバーホールディング	10,100	918.00	9,271,800	貸付株式数 3,000株
ジェコス	6,400	982.00	6,284,800	
ヤマザワ	200	1,173.00	234,600	

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
や ま や	300	2,829.00	848,700	貸付株式数 100株
ベルーナ	25,700	752.00	19,326,400	貸付株式数 9,600株
合計			391,517,177,670	

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024 年 12 月 30 日

Ⅰ	資産総額	21,825,195,385 円
Ⅱ	負債総額	20,468,791 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,804,726,594 円
Ⅳ	発行済数量	9,127,942,901 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3888 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 12 月 30 日

Ⅰ	資産総額	431,783,605,199 円
Ⅱ	負債総額	14,239,153,946 円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	417,544,451,253 円
Ⅳ	発行済数量	203,873,244,351 口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0481 円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

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

(5) 受益権の譲渡
① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2024 年 12 月末日現在

資本金の額　　414 億 2,454 万 1,896 円

発行可能株式総数　799 万 9,980 株

発行済株式総数　　326 万 657 株

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

ｂ．委託会社の機構

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 12 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	91	340,875
追加型株式投資信託	791	30,692,916
株式投資信託　　合計	882	31,033,791
単位型公社債投資信託	77	144,018
追加型公社債投資信託	14	1,440,104
公社債投資信託　合計	91	1,584,122
総合計	973	32,617,913

３【委託会社等の経理状況】

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

　また、当社の中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第282条及び第306条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第65期事業年度（2023年４月１日から2024年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

　また、第66期事業年度に係る中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による中間監査を受けております。

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

独立監査人の監査報告書

2024 年５月 27 日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	間瀬　友未
指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	渡部　啓太

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2024年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以　上

(注) 1.　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2.　XBRL データは監査の対象には含まれていません。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 (2023年３月31日)		当事業年度 (2024年３月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		1,982		4,813
有価証券		346		503
前払費用		393		481
未収委託者報酬		12,525		16,513
未収収益		47		78
関係会社短期貸付金		22,100		23,400
その他		59		88
流動資産計		37,455		45,878
固定資産				
有形固定資産	※1	196	※1	176
建物		3		2
器具備品		193		174
無形固定資産		1,482		1,342
ソフトウェア		1,351		1,063
ソフトウェア仮勘定		131		279
投資その他の資産		13,824		13,660
投資有価証券		8,260		8,448
関係会社株式		3,475		3,475
出資金		177		177
長期差入保証金		1,066		1,021
繰延税金資産		824		524
その他		20		12
固定資産計		15,503		15,180
資産合計		52,959		61,058

（単位:百万円）

	前事業年度 （2023年３月31日）		当事業年度 （2024年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		101		158
未払金		5,874		6,187
未払収益分配金		38		39
未払償還金		12		12
未払手数料		4,525		5,849
その他未払金	※2	1,297	※2	285
未払費用		3,987		5,035
未払法人税等		560		3,842
未払消費税等		327		872
賞与引当金		692		1,048
その他		2		1
流動負債計		11,545		17,146
固定負債				
退職給付引当金		2,276		2,227
役員退職慰労引当金		51		62
その他		0		－
固定負債計		2,329		2,289
負債合計		13,874		19,435
純資産の部				
株主資本				
資本金		15,174		15,174
資本剰余金				
資本準備金		11,495		11,495
資本剰余金合計		11,495		11,495
利益剰余金				
利益準備金		374		374
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		11,505		13,048
利益剰余金合計		11,879		13,422
株主資本合計		38,549		40,092
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		534		1,530
評価・換算差額等合計		534		1,530
純資産合計		39,084		41,623
負債・純資産合計		52,959		61,058

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	69,845	76,221
その他営業収益	559	717
営業収益計	70,405	76,939
営業費用		
支払手数料	29,405	31,497
広告宣伝費	662	947
調査費	9,638	10,709
調査費	1,469	1,700
委託調査費	8,169	9,009
委託計算費	1,783	1,783
営業雑経費	1,658	2,285
通信費	181	163
印刷費	468	514
協会費	51	51
諸会費	17	18
その他営業雑経費	939	1,538
営業費用計	43,147	47,224
一般管理費		
給料	5,788	6,601
役員報酬	317	483
給料・手当	4,369	4,543
賞与	409	527
賞与引当金繰入額	692	1,048
福利厚生費	874	969
交際費	66	96
旅費交通費	95	192
租税公課	476	508
不動産賃借料	1,300	1,269
退職給付費用	488	334
役員退職慰労引当金繰入額	38	6
固定資産減価償却費	625	478
諸経費	2,193	1,888
一般管理費計	11,946	12,346
営業利益	15,310	17,368

（単位:百万円）

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2022 年４月１日 至　2023 年３月 31 日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）

（単位：百万円）

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	534	534	39,084
当期変動額			
剰余金の配当	－	－	△ 10,316
当期純利益	－	－	11,859
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	995	995	995
当期変動額合計	995	995	2,538
当期末残高	1,530	1,530	41,623

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18 年
器具備品	４～20 年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（表示方法の変更）

（損益計算書関係）

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の 100 分の 10 を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

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

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

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

※２　関係会社項目

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

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

３　保証債務

前事業年度（2023 年３月 31 日）

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

当事業年度（2024 年３月 31 日）

子会社である Daiwa Asset Management(Singapore)Ltd. の債務 2,354 百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

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

（２）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合　　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

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

（２）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2024 年６月 19 日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

①剰余金の配当の総額　11,858百万円
②配当の原資　利益剰余金
③１株当たり配当額　4,546円
④基準日　2024年３月31日
⑤効力発生日　2024年６月20日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主にグループ通算制度における通算親法人へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したことにより発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

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（2023 年３月 31 日）
（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

当事業年度（2024 年３月 31 日）
（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券	144	8,141	－	8,285
資産合計	144	8,141	－	8,285

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債
現金・預金、未収委託者報酬、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（１年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

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

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

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2023年３月31日）

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

当事業年度（2024年３月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2023年３月31日）

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

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

当事業年度（2024年３月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	144	55	89
（２）その他	6,597	4,268	2,329
小計	6,742	4,323	2,419
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,543	1,756	△213
小計	1,543	1,756	△213
合計	8,285	6,079	2,205

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（１）株式	－	－	－
（２）その他			
証券投資信託	1,455	220	1
合計	1,455	220	1

４．減損処理を行った有価証券

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

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

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

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

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

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

（３）退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

（注）その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度184百万円、当事業年度187百万円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 （2023年３月31日）	当事業年度 （2024年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	697	681
賞与引当金	182	262
投資有価証券評価損	177	204
未払事業税	114	197
関係会社株式評価損	155	155
出資金評価損	94	94
システム関連費用	68	25
その他	309	289
繰延税金資産小計	1,799	1,910
評価性引当額	△ 459	△ 486
繰延税金資産合計	1,339	1,424
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△ 356	△ 740
連結法人間取引（譲渡益）	△ 159	△ 159
繰延税金負債合計	△ 515	△ 899
繰延税金資産の純額	824	524

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

前事業年度（2023年３月31日）

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

当事業年度（2024年３月31日）

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

３．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

（収益認識関係）

（１）　顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が 76,221 百万円、その他 717 百万円であります。

（２）　収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	11,100 0	関係会社短期貸付金 －	23,400 －

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　2022 年４月１日　至　2023 年３月 31 日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	2,354	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自　2023 年４月１日　至　2024 年３月 31 日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注２） 不動産の賃借料（注３）	13,749 1,030	未払手数料 長期差入保証金	3,491 1,010
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注４）	902	未払費用	87

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）		当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）	
１株当たり純資産額	14,983.42円	１株当たり純資産額	15,956.63円
１株当たり当期純利益	3,955.35円	１株当たり当期純利益	4,546.57円

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

（注２）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
当期純利益（百万円）	10,317	11,859
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）
（株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行）

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

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

独立監査人の中間監査報告書

2024 年 11 月 25 日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	渡部　啓太
指定有限責任社員 業 務 執 行 社 員	公認会計士	松田　好弘

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2024年４月１日から2025年３月31日までの第66期事業年度の中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2024年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の

執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

(注) 1.　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2.　XBRL データは監査の対象には含まれていません。

中間財務諸表

（１）中間貸借対照表

（単位：百万円）

		当中間会計期間 （2024年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		4,555
有価証券		1,271
未収委託者報酬		18,273
関係会社短期貸付金		16,900
その他		916
流動資産合計		41,916
固定資産		
有形固定資産	※１	60
無形固定資産		
ソフトウエア		878
その他		346
無形固定資産合計		1,225
投資その他の資産		
投資有価証券		9,666
関係会社株式		3,414
繰延税金資産		748
その他		1,095
投資その他の資産合計		14,924
固定資産合計		16,211
資産合計		58,128

（単位：百万円）

		当中間会計期間 （2024年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		6,580
未払費用		5,540
未払法人税等		4,405
賞与引当金		910
その他	※２	1,107
流動負債合計		18,545
固定負債		
退職給付引当金		2,270
役員退職慰労引当金		55
固定負債合計		2,325
負債合計		20,870
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		8,774
利益剰余金合計		9,148
株主資本合計		35,818
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,438
評価・換算差額等合計		1,438
純資産合計		37,257
負債・純資産合計		58,128

（２）中間損益計算書

（単位：百万円）

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

（３）中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2024 年４月１日 至　2024 年９月 30 日）

（単位：百万円）

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

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

注記事項
（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法
（１）子会社及び関連会社株式
移動平均法による原価法により計上しております。

（２）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エアについては、社内における利用可能期間（５年間）に基づく定額法によっております。

３．引当金の計上基準
（１）賞与引当金
役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

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

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

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

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

５．その他中間財務諸表の作成のための基本となる重要な事項

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

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 (2024 年９月 30 日現在)
有形固定資産	358百万円

※２　消費税等の取扱い

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

３　保証債務

当中間会計期間（2024年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,340百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

※１　減価償却実施額

	当中間会計期間 （自　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
有形固定資産	9百万円
無形固定資産	211百万円

※２　営業外収益の主要項目

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

※３　営業外費用の主要項目

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

※４　特別利益の項目

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

※５　特別損失の項目

	当中間会計期間 （自　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
固定資産売却損	
美術品	85百万円
ゴルフ会員権	15百万円
投資有価証券評価損	53百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）
当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項　（単位：千株）

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

２．配当に関する事項
配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2024年６月19日定時株主総会	普通株式	11,858	4,546	2024年３月31日	2024年６月20日

（金融商品関係）
当中間会計期間（2024年９月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券	1,602	8,991	－	10,594
資産合計	1,602	8,991	－	10,594

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

市場で取得した株式及び上場投資信託は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。当社が保有している証券投資信託のうちレベル１の時価を採用しているもの以外は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル２に分類しております。

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

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	342
子会社株式	1,386
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2024年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額　1,386百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

２．その他有価証券

	中間貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	123	55	67
（２）その他	6,715	4,477	2,238
小計	6,838	4,532	2,306
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,756	3,988	△232
小計	3,756	3,988	△232
合計	10,594	8,520	2,073

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額　342百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が 44,508 百万円、その他 483 百万円であります。

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

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

［関連情報］

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

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

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

（注２）　１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　2024年４月１日 至　2024年９月30日）	
中間純利益(百万円)	7,584
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,584
普通株主に帰属しない金額(百万円)	－
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

（株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行）

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

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式　652,132株
払込金額	1株につき80,506円
払込金額の総額	52,500,538,792円
増加する資本金の金額	26,250,269,396円
払込日	2024年10月1日
資金の使途	投融資及び運転資金に充当する予定であります。
新株式発行前の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：100%
新株式発行後の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：80% 株式会社かんぽ生命保険：20%

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 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

追加型証券投資信託

（年金ダイワ日本株式インデックス）

約　　款

大和アセットマネジメント株式会社

約款第19条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

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

２．運用方法

(1) 投資対象

トピックス・インデックス・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 投資成果を東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

② 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として、信託財産総額の50％以下とします。

④ 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、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 外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資は、行ないません。

３．収益分配方針

① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とします。

② 原則として、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③ 留保益は、上記「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

追加型証券投資信託
（年金ダイワ日本株式インデックス）
約　　款

（信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託）
第 1条　この信託は、証券投資信託であり、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。
②　この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
③　受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
④　前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行なうものとします。
（信託の目的および金額）
第 2条　委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。
（信託金の限度額）
第 3条　委託者は、受託者と合意のうえ、1,000億円を限度として信託金を追加することができます。
②　追加信託が行なわれたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。
③　委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。
（信託期間）
第 4条　この信託の期間は、信託契約締結日から第40条第1項、第41条第1項、第42条第1項および第44条第2項の規定による信託終了日までとします。
（受益権の取得申込の勧誘の種類）
第 5条　この信託にかかる受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。
（当初の受益者）
第 6条　この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。
（受益権の分割および再分割）
第 7条　委託者は、第2条の規定による受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。
②　委託者は、受益権の再分割を行ないません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
（追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法）
第 8条　追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。
②　この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。
（信託日時の異なる受益権の内容）
第 9条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。
（受益権の帰属と受益証券の不発行）
第10条　この信託のすべての受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下

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

② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

③ 委託者は、第7条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

（受益権の設定にかかる受託者の通知）

第11条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

（受益権の申込単位および価額）

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

② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。）（以下総称して「指定販売会社」といいます。）は、第7条第1項の規定により分割される受益権を別に定める積立投資約款に従って契約（以下「積立投資契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1円以上1円単位をもって取得の申込に応じることができます。

③ 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

④ 第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益証券の価額は、1口につき1円に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

⑤ 前項の規定にかかわらず、受益者が積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第30条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

（受益権の譲渡にかかる記載または記録）

第12条の2 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（受益権の譲渡の対抗要件）

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

第13条　（削　　除）
第14条　（削　　除）
第15条　（削　　除）
（投資の対象とする資産の種類）
第16条　この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。
1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
イ．有価証券
ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条に定めるものに限ります。）
ハ．約束手形
ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
イ．為替手形
（有価証券および金融商品の指図範囲等）
第17条　委託者は、信託金を、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたトピックス・インデックス・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
3. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
（受託者の自己または利害関係人等との取引）
第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第21条において同じ。）、第21条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条および第17条に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行なうことができます。
② 前項の取扱いは、第20条、第25条から第27条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。
（運用の基本方針）
第19条　委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行ないます。
（先物取引等の運用指図）
第20条　委託者は、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号

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

（デリバティブ取引等にかかる投資制限）

第20条の2　委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（信用リスク集中回避のための投資制限）

第20条の3　一般社団法人投資信託協会規則に定める一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21条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②　受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③　前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存にかかる業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第22条　（削　　除）

（混蔵寄託）

第23条　金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行されたコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第24条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

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

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

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

（一部解約の請求および有価証券売却等の指図）

第25条　委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第26条　委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第27条　委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

②　一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10％を超えないこととします。

③　収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④　借入金の利息は信託財産中から支弁します。

（損益の帰属）

第28条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（信託終了時における受託者による資金の立替え）

第29条　信託終了日までに金額を見積ることのできる未収入金があるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

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

（信託の計算期間）

第30条　この信託の計算期間は、毎年12月1日から翌年11月30日までとします。ただし、第1計算期間は2006年10月27日から2007年11月30日までとします。

②　前項の規定にかかわらず、前項の規定により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。

（信託財産に関する報告）

第31条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

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

（信託事務の諸費用および監査報酬）

第32条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②　信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

（信託報酬等の額および支弁の方法）

第33条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第30条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の17の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

②　前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6カ月終了日（6カ月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

③　第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

（収益の分配方式）

第34条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

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

②　毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

（収益分配金の再投資）

第35条　収益分配金（委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金を除きます。）は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、指定販売会社に支払われます。

②　指定販売会社は、積立投資契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとします。当該取得申込により増加した受益権は、第10条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。

③　委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金の支払いは、委託者において行なうものとします。

④　収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

（償還金および一部解約金の支払い）

第36条　償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

②　一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、4営業日目から受益者に支払います。

③　前2項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとします。

④　償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

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

第37条　受託者は、収益分配金については第35条に規定する交付開始前に、償還金については前条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第2項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

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

（償還金の時効）

第38条　受益者が、信託終了による償還金について第36条第1項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第39条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、1口単位をもって、委託者に一部解約請求をすることができます。

②　委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約

にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

③　前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の基準価額とします。

④　2007年1月4日以降の信託契約の一部解約にかかる一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、2007年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約請求で、2007年1月4日前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。

⑤　委託者は、金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約請求の受付を中止することができます。

⑥　前項により一部解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

（質権口記載または記録の受益権の取扱い）

第39条の2　振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

（信託契約の解約）

第40条　委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

②　委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

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

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

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

⑥　第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第41条　委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

②　委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第45条の規定に従います。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第42条　委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

②　前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第45条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

（委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い）

第43条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

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

（受託者の辞任および解任に伴う取扱い）

第44条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第45条の規定に従い、新受託者を選任します。

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

（信託約款の変更）

第45条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

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

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

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

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

（反対者の買取請求権）

第46条　第40条の規定に従い信託契約の解約を行なう場合または前条の規定に従い信託約款の変更を行なう場合において、第40条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第46条の2　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

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

（公告）

第47条　委託者が受益者に対してする公告は、2008年6月30日までは日本経済新聞に掲載し、2008年7月1日以降は電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

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

②　2008年7月1日以降において、前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

（信託約款に関する疑義の取扱い）

第48条　この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

（付　　則）

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

第 2条　第35条第4項および第36条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第 3条　2006年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条（受益証券の再交付）から第15条（受益証券の再交付の費用）の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者

がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

2006年10月27日

委託者　　大和アセットマネジメント株式会社

受託者　　三井住友信託銀行株式会社