

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2023年4月3日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 小松 幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワ上場投信 - トピックス 2023年4月4日付けで、ファンドの名称を「iFreeETF TOPIX（年1回決算型）」に変更します。
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	20兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	名 称 株式会社東京証券取引所 所在地 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

iFreeETF TOPIX（年1回決算型）

2023年4月4日付で、ファンドの名称を「ダイワ上場投信 - トピックス」から「iFreeETF TOPIX（年1回決算型）」に変更します。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

20兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

10口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5)【申込手数料】

販売会社は、当該販売会社が定める申込手数料および当該申込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。）に相当する金額を取得申込者から徴収することができるものとします。当該申込手数料は、当該販売会社および受託会社が収受するものとします。

販売会社については、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/>

(6)【申込単位】

委託会社は、取得申込みに適用される各銘柄の株式（以下「取得時のバスケット」といいます。）を所定の方法（ 1 ）によって提示するものとします。

受益権の取得申込者は、販売会社（ 2 ）に対し、取得時のバスケットを単位として受益権の取得申込みを行なうことができます。

取得時のバスケットは、日々変更されます。

原則として、所定の方法に定められる金銭の支払い以外に、金銭によって受益権の取得申込みを行なうことはできません。

（ 1 ）所定の方法

1. 委託会社は、取得申込受付日の3営業日前までに、取得申込受付日に適用される「取得時のバスケット」を定めます。委託会社は、原則として、取得時のバスケットを、取得申込可能日の毎日、インターネット・サイト「<https://www.daiwa-am.co.jp/etf/>」に掲示します。
2. 「取得時のバスケット」1単位当たりの取得口数は、取得時のバスケットの評価額を取得申込受付日の基準価額で除して得た口数をもとに、委託会社が定めるもの（10口の整数倍とします。）とします。
3. 取得時のバスケットの評価額が、委託会社が定める口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額に満たない場合には、取得申込者はその差額に相当する金銭を支払うものとします。
4. 取得時のバスケットに取得申込者の自社株式等（自社が発行した株式またはその親会社（会社法第2条第1項第4号に規定する親会社をいいます。）が発行した株式をいいます。以下同じ。）が含まれている場合には、当該株式に代えて、当該株式の評価額に、これを信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該評価額に別に定める率を乗じて得た額を加算した金額の金銭を引渡すことによって、取得の申込みに応じることができるものとします。

取得申込者は、販売会社を通じて、委託会社に取得時のバスケットに自社株式等が含まれている旨を通知するものとします。この通知が取得申込時に行なわれなかった場合において、そのことによって取得申込者または信託財産その他に損害が生じた場合には、当該取得申込者がすべての責を負うものとします。

（ 2 ）販売会社

販売会社については、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/>

(7) 【申込期間】

2023年4月4日から2023年10月3日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、取得申込みにかかる取得時のバスケットの各銘柄の株式および金銭を、当該取得申込みにかかる信託が設定される日までに販売会社に引渡し、当該取得時のバスケットの各銘柄の

株式を保護預けするものとしします。取得申込みにかかる株式については、販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、受託会社の指定するファンド口座に移管されます。(株式等に金銭が含まれる場合は、当該金銭については、販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、委託会社の口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込まれます。)

(10)【払込取扱場所】

前(9)の引渡しは、販売会社において行なうものとしします。販売会社については、前(6)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、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を東証株価指数の変動率に一致させることを目的とします。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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)	独立区分	補足分類
単位型投信	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券	MRF	
追加型投信	内外	不動産投信	ETF	特殊型
		その他資産 ()		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(注1) 商品分類の定義

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

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

(注2) 属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。)に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信	目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの	
	その他資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの	
	資産複合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配分固定型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配分変更型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの	
決算頻度	年1回	目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの	
	年2回	目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの	
	年4回	目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの	
	年6回(隔月)	目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの	
	年12回(毎月)	目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの	
	日々	目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの	
	その他	上記属性にあてはまらないすべてのもの	

投資対象地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東（中東）	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
対象インデックス	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	TOPIX	目論見書等において、TOPIXに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

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

< 信託の限度 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、20兆円に相当する株券および金銭を限度として追加信託することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、上記の限度を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1

信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を東証株価指数(TOPIX)の変動率に一致させることを目的として、東証株価指数に採用されている銘柄(採用予定を含みます。)の株式に投資します。

- 東証株価指数を構成する全銘柄の株式の時価総額構成比率の95%以上を構成する銘柄の株式を組入れることを原則とします。
- 上記に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行なうこと(有価証券指数等先物取引等を利用することを含みます。)があります。

- ・安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。
 - (a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
 - (b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク(市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。)を減じる目的
- ・市況動向、資産規模等によっては、上記の運用が行なえないことがあります。

東証株価指数(TOPIX)について

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

- ①東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。
- ② J P X は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ③ J P X は、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ J P X は、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤本件商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ J P X は、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦ J P X は、当社または本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- ⑧以上の項目に限らず、J P X は本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

2

当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

- 受益権は、東京証券取引所に上場され、株式と同様に売買することができます。
 - 売買単位は、10口単位です。
 - 取引方法は、原則として株式と同様です。
- 追加設定は、株式により行ないます。
 - 追加設定にかかる受益権の取得申込者は、取得時のバスケット（東証株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。
 - 原則として、所定の方法に定められる金銭の支払い以外に、金銭によって受益権の取得申込を行なうことはできません。

●受益権を株式と交換することができます。

- ・受益者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に対し、委託会社が定める一定口数の整数倍の受益権をもって、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換を申込むことができます。
- ・解約申込により受益権を換金することはできません。

●収益分配金は、名義登録受益者に対して支払われます。

- ・名義登録受益者とは、計算期間終了日において氏名または名称、住所および個人番号または法人番号（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所）が受託会社に登録されている者をいいます。

3 収益の分配は、計算期間ごとに、信託財産について生じる配当、受取利息その他これらに類する収益の額の合計額から支払利子、運用管理費用（信託報酬）その他これらに類する費用の額の合計額を控除した額の全額について行ないます。決算日は毎年7月10日です。

※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。

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を東証株価指数の変動率に一致させることを目的として運用を行ないます。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

- 同指数が加重平均であるため、個別銘柄の組入比率を同指数構成銘柄の時価総額構成比率と全くの同一の比率とすることができないこと
- 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
- 株価指数先物取引と指数の動きの不一致（株価指数先物取引を利用した場合）
- 株式および株価指数先物取引（株価指数先物取引を利用した場合）の最低取引単位の影響
- 株式および株価指数先物取引（株価指数先物取引を利用した場合）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
- 追加設定時、および組入銘柄の配当金や権利処理等によって信託財産に現金が発生すること

(2) 【ファンドの沿革】

2001年7月11日	信託契約締結、当初設定、運用開始
2001年7月13日	受益証券を東京証券取引所に上場
2023年4月4日	ファンドの名称を「iFreeETF TOPIX（年1回決算型）」に変更（従来は「ダイワ上場投信 - トピックス」）

(3) 【ファンドの仕組み】

	名 称	関係業務の内容
委託 会社	大和アセットマネジメント株式 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。）（ 1 ）の委託者であり、受益 権の募集・発行、信託財産の運用指図、受益権とその 信託財産に属する株式との交換の指図、信託財産の計 算等を行ないます。
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（ 1 ）の受託者であり、委託会社の指図 に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行 ないます。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。
取扱 窓口	販売会社	受益権の募集、交換の取扱い等に関する委託会社お よび受託会社との三者間契約（ 2 ）に基づき、受益 権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株 式との交換に関する事務等を行ないます。

1：「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。

2：受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務の内容等が規定されています。

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。

< 委託会社の概況（2023年1月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

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

・ 大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率

		株	%
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	100.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

委託会社は、信託財産の運用にあたっては、次の基本方針にしたがって、その指図を行ないます。

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を東証株価指数の変動率に一致させることを目的として、東証株価指数に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式に対する投資として運用を行ないます。

東証株価指数を構成する全銘柄の株式の時価総額構成比率の95%以上を構成する銘柄の株式を組入れることを原則とします。

前 および前 の基本方針に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行なうこと（有価証券指数等先物取引等を利用することを含みます。）があります。

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

イ．投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

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

市況動向、資産規模等によっては、上記の運用を行なえないことがあります。

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

(2)【投資対象】

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

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
6. 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。）

なお、前1.の証券または証券を「株式」といいます。

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

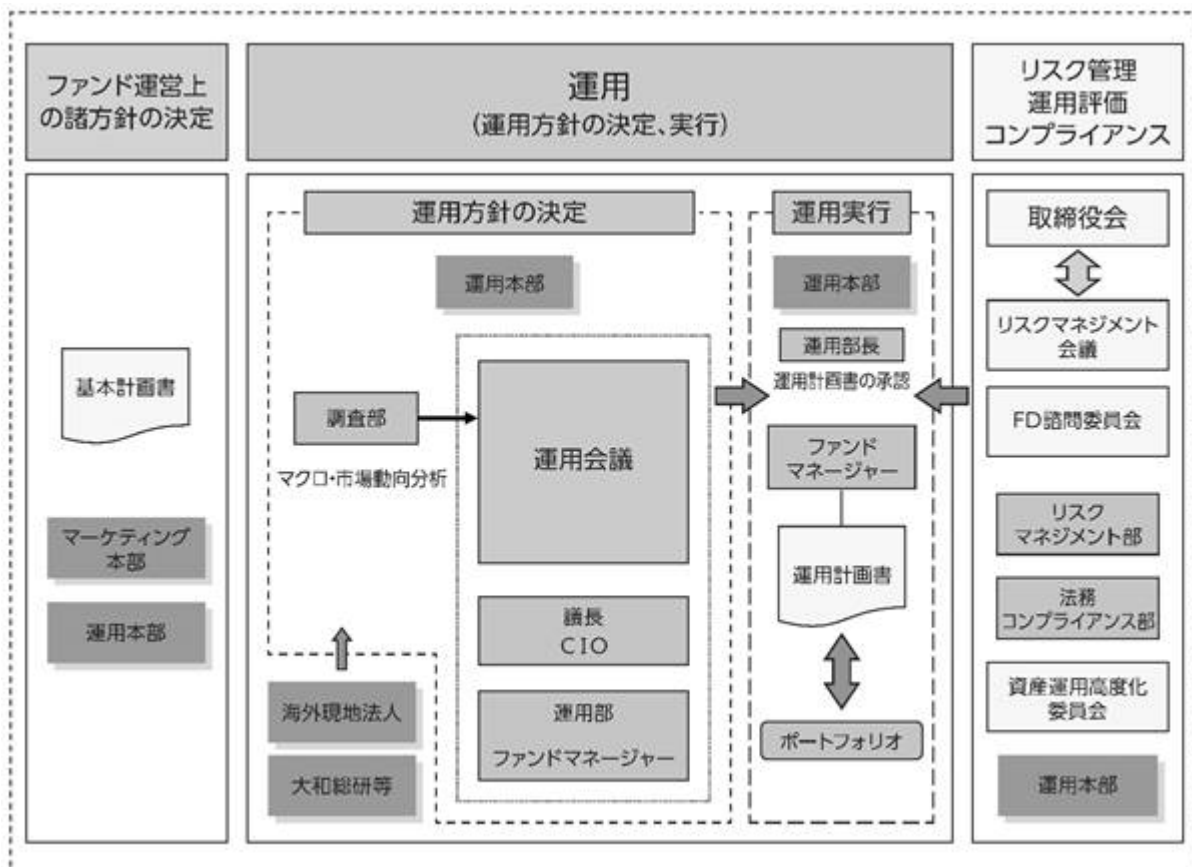
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

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

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．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。

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

上記の運用体制は2023年1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】

収益の分配は、計算期間ごとに、信託財産について生じる配当、受取利息その他これらに類する収益の額の合計額から支払利子、信託報酬その他これらに類する費用の額の合計額を控除した額の全額について行ないます。

(5)【投資制限】

株式(信託約款)

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資する株式の範囲(信託約款)

イ. 委託会社が投資することを指図する株式は、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号口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。)に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

ロ. 前イ.にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

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。

デリバティブ取引等(信託約款)

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

有価証券の貸付け(信託約款)

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

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

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

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

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

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への投資は、行ないません。

信用リスク集中回避（信託約款）

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

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。くわしくは「第2 管理及び運営」をご参照下さい。

(3) その他の留意点

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

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

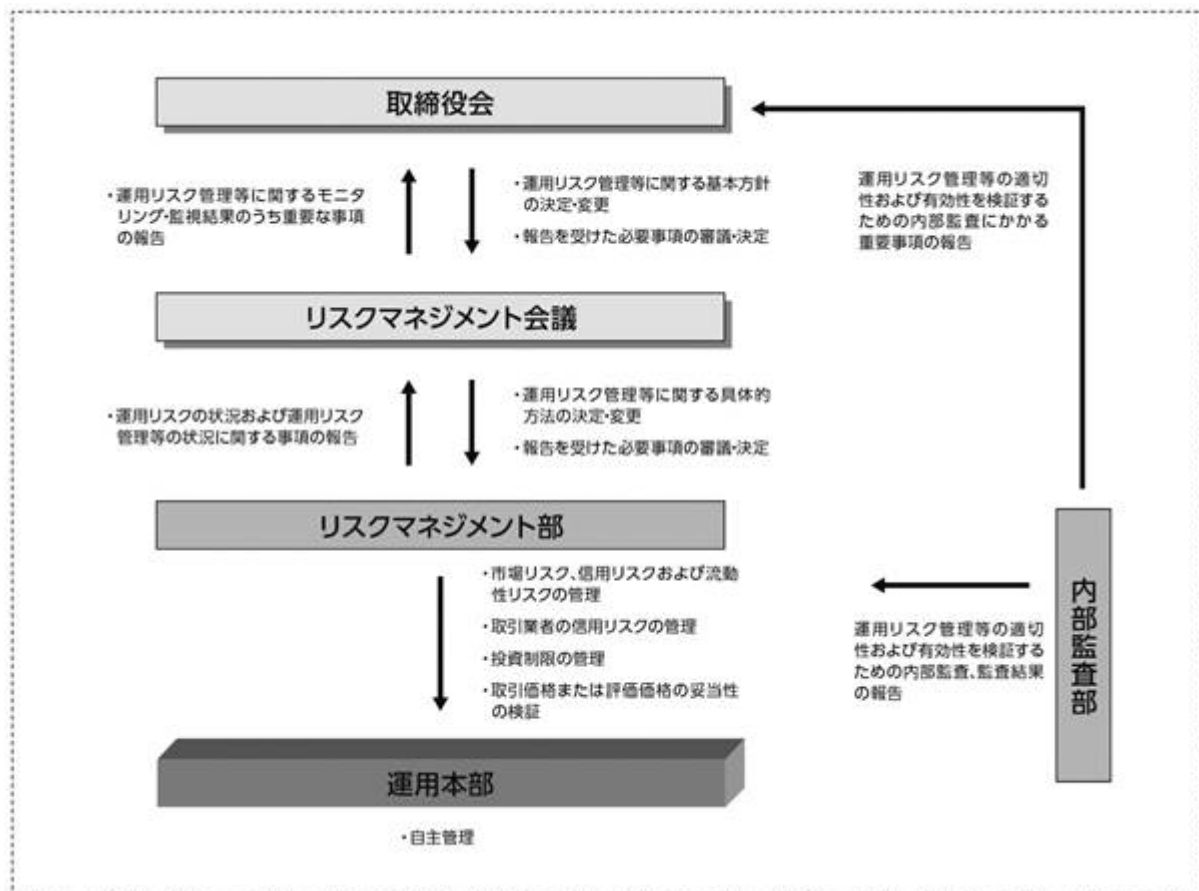
流動性リスクに関する事項

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

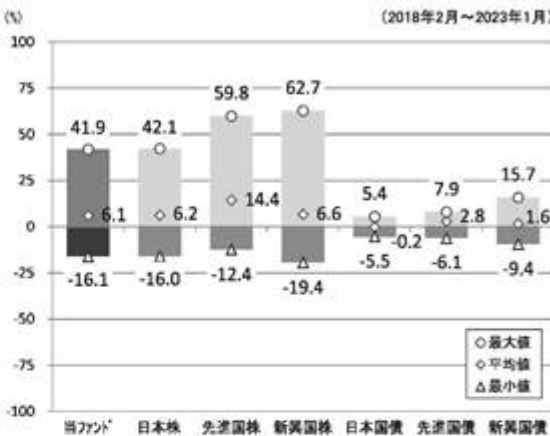
参考情報

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

※指数について

●東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社「J P X」総研または株式会社「J P X」総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利は「J P X」が有します。「J P X」は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[<https://www.daiwa-am.com.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・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社は、当該販売会社が定める申込手数料および当該申込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。）に相当する金額を取得申込者から徴収することができるものとします。当該申込手数料は、当該販売会社および受託会社が収受するものとします。

販売会社については、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/>

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

販売会社は、受益権の交換または買取りに際して、当該販売会社が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受益者から徴収することができるものとします。当該手数料は、販売会社ならびに受託会社が収受するものとします。

販売会社については、前(1)をご参照下さい。

信託財産留保額

ありません。

交換手数料は、受益権の交換に関する事務等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、次のイ.の額にロ.の額を加算して得た額とします。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か月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

イ. 信託財産の純資産総額に年率10,000分の6.6（税抜10,000分の6）以内を乗じて得た額

ロ. 信託財産に属する株式の貸付けにかかる品貸料（貸付株券から発生する配当金相当額等を含まないものとし、株式の貸付けにあたって担保として現金を受入れた場合には、当該現金の運用により生じたとみなし得る収益を加算し、貸付けの相手方に支払う当該現金に対する利息額を控除するものとします（控除した額が負数のときは零とします。）。）に100分の55（税抜100分の50）以内の率を乗じて得た額。

なお、提出日現在における上記イ.およびロ.に定める率は、次のとおりとなっております（今後、変更されることがあります。）。

イ. 年率10,000分の6.6（税抜10,000分の6）

ロ. 100分の55（税抜100分の50）

ただし、イ.とロ.の合計は、年率0.275%以内（税抜0.25%以内）

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。

提出日現在における信託報酬にかかる委託会社、受託会社への配分については、次のとおりとなっております（今後、変更されることがあります。）。

イ. 前 イ.の報酬

委託会社 年率10,000分の4（税抜）

受託会社 年率10,000分の2（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。

ロ. 前 ロ.の報酬

委託会社 報酬の50%

受託会社 報酬の50%

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、目論見書作成等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、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ならびに信託財産にかかる監査報酬および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。なお、受益権の上場にかかる費用および対象指数の商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（以下「商標使用料」といいます。）ならびにこれらにかかる消費税等に相当する金額を、受益者の負担として信託財産中から支弁することができます。ただし、各計算期間において、信託財産中から支弁する受益権の上場にかかる費用および商標使用料の合計額は、信託財産の純資産総額に年率10,000分の6.6（税抜10,000分の6）を乗じて得た額を超えないものとしします。

* 提出日現在、商標使用料は信託財産の純資産総額に、年率10,000分の3.3（税抜10,000分の3）以内を乗じて得た額（ただし、165万円(税抜150万円)を下回る場合は、165万円(税抜150万円)）となります。

* 提出日現在、上場にかかる費用は以下となります。

- ・年間上場料：毎年末の純資産総額に対して、最大0.00825%（税抜0.0075%）
- ・追加上場料：追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して、0.00825%（税抜0.0075%）

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は、信託財産中より支弁します。

（ ）売買委託手数料などの「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。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は特定株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

受益権を売却される場合には、「申告分離課税」の取扱いとなり、譲渡益に対して20%（所得税15%および地方税5%）の税率で課税されます。

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。

受益権を譲渡して生じた損失金額は上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益・償還差益および申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得・利子所得と通

算できます。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。売却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。

ロ．収益分配金の受取時

収益分配金は、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ます。

ただし、2037年12月31日まで、収益分配金の受取時に、収益分配金に対する所得税の源泉徴収額に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。

収益分配金については、源泉徴収のみで課税関係が終了する申告不要制度を選択することができます。

一方、確定申告を行なう場合には、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択します。総合課税を選択した場合は、配当控除の適用があり、その取扱いは、株式の配当金と同様となります。

ハ．受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、前イ．と同様の取扱いとなります。

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。

法人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、受益権の取得価額と売却価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されます。

ロ．収益分配金の受取時

収益分配金は、配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収（ ）されます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

ただし、2037年12月31日までは基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。益金不算入制度が適用されます。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

ハ．受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、前イ．と同様の取扱いとなります。

() 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

() 上記は、2023年1月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】（2023年1月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	7,399,086,366,250	98.32
内 日本	7,399,086,366,250	98.32
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	126,674,498,779	1.68
純資産総額	7,525,760,865,029	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)	125,878,860,000	1.67
内 日本	125,878,860,000	1.67

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

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

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

(2)【投資資産】（2023年1月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	143,052,800	2,103.92 300,972,218,622	1,896.50 271,299,635,200	3.60
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	18,429,000	11,138.69 205,274,952,560	11,580.00 213,407,820,000	2.84
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	162,912,800	725.28 118,157,723,138	952.70 155,207,024,560	2.06
4	キーエンス	日本	株式	電気機器	2,606,400	49,704.82 129,550,645,534	59,280.00 154,507,392,000	2.05
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	33,480,300	3,838.81 128,524,628,012	3,892.00 130,305,327,600	1.73

6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	18,750,000	4,073.99 76,387,312,659	5,652.00 105,975,000,000	1.41
7	武田薬品	日本	株式	医薬品	23,123,000	3,885.80 89,851,359,020	4,090.00 94,573,070,000	1.26
8	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	15,107,200	5,405.00 81,654,493,139	6,144.00 92,818,636,800	1.23
9	任天堂	日本	株式	その他製品	16,448,100	5,797.14 95,352,051,625	5,625.00 92,520,562,500	1.23
10	第一三共	日本	株式	医薬品	22,762,600	3,527.57 80,296,765,816	4,064.00 92,507,206,400	1.23
11	日立	日本	株式	電気機器	12,794,900	6,493.94 83,089,365,687	6,782.00 86,775,011,800	1.15
12	信越化学	日本	株式	化学	4,404,000	15,993.06 70,433,445,549	19,075.00 84,006,300,000	1.12
13	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1,837,900	43,529.16 80,002,249,774	45,170.00 83,017,943,000	1.10
14	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	19,827,300	4,247.03 84,207,270,848	4,144.00 82,164,331,200	1.09
15	KDDI	日本	株式	情報・通信業	20,190,600	4,291.75 86,653,201,515	4,059.00 81,953,645,400	1.09
16	HOYA	日本	株式	精密機器	5,564,300	12,235.49 68,081,953,089	14,200.00 79,013,060,000	1.05
17	三井物産	日本	株式	卸売業	20,168,800	2,861.77 57,718,649,603	3,820.00 77,044,816,000	1.02
18	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	37,107,700	1,563.51 58,018,466,440	2,027.50 75,235,861,750	1.00
19	三菱商事	日本	株式	卸売業	17,234,100	3,891.39 67,064,720,649	4,336.00 74,727,057,600	0.99
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	16,984,700	3,805.82 64,640,822,722	4,183.00 71,047,000,100	0.94
21	ダイキン工業	日本	株式	機械	3,141,200	22,052.70 69,271,946,067	22,470.00 70,582,764,000	0.94
22	東京海上HD	日本	株式	保険業	25,836,900	2,653.03 68,546,187,162	2,714.00 70,121,346,600	0.93
23	本田技研	日本	株式	輸送用機器	21,177,300	3,251.52 68,858,462,246	3,207.00 67,915,601,100	0.90
24	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	41,974,600	1,524.63 63,995,843,689	1,486.50 62,395,242,900	0.83
25	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	2,834,600	18,153.73 51,458,574,653	21,580.00 61,170,668,000	0.81

26	ファナック	日本	株式	電気機器	2,557,200	21,900.20 56,003,198,686	22,905.00 58,572,666,000	0.78
27	村田製作所	日本	株式	電気機器	7,900,900	7,610.69 60,131,332,261	7,394.00 58,419,254,600	0.78
28	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	9,499,700	5,331.80 50,650,534,558	6,127.00 58,204,661,900	0.77
29	SMC	日本	株式	機械	853,200	62,246.62 53,108,817,122	65,350.00 55,756,620,000	0.74
30	富士通	日本	株式	電気機器	2,621,700	17,886.05 46,891,871,535	18,510.00 48,527,667,000	0.64

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.32%
合計	98.32%

(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	0.09%
鉱業	0.30%
建設業	1.92%
食料品	3.36%
繊維製品	0.46%
パルプ・紙	0.18%
化学	6.10%
医薬品	5.28%
石油・石炭製品	0.48%
ゴム製品	0.70%
ガラス・土石製品	0.71%
鉄鋼	0.83%
非鉄金属	0.74%
金属製品	0.56%
機械	5.15%
電気機器	17.09%
輸送用機器	7.29%
精密機器	2.57%
その他製品	2.27%

電気・ガス業	1.22%
陸運業	2.93%
海運業	0.59%
空運業	0.50%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	8.77%
卸売業	5.83%
小売業	4.47%
銀行業	6.46%
証券、商品先物取引業	0.75%
保険業	2.37%
その他金融業	1.12%
不動産業	1.87%
サービス業	5.23%
合計	98.32%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 05 03月	買建	6,372	123,575,517,100	125,878,860,000	1.67%

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)	東京証券取 引所 市場相場
第12計算期間末 (2013年7月10日)	935,579,160,460	943,078,552,355	1,222.6	1,232.4	1,222

第13計算期間末 (2014年7月10日)	1,123,731,191,021	1,137,960,316,067	1,295.2	1,311.6	1,294
第14計算期間末 (2015年7月10日)	1,279,925,104,350	1,298,892,337,720	1,633.0	1,657.2	1,632
第15計算期間末 (2016年7月10日)	1,178,144,843,356	1,202,723,169,102	1,246.3	1,272.3	1,247
第16計算期間末 (2017年7月10日)	2,472,283,433,116	2,510,269,439,522	1,672.7	1,698.4	1,673
第17計算期間末 (2018年7月10日)	3,714,241,986,557	3,781,221,701,176	1,780.0	1,812.1	1,782
第18計算期間末 (2019年7月10日)	4,327,811,695,639	4,420,375,738,345	1,631.7	1,666.6	1,631
第19計算期間末 (2020年7月10日)	5,463,405,113,650	5,578,156,609,339	1,599.7	1,633.3	1,600
第20計算期間末 (2021年7月10日)	7,160,029,881,685	7,294,591,878,160	1,995.4	2,032.9	1,999
2022年1月末日	7,289,173,631,838	-	1,996.8	-	1,999
2月末日	7,252,898,953,149	-	1,987.9	-	1,986
3月末日	7,558,052,245,910	-	2,073.1	-	2,076
4月末日	7,392,327,997,882	-	2,023.3	-	2,022
5月末日	7,446,306,463,721	-	2,038.7	-	2,039
6月末日	7,289,336,711,482	-	1,996.8	-	1,998
第21計算期間末 (2022年7月10日)	7,186,003,697,049	7,358,041,778,109	1,967.4	2,014.5	1,969
7月末日	7,385,705,257,404	-	2,022.5	-	2,021
8月末日	7,450,156,525,682	-	2,046.8	-	2,046
9月末日	7,033,488,468,721	-	1,934.5	-	1,933
10月末日	7,391,513,311,816	-	2,032.9	-	2,032
11月末日	7,546,696,727,776	-	2,092.6	-	2,090
12月末日	7,209,262,057,933	-	1,996.9	-	1,999
2023年1月末日	7,525,760,865,029	-	2,085.1	-	2,084

(注) 計算期間末日が休業日の場合は、前営業日の市場相場を記載しております。

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第12計算期間	9.80
第13計算期間	16.40
第14計算期間	24.20
第15計算期間	26.00

第16計算期間	25.70
第17計算期間	32.10
第18計算期間	34.90
第19計算期間	33.60
第20計算期間	37.50
第21計算期間	47.10
2022年7月11日～ 2023年1月10日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第12計算期間	60.8
第13計算期間	7.3
第14計算期間	27.9
第15計算期間	22.1
第16計算期間	36.3
第17計算期間	8.3
第18計算期間	6.4
第19計算期間	0.1
第20計算期間	27.1
第21計算期間	1.0
2022年7月11日～ 2023年1月10日	0.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第12計算期間	425,333,390	43,524,406
第13計算期間	501,946,560	399,561,055
第14計算期間	258,772,110	342,631,712
第15計算期間	282,232,170	120,681,923
第16計算期間	786,531,040	253,796,537
第17計算期間	819,848,810	211,308,063
第18計算期間	646,528,910	80,859,547
第19計算期間	817,564,030	54,605,778
第20計算期間	375,247,580	202,150,760
第21計算期間	205,503,430	141,210,150
2022年7月11日～ 2023年1月10日	35,516,770	77,836,147

(参考情報) 運用実績

● iFreeETF TOPIX (年1回決算型)

2023年1月31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	20,851円
純資産総額	75,257億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	4.4%
3か月間	2.6%
6か月間	3.1%
1年間	6.9%
3年間	25.6%
5年間	20.4%
設定来	129.3%

※上記の「基準価額の騰落率」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口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 471円 設定来分配金合計額: 4,425.4円

決算期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期	第20期	第21期
	11年7月	12年7月	13年7月	14年7月	15年7月	16年7月	17年7月	18年7月	19年7月	20年7月	21年7月	22年7月
分配金	153円	155円	98円	164円	242円	260円	257円	321円	349円	336円	375円	471円

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

主要な資産の状況

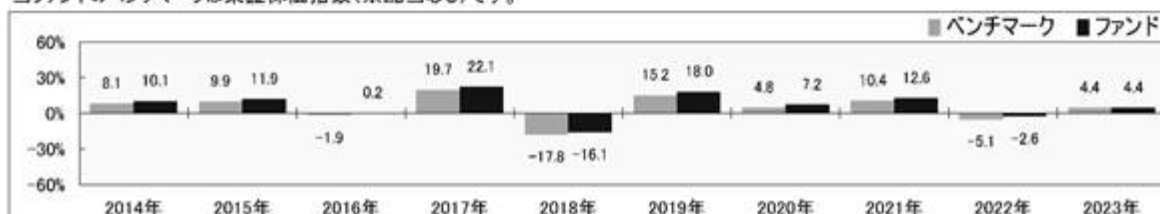
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,164	98.3%	電気機器	17.1%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.6%
国内株式先物	1	1.7%	情報・通信業	8.8%	ソニーグループ	電気機器	2.8%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	7.3%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.1%
コール・ローン、その他	-	1.7%	銀行業	6.5%	キーエンス	電気機器	2.1%
合計	2,165	-	化学	6.1%	日本電信電話	情報・通信業	1.7%
株式市場・上場別構成			卸売業	5.8%	TOPIX先物 0503月	-	1.7%
東証プライム市場		97.8%	医薬品	5.3%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.4%
東証スタンダード市場		0.5%	サービス業	5.2%	武田薬品	医薬品	1.3%
東証グロス市場		-	機械	5.2%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.2%
地方市場・その他		-	その他	31.1%	任天堂	その他製品	1.2%
合計		98.3%	合計	98.3%	合計		19.1%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数(※配当なし)です。



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

・2023年は1月31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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- イ．受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。
- ロ．受益権の取得申込者は、東証株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの（以下「取得時のバスケット」といいます。）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。また、当該取得時のバスケットの評価額（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評価して得た額をいいます。以下同じ。）をもって、それに相当するものとして委託会社が定める一定口数の受益権を単位として取得するものとします。受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額とします。
- ハ．受益権の取得申込者が、委託会社が別に定める時限までに取得申込みをした場合には、当日を取得申込受付日として委託会社は当該取得申込みを受付けます。
- ニ．取得申込受付日に対応する取得時のバスケットを構成する各株式の銘柄名とその数量は、委託会社が取得申込受付日以前の別に定める期日に別に定める方法により提示するものとします。
- ホ．前ロ．にかかわらず、受益権の取得申込者は、取得時のバスケットの評価額が取得する一定口数の受益権の評価額に満たない場合には、その差額に相当する部分を金銭をもって支払うものとします。
- ヘ．前ロ．にかかわらず、取得時のバスケットに受益権の取得申込者が発行した株式またはその親会社（会社法第2条第1項第4号に規定する親会社をいいます。以下同じ。）が発行した株式（以下「自社株式等」といいます。）が含まれる場合には、当該取得申込者は当該自社株式等に代えて当該自社株式等に相当する金額（評価額により算出したものに限ります。）に、当該自社株式等を信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該金額に別に定める率を乗じて得た額を加算して得た金額の金銭をもって取得することができるものとします。
- ト．前ヘ．に該当する場合には、受益権の取得申込者は、販売会社を通じてその旨を委託会社に通知するものとします。この通知が取得申込みの際に行なわれなかった場合において、そのことによって当該取得申込者または信託財産その他に損害が生じた場合には、当該取得申込者がすべての責を負うものとします。
- チ．前ロ．にかかわらず、取得時のバスケットに、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは当該権利を取得することができる者が確定する日またはその前営業日に取得の申込みに応じて受益権の受渡しが行なわれることとなる株式（以下本チ．において「配当落ち株式等」といいます。）が含まれる場合には、当該取得申込者は当該配当落ち株式等に代えて当該配当落ち株式等に相当する金額（評価額により算出したものに限ります。）に、当該配当落ち株式等を信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該金額に別に定める率を乗じて得た額を加算して得た金額の金銭をもって取得することができるものとします。
- リ．販売会社は、取得申込みにかかる取得時のバスケットの各銘柄の株式を、取得申込みにかかる信託が設定される日までに、別に定める契約に基づき委託会社に代わって受託会社に引渡すものとします。
- ヌ．販売会社は、受益権の取得申込者が引渡すべき取得時のバスケットの各銘柄の一部の引渡日を別に定める方法に基づいて指定する場合には、担保金を差入れるものとします。なお、担保金に付利は行なわないものとします。担保金が差入れられた場合には、委託会社は信託財産への担保金の受入れの指図を行なうものとします。

ル．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、前リ．に定める株式（前ホ．、前ヘ．および前チ．に該当する場合の金銭を含みます。）または前ヌ．に定める担保金の引渡しと引換えに、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。また、別に定める金融商品取引清算機関（金融商品取引法第2条第29項に規定する金融商品取引清算機関とし、以下「清算機関」といいます。）の業務方法書（以下「業務方法書」といいます。）に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受け付けによって生じる株式および金銭の委託会社への受渡または支払いの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、振替機関等における当該清算機関の名義の口座に口数の増加の記載または記録が行なわれ、取得申込者が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における口数の増加の記載または記録は、当該清算機関と販売会社（販売会社による清算機関への債務の負担の申込みにおいて、当該販売会社の委託を受けて金融商品取引法第2条第27項に定める有価証券等清算取次ぎが行なわれる場合には、当該有価証券等清算取次ぎを行なう金融商品取引業者または登録金融機関を含みます。）との間で振替機関等を介して行なわれます。別に定める金融商品取引清算機関は、株式会社日本証券クリアリング機構とします。

ヲ．委託会社は、原則として、次の1.から4.までに該当する場合は、受益権の取得申込みの受け付けを停止します。なお、次の1.から3.までに該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の取得申込みを受け付けることがあります。

- 1．東証株価指数構成銘柄の配当落日および権利落日
- 2．東証株価指数構成銘柄の変更および増減資等に伴う株数の変更日の2営業日前から起算して6営業日以内
- 3．計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）
- 4．前1.から前3.までのほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めたとき

ワ．販売会社は、当該販売会社が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、受益権の取得申込者から徴収することができるものとします。当該手数料は、販売会社ならびに受託会社が収受するものとします。

カ．委託会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときおよび委託会社が必要と認めるときは、取得申込みの受け付けの中止、取得申込みの受け付けの取消またはその両方を行なうことができます。

ヨ．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、取得申込みにかかる取得時のバスケットの各銘柄の株式および金銭または担保金について、受入れまたは振替済みの通知を受けた場合は、振替機関に対し追加信託が行なわれた旨を通知するものとします。ただし、業務方法書に定めるところにより、当該株式および金銭の委託会社への受渡または支払いの債務を清算機関が負担する場合には、受託会社は、委託会社の指図に基づき、当該株式および金銭についての受入れまたは振替済みの通知にかかわらず、振替機関に対し追加信託が行なわれた旨を通知するものとします。

2【換金（解約）手続等】

<解約>

受益者は、自己に帰属する受益権（受託会社が「3 資産管理等の概要(5) 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からの「3 資産管理等の概要(5)」の規定による請求により買取った受益権を除きます。）について、信託期間中において信託契約の一部解約の実行を請求することはできません。

<交換>

イ．受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、当該受益権と当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換（以下「交換」といいます。）を請求することができます。

ロ．受益者が交換の請求をするときは、販売会社に対し、委託会社が定める一定口数の整数倍の振替受益権をもって、販売会社所定の方法で行なうものとします。

ハ．交換を請求しようとする受益者が、委託会社が別に定める時限までに交換請求をした場合には、当日を交換請求受付日として委託会社は当該交換請求を受け付けます。

ニ．委託会社は、交換に際し、信託財産に属する株式の評価額をもって、それに相当する口数の振替受益権と交換するものとします。交換に際し、振替受益権の価額は、交換請求受付日の基準価額とします。

ホ．前イ．にかかわらず、委託会社は、原則として、次の1.から3.までに該当する場合は、振替受益権の交換請求の受け付けを停止します。なお、次の1.から2.までに該当する場合であっても、委託会社の判断により、振替受益権の交換請求を受け付けることがあります。

1．東証株価指数構成銘柄の変更および増減資等に伴う株数の変更日の2営業日前から起算して6営業日以内

2．計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）

3．前1.から前2.までのほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

ヘ．販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続きを行なうものとします。なお、業務方法書に定めるところにより、当該販売会社が、振替受益権の委託会社への受渡しの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、当該清算機関が振替受益権の抹消にかかる手続きを行ないます。当該抹消にかかる手続きおよび後ヨ．に掲げる交換株式にかかる振替請求が行なわれた後に、振替機関は、後ル．または後ヲ．に定める当該交換にかかる振替受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座に前イ．の交換の請求を行なった受益者にかかる当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

ト．受託会社は、後ル．または後ヲ．の委託会社の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび後タ．に定める抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ、抹消したものとして取扱います。

チ．販売会社は、当該販売会社が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交換請求者から徴収することができるものとします。当該手数料は、販売会社ならびに受託会社が収受するものとします。

- リ．委託会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときおよび委託会社が必要と認めるときは、交換請求の受付けの中止、交換請求の受付けの取消またはその両方を行なうことができます。
- ヌ．前リ．により、交換請求の受付けを中止したときは、受益者は、当該受付中止以前に行なった当日の交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換の請求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交換の請求を受付けたものとして計算されるものとします。
- ル．委託会社は、交換の請求を受付けた場合には、当該請求にかかる振替受益権と、当該振替受益権の信託財産に対する持分に相当する株式として委託会社が指定するものとの交換を行なうよう受託会社に指図します。
- ロ．前ル．にかかわらず、委託会社が指定する株式に自社株式等が含まれる場合には、原則として、委託会社は、前ル．の請求にかかる振替受益権の口数から当該自社株式等に相当する金額（評価額により算出したものから、当該株式売却および当該売却代金により信託財産中の株式の銘柄およびその数量を変更するための取引にかかる経費に相当する金額として、当該評価額に別に定める率を乗じて得た額を減じた金額とします。）に相当する口数を除いた口数の振替受益権と、当該振替受益権の持分に相当する株式（当該自社株式等を除きます。）を交換するよう受託会社に指図するものとします。
- ワ．前ロ．に該当する場合には、交換請求を行なう受益者は、販売会社を通じてその旨を委託会社に通知するものとします。この通知が交換請求の際に行なわれなかった場合において、そのことによって交換請求者または信託財産その他に損害が生じた場合には、交換請求者がすべての責を負うものとします。
- カ．前ル．にかかわらず、前ル．の委託会社が指定する株式に、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは当該権利を取得することができる者が確定する日に交換の申込みに応じて受益権の受渡しが行なわれることとなる株式（以下本カ．において「配当落ち株式等」といいます。）が含まれる場合には、委託会社は、当該配当落ち株式等に代えて当該配当落ち株式等の評価額（当該評価額から、当該株式売却および当該売却代金により信託財産中の株式の銘柄およびその数量を変更するための取引にかかる経費に相当する金額として、当該評価額に別に定める率を乗じて得た額を減じた額とします。）に相当する金銭の交付をもって交換するよう受託会社に指図することができるものとします。
- コ．受託会社は、前ヘ．に掲げる手続きが行なわれたことを確認したときには、委託会社の指図にしたがい、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式にかかる振替請求および金銭の交付を行なうものとします。ただし、業務方法書の定めるところにより、前ク．に掲げる交換の請求を受付けた販売会社が、振替受益権の委託会社への受渡しの債務の負担を当該清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、受託会社は、前ヘ．に掲げる手続きにかかわらず、委託会社の指図にしたがい、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式にかかる振替請求および金銭の交付を行なうものとします。別に定める期日から、受益者への交換株式の交付に際しては振替機関等の口座に前イ．の交換の請求を行なった受益者にかかる株数の増加の記載または記録が行なわれ、受益者への金銭の交付については販売会社において行なわれます。
- ク．委託会社は、交換請求受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したのものとして取扱うこととし、受託会社は、当該受益権にかかる振替受益権が交換株式の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

< 買取り >

- イ．販売会社は、次に該当する場合で、受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。
1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権
 2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき

- ロ．前イ．の買取価額は、買取申込みを受付けた日の基準価額から、販売会社が定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を控除した価額とすることができます。
- ハ．販売会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することができます。
- 二．前ハ．により受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取停止以前に行なった当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受付けたものとして、前ロ．に準じて計算されたものとします。

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10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）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）主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東証株価指数に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式：
原則として金融商品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) 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7月11日から翌年7月10日までとします。

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が200万口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合

- 意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となったときまたは東証株価指数が廃止された場合には、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。
 3. 委託会社は、前1.および前2.の各事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 4. 前3.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。
 5. 前4.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。
 6. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 7. 前4.から前6.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約する場合には適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前4.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も同じとします。
 8. 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。
 9. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の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。
 10. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

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

す。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

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。

反対者の買取請求権

前 の1.から7.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 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 の4.または前 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。

公告

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

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

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

関係法人との契約の更改

受益権の募集、交換の取扱い等に関する委託会社、受託会社および販売会社との三者間契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社、受託会社もしくは販売会社の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。ただし、業務方法書に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受付けによって生じる株式および金銭の委託会社への受渡または支払いの債務の負担を当該清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合の信託契約締結当初または追加信託当初の受益者は当該清算機関とします。

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

<支払方法>

イ. 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。

ロ. 計算期間終了日において氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者）にあっては、氏名または名称および住所とします。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、受託会社は収益分

配金を当該名義登録受益者に支払います。この場合、名義登録受益者が当該計算期間終了日における振替制度移行後も受益証券を保有している所有者と異なる場合であっても、委託会社および受託会社は当該所有者に対して収益分配金の支払いおよびその他損害についてその責を負わないものとします。

ハ．受益者は、原則として前口．に規定する登録を当ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の取引参加者を經由して行なうものとします。この場合、当該取引参加者は、当該取引参加者が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徴することができるものとします。

ただし、証券金融会社等は前口．に規定する登録を受託会社に対して直接行なうことができます。

ニ．社振法関係法令等に基づき、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権の名義登録の手続きは原則として以下のとおりとします。

(a) 受益権は、前ハ．の取引参加者の振替口座簿に口数が記載または記録されることにより、当該振替口座簿に記載または記録された口数に応じた受益権が帰属します。

(b) 前ハ．の取引参加者は、計算期間終了日までに当該取引参加者にかかる前(a)の受益権の受益者の氏名もしくは名称および住所その他受託会社が定める事項を書面等により受託会社に届出るものとします。また、届出た内容に変更が生じた場合は、当該取引参加者所定の方法による当該受益者からの申し出に基づき、当該取引参加者はこれを受託会社に通知するものとします。

(c) 前ハ．の取引参加者は、計算期間終了日現在の当該取引参加者にかかる前(a)の受益権の受益者の振替機関の定める事項を（当該取引参加者が直接口座管理機関でない場合はその上位機関を通じて）振替機関に報告するとともに、振替機関は業務規程等に基づき、これを受託会社に通知するものとします。

ホ．追加信託時の受益者については、前口．に規定する登録を行なったうえで、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されるものとします。

ヘ．前口．に規定する収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定した預金口座等に当該収益分配金を振込む方式により行なうものとします。なお、名義登録受益者が前ハ．に規定する取引参加者と別途収益分配金の取扱いにかかる契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとします。

ト．受託会社は、支払開始日から5年経過した後に、前口．の名義登録受益者にかかる収益分配金の未払い残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとします。

チ．受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

信託終了時の交換等

イ．委託会社は、信託が終了することとなったときは、委託会社が別に定める一定口数以上の受益権を有する受益者に対しては、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権または当該受益権を表示する受益証券と引換えに交換するものとします。この場合は、「2 換金（解約）手続等」の規定に準じるものとします。

ロ．委託会社が信託の終了に関して指定する販売会社は、委託会社が別に定める一定口数未満の受益権について買取るものとします。この場合には、当該販売会社が別に定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

ハ．信託終了に際して、委託会社が信託終了に関して指定する販売会社は、その所有にかかるすべての受益権を交換請求するものとします。交換により引渡される株式に当該販売会社の自社株式等が含ま

れる場合には、委託会社は、受託会社に対しこれを売却する指図をするとともに、当該自社株式等の評価額に相当する口数の受益権を、受託会社は信託財産をもって買取るものとします。

二．受益者が、前イ．の交換について、交換開始日から10年間その交換の請求をしないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

交換請求権および買取請求権

受益者は、保有する受益権について、交換または買取りを請求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21期計算期間（2021年7月11日から2022年7月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワ上場投信 - トピックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 2021年7月10日現在	第21期 2022年7月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	609,558,265,442	592,960,255,089
株式	2 3 7,131,149,308,360	2 3 7,161,179,190,410
未収配当金	7,278,348,963	9,833,591,684
未収利息	11,211,110	10,793,708
前払金	3,602,472,000	6,766,249,500
その他未収収益	4 1,782,106,099	4 1,105,407,279
差入委託証拠金	2,477,364,000	4,165,800,000
流動資産合計	7,755,859,075,974	7,776,021,287,670
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	487,270,000	496,012,250
未払金	3,753,205,000	5,618,807,500
未払収益分配金	134,561,996,475	172,038,081,060
未払受託者報酬	1,618,929,354	1,541,561,275
未払委託者報酬	3,196,684,411	3,101,171,450
未払利息	703,747	183,898
受入担保金	451,324,642,607	406,230,244,192
その他未払費用	885,762,695	991,528,996
流動負債合計	595,829,194,289	590,017,590,621
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,485,399,882,500	1 4,565,766,482,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,674,629,999,185	2,620,237,214,549
（分配準備積立金）	88,592,191	128,223,440
元本等合計	7,160,029,881,685	7,186,003,697,049
純資産合計	7,160,029,881,685	7,186,003,697,049
負債純資産合計	7,755,859,075,974	7,776,021,287,670

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第20期		第21期	
	自	2020年7月11日 至 2021年7月10日	自	2021年7月11日 至 2022年7月10日
営業収益				
受取配当金		133,512,207,920		174,206,052,269
受取利息		819,712,841		564,481,988
有価証券売買等損益		1,366,287,741,066		95,978,072,627
派生商品取引等損益		11,880,974,000		7,715,365,750
その他収益		1 10,334,029,735		1 8,033,979,142
営業収益合計		1,522,834,665,562		79,111,075,022
営業費用				
支払利息		239,615,407		138,109,510
受託者報酬		3,087,973,040		3,190,320,715
委託者報酬		6,009,869,055		6,425,397,081
その他費用		876,241,696		972,973,784
営業費用合計		10,213,699,198		10,726,801,090
営業利益		1,512,620,966,364		68,384,273,932
経常利益		1,512,620,966,364		68,384,273,932
当期純利益		1,512,620,966,364		68,384,273,932
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,194,376,256,150		2,674,629,999,185
剰余金増加額又は欠損金減少額		228,584,980,746		162,987,803,082
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		228,584,980,746		162,987,803,082
剰余金減少額又は欠損金増加額		126,390,207,600		113,726,780,590
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		126,390,207,600		113,726,780,590
分配金		2 134,561,996,475		2 172,038,081,060
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,674,629,999,185		2,620,237,214,549

(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21期	
	自 2021年7月11日	至 2022年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第20期	第21期
	2021年7月10日現在	2022年7月10日現在
1. 1 期首元本額	4,269,028,857,500円	4,485,399,882,500円
期中追加設定元本額	469,059,475,000円	256,879,287,500円
期中一部交換元本額	252,688,450,000円	176,512,687,500円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,588,319,906口	3,652,613,186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 424,922,672,060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 391,513,077,890円
4.	3	差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 9,160,662,000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 7,805,899,000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1,759,675,291円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分1,089,028,474円が含まれております。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第20期		第21期	
	自	至	自	至
1. 1	2020年7月11日	2021年7月10日	2021年7月11日	2022年7月10日
1.	1	その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額8,965,965,775円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額6,669,392,712円が含まれております。
2.	2	分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(144,426,335,089円)及び分配準備積立金(198,337,368円)の合計額から、経費(9,974,083,791円)を控除して計算される分配対象額は134,650,588,666円(10口当たり375円)であり、うち134,561,996,475円(10口当たり375円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(182,666,403,889円)及び分配準備積立金(88,592,191円)の合計額から、経費(10,588,691,580円)を控除して計算される分配対象額は172,166,304,500円(10口当たり471円)であり、うち172,038,081,060円(10口当たり471円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第21期
	自 2021年7月11日 至 2022年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第21期
	2022年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第20期 2021年7月10日現在	第21期 2022年7月10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）
株式	1,267,226,998,920	102,632,048,466
合計	1,267,226,998,920	102,632,048,466

（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	第20期 2021年7月10日 現在				第21期 2022年7月10日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)		(円)		(円)	
市場取引								
株値指数								
先物取引								
買 建	27,485,500,000	-	26,999,000,000	486,500,000	25,597,408,500	-	25,102,125,000	495,283,500
合計	27,485,500,000	-	26,999,000,000	486,500,000	25,597,408,500	-	25,102,125,000	495,283,500

（注） 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第21期
自 2021年7月11日
至 2022年7月10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20期 2021年7月10日現在	第21期 2022年7月10日現在
1口当たり純資産額 (10口当たり純資産額)	1,995.4円 (19,954円)	1,967.4円 (19,674円)

(4) 【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	130,300	3,495.00	455,398,500	貸付株式数 4,700株 (2,000株)
日本水産	3,720,600	567.00	2,109,580,200	
マルハニチロ	530,700	2,498.00	1,325,688,600	
雪国まいたけ	292,400	944.00	276,025,600	貸付株式数 9,000株
カネコ種苗	113,400	1,580.00	179,172,000	貸付株式数 1,800株
サカタのタネ	434,400	4,345.00	1,887,468,000	貸付株式数 360,000株
ホクト	305,500	1,934.00	590,837,000	貸付株式数 29,700株
ホクリヨウ	54,300	620.00	33,666,000	
ショーボンドHD	468,000	5,850.00	2,737,800,000	
ミライト・ワン	1,289,800	1,636.00	2,110,112,800	
タマホーム	242,700	2,371.00	575,441,700	貸付株式数 218,400株
サンヨーホームズ	46,300	719.00	33,289,700	貸付株式数 35,100株
日本アクア	159,300	581.00	92,553,300	
ファーストコーポレーション	98,000	721.00	70,658,000	貸付株式数 83,900株
ベステラ	80,900	1,126.00	91,093,400	貸付株式数 71,000株
ROBOT HOME	667,700	178.00	118,850,600	貸付株式数 593,500株 (23,200株)
キャンディル	59,100	531.00	31,382,100	貸付株式数 54,000株 (4,000株)
住石ホールディングス	701,300	183.00	128,337,900	貸付株式数 485,500株
日鉄鉱業	76,600	5,190.00	397,554,000	
三井松島HLDGS	167,600	2,801.00	469,447,600	貸付株式数 107,700株
INPEX	13,972,500	1,374.00	19,198,215,000	貸付株式数 1,827,300株
石油資源開発	471,300	3,105.00	1,463,386,500	
K&Oエナジーグループ	155,900	1,498.00	233,538,200	

ダイセキ環境ソリューション	77,100	857.00	66,074,700	貸付株式数	67,000株
第一カッター興業	88,000	1,279.00	112,552,000		
明豊ファシリティワークス	128,900	636.00	81,980,400	貸付株式数	51,200株
安藤・間	1,824,100	851.00	1,552,309,100		
東急建設	1,075,800	618.00	664,844,400		
コムシスホールディングス	1,291,500	2,578.00	3,329,487,000		
ビーアールホールディングス	503,500	329.00	165,651,500	貸付株式数	247,500株
高松コンストラクションG P	255,100	2,020.00	515,302,000		
東建コーポレーション	111,200	8,060.00	896,272,000	貸付株式数	85,100株
ソネック	41,300	999.00	41,258,700	貸付株式数	34,000株
ヤマウラ	174,100	942.00	164,002,200	貸付株式数	158,000株
オリエンタル白石	1,346,500	239.00	321,813,500	貸付株式数	30,000株
大成建設	2,575,200	4,205.00	10,828,716,000		
大林組	8,592,000	957.00	8,222,544,000		
清水建設	7,945,300	747.00	5,935,139,100		
飛島建設	247,500	1,023.00	253,192,500		
長谷工コーポレーション	2,479,800	1,564.00	3,878,407,200		
松井建設	308,100	619.00	190,713,900		
銭高組	33,700	3,180.00	107,166,000	貸付株式数	200株
鹿島建設	6,295,300	1,494.00	9,405,178,200		
不動テトラ	196,300	1,593.00	312,705,900	貸付株式数	1,400株
大末建設	97,300	1,497.00	145,658,100		
鉄建建設	186,800	1,780.00	332,504,000		
西松建設	560,000	3,975.00	2,226,000,000	貸付株式数	440,000株
三井住友建設	2,086,100	452.00	942,917,200		
大豊建設	135,200	4,165.00	563,108,000	貸付株式数	102,900株
佐田建設	198,900	453.00	90,101,700	貸付株式数	9,500株
ナカノフード建設	221,100	300.00	66,330,000	貸付株式数	12,800株
奥村組	460,500	2,955.00	1,360,777,500		
東鉄工業	363,700	2,356.00	856,877,200		
イチケン	66,800	1,794.00	119,839,200		
富士ピー・エス	119,400	455.00	54,327,000	貸付株式数	104,000株
浅沼組	103,600	5,340.00	553,224,000		
戸田建設	3,546,800	699.00	2,479,213,200		
熊谷組	457,600	2,738.00	1,252,908,800	貸付株式数	30,000株
北野建設	56,400	2,122.00	119,680,800	貸付株式数	1,800株
植木組	75,600	1,334.00	100,850,400	貸付株式数	54,000株
矢作建設	367,700	763.00	280,555,100		
ピーエス三菱	304,400	606.00	184,466,400	貸付株式数	8,600株
日本ハウスHLDGS	622,800	393.00	244,760,400	貸付株式数	351,300株

大東建託	946,800	11,960.00	11,323,728,000		
新日本建設	393,500	717.00	282,139,500		
東亜道路	47,900	5,590.00	267,761,000		
日本道路	80,600	6,250.00	503,750,000	貸付株式数	16,500株
東亜建設	205,900	2,443.00	503,013,700	貸付株式数	400株
日本国土開発	720,000	519.00	373,680,000	貸付株式数	63,300株
若築建設	142,600	2,190.00	312,294,000	貸付株式数	1,200株
東洋建設	1,037,400	861.00	893,201,400		
五洋建設	3,405,800	694.00	2,363,625,200		
世紀東急	444,300	804.00	357,217,200	貸付株式数	5,700株
福田組	98,800	4,670.00	461,396,000	貸付株式数	1,000株
日本ドライケミカル	65,900	1,571.00	103,528,900	貸付株式数	6,700株
住友林業	2,027,300	1,979.00	4,012,026,700	貸付株式数	569,900株
日本基礎技術	225,900	597.00	134,862,300	貸付株式数	2,900株
巴コーポレーション	336,100	443.00	148,892,300	貸付株式数	4,700株
大和ハウス	7,323,600	3,209.00	23,501,432,400		
ライト工業	508,500	1,852.00	941,742,000	貸付株式数	100株
積水ハウス	8,780,500	2,331.00	20,467,345,500	貸付株式数	3,300,300株
日特建設	191,200	805.00	153,916,000	貸付株式数	400株
北陸電気工事	164,800	744.00	122,611,200		
ユアテック	529,400	719.00	380,638,600		
日本リーテック	176,100	933.00	164,301,300		
四電工	89,400	1,714.00	153,231,600		
中電工	372,800	2,119.00	789,963,200		
関電工	1,504,400	842.00	1,266,704,800		
きんでん	1,879,200	1,579.00	2,967,256,800		
東京エネシス	273,000	1,009.00	275,457,000		
トーエネック	93,000	3,565.00	331,545,000		
住友電設	228,400	2,587.00	590,870,800		
日本電設工業	394,700	1,777.00	701,381,900	貸付株式数	2,400株
エクシオグループ	1,283,900	2,107.00	2,705,177,300		
新日本空調	200,100	1,815.00	363,181,500	貸付株式数	9,600株
日本工営	179,500	3,290.00	590,555,000		
九電工	584,100	2,717.00	1,586,999,700		
三機工業	601,000	1,556.00	935,156,000		
日揮ホールディングス	2,613,300	1,649.00	4,309,331,700	貸付株式数	12,800株
中外炉工業	85,800	1,630.00	139,854,000	貸付株式数	1,000株
ヤマト	221,900	749.00	166,203,100	貸付株式数	3,500株
太平電業	167,800	2,833.00	475,377,400		
高砂熱学	707,800	1,624.00	1,149,467,200		

三晃金属	36,300	2,655.00	96,376,500	貸付株式数	300株
NEC ネットエスアイ	957,300	1,933.00	1,850,460,900		
朝日工業社	112,300	1,813.00	203,599,900	貸付株式数	13,500株
明星工業	465,000	695.00	323,175,000		
大気社	385,600	3,095.00	1,193,432,000		
ダイダン	173,800	2,099.00	364,806,200		
日比谷総合設備	251,900	1,899.00	478,358,100	貸付株式数	400株
ニッポン	722,000	1,650.00	1,191,300,000		
日清製粉G本社	2,787,900	1,634.00	4,555,428,600		
日東富士製粉	43,100	4,515.00	194,596,500	貸付株式数	200株
昭和産業	233,400	2,582.00	602,638,800		
鳥越製粉	214,500	649.00	139,210,500	貸付株式数	104,300株
中部飼料	306,000	1,063.00	325,278,000	貸付株式数	89,300株
フィード・ワン	352,500	678.00	238,995,000		
東洋精糖	50,100	936.00	46,893,600	貸付株式数	1,200株
日本甜菜糖	154,500	1,690.00	261,105,000		
DM三井製糖ホールディ	239,100	1,915.00	457,876,500	貸付株式数	60,000株
塩水港精糖	352,700	206.00	72,656,200	貸付株式数	50,700株
日新製糖	140,300	1,762.00	247,208,600		
LIFULL	860,900	168.00	144,631,200	貸付株式数	617,600株
ミクシィ	644,900	2,219.00	1,431,033,100	貸付株式数	1,200株
ジェイエイシーリクルートメント	227,400	1,829.00	415,914,600	貸付株式数	200株
日本M&Aセンターホールデ	4,624,400	1,670.00	7,722,748,000		
メンバーズ	73,400	2,592.00	190,252,800	貸付株式数	18,700株
中広	45,200	390.00	17,628,000	貸付株式数	37,400株
UTグループ	406,800	2,594.00	1,055,239,200		
アイティメディア	133,800	1,580.00	211,404,000	貸付株式数	108,100株
E・Jホールディングス	162,100	1,163.00	188,522,300	貸付株式数	119,000株
夢真ビーネックスグループ	919,000	1,581.00	1,452,939,000	貸付株式数	200,000株
コシダカホールディングス	754,000	694.00	523,276,000	貸付株式数	277,200株
アルトナー	68,200	875.00	59,675,000		
パソナグループ	305,400	1,944.00	593,697,600	貸付株式数	11,000株
CDS	69,800	1,779.00	124,174,200		
リンクアンドモチベーション	621,400	481.00	298,893,400	貸付株式数	534,300株
エス・エム・エス	957,800	2,951.00	2,826,467,800		
サニーサイドアップG	97,500	647.00	63,082,500	貸付株式数	40,100株
パーソルホールディングス	2,818,700	2,685.00	7,568,209,500	貸付株式数	262,300株
リニカル	158,700	766.00	121,564,200	貸付株式数	900株
クックパッド	885,800	201.00	178,045,800	貸付株式数	592,000株
エスクリ	126,400	356.00	44,998,400	貸付株式数	106,000株

アイ・ケイ・ケイホールディング	137,300	593.00	81,418,900	貸付株式数	109,000株
森永製菓	595,500	4,375.00	2,605,312,500		
中村屋	60,300	3,135.00	189,040,500	貸付株式数	45,100株
江崎グリコ	689,900	4,015.00	2,769,948,500	貸付株式数	412,600株
名糖産業	106,800	1,658.00	177,074,400	貸付株式数	100,000株
井村屋グループ	144,000	2,280.00	328,320,000	貸付株式数	11,600株 (1,000株)
不二家	165,400	2,401.00	397,125,400	貸付株式数	17,000株
山崎製パン	1,816,000	1,718.00	3,119,888,000	貸付株式数	200,000株
第一屋製パン	57,200	494.00	28,256,800	貸付株式数	49,500株
モロゾフ	87,400	3,625.00	316,825,000	貸付株式数	58,000株
亀田製菓	153,400	4,645.00	712,543,000		
寿スピリッツ	256,500	6,300.00	1,615,950,000	貸付株式数	13,300株
カルビー	1,349,500	2,822.00	3,808,289,000	貸付株式数	30,000株
森永乳業	502,400	5,120.00	2,572,288,000	貸付株式数	42,600株
六甲バター	196,400	1,396.00	274,174,400	貸付株式数	20,900株
ヤクルト	1,880,200	8,010.00	15,060,402,000		
明治ホールディングス	1,630,800	7,010.00	11,431,908,000		
雪印メグミルク	648,000	1,881.00	1,218,888,000		
プリマハム	370,200	2,292.00	848,498,400	貸付株式数	82,100株
日本ハム	1,037,500	4,300.00	4,461,250,000		
林兼産業	89,800	480.00	43,104,000	貸付株式数	700株
丸大食品	267,000	1,556.00	415,452,000	貸付株式数	22,600株
S Foods	266,000	3,120.00	829,920,000	貸付株式数	224,000株
柿安本店	102,700	2,386.00	245,042,200	貸付株式数	21,600株
伊藤ハム米久HLDGS	1,906,800	690.00	1,315,692,000		
学情	114,200	983.00	112,258,600	貸付株式数	5,100株
スタジオアリス	126,100	2,363.00	297,974,300	貸付株式数	110,000株 (3,300株)
クロスキャット	155,900	951.00	148,260,900	貸付株式数	129,000株
シミックホールディングス	138,800	1,486.00	206,256,800	貸付株式数	127,000株
エプロ	59,800	701.00	41,919,800	貸付株式数	8,500株
システナ	4,130,100	449.00	1,854,414,900		
NJS	62,200	1,915.00	119,113,000		
デジタルアーツ	155,500	6,340.00	985,870,000		
日鉄ソリューションズ	503,000	3,745.00	1,883,735,000		
総合警備保障	1,028,100	3,850.00	3,958,185,000		
キューブシステム	146,200	985.00	144,007,000	貸付株式数	90,500株
いちご	3,240,600	312.00	1,011,067,200		
WOW WORLD	40,400	1,027.00	41,490,800		

日本駐車場開発	2,872,300	171.00	491,163,300	貸付株式数	1,370,600株
コア	122,400	1,454.00	177,969,600	貸付株式数	12,500株
カカクコム	2,068,400	2,353.00	4,866,945,200		
アイロムグループ	101,500	1,876.00	190,414,000	貸付株式数	77,200株
セントケア・ホールディング	183,300	860.00	157,638,000		
サイネックス	47,500	594.00	28,215,000	貸付株式数	1,000株
ルネサンス	196,000	915.00	179,340,000	貸付株式数	168,400株
ディップ	495,900	3,730.00	1,849,707,000	貸付株式数	161,400株
S B Sホールディングス	218,200	2,750.00	600,050,000	貸付株式数	700株
デジタルホールディングス	196,500	1,230.00	241,695,000	貸付株式数	3,300株
新日本科学	343,200	2,000.00	686,400,000		
キャリアデザインセンター	58,200	1,151.00	66,988,200	貸付株式数	32,400株
ベネフィット・ワン	1,025,700	1,961.00	2,011,397,700	貸付株式数	264,600株
エムスリー	4,975,200	4,136.00	20,577,427,200		
ツカダ・グローバルHOLD	179,600	321.00	57,651,600	貸付株式数	157,000株
プラス	36,600	902.00	33,013,200	貸付株式数	30,000株
アウトソーシング	1,614,900	1,110.00	1,792,539,000		
ウェルネット	248,700	451.00	112,163,700	貸付株式数	59,900株
ワールドホールディングス	112,800	2,263.00	255,266,400	貸付株式数	17,200株
ディー・エヌ・エー	1,073,500	1,878.00	2,016,033,000		
博報堂D Y H L D G S	3,568,500	1,255.00	4,478,467,500	貸付株式数	3,600株
ぐるなび	411,400	371.00	152,629,400	貸付株式数	368,000株
タカミヤ	341,400	362.00	123,586,800		
ジャパンベストレスキューS	159,000	752.00	119,568,000	貸付株式数	1,000株
ファンコミュニケーションズ	634,200	383.00	242,898,600	貸付株式数	5,600株
ライク	93,800	2,257.00	211,706,600	貸付株式数	62,300株
ビジネス・ブレークスルー	104,600	418.00	43,722,800	貸付株式数	87,600株
エスプール	796,200	962.00	765,944,400		
W D Bホールディングス	128,800	2,341.00	301,520,800		
手間いらず	41,600	5,150.00	214,240,000	貸付株式数	19,000株
ティア	164,300	431.00	70,813,300	貸付株式数	8,100株
C D G	30,000	1,278.00	38,340,000	貸付株式数	26,000株
アドウェイズ	423,300	668.00	282,764,400	貸付株式数	336,000株
バリューコマース	220,900	3,140.00	693,626,000	貸付株式数	53,300株
インフォマート	3,089,300	389.00	1,201,737,700	貸付株式数	12,300株
サッポロホールディングス	866,200	2,902.00	2,513,712,400	貸付株式数	606,000株
アサヒグループホールディン	6,037,500	4,457.00	26,909,137,500	貸付株式数	1,831,700株
麒麟HD	10,884,300	2,175.50	23,678,794,650		
宝ホールディングス	1,646,200	1,011.00	1,664,308,200		
オエノンホールディングス	781,100	305.00	238,235,500	貸付株式数	2,800株

養命酒	79,400	1,782.00	141,490,800	貸付株式数	71,200株
コカ・コーラボトラーズJHD	1,889,500	1,521.00	2,873,929,500		
サントリー食品インター	1,981,300	5,100.00	10,104,630,000	貸付株式数	1,667,000株
ダイドーグループHD	151,900	5,040.00	765,576,000	貸付株式数	136,400株
伊藤園	898,800	6,250.00	5,617,500,000		
キーコーヒー	270,100	2,086.00	563,428,600		
ユニカフェ	88,900	920.00	81,788,000	貸付株式数	78,000株
ジャパンフーズ	42,100	1,130.00	47,573,000	貸付株式数	35,300株
日清オイリオグループ	339,700	3,215.00	1,092,135,500		
不二製油グループ	641,700	2,316.00	1,486,177,200		
かどや製油	25,800	3,540.00	91,332,000	貸付株式数	24,000株
J-オイルミルズ	276,200	1,625.00	448,825,000	貸付株式数	800株
ローソン	643,100	4,515.00	2,903,596,500		
サンエー	197,600	4,065.00	803,244,000	貸付株式数	5,300株
カワチ薬品	225,100	2,146.00	483,064,600	貸付株式数	125,200株
エービーシー・マート	453,700	5,720.00	2,595,164,000		
ハードオフコーポレーション	128,000	905.00	115,840,000		
高千穂交易	102,500	1,937.00	198,542,500	貸付株式数	77,600株
アスクル	625,300	1,644.00	1,027,993,200	貸付株式数	116,200株
ゲオホールディングス	349,600	1,275.00	445,740,000	貸付株式数	158,400株
アダストリア	312,800	2,029.00	634,671,200	貸付株式数	263,000株
ジーフット	175,500	330.00	57,915,000	貸付株式数	157,800株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	41,800	399.00	16,678,200	貸付株式数	23,800株
オルバヘルスケアHLDGS	47,300	1,620.00	76,626,000	貸付株式数	9,100株
伊藤忠食品	58,300	4,955.00	288,876,500	貸付株式数	8,600株
くら寿司	303,300	3,160.00	958,428,000	貸付株式数	268,300株
キャンドウ	107,700	2,140.00	230,478,000	貸付株式数	96,000株
エレマテック	232,400	1,227.00	285,154,800		
アイケイ	91,400	446.00	40,764,400	貸付株式数	50,100株
パルグループHLDGS	254,300	1,702.00	432,818,600		
エディオン	1,333,800	1,276.00	1,701,928,800	貸付株式数	911,100株
あらた	214,600	4,015.00	861,619,000	貸付株式数	27,100株
サーラコーポレーション	589,700	699.00	412,200,300		
ワッツ	140,200	724.00	101,504,800	貸付株式数	111,000株
トーマンデバイス	43,700	5,480.00	239,476,000	貸付株式数	15,000株
ハローズ	132,600	2,990.00	396,474,000	貸付株式数	55,600株
JPホールディングス	724,200	259.00	187,567,800	貸付株式数	11,400株
フジオフードG本社	215,500	1,347.00	290,278,500	貸付株式数	194,600株
あみやき亭	69,100	2,910.00	201,081,000	貸付株式数	53,000株
東京エレクトロンデバイス	86,200	5,200.00	448,240,000	貸付株式数	14,800株

ひらまつ	616,100	196.00	120,755,600	貸付株式数	65,300株
フィールズ	254,200	844.00	214,544,800	貸付株式数	93,000株
双日	2,980,800	1,927.00	5,744,001,600		
アルフレッサホールディングス	3,014,100	1,824.00	5,497,718,400		
大黒天物産	92,900	4,310.00	400,399,000	貸付株式数	81,600株
ハニーズホールディングス	229,900	1,235.00	283,926,500	貸付株式数	210,000株
ファーマライズHD	62,100	702.00	43,594,200	貸付株式数	11,200株
キッコーマン	1,776,000	7,720.00	13,710,720,000		
味の素	5,902,700	3,431.00	20,252,163,700		
ブルドックソ - ス	105,500	1,894.00	199,817,000	貸付株式数	94,600株
キューピー	1,296,000	2,297.00	2,976,912,000	貸付株式数	300株
ハウス食品G本社	922,800	2,941.00	2,713,954,800	貸付株式数	100株
カゴメ	1,123,800	3,375.00	3,792,825,000		
焼津水産化工	119,700	923.00	110,483,100	貸付株式数	8,300株
アリアケジャパン	270,400	5,530.00	1,495,312,000	貸付株式数	2,300株
ピエトロ	38,700	1,834.00	70,975,800	貸付株式数	34,000株
エバラ食品工業	64,800	3,005.00	194,724,000	貸付株式数	11,900株
やまみ	25,500	1,663.00	42,406,500		
ニチレイ	1,104,800	2,416.00	2,669,196,800		
横浜冷凍	705,800	888.00	626,750,400		
東洋水産	1,320,300	5,350.00	7,063,605,000		
イトアンドHLDGS	111,800	2,284.00	255,351,200	貸付株式数	81,000株
大冷	33,000	1,908.00	62,964,000	貸付株式数	28,000株
ヨシムラ・フード・HLDGS	152,600	481.00	73,400,600	貸付株式数	129,800株
日清食品HD	954,600	9,720.00	9,278,712,000		
永谷園ホールディングス	131,600	2,008.00	264,252,800	貸付株式数	10,300株
一正蒲鉾	115,100	790.00	90,929,000	貸付株式数	33,600株 (1,000株)
フジッコ	275,200	1,990.00	547,648,000		
ロックフィールド	294,400	1,467.00	431,884,800	貸付株式数	209,700株
日本たばこ産業	15,877,900	2,342.50	37,193,980,750	貸付株式数	467,600株
ケンコーマヨネーズ	151,000	1,455.00	219,705,000	貸付株式数	100株
わらべや日洋HD	177,700	2,188.00	388,807,600	貸付株式数	3,600株
なとり	165,300	2,044.00	337,873,200	貸付株式数	117,600株
イフジ産業	51,700	953.00	49,270,100	貸付株式数	29,500株
ピックルスコーポレーション	141,500	1,127.00	159,470,500		
ファーマフーズ	372,800	1,439.00	536,459,200	貸付株式数	239,600株
北の達人コーポ	1,033,700	214.00	221,211,800	貸付株式数	930,300株 (223,600株)

ユーグレナ	1,528,000	915.00	1,398,120,000	貸付株式数 890,000株 (176,000株)
紀文食品	229,900	987.00	226,911,300	貸付株式数 145,900株
スター・マイカ・HLDGS	158,700	1,436.00	227,893,200	貸付株式数 1,500株
SREホールディングス	74,000	2,619.00	193,806,000	貸付株式数 66,500株
ADワークスグループ	518,900	149.00	77,316,100	貸付株式数 351,700株
片倉工業	258,000	2,055.00	530,190,000	貸付株式数 20,000株
グンゼ	167,700	3,730.00	625,521,000	
ヒューリック	6,330,800	1,039.00	6,577,701,200	貸付株式数 5,697,700株
神栄	42,100	851.00	35,827,100	貸付株式数 600株
ラサ商事	131,900	964.00	127,151,600	貸付株式数 100株
アルペン	213,600	2,103.00	449,200,800	貸付株式数 189,000株
ハブ	94,100	531.00	49,967,100	貸付株式数 81,000株
ラクーンホールディングス	245,700	1,643.00	403,685,100	貸付株式数 145,500株 (5,000株)
クオールホールディングス	356,400	1,360.00	484,704,000	貸付株式数 19,400株
アルコニックス	368,900	1,291.00	476,249,900	
神戸物産	2,004,900	3,475.00	6,967,027,500	貸付株式数 1,838,800株
ソリトンシステムズ	144,800	1,267.00	183,461,600	貸付株式数 126,000株 (5,000株)
ジンスホールディングス	153,900	4,355.00	670,234,500	貸付株式数 122,300株
ビックカメラ	1,723,400	1,146.00	1,975,016,400	貸付株式数 1,551,000株
DCMホールディングス	1,725,700	1,009.00	1,741,231,300	貸付株式数 300,000株
ペッパーフードサービス	397,200	367.00	145,772,400	貸付株式数 300,300株
ハイパー	72,100	453.00	32,661,300	貸付株式数 60,000株
Monotaro	3,673,800	2,316.00	8,508,520,800	貸付株式数 682,100株
東京一番フーズ	65,600	593.00	38,900,800	貸付株式数 60,000株
DDホールディングス	152,200	546.00	83,101,200	貸付株式数 111,500株
あいホールディングス	414,800	1,607.00	666,583,600	貸付株式数 348,000株
ディービーエックス	98,800	1,085.00	107,198,000	貸付株式数 72,900株
きちりホールディングス	77,400	365.00	28,251,000	貸付株式数 63,900株
アークランドサービスHD	212,100	2,126.00	450,924,600	貸付株式数 190,800株
J. フロント リテイリング	3,222,000	1,041.00	3,354,102,000	
ドトール・日レスHD	459,600	1,523.00	699,970,800	貸付株式数 9,700株
マツキヨココカラ&カンパニー	1,702,400	5,160.00	8,784,384,000	
ブロンコビリー	152,100	2,329.00	354,240,900	貸付株式数 115,200株 (2,000株)
ZOZO	1,998,200	2,831.00	5,656,904,200	
トレジャー・ファクトリー	85,100	1,221.00	103,907,100	貸付株式数 66,900株
物語コーポレーション	144,000	5,380.00	774,720,000	貸付株式数 69,800株

三越伊勢丹HD	4,361,200	986.00	4,300,143,200	
東洋紡	1,142,100	1,037.00	1,184,357,700	貸付株式数 2,800株
ユニチカ	793,600	234.00	185,702,400	貸付株式数 163,900株
富士紡ホールディングス	118,200	3,340.00	394,788,000	
日清紡ホールディングス	1,703,100	1,040.00	1,771,224,000	
倉敷紡績	201,400	2,006.00	404,008,400	
ダイワボウHD	1,235,800	1,839.00	2,272,636,200	
シキボウ	151,600	890.00	134,924,000	貸付株式数 8,100株
日東紡績	365,800	2,263.00	827,805,400	
トヨタ紡織	1,031,400	2,002.00	2,064,862,800	
マクニカ・富士エレHLDGS	692,900	2,574.00	1,783,524,600	貸付株式数 15,400株
Hamee	104,400	1,075.00	112,230,000	貸付株式数 90,000株 (1,200株)
マーケットエンタープライズ	29,100	1,132.00	32,941,200	貸付株式数 24,000株
ラクト・ジャパン	99,800	2,339.00	233,432,200	貸付株式数 44,600株 (500株)
ウエルシアHD	1,536,300	2,896.00	4,449,124,800	貸付株式数 40,000株
クリエイトSDH	428,500	3,095.00	1,326,207,500	貸付株式数 352,000株
グリムス	129,200	1,563.00	201,939,600	貸付株式数 113,000株
バイタルKSKHD	462,700	683.00	316,024,100	
八洲電機	209,400	984.00	206,049,600	貸付株式数 170,000株
メディアスホールディングス	165,800	961.00	159,333,800	貸付株式数 143,000株
レスターホールディングス	275,400	1,876.00	516,650,400	貸付株式数 233,000株
ジューテックHD	56,800	1,030.00	58,504,000	
丸善CHI HD	339,100	371.00	125,806,100	貸付株式数 305,100株 (8,100株)
大光	123,300	707.00	87,173,100	貸付株式数 104,200株
OCHIホールディングス	65,500	1,213.00	79,451,500	貸付株式数 58,700株
TOKAIホールディングス	1,407,500	874.00	1,230,155,000	
黒谷	78,900	591.00	46,629,900	貸付株式数 64,600株
ミサワ	58,700	604.00	35,454,800	貸付株式数 50,000株
ティーライフ	38,900	1,390.00	54,071,000	貸付株式数 35,000株
Cominix	50,400	718.00	36,187,200	貸付株式数 42,500株
エー・ピーホールディングス	56,900	445.00	25,320,500	貸付株式数 51,100株
三洋貿易	265,700	983.00	261,183,100	貸付株式数 100株
チムニー	88,600	1,209.00	107,117,400	貸付株式数 77,000株
シュッピン	241,500	1,302.00	314,433,000	貸付株式数 192,000株
ビューティガレージ	46,800	2,621.00	122,662,800	貸付株式数 42,000株 (1,000株)

オイシックス・ラ・大地	418,000	1,761.00	736,098,000	貸付株式数	313,500株 (2,000株)
ウイン・パートナーズ	209,400	1,034.00	216,519,600	貸付株式数	181,000株
ネクステージ	590,100	2,459.00	1,451,055,900	貸付株式数	16,300株
ジョイフル本田	833,800	1,596.00	1,330,744,800	貸付株式数	692,900株
鳥貴族ホールディングス	95,900	2,162.00	207,335,800	貸付株式数	85,000株 (32,800株)
ホットランド	217,200	1,307.00	283,880,400	貸付株式数	155,700株 (13,800株)
すかいらーくHD	3,542,800	1,570.00	5,562,196,000	貸付株式数	1,148,300株
SFPホールディングス	141,900	1,539.00	218,384,100	貸付株式数	124,000株
綿半ホールディングス	200,000	1,366.00	273,200,000	貸付株式数	61,500株
日本毛織	713,000	981.00	699,453,000	貸付株式数	652,000株
ダイトウボウ	470,100	90.00	42,309,000	貸付株式数	242,000株
トーア紡コーポレーション	106,500	369.00	39,298,500	貸付株式数	2,400株
ガイドーリミテッド	414,400	183.00	75,835,200	貸付株式数	294,000株
ヨシックスホールディングス	56,800	2,279.00	129,447,200	貸付株式数	46,700株
ユナイテッド・スーパーマート	844,500	1,082.00	913,749,000	貸付株式数	740,000株
三栄建築設計	116,700	1,604.00	187,186,800		
野村不動産HLDS	1,506,100	3,185.00	4,796,928,500		
三重交通グループHD	589,600	465.00	274,164,000	貸付株式数	497,600株
サムティ	439,300	2,017.00	886,068,100	貸付株式数	242,300株
ディア・ライフ	356,800	605.00	215,864,000	貸付株式数	253,100株
コーセーアールイー	85,500	652.00	55,746,000	貸付株式数	75,100株
地主	184,400	2,052.00	378,388,800	貸付株式数	121,200株
プレサンスコーポレーション	317,200	1,505.00	477,386,000	貸付株式数	115,900株
フィル・カンパニー	47,700	1,281.00	61,103,700	貸付株式数	44,000株
THEグローバル社	155,700	145.00	22,576,500	貸付株式数	133,600株
ハウスコム	50,000	891.00	44,550,000	貸付株式数	3,700株
JPMC	139,500	1,000.00	139,500,000	貸付株式数	300株
サンセイランディック	85,500	835.00	71,392,500	貸付株式数	37,300株
エストラスト	33,900	561.00	19,017,900	貸付株式数	200株
フージャースHD	372,000	787.00	292,764,000		
オープンハウスグループ	925,300	5,550.00	5,135,415,000	貸付株式数	180,200株
東急不動産HD	7,912,700	695.00	5,499,326,500		
飯田GHD	2,427,300	2,112.00	5,126,457,600		
イーランド	41,000	1,406.00	57,646,000		
ムゲンエステート	178,600	477.00	85,192,200	貸付株式数	16,800株
帝国繊維	301,600	1,662.00	501,259,200		
日本コークス工業	2,492,600	116.00	289,141,600	貸付株式数	1,261,000株

ゴルフダイジェスト・オン	150,800	1,318.00	198,754,400	貸付株式数 43,500株 (1,000株)
ミタチ産業	72,800	859.00	62,535,200	貸付株式数 45,500株
B E E N O S	146,700	2,360.00	346,212,000	貸付株式数 107,000株
あさひ	240,200	1,279.00	307,215,800	貸付株式数 88,000株
日本調剤	176,200	1,326.00	233,641,200	貸付株式数 143,500株
コスモス薬品	293,100	13,140.00	3,851,334,000	貸付株式数 256,000株
シップヘルスケアHD	838,300	2,535.00	2,125,090,500	
トーエル	127,200	906.00	115,243,200	貸付株式数 116,000株
ソフトクリエイトHD	126,300	4,040.00	510,252,000	
セブン&アイ・HLDGS	9,744,100	5,325.00	51,887,332,500	
クリエイト・レストランツ・ホール	1,949,500	898.00	1,750,651,000	貸付株式数 1,735,000株 (289,400株)
明治電機工業	87,400	1,080.00	94,392,000	貸付株式数 12,300株
ツルハホールディングス	634,100	7,520.00	4,768,432,000	貸付株式数 80,300株
デリカフーズHLDGS	112,500	510.00	57,375,000	貸付株式数 98,000株
スターティアホールディングス	65,700	770.00	50,589,000	貸付株式数 45,600株
サンマルクホールディングス	229,400	1,553.00	356,258,200	貸付株式数 30,000株
フェリシモ	64,500	1,124.00	72,498,000	貸付株式数 52,500株
トリドールホールディングス	723,000	2,517.00	1,819,791,000	貸付株式数 650,700株 (2,500株)
帝 人	2,538,700	1,419.00	3,602,415,300	
東 レ	17,933,800	747.60	13,407,308,880	
ク ラ レ	3,900,800	1,071.00	4,177,756,800	
旭 化 成	17,876,200	1,055.50	18,868,329,100	
T O K Y O B A S E	266,500	325.00	86,612,500	貸付株式数 239,800株
稲葉製作所	147,900	1,361.00	201,291,900	貸付株式数 138,000株
宮地エンジニアリングG	82,500	3,275.00	270,187,500	
トーカロ	752,700	1,239.00	932,595,300	
アルファCO	102,800	988.00	101,566,400	貸付株式数 10,400株
S U M C O	4,811,600	1,757.00	8,453,981,200	貸付株式数 2,750,000株
川田テクノロジーズ	54,300	3,505.00	190,321,500	
R S T E C H N O L O G I E S	94,800	6,040.00	572,592,000	
ジェイテックコーポレーション	37,600	2,185.00	82,156,000	貸付株式数 33,700株
信和	181,100	779.00	141,076,900	
ビーロッド	201,700	503.00	101,455,100	貸付株式数 11,600株
ファーストブラザーズ	66,200	848.00	56,137,600	貸付株式数 16,700株
A N D D Oホールディングス	143,500	820.00	117,670,000	貸付株式数 129,000株
シーアールイー	110,000	1,663.00	182,930,000	貸付株式数 98,800株
プロパティエージェント	33,500	1,450.00	48,575,000	貸付株式数 28,000株

ケイアイスター不動産	130,900	4,650.00	608,685,000	貸付株式数 47,000株 (45,000株)
アグレ都市デザイン	47,400	1,505.00	71,337,000	貸付株式数 31,000株
グッドコムアセット	125,700	1,258.00	158,130,600	貸付株式数 35,400株 (33,400株)
ジェイ・エス・ビー	59,200	3,115.00	184,408,000	貸付株式数 2,100株
ロードスターキャピタル	73,700	1,907.00	140,545,900	貸付株式数 66,300株
テンポイノベーション	81,000	867.00	70,227,000	貸付株式数 65,400株
グローバルリンクマネジメント	50,900	905.00	46,064,500	貸付株式数 43,000株
フェイスネットワーク	36,500	1,366.00	49,859,000	貸付株式数 16,800株
住江織物	49,300	1,658.00	81,739,400	貸付株式数 45,000株
日本フェルト	163,700	411.00	67,280,700	貸付株式数 143,000株
イチカワ	34,100	1,393.00	47,501,300	貸付株式数 3,000株
エコナックホールディングス	485,000	91.00	44,135,000	貸付株式数 269,400株
日東製網	31,000	1,309.00	40,579,000	貸付株式数 1,200株
芦森工業	55,600	1,000.00	55,600,000	貸付株式数 15,400株
アツギ	206,100	490.00	100,989,000	貸付株式数 5,400株
ウイルプラスHLDGS	54,600	861.00	47,010,600	貸付株式数 37,900株
JMホールディングス	219,800	1,648.00	362,230,400	貸付株式数 197,800株 (12,800株)
コメダホールディングス	634,300	2,247.00	1,425,272,100	貸付株式数 350,000株
サツドラホールディングス	130,400	662.00	86,324,800	貸付株式数 111,100株
アレンザホールディングス	193,500	1,018.00	196,983,000	貸付株式数 178,000株
串カツ田中HLDGS	77,500	1,813.00	140,507,500	貸付株式数 32,000株
バロックジャパン	201,500	797.00	160,595,500	貸付株式数 176,000株 (2,000株)
クスリのアオキHLDGS	259,900	5,440.00	1,413,856,000	貸付株式数 209,800株
ダイニック	93,500	622.00	58,157,000	貸付株式数 7,300株
共和レザー	157,200	561.00	88,189,200	貸付株式数 3,200株
ピーバンドットコム	40,700	513.00	20,879,100	貸付株式数 26,500株
力の源HD	148,800	645.00	95,976,000	貸付株式数 131,500株
FOOD & LIFE COMPAN	1,488,600	2,721.00	4,050,480,600	
アセンテック	99,200	621.00	61,603,200	貸付株式数 83,800株
セーレン	533,000	2,028.00	1,080,924,000	貸付株式数 494,000株
ソトー	105,300	845.00	88,978,500	貸付株式数 1,200株
東海染工	33,100	1,135.00	37,568,500	貸付株式数 2,800株
小松マテーレ	434,800	1,071.00	465,670,800	貸付株式数 200株
ワコールホールディングス	590,700	2,077.00	1,226,883,900	
ホギメディカル	359,300	3,255.00	1,169,521,500	貸付株式数 500株
クラウディアHLDGS	62,200	253.00	15,736,600	貸付株式数 54,200株

T S Iホールディングス	877,500	336.00	294,840,000	貸付株式数	727,000株
マツオカコーポレーション	83,200	929.00	77,292,800	貸付株式数	63,000株
ワールド	378,000	1,265.00	478,170,000	貸付株式数	68,300株
T I S	2,530,700	3,575.00	9,047,252,500		
J N Sホールディングス	133,600	411.00	54,909,600	貸付株式数	96,000株
グリー	1,317,100	831.00	1,094,510,100	貸付株式数	1,124,200株
G M Oペパボ	30,000	1,982.00	59,460,000	貸付株式数	26,000株
コーエーテクモHD	923,500	4,650.00	4,294,275,000		
三菱総合研究所	120,500	4,140.00	498,870,000		
ボルテージ	77,600	341.00	26,461,600	貸付株式数	52,000株
電算	32,100	2,169.00	69,624,900	貸付株式数	1,100株
A G S	114,600	731.00	83,772,600	貸付株式数	63,700株
ファインデックス	243,600	660.00	160,776,000	貸付株式数	187,200株
ブレインパッド	245,000	1,080.00	264,600,000	貸付株式数	57,900株
K L a b	495,600	478.00	236,896,800	貸付株式数	84,800株
ポルトゥウィンホールディング	419,500	939.00	393,910,500		
ネクソン	6,605,000	2,940.00	19,418,700,000		
アイスタイル	747,100	243.00	181,545,300	貸付株式数	587,000株
エムアップホールディングス	334,300	1,327.00	443,616,100		
エイチーム	181,500	710.00	128,865,000	貸付株式数	89,900株
エニグモ	312,400	522.00	163,072,800	貸付株式数	265,400株
テクノスジャパン	224,100	479.00	107,343,900	貸付株式数	88,200株
e n i s h	204,300	400.00	81,720,000	貸付株式数	131,300株
コロプラ	952,400	649.00	618,107,600	貸付株式数	155,300株
オルトプラス	207,200	357.00	73,970,400	貸付株式数	139,000株
ブロードリーフ	1,434,800	453.00	649,964,400	貸付株式数	396,000株
クロス・マーケティングG	109,900	724.00	79,567,600	貸付株式数	96,000株
デジタルハーツHLDGS	131,400	1,800.00	236,520,000	貸付株式数	38,000株
システム情報	216,700	983.00	213,016,100	貸付株式数	181,000株
メディアドゥ	98,800	1,979.00	195,525,200	貸付株式数	78,600株 (2,000株)
じげん	818,600	342.00	279,961,200		
ブイキューブ	294,500	1,213.00	357,228,500	貸付株式数	203,800株
エンカレッジ・テクノロジー	63,500	505.00	32,067,500	貸付株式数	29,200株
サイバーリンクス	96,800	1,154.00	111,707,200	貸付株式数	80,400株
ディー・エル・イー	193,900	362.00	70,191,800	貸付株式数	170,000株 (1,000株)
フィックスターズ	277,200	982.00	272,210,400		
C A R T A H O L D I N G S	118,100	1,855.00	219,075,500	貸付株式数	97,300株

オプティム	201,900	821.00	165,759,900	貸付株式数	177,000株 (5,600株)
セレス	108,400	1,206.00	130,730,400	貸付株式数	94,600株
S H I F T	179,700	19,100.00	3,432,270,000	貸付株式数	39,200株
特種東海製紙	150,300	3,090.00	464,427,000		
ティーガイア	256,800	1,612.00	413,961,600	貸付株式数	89,500株
セック	42,300	2,505.00	105,961,500	貸付株式数	21,200株
テクマトリックス	489,500	1,845.00	903,127,500	貸付株式数	15,800株
プロシップ	95,900	1,589.00	152,385,100	貸付株式数	43,000株
ガンホー・オンライン・エンター	751,900	2,477.00	1,862,456,300	貸付株式数	659,000株
GMOペイメントゲートウェイ	560,900	10,950.00	6,141,855,000		
ザッパラス	100,100	361.00	36,136,100	貸付株式数	7,100株
システムリサーチ	84,300	2,075.00	174,922,500	貸付株式数	29,600株
インターネットイニシアティブ	771,200	5,080.00	3,917,696,000		
さくらインターネット	310,100	547.00	169,624,700	貸付株式数	274,000株 (34,000株)
ヴィンクス	81,200	1,270.00	103,124,000	貸付株式数	3,200株
GMOグローバルサインHD	64,300	5,400.00	347,220,000	貸付株式数	56,000株 (9,500株)
S R Aホールディングス	139,700	2,839.00	396,608,300		
システムインテグレータ	91,400	481.00	43,963,400	貸付株式数	80,000株
朝日ネット	263,800	581.00	153,267,800		
e B A S E	345,600	542.00	187,315,200	貸付株式数	137,900株
アバント	310,100	1,474.00	457,087,400		
アドソル日進	103,300	1,589.00	164,143,700	貸付株式数	77,400株
ODKソリューションズ	60,200	570.00	34,314,000	貸付株式数	3,200株
フリービット	150,300	826.00	124,147,800	貸付株式数	124,900株 (19,400株)
コムチュア	324,900	2,800.00	909,720,000		
サイバーコム	44,200	1,316.00	58,167,200		
アステリア	208,200	924.00	192,376,800	貸付株式数	56,800株
アイル	137,800	1,533.00	211,247,400		
王子ホールディングス	11,150,400	563.00	6,277,675,200		
日本製紙	1,171,500	971.00	1,137,526,500	貸付株式数	695,000株
三菱製紙	368,900	294.00	108,456,600	貸付株式数	13,100株
北越コーポレーション	1,722,500	715.00	1,231,587,500	貸付株式数	300株
中越パルプ	110,200	906.00	99,841,200	貸付株式数	70,600株
巴川製紙	85,700	609.00	52,191,300	貸付株式数	30,800株
大王製紙	1,238,700	1,454.00	1,801,069,800		
阿波製紙	65,300	302.00	19,720,600	貸付株式数	60,000株

マークライズ	145,300	2,212.00	321,403,600		
メディカル・データ・ビジ	366,700	1,148.00	420,971,600	貸付株式数	192,800株
gumi	401,100	651.00	261,116,100	貸付株式数	251,000株
ショーケース	62,800	434.00	27,255,200	貸付株式数	53,600株
モバイルファクトリー	65,500	1,095.00	71,722,500	貸付株式数	57,000株
テラスカイ	105,400	1,509.00	159,048,600	貸付株式数	93,500株 (6,300株)
デジタル・インフォメーション	127,900	1,402.00	179,315,800		
P C Iホールディングス	113,600	918.00	104,284,800	貸付株式数	78,000株
パイブドHD	53,000	2,799.00	148,347,000		
アイビーシー	42,000	441.00	18,522,000	貸付株式数	38,500株
ネオジャパン	82,000	1,120.00	91,840,000	貸付株式数	73,800株
P R T I M E S	61,700	2,122.00	130,927,400	貸付株式数	54,000株
ラクス	1,327,900	1,884.00	2,501,763,600	貸付株式数	281,000株
ランドコンピュータ	65,900	876.00	57,728,400		
ダブルスタンダード	87,100	1,993.00	173,590,300	貸付株式数	69,900株
オーブンドア	171,900	1,624.00	279,165,600	貸付株式数	154,600株
マイネット	103,600	493.00	51,074,800	貸付株式数	70,000株
アカツキ	129,300	2,632.00	340,317,600		
ベネフィットジャパン	21,800	1,923.00	41,921,400	貸付株式数	3,000株
U B I C O Mホールディングス	76,000	2,613.00	198,588,000	貸付株式数	66,000株 (5,600株)
カナミックネットワーク	352,700	589.00	207,740,300	貸付株式数	216,000株
ノムラシステムコーポレーション	297,500	123.00	36,592,500	貸付株式数	80,200株
レンゴー	2,234,700	741.00	1,655,912,700		
トーモク	141,900	1,500.00	212,850,000	貸付株式数	50,000株
ザ・パック	182,200	2,326.00	423,797,200	貸付株式数	9,600株
チェンジ	601,400	2,155.00	1,296,017,000		
シンクロ・フード	147,900	383.00	56,645,700	貸付株式数	124,000株
オークネット	153,800	2,098.00	322,672,400	貸付株式数	130,100株
キャピタル・アセット・プラン	52,500	635.00	33,337,500	貸付株式数	46,900株
セグエグループ	75,000	535.00	40,125,000	貸付株式数	65,000株
エイトレッド	41,200	2,009.00	82,770,800	貸付株式数	33,700株
マクロミル	556,100	932.00	518,285,200	貸付株式数	163,300株
ビーグリー	68,200	1,286.00	87,705,200	貸付株式数	19,400株
オロ	88,800	1,721.00	152,824,800	貸付株式数	78,000株
ユーザーローカル	88,100	1,589.00	139,990,900	貸付株式数	77,000株 (2,000株)
テモナ	52,300	362.00	18,932,600	貸付株式数	47,300株
ニーズウェル	83,900	630.00	52,857,000	貸付株式数	51,300株

マネーフォワード	589,700	3,790.00	2,234,963,000	貸付株式数	430,000株
サインポスト	93,600	897.00	83,959,200	貸付株式数	79,800株 (3,000株)
昭和電工	2,540,700	2,222.00	5,645,435,400		
住友化学	19,713,600	525.00	10,349,640,000		
住友精化	115,300	2,876.00	331,602,800		
日産化学	1,300,600	6,510.00	8,466,906,000		
ラサ工業	101,900	1,815.00	184,948,500		
クレハ	209,500	10,030.00	2,101,285,000		
多木化学	95,400	4,465.00	425,961,000	貸付株式数	75,000株 (6,400株)
テイカ	165,000	1,201.00	198,165,000		
石原産業	518,000	1,014.00	525,252,000		
片倉コープアグリ	65,200	1,257.00	81,956,400	貸付株式数	700株
日本曹達	316,600	4,235.00	1,340,801,000	貸付株式数	400株
東ソー	3,573,400	1,712.00	6,117,660,800		
トクヤマ	858,600	1,752.00	1,504,267,200	貸付株式数	3,500株
セントラル硝子	433,100	3,095.00	1,340,444,500		
東亜合成	1,376,200	1,037.00	1,427,119,400		
大阪ソーダ	220,300	3,270.00	720,381,000	貸付株式数	25,600株
関東電化	527,200	882.00	464,990,400		
デンカ	973,400	3,315.00	3,226,821,000		
イビデン	1,419,400	3,890.00	5,521,466,000	貸付株式数	102,800株
信越化学	4,580,000	15,980.00	73,188,400,000		
日本カ - バイド	103,300	1,341.00	138,525,300		
電算システムHD	118,700	2,390.00	283,693,000		
堺 化 学	187,100	1,857.00	347,444,700	貸付株式数	130,000株
第一稀元素化学工	245,700	1,187.00	291,645,900	貸付株式数	4,400株
エア・ウォーター	2,315,200	1,698.00	3,931,209,600	貸付株式数	4,900株
日本酸素HLDGS	2,380,200	2,184.00	5,198,356,800	貸付株式数	1,100株
日本化学工業	81,800	1,932.00	158,037,600		
東邦アセチレン	57,800	1,108.00	64,042,400		
日本パ - カライジング	1,214,800	938.00	1,139,482,400		
高压ガス	407,400	666.00	271,328,400	貸付株式数	300株
チタン工業	33,300	1,610.00	53,613,000	貸付株式数	22,600株
四国化成	334,000	1,231.00	411,154,000		
戸田工業	61,500	2,295.00	141,142,500	貸付株式数	49,000株
ステラ ケミファ	145,400	2,431.00	353,467,400	貸付株式数	31,100株
保土谷化学	77,100	3,270.00	252,117,000		
日本触媒	411,200	5,220.00	2,146,464,000		

大日精化	204,500	1,775.00	362,987,500		
カネカ	622,800	3,375.00	2,101,950,000	貸付株式数	47,100株
協和キリン	2,968,100	3,130.00	9,290,153,000		
三菱瓦斯化学	2,274,700	1,943.00	4,419,742,100	貸付株式数	27,700株
三井化学	2,249,600	2,835.00	6,377,616,000		
J S R	2,692,700	3,505.00	9,437,913,500	貸付株式数	57,600株
東京応化工業	429,300	6,820.00	2,927,826,000	貸付株式数	129,000株
大阪有機化学	205,200	2,481.00	509,101,200	貸付株式数	6,000株
三菱ケミカルグループ	17,937,400	744.20	13,349,013,080		
K H ネオケム	442,400	2,442.00	1,080,340,800	貸付株式数	297,000株
ダイセル	3,885,000	835.00	3,243,975,000	貸付株式数	156,200株
住友ベークライト	408,900	4,120.00	1,684,668,000		
積水化学	5,519,700	1,858.00	10,255,602,600		
日本ゼオン	2,171,700	1,359.00	2,951,340,300	貸付株式数	1,600株
アイカ工業	681,100	3,015.00	2,053,516,500	貸付株式数	90,000株
U B E	1,361,900	2,028.00	2,761,933,200		
積水樹脂	396,800	1,725.00	684,480,000		
タキロンシーアイ	625,100	539.00	336,928,900		
旭有機材	163,300	1,938.00	316,475,400	貸付株式数	1,400株
ニチバン	152,100	1,615.00	245,641,500	貸付株式数	112,100株
リケンテクノス	587,200	435.00	255,432,000		
大倉工業	125,200	1,688.00	211,337,600		
積水化成製品	344,300	409.00	140,818,700		
群栄化学	57,800	2,539.00	146,754,200		
タイガース ポリマー	138,300	426.00	58,915,800	貸付株式数	200株
ミライアル	92,700	1,720.00	159,444,000	貸付株式数	30,000株
ダイキアクシス	112,800	692.00	78,057,600	貸付株式数	91,400株
ダイキョーニシカワ	609,200	524.00	319,220,800	貸付株式数	9,500株
竹本容器	103,300	763.00	78,817,900	貸付株式数	18,800株
森六ホールディングス	139,900	1,784.00	249,581,600		
恵和	79,400	3,390.00	269,166,000		
日本化薬	2,030,300	1,099.00	2,231,299,700		
カーリットホールディングス	242,200	673.00	163,000,600	貸付株式数	74,600株
ソルクシーズ	245,500	369.00	90,589,500	貸付株式数	206,000株
C L ホールディングス	59,600	904.00	53,878,400	貸付株式数	51,000株
プレステージ・インター	1,056,900	692.00	731,374,800		
フェイス	76,100	597.00	45,431,700	貸付株式数	5,400株
プロトコーポレーション	307,200	1,049.00	322,252,800	貸付株式数	21,600株
ハイマックス	76,800	1,364.00	104,755,200	貸付株式数	64,000株
アミューズ	153,700	1,958.00	300,944,600		

野村総合研究所	5,034,700	3,810.00	19,182,207,000	
ドリームインキュベータ	86,300	1,929.00	166,472,700	貸付株式数 64,100株
サイバネットシステム	205,600	847.00	174,143,200	
クイック	175,000	1,423.00	249,025,000	
T A C	152,700	215.00	32,830,500	貸付株式数 12,200株
C E ホールディングス	140,000	459.00	64,260,000	貸付株式数 121,000株
日本システム技術	51,300	2,457.00	126,044,100	貸付株式数 600株
電通グループ	2,642,000	4,160.00	10,990,720,000	
インテージホールディングス	333,300	1,311.00	436,956,300	
テイクアンドギヴニーズ	131,700	1,291.00	170,024,700	貸付株式数 43,500株
東邦システムサイエンス	76,300	908.00	69,280,400	貸付株式数 66,000株
びあ	84,400	3,090.00	260,796,000	貸付株式数 61,200株 (1,800株)
イオンファンタジー	108,800	2,412.00	262,425,600	貸付株式数 89,300株
ソースネクスト	1,248,600	214.00	267,200,400	貸付株式数 1,095,000株 (113,800株)
シーティーエス	318,000	811.00	257,898,000	貸付株式数 12,900株
ネクシィーズグループ	86,400	583.00	50,371,200	貸付株式数 80,300株
インフォコム	316,500	2,129.00	673,828,500	
メディカルシステムネットワーク	252,600	434.00	109,628,400	
日本精化	185,800	1,920.00	356,736,000	貸付株式数 63,800株
扶桑化学工業	227,600	3,480.00	792,048,000	
トリケミカル	297,600	2,144.00	638,054,400	
シンプレクスHD	458,100	1,773.00	812,211,300	貸付株式数 12,600株
H E R O Z	82,600	837.00	69,136,200	貸付株式数 74,300株 (17,500株)
ラクスル	345,400	1,956.00	675,602,400	貸付株式数 226,000株
I P S	79,600	2,270.00	180,692,000	貸付株式数 1,900株
F I G	314,400	321.00	100,922,400	貸付株式数 182,700株
システムサポート	104,500	1,252.00	130,834,000	貸付株式数 6,300株
A D E K A	1,140,700	2,296.00	2,619,047,200	
日油	834,900	5,140.00	4,291,386,000	貸付株式数 100株
ミヨシ油脂	103,900	1,023.00	106,289,700	貸付株式数 11,200株
新日本理化	409,900	262.00	107,393,800	貸付株式数 47,700株
ハリマ化成グループ	191,000	750.00	143,250,000	貸付株式数 3,400株
イーソル	177,000	605.00	107,085,000	貸付株式数 155,000株
アルテリア・ネットワークス	274,800	1,244.00	341,851,200	
東海ソフト	45,100	928.00	41,852,800	貸付株式数 35,300株
ウイングアーク1 S T	220,400	1,654.00	364,541,600	貸付株式数 30,800株

ヒト・コミュニケーションズHD	65,600	1,584.00	103,910,400	貸付株式数 46,300株 (2,000株)
サーバーワークス	49,600	2,265.00	112,344,000	貸付株式数 43,000株
東名	20,200	1,050.00	21,210,000	貸付株式数 19,000株
ヴィッツ	26,700	1,092.00	29,156,400	貸付株式数 1,700株
トピラスシステムズ	58,400	918.00	53,611,200	貸付株式数 6,800株
Sansan	915,600	1,070.00	979,692,000	貸付株式数 288,000株
Link-U	51,900	658.00	34,150,200	貸付株式数 45,000株 (6,500株)
ギフトィ	237,500	1,216.00	288,800,000	貸付株式数 217,000株 (10,000株)
花王	6,091,500	5,708.00	34,770,282,000	貸付株式数 923,700株
第一工業製薬	97,900	2,301.00	225,267,900	
石原ケミカル	134,600	1,276.00	171,749,600	貸付株式数 87,100株
日華化学	97,400	811.00	78,991,400	貸付株式数 2,900株
ニイタカ	54,500	2,074.00	113,033,000	貸付株式数 47,000株
三洋化成	172,600	4,700.00	811,220,000	貸付株式数 400株
ベース	49,500	5,370.00	265,815,000	貸付株式数 42,000株
JMDC	362,500	6,900.00	2,501,250,000	貸付株式数 226,900株
武田薬品	23,190,300	3,884.00	90,071,125,200	
アステラス製薬	25,225,100	2,122.00	53,527,662,200	
住友ファーマ	1,822,500	1,103.00	2,010,217,500	
塩野義製薬	3,424,900	7,063.00	24,190,068,700	
わかもと製薬	287,200	259.00	74,384,800	貸付株式数 257,000株
日本新薬	643,500	8,310.00	5,347,485,000	
中外製薬	9,228,300	3,657.00	33,747,893,100	
科研製薬	420,900	3,895.00	1,639,405,500	
エーザイ	3,260,000	6,096.00	19,872,960,000	
理研ビタミン	208,300	1,708.00	355,776,400	
ロート製薬	1,406,300	4,010.00	5,639,263,000	
小野薬品	5,687,700	3,756.00	21,363,001,200	
久光製薬	624,100	3,380.00	2,109,458,000	
有機合成薬品	201,200	267.00	53,720,400	貸付株式数 22,100株
持田製薬	331,100	3,335.00	1,104,218,500	
参天製薬	5,138,900	1,078.00	5,539,734,200	
扶桑薬品	95,300	2,093.00	199,462,900	
日本ケミファ	31,200	1,865.00	58,188,000	貸付株式数 600株
ツムラ	843,900	3,160.00	2,666,724,000	
日医工	850,200	360.00	306,072,000	貸付株式数 570,000株
テルモ	8,349,000	4,167.00	34,790,283,000	

HUグループHD	736,700	3,020.00	2,224,834,000	貸付株式数	32,000株
キッセイ薬品工業	427,200	2,687.00	1,147,886,400		
生化学工業	520,500	847.00	440,863,500	貸付株式数	4,600株
栄研化学	438,800	1,859.00	815,729,200		
日水製薬	108,600	1,713.00	186,031,800	貸付株式数	1,200株
鳥居薬品	158,400	3,275.00	518,760,000		
JCRファーマ	831,700	2,555.00	2,124,993,500	貸付株式数	9,900株
東和薬品	424,800	2,630.00	1,117,224,000		
富士製薬工業	158,800	973.00	154,512,400		
ゼリア新薬工業	438,000	2,180.00	954,840,000	貸付株式数	128,100株
第一三共	21,402,400	3,443.00	73,688,463,200		
キョーリン製薬HD	532,700	1,800.00	958,860,000		
大幸薬品	444,800	589.00	261,987,200	貸付株式数	312,300株 (3,900株)
ダイト	183,500	2,836.00	520,406,000		
大塚ホールディングス	5,620,900	4,879.00	27,424,371,100		
大正製薬HD	545,800	5,410.00	2,952,778,000	貸付株式数	700株
ペプチドリーム	1,548,300	1,562.00	2,418,444,600		
大日本塗料	326,600	711.00	232,212,600	貸付株式数	229,000株
日本ペイントHOLD	10,857,400	1,112.00	12,073,428,800	貸付株式数	342,400株
関西ペイント	2,497,300	1,853.00	4,627,496,900		
神東塗料	227,000	148.00	33,596,000	貸付株式数	190,700株
中国塗料	624,700	894.00	558,481,800		
日本特殊塗料	173,100	969.00	167,733,900		
藤倉化成	359,600	472.00	169,731,200	貸付株式数	2,500株
太陽ホールディングス	425,700	2,792.00	1,188,554,400		
DIC	1,046,000	2,426.00	2,537,596,000	貸付株式数	739,000株
サカタインクス	496,400	944.00	468,601,600	貸付株式数	63,000株
東洋インキSCホールディン	534,000	1,895.00	1,011,930,000	貸付株式数	467,000株
T&K TOKA	232,800	819.00	190,663,200		
アルプス技研	238,900	1,792.00	428,108,800		
サニックス	493,000	230.00	113,390,000	貸付株式数	403,300株 (27,300株)
ダイオーズ	55,500	1,074.00	59,607,000	貸付株式数	45,500株
日本空調サービス	294,900	782.00	230,611,800		
オリエンタルランド	2,998,500	18,125.00	54,347,812,500	貸付株式数	485,500株
フォーカスシステムズ	179,300	892.00	159,935,600	貸付株式数	7,300株
ダスキン	607,100	2,880.00	1,748,448,000		
パーク24	1,723,500	1,716.00	2,957,526,000	貸付株式数	20,200株

明光ネットワークジャパン	331,100	613.00	202,964,300	貸付株式数 222,600株 (3,300株)
ファルコホールディングス	124,100	1,918.00	238,023,800	貸付株式数 7,100株
クレスコ	210,600	1,943.00	409,195,800	
フジ・メディア・HD	2,574,400	1,167.00	3,004,324,800	
秀英予備校	61,500	427.00	26,260,500	貸付株式数 53,000株
田谷	51,500	551.00	28,376,500	貸付株式数 42,000株
ラウンドワン	787,000	1,376.00	1,082,912,000	貸付株式数 300株
リゾートトラスト	1,193,000	2,010.00	2,397,930,000	
オービック	912,200	21,120.00	19,265,664,000	貸付株式数 24,300株
ジャストシステム	411,900	4,030.00	1,659,957,000	
TDCソフト	229,900	1,078.00	247,832,200	貸付株式数 100株
Zホールディングス	41,749,600	435.50	18,181,950,800	
ビー・エム・エル	358,700	3,605.00	1,293,113,500	
トレンドマイクロ	1,418,600	7,280.00	10,327,408,000	貸付株式数 811,200株
りらいあコミュニケーション	415,800	1,089.00	452,806,200	
IDホールディングス	182,200	822.00	149,768,400	
リソー教育	1,287,700	320.00	412,064,000	
日本オラクル	470,100	8,100.00	3,807,810,000	
早稲田アカデミー	156,900	1,138.00	178,552,200	貸付株式数 4,400株
アルファシステムズ	77,300	4,370.00	337,801,000	貸付株式数 8,400株
フューチャー	611,200	1,542.00	942,470,400	
CAC HOLDINGS	150,600	1,374.00	206,924,400	
SBテクノロジー	125,100	2,275.00	284,602,500	
トーセ	71,200	757.00	53,898,400	貸付株式数 38,300株
ユー・エス・エス	3,156,300	2,427.00	7,660,340,100	
オービックビジネスC	276,200	4,925.00	1,360,285,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	1,318,900	3,480.00	4,589,772,000	
アイティフォー	350,500	783.00	274,441,500	貸付株式数 2,500株
東京個別指導学院	248,500	609.00	151,336,500	貸付株式数 207,000株
東計電算	34,200	5,840.00	199,728,000	貸付株式数 6,100株
サイバーエージェント	6,022,000	1,359.00	8,183,898,000	貸付株式数 3,915,000株
楽天グループ	13,084,900	637.00	8,335,081,300	貸付株式数 11,934,000株
エクスネット	45,500	1,012.00	46,046,000	貸付株式数 700株
クリーク・アンド・リバー社	147,700	2,110.00	311,647,000	貸付株式数 9,300株
モーニングスター	493,000	523.00	257,839,000	貸付株式数 115,200株
テー・オー・ダブリュー	538,200	309.00	166,303,800	貸付株式数 10,300株
大塚商会	1,566,500	4,110.00	6,438,315,000	貸付株式数 241,300株
サイボウズ	386,600	1,098.00	424,486,800	貸付株式数 24,900株
山田コンサルティングGP	145,900	1,106.00	161,365,400	貸付株式数 40,000株

セントラルスポーツ	105,100	2,451.00	257,600,100	貸付株式数	91,900株
パラカ	84,900	1,790.00	151,971,000	貸付株式数	64,800株
電通国際情報S	358,300	4,280.00	1,533,524,000	貸付株式数	152,000株
A C C E S S	326,800	753.00	246,080,400	貸付株式数	85,400株
デジタルガレージ	479,000	3,870.00	1,853,730,000	貸付株式数	132,800株
イーエムシステムズ	477,900	1,016.00	485,546,400	貸付株式数	9,800株
ウェザーニューズ	86,800	7,560.00	656,208,000	貸付株式数	10,300株
C I J	224,200	728.00	163,217,600	貸付株式数	1,900株
ビジネスエンジニアリング	66,000	2,336.00	154,176,000	貸付株式数	57,000株
日本エンタープライズ	282,300	152.00	42,909,600	貸付株式数	200,800株
WOWOW	119,000	1,490.00	177,310,000	貸付株式数	6,600株
スカラ	242,900	719.00	174,645,100		
インテリジェント ウェイブ	144,900	798.00	115,630,200	貸付株式数	127,000株
フルキャストホールディングス	240,200	2,426.00	582,725,200		
エン・ジャパン	501,100	1,943.00	973,637,300		
あすか製薬HD	279,900	1,036.00	289,976,400		
サワイグループHD	565,900	4,250.00	2,405,075,000		
富士フイルムHLDGS	5,185,400	7,622.00	39,523,118,800		
コニカミノルタ	5,985,800	456.00	2,729,524,800	貸付株式数	668,100株
資生堂	5,496,300	5,552.00	30,515,457,600		
ライオン	2,947,700	1,516.00	4,468,713,200	貸付株式数	1,569,800株
高砂香料	166,200	2,500.00	415,500,000		
マンダム	574,700	1,620.00	931,014,000		
ミルボン	364,000	5,070.00	1,845,480,000		
ファンケル	1,194,200	2,532.00	3,023,714,400		
コーセー	554,900	12,260.00	6,803,074,000	貸付株式数	67,700株
コタ	205,600	1,565.00	321,764,000		
シーボン	38,200	1,698.00	64,863,600	貸付株式数	33,000株
ポーラ・オルビスHD	1,259,300	1,634.00	2,057,696,200	貸付株式数	981,700株
ノエビアホールディングス	218,900	5,860.00	1,282,754,000		
アジュバンホールディング	66,400	984.00	65,337,600	貸付株式数	55,000株
新日本製薬	140,300	1,515.00	212,554,500	貸付株式数	105,000株
エステー	189,800	1,550.00	294,190,000		
アグロカネショウ	98,300	1,244.00	122,285,200	貸付株式数	11,000株 (1,500株)
コニシ	447,500	1,562.00	698,995,000	貸付株式数	900株
長谷川香料	508,700	2,939.00	1,495,069,300	貸付株式数	400株
星光PMC	166,800	528.00	88,070,400		
小林製薬	826,900	8,830.00	7,301,527,000	貸付株式数	239,100株
荒川化学工業	208,000	981.00	204,048,000	貸付株式数	11,000株

メック	202,100	2,256.00	455,937,600	貸付株式数	39,600株
日本高純度化学	69,500	2,253.00	156,583,500	貸付株式数	1,000株
タカラバイオ	772,200	1,984.00	1,532,044,800		
J C U	302,700	3,420.00	1,035,234,000		
新田ゼラチン	168,400	611.00	102,892,400	貸付株式数	5,900株
O A T アグリオ	121,800	1,548.00	188,546,400		
デクセリアルズ	768,300	3,545.00	2,723,623,500	貸付株式数	56,600株
アース製薬	242,500	5,400.00	1,309,500,000	貸付株式数	8,500株
北興化学	247,100	918.00	226,837,800		
大成ラミック	77,500	2,674.00	207,235,000		
クミアイ化学	1,098,000	1,048.00	1,150,704,000		
日本農薬	525,700	651.00	342,230,700		
富士興産	72,100	1,065.00	76,786,500		
ニチレキ	319,200	1,324.00	422,620,800	貸付株式数	100株
ユシロ化学	140,200	901.00	126,320,200	貸付株式数	1,600株
ビーピー・カストロール	105,300	1,110.00	116,883,000		
富士石油	644,500	304.00	195,928,000		
M O R E S C O	97,700	1,220.00	119,194,000		
出光興産	3,001,500	3,180.00	9,544,770,000		
E N E O S ホールディングス	44,385,300	499.40	22,166,018,820		
コスモエネルギーH L D G S	1,164,800	3,405.00	3,966,144,000	貸付株式数	117,300株
テスホールディングス	257,500	1,188.00	305,910,000	貸付株式数	225,000株
インフロニアHD	3,221,600	940.00	3,028,304,000		
横浜ゴム	1,397,800	1,919.00	2,682,378,200		
T O Y O T I R E	1,411,700	1,750.00	2,470,475,000		
ブリヂストン	7,845,200	4,966.00	38,959,263,200		
住友ゴム	2,409,500	1,215.00	2,927,542,500		
藤倉コンポジット	236,100	859.00	202,809,900	貸付株式数	180,200株
オカモト	136,400	3,835.00	523,094,000		
アキレス	189,100	1,357.00	256,608,700	貸付株式数	3,300株
フ コ ク	129,200	950.00	122,740,000		
ニッタ	277,200	2,746.00	761,191,200	貸付株式数	200株
クリエートメディック	88,600	982.00	87,005,200	貸付株式数	5,100株
住友理工	571,700	584.00	333,872,800		
三ツ星ベルト	358,400	2,840.00	1,017,856,000		
バンドー化学	475,900	937.00	445,918,300		
A G C	2,500,100	4,760.00	11,900,476,000		
日本板硝子	1,334,000	388.00	517,592,000	貸付株式数	51,200株
石塚硝子	46,500	1,604.00	74,586,000	貸付株式数	33,000株
有沢製作所	400,400	1,000.00	400,400,000		

日本山村硝子	102,100	689.00	70,346,900	貸付株式数	300株
日本電気硝子	1,094,000	2,640.00	2,888,160,000	貸付株式数	282,600株
オハラ	116,700	1,167.00	136,188,900	貸付株式数	102,000株 (11,700株)
住友大阪セメント	440,300	3,550.00	1,563,065,000	貸付株式数	242,300株
太平洋セメント	1,676,000	1,961.00	3,286,636,000		
リソルホールディングス	30,600	4,570.00	139,842,000	貸付株式数	25,000株
日本ヒュ - ム	241,800	649.00	156,928,200		
日本コンクリ - ト	529,400	263.00	139,232,200	貸付株式数	6,000株
三谷セキサン	120,300	4,185.00	503,455,500		
アジアパイルHD	418,800	466.00	195,160,800	貸付株式数	2,300株
東海カーボン	2,266,700	1,033.00	2,341,501,100		
日本カーボン	151,900	4,000.00	607,600,000	貸付株式数	100株
東洋炭素	173,200	2,895.00	501,414,000	貸付株式数	43,800株
ノリタケ	149,700	4,155.00	622,003,500	貸付株式数	400株
TOTO	1,783,300	4,570.00	8,149,681,000		
日本碍子	2,905,800	1,842.00	5,352,483,600		
日本特殊陶業	2,057,300	2,422.00	4,982,780,600		
ダントーホールディングス	192,600	290.00	55,854,000	貸付株式数	168,000株
MARUWA	102,000	15,130.00	1,543,260,000		
品川リフラクトリーズ	69,200	3,530.00	244,276,000		
黒崎播磨	50,200	4,310.00	216,362,000		
ヨータイ	187,700	1,456.00	273,291,200		
東京窯業	291,500	271.00	78,996,500	貸付株式数	124,000株
ニッカトー	122,400	450.00	55,080,000	貸付株式数	96,000株
フジミインコーポレーテッド	236,500	5,480.00	1,296,020,000		
クニミネ工業	92,700	919.00	85,191,300	貸付株式数	5,800株
エーアンドエーマテリアル	49,900	858.00	42,814,200	貸付株式数	42,300株
ニチアス	621,100	2,311.00	1,435,362,100		
日本製鉄	12,187,300	1,930.00	23,521,489,000		
神戸製鋼所	5,082,900	617.00	3,136,149,300		
中山製鋼所	404,500	426.00	172,317,000		
合同製鐵	141,500	1,363.00	192,864,500	貸付株式数	4,100株
JFEホールディングス	6,754,100	1,468.00	9,915,018,800	貸付株式数	382,000株
東京製鐵	852,400	1,456.00	1,241,094,400		
共英製鋼	287,800	1,381.00	397,451,800		
大和工業	476,500	4,360.00	2,077,540,000		
東京鐵鋼	120,200	1,241.00	149,168,200	貸付株式数	73,600株
大阪製鐵	155,000	1,430.00	221,650,000	貸付株式数	1,700株
淀川製鋼所	319,000	2,325.00	741,675,000	貸付株式数	50,400株

丸一鋼管	846,500	2,851.00	2,413,371,500	
モリ工業	71,200	2,399.00	170,808,800	
大同特殊鋼	398,100	3,590.00	1,429,179,000	貸付株式数 5,900株
日本高周波	107,800	319.00	34,388,200	貸付株式数 1,400株
日本冶金工	198,600	2,156.00	428,181,600	
山陽特殊製鋼	249,500	1,882.00	469,559,000	
愛知製鋼	164,100	2,064.00	338,702,400	貸付株式数 700株
日立金属	3,143,000	2,041.00	6,414,863,000	
日本金属	73,700	1,187.00	87,481,900	貸付株式数 51,000株
大平洋金属	179,500	2,366.00	424,697,000	
新日本電工	1,614,200	347.00	560,127,400	
栗本鉄工所	120,100	1,641.00	197,084,100	貸付株式数 1,500株
虹 技	37,000	988.00	36,556,000	貸付株式数 500株
日本鑄鉄管	30,100	994.00	29,919,400	貸付株式数 6,200株
日本製鋼所	749,400	3,080.00	2,308,152,000	
三菱製鋼	187,300	939.00	175,874,700	貸付株式数 100株
日亜鋼業	331,900	254.00	84,302,600	
日本精線	45,900	4,385.00	201,271,500	貸付株式数 38,900株
エンビプロHD	193,200	764.00	147,604,800	貸付株式数 172,500株 (1,000株)
大紀アルミニウム	359,700	1,191.00	428,402,700	貸付株式数 80,400株
日本軽金属HD	738,200	1,528.00	1,127,969,600	
三井金属	787,500	3,095.00	2,437,312,500	
東邦亜鉛	149,500	2,163.00	323,368,500	貸付株式数 23,500株
三菱マテリアル	1,686,200	1,926.00	3,247,621,200	
住友鉱山	3,196,700	4,043.00	12,924,258,100	
DOWAホールディングス	681,400	4,500.00	3,066,300,000	貸付株式数 5,400株
古河機金	444,600	1,201.00	533,964,600	
エス・サイエンス	1,296,900	27.00	35,016,300	貸付株式数 835,100株
大阪チタニウム	337,100	2,850.00	960,735,000	貸付株式数 303,300株
東邦チタニウム	522,400	2,223.00	1,161,295,200	貸付株式数 458,000株
UACJ	398,500	2,087.00	831,669,500	貸付株式数 1,800株
CKサンエツ	54,900	4,070.00	223,443,000	貸付株式数 50,900株 (500株)
古河電工	841,700	2,264.00	1,905,608,800	
住友電工	10,181,900	1,457.50	14,840,119,250	
フジクラ	3,252,300	736.00	2,393,692,800	
昭和電線HLDGS	254,100	1,578.00	400,969,800	
東京特殊電線	37,500	2,273.00	85,237,500	貸付株式数 26,500株
タツタ電線	514,200	459.00	236,017,800	

カナレ電気	43,500	1,537.00	66,859,500	貸付株式数	38,000株
平河ヒューテック	161,600	1,058.00	170,972,800	貸付株式数	124,700株
リョービ	299,000	1,024.00	306,176,000		
アーレステイ	310,500	367.00	113,953,500	貸付株式数	1,800株
アサヒHD	1,168,300	2,053.00	2,398,519,900		
東洋製罐グループHD	1,486,700	1,410.00	2,096,247,000		
ホッカンホールディングス	135,800	1,223.00	166,083,400	貸付株式数	103,600株
コロナ	141,200	834.00	117,760,800	貸付株式数	2,600株
横河ブリッジHLDGS	417,500	1,939.00	809,532,500		
駒井ハルテック	45,600	1,677.00	76,471,200		
高田機工	24,600	2,426.00	59,679,600	貸付株式数	17,000株
三和ホールディングス	2,750,700	1,315.00	3,617,170,500		
文化シヤッタ-	859,900	1,007.00	865,919,300	貸付株式数	577,000株
三協立山	346,900	544.00	188,713,600		
アルインコ	192,600	853.00	164,287,800	貸付株式数	158,200株
東洋シヤッタ-	64,400	590.00	37,996,000		
LIXIL	4,592,100	2,696.00	12,380,301,600		
日本ファイルコン	182,600	491.00	89,656,600	貸付株式数	41,600株
ノーリツ	465,500	1,474.00	686,147,000		
長府製作所	296,600	1,760.00	522,016,000		
リンナイ	504,100	9,790.00	4,935,139,000		
ユニプレス	483,700	814.00	393,731,800	貸付株式数	62,400株
ダイニチ工業	139,800	649.00	90,730,200	貸付株式数	4,300株
日東精工	329,700	482.00	158,915,400		
三洋工業	35,400	1,707.00	60,427,800	貸付株式数	3,100株
岡部	451,600	611.00	275,927,600		
ジーテクト	322,000	1,261.00	406,042,000		
東プレ	445,400	1,032.00	459,652,800	貸付株式数	24,200株
高周波熱錬	449,700	648.00	291,405,600	貸付株式数	2,100株
東京製綱	179,000	900.00	161,100,000	貸付株式数	2,200株
サンコール	249,400	604.00	150,637,600		
モリテックスチル	227,200	278.00	63,161,600	貸付株式数	174,700株
パイオラックス	383,400	1,946.00	746,096,400		
エイチワン	260,000	599.00	155,740,000	貸付株式数	4,800株
日本発条	2,459,200	847.00	2,082,942,400		
中央発條	140,500	690.00	96,945,000	貸付株式数	2,900株
アドバネクス	38,000	1,156.00	43,928,000	貸付株式数	31,400株
三浦工業	1,147,800	3,155.00	3,621,309,000		
タクマ	836,500	1,316.00	1,100,834,000		
テクノプロ・ホールディング	1,688,300	3,055.00	5,157,756,500	貸付株式数	871,000株

アトラグループ	62,700	195.00	12,226,500	貸付株式数	54,000株
インターワークス	80,800	367.00	29,653,600	貸付株式数	7,600株
アイ・アールジャパンHD	130,900	2,229.00	291,776,100	貸付株式数	35,800株
K e e P e r 技研	181,500	3,450.00	626,175,000	貸付株式数	159,000株
ファーストロジック	43,500	771.00	33,538,500	貸付株式数	29,000株
三機サービス	49,100	990.00	48,609,000	貸付株式数	42,100株
G u n o s y	155,500	705.00	109,627,500	貸付株式数	139,800株
デザインワン・ジャパン	83,400	183.00	15,262,200	貸付株式数	58,000株
イー・ガーディアン	95,400	2,905.00	277,137,000	貸付株式数	100株
リブセンス	154,900	182.00	28,191,800	貸付株式数	135,000株 (53,200株)
ジャパンマテリアル	867,000	1,880.00	1,629,960,000		
ベクトル	395,300	1,007.00	398,067,100	貸付株式数	334,000株
ウチヤマホールディングス	138,700	293.00	40,639,100	貸付株式数	121,000株
チャームケアコーポレーション	209,600	1,008.00	211,276,800	貸付株式数	35,000株
キャリアリンク	103,800	2,006.00	208,222,800	貸付株式数	5,600株
I B J	230,700	761.00	175,562,700	貸付株式数	173,100株
アサンテ	124,600	1,514.00	188,644,400	貸付株式数	91,100株
バリューHR	243,600	1,336.00	325,449,600	貸付株式数	183,400株
M & A キャピタルパートナー	232,300	3,485.00	809,565,500	貸付株式数	45,000株
ライドオンエクスプレスHD	109,500	1,228.00	134,466,000	貸付株式数	87,000株
E R I ホールディングス	79,000	1,168.00	92,272,000	貸付株式数	63,000株
アビスト	43,800	2,723.00	119,267,400	貸付株式数	17,200株
シグマクシス・ホールディング	339,400	1,215.00	412,371,000	貸付株式数	200株
ウィルグループ	209,300	1,199.00	250,950,700	貸付株式数	200株
エスクローAJ	293,100	162.00	47,482,200	貸付株式数	191,600株
メドピア	197,700	2,157.00	426,438,900	貸付株式数	171,000株
レアジョブ	53,200	563.00	29,951,600	貸付株式数	46,700株
リクルートホールディングス	20,195,900	4,242.00	85,671,007,800		
エラン	388,600	1,077.00	418,522,200		
ツガミ	595,300	1,153.00	686,380,900	貸付株式数	64,900株
オークマ	278,200	5,100.00	1,418,820,000		
芝浦機械	329,500	2,673.00	880,753,500		
アマダ	4,605,300	1,016.00	4,678,984,800		
アイダエンジニア	636,100	925.00	588,392,500		
滝澤鉄工所	84,400	1,193.00	100,689,200	貸付株式数	2,900株
F U J I	1,165,000	2,034.00	2,369,610,000		
牧野フライス	296,400	4,350.00	1,289,340,000		
オーエスジー	1,271,800	1,635.00	2,079,393,000		
ダイジェット	30,100	906.00	27,270,600	貸付株式数	100株

旭ダイヤモンド	714,300	627.00	447,866,100	貸付株式数	25,800株
D M G 森精機	1,615,200	1,691.00	2,731,303,200	貸付株式数	1,009,000株
ソディック	635,200	807.00	512,606,400		
ディスコ	429,900	30,700.00	13,197,930,000	貸付株式数	20,100株
日東工器	139,900	1,508.00	210,969,200		
日進工具	229,200	1,260.00	288,792,000	貸付株式数	5,300株
パンチ工業	246,400	444.00	109,401,600		
富士ダイス	146,700	660.00	96,822,000	貸付株式数	3,200株
土木管理総合試験	130,400	323.00	42,119,200	貸付株式数	52,700株
ネットマーケティング	137,700	558.00	76,836,600	貸付株式数	120,000株
日本郵政	30,802,100	973.60	29,988,924,560		
ベルシステム24HLDGS	405,200	1,413.00	572,547,600	貸付株式数	100株
鎌倉新書	321,000	548.00	175,908,000	貸付株式数	288,900株 (18,300株)
S M N	61,400	585.00	35,919,000	貸付株式数	53,000株
一蔵	35,400	459.00	16,248,600	貸付株式数	31,000株
グローバルキッズCOMP	43,100	676.00	29,135,600	貸付株式数	33,800株
エアトリ	162,400	2,329.00	378,229,600	貸付株式数	148,000株
アトラエ	197,500	1,685.00	332,787,500		
ストライク	124,200	3,560.00	442,152,000	貸付株式数	17,700株
ソラスト	693,100	747.00	517,745,700		
セラク	89,400	1,264.00	113,001,600	貸付株式数	78,000株
インソース	312,300	2,397.00	748,583,100	貸付株式数	235,400株
豊田自動織機	2,089,300	8,110.00	16,944,223,000		
豊和工業	149,500	911.00	136,194,500	貸付株式数	85,300株
ニデックオーケーケー	110,100	1,171.00	128,927,100	貸付株式数	94,000株
石川製作所	76,100	1,611.00	122,597,100	貸付株式数	51,000株 (5,300株)
東洋機械金属	189,800	558.00	105,908,400		
津田駒工業	50,000	507.00	25,350,000	貸付株式数	45,000株
エンシュウ	64,100	896.00	57,433,600	貸付株式数	31,800株
島精機製作所	426,400	2,147.00	915,480,800	貸付株式数	22,500株
オプトラン	365,700	1,856.00	678,739,200		
N C ホールディングス	81,600	2,091.00	170,625,600	貸付株式数	800株
イワキポンプ	185,600	960.00	178,176,000		
フリーー	259,200	1,172.00	303,782,400		
ヤマシンフィルタ	457,900	330.00	151,107,000	貸付株式数	410,000株
日阪製作所	299,800	828.00	248,234,400		
やまびこ	485,000	1,152.00	558,720,000	貸付株式数	8,500株

野村マイクロ・サイエンス	93,000	3,485.00	324,105,000	貸付株式数 79,700株 (1,000株)
平田機工	128,200	4,410.00	565,362,000	貸付株式数 12,000株
ペガサスミシン製造	295,600	584.00	172,630,400	貸付株式数 700株
マルマエ	119,700	1,924.00	230,302,800	貸付株式数 107,600株 (100株)
タツモ	149,400	1,227.00	183,313,800	貸付株式数 75,500株
ナプテスコ	1,552,700	3,355.00	5,209,308,500	貸付株式数 970,000株
三井海洋開発	310,000	1,131.00	350,610,000	貸付株式数 300株
レオン自動機	312,000	1,283.00	400,296,000	
S M C	864,100	62,240.00	53,781,584,000	
ホソカワミクロン	189,600	2,684.00	508,886,400	
ユニオンツール	108,900	3,205.00	349,024,500	貸付株式数 2,000株
オイレス工業	377,000	1,572.00	592,644,000	貸付株式数 265,000株
日精エーエスピー	112,600	3,550.00	399,730,000	貸付株式数 4,200株
サト - ホールディングス	383,800	1,888.00	724,614,400	
技研製作所	258,200	3,110.00	803,002,000	
日本エアーテック	134,200	1,012.00	135,810,400	貸付株式数 83,400株
カワタ	85,900	967.00	83,065,300	
日精樹脂工業	183,500	894.00	164,049,000	
オカダアイヨン	92,100	1,473.00	135,663,300	貸付株式数 64,000株
ワイエイシーホールディングス	116,300	1,510.00	175,613,000	貸付株式数 33,500株
小松製作所	13,371,500	2,936.00	39,258,724,000	
住友重機械	1,576,300	2,914.00	4,593,338,200	
日立建機	1,182,400	2,865.00	3,387,576,000	
日工	366,400	622.00	227,900,800	
巴工業	106,200	2,346.00	249,145,200	貸付株式数 80,500株
井関農機	231,500	1,193.00	276,179,500	貸付株式数 700株
T O W A	252,100	1,738.00	438,149,800	貸付株式数 179,400株
丸山製作所	46,100	1,543.00	71,132,300	貸付株式数 7,400株
北川鉄工所	115,100	1,393.00	160,334,300	貸付株式数 800株
シンニッタン	352,700	219.00	77,241,300	貸付株式数 40,800株
ローツェ	145,500	8,560.00	1,245,480,000	貸付株式数 11,200株
タカキタ	89,800	510.00	45,798,000	貸付株式数 82,000株
クボタ	14,292,900	2,095.00	29,943,625,500	
荏原実業	135,400	2,228.00	301,671,200	貸付株式数 600株
東洋エンジニア	388,500	625.00	242,812,500	貸付株式数 299,400株
三菱化工機	87,000	2,026.00	176,262,000	貸付株式数 1,500株
月島機械	459,800	879.00	404,164,200	
帝国電機製作所	187,100	1,648.00	308,340,800	

東京機械	120,100	849.00	101,964,900	
新東工業	549,900	686.00	377,231,400	貸付株式数 4,000株
渋谷工業	231,900	2,415.00	560,038,500	貸付株式数 100株
アイチ コーポレーション	419,900	828.00	347,677,200	
小森コーポレーション	677,400	800.00	541,920,000	貸付株式数 600株
鶴見製作所	207,700	1,905.00	395,668,500	
住友精密	43,900	2,847.00	124,983,300	
日本ギア工業	104,700	291.00	30,467,700	貸付株式数 91,000株
酒井重工業	48,100	2,843.00	136,748,300	
荏原製作所	1,180,400	5,080.00	5,996,432,000	貸付株式数 659,200株
石井鉄工所	34,600	2,964.00	102,554,400	貸付株式数 1,100株
西島製作所	239,900	1,293.00	310,190,700	
北越工業	248,600	873.00	217,027,800	
ダイキン工業	3,222,000	22,040.00	71,012,880,000	
オルガノ	85,000	8,490.00	721,650,000	
ト - ヨ - カネツ	102,500	2,674.00	274,085,000	
栗田工業	1,490,300	4,990.00	7,436,597,000	貸付株式数 55,600株
椿本チエイン	385,700	3,065.00	1,182,170,500	貸付株式数 400株
大同工業	120,200	797.00	95,799,400	
日 機 装	748,500	821.00	614,518,500	
木村化工機	226,300	739.00	167,235,700	貸付株式数 164,000株
レイズネクスト	397,000	1,143.00	453,771,000	貸付株式数 100株
アネスト岩田	458,900	899.00	412,551,100	
ダイフク	1,391,700	8,180.00	11,384,106,000	
サムコ	81,100	2,669.00	216,455,900	貸付株式数 63,200株
加藤製作所	140,000	804.00	112,560,000	貸付株式数 3,800株
油研工業	45,500	1,730.00	78,715,000	貸付株式数 2,400株
タダノ	1,423,500	937.00	1,333,819,500	貸付株式数 2,700株
フジテック	905,700	3,035.00	2,748,799,500	貸付株式数 625,800株
C K D	746,500	1,765.00	1,317,572,500	
キトー	231,200	2,621.00	605,975,200	
平和	823,000	2,029.00	1,669,867,000	
理想科学工業	247,200	2,253.00	556,941,600	貸付株式数 1,800株
S A N K Y O	607,600	4,125.00	2,506,350,000	
日本金銭機械	298,800	665.00	198,702,000	貸付株式数 38,100株
マースグループH L D G S	187,500	1,609.00	301,687,500	
フクシマガリレイ	182,100	3,590.00	653,739,000	貸付株式数 700株
オーイズミ	103,100	403.00	41,549,300	
ダイコク電機	135,500	1,233.00	167,071,500	貸付株式数 1,200株
竹内製作所	448,900	2,351.00	1,055,363,900	

ア マ ノ	772,500	2,442.00	1,886,445,000	
J U K I	410,600	714.00	293,168,400	
サンデン	409,300	239.00	97,822,700	貸付株式数 310,500株
ジャノメ	250,300	705.00	176,461,500	貸付株式数 42,200株
ブラザー工業	3,362,900	2,371.00	7,973,435,900	
マックス	348,400	1,631.00	568,240,400	
モリタホールディングス	472,900	1,313.00	620,917,700	
グローリー	699,500	2,078.00	1,453,561,000	
新晃工業	274,100	1,657.00	454,183,700	貸付株式数 3,000株
大和冷機工業	426,400	1,099.00	468,613,600	貸付株式数 1,100株
セガサミーホールディングス	2,651,800	2,224.00	5,897,603,200	貸付株式数 4,000株
日本ピストンリング	107,500	1,255.00	134,912,500	
リ ケ ン	107,400	2,316.00	248,738,400	
T P R	321,400	1,199.00	385,358,600	
ツバキ・ナカシマ	647,500	911.00	589,872,500	
ホシザキ	1,725,100	4,045.00	6,978,029,500	
大豊工業	240,400	656.00	157,702,400	貸付株式数 5,700株
日本精工	5,049,800	723.00	3,651,005,400	
N T N	5,365,200	249.00	1,335,934,800	貸付株式数 118,700株
ジェイテクト	2,515,700	1,009.00	2,538,341,300	
不 二 越	205,300	3,600.00	739,080,000	貸付株式数 12,300株
ミネベアミツミ	4,694,700	2,329.00	10,933,956,300	
日本トムソン	673,200	515.00	346,698,000	
T H K	1,665,200	2,675.00	4,454,410,000	
ユーシン精機	228,400	703.00	160,565,200	
前澤給装工業	189,500	902.00	170,929,000	貸付株式数 100株
イーグル工業	319,000	972.00	310,068,000	
前澤工業	176,700	612.00	108,140,400	貸付株式数 5,900株
日本ピラ - 工業	252,300	2,620.00	661,026,000	
キッツ	828,200	658.00	544,955,600	
日 立	14,190,400	6,490.00	92,095,696,000	
東 芝	5,158,100	5,408.00	27,895,004,800	貸付株式数 800株
三菱電機	27,536,400	1,454.50	40,051,693,800	
富士電機	1,641,000	5,450.00	8,943,450,000	
東洋電機製造	98,100	891.00	87,407,100	貸付株式数 24,100株
安川電機	2,931,600	4,545.00	13,324,122,000	
シンフォニア テクノロジー	300,100	1,366.00	409,936,600	貸付株式数 5,300株
明 電 舎	417,100	2,038.00	850,049,800	
オリジン	67,600	1,166.00	78,821,600	
山洋電気	107,000	5,220.00	558,540,000	貸付株式数 12,000株

デンヨー	209,300	1,612.00	337,391,600		
P H Cホールディングス	455,500	1,438.00	655,009,000	貸付株式数	319,500株
ベйкаレントコンサルティング	199,200	39,000.00	7,768,800,000		
ORCHESTRA HLDGS	53,900	2,521.00	135,881,900	貸付株式数	33,800株
アイモバイル	140,200	1,376.00	192,915,200	貸付株式数	126,000株
キャリアインデックス	96,100	542.00	52,086,200		
M S - J a p a n	114,600	903.00	103,483,800	貸付株式数	96,200株
船場	56,400	665.00	37,506,000	貸付株式数	500株
ジャパンエレベーターSHD	894,200	1,561.00	1,395,846,200		
フルテック	39,400	1,324.00	52,165,600	貸付株式数	33,000株
グリーンズ	106,300	561.00	59,634,300	貸付株式数	38,400株
ツナググループHLDGS	79,100	315.00	24,916,500	貸付株式数	40,700株
GAMEWITH	83,900	482.00	40,439,800	貸付株式数	70,000株
M S & CONSULTING	41,000	652.00	26,732,000	貸付株式数	33,000株
ウェルビー	184,800	689.00	127,327,200	貸付株式数	162,000株
エル・ティー・エス	36,000	3,650.00	131,400,000	貸付株式数	23,900株
ミダックホールディングス	127,300	2,745.00	349,438,500	貸付株式数	111,800株
日総工産	220,000	581.00	127,820,000	貸付株式数	191,600株
キュービーネットHLDGS	130,400	1,333.00	173,823,200		
R P Aホールディングス	397,200	334.00	132,664,800	貸付株式数	357,400株
三桜工業	408,000	675.00	275,400,000	貸付株式数	44,200株
マキタ	3,334,700	3,469.00	11,568,074,300		
東芝テック	316,700	4,335.00	1,372,894,500		
芝浦メカトロニクス	52,400	9,290.00	486,796,000	貸付株式数	3,900株
マブチモーター	675,800	3,630.00	2,453,154,000	貸付株式数	538,000株
日本電産	6,554,700	8,997.00	58,972,635,900		
ユーエムシーエレクトロニクス	103,700	437.00	45,316,900	貸付株式数	58,700株
トレックス・セミコンダクター	127,100	2,476.00	314,699,600	貸付株式数	89,000株
東光高岳	164,100	1,747.00	286,682,700	貸付株式数	7,600株
ダブル・スコープ	849,300	1,673.00	1,420,878,900	貸付株式数	449,600株 (1,000株)
宮越ホールディングス	110,100	912.00	100,411,200	貸付株式数	96,000株
ダイヘン	273,000	4,000.00	1,092,000,000		
ヤーマン	481,200	1,700.00	818,040,000	貸付株式数	432,900株
J V Cケンウッド	2,403,600	178.00	427,840,800		
ミマキエンジニアリング	264,100	539.00	142,349,900		
I - P E X	137,300	1,322.00	181,510,600	貸付株式数	14,900株
日新電機	691,500	1,424.00	984,696,000		
大崎電気	496,600	504.00	250,286,400	貸付株式数	15,000株
オムロン	2,456,000	7,001.00	17,194,456,000		

日東工業	370,600	2,338.00	866,462,800		
I D E C	365,200	2,779.00	1,014,890,800		
正興電機製作所	80,900	1,104.00	89,313,600	貸付株式数	73,000株
不二電機工業	55,000	1,151.00	63,305,000	貸付株式数	49,500株 (1,500株)
ジーエス・ユアサ コーポ	886,100	2,203.00	1,952,078,300	貸付株式数	30,200株
サクサホールディングス	68,700	1,258.00	86,424,600	貸付株式数	5,000株
メルコホールディングス	82,200	3,505.00	288,111,000	貸付株式数	55,000株
テクノメディカ	66,300	1,580.00	104,754,000	貸付株式数	55,400株
ダイヤモンドエレクトリックHD	82,200	1,620.00	133,164,000	貸付株式数	67,200株
日本電気	3,499,100	5,500.00	19,245,050,000		
富士通	2,654,800	17,890.00	47,494,372,000		
沖電気	1,118,600	743.00	831,119,800		
岩崎通信機	120,200	797.00	95,799,400	貸付株式数	7,700株
電気興業	142,000	2,518.00	357,556,000		
サンケン電気	252,900	4,715.00	1,192,423,500		
ナカヨ	48,400	1,131.00	54,740,400	貸付株式数	4,200株
アイホン	133,600	1,790.00	239,144,000	貸付株式数	5,900株
ルネサスエレクトロニクス	16,065,300	1,231.00	19,776,384,300	貸付株式数	11,787,500株
セイコーエプソン	3,294,700	1,931.00	6,362,065,700	貸付株式数	13,200株
ワコム	2,261,100	845.00	1,910,629,500	貸付株式数	1,338,000株
アルバック	587,600	4,755.00	2,794,038,000		
アクセル	113,100	784.00	88,670,400	貸付株式数	87,700株
E I Z O	201,200	3,785.00	761,542,000		
ジャパンディスプレイ	10,075,600	66.00	664,989,600	貸付株式数	6,245,300株
日本信号	626,000	992.00	620,992,000		
京三製作所	575,500	438.00	252,069,000		
能美防災	334,400	1,869.00	624,993,600		
ホーチキ	184,600	1,282.00	236,657,200		
星和電機	121,400	463.00	56,208,200	貸付株式数	54,200株
エレコム	675,700	1,595.00	1,077,741,500		
パナソニック ホールディング	31,469,200	1,125.00	35,402,850,000		
シャープ	2,802,500	1,058.00	2,965,045,000	貸付株式数	2,522,200株
アンリツ	1,900,600	1,529.00	2,906,017,400	貸付株式数	347,900株
富士通ゼネラル	801,000	2,741.00	2,195,541,000	貸付株式数	400株
ソニーグループ	18,482,800	11,145.00	205,990,806,000		
T D K	4,273,500	4,050.00	17,307,675,000		
帝国通信工業	130,200	1,400.00	182,280,000	貸付株式数	700株
タムラ製作所	1,061,500	584.00	619,916,000	貸付株式数	532,900株
アルプスアルパイン	2,410,400	1,308.00	3,152,803,200	貸付株式数	61,400株

池上通信機	86,800	606.00	52,600,800	貸付株式数	37,700株
日本電波工業	295,200	1,082.00	319,406,400	貸付株式数	167,700株
鈴木	145,300	763.00	110,863,900	貸付株式数	2,300株
メイコー	319,100	3,100.00	989,210,000	貸付株式数	20,600株
日本トリム	55,600	2,427.00	134,941,200		
ローランド ディー . ジー .	174,000	3,120.00	542,880,000	貸付株式数	19,300株
フオスタ - 電機	274,800	743.00	204,176,400	貸付株式数	100株
S M K	68,800	2,123.00	146,062,400	貸付株式数	2,500株
ヨコオ	196,500	1,968.00	386,712,000	貸付株式数	400株
ティアック	450,600	119.00	53,621,400	貸付株式数	224,100株
ホシデン	652,000	1,234.00	804,568,000	貸付株式数	6,800株
ヒロセ電機	409,300	18,270.00	7,477,911,000		
日本航空電子	591,700	2,042.00	1,208,251,400		
T O A	316,300	777.00	245,765,100		
マクセル	537,400	1,314.00	706,143,600	貸付株式数	400株
古野電気	350,600	1,046.00	366,727,600	貸付株式数	6,700株
ユニデンホールディングス	64,700	4,095.00	264,946,500		
スミダコーポレーション	276,500	789.00	218,158,500	貸付株式数	66,300株
アイコム	95,300	2,475.00	235,867,500	貸付株式数	87,000株
リオン	101,500	2,413.00	244,919,500	貸付株式数	300株
本多通信工業	228,900	526.00	120,401,400	貸付株式数	198,000株 (10,000株)
横河電機	2,706,600	2,209.00	5,978,879,400		
新電元工業	104,200	3,390.00	353,238,000	貸付株式数	5,200株
アズビル	1,711,200	3,785.00	6,476,892,000		
東亜ディーケーケー	145,800	901.00	131,365,800	貸付株式数	76,800株
日本光電工業	1,138,000	2,980.00	3,391,240,000		
チ ノ ー	93,400	1,651.00	154,203,400	貸付株式数	56,000株
共和電業	282,700	305.00	86,223,500	貸付株式数	22,300株
日本電子材料	138,700	1,625.00	225,387,500	貸付株式数	100,000株
堀場製作所	506,600	6,040.00	3,059,864,000	貸付株式数	238,900株
アドバンテスト	2,193,500	7,280.00	15,968,680,000		
小野測器	111,900	424.00	47,445,600	貸付株式数	5,300株
エスベック	217,700	1,786.00	388,812,200		
キーエンス	2,673,500	49,630.00	132,685,805,000		
日置電機	141,400	6,440.00	910,616,000	貸付株式数	4,000株
シスメックス	2,112,600	8,839.00	18,673,271,400	貸付株式数	12,500株
日本マイクロニクス	440,000	1,219.00	536,360,000	貸付株式数	34,400株
メガチップス	261,600	3,020.00	790,032,000	貸付株式数	700株
O B A R A G R O U P	114,800	2,995.00	343,826,000	貸付株式数	61,200株

I M A G I C A G R O U P	204,800	760.00	155,648,000	貸付株式数	164,400株
澤藤電機	35,600	1,453.00	51,726,800	貸付株式数	32,000株
デンソー	5,774,300	7,280.00	42,036,904,000		
原田工業	139,600	892.00	124,523,200	貸付株式数	119,600株
コーセル	327,100	832.00	272,147,200		
イリソ電子工業	247,600	3,205.00	793,558,000	貸付株式数	74,400株
オプテックスグループ	484,100	2,056.00	995,309,600		
千代田インテグレ	111,700	1,969.00	219,937,300		
レーザーテック	1,209,300	17,480.00	21,138,564,000		
スタンレー電気	1,901,800	2,296.00	4,366,532,800		
岩崎電気	93,200	2,597.00	242,040,400		
ウシオ電機	1,396,000	1,717.00	2,396,932,000		
岡谷電機	209,800	252.00	52,869,600	貸付株式数	184,000株
ヘリオステクノH	250,700	325.00	81,477,500	貸付株式数	108,000株
エノモト	81,800	1,444.00	118,119,200	貸付株式数	34,500株
日本セラミック	274,300	2,030.00	556,829,000		
遠藤照明	135,500	760.00	102,980,000		
古河電池	210,200	1,210.00	254,342,000	貸付株式数	178,700株 (2,000株)
双信電機	141,100	502.00	70,832,200	貸付株式数	116,800株
山一電機	192,200	1,654.00	317,898,800		
函 研	192,000	3,210.00	616,320,000	貸付株式数	78,700株
日本電子	566,300	5,420.00	3,069,346,000	貸付株式数	12,100株
カ シ オ	1,825,000	1,257.00	2,294,025,000	貸付株式数	616,000株
ファナック	2,589,400	21,905.00	56,720,807,000		
日本シイエムケイ	520,000	432.00	224,640,000	貸付株式数	420,400株
エンプラス	72,800	3,050.00	222,040,000	貸付株式数	49,100株
大真空	364,700	885.00	322,759,500	貸付株式数	288,000株
ロ ー ム	1,226,700	9,450.00	11,592,315,000	貸付株式数	27,300株
浜松ホトニクス	1,965,400	5,600.00	11,006,240,000		
三井ハイテック	253,000	8,420.00	2,130,260,000	貸付株式数	173,800株
新光電気工業	866,900	3,495.00	3,029,815,500	貸付株式数	24,400株
京 セ ラ	4,150,800	6,929.00	28,760,893,200		
協栄産業	29,200	1,323.00	38,631,600	貸付株式数	1,800株
太陽誘電	1,312,000	4,565.00	5,989,280,000		
村田製作所	8,047,700	7,616.00	61,291,283,200		
双葉電子工業	505,300	682.00	344,614,600	貸付株式数	4,400株
日東電工	1,783,400	8,550.00	15,248,070,000		
北陸電気工業	110,300	1,087.00	119,896,100		
東海理化電機	777,000	1,460.00	1,134,420,000	貸付株式数	28,200株

ニチコン	786,000	1,200.00	943,200,000	
日本ケミコン	279,100	1,661.00	463,585,100	
K O A	408,000	1,584.00	646,272,000	貸付株式数 400株
三井E & S H D	1,085,700	334.00	362,623,800	貸付株式数 25,300株
日立造船	2,338,700	843.00	1,971,524,100	
三菱重工業	4,326,600	5,014.00	21,693,572,400	
川崎重工業	1,999,500	2,491.00	4,980,754,500	
I H I	1,842,000	3,535.00	6,511,470,000	
名村造船所	759,600	414.00	314,474,400	貸付株式数 569,700株 (64,000株)
サノヤスホールディングス	334,300	123.00	41,118,900	貸付株式数 187,000株
スプリックス	96,100	986.00	94,754,600	貸付株式数 79,000株
マネジメントソリューションズ	138,500	2,789.00	386,276,500	貸付株式数 124,500株
プロレド・パートナーズ	61,600	495.00	30,492,000	貸付株式数 54,000株
A N D F A C T O R Y	81,300	398.00	32,357,400	貸付株式数 67,000株
テノ・ホールディングス	34,300	687.00	23,564,100	貸付株式数 30,000株
フロンティア・マネジメント	73,500	1,247.00	91,654,500	
ピアラ	45,700	690.00	31,533,000	貸付株式数 33,000株 (500株)
コプロ・ホールディングス	55,000	837.00	46,035,000	貸付株式数 46,400株
ギークス	48,500	979.00	47,481,500	貸付株式数 43,500株
カーブスホールディングス	773,800	675.00	522,315,000	貸付株式数 575,600株
フォーラムエンジニアリング	171,400	925.00	158,545,000	貸付株式数 25,600株
F A S T F I T N E S S J A P	51,500	1,386.00	71,379,000	貸付株式数 46,200株
日本車輛	94,100	2,046.00	192,528,600	貸付株式数 500株
三菱ロジスネクスト	390,700	869.00	339,518,300	
近畿車輛	44,400	1,100.00	48,840,000	貸付株式数 4,700株
一家ホールディングス	61,000	563.00	34,343,000	貸付株式数 21,900株
フルサト・マルカHD	257,500	2,582.00	664,865,000	貸付株式数 32,000株
ヤマエグループHD	162,800	1,362.00	221,733,600	貸付株式数 2,100株
藤久ホールディングス	90,200	658.00	59,351,600	貸付株式数 43,200株
F P G	979,100	903.00	884,127,300	貸付株式数 199,700株
島根銀行	92,600	500.00	46,300,000	貸付株式数 400株
じもとホールディングス	192,600	563.00	108,433,800	
全国保証	694,000	4,310.00	2,991,140,000	貸付株式数 380,200株
めぶきフィナンシャルG	11,971,100	262.00	3,136,428,200	
ジャパンインベストメントA	225,100	1,235.00	277,998,500	貸付株式数 149,500株 (5,000株)
東京きらぼしFG	336,900	2,184.00	735,789,600	
九州フィナンシャルG	5,093,600	383.00	1,950,848,800	

かんぽ生命保険	2,929,100	2,171.00	6,359,076,100	貸付株式数	161,600株
ゆうちょ銀行	6,869,400	1,061.00	7,288,433,400	貸付株式数	6,025,000株
あんしん保証	115,400	260.00	30,004,000	貸付株式数	49,600株
富山第一銀行	647,300	410.00	265,393,000		
コンコルディア・フィナンシャル	14,404,600	451.00	6,496,474,600		
ジェイリース	98,100	1,980.00	194,238,000	貸付株式数	71,000株
西日本フィナンシャルHD	1,527,600	727.00	1,110,565,200		
イントラスト	123,000	552.00	67,896,000		
日本モーゲージサービス	161,700	968.00	156,525,600	貸付株式数	118,900株
C a s a	102,700	879.00	90,273,300	貸付株式数	92,300株
アルヒ	429,700	1,005.00	431,848,500	貸付株式数	284,300株
プレミアグループ	147,400	4,345.00	640,453,000		
日産自動車	34,796,600	504.20	17,544,445,720	貸付株式数	18,264,500株
いすゞ自動車	8,545,900	1,451.00	12,400,100,900		
トヨタ自動車	134,504,400	2,111.00	283,938,788,400		
日野自動車	3,684,400	711.00	2,619,608,400		
三菱自動車工業	10,921,000	420.00	4,586,820,000	貸付株式数	9,828,900株
エフテック	188,400	498.00	93,823,200		
レシップホールディングス	117,000	538.00	62,946,000	貸付株式数	6,900株
G M B	53,200	698.00	37,133,600	貸付株式数	1,700株
ファルテック	51,600	600.00	30,960,000		
武蔵精密工業	657,800	1,389.00	913,684,200	貸付株式数	237,100株
日産車体	432,200	578.00	249,811,600	貸付株式数	366,400株
新明和工業	769,500	1,059.00	814,900,500		
極東開発工業	469,900	1,413.00	663,968,700		
トピー工業	220,400	1,305.00	287,622,000		
ティラド	80,000	2,526.00	202,080,000		
曙ブレーキ	1,619,300	157.00	254,230,100	貸付株式数	1,074,900株
タチエス	484,400	1,068.00	517,339,200	貸付株式数	44,200株
N O K	1,110,300	1,086.00	1,205,785,800		
フタバ産業	656,400	375.00	246,150,000		
K Y B	259,400	3,030.00	785,982,000		
市光工業	352,800	371.00	130,888,800		
大同メタル工業	565,800	522.00	295,347,600		
プレス工業	1,322,000	395.00	522,190,000		
ミクニ	343,100	349.00	119,741,900	貸付株式数	400株
太平洋工業	561,500	1,049.00	589,013,500	貸付株式数	300株
河西工業	361,900	259.00	93,732,100	貸付株式数	129,900株
アイシン	2,159,400	4,165.00	8,993,901,000		
マ ッ ダ	8,681,300	1,020.00	8,854,926,000	貸付株式数	431,200株

今仙電機製作所	193,400	590.00	114,106,000	貸付株式数	1,500株
本田技研	21,571,200	3,250.00	70,106,400,000		
スズキ	5,848,600	4,240.00	24,798,064,000		
S U B A R U	7,750,300	2,253.00	17,461,425,900		
安永	118,700	711.00	84,395,700	貸付株式数	99,800株
ヤマハ発動機	3,849,600	2,505.00	9,643,248,000	貸付株式数	536,200株
小糸製作所	1,472,900	4,460.00	6,569,134,000		
T B K	296,400	334.00	98,997,600	貸付株式数	7,400株
エクセディ	445,200	1,709.00	760,846,800		
ミツバ	459,300	401.00	184,179,300		
豊田合成	834,000	2,147.00	1,790,598,000		
愛三工業	462,300	703.00	324,996,900		
盟和産業	41,800	1,000.00	41,800,000	貸付株式数	28,700株
日本プラスト	213,200	450.00	95,940,000		
ヨロズ	229,400	876.00	200,954,400	貸付株式数	164,700株
エフ・シー・シー	482,400	1,335.00	644,004,000	貸付株式数	98,500株
新家工業	61,000	1,457.00	88,877,000		
シマノ	1,085,600	23,450.00	25,457,320,000	貸付株式数	105,800株
テイ・エス テック	1,245,900	1,432.00	1,784,128,800		
33FG	233,600	1,401.00	327,273,600		
第四北越フィナンシャルG	410,400	2,477.00	1,016,560,800	貸付株式数	40,600株
ひろぎんHLDGS	3,719,900	617.00	2,295,178,300	貸付株式数	70,400株
マーキュリアホールディングス	157,300	607.00	95,481,100	貸付株式数	88,200株
おきなわFG	245,900	2,137.00	525,488,300	貸付株式数	184,000株
ダイレクトマーケティングミクス	286,000	1,829.00	523,094,000	貸付株式数	63,400株
ポピンズ	65,300	1,824.00	119,107,200	貸付株式数	30,900株
LITALICO	228,300	2,332.00	532,395,600	貸付株式数	25,200株
十六FG	338,700	2,347.00	794,928,900		
北國FHD	240,200	4,555.00	1,094,111,000		
ネットプロHD	883,600	527.00	465,657,200	貸付株式数	774,900株
プロクレアホールディングス	295,300	1,992.00	588,237,600	貸付株式数	90,600株
ジャムコ	172,400	1,111.00	191,536,400	貸付株式数	155,000株 (25,900株)
小野建	259,700	1,400.00	363,580,000	貸付株式数	2,600株
はるやまHLDGS	136,000	442.00	60,112,000	貸付株式数	117,000株
南陽	54,600	1,784.00	97,406,400	貸付株式数	1,100株
ノジマ	470,000	2,840.00	1,334,800,000		
佐島電機	181,000	1,061.00	192,041,000	貸付株式数	100株
カップ・クリエイト	407,500	1,443.00	588,022,500	貸付株式数	366,600株 (12,000株)

エコートレーディング	60,900	576.00	35,078,400	貸付株式数	46,000株
伯東	169,700	2,500.00	424,250,000	貸付株式数	100株
コンドーテック	217,100	1,000.00	217,100,000	貸付株式数	188,000株
中山福	152,900	315.00	48,163,500	貸付株式数	129,000株
ライトオン	217,000	735.00	159,495,000	貸付株式数	24,900株
ナガイレーベン	350,300	1,960.00	686,588,000	貸付株式数	100株
三菱食品	279,100	3,670.00	1,024,297,000		
良品計画	3,343,700	1,268.00	4,239,811,600		
パリミキホールディングス	359,400	271.00	97,397,400	貸付株式数	273,600株
松田産業	211,700	2,057.00	435,466,900		
第一興商	551,400	3,670.00	2,023,638,000		
メディパルHD	2,687,800	1,950.00	5,241,210,000		
アドヴァングループ	246,300	788.00	194,084,400	貸付株式数	18,300株
S P K	115,000	1,378.00	158,470,000	貸付株式数	1,100株
萩原電気HLDGS	99,200	1,956.00	194,035,200		
アルビス	84,800	2,222.00	188,425,600	貸付株式数	69,800株
アズワン	417,000	6,000.00	2,502,000,000		
スズデン	90,600	1,928.00	174,676,800	貸付株式数	400株
尾家産業	67,900	833.00	56,560,700	貸付株式数	63,000株
シモジマ	177,900	986.00	175,409,400	貸付株式数	150,900株
ドウシシャ	273,800	1,548.00	423,842,400	貸付株式数	221,400株
小津産業	63,800	1,873.00	119,497,400	貸付株式数	54,600株
コナカ	313,800	339.00	106,378,200	貸付株式数	211,600株
高速	153,800	1,485.00	228,393,000	貸付株式数	22,300株
ハウス ローゼ	35,500	1,661.00	58,965,500	貸付株式数	31,900株
G - 7ホールディングス	322,900	1,451.00	468,527,900		
たけびし	98,700	1,471.00	145,187,700	貸付株式数	91,000株
イオン北海道	383,100	1,079.00	413,364,900	貸付株式数	97,900株
コジマ	499,700	642.00	320,807,400	貸付株式数	420,000株
ヒマラヤ	90,300	965.00	87,139,500	貸付株式数	80,700株
コーナン商事	413,100	3,670.00	1,516,077,000		
ネットワンシステムズ	1,067,800	3,225.00	3,443,655,000		
エコス	96,100	2,271.00	218,243,100	貸付株式数	87,000株
ワタミ	351,900	891.00	313,542,900	貸付株式数	174,800株 (5,000株)
マルシェ	94,000	451.00	42,394,000	貸付株式数	68,000株
リックス	59,400	1,937.00	115,057,800	貸付株式数	54,000株
システムソフト	854,900	106.00	90,619,400	貸付株式数	446,000株
パンパシフィックHD	5,810,900	2,132.00	12,388,838,800		
丸文	231,100	725.00	167,547,500		

西松屋チェーン	573,600	1,498.00	859,252,800	貸付株式数	516,200株
ゼンショーホールディングス	1,418,600	3,330.00	4,723,938,000	貸付株式数	163,100株
ハピネット	220,200	1,555.00	342,411,000		
幸楽苑ホールディングス	169,100	1,265.00	213,911,500	貸付株式数	131,000株
ハークスレイ	121,300	547.00	66,351,100	貸付株式数	3,300株
橋本総業HLDGS	51,300	1,945.00	99,778,500	貸付株式数	40,800株
日本ライフライン	860,800	940.00	809,152,000		
サイゼリヤ	431,000	2,624.00	1,130,944,000	貸付株式数	356,400株
タカショー	225,500	728.00	164,164,000	貸付株式数	144,900株
VTホールディングス	1,093,500	492.00	538,002,000		
アルゴグラフィックス	225,100	3,205.00	721,445,500		
魚力	80,400	2,450.00	196,980,000	貸付株式数	65,900株
IDOM	881,300	763.00	672,431,900	貸付株式数	49,400株
日本エム・ディ・エム	169,900	1,587.00	269,631,300	貸付株式数	1,800株
ポブラ	64,900	146.00	9,475,400	貸付株式数	60,000株
フジ・コーポレーション	153,800	1,243.00	191,173,400	貸付株式数	126,600株
ユナイテッドアローズ	304,400	1,827.00	556,138,800	貸付株式数	242,000株
進和	171,800	2,177.00	374,008,600	貸付株式数	115,000株
エスケイジャパン	70,100	460.00	32,246,000	貸付株式数	8,100株
ダイترون	112,500	1,799.00	202,387,500		
ハイデイ日高	419,400	2,066.00	866,480,400	貸付株式数	314,500株
シークス	369,300	937.00	346,034,100	貸付株式数	21,600株
YU-WA CREATION H	170,500	209.00	35,634,500	貸付株式数	900株
コロワイド	1,194,200	1,825.00	2,179,415,000	貸付株式数	716,500株 (22,900株)
ピーシーデポコーポ	337,400	308.00	103,919,200	貸付株式数	95,500株
田中商事	89,000	589.00	52,421,000	貸付株式数	8,300株
オーハシテクニカ	143,000	1,351.00	193,193,000	貸付株式数	1,600株
壺番屋	204,600	4,725.00	966,735,000	貸付株式数	113,600株
白銅	93,600	2,342.00	219,211,200	貸付株式数	17,500株
トップカルチャー	104,600	232.00	24,267,200	貸付株式数	3,200株
PLANT	66,800	643.00	42,952,400	貸付株式数	61,100株
スギホールディングス	580,000	6,120.00	3,549,600,000	貸付株式数	107,800株
ダイコー通産	34,200	1,139.00	38,953,800	貸付株式数	28,200株
薬王堂ホールディングス	144,800	2,070.00	299,736,000		
島津製作所	3,525,600	4,450.00	15,688,920,000		
JMS	226,400	541.00	122,482,400		
クボテック	63,400	253.00	16,040,200	貸付株式数	52,200株
長野計器	195,700	1,113.00	217,814,100		
ブイ・テクノロジ	129,100	2,827.00	364,965,700	貸付株式数	400株

スター精密	398,200	1,615.00	643,093,000		
東京計器	187,900	1,295.00	243,330,500	貸付株式数	132,000株
愛知時計	106,000	1,384.00	146,704,000		
インターアクション	147,700	1,841.00	271,915,700	貸付株式数	54,200株 (5,700株)
オーバル	263,700	343.00	90,449,100	貸付株式数	211,700株
東京精密	460,500	4,385.00	2,019,292,500		
マニー	1,077,300	1,436.00	1,547,002,800	貸付株式数	8,800株
ニコン	4,158,700	1,439.00	5,984,369,300		
トプコン	1,387,300	1,784.00	2,474,943,200		
オリンパス	14,282,200	2,705.50	38,640,492,100	貸付株式数	691,200株
理研計器	195,000	3,800.00	741,000,000	貸付株式数	32,200株
S C R E E Nホールディングス	465,400	9,000.00	4,188,600,000		
キヤノン電子	270,600	1,523.00	412,123,800	貸付株式数	2,700株
タムロン	206,000	2,582.00	531,892,000	貸付株式数	400株
H O Y A	5,696,100	12,200.00	69,492,420,000		
シード	137,700	512.00	70,502,400	貸付株式数	55,700株
ノーリツ鋼機	265,200	2,279.00	604,390,800	貸付株式数	39,800株
A & Dホロンホールディングス	331,600	889.00	294,792,400		
朝日インテック	3,234,700	2,388.00	7,724,463,600		
キヤノン	14,661,100	3,100.00	45,449,410,000	貸付株式数	6,350,800株
リコー	7,019,900	1,042.00	7,314,735,800	貸付株式数	22,100株
シチズン時計	2,879,500	529.00	1,523,255,500		
リズム	92,200	1,675.00	154,435,000		
大研医器	233,200	478.00	111,469,600		
メニコン	910,200	3,250.00	2,958,150,000	貸付株式数	15,700株
シンシア	31,400	430.00	13,502,000	貸付株式数	24,800株
中本パックス	82,400	1,576.00	129,862,400	貸付株式数	57,800株
スノーピーク	384,300	2,679.00	1,029,539,700	貸付株式数	314,400株 (6,100株)
パラマウントベッドHD	565,600	2,282.00	1,290,699,200		
トランザクション	188,600	1,139.00	214,815,400	貸付株式数	108,400株
粧美堂	73,800	400.00	29,520,000	貸付株式数	68,000株
ニホンフラッシュ	229,400	935.00	214,489,000	貸付株式数	57,700株
前田工織	265,900	2,916.00	775,364,400	貸付株式数	17,000株
永大産業	321,300	260.00	83,538,000	貸付株式数	5,300株
アートネイチャー	252,000	747.00	188,244,000		
バンダイナムコHLDGS	2,440,200	9,947.00	24,272,669,400		
アイフイスジャパン	75,100	627.00	47,087,700	貸付株式数	60,500株
共立印刷	404,200	143.00	57,800,600	貸付株式数	329,000株

SHOEI	258,300	5,360.00	1,384,488,000		
フランスベッドHLDGS	379,200	896.00	339,763,200	貸付株式数	1,900株
マーベラス	456,000	681.00	310,536,000		
パイロットコーポレーション	421,400	4,760.00	2,005,864,000		
萩原工業	177,500	1,118.00	198,445,000	貸付株式数	102,800株
エイベックス	499,600	1,435.00	716,926,000	貸付株式数	350,000株
フジシールインターナショナル	606,100	1,461.00	885,512,100		
タカラトミー	1,218,300	1,399.00	1,704,401,700		
広済堂ホールディングス	183,200	1,046.00	191,627,200	貸付株式数	11,600株
エステールホールディングス	63,000	631.00	39,753,000	貸付株式数	57,000株
レック	349,600	664.00	232,134,400	貸付株式数	26,300株
タカノ	100,800	824.00	83,059,200	貸付株式数	84,200株
三光合成	337,300	329.00	110,971,700	貸付株式数	50,100株
プロネクス	228,400	1,097.00	250,554,800		
ホクシン	207,800	146.00	30,338,800	貸付株式数	182,000株
ウッドワン	90,200	1,133.00	102,196,600	貸付株式数	200株
大建工業	149,000	1,871.00	278,779,000		
きもと	451,600	222.00	100,255,200	貸付株式数	12,900株
凸版印刷	3,844,000	2,190.00	8,418,360,000		
大日本印刷	3,196,600	2,819.00	9,011,215,400		
共同印刷	76,700	2,522.00	193,437,400	貸付株式数	19,000株
NISSHA	512,500	1,498.00	767,725,000	貸付株式数	100株
光村印刷	22,700	1,236.00	28,057,200	貸付株式数	20,200株
藤森工業	229,300	3,495.00	801,403,500		
ヴィア・ホールディングス	377,700	144.00	54,388,800	貸付株式数	276,000株
TAKARA & COMPANY	168,800	1,831.00	309,072,800	貸付株式数	103,900株
前澤化成工業	173,000	1,293.00	223,689,000	貸付株式数	120,700株
未来工業	105,600	1,492.00	157,555,200		
アシックス	2,261,200	2,581.00	5,836,157,200	貸付株式数	30,000株
ツツミ	73,600	1,980.00	145,728,000	貸付株式数	50,200株
ウェーブロックHLDGS	112,200	627.00	70,349,400	貸付株式数	88,700株 (4,500株)
ジェイ エス ピー	172,800	1,433.00	247,622,400	貸付株式数	145,500株
ニチハ	376,100	2,622.00	986,134,200		
ローランド	205,600	4,015.00	825,484,000		
エフピコ	542,200	2,872.00	1,557,198,400		
小松ウオール工業	89,900	1,968.00	176,923,200		
ヤマハ	1,715,700	5,630.00	9,659,391,000		
河合楽器	74,400	2,648.00	197,011,200	貸付株式数	1,800株
クリナップ	274,300	587.00	161,014,100		

ピジョン	1,783,000	1,933.00	3,446,539,000	貸付株式数	977,000株
天馬	231,700	2,275.00	527,117,500	貸付株式数	74,900株
兼松サステック	19,000	1,615.00	30,685,000	貸付株式数	16,000株
キングジム	216,000	895.00	193,320,000	貸付株式数	200,000株
象印マホービン	731,500	1,496.00	1,094,324,000	貸付株式数	15,500株
リンテック	561,600	2,303.00	1,293,364,800		
信越ポリマー	529,900	1,208.00	640,119,200	貸付株式数	1,400株
東リ	673,300	203.00	136,679,900		
イトーキ	543,700	373.00	202,800,100	貸付株式数	3,100株
任天堂	1,665,400	57,960.00	96,526,584,000		
三菱鉛筆	397,600	1,414.00	562,206,400	貸付株式数	2,300株
松風	98,400	1,692.00	166,492,800	貸付株式数	93,000株
タカラスタンダ - ド	474,200	1,282.00	607,924,400		
コクヨ	1,297,100	1,729.00	2,242,685,900	貸付株式数	493,300株
ナカバヤシ	237,300	503.00	119,361,900	貸付株式数	300株
ニフコ	984,800	3,205.00	3,156,284,000		
立川ブラインド	114,300	1,051.00	120,129,300	貸付株式数	104,000株
グローブライド	219,700	2,147.00	471,695,900		
オカムラ	829,700	1,228.00	1,018,871,600		
バルカー	239,500	2,582.00	618,389,000	貸付株式数	100株
MUTOHホールディングス	37,000	2,060.00	76,220,000	貸付株式数	31,000株
伊藤忠	17,421,500	3,803.00	66,253,964,500		
丸紅	25,173,800	1,183.50	29,793,192,300		
スクロール	447,300	929.00	415,541,700	貸付株式数	19,000株
高島	41,300	2,589.00	106,925,700		
ヨンドシーホールディングス	245,000	1,750.00	428,750,000	貸付株式数	72,100株
三陽商会	127,300	866.00	110,241,800	貸付株式数	4,900株
長瀬産業	1,329,000	1,887.00	2,507,823,000		
ナイガイ	97,900	287.00	28,097,300	貸付株式数	63,000株
蝶理	162,400	1,927.00	312,944,800		
豊田通商	2,594,600	4,375.00	11,351,375,000		
オンワードホールディングス	1,591,400	247.00	393,075,800	貸付株式数	83,900株
三共生興	371,900	506.00	188,181,400		
兼松	1,006,200	1,347.00	1,355,351,400		
美津濃	243,300	2,347.00	571,025,100	貸付株式数	300株
ツカモトコーポレーション	48,500	1,093.00	53,010,500	貸付株式数	5,700株
ルックホールディングス	92,000	1,602.00	147,384,000		
三井物産	21,062,100	2,851.50	60,058,578,150		
日本紙パルプ	137,700	3,885.00	534,964,500		
東京エレクトロン	1,872,200	43,550.00	81,534,310,000		

カメイ	309,800	1,057.00	327,458,600		
東都水産	14,700	4,545.00	66,811,500	貸付株式数	12,000株
OUGホールディングス	42,100	2,798.00	117,795,800	貸付株式数	16,600株
スターゼン	196,600	2,057.00	404,406,200	貸付株式数	11,000株
セイコーHD	417,300	2,862.00	1,194,312,600		
山 善	1,047,600	984.00	1,030,838,400	貸付株式数	51,300株
椿本興業	47,700	3,590.00	171,243,000		
住友商事	17,194,800	1,853.00	31,861,964,400		
B I P R O G Y	904,000	2,778.00	2,511,312,000		
内田洋行	114,700	5,040.00	578,088,000	貸付株式数	15,900株
三菱商事	19,053,500	3,885.00	74,022,847,500		
第一実業	111,800	3,350.00	374,530,000		
キヤノンマーケティングJPN	720,400	2,833.00	2,040,893,200	貸付株式数	288,600株
西華産業	124,300	1,622.00	201,614,600		
佐藤商事	199,600	1,090.00	217,564,000		
菱洋エレクトロ	171,900	2,269.00	390,041,100	貸付株式数	154,700株 (7,000株)
東京産業	236,300	710.00	167,773,000		
ユアサ商事	233,200	3,480.00	811,536,000		
神鋼商事	65,000	3,700.00	240,500,000		
トルク	154,000	197.00	30,338,000		
阪和興業	504,200	2,842.00	1,432,936,400	貸付株式数	9,400株
正栄食品	188,200	3,795.00	714,219,000	貸付株式数	137,000株 (2,600株)
カナデン	235,700	1,020.00	240,414,000	貸付株式数	199,000株
菱電商事	229,900	1,594.00	366,460,600	貸付株式数	174,000株
ニプロ	2,041,700	1,095.00	2,235,661,500		
岩谷産業	643,700	5,230.00	3,366,551,000		
ナイス	89,000	1,624.00	144,536,000	貸付株式数	100株
ニチモウ	34,700	2,335.00	81,024,500		
極東貿易	83,400	2,633.00	219,592,200	貸付株式数	50,600株
アステナホールディングス	373,500	450.00	168,075,000		
兼松エレクトロニクス	157,500	4,045.00	637,087,500		
三愛オブリ	650,300	1,019.00	662,655,700		
稲畑産業	581,400	2,278.00	1,324,429,200		
G S I クレオス	139,000	1,382.00	192,098,000	貸付株式数	101,000株
明和産業	267,900	712.00	190,744,800	貸付株式数	234,000株
クワザワホールディングス	103,300	444.00	45,865,200	貸付株式数	94,000株
キムラタン	1,620,900	22.00	35,659,800	貸付株式数	1,185,000株
ゴ-ルドウイン	478,200	7,810.00	3,734,742,000		

ユニ・チャーム	5,687,000	4,798.00	27,286,226,000	貸付株式数	420,000株
デサント	493,400	3,225.00	1,591,215,000	貸付株式数	7,300株
キング	136,300	509.00	69,376,700	貸付株式数	33,500株
ワキタ	524,300	1,187.00	622,344,100		
ヤマトインタ-ナショナル	214,500	281.00	60,274,500	貸付株式数	164,000株
東邦ホールディングス	788,700	2,053.00	1,619,201,100		
サンゲツ	705,000	1,574.00	1,109,670,000		
ミツウロコグループ	333,300	911.00	303,636,300	貸付株式数	8,900株
シナネンホールディングス	95,700	3,445.00	329,686,500	貸付株式数	3,500株
伊藤忠エネクス	642,300	1,043.00	669,918,900		
サンリオ	815,900	2,946.00	2,403,641,400	貸付株式数	254,900株
サンワテクノス	147,100	1,293.00	190,200,300		
リョーサン	297,600	2,142.00	637,459,200		
新光商事	383,000	882.00	337,806,000		
トーホー	111,100	1,297.00	144,096,700	貸付株式数	85,000株
三信電気	119,400	1,530.00	182,682,000		
東陽テクニカ	286,700	1,129.00	323,684,300	貸付株式数	7,400株
モスフードサービス	381,200	3,190.00	1,216,028,000	貸付株式数	247,000株
加賀電子	236,500	3,005.00	710,682,500		
三益半導体	227,500	2,031.00	462,052,500	貸付株式数	3,900株
都築電気	129,500	1,280.00	165,760,000		
ソーダニツカ	231,300	567.00	131,147,100		
立花エレテック	189,000	1,512.00	285,768,000	貸付株式数	6,400株
木曽路	386,300	2,175.00	840,202,500	貸付株式数	188,500株
S R Sホールディングス	417,800	857.00	358,054,600	貸付株式数	299,000株
千趣会	524,600	378.00	198,298,800	貸付株式数	412,000株 (30,000株)
タカキユー	201,600	90.00	18,144,000	貸付株式数	188,000株
リテールパートナーズ	384,500	1,165.00	447,942,500	貸付株式数	296,000株
ケーヨー	536,900	889.00	477,304,100	貸付株式数	182,500株
上新電機	282,100	1,915.00	540,221,500		
日本瓦斯	1,388,500	1,944.00	2,699,244,000	貸付株式数	208,700株
ロイヤルホールディングス	449,200	2,115.00	950,058,000	貸付株式数	324,800株
東天紅	21,200	910.00	19,292,000		
いなげや	287,800	1,275.00	366,945,000	貸付株式数	103,000株
チヨダ	247,400	778.00	192,477,200	貸付株式数	900株
ライフコーポレーション	226,400	2,664.00	603,129,600		
リンガーハット	334,300	2,363.00	789,950,900	貸付株式数	208,000株
MrMaxHD	362,800	614.00	222,759,200	貸付株式数	93,600株
テンアライド	284,000	305.00	86,620,000	貸付株式数	229,900株

A O K Iホールディングス	561,900	661.00	371,415,900	貸付株式数	97,600株
オークワ	414,500	855.00	354,397,500	貸付株式数	200株
コメリ	448,600	2,612.00	1,171,743,200		
青山商事	553,800	839.00	464,638,200	貸付株式数	1,400株
しまむら	338,100	12,350.00	4,175,535,000		
はせがわ	153,800	253.00	38,911,400	貸付株式数	3,900株
高島屋	1,954,100	1,337.00	2,612,631,700		
松屋	488,300	823.00	401,870,900	貸付株式数	11,500株
エイチ・ツー・オーリテイリング	1,261,500	953.00	1,202,209,500	貸付株式数	49,000株
近鉄百貨店	83,400	2,335.00	194,739,000	貸付株式数	63,800株
丸井グループ	2,102,400	2,232.00	4,692,556,800		
クレディセゾン	1,698,700	1,532.00	2,602,408,400		
アクシアルリテイリング	192,700	3,275.00	631,092,500	貸付株式数	5,000株
井筒屋	136,800	334.00	45,691,200	貸付株式数	90,000株
イオン	9,584,400	2,624.50	25,154,257,800	貸付株式数	1,335,900株
イズミ	459,600	3,020.00	1,387,992,000	貸付株式数	3,600株
フォーバル	101,700	874.00	88,885,800		
平和堂	433,300	1,962.00	850,134,600	貸付株式数	385,000株
フジ	636,400	2,193.00	1,395,625,200	貸付株式数	345,400株
ヤオコー	329,900	6,280.00	2,071,772,000	貸付株式数	223,000株
ゼビオホールディングス	395,100	900.00	355,590,000	貸付株式数	8,100株
ケーズホールディングス	2,473,300	1,360.00	3,363,688,000		
PALTAC	407,600	4,345.00	1,771,022,000		
三谷産業	452,700	311.00	140,789,700	貸付株式数	89,100株
OLYMPICグループ	128,500	639.00	82,111,500	貸付株式数	113,600株
日産東京販売HD	427,300	269.00	114,943,700		
新生銀行	1,898,400	1,972.00	3,743,644,800		
あおぞら銀行	1,625,200	2,678.00	4,352,285,600		
三菱UFJフィナンシャルG	170,332,700	724.60	123,423,074,420	貸付株式数	11,904,900株
りそなホールディングス	30,791,000	503.70	15,509,426,700		
三井住友トラストHD	4,813,000	4,198.00	20,204,974,000		
三井住友フィナンシャルG	18,884,200	4,064.00	76,745,388,800	貸付株式数	2,612,000株
千葉銀行	8,217,400	733.00	6,023,354,200		
群馬銀行	4,681,600	376.00	1,760,281,600		
武蔵野銀行	371,600	1,746.00	648,813,600		
千葉興業銀行	626,900	252.00	157,978,800		
筑波銀行	1,134,400	187.00	212,132,800		
七十七銀行	772,500	1,731.00	1,337,197,500		
秋田銀行	174,100	1,638.00	285,175,800		
山形銀行	267,900	888.00	237,895,200	貸付株式数	16,000株

岩手銀行	178,000	1,946.00	346,388,000	
東邦銀行	2,081,600	205.00	426,728,000	貸付株式数 91,500株
東北銀行	130,800	966.00	126,352,800	貸付株式数 8,900株
ふくおかフィナンシャルG	2,101,000	2,375.00	4,989,875,000	
静岡銀行	5,996,600	808.00	4,845,252,800	
スルガ銀行	2,551,800	369.00	941,614,200	貸付株式数 53,000株
八十二銀行	5,398,400	497.00	2,683,004,800	貸付株式数 28,100株
山梨中央銀行	292,700	1,156.00	338,361,200	
大垣共立銀行	498,300	1,726.00	860,065,800	
福井銀行	232,100	1,345.00	312,174,500	貸付株式数 7,700株
清水銀行	104,000	1,449.00	150,696,000	貸付株式数 200株
富山銀行	45,000	1,788.00	80,460,000	貸付株式数 40,300株 (16,500株)
滋賀銀行	474,300	2,651.00	1,257,369,300	
南都銀行	393,400	1,982.00	779,718,800	
百五銀行	2,444,100	323.00	789,444,300	
京都銀行	903,000	5,610.00	5,065,830,000	
紀陽銀行	863,200	1,369.00	1,181,720,800	貸付株式数 200株
ほくほくフィナンシャルG	1,651,300	828.00	1,367,276,400	貸付株式数 3,700株
山陰合同銀行	1,617,600	654.00	1,057,910,400	
中国銀行	2,047,500	976.00	1,998,360,000	
鳥取銀行	92,600	1,159.00	107,323,400	貸付株式数 200株
伊予銀行	3,262,500	651.00	2,123,887,500	
百十四銀行	267,900	1,649.00	441,767,100	
四国銀行	383,100	841.00	322,187,100	貸付株式数 108,500株 (9,200株)
阿波銀行	386,200	2,004.00	773,944,800	
大分銀行	156,300	1,848.00	288,842,400	
宮崎銀行	157,600	2,051.00	323,237,600	
佐賀銀行	153,200	1,468.00	224,897,600	
琉球銀行	631,800	784.00	495,331,200	
セブン銀行	8,642,300	258.00	2,229,713,400	
みずほフィナンシャルG	34,890,100	1,559.00	54,393,665,900	
高知銀行	91,500	693.00	63,409,500	貸付株式数 4,500株
山口フィナンシャルG	2,905,900	745.00	2,164,895,500	
芙蓉総合リース	249,600	7,720.00	1,926,912,000	
みずほリース	359,100	3,170.00	1,138,347,000	貸付株式数 2,500株
東京センチュリー	450,800	4,460.00	2,010,568,000	
SBIホールディングス	3,594,100	2,693.00	9,678,911,300	貸付株式数 254,800株
日本証券金融	1,143,300	850.00	971,805,000	貸付株式数 200株

アイフル	4,883,000	363.00	1,772,529,000	
日本アジア投資	229,200	241.00	55,237,200	貸付株式数 86,200株
長野銀行	89,100	1,260.00	112,266,000	貸付株式数 200株
名古屋銀行	178,000	3,050.00	542,900,000	
北洋銀行	3,655,500	226.00	826,143,000	
愛知銀行	90,300	5,240.00	473,172,000	
中京銀行	89,800	1,694.00	152,121,200	貸付株式数 200株
大光銀行	86,400	1,339.00	115,689,600	貸付株式数 3,700株
愛媛銀行	379,200	887.00	336,350,400	貸付株式数 200株
トマト銀行	88,300	1,002.00	88,476,600	
京葉銀行	1,214,100	460.00	558,486,000	貸付株式数 25,900株
栃木銀行	1,305,100	252.00	328,885,200	
北日本銀行	84,600	1,631.00	137,982,600	貸付株式数 9,100株
東和銀行	476,900	516.00	246,080,400	貸付株式数 600株
福島銀行	307,700	214.00	65,847,800	貸付株式数 13,800株
大東銀行	128,100	645.00	82,624,500	貸付株式数 2,400株
リコーリース	257,500	3,545.00	912,837,500	貸付株式数 144,300株 (48,500株)
イオンフィナンシャルサービス	1,583,100	1,261.00	1,996,289,100	
アコム	5,740,200	319.00	1,831,123,800	
ジャックス	289,100	3,375.00	975,712,500	
オリコ	7,872,100	127.00	999,756,700	
オリックス	17,289,300	2,265.00	39,160,264,500	
三菱HCキャピタル	9,406,200	616.00	5,794,219,200	
ジャフコグループ	1,006,800	1,683.00	1,694,444,400	
九州リースサービス	124,900	568.00	70,943,200	貸付株式数 114,900株
トモニホールディングス	2,099,600	309.00	648,776,400	貸付株式数 40,000株
大和証券G本社	18,688,800	617.60	11,542,202,880	
野村ホールディングス	44,430,400	506.00	22,481,782,400	
岡三証券グループ	2,098,000	345.00	723,810,000	貸付株式数 46,800株
丸三証券	864,500	485.00	419,282,500	貸付株式数 286,100株
東洋証券	880,300	202.00	177,820,600	貸付株式数 693,100株
東海東京HD	2,864,400	377.00	1,079,878,800	
光世証券	60,900	450.00	27,405,000	貸付株式数 51,500株
水戸証券	712,300	258.00	183,773,400	
いちよし証券	481,600	640.00	308,224,000	貸付株式数 4,800株
松井証券	1,425,000	801.00	1,141,425,000	
SOMPOホールディングス	4,140,400	5,923.00	24,523,589,200	
日本取引所グループ	6,778,700	2,091.00	14,174,261,700	
マネックスG	2,449,800	455.00	1,114,659,000	貸付株式数 2,093,700株

極東証券	330,300	686.00	226,585,800	貸付株式数	18,100株
岩井コスモホールディング	274,900	1,250.00	343,625,000		
アイザワ証券グループ	391,800	708.00	277,394,400	貸付株式数	2,700株
フィデアホール	265,800	1,288.00	342,350,400	貸付株式数	1,700株
池田泉州HD	3,088,800	197.00	608,493,600		
アニコムホールディングス	893,700	662.00	591,629,400	貸付株式数	9,100株
MS&AD	5,981,600	4,257.00	25,463,671,200		
マネーパートナーズGP	309,600	254.00	78,638,400		
スパークス・グループ	1,343,800	277.00	372,232,600	貸付株式数	224,600株
小林洋行	103,500	217.00	22,459,500	貸付株式数	2,000株
第一生命HLDGS	14,171,000	2,403.00	34,052,913,000		
東京海上HD	8,097,500	7,959.00	64,448,002,500		
アドバンテッジリスクマネ	142,600	444.00	63,314,400	貸付株式数	84,300株
イー・ギャランティ	432,300	2,200.00	951,060,000	貸付株式数	12,900株
アサックス	151,200	603.00	91,173,600	貸付株式数	127,000株
NECキャピタルソリューション	118,500	2,035.00	241,147,500		
T&Dホールディングス	6,474,500	1,595.00	10,326,827,500		
アドバンスクリエイト	139,600	960.00	134,016,000	貸付株式数	115,100株
三井不動産	11,355,600	2,848.00	32,340,748,800		
三菱地所	16,570,300	1,943.50	32,204,378,050		
平和不動産	462,800	3,910.00	1,809,548,000		
東京建物	2,490,800	1,930.00	4,807,244,000		
京阪神ビルディング	380,200	1,292.00	491,218,400	貸付株式数	200株
住友不動産	5,233,100	3,441.00	18,007,097,100		
太平洋興発	107,000	614.00	65,698,000	貸付株式数	5,600株
テーオーシー	436,400	776.00	338,646,400	貸付株式数	132,500株
東京楽天地	41,800	3,930.00	164,274,000	貸付株式数	38,000株
レオパレス21	3,017,400	245.00	739,263,000		
スターツコーポレーション	395,800	2,796.00	1,106,656,800		
フジ住宅	337,600	652.00	220,115,200	貸付株式数	500株
空港施設	291,100	533.00	155,156,300		
明和地所	136,900	620.00	84,878,000		
ゴールドクレスト	229,300	1,684.00	386,141,200		
リログループ	1,542,000	2,039.00	3,144,138,000		
エスリード	113,500	1,651.00	187,388,500	貸付株式数	700株
日神グループHLDGS	473,200	430.00	203,476,000	貸付株式数	363,000株
日本エスコン	541,700	765.00	414,400,500	貸付株式数	17,600株
タカラレーベン	1,219,300	352.00	429,193,600		
AVANTIA	136,500	803.00	109,609,500	貸付株式数	11,300株
イオンモール	1,459,100	1,645.00	2,400,219,500		

毎日コムネット	99,000	623.00	61,677,000	貸付株式数	89,000株
ファースト住建	108,500	1,100.00	119,350,000	貸付株式数	48,500株
ランド	15,839,700	10.00	158,397,000	貸付株式数	11,261,400株
カチタス	720,500	3,175.00	2,287,587,500	貸付株式数	55,300株
東祥	210,500	1,249.00	262,914,500	貸付株式数	142,200株
トーセイ	401,400	1,177.00	472,447,800	貸付株式数	176,300株
穴吹興産	63,500	2,081.00	132,143,500	貸付株式数	55,200株
サンフロンティア不動産	402,000	1,084.00	435,768,000		
FJネクストホールディングス	285,600	1,063.00	303,592,800	貸付株式数	232,600株
インテリックス	65,500	567.00	37,138,500	貸付株式数	10,000株
ランドビジネス	98,200	227.00	22,291,400	貸付株式数	1,100株
サンネクスタグループ	92,800	1,012.00	93,913,600	貸付株式数	81,000株
グランディハウス	197,500	534.00	105,465,000		
東武鉄道	2,690,600	2,974.00	8,001,844,400	貸付株式数	18,500株
相鉄ホールディングス	876,700	2,267.00	1,987,478,900		
東急	6,868,800	1,528.00	10,495,526,400		
京浜急行	3,283,900	1,380.00	4,531,782,000	貸付株式数	87,900株
小田急電鉄	3,713,200	1,791.00	6,650,341,200		
京王電鉄	1,295,200	4,800.00	6,216,960,000		
京成電鉄	1,737,200	3,430.00	5,958,596,000		
富士急行	301,600	3,905.00	1,177,748,000	貸付株式数	230,400株
新京成電鉄	68,200	2,781.00	189,664,200	貸付株式数	200株
東日本旅客鉄道	4,500,400	6,594.00	29,675,637,600		
西日本旅客鉄道	3,129,100	4,688.00	14,669,220,800		
東海旅客鉄道	2,075,600	14,860.00	30,843,416,000		
西武ホールディングス	3,555,600	1,286.00	4,572,501,600	貸付株式数	95,600株
鴻池運輸	417,400	1,250.00	521,750,000		
西日本鉄道	708,800	2,770.00	1,963,376,000	貸付株式数	24,100株
ハマキョウレックス	191,500	3,010.00	576,415,000		
サカイ引越センター	135,800	4,630.00	628,754,000	貸付株式数	19,200株
近鉄グループHLDGS	2,619,900	4,075.00	10,676,092,500		
阪急阪神HLDGS	3,261,100	3,595.00	11,723,654,500	貸付株式数	96,200株
南海電鉄	1,168,700	2,480.00	2,898,376,000	貸付株式数	257,600株
京阪ホールディングス	1,088,600	3,145.00	3,423,647,000	貸付株式数	22,000株
神戸電鉄	66,500	3,185.00	211,802,500	貸付株式数	58,000株
名古屋鉄道	2,702,600	2,012.00	5,437,631,200		
山陽電鉄	199,300	2,116.00	421,718,800	貸付株式数	129,100株
アルプス物流	195,200	1,111.00	216,867,200		
トランコム	78,100	7,240.00	565,444,000	貸付株式数	15,900株
ヤマトホールディングス	3,915,400	2,257.00	8,837,057,800		

山 九	678,900	3,965.00	2,691,838,500	貸付株式数	2,200株
日 新	204,200	1,593.00	325,290,600		
丸 運	132,800	233.00	30,942,400	貸付株式数	124,000株
丸全昭和運輸	188,700	3,185.00	601,009,500		
センコーグループHLDGS	1,294,800	898.00	1,162,730,400	貸付株式数	136,900株
トナミホールディングス	53,700	3,600.00	193,320,000		
ニッコンホールディングス	843,200	2,219.00	1,871,060,800		
日石輸送	30,400	2,442.00	74,236,800	貸付株式数	3,100株
福山通運	357,600	3,090.00	1,104,984,000	貸付株式数	400株
セイノーホールディングス	1,522,000	1,118.00	1,701,596,000	貸付株式数	26,500株
エスライン	76,300	832.00	63,481,600	貸付株式数	69,000株
神奈川中央交通	69,300	3,350.00	232,155,000	貸付株式数	57,100株
日立物流	539,200	8,580.00	4,626,336,000		
丸和運輸機関	472,200	1,397.00	659,663,400	貸付株式数	392,900株
C & F ロジホールディングス	235,200	1,098.00	258,249,600		
日本郵船	2,336,500	9,340.00	21,822,910,000		
商船三井	4,309,400	3,130.00	13,488,422,000	貸付株式数	247,500株
川崎汽船	860,600	7,930.00	6,824,558,000	貸付株式数	754,000株
NSユニテッド海運	131,900	3,700.00	488,030,000	貸付株式数	95,800株
明治海運	263,800	900.00	237,420,000	貸付株式数	236,800株
飯野海運	1,097,300	678.00	743,969,400		
共栄タンカー	49,100	944.00	46,350,400	貸付株式数	43,000株
九州旅客鉄道	1,873,200	2,678.00	5,016,429,600		
SGホールディングス	4,693,000	2,423.00	11,371,139,000		
NIPPON EXPRESS	830,000	7,520.00	6,241,600,000		
日本航空	6,006,400	2,243.00	13,472,355,200		
ANAホールディングス	6,654,200	2,422.50	16,119,799,500		
ビーウィズ	75,400	1,385.00	104,429,000	貸付株式数	67,700株
パスコ	52,900	1,309.00	69,246,100		
TREホールディングス	530,200	1,696.00	899,219,200	貸付株式数	8,000株
人・夢・技術グループ	112,300	2,392.00	268,621,600	貸付株式数	1,400株
西本WISMETTAC HD	65,800	3,840.00	252,672,000	貸付株式数	600株
シルバーライフ	59,400	1,374.00	81,615,600	貸付株式数	52,000株 (14,300株)
ヤマシタヘルスケアHLDGS	25,700	1,802.00	46,311,400	貸付株式数	19,800株
GENKY DRUGSTORES	127,800	3,330.00	425,574,000	貸付株式数	114,900株
コア商事HLDGS	181,700	703.00	127,735,100	貸付株式数	150,000株
国際紙パルプ商事	536,600	480.00	257,568,000		
ナルミヤ・インターナショナル	65,000	864.00	56,160,000	貸付株式数	56,000株
ブックオフGHD	169,500	1,004.00	170,178,000	貸付株式数	122,700株

ギフトホールディングス	45,700	2,152.00	98,346,400	貸付株式数	41,000株
三菱倉庫	675,600	3,340.00	2,256,504,000		
三井倉庫HOLD	273,500	2,903.00	793,970,500		
住友倉庫	820,600	2,014.00	1,652,688,400	貸付株式数	186,000株
渋沢倉庫	139,500	2,114.00	294,903,000		
ヤマタネ	124,800	1,568.00	195,686,400	貸付株式数	57,000株
東陽倉庫	396,300	292.00	115,719,600	貸付株式数	3,500株
乾汽船	167,300	1,768.00	295,786,400	貸付株式数	53,600株
日本トランスシティ	492,200	488.00	240,193,600		
ケイヒン	48,000	1,354.00	64,992,000	貸付株式数	3,700株
中央倉庫	144,200	972.00	140,162,400	貸付株式数	134,000株
川西倉庫	51,100	1,051.00	53,706,100	貸付株式数	43,000株
安田倉庫	187,600	919.00	172,404,400		
ファイズホールディングス	59,600	702.00	41,839,200	貸付株式数	39,200株
東洋埠頭	78,000	1,278.00	99,684,000		
上組	1,327,000	2,703.00	3,586,881,000		
サンリツ	71,600	701.00	50,191,600	貸付株式数	1,200株
キムラユニティー	145,400	769.00	111,812,600	貸付株式数	6,600株
キューソー流通システム	139,500	1,126.00	157,077,000	貸付株式数	115,300株
近鉄エクスプレス	527,700	4,165.00	2,197,870,500		
東海運	159,100	283.00	45,025,300	貸付株式数	133,000株
エーアイティー	175,300	1,475.00	258,567,500	貸付株式数	27,100株
内外トランスライン	107,900	1,831.00	197,564,900	貸付株式数	82,100株
ショーエイコーポ	79,200	582.00	46,094,400	貸付株式数	62,300株
日本コンセプト	89,000	1,403.00	124,867,000		
TBSホールディングス	1,414,600	1,680.00	2,376,528,000		
日本テレビHLD S	2,416,600	1,218.00	2,943,418,800	貸付株式数	400株
朝日放送グループHD	229,800	645.00	148,221,000	貸付株式数	206,400株
テレビ朝日HD	695,900	1,477.00	1,027,844,300	貸付株式数	3,200株
スカパーJ S A T H D	2,451,800	535.00	1,311,713,000		
テレビ東京HD	178,200	1,935.00	344,817,000	貸付株式数	400株
日本BS放送	97,900	1,050.00	102,795,000	貸付株式数	85,000株
ビジョン	460,700	1,031.00	474,981,700		
スマートバリュー	65,900	490.00	32,291,000	貸付株式数	54,000株
USEN-NEXT HLDGS	220,000	2,190.00	481,800,000	貸付株式数	197,100株
ワイヤレスゲート	118,600	286.00	33,919,600	貸付株式数	85,000株 (2,000株)
コネクシオ	204,800	1,328.00	271,974,400		
日本通信	2,407,400	201.00	483,887,400	貸付株式数	1,354,100株
クロップス	52,800	912.00	48,153,600		

日本電信電話	32,451,200	3,830.00	124,288,096,000	貸付株式数	656,100株
KDDI	21,106,800	4,293.00	90,611,492,400		
ソフトバンク	43,851,300	1,525.00	66,873,232,500		
光通信	333,800	13,930.00	4,649,834,000		
エムティーアイ	224,300	483.00	108,336,900	貸付株式数	16,400株
GMOインターネット	1,014,000	2,611.00	2,647,554,000	貸付株式数	2,400株
ファイバーゲート	132,200	918.00	121,359,600	貸付株式数	114,000株 (14,000株)
アйдママーケティングコミュ	62,000	294.00	18,228,000	貸付株式数	51,600株
KADOKAWA	1,558,700	3,085.00	4,808,589,500		
学研ホールディングス	408,900	927.00	379,050,300	貸付株式数	18,200株
ゼンリン	472,500	921.00	435,172,500	貸付株式数	16,400株
昭文社ホールディングス	116,700	366.00	42,712,200	貸付株式数	64,300株
インプレスホールディングス	239,500	213.00	51,013,500	貸付株式数	70,000株
東京電力HD	22,080,900	619.00	13,668,077,100	貸付株式数	11,682,900株
中部電力	8,332,300	1,378.00	11,481,909,400		
関西電力	10,318,700	1,375.00	14,188,212,500		
中国電力	4,255,700	893.00	3,800,340,100		
北陸電力	2,504,700	542.00	1,357,547,400	貸付株式数	105,200株
東北電力	6,449,100	741.00	4,778,783,100		
四国電力	2,452,200	795.00	1,949,499,000		
九州電力	5,646,700	879.00	4,963,449,300	貸付株式数	10,900株
北海道電力	2,563,800	512.00	1,312,665,600		
沖縄電力	625,700	1,298.00	812,158,600	貸付株式数	16,800株
電源開発	2,179,900	2,253.00	4,911,314,700		
エフオン	178,500	563.00	100,495,500	貸付株式数	100株
イーレックス	380,000	2,356.00	895,280,000	貸付株式数	216,200株
レノバ	578,500	2,629.00	1,520,876,500	貸付株式数	500,500株
東京瓦斯	5,251,400	2,510.00	13,181,014,000		
大阪瓦斯	4,961,900	2,408.00	11,948,255,200		
東邦瓦斯	1,157,100	2,979.00	3,447,000,900		
北海道瓦斯	146,400	1,578.00	231,019,200		
広島ガス	515,800	320.00	165,056,000	貸付株式数	3,700株
西部ガスHLDGS	281,000	1,838.00	516,478,000		
静岡ガス	698,000	916.00	639,368,000	貸付株式数	11,900株
メタウォーター	306,200	2,003.00	613,318,600	貸付株式数	600株
アイネット	134,000	1,235.00	165,490,000		
松竹	166,100	11,940.00	1,983,234,000	貸付株式数	7,500株
東宝	1,708,200	4,915.00	8,395,803,000		

エイチ・アイ・エス	585,100	1,966.00	1,150,306,600	貸付株式数 530,000株 (30,000株)
東映	81,200	18,460.00	1,498,952,000	貸付株式数 5,000株
ラックランド	85,000	2,920.00	248,200,000	貸付株式数 74,000株
NTTデータ	7,708,200	1,954.00	15,061,822,800	
共立メンテナンス	503,100	4,615.00	2,321,806,500	貸付株式数 316,500株
イチネンホールディングス	288,900	1,234.00	356,502,600	
建設技術研究所	142,800	2,608.00	372,422,400	
スペース	182,900	884.00	161,683,600	貸付株式数 2,100株
アインホールディングス	357,000	7,490.00	2,673,930,000	
燦ホールディングス	122,700	1,799.00	220,737,300	
ピー・シー・エー	169,400	1,232.00	208,700,800	貸付株式数 140,000株
スバル興業	17,100	8,550.00	146,205,000	貸付株式数 15,000株
東京テアトル	102,800	1,211.00	124,490,800	貸付株式数 59,000株
タナベ経営	108,400	665.00	72,086,000	貸付株式数 500株
ビジネスB太田昭和	96,200	1,447.00	139,201,400	
ナガワ	78,700	7,780.00	612,286,000	貸付株式数 71,600株
東京都競馬	210,700	4,035.00	850,174,500	
常磐興産	96,900	1,252.00	121,318,800	貸付株式数 63,600株
カナモト	461,400	1,933.00	891,886,200	貸付株式数 2,400株
DTS	539,300	3,245.00	1,750,028,500	
スクウェア・エニックス・HD	1,346,800	6,050.00	8,148,140,000	
シーイーシー	309,900	1,184.00	366,921,600	
カプコン	2,729,500	3,670.00	10,017,265,000	
西尾レントオール	233,900	2,779.00	650,008,100	貸付株式数 400株
アイ・エス・ピー	135,400	1,000.00	135,400,000	貸付株式数 12,800株
アゴーラホスピタリティーG	1,548,400	22.00	34,064,800	貸付株式数 16,400株
日本空港ビルデング	938,400	5,070.00	4,757,688,000	貸付株式数 145,000株
トランス・コスモス	357,600	3,470.00	1,240,872,000	貸付株式数 66,400株
乃村工藝社	1,208,200	893.00	1,078,922,600	貸付株式数 100株
ジャステック	167,600	1,165.00	195,254,000	貸付株式数 24,800株
SCSK	2,004,000	2,380.00	4,769,520,000	
藤田観光	123,100	2,642.00	325,230,200	貸付株式数 90,200株 (1,000株)
KNT-CTホールディングス	175,400	1,414.00	248,015,600	貸付株式数 153,000株
日本管財	301,700	2,582.00	778,989,400	貸付株式数 178,800株
トーカイ	222,700	1,669.00	371,686,300	
白洋舎	29,500	1,290.00	38,055,000	貸付株式数 27,000株
セコム	2,778,100	8,657.00	24,050,011,700	
日本システムウエア	109,300	2,322.00	253,794,600	

セントラル警備保障	135,800	2,826.00	383,770,800	貸付株式数	119,000株
アイネス	248,700	1,622.00	403,391,400	貸付株式数	2,100株
丹青社	532,400	806.00	429,114,400		
メイテック	1,003,700	2,307.00	2,315,535,900		
T K C	440,800	3,360.00	1,481,088,000	貸付株式数	500株
富士ソフト	277,800	8,060.00	2,239,068,000	貸付株式数	248,400株
応用地質	268,600	1,693.00	454,739,800	貸付株式数	400株
船井総研ホールディング	529,100	2,256.00	1,193,649,600		
N S D	906,800	2,512.00	2,277,881,600	貸付株式数	87,100株
進学会ホールディングス	91,800	321.00	29,467,800	貸付株式数	80,000株
丸紅建材リース	25,100	1,852.00	46,485,200		
オ オ バ	176,400	740.00	130,536,000	貸付株式数	139,000株
コナミグループ	1,051,600	7,140.00	7,508,424,000		
いであ	68,800	1,675.00	115,240,000	貸付株式数	58,700株
学 究 社	90,500	1,566.00	141,723,000		
ベネッセホールディングス	939,500	2,197.00	2,064,081,500		
イオンディライト	324,900	2,820.00	916,218,000		
ナック	133,700	970.00	129,689,000	貸付株式数	105,000株
福井コンピュータH L D S	132,900	3,515.00	467,143,500	貸付株式数	800株
ダイセキ	514,000	3,730.00	1,917,220,000	貸付株式数	11,100株
ステップ	103,100	1,672.00	172,383,200	貸付株式数	83,000株
日鉄物産	177,700	4,985.00	885,834,500		
泉州電業	72,200	4,975.00	359,195,000	貸付株式数	67,000株
元気寿司	81,400	2,510.00	204,314,000	貸付株式数	6,700株
トラスコ中山	604,500	1,826.00	1,103,817,000	貸付株式数	2,700株
ヤマダホールディングス	10,280,300	486.00	4,996,225,800		
オートバックスセブン	901,800	1,403.00	1,265,225,400	貸付株式数	654,000株
モリト	211,500	758.00	160,317,000	貸付株式数	12,100株
アークランドサカモト	454,900	1,592.00	724,200,800		
ニトリホールディングス	1,153,200	13,705.00	15,804,606,000		
グルメ杵屋	230,700	1,005.00	231,853,500	貸付株式数	184,000株
愛 眼	212,200	179.00	37,983,800	貸付株式数	160,800株
ケーユーホールディングス	151,700	1,067.00	161,863,900	貸付株式数	2,100株
吉野家ホールディングス	1,014,200	2,398.00	2,432,051,600	貸付株式数	536,900株
加藤産業	314,500	3,315.00	1,042,567,500		
北恵	73,400	841.00	61,729,400	貸付株式数	60,600株
イノテック	175,800	1,299.00	228,364,200		
イエローハット	457,400	1,697.00	776,207,800		
松屋フーズH L D G S	139,800	4,010.00	560,598,000	貸付株式数	117,800株
J B C Cホールディングス	195,600	1,589.00	310,808,400		

J Kホールディングス	204,000	977.00	199,308,000	貸付株式数	4,500株
サガミホールディングス	416,400	1,095.00	455,958,000	貸付株式数	207,700株
日 伝	197,000	1,921.00	378,437,000	貸付株式数	36,100株
関西フードマーケット	233,900	1,204.00	281,615,600	貸付株式数	123,700株
ミロク情報サービス	255,000	1,321.00	336,855,000	貸付株式数	22,800株
北沢産業	152,800	201.00	30,712,800	貸付株式数	34,400株
杉本商事	135,900	2,047.00	278,187,300	貸付株式数	500株
因幡電機産業	723,500	2,719.00	1,967,196,500		
王将フードサービス	192,200	6,720.00	1,291,584,000	貸付株式数	12,600株
プレナス	325,300	1,977.00	643,118,100		
ミニストップ	215,100	1,470.00	316,197,000	貸付株式数	181,000株
アークス	515,000	2,085.00	1,073,775,000	貸付株式数	23,900株
パローホールディングス	593,300	1,898.00	1,126,083,400		
東 テ ク	86,500	3,080.00	266,420,000	貸付株式数	20,900株
ミスミグループ本社	3,648,500	3,195.00	11,656,957,500		
アルテック	177,400	271.00	48,075,400	貸付株式数	83,900株
ベ ル ク	129,200	5,180.00	669,256,000		
大 庄	155,500	1,151.00	178,980,500	貸付株式数	133,800株
タキヒヨー	78,400	934.00	73,225,600	貸付株式数	70,500株
ファーストリテイリング	388,600	68,260.00	26,525,836,000		
ソフトバンクグループ	17,360,800	5,400.00	93,748,320,000		
蔵王産業	56,000	1,867.00	104,552,000	貸付株式数	1,200株
スズケン	1,041,300	3,785.00	3,941,320,500	貸付株式数	200株
サンドラッグ	1,093,100	3,090.00	3,377,679,000		
サックスパーホールディング	273,500	616.00	168,476,000	貸付株式数	230,000株
ジェコス	200,100	825.00	165,082,500		
ヤマザワ	60,300	1,493.00	90,027,900	貸付株式数	55,000株
や ま や	59,700	2,506.00	149,608,200	貸付株式数	50,900株
グローセル	314,600	399.00	125,525,400	貸付株式数	207,400株
ペルーナ	623,500	757.00	471,989,500	貸付株式数	230,500株
合計			7,161,179,190,410		

(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。

武田薬品	158,000株	ソニーグループ	200,000株
キーエンス	23,000株	本田技研	200,000株
三菱商事	125,000株	三菱UFJフィナンシャルG	800,000株
三井住友フィナンシャルG	200,000株	みずほフィナンシャルG	400,000株
東海旅客鉄道	16,200株	KDDI	100,000株

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

貸付であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年7月11日から2023年1月10日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

ダイワ上場投信 - トピックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2023年1月10日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	564,727,337,265
株式	2 3 7,048,162,516,090
交換未引渡株式	4 1,930,620,950
未収入金	6,454,966
未収配当金	10,841,260,218
未収利息	12,333,608
前払金	4,288,172,500
その他未収収益	5 1,769,369,519
差入委託証拠金	3,827,925,000
流動資産合計	7,635,565,990,116
資産合計	
7,635,565,990,116	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,813,777,100
未払解約金	4 1,930,620,950
未払受託者報酬	967,019,620
未払委託者報酬	1,783,626,718
受入担保金	458,645,287,652
その他未払費用	657,399,159
流動負債合計	467,797,731,199
負債合計	
467,797,731,199	
純資産の部	
元本等	
元本	1 4,512,867,261,250
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,654,900,997,667
（分配準備積立金）	128,223,440
元本等合計	7,167,768,258,917
純資産合計	
7,167,768,258,917	
負債純資産合計	7,635,565,990,116

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2022年7月11日 至 2023年1月10日
営業収益	
受取配当金	87,556,601,459
受取利息	271,814,200
有価証券売買等損益	21,460,176,712
派生商品取引等損益	1,623,999,450
その他収益	1,418,132,538
営業収益合計	72,177,370,935
営業費用	
支払利息	119,654,789
受託者報酬	967,019,620
委託者報酬	1,783,626,718
その他費用	699,726,704
営業費用合計	3,570,027,831
営業利益	68,607,343,104
経常利益	68,607,343,104
中間純利益	68,607,343,104
期首剰余金又は期首欠損金()	2,620,237,214,549
剰余金増加額又は欠損金減少額	27,088,654,544
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	27,088,654,544
剰余金減少額又は欠損金増加額	61,032,214,530
中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	61,032,214,530
中間剰余金又は中間欠損金()	2,654,900,997,667

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	2022年7月11日	2023年1月10日
	株式	
	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引	
	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金	
	<p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末
	2023年1月10日現在
1. 1 期首元本額	4,565,766,482,500円
期中追加設定元本額	44,395,962,500円
期中一部交換元本額	97,295,183,750円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,610,293,809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 440,294,546,360円
4.	3	差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 8,315,649,000円
5.	4	交換未引渡株式及び未払解約金	2023年1月6日を交換請求受付日とした交換の対象となる株式及び当該株式の引渡債務であります。
6.	5	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1,749,866,124円が含まれております。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年7月11日 至 2023年1月10日
1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額3,771,508,620円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2023年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	当中間計算期間末 2023年1月10日 現在			
	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	123,572,012,500	-	119,761,740,000	3,810,272,500
合計	123,572,012,500	-	119,761,740,000	3,810,272,500

(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。

原則として中間計算期間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、中間計算期間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)

	当中間計算期間末 2023年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,985.4円
(10口当たり純資産額)	(19,854円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年1月31日

資産総額	8,010,406,347,083円
負債総額	484,645,482,054円
純資産総額（ - ）	7,525,760,865,029円
発行済数量	3,609,328,432口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2,085.1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) 名義登録と収益分配金の支払い

受託会社は、計算期間終了日において氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。この場合、名義登録受益者が当該計算期間終了日における振替制度移行後も受益証券を保有している所有者と異なる場合であっても、委託会社および受託会社は当該所有者に対して収益分配金の支払いおよびその他損害についてその責を負わないものとします。

(3) 受益者に対する特典

ありません。

(4) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(5) 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。

(6) 受益権の譲渡

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

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

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

(7) 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。

(8) 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。

(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、交換請求の受付け、交換株式の交付等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2023年1月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年1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	88	306,528
追加型株式投資信託	773	21,171,806
株式投資信託 合計	861	21,478,334
単位型公社債投資信託	82	164,674
追加型公社債投資信託	14	1,419,620
公社債投資信託 合計	96	1,584,294
総合計	957	23,062,628

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第63期事業年度（2021年4月1日から2022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64期事業年度に係る中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,860	3,168
有価証券	333	486
前払費用	237	332
未収委託者報酬	13,150	13,811
未収収益	49	52
関係会社短期貸付金	18,700	24,900
その他	207	45
流動資産計	37,539	42,799
固定資産		
有形固定資産	1	203
建物	6	4

器具備品	218	198
無形固定資産	1,937	1,770
ソフトウェア	1,882	1,738
ソフトウェア仮勘定	54	31
投資その他の資産	16,121	16,617
投資有価証券	10,159	10,755
関係会社株式	3,705	3,705
出資金	183	177
長期差入保証金	1,068	1,067
繰延税金資産	973	885
その他	30	26
固定資産計	18,283	18,591
資産合計	55,822	61,390

(単位:百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	68	65
未払金	8,405	9,856
未払収益分配金	13	26
未払償還金	39	12
未払手数料	4,734	4,917
その他未払金	2	4,900
未払費用	3,777	4,246
未払法人税等	804	980
未払消費税等	631	1,016
賞与引当金	950	866
その他	88	2
流動負債計	14,725	17,033
固定負債		
退職給付引当金	2,452	2,399
役員退職慰労引当金	74	13
その他	3	1
固定負債計	2,530	2,415
負債合計	17,256	19,449
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	10,574	13,925
利益剰余金合計	10,948	14,299
株主資本合計	37,618	40,969
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	947	971
評価・換算差額等合計	947	971
純資産合計	38,566	41,941
負債・純資産合計	55,822	61,390

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	65,487	74,402
その他営業収益	419	545
営業収益計	65,906	74,948
営業費用		
支払手数料	27,965	31,234
広告宣伝費	624	650
調査費	8,245	9,104
調査費	1,134	1,252
委託調査費	7,110	7,851
委託計算費	1,501	1,729
営業雑経費	1,870	2,051
通信費	240	189
印刷費	478	468
協会費	51	46
諸会費	14	15
その他営業雑経費	1,084	1,331
営業費用計	40,207	44,768

一般管理費		
給料	5,991	5,948
役員報酬	351	306
給料・手当	4,293	4,281
賞与	395	493
賞与引当金繰入額	950	866
福利厚生費	893	867
交際費	32	46
旅費交通費	37	48
租税公課	472	527
不動産賃借料	1,302	1,300
退職給付費用	449	408
役員退職慰労引当金繰入額	28	10
固定資産減価償却費	661	606
諸経費	1,763	1,864
一般管理費計	11,631	11,628
営業利益	14,067	18,551

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	578	327
有価証券償還益	42	40
その他	68	264
営業外収益計	689	631
営業外費用		
投資有価証券売却損	69	59
有価証券償還損	47	0
その他	24	34
営業外費用計	141	93
経常利益	14,616	19,089
特別損失		
システム刷新関連費用	547	-
関係会社整理損失	267	-
投資有価証券評価損	45	331
特別損失計	860	331
税引前当期純利益	13,756	18,757
法人税、住民税及び事業税	4,476	5,950
法人税等調整額	109	69

法人税等合計	4,366	6,019
当期純利益	9,389	12,738

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,564	△ 10,564	△ 10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△ 1,175	△ 1,175	△ 1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	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	△ 363	△ 363	38,430
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物 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別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与及び上席参事についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、翌事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「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）を適用する予定であります。

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

（会計方針の変更に関する注記）

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。これによる当事業年度の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載しておりません。

（未適用の会計基準等）

- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響については、現時点で評価中であります。

（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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物	35百万円	37百万円
器具備品	259百万円	283百万円

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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
未払金	3,473百万円	4,694百万円

3 保証債務

前事業年度（2021年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,727百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2022年3月31日）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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
2020年6月23日 定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年 3月31日	2020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

2021年6月22日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	9,388百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,599円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月23日

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、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連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

() 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、2019年7月4日公表の企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下、「2019年適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

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(2021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
投資有価証券(1)	85	-	-	85
資産合計	85	-	-	85

(1) 2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

(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、コマーシャル・ペーパー、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。

当事業年度(2022年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券(1)	66	-	-	66
資産合計	66	-	-	66

(1) 2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券486百万円、投資有価証券10,022百万円は上記の表に含めておりません。

(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

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。なお、2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価額によっていることからレベルを付していません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

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

（単位：百万円）

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,677	1,677
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（2021年3月31日）

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2021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	85	55	30
（２）その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	160
小計	2,561	2,721	160
合計	9,826	8,474	1,352

(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(2022年3月31日)

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、関係会社株式について267百万円、証券投資信託について45百万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331百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
退職給付債務の期首残高	2,574	百万円	2,452	百万円
勤務費用	155		152	
退職給付の支払額	378		303	
その他	101		98	
退職給付債務の期末残高	2,452		2,399	

(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
非積立型制度の退職給付債務	2,452	百万円	2,399	百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452		2,399	
退職給付引当金	2,452		2,399	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452		2,399	

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
勤務費用	155	百万円	152	百万円
その他	108		67	
確定給付制度に係る退職給付費用	263		219	

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186百万円、当事業年度189百万円であります。

(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		当事業年度	
	(2021年3月31日)		(2022年3月31日)	
繰延税金資産				
退職給付引当金	750		734	
賞与引当金	243		227	

未払事業税	170	213
投資有価証券評価損	128	144
システム関連費用	155	111
出資金評価損	94	94
その他	298	437
繰延税金資産小計	1,841	1,963
評価性引当額	254	356
繰延税金資産合計	1,586	1,607
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	159	159
その他有価証券評価差額金	453	562
繰延税金負債合計	612	722
繰延税金資産の純額	973	885

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（2021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（2022年3月31日）

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

（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74,402百万円、その他545百万円であります。

（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
載を省略してあります。

(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、
記載を省略してあります。

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 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

[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 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

属性	会社等の 名称	住所	資本金また は出資金 (百万円)	事業 の内 容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関係内容		取引の内 容	取引金額 (百万 円)	科目	期末残高 (百万 円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会 社	㈱大和証 券グルー プ本社	東京 都千 代田 区	247,397	証券 持株 会社 業	被所有 100.0	あり	経営管 理	資金の貸 付 利息の受 取(注)	19,300 0	関係会 社短期 貸付金 -	18,700 -

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,727	-	-

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)	14,917	未払手数料	3,321
							不動産の賃借料(注4)	527	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	株大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	527	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	-------------------	-------	-----------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 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)	15,348 1,062	未払手数料 長期差入保証金	3,028 1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	1,065	未払費用	91

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,784.79円	1株当たり純資産額	16,078.50円
1株当たり当期純利益	3,599.54円	1株当たり当期純利益	4,883.43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いません。

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益(百万円)	9,389	12,738
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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 (2022年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		3,876
有価証券		498
未収委託者報酬		12,633
関係会社短期貸付金		16,600
その他		557
流動資産合計		34,165
固定資産		
有形固定資産	1	196
無形固定資産		
ソフトウェア		1,443
その他		141
無形固定資産合計		1,584
投資その他の資産		
投資有価証券		7,533
関係会社株式		3,482
繰延税金資産		887
その他		1,267
投資その他の資産合計		13,170
固定資産合計		14,950
資産合計		49,116

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2022年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		5,646

未払費用	4,193
未払法人税等	1,623
賞与引当金	486
その他	2 655
流動負債合計	12,605
固定負債	
退職給付引当金	2,344
役員退職慰労引当金	33
その他	1
固定負債合計	2,379
負債合計	14,984
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,692
利益剰余金合計	7,067
株主資本合計	33,737
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	394
評価・換算差額等合計	394
純資産合計	34,131
負債・純資産合計	49,116

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間
	(自 2022年4月1日
	至 2022年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	35,926
その他営業収益	281

営業収益合計		36,208
営業費用		
支払手数料		15,088
その他営業費用		6,970
営業費用合計		22,059
一般管理費	1	5,766
営業利益		8,382
営業外収益	2	579
営業外費用	3	274
経常利益		8,686
特別利益		-
特別損失	4	460
税引前中間純利益		8,226
法人税、住民税及び事業税		2,472
法人税等調整額		248
中間純利益		5,505

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金 資本準備金	利益剰余金 利益準備金	利益剰余金		株主資本合計
				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
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,737	12,737	12,737
中間純利益	-	-	-	5,505	5,505	5,505
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	-	-	-	7,232	7,232	7,232
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,692	7,067	33,737

	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
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,737
中間純利益	-	-	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	576	576	576
当中間期変動額合計	576	576	7,809
当中間期末残高	394	394	34,131

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（2）無形固定資産

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

3．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

(会計方針の変更)

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

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

(追加情報)

(連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用)

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については「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。以下「実務対応報告第42号」という。)に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2022年9月30日現在)
有形固定資産	326百万円

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（2022年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,122百万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 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	302百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券売却益	268百万円
有価証券償還益	149百万円
為替差益	114百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券売却損	244百万円

4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券評価損	237百万円
関係会社整理損失	222百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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
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

(金融商品関係)

当中間会計期間(2022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	57	7,306	-	7,364
資産合計	57	7,306	-	7,364

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

（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
非上場株式等	666
子会社株式	1,454
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2022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 1,454百万円）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	57	55	2
（2）その他	4,614	3,570	1,043
小計	4,671	3,625	1,046
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,692	3,171	478
小計	2,692	3,171	478
合計	7,364	6,797	567

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

〔収益認識関係〕

（１）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が35,926百万円、その他281百万円であります。

（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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,084.78円
1株当たり中間純利益	2,110.46円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,505
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,505
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

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

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

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

5【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2022年4月1日付で、定款について次の変更を致しました。

- ・ 監査役の人数の変更（4名以内から5名以内に変更）

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名 称	資本金の額 (2022年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	イービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,505百万円	(注1)	
	クレディ・スイス証券株式会社	78,100百万円	(注1)	
	ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	(注1)	
	ジェフリーズ証券会社 東京支店	2,004百万円 (2021年11月30日現在)	(注1)	
	シティグループ証券株式会社	96,307百万円	(注1)	
	J P モルガン証券株式会社	73,272百万円	(注1)	
	ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	35,765百万円	(注1)	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	(注1)	
	野村證券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	バークレイズ証券株式会社	38,945百万円	(注1)	
	BNPパリバ証券株式会社	102,025百万円	(注1)	
	BofA証券株式会社	83,140百万円	(注1)	
	みずほ証券株式会社	125,167百万円	(注1)	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	(注1)		
モルガン・スタンレーM U F G証券株式会社	62,149百万円	(注1)		
UBS証券株式会社	34,708百万円	(注1)		

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

- (注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
- (注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
- (注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- (注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。
- (注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
- (注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
- (注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。
- (注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。
- (注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部（信託財産の管理等）を行いません。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務等を行いません。

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

- ・金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
- ・目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
- ・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
- ・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
 - 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
 - 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
- ・使用開始日を記載することがあります。
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
 - 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
 - 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
- ・次の事項を記載することがあります。

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

- ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
- ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
- ・ 図案を採用することがあります。
- ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
- ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2022年5月23日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2021年4月1日から2022年3月31日までの第63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2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年9月2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	竹内 知明
--------------------	-------	-------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ上場投信 - トピックスの2021年7月11日から2022年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ上場投信 - トピックスの2022年7月10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。

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月28日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022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（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的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。

独立監査人の中間監査報告書

2023年2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	鈴木 崇雄
-------	-------

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士	竹内 知明
-------	-------

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ上場投信 - トピックスの2022年7月11日から2023年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ上場投信 - トピックスの2023年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年7月11日から2023年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。