

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2019年10月3日提出
【計算期間】	第12計算期間 (自 2019年1月11日 至 2019年7月10日)
【ファンド名】	ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社 (2020年4月1日より、大和アセットマネジメント株式会社(予定))
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【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
【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 【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「TOPIX Ex-Financials」（以下「対象株価指数」という場合があります。）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	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	独立区分	E T F
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	株式 一般
	決算頻度	年2回
	投資対象地域	日本
	対象インデックス	その他の指数（TOPIX Ex-Financials）

(注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「国内」...目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「株式」...目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「E T F」...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
- ・「インデックス型」...目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

- ・「株式 一般」...大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「年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
- ・「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
- ・「その他の指数」...日経225、T O P I Xにあてはまらないすべてのもの

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)	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
追加型投信	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信 その他資産 () 資産複合	ETF	

(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	年2回	日本	日経225
大型株		北米	
中小型株		欧州	
債券	年4回	アジア	TOPIX
一般	年6回 (隔月)	オセアニア	
公債	年12回 (毎月)	中南米	
社債	日々	アフリカ	その他 (TOPIX) (Ex-Financials)
その他債券	その他 ()	中近東 (中東)	
クレジット属性 ()		エマージング	
不動産投信			
その他資産 ()			
資産複合 ()			
資産配分固定型			
資産配分変更型			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託の限度 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、2兆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「TOPIX Ex-Financials」（以下「対象株価指数」という場合があります。）の変動率に一致させることを目的として、対象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。

- 対象株価指数を構成する銘柄のうち、時価総額構成比率95%以上を占める各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（株価指数先物取引等を利用することを含みます。）があります。
- 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。

「TOPIX Ex-Financials」について

- ◆「TOPIX Ex-Financials」は、株式会社東京証券取引所が算出・公表する東証業種別株価指数の分類（33業種）のうち、「保険業」、「銀行業」、「証券、商品先物取引業」、「その他金融業」を除く29業種に分類されるすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするものです。
- ◆1993年7月5日の時価総額を1,000として、東京証券取引所が算出・公表しております（注1参照）。
- ◆新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します（注2参照）。

（注1）算出方法：毎日の指数 = 当日の時価総額 ÷ 基準時の時価総額 × 1,000

（注2）基準時の時価総額の修正方法：

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

- ① TOPIX Ex-Financialsの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIX Ex-Financialsに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。
- ② (株)東京証券取引所は、TOPIX Ex-Financialsの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX Ex-Financialsの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ③ (株)東京証券取引所は、TOPIX Ex-Financialsの指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIX Ex-Financialsの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ (株)東京証券取引所は、TOPIX Ex-Financialsの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIX Ex-Financials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 「ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials」は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ (株)東京証券取引所は、「ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials」の購入者または公衆に対し、「ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials」の説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦ (株)東京証券取引所は、当社または「ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials」の購入者のニーズを、TOPIX Ex-Financialsの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は「ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials」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（「TOPIX Ex-Financials」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を申込みことができます。
- 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1月10日および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「TOPIX Ex-Financials」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。

- (a) 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
- (b) 運用管理費用（信託報酬）、売買委託手数料等の費用負担
- (c) 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
- (d) 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
- (e) 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）
- (f) 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
- (g) 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】

2013年9月19日 信託契約締結、当初設定、運用開始
2013年9月20日 受益権を東京証券取引所に上場

(3) 【ファンドの仕組み】

	名 称	関係業務の内容
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 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：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）	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、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。
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（2019年7月末日現在） >

- ・ 資本金の額 151億7,427万2,500円
- ・ 沿革

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

・大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
		株	%
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対象株価指数の変動率に一致させることを目的として、対象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。

対象株価指数を構成する銘柄のうち、時価総額構成比率95%以上を占める各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（株価指数先物取引等を利用することを含みます。）があります。

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。

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

二．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、信託財産を、主として株式に投資することを指図します。

前 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、交換、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託財産を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。

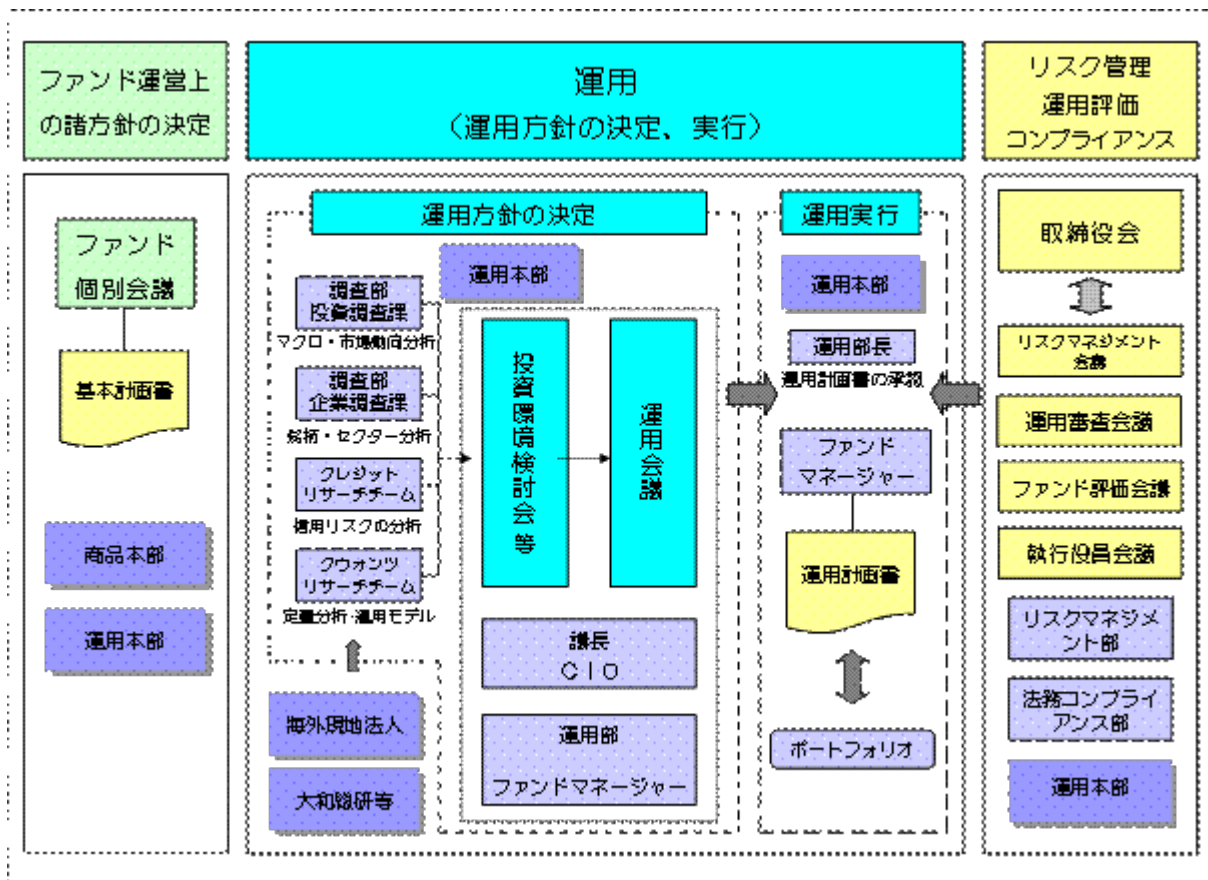
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ．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。

ニ．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。

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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ．ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

ロ．運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ハ．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。

二．執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2019年7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号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）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指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

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。

株式の貸付け（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。

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。

- 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。

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

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

イ．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。

ロ．市場の急変時等には、前掲「2 投資方針」にしたがった運用ができない場合があります。

ハ．コンピューター関係の不慮の出来事に起因する市場リスクやシステム上のリスクが生じる可能性があります。

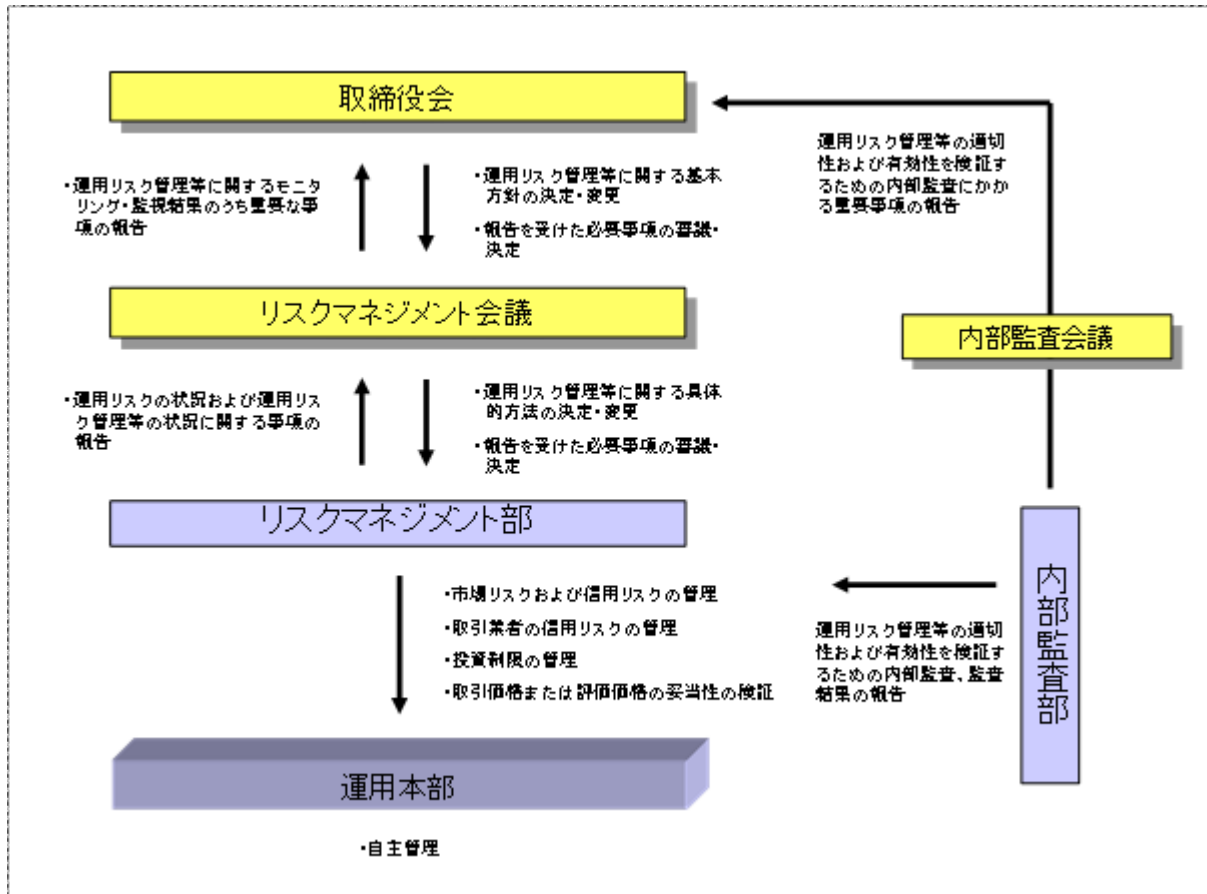
(2) その他の留意点

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。

(3) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

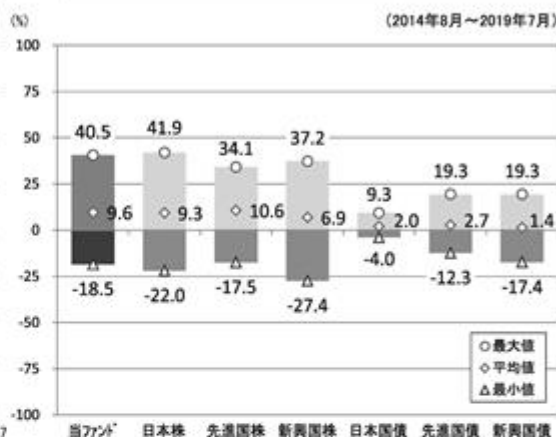
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

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、委託会社と受託会社との間の配分は以下のとおりとします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

イ. 信託財産の純資産総額に年率0.198%(税抜0.18%)以内を乗じて得た額

委託会社 年率0.13%(税抜)以内

受託会社 年率0.05%(税抜)以内

* 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. 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ます。)に55%(税抜50%)以内の率を乗じて得た額。ただし、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、当該品貸料に、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して得た額(当該額が負数のときは零とします。)に55%(税抜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0.198%(税抜0.18%)

ロ．55%（税抜50%）

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0.13%（税抜）

受託会社 年率0.05%（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および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。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。

* 提出日現在、商標使用料は信託財産の純資産総額に、年率0.033%（税抜0.03%）以内を乗じて得た額（ただし、88万円(税抜80万円)を下回る場合は88万円（税抜80万円））となります。

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

信託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。

() 2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

() 上記は、2019年7月末現在のものですので、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】（2019年7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	26,721,497,590	99.80
内 日本	26,721,497,590	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	53,456,276	0.20
純資産総額	26,774,953,866	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（2019年7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	148,200	6,908.00 1,023,765,600	7,024.00 1,040,956,800	3.89
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	104,200	5,182.00 539,964,400	5,628.00 586,437,600	2.19
3	ソニー	日本	株式	電気機 器	89,300	5,955.00 531,781,500	6,170.00 550,981,000	2.06
4	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	89,400	5,170.00 462,198,000	4,922.00 440,026,800	1.64
5	武田薬品	日本	株式	医薬品	116,200	3,862.00 448,764,400	3,635.00 422,387,000	1.58
6	キーエンス	日本	株式	電気機 器	6,500	65,170.00 423,605,000	63,130.00 410,345,000	1.53
7	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス 業	91,200	3,495.00 318,744,000	3,718.00 339,081,600	1.27
8	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	107,500	2,857.50 307,181,250	2,853.50 306,751,250	1.15
9	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	112,200	2,859.50 320,835,900	2,710.50 304,118,100	1.14
10	任天堂	日本	株式	その他 製品	7,500	40,000.00 300,000,000	40,100.00 300,750,000	1.12

11	三菱商事	日本	株式	卸売業	92,000	2,931.50 269,698,000	2,936.50 270,158,000	1.01
12	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	11,800	21,770.00 256,886,000	21,920.00 258,656,000	0.97
13	花王	日本	株式	化学	32,400	8,275.00 268,110,000	7,979.00 258,519,600	0.97
14	信越化学	日本	株式	化学	22,900	9,691.00 221,923,900	11,155.00 255,449,500	0.95
15	第一三共	日本	株式	医薬品	37,900	5,955.00 225,694,500	6,647.00 251,921,300	0.94
16	ファナック	日本	株式	電気機器	12,700	19,595.00 248,856,500	19,530.00 248,031,000	0.93
17	ダイキン工業	日本	株式	機械	18,100	14,160.00 256,296,000	13,585.00 245,888,500	0.92
18	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	23,700	10,250.00 242,925,000	10,005.00 237,118,500	0.89
19	日本電産	日本	株式	電気機器	16,000	14,315.00 229,040,000	14,715.00 235,440,000	0.88
20	日立	日本	株式	電気機器	59,700	4,057.00 242,202,900	3,892.00 232,352,400	0.87
21	HOYA	日本	株式	精密機器	26,700	7,998.00 213,546,600	8,405.00 224,413,500	0.84
22	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	15,100	13,830.00 208,833,000	14,440.00 218,044,000	0.81
23	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	83,000	2,573.50 213,600,500	2,615.00 217,045,000	0.81
24	資生堂	日本	株式	化学	26,400	8,124.00 214,473,600	8,046.00 212,414,400	0.79
25	キヤノン	日本	株式	電気機器	71,500	3,193.00 228,299,500	2,970.50 212,390,750	0.79
26	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	138,400	1,439.50 199,226,800	1,469.00 203,309,600	0.76
27	村田製作所	日本	株式	電気機器	41,900	4,849.00 203,173,100	4,843.00 202,921,700	0.76
28	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	54,100	3,773.00 204,119,300	3,728.00 201,684,800	0.75
29	三井物産	日本	株式	卸売業	107,700	1,807.00 194,613,900	1,779.00 191,598,300	0.72
30	伊藤忠	日本	株式	卸売業	91,500	2,075.00 189,862,500	2,082.00 190,503,000	0.71

(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	99.80%
合計	99.80%

(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	0.13%
鉱業	0.30%
建設業	3.08%
食料品	4.52%
繊維製品	0.70%
パルプ・紙	0.30%
化学	8.19%
医薬品	6.24%
石油・石炭製品	0.66%
ゴム製品	0.84%
ガラス・土石製品	0.93%
鉄鋼	0.95%
非鉄金属	0.83%
金属製品	0.64%
機械	5.63%
電気機器	15.44%
輸送用機器	8.65%
精密機器	2.37%
その他製品	2.44%
電気・ガス業	1.89%
陸運業	5.20%
海運業	0.19%
空運業	0.61%
倉庫・運輸関連業	0.22%
情報・通信業	10.08%
卸売業	5.50%
小売業	5.16%
不動産業	2.71%
サービス業	5.41%

合計	99.80%
----	--------

(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】

該当事項はありません。

(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1計算期間末 (2014年1月10日)	10,797,378,820	10,826,385,258	1,079.50	1,082.40	1,076
第2計算期間末 (2014年7月10日)	19,073,883,378	19,262,113,959	1,063.99	1,074.49	-
第3計算期間末 (2015年1月10日)	20,915,809,343	21,178,755,740	1,169.30	1,184.00	-
第4計算期間末 (2015年7月10日)	18,371,096,566	18,567,799,518	1,316.87	1,330.97	-
第5計算期間末 (2016年1月10日)	26,593,586,491	26,787,806,652	1,218.63	1,227.53	-
第6計算期間末 (2016年7月10日)	24,114,848,389	24,354,077,806	1,058.42	1,068.92	-
第7計算期間末 (2017年1月10日)	1,799,193,082	2,030,245,950	1,166.48	1,316.28	1,170
第8計算期間末 (2017年7月10日)	6,694,133,889	6,719,583,933	1,236.24	1,240.94	1,223
第9計算期間末 (2018年1月10日)	2,208,423,496	2,260,743,264	1,430.92	1,464.82	1,424
第10計算期間末 (2018年7月10日)	25,265,291,318	25,328,399,349	1,321.15	1,324.45	-
2018年7月末日	25,754,932,185	-	1,346.76	-	1,350
8月末日	25,505,548,196	-	1,333.72	-	1,332
9月末日	37,941,418,937	-	1,406.04	-	1,411
10月末日	25,456,575,128	-	1,266.92	-	1,268
11月末日	25,927,882,302	-	1,290.38	-	-

12月末日	23,376,945,353	-	1,163.42	-	1,160
第11計算期間末 (2019年1月10日)	23,477,218,115	23,778,617,285	1,168.41	1,183.41	1,163
2019年1月末日	24,191,726,041	-	1,203.97	-	1,207
2月末日	24,906,523,078	-	1,239.55	-	1,239
3月末日	24,976,151,201	-	1,243.01	-	1,248
4月末日	25,412,005,342	-	1,264.70	-	-
5月末日	26,054,439,996	-	1,182.17	-	1,190
6月末日	26,797,867,983	-	1,215.90	-	1,217
第12計算期間末 (2019年7月10日)	26,825,499,875	27,109,809,141	1,217.16	1,230.06	-
7月末日	26,774,953,866	-	1,214.86	-	-

(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1計算期間	2.90
第2計算期間	10.50
第3計算期間	14.70
第4計算期間	14.10
第5計算期間	8.90
第6計算期間	10.50
第7計算期間	149.80
第8計算期間	4.70
第9計算期間	33.90
第10計算期間	3.30
第11計算期間	15.00
第12計算期間	12.90

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	9.4
第2計算期間	0.5
第3計算期間	11.3
第4計算期間	13.8
第5計算期間	6.8
第6計算期間	12.3
第7計算期間	24.4
第8計算期間	6.4

第9計算期間	18.5
第10計算期間	7.4
第11計算期間	10.4
第12計算期間	5.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	10,002,220	0
第2計算期間	19,767,470	11,842,968
第3計算期間	14,884,100	14,923,312
第4計算期間	984,420	4,921,366
第5計算期間	8,858,210	986,284
第6計算期間	3,883,840	2,922,576
第7計算期間	0	21,241,345
第8計算期間	5,813,620	1,941,126
第9計算期間	967,650	4,839,197
第10計算期間	17,580,290	0
第11計算期間	7,860,980	6,891,348
第12計算期間	1,946,200	0

(注) 当初設定数量は5,054,850口です。

(参考情報) 運用実績

●ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials

2019年7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	121,486円
純資産総額	267億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	1.0%
3か月間	-2.9%
6か月間	2.0%
1年間	-7.7%
3年間	26.6%
5年間	37.9%
設定来	54.1%



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

分配の推移(100口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 2,790円 設定来分配金合計額: 28,120円											
	第1期 14年1月	第2期 14年7月	第3期 15年1月	第4期 15年7月	第5期 16年1月	第6期 16年7月	第7期 17年1月	第8期 17年7月	第9期 18年1月	第10期 18年7月	第11期 19年1月	第12期 19年7月
分配金	290円	1,050円	1,470円	1,410円	890円	1,050円	14,980円	470円	3,390円	330円	1,500円	1,290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

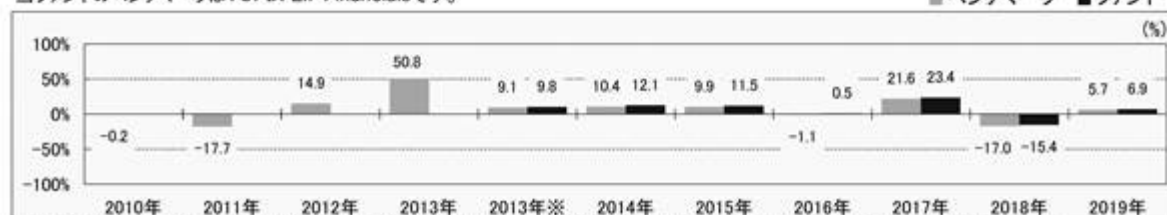
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	2,001	99.8%	電気機器	15.4%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.9%
国内株式先物	-	-	情報・通信業	10.1%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.2%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	8.7%	ソニー	電気機器	2.1%
コール・ローン、その他	-	0.2%	化学	8.2%	日本電信電話	情報・通信業	1.6%
合計	2,001	100.0%	医薬品	6.2%	武田薬品	医薬品	1.6%
株式市場・上場別構成			機械	5.6%	キーエンス	電気機器	1.5%
一部(東証・名証)		99.8%	卸売業	5.5%	リクルートホールディングス	サービス業	1.3%
二部(東証・名証)		-	サービス業	5.4%	KDDI	情報・通信業	1.1%
新興市場他		-	陸運業	5.2%	本田技研	輸送用機器	1.1%
その他		-	その他	29.5%	任天堂	その他製品	1.1%
合計		99.8%	合計	99.8%	合計		17.6%

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはTOPIX Ex-Financialsです。

■ベンチマーク ■ファンド



・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。

・2013年※は設定日(9月19日)から年末、2019年は7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。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

受益権の取得申込者は、対象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。

受益権の取得申込者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後3時）までに取得申込みをした場合には、その翌営業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。

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。

前 の規定にかかわらず、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。

前 の規定にかかわらず、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（以下本 において「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。

前 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。

前 の規定にかかわらず、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 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。

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。

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。

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 に定める株式(前 、前 および前 に該当する場合の金銭を含みます。)または前 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。

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付けることがあります。

1. 対象株価指数構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内
2. 対象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5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6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

販売会社は、当該販売会社が定める手数料ならびに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。

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、取得申込みの受付けの中止、取得申込みの受付けの取消しまたはその両方を行なうことができます。

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

受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、前 に定める株式(前 、前 および前 に該当する場合の金銭を含みます。)または前 に定める担保金について、受入れまたは振替済みの通知を受けた場合、振替機関に対し当該受益権にかかる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)」に規定する重大な信託約款の変更等に反対した受益者からの「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。)につき、信託期間中において、当ファンドの一部解約請求をすることはできません。

< 交換 >

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。

受益者が交換請求をするときは、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行なうものとします。

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（営業日の午後3時）までに交換請求をした場合には、その翌営業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付けます。

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受益権と交換するものとします。交換に際し、受益権の価額は、交換請求受付日の基準価額とします。

前 の規定にかかわらず、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、受益権の交換請求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、受益権の交換請求を受け付けることがあります。

1. 対象株価指数構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日
2. 対象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4営業日前から起算して8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5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6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るとき

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。当該抹消にかかる手続きおよび後 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 または後 に定める当該交換にかかる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 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。

受託会社は、後 または後 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 に定める抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ、抹消したもとして取扱います。

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。

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、交換請求の受け付けの中止、交換請求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。

前 の規定により交換請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の交換請求を撤回することができます。ただし、受益者がその交換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請求を受け付けたものとして計算されるものとします。

委託会社は、交換の請求を受け付けた場合には、当該請求にかかる受益権と、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。

前 の規定にかかわらず、委託会社が指定する株式に当該請求を行なった受益者が発行した株式またはその親会社が発行した株式（以下本 において「自社株式等」といいます。）が含まれる場合には、原則として、委託会社は、前 の請求にかかる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受益権と、当該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。

前 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。

前 の規定にかかわらず、前 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 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。

受託会社は、前 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。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。

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 >

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. 交換により取引所売買単位未満の振替受益権が生じた場合
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場合

前 の買取価額は、買取請求受付日の基準価額から、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。

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。

前 の規定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することができます。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 の規定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100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

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

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) 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1月11日から7月10日まで、および7月11日から翌年1月10日までとします。ただし、第1計算期間は、2013年9月19日から2014年1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場合または対象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。なお、受益権を上場したすべての金融商品取引所において当該受益権の上場が廃止された場合には、委託会社は、その廃止された日に、信託を終了するための手続きを開始するものとします。
3. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

4. 前3.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本4.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
5. 前3.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
6. 前3.から前5.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とき、あるいは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.から前5.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更等

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

6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

前 1. の1. から6. までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 1. の規定にしたがい重大な信託約款の変更等を行なう場合には、書面決議において当該解約または重大な信託約款の変更等に反対した受益者は、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すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、前 1. の3. または前 1. の2. に規定する書面に付記します。

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。

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 >

1. 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。
2. 受託会社は、計算期間終了日現在において、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（以下「名義登録受益者」といいます。）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。

3. 受益者は、原則として前2.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（口座管理機関であるものに限り、以下同じ。）を経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2.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。

4. 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。

イ. 受益権は、前3.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。

ロ. 前3.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イ.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のものとします。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。

ハ. 前3.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イ.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。

5. 信託契約締結当初および追加信託時の受益者については、前2.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。

6. 前2.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3.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。

7. 受託会社は、支払開始日から5年経過した後に、収益分配金について未払残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとします。

8. 受託会社は、前7.の規定により委託会社に収益分配金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

9. 受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、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

1. 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。

2. 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のものとします。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。

3. 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が発行した株式またはその親会社が発行した株式(以下本3.において「自社株式等」といいます。)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。
4. 受益者が、信託終了時の交換について信託終了日から10年間その交換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) 当ファンドの計算期間は6か月であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 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12期計算期間(2019年1月11日から2019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】

ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 2019年1月10日現在	第12期 2019年7月10日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	62,303,034
コール・ローン	335,119,705	236,690,437
株式	23,429,437,500	26,776,579,560
未収入金	-	21,477,217
未収配当金	43,338,262	44,536,540
流動資産合計	23,807,895,467	27,141,586,788
資産合計	23,807,895,467	27,141,586,788
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	301,399,170	284,309,266
未払受託者報酬	7,184,385	6,764,736
未払委託者報酬	18,679,465	17,588,399
その他未払費用	3,414,332	7,424,512
流動負債合計	330,677,352	316,086,913
負債合計	330,677,352	316,086,913
純資産の部		
元本等		
元本	1 19,872,251,942	1 21,797,043,742
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,604,966,173	5,028,456,133
(分配準備積立金)	1,952,443	1,280,555
元本等合計	23,477,218,115	26,825,499,875
純資産合計	23,477,218,115	26,825,499,875
負債純資産合計	23,807,895,467	27,141,586,788

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 自 2018年7月11日 至 2019年1月10日	第12期 自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
営業収益		
受取配当金	332,323,547	312,546,349
受取利息	5	-
有価証券売買等損益	3,042,153,112	1,000,479,730
その他収益	337,515	218,208
営業収益合計	2,709,492,045	1,313,244,287
営業費用		
支払利息	34,844	36,821
受託者報酬	7,184,385	6,764,736
委託者報酬	18,679,465	17,588,399
その他費用	5,070,333	4,737,223
営業費用合計	30,969,027	29,127,179
営業利益又は営業損失()	2,740,461,072	1,284,117,108
経常利益又は経常損失()	2,740,461,072	1,284,117,108
当期純利益又は当期純損失()	2,740,461,072	1,284,117,108
期首剰余金又は期首欠損金()	6,352,005,424	3,604,966,173
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,003,051,579	423,682,118
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,003,051,579	423,682,118
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,708,230,588	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,708,230,588	-
分配金	1,301,399,170	1,284,309,266
期末剰余金又は期末欠損金()	3,604,966,173	5,028,456,133

(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12期	
	自 2019年1月11日	至 2019年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)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。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</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。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. 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11期	第12期
	2019年1月10日現在	2019年7月10日現在
1. 1 期首元本額	18,913,285,894円	19,872,251,942円
期中追加設定元本額	7,774,509,220円	1,924,791,800円
期中一部交換元本額	6,815,543,172円	- 円

2.	計算期間末日における受益権の総数	20,093,278口	22,039,478口
----	------------------	-------------	-------------

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第11期	第12期
	自 2018年7月11日 至 2019年1月10日	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日
1 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（332,626,223円）及び分配準備積立金（1,659,573円）の合計額から、経費（30,934,183円）を控除して計算される分配対象額は303,351,613円（100口当たり1,509円）であり、うち301,399,170円（100口当たり1,500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（312,727,736円）及び分配準備積立金（1,952,443円）の合計額から、経費（29,090,358円）を控除して計算される分配対象額は285,589,821円（100口当たり1,295円）であり、うち284,309,266円（100口当たり1,290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12期 自 2019年1月11日 至 2019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、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第12期 2019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
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第11期 2019年1月10日現在	第12期 2019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	3,265,611,820	983,305,303
新株予約権証券	-	0
合計	3,265,611,820	983,305,303

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第11期 2019年1月10日現在	第12期 2019年7月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第12期 自 2019年1月11日 至 2019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11期 2019年1月10日現在	第12期 2019年7月10日現在
1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,168.41円 (116,841円)	1,217.16円 (121,716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	500	3,035.00	1,517,500	
日本水産	18,000	698.00	12,564,000	
マルハニチロ	2,600	3,285.00	8,541,000	
ハウスイ	100	835.00	83,500	
カネコ種苗	500	1,312.00	656,000	
サカタのタネ	2,200	3,190.00	7,018,000	
ホクト	1,600	1,852.00	2,963,200	
ホクリヨウ	200	605.00	121,000	
ヒノキヤグループ	300	2,158.00	647,400	
ショーボンドHD	2,800	3,845.00	10,766,000	
ミライト・ホールディングス	4,700	1,626.00	7,642,200	
タマホーム	800	1,097.00	877,600	
サンヨーホームズ	200	681.00	136,200	
日本アクア	400	660.00	264,000	
ファーストコーポレーション	500	662.00	331,000	
ベステラ	300	1,319.00	395,700	
TATERU	2,200	206.00	453,200	
スペースバリューHD	2,200	511.00	1,124,200	
住石ホールディングス	4,000	138.00	552,000	
日鉄鉱業	400	4,610.00	1,844,000	
三井松島HLDGS	700	1,323.00	926,100	
国際石油開発帝石	72,300	973.80	70,405,740	
石油資源開発	2,600	2,447.00	6,362,200	
K&Oエナジーグループ	800	1,557.00	1,245,600	
ダイセキ環境ソリューション	300	663.00	198,900	

第一カッター興業	200	1,751.00	350,200
安藤・間	11,500	736.00	8,464,000
東急建設	5,200	747.00	3,884,400
コムシスホールディングス	6,500	2,741.00	17,816,500
ミサワホーム	1,500	1,045.00	1,567,500
ビーアールホールディングス	1,600	345.00	552,000
高松コンストラクションG P	1,000	2,278.00	2,278,000
東建コーポレーション	500	6,360.00	3,180,000
ソネック	200	803.00	160,600
ヤマウラ	600	842.00	505,200
大成建設	14,900	3,935.00	58,631,500
大林組	44,600	1,063.00	47,409,800
清水建設	45,600	893.00	40,720,800
飛島建設	1,400	1,305.00	1,827,000
長谷工コーポレーション	18,500	1,166.00	21,571,000
松井建設	1,700	626.00	1,064,200
銭高組	200	4,505.00	901,000
鹿島建設	34,900	1,470.00	51,303,000
不動テトラ	1,000	1,362.00	1,362,000
大末建設	500	940.00	470,000
鉄建建設	800	2,976.00	2,380,800
西松建設	3,200	2,135.00	6,832,000
三井住友建設	10,800	602.00	6,501,600
大豊建設	900	2,772.00	2,494,800
前田建設	10,700	880.00	9,416,000
佐田建設	900	381.00	342,900
ナカノフドー建設	1,300	433.00	562,900
奥村組	2,500	3,300.00	8,250,000
東鉄工業	1,900	2,987.00	5,675,300
イチケン	200	1,708.00	341,600
富士ピー・エス	400	487.00	194,800
浅沼組	500	3,545.00	1,772,500
戸田建設	17,300	612.00	10,587,600
熊谷組	2,200	3,160.00	6,952,000
青木あすなろ建設	700	865.00	605,500
北野建設	300	2,641.00	792,300
植木組	200	2,226.00	445,200
矢作建設	2,100	724.00	1,520,400
ピーエス三菱	1,600	605.00	968,000
日本ハウスHLDGS	2,800	434.00	1,215,200

大東建託	5,300	14,015.00	74,279,500	
新日本建設	1,800	904.00	1,627,200	
N I P P O	4,000	2,103.00	8,412,000	
東亜道路	300	3,270.00	981,000	
前田道路	4,700	2,321.00	10,908,700	
日本道路	400	6,210.00	2,484,000	
東亜建設	1,400	1,602.00	2,242,800	
日本国土開発	2,400	525.00	1,260,000	
若築建設	700	1,439.00	1,007,300	
東洋建設	5,400	407.00	2,197,800	
五洋建設	17,700	522.00	9,239,400	
世紀東急	2,200	631.00	1,388,200	
福 田 組	400	4,500.00	1,800,000	
日本ドライケミカル	300	1,134.00	340,200	
住友林業	10,600	1,300.00	13,780,000	
日本基礎技術	1,600	336.00	537,600	
巴コーポレーション	1,900	372.00	706,800	
大和ハウス	41,300	3,187.00	131,623,100	
ライト工業	2,800	1,429.00	4,001,200	
積水ハウス	45,600	1,848.50	84,291,600	
日特建設	1,400	601.00	841,400	
北陸電気工事	700	897.00	627,900	
ユアテック	2,400	749.00	1,797,600	
四電工	200	2,716.00	543,200	
中電工	2,000	2,336.00	4,672,000	
関 電 工	6,800	929.00	6,317,200	
きんでん	10,000	1,656.00	16,560,000	
東京エネシス	1,600	944.00	1,510,400	
トーエネック	400	3,335.00	1,334,000	
住友電設	1,000	1,751.00	1,751,000	
日本電設工業	2,500	2,168.00	5,420,000	
協和エクシオ	5,900	2,655.00	15,664,500	
新日本空調	1,400	1,720.00	2,408,000	
日本工営	800	2,388.00	1,910,400	
九電工	2,900	3,445.00	9,990,500	
三機工業	3,500	1,211.00	4,238,500	
日 揮	12,900	1,503.00	19,388,700	
中外炉工業	400	1,616.00	646,400	
ヤマト	1,400	575.00	805,000	
太平電業	900	2,270.00	2,043,000	

高砂熱学	3,900	1,783.00	6,953,700	
三晃金属	200	2,426.00	485,200	
NEC ネットエスアイ	1,500	2,803.00	4,204,500	
朝日工業社	300	2,720.00	816,000	
明星工業	2,700	734.00	1,981,800	
大気社	2,100	3,315.00	6,961,500	
ダイダン	900	2,311.00	2,079,900	
日比谷総合設備	1,500	1,900.00	2,850,000	
東芝プラントシステム	3,200	2,005.00	6,416,000	
日本製粉	4,500	1,762.00	7,929,000	
日清製粉G本社	15,100	2,477.00	37,402,700	
日東富士製粉	100	5,760.00	576,000	
昭和産業	1,300	3,150.00	4,095,000	
鳥越製粉	1,300	853.00	1,108,900	
中部飼料	1,700	1,272.00	2,162,400	
フィード・ワン	9,000	194.00	1,746,000	
東洋精糖	200	1,011.00	202,200	
日本甜菜糖	700	2,053.00	1,437,100	
三井製糖	1,000	2,263.00	2,263,000	
塩水港精糖	1,500	210.00	315,000	
日新製糖	600	1,991.00	1,194,600	
LIFULL	4,400	510.00	2,244,000	
ジェイエイシーリクルートメント	900	2,514.00	2,262,600	
日本M&Aセンター	9,400	2,696.00	25,342,400	
メンバーズ	400	1,940.00	776,000	
中広	100	629.00	62,900	
アイティメディア	200	564.00	112,800	
タケエイ	1,400	1,001.00	1,401,400	
E・Jホールディングス	100	1,088.00	108,800	
トラスト・テック	1,200	1,617.00	1,940,400	
コシダカホールディングス	3,300	1,607.00	5,303,100	
アルトナー	200	790.00	158,000	
パソナグループ	1,300	1,647.00	2,141,100	
CDS	300	1,328.00	398,400	
リンクアンドモチベーション	2,400	622.00	1,492,800	
GCA	1,400	720.00	1,008,000	
エス・エム・エス	4,700	2,604.00	12,238,800	
サニーサイドアップ	200	1,029.00	205,800	
パーソルホールディングス	12,800	2,544.00	32,563,200	
リニカル	700	1,039.00	727,300	

クックパッド	4,100	333.00	1,365,300
エスクリ	300	743.00	222,900
アイ・ケイ・ケイ	600	705.00	423,000
森永製菓	3,500	5,400.00	18,900,000
中村屋	300	4,340.00	1,302,000
江崎グリコ	4,100	4,735.00	19,413,500
名糖産業	600	1,431.00	858,600
井村屋グループ	500	2,100.00	1,050,000
不二家	700	1,983.00	1,388,100
山崎製パン	10,900	1,712.00	18,660,800
第一屋製パン	200	985.00	197,000
モロゾフ	200	5,050.00	1,010,000
亀田製菓	800	4,985.00	3,988,000
寿スピリッツ	1,500	5,660.00	8,490,000
カルビー	6,200	3,010.00	18,662,000
森永乳業	2,700	4,355.00	11,758,500
六甲バター	900	1,820.00	1,638,000
ヤクルト	10,000	6,370.00	63,700,000
明治ホールディングス	9,400	7,690.00	72,286,000
雪印メグミルク	3,200	2,379.00	7,612,800
プリマハム	1,900	2,084.00	3,959,600
日本ハム	5,500	4,605.00	25,327,500
林兼産業	400	656.00	262,400
丸大食品	1,500	2,038.00	3,057,000
S Foods	1,300	3,795.00	4,933,500
伊藤ハム米久HLDGS	8,600	724.00	6,226,400
学情	500	1,142.00	571,000
スタジオアリス	600	2,098.00	1,258,800
クロスキャット	200	1,000.00	200,000
シミックホールディングス	600	2,141.00	1,284,600
システナ	4,700	1,858.00	8,732,600
NJS	300	1,673.00	501,900
デジタルアーツ	600	10,070.00	6,042,000
日鉄ソリューションズ	2,000	3,500.00	7,000,000
総合警備保障	5,000	4,965.00	24,825,000
キューブシステム	600	837.00	502,200
いちご	16,800	333.00	5,594,400
エイジア	200	1,178.00	235,600
日本駐車場開発	15,800	184.00	2,907,200
コア	500	1,643.00	821,500

カカクコム	9,500	2,302.00	21,869,000	
アイロムグループ	400	1,695.00	678,000	
セントケア・ホールディング	600	506.00	303,600	
サイネックス	200	640.00	128,000	
ルネサンス	700	1,794.00	1,255,800	
ディップ	2,100	1,869.00	3,924,900	
SBSホールディングス	1,400	1,528.00	2,139,200	
オプトホールディング	700	1,733.00	1,213,100	
新日本科学	1,800	740.00	1,332,000	
ツクイ	3,000	533.00	1,599,000	
キャリアデザインセンター	300	1,595.00	478,500	
ベネフィット・ワン	3,600	1,903.00	6,850,800	
エムスリー	26,700	2,024.00	54,040,800	
ツカダ・グローバルHOLD	700	586.00	410,200	
プラス	100	721.00	72,100	
アウトソーシング	6,700	1,414.00	9,473,800	
ウェルネット	1,300	991.00	1,288,300	
ワールドホールディングス	300	1,714.00	514,200	
ディー・エヌ・エー	6,900	2,142.00	14,779,800	
博報堂DYHLDGS	17,700	1,806.00	31,966,200	
ぐるなび	1,900	657.00	1,248,300	
タカミヤ	1,400	754.00	1,055,600	
ジャパンベストレスキューS	900	1,507.00	1,356,300	
ファンコミュニケーションズ	3,600	570.00	2,052,000	
ライク	500	1,510.00	755,000	
ビジネス・ブレークスルー	500	360.00	180,000	
WDBホールディングス	500	2,785.00	1,392,500	
ティア	500	644.00	322,000	
CDG	100	1,390.00	139,000	
バリューコマース	800	2,316.00	1,852,800	
インフォマート	7,000	1,642.00	11,494,000	
サッポロホールディングス	4,900	2,404.00	11,779,600	
アサヒグループホールディン	28,000	5,024.00	140,672,000	
麒麟HD	60,200	2,367.00	142,493,400	
宝ホールディングス	10,100	1,158.00	11,695,800	
オエノンホールディングス	3,900	375.00	1,462,500	
養命酒	400	1,996.00	798,400	
コカ・コーラボトラーズJHD	10,300	2,724.00	28,057,200	
サントリー食品インター	8,900	4,705.00	41,874,500	
ダイドーグループHD	700	4,680.00	3,276,000	

伊藤園	4,100	5,100.00	20,910,000
キーコーヒー	1,400	2,154.00	3,015,600
ユニカフェ	400	981.00	392,400
ジャパンフーズ	200	1,218.00	243,600
日清オイリオグループ	1,800	3,070.00	5,526,000
不二製油グループ	3,200	3,370.00	10,784,000
かどや製油	100	4,100.00	410,000
J - オイルミルズ	600	4,015.00	2,409,000
ローソン	3,500	5,450.00	19,075,000
サンエー	900	4,540.00	4,086,000
カワチ薬品	900	2,013.00	1,811,700
エービーシー・マート	2,100	6,640.00	13,944,000
ハードオフコーポレーション	500	691.00	345,500
高千穂交易	500	1,056.00	528,000
アスクル	1,300	2,309.00	3,001,700
ゲオホールディングス	2,000	1,488.00	2,976,000
アダストリア	1,900	2,144.00	4,073,600
ジーフット	700	658.00	460,600
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	683.00	136,600
伊藤忠食品	300	4,695.00	1,408,500
くら寿司	700	4,340.00	3,038,000
キャンドゥ	600	1,656.00	993,600
エレマテック	1,200	1,015.00	1,218,000
パルグループHLDGS	600	3,510.00	2,106,000
JALUX	300	2,755.00	826,500
エディオン	5,700	1,034.00	5,893,800
あらた	700	3,765.00	2,635,500
サーラコーポレーション	2,700	612.00	1,652,400
ワッツ	400	700.00	280,000
トーマンデバイス	200	2,300.00	460,000
ハローズ	500	2,333.00	1,166,500
J Pホールディングス	3,700	289.00	1,069,300
フジオフードシステム	500	2,603.00	1,301,500
あみやき亭	300	3,525.00	1,057,500
東京エレクトロニクス	400	1,989.00	795,600
ひらまつ	2,600	372.00	967,200
フィールズ	1,100	530.00	583,000
双日	72,200	348.00	25,125,600
アルフレッサホールディングス	14,600	2,754.00	40,208,400
大黒天物産	300	3,770.00	1,131,000

ハニーズホールディングス	1,300	1,336.00	1,736,800	
ファーマライズHD	300	526.00	157,800	
キッコーマン	8,800	4,830.00	42,504,000	
味の素	29,400	1,872.00	55,036,800	
キューピー	7,400	2,530.00	18,722,000	
ハウス食品G本社	5,100	4,190.00	21,369,000	
カゴメ	5,300	2,483.00	13,159,900	
焼津水産化工	600	1,102.00	661,200	
アリアケジャパン	1,300	7,020.00	9,126,000	
ピエトロ	200	1,600.00	320,000	
エバラ食品工業	300	2,143.00	642,900	
ニチレイ	6,900	2,670.00	18,423,000	
横浜冷凍	3,600	1,025.00	3,690,000	
東洋水産	6,900	4,585.00	31,636,500	
イートアンド	400	1,663.00	665,200	
大冷	100	1,901.00	190,100	
ヨシムラ・フード・HLDGS	300	947.00	284,100	
日清食品HD	5,800	6,900.00	40,020,000	
永谷園ホールディングス	700	2,139.00	1,497,300	
一正蒲鉾	500	1,032.00	516,000	
フジッコ	1,500	2,027.00	3,040,500	
ロックフィールド	1,500	1,454.00	2,181,000	
日本たばこ産業	76,900	2,447.50	188,212,750	
ケンコーマヨネーズ	700	2,364.00	1,654,800	
わらべや日洋HD	800	1,803.00	1,442,400	
なとり	700	1,611.00	1,127,700	
イフジ産業	200	670.00	134,000	
ピクルスコーポレーション	300	2,484.00	745,200	
北の達人コーポ	5,200	611.00	3,177,200	
ユーグレナ	5,400	1,024.00	5,529,600	
スター・マイカ・HLDGS	600	1,678.00	1,006,800	
片倉工業	1,700	1,294.00	2,199,800	
ゲンゼ	800	4,980.00	3,984,000	
ヒューリック	27,300	918.00	25,061,400	
神栄	200	783.00	156,600	
ラサ商事	600	823.00	493,800	
アルペン	900	1,584.00	1,425,600	
ハブ	400	1,234.00	493,600	
ラクーンホールディングス	600	655.00	393,000	
クオールホールディングス	2,000	1,645.00	3,290,000	

アルコニックス	1,500	1,364.00	2,046,000
神戸物産	2,000	5,380.00	10,760,000
ソリトンシステムズ	700	1,054.00	737,800
ジーンズホールディングス	800	5,900.00	4,720,000
ビックカメラ	7,200	1,102.00	7,934,400
D C Mホールディングス	7,100	1,091.00	7,746,100
ペッパーフードサービス	1,000	1,701.00	1,701,000
MonotaRO	8,400	2,703.00	22,705,200
東京一番フーズ	300	606.00	181,800
DDホールディングス	300	2,191.00	657,300
あいホールディングス	1,900	1,802.00	3,423,800
ディーブイエックス	500	797.00	398,500
きちりホールディングス	300	731.00	219,300
アークランドサービスHD	900	1,945.00	1,750,500
J. フロントリテイリング	16,800	1,290.00	21,672,000
ドトール・日レスHD	2,300	2,088.00	4,802,400
マツモトキヨシHLDGS	5,400	3,370.00	18,198,000
ブロンコビリー	600	2,233.00	1,339,800
ZOZO	14,100	1,972.00	27,805,200
トレジャー・ファクトリー	400	898.00	359,200
物語コーポレーション	300	9,190.00	2,757,000
ココカラファイン	1,600	5,790.00	9,264,000
三越伊勢丹HD	24,500	901.00	22,074,500
東洋紡	5,600	1,319.00	7,386,400
ユニチカ	3,900	406.00	1,583,400
富士紡ホールディングス	600	2,344.00	1,406,400
日清紡ホールディングス	7,300	816.00	5,956,800
倉敷紡績	1,300	1,932.00	2,511,600
ダイワボウHD	1,300	5,130.00	6,669,000
シキボウ	600	1,005.00	603,000
日東紡績	2,000	2,325.00	4,650,000
トヨタ紡織	4,700	1,416.00	6,655,200
マクニカ・富士エレHLDGS	3,700	1,527.00	5,649,900
Hamee	200	842.00	168,400
ラクト・ジャパン	600	3,690.00	2,214,000
ウエルシアHD	3,600	4,970.00	17,892,000
クリエイトSDH	2,000	2,527.00	5,054,000
バイタルKSKHD	2,500	1,033.00	2,582,500
八洲電機	900	843.00	758,700
メディアスホールディングス	700	700.00	490,000

レスターホールディングス	1,500	1,612.00	2,418,000
ジュテックHD	300	981.00	294,300
丸善CHI HD	1,600	389.00	622,400
大光	200	649.00	129,800
OCHIホールディングス	400	1,213.00	485,200
TOKAIホールディングス	6,900	939.00	6,479,100
黒谷	200	460.00	92,000
ミサワ	200	432.00	86,400
ティーライフ	200	914.00	182,800
Cominix	200	830.00	166,000
エー・ピーカンパニー	200	488.00	97,600
三洋貿易	600	2,370.00	1,422,000
チムニー	400	2,430.00	972,000
シュッピン	800	824.00	659,200
ビューティガレージ	200	1,694.00	338,800
ウイン・パートナーズ	800	1,174.00	939,200
ネクステージ	2,100	1,209.00	2,538,900
ジョイフル本田	3,900	1,245.00	4,855,500
鳥貴族	400	2,195.00	878,000
キリン堂ホールディングス	500	1,835.00	917,500
ホットランド	600	1,566.00	939,600
すかいらーくHD	12,300	1,911.00	23,505,300
SFPホールディングス	500	1,883.00	941,500
綿半ホールディングス	500	2,410.00	1,205,000
日本毛織	4,300	838.00	3,603,400
ダイトウボウ	2,100	83.00	174,300
トーア紡コーポレーション	500	457.00	228,500
ダイドーリミテッド	1,600	289.00	462,400
ヨシックス	200	2,627.00	525,400
ユナイテッド・スーパーマーケ	3,900	965.00	3,763,500
三栄建築設計	500	1,585.00	792,500
野村不動産HLDS	8,800	2,408.00	21,190,400
三重交通グループHD	2,700	583.00	1,574,100
サムティ	1,900	1,697.00	3,224,300
ディア・ライフ	1,700	475.00	807,500
コーセーアールイー	400	766.00	306,400
エー・ディー・ワークス	19,000	33.00	627,000
日本商業開発	800	1,512.00	1,209,600
プレサンスコーポレーション	2,100	1,533.00	3,219,300
ユニゾホールディングス	2,000	2,390.00	4,780,000

THEグローバル社	600	512.00	307,200
日本管理センター	800	1,130.00	904,000
サンセイランディック	300	732.00	219,600
エストラスト	200	718.00	143,600
フージャースHD	2,800	611.00	1,710,800
オープンハウス	2,200	4,475.00	9,845,000
東急不動産HD	35,200	640.00	22,528,000
飯田GHD	11,000	1,795.00	19,745,000
イーグランド	200	715.00	143,000
ムゲンエステート	800	570.00	456,000
帝国繊維	1,600	2,099.00	3,358,400
日本コークス工業	11,200	93.00	1,041,600
ゴルフダイジェスト・オン	500	610.00	305,000
ミタチ産業	200	702.00	140,400
B E E N O S	300	1,617.00	485,100
あさひ	1,000	1,249.00	1,249,000
日本調剤	400	3,340.00	1,336,000
コスモス薬品	500	18,390.00	9,195,000
シップヘルスケアHD	2,700	4,870.00	13,149,000
トーエル	600	718.00	430,800
ソフトクリエイトHD	500	1,597.00	798,500
オンリー	200	845.00	169,000
セブン&アイ・HLDGS	54,100	3,773.00	204,119,300
薬王堂	500	2,513.00	1,256,500
クリエイト・レストランツ・ホール	3,600	1,416.00	5,097,600
明治電機工業	400	1,389.00	555,600
ツルハホールディングス	2,700	10,470.00	28,269,000
デリカフーズHLDGS	200	1,473.00	294,600
スターティアホールディングス	200	549.00	109,800
サンマルクホールディングス	1,000	2,398.00	2,398,000
フェリシモ	300	968.00	290,400
トリドールホールディングス	1,700	2,331.00	3,962,700
帝人	10,700	1,819.00	19,463,300
東レ	100,800	770.00	77,616,000
クラレ	22,000	1,254.00	27,588,000
旭化成	92,400	1,103.00	101,917,200
サカイオーベックス	300	1,741.00	522,300
TOKYO BASE	1,300	884.00	1,149,200
稲葉製作所	700	1,482.00	1,037,400
宮地エンジニアリングG	400	1,862.00	744,800

トーカロ	3,500	806.00	2,821,000
アルファCO	400	1,245.00	498,000
SUMCO	14,600	1,300.00	18,980,000
川田テクノロジーズ	300	7,630.00	2,289,000
RS TECHNOLOGIES	200	3,030.00	606,000
信和	600	941.00	564,600
ビーロット	200	2,263.00	452,600
ファーストブラザーズ	300	1,020.00	306,000
ハウスドゥ	300	1,533.00	459,900
シーアールイー	400	1,100.00	440,000
プロパティエージェント	100	1,126.00	112,600
ケイアイスター不動産	300	1,729.00	518,700
アグレ都市デザイン	100	500.00	50,000
グッドコムアセット	200	1,497.00	299,400
テンポイノベーション	100	1,637.00	163,700
グローバルリンクマネジメント	100	587.00	58,700
住江織物	300	3,000.00	900,000
日本フェルト	700	452.00	316,400
イチカワ	200	1,786.00	357,200
エコナックホールディングス	2,300	127.00	292,100
日東製網	100	1,438.00	143,800
芦森工業	300	1,623.00	486,900
アツギ	1,000	911.00	911,000
ウイルプラスHLDGS	100	811.00	81,100
ジャパンミート	500	1,894.00	947,000
コメダホールディングス	3,000	2,078.00	6,234,000
サツドラホールディングス	200	1,878.00	375,600
デファクトスタンダード	100	362.00	36,200
アレンザホールディングス	700	919.00	643,300
パロックジャパン	1,000	905.00	905,000
クスリのアオキHLDGS	1,100	7,190.00	7,909,000
ダイニック	500	745.00	372,500
共和レザー	700	806.00	564,200
力の源HD	300	925.00	277,500
スシローグローバルHLDGS	1,500	6,690.00	10,035,000
LIXILビバ	1,000	1,253.00	1,253,000
セーレン	3,200	1,540.00	4,928,000
ソトー	500	970.00	485,000
東海染工	200	1,128.00	225,600
小松マテーレ	2,200	786.00	1,729,200

ワコールホールディングス	3,900	2,806.00	10,943,400
ホギメディカル	1,700	3,175.00	5,397,500
レナウン	3,900	102.00	397,800
クラウドディアHLDGS	300	528.00	158,400
T S Iホールディングス	4,800	635.00	3,048,000
マツオカコーポレーション	400	2,610.00	1,044,000
ワールド	1,000	2,040.00	2,040,000
T I S	4,400	5,790.00	25,476,000
ネオス	400	999.00	399,600
電算システム	500	3,450.00	1,725,000
グリー	7,200	524.00	3,772,800
コーエーテクモHD	2,700	2,035.00	5,494,500
三菱総合研究所	500	3,425.00	1,712,500
ボルテージ	200	526.00	105,200
電算	100	2,011.00	201,100
A G S	700	664.00	464,800
ファインデックス	1,000	982.00	982,000
ブレインパッド	300	6,580.00	1,974,000
K L a b	2,300	1,012.00	2,327,600
ポルトゥウィン・ピットクル	1,800	1,120.00	2,016,000
イーブックイニシアティブ	200	2,119.00	423,800
ネクソン	33,200	1,697.00	56,340,400
アイスタイル	3,500	834.00	2,919,000
エムアップ	400	2,503.00	1,001,200
エイチーム	800	1,199.00	959,200
エニグモ	400	2,501.00	1,000,400
テクノスジャパン	1,000	590.00	590,000
e n i s h	400	634.00	253,600
コロブラ	3,800	718.00	2,728,400
オルトプラス	700	267.00	186,900
ブロードリーフ	6,500	574.00	3,731,000
クロス・マーケティングG	300	383.00	114,900
デジタルハーツHLDGS	500	1,102.00	551,000
システム情報	600	1,144.00	686,400
メディアドゥHLDGS	200	3,640.00	728,000
じげん	1,500	791.00	1,186,500
ブイキューブ	600	595.00	357,000
エンカレッジ・テクノロジー	200	837.00	167,400
サイバーリンクス	200	1,196.00	239,200
ディー・エル・イー	800	201.00	160,800

フィックスターズ	1,400	1,975.00	2,765,000
CARTA HOLDINGS	600	1,341.00	804,600
オブティム	600	3,160.00	1,896,000
セレス	400	1,941.00	776,400
特種東海製紙	800	3,905.00	3,124,000
ティーガイア	1,400	2,114.00	2,959,600
セック	200	3,675.00	735,000
日本アジアグループ	1,500	354.00	531,000
豆蔵ホールディングス	800	1,447.00	1,157,600
テクマトリックス	800	2,031.00	1,624,800
プロシップ	400	1,260.00	504,000
ガンホー・オンライン・エンター	3,140	3,030.00	9,514,200
GMOペイメントゲートウェイ	2,200	7,140.00	15,708,000
ザッパラス	600	345.00	207,000
システムリサーチ	200	3,805.00	761,000
インターネットイニシアティブ	2,200	2,130.00	4,686,000
さくらインターネット	1,600	585.00	936,000
ヴィンクス	400	1,130.00	452,000
GMOクラウド	300	3,125.00	937,500
SRAホールディングス	600	2,586.00	1,551,600
MINORIソリューションズ	200	1,960.00	392,000
システムインテグレータ	400	752.00	300,800
朝日ネット	1,000	725.00	725,000
eBASE	800	1,180.00	944,000
アバント	300	2,050.00	615,000
アドソル日進	400	1,664.00	665,600
フリービット	800	1,046.00	836,800
コムチュア	700	4,215.00	2,950,500
サイバーコム	200	1,922.00	384,400
アステリア	600	1,050.00	630,000
王子ホールディングス	58,600	588.00	34,456,800
日本製紙	6,300	1,901.00	11,976,300
三菱製紙	2,200	589.00	1,295,800
北越コーポレーション	8,700	561.00	4,880,700
中越パルプ	500	1,571.00	785,500
巴川製紙	400	886.00	354,400
大王製紙	6,400	1,290.00	8,256,000
阿波製紙	300	443.00	132,900
マークラインズ	400	1,944.00	777,600
メディカル・データ・ビジ	1,100	1,196.00	1,315,600

g u m i	1,600	562.00	899,200
ショーケース	300	583.00	174,900
モバイルファクトリー	300	1,545.00	463,500
テラスカイ	200	1,635.00	327,000
デジタル・インフォメーション	500	1,806.00	903,000
P C Iホールディングス	200	2,235.00	447,000
パイプドHD	200	1,248.00	249,600
アイピーシー	200	1,318.00	263,600
ネオジャパン	200	965.00	193,000
P R T I M E S	100	2,980.00	298,000
ランドコンピュータ	100	1,116.00	111,600
ダブルスタンダード	100	4,850.00	485,000
オーブンドア	600	2,891.00	1,734,600
マイネット	400	723.00	289,200
アカツキ	400	6,890.00	2,756,000
ベネフィットジャパン	100	900.00	90,000
U B I C O Mホールディングス	200	1,748.00	349,600
L I N E	4,100	3,150.00	12,915,000
カナミックネットワーク	200	2,273.00	454,600
ノムラシステムコーポレーション	100	938.00	93,800
レンゴー	13,400	830.00	11,122,000
トーモク	700	1,816.00	1,271,200
ザ・パック	900	3,300.00	2,970,000
チェンジ	200	2,460.00	492,000
シンクロ・フード	500	567.00	283,500
オークネット	600	1,320.00	792,000
エイトレッド	100	1,824.00	182,400
A O I T Y O H O L D I N G S	1,500	679.00	1,018,500
マクロミル	1,700	1,326.00	2,254,200
ビーグリー	200	901.00	180,200
オロ	200	2,492.00	498,400
テモナ	200	486.00	97,200
サインポスト	200	3,000.00	600,000
昭和電工	8,700	2,944.00	25,612,800
住友化学	102,400	483.00	49,459,200
住友精化	600	3,275.00	1,965,000
日産化学	8,100	4,645.00	37,624,500
ラサ工業	400	1,406.00	562,400
クレハ	1,300	7,120.00	9,256,000
多木化学	400	4,190.00	1,676,000

テイカ	1,000	2,425.00	2,425,000	
石原産業	2,500	1,197.00	2,992,500	
片倉コープアグリ	300	1,055.00	316,500	
日東エフシー	800	1,196.00	956,800	
日本曹達	2,100	2,688.00	5,644,800	
東ソー	20,100	1,485.00	29,848,500	
トクヤマ	3,900	2,718.00	10,600,200	
セントラル硝子	2,800	2,449.00	6,857,200	
東亜合成	8,300	1,153.00	9,569,900	
大阪ソーダ	1,500	2,626.00	3,939,000	
関東電化	3,100	712.00	2,207,200	
デンカ	5,100	3,130.00	15,963,000	
イビデン	8,200	1,800.00	14,760,000	
信越化学	22,900	9,691.00	221,923,900	
日本カ - バイド	400	1,369.00	547,600	
堺 化 学	800	2,598.00	2,078,400	
第一稀元素化学工	1,200	862.00	1,034,400	
エア・ウォーター	10,700	1,746.00	18,682,200	
大陽日酸	10,800	2,139.00	23,101,200	
日本化学工業	400	2,114.00	845,600	
東邦アセチレン	200	1,300.00	260,000	
日本パ - カライジング	7,100	1,180.00	8,378,000	
高压ガス	2,100	860.00	1,806,000	
チタン工業	200	3,005.00	601,000	
四国化成	2,200	1,150.00	2,530,000	
戸田工業	300	2,318.00	695,400	
ステラ ケミファ	700	2,763.00	1,934,100	
保土谷化学	400	2,746.00	1,098,400	
日本触媒	2,200	7,100.00	15,620,000	
大日精化	1,000	3,085.00	3,085,000	
カネカ	3,600	3,995.00	14,382,000	
協和キリン	15,600	1,913.00	29,842,800	
三菱瓦斯化学	13,400	1,411.00	18,907,400	
三井化学	11,800	2,524.00	29,783,200	
J S R	13,100	1,633.00	21,392,300	
東京応化工業	2,300	3,370.00	7,751,000	
大阪有機化学	1,300	957.00	1,244,100	
三菱ケミカルH L D G S	87,000	743.40	64,675,800	
K H ネオケム	2,000	2,831.00	5,662,000	
ダイセル	20,200	934.00	18,866,800	

住友ベークライト	2,300	3,560.00	8,188,000
積水化学	28,500	1,604.00	45,714,000
日本ゼオン	11,700	1,168.00	13,665,600
アイカ工業	4,000	3,600.00	14,400,000
宇部興産	6,600	2,185.00	14,421,000
積水樹脂	2,200	2,090.00	4,598,000
タキロンシーアイ	2,800	656.00	1,836,800
旭有機材	800	1,386.00	1,108,800
日立化成	6,100	2,945.00	17,964,500
ニチバン	600	2,023.00	1,213,800
リケンテクノス	3,700	532.00	1,968,400
大倉工業	600	1,730.00	1,038,000
積水化成品	2,000	756.00	1,512,000
群栄化学	300	2,408.00	722,400
タイガース ポリマー	600	569.00	341,400
ミライアル	300	1,355.00	406,500
ダイキアクシス	400	865.00	346,000
ダイキョーニシカワ	2,700	896.00	2,419,200
竹本容器	400	1,252.00	500,800
森六ホールディングス	600	2,444.00	1,466,400
日本化薬	8,400	1,322.00	11,104,800
カーリットホールディングス	1,500	635.00	952,500
E P Sホールディングス	2,000	1,700.00	3,400,000
ソルクシーズ	500	979.00	489,500
レグス	300	1,827.00	548,100
プレステージ・インター	2,400	1,707.00	4,096,800
フェイス	500	882.00	441,000
プロトコーポレーション	1,000	1,069.00	1,069,000
ハイマックス	100	1,829.00	182,900
アミューズ	700	2,539.00	1,777,300
野村総合研究所	25,200	1,761.00	44,377,200
ドリームインキュベータ	400	1,385.00	554,000
サイバネットシステム	1,000	641.00	641,000
クイック	700	1,619.00	1,133,300
T A C	600	198.00	118,800
C Eホールディングス	300	1,131.00	339,300
ケネディクス	11,200	569.00	6,372,800
日本システム技術	200	1,774.00	354,800
電通	15,500	3,875.00	60,062,500
インテージホールディングス	1,700	937.00	1,592,900

テイクアンドギヴニーズ	400	1,114.00	445,600
東邦システムサイエンス	400	1,036.00	414,400
びあ	300	4,805.00	1,441,500
イオンファンタジー	400	2,383.00	953,200
ソースネクスト	5,000	439.00	2,195,000
シーティーエス	1,500	695.00	1,042,500
ネクシィーズグループ	400	2,076.00	830,400
インフォコム	1,200	2,449.00	2,938,800
メディカルシステムネットワーク	1,500	568.00	852,000
日本精化	1,000	1,234.00	1,234,000
扶桑化学工業	1,400	2,076.00	2,906,400
トリケミカル	300	4,570.00	1,371,000
F I G	1,100	337.00	370,700
A D E K A	6,500	1,603.00	10,419,500
日油	5,000	3,930.00	19,650,000
ミヨシ油脂	500	1,109.00	554,500
新日本理化	2,400	211.00	506,400
ハリマ化成グループ	1,000	1,031.00	1,031,000
アルテリア・ネットワークス	500	1,278.00	639,000
ヒト・コミュニケーションズHD	300	1,822.00	546,600
花 王	32,400	8,275.00	268,110,000
第一工業製薬	400	3,440.00	1,376,000
石原ケミカル	300	1,625.00	487,500
日華化学	400	845.00	338,000
ニイタカ	200	1,415.00	283,000
三洋化成	800	5,520.00	4,416,000
武田薬品	116,200	3,862.00	448,764,400
アステラス製薬	118,400	1,572.50	186,184,000
大日本住友製薬	9,800	2,006.00	19,658,800
塩野義製薬	17,000	6,238.00	106,046,000
田辺三菱製薬	13,900	1,237.00	17,194,300
わかもと製薬	1,700	266.00	452,200
あすか製薬	1,700	1,287.00	2,187,900
日本新薬	3,600	7,990.00	28,764,000
バイオフェルミン製薬	200	2,274.00	454,800
中外製薬	13,800	7,250.00	100,050,000
科研製薬	2,400	5,520.00	13,248,000
エーザイ	15,900	6,156.00	97,880,400
理研ビタミン	600	3,480.00	2,088,000
ロート製薬	6,800	3,045.00	20,706,000

小野薬品	31,300	2,021.50	63,272,950
久光製薬	4,000	4,410.00	17,640,000
有機合成薬品	900	235.00	211,500
持田製薬	2,000	4,705.00	9,410,000
参天製薬	25,100	1,772.00	44,477,200
扶桑薬品	400	1,920.00	768,000
日本ケミファ	200	2,933.00	586,600
ツムラ	4,200	3,060.00	12,852,000
日医工	3,400	1,287.00	4,375,800
テルモ	37,600	3,291.00	123,741,600
みらかホールディングス	3,700	2,508.00	9,279,600
キッセイ薬品工業	2,400	2,737.00	6,568,800
生化学工業	2,600	1,285.00	3,341,000
栄研化学	2,400	1,806.00	4,334,400
日水製薬	500	1,225.00	612,500
鳥居薬品	700	2,634.00	1,843,800
JCRファーマ	900	6,520.00	5,868,000
東和薬品	2,000	2,887.00	5,774,000
富士製薬工業	800	1,455.00	1,164,000
沢井製薬	2,700	6,120.00	16,524,000
ゼリア新薬工業	2,600	2,124.00	5,522,400
第一三共	37,900	5,955.00	225,694,500
キョーリン製薬HD	2,900	1,877.00	5,443,300
大幸薬品	500	2,200.00	1,100,000
ダイト	700	3,420.00	2,394,000
大塚ホールディングス	25,400	3,886.00	98,704,400
大正製薬HD	2,900	8,480.00	24,592,000
ペプチドリーム	6,300	5,630.00	35,469,000
大日本塗料	1,600	1,028.00	1,644,800
日本ペイントHOLD	10,800	4,400.00	47,520,000
関西ペイント	14,700	2,092.00	30,752,400
神東塗料	900	172.00	154,800
中国塗料	4,300	926.00	3,981,800
日本特殊塗料	900	1,385.00	1,246,500
藤倉化成	1,800	578.00	1,040,400
太陽ホールディングス	1,000	3,235.00	3,235,000
DIC	6,000	2,811.00	16,866,000
サカタインクス	2,800	1,033.00	2,892,400
東洋インキSCホールディング	2,700	2,315.00	6,250,500
T&K TOKA	900	980.00	882,000

アルプス技研	1,320	1,645.00	2,171,400	
サニックス	2,300	236.00	542,800	
ダイオーズ	300	1,420.00	426,000	
日本空調サービス	1,500	726.00	1,089,000	
オリエンタルランド	15,100	13,830.00	208,833,000	
フォーカスシステムズ	800	871.00	696,800	
ダスキン	3,300	2,902.00	9,576,600	
パーク24	7,600	2,479.00	18,840,400	
明光ネットワークジャパン	1,700	995.00	1,691,500	
ファルコホールディングス	600	1,659.00	995,400	
クレスコ	400	3,815.00	1,526,000	
フジ・メディア・HD	13,500	1,478.00	19,953,000	
秀英予備校	300	427.00	128,100	
田谷	200	600.00	120,000	
ラウンドワン	4,000	1,584.00	6,336,000	
リゾートトラスト	5,300	1,625.00	8,612,500	
オービック	4,500	11,860.00	53,370,000	
ジャストシステム	1,900	3,550.00	6,745,000	
TDCソフト	1,100	872.00	959,200	
ヤフー	85,000	332.00	28,220,000	
ビー・エム・エル	1,700	3,095.00	5,261,500	
ワタベウェディング	200	622.00	124,400	
トレンドマイクロ	7,000	4,935.00	34,545,000	
りらいあコミュニケーション	2,300	1,278.00	2,939,400	
IDホールディングス	300	1,192.00	357,600	
リソー教育	6,500	500.00	3,250,000	
日本オラクル	2,200	8,810.00	19,382,000	
早稲田アカデミー	400	761.00	304,400	
アルファシステムズ	400	2,800.00	1,120,000	
フューチャー	1,800	2,100.00	3,780,000	
CAC HOLDINGS	900	1,325.00	1,192,500	
ソフトバンク・テクノ	500	2,343.00	1,171,500	
トーセ	300	855.00	256,500	
ユー・エス・エス	15,500	2,155.00	33,402,500	
オービックビジネスC	1,400	4,990.00	6,986,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	6,000	2,837.00	17,022,000	
アイティフォー	1,700	885.00	1,504,500	
東京個別指導学院	400	955.00	382,000	
東計電算	200	3,055.00	611,000	
サイバーエージェント	7,700	4,090.00	31,493,000	

楽天	59,100	1,169.00	69,087,900
エックスネット	200	906.00	181,200
クリーク・アンド・リバー社	700	1,275.00	892,500
テー・オー・ダブリュー	1,300	785.00	1,020,500
大塚商会	7,100	4,330.00	30,743,000
サイボウズ	1,600	1,400.00	2,240,000
ソフトブレーン	900	509.00	458,100
山田コンサルティングG P	600	2,096.00	1,257,600
セントラルスポーツ	400	3,185.00	1,274,000
パラカ	300	2,004.00	601,200
電通国際情報S	700	3,545.00	2,481,500
デジタルガレージ	2,500	3,655.00	9,137,500
イーエムシステムズ	1,000	1,641.00	1,641,000
ウェザーニューズ	400	3,160.00	1,264,000
C I J	900	996.00	896,400
東洋ビジネスエンジ	100	2,120.00	212,000
日本エンタープライズ	1,400	194.00	271,600
WOWOW	600	2,724.00	1,634,400
スカラ	900	936.00	842,400
インテリジェント ウェイブ	400	926.00	370,400
フルキャストホールディングス	1,400	2,360.00	3,304,000
エン・ジャパン	1,500	4,495.00	6,742,500
富士フイルムH L D G S	27,700	5,415.00	149,995,500
コニカミノルタ	29,000	1,081.00	31,349,000
資 生 堂	26,400	8,124.00	214,473,600
ライオン	18,400	2,103.00	38,695,200
高砂香料	800	2,953.00	2,362,400
マンダム	3,000	2,677.00	8,031,000
ミルボン	1,700	5,470.00	9,299,000
ファンケル	6,000	2,610.00	15,660,000
コーセー	2,300	17,820.00	40,986,000
コタ	600	1,183.00	709,800
シーボン	100	2,356.00	235,600
ポーラ・オルビスHD	5,800	2,969.00	17,220,200
ノエビアホールディングス	1,000	5,910.00	5,910,000
アジュバンコスメジャパン	300	938.00	281,400
エステー	900	1,640.00	1,476,000
アグロカネショウ	500	1,815.00	907,500
コ ニ シ	2,400	1,538.00	3,691,200
長谷川香料	1,700	1,974.00	3,355,800

星光PMC	800	775.00	620,000
小林製薬	3,800	7,730.00	29,374,000
荒川化学工業	1,300	1,494.00	1,942,200
メック	800	1,070.00	856,000
日本高純度化学	300	2,360.00	708,000
タカラバイオ	3,600	2,149.00	7,736,400
JCU	1,800	2,061.00	3,709,800
新田ゼラチン	800	725.00	580,000
OATアグリオ	200	1,369.00	273,800
デクセリアルズ	3,600	709.00	2,552,400
アース製薬	900	4,865.00	4,378,500
北興化学	1,500	488.00	732,000
大成ラミック	400	2,846.00	1,138,400
クミアイ化学	5,600	794.00	4,446,400
日本農薬	3,100	421.00	1,305,100
富士興産	500	1,032.00	516,000
ニチレキ	1,800	1,054.00	1,897,200
ユシロ化学	600	1,328.00	796,800
ビーピー・カストロール	400	1,361.00	544,400
富士石油	3,200	268.00	857,600
MORESCO	400	1,453.00	581,200
出光興産	15,300	3,190.00	48,807,000
JXTGホールディングス	223,200	535.10	119,434,320
コスモエネルギーHLDGS	3,900	2,446.00	9,539,400
横浜ゴム	7,800	2,042.00	15,927,600
TOYO TIRE	6,800	1,507.00	10,247,600
ブリヂストン	40,900	4,204.00	171,943,600
住友ゴム	11,900	1,232.00	14,660,800
藤倉コンポジット	1,300	433.00	562,900
オカモト	900	4,960.00	4,464,000
アキレス	900	2,067.00	1,860,300
フコク	500	742.00	371,000
ニッタ	1,600	3,055.00	4,888,000
クリエートメディック	400	931.00	372,400
住友理工	2,600	834.00	2,168,400
三ツ星ベルト	1,800	2,022.00	3,639,600
バンドー化学	2,500	979.00	2,447,500
AGC	13,200	3,680.00	48,576,000
日本板硝子	6,400	719.00	4,601,600
石塚硝子	200	2,136.00	427,200

有沢製作所	2,100	889.00	1,866,900
日本山村硝子	500	1,401.00	700,500
日本電気硝子	5,900	2,738.00	16,154,200
オハラ	500	1,557.00	778,500
住友大阪セメント	2,700	4,115.00	11,110,500
太平洋セメント	8,500	3,175.00	26,987,500
リソルホールディングス	100	4,075.00	407,500
日本ヒューム	1,400	707.00	989,800
日本コンクリート	2,800	290.00	812,000
三谷セキサン	600	2,992.00	1,795,200
アジアパイルHD	1,900	570.00	1,083,000
東海カーボン	12,000	1,052.00	12,624,000
日本カーボン	600	4,110.00	2,466,000
東洋炭素	700	2,215.00	1,550,500
ノリタケ	700	4,495.00	3,146,500
TOTO	10,300	4,330.00	44,599,000
日本碍子	16,200	1,564.00	25,336,800
日本特殊陶業	11,200	1,931.00	21,627,200
ダントーホールディングス	1,000	114.00	114,000
MARUWA	400	5,690.00	2,276,000
品川リフクトリーズ	300	2,922.00	876,600
黒崎播磨	200	6,040.00	1,208,000
ヨータイ	1,100	540.00	594,000
イソライト	600	457.00	274,200
東京窯業	1,800	296.00	532,800
ニッカトー	600	674.00	404,400
フジミインコーポレーテッド	1,300	2,232.00	2,901,600
クニミネ工業	400	870.00	348,000
エーアンドエーマテリアル	200	1,019.00	203,800
ニチアス	3,700	1,960.00	7,252,000
日本製鉄	61,000	1,813.00	110,593,000
神戸製鋼所	24,100	692.00	16,677,200
中山製鋼所	1,900	497.00	944,300
合同製鐵	600	2,089.00	1,253,400
JFEホールディングス	35,400	1,523.50	53,931,900
東京製鐵	7,000	823.00	5,761,000
共英製鋼	1,600	1,864.00	2,982,400
大和工業	2,800	3,095.00	8,666,000
東京鐵鋼	500	1,305.00	652,500
大阪製鐵	800	1,718.00	1,374,400

淀川製鋼所	1,800	2,086.00	3,754,800	
丸一鋼管	4,700	2,857.00	13,427,900	
モリ工業	400	1,958.00	783,200	
大同特殊鋼	2,200	3,990.00	8,778,000	
日本高周波	400	466.00	186,400	
日本冶金工	10,900	224.00	2,441,600	
山陽特殊製鋼	1,700	1,436.00	2,441,200	
愛知製鋼	700	3,175.00	2,222,500	
日立金属	14,100	1,186.00	16,722,600	
日本金属	300	910.00	273,000	
大平洋金属	800	2,259.00	1,807,200	
新日本電工	8,000	203.00	1,624,000	
栗本鉄工所	600	1,498.00	898,800	
虹 技	200	1,342.00	268,400	
日本鑄鉄管	100	1,312.00	131,200	
日本製鋼所	4,100	1,796.00	7,363,600	
三菱製鋼	900	1,230.00	1,107,000	
日亜鋼業	2,000	339.00	678,000	
日本精線	200	2,628.00	525,600	
エンビプロHD	300	672.00	201,600	
大紀アルミニウム	2,200	770.00	1,694,000	
日本軽金属HD	35,700	228.00	8,139,600	
三井金属	3,700	2,428.00	8,983,600	
東邦亜鉛	700	2,453.00	1,717,100	
三菱マテリアル	8,700	2,999.00	26,091,300	
住友鉱山	18,000	3,135.00	56,430,000	
DOWAホールディングス	3,000	3,370.00	10,110,000	
古河機金	2,200	1,388.00	3,053,600	
エス・サイエンス	5,900	62.00	365,800	
大阪チタニウム	1,600	1,816.00	2,905,600	
東邦チタニウム	2,400	1,016.00	2,438,400	
UACJ	2,000	1,808.00	3,616,000	
CKサンエツ	200	2,800.00	560,000	
古河電工	3,900	3,175.00	12,382,500	
住友電工	49,000	1,415.50	69,359,500	
フジクラ	15,800	413.00	6,525,400	
昭和電線HLDGS	1,600	889.00	1,422,400	
東京特殊電線	200	1,839.00	367,800	
タツタ電線	2,600	521.00	1,354,600	
カナレ電気	200	1,880.00	376,000	

平河ビューテック	500	1,232.00	616,000	
リョービ	1,700	2,043.00	3,473,100	
アーレステイ	1,700	562.00	955,400	
アサヒHD	2,500	2,285.00	5,712,500	
東洋製罐グループHD	8,400	2,059.00	17,295,600	
ホッカホールディングス	600	1,731.00	1,038,600	
コロナ	700	1,083.00	758,100	
横河ブリッジHLDGS	2,500	1,681.00	4,202,500	
OSJBHD	6,600	259.00	1,709,400	
駒井ハルテック	200	1,673.00	334,600	
高田機工	100	2,503.00	250,300	
三和ホールディングス	13,600	1,138.00	15,476,800	
文化シャツタ-	4,000	858.00	3,432,000	
三協立山	1,900	1,208.00	2,295,200	
アルインコ	1,000	1,005.00	1,005,000	
東洋シャツタ-	300	692.00	207,600	
LIXILグループ	19,400	1,802.00	34,958,800	
日本ファイルコン	900	479.00	431,100	
ノーリツ	2,900	1,338.00	3,880,200	
長府製作所	1,400	2,268.00	3,175,200	
リンナイ	2,400	6,940.00	16,656,000	
ユニプレス	2,600	1,781.00	4,630,600	
ダイニチ工業	700	632.00	442,400	
日東精工	1,900	590.00	1,121,000	
三洋工業	200	1,793.00	358,600	
岡部	2,700	933.00	2,519,100	
ジーテクト	1,500	1,515.00	2,272,500	
中国工業	200	580.00	116,000	
東プレ	2,500	1,735.00	4,337,500	
高周波熱錬	2,500	888.00	2,220,000	
東京製綱	700	985.00	689,500	
サンコール	700	518.00	362,600	
モリテックスチル	900	376.00	338,400	
パイオラックス	2,100	1,903.00	3,996,300	
エイチワン	1,400	756.00	1,058,400	
日本発条	13,100	838.00	10,977,800	
中央発条	100	2,891.00	289,100	
アドバネクス	200	1,705.00	341,000	
三浦工業	5,800	3,170.00	18,386,000	
タクマ	4,800	1,380.00	6,624,000	

テクノプロ・ホールディング	2,400	6,190.00	14,856,000	
アトラ	200	286.00	57,200	
インターワークス	200	717.00	143,400	
アイ・アールジャパンHD	400	2,620.00	1,048,000	
K e e P e r 技研	400	1,322.00	528,800	
ファーストロジック	200	601.00	120,200	
三機サービス	200	1,206.00	241,200	
G u n o s y	700	1,870.00	1,309,000	
デザインワン・ジャパン	200	331.00	66,200	
イー・ガーディアン	600	1,902.00	1,141,200	
リブセンス	600	254.00	152,400	
ジャパンマテリアル	3,600	1,512.00	5,443,200	
ベクトル	1,600	1,075.00	1,720,000	
ウチヤマホールディングス	600	537.00	322,200	
チャームケアコーポレーション	100	1,737.00	173,700	
ライクキッズネクスト	100	1,051.00	105,100	
キャリアリンク	400	603.00	241,200	
I B J	800	977.00	781,600	
アサンテ	500	2,111.00	1,055,500	
N・フィールド	800	724.00	579,200	
バリューHR	200	3,350.00	670,000	
M&Aキャピタルパートナー	300	6,140.00	1,842,000	
ライドオンエクスプレスHD	500	1,190.00	595,000	
E R Iホールディングス	300	818.00	245,400	
アビスト	200	2,684.00	536,800	
シグマクシス	600	1,321.00	792,600	
ウィルグループ	800	902.00	721,600	
エスクローAJ	1,800	268.00	482,400	
日本ビューホテル	400	1,434.00	573,600	
リクルートホールディングス	91,200	3,495.00	318,744,000	
エラン	800	1,770.00	1,416,000	
ツガミ	2,900	941.00	2,728,900	
オークマ	1,700	5,540.00	9,418,000	
東芝機械	1,600	2,386.00	3,817,600	
アマダホールディングス	20,200	1,199.00	24,219,800	
アイダエンジニア	3,800	902.00	3,427,600	
滝澤鉄工所	400	1,421.00	568,400	
F U J I	4,000	1,407.00	5,628,000	
牧野フライス	1,600	4,435.00	7,096,000	
オーエスジー	6,500	2,190.00	14,235,000	

ダイジェット	100	1,656.00	165,600
旭ダイヤモンド	3,600	678.00	2,440,800
D M G 森精機	8,400	1,773.00	14,893,200
ソディック	2,900	965.00	2,798,500
ディスコ	1,800	18,450.00	33,210,000
日東工器	700	2,173.00	1,521,100
日進工具	400	2,062.00	824,800
パンチ工業	800	583.00	466,400
富士ダイス	500	689.00	344,500
土木管理総合試験	500	462.00	231,000
ネットマーケティング	400	551.00	220,400
ベルシステム24HLDGS	2,200	1,595.00	3,509,000
鎌倉新書	900	1,469.00	1,322,100
ソネット・メディア・ネットワー	100	869.00	86,900
一蔵	100	690.00	69,000
L I T A L I C O	300	1,903.00	570,900
グローバルキッズCOMP	100	1,009.00	100,900
エポラブルアジア	300	2,534.00	760,200
アトラエ	200	2,744.00	548,800
ストライク	300	2,350.00	705,000
ソラスト	3,000	1,086.00	3,258,000
セラク	300	660.00	198,000
インソース	400	2,413.00	965,200
豊田自動織機	10,800	5,890.00	63,612,000
豊和工業	700	860.00	602,000
OKK	500	825.00	412,500
石川製作所	300	1,426.00	427,800
東洋機械金属	900	595.00	535,500
津田駒工業	300	1,607.00	482,100
エンシュウ	300	1,190.00	357,000
島精機製作所	1,900	3,135.00	5,956,500
オプトラン	1,400	2,566.00	3,592,400
NCホールディングス	400	480.00	192,000
イワキポンプ	500	1,136.00	568,000
フリー	1,000	1,148.00	1,148,000
ヤマシンフィルタ	2,300	642.00	1,476,600
日阪製作所	1,700	898.00	1,526,600
やまびこ	2,600	922.00	2,397,200
平田機工	600	6,240.00	3,744,000
ペガサスミシン製造	1,300	567.00	737,100

マルマエ	300	798.00	239,400
タツモ	400	812.00	324,800
ナブテスコ	7,200	2,961.00	21,319,200
三井海洋開発	1,500	2,942.00	4,413,000
レオン自動機	1,400	1,801.00	2,521,400
S M C	4,000	39,620.00	158,480,000
ヤマハモーターロボH L D G S	900	437.00	393,300
ホソカワミクロン	400	4,445.00	1,778,000
ユニオンツール	500	3,090.00	1,545,000
オイレス工業	1,900	1,566.00	2,975,400
日精エーエスピー	400	2,527.00	1,010,800
サト - ホールディングス	1,700	2,724.00	4,630,800
技研製作所	800	3,250.00	2,600,000
日本エアーテック	400	584.00	233,600
カワタ	200	1,076.00	215,200
日精樹脂工業	1,000	1,029.00	1,029,000
オカダアイヨン	400	1,294.00	517,600
ワイエイシーホールディングス	500	944.00	472,000
小松製作所	60,000	2,523.50	151,410,000
住友重機械	7,600	3,615.00	27,474,000
日立建機	5,300	2,731.00	14,474,300
日工	300	2,948.00	884,400
巴工業	500	2,384.00	1,192,000
井関農機	1,400	1,559.00	2,182,600
T O W A	1,100	832.00	915,200
丸山製作所	300	1,113.00	333,900
北川鉄工所	600	2,208.00	1,324,800
シンニッタン	2,100	338.00	709,800
ローツェ	500	2,319.00	1,159,500
タカキタ	400	558.00	223,200
クボタ	71,000	1,747.00	124,037,000
荏原実業	400	2,002.00	800,800
東洋エンジニア	1,800	554.00	997,200
三菱化工機	400	1,659.00	663,600
月島機械	2,600	1,254.00	3,260,400
帝国電機製作所	900	1,201.00	1,080,900
東京機械	500	417.00	208,500
新東工業	3,100	954.00	2,957,400
渋谷工業	1,300	2,952.00	3,837,600
アイチ コーポレーション	2,300	713.00	1,639,900

小森コーポレーション	3,700	1,169.00	4,325,300
鶴見製作所	1,000	1,936.00	1,936,000
住友精密	200	2,764.00	552,800
酒井重工業	200	2,690.00	538,000
荏原製作所	6,000	2,889.00	17,334,000
石井鉄工所	200	1,993.00	398,600
西島製作所	1,500	1,044.00	1,566,000
北越工業	1,500	1,222.00	1,833,000
千代田化工建	10,800	313.00	3,380,400
ダイキン工業	18,100	14,160.00	256,296,000
オルガノ	400	3,560.00	1,424,000
ト - ヨ - カネツ	500	2,128.00	1,064,000
栗田工業	7,200	2,740.00	19,728,000
椿本チエイン	1,800	3,520.00	6,336,000
大同工業	600	881.00	528,600
日 機 装	4,300	1,410.00	6,063,000
木村化工機	1,000	349.00	349,000
レイズネクスト	2,700	1,195.00	3,226,500
アネスト岩田	2,100	948.00	1,990,800
ダイフク	7,300	5,950.00	43,435,000
サムコ	300	871.00	261,300
加藤製作所	600	2,007.00	1,204,200
油研工業	200	1,696.00	339,200
タダノ	6,500	1,084.00	7,046,000
フジテック	4,800	1,405.00	6,744,000
C K D	3,800	1,117.00	4,244,600
キトー	900	1,652.00	1,486,800
平和	3,800	2,177.00	8,272,600
理想科学工業	1,300	1,733.00	2,252,900
S A N K Y O	3,500	3,890.00	13,615,000
日本金銭機械	1,600	1,100.00	1,760,000
マースグループH L D G S	800	2,038.00	1,630,400
福島工業	800	3,410.00	2,728,000
オーイズミ	500	384.00	192,000
ダイコク電機	600	1,351.00	810,600
竹内製作所	2,300	1,768.00	4,066,400
ア マ ノ	3,900	3,040.00	11,856,000
J U K I	1,900	1,013.00	1,924,700
サンデンホールディングス	1,700	555.00	943,500
蛇の目ミシン	1,300	461.00	599,300

ブラザー工業	17,400	2,098.00	36,505,200
マックス	2,100	1,588.00	3,334,800
モリタホールディングス	2,300	1,885.00	4,335,500
グローリー	3,800	2,902.00	11,027,600
新晃工業	1,300	1,655.00	2,151,500
大和冷機工業	2,000	1,064.00	2,128,000
セガサミーホールディングス	13,200	1,349.00	17,806,800
日本ピストンリング	400	1,400.00	560,000
リケン	600	4,145.00	2,487,000
TPR	1,900	1,843.00	3,501,700
ツバキ・ナカシマ	2,100	1,818.00	3,817,800
ホシザキ	4,000	7,690.00	30,760,000
大豊工業	1,000	820.00	820,000
日本精工	27,200	940.00	25,568,000
NTN	28,600	314.00	8,980,400
ジェイテクト	12,800	1,315.00	16,832,000
不二越	1,300	4,475.00	5,817,500
ミネベアミツミ	24,600	1,785.00	43,911,000
日本トムソン	4,000	497.00	1,988,000
THK	8,400	2,599.00	21,831,600
ユーシン精機	1,000	1,010.00	1,010,000
前澤給装工業	500	2,001.00	1,000,500
イーグル工業	1,700	1,036.00	1,761,200
前澤工業	900	365.00	328,500
日本ピラ - 工業	1,400	1,030.00	1,442,000
キッツ	5,300	740.00	3,922,000
日立	59,700	4,057.00	242,202,900
三菱電機	132,800	1,450.00	192,560,000
富士電機	8,700	3,695.00	32,146,500
東洋電機製造	500	1,301.00	650,500
安川電機	15,400	3,550.00	54,670,000
シンフォニアテクノロジー	1,900	1,262.00	2,397,800
明電舎	2,600	1,697.00	4,412,200
オリジン	300	1,475.00	442,500
山洋電気	600	4,245.00	2,547,000
デンヨー	1,300	1,545.00	2,008,500
ベイカレントコンサルティング	300	4,030.00	1,209,000
ORCHESTRA HLDGS	100	1,277.00	127,700
アイモバイル	300	800.00	240,000
キャリアインデックス	400	822.00	328,800

MS - J a p a n	500	1,646.00	823,000
船場	200	957.00	191,400
グレイステクノロジー	300	2,560.00	768,000
ジャパンエレベーターSHD	700	2,719.00	1,903,300
フルテック	100	1,176.00	117,600
グリーンズ	300	1,532.00	459,600
ツナググループHLDGS	100	605.00	60,500
ソウルドアウト	100	2,339.00	233,900
MS & CONSULTING	200	1,113.00	222,600
日総工産	600	1,532.00	919,200
キュービーネットHLDGS	600	2,413.00	1,447,800
RPAホールディングス	400	2,362.00	944,800
三桜工業	1,800	450.00	810,000
マキタ	16,100	3,685.00	59,328,500
東芝テック	1,700	3,130.00	5,321,000
芝浦メカトロニクス	200	2,726.00	545,200
マブチモーター	3,800	3,750.00	14,250,000
日本電産	16,000	14,315.00	229,040,000
ユーエムシーエレクトロニクス	700	1,333.00	933,100
トレックス・セミコンダクター	400	1,187.00	474,800
東光高岳	600	1,205.00	723,000
ダブル・スコープ	2,000	1,433.00	2,866,000
宮越ホールディングス	500	906.00	453,000
ダイヘン	1,500	3,025.00	4,537,500
田淵電機	1,900	115.00	218,500
ヤーマン	2,000	938.00	1,876,000
JVCケンウッド	10,000	253.00	2,530,000
ミマキエンジニアリング	1,300	624.00	811,200
第一精工	500	1,280.00	640,000
日新電機	3,100	1,219.00	3,778,900
大崎電気	2,600	700.00	1,820,000
オムロン	14,100	5,480.00	77,268,000
日東工業	2,200	2,103.00	4,626,600
I D E C	1,800	2,032.00	3,657,600
正興電機製作所	200	764.00	152,800
不二電機工業	100	1,273.00	127,300
ジーエス・ユアサ コーポ	4,800	2,125.00	10,200,000
サクサホールディングス	300	1,967.00	590,100
メルコホールディングス	500	3,060.00	1,530,000
テクノメディカ	300	2,151.00	645,300

日本電気	17,200	4,385.00	75,422,000
富士通	12,900	7,778.00	100,336,200
沖電気	5,900	1,325.00	7,817,500
岩崎通信機	600	800.00	480,000
電気興業	600	2,970.00	1,782,000
サンケン電気	1,600	2,333.00	3,732,800
ナカヨ	200	1,629.00	325,800
アイホン	700	1,686.00	1,180,200
ルネサスエレクトロニクス	13,700	612.00	8,384,400
セイコーエプソン	16,600	1,735.00	28,801,000
ワコム	9,600	373.00	3,580,800
アルバック	2,600	3,580.00	9,308,000
アクセル	500	717.00	358,500
E I Z O	1,300	4,040.00	5,252,000
ジャパンディスプレイ	31,400	81.00	2,543,400
日本信号	3,500	1,226.00	4,291,000
京三製作所	2,800	375.00	1,050,000
能美防災	1,800	2,310.00	4,158,000
ホーチキ	800	1,333.00	1,066,400
星和電機	500	529.00	264,500
エレコム	1,300	3,835.00	4,985,500
パナソニック	151,600	927.50	140,609,000
シャープ	13,200	1,395.00	18,414,000
アンリツ	8,600	1,859.00	15,987,400
富士通ゼネラル	4,100	1,697.00	6,957,700
ソニー	89,300	5,955.00	531,781,500
T D K	7,000	8,460.00	59,220,000
帝国通信工業	500	1,184.00	592,000
タムラ製作所	5,100	590.00	3,009,000
アルプスアルパイン	13,800	1,818.00	25,088,400
池上通信機	400	1,111.00	444,400
日本電波工業	1,300	492.00	639,600
鈴木	600	646.00	387,600
日本トリム	200	5,030.00	1,006,000
ローランド ディー . ジー .	600	2,491.00	1,494,600
フオスタ - 電機	1,600	1,613.00	2,580,800
S M K	300	2,804.00	841,200
ヨコオ	900	2,193.00	1,973,700
ティアック	900	205.00	184,500
ホシデン	4,000	1,195.00	4,780,000

ヒロセ電機	2,000	11,980.00	23,960,000
日本航空電子	3,000	1,528.00	4,584,000
T O A	1,500	1,264.00	1,896,000
マクセルホールディングス	2,800	1,543.00	4,320,400
古野電気	1,800	1,026.00	1,846,800
ユニデンホールディングス	400	1,952.00	780,800
スミダコーポレーション	1,200	1,158.00	1,389,600
アイコム	700	2,480.00	1,736,000
リオン	600	2,150.00	1,290,000
本多通信工業	1,000	500.00	500,000
船井電機	1,400	803.00	1,124,200
横河電機	13,300	2,122.00	28,222,600
新電元工業	400	3,545.00	1,418,000
アズビル	8,600	2,650.00	22,790,000
東亜ディーケーケー	600	819.00	491,400
日本光電工業	6,000	2,968.00	17,808,000
チノール	400	1,431.00	572,400
共和電業	1,500	414.00	621,000
日本電子材料	500	531.00	265,500
堀場製作所	2,600	5,680.00	14,768,000
アドバンテスト	9,100	3,035.00	27,618,500
小野測器	600	549.00	329,400
エスベック	1,300	2,274.00	2,956,200
キーエンス	6,500	65,170.00	423,605,000
日置電機	600	3,545.00	2,127,000
シスメックス	10,400	7,407.00	77,032,800
日本マイクロニクス	2,200	978.00	2,151,600
メガチップス	1,000	1,424.00	1,424,000
O B A R A G R O U P	700	3,645.00	2,551,500
I M A G I C A G R O U P	1,000	650.00	650,000
澤藤電機	100	1,765.00	176,500
デンソー	29,200	4,564.00	133,268,800
原田工業	400	832.00	332,800
コーセル	1,800	1,147.00	2,064,600
イリソ電子工業	1,300	5,450.00	7,085,000
オプテックスグループ	2,400	1,358.00	3,259,200
千代田インテグレ	500	2,149.00	1,074,500
アイ・オー・データ	500	936.00	468,000
レーザーテック	2,700	4,360.00	11,772,000
スタンレー電気	9,400	2,667.00	25,069,800

岩崎電気	500	1,299.00	649,500
ウシオ電機	8,200	1,421.00	11,652,200
岡谷電機	900	381.00	342,900
ヘリオステクノH	1,300	633.00	822,900
エノモト	300	827.00	248,100
日本セラミック	1,400	2,964.00	4,149,600
遠藤照明	600	748.00	448,800
古河電池	900	646.00	581,400
双信電機	600	561.00	336,600
山一電機	900	1,049.00	944,100
図 研	800	1,745.00	1,396,000
日本電子	2,600	2,358.00	6,130,800
カ シ オ	11,700	1,312.00	15,350,400
ファナック	12,700	19,595.00	248,856,500
日本シイエムケイ	3,500	620.00	2,170,000
エンプラス	600	3,245.00	1,947,000
大真空	400	1,176.00	470,400
ロ - ム	6,500	7,270.00	47,255,000
浜松ホトニクス	9,500	4,185.00	39,757,500
三井ハイテック	1,600	1,184.00	1,894,400
新光電気工業	4,500	918.00	4,131,000
京 セ ラ	20,200	7,098.00	143,379,600
協栄産業	100	1,436.00	143,600
太陽誘電	6,000	2,095.00	12,570,000
村田製作所	41,900	4,849.00	203,173,100
双葉電子工業	2,200	1,414.00	3,110,800
日東電工	9,100	5,084.00	46,264,400
北陸電気工業	500	1,075.00	537,500
東海理化電機	3,600	1,812.00	6,523,200
ニチコン	4,200	895.00	3,759,000
日本ケミコン	900	1,683.00	1,514,700
K O A	2,100	1,379.00	2,895,900
三井E & S H D	4,800	938.00	4,502,400
日立造船	10,600	396.00	4,197,600
三菱重工業	22,300	4,789.00	106,794,700
川崎重工業	10,400	2,528.00	26,291,200
I H I	10,300	2,466.00	25,399,800
名村造船所	4,100	295.00	1,209,500
サノヤスホールディングス	1,800	213.00	383,400
スプリックス	300	1,716.00	514,800

日本車輛	400	2,528.00	1,011,200
三菱ロジスネクスト	1,700	1,134.00	1,927,800
近畿車輛	200	1,752.00	350,400
日産自動車	156,400	773.70	121,006,680
いすゞ自動車	42,000	1,221.00	51,282,000
トヨタ自動車	148,200	6,908.00	1,023,765,600
日野自動車	16,700	860.00	14,362,000
三菱自動車工業	49,100	512.00	25,139,200
エフテック	900	748.00	673,200
レシップホールディングス	400	805.00	322,000
G M B	200	846.00	169,200
ファルテック	200	805.00	161,000
武蔵精密工業	3,100	1,431.00	4,436,100
日産車体	2,600	1,070.00	2,782,000
新明和工業	6,100	1,342.00	8,186,200
極東開発工業	2,600	1,334.00	3,468,400
日信工業	2,400	1,484.00	3,561,600
トピー工業	1,000	2,400.00	2,400,000
ティラド	400	1,924.00	769,600
曙ブレーキ	7,300	129.00	941,700
タチエス	2,300	1,369.00	3,148,700
N O K	7,100	1,632.00	11,587,200
フタバ産業	3,800	634.00	2,409,200
K Y B	1,500	3,220.00	4,830,000
市光工業	2,000	720.00	1,440,000
大同メタル工業	2,200	662.00	1,456,400
プレス工業	6,600	490.00	3,234,000
ミクニ	1,800	374.00	673,200
太平洋工業	2,800	1,584.00	4,435,200
ケーヒン	3,000	1,540.00	4,620,000
河西工業	1,700	825.00	1,402,500
アイシン精機	11,000	3,690.00	40,590,000
マ ッ ダ	41,700	1,113.00	46,412,100
今仙電機製作所	1,300	925.00	1,202,500
本田技研	112,200	2,859.50	320,835,900
スズキ	24,300	4,723.00	114,768,900
S U B A R U	41,300	2,766.50	114,256,450
安永	600	1,444.00	866,400
ヤマハ発動機	18,900	1,898.00	35,872,200
ショーワ	3,100	1,446.00	4,482,600

小糸製作所	8,100	5,820.00	47,142,000
T B K	1,700	400.00	680,000
エクセディ	1,900	2,242.00	4,259,800
ミツバ	2,500	622.00	1,555,000
豊田合成	4,300	2,088.00	8,978,400
愛三工業	2,100	679.00	1,425,900
盟和産業	200	1,037.00	207,400
日本プラスト	1,000	725.00	725,000
ヨロズ	1,300	1,365.00	1,774,500
エフ・シー・シー	2,400	2,176.00	5,222,400
新家工業	300	1,504.00	451,200
シマノ	5,300	15,860.00	84,058,000
テイ・エス テック	3,000	3,015.00	9,045,000
ジャムコ	600	2,069.00	1,241,400
小野建	1,300	1,414.00	1,838,200
はるやまHLDGS	600	812.00	487,200
南陽	200	1,642.00	328,400
ノジマ	2,400	1,822.00	4,372,800
佐島電機	900	882.00	793,800
カッパ・クリエイト	1,900	1,411.00	2,680,900
エコートレーディング	300	543.00	162,900
伯東	800	1,233.00	986,400
コンドーテック	900	927.00	834,300
中山福	700	550.00	385,000
ライトオン	1,000	721.00	721,000
ナガイレーベン	2,000	2,384.00	4,768,000
ジーンズメイト	400	364.00	145,600
三菱食品	1,500	2,876.00	4,314,000
良品計画	1,900	20,020.00	38,038,000
三城ホールディングス	1,700	353.00	600,100
松田産業	900	1,525.00	1,372,500
第一興商	2,000	4,995.00	9,990,000
メディパルHD	14,100	2,406.00	33,924,600
アドヴァン	2,000	1,131.00	2,262,000
S P K	300	2,489.00	746,700
萩原電気HLDGS	400	2,941.00	1,176,400
アルビス	500	2,715.00	1,357,500
アズワン	900	9,120.00	8,208,000
スズデン	400	1,364.00	545,600
尾家産業	400	1,303.00	521,200

シモジマ	700	1,126.00	788,200
ドウシシャ	1,300	1,791.00	2,328,300
小津産業	300	1,738.00	521,400
コナカ	1,700	417.00	708,900
高速	700	1,228.00	859,600
ハウス ローゼ	100	1,628.00	162,800
G - 7ホールディングス	400	3,005.00	1,202,000
たけびし	400	1,391.00	556,400
イオン北海道	1,400	730.00	1,022,000
コジマ	2,000	505.00	1,010,000
ヒマラヤ	400	831.00	332,400
コーナン商事	1,800	2,332.00	4,197,600
ネットワンシステムズ	4,600	2,976.00	13,689,600
エコス	400	1,491.00	596,400
ワタミ	1,800	1,543.00	2,777,400
マルシェ	300	781.00	234,300
リックス	300	1,532.00	459,600
システムソフト	3,000	121.00	363,000
パンパシフィックHD	8,000	6,830.00	54,640,000
丸文	1,300	587.00	763,100
西松屋チェーン	2,900	865.00	2,508,500
ゼンショーホールディングス	6,300	2,308.00	14,540,400
ハピネット	1,000	1,326.00	1,326,000
幸楽苑ホールディングス	800	2,933.00	2,346,400
ハークスレイ	300	1,059.00	317,700
橋本総業HLDGS	200	1,602.00	320,400
日本ライフライン	4,200	1,934.00	8,122,800
サイゼリヤ	2,200	2,450.00	5,390,000
タカショー	600	460.00	276,000
エクセル	500	1,588.00	794,000
V Tホールディングス	4,700	415.00	1,950,500
マルカ	400	1,958.00	783,200
アルゴグラフィックス	1,000	2,431.00	2,431,000
魚力	300	1,502.00	450,600
IDOM	4,500	298.00	1,341,000
日本エム・ディ・エム	700	1,499.00	1,049,300
ポプラ	300	502.00	150,600
フジ・コーポレーション	200	2,093.00	418,600
ユナイテッドアローズ	1,600	3,300.00	5,280,000
進和	700	2,258.00	1,580,600

エスケイジャパン	300	595.00	178,500
ダイترون	600	1,210.00	726,000
ハイデイ日高	1,900	2,072.00	3,936,800
シークス	1,700	1,376.00	2,339,200
京都きもの友禅	800	344.00	275,200
コロワイド	4,400	2,139.00	9,411,600
ピーシーデポコーポ	1,800	448.00	806,400
田中商事	400	621.00	248,400
オーハシテクニカ	700	1,464.00	1,024,800
壺番屋	900	4,845.00	4,360,500
白銅	400	1,422.00	568,800
トップカルチャー	400	355.00	142,000
P L A N T	300	784.00	235,200
スギホールディングス	2,900	5,210.00	15,109,000
島津製作所	17,200	2,755.00	47,386,000
J M S	1,300	755.00	981,500
クボテック	300	427.00	128,100
長野計器	1,000	788.00	788,000
ブイ・テクノロジー	600	5,080.00	3,048,000
スター精密	2,300	1,407.00	3,236,100
東京計器	800	974.00	779,200
愛知時計	200	4,105.00	821,000
インターアクション	600	1,365.00	819,000
オーバル	1,400	262.00	366,800
東京精密	2,400	2,830.00	6,792,000
マニー	1,700	7,690.00	13,073,000
ニコン	23,300	1,568.00	36,534,400
トプコン	7,100	1,368.00	9,712,800
オリンパス	79,200	1,216.00	96,307,200
理研計器	1,300	2,013.00	2,616,900
S C R E E Nホールディングス	2,300	4,890.00	11,247,000
キヤノン電子	1,300	1,935.00	2,515,500
タムロン	1,100	2,207.00	2,427,700
H O Y A	26,700	7,998.00	213,546,600
シ ー ド	500	1,158.00	579,000
ノーリツ鋼機	1,000	2,105.00	2,105,000
エー・アンド・デイ	1,300	805.00	1,046,500
朝日インテック	10,000	2,764.00	27,640,000
キヤノン	71,500	3,193.00	228,299,500
リ コ ー	39,900	1,052.00	41,974,800

シチズン時計	14,600	565.00	8,249,000
リズム時計	400	1,334.00	533,600
大研医器	1,000	638.00	638,000
メニコン	1,900	3,710.00	7,049,000
シンシア	200	621.00	124,200
中本パックス	300	1,510.00	453,000
スノーピーク	300	1,449.00	434,700
パラマウントベッドHD	1,600	4,130.00	6,608,000
トランザクション	700	936.00	655,200
SHOBI	400	379.00	151,600
ニホンフラッシュ	500	2,814.00	1,407,000
前田工織	1,600	1,947.00	3,115,200
永大産業	1,800	359.00	646,200
アートネイチャー	1,500	668.00	1,002,000
バンダイナムコHLDGS	13,700	5,190.00	71,103,000
アイフィスジャパン	300	628.00	188,400
共立印刷	2,200	187.00	411,400
SHOEI	600	4,520.00	2,712,000
フランスベッドHLDGS	1,900	994.00	1,888,600
マーベラス	2,000	805.00	1,610,000
パイロットコーポレーション	2,300	4,160.00	9,568,000
萩原工業	700	1,354.00	947,800
エイベックス	2,300	1,416.00	3,256,800
トッパン・フォームズ	2,800	931.00	2,606,800
フジシールインターナショナル	3,000	3,460.00	10,380,000
タカラトミー	5,700	1,299.00	7,404,300
廣濟堂	1,300	699.00	908,700
エステールホールディングス	300	616.00	184,800
アーク	5,100	104.00	530,400
レック	1,500	1,219.00	1,828,500
タカノ	500	775.00	387,500
三光合成	1,100	364.00	400,400
プロネクサス	1,300	1,120.00	1,456,000
ホクシン	800	132.00	105,600
ウッドワン	400	1,021.00	408,400
大建工業	900	2,131.00	1,917,900
きもと	2,300	171.00	393,300
凸版印刷	18,900	1,744.00	32,961,600
大日本印刷	18,800	2,341.00	44,010,800
図書印刷	1,400	1,392.00	1,948,800

共同印刷	400	2,834.00	1,133,600	
N I S S H A	2,700	1,151.00	3,107,700	
光村印刷	100	1,991.00	199,100	
藤森工業	1,300	2,978.00	3,871,400	
ヴィア・ホールディングス	1,700	623.00	1,059,100	
宝印刷	600	1,687.00	1,012,200	
前澤化成工業	800	1,111.00	888,800	
未来工業	300	1,905.00	571,500	
アシックス	13,200	1,170.00	15,444,000	
ツ ツ ミ	400	1,979.00	791,600	
ウェーブロックHLDGS	300	689.00	206,700	
ジェイ エス ピー	700	1,999.00	1,399,300	
ニ チ ハ	1,900	3,030.00	5,757,000	
エフピコ	1,200	6,600.00	7,920,000	
小松ウオール工業	400	1,869.00	747,600	
ヤマハ	8,000	5,020.00	40,160,000	
河合楽器	400	3,105.00	1,242,000	
クリナップ	1,300	589.00	765,700	
ピジヨン	8,100	4,035.00	32,683,500	
天馬	800	1,858.00	1,486,400	
兼松サステック	100	1,659.00	165,900	
キングジム	1,000	833.00	833,000	
象印マホービン	2,700	1,324.00	3,574,800	
リンテック	3,100	2,221.00	6,885,100	
信越ポリマー	2,400	741.00	1,778,400	
東 リ	3,500	250.00	875,000	
イトーキ	2,500	460.00	1,150,000	
任 天 堂	7,500	40,000.00	300,000,000	
三菱鉛筆	2,200	1,722.00	3,788,400	
松 風	600	1,434.00	860,400	
タカラスタンダ - ド	2,700	1,727.00	4,662,900	
コ ク ヨ	6,400	1,498.00	9,587,200	
ナカバヤシ	1,400	538.00	753,200	
ニ フ コ	5,300	2,698.00	14,299,400	
立川ブラインド	500	1,408.00	704,000	
グロープライド	600	3,385.00	2,031,000	
オカムラ	4,700	1,059.00	4,977,300	
バルカー	1,000	2,237.00	2,237,000	
M U T O Hホールディングス	200	1,707.00	341,400	
伊 藤 忠	91,500	2,075.00	189,862,500	

丸 紅	128,900	725.80	93,555,620
スクロール	2,100	350.00	735,000
高 島	200	1,671.00	334,200
ヨンドシーホールディングス	1,500	2,567.00	3,850,500
三陽商会	700	1,597.00	1,117,900
長瀬産業	7,300	1,587.00	11,585,100
ナイガイ	400	461.00	184,400
蝶 理	800	1,727.00	1,381,600
豊田通商	14,700	3,340.00	49,098,000
オンワ - ドホールディングス	7,900	585.00	4,621,500
三共生興	2,300	538.00	1,237,400
兼 松	5,200	1,227.00	6,380,400
美 津 濃	1,400	2,457.00	3,439,800
ツカモトコーポレーション	200	1,045.00	209,000
ユニー・ファミリーマートHD	14,600	2,678.00	39,098,800
ルックホールディングス	400	1,262.00	504,800
三井物産	107,700	1,807.00	194,613,900
日本紙パルプ	700	3,710.00	2,597,000
東京エレクトロン	8,900	16,405.00	146,004,500
日立ハイテクノロジーズ	4,100	5,800.00	23,780,000
カメイ	1,800	1,164.00	2,095,200
東都水産	200	2,582.00	516,400
OUGホールディングス	200	2,666.00	533,200
スターゼン	400	4,345.00	1,738,000
セイコーHD	2,100	2,238.00	4,699,800
山 善	5,100	1,039.00	5,298,900
椿本興業	300	3,250.00	975,000
住友商事	77,300	1,638.50	126,656,050
日本ユニシス	4,100	3,675.00	15,067,500
内田洋行	600	3,675.00	2,205,000
三菱商事	92,000	2,931.50	269,698,000
第一実業	500	3,085.00	1,542,500
キヤノンマーケティングJPN	3,800	2,330.00	8,854,000
西華産業	700	1,354.00	947,800
佐藤商事	1,300	896.00	1,164,800
菱洋エレクトロ	1,400	1,868.00	2,615,200
東京産業	1,400	506.00	708,400
ユアサ商事	1,400	3,150.00	4,410,000
神鋼商事	300	2,321.00	696,300
小林産業	700	317.00	221,900

阪和興業	2,300	2,925.00	6,727,500	
正栄食品	600	3,300.00	1,980,000	
カナデン	1,400	1,387.00	1,941,800	
菱電商事	1,000	1,606.00	1,606,000	
ニプロ	9,200	1,219.00	11,214,800	
フルサト工業	700	1,418.00	992,600	
岩谷産業	2,900	3,730.00	10,817,000	
すてきナイスグループ	500	577.00	288,500	
昭光通商	400	642.00	256,800	
ニチモウ	200	1,753.00	350,600	
極東貿易	400	1,555.00	622,000	
イワキ	1,600	495.00	792,000	
兼松エレクトロニクス	700	3,145.00	2,201,500	
三愛石油	3,600	1,043.00	3,754,800	
稲畑産業	3,100	1,389.00	4,305,900	
G S Iクレオス	300	1,300.00	390,000	
明和産業	1,300	380.00	494,000	
クワザワ	400	513.00	205,200	
キムラタン	6,500	39.00	253,500	
ゴ-ルドウイン	1,100	13,720.00	15,092,000	
ユニ・チャ-ム	28,200	3,187.00	89,873,400	
デサント	3,100	1,780.00	5,518,000	
キング	600	605.00	363,000	
ワキタ	2,800	1,082.00	3,029,600	
ヤマトインタ-ナショナル	800	418.00	334,400	
東邦ホールディングス	4,000	2,548.00	10,192,000	
サンゲツ	4,000	2,056.00	8,224,000	
ミツウロコグループ	2,000	813.00	1,626,000	
シナネンホールディングス	500	1,910.00	955,000	
伊藤忠エネクス	2,900	884.00	2,563,600	
サンリオ	4,100	2,380.00	9,758,000	
サンワテクノス	700	901.00	630,700	
リョ-サン	1,500	2,581.00	3,871,500	
新光商事	1,300	1,889.00	2,455,700	
トーホ-	500	2,119.00	1,059,500	
三信電気	1,000	1,786.00	1,786,000	
東陽テクニカ	1,600	999.00	1,598,400	
モスフードサービス	1,800	2,379.00	4,282,200	
加賀電子	1,400	1,678.00	2,349,200	
三益半導体	800	1,579.00	1,263,200	

ソーダニツカ	1,400	580.00	812,000
立花エレテック	900	1,693.00	1,523,700
木曾路	1,700	2,600.00	4,420,000
S R S ホールディングス	1,600	1,012.00	1,619,200
千 趣 会	2,400	288.00	691,200
タカキユー	900	180.00	162,000
ケーヨー	2,400	483.00	1,159,200
上新電機	1,600	2,152.00	3,443,200
日本瓦斯	2,200	2,806.00	6,173,200
ロイヤルホールディングス	2,300	2,780.00	6,394,000
東 天 紅	100	1,225.00	122,500
いなげや	1,500	1,433.00	2,149,500
島 忠	2,900	2,542.00	7,371,800
チヨダ	1,500	1,605.00	2,407,500
ライフコーポレーション	900	2,350.00	2,115,000
リンガーハット	1,700	2,375.00	4,037,500
M r M a x H D	1,900	479.00	910,100
テンアライド	1,300	426.00	553,800
A O K I ホールディングス	2,600	1,056.00	2,745,600
オークワ	1,900	1,108.00	2,105,200
コメリ	2,100	2,247.00	4,718,700
青山商事	2,300	2,069.00	4,758,700
しまむら	1,600	8,250.00	13,200,000
はせがわ	600	400.00	240,000
高 島 屋	10,400	1,234.00	12,833,600
松 屋	2,600	870.00	2,262,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	6,700	1,269.00	8,502,300
近鉄百貨店	500	3,245.00	1,622,500
パ ル コ	1,400	1,154.00	1,615,600
丸井グループ	11,100	2,410.00	26,751,000
アクシアル リテイリング	1,000	3,865.00	3,865,000
井 筒 屋	600	257.00	154,200
イオン	50,300	1,865.00	93,809,500
イ ズ ミ	2,700	4,210.00	11,367,000
フォーバル	500	919.00	459,500
平 和 堂	2,700	2,023.00	5,462,100
フ ジ	1,700	1,900.00	3,230,000
ヤオコー	1,600	4,945.00	7,912,000
ゼビオホールディングス	1,700	1,261.00	2,143,700
ケーズホールディングス	13,600	1,052.00	14,307,200

PALTAC	2,400	6,040.00	14,496,000
三谷産業	1,600	282.00	451,200
OLYMPICグループ	700	657.00	459,900
日産東京販売HD	2,000	275.00	550,000
アドバンテッジリスクマネ	500	733.00	366,500
三井不動産	69,500	2,604.00	180,978,000
三菱地所	91,800	2,027.50	186,124,500
平和不動産	2,500	2,289.00	5,722,500
東京建物	14,400	1,260.00	18,144,000
ダイビル	3,900	1,012.00	3,946,800
京阪神ビルディング	2,400	1,014.00	2,433,600
住友不動産	29,400	3,983.00	117,100,200
太平洋興発	500	763.00	381,500
テーオーシー	3,000	668.00	2,004,000
東京楽天地	200	5,130.00	1,026,000
レオパレス21	16,100	244.00	3,928,400
スターツコーポレーション	1,800	2,611.00	4,699,800
フジ住宅	1,700	764.00	1,298,800
空港施設	1,600	510.00	816,000
明和地所	700	568.00	397,600
ゴールドクレスト	1,000	1,923.00	1,923,000
リログループ	6,900	2,880.00	19,872,000
日本エスリード	500	1,663.00	831,500
日神不動産	2,000	475.00	950,000
日本エスコ	2,400	703.00	1,687,200
タカラレーベン	6,200	389.00	2,411,800
サンヨーハウジ 名古屋	700	951.00	665,700
イオンモール	6,600	1,729.00	11,411,400
毎日コムネット	100	734.00	73,400
ファースト住建	500	1,239.00	619,500
ランド	53,400	8.00	427,200
カチタス	1,600	4,090.00	6,544,000
東祥	700	2,774.00	1,941,800
トーセイ	1,900	1,103.00	2,095,700
穴吹興産	100	2,860.00	286,000
サンフロンティア不動産	1,900	1,093.00	2,076,700
エフ・ジェー・ネクスト	1,100	1,101.00	1,211,100
インテリックス	300	687.00	206,100
ランドビジネス	600	760.00	456,000
グランディハウス	1,300	478.00	621,400

東武鉄道	14,000	3,145.00	44,030,000
相鉄ホールディングス	4,600	2,964.00	13,634,400
東京急行	36,000	1,949.00	70,164,000
京浜急行	18,200	1,848.00	33,633,600
小田急電鉄	21,400	2,584.00	55,297,600
京王電鉄	7,400	7,130.00	52,762,000
京成電鉄	10,100	3,990.00	40,299,000
富士急行	1,900	4,125.00	7,837,500
新京成電鉄	300	2,035.00	610,500
東日本旅客鉄道	23,700	10,250.00	242,925,000
西日本旅客鉄道	11,900	8,845.00	105,255,500
東海旅客鉄道	11,800	21,770.00	256,886,000
西武ホールディングス	17,000	1,803.00	30,651,000
鴻池運輸	2,200	1,720.00	3,784,000
西日本鉄道	3,800	2,376.00	9,028,800
ハマキョウレックス	900	3,825.00	3,442,500
サカイ引越センター	600	6,740.00	4,044,000
近鉄グループHLDGS	12,700	5,190.00	65,913,000
阪急阪神HLDGS	16,900	3,860.00	65,234,000
南海電鉄	5,700	2,657.00	15,144,900
京阪ホールディングス	5,700	4,640.00	26,448,000
神戸電鉄	300	4,015.00	1,204,500
名古屋鉄道	10,200	3,010.00	30,702,000
山陽電鉄	900	2,155.00	1,939,500
TRANCOM	300	6,340.00	1,902,000
日本通運	4,900	5,810.00	28,469,000
ヤマトホールディングス	22,100	2,190.00	48,399,000
山 九	3,600	5,730.00	20,628,000
日 新	1,000	1,781.00	1,781,000
丸 運	700	281.00	196,700
丸全昭和運輸	900	3,310.00	2,979,000
センコーグループHLDGS	6,900	865.00	5,968,500
トナミホールディングス	300	5,860.00	1,758,000
ニッコンホールディングス	4,800	2,546.00	12,220,800
日石輸送	100	2,880.00	288,000
福山通運	1,700	4,040.00	6,868,000
セイノーホールディングス	9,400	1,403.00	13,188,200
エスライン	300	985.00	295,500
神奈川中央交通	300	3,800.00	1,140,000
日立物流	2,800	3,390.00	9,492,000

丸和運輸機関	600	4,600.00	2,760,000
C & F ロジホールディングス	1,400	1,296.00	1,814,400
日本郵船	10,600	1,795.00	19,027,000
商船三井	7,400	2,663.00	19,706,200
川崎汽船	4,000	1,436.00	5,744,000
N S ユナイテッド海運	600	2,352.00	1,411,200
明治海運	1,400	318.00	445,200
飯野海運	6,100	362.00	2,208,200
共栄タンカー	100	1,437.00	143,700
九州旅客鉄道	10,600	3,185.00	33,761,000
S G ホールディングス	11,800	3,010.00	35,518,000
日本航空	23,200	3,441.00	79,831,200
A N A ホールディングス	22,900	3,639.00	83,333,100
パスコ	200	822.00	164,400
西本W I S M E T T A C H D	300	3,830.00	1,149,000
ヤマシタヘルスケアH L D G S	100	1,339.00	133,900
G E N K Y D R U G S T O R E S	400	2,708.00	1,083,200
国際紙パルプ商事	2,300	313.00	719,900
総合メディカルH D	1,100	1,726.00	1,898,600
ブックオフG H D	600	1,257.00	754,200
三菱倉庫	4,400	2,963.00	13,037,200
三井倉庫H O L D	1,600	1,526.00	2,441,600
住友倉庫	4,700	1,383.00	6,500,100
渋沢倉庫	600	1,723.00	1,033,800
ヤマタネ	600	1,400.00	840,000
東陽倉庫	2,300	320.00	736,000
乾汽船	1,000	862.00	862,000
日本トランスシティ	2,800	503.00	1,408,400
ケイヒン	200	1,248.00	249,600
中央倉庫	700	1,084.00	758,800
川西倉庫	200	1,057.00	211,400
安田倉庫	1,000	887.00	887,000
ファイズ	200	737.00	147,400
東洋埠頭	400	1,409.00	563,600
宇徳	1,000	491.00	491,000
上 組	7,900	2,517.00	19,884,300
サンリツ	300	643.00	192,900
キムラユニティー	300	1,110.00	333,000
キューソー流通システム	300	2,008.00	602,400
近鉄エクスプレス	2,400	1,417.00	3,400,800

東海運	700	268.00	187,600
エーアイティー	800	1,059.00	847,200
内外トランスライン	400	1,343.00	537,200
ショーエイコーポ	100	778.00	77,800
日本コンセプト	300	1,268.00	380,400
東京放送HD	8,700	1,895.00	16,486,500
日本テレビHLD S	11,900	1,662.00	19,777,800
朝日放送グループHD	1,400	731.00	1,023,400
テレビ朝日HD	3,700	1,882.00	6,963,400
スカパーJ S A T H D	10,100	426.00	4,302,600
テレビ東京HD	1,000	2,343.00	2,343,000
日本BS放送	400	1,066.00	426,400
ビジョン	400	4,980.00	1,992,000
スマートバリュー	100	724.00	72,400
USEN-NEXT HLDGS	500	813.00	406,500
ワイヤレスゲート	500	559.00	279,500
コネクシオ	900	1,393.00	1,253,700
日本通信	11,300	263.00	2,971,900
クロップス	200	616.00	123,200
日本電信電話	89,400	5,170.00	462,198,000
KDDI	107,500	2,857.50	307,181,250
ソフトバンク	138,400	1,439.50	199,226,800
光通信	1,600	24,280.00	38,848,000
NTTドコモ	83,000	2,573.50	213,600,500
エムティーアイ	1,600	776.00	1,241,600
GMOインターネット	4,800	1,936.00	9,292,800
アイドママーケティングコミュ	300	656.00	196,800
KADOKAWA	3,900	1,472.00	5,740,800
学研ホールディングス	400	5,260.00	2,104,000
ゼンリン	2,600	1,970.00	5,122,000
昭文社	600	355.00	213,000
インプレスホールディングス	1,000	141.00	141,000
東京電力HD	105,900	545.00	57,715,500
中部電力	40,700	1,517.50	61,762,250
関西電力	54,200	1,267.50	68,698,500
中国電力	18,300	1,357.00	24,833,100
北陸電力	13,100	777.00	10,178,700
東北電力	31,100	1,085.00	33,743,500
四国電力	11,900	1,000.00	11,900,000
九州電力	27,300	1,068.00	29,156,400

北海道電力	12,500	598.00	7,475,000
沖縄電力	2,500	1,721.00	4,302,500
電源開発	10,600	2,477.00	26,256,200
エフオン	600	834.00	500,400
イーレックス	2,300	1,159.00	2,665,700
レノバ	1,400	816.00	1,142,400
東京瓦斯	26,100	2,686.00	70,104,600
大阪瓦斯	25,800	1,922.00	49,587,600
東邦瓦斯	6,600	3,970.00	26,202,000
北海道瓦斯	700	1,491.00	1,043,700
広島ガス	2,700	336.00	907,200
西部瓦斯	1,600	2,240.00	3,584,000
静岡ガス	4,200	816.00	3,427,200
メタウォーター	600	3,385.00	2,031,000
アイネット	700	1,218.00	852,600
松竹	800	12,660.00	10,128,000
東宝	8,600	4,750.00	40,850,000
エイチ・アイ・エス	2,300	2,557.00	5,881,100
東映	500	15,100.00	7,550,000
ラックランド	200	2,245.00	449,000
NTTデータ	34,700	1,474.00	51,147,800
共立メンテナンス	2,000	4,790.00	9,580,000
イチネンホールディングス	1,400	1,131.00	1,583,400
建設技術研究所	800	1,530.00	1,224,000
スペース	800	1,200.00	960,000
長大	500	762.00	381,000
アインホールディングス	1,800	6,550.00	11,790,000
燦ホールディングス	300	2,305.00	691,500
ピー・シー・エー	200	3,370.00	674,000
スバル興業	100	6,230.00	623,000
東京テアトル	500	1,347.00	673,500
タナベ経営	200	1,201.00	240,200
ビジネスB太田昭和	200	2,300.00	460,000
ナガワ	300	5,040.00	1,512,000
よみうりランド	300	4,940.00	1,482,000
東京都競馬	800	3,300.00	2,640,000
常磐興産	500	1,681.00	840,500
カナモト	1,900	2,850.00	5,415,000
東京ドーム	4,800	1,015.00	4,872,000
D T S	3,000	2,312.00	6,936,000

スクウェア・エニックス・HD	6,200	3,750.00	23,250,000	
シーイーシー	1,500	2,461.00	3,691,500	
カプコン	5,700	2,248.00	12,813,600	
西尾レントオール	1,400	3,065.00	4,291,000	
アイ・エス・ビー	200	1,720.00	344,000	
アゴーラ・ホスピタリティーG	7,000	34.00	238,000	
日本空港ビルデング	4,200	4,230.00	17,766,000	
トランス・コスモス	1,500	2,466.00	3,699,000	
乃村工藝社	5,800	1,436.00	8,328,800	
ジャステック	700	1,080.00	756,000	
SCSK	3,600	5,360.00	19,296,000	
藤田観光	500	2,897.00	1,448,500	
KNT-CTホールディングス	600	1,423.00	853,800	
日本管財	1,500	1,869.00	2,803,500	
トーカイ	1,300	2,281.00	2,965,300	
白洋舎	100	2,885.00	288,500	
セコム	13,500	9,042.00	122,067,000	
日本システムウエア	400	2,604.00	1,041,600	
セントラル警備保障	600	5,400.00	3,240,000	
アイネス	1,700	1,141.00	1,939,700	
丹青社	2,400	1,279.00	3,069,600	
メイテック	1,700	5,650.00	9,605,000	
TKC	1,000	4,760.00	4,760,000	
富士ソフト	2,000	4,965.00	9,930,000	
応用地質	1,500	1,109.00	1,663,500	
船井総研ホールディン	2,600	2,593.00	6,741,800	
NSD	2,200	3,260.00	7,172,000	
進学会ホールディングス	500	605.00	302,500	
丸紅建材リース	100	1,720.00	172,000	
オオバ	900	614.00	552,600	
コナミホールディングス	5,300	4,895.00	25,943,500	
いであ	200	1,201.00	240,200	
学究社	400	1,321.00	528,400	
ベネッセホールディングス	4,700	2,552.00	11,994,400	
イオンディライト	1,600	3,155.00	5,048,000	
ナック	700	979.00	685,300	
福井コンピュータHLDS	400	2,426.00	970,400	
ニチイ学館	1,900	1,663.00	3,159,700	
ダイセキ	2,200	2,698.00	5,935,600	
ステップ	400	1,475.00	590,000	

日鉄物産	900	4,435.00	3,991,500
泉州電業	400	2,866.00	1,146,400
元気寿司	300	3,340.00	1,002,000
トラスコ中山	2,700	2,302.00	6,215,400
ヤマダ電機	39,800	499.00	19,860,200
オートバックスセブン	5,200	1,787.00	9,292,400
モリト	900	809.00	728,100
アークランドサカモト	2,300	1,352.00	3,109,600
ニトリホールディングス	5,800	14,645.00	84,941,000
グルメ杵屋	900	1,161.00	1,044,900
愛眼	1,000	251.00	251,000
ケーユーホールディングス	600	915.00	549,000
吉野家ホールディングス	4,600	2,049.00	9,425,400
加藤産業	2,100	3,260.00	6,846,000
北恵	200	869.00	173,800
イノテック	800	887.00	709,600
イエローハット	2,400	1,424.00	3,417,600
松屋フーズHLDGS	600	3,425.00	2,055,000
JBCホールディングス	900	1,433.00	1,289,700
JKホールディングス	1,300	580.00	754,000
サガミホールディングス	1,800	1,330.00	2,394,000
日伝	1,000	1,917.00	1,917,000
関西スーパーマーケット	900	1,126.00	1,013,400
ミロク情報サービス	1,400	3,385.00	4,739,000
北沢産業	900	263.00	236,700
杉本商事	700	2,132.00	1,492,400
因幡電機産業	1,900	4,715.00	8,958,500
王将フードサービス	900	6,420.00	5,778,000
プレナス	1,600	1,869.00	2,990,400
ミニストップ	900	1,565.00	1,408,500
アークス	2,500	2,241.00	5,602,500
パローホールディングス	2,800	2,330.00	6,524,000
東テク	400	2,365.00	946,000
ミスミグループ本社	16,300	2,507.00	40,864,100
藤久	100	727.00	72,700
アルテック	900	216.00	194,400
ベルク	600	5,310.00	3,186,000
大庄	600	1,599.00	959,400
タキヒヨー	400	1,824.00	729,600
ファーストリテイリング	1,800	66,880.00	120,384,000

ソフトバンクグループ	109,200	5,182.00	565,874,400	
葦王産業	200	1,340.00	268,000	
スズケン	6,100	6,260.00	38,186,000	
サンドラッグ	4,900	3,050.00	14,945,000	
サックスバーホールディング	1,200	977.00	1,172,400	
ジェコス	800	977.00	781,600	
ヤマザワ	300	1,648.00	494,400	
やまや	200	2,229.00	445,800	
グローセル	1,300	452.00	587,600	
ベルーナ	3,200	751.00	2,403,200	
合計			26,776,579,560	

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
新株予約権証券	ADワークス第22回新株予約権	19,000	0	
新株予約権証券 合計			0	
合計			0	

新株予約権証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2019年7月31日

資産総額	27,115,686,972円
負債総額	340,733,106円
純資産総額（ - ）	26,774,953,866円
発行済数量	22,039,478口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1,214.86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、計算期間終了日現在において、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。

(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。

前 の申請のある場合には、前 の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前 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。

前 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。

第二部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2019年7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、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

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. ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

- ・ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

- ・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

- ・リスクマネジメント会議

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

- ・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年7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	71	138,765
追加型株式投資信託	711	15,434,496
株式投資信託 合計	782	15,573,261
単位型公社債投資信託	30	110,386
追加型公社債投資信託	14	1,395,748
公社債投資信託 合計	44	1,506,134
総合計	826	17,079,395

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。
- 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、当事業年度（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
- 3．財務諸表の記載金額は、百万円未満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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
固定資産		
有形固定資産	1	206
建物	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799
投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836
出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	2 4,476	2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
固定負債		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計	
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金			繰越利益 剰余金

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	41,112

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計	
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		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			利益剰余金合計
				繰越利益剰余金			

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

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

（未適用の会計基準等）

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

（1）概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

（2）適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

（『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

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

（損益計算書）

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

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

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万円として組替えております。

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円

器具備品

235百万円

264百万円

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2017年4月1日至2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017年 6月27日

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

2018年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金

1株当たり配当額	4,857円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月26日

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018年 6月26日

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

2019年6月21日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されておりま。

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. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:百万円)

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		28,489	28,489	-

(2) 未収委託者報酬	11,468	11,468	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	8,380	8,380	-
資産計	48,338	48,338	-
(1) 未払手数料	(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金	(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)	(2,805)	(2,805)	-
負債計	(11,298)	(11,298)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2018年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-

有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(2019年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	87	55	32
(2) その他 証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	389	86	-
(2) その他 証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度171百万円、当事業年度174百万円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

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

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

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

前事業年度（2018年3月31日）

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

当事業年度（2019年3月31日）

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)(注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	(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)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円) (注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	(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)	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,063	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,760.66円	1株当たり純資産額	15,389.06円
1株当たり当期純利益	4,857.40円	1株当たり当期純利益	4,550.81円

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

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の1株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

(注3)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,670	11,870

普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525
-----------------	-----------	-----------

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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

2020年4月1日付で、定款について次の変更を行なう予定です。

- ・ 商号の変更(大和アセットマネジメント株式会社に変更)

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

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】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容

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。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 (2019年3月 末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	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。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,500	
クレディ・スイス証券株式会社	78,100	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616	
J P モルガン証券株式会社	73,272	
シティグループ証券株式会社	96,307	
野村證券株式会社	10,000	
B N P パリバ証券株式会社	102,025	
みずほ証券株式会社	125,167	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	
メリルリンチ日本証券株式会社	83,140	
モルガン・スタンレーM U F G 証券株式会社	62,149	

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。

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。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容：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。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

(提出年月日)	(書類名)
2019年4月3日	有価証券届出書、有価証券報告書

独立監査人の監査報告書

2019年5月24日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(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

2019年8月2日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financialsの2019年1月11日から2019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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financialsの2019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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。