

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2020年4月3日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 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
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	名 称 株式会社東京証券取引所 所在地 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

5兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

100口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

（注1）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取得申込みを受付けます。

（注2）基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせる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/>

(5) 【申込手数料】

販売会社は、当該販売会社が定める申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を取得申込者から徴収することができるものとします。当該申込手数料は、当該販売会社および受託会社が収受するものとします。

販売会社については、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/>

(6) 【申込単位】

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

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

取得時のバスケットは、日々変更されます。

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

（ 1 ）所定の方法

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

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

（ 2 ）販売会社

販売会社については、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/>

(7) 【申込期間】

2020年4月4日から2020年10月2日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

ただし、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. 「TOPIX Ex-Financials」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. 「TOPIX Ex-Financials」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. 当ファンドの計算期間終了日の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.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

(8) 【申込取扱場所】

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/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、取得申込みにかかる取得時のバスケットの各銘柄の株式および金銭を、当該取得申込みにかかる信託が設定される日までに販売会社に引渡し、当該取得時のバスケットの各銘柄の株式を保護預けするものとします。取得申込みにかかる株式については、販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、受託会社の指定するファンド口座に移管されます（株式等に金銭が含まれる場合は、当該金銭については、販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、委託会社の口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込まれます。）。

(10) 【払込取扱場所】

前(9)の引渡しは、販売会社において行なうものとします。販売会社については、前(6)をご参照下さい。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

受益権の取得申込者は、申込取扱場所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。

委託会社の営業日の午後3時までに取得申込みをした場合（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）、その翌営業日を取得申込受付日として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌々営業日の取得申込受付日としての取扱いとなります。

委託会社および受託会社は、当ファンドの受益権について、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）に上場申請を行なうものとし、

当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得た場合には、当該金融商品取引所に上場されるものとします。

委託会社および受託会社は、前記の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行なう受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置にしたがうものとします。

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、取得申込みの取消しまたはその両方を行なうことができます。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金の支払い、交換の請求は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって行なわれます。

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

- ・ファンドの設定、交換等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「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：

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

- ①TOPIX 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	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 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。

*再信託受託会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

< 委託会社の概況（2020年1月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

1959年12月12日	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
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

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

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

委託会社は、信託財産を、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

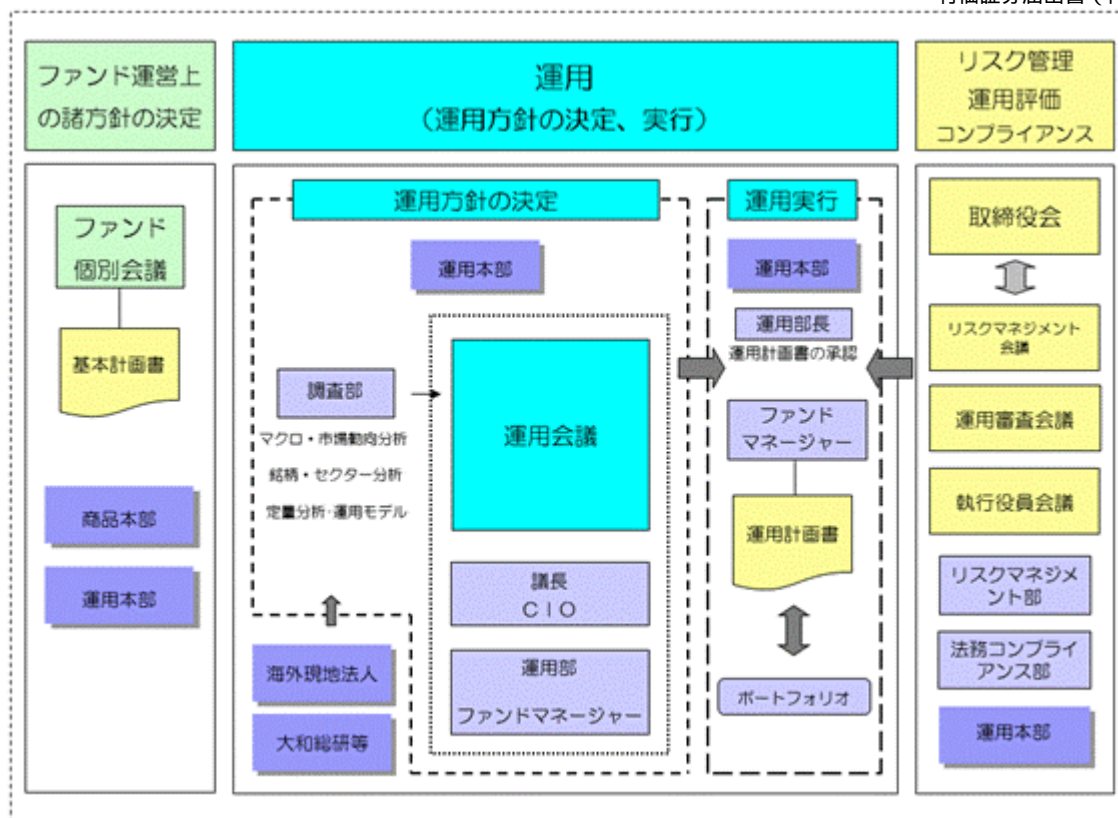
4. 手形割引市場において売買される手形

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．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO (Chief Investment Officer) (1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・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的的確な状況報告
- ・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。

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．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。

ロ．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。

ハ．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2020年1月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資する株式の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号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。

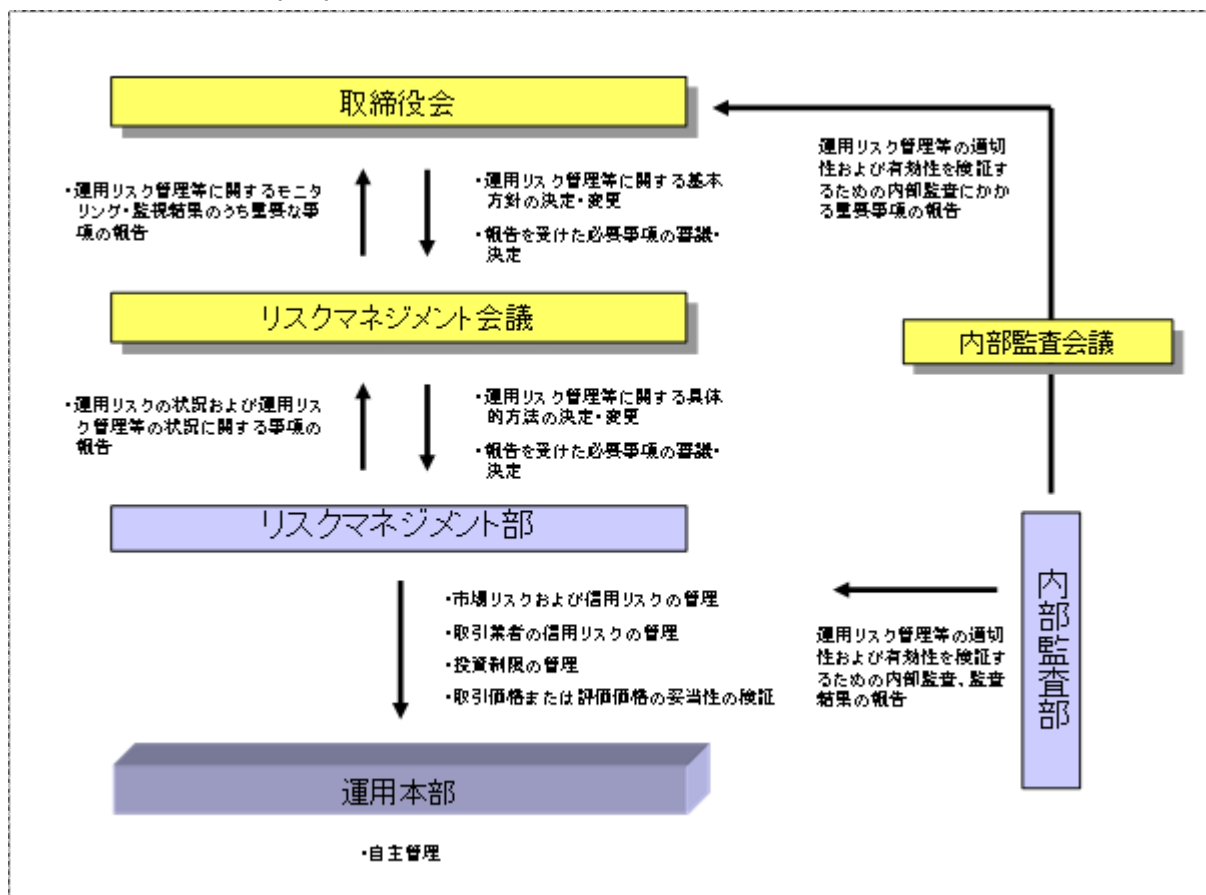
(2) その他の留意点

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。

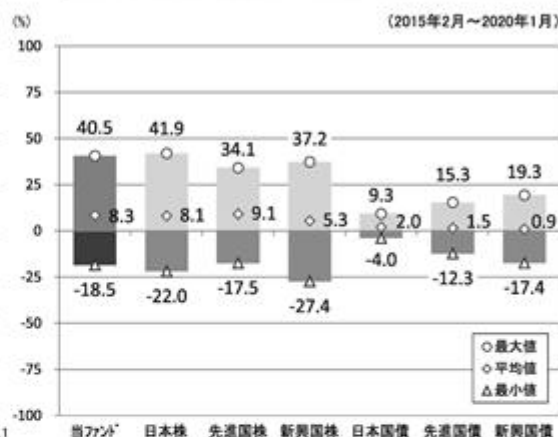
参考情報

- 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、飛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。

() 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、2020年1月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】 (2020年1月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	28,591,259,896	99.79
内 日本	28,591,259,896	99.79
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	61,252,131	0.21
純資産総額	28,652,512,027	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】 (2020年1月31日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	150,200.5	7,661.00 1,150,686,030	7,652.00 1,149,334,226	4.01
2 ソニー	日本	株式	電気機 器	85,100	7,843.00 667,439,300	7,718.00 656,801,800	2.29
3 日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	176,400	2,788.50 491,891,400	2,786.50 491,538,600	1.72
4 ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	104,700	4,877.34 510,658,120	4,524.00 473,662,800	1.65
5 武田薬品	日本	株式	医薬品	111,700	4,379.00 489,134,300	4,227.00 472,155,900	1.65
6 キーエンス	日本	株式	電気機 器	12,200	39,780.00 485,316,000	37,370.00 455,914,000	1.59
7 リクルートホールディングス	日本	株式	サービス 業	91,900	4,237.00 389,380,300	4,304.00 395,537,600	1.38
8 任天堂	日本	株式	その他 製品	8,200	43,440.00 356,208,000	40,770.00 334,314,000	1.17
9 KDDI	日本	株式	情報・通 信業	98,200	3,288.00 322,881,600	3,271.00 321,212,200	1.12

10	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	97,300	3,074.00 299,100,200	3,107.00 302,311,100	1.06
11	本田技研	日本	株式	輸送用機器	105,700	3,060.00 323,442,000	2,831.00 299,236,700	1.04
12	信越化学	日本	株式	化学	22,800	11,960.00 272,688,000	12,715.00 289,902,000	1.01
13	HOYA	日本	株式	精密機器	27,000	10,650.00 287,550,000	10,600.00 286,200,000	1.00
14	第一三共	日本	株式	医薬品	38,400	7,176.00 275,558,400	7,441.00 285,734,400	1.00
15	花王	日本	株式	化学	32,200	9,182.75 295,684,770	8,782.00 282,780,400	0.99
16	日立	日本	株式	電気機器	64,500	4,564.00 294,378,000	4,230.00 272,835,000	0.95
17	ダイキン工業	日本	株式	機械	17,100	15,505.00 265,135,500	15,635.00 267,358,500	0.93
18	三菱商事	日本	株式	卸売業	92,800	2,897.00 268,841,600	2,823.00 261,974,400	0.91
19	ファナック	日本	株式	電気機器	12,800	20,670.00 264,576,000	20,320.00 260,096,000	0.91
20	村田製作所	日本	株式	電気機器	39,400	6,884.00 271,229,600	6,328.00 249,323,200	0.87
21	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	11,200	21,920.00 245,504,000	21,585.00 241,752,000	0.84
22	伊藤忠	日本	株式	卸売業	92,500	2,574.50 238,141,250	2,568.00 237,540,000	0.83
23	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	118,100	1,880.00 222,028,000	1,950.50 230,354,050	0.80
24	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	23,600	9,889.00 233,380,400	9,700.00 228,920,000	0.80
25	三井物産	日本	株式	卸売業	116,200	1,971.50 229,088,300	1,960.50 227,810,100	0.80
26	日本電産	日本	株式	電気機器	16,200	15,425.00 249,885,000	14,040.00 227,448,000	0.79
27	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	9,000	24,840.00 223,560,000	24,500.00 220,500,000	0.77
28	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	51,700	4,171.00 215,640,700	4,217.00 218,018,900	0.76
29	キヤノン	日本	株式	電気機器	72,300	3,060.00 221,238,000	2,886.50 208,693,950	0.73

30	三菱電機	日本	株式	電気機器	134,200	1,519.00 203,849,800	1,545.00 207,339,000	0.72
----	------	----	----	------	---------	-------------------------	-------------------------	------

(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	99.79%
合計	99.79%

(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	0.11%
鉱業	0.30%
建設業	3.17%
食料品	4.26%
繊維製品	0.65%
パルプ・紙	0.26%
化学	7.95%
医薬品	6.81%
石油・石炭製品	0.53%
ゴム製品	0.76%
ガラス・土石製品	0.92%
鉄鋼	0.83%
非鉄金属	0.80%
金属製品	0.65%
機械	5.66%
電気機器	16.20%
輸送用機器	8.51%
精密機器	2.72%
その他製品	2.51%
電気・ガス業	1.65%
陸運業	4.83%
海運業	0.18%
空運業	0.53%
倉庫・運輸関連業	0.20%
情報・通信業	9.82%
卸売業	5.63%
小売業	5.09%

不動産業	2.83%
サービス業	5.43%
合計	99.79%

(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	-
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	-	-
8月末日	33,926,337,436	-	1,175.75	-	1,180
9月末日	35,857,578,439	-	1,242.67	-	-
10月末日	28,650,150,483	-	1,305.64	-	1,310
11月末日	29,174,922,856	-	1,329.56	-	-
12月末日	29,583,339,546	-	1,348.17	-	1,353
第13計算期間末 (2020年1月10日)	29,524,020,451	29,866,335,853	1,345.47	1,361.07	-
2020年1月末日	28,652,512,027	-	1,305.75	-	1,317

(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
第13計算期間	15.60

【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
第13計算期間	11.8

(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
第13計算期間	6,815,690	6,911,873

(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

2020年1月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	130,575円
純資産総額	286億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	-2.0%
3か月間	1.2%
6か月間	8.7%
1年間	10.9%
3年間	21.2%
5年間	34.2%
設定来	67.5%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(100口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 2,850円 設定来分配金合計額: 29,680円

決算期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期
	14年7月	15年1月	15年7月	16年1月	16年7月	17年1月	17年7月	18年1月	18年7月	19年1月	19年7月	20年1月
分配金	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	1,560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。

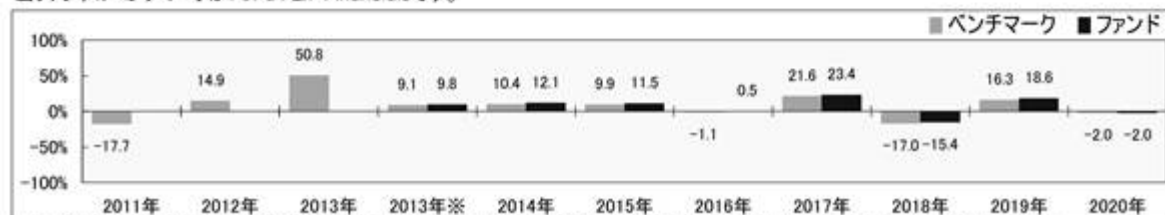
主要な資産の状況

※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	2,014	99.8%	電気機器	16.2%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.0%
国内株式先物	-	-	情報・通信業	9.8%	ソニー	電気機器	2.3%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	8.5%	日本電信電話	情報・通信業	1.7%
コール・ローン、その他		0.2%	化学	8.0%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.7%
合計	2,014	100.0%	医薬品	6.8%	武田薬品	医薬品	1.6%
株式市場・上場別構成			機械	5.7%	キーエンス	電気機器	1.6%
一部(東証・名証)		99.8%	卸売業	5.6%	リクルートホールディングス	サービス業	1.4%
二部(東証・名証)		-	サービス業	5.4%	任天堂	その他製品	1.2%
新興市場他		-	小売業	5.1%	KDDI	情報・通信業	1.1%
その他		-	その他	28.7%	NTTドコモ	情報・通信業	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。



・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、2020年は1月31日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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、抹消したもものとして取扱います。

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のものとして取扱うこととし、受託会社は、当該受益権にかかる振替受益権が交換株式の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

< 買取り >

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續きに関する事項は、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ます。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するものとします。また、届出た内容に変更が生じた場合は、当該取引参加者所定の方法による当該受益者からの申出に基づき、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るものとします。この場合には、当該販売会社が別に定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

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13期計算期間(2019年7月11日から2020年1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12期 2019年7月10日現在	第13期 2020年1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	236,690,437	346,311,408
株式	26,776,579,560	29,493,240,421
未収入金	21,477,217	8,797,800
未収配当金	44,536,540	50,755,286
流動資産合計	27,141,586,788	29,899,104,915
資産合計	27,141,586,788	29,899,104,915
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	284,309,266	342,315,402
未払受託者報酬	6,764,736	8,048,475
未払委託者報酬	17,588,399	20,926,114
その他未払費用	7,424,512	3,794,473
流動負債合計	316,086,913	375,084,464
負債合計	316,086,913	375,084,464
純資産の部		
元本等		
元本	1 21,797,043,742	1 21,701,918,755
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,028,456,133	7,822,101,696
(分配準備積立金)	1,280,555	623,504
元本等合計	26,825,499,875	29,524,020,451
純資産合計	26,825,499,875	29,524,020,451
負債純資産合計	27,141,586,788	29,899,104,915

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第12期		第13期	
	自	2019年1月11日 至 2019年7月10日	自	2019年7月11日 至 2020年1月10日
営業収益				
受取配当金		312,546,349		376,091,488
受取利息		-		130
有価証券売買等損益		1,000,479,730		3,390,265,093
その他収益		218,208		222,921
営業収益合計		1,313,244,287		3,766,579,632
営業費用				
支払利息		36,821		37,986
受託者報酬		6,764,736		8,048,475
委託者報酬		17,588,399		20,926,114
その他費用		4,737,223		5,643,613
営業費用合計		29,127,179		34,656,188
営業利益		1,284,117,108		3,731,923,444
経常利益		1,284,117,108		3,731,923,444
当期純利益		1,284,117,108		3,731,923,444
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,604,966,173		5,028,456,133
剰余金増加額又は欠損金減少額		423,682,118		1,157,372,314
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		423,682,118		1,157,372,314
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,753,334,793
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,753,334,793
分配金		1 284,309,266		1 342,315,402
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,028,456,133		7,822,101,696

(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13期	
	自 2019年7月11日	至 2020年1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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. 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12期	第13期
	2019年7月10日現在	2020年1月10日現在
1. 1 期首元本額	19,872,251,942円	21,797,043,742円
期中追加設定元本額	1,924,791,800円	6,740,717,410円
期中一部交換元本額	- 円	6,835,842,397円

2.	計算期間末日における受益権の総数	22,039,478口	21,943,295口
----	------------------	-------------	-------------

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第12期	第13期
	自 2019年1月11日 至 2019年7月10日	自 2019年7月11日 至 2020年1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（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。	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（376,276,553円）及び分配準備積立金（1,280,555円）の合計額から、経費（34,618,202円）を控除して計算される分配対象額は342,938,906円（100口当たり1,562円）であり、うち342,315,402円（100口当たり1,560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13期
	自 2019年7月11日 至 2020年1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13期 2020年1月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)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12期 2019年7月10日現在	第13期 2020年1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	983,305,303	3,143,956,109
合計	983,305,303	3,143,956,109

(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12期 2019年7月10日現在	第13期 2020年1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13期

自 2019年7月11日

至 2020年1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12期 2019年7月10日現在	第13期 2020年1月10日現在
1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,217.16円 (121,716円)	1,345.47円 (134,547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	600	2,932.00	1,759,200	
日本水産	18,200	627.00	11,411,400	
マルハニチロ	2,600	2,755.00	7,163,000	
ハウスイ	100	883.00	88,300	
カネコ種苗	600	1,425.00	855,000	
サカタのタネ	2,200	3,590.00	7,898,000	
ホクト	1,400	1,955.00	2,737,000	
ホクリヨウ	300	707.00	212,100	
ヒノキヤグループ	500	2,164.00	1,082,000	
ショーボンドHD	2,600	4,645.00	12,077,000	
ミライト・ホールディングス	5,400	1,718.00	9,277,200	
タマホーム	900	1,520.00	1,368,000	
サンヨーホームズ	200	707.00	141,400	
日本アクア	700	593.00	415,100	
ファーストコーポレーション	600	604.00	362,400	
ベステラ	300	1,269.00	380,700	
TATERU	3,800	210.00	798,000	
スペースバリューHD	2,200	589.00	1,295,800	
住石ホールディングス	3,700	150.00	555,000	
日鉄鉱業	400	4,920.00	1,968,000	
三井松島HLDGS	700	1,211.00	847,700	
国際石油開発帝石	73,100	1,170.00	85,527,000	

石油資源開発	2,400	3,045.00	7,308,000	
K & Oエナジーグループ	900	1,580.00	1,422,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,164.00	465,600	
第一カッター興業	200	1,831.00	366,200	
明豊ファシリティワークス	400	760.00	304,000	
安藤・間	10,900	968.00	10,551,200	
東急建設	5,300	751.00	3,980,300	
コムシスホールディングス	6,500	3,210.00	20,865,000	
ピーアールホールディングス	2,000	481.00	962,000	
高松コンストラクショング P	1,100	2,838.00	3,121,800	
東建コーポレーション	600	7,530.00	4,518,000	
ソネック	200	829.00	165,800	
ヤマウラ	800	939.00	751,200	
大成建設	14,000	4,500.00	63,000,000	
大 林 組	42,100	1,226.00	51,614,600	
清水建設	42,700	1,128.00	48,165,600	
飛鳥建設	1,200	1,476.00	1,771,200	
長谷工コーポレーション	16,300	1,483.00	24,172,900	
松井建設	1,700	799.00	1,358,300	
銭 高 組	200	4,095.00	819,000	
鹿島建設	33,100	1,430.00	47,333,000	
不動テトラ	1,100	1,641.00	1,805,100	
大末建設	500	978.00	489,000	
鉄建建設	900	2,814.00	2,532,600	
西松建設	3,200	2,458.00	7,865,600	
三井住友建設	10,200	627.00	6,395,400	
大豊建設	900	2,827.00	2,544,300	
前田建設	10,500	1,043.00	10,951,500	
佐田建設	900	480.00	432,000	
ナカノフドー建設	1,200	491.00	589,200	
奥 村 組	2,300	2,980.00	6,854,000	
東鉄工業	1,800	3,185.00	5,733,000	
イチケン	300	1,802.00	540,600	
富士ピー・エス	600	588.00	352,800	
浅沼組	500	4,835.00	2,417,500	
戸田建設	17,500	720.00	12,600,000	
熊 谷 組	2,000	3,285.00	6,570,000	
北野建設	300	2,586.00	775,800	
植 木 組	200	2,532.00	506,400	
矢作建設	1,900	821.00	1,559,900	

ピーエス三菱	1,400	712.00	996,800	
日本ハウスHLDGS	2,900	501.00	1,452,900	
大東建託	5,000	13,000.00	65,000,000	
新日本建設	1,800	922.00	1,659,600	
NIPPO	3,500	2,398.00	8,393,000	
東亜道路	300	3,590.00	1,077,000	
前田道路	4,500	2,650.00	11,925,000	
日本道路	400	6,780.00	2,712,000	
東亜建設	1,300	1,660.00	2,158,000	
日本国土開発	2,500	657.00	1,642,500	
若築建設	800	1,727.00	1,381,600	
東洋建設	4,700	518.00	2,434,600	
五洋建設	16,700	677.00	11,305,900	
世紀東急	2,000	925.00	1,850,000	
福田組	500	4,905.00	2,452,500	
日本ドライケミカル	300	1,980.00	594,000	
住友林業	10,700	1,596.00	17,077,200	
日本基礎技術	1,400	408.00	571,200	
巴コーポレーション	1,900	461.00	875,900	
大和ハウス	41,700	3,400.00	141,780,000	
ライト工業	2,400	1,570.00	3,768,000	
積水ハウス	46,100	2,374.00	109,441,400	
日特建設	1,100	863.00	949,300	
北陸電気工事	700	1,119.00	783,300	
ユアテック	2,400	703.00	1,687,200	
四電工	200	2,899.00	579,800	
中電工	1,700	2,531.00	4,302,700	
関電工	6,000	1,036.00	6,216,000	
きんでん	10,000	1,685.00	16,850,000	
東京エネシス	1,400	911.00	1,275,400	
トーエネック	400	3,865.00	1,546,000	
住友電設	1,200	2,776.00	3,331,200	
日本電設工業	2,300	2,232.00	5,133,600	
協和エクシオ	6,400	2,812.00	17,996,800	
新日本空調	1,100	2,162.00	2,378,200	
日本工営	900	3,535.00	3,181,500	
九電工	3,000	3,255.00	9,765,000	
三機工業	3,000	1,545.00	4,635,000	
日揮ホールディングス	13,000	1,727.00	22,451,000	
中外炉工業	500	1,796.00	898,000	

ヤマト	1,300	749.00	973,700
太平電業	1,000	2,319.00	2,319,000
高砂熱学	3,700	1,930.00	7,141,000
三晃金属	200	2,626.00	525,200
NEC ネットエスアイ	1,200	4,030.00	4,836,000
朝日工業社	300	3,470.00	1,041,000
明星工業	2,700	989.00	2,670,300
大気社	2,000	3,780.00	7,560,000
ダイダン	1,000	2,743.00	2,743,000
日比谷総合設備	1,400	1,961.00	2,745,400
日本製粉	3,900	1,708.00	6,661,200
日清製粉G本社	15,200	1,903.00	28,925,600
日東富士製粉	100	6,370.00	637,000
昭和産業	1,200	3,115.00	3,738,000
鳥越製粉	1,200	856.00	1,027,200
中部飼料	1,600	1,672.00	2,675,200
フィード・ワン	9,000	182.00	1,638,000
東洋精糖	200	1,210.00	242,000
日本甜菜糖	700	2,005.00	1,403,500
三井製糖	1,200	2,230.00	2,676,000
塩水港精糖	1,500	228.00	342,000
日新製糖	600	2,030.00	1,218,000
LIFULL	4,500	555.00	2,497,500
ジェイエシーリクルートメント	900	1,904.00	1,713,600
日本M&Aセンター	9,700	3,915.00	37,975,500
メンバーズ	400	2,200.00	880,000
中広	100	545.00	54,500
UTグループ	1,500	3,310.00	4,965,000
アイティメディア	400	891.00	356,400
タケエイ	1,200	1,236.00	1,483,200
E・Jホールディングス	200	1,819.00	363,800
ビーネックスグループ	1,400	1,300.00	1,820,000
コシダカホールディングス	3,100	1,590.00	4,929,000
アルトナー	300	825.00	247,500
パソナグループ	1,600	1,607.00	2,571,200
CDS	300	1,636.00	490,800
リンクアンドモチベーション	2,800	613.00	1,716,400
GCA	1,500	997.00	1,495,500
エス・エム・エス	4,000	3,050.00	12,200,000
サニーサイドアップG	300	1,126.00	337,800

パーソルホールディングス	12,800	2,098.00	26,854,400	
リニカル	600	1,133.00	679,800	
クックパッド	4,500	349.00	1,570,500	
エスクリ	400	775.00	310,000	
アイ・ケイ・ケイ	600	731.00	438,600	
森永製菓	3,200	5,370.00	17,184,000	
中村屋	300	4,345.00	1,303,500	
江崎グリコ	4,000	4,915.00	19,660,000	
名糖産業	600	1,350.00	810,000	
井村屋グループ	600	1,950.00	1,170,000	
不二家	800	2,141.00	1,712,800	
山崎製パン	10,100	1,997.00	20,169,700	
第一屋製パン	200	960.00	192,000	
モロゾフ	200	5,120.00	1,024,000	
亀田製菓	800	5,030.00	4,024,000	
寿スピリッツ	1,300	8,730.00	11,349,000	
カルビー	6,100	3,635.00	22,173,500	
森永乳業	2,500	4,380.00	10,950,000	
六甲バター	900	1,734.00	1,560,600	
ヤクルト	9,300	6,030.00	56,079,000	
明治ホールディングス	8,900	7,540.00	67,106,000	
雪印メグミルク	3,200	2,545.00	8,144,000	
プリマハム	2,100	2,513.00	5,277,300	
日本ハム	5,100	4,745.00	24,199,500	
林兼産業	400	705.00	282,000	
丸大食品	1,400	2,256.00	3,158,400	
S Foods	1,100	2,890.00	3,179,000	
柿安本店	500	3,155.00	1,577,500	
伊藤ハム米久HLDGS	8,700	714.00	6,211,800	
学情	500	2,445.00	1,222,500	
スタジオアリス	600	1,976.00	1,185,600	
クロスキャット	300	1,186.00	355,800	
シミックホールディングス	700	1,806.00	1,264,200	
エプコ	200	1,439.00	287,800	
システナ	4,700	1,913.00	8,991,100	
NJS	300	1,841.00	552,300	
デジタルアーツ	600	5,810.00	3,486,000	
日鉄ソリューションズ	2,000	3,825.00	7,650,000	
総合警備保障	5,100	5,990.00	30,549,000	
キューブシステム	700	794.00	555,800	

いちご	16,800	452.00	7,593,600	
エイジア	200	1,495.00	299,000	
日本駐車場開発	14,500	148.00	2,146,000	
コア	600	1,530.00	918,000	
カカクコム	9,600	2,963.00	28,444,800	
アイロムグループ	500	1,404.00	702,000	
セントケア・ホールディング	800	483.00	386,400	
サイネックス	200	703.00	140,600	
ルネサンス	700	1,746.00	1,222,200	
ディップ	1,800	3,325.00	5,985,000	
SBSホールディングス	1,200	1,898.00	2,277,600	
オプトホールディング	700	1,640.00	1,148,000	
新日本科学	1,400	627.00	877,800	
ツクイ	3,000	615.00	1,845,000	
キャリアデザインセンター	300	1,378.00	413,400	
ベネフィット・ワン	3,500	2,284.00	7,994,000	
エムスリー	28,300	3,440.00	97,352,000	
ツカダ・グローバルHOLD	800	587.00	469,600	
プラス	100	833.00	83,300	
アウトソーシング	7,300	1,125.00	8,212,500	
ウェルネット	1,200	727.00	872,400	
ワールドホールディングス	400	1,812.00	724,800	
ディー・エヌ・エー	6,300	1,797.00	11,321,100	
博報堂DYHLDGS	17,800	1,747.00	31,096,600	
ぐるなび	2,200	998.00	2,195,600	
タカミヤ	1,400	679.00	950,600	
ジャパンベストレスキューS	900	1,138.00	1,024,200	
ファンコミュニケーションズ	3,500	473.00	1,655,500	
ライク	500	1,578.00	789,000	
ビジネス・ブレークスルー	500	343.00	171,500	
エスプール	2,500	832.00	2,080,000	
WDBホールディングス	600	2,713.00	1,627,800	
ティア	700	592.00	414,400	
CDG	100	1,425.00	142,500	
バリューコマース	700	2,547.00	1,782,900	
インフォマート	14,000	1,032.00	14,448,000	
サッポロホールディングス	4,600	2,622.00	12,061,200	
アサヒグループホールディン	28,200	4,954.00	139,702,800	
麒麟HD	57,100	2,382.00	136,012,200	
宝ホールディングス	10,100	1,027.00	10,372,700	

オエノンホールディングス	3,600	399.00	1,436,400
養命酒	400	1,984.00	793,600
コカ・コーラボトラーズJHD	9,500	2,851.00	27,084,500
サントリー食品インター	9,000	4,550.00	40,950,000
ダイドーグループHD	700	4,570.00	3,199,000
伊藤園	4,100	5,600.00	22,960,000
キーコーヒー	1,300	2,313.00	3,006,900
ユニカフェ	300	981.00	294,300
ジャパンフーズ	200	1,288.00	257,600
日清オイリオグループ	1,700	3,900.00	6,630,000
不二製油グループ	3,300	2,982.00	9,840,600
かどや製油	100	3,840.00	384,000
J - オイルミルズ	700	4,335.00	3,034,500
ローソン	3,300	6,480.00	21,384,000
サンエー	1,100	4,640.00	5,104,000
カワチ薬品	1,000	2,189.00	2,189,000
エービーシー・マート	2,100	7,100.00	14,910,000
ハードオフコーポレーション	500	828.00	414,000
高千穂交易	500	1,286.00	643,000
アスクル	1,400	3,410.00	4,774,000
ゲオホールディングス	2,400	1,308.00	3,139,200
アダストリア	1,800	2,381.00	4,285,800
ジーフット	800	621.00	496,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	710.00	142,000
伊藤忠食品	300	5,160.00	1,548,000
くら寿司	700	5,530.00	3,871,000
キャンドウ	600	1,696.00	1,017,600
エレマテック	1,200	1,150.00	1,380,000
パルグループHLDGS	700	3,695.00	2,586,500
JALUX	400	2,523.00	1,009,200
エディオン	6,100	1,220.00	7,442,000
あらた	1,100	4,545.00	4,999,500
サーラコーポレーション	2,700	637.00	1,719,900
ワッツ	600	614.00	368,400
トーマンデバイス	200	3,610.00	722,000
ハローズ	500	2,667.00	1,333,500
J Pホールディングス	4,000	327.00	1,308,000
フジオフードシステム	1,200	1,848.00	2,217,600
あみやき亭	300	3,670.00	1,101,000
東京エレクトロニクスデバイス	500	2,761.00	1,380,500

ひらまつ	2,400	285.00	684,000
フィールズ	1,000	626.00	626,000
双日	73,000	350.00	25,550,000
アルフレッサホールディングス	14,700	2,205.00	32,413,500
大黒天物産	300	3,315.00	994,500
ハニーズホールディングス	1,200	1,578.00	1,893,600
ファーマライズHD	300	647.00	194,100
キッコーマン	9,700	5,440.00	52,768,000
味の素	29,800	1,819.50	54,221,100
キューピー	7,500	2,418.00	18,135,000
ハウス食品G本社	5,000	3,745.00	18,725,000
カゴメ	5,100	2,625.00	13,387,500
焼津水産化工	700	1,034.00	723,800
アリアケジャパン	1,200	7,910.00	9,492,000
ピエトロ	200	1,637.00	327,400
エバラ食品工業	300	2,228.00	668,400
やまみ	100	2,398.00	239,800
ニチレイ	6,400	2,639.00	16,889,600
横浜冷凍	3,700	988.00	3,655,600
東洋水産	6,900	4,585.00	31,636,500
イートアンド	500	1,855.00	927,500
大冷	200	1,962.00	392,400
ヨシムラ・フード・HLDGS	700	1,188.00	831,600
日清食品HD	5,700	8,120.00	46,284,000
永谷園ホールディングス	700	2,180.00	1,526,000
一正蒲鉾	500	1,007.00	503,500
フジッコ	1,500	1,964.00	2,946,000
ロックフィールド	1,500	1,533.00	2,299,500
日本たばこ産業	77,800	2,415.50	187,925,900
ケンコーマヨネーズ	800	2,500.00	2,000,000
わらべや日洋HD	900	1,847.00	1,662,300
なとり	800	1,711.00	1,368,800
イフジ産業	200	763.00	152,600
ピクルスコーポレーション	300	2,635.00	790,500
北の達人コーポ	4,700	765.00	3,595,500
ユーグレナ	5,700	803.00	4,577,100
スター・マイカ・HLDGS	700	1,797.00	1,257,900
片倉工業	1,900	1,313.00	2,494,700
ゲンゼ	1,000	4,890.00	4,890,000
ヒューリック	28,300	1,333.00	37,723,900

神 栄	200	736.00	147,200
ラサ商事	700	1,026.00	718,200
アルペン	1,000	1,759.00	1,759,000
ハブ	400	1,082.00	432,800
ラクーンホールディングス	600	944.00	566,400
クオールホールディングス	1,900	1,497.00	2,844,300
アルコニックス	1,400	1,429.00	2,000,600
神戸物産	4,600	3,980.00	18,308,000
ソリトンシステムズ	600	1,364.00	818,400
ジーンズホールディングス	700	7,740.00	5,418,000
ビックカメラ	7,800	1,266.00	9,874,800
DCMホールディングス	7,100	1,031.00	7,320,100
ペッパーフードサービス	1,100	1,121.00	1,233,100
MonotaRO	9,400	2,887.00	27,137,800
東京一番フーズ	300	634.00	190,200
DDホールディングス	500	1,576.00	788,000
あいホールディングス	1,900	1,979.00	3,760,100
ディーブイエックス	500	929.00	464,500
きちりホールディングス	400	778.00	311,200
アークランドサービスHD	1,000	2,012.00	2,012,000
J. フロント リテイリング	15,800	1,551.00	24,505,800
ドトール・日レスHD	2,100	2,157.00	4,529,700
マツモトキヨシHLDGS	5,500	4,440.00	24,420,000
ブロンコビリー	700	2,764.00	1,934,800
ZOZO	9,900	2,050.00	20,295,000
トレジャー・ファクトリー	400	1,028.00	411,200
物語コーポレーション	300	9,040.00	2,712,000
ココカラファイン	1,400	6,680.00	9,352,000
三越伊勢丹HD	23,100	1,003.00	23,169,300
東洋紡	5,200	1,595.00	8,294,000
ユニチカ	3,900	353.00	1,376,700
富士紡ホールディングス	600	3,535.00	2,121,000
日清紡ホールディングス	8,900	1,050.00	9,345,000
倉敷紡績	1,400	2,459.00	3,442,600
ダイワボウHD	1,100	6,560.00	7,216,000
シキボウ	700	1,025.00	717,500
日東紡績	2,000	4,935.00	9,870,000
トヨタ紡織	3,900	1,722.00	6,715,800
マクニカ・富士エレHLDGS	3,200	1,857.00	5,942,400
Hamee	400	1,596.00	638,400

ラクト・ジャパン	500	3,780.00	1,890,000
ウエルシアHD	3,900	6,890.00	26,871,000
クリエイトSDH	1,900	2,883.00	5,477,700
バイタルKSKHD	2,500	1,036.00	2,590,000
八洲電機	1,000	921.00	921,000
メディアスホールディングス	700	865.00	605,500
レスターホールディングス	1,400	2,027.00	2,837,800
ジュテックHD	300	1,171.00	351,300
丸善CHI HD	1,500	367.00	550,500
大光	600	669.00	401,400
OCHIホールディングス	400	1,473.00	589,200
TOKAIホールディングス	7,000	1,084.00	7,588,000
黒谷	300	528.00	158,400
ミサワ	300	758.00	227,400
ティーライフ	200	887.00	177,400
Cominix	200	828.00	165,600
エー・ピーカンパニー	200	615.00	123,000
三洋貿易	700	2,512.00	1,758,400
チムニー	400	2,338.00	935,200
シュッピン	900	1,303.00	1,172,700
ビューティガレージ	200	2,440.00	488,000
ウイン・パートナーズ	1,000	1,336.00	1,336,000
ネクステージ	1,900	1,174.00	2,230,600
ジョイフル本田	3,900	1,358.00	5,296,200
鳥貴族	400	2,377.00	950,800
麒麟堂ホールディングス	500	2,163.00	1,081,500
ホットランド	900	1,274.00	1,146,600
すかいらーくHD	14,800	2,154.00	31,879,200
SFPホールディングス	600	2,548.00	1,528,800
綿半ホールディングス	500	1,841.00	920,500
日本毛織	4,300	1,131.00	4,863,300
ダイトウボウ	2,100	85.00	178,500
トーア紡コーポレーション	500	534.00	267,000
ダイドーリミテッド	1,700	279.00	474,300
ヨシックス	200	2,799.00	559,800
ユナイテッド・スーパーマーケ	3,800	969.00	3,682,200
三栄建築設計	500	1,604.00	802,000
野村不動産HLDS	8,000	2,643.00	21,144,000
三重交通グループHD	2,700	621.00	1,676,700
サムティ	1,900	1,942.00	3,689,800

ディア・ライフ	1,700	602.00	1,023,400
コーセーアールイー	400	930.00	372,000
エー・ディー・ワークス	24,600	30.00	738,000
日本商業開発	800	1,695.00	1,356,000
プレサンスコーポレーション	2,100	1,331.00	2,795,100
ユニゾホールディングス	2,000	5,180.00	10,360,000
THEグローバル社	700	457.00	319,900
ハウスコム	200	1,580.00	316,000
日本管理センター	900	1,275.00	1,147,500
サンセイランディック	400	892.00	356,800
エストラスト	200	832.00	166,400
フージャースHD	2,600	708.00	1,840,800
オープンハウス	3,800	3,175.00	12,065,000
東急不動産HD	36,000	735.00	26,460,000
飯田GHD	11,000	1,945.00	21,395,000
イーグランド	200	872.00	174,400
ムゲンエステート	900	758.00	682,200
帝国繊維	1,500	2,399.00	3,598,500
日本コークス工業	11,300	80.00	904,000
ゴルフダイジェスト・オン	600	652.00	391,200
ミタチ産業	400	767.00	306,800
B E E N O S	500	1,313.00	656,500
あさひ	1,000	1,373.00	1,373,000
日本調剤	400	3,875.00	1,550,000
コスモス薬品	600	23,800.00	14,280,000
シップヘルスケアHD	2,100	5,020.00	10,542,000
トーエル	600	785.00	471,000
ソフトクリエイイトHD	600	1,708.00	1,024,800
オンリー	200	808.00	161,600
セブン&アイ・HLDGS	51,700	4,171.00	215,640,700
クリエイイト・レストランツ・ホール	3,600	2,044.00	7,358,400
明治電機工業	400	1,630.00	652,000
ツルハホールディングス	2,900	13,930.00	40,397,000
デリカフーズHLDGS	500	726.00	363,000
スターティアホールディングス	300	857.00	257,100
サンマルクホールディングス	1,000	2,345.00	2,345,000
フェリシモ	300	1,046.00	313,800
トリドールホールディングス	1,600	2,832.00	4,531,200
帝人	10,700	2,006.00	21,464,200
東レ	95,200	737.60	70,219,520

ク ラ レ	20,700	1,293.00	26,765,100
旭 化 成	87,700	1,194.50	104,757,650
サカイオーベックス	300	1,890.00	567,000
T O K Y O B A S E	1,200	600.00	720,000
稲葉製作所	700	1,427.00	998,900
宮地エンジニアリングG	400	2,002.00	800,800
トーカロ	3,700	1,115.00	4,125,500
アルファCO	500	1,339.00	669,500
S U M C O	15,900	1,881.00	29,907,900
川田テクノロジーズ	300	6,570.00	1,971,000
R S T E C H N O L O G I E S	400	3,670.00	1,468,000
信和	600	1,143.00	685,800
ビーロット	300	1,852.00	555,600
ファーストブラザーズ	300	1,373.00	411,900
ハウスドゥ	700	1,448.00	1,013,600
シーアールイー	300	1,192.00	357,600
プロパティエージェント	200	1,160.00	232,000
ケイアイスター不動産	400	2,057.00	822,800
アグレ都市デザイン	200	576.00	115,200
グッドコムアセット	300	1,974.00	592,200
ジェイ・エス・ビー	100	5,460.00	546,000
テンポイノベーション	200	970.00	194,000
グローバルリンクマネジメント	200	631.00	126,200
住江織物	400	2,810.00	1,124,000
日本フェルト	700	499.00	349,300
イチカワ	200	1,519.00	303,800
エコナックホールディングス	2,300	145.00	333,500
日東製網	200	1,744.00	348,800
芦森工業	300	1,399.00	419,700
アツギ	1,100	853.00	938,300
ウイルプラスHLDGS	200	902.00	180,400
ジャパンミート	700	2,288.00	1,601,600
コメダホールディングス	2,900	2,143.00	6,214,700
サツドラホールディングス	200	1,833.00	366,600
アレンザホールディングス	700	946.00	662,200
串カツ田中HLDGS	200	2,294.00	458,800
パロックジャパン	900	1,015.00	913,500
クスリのアオキHLDGS	1,300	6,880.00	8,944,000
ダイニック	500	785.00	392,500
共和レザー	700	815.00	570,500

力の源HD	600	1,142.00	685,200
スシローグローバルHLDGS	1,500	9,960.00	14,940,000
LIXILピバ	1,300	1,961.00	2,549,300
アセンテック	100	2,259.00	225,900
セーレン	3,200	1,522.00	4,870,400
ソトー	500	970.00	485,000
東海染工	200	1,134.00	226,800
小松マテーレ	2,200	795.00	1,749,000
ワコールホールディングス	3,400	3,025.00	10,285,000
ホギメディカル	1,500	3,620.00	5,430,000
レナウン	3,400	113.00	384,200
クラウドシアHLDGS	300	486.00	145,800
TSIホールディングス	4,400	551.00	2,424,400
マツオカコーポレーション	400	2,401.00	960,400
ワールド	1,900	2,620.00	4,978,000
TIS	4,400	6,710.00	29,524,000
ネオス	500	840.00	420,000
電算システム	500	3,025.00	1,512,500
グリー	9,100	483.00	4,395,300
コーエーテクモHD	2,700	2,926.00	7,900,200
三菱総合研究所	600	4,385.00	2,631,000
ボルテージ	200	620.00	124,000
電算	100	2,257.00	225,700
AGS	700	826.00	578,200
ファインデックス	1,100	1,300.00	1,430,000
ブレインパッド	300	6,030.00	1,809,000
KLab	2,500	815.00	2,037,500
ポルトゥウィン・ピットクル	1,600	961.00	1,537,600
イーブックイニシアティブ	200	2,031.00	406,200
ネクソン	37,500	1,587.00	59,512,500
アイスタイル	3,400	610.00	2,074,000
エムアップ	400	2,910.00	1,164,000
エイチーム	900	1,073.00	965,700
エニグモ	900	936.00	842,400
テクノスジャパン	1,000	495.00	495,000
enish	600	713.00	427,800
コロプラ	4,300	1,175.00	5,052,500
オルトプラス	900	901.00	810,900
ブロードリーフ	6,500	645.00	4,192,500
クロス・マーケティングG	600	381.00	228,600

デジタルハーツHLDGS	700	1,043.00	730,100
システム情報	700	1,115.00	780,500
メディアドゥHLDGS	400	4,055.00	1,622,000
じげん	3,300	537.00	1,772,100
ブイキューブ	800	701.00	560,800
エンカレッジ・テクノロジー	200	940.00	188,000
サイバーリンクス	200	1,245.00	249,000
ディー・エル・イー	900	200.00	180,000
フィックスターズ	1,400	1,680.00	2,352,000
CARTA HOLDINGS	600	1,158.00	694,800
オプティム	300	4,045.00	1,213,500
セレス	400	1,234.00	493,600
SHIFT	300	9,130.00	2,739,000
特種東海製紙	800	4,060.00	3,248,000
ティーガイア	1,200	2,643.00	3,171,600
セック	200	4,035.00	807,000
日本アジアグループ	1,400	380.00	532,000
豆蔵ホールディングス	900	1,502.00	1,351,800
テクマトリックス	900	2,467.00	2,220,300
プロシップ	400	1,503.00	601,200
ガンホー・オンライン・エンター	3,200	2,234.00	7,148,800
GMOペイメントゲートウェイ	2,200	7,910.00	17,402,000
ザッパラス	700	399.00	279,300
システムリサーチ	300	1,811.00	543,300
インターネットイニシアティブ	1,900	2,983.00	5,667,700
さくらインターネット	1,400	741.00	1,037,400
ヴィンクス	400	1,277.00	510,800
GMOクラウド	200	2,612.00	522,400
SRAホールディングス	700	2,638.00	1,846,600
システムインテグレータ	400	947.00	378,800
朝日ネット	900	643.00	578,700
eBASE	800	1,502.00	1,201,600
アバント	1,000	1,073.00	1,073,000
アドソル日進	500	2,286.00	1,143,000
フリービット	800	999.00	799,200
コムチュア	1,500	2,538.00	3,807,000
サイバーコム	200	2,381.00	476,200
アステリア	800	620.00	496,000
アイル	500	2,050.00	1,025,000
王子ホールディングス	55,000	597.00	32,835,000

日本製紙	5,800	1,856.00	10,764,800
三菱製紙	1,500	487.00	730,500
北越コーポレーション	8,700	562.00	4,889,400
中越パルプ	600	1,630.00	978,000
巴川製紙	400	917.00	366,800
大王製紙	5,800	1,490.00	8,642,000
阿波製紙	300	544.00	163,200
マークライNZ	700	2,073.00	1,451,100
メディカル・データ・ビジ	1,000	874.00	874,000
g u m i	1,700	852.00	1,448,400
ショーケース	300	696.00	208,800
モバイルファクトリー	300	1,361.00	408,300
テラスカイ	500	2,417.00	1,208,500
デジタル・インフォメーション	600	1,815.00	1,089,000
P C Iホールディングス	300	2,290.00	687,000
パイプドHD	200	2,151.00	430,200
アイビーシー	200	1,319.00	263,800
ネオジャパン	200	1,100.00	220,000
P R T I M E S	100	2,564.00	256,400
ランドコンピュータ	200	1,149.00	229,800
ダブルスタンダード	200	4,815.00	963,000
オープンドア	700	1,500.00	1,050,000
マイネット	400	713.00	285,200
アカツキ	500	5,920.00	2,960,000
ベネフィットジャパン	100	1,898.00	189,800
U B I C O Mホールディングス	300	1,374.00	412,200
L I N E	3,000	5,380.00	16,140,000
カナミックネットワーク	800	828.00	662,400
ノムラシステムコーポレーション	300	552.00	165,600
レンゴー	12,400	831.00	10,304,400
トーモク	800	1,861.00	1,488,800
ザ・パック	1,000	4,000.00	4,000,000
チェンジ	300	3,050.00	915,000
シンクロ・フード	600	584.00	350,400
オークネット	800	1,323.00	1,058,400
セグエグループ	200	944.00	188,800
エイトレッド	200	1,745.00	349,000
A O I T Y O H O L D I N G S	1,300	737.00	958,100
マクロミル	2,400	1,034.00	2,481,600
ビーグリー	300	1,241.00	372,300

オロ	300	3,960.00	1,188,000
ユーザーローカル	100	3,475.00	347,500
テモナ	200	518.00	103,600
ニーズウェル	200	777.00	155,400
サインポスト	200	2,015.00	403,000
昭和電工	9,400	2,746.00	25,812,400
住友化学	96,600	482.00	46,561,200
住友精化	600	3,385.00	2,031,000
日産化学	7,400	4,670.00	34,558,000
ラサ工業	500	1,517.00	758,500
クレハ	1,100	6,680.00	7,348,000
多木化学	400	4,665.00	1,866,000
テイカ	1,000	1,976.00	1,976,000
石原産業	2,400	998.00	2,395,200
片倉コープアグリ	300	1,209.00	362,700
日本曹達	1,900	3,000.00	5,700,000
東ソー	20,300	1,665.00	33,799,500
トクヤマ	3,800	2,805.00	10,659,000
セントラル硝子	2,700	2,587.00	6,984,900
東亜合成	8,300	1,255.00	10,416,500
大阪ソーダ	1,300	3,045.00	3,958,500
関東電化	3,100	970.00	3,007,000
デンカ	4,800	3,145.00	15,096,000
イビデン	8,200	2,741.00	22,476,200
信越化学	22,800	11,960.00	272,688,000
日本カ - バイド	400	1,465.00	586,000
堺 化 学	900	2,435.00	2,191,500
第一稀元素化学工	1,400	901.00	1,261,400
エア・ウォーター	10,800	1,583.00	17,096,400
大陽日酸	12,600	2,411.00	30,378,600
日本化学工業	400	3,110.00	1,244,000
東邦アセチレン	200	1,313.00	262,600
日本パ - カライジング	6,600	1,155.00	7,623,000
高压ガス	2,100	867.00	1,820,700
チタン工業	200	2,614.00	522,800
四国化成	2,000	1,355.00	2,710,000
戸田工業	300	2,125.00	637,500
ステラ ケミファ	700	3,145.00	2,201,500
保土谷化学	500	4,225.00	2,112,500
日本触媒	2,000	6,550.00	13,100,000

大日精化	1,200	3,085.00	3,702,000	
カネカ	3,400	3,465.00	11,781,000	
協和キリン	13,500	2,665.00	35,977,500	
三菱瓦斯化学	12,400	1,650.00	20,460,000	
三井化学	11,900	2,581.00	30,713,900	
J S R	12,300	2,027.00	24,932,100	
東京応化工業	2,300	4,320.00	9,936,000	
大阪有機化学	1,200	1,671.00	2,005,200	
三菱ケミカルH L D G S	87,900	811.20	71,304,480	
K H ネオケム	2,300	2,279.00	5,241,700	
ダイセル	18,000	1,026.00	18,468,000	
住友ベークライト	2,100	4,095.00	8,599,500	
積水化学	28,300	1,865.00	52,779,500	
日本ゼオン	11,900	1,333.00	15,862,700	
アイカ工業	3,900	3,640.00	14,196,000	
宇部興産	6,600	2,297.00	15,160,200	
積水樹脂	2,400	2,301.00	5,522,400	
タキロンシーアイ	2,800	726.00	2,032,800	
旭有機材	700	1,737.00	1,215,900	
日立化成	6,100	4,590.00	27,999,000	
ニチバン	700	1,867.00	1,306,900	
リケンテクノス	3,300	522.00	1,722,600	
大倉工業	600	1,893.00	1,135,800	
積水化成品	1,800	803.00	1,445,400	
群栄化学	300	2,600.00	780,000	
タイガース ポリマー	700	601.00	420,700	
ミライアル	500	1,351.00	675,500	
ダイキアクシス	500	915.00	457,500	
ダイキョーニシカワ	2,800	828.00	2,318,400	
竹本容器	500	954.00	477,000	
森六ホールディングス	700	2,314.00	1,619,800	
日本化薬	8,100	1,357.00	10,991,700	
カーリットホールディングス	1,400	614.00	859,600	
E P S ホールディングス	1,900	1,402.00	2,663,800	
ソルクシーズ	600	1,017.00	610,200	
レグス	300	1,599.00	479,700	
プレステージ・インター	4,800	1,001.00	4,804,800	
フェイス	500	800.00	400,000	
プロトコーポレーション	1,200	1,260.00	1,512,000	
ハイマックス	200	2,079.00	415,800	

アミューズ	700	3,090.00	2,163,000
野村総合研究所	22,000	2,382.00	52,404,000
ドリームインキュベータ	400	1,576.00	630,400
サイバネットシステム	900	919.00	827,100
クイック	800	1,586.00	1,268,800
T A C	800	225.00	180,000
C Eホールディングス	800	513.00	410,400
ケネディクス	12,200	566.00	6,905,200
日本システム技術	200	1,578.00	315,600
電通グループ	13,200	3,785.00	49,962,000
インテージホールディングス	1,600	929.00	1,486,400
テイクアンドギヴニーズ	500	1,172.00	586,000
東邦システムサイエンス	300	932.00	279,600
ぴあ	400	4,665.00	1,866,000
イオンファンタジー	500	2,975.00	1,487,500
ソースネクスト	6,200	558.00	3,459,600
シーティーエス	1,400	752.00	1,052,800
ネクシィーズグループ	400	1,815.00	726,000
インフォコム	1,400	2,785.00	3,899,000
メディカルシステムネットワーク	1,300	542.00	704,600
日本精化	1,100	1,261.00	1,387,100
扶桑化学工業	1,300	3,155.00	4,101,500
トリケミカル	300	9,420.00	2,826,000
ラクスル	700	3,740.00	2,618,000
F I G	1,400	306.00	428,400
システムサポート	100	2,129.00	212,900
A D E K A	6,100	1,614.00	9,845,400
日油	5,000	3,505.00	17,525,000
ミヨシ油脂	500	1,229.00	614,500
新日本理化	2,200	206.00	453,200
ハリマ化成グループ	1,100	1,156.00	1,271,600
イーソル	500	2,340.00	1,170,000
アルテリア・ネットワークス	1,500	1,880.00	2,820,000
ヒト・コミュニケーションズHD	300	1,512.00	453,600
花 王	32,100	9,184.00	294,806,400
第一工業製薬	500	4,255.00	2,127,500
石原ケミカル	400	1,962.00	784,800
日華化学	400	877.00	350,800
ニイタカ	200	1,805.00	361,000
三洋化成	800	5,230.00	4,184,000

武田薬品	111,700	4,379.00	489,134,300
アステラス製薬	118,100	1,880.00	222,028,000
大日本住友製薬	10,000	2,175.00	21,750,000
塩野義製薬	17,200	6,929.00	119,178,800
田辺三菱製薬	16,400	2,003.00	32,849,200
わかもと製薬	1,600	261.00	417,600
あすか製薬	1,500	1,274.00	1,911,000
日本新薬	3,500	9,850.00	34,475,000
ピオフェルミン製薬	200	2,398.00	479,600
中外製薬	14,000	10,450.00	146,300,000
科研製薬	2,300	6,040.00	13,892,000
エーザイ	16,100	8,267.00	133,098,700
理研ビタミン	600	4,020.00	2,412,000
ロート製薬	6,900	3,405.00	23,494,500
小野薬品	31,700	2,586.00	81,976,200
久光製薬	3,700	5,600.00	20,720,000
有機合成薬品	1,000	290.00	290,000
持田製薬	1,900	4,445.00	8,445,500
参天製薬	25,000	2,152.00	53,800,000
扶桑薬品	500	2,055.00	1,027,500
日本ケミファ	200	2,891.00	578,200
ツムラ	4,200	3,190.00	13,398,000
日医工	3,800	1,336.00	5,076,800
テルモ	38,000	3,923.00	149,074,000
みらかホールディングス	3,600	2,663.00	9,586,800
キッセイ薬品工業	2,400	3,130.00	7,512,000
生化学工業	2,600	1,256.00	3,265,600
栄研化学	2,400	2,156.00	5,174,400
日水製薬	600	1,320.00	792,000
鳥居薬品	800	3,285.00	2,628,000
JCRファーマ	900	9,550.00	8,595,000
東和薬品	1,700	2,840.00	4,828,000
富士製薬工業	900	1,308.00	1,177,200
沢井製薬	2,800	7,090.00	19,852,000
ゼリア新薬工業	2,400	2,107.00	5,056,800
第一三共	38,400	7,176.00	275,558,400
キョーリン製薬HD	3,000	1,938.00	5,814,000
大幸薬品	500	3,485.00	1,742,500
ダイト	800	3,135.00	2,508,000
大塚ホールディングス	25,600	4,994.00	127,846,400

大正製薬HD	2,800	8,090.00	22,652,000
ペプチドリーム	6,800	5,700.00	38,760,000
大日本塗料	1,500	1,193.00	1,789,500
日本ペイントHOLD	10,800	5,570.00	60,156,000
関西ペイント	14,800	2,662.00	39,397,600
神東塗料	1,000	222.00	222,000
中国塗料	3,700	1,035.00	3,829,500
日本特殊塗料	1,000	1,458.00	1,458,000
藤倉化成	1,800	578.00	1,040,400
太陽ホールディングス	1,000	4,580.00	4,580,000
DIC	5,600	2,975.00	16,660,000
サカタインクス	2,900	1,166.00	3,381,400
東洋インキSCホールディング	2,800	2,577.00	7,215,600
T&K TOKA	1,000	1,014.00	1,014,000
アルプス技研	1,100	2,026.00	2,228,600
サニックス	2,200	369.00	811,800
ダイオーズ	300	1,365.00	409,500
日本空調サービス	1,300	836.00	1,086,800
オリエンタルランド	13,600	15,915.00	216,444,000
フォーカスシステムズ	800	1,002.00	801,600
ダスキン	3,300	3,070.00	10,131,000
パーク24	7,100	2,602.00	18,474,200
明光ネットワークジャパン	1,500	1,016.00	1,524,000
ファルコホールディングス	700	1,848.00	1,293,600
クレスコ	400	3,860.00	1,544,000
フジ・メディア・HD	12,700	1,532.00	19,456,400
秀英予備校	300	457.00	137,100
田谷	200	621.00	124,200
ラウンドワン	3,600	1,062.00	3,823,200
リゾートトラスト	5,900	1,844.00	10,879,600
オービック	4,600	15,690.00	72,174,000
ジャストシステム	2,100	6,250.00	13,125,000
TDCソフト	1,200	1,147.00	1,376,400
Zホールディングス	180,900	481.00	87,012,900
ビー・エム・エル	1,700	3,025.00	5,142,500
ワタベウェディング	200	567.00	113,400
トレンドマイクロ	5,900	5,670.00	33,453,000
りらいあコミュニケーション	2,300	1,423.00	3,272,900
IDホールディングス	500	1,649.00	824,500
リソー教育	5,900	383.00	2,259,700

日本オラクル	2,700	9,940.00	26,838,000
早稲田アカデミー	400	1,107.00	442,800
アルファシステムズ	400	2,893.00	1,157,200
フューチャー	1,600	1,937.00	3,099,200
CAC HOLDINGS	900	1,530.00	1,377,000
S Bテクノロジー	500	2,239.00	1,119,500
トーセ	400	908.00	363,200
ユー・エス・エス	14,400	2,040.00	29,376,000
オービックビジネスC	1,300	5,160.00	6,708,000
伊藤忠テクノソリュー	6,000	3,270.00	19,620,000
アイティフォー	1,600	895.00	1,432,000
東京個別指導学院	500	693.00	346,500
東計電算	200	3,595.00	719,000
サイバーエージェント	7,400	3,910.00	28,934,000
楽天	59,800	920.00	55,016,000
エックスネット	200	992.00	198,400
クリーク・アンド・リバー社	700	1,168.00	817,600
テー・オー・ダブリュー	1,100	990.00	1,089,000
大塚商会	7,100	4,505.00	31,985,500
サイボウズ	1,500	1,614.00	2,421,000
ソフトブレーン	800	643.00	514,400
山田コンサルティングG P	600	1,615.00	969,000
セントラルスポーツ	500	3,145.00	1,572,500
パラカ	300	2,004.00	601,200
電通国際情報S	800	4,555.00	3,644,000
デジタルガレージ	2,400	4,480.00	10,752,000
イーエムシステムズ	1,800	988.00	1,778,400
ウェザーニューズ	400	3,690.00	1,476,000
C I J	1,000	956.00	956,000
ビジネスエンジニアリング	200	3,115.00	623,000
日本エンタープライズ	1,300	259.00	336,700
WOWOW	600	2,702.00	1,621,200
スカラ	900	782.00	703,800
インテリジェント ウェイブ	500	823.00	411,500
フルキャストホールディングス	1,300	2,540.00	3,302,000
エン・ジャパン	2,300	4,840.00	11,132,000
富士フイルムH L D G S	25,700	5,843.00	150,165,100
コニカミノルタ	29,300	714.00	20,920,200
資 生 堂	26,700	7,955.00	212,398,500
ライオン	17,500	2,098.00	36,715,000

高砂香料	800	2,496.00	1,996,800
マンダム	3,000	3,010.00	9,030,000
ミルボン	1,800	6,260.00	11,268,000
ファンケル	5,400	3,075.00	16,605,000
コーセー	2,500	17,590.00	43,975,000
コタ	700	1,629.00	1,140,300
シーボン	200	2,482.00	496,400
ポーラ・オルビスHD	5,700	2,645.00	15,076,500
ノエビアホールディングス	1,300	5,950.00	7,735,000
アジュバンコスメジャパン	300	982.00	294,600
エステー	900	1,698.00	1,528,200
アグロカネショウ	400	1,498.00	599,200
コニシ	2,200	1,541.00	3,390,200
長谷川香料	1,800	2,186.00	3,934,800
星光PMC	800	967.00	773,600
小林製薬	3,800	9,210.00	34,998,000
荒川化学工業	1,200	1,596.00	1,915,200
メック	900	1,466.00	1,319,400
日本高純度化学	400	2,640.00	1,056,000
タカラバイオ	3,500	2,109.00	7,381,500
JCU	1,600	3,275.00	5,240,000
新田ゼラチン	800	685.00	548,000
OATアグリオ	200	1,614.00	322,800
デクセリアルズ	3,500	1,085.00	3,797,500
アース製薬	1,000	5,730.00	5,730,000
北興化学	1,400	567.00	793,800
大成ラミック	400	2,931.00	1,172,400
クミアイ化学	5,600	990.00	5,544,000
日本農薬	2,400	570.00	1,368,000
富士興産	400	679.00	271,600
ニチレキ	1,600	1,354.00	2,166,400
ユシロ化学	800	1,438.00	1,150,400
ビーピー・カストロール	500	1,477.00	738,500
富士石油	3,600	242.00	871,200
MORESCO	500	1,422.00	711,000
出光興産	15,100	3,015.00	45,526,500
JXTGホールディングス	204,200	502.80	102,671,760
コスモエネルギーHLDGS	3,900	2,529.00	9,863,100
横浜ゴム	7,800	2,066.00	16,114,800
TOYO TIRE	7,700	1,481.00	11,403,700

ブリヂストン	41,300	4,007.00	165,489,100	
住友ゴム	12,100	1,289.00	15,596,900	
藤倉コンポジット	1,200	473.00	567,600	
オカモト	800	4,045.00	3,236,000	
アキレス	900	1,855.00	1,669,500	
フコク	600	737.00	442,200	
ニッタ	1,500	3,165.00	4,747,500	
クリエートメディック	400	1,050.00	420,000	
住友理工	2,600	920.00	2,392,000	
三ツ星ベルト	1,800	2,053.00	3,695,400	
バンドー化学	2,400	903.00	2,167,200	
A G C	13,300	3,875.00	51,537,500	
日本板硝子	6,400	671.00	4,294,400	
石塚硝子	200	2,517.00	503,400	
有沢製作所	2,100	1,005.00	2,110,500	
日本山村硝子	600	1,298.00	778,800	
日本電気硝子	5,400	2,366.00	12,776,400	
オハラ	500	1,424.00	712,000	
住友大阪セメント	2,500	4,685.00	11,712,500	
太平洋セメント	8,500	3,160.00	26,860,000	
リソルホールディングス	100	4,130.00	413,000	
日本ヒューム	1,300	825.00	1,072,500	
日本コンクリート	2,900	289.00	838,100	
三谷セキサン	600	3,810.00	2,286,000	
アジアパイルHD	1,900	580.00	1,102,000	
東海カーボン	14,100	1,039.00	14,649,900	
日本カーボン	700	4,020.00	2,814,000	
東洋炭素	800	2,309.00	1,847,200	
ノリタケ	700	4,630.00	3,241,000	
TOTO	9,600	4,725.00	45,360,000	
日本碍子	16,400	1,960.00	32,144,000	
日本特殊陶業	10,400	2,114.00	21,985,600	
ダントーホールディングス	1,000	117.00	117,000	
MARUWA	500	8,610.00	4,305,000	
品川リフラクトリーズ	400	3,330.00	1,332,000	
黒崎播磨	300	6,400.00	1,920,000	
ヨータイ	1,100	715.00	786,500	
イソライト	700	647.00	452,900	
東京窯業	1,700	339.00	576,300	
ニッカトー	600	755.00	453,000	

フジミインコーポレーテッド	1,200	3,065.00	3,678,000	
クニミネ工業	500	1,314.00	657,000	
エーアンドエーマテリアル	200	1,526.00	305,200	
ニチアス	3,700	2,771.00	10,252,700	
日本製鉄	59,400	1,643.00	97,594,200	
神戸製鋼所	24,300	575.00	13,972,500	
中山製鋼所	1,800	536.00	964,800	
合同製鐵	700	2,736.00	1,915,200	
J F Eホールディングス	35,900	1,427.00	51,229,300	
東京製鐵	6,500	771.00	5,011,500	
共英製鋼	1,500	2,090.00	3,135,000	
大和工業	2,800	2,666.00	7,464,800	
東京鐵鋼	500	1,489.00	744,500	
大阪製鐵	700	1,496.00	1,047,200	
淀川製鋼所	1,800	1,982.00	3,567,600	
丸一鋼管	4,300	3,085.00	13,265,500	
モリ工業	400	2,546.00	1,018,400	
大同特殊鋼	2,200	4,675.00	10,285,000	
日本高周波	500	434.00	217,000	
日本冶金工	1,100	2,268.00	2,494,800	
山陽特殊製鋼	1,000	1,538.00	1,538,000	
愛知製鋼	700	3,660.00	2,562,000	
日立金属	14,300	1,645.00	23,523,500	
日本金属	300	913.00	273,900	
大平洋金属	900	2,540.00	2,286,000	
新日本電工	8,600	169.00	1,453,400	
栗本鉄工所	700	2,138.00	1,496,600	
虹 技	200	1,460.00	292,000	
日本鑄鉄管	100	1,652.00	165,200	
日本製鋼所	4,000	2,159.00	8,636,000	
三菱製鋼	1,000	1,052.00	1,052,000	
日亜鋼業	1,900	339.00	644,100	
日本精線	200	3,225.00	645,000	
エンビプロHD	500	855.00	427,500	
大紀アルミニウム	2,200	767.00	1,687,400	
日本軽金属HD	33,600	223.00	7,492,800	
三井金属	3,600	2,840.00	10,224,000	
東邦亜鉛	700	2,075.00	1,452,500	
三菱マテリアル	8,800	2,898.00	25,502,400	
住友鋳山	17,000	3,502.00	59,534,000	

DOWAホールディングス	3,400	4,115.00	13,991,000	
古河機金	2,400	1,423.00	3,415,200	
エス・サイエンス	5,900	47.00	277,300	
大阪チタニウム	1,400	1,515.00	2,121,000	
東邦チタニウム	2,400	928.00	2,227,200	
U A C J	2,000	2,402.00	4,804,000	
C Kサンエツ	300	3,435.00	1,030,500	
古河電工	4,100	2,750.00	11,275,000	
住友電工	49,600	1,638.00	81,244,800	
フジクラ	16,000	446.00	7,136,000	
昭和電線H L D G S	1,500	1,482.00	2,223,000	
東京特殊電線	200	2,349.00	469,800	
タツタ電線	2,600	632.00	1,643,200	
カナレ電気	200	1,825.00	365,000	
平河ヒューテック	500	1,717.00	858,500	
リョービ	1,600	1,950.00	3,120,000	
アーレステイ	1,700	547.00	929,900	
アサヒHD	2,300	2,744.00	6,311,200	
東洋製罐グループHD	8,500	1,943.00	16,515,500	
ホッカンホールディングス	700	2,052.00	1,436,400	
コロナ	700	1,071.00	749,700	
横河ブリッジH L D G S	2,500	1,920.00	4,800,000	
O S J B H D	6,600	268.00	1,768,800	
駒井ハルテック	200	1,900.00	380,000	
高田機工	100	2,660.00	266,000	
三和ホールディングス	12,700	1,230.00	15,621,000	
文化シャツタ -	3,900	937.00	3,654,300	
三協立山	1,800	1,524.00	2,743,200	
アルインコ	1,000	1,285.00	1,285,000	
東洋シャツタ -	300	706.00	211,800	
L I X I Lグループ	19,600	1,875.00	36,750,000	
日本フィルコン	1,000	563.00	563,000	
ノーリツ	2,800	1,460.00	4,088,000	
長府製作所	1,300	2,395.00	3,113,500	
リンナイ	2,600	8,510.00	22,126,000	
ユニプレス	2,600	1,510.00	3,926,000	
ダイニチ工業	700	702.00	491,400	
日東精工	1,800	640.00	1,152,000	
三洋工業	200	2,024.00	404,800	
岡 部	2,700	909.00	2,454,300	

ジーテクト	1,600	1,728.00	2,764,800
東 プ レ	2,500	1,758.00	4,395,000
高周波熱錬	2,600	904.00	2,350,400
東京製綱	900	1,256.00	1,130,400
サンコール	700	577.00	403,900
モリテックスチル	1,000	396.00	396,000
パイオラックス	2,000	2,105.00	4,210,000
エイチワン	1,300	825.00	1,072,500
日本発条	14,200	993.00	14,100,600
中央発條	200	3,055.00	611,000
アドバネクス	200	1,711.00	342,200
三浦工業	5,700	3,860.00	22,002,000
タ ク マ	4,500	1,272.00	5,724,000
テクノプロ・ホールディング	2,600	7,530.00	19,578,000
アトラ	300	336.00	100,800
インターワークス	200	536.00	107,200
アイ・アールジャパンHD	500	5,240.00	2,620,000
Ke e P e r 技研	500	1,355.00	677,500
ファーストロジック	300	611.00	183,300
三機サービス	300	1,100.00	330,000
G u n o s y	900	1,421.00	1,278,900
デザインワン・ジャパン	300	302.00	90,600
イー・ガーディアン	700	2,018.00	1,412,600
リブセンス	800	296.00	236,800
ジャパンマテリアル	3,900	1,869.00	7,289,100
ベクトル	1,600	1,063.00	1,700,800
ウチヤマホールディングス	600	542.00	325,200
チャームケアコーポレーション	800	980.00	784,000
ライクキッズ	300	820.00	246,000
キャリアリンク	400	652.00	260,800
I B J	900	1,349.00	1,214,100
アサンテ	500	2,021.00	1,010,500
N・フィールド	900	656.00	590,400
バリューHR	300	3,160.00	948,000
M&Aキャピタルパートナー	1,000	4,685.00	4,685,000
ライドオンエクスプレスHD	500	2,111.00	1,055,500
E R Iホールディングス	400	761.00	304,400
アピスト	200	2,661.00	532,200
シグマクシス	900	2,107.00	1,896,300
ウィルグループ	800	1,264.00	1,011,200

エスクロー A J	1,800	234.00	421,200
リクルートホールディングス	91,900	4,237.00	389,380,300
エラン	800	1,635.00	1,308,000
ツガミ	2,800	1,155.00	3,234,000
オークマ	1,500	5,680.00	8,520,000
東芝機械	1,500	2,949.00	4,423,500
アマダホールディングス	16,900	1,266.00	21,395,400
アイダエンジニア	3,600	961.00	3,459,600
滝澤鉄工所	400	1,383.00	553,200
F U J I	5,700	2,033.00	11,588,100
牧野フライス	1,600	4,875.00	7,800,000
オーエスジー	6,100	2,097.00	12,791,700
ダイジェット	100	1,470.00	147,000
旭ダイヤモンド	3,500	645.00	2,257,500
D M G 森精機	8,400	1,682.00	14,128,800
ソディック	3,100	974.00	3,019,400
ディスコ	1,800	26,900.00	48,420,000
日東工器	700	2,361.00	1,652,700
日進工具	400	2,872.00	1,148,800
パンチ工業	1,200	510.00	612,000
富士ダイス	600	764.00	458,400
土木管理総合試験	600	456.00	273,600
ネットマーケティング	500	960.00	480,000
ベルシステム 2 4 H L D G S	2,100	1,635.00	3,433,500
鎌倉新書	1,000	1,731.00	1,731,000
S M N	200	882.00	176,400
一蔵	100	812.00	81,200
L I T A L I C O	400	2,578.00	1,031,200
グローバルキッズCOMP	200	783.00	156,600
エアトリ	600	1,964.00	1,178,400
アトラエ	300	3,760.00	1,128,000
ストライク	500	5,530.00	2,765,000
ソラスト	3,500	1,233.00	4,315,500
セラク	400	884.00	353,600
インソース	600	3,395.00	2,037,000
豊田自動織機	10,900	6,330.00	68,997,000
豊和工業	700	890.00	623,000
O K K	500	661.00	330,500
石川製作所	300	1,891.00	567,300
東洋機械金属	900	547.00	492,300

津田駒工業	300	1,237.00	371,100
エンシュウ	300	1,339.00	401,700
島精機製作所	2,100	2,411.00	5,063,100
オプトラン	1,500	3,210.00	4,815,000
N C ホールディングス	400	705.00	282,000
イワキポンプ	600	1,288.00	772,800
フリー	1,300	1,246.00	1,619,800
ヤマシンフィルタ	2,900	854.00	2,476,600
日阪製作所	1,600	984.00	1,574,400
やまびこ	2,600	1,141.00	2,966,600
平田機工	600	7,130.00	4,278,000
ペガサスマシン製造	1,300	501.00	651,300
マルマエ	500	980.00	490,000
タツモ	600	1,417.00	850,200
ナブテスコ	7,800	3,425.00	26,715,000
三井海洋開発	1,400	2,641.00	3,697,400
レオン自動機	1,300	1,528.00	1,986,400
S M C	4,200	53,120.00	223,104,000
ヤマハモーターロボH L D G S	1,200	619.00	742,800
ホソカワミクロン	500	4,750.00	2,375,000
ユニオンツール	500	3,340.00	1,670,000
オイレス工業	1,700	1,664.00	2,828,800
日精エーエスビー	400	4,415.00	1,766,000
サト - ホールディングス	1,900	3,380.00	6,422,000
技研製作所	1,200	4,900.00	5,880,000
日本エアーテック	400	772.00	308,800
カワタ	400	1,117.00	446,800
日精樹脂工業	1,100	1,015.00	1,116,500
オカダアイヨン	400	1,283.00	513,200
ワイエイシーホールディングス	600	725.00	435,000
小松製作所	60,800	2,616.00	159,052,800
住友重機械	7,700	3,165.00	24,370,500
日立建機	5,400	3,365.00	18,171,000
日工	1,800	819.00	1,474,200
巴工業	600	2,230.00	1,338,000
井関農機	1,300	1,644.00	2,137,200
T O W A	1,400	1,175.00	1,645,000
丸山製作所	300	1,196.00	358,800
北川鉄工所	600	2,353.00	1,411,800
シンニッタン	2,100	455.00	955,500

ローツエ	600	4,560.00	2,736,000	
タカキタ	500	623.00	311,500	
クボタ	71,200	1,706.00	121,467,200	
荏原実業	300	2,295.00	688,500	
東洋エンジニア	1,800	657.00	1,182,600	
三菱化工機	500	1,926.00	963,000	
月島機械	2,500	1,665.00	4,162,500	
帝国電機製作所	1,100	1,497.00	1,646,700	
東京機械	500	370.00	185,000	
新東工業	3,200	1,027.00	3,286,400	
渋谷工業	1,200	3,080.00	3,696,000	
アイチ コーポレーション	2,300	750.00	1,725,000	
小森コーポレーション	3,400	1,118.00	3,801,200	
鶴見製作所	1,000	1,985.00	1,985,000	
住友精密	200	3,305.00	661,000	
日本ギア工業	400	405.00	162,000	
酒井重工業	300	2,824.00	847,200	
荏原製作所	6,000	3,365.00	20,190,000	
石井鉄工所	200	2,656.00	531,200	
西島製作所	1,400	910.00	1,274,000	
北越工業	1,400	1,324.00	1,853,600	
ダイキン工業	17,100	15,505.00	265,135,500	
オルガノ	500	7,460.00	3,730,000	
ト - ヨ - カネツ	600	2,287.00	1,372,200	
栗田工業	7,300	3,285.00	23,980,500	
椿本チエイン	1,900	3,805.00	7,229,500	
大同工業	600	809.00	485,400	
日 機 装	4,000	1,450.00	5,800,000	
木村化工機	1,100	681.00	749,100	
レイズネクスト	2,300	1,384.00	3,183,200	
アネスト岩田	2,100	1,062.00	2,230,200	
ダイフク	6,900	7,210.00	49,749,000	
サムコ	400	1,994.00	797,600	
加藤製作所	700	1,621.00	1,134,700	
油研工業	200	1,738.00	347,600	
タダノ	6,500	989.00	6,428,500	
フジテック	4,900	1,750.00	8,575,000	
C K D	3,700	1,969.00	7,285,300	
キトー	1,000	1,667.00	1,667,000	
平和	3,700	2,275.00	8,417,500	

理想科学工業	1,200	1,905.00	2,286,000	
SANKYO	3,000	3,685.00	11,055,000	
日本金銭機械	1,500	891.00	1,336,500	
マースグループHLDGS	900	2,067.00	1,860,300	
フクシマガリレイ	800	3,980.00	3,184,000	
オーイズミ	600	604.00	362,400	
ダイコク電機	600	1,663.00	997,800	
竹内製作所	2,200	1,632.00	3,590,400	
アマノ	3,500	3,310.00	11,585,000	
JUKI	1,900	856.00	1,626,400	
サンデンホールディングス	1,800	774.00	1,393,200	
蛇の目マシン	1,200	412.00	494,400	
ブラザー工業	16,400	2,313.00	37,933,200	
マックス	2,000	2,136.00	4,272,000	
モリタホールディングス	2,300	1,740.00	4,002,000	
グローリー	3,700	3,360.00	12,432,000	
新晃工業	1,200	1,879.00	2,254,800	
大和冷機工業	1,900	1,176.00	2,234,400	
セガサミーホールディングス	13,300	1,583.00	21,053,900	
日本ピストンリング	500	1,567.00	783,500	
リケン	600	4,045.00	2,427,000	
TPR	1,800	2,064.00	3,715,200	
ツバキ・ナカシマ	2,700	1,500.00	4,050,000	
ホシザキ	3,900	9,990.00	38,961,000	
大豊工業	1,100	828.00	910,800	
日本精工	25,300	1,025.00	25,932,500	
NTN	31,100	342.00	10,636,200	
ジェイテクト	12,900	1,290.00	16,641,000	
不二越	1,200	4,715.00	5,658,000	
ミネベアミツミ	24,900	2,373.00	59,087,700	
日本トムソン	4,000	498.00	1,992,000	
THK	7,800	3,085.00	24,063,000	
ユーシン精機	1,000	1,029.00	1,029,000	
前澤給装工業	500	2,263.00	1,131,500	
イーグル工業	1,700	1,084.00	1,842,800	
前澤工業	900	400.00	360,000	
日本ピラ - 工業	1,400	1,551.00	2,171,400	
キッツ	5,400	751.00	4,055,400	
日立	64,500	4,564.00	294,378,000	
三菱電機	134,200	1,519.00	203,849,800	

富士電機	8,100	3,340.00	27,054,000
東洋電機製造	500	1,571.00	785,500
安川電機	14,500	4,415.00	64,017,500
シンフォニアテクノロジー	1,700	1,357.00	2,306,900
明電舎	2,500	2,374.00	5,935,000
オリジン	400	1,650.00	660,000
山洋電気	600	5,500.00	3,300,000
デンヨー	1,100	2,080.00	2,288,000
ベikalレントコンサルティング	800	5,970.00	4,776,000
ORCHESTRA HLDGS	300	1,180.00	354,000
アイモバイル	400	750.00	300,000
キャリアインデックス	500	415.00	207,500
MS - Japan	400	1,587.00	634,800
船場	200	1,084.00	216,800
グレイステクノロジー	600	2,832.00	1,699,200
ジャパンエレベーターSHD	1,300	2,694.00	3,502,200
フルテック	200	1,313.00	262,600
グリーンズ	500	1,120.00	560,000
ツナググループHLDGS	200	736.00	147,200
GAMEWITH	300	785.00	235,500
ソウルドアウト	200	1,923.00	384,600
MS&CONSULTING	200	1,020.00	204,000
日総工産	800	1,183.00	946,400
キュービーネットHLDGS	800	2,515.00	2,012,000
RPAホールディングス	700	1,104.00	772,800
三桜工業	1,700	1,127.00	1,915,900
マキタ	17,500	4,095.00	71,662,500
東芝テック	1,700	4,565.00	7,760,500
芝浦メカトロニクス	200	3,950.00	790,000
マブチモーター	3,700	4,245.00	15,706,500
日本電産	16,200	15,425.00	249,885,000
ユーエムシーエレクトロニクス	800	474.00	379,200
トレックス・セミコンダクター	800	1,714.00	1,371,200
東光高岳	700	1,194.00	835,800
ダブル・スコープ	1,900	1,000.00	1,900,000
宮越ホールディングス	500	1,138.00	569,000
ダイヘン	1,500	3,560.00	5,340,000
ヤーマン	1,900	727.00	1,381,300
JVCケンウッド	10,900	269.00	2,932,100
ミマキエンジニアリング	1,200	523.00	627,600

第一精工	500	2,647.00	1,323,500
日新電機	3,100	1,348.00	4,178,800
大崎電気	2,700	689.00	1,860,300
オムロン	12,200	6,490.00	79,178,000
日東工業	2,000	2,599.00	5,198,000
I D E C	1,900	2,244.00	4,263,600
正興電機製作所	300	979.00	293,700
不二電機工業	200	1,299.00	259,800
ジーエス・ユアサ コーポ	4,500	2,387.00	10,741,500
サクサホールディングス	300	1,977.00	593,100
メルコホールディングス	500	3,050.00	1,525,000
テクノメディカ	300	2,072.00	621,600
ダイヤモンドエレクトリックHD	200	963.00	192,600
日本電気	16,300	5,040.00	82,152,000
富士通	12,900	11,125.00	143,512,500
沖電気	5,500	1,506.00	8,283,000
岩崎通信機	600	850.00	510,000
電気興業	600	3,360.00	2,016,000
サンケン電気	1,500	3,320.00	4,980,000
ナカヨ	300	1,699.00	509,700
アイホン	800	1,815.00	1,452,000
ルネサスエレクトロニクス	64,000	821.00	52,544,000
セイコーエプソン	16,700	1,622.00	27,087,400
ワコム	9,000	462.00	4,158,000
アルバック	2,700	4,355.00	11,758,500
アクセル	600	1,054.00	632,400
E I Z O	1,000	3,900.00	3,900,000
ジャパンディスプレイ	38,800	78.00	3,026,400
日本信号	3,400	1,454.00	4,943,600
京三製作所	3,100	627.00	1,943,700
能美防災	1,800	2,439.00	4,390,200
ホーチキ	1,000	1,686.00	1,686,000
星和電機	700	581.00	406,700
エレコム	1,500	4,525.00	6,787,500
パナソニック	153,400	1,041.00	159,689,400
シャープ	15,500	1,734.00	26,877,000
アンリツ	8,600	2,195.00	18,877,000
富士通ゼネラル	3,600	2,589.00	9,320,400
ソニー	85,100	7,843.00	667,439,300
T D K	6,500	12,550.00	81,575,000

帝国通信工業	600	1,234.00	740,400
タムラ製作所	4,500	726.00	3,267,000
アルプスアルパイン	11,900	2,549.00	30,333,100
池上通信機	400	1,160.00	464,000
日本電波工業	1,200	549.00	658,800
鈴木	700	803.00	562,100
日本トリム	200	4,800.00	960,000
ローランド ディー . ジー .	700	2,097.00	1,467,900
フオスタ - 電機	1,400	1,960.00	2,744,000
S M K	300	3,185.00	955,500
ヨコオ	900	3,310.00	2,979,000
ティアック	1,000	218.00	218,000
ホシデン	3,700	1,395.00	5,161,500
ヒロセ電機	2,100	14,200.00	29,820,000
日本航空電子	3,100	2,300.00	7,130,000
T O A	1,400	1,157.00	1,619,800
マクセルホールディングス	2,900	1,496.00	4,338,400
古野電気	1,700	1,365.00	2,320,500
ユニデンホールディングス	400	1,951.00	780,400
スミダコーポレーション	1,000	1,253.00	1,253,000
アイコム	700	2,741.00	1,918,700
リオン	600	3,600.00	2,160,000
本多通信工業	1,100	577.00	634,700
船井電機	1,400	698.00	977,200
横河電機	12,300	2,033.00	25,005,900
新電元工業	500	3,815.00	1,907,500
アズビル	8,500	3,095.00	26,307,500
東亜ディーケーケー	700	1,033.00	723,100
日本光電工業	5,500	3,065.00	16,857,500
チ ノ ー	500	1,423.00	711,500
共和電業	1,400	433.00	606,200
日本電子材料	500	1,119.00	559,500
堀場製作所	2,700	7,320.00	19,764,000
アドバンテスト	10,000	6,350.00	63,500,000
小野測器	600	556.00	333,600
エスペック	1,200	2,279.00	2,734,800
キーエンス	12,200	39,780.00	485,316,000
日置電機	700	3,780.00	2,646,000
シスメックス	9,600	7,656.00	73,497,600
日本マイクロニクス	2,300	1,366.00	3,141,800

メガチップス	1,200	1,883.00	2,259,600	
OBARA GROUP	700	3,675.00	2,572,500	
IMAGICA GROUP	1,100	604.00	664,400	
澤藤電機	200	2,346.00	469,200	
デンソー	29,600	4,850.00	143,560,000	
原田工業	600	1,013.00	607,800	
コーセル	1,600	1,204.00	1,926,400	
イリソ電子工業	1,100	4,785.00	5,263,500	
オプテックスグループ	2,200	1,566.00	3,445,200	
千代田インテグレ	600	2,223.00	1,333,800	
アイ・オー・データ	500	1,038.00	519,000	
レーザーテック	5,600	5,750.00	32,200,000	
スタンレー電気	9,500	3,115.00	29,592,500	
岩崎電気	500	1,474.00	737,000	
ウシオ電機	7,800	1,776.00	13,852,800	
岡谷電機	1,100	389.00	427,900	
ヘリオステクノH	1,200	472.00	566,400	
エノモト	400	1,397.00	558,800	
日本セラミック	1,400	2,697.00	3,775,800	
遠藤照明	700	717.00	501,900	
古河電池	1,000	841.00	841,000	
双信電機	700	499.00	349,300	
山一電機	1,000	1,694.00	1,694,000	
図 研	900	2,619.00	2,357,100	
日本電子	2,600	3,520.00	9,152,000	
カ シ オ	11,900	2,282.00	27,155,800	
ファナック	12,800	20,670.00	264,576,000	
日本シイエムケイ	3,200	613.00	1,961,600	
エンプラス	700	3,370.00	2,359,000	
大真空	500	1,920.00	960,000	
ロ - ム	6,000	8,900.00	53,400,000	
浜松ホトニクス	9,600	4,530.00	43,488,000	
三井ハイテック	1,500	1,754.00	2,631,000	
新光電気工業	4,500	1,350.00	6,075,000	
京 セ ラ	18,900	7,663.00	144,830,700	
協栄産業	100	1,477.00	147,700	
太陽誘電	6,000	3,540.00	21,240,000	
村田製作所	39,400	6,884.00	271,229,600	
双葉電子工業	2,100	1,349.00	2,832,900	
日東電工	9,300	6,170.00	57,381,000	

北陸電気工業	500	1,336.00	668,000
東海理化電機	3,500	2,104.00	7,364,000
ニチコン	4,600	1,093.00	5,027,800
日本ケミコン	1,000	2,014.00	2,014,000
K O A	2,000	1,402.00	2,804,000
三井E & S H D	4,800	939.00	4,507,200
日立造船	10,600	410.00	4,346,000
三菱重工業	22,500	4,304.00	96,840,000
川崎重工業	10,400	2,383.00	24,783,200
I H I	9,700	2,782.00	26,985,400
名村造船所	4,300	262.00	1,126,600
サノヤスホールディングス	1,600	181.00	289,600
スプリックス	400	1,147.00	458,800
マネジメントソリューションズ	100	3,250.00	325,000
日本車輛	500	3,230.00	1,615,000
三菱ロジスネクスト	1,800	1,496.00	2,692,800
近畿車輛	200	1,655.00	331,000
日産自動車	158,300	636.90	100,821,270
いすゞ自動車	38,900	1,229.00	47,808,100
トヨタ自動車	150,201.5	7,661.00	1,150,693,691
日野自動車	16,800	1,149.00	19,303,200
三菱自動車工業	49,700	451.00	22,414,700
エフテック	900	816.00	734,400
レシップホールディングス	500	696.00	348,000
G M B	200	801.00	160,200
ファルテック	200	1,175.00	235,000
武蔵精密工業	3,000	1,455.00	4,365,000
日産車体	2,600	1,044.00	2,714,400
新明和工業	3,600	1,485.00	5,346,000
極東開発工業	2,500	1,583.00	3,957,500
日信工業	2,700	2,234.00	6,031,800
トピー工業	1,100	1,956.00	2,151,600
ティラド	500	1,955.00	977,500
曙ブレーキ	7,400	243.00	1,798,200
タチエス	2,200	1,420.00	3,124,000
N O K	7,200	1,624.00	11,692,800
フタバ産業	3,700	726.00	2,686,200
K Y B	1,500	3,185.00	4,777,500
市光工業	2,000	721.00	1,442,000
大同メタル工業	2,600	738.00	1,918,800

プレス工業	6,700	411.00	2,753,700
ミクニ	1,700	348.00	591,600
太平洋工業	2,800	1,519.00	4,253,200
ケーヒン	3,100	2,577.00	7,988,700
河西工業	1,800	828.00	1,490,400
アイシン精機	11,100	3,900.00	43,290,000
マ ッ ダ	39,500	955.00	37,722,500
今仙電機製作所	1,200	959.00	1,150,800
本田技研	105,700	3,060.00	323,442,000
スズキ	26,600	4,578.00	121,774,800
S U B A R U	41,700	2,688.00	112,089,600
安永	600	1,213.00	727,800
ヤマハ発動機	17,500	2,131.00	37,292,500
ショーワ	3,200	2,287.00	7,318,400
小糸製作所	8,000	5,000.00	40,000,000
T B K	1,600	495.00	792,000
エクセディ	1,800	2,411.00	4,339,800
ミツバ	2,500	697.00	1,742,500
豊田合成	4,300	2,748.00	11,816,400
愛三工業	2,100	760.00	1,596,000
盟和産業	200	1,136.00	227,200
日本プラスト	1,100	709.00	779,900
ヨ ロ ズ	1,300	1,449.00	1,883,700
エフ・シー・シー	2,200	2,353.00	5,176,600
新家工業	300	1,468.00	440,400
シマノ	5,000	17,440.00	87,200,000
テイ・エス テック	3,100	3,365.00	10,431,500
ジャムコ	700	1,461.00	1,022,700
小 野 建	1,200	1,414.00	1,696,800
はるやまH L D G S	600	881.00	528,600
南 陽	300	1,908.00	572,400
ノ ジ マ	2,400	2,229.00	5,349,600
佐鳥電機	1,000	926.00	926,000
カップ・クリエイト	1,900	1,519.00	2,886,100
エコートレーディング	300	565.00	169,500
伯東	800	1,347.00	1,077,600
コンドーテック	1,000	1,146.00	1,146,000
中山福	800	547.00	437,600
ライトオン	1,000	593.00	593,000
ナガイレーベン	1,900	2,364.00	4,491,600

ジーンズメイト	400	312.00	124,800	
三菱食品	1,500	3,165.00	4,747,500	
良品計画	17,600	2,628.00	46,252,800	
三城ホールディングス	1,400	308.00	431,200	
松田産業	1,000	1,613.00	1,613,000	
第一興商	2,000	5,640.00	11,280,000	
メディパルHD	14,300	2,430.00	34,749,000	
アドヴァン	2,000	1,230.00	2,460,000	
S P K	300	2,895.00	868,500	
萩原電気HLDGS	500	2,768.00	1,384,000	
アルビス	500	2,255.00	1,127,500	
アズワン	900	10,060.00	9,054,000	
スズデン	500	1,490.00	745,000	
尾家産業	400	1,464.00	585,600	
シモジマ	800	1,193.00	954,400	
ドウシシャ	1,200	1,745.00	2,094,000	
小津産業	300	1,805.00	541,500	
コナカ	1,600	421.00	673,600	
高速	800	1,241.00	992,800	
ハウス ローゼ	200	1,678.00	335,600	
G - 7ホールディングス	800	2,458.00	1,966,400	
たけびし	500	1,479.00	739,500	
イオン北海道	1,300	796.00	1,034,800	
コジマ	2,300	562.00	1,292,600	
ヒマラヤ	500	840.00	420,000	
コーナン商事	1,900	2,522.00	4,791,800	
ネットワンシステムズ	5,000	2,866.00	14,330,000	
エコス	500	1,689.00	844,500	
ワタミ	1,600	1,306.00	2,089,600	
マルシェ	300	785.00	235,500	
リックス	300	1,750.00	525,000	
システムソフト	3,100	104.00	322,400	
パンパシフィックHD	31,700	1,932.00	61,244,400	
丸文	1,200	627.00	752,400	
西松屋チェーン	2,900	946.00	2,743,400	
ゼンショーホールディングス	6,300	2,526.00	15,913,800	
ハピネット	1,100	1,391.00	1,530,100	
幸楽苑ホールディングス	800	2,173.00	1,738,400	
ハークスレイ	300	1,292.00	387,600	
橋本総業HLDGS	300	1,906.00	571,800	

日本ライフライン	3,900	1,509.00	5,885,100
サイゼリヤ	2,200	2,592.00	5,702,400
タカショー	600	528.00	316,800
エクセル	400	1,592.00	636,800
V Tホールディングス	5,500	477.00	2,623,500
マルカ	500	2,307.00	1,153,500
アルゴグラフィックス	1,100	3,515.00	3,866,500
魚力	400	1,592.00	636,800
I D O M	3,600	585.00	2,106,000
日本エム・ディ・エム	800	2,539.00	2,031,200
ポプラ	300	500.00	150,000
フジ・コーポレーション	300	2,256.00	676,800
ユナイテッドアローズ	1,400	2,996.00	4,194,400
進和	800	2,434.00	1,947,200
エスケイジャパン	300	496.00	148,800
ダイترون	600	1,972.00	1,183,200
ハイデイ日高	1,900	2,024.00	3,845,600
シークス	1,700	1,465.00	2,490,500
京都きもの友禅	800	351.00	280,800
コロワイド	4,400	2,310.00	10,164,000
ピーシーデポコーポ	1,800	586.00	1,054,800
田中商事	400	756.00	302,400
オーハシテクニカ	700	1,528.00	1,069,600
壱番屋	900	5,990.00	5,391,000
白銅	500	1,548.00	774,000
トップカルチャー	500	337.00	168,500
P L A N T	300	621.00	186,300
スギホールディングス	2,600	5,780.00	15,028,000
薬王堂ホールディングス	600	2,367.00	1,420,200
島津製作所	16,000	3,410.00	54,560,000
J M S	1,100	808.00	888,800
クボテック	300	401.00	120,300
長野計器	1,000	941.00	941,000
ブイ・テクノロジー	600	5,360.00	3,216,000
スター精密	2,100	1,553.00	3,261,300
東京計器	900	1,116.00	1,004,400
愛知時計	200	4,415.00	883,000
インターアクション	700	2,923.00	2,046,100
オーバル	1,200	249.00	298,800
東京精密	2,400	4,310.00	10,344,000

マニー	5,300	3,125.00	16,562,500
ニコン	21,700	1,381.00	29,967,700
トプコン	6,800	1,696.00	11,532,800
オリンパス	74,300	1,740.00	129,282,000
理研計器	1,200	2,254.00	2,704,800
S C R E E Nホールディングス	2,300	7,960.00	18,308,000
キヤノン電子	1,400	2,121.00	2,969,400
タムロン	1,100	2,584.00	2,842,400
HOYA	27,000	10,650.00	287,550,000
シード	600	1,105.00	663,000
ノーリツ鋼機	900	1,497.00	1,347,300
エー・アンド・デイ	1,200	1,062.00	1,274,400
朝日インテック	11,400	3,235.00	36,879,000
キヤノン	72,300	3,060.00	221,238,000
リコー	34,200	1,247.00	42,647,400
シチズン時計	15,700	585.00	9,184,500
リズム時計	400	931.00	372,400
大研医器	900	667.00	600,300
メニコン	1,800	4,730.00	8,514,000
シンシア	100	624.00	62,400
中本パックス	300	1,658.00	497,400
スノーピーク	600	1,098.00	658,800
パラマウントベッドHD	1,400	4,655.00	6,517,000
トランザクション	900	971.00	873,900
粧美堂	400	398.00	159,200
ニホンフラッシュ	600	2,914.00	1,748,400
前田工織	1,500	2,211.00	3,316,500
永大産業	1,800	354.00	637,200
アートネイチャー	1,400	857.00	1,199,800
バンダイナムコHLDGS	13,900	6,569.00	91,309,100
アイフィスジャパン	300	766.00	229,800
共立印刷	2,200	170.00	374,000
SHOEI	600	5,190.00	3,114,000
フランスベッドHLDGS	1,900	964.00	1,831,600
マーベラス	2,000	725.00	1,450,000
パイロットコーポレーション	2,300	4,455.00	10,246,500
萩原工業	700	1,671.00	1,169,700
エイベックス	2,300	1,244.00	2,861,200
トッパン・フォームズ	2,900	1,178.00	3,416,200
フジシールインターナショナル	3,000	2,370.00	7,110,000

タカラトミー	6,000	1,307.00	7,842,000
廣濟堂	900	818.00	736,200
エステールホールディングス	400	692.00	276,800
アーク	5,100	94.00	479,400
レック	1,400	1,279.00	1,790,600
タカノ	500	800.00	400,000
三光合成	1,500	386.00	579,000
プロネクサス	1,200	1,250.00	1,500,000
ホクシン	800	159.00	127,200
ウッドワン	500	1,237.00	618,500
大建工業	900	1,945.00	1,750,500
きもと	2,300	177.00	407,100
凸版印刷	18,900	2,264.00	42,789,600
大日本印刷	17,600	3,015.00	53,064,000
共同印刷	400	3,000.00	1,200,000
N I S S H A	2,800	1,096.00	3,068,800
光村印刷	100	1,752.00	175,200
藤森工業	1,200	3,515.00	4,218,000
ヴィア・ホールディングス	1,600	677.00	1,083,200
TAKARA & COMPANY	600	1,731.00	1,038,600
前澤化成工業	900	1,199.00	1,079,100
未来工業	700	2,175.00	1,522,500
アシックス	11,100	1,603.00	17,793,300
ツ ツ ミ	400	2,140.00	856,000
ウェーブロックHLDGS	500	832.00	416,000
ジェイ エス ピー	800	1,919.00	1,535,200
ニチハ	1,900	2,589.00	4,919,100
エフピコ	1,500	6,550.00	9,825,000
小松ウオール工業	400	2,217.00	886,800
ヤマハ	8,000	6,230.00	49,840,000
河合楽器	400	3,935.00	1,574,000
クリナップ	1,200	740.00	888,000
ピジョン	8,100	4,185.00	33,898,500
天馬	900	2,008.00	1,807,200
オリバー	300	3,600.00	1,080,000
兼松サステック	100	1,842.00	184,200
キングジム	1,100	881.00	969,100
象印マホービン	3,900	2,317.00	9,036,300
リンテック	3,200	2,415.00	7,728,000
信越ポリマー	2,400	1,063.00	2,551,200

東リ	3,300	304.00	1,003,200	
イトーキ	2,900	517.00	1,499,300	
任天堂	8,200	43,440.00	356,208,000	
三菱鉛筆	2,200	1,682.00	3,700,400	
松風	600	1,896.00	1,137,600	
タカラスタンダ-ド	2,800	1,986.00	5,560,800	
コクヨ	6,400	1,654.00	10,585,600	
ナカバヤシ	1,300	621.00	807,300	
ニフコ	4,900	2,988.00	14,641,200	
立川ブラインド	600	1,312.00	787,200	
グローブライド	600	2,606.00	1,563,600	
オカムラ	4,700	1,099.00	5,165,300	
バルカー	1,100	2,548.00	2,802,800	
MUTOHホールディングス	200	1,703.00	340,600	
伊藤忠	92,500	2,574.50	238,141,250	
丸紅	137,600	821.00	112,969,600	
スクロール	2,000	380.00	760,000	
高島	200	1,986.00	397,200	
ヨンドシーホールディングス	1,300	2,556.00	3,322,800	
三陽商会	700	1,360.00	952,000	
長瀬産業	7,400	1,603.00	11,862,200	
ナイガイ	500	461.00	230,500	
蝶理	800	2,147.00	1,717,600	
豊田通商	14,800	3,810.00	56,388,000	
オンワ-ドホールディングス	7,900	655.00	5,174,500	
三共生興	2,000	600.00	1,200,000	
兼松	4,900	1,451.00	7,109,900	
美津濃	1,200	2,734.00	3,280,800	
ツカモトコーポレーション	200	1,131.00	226,200	
ファミリーマート	10,600	2,625.00	27,825,000	
ルックホールディングス	400	1,193.00	477,200	
三井物産	116,200	1,971.50	229,088,300	
日本紙パルプ	800	4,205.00	3,364,000	
東京エレクトロン	9,000	24,840.00	223,560,000	
日立ハイテクノロジーズ	4,600	7,920.00	36,432,000	
カメイ	1,700	1,242.00	2,111,400	
東都水産	200	2,760.00	552,000	
OUGホールディングス	200	2,702.00	540,400	
スターゼン	500	4,350.00	2,175,000	
セイコーHD	1,900	2,954.00	5,612,600	

山 善	5,200	1,080.00	5,616,000	
椿本興業	200	4,245.00	849,000	
住友商事	83,400	1,614.00	134,607,600	
日本ユニシス	4,100	3,545.00	14,534,500	
内田洋行	600	7,720.00	4,632,000	
三菱商事	92,800	2,897.00	268,841,600	
第一実業	600	3,795.00	2,277,000	
キヤノンマーケティングJPN	3,800	2,553.00	9,701,400	
西華産業	700	1,346.00	942,200	
佐藤商事	1,100	1,005.00	1,105,500	
菱洋エレクトロ	1,300	2,064.00	2,683,200	
東京産業	1,200	620.00	744,000	
ユアサ商事	1,300	3,630.00	4,719,000	
神鋼商事	300	2,726.00	817,800	
小林産業	800	295.00	236,000	
阪和興業	2,500	2,829.00	7,072,500	
正栄食品	900	4,085.00	3,676,500	
カナデン	1,100	1,378.00	1,515,800	
菱電商事	1,000	1,677.00	1,677,000	
ニプロ	9,300	1,296.00	12,052,800	
フルサト工業	700	1,730.00	1,211,000	
岩谷産業	2,900	3,710.00	10,759,000	
すてきナイスグループ	600	1,263.00	757,800	
昭光通商	400	726.00	290,400	
ニチモウ	200	1,985.00	397,000	
極東貿易	400	2,198.00	879,200	
イワキ	1,700	449.00	763,300	
兼松エレクトロニクス	700	3,565.00	2,495,500	
三愛石油	3,300	1,185.00	3,910,500	
稲畑産業	2,900	1,601.00	4,642,900	
G S Iクレオス	300	1,300.00	390,000	
明和産業	1,200	611.00	733,200	
クワザワ	500	700.00	350,000	
キムラタン	6,900	30.00	207,000	
ゴ-ルドウイン	2,400	7,900.00	18,960,000	
ユニ・チャ-ム	25,900	3,754.00	97,228,600	
デサント	2,600	2,073.00	5,389,800	
キ ン グ	600	550.00	330,000	
ワ キ タ	2,800	1,114.00	3,119,200	
ヤマトインタ-ナショナル	800	413.00	330,400	

東邦ホールディングス	4,200	2,411.00	10,126,200	
サンゲツ	3,600	2,076.00	7,473,600	
ミツウロコグループ	1,900	1,212.00	2,302,800	
シナネンホールディングス	500	1,983.00	991,500	
伊藤忠エネクス	2,900	915.00	2,653,500	
サンリオ	3,700	2,174.00	8,043,800	
サンワ テクノス	900	1,132.00	1,018,800	
リョーサン	1,500	2,746.00	4,119,000	
新光商事	2,100	904.00	1,898,400	
トーホー	600	1,960.00	1,176,000	
三信電気	700	1,785.00	1,249,500	
東陽テクニカ	1,500	1,319.00	1,978,500	
モスフード サービス	1,700	3,035.00	5,159,500	
加賀電子	1,300	2,589.00	3,365,700	
三益半導体	1,200	2,342.00	2,810,400	
ソーダニツカ	1,400	633.00	886,200	
立花エレテック	1,000	1,859.00	1,859,000	
木曽路	1,700	2,971.00	5,050,700	
S R Sホールディングス	1,600	1,051.00	1,681,600	
千 趣 会	2,400	462.00	1,108,800	
タカキユー	1,000	190.00	190,000	
ケーヨー	2,700	558.00	1,506,600	
上新電機	1,600	2,508.00	4,012,800	
日本瓦斯	2,100	3,355.00	7,045,500	
ロイヤルホールディングス	2,300	2,455.00	5,646,500	
東 天 紅	100	1,286.00	128,600	
いなげや	1,600	1,490.00	2,384,000	
島 忠	2,800	3,230.00	9,044,000	
チヨダ	1,400	1,596.00	2,234,400	
ライフコーポレーション	1,000	2,503.00	2,503,000	
リンガーハット	1,600	2,533.00	4,052,800	
Mr Max HD	1,800	505.00	909,000	
テンアライド	1,200	443.00	531,600	
A O K Iホールディングス	2,600	1,100.00	2,860,000	
オークワ	2,100	1,477.00	3,101,700	
コメリ	2,000	2,248.00	4,496,000	
青山商事	2,700	1,535.00	4,144,500	
しまむら	1,500	8,300.00	12,450,000	
はせがわ	700	401.00	280,700	
高 島 屋	9,600	1,239.00	11,894,400	

松屋	2,700	852.00	2,300,400
エイチ・ツー・オーリテイリング	6,300	1,213.00	7,641,900
近鉄百貨店	500	3,870.00	1,935,000
パルコ	1,300	1,849.00	2,403,700
丸井グループ	12,100	2,776.00	33,589,600
アクシアルリテイリング	1,100	3,760.00	4,136,000
井筒屋	700	250.00	175,000
イオン	50,900	2,280.00	116,052,000
イズミ	2,700	3,820.00	10,314,000
フォーバル	600	1,198.00	718,800
平和堂	2,700	2,052.00	5,540,400
フジ	1,600	1,870.00	2,992,000
ヤオコー	1,500	5,560.00	8,340,000
ゼビオホールディングス	1,600	1,269.00	2,030,400
ケーズホールディングス	12,800	1,427.00	18,265,600
PALTAC	2,100	5,540.00	11,634,000
三谷産業	1,700	342.00	581,400
OLYMPICグループ	700	627.00	438,900
日産東京販売HD	1,900	288.00	547,200
アドバンテッジリスクマネ	600	1,026.00	615,600
三井不動産	65,700	2,742.00	180,149,400
三菱地所	92,800	2,081.00	193,116,800
平和不動産	2,400	3,080.00	7,392,000
東京建物	14,500	1,726.00	25,027,000
ダイビル	3,400	1,294.00	4,399,600
京阪神ビルディング	2,100	1,424.00	2,990,400
住友不動産	29,800	3,834.00	114,253,200
太平洋興発	500	811.00	405,500
テーオーシー	2,600	917.00	2,384,200
東京楽天地	200	6,190.00	1,238,000
レオパレス21	17,400	387.00	6,733,800
スターツコーポレーション	1,800	2,780.00	5,004,000
フジ住宅	1,500	694.00	1,041,000
空港施設	1,300	548.00	712,400
明和地所	700	621.00	434,700
ゴールドクレスト	1,000	2,096.00	2,096,000
リログループ	7,000	3,100.00	21,700,000
エスリード	500	2,106.00	1,053,000
日神グループHLDGS	2,000	547.00	1,094,000
日本エスコン	2,400	917.00	2,200,800

タカラレーベン	6,100	499.00	3,043,900
A V A N T I A	700	1,039.00	727,300
イオンモール	6,600	1,893.00	12,493,800
毎日コムネット	300	948.00	284,400
ファースト住建	600	1,241.00	744,600
ランド	72,100	12.00	865,200
カチタス	1,600	4,820.00	7,712,000
東祥	800	2,422.00	1,937,600
トーセイ	1,800	1,475.00	2,655,000
穴吹興産	200	1,760.00	352,000
サンフロンティア不動産	1,800	1,323.00	2,381,400
エフ・ジェー・ネクスト	1,200	1,147.00	1,376,400
インテリックス	400	759.00	303,600
ランドビジネス	600	728.00	436,800
日本社宅サービス	300	1,105.00	331,500
グランディハウス	1,000	486.00	486,000
東武鉄道	14,200	3,965.00	56,303,000
相鉄ホールディングス	4,300	2,983.00	12,826,900
東急	33,900	1,975.00	66,952,500
京浜急行	17,200	2,102.00	36,154,400
小田急電鉄	20,000	2,553.00	51,060,000
京王電鉄	7,000	6,600.00	46,200,000
京成電鉄	9,300	4,325.00	40,222,500
富士急行	1,800	4,160.00	7,488,000
新京成電鉄	300	2,375.00	712,500
東日本旅客鉄道	23,600	9,889.00	233,380,400
西日本旅客鉄道	12,000	9,451.00	113,412,000
東海旅客鉄道	11,200	21,920.00	245,504,000
西武ホールディングス	18,000	1,816.00	32,688,000
鴻池運輸	2,100	1,631.00	3,425,100
西日本鉄道	3,700	2,518.00	9,316,600
ハマキョウレックス	1,000	3,540.00	3,540,000
サカイ引越センター	700	6,860.00	4,802,000
近鉄グループHLDGS	12,700	5,970.00	75,819,000
阪急阪神HLDGS	17,000	4,715.00	80,155,000
南海電鉄	6,000	3,000.00	18,000,000
京阪ホールディングス	5,700	5,310.00	30,267,000
神戸電鉄	300	3,995.00	1,198,500
名古屋鉄道	10,500	3,390.00	35,595,000
山陽電鉄	900	2,211.00	1,989,900

トランコム	400	8,040.00	3,216,000	
日本通運	4,500	6,360.00	28,620,000	
ヤマトホールディングス	22,300	1,883.00	41,990,900	
山 九	3,500	5,610.00	19,635,000	
日 新	1,100	1,844.00	2,028,400	
丸 運	700	342.00	239,400	
丸全昭和運輸	1,000	3,160.00	3,160,000	
センコーグループHLDGS	7,000	919.00	6,433,000	
トナミホールディングス	300	5,220.00	1,566,000	
ニッコンホールディングス	4,600	2,711.00	12,470,600	
日石輸送	100	2,911.00	291,100	
福山通運	1,600	4,050.00	6,480,000	
セイノーホールディングス	9,500	1,464.00	13,908,000	
エスライン	400	1,035.00	414,000	
神奈川中央交通	300	4,040.00	1,212,000	
日立物流	2,300	3,150.00	7,245,000	
丸和運輸機関	1,300	2,420.00	3,146,000	
C & F ロジホールディングス	1,300	1,388.00	1,804,400	
日本郵船	10,600	1,922.00	20,373,200	
商船三井	8,000	2,911.00	23,288,000	
川崎汽船	3,900	1,715.00	6,688,500	
NSユナイテッド海運	700	2,178.00	1,524,600	
明治海運	1,400	383.00	536,200	
飯野海運	6,000	367.00	2,202,000	
共栄タンカー	200	985.00	197,000	
九州旅客鉄道	11,300	3,645.00	41,188,500	
SGホールディングス	13,300	2,478.00	32,957,400	
日本航空	23,300	3,432.00	79,965,600	
ANAホールディングス	23,200	3,588.00	83,241,600	
パスコ	200	1,993.00	398,600	
西本WISMETTAC HD	200	3,515.00	703,000	
ヤマシタヘルスケアHLDGS	100	2,400.00	240,000	
GENKY DRUGSTORES	600	2,309.00	1,385,400	
国際紙パルプ商事	3,100	296.00	917,600	
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,375.00	275,000	
総合メディカルHD	1,200	2,003.00	2,403,600	
ブックオフGHD	800	1,002.00	801,600	
三菱倉庫	4,000	2,855.00	11,420,000	
三井倉庫HOLD	1,500	1,982.00	2,973,000	
住友倉庫	4,700	1,506.00	7,078,200	

渋沢倉庫	700	2,325.00	1,627,500
ヤマタネ	700	1,600.00	1,120,000
東陽倉庫	2,300	334.00	768,200
乾汽船	700	1,155.00	808,500
日本トランスシティ	2,800	537.00	1,503,600
ケイヒン	200	1,332.00	266,400
中央倉庫	800	1,208.00	966,400
川西倉庫	200	1,044.00	208,800
安田倉庫	1,000	1,030.00	1,030,000
ファイズホールディングス	300	558.00	167,400
東洋埠頭	400	1,401.00	560,400
宇徳	1,100	586.00	644,600
上組	7,300	2,411.00	17,600,300
サンリツ	300	737.00	221,100
キムラユニティー	300	1,153.00	345,900
キューソー流通システム	300	1,900.00	570,000
近鉄エクスプレス	2,700	1,895.00	5,116,500
東海運	700	291.00	203,700
エーアイティー	900	1,083.00	974,700
内外トランスライン	400	1,384.00	553,600
ショーエイコーポ	100	784.00	78,400
日本コンセプト	400	1,522.00	608,800
東京放送HD	8,000	1,873.00	14,984,000
日本テレビHLD S	11,000	1,457.00	16,027,000
朝日放送グループHD	1,300	765.00	994,500
テレビ朝日HD	3,600	1,984.00	7,142,400
スカパーJ S A T H D	8,700	480.00	4,176,000
テレビ東京HD	1,100	2,429.00	2,671,900
日本BS放送	400	1,169.00	467,600
ビジョン	1,200	1,867.00	2,240,400
スマートバリュー	400	804.00	321,600
USEN-NEXT HLDGS	500	1,482.00	741,000
ワイヤレスゲート	600	722.00	433,200
コネクシオ	700	1,698.00	1,188,600
日本通信	10,200	237.00	2,417,400
クロップス	200	727.00	145,400
日本電信電話	176,400	2,788.50	491,891,400
KDDI	98,200	3,288.00	322,881,600
ソフトバンク	119,700	1,477.00	176,796,900
光通信	1,400	27,430.00	38,402,000

NTTドコモ	97,300	3,074.00	299,100,200	
エムティーアイ	1,300	737.00	958,100	
GMOインターネット	5,200	2,259.00	11,746,800	
ファイバーゲート	200	1,408.00	281,600	
アйдママーケティングコミュ	400	696.00	278,400	
KADOKAWA	3,500	2,073.00	7,255,500	
学研ホールディングス	400	7,510.00	3,004,000	
ゼンリン	2,600	1,748.00	4,544,800	
昭文社	600	394.00	236,400	
インプレスホールディングス	1,100	188.00	206,800	
東京電力HD	107,200	443.00	47,489,600	
中部電力	41,100	1,473.00	60,540,300	
関西電力	50,900	1,234.00	62,810,600	
中国電力	18,600	1,427.00	26,542,200	
北陸電力	12,300	775.00	9,532,500	
東北電力	33,500	1,038.00	34,773,000	
四国電力	12,100	1,037.00	12,547,700	
九州電力	27,700	898.00	24,874,600	
北海道電力	12,600	509.00	6,413,400	
沖縄電力	2,500	2,006.00	5,015,000	
電源開発	10,700	2,555.00	27,338,500	
エフオン	600	739.00	443,400	
イーレックス	1,900	1,815.00	3,448,500	
レノバ	2,200	1,147.00	2,523,400	
東京瓦斯	25,800	2,633.00	67,931,400	
大阪瓦斯	26,100	2,001.00	52,226,100	
東邦瓦斯	6,600	4,390.00	28,974,000	
北海道瓦斯	700	1,604.00	1,122,800	
広島ガス	2,800	353.00	988,400	
西部瓦斯	1,500	2,478.00	3,717,000	
静岡ガス	3,800	930.00	3,534,000	
メタウォーター	700	4,335.00	3,034,500	
アイネット	700	1,660.00	1,162,000	
松竹	900	16,250.00	14,625,000	
東宝	7,900	4,485.00	35,431,500	
エイチ・アイ・エス	2,000	3,055.00	6,110,000	
東映	500	16,390.00	8,195,000	
ラックランド	300	2,172.00	651,600	
NTTデータ	35,100	1,554.00	54,545,400	
共立メンテナンス	2,100	5,080.00	10,668,000	

イチネンホールディングス	1,400	1,559.00	2,182,600
建設技術研究所	900	2,315.00	2,083,500
スペース	800	1,287.00	1,029,600
長 大	500	1,328.00	664,000
アインホールディングス	1,800	6,850.00	12,330,000
燦ホールディングス	600	1,464.00	878,400
ピー・シー・エー	200	5,150.00	1,030,000
スバル興業	100	9,920.00	992,000
東京テアトル	500	1,392.00	696,000
タナベ経営	200	1,295.00	259,000
ビジネスB太田昭和	200	2,501.00	500,200
ナ ガ ワ	400	7,910.00	3,164,000
よみうりランド	300	4,530.00	1,359,000
東京都競馬	800	3,340.00	2,672,000
常磐興産	500	1,677.00	838,500
カナモト	2,100	2,794.00	5,867,400
東京ドーム	5,200	1,085.00	5,642,000
D T S	2,900	2,550.00	7,395,000
スクウェア・エニックス・HD	5,600	5,670.00	31,752,000
シーイーシー	1,400	2,186.00	3,060,400
カプコン	6,200	3,100.00	19,220,000
西尾レントオール	1,300	3,105.00	4,036,500
アイ・エス・ビー	300	2,177.00	653,100
アゴーラ・ホスピタリティーG	8,200	33.00	270,600
日本空港ビルデング	4,200	5,940.00	24,948,000
トランス・コスモス	1,200	2,846.00	3,415,200
乃村工藝社	5,500	1,358.00	7,469,000
ジャステック	800	1,194.00	955,200
S C S K	3,000	5,890.00	17,670,000
藤田観光	600	2,829.00	1,697,400
K N T - C Tホールディングス	800	1,505.00	1,204,000
日本管財	1,400	1,970.00	2,758,000
トーカイ	1,200	2,726.00	3,271,200
白 洋 舎	100	2,826.00	282,600
セコム	13,600	9,798.00	133,252,800
日本システムウエア	400	2,568.00	1,027,200
セントラル警備保障	600	6,370.00	3,822,000
アイネス	1,300	1,424.00	1,851,200
丹青社	2,400	1,340.00	3,216,000
メイテック	1,600	6,350.00	10,160,000

T K C	1,100	5,340.00	5,874,000
富士ソフト	1,700	4,380.00	7,446,000
応用地質	1,400	1,440.00	2,016,000
船井総研ホールディング	2,700	2,695.00	7,276,500
N S D	4,400	1,788.00	7,867,200
進学会ホールディングス	500	529.00	264,500
丸紅建材リース	100	1,831.00	183,100
オ オ バ	1,000	938.00	938,000
コナミホールディングス	4,800	4,475.00	21,480,000
いであ	200	2,800.00	560,000
学 究 社	400	1,411.00	564,400
ベネッセホールディングス	4,300	2,944.00	12,659,200
イオンディライト	1,600	4,050.00	6,480,000
ナック	700	1,017.00	711,900
福井コンピュータH L D S	500	3,605.00	1,802,500
ニチイ学館	1,800	1,626.00	2,926,800
ダイセキ	2,200	3,160.00	6,952,000
ステップ	500	1,600.00	800,000
日鉄物産	900	5,140.00	4,626,000
泉州電業	400	3,480.00	1,392,000
元気寿司	300	2,954.00	886,200
トラスコ中山	2,800	2,780.00	7,784,000
ヤマダ電機	40,300	572.00	23,051,600
オートバックスセブン	4,900	1,701.00	8,334,900
モリト	1,000	778.00	778,000
アークランドサカモト	2,100	1,246.00	2,616,600
ニトリホールディングス	5,700	17,400.00	99,180,000
グルメ杵屋	900	1,222.00	1,099,800
愛 眼	1,100	247.00	271,700
ケーユーホールディングス	700	933.00	653,100
吉野家ホールディングス	4,300	3,025.00	13,007,500
加藤産業	2,100	3,435.00	7,213,500
北恵	300	926.00	277,800
イノテック	800	1,255.00	1,004,000
イエローハット	2,500	1,931.00	4,827,500
松屋フーズH L D G S	600	4,750.00	2,850,000
J B C Cホールディングス	900	1,932.00	1,738,800
J Kホールディングス	1,200	749.00	898,800
サガミホールディングス	1,800	1,375.00	2,475,000
日 伝	1,200	2,090.00	2,508,000

関西スーパーマーケット	1,100	1,044.00	1,148,400	
ミロク情報サービス	1,200	3,390.00	4,068,000	
北沢産業	1,000	274.00	274,000	
杉本商事	700	2,062.00	1,443,400	
因幡電機産業	3,800	2,714.00	10,313,200	
王将フードサービス	1,000	6,700.00	6,700,000	
プレナス	1,500	1,945.00	2,917,500	
ミニストップ	1,000	1,570.00	1,570,000	
アークス	2,700	2,303.00	6,218,100	
バローホールディングス	2,900	2,074.00	6,014,600	
東 テ ク	400	2,658.00	1,063,200	
ミスミグループ本社	16,600	2,908.00	48,272,800	
藤 久	100	727.00	72,700	
アルテック	1,000	241.00	241,000	
ベ ル ク	700	5,640.00	3,948,000	
大 庄	700	1,679.00	1,175,300	
タキヒヨー	400	1,850.00	740,000	
ファーストリテイリング	1,800	61,990.00	111,582,000	
ソフトバンクグループ	104,500	4,878.00	509,751,000	
蔵王産業	300	1,490.00	447,000	
スズケン	5,600	4,470.00	25,032,000	
サンドラッグ	5,000	3,995.00	19,975,000	
サックスパーホールディング	1,100	921.00	1,013,100	
ジェコス	900	1,129.00	1,016,100	
ヤマザワ	300	1,697.00	509,100	
や ま や	300	2,280.00	684,000	
グローセル	1,300	468.00	608,400	
ベルーナ	2,800	696.00	1,948,800	
合計			29,493,240,421	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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】

2020年1月31日

資産総額	29,014,683,297円
負債総額	362,171,270円
純資産総額（ - ）	28,652,512,027円
発行済数量	21,943,295口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1,305.75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。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2020年1月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に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. 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。

ハ. 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。

ニ. 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

・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。

2020年1月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	63	117,577
追加型株式投資信託	696	16,519,998
株式投資信託 合計	759	16,637,574
単位型公社債投資信託	30	101,950
追加型公社債投資信託	14	1,486,108
公社債投資信託 合計	44	1,588,057
総合計	803	18,225,632

3 【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期事業年度（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。

また、第61期事業年度に係る中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	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、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、

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 その他有価証券		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 (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)
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 (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)
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 (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)
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。

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。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (2019年9月30日)	
資産の部		
流動資産		
現金・預金		19,529
有価証券		724
未収委託者報酬		11,175
その他		383
流動資産合計		31,812
固定資産		
有形固定資産	1	211
無形固定資産		
ソフトウェア		2,380
その他		403
無形固定資産合計		2,784
投資その他の資産		
投資有価証券		7,928
関係会社株式		2,664
繰延税金資産		1,205
その他		1,280
投資その他の資産合計		13,078
固定資産合計		16,073
資産合計		47,886

（単位：百万円）

当中間会計期間
（2019年9月30日）

負債の部	
流動負債	
未払金	6,021
未払費用	3,486
未払法人税等	754
賞与引当金	506
その他	2 474
流動負債合計	11,243
固定負債	
退職給付引当金	2,483
役員退職慰労引当金	128
その他	7
固定負債合計	2,619
負債合計	13,862
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,968
利益剰余金合計	7,343
株主資本合計	34,013
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	10
評価・換算差額等合計	10
純資産合計	34,023
負債・純資産合計	47,886

（2）中間損益計算書

（単位：百万円）

当中間会計期間

(自 2019年4月1日
至 2019年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		35,076
その他営業収益		309
営業収益合計		35,385
営業費用		
支払手数料		15,895
その他営業費用		6,272
営業費用合計		22,167
一般管理費	1	5,954
営業利益		7,263
営業外収益	2	968
営業外費用	3	148
経常利益		8,083
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		8,083
法人税、住民税及び事業税		2,313
法人税等調整額		15
中間純利益		5,785

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868

中間純利益	-	-	-	5,785	5,785	5,785
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	6,083	6,083	6,083
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,968	7,343	34,013

	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	46	46	40,142
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
中間純利益	-	-	5,785
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	35	35	35
当中間期変動額合計	35	35	6,118
当中間期末残高	10	10	34,023

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

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とおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 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。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2019年9月30日現在)
有形固定資産	310百万円

2 消費税等の取扱い

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

3 保証債務

当中間会計期間(2019年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,639百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
有形固定資産	14百万円
無形固定資産	472百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
受取配当金	901百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
有価証券償還損	71百万円
為替差損	68百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日

2019年6月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年3月31 日	2019年6月24日
----------------------	------	--------	-------	----------------	------------

(金融商品関係)

当中間会計期間(2019年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、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)。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金・預金	19,529	19,529	-
(2)未収委託者報酬	11,175	11,175	-
(3)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,986	7,986	-
資産合計	38,691	38,691	-
(1)未払金	(5,965)	(5,965)	-
(2)未払費用(*2)	(2,867)	(2,867)	-
負債合計	(8,833)	(8,833)	-

(*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・預金及び(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)未払金及び(2)未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と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	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,836
関連会社株式	827
差入保証金	1,068

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。

（有価証券関係）

当中間会計期間（2019年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,836百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 827百万円）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

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	66	55	11
（2）その他			
証券投資信託	3,971	3,628	343
小計	4,038	3,683	354
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,947	4,292	344
小計	3,947	4,292	344
合計	7,986	7,975	10

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 666百万円）については、市場価格がなく、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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

[関連情報]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,043.35円
1株当たり中間純利益	2,217.93円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,785
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,785
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 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。

*再信託受託会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
- ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
使用開始日を記載することがあります。
- 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
ファンドの形態等を記載することがあります。
図案を採用することがあります。
ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

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

2020年2月7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7月11日から2020年1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2020年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月22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2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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. 上記は中間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データは中間監査の対象には含まれていません。