

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2020年10月2日提出
【計算期間】	第14計算期間 (自 2020年1月11日 至 2020年7月10日)
【ファンド名】	ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials
【発行者名】	大和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
【縦覧に供する場所】	名 称 株式会社東京証券取引所 所在地 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「TOPIX Ex-Financials」（以下「対象株価指数」という場合があります。）の変動率に一致させることを目的とします。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	独立区分	E T F
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	株式 一般
	決算頻度	年2回
	投資対象地域	日本
	対象インデックス	その他の指数（TOPIX Ex-Financials）

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

- ・「株式 一般」...大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「年2回」...目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの

- ・「日本」...目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「その他の指数」...日経225、TOPIX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	
	内外	不動産投信	ETF	特殊型
		その他資産 ()		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	対象インデックス
株式		グローバル	
一般	年1回	日本	日経225
大型株	年2回	北米	
中小型株	年4回	欧州	
債券	年6回 (隔月)	アジア	TOPIX
一般	年12回 (毎月)	オセアニア	
公債	日々	中南米	その他 (TOPIX Ex-Financials)
社債	その他 ()	アフリカ	
その他債券		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：

修正後の基準時価総額 = 修正前日の基準時価総額 × (修正前日の時価総額 ± 修正額)
÷ 修正前日の時価総額

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

2 当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

- 受益権は、東京証券取引所に上場され、株式と同様に売買することができます。
 - 売買単位は、10口単位です。
 - 取引方法は、原則として株式と同様です。
- 追加設定は、株式により行ないます。
 - 追加設定にかかる受益権の取得申込者は、取得時のバスケット（「TOPIX Ex-Financials」を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。
 - 原則として、所定の方法に定められる金銭の支払い以外に、金銭によって受益権の取得申込を行なうことはできません。
- 受益権を株式と交換することができます。
 - 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、当該受益権と当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換を申込みことができます。
 - 解約申込により受益権を換金することはできません。
- 収益分配金は、名義登録受益者に対して支払われます。
 - 名義登録受益者とは、計算期間終了日において氏名または名称、住所および個人番号または法人番号（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所）が受託会社に登録されている者をいいます。

3 収益の分配は、計算期間ごとに、信託財産について生じる配当、受取利息その他これらに類する収益の額の合計額から支払利子、運用管理費用（信託報酬）その他これらに類する費用の額の合計額を控除した額の全額について行ないます。決算日は毎年1月10日および7月10日です。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「TOPIX Ex-Financials」の変動率に一致させることを目的として運用を行いません。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いません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）	信託契約（ 1 ）の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。
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いません。

- 1：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 2：受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務の内容等が規定されています。

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。

< 委託会社の概況（2020年7月末日現在） >

- ・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

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。

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

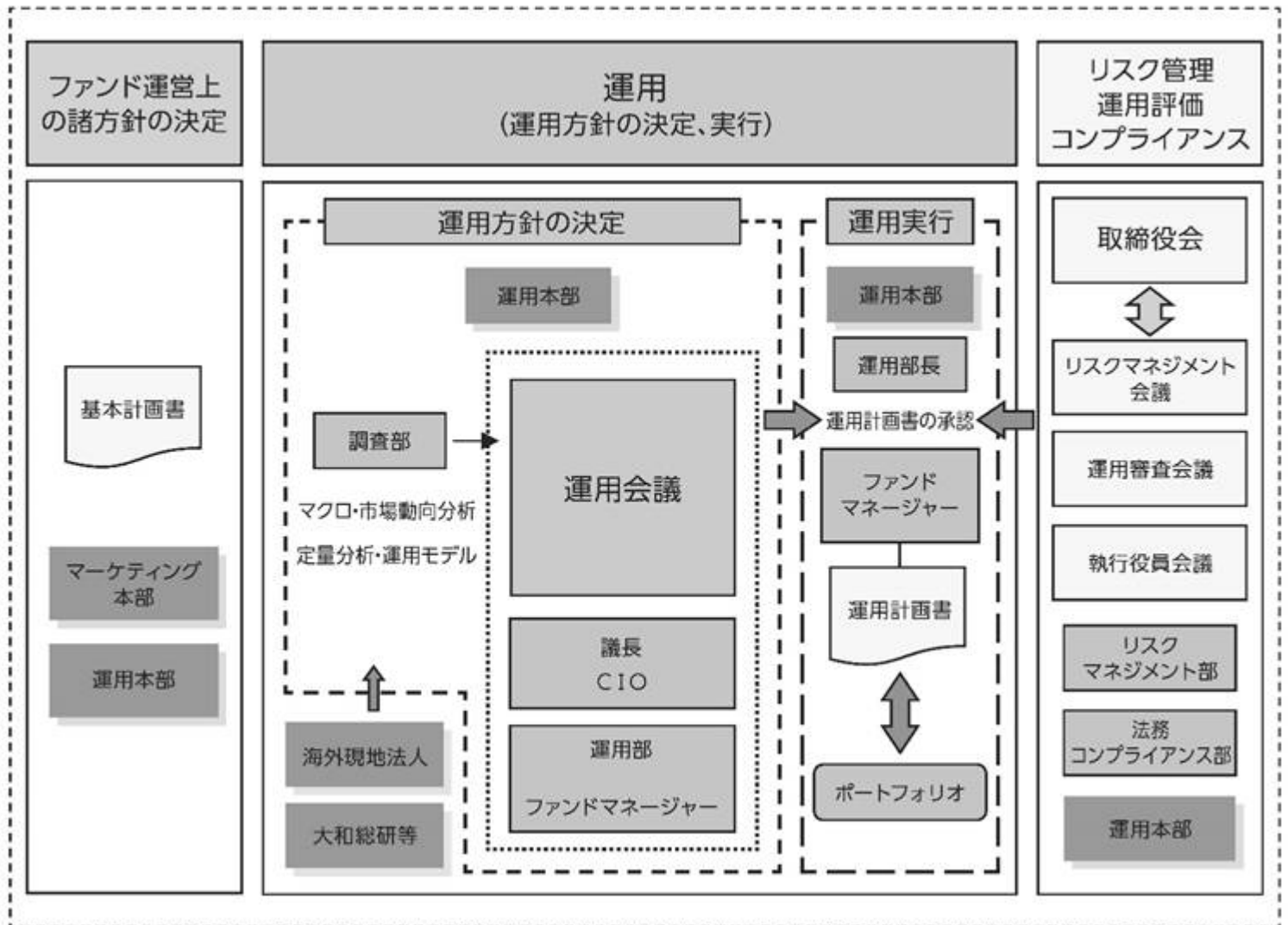
4. 手形割引市場において売買される手形

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商品担当役員の決裁により決定します。

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO (Chief Investment Officer) (2名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

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25～35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7月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資する株式の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

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

先物取引等(信託約款)

委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

デリバティブ取引等(信託約款)

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

株式の貸付け(信託約款)

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

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

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

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

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への投資は、行ないません。

信用リスク集中回避(信託約款)

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

その他

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

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

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

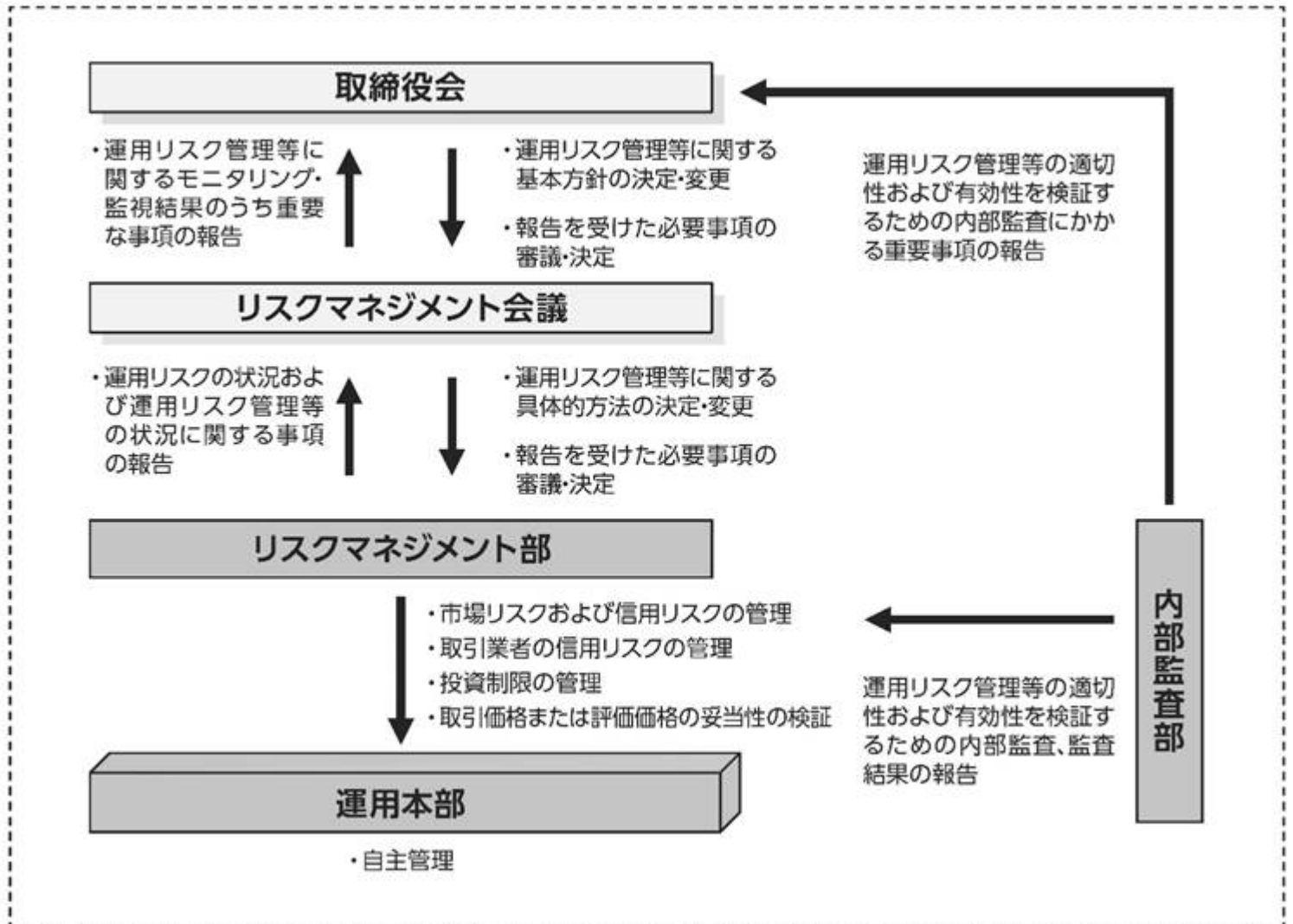
(2) その他の留意点

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

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

(3) リスク管理体制

運用リスク管理体制()は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

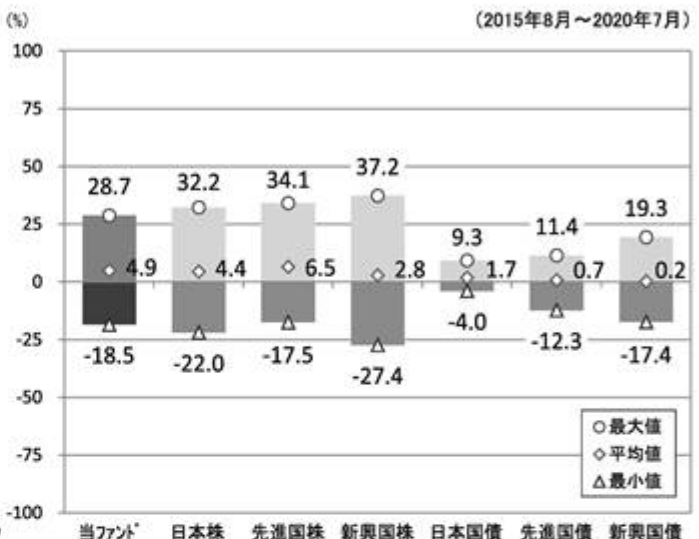
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株：MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債：NOMURA-BPI国債

先進国債：FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円ベース)

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

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

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

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

販売会社は、受益権の交換または買取りに際して、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を受益者から徴収することができるものとします。当該手数料は、販売会社ならびに受託会社が収受するものとします。

販売会社については、前(1)をご参照下さい。

信託財産留保額

ありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、次のイ.の額にロ.の額を加算して得た額とし、委託会社と受託会社との間の配分は以下のとおりとします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

委託会社 年率0.13%（税抜）以内

受託会社 年率0.05%（税抜）以内

* 上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

ロ．信託財産に属する株式の貸付けにかかる品貸料(貸付株券から発生する配当金相当額等を含まないものとし、)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7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7月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	10,583,481,690	99.88
内 日本	10,583,481,690	99.88
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,371,098	0.12
純資産総額	10,595,852,788	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7月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	61,900	6,568.00 406,559,200	6,217.00 384,832,300	3.63
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	43,200	6,267.00 270,734,400	6,595.00 284,904,000	2.69
3	ソニー	日本	株式	電気機 器	34,800	7,780.00 270,744,000	8,076.00 281,044,800	2.65
4	キーエンス	日本	株式	電気機 器	5,000	44,840.00 224,200,000	44,220.00 221,100,000	2.09
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	72,800	2,515.00 183,092,000	2,443.50 177,886,800	1.68
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	46,200	3,670.00 169,554,000	3,756.00 173,527,200	1.64
7	任天堂	日本	株式	その他製 品	3,400	48,680.00 165,512,000	46,440.00 157,896,000	1.49
8	第一三共	日本	株式	医薬品	15,900	8,459.00 134,498,100	9,258.00 147,202,200	1.39
9	ダイキン工業	日本	株式	機械	7,100	18,415.00 130,746,500	18,450.00 130,995,000	1.24

10	KDDI	日本	株式	情報・通信業	39,700	3,265.00 129,620,500	3,259.00 129,382,300	1.22
11	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	38,000	3,570.00 135,660,000	3,268.00 124,184,000	1.17
12	HOYA	日本	株式	精密機器	11,000	10,735.00 118,085,000	10,420.00 114,620,000	1.08
13	信越化学	日本	株式	化学	9,300	12,410.00 115,413,000	12,275.00 114,157,500	1.08
14	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	39,000	2,935.50 114,484,500	2,907.50 113,392,500	1.07
15	日本電産	日本	株式	電気機器	13,400	6,985.00 93,599,000	8,375.00 112,225,000	1.06
16	本田技研	日本	株式	輸送用機器	43,700	2,636.50 115,215,050	2,524.00 110,298,800	1.04
17	村田製作所	日本	株式	電気機器	16,300	6,480.00 105,624,000	6,609.00 107,726,700	1.02
18	花王	日本	株式	化学	13,300	8,409.00 111,839,700	7,636.00 101,558,800	0.96
19	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	3,500	29,610.00 103,635,000	28,800.00 100,800,000	0.95
20	SMC	日本	株式	機械	1,700	55,700.00 94,690,000	55,070.00 93,619,000	0.88
21	ファナック	日本	株式	電気機器	5,200	19,725.00 102,570,000	17,705.00 92,066,000	0.87
22	伊藤忠	日本	株式	卸売業	38,300	2,296.00 87,936,800	2,300.00 88,090,000	0.83
23	日立	日本	株式	電気機器	26,700	3,342.00 89,231,400	3,128.00 83,517,600	0.79
24	中外製薬	日本	株式	医薬品	17,300	5,398.00 93,385,400	4,736.00 81,932,800	0.77
25	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	48,200	1,713.50 82,590,700	1,650.00 79,530,000	0.75
26	富士通	日本	株式	電気機器	5,400	12,960.00 69,984,000	14,120.00 76,248,000	0.72
27	三菱商事	日本	株式	卸売業	35,900	2,241.50 80,469,850	2,119.50 76,090,050	0.72
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	55,500	1,376.50 76,395,750	1,370.50 76,062,750	0.72
29	三井物産	日本	株式	卸売業	47,400	1,560.00 73,944,000	1,574.00 74,607,600	0.70

30	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	5,600	13,865.00 77,644,000	12,670.00 70,952,000	0.67
----	-----------	----	----	-------	-------	-------------------------	-------------------------	------

(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	99.88%
合計	99.88%

(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	0.10%
鉱業	0.20%
建設業	2.71%
食料品	4.24%
繊維製品	0.52%
パルプ・紙	0.24%
化学	7.95%
医薬品	7.50%
石油・石炭製品	0.46%
ゴム製品	0.61%
ガラス・土石製品	0.82%
鉄鋼	0.58%
非鉄金属	0.76%
金属製品	0.57%
機械	5.88%
電気機器	17.35%
輸送用機器	7.71%
精密機器	2.91%
その他製品	2.75%
電気・ガス業	1.60%
陸運業	3.89%
海運業	0.14%
空運業	0.35%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	11.84%
卸売業	4.95%
小売業	5.57%

不動産業	2.06%
サービス業	5.42%
合計	99.88%

(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

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	-
2019年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
2月末日	8,215,810,567	-	1,170.23	-	1,161
3月末日	8,877,453,682	-	1,110.19	-	1,114
4月末日	9,260,634,018	-	1,158.11	-	1,153
5月末日	9,907,461,271	-	1,239.00	-	1,239
6月末日	9,911,309,309	-	1,239.48	-	1,247
第14計算期間末 (2020年7月10日)	10,859,497,760	10,960,856,556	1,210.67	1,221.97	1,207
7月末日	10,595,852,788	-	1,181.28	-	1,244

(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
第14計算期間	11.30

【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
第14計算期間	9.2

(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
第14計算期間	1,949,140	14,922,630

(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7月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	118,128円
純資産総額	105億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-3.8%
3カ月間	3.0%
6カ月間	-8.7%
1年間	-0.7%
3年間	1.7%
5年間	6.0%
設定来	53.0%



※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: 2,690円

設定来分配金合計額: 30,810円

決算期	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	第14期
	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	20年7月
分配金	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	1,130円

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

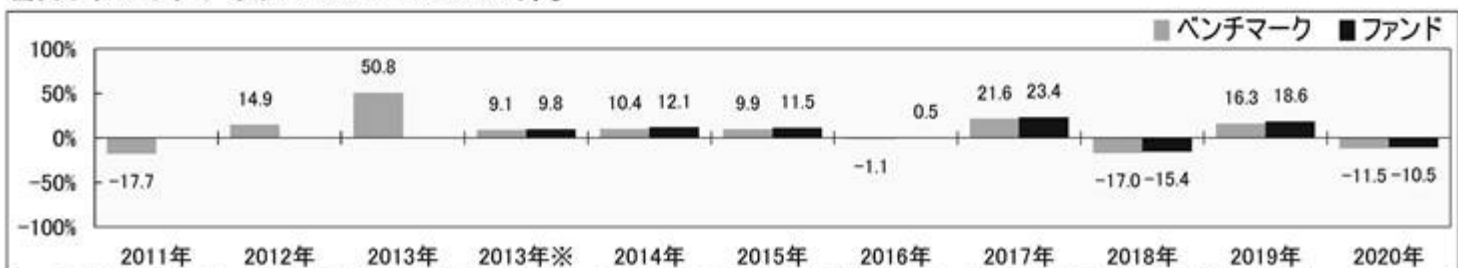
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,988	99.9%	電気機器	17.4%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.6%
国内株式先物	-	-	情報・通信業	11.8%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.7%
不動産投資信託等	-	-	化学	7.9%	ソニー	電気機器	2.7%
コール・ローン、その他	-	0.1%	輸送用機器	7.7%	キーエンス	電気機器	2.1%
合計	1,988	100.0%	医薬品	7.5%	日本電信電話	情報・通信業	1.7%
株式市場・上場別構成		比率	機械	5.9%	武田薬品	医薬品	1.6%
一部(東証・名証)		99.9%	小売業	5.6%	任天堂	その他製品	1.5%
二部(東証・名証)		-	サービス業	5.4%	第一三共	医薬品	1.4%
新興市場他		-	卸売業	5.0%	ダイキン工業	機械	1.2%
その他		-	その他	25.7%	KDDI	情報・通信業	1.2%
合計		99.9%	合計	99.9%	合計		19.7%

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7月31日までの騰落率を表しています。

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

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

1. 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るとき

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、取得申込みの受け付けの中止、取得申込みの受け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せん。

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、抹消したものととして取扱います。

販売会社は、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を交換請求者から徴収することができるものとします。当該手数料は、販売会社ならびに受託会社が収受するものとします。

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

前 の規定により交換請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の交換請求を撤回することができます。ただし、受益者がその交換請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に交換請求を受け付けたものとして計算されるものとします。

委託会社は、交換の請求を受け付けた場合には、当該請求にかかる受益権と、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式として委託会社が指定するものとの交換を行なうよう受託会社に指図します。

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

額により算出したものから、当該株式売却および当該売却代金により信託財産中の株式の銘柄およびその数量を変更するための取引にかかる経費に相当する金額として、当該評価額に別に定める率を乗じて得た額を減じた金額とします。)に相当する口数を除いた口数の受益権と、当該受益権の持分に相当する株式(当該自社株式等を除きます。)を交換するよう受託会社に指図するものとします。

前 に該当する場合には、交換請求を行なう受益者は、販売会社を通じてその旨を委託会社に通知するものとします。この通知が交換請求の際に行なわれなかった場合において、そのことによって交換請求者または信託財産その他に損害が生じた場合には、交換請求者がすべての責を負うものとします。

前 の規定にかかわらず、前 の委託会社が指定する株式に、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは当該権利を取得することができる者が確定する日に交換の申込みに応じて受益権の受渡しが行なわれることとなる株式(以下本 において「配当落ち株式等」といいます。)が含まれる場合には、委託会社は、当該配当落ち株式等に代えて当該配当落ち株式等の評価額(当該評価額から、当該株式売却および当該売却代金により信託財産中の株式の銘柄およびその数量を変更するための取引にかかる経費に相当する金額として、当該評価額に別に定める率を乗じて得た額を減じた額とします。)に相当する金銭の交付をもって交換するよう受託会社に指図することができるものとします。

受託会社は、前 に掲げる手続きが行なわれたことを確認したときには、委託会社の指図にしたがい、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式にかかる振替請求および金銭の交付を行なうものとします。別に定める期日から、受益者への交換株式の交付に際しては振替機関等の口座に前の交換の請求を行なった受益者にかかる株数の増加の記載または記録が行なわれ、受益者への金銭の交付については販売会社において行なわれます。

委託会社は、交換請求受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したものと取り扱うこととし、受託会社は、当該受益権にかかる振替受益権が交換株式の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

< 買取り >

販売会社は、次に該当する場合で、受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

1. 交換により取引所売買単位未満の振替受益権が生じた場合
2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になった場合

前 の買取価額は、買取請求受付日の基準価額から、販売会社が定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を控除した価額とすることができます。

販売会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することができます。

前 の規定により受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取停止以前に行なった当日の買取請求を撤回することができます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受付けたものとして、前 の規定に準じて計算されたものとします。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した100口当たりの価額をいいます。

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

(注) 主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・対象株価指数に採用されている銘柄(採用予定を含みます。)の株式：
原則として金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年1月11日から7月10日まで、および7月11日から翌年1月10日までとします。ただし、第1計算期間は、2013年9月19日から2014年1月10日までとします。

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が200万口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合または対象株価指数が廃止された場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。なお、受益権を上場したすべての金融商品取引所において当該受益権の上場が廃止された場合には、委託会社は、その廃止された日に、信託を終了するための手続きを開始するものとします。
3. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を

定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

信託約款の変更等

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

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

反対者の買取請求権

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

公告

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

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

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

関係法人との契約の更改

受益権の募集、交換の取扱い等に関する委託会社、受託会社および販売会社との三者間契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社、受託会社もしくは販売会社のいずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

<支払方法>

1. 受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）を持分に依りて請求する権利を有します。
2. 受託会社は、計算期間終了日現在において、氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を

有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者（以下「名義登録受益者」といいます。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。

3. 受益者は、原則として前2.に規定する登録を当ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の取引参加者（口座管理機関であるものに限り、以下同じ。）を経由して行なうものとします。この場合、当該取引参加者は、当該取引参加者が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は前2.に規定する登録を受託会社に対して直接行なうことができます。
4. 社振法関係法令等に基づき、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益権の名義登録の手続きは原則として以下のとおりとします。
 - イ. 受益権は、前3.の取引参加者の振替口座簿に口数が記載または記録されることにより、当該振替口座簿に記載または記録された口数に応じた受益権が帰属します。
 - ロ. 前3.の取引参加者は、計算期間終了日までに当該取引参加者にかかる前イ.の受益権の受益者の氏名もしくは名称および住所その他受託会社が定める事項を書面等により受託会社に届出のものとします。また、届出た内容に変更が生じた場合は、当該取引参加者所定の方法による当該受益者からの申出に基づき、当該取引参加者はこれを受託会社に通知するものとします。
 - ハ. 前3.の取引参加者は、計算期間終了日現在の当該取引参加者にかかる前イ.の受益権の受益者の振替機関の定める事項を（当該取引参加者が直接口座管理機関でない場合はその上位機関を通じて）振替機関に報告するとともに、振替機関は業務規程等に基づき、これを受託会社に通知するものとします。
5. 信託契約締結当初および追加信託時の受益者については、前2.に規定する登録を行なったうえで、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されるものとします。
6. 前2.に規定する収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定した預金口座等に当該収益分配金を振込む方式により行なうものとします。なお、名義登録受益者が前3.に規定する取引参加者と別途収益分配金の取扱いにかかる契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとします。
7. 受託会社は、支払開始日から5年経過した後に、収益分配金について未払残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとします。
8. 受託会社は、前7.の規定により委託会社に収益分配金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。
9. 受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

信託終了時の交換等

1. 委託会社は、信託が終了することとなったときは、委託会社が別に定める一定口数以上の受益権を有する受益者に対しては、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権と引換えに交換するものとします。この場合は、「2 換金（解約）手続等」の規定に準じるものとします。
2. 委託会社が信託の終了に関して指定する販売会社は、委託会社が別に定める一定口数未満の受益権について買取るものとします。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14期計算期間(2020年1月11日から2020年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 2020年1月10日現在	第14期 2020年7月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	346,311,408	118,082,371
株式	29,493,240,421	10,846,064,770
未収入金	8,797,800	-
未収配当金	50,755,286	16,779,656
流動資産合計	29,899,104,915	10,980,926,797
資産合計	29,899,104,915	10,980,926,797
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	342,315,402	101,358,796
未払受託者報酬	8,048,475	3,973,770
未払委託者報酬	20,926,114	10,331,882
その他未払費用	3,794,473	5,764,589
流動負債合計	375,084,464	121,429,037
負債合計	375,084,464	121,429,037
純資産の部		
元本等		
元本	1 21,701,918,755	1 8,871,137,145
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,822,101,696	1,988,360,615
（分配準備積立金）	623,504	152,338
元本等合計	29,524,020,451	10,859,497,760
純資産合計	29,524,020,451	10,859,497,760
負債純資産合計	29,899,104,915	10,980,926,797

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期		第14期	
	自	2019年7月11日 至 2020年1月10日	自	2020年1月11日 至 2020年7月10日
営業収益				
受取配当金		376,091,488		117,944,733
受取利息		130		159
有価証券売買等損益		3,390,265,093		2,455,891,197
その他収益		222,921		42,527
営業収益合計		3,766,579,632		2,337,903,778
営業費用				
支払利息		37,986		12,486
受託者報酬		8,048,475		3,973,770
委託者報酬		20,926,114		10,331,882
その他費用		5,643,613		2,781,651
営業費用合計		34,656,188		17,099,789
営業利益又は営業損失（ ）		3,731,923,444		2,355,003,567
経常利益又は経常損失（ ）		3,731,923,444		2,355,003,567
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,731,923,444		2,355,003,567
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,028,456,133		7,822,101,696
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,157,372,314		433,710,462
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,157,372,314		433,710,462
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,753,334,793		3,811,089,180
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		3,811,089,180
分配金		1,342,315,402		1,101,358,796
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,822,101,696		1,988,360,615

(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14期	
	自 2020年1月11日	至 2020年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1. 1 期首元本額	21,797,043,742円	21,701,918,755円
期中追加設定元本額	6,740,717,410円	1,927,699,460円
期中一部交換元本額	6,835,842,397円	14,758,481,070円
2. 計算期間末日における受益権の総数	21,943,295口	8,969,805口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	自 2019年7月11日 至 2020年1月10日	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日

1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(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。	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(117,974,933円)及び分配準備積立金(623,504円)の合計額から、経費(17,087,303円)を控除して計算される分配対象額は101,511,134円(100口当たり1,131円)であり、うち101,358,796円(100口当たり1,130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14期 自 2020年1月11日 至 2020年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第14期
	2020年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)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13期	第14期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	3,143,956,109	939,954,525
合計	3,143,956,109	939,954,525

（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13期	第14期
2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第14期
自 2020年1月11日
至 2020年7月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第13期	第14期
	2020年1月10日現在	2020年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,345.47円	1,210.67円
（100口当たり純資産額）	（134,547円）	（121,067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	200	2,650.00	530,000	
日本水産	7,500	449.00	3,367,500	
マルハニチロ	1,100	2,064.00	2,270,400	
カネコ種苗	200	1,311.00	262,200	
サカタのタネ	900	3,275.00	2,947,500	
ホクト	600	1,981.00	1,188,600	
ホクリヨウ	100	630.00	63,000	
ヒノキヤグループ	200	1,499.00	299,800	
ショーボンドHD	1,100	4,715.00	5,186,500	
ミライト・ホールディングス	2,300	1,518.00	3,491,400	
タマホーム	400	1,170.00	468,000	
サンヨーホームズ	100	628.00	62,800	
日本アクア	300	620.00	186,000	
ファーストコーポレーション	200	546.00	109,200	
ベステラ	100	981.00	98,100	
TATERU	1,600	172.00	275,200	
キャンディル	100	514.00	51,400	
スペースバリューHD	900	339.00	305,100	
住石ホールディングス	1,600	116.00	185,600	
日鉄鉱業	100	4,105.00	410,500	
三井松島HLDGS	300	754.00	226,200	
国際石油開発帝石	30,000	598.20	17,946,000	
石油資源開発	1,000	1,782.00	1,782,000	
K&Oエナジーグループ	300	1,422.00	426,600	
ダイセキ環境ソリューション	100	792.00	79,200	
第一カッター興業	100	2,330.00	233,000	
明豊ファシリティワークス	200	534.00	106,800	
安藤・間	4,500	589.00	2,650,500	
東急建設	2,100	532.00	1,117,200	
コムシスホールディングス	2,700	3,115.00	8,410,500	
ビーアールホールディングス	800	574.00	459,200	
高松コンストラクションGP	400	2,291.00	916,400	
東建コーポレーション	200	6,960.00	1,392,000	

ソネック	100	784.00	78,400	
ヤマウラ	300	800.00	240,000	
大成建設	5,700	3,780.00	21,546,000	
大林組	17,200	977.00	16,804,400	
清水建設	17,600	836.00	14,713,600	
飛鳥建設	600	1,019.00	611,400	
長谷工コーポレーション	6,700	1,304.00	8,736,800	
松井建設	700	617.00	431,900	
銭高組	100	3,680.00	368,000	
鹿島建設	13,500	1,232.00	16,632,000	
不動テトラ	400	1,423.00	569,200	
大末建設	200	797.00	159,400	
鉄建建設	300	1,980.00	594,000	
西松建設	1,300	2,015.00	2,619,500	
三井住友建設	4,200	448.00	1,881,600	
大豊建設	300	2,360.00	708,000	
前田建設	4,400	764.00	3,361,600	
佐田建設	300	414.00	124,200	
ナカノフドー建設	600	346.00	207,600	
奥村組	900	2,441.00	2,196,900	
東鉄工業	800	2,630.00	2,104,000	
イチケン	100	1,462.00	146,200	
富士ピー・エス	200	580.00	116,000	
浅沼組	200	4,055.00	811,000	
戸田建設	7,200	681.00	4,903,200	
熊谷組	800	2,554.00	2,043,200	
北野建設	100	2,557.00	255,700	
植木組	100	2,483.00	248,300	
矢作建設	800	735.00	588,000	
ピーエス三菱	600	512.00	307,200	
日本ハウスHLDGS	1,100	263.00	289,300	
大東建託	1,900	9,708.00	18,445,200	
新日本建設	800	772.00	617,600	
NIPPO	1,500	2,640.00	3,960,000	
東亜道路	100	3,075.00	307,500	
前田道路	1,800	1,943.00	3,497,400	
日本道路	100	7,160.00	716,000	
東亜建設	600	1,509.00	905,400	
日本国土開発	1,300	556.00	722,800	
若築建設	300	1,188.00	356,400	

東洋建設	1,900	373.00	708,700
五洋建設	6,900	572.00	3,946,800
世紀東急	800	732.00	585,600
福田組	200	4,625.00	925,000
日本ドライケミカル	100	1,639.00	163,900
住友林業	4,400	1,293.00	5,689,200
日本基礎技術	700	400.00	280,000
巴コーポレーション	800	320.00	256,000
大和ハウス	17,100	2,416.00	41,313,600
ライト工業	1,000	1,455.00	1,455,000
積水ハウス	18,900	2,022.50	38,225,250
日特建設	400	750.00	300,000
北陸電気工事	300	882.00	264,600
ユアテック	1,000	611.00	611,000
日本リーテック	300	2,591.00	777,300
四電工	100	2,360.00	236,000
中電工	700	2,173.00	1,521,100
関電工	2,500	877.00	2,192,500
きんでん	4,200	1,734.00	7,282,800
東京エネシス	600	704.00	422,400
トーエネック	200	3,485.00	697,000
住友電設	400	2,309.00	923,600
日本電設工業	900	2,294.00	2,064,600
協和エクシオ	2,600	2,541.00	6,606,600
新日本空調	600	2,253.00	1,351,800
日本工営	300	2,819.00	845,700
九電工	1,200	3,120.00	3,744,000
三機工業	1,200	1,176.00	1,411,200
日揮ホールディングス	5,300	1,094.00	5,798,200
中外炉工業	200	1,510.00	302,000
ヤマト	600	588.00	352,800
太平電業	400	2,176.00	870,400
高砂熱学	1,600	1,525.00	2,440,000
三晃金属	100	2,031.00	203,100
NEC ネットズエスアイ	1,700	2,211.00	3,758,700
朝日工業社	100	3,035.00	303,500
明星工業	1,100	769.00	845,900
大気社	900	2,953.00	2,657,700
ダイダン	400	2,578.00	1,031,200
日比谷総合設備	600	1,766.00	1,059,600

日本製粉	1,700	1,638.00	2,784,600
日清製粉G本社	6,300	1,522.00	9,588,600
昭和産業	600	3,250.00	1,950,000
鳥越製粉	600	820.00	492,000
中部飼料	700	1,526.00	1,068,200
フィード・ワン	3,700	185.00	684,500
東洋精糖	100	1,150.00	115,000
日本甜菜糖	300	1,680.00	504,000
三井製糖	400	1,900.00	760,000
塩水港精糖	700	237.00	165,900
日新製糖	200	1,729.00	345,800
L I F U L L	1,800	413.00	743,400
ジェイエシーリクルートメント	300	1,031.00	309,300
日本M&Aセンター	3,900	4,955.00	19,324,500
メンバーズ	100	1,358.00	135,800
UTグループ	700	2,545.00	1,781,500
アイティメディア	100	1,845.00	184,500
タケエイ	600	961.00	576,600
E・Jホールディングス	100	1,961.00	196,100
ビーネックスグループ	700	964.00	674,800
コシダカホールディングス	1,200	374.00	448,800
アルトナー	100	837.00	83,700
パソナグループ	600	1,157.00	694,200
C D S	100	1,180.00	118,000
リンクアンドモチベーション	1,100	357.00	392,700
G C A	700	573.00	401,100
エス・エム・エス	1,700	2,322.00	3,947,400
サニーサイドアップG	100	659.00	65,900
パーソルホールディングス	5,300	1,378.00	7,303,400
リニカル	200	791.00	158,200
クックパッド	1,800	315.00	567,000
エスクリ	100	335.00	33,500
アイ・ケイ・ケイ	200	535.00	107,000
森永製菓	1,200	3,950.00	4,740,000
中村屋	100	4,010.00	401,000
江崎グリコ	1,700	4,990.00	8,483,000
名糖産業	200	1,311.00	262,200
井村屋グループ	200	2,155.00	431,000
不二家	300	2,149.00	644,700
山崎製パン	4,200	1,782.00	7,484,400

第一屋製パン	100	982.00	98,200
モロゾフ	100	5,400.00	540,000
亀田製菓	300	5,140.00	1,542,000
寿スピリッツ	600	4,080.00	2,448,000
カルビー	2,600	2,973.00	7,729,800
森永乳業	1,000	4,725.00	4,725,000
六甲バター	300	1,417.00	425,100
ヤクルト	3,800	6,270.00	23,826,000
明治ホールディングス	3,700	8,340.00	30,858,000
雪印メグミルク	1,300	2,435.00	3,165,500
プリマハム	900	2,786.00	2,507,400
日本ハム	2,100	4,255.00	8,935,500
林兼産業	200	545.00	109,000
丸大食品	700	1,833.00	1,283,100
S Foods	400	2,492.00	996,800
柿安本店	200	2,576.00	515,200
伊藤ハム米久HLDGS	3,600	618.00	2,224,800
学情	200	1,015.00	203,000
スタジオアリス	200	1,455.00	291,000
クロスキャット	100	1,119.00	111,900
シミックホールディングス	300	1,332.00	399,600
エプコ	100	1,225.00	122,500
システナ	1,900	1,366.00	2,595,400
NJS	100	1,769.00	176,900
デジタルアーツ	200	8,660.00	1,732,000
日鉄ソリューションズ	800	2,839.00	2,271,200
総合警備保障	2,100	4,900.00	10,290,000
キューブシステム	300	935.00	280,500
いちご	7,000	238.00	1,666,000
エイジア	100	1,360.00	136,000
日本駐車場開発	5,900	138.00	814,200
コア	200	1,153.00	230,600
カカクコム	3,900	2,824.00	11,013,600
アイロムグループ	200	2,417.00	483,400
セントケア・ホールディング	300	410.00	123,000
サイネックス	100	686.00	68,600
ルネサンス	300	894.00	268,200
ディップ	800	2,160.00	1,728,000
SBSホールディングス	600	2,207.00	1,324,200
デジタルホールディングス	200	1,414.00	282,800

新日本科学	600	599.00	359,400
ツクイ	1,200	474.00	568,800
キャリアデザインセンター	100	817.00	81,700
ベネフィット・ワン	1,900	2,184.00	4,149,600
エムスリー	11,700	4,895.00	57,271,500
ツカダ・グローバルHOLD	300	258.00	77,400
アウトソーシング	3,000	585.00	1,755,000
ウェルネット	600	605.00	363,000
ワールドホールディングス	200	1,502.00	300,400
ディー・エヌ・エー	2,300	1,290.00	2,967,000
博報堂DYHLDGS	7,300	1,133.00	8,270,900
ぐるなび	900	685.00	616,500
タカミヤ	600	527.00	316,200
ジャパンベストレスキューS	300	779.00	233,700
ファンコミュニケーションズ	1,500	428.00	642,000
ライク	200	1,235.00	247,000
ビジネス・ブレークスルー	200	360.00	72,000
エスプール	1,100	661.00	727,100
WDBホールディングス	200	2,586.00	517,200
ティア	300	481.00	144,300
バリューコマース	300	2,938.00	881,400
インフォマート	5,700	704.00	4,012,800
サッポロホールディングス	1,900	1,896.00	3,602,400
アサヒグループホールディン	11,600	3,587.00	41,609,200
麒麟HD	23,600	2,086.50	49,241,400
宝ホールディングス	4,200	948.00	3,981,600
オエノンホールディングス	1,500	397.00	595,500
養命酒	100	1,781.00	178,100
コカ・コーラボトラーズJHD	3,800	1,837.00	6,980,600
サントリー食品インター	3,700	4,315.00	15,965,500
ダイドーグループHD	200	4,730.00	946,000
伊藤園	1,700	6,180.00	10,506,000
キーコーヒー	600	2,146.00	1,287,600
ユニカフェ	100	981.00	98,100
ジャパンフーズ	100	1,180.00	118,000
日清オイリオグループ	800	3,285.00	2,628,000
不二製油グループ	1,400	2,786.00	3,900,400
J-オイルミルズ	300	3,925.00	1,177,500
ローソン	1,500	5,500.00	8,250,000
サンエー	400	4,000.00	1,600,000

カワチ薬品	400	2,850.00	1,140,000
エービーシー・マート	900	5,890.00	5,301,000
ハードオフコーポレーション	200	675.00	135,000
高千穂交易	200	889.00	177,800
アスクル	600	3,475.00	2,085,000
ゲオホールディングス	1,000	1,405.00	1,405,000
アダストリア	800	1,493.00	1,194,400
ジーフット	300	479.00	143,700
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	447.00	44,700
カワニシホールディングス	100	1,274.00	127,400
伊藤忠食品	100	4,805.00	480,500
くら寿司	200	4,600.00	920,000
キャンドゥ	200	2,095.00	419,000
エレマテック	600	791.00	474,600
バルグループHLDGS	600	1,155.00	693,000
JALUX	100	1,650.00	165,000
エディオン	2,500	1,033.00	2,582,500
あらた	400	4,555.00	1,822,000
サーラコーポレーション	1,100	556.00	611,600
ワッツ	200	1,050.00	210,000
トーマンデバイス	100	3,615.00	361,500
ハローズ	200	3,295.00	659,000
J Pホールディングス	1,700	256.00	435,200
フジオフードG本社	400	1,231.00	492,400
あみやき亭	100	2,803.00	280,300
東京エレクトロデバイス	200	3,685.00	737,000
ひらまつ	1,000	165.00	165,000
フィールズ	400	341.00	136,400
双日	30,000	229.00	6,870,000
アルフレッサホールディングス	6,100	2,177.00	13,279,700
大黒天物産	100	5,930.00	593,000
ハニーズホールディングス	600	1,063.00	637,800
ファーマライズHD	100	672.00	67,200
キッコーマン	4,000	4,850.00	19,400,000
味の素	12,300	1,721.50	21,174,450
キューピー	3,000	1,882.00	5,646,000
ハウス食品G本社	2,000	3,280.00	6,560,000
カゴメ	2,100	3,170.00	6,657,000
焼津水産化工	200	841.00	168,200
アリアケジャパン	600	6,570.00	3,942,000

ピエトロ	100	1,620.00	162,000
エバラ食品工業	100	2,100.00	210,000
ニチレイ	2,600	3,040.00	7,904,000
横浜冷凍	1,600	858.00	1,372,800
東洋水産	2,800	6,130.00	17,164,000
イートアンド	200	1,702.00	340,400
大冷	100	2,004.00	200,400
ヨシムラ・フード・HLDGS	300	1,181.00	354,300
日清食品HD	2,400	9,510.00	22,824,000
永谷園ホールディングス	200	2,100.00	420,000
一正蒲鉾	200	935.00	187,000
フジッコ	700	1,953.00	1,367,100
ロックフィールド	700	1,252.00	876,400
日本たばこ産業	32,200	1,930.00	62,146,000
ケンコーマヨネーズ	300	1,830.00	549,000
わらべや日洋HD	300	1,514.00	454,200
なとり	300	1,739.00	521,700
イフジ産業	100	792.00	79,200
ピックルスコーポレーション	100	2,765.00	276,500
北の達人コーポ	1,900	536.00	1,018,400
ユーグレナ	2,400	736.00	1,766,400
スター・マイカ・HLDGS	200	1,378.00	275,600
ADワークスグループ	900	160.00	144,000
片倉工業	800	1,046.00	836,800
グンゼ	300	4,000.00	1,200,000
ヒューリック	11,600	940.00	10,904,000
神栄	100	487.00	48,700
ラサ商事	300	908.00	272,400
アルペン	400	1,643.00	657,200
ハブ	100	577.00	57,700
ラクーンホールディングス	200	1,004.00	200,800
クオールホールディングス	800	1,100.00	880,000
アルコニックス	600	1,216.00	729,600
神戸物産	1,900	6,520.00	12,388,000
ソリトンシステムズ	200	1,417.00	283,400
ジンスホールディングス	300	7,390.00	2,217,000
ビックカメラ	3,300	1,148.00	3,788,400
DCMホールディングス	3,000	1,271.00	3,813,000
ペッパーフードサービス	400	500.00	200,000
ハイパー	100	555.00	55,500

MonotaRO	3,800	4,540.00	17,252,000	
東京一番フーズ	100	499.00	49,900	
DDホールディングス	200	728.00	145,600	
あいホールディングス	800	1,479.00	1,183,200	
ディービーエックス	200	861.00	172,200	
きちりホールディングス	100	545.00	54,500	
アークランドサービスHD	300	1,843.00	552,900	
J. フロントリテイリング	6,400	658.00	4,211,200	
ドトール・日レスHD	900	1,666.00	1,499,400	
マツモトキヨシHLDGS	2,300	3,880.00	8,924,000	
ブロンコビリー	200	2,218.00	443,600	
ZOZO	3,700	2,584.00	9,560,800	
トレジャー・ファクトリー	100	755.00	75,500	
物語コーポレーション	100	7,630.00	763,000	
ココカラファイン	600	5,980.00	3,588,000	
三越伊勢丹HD	9,600	574.00	5,510,400	
東洋紡	2,100	1,433.00	3,009,300	
ユニチカ	1,600	332.00	531,200	
富士紡ホールディングス	200	3,055.00	611,000	
日清紡ホールディングス	3,700	734.00	2,715,800	
倉敷紡績	600	2,018.00	1,210,800	
ダイワボウHD	600	7,170.00	4,302,000	
シキボウ	200	1,003.00	200,600	
日東紡績	800	5,020.00	4,016,000	
トヨタ紡織	1,600	1,356.00	2,169,600	
マクニカ・富士エレHLDGS	1,200	1,477.00	1,772,400	
Hamee	200	1,882.00	376,400	
ラクト・ジャパン	200	3,430.00	686,000	
ウエルシアHD	1,700	8,800.00	14,960,000	
クリエイトSDH	900	3,320.00	2,988,000	
バイタルKSKHD	1,000	1,011.00	1,011,000	
八洲電機	400	900.00	360,000	
メディアスホールディングス	300	872.00	261,600	
レスターホールディングス	600	1,995.00	1,197,000	
ジュテックHD	100	999.00	99,900	
丸善CHIHD	700	390.00	273,000	
大光	200	640.00	128,000	
OCHIホールディングス	100	1,443.00	144,300	
TOKAIホールディングス	2,800	978.00	2,738,400	
黒谷	100	521.00	52,100	

ミサワ	100	643.00	64,300
ティーライフ	100	1,100.00	110,000
Cominix	100	706.00	70,600
エー・ピーカンパニー	100	435.00	43,500
三洋貿易	600	954.00	572,400
チムニー	100	1,206.00	120,600
シュッピン	300	693.00	207,900
ビューティガレージ	100	1,990.00	199,000
オイシックス・ラ・大地	600	2,040.00	1,224,000
ウイン・パートナーズ	300	896.00	268,800
ネクステージ	800	959.00	767,200
ジョイフル本田	1,600	1,429.00	2,286,400
鳥貴族	200	1,407.00	281,400
キリン堂ホールディングス	200	2,541.00	508,200
ホットランド	300	1,034.00	310,200
すかいらーくHD	6,100	1,605.00	9,790,500
SFPホールディングス	200	1,364.00	272,800
綿半ホールディングス	200	1,858.00	371,600
日本毛織	1,800	987.00	1,776,600
ダイトウボウ	900	109.00	98,100
トーア紡コーポレーション	200	455.00	91,000
ダイドーリミテッド	800	190.00	152,000
ヨシックス	100	1,778.00	177,800
ユナイテッド・スーパーマーケ	1,600	1,221.00	1,953,600
三栄建築設計	200	1,385.00	277,000
野村不動産HLDGS	3,400	1,825.00	6,205,000
三重交通グループHD	1,100	439.00	482,900
サムティ	800	1,233.00	986,400
ディア・ライフ	700	472.00	330,400
コーセーアールイー	100	508.00	50,800
日本商業開発	300	1,468.00	440,400
プレサンスコーポレーション	900	1,163.00	1,046,700
フィル・カンパニー	100	2,190.00	219,000
THEグローバル社	200	205.00	41,000
ハウスコム	100	1,257.00	125,700
日本管理センター	300	1,037.00	311,100
サンセイランディック	100	751.00	75,100
エストラスト	100	639.00	63,900
フージャースHD	1,100	506.00	556,600
オープンハウス	1,600	3,645.00	5,832,000

東急不動産HD	14,800	433.00	6,408,400
飯田GH D	4,500	1,704.00	7,668,000
イーグランド	100	687.00	68,700
ムゲンエステート	300	469.00	140,700
帝国繊維	700	2,150.00	1,505,000
日本コークス工業	4,600	62.00	285,200
ゴルフダイジェスト・オン	200	507.00	101,400
ミタチ産業	100	560.00	56,000
B E E N O S	200	1,116.00	223,200
あさひ	400	1,536.00	614,400
日本調剤	300	1,673.00	501,900
コスモス薬品	500	17,000.00	8,500,000
シップヘルスケアHD	900	4,545.00	4,090,500
トーエル	200	650.00	130,000
ソフトクリエイイトHD	200	2,131.00	426,200
オンリー	100	566.00	56,600
セブン&アイ・H L D G S	21,400	3,304.00	70,705,600
クリエイイト・レストランツ・ホール	2,900	601.00	1,742,900
明治電機工業	100	1,361.00	136,100
ツルハホールディングス	1,200	14,570.00	17,484,000
デリカフーズH L D G S	200	608.00	121,600
スターティアホールディングス	100	580.00	58,000
サンマルクホールディングス	400	1,530.00	612,000
フェリシモ	100	1,051.00	105,100
トリドールホールディングス	1,400	1,127.00	1,577,800
帝 人	4,400	1,650.00	7,260,000
東 レ	39,100	484.20	18,932,220
ク ラ レ	8,500	1,080.00	9,180,000
旭 化 成	35,800	823.60	29,484,880
サカイオーベックス	100	2,145.00	214,500
T O K Y O B A S E	600	329.00	197,400
稲葉製作所	300	1,400.00	420,000
宮地エンジニアリングG	100	1,616.00	161,600
トーカロ	1,600	1,116.00	1,785,600
アルファCO	200	900.00	180,000
S U M C O	6,500	1,620.00	10,530,000
川田テクノロジーズ	100	4,650.00	465,000
R S T E C H N O L O G I E S	100	4,070.00	407,000
信和	200	691.00	138,200
ビーロット	200	582.00	116,400

ファーストブラザーズ	100	711.00	71,100
ハウスドゥ	200	834.00	166,800
シーアールイー	100	1,546.00	154,600
プロパティエージェント	100	1,003.00	100,300
ケイアイスター不動産	100	1,701.00	170,100
アグレ都市デザイン	100	515.00	51,500
グッドコムアセット	100	1,528.00	152,800
ジェイ・エス・ビー	100	2,671.00	267,100
テンポイノベーション	100	609.00	60,900
グローバルリンクマネジメント	100	598.00	59,800
住江織物	100	1,978.00	197,800
日本フェルト	300	440.00	132,000
イチカワ	100	1,123.00	112,300
エコナックホールディングス	900	94.00	84,600
日東製網	100	1,377.00	137,700
芦森工業	100	973.00	97,300
アツギ	400	595.00	238,000
ウイルプラスHLDGS	100	585.00	58,500
JMホールディングス	400	3,385.00	1,354,000
コメダホールディングス	1,100	1,763.00	1,939,300
サツドラホールディングス	100	1,977.00	197,700
アレンザホールディングス	200	1,091.00	218,200
串カツ田中HLDGS	100	1,577.00	157,700
パロックジャパン	300	645.00	193,500
クスリのアオキHLDGS	600	9,790.00	5,874,000
ダイニック	200	707.00	141,400
共和レザー	300	609.00	182,700
力の源HD	200	618.00	123,600
スシローグローバルHLDGS	3,000	2,415.00	7,245,000
LIXILビバ	600	2,596.00	1,557,600
セーレン	1,300	1,252.00	1,627,600
ソトー	200	947.00	189,400
東海染工	100	1,120.00	112,000
小松マテーレ	900	690.00	621,000
ワコールホールディングス	1,500	1,882.00	2,823,000
ホギメディカル	700	3,065.00	2,145,500
クラウドディアHLDGS	100	326.00	32,600
TSIホールディングス	1,800	336.00	604,800
マツオカコーポレーション	100	1,682.00	168,200
ワールド	800	1,420.00	1,136,000

T I S	5,400	2,250.00	12,150,000	
ネオス	200	677.00	135,400	
電算システム	200	4,455.00	891,000	
グリー	3,400	466.00	1,584,400	
コーエーテクモHD	1,100	3,465.00	3,811,500	
三菱総合研究所	200	4,195.00	839,000	
ボルテージ	100	498.00	49,800	
A G S	300	763.00	228,900	
ファインデックス	400	915.00	366,000	
ブレインパッド	100	4,230.00	423,000	
K L a b	1,000	709.00	709,000	
ポールトゥウィン・ピットクル	700	823.00	576,100	
イーブックイニシアティブ	100	3,075.00	307,500	
ネクソン	15,400	2,593.00	39,932,200	
アイスタイル	1,600	281.00	449,600	
エムアップホールディングス	100	2,390.00	239,000	
エイチーム	300	846.00	253,800	
エニグモ	400	1,262.00	504,800	
テクノスジャパン	400	748.00	299,200	
e n i s h	200	757.00	151,400	
コロプラ	1,800	1,039.00	1,870,200	
オルトプラス	300	436.00	130,800	
ブロードリーフ	2,700	543.00	1,466,100	
クロス・マーケティングG	200	331.00	66,200	
デジタルハーツHLDGS	200	852.00	170,400	
システム情報	200	1,400.00	280,000	
メディアドゥ	100	4,550.00	455,000	
じげん	1,400	312.00	436,800	
ブイキューブ	300	1,238.00	371,400	
エンカレッジ・テクノロジー	100	820.00	82,000	
サイバーリンクス	100	2,117.00	211,700	
ディー・エル・イー	400	501.00	200,400	
フィックスターズ	600	1,191.00	714,600	
C A R T A H O L D I N G S	200	1,233.00	246,600	
オブティム	200	3,620.00	724,000	
セレス	200	1,065.00	213,000	
S H I F T	200	12,780.00	2,556,000	
特種東海製紙	300	4,470.00	1,341,000	
ティーガイア	400	1,952.00	780,800	
セック	100	2,899.00	289,900	

日本アジアグループ	600	282.00	169,200
テクマトリックス	700	1,878.00	1,314,600
プロシップ	100	1,382.00	138,200
ガンホー・オンライン・エンター	1,300	1,987.00	2,583,100
GMOペイメントゲートウェイ	1,100	11,790.00	12,969,000
ザッパラス	200	373.00	74,600
システムリサーチ	100	1,886.00	188,600
インターネットイニシアティブ	800	3,600.00	2,880,000
さくらインターネット	600	606.00	363,600
ヴィンクス	100	1,314.00	131,400
GMOクラウド	100	8,090.00	809,000
SRAホールディングス	300	2,301.00	690,300
システムインテグレータ	100	1,028.00	102,800
朝日ネット	300	1,119.00	335,700
eBASE	700	1,326.00	928,200
アバント	400	982.00	392,800
アドソル日進	200	2,294.00	458,800
フリービット	200	720.00	144,000
コムチュア	700	2,704.00	1,892,800
サイバーコム	100	1,770.00	177,000
アステリア	300	503.00	150,900
アイル	200	1,577.00	315,400
王子ホールディングス	22,500	465.00	10,462,500
日本製紙	2,500	1,407.00	3,517,500
三菱製紙	700	331.00	231,700
北越コーポレーション	3,600	354.00	1,274,400
中越パルプ	200	1,438.00	287,600
巴川製紙	100	926.00	92,600
大王製紙	2,400	1,436.00	3,446,400
阿波製紙	100	482.00	48,200
マークライnz	200	2,228.00	445,600
メディカル・データ・ビジ	400	1,231.00	492,400
gumi	700	982.00	687,400
ショーケース	100	668.00	66,800
モバイルファクトリー	100	992.00	99,200
テラスカイ	200	2,829.00	565,800
デジタル・インフォメーション	200	1,306.00	261,200
PCIホールディングス	200	1,093.00	218,600
パイプドHD	100	1,428.00	142,800
アイビーシー	100	935.00	93,500

ネオジャパン	100	2,306.00	230,600
ランドコンピュータ	100	964.00	96,400
ダブルスタンダード	100	5,370.00	537,000
オープンドア	200	1,263.00	252,600
マイネット	200	1,140.00	228,000
アカツキ	200	3,790.00	758,000
UBICOMホールディングス	100	2,066.00	206,600
LINE	1,200	5,500.00	6,600,000
カナミックネットワーク	400	927.00	370,800
ノムラシステムコーポレーション	200	390.00	78,000
レンゴー	5,200	816.00	4,243,200
トーモク	300	1,732.00	519,600
ザ・パック	400	2,816.00	1,126,400
チェンジ	200	8,140.00	1,628,000
シンクロ・フード	200	309.00	61,800
オークネット	300	1,011.00	303,300
セグエグループ	100	841.00	84,100
エイトレッド	100	1,885.00	188,500
AOI TYO HOLDINGS	600	384.00	230,400
マクロミル	1,100	709.00	779,900
ビーグリー	100	1,854.00	185,400
オロ	100	2,735.00	273,500
テモナ	100	952.00	95,200
ニーズウェル	100	705.00	70,500
サインポスト	100	1,534.00	153,400
昭和電工	3,800	2,271.00	8,629,800
住友化学	39,700	312.00	12,386,400
住友精化	200	3,495.00	699,000
日産化学	3,000	5,510.00	16,530,000
ラサ工業	200	1,422.00	284,400
クレハ	600	4,410.00	2,646,000
多木化学	200	7,030.00	1,406,000
テイカ	300	1,288.00	386,400
石原産業	1,000	672.00	672,000
片倉コープアグリ	100	1,198.00	119,800
日本曹達	800	2,724.00	2,179,200
東ソー	8,300	1,427.00	11,844,100
トクヤマ	1,600	2,369.00	3,790,400
セントラル硝子	1,100	1,840.00	2,024,000
東亜合成	3,400	1,031.00	3,505,400

大阪ソーダ	600	2,317.00	1,390,200
関東電化	1,200	821.00	985,200
デンカ	1,900	2,551.00	4,846,900
イビデン	3,400	3,130.00	10,642,000
信越化学	9,300	12,410.00	115,413,000
日本カ - バイド	200	1,152.00	230,400
堺 化 学	300	1,946.00	583,800
第一稀元素化学工	700	712.00	498,400
エア・ウォーター	5,100	1,454.00	7,415,400
大陽日酸	5,200	1,774.00	9,224,800
日本化学工業	100	2,089.00	208,900
東邦アセチレン	100	1,231.00	123,100
日本パ - カライジング	2,700	1,063.00	2,870,100
高圧ガス	900	779.00	701,100
チタン工業	100	1,679.00	167,900
四国化成	800	1,004.00	803,200
戸田工業	100	1,669.00	166,900
ステラ ケミファ	300	2,301.00	690,300
保土谷化学	200	4,735.00	947,000
日本触媒	900	5,390.00	4,851,000
大日精化	400	2,206.00	882,400
カネカ	1,500	2,574.00	3,861,000
協和キリン	5,500	2,680.00	14,740,000
三菱瓦斯化学	5,200	1,603.00	8,335,600
三井化学	4,900	2,167.00	10,618,300
J S R	5,100	2,110.00	10,761,000
東京応化工業	900	5,650.00	5,085,000
大阪有機化学	600	2,832.00	1,699,200
三菱ケミカルH L D G S	36,100	607.30	21,923,530
K H ネオケム	900	2,030.00	1,827,000
ダイセル	7,300	764.00	5,577,200
住友ベ - クライト	900	2,724.00	2,451,600
積水化学	11,600	1,466.00	17,005,600
日本ゼオン	4,800	947.00	4,545,600
アイカ工業	1,700	3,505.00	5,958,500
宇部興産	2,700	1,757.00	4,743,900
積水樹脂	1,000	2,089.00	2,089,000
タキロンシーアイ	1,100	679.00	746,900
旭有機材	300	1,346.00	403,800
ニチバン	200	1,496.00	299,200

リケンテクノス	1,500	390.00	585,000
大倉工業	200	1,452.00	290,400
積水化成品	800	527.00	421,600
群栄化学	100	2,552.00	255,200
タイガース ポリマー	200	452.00	90,400
ミライアル	200	982.00	196,400
ダイキアクシス	200	722.00	144,400
ダイキョーニシカワ	1,100	443.00	487,300
竹本容器	200	668.00	133,600
森六ホールディングス	300	1,564.00	469,200
日本化薬	3,400	1,047.00	3,559,800
カーリットホールディングス	600	481.00	288,600
E P Sホールディングス	800	995.00	796,000
ソルクシーズ	200	678.00	135,600
レッグス	100	827.00	82,700
プレステージ・インター	1,900	851.00	1,616,900
フェイス	200	621.00	124,200
プロトコーポレーション	400	942.00	376,800
ハイマックス	100	1,927.00	192,700
アミューズ	300	2,203.00	660,900
野村総合研究所	7,800	2,897.00	22,596,600
ドリームインキュベータ	100	1,214.00	121,400
サイバネットシステム	300	639.00	191,700
クイック	300	1,105.00	331,500
T A C	300	192.00	57,600
C Eホールディングス	300	516.00	154,800
ケネディクス	4,900	480.00	2,352,000
日本システム技術	100	1,584.00	158,400
電通グループ	5,400	2,393.00	12,922,200
インテージホールディングス	700	868.00	607,600
テイクアンドギヴニーズ	200	547.00	109,400
東邦システムサイエンス	100	904.00	90,400
びあ	100	2,969.00	296,900
イオンファンタジー	200	1,381.00	276,200
ソースネクスト	2,600	272.00	707,200
シーティーエス	700	827.00	578,900
ネクシーズグループ	200	915.00	183,000
インフォコム	700	3,160.00	2,212,000
メディカルシステムネットワーク	600	466.00	279,600
日本精化	400	1,385.00	554,000

扶桑化学工業	600	3,900.00	2,340,000
トリケミカル	100	11,770.00	1,177,000
ラクスル	300	3,550.00	1,065,000
F I G	700	260.00	182,000
A D E K A	2,500	1,399.00	3,497,500
日油	2,000	3,855.00	7,710,000
ミヨシ油脂	200	1,040.00	208,000
新日本理化	900	156.00	140,400
ハリマ化成グループ	400	870.00	348,000
イーソル	200	1,072.00	214,400
アルテリア・ネットワークス	700	1,972.00	1,380,400
ヒト・コミュニケーションズHD	100	1,006.00	100,600
トビラシステムズ	100	1,779.00	177,900
花 王	13,300	8,409.00	111,839,700
第一工業製薬	200	4,960.00	992,000
石原ケミカル	100	1,931.00	193,100
日華化学	200	800.00	160,000
ニイタカ	100	4,940.00	494,000
三洋化成	300	4,545.00	1,363,500
武田薬品	46,200	3,670.00	169,554,000
アステラス製薬	48,200	1,713.50	82,590,700
大日本住友製薬	4,200	1,347.00	5,657,400
塩野義製薬	7,000	6,134.00	42,938,000
わかもと製薬	700	265.00	185,500
あすか製薬	700	1,153.00	807,100
日本新薬	1,500	7,850.00	11,775,000
バイオエルミン製薬	100	2,219.00	221,900
中外製薬	17,300	5,398.00	93,385,400
科研製薬	900	5,120.00	4,608,000
エーザイ	6,600	8,723.00	57,571,800
理研ビタミン	600	2,169.00	1,301,400
ロート製薬	2,800	3,430.00	9,604,000
小野薬品	12,700	2,910.00	36,957,000
久光製薬	1,500	4,960.00	7,440,000
有機合成薬品	400	326.00	130,400
持田製薬	800	3,815.00	3,052,000
参天製薬	10,300	1,857.00	19,127,100
扶桑薬品	200	2,210.00	442,000
日本ケミファ	100	2,410.00	241,000
ツムラ	1,700	2,758.00	4,688,600

日医工	1,600	1,212.00	1,939,200
テ ル モ	15,800	3,899.00	61,604,200
H UグループHD	1,500	2,503.00	3,754,500
キッセイ薬品工業	1,000	2,318.00	2,318,000
生化学工業	1,000	1,030.00	1,030,000
栄研化学	1,000	1,594.00	1,594,000
日水製薬	200	1,090.00	218,000
鳥居薬品	300	3,100.00	930,000
J C Rファーマ	400	10,380.00	4,152,000
東和薬品	700	1,872.00	1,310,400
富士製薬工業	300	1,123.00	336,900
沢井製薬	1,100	5,140.00	5,654,000
ゼリア新薬工業	1,000	1,872.00	1,872,000
第一三共	15,900	8,459.00	134,498,100
キョーリン製薬HD	1,200	2,056.00	2,467,200
大幸薬品	700	2,202.00	1,541,400
ダイト	300	3,800.00	1,140,000
大塚ホールディングス	10,600	4,446.00	47,127,600
大正製薬HD	1,100	6,150.00	6,765,000
ペプチドリーム	2,800	4,640.00	12,992,000
大日本塗料	700	865.00	605,500
日本ペイントHOLD	4,500	7,740.00	34,830,000
関西ペイント	6,100	2,154.00	13,139,400
神東塗料	400	169.00	67,600
中国塗料	1,600	800.00	1,280,000
日本特殊塗料	400	943.00	377,200
藤倉化成	800	495.00	396,000
太陽ホールディングス	300	5,050.00	1,515,000
D I C	2,400	2,644.00	6,345,600
サカタインクス	1,100	1,011.00	1,112,100
東洋インキS Cホールディン	1,100	1,997.00	2,196,700
T & K T O K A	400	796.00	318,400
アルプス技研	600	1,818.00	1,090,800
サニックス	900	260.00	234,000
ダイオーズ	100	990.00	99,000
日本空調サービス	600	721.00	432,600
オリエンタルランド	5,600	13,865.00	77,644,000
フォーカスシステムズ	300	800.00	240,000
ダスキン	1,300	2,640.00	3,432,000
パーク24	2,900	1,672.00	4,848,800

明光ネットワークジャパン	700	802.00	561,400
ファルコホールディングス	300	1,466.00	439,800
クレスコ	300	1,294.00	388,200
フジ・メディア・HD	5,200	968.00	5,033,600
秀英予備校	100	420.00	42,000
田谷	100	517.00	51,700
ラウンドワン	1,500	706.00	1,059,000
リゾートトラスト	2,500	1,314.00	3,285,000
オービック	1,900	19,090.00	36,271,000
ジャストシステム	900	7,870.00	7,083,000
TDCソフト	400	872.00	348,800
Zホールディングス	74,300	532.00	39,527,600
ビー・エム・エル	700	2,702.00	1,891,400
ワタベウェディング	100	276.00	27,600
トレンドマイクロ	2,500	6,180.00	15,450,000
りらいあコミュニケーション	900	1,091.00	981,900
IDホールディングス	200	1,325.00	265,000
リソー教育	2,500	293.00	732,500
日本オラクル	1,100	13,370.00	14,707,000
早稲田アカデミー	100	919.00	91,900
アルファシステムズ	100	3,785.00	378,500
フューチャー	700	1,674.00	1,171,800
CAC HOLDINGS	300	1,154.00	346,200
SBテクノロジー	200	3,600.00	720,000
トーセ	100	846.00	84,600
ユー・エス・エス	6,000	1,646.00	9,876,000
オービックビジネスC	600	5,900.00	3,540,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,500	4,175.00	10,437,500
アイティフォー	700	720.00	504,000
東京個別指導学院	200	485.00	97,000
東計電算	100	4,025.00	402,500
サイバーエージェント	3,300	5,980.00	19,734,000
楽天	24,600	988.00	24,304,800
エクスネット	100	970.00	97,000
クリーク・アンド・リバー社	200	1,307.00	261,400
テー・オー・ダブリュー	800	320.00	256,000
大塚商会	2,900	5,640.00	16,356,000
サイボウズ	700	3,490.00	2,443,000
ソフトブレーン	300	415.00	124,500
山田コンサルティングGP	200	1,185.00	237,000

セントラルスポーツ	200	2,061.00	412,200	
バラカ	100	1,550.00	155,000	
電通国際情報S	300	4,950.00	1,485,000	
A C C E S S	500	926.00	463,000	
デジタルガレージ	1,000	3,600.00	3,600,000	
イーエムシステムズ	800	910.00	728,000	
ウェザーニューズ	200	3,400.00	680,000	
C I J	300	779.00	233,700	
ビジネスエンジニアリング	100	2,554.00	255,400	
日本エンタープライズ	600	271.00	162,600	
WOWOW	200	2,383.00	476,600	
スカラ	300	626.00	187,800	
インテリジェント ウェイブ	200	770.00	154,000	
フルキャストホールディングス	600	1,279.00	767,400	
エン・ジャパン	900	2,542.00	2,287,800	
富士フイルムHLDGS	10,600	4,639.00	49,173,400	
コニカミノルタ	12,100	360.00	4,356,000	
資生堂	11,000	6,712.00	73,832,000	
ライオン	7,200	2,645.00	19,044,000	
高砂香料	300	2,070.00	621,000	
マンダム	1,200	1,896.00	2,275,200	
ミルボン	800	4,840.00	3,872,000	
ファンケル	2,300	3,065.00	7,049,500	
コーセー	1,000	12,020.00	12,020,000	
コタ	300	1,160.00	348,000	
シーボン	100	1,901.00	190,100	
ポーラ・オルビスHD	2,400	1,782.00	4,276,800	
ノエビアホールディングス	600	4,435.00	2,661,000	
アジュバンコスメジャパン	100	942.00	94,200	
エステー	300	1,652.00	495,600	
アグロカネショウ	100	1,251.00	125,100	
コニシ	900	1,395.00	1,255,500	
長谷川香料	1,000	2,314.00	2,314,000	
星光PMC	300	686.00	205,800	
小林製薬	1,600	9,410.00	15,056,000	
荒川化学工業	600	1,139.00	683,400	
メック	300	2,018.00	605,400	
日本高純度化学	100	2,476.00	247,600	
タカラバイオ	1,500	3,010.00	4,515,000	
J C U	700	3,170.00	2,219,000	

新田ゼラチン	300	632.00	189,600
O A Tアグリオ	100	1,078.00	107,800
デクセリアルズ	1,500	807.00	1,210,500
アース製薬	400	7,240.00	2,896,000
北興化学	600	551.00	330,600
大成ラミック	200	2,638.00	527,600
クミアイ化学	2,400	984.00	2,361,600
日本農薬	1,000	500.00	500,000
富士興産	100	405.00	40,500
ニチレキ	700	1,581.00	1,106,700
ユシロ化学	300	1,257.00	377,100
ビーピー・カストロール	200	1,056.00	211,200
富士石油	1,500	154.00	231,000
M O R E S C O	200	964.00	192,800
出光興産	6,200	2,248.00	13,937,600
E N E O Sホールディングス	82,900	374.80	31,070,920
コスモエネルギーH L D G S	1,600	1,479.00	2,366,400
横浜ゴム	3,300	1,452.00	4,791,600
T O Y O T I R E	3,300	1,384.00	4,567,200
ブリヂストン	16,000	3,390.00	54,240,000
住友ゴム	5,000	964.00	4,820,000
藤倉コンポジット	600	354.00	212,400
オカモト	300	3,805.00	1,141,500
アキレス	300	1,913.00	573,900
フ コ ク	200	649.00	129,800
ニッタ	700	2,288.00	1,601,600
クリエートメディック	200	950.00	190,000
住友理工	1,000	565.00	565,000
三ツ星ベルト	800	1,617.00	1,293,600
バンドー化学	1,000	603.00	603,000
A G C	5,400	2,976.00	16,070,400
日本板硝子	2,600	360.00	936,000
石塚硝子	100	1,758.00	175,800
有沢製作所	900	803.00	722,700
日本山村硝子	200	841.00	168,200
日本電気硝子	2,200	1,629.00	3,583,800
オハラ	200	1,041.00	208,200
住友大阪セメント	1,000	3,555.00	3,555,000
太平洋セメント	3,500	2,283.00	7,990,500
日本ヒユ - ム	600	751.00	450,600

日本コンクリート	1,100	260.00	286,000
三谷セキサン	200	4,810.00	962,000
アジアパイルHD	800	450.00	360,000
東海カーボン	5,800	970.00	5,626,000
日本カーボン	200	3,420.00	684,000
東洋炭素	300	1,654.00	496,200
ノリタケ	300	3,175.00	952,500
TOTO	3,900	4,155.00	16,204,500
日本碍子	6,700	1,382.00	9,259,400
日本特殊陶業	4,300	1,424.00	6,123,200
ダントーホールディングス	400	87.00	34,800
MARUWA	200	7,930.00	1,586,000
品川リフラクトリーズ	100	2,089.00	208,900
黒崎播磨	100	3,505.00	350,500
ヨータイ	400	705.00	282,000
イソライト	200	401.00	80,200
東京窯業	700	278.00	194,600
ニッカトー	200	645.00	129,000
フジミインコーポレーテッド	600	3,415.00	2,049,000
クニミネ工業	200	890.00	178,000
エーアンドエーマテリアル	100	1,032.00	103,200
ニチアス	1,600	2,253.00	3,604,800
日本製鉄	24,300	980.30	23,821,290
神戸製鋼所	9,900	353.00	3,494,700
中山製鋼所	800	341.00	272,800
合同製鐵	300	1,749.00	524,700
JFEホールディングス	14,800	750.00	11,100,000
東京製鐵	2,700	608.00	1,641,600
共英製鋼	700	1,248.00	873,600
大和工業	1,100	2,049.00	2,253,900
東京鐵鋼	200	1,450.00	290,000
大阪製鐵	300	1,203.00	360,900
淀川製鋼所	800	1,760.00	1,408,000
丸一鋼管	1,800	2,591.00	4,663,800
モリ工業	100	2,112.00	211,200
大同特殊鋼	900	3,255.00	2,929,500
日本高周波	200	333.00	66,600
日本冶金工	400	1,486.00	594,400
山陽特殊製鋼	300	833.00	249,900
愛知製鋼	300	2,942.00	882,600

日立金属	6,000	1,275.00	7,650,000
日本金属	100	590.00	59,000
大太平洋金属	300	1,506.00	451,800
新日本電工	3,500	160.00	560,000
栗本鉄工所	200	1,584.00	316,800
虹 技	100	1,161.00	116,100
日本製鋼所	1,700	1,477.00	2,510,900
三菱製鋼	400	605.00	242,000
日亜鋼業	800	267.00	213,600
日本精線	100	3,245.00	324,500
エンビプロHD	200	517.00	103,400
大紀アルミニウム	900	513.00	461,700
日本軽金属HD	13,800	182.00	2,511,600
三井金属	1,500	2,245.00	3,367,500
東邦亜鉛	200	1,478.00	295,600
三菱マテリアル	3,600	2,228.00	8,020,800
住友鉱山	7,000	3,157.00	22,099,000
DOWAホールディングス	1,500	3,245.00	4,867,500
古河機金	1,000	1,051.00	1,051,000
エス・サイエンス	2,500	45.00	112,500
大阪チタニウム	600	887.00	532,200
東邦チタニウム	1,000	624.00	624,000
UACJ	800	1,824.00	1,459,200
CKサンエツ	100	2,889.00	288,900
古河電工	1,700	2,550.00	4,335,000
住友電工	20,400	1,215.00	24,786,000
フジクラ	6,500	304.00	1,976,000
昭和電線HLDGS	700	1,104.00	772,800
東京特殊電線	100	2,111.00	211,100
タツタ電線	1,100	518.00	569,800
カナレ電気	100	1,621.00	162,100
平河ビューテック	200	983.00	196,600
リョービ	700	1,068.00	747,600
アーレステイ	800	326.00	260,800
アサヒHD	900	2,797.00	2,517,300
東洋製罐グループHD	3,500	1,134.00	3,969,000
ホッカンホールディングス	300	1,665.00	499,500
コロナ	300	1,008.00	302,400
横河ブリッジHLDGS	1,000	2,124.00	2,124,000
OSJB HD	2,700	219.00	591,300

駒井ハルテック	100	1,401.00	140,100
三和ホールディングス	5,300	890.00	4,717,000
文化シャツタ -	1,600	724.00	1,158,400
三協立山	700	877.00	613,900
アルインコ	300	898.00	269,400
東洋シャツタ -	100	647.00	64,700
L I X I Lグループ	8,000	1,471.00	11,768,000
日本フィルコン	400	455.00	182,000
ノーリツ	1,100	1,289.00	1,417,900
長府製作所	600	2,055.00	1,233,000
リンナイ	1,000	8,760.00	8,760,000
ユニプレス	1,000	840.00	840,000
ダイニチ工業	300	683.00	204,900
日東精工	800	422.00	337,600
三洋工業	100	1,937.00	193,700
岡 部	1,100	782.00	860,200
ジーテクト	700	937.00	655,900
東 プ レ	1,000	1,091.00	1,091,000
高周波熱錬	1,000	475.00	475,000
東京製綱	300	542.00	162,600
サンコール	300	400.00	120,000
モリテックスチル	400	264.00	105,600
パイオラックス	800	1,490.00	1,192,000
エイチワン	600	510.00	306,000
日本発条	5,900	636.00	3,752,400
中央発條	100	2,621.00	262,100
アドバネクス	100	1,385.00	138,500
三浦工業	2,400	4,250.00	10,200,000
タ ク マ	1,800	1,446.00	2,602,800
テクノプロ・ホールディング	1,000	5,780.00	5,780,000
アトラ	100	219.00	21,900
インターワークス	100	340.00	34,000
アイ・アールジャパンHD	200	11,180.00	2,236,000
K e e P e r 技研	200	1,649.00	329,800
ファーストロジック	100	618.00	61,800
三機サービス	100	926.00	92,600
G u n o s y	300	918.00	275,400
デザインワン・ジャパン	100	261.00	26,100
イー・ガーディアン	200	2,915.00	583,000
リブセンス	300	284.00	85,200

ジャパンマテリアル	1,700	1,700.00	2,890,000
ベクトル	700	841.00	588,700
ウチヤマホールディングス	200	294.00	58,800
チャームケアコーポレーション	400	754.00	301,600
ライクキッズ	100	1,003.00	100,300
キャリアリンク	100	737.00	73,700
I B J	300	631.00	189,300
アサンテ	200	1,420.00	284,000
N・フィールド	300	498.00	149,400
バリューHR	200	1,318.00	263,600
M&Aキャピタルパートナー	300	3,920.00	1,176,000
ライドオンエクスプレスHD	200	2,361.00	472,200
E R Iホールディングス	100	624.00	62,400
アピスト	100	2,574.00	257,400
シグマクシス	300	1,511.00	453,300
ウィルグループ	300	618.00	185,400
エスクローAJ	800	240.00	192,000
リクルートホールディングス	38,000	3,570.00	135,660,000
エラン	300	1,702.00	510,600
ツガミ	1,100	906.00	996,600
オークマ	700	4,445.00	3,111,500
芝浦機械	700	2,065.00	1,445,500
アマダ	7,000	790.00	5,530,000
アイダエンジニア	1,500	714.00	1,071,000
滝澤鉄工所	100	980.00	98,000
F U J I	2,400	1,822.00	4,372,800
牧野フライス	700	3,145.00	2,201,500
オーエスジー	2,600	1,574.00	4,092,400
ダイジェット	100	1,322.00	132,200
旭ダイヤモンド	1,500	449.00	673,500
D M G 森精機	3,500	1,245.00	4,357,500
ソディック	1,200	792.00	950,400
ディスコ	800	27,640.00	22,112,000
日東工器	300	1,798.00	539,400
日進工具	100	2,455.00	245,500
パンチ工業	600	404.00	242,400
富士ダイス	200	660.00	132,000
土木管理総合試験	200	380.00	76,000
ネットマーケティング	100	600.00	60,000
ベルシステム24HLDGS	900	1,669.00	1,502,100

鎌倉新書	300	995.00	298,500
SMN	100	1,040.00	104,000
LITALICO	200	2,137.00	427,400
グローバルキッズCOMP	100	591.00	59,100
エアトリ	200	1,220.00	244,000
アトラエ	100	2,967.00	296,700
ストライク	200	5,000.00	1,000,000
ソラスト	1,500	1,021.00	1,531,500
セラク	100	1,051.00	105,100
インソース	200	2,616.00	523,200
豊田自動織機	4,500	5,460.00	24,570,000
豊和工業	300	736.00	220,800
OKK	200	363.00	72,600
石川製作所	100	1,551.00	155,100
東洋機械金属	300	385.00	115,500
津田駒工業	100	873.00	87,300
エンシュウ	100	877.00	87,700
島精機製作所	900	1,314.00	1,182,600
オプトラ	700	2,465.00	1,725,500
NCホールディングス	100	545.00	54,500
イワキポンプ	200	917.00	183,400
フリー	600	944.00	566,400
ヤマシンフィルタ	1,100	990.00	1,089,000
日阪製作所	700	724.00	506,800
やまびこ	1,000	907.00	907,000
平田機工	200	5,830.00	1,166,000
ペガサスミシン製造	600	302.00	181,200
マルマエ	200	1,168.00	233,600
タツモ	200	1,770.00	354,000
ナブテスコ	3,300	3,320.00	10,956,000
三井海洋開発	600	1,448.00	868,800
レオン自動機	600	1,205.00	723,000
SMC	1,700	55,700.00	94,690,000
ホソカワミクロン	200	5,290.00	1,058,000
ユニオンツール	200	2,543.00	508,600
オイレス工業	700	1,354.00	947,800
日精エーエスビー	200	3,000.00	600,000
サト - ホールディングス	800	2,393.00	1,914,400
技研製作所	400	4,770.00	1,908,000
日本エアーテック	100	1,151.00	115,100

カワタ	100	718.00	71,800
日精樹脂工業	400	782.00	312,800
オカダアイヨン	100	916.00	91,600
ワイエイシイホールディングス	200	657.00	131,400
小松製作所	25,000	2,160.00	54,000,000
住友重機械	3,200	2,178.00	6,969,600
日立建機	2,200	3,000.00	6,600,000
日工	800	596.00	476,800
巴工業	200	1,790.00	358,000
井関農機	600	1,076.00	645,600
TOWA	600	1,396.00	837,600
丸山製作所	100	1,118.00	111,800
北川鉄工所	200	1,477.00	295,400
シンニッタン	900	209.00	188,100
ローツェ	200	6,020.00	1,204,000
タカキタ	200	585.00	117,000
クボタ	29,500	1,518.00	44,781,000
荏原実業	100	2,746.00	274,600
東洋エンジニア	800	333.00	266,400
三菱化工機	200	1,806.00	361,200
月島機械	1,000	1,103.00	1,103,000
帝国電機製作所	400	1,191.00	476,400
東京機械	200	264.00	52,800
新東工業	1,300	733.00	952,900
渋谷工業	600	2,810.00	1,686,000
アイチコーポレーション	900	740.00	666,000
小森コーポレーション	1,500	665.00	997,500
鶴見製作所	400	1,721.00	688,400
住友精密	100	2,081.00	208,100
日本ギア工業	100	275.00	27,500
酒井重工業	100	2,036.00	203,600
荏原製作所	2,400	2,493.00	5,983,200
石井鉄工所	100	2,430.00	243,000
西島製作所	600	835.00	501,000
北越工業	600	1,030.00	618,000
ダイキン工業	7,100	18,415.00	130,746,500
オルガノ	200	5,440.00	1,088,000
トヨカネツ	200	2,000.00	400,000
栗田工業	2,900	2,943.00	8,534,700
椿本チエイン	800	2,493.00	1,994,400

大同工業	200	617.00	123,400
日機装	1,700	925.00	1,572,500
木村化工機	400	402.00	160,800
レイズネクスト	900	1,219.00	1,097,100
アネスト岩田	900	798.00	718,200
ダイフク	2,800	10,030.00	28,084,000
サムコ	100	3,170.00	317,000
加藤製作所	300	1,157.00	347,100
油研工業	100	1,503.00	150,300
タダノ	2,700	854.00	2,305,800
フジテック	2,000	1,860.00	3,720,000
CKD	1,600	2,121.00	3,393,600
キトー	400	1,179.00	471,600
平和	1,600	1,762.00	2,819,200
理想科学工業	600	1,255.00	753,000
SANKYO	1,200	2,635.00	3,162,000
日本金銭機械	700	534.00	373,800
マースグループHLDGS	300	1,594.00	478,200
フクシマガリレイ	300	3,290.00	987,000
オーイズミ	200	372.00	74,400
ダイコク電機	200	1,180.00	236,000
竹内製作所	900	1,795.00	1,615,500
アマノ	1,500	2,212.00	3,318,000
JUKI	800	505.00	404,000
サンデンホールディングス	800	280.00	224,000
蛇の目マシン	600	415.00	249,000
ブラザー工業	6,800	1,833.00	12,464,400
マックス	900	1,488.00	1,339,200
モリタホールディングス	1,000	1,731.00	1,731,000
グローリー	1,500	2,430.00	3,645,000
新晃工業	600	1,401.00	840,600
大和冷機工業	800	935.00	748,000
セガサミーホールディングス	5,400	1,281.00	6,917,400
日本ピストンリング	200	1,146.00	229,200
リケン	200	2,666.00	533,200
TPR	800	1,397.00	1,117,600
ツバキ・ナカシマ	1,100	772.00	849,200
ホシザキ	1,700	8,680.00	14,756,000
大豊工業	400	505.00	202,000
日本精工	10,500	744.00	7,812,000

N T N	12,700	198.00	2,514,600	
ジェイテクト	5,300	761.00	4,033,300	
不二越	600	3,245.00	1,947,000	
ミネベアミツミ	10,300	1,836.00	18,910,800	
日本トムソン	1,700	321.00	545,700	
T H K	3,300	2,678.00	8,837,400	
ユーシン精機	400	676.00	270,400	
前澤給装工業	200	2,026.00	405,200	
イーグル工業	700	672.00	470,400	
前澤工業	300	379.00	113,700	
日本ピラ - 工業	600	1,362.00	817,200	
キッツ	2,300	655.00	1,506,500	
日立	26,700	3,342.00	89,231,400	
三菱電機	55,500	1,376.50	76,395,750	
富士電機	3,400	2,781.00	9,455,400	
東洋電機製造	200	1,137.00	227,400	
安川電機	6,000	4,110.00	24,660,000	
シンフォニア テクノロジー	800	1,004.00	803,200	
明電舎	1,000	1,553.00	1,553,000	
オリジン	100	1,270.00	127,000	
山洋電気	200	4,620.00	924,000	
デンヨー	600	1,960.00	1,176,000	
ベйкаレントコンサルティング	300	9,130.00	2,739,000	
ORCHESTRA HLDGS	100	1,590.00	159,000	
アイモバイル	100	777.00	77,700	
キャリアインデックス	200	506.00	101,200	
MS - J a p a n	100	747.00	74,700	
船場	100	964.00	96,400	
グレイステクノロジー	200	5,880.00	1,176,000	
ジャパンエレベーターSHD	600	3,555.00	2,133,000	
フルテック	100	1,271.00	127,100	
グリーンズ	100	449.00	44,900	
ツナググループHLDGS	100	393.00	39,300	
GAMEWITH	100	551.00	55,100	
ソウルドアウト	100	2,550.00	255,000	
MS&CONSULTING	100	598.00	59,800	
日総工産	300	617.00	185,100	
キュービーネットHLDGS	200	1,830.00	366,000	
RPAホールディングス	300	680.00	204,000	
三桜工業	700	619.00	433,300	

マキタ	7,200	3,915.00	28,188,000
東芝テック	700	4,205.00	2,943,500
芝浦メカトロニクス	100	2,726.00	272,600
マブチモーター	1,600	3,220.00	5,152,000
日本電産	13,400	6,985.00	93,599,000
ユーエムシーエレクトロニクス	300	382.00	114,600
トレックス・セミコンダクター	300	1,196.00	358,800
東光高岳	300	969.00	290,700
ダブル・スコープ	900	711.00	639,900
宮越ホールディングス	200	664.00	132,800
ダイヘン	700	3,975.00	2,782,500
ヤーマン	900	936.00	842,400
JVCケンウッド	4,500	151.00	679,500
ミマキエンジニアリング	600	377.00	226,200
第一精工	200	1,962.00	392,400
日新電機	1,200	997.00	1,196,400
大崎電気	1,100	508.00	558,800
オムロン	5,000	7,250.00	36,250,000
日東工業	800	1,742.00	1,393,600
I D E C	800	1,589.00	1,271,200
正興電機製作所	100	922.00	92,200
不二電機工業	100	1,328.00	132,800
ジーエス・ユアサ コーポ	1,800	1,762.00	3,171,600
サクサホールディングス	100	1,512.00	151,200
メルコホールディングス	200	3,225.00	645,000
テクノメディカ	100	1,700.00	170,000
ダイヤモンドエレクトリクHD	100	550.00	55,000
日本電気	6,800	5,550.00	37,740,000
富士通	5,400	12,960.00	69,984,000
沖電気	2,300	1,015.00	2,334,500
岩崎通信機	200	817.00	163,400
電気興業	200	2,422.00	484,400
サンケン電気	700	1,980.00	1,386,000
ナカヨ	100	1,360.00	136,000
アイホン	300	1,411.00	423,300
ルネサスエレクトロニクス	26,400	592.00	15,628,800
セイコーエプソン	6,900	1,173.00	8,093,700
ワコム	3,700	571.00	2,112,700
アルバック	1,000	3,245.00	3,245,000
アクセル	200	754.00	150,800

E I Z O	400	4,020.00	1,608,000
ジャパンディスプレイ	16,000	43.00	688,000
日本信号	1,500	1,059.00	1,588,500
京三製作所	1,200	550.00	660,000
能美防災	800	2,009.00	1,607,200
ホーチキ	400	1,190.00	476,000
星和電機	200	595.00	119,000
エレコム	700	5,430.00	3,801,000
パナソニック	63,500	954.90	60,636,150
シャープ	6,400	1,122.00	7,180,800
アンリツ	3,600	2,488.00	8,956,800
富士通ゼネラル	1,600	2,400.00	3,840,000
ソ ニ ー	34,800	7,780.00	270,744,000
T D K	2,700	10,480.00	28,296,000
帝国通信工業	200	1,142.00	228,400
タムラ製作所	1,800	428.00	770,400
アルプスアルパイン	4,800	1,313.00	6,302,400
池上通信機	200	851.00	170,200
日本電波工業	600	309.00	185,400
鈴木	200	652.00	130,400
日本トリム	100	3,200.00	320,000
ローランド ディー . ジー .	300	1,125.00	337,500
フオスタ - 電機	600	1,079.00	647,400
S M K	100	2,420.00	242,000
ヨコオ	300	2,573.00	771,900
ティアック	300	132.00	39,600
ホシデン	1,600	909.00	1,454,400
ヒロセ電機	900	11,630.00	10,467,000
日本航空電子	1,200	1,392.00	1,670,400
T O A	700	721.00	504,700
マクセルホールディングス	1,100	912.00	1,003,200
古野電気	800	937.00	749,600
ユニデンホールディングス	100	1,702.00	170,200
スミダコーポレーション	400	689.00	275,600
アイコム	300	2,970.00	891,000
リオン	200	2,071.00	414,200
本多通信工業	400	393.00	157,200
船井電機	600	486.00	291,600
横河電機	5,100	1,598.00	8,149,800
新電元工業	200	2,023.00	404,600

アズビル	3,500	3,360.00	11,760,000	
東亜ディーケーケー	200	846.00	169,200	
日本光電工業	2,400	3,515.00	8,436,000	
チノール	200	1,375.00	275,000	
共和電業	600	397.00	238,200	
日本電子材料	200	1,464.00	292,800	
堀場製作所	1,100	5,730.00	6,303,000	
アドバンテスト	4,200	6,960.00	29,232,000	
小野測器	200	474.00	94,800	
エスペック	600	1,823.00	1,093,800	
キーエンス	5,000	44,840.00	224,200,000	
日置電機	300	2,991.00	897,300	
シスメックス	3,900	7,924.00	30,903,600	
日本マイクロニクス	900	1,170.00	1,053,000	
メガチップス	600	2,047.00	1,228,200	
OBARA GROUP	200	3,330.00	666,000	
IMAGICA GROUP	400	361.00	144,400	
澤藤電機	100	1,551.00	155,100	
デンソー	12,200	4,071.00	49,666,200	
原田工業	200	882.00	176,400	
コーセル	800	838.00	670,400	
イリソ電子工業	600	3,130.00	1,878,000	
オプテックスグループ	900	1,163.00	1,046,700	
千代田インテグレ	200	1,558.00	311,600	
アイ・オー・データ	200	992.00	198,400	
レーザーテック	2,500	11,510.00	28,775,000	
スタンレー電気	3,800	2,529.00	9,610,200	
岩崎電気	200	1,816.00	363,200	
ウシオ電機	3,200	1,317.00	4,214,400	
岡谷電機	400	292.00	116,800	
ヘリオステクノH	600	302.00	181,200	
エノモト	100	1,008.00	100,800	
日本セラミック	600	2,115.00	1,269,000	
遠藤照明	200	602.00	120,400	
古河電池	300	1,122.00	336,600	
双信電機	200	394.00	78,800	
山一電機	400	1,346.00	538,400	
図研	300	3,070.00	921,000	
日本電子	1,100	3,020.00	3,322,000	
カシオ	4,800	1,859.00	8,923,200	

ファナック	5,200	19,725.00	102,570,000
日本シイエムケイ	1,200	387.00	464,400
エンプラス	200	2,227.00	445,400
大真空	200	2,372.00	474,400
ローム	2,500	7,030.00	17,575,000
浜松ホトニクス	3,900	4,800.00	18,720,000
三井ハイテック	700	1,715.00	1,200,500
新光電気工業	1,800	1,655.00	2,979,000
京セラ	7,800	5,637.00	43,968,600
太陽誘電	2,500	3,310.00	8,275,000
村田製作所	16,300	6,480.00	105,624,000
双葉電子工業	900	957.00	861,300
日東電工	3,800	5,850.00	22,230,000
北陸電気工業	200	816.00	163,200
東海理化電機	1,500	1,443.00	2,164,500
ニチコン	1,900	689.00	1,309,100
日本ケミコン	400	1,856.00	742,400
K O A	800	924.00	739,200
三井E & S H D	2,000	409.00	818,000
日立造船	4,400	367.00	1,614,800
三菱重工業	9,200	2,538.00	23,349,600
川崎重工業	4,300	1,487.00	6,394,100
I H I	3,900	1,492.00	5,818,800
名村造船所	1,800	148.00	266,400
サノヤスホールディングス	700	152.00	106,400
スプリックス	200	657.00	131,400
マネジメントソリューションズ	100	1,236.00	123,600
プロレド・パートナーズ	100	5,220.00	522,000
カーブスホールディングス	1,400	540.00	756,000
フォーラムエンジニアリング	200	730.00	146,000
日本車輛	200	2,313.00	462,600
三菱ロジスネクスト	800	864.00	691,200
近畿車輛	100	1,160.00	116,000
日産自動車	65,000	374.80	24,362,000
いすゞ自動車	16,000	915.40	14,646,400
トヨタ自動車	61,900	6,568.00	406,559,200
日野自動車	6,900	687.00	4,740,300
三菱自動車工業	20,400	258.00	5,263,200
エフテック	300	465.00	139,500
レシップホールディングス	200	527.00	105,400

G M B	100	552.00	55,200
ファルテック	100	635.00	63,500
武蔵精密工業	1,200	856.00	1,027,200
日産車体	1,100	861.00	947,100
新明和工業	1,600	992.00	1,587,200
極東開発工業	1,000	1,252.00	1,252,000
日信工業	1,100	2,201.00	2,421,100
トピー工業	400	1,129.00	451,600
ティラド	200	1,235.00	247,000
曙ブレーキ	3,000	163.00	489,000
タチエス	900	828.00	745,200
N O K	2,900	1,262.00	3,659,800
フタバ産業	1,600	415.00	664,000
K Y B	700	1,901.00	1,330,700
市光工業	800	466.00	372,800
大同メタル工業	1,000	520.00	520,000
プレス工業	2,700	272.00	734,400
ミクニ	700	248.00	173,600
太平洋工業	1,100	850.00	935,000
ケーヒン	1,200	2,544.00	3,052,800
河西工業	800	405.00	324,000
アイシン精機	4,500	3,000.00	13,500,000
マ ッ ダ	16,200	628.00	10,173,600
今仙電機製作所	600	666.00	399,600
本田技研	43,700	2,636.50	115,215,050
スズキ	10,900	3,652.00	39,806,800
S U B A R U	17,100	2,129.50	36,414,450
安永	200	962.00	192,400
ヤマハ発動機	7,200	1,625.00	11,700,000
ショーワ	1,200	2,245.00	2,694,000
小糸製作所	3,400	4,240.00	14,416,000
T B K	700	421.00	294,700
エクセディ	800	1,449.00	1,159,200
ミツバ	1,000	377.00	377,000
豊田合成	1,800	2,102.00	3,783,600
愛三工業	900	482.00	433,800
盟和産業	100	841.00	84,100
日本プラスト	400	407.00	162,800
ヨ ロ ズ	600	1,004.00	602,400
エフ・シー・シー	900	1,742.00	1,567,800

新家工業	100	1,152.00	115,200
シマノ	2,100	20,980.00	44,058,000
テイ・エス テック	1,200	2,763.00	3,315,600
ジャムコ	200	694.00	138,800
小野建	600	1,159.00	695,400
はるやまHLDGS	200	689.00	137,800
南陽	100	1,487.00	148,700
ノジマ	1,000	2,617.00	2,617,000
佐島電機	300	772.00	231,600
カッパ・クリエイト	800	1,344.00	1,075,200
エコートレーディング	100	519.00	51,900
伯東	300	915.00	274,500
コンドーテック	400	1,089.00	435,600
中山福	300	407.00	122,100
ライトオン	400	585.00	234,000
ナガイレーベン	800	2,643.00	2,114,400
ジーンズメイト	100	216.00	21,600
三菱食品	700	2,707.00	1,894,900
良品計画	7,200	1,371.00	9,871,200
三城ホールディングス	600	253.00	151,800
松田産業	300	1,330.00	399,000
第一興商	800	3,050.00	2,440,000
メディパルHD	5,900	1,977.00	11,664,300
アドヴァン	800	1,262.00	1,009,600
SPK	200	1,212.00	242,400
萩原電気HLDGS	200	1,960.00	392,000
アルビス	200	2,224.00	444,800
アズワン	400	11,230.00	4,492,000
スズデン	200	1,175.00	235,000
尾家産業	100	1,200.00	120,000
シモジマ	300	1,171.00	351,300
ドウシシャ	600	1,601.00	960,600
小津産業	100	1,745.00	174,500
コナカ	700	288.00	201,600
高速	300	1,377.00	413,100
ハウスローゼ	100	1,583.00	158,300
G-7ホールディングス	300	2,365.00	709,500
たけびし	200	1,387.00	277,400
イオン北海道	700	760.00	532,000
コジマ	900	517.00	465,300

ヒマラヤ	200	807.00	161,400	
コーナン商事	800	3,450.00	2,760,000	
ネットワンシステムズ	2,000	3,505.00	7,010,000	
エコス	200	1,993.00	398,600	
ワタミ	700	877.00	613,900	
マルシェ	100	480.00	48,000	
リックス	100	1,608.00	160,800	
システムソフト	1,200	92.00	110,400	
パンパシフィックHD	11,900	2,420.00	28,798,000	
丸文	600	517.00	310,200	
西松屋チェーン	1,200	1,072.00	1,286,400	
ゼンショーホールディングス	2,600	2,027.00	5,270,200	
ハピネット	400	1,083.00	433,200	
幸楽苑ホールディングス	300	1,468.00	440,400	
ハークスレイ	100	1,013.00	101,300	
橋本総業HLDGS	100	1,990.00	199,000	
日本ライフライン	1,600	1,310.00	2,096,000	
サイゼリヤ	900	1,846.00	1,661,400	
タカショー	200	478.00	95,600	
V Tホールディングス	2,300	341.00	784,300	
マルカ	200	1,699.00	339,800	
アルゴグラフィックス	400	3,315.00	1,326,000	
魚力	100	1,570.00	157,000	
IDOM	1,500	484.00	726,000	
日本エム・ディ・エム	300	1,494.00	448,200	
ポプラ	100	390.00	39,000	
フジ・コーポレーション	100	1,918.00	191,800	
ユナイテッドアローズ	600	1,583.00	949,800	
進和	300	1,872.00	561,600	
エスケイジャパン	100	284.00	28,400	
ダイトロン	200	1,437.00	287,400	
ハイデイ日高	800	1,531.00	1,224,800	
シークス	700	893.00	625,100	
京都きもの友禅	300	256.00	76,800	
コロナイド	1,800	1,332.00	2,397,600	
ピーシーデポコーポ	800	686.00	548,800	
田中商事	100	687.00	68,700	
オーハシテクニカ	300	1,589.00	476,700	
壱番屋	300	4,715.00	1,414,500	
白銅	200	1,354.00	270,800	

トップカルチャー	200	345.00	69,000
P L A N T	100	615.00	61,500
スギホールディングス	1,100	7,480.00	8,228,000
薬王堂ホールディングス	200	2,686.00	537,200
島津製作所	6,500	2,876.00	18,694,000
J M S	600	757.00	454,200
クボテック	100	358.00	35,800
長野計器	300	980.00	294,000
ブイ・テクノロジー	200	3,700.00	740,000
スター精密	900	1,252.00	1,126,800
東京計器	300	905.00	271,500
愛知時計	100	4,415.00	441,500
インターアクション	300	1,844.00	553,200
オーバル	600	210.00	126,000
東京精密	1,000	3,410.00	3,410,000
マニー	2,100	2,836.00	5,955,600
ニコン	8,800	834.00	7,339,200
トプコン	2,800	806.00	2,256,800
オリンパス	30,700	1,978.00	60,724,600
理研計器	600	2,339.00	1,403,400
S C R E E Nホールディングス	900	5,270.00	4,743,000
キヤノン電子	600	1,562.00	937,200
タムロン	400	1,720.00	688,000
H O Y A	11,000	10,735.00	118,085,000
シ ー ド	200	694.00	138,800
ノーリツ鋼機	300	1,488.00	446,400
エー・アンド・デイ	600	652.00	391,200
朝日インテック	6,300	3,000.00	18,900,000
キヤノン	29,900	2,007.00	60,009,300
リ コ ー	14,100	766.00	10,800,600
シチズン時計	6,400	317.00	2,028,800
リズム時計	100	588.00	58,800
大研医器	300	551.00	165,300
メニコン	800	5,240.00	4,192,000
中本パックス	100	1,438.00	143,800
スノーピーク	300	1,234.00	370,200
パラマウントベッドHD	700	4,355.00	3,048,500
トランザクション	300	1,153.00	345,900
粧美堂	100	341.00	34,100
ニホンフラッシュ	600	1,365.00	819,000

前田工織	700	2,432.00	1,702,400
永大産業	800	270.00	216,000
アートネイチャー	700	597.00	417,900
バンダイナムコHLDGS	5,700	5,762.00	32,843,400
アイフィスジャパン	100	696.00	69,600
共立印刷	900	131.00	117,900
SHOEI	600	2,603.00	1,561,800
フランスベッドHLDGS	800	801.00	640,800
マーベラス	800	695.00	556,000
パイロットコーポレーション	900	3,250.00	2,925,000
萩原工業	300	1,419.00	425,700
エイベックス	900	880.00	792,000
トッパン・フォームズ	1,100	1,034.00	1,137,400
フジシールインターナショナル	1,200	1,927.00	2,312,400
タカラトミー	2,500	819.00	2,047,500
廣濟堂	300	771.00	231,300
エステールホールディングス	100	618.00	61,800
アーク	2,100	110.00	231,000
レック	700	1,415.00	990,500
タカノ	200	661.00	132,200
三光合成	700	250.00	175,000
プロネクサス	600	1,151.00	690,600
ホクシン	300	116.00	34,800
ウッドワン	200	1,082.00	216,400
大建工業	300	1,721.00	516,300
きもと	900	166.00	149,400
凸版印刷	7,800	1,693.00	13,205,400
大日本印刷	7,200	2,417.00	17,402,400
共同印刷	100	2,645.00	264,500
NISSHA	1,100	953.00	1,048,300
藤森工業	600	3,475.00	2,085,000
ヴィア・ホールディングス	700	334.00	233,800
TAKARA & COMPANY	200	2,111.00	422,200
前澤化成工業	300	960.00	288,000
未来工業	300	1,867.00	560,100
アシックス	4,500	1,195.00	5,377,500
ツツミ	100	1,812.00	181,200
ウェーブロックHLDGS	200	849.00	169,800
ジェイエスピー	300	1,384.00	415,200
ニチハ	800	2,221.00	1,776,800

エフピコ	700	8,670.00	6,069,000
小松ウオール工業	100	1,740.00	174,000
ヤマハ	3,300	4,710.00	15,543,000
河合楽器	100	2,600.00	260,000
クリナップ	600	545.00	327,000
ピジョン	3,400	4,395.00	14,943,000
天馬	300	1,581.00	474,300
オリバー	100	2,348.00	234,800
キングジム	400	800.00	320,000
象印マホービン	1,700	1,310.00	2,227,000
リンテック	1,300	2,534.00	3,294,200
信越ポリマー	1,000	865.00	865,000
東リ	1,500	242.00	363,000
イトーキ	1,100	316.00	347,600
任天堂	3,400	48,680.00	165,512,000
三菱鉛筆	900	1,212.00	1,090,800
松風	200	1,386.00	277,200
タカラスタンダード	1,100	1,492.00	1,641,200
コクヨ	2,700	1,200.00	3,240,000
ナカバヤシ	600	550.00	330,000
ニフコ	2,000	2,200.00	4,400,000
立川ブラインド	200	1,146.00	229,200
グローブライド	200	1,987.00	397,400
オカムラ	1,900	719.00	1,366,100
バルカー	400	1,813.00	725,200
MUTOHホールディングス	100	1,500.00	150,000
伊藤忠	38,300	2,296.00	87,936,800
丸紅	56,600	469.30	26,562,380
スクロール	800	427.00	341,600
高島	100	1,771.00	177,100
ヨンドシーホールディングス	600	1,900.00	1,140,000
三陽商会	200	577.00	115,400
長瀬産業	3,000	1,260.00	3,780,000
ナイガイ	200	349.00	69,800
蝶理	300	1,655.00	496,500
豊田通商	6,100	2,663.00	16,244,300
オンワードホールディングス	3,300	284.00	937,200
三共生興	800	414.00	331,200
兼松	2,000	1,224.00	2,448,000
美津濃	600	1,932.00	1,159,200

ツカモトコーポレーション	100	1,125.00	112,500	
ファミリーマート	4,400	2,306.00	10,146,400	
ルックホールディングス	200	685.00	137,000	
三井物産	47,400	1,560.00	73,944,000	
日本紙パルプ	300	3,655.00	1,096,500	
東京エレクトロン	3,500	29,610.00	103,635,000	
カメイ	700	952.00	666,400	
東都水産	100	3,275.00	327,500	
OUGホールディングス	100	2,571.00	257,100	
スターゼン	200	3,990.00	798,000	
セイコーHD	800	1,571.00	1,256,800	
山 善	2,100	900.00	1,890,000	
椿本興業	100	3,210.00	321,000	
住友商事	34,300	1,205.00	41,331,500	
日本ユニシス	1,700	3,255.00	5,533,500	
内田洋行	200	6,200.00	1,240,000	
三菱商事	35,900	2,241.50	80,469,850	
第一実業	200	3,650.00	730,000	
キヤノンマーケティングJPN	1,600	2,123.00	3,396,800	
西華産業	300	1,148.00	344,400	
佐藤商事	400	840.00	336,000	
菱洋エレクトロ	600	3,175.00	1,905,000	
東京産業	600	495.00	297,000	
ユアサ商事	600	2,892.00	1,735,200	
神鋼商事	100	1,805.00	180,500	
トルク	300	266.00	79,800	
阪和興業	1,000	1,895.00	1,895,000	
正栄食品	300	3,815.00	1,144,500	
カナデン	400	1,223.00	489,200	
菱電商事	300	1,379.00	413,700	
ニプロ	3,800	1,131.00	4,297,800	
フルサト工業	300	1,302.00	390,600	
岩谷産業	1,200	3,710.00	4,452,000	
ナイス	200	828.00	165,600	
昭光通商	100	578.00	57,800	
ニチモウ	100	1,791.00	179,100	
極東貿易	100	1,256.00	125,600	
イワキ	800	512.00	409,600	
兼松エレクトロニクス	300	3,975.00	1,192,500	
三愛石油	1,400	858.00	1,201,200	

稲畑産業	1,200	1,238.00	1,485,600	
G S I クレオス	100	1,160.00	116,000	
明和産業	600	432.00	259,200	
クワザワ	200	519.00	103,800	
キムラタン	2,800	26.00	72,800	
ヤマエ久野	400	1,224.00	489,600	
ゴ - ルドウイン	1,000	6,500.00	6,500,000	
ユニ・チャ - ム	10,700	4,873.00	52,141,100	
デサント	1,000	1,538.00	1,538,000	
キ ン グ	200	463.00	92,600	
ワ キ タ	1,100	901.00	991,100	
ヤマトインタ - ナショナル	300	360.00	108,000	
東邦ホールディングス	1,800	1,867.00	3,360,600	
サンゲツ	1,600	1,434.00	2,294,400	
ミツウロコグループ	800	1,114.00	891,200	
シナネンホールディングス	200	2,686.00	537,200	
伊藤忠エネクス	1,200	841.00	1,009,200	
サンリオ	1,600	1,562.00	2,499,200	
サンワ テクノス	300	829.00	248,700	
リョーサン	700	2,107.00	1,474,900	
新光商事	900	814.00	732,600	
トーホー	200	1,807.00	361,400	
三信電気	300	1,636.00	490,800	
東陽テクニカ	700	931.00	651,700	
モスフード サービス	800	2,680.00	2,144,000	
加賀電子	600	1,933.00	1,159,800	
三益半導体	400	2,367.00	946,800	
ソーダニツカ	600	500.00	300,000	
立花エレテック	400	1,662.00	664,800	
木曽路	800	2,266.00	1,812,800	
S R S ホールディングス	700	819.00	573,300	
千 趣 会	1,000	335.00	335,000	
タカキユー	400	125.00	50,000	
リテールパートナーズ	700	1,856.00	1,299,200	
ケーヨー	1,100	753.00	828,300	
上新電機	700	1,995.00	1,396,500	
日本瓦斯	900	4,750.00	4,275,000	
ロイヤルホールディングス	900	1,636.00	1,472,400	
いなげや	700	1,723.00	1,206,100	
島 忠	1,000	2,969.00	2,969,000	

チヨダ	600	1,085.00	651,000
ライフコーポレーション	400	3,755.00	1,502,000
リンガーハット	700	2,176.00	1,523,200
MrMaxHD	800	615.00	492,000
テンアライド	600	360.00	216,000
AOKIホールディングス	1,100	567.00	623,700
オークワ	900	1,501.00	1,350,900
コメリ	900	2,740.00	2,466,000
青山商事	1,100	608.00	668,800
しまむら	700	7,230.00	5,061,000
はせがわ	300	300.00	90,000
高島屋	3,900	801.00	3,123,900
松屋	1,100	625.00	687,500
エイチ・ツー・オーリテイリング	2,600	661.00	1,718,600
近鉄百貨店	200	2,801.00	560,200
丸井グループ	5,100	1,693.00	8,634,300
アクシアルリテイリング	400	4,425.00	1,770,000
井筒屋	300	176.00	52,800
イオン	21,100	2,386.50	50,355,150
イズミ	1,100	3,205.00	3,525,500
フオーバル	200	994.00	198,800
平和堂	1,100	1,885.00	2,073,500
フジ	700	1,771.00	1,239,700
ヤオコー	700	7,930.00	5,551,000
ゼビオホールディングス	700	774.00	541,800
ケーズホールディングス	5,300	1,351.00	7,160,300
PALTAC	900	4,910.00	4,419,000
三谷産業	800	332.00	265,600
OLYMPICグループ	200	878.00	175,600
日産東京販売HD	800	241.00	192,800
アドバンテッジリスクマネ	200	795.00	159,000
三井不動産	27,000	1,710.00	46,170,000
三菱地所	38,400	1,503.50	57,734,400
平和不動産	1,000	2,885.00	2,885,000
東京建物	5,800	1,132.00	6,565,600
ダイビル	1,500	1,013.00	1,519,500
京阪神ビルディング	900	1,310.00	1,179,000
住友不動産	12,300	2,580.50	31,740,150
太平洋興発	200	595.00	119,000
テーオーシー	1,000	636.00	636,000

東京楽天地	100	3,900.00	390,000
レオパレス21	7,100	172.00	1,221,200
スターツコーポレーション	800	2,071.00	1,656,800
フジ住宅	700	507.00	354,900
空港施設	600	403.00	241,800
明和地所	300	381.00	114,300
ゴールドクレスト	400	1,366.00	546,400
リログループ	2,800	1,979.00	5,541,200
エスリード	200	1,301.00	260,200
日神グループHLDGS	800	346.00	276,800
日本エスコ	1,000	763.00	763,000
タカラレーベン	2,500	339.00	847,500
AVANTIA	300	860.00	258,000
イオンモール	2,700	1,238.00	3,342,600
毎日コムネット	100	765.00	76,500
ファースト住建	200	889.00	177,800
ランド	29,600	10.00	296,000
カチタス	1,400	2,522.00	3,530,800
東祥	300	1,194.00	358,200
トーセイ	800	891.00	712,800
穴吹興産	100	1,418.00	141,800
サンフロンティア不動産	800	806.00	644,800
エフ・ジェー・ネクスト	400	831.00	332,400
インテリックス	100	449.00	44,900
ランドビジネス	200	326.00	65,200
サンネクスタグループ	100	981.00	98,100
グランディハウス	400	361.00	144,400
東武鉄道	5,800	3,380.00	19,604,000
相鉄ホールディングス	1,800	2,721.00	4,897,800
東急	13,900	1,382.00	19,209,800
京浜急行	7,100	1,550.00	11,005,000
小田急電鉄	8,200	2,570.00	21,074,000
京王電鉄	2,900	5,830.00	16,907,000
京成電鉄	3,800	3,115.00	11,837,000
富士急行	800	3,190.00	2,552,000
新京成電鉄	100	2,130.00	213,000
東日本旅客鉄道	9,800	7,116.00	69,736,800
西日本旅客鉄道	5,000	5,389.00	26,945,000
東海旅客鉄道	4,600	15,055.00	69,253,000
西武ホールディングス	7,400	1,135.00	8,399,000

鴻池運輸	900	1,043.00	938,700
西日本鉄道	1,600	2,829.00	4,526,400
ハマキョウレックス	400	3,100.00	1,240,000
サカイ引越センター	300	5,010.00	1,503,000
近鉄グループHLDGS	5,300	4,555.00	24,141,500
阪急阪神HLDGS	7,000	3,415.00	23,905,000
南海電鉄	2,500	2,351.00	5,877,500
京阪ホールディングス	2,400	4,585.00	11,004,000
神戸電鉄	100	3,510.00	351,000
名古屋鉄道	4,300	2,924.00	12,573,200
山陽電鉄	300	2,130.00	639,000
トランコム	100	6,950.00	695,000
日本通運	1,800	5,600.00	10,080,000
ヤマトホールディングス	9,100	2,679.00	24,378,900
山 九	1,500	3,890.00	5,835,000
日 新	400	1,415.00	566,000
丸 運	300	215.00	64,500
丸全昭和運輸	400	2,953.00	1,181,200
センコーグループHLDGS	2,800	801.00	2,242,800
トナミホールディングス	100	5,400.00	540,000
ニッコンホールディングス	1,900	2,023.00	3,843,700
福山通運	700	3,645.00	2,551,500
セイノーホールディングス	3,900	1,374.00	5,358,600
エスライン	100	901.00	90,100
神奈川中央交通	100	3,930.00	393,000
日立物流	900	2,847.00	2,562,300
丸和運輸機関	600	3,300.00	1,980,000
C & F ロジホールディングス	600	1,476.00	885,600
日本郵船	4,400	1,466.00	6,450,400
商船三井	3,400	1,911.00	6,497,400
川崎汽船	1,600	1,030.00	1,648,000
NSユナイテッド海運	300	1,403.00	420,900
明治海運	600	311.00	186,600
飯野海運	2,500	331.00	827,500
共栄タンカー	100	765.00	76,500
九州旅客鉄道	4,600	2,525.00	11,615,000
SGホールディングス	5,500	3,705.00	20,377,500
日本航空	9,300	1,907.00	17,735,100
ANAホールディングス	9,600	2,347.50	22,536,000
パスコ	100	1,403.00	140,300

西本WISMETTAC HD	100	2,100.00	210,000
GENKY DRUGSTORES	200	3,520.00	704,000
国際紙パルプ商事	1,200	266.00	319,200
ナルミヤ・インターナショナル	100	565.00	56,500
ブックオフGHD	300	759.00	227,700
三菱倉庫	1,700	2,694.00	4,579,800
三井倉庫HOLD	700	1,479.00	1,035,300
住友倉庫	1,900	1,221.00	2,319,900
渋沢倉庫	300	1,915.00	574,500
ヤマタネ	200	1,153.00	230,600
東陽倉庫	900	300.00	270,000
乾汽船	300	821.00	246,300
日本トランスシティ	1,100	439.00	482,900
ケイヒン	100	1,217.00	121,700
中央倉庫	300	945.00	283,500
川西倉庫	100	977.00	97,700
安田倉庫	400	847.00	338,800
ファイズホールディングス	100	1,035.00	103,500
東洋埠頭	100	1,363.00	136,300
宇徳	400	450.00	180,000
上組	2,900	2,016.00	5,846,400
サンリツ	100	575.00	57,500
キムラユニティー	100	990.00	99,000
キューソー流通システム	100	1,430.00	143,000
近鉄エクスプレス	1,100	1,874.00	2,061,400
東海運	300	265.00	79,500
エーアイティー	300	721.00	216,300
内外トランスライン	200	975.00	195,000
ショーエイコーポ	100	867.00	86,700
日本コンセプト	100	1,203.00	120,300
東京放送HD	3,400	1,613.00	5,484,200
日本テレビHLD S	4,500	1,143.00	5,143,500
朝日放送グループHD	600	720.00	432,000
テレビ朝日HD	1,600	1,482.00	2,371,200
スカパーJ S A T H D	3,600	416.00	1,497,600
テレビ東京HD	400	2,290.00	916,000
日本BS放送	200	1,077.00	215,400
ビジョン	600	620.00	372,000
スマートバリュー	100	1,135.00	113,500
USEN-NEXT HLDGS	200	1,362.00	272,400

ワイヤレスゲート	200	717.00	143,400
コネクシオ	300	1,351.00	405,300
日本通信	4,300	210.00	903,000
クロップス	100	710.00	71,000
日本電信電話	72,800	2,515.00	183,092,000
KDDI	39,700	3,265.00	129,620,500
ソフトバンク	49,500	1,393.50	68,978,250
光通信	600	22,560.00	13,536,000
NTTドコモ	39,000	2,935.50	114,484,500
エムティーアイ	600	811.00	486,600
GMOインターネット	2,100	2,992.00	6,283,200
ファイバーゲート	100	1,447.00	144,700
アイドママーケティングコミュ	100	438.00	43,800
KADOKAWA	1,500	2,371.00	3,556,500
学研ホールディングス	700	1,396.00	977,200
ゼンリン	1,100	1,121.00	1,233,100
昭文社ホールディングス	200	427.00	85,400
インプレスホールディングス	400	144.00	57,600
東京電力HD	44,100	305.00	13,450,500
中部電力	16,900	1,334.50	22,553,050
関西電力	20,900	1,060.00	22,154,000
中国電力	7,900	1,400.00	11,060,000
北陸電力	5,100	655.00	3,340,500
東北電力	13,800	1,009.00	13,924,200
四国電力	5,100	775.00	3,952,500
九州電力	11,400	893.00	10,180,200
北海道電力	5,200	398.00	2,069,600
沖縄電力	1,000	1,745.00	1,745,000
電源開発	4,400	1,759.00	7,739,600
エフオン	300	587.00	176,100
イーレックス	800	1,401.00	1,120,800
レノバ	900	1,020.00	918,000
東京瓦斯	10,600	2,568.50	27,226,100
大阪瓦斯	10,700	2,112.00	22,598,400
東邦瓦斯	2,700	5,360.00	14,472,000
北海道瓦斯	300	1,552.00	465,600
広島ガス	1,100	351.00	386,100
西部瓦斯	700	2,492.00	1,744,400
静岡ガス	1,600	876.00	1,401,600
メタウォーター	200	4,690.00	938,000

アイネット	200	1,486.00	297,200
松 竹	400	14,290.00	5,716,000
東 宝	3,300	3,540.00	11,682,000
エイチ・アイ・エス	800	1,592.00	1,273,600
東 映	200	14,150.00	2,830,000
ラックランド	100	2,047.00	204,700
N T Tデータ	14,400	1,191.00	17,150,400
共立メンテナンス	900	3,605.00	3,244,500
イチネンホールディングス	700	1,103.00	772,100
建設技術研究所	300	1,680.00	504,000
スペース	300	894.00	268,200
長 大	200	1,027.00	205,400
アインホールディングス	700	6,810.00	4,767,000
燦ホールディングス	200	1,126.00	225,200
ピー・シー・エー	100	4,070.00	407,000
東京テアトル	200	1,160.00	232,000
タナベ経営	100	1,277.00	127,700
ビジネスB太田昭和	200	1,142.00	228,400
ナ ガ ワ	100	7,200.00	720,000
よみうりランド	100	3,425.00	342,500
東京都競馬	300	3,955.00	1,186,500
常磐興産	200	1,324.00	264,800
カナモト	900	2,243.00	2,018,700
東京ドーム	2,100	705.00	1,480,500
D T S	1,200	2,181.00	2,617,200
スクウェア・エニックス・HD	2,400	5,520.00	13,248,000
シーイーシー	600	1,577.00	946,200
カプコン	2,600	4,125.00	10,725,000
西尾レントオール	600	2,120.00	1,272,000
アイ・エス・ピー	100	2,082.00	208,200
アゴーラ・ホスピタリティーG	3,400	33.00	112,200
日本空港ビルデング	1,700	4,375.00	7,437,500
トランス・コスモス	600	2,513.00	1,507,800
乃村工藝社	2,400	777.00	1,864,800
ジャステック	300	1,223.00	366,900
S C S K	1,200	5,140.00	6,168,000
藤田観光	200	1,507.00	301,400
K N T - C Tホールディングス	300	1,007.00	302,100
日本管財	600	1,841.00	1,104,600
トーカイ	600	2,240.00	1,344,000

セコム	5,600	9,242.00	51,755,200
日本システムウエア	200	1,892.00	378,400
セントラル警備保障	200	3,845.00	769,000
アイネス	600	1,349.00	809,400
丹青社	1,000	675.00	675,000
メイテック	700	5,010.00	3,507,000
T K C	400	5,840.00	2,336,000
富士ソフト	700	4,425.00	3,097,500
応用地質	600	1,430.00	858,000
船井総研ホールディング	1,100	2,246.00	2,470,600
N S D	1,700	1,882.00	3,199,400
進学会ホールディングス	200	446.00	89,200
オ オ バ	300	661.00	198,300
コナミホールディングス	1,900	3,270.00	6,213,000
いであ	100	1,836.00	183,600
学 究 社	100	1,058.00	105,800
ベネッセホールディングス	1,800	2,766.00	4,978,800
イオンディライト	700	2,945.00	2,061,500
ナック	300	851.00	255,300
福井コンピュータH L D S	200	2,568.00	513,600
ニチイ学館	800	1,585.00	1,268,000
ダイセキ	900	2,415.00	2,173,500
ステップ	200	1,507.00	301,400
日鉄物産	300	3,290.00	987,000
泉州電業	100	2,554.00	255,400
元気寿司	100	2,163.00	216,300
トラスコ中山	1,100	2,650.00	2,915,000
ヤマダ電機	16,600	492.00	8,167,200
オートバックスセブン	2,000	1,345.00	2,690,000
モリト	300	639.00	191,700
アークランドサカモト	900	1,841.00	1,656,900
ニトリホールディングス	2,400	21,920.00	52,608,000
グルメ杵屋	300	910.00	273,000
愛 眼	400	217.00	86,800
ケーユーホールディングス	200	818.00	163,600
吉野家ホールディングス	1,800	2,003.00	3,605,400
加藤産業	900	3,285.00	2,956,500
北恵	100	911.00	91,100
イノテック	300	951.00	285,300
イエローハット	1,000	1,446.00	1,446,000

松屋フーズHLDGS	200	3,460.00	692,000	
JBCCHホールディングス	300	1,434.00	430,200	
JKホールディングス	600	749.00	449,400	
サガミホールディングス	800	1,129.00	903,200	
日伝	500	2,054.00	1,027,000	
関西スーパーマーケット	400	1,066.00	426,400	
ミロク情報サービス	600	2,160.00	1,296,000	
北沢産業	400	278.00	111,200	
杉本商事	300	1,723.00	516,900	
因幡電機産業	1,600	2,431.00	3,889,600	
王将フードサービス	300	5,620.00	1,686,000	
プレナス	700	1,731.00	1,211,700	
ミニストップ	400	1,492.00	596,800	
アークス	1,100	2,476.00	2,723,600	
バローホールディングス	1,200	2,153.00	2,583,600	
東テク	200	2,176.00	435,200	
ミスミグループ本社	6,900	2,642.00	18,229,800	
アルテック	400	235.00	94,000	
ベルク	200	7,610.00	1,522,000	
大庄	300	1,147.00	344,100	
タキヒヨー	100	1,750.00	175,000	
ファーストリテイリング	700	60,280.00	42,196,000	
ソフトバンクグループ	43,200	6,267.00	270,734,400	
蔵王産業	100	1,400.00	140,000	
スズケン	2,400	3,810.00	9,144,000	
サンドラッグ	2,000	3,465.00	6,930,000	
サックスパーホールディング	600	534.00	320,400	
ジェコス	300	864.00	259,200	
ヤマザワ	100	1,658.00	165,800	
やまや	100	2,100.00	210,000	
グローセル	600	413.00	247,800	
ベルーナ	1,100	635.00	698,500	
合計			10,846,064,770	

(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7月31日

資産総額	10,720,663,996円
負債総額	124,811,208円
純資産総額(-)	10,595,852,788円
発行済数量	8,969,805口
1単位当たり純資産額(/)	1,181.28円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 名義登録と収益分配金の支払い

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

(3) 受益者に対する特典

ありません。

(4) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(5) 受益証券の再発行

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

(6) 受益権の譲渡

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

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

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

(7) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(8) 受益権の再分割

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、交換請求の受付け、交換株式の交付等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第二部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2020年7月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．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7月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	52	90,060
追加型株式投資信託	705	16,230,396
株式投資信託 合計	757	16,320,457
単位型公社債投資信託	29	99,164
追加型公社債投資信託	14	1,449,037
公社債投資信託 合計	43	1,548,201
総合計	800	17,868,658

3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,489	2,741
有価証券	554	22,167
前払費用	214	205
未収委託者報酬	11,468	10,847
未収収益	98	63
その他	56	62
流動資産計	40,882	36,088
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	10	7
器具備品	195	209
無形固定資産	2,821	2,362
ソフトウェア	2,804	2,028
ソフトウェア仮勘定	17	333
投資その他の資産	12,799	15,844
投資有価証券	8,493	9,153
関係会社株式	1,836	3,972
出資金	183	183
長期差入保証金	1,070	1,069
繰延税金資産	1,183	1,431
その他	31	33
固定資産計	15,827	18,424

資産合計

56,709

54,512

(単位:百万円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	75	69
未払金	8,548	7,573
未払収益分配金	15	14
未払償還金	40	39
未払手数料	4,610	3,988
その他未払金	2	2
未払費用	3,735	3,830
未払法人税等	726	656
未払消費税等	255	590
賞与引当金	725	688
その他	2	5
流動負債計	14,070	13,414
固定負債		
退職給付引当金	2,389	2,574
役員退職慰労引当金	103	88
その他	2	5
固定負債計	2,496	2,667
負債合計	16,567	16,082
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	13,052	11,749
利益剰余金合計	13,426	12,123
株主資本合計	40,096	38,793

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	46	363
評価・換算差額等合計	46	363
純資産合計	40,142	38,430
負債・純資産合計	56,709	54,512

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	76,052	69,550
その他営業収益	673	583
営業収益計	76,725	70,134
営業費用		
支払手数料	35,789	31,120
広告宣伝費	694	745
調査費	9,066	8,858
調査費	1,057	1,188
委託調査費	8,009	7,670
委託計算費	1,351	1,410
営業雑経費	1,557	1,770
通信費	228	240
印刷費	513	524
協会費	55	56
諸会費	13	13
その他営業雑経費	746	936
営業費用計	48,459	43,906
一般管理費		
給料	5,755	5,793
役員報酬	373	374
給料・手当	4,145	4,335
賞与	510	395
賞与引当金繰入額	725	688
福利厚生費	796	838
交際費	64	62
旅費交通費	178	154
租税公課	472	451
不動産賃借料	1,291	1,299

退職給付費用	374	368
役員退職慰労引当金繰入額	34	37
固定資産減価償却費	907	925
諸経費	1,819	1,770
一般管理費計	11,693	11,702
営業利益	16,572	14,525

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31 日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	38	912
投資有価証券売却益	215	214
有価証券償還益	133	24
その他	134	78
営業外収益計	521	1,230
営業外費用		
有価証券償還損	32	71
投資有価証券売却損	40	1
その他	60	54
営業外費用計	132	127
経常利益	16,961	15,629
特別損失		
システム刷新関連費用	-	537
投資有価証券評価損	-	48
関係会社整理損失	29	-
特別損失計	29	585
税引前当期純利益	16,931	15,043
法人税、住民税及び事業税	5,076	4,555
法人税等調整額	15	78
法人税等合計	5,060	4,477
当期純利益	11,870	10,566

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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
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
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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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	13,052	13,426	40,096
当期変動額						

剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,302	1,302	1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	410	410	410
当期変動額合計	410	410	410
当期末残高	363	363	38,430

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

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 8～18年

器具備品

4～17年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

6. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018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 2018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

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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。

2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）

(1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（以下「時価算定会計基準等」という。）が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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)

(損益計算書)

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた172百万円は、「受取配当金」38百万円、「その他」134百万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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	31百万円	34百万円
器具備品	264百万円	276百万円

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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
未払金	3,788百万円	3,397百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(2020年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万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 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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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
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

(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

2020年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	10,564百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,050円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月24日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、

株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

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(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。

当事業年度(2020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		2,741	2,741	-
(2) 未収委託者報酬		10,847	10,847	-
(3) 有価証券及び投資有価証券				
有価証券		21,900	21,900	-
其他有価証券		8,754	8,754	-
資産計		44,243	44,243	-
(1) 未払手数料		(3,988)	(3,988)	-
(2) その他未払金		(3,530)	(3,530)	-
(3) 未払費用(*2)		(2,889)	(2,889)	-
負債計		(10,408)	(10,408)	-

(*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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	666	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	1,836	3,972
(3) 長期差入保証金	1,070	1,069

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(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

当事業年度(2020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	2,741	-	-	-
未収委託者報酬	10,847	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
有価証券	21,900	-	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの	267	3,463	1,184	-
合計	35,756	3,463	1,184	-

(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(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、記載していません。

当事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,944百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がなく、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、記載していません。

2. その他有価証券

前事業年度(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	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	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。

当事業年度(2020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	60	55	5
(2) その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	764
小計	27,589	28,354	764
合計	30,654	31,181	526

(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 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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

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、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,350百万円	2,389百万円
勤務費用	158	159
退職給付の支払額	171	183
その他	52	207
退職給付債務の期末残高	2,389	2,574

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,389百万円	2,574百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574
退職給付引当金	2,389	2,574
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	158百万円	159百万円
その他	41	27
確定給付制度に係る退職給付費用	199	187

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174百万円、当事業年度181百万円であります。

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		788
	731	
システム関連費用	170	198
賞与引当金	182	177
未払事業税	141	129
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	32	47
その他	240	399
繰延税金資産小計	1,592	1,835
評価性引当額	164	173
繰延税金資産合計	1,428	1,661
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	85	71
繰延税金負債合計	244	230
繰延税金資産の純額	1,183	1,431

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(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。

当事業年度（2020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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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 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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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)	1,603	-	-

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。

(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 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。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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)	16,953	未払手数料	2,984
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)	1,031	未払費用	224
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)	1,061	長期差入保証金	1,054

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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,389.06円	1株当たり純資産額	14,732.52円
1株当たり当期純利益	4,550.81円	1株当たり当期純利益	4,050.66円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,870	10,566
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2020年2月17日付で、Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.への出資を行い、当該会社を子会社といたしました。

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（2020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 (2020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	5,505	
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	
野村証券株式会社	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：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2020年7月27日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

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

第3 【参考情報】

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

(提出年月日)	(書類名)
2020年4月3日	有価証券届出書、有価証券報告書

独立監査人の監査報告書

2020年5月22日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員業 務執行社員	公認会計士	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
--------------------	-------	-------	---

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年8月7日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 宮田 世紀 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financialsの2020年1月11日から2020年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financialsの2020年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記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。