

【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】	2021年4月2日提出
【計算期間】	第15計算期間 (自 2020年7月11日 至 2021年1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			
中小型株	年2回	北米	
債券		欧州	TOPIX
一般	年4回	アジア	
公債		オセアニア	
社債	年6回 (隔月)	中南米	
その他債券		アフリカ	その他 (TOPIX Ex-Financials)
クレジット属性 ()		中近東 (中東)	
不動産投信	年12回 (毎月)	エマージング	
その他資産 ()	日々		
資産複合 ()	その他 ()		
資産配分固定型			
資産配分変更型			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託の限度 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、2兆円に相当する株券および金銭を限度として追加信託することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、上記の限度を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1 信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「TOPIX Ex-Financials」(以下「対象株価指数」という場合があります。)の変動率に一致させることを目的として、対象株価指数に採用されている銘柄(採用予定を含みます。)の株式に投資します。

- 対象株価指数を構成する銘柄のうち、時価総額構成比率95%以上を占める各銘柄の株式を組入れることを原則とします。
- 上記に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行なうこと(株価指数先物取引等を利用することを含みます。)があります。
- 市況動向、資産規模等によっては、上記の運用が行なえないことがあります。

「TOPIX Ex-Financials」について

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

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

(注2) 基準時の時価総額の修正方法：

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

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

2 当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

●受益権は、東京証券取引所に上場され、株式と同様に売買することができます。

- 売買単位は、10口単位です。
- 取引方法は、原則として株式と同様です。

●追加設定は、株式により行ないます。

- 追加設定にかかる受益権の取得申込者は、取得時のバスケット（「TOPIX Ex-Financials」を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。
- 原則として、所定の方法に定められる金銭の支払い以外に、金銭によって受益権の取得申込を行なうことはできません。

●受益権を株式と交換することができます。

- 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、当該受益権と当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換を申込みことができます。
- 解約申込により受益権を換金することはできません。

●収益分配金は、名義登録受益者に対して支払われます。

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

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「TOPIX Ex-Financials」の変動率に一致させることを目的として運用を行いません。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（2021年1月末日現在） >

- ・ 資本金の額 151億7,427万2,500円
- ・ 沿革

1959年12月12日 大和証券投資信託委託株式会社として設立

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

・大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株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。

- 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

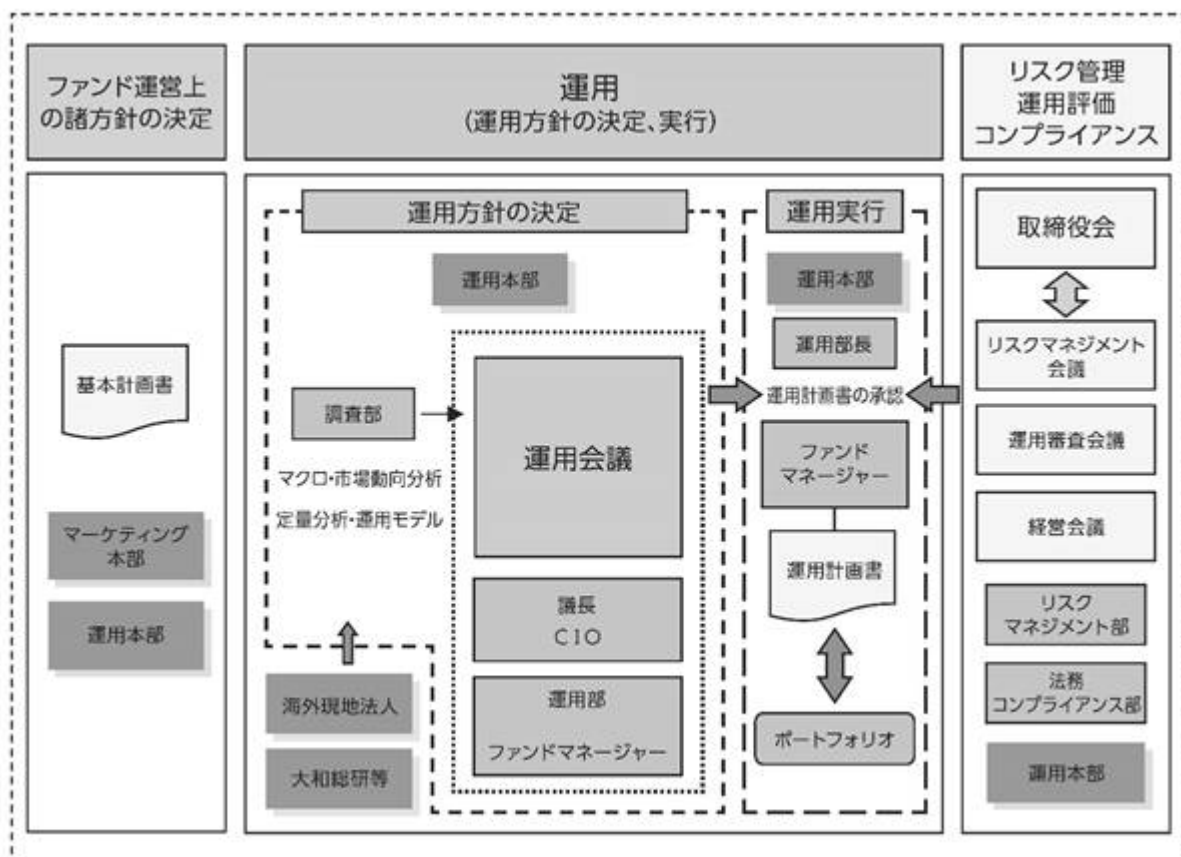
4．手形割引市場において売買される手形

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）（3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経営会議

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．経営会議

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2021年1月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

(5) 【投資制限】

株式(信託約款)

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資する株式の範囲(信託約款)

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

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

先物取引等(信託約款)

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

デリバティブ取引等(信託約款)

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

株式の貸付け(信託約款)

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

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

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

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

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への投資は、行ないません。

信用リスク集中回避(信託約款)

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

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

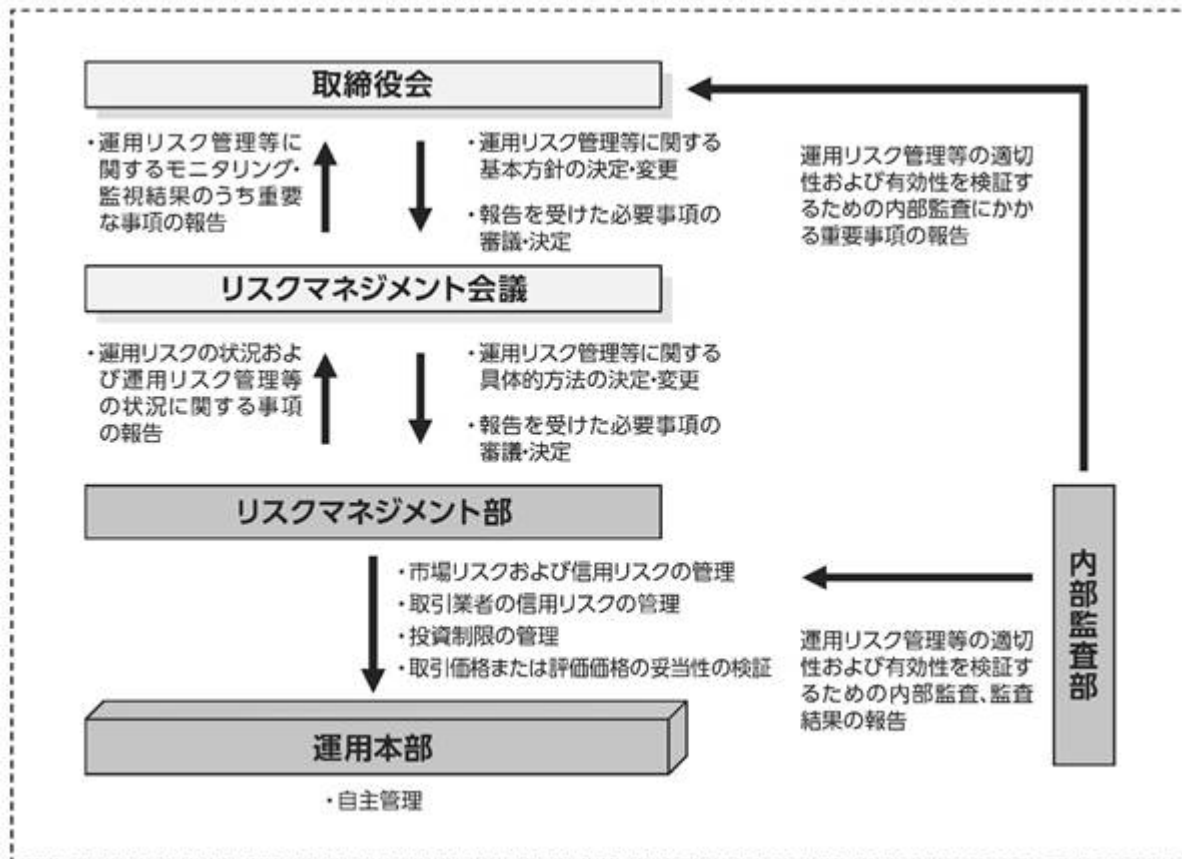
(2) その他の留意点

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

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

(3) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

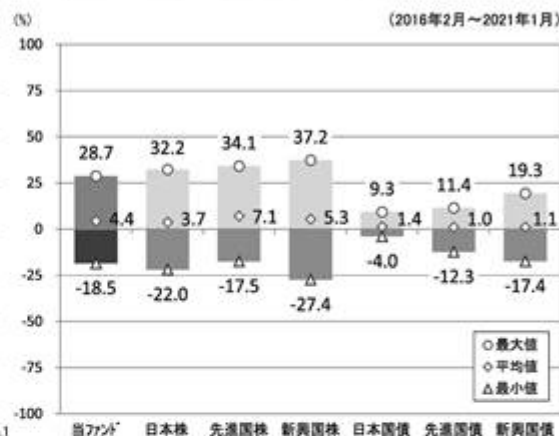
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

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

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

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

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

販売会社については、前(1)をご参照下さい。

信託財産留保額

ありません。

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

(3) 【信託報酬等】

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

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

委託会社 年率0.13%(税抜)以内

受託会社 年率0.05%(税抜)以内

* 上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

イ. 年率0.198%(税抜0.18%)

ロ．55%（税抜50%）

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

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

イ．前 イ.の報酬

委託会社 年率0.13%（税抜）

受託会社 年率0.05%（税抜）

*上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

ロ．前 ロ.の報酬

委託会社 報酬の50%

受託会社 報酬の50%

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、受益権の上場にかかる費用および対象指数の商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（以下「商標使用料」といいます。）ならびにこれらにかかる消費税等に相当する金額を、受益者の負担として信託財産中から支弁することができます。

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

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

信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は特定株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

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

ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

受益権を譲渡して生じた損失金額は上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益・償還差益および申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得・利子所得と通算できます。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。売却時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

ロ．収益分配金の受取時

収益分配金は、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。

ただし、2037年12月31日まで、収益分配金の受取時に、収益分配金に対する所得税の源泉徴収額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

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

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

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

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

法人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

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

ロ．収益分配金の受取時

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

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

- () 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- () 上記は、2021年1月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（2021年1月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	5,835,930,850	99.81
内 日本	5,835,930,850	99.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,130,842	0.19
純資産総額	5,847,061,692	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】（2021年1月29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	26,100	7,939.00 207,207,900	7,300.00 190,530,000	3.26
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	20,100	7,992.47 160,648,800	8,108.00 162,970,800	2.79
3	ソニー	日本	株式	電気機 器	16,100	10,702.40 172,308,700	10,050.00 161,805,000	2.77
4	キーエンス	日本	株式	電気機 器	2,500	58,607.42 146,518,567	56,140.00 140,350,000	2.40
5	任天堂	日本	株式	その他 製品	1,500	65,370.00 98,055,000	60,580.00 90,870,000	1.55
6	日本電産	日本	株式	電気機 器	6,200	14,031.37 86,994,500	13,850.00 85,870,000	1.47
7	信越化学	日本	株式	化学	4,700	19,004.48 89,321,100	18,175.00 85,422,500	1.46
8	リクルートホールディングス	日本	株式	サービ ス業	17,600	4,440.59 78,154,400	4,542.00 79,939,200	1.37
9	武田薬品	日本	株式	医薬品	21,400	3,695.46 79,083,000	3,698.00 79,137,200	1.35

10	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	29,600	2,816.50 83,368,400	2,618.00 77,492,800	1.33
11	村田製作所	日本	株式	電気機 器	7,600	10,078.65 76,597,800	10,055.00 76,418,000	1.31
12	第一三共	日本	株式	医薬品	22,100	3,642.58 80,501,100	3,365.00 74,366,500	1.27
13	ダイキン工業	日本	株式	機械	3,300	23,397.66 77,212,300	22,105.00 72,946,500	1.25
14	HOYA	日本	株式	精密機 器	5,100	14,075.00 71,782,500	13,395.00 68,314,500	1.17
15	ファナック	日本	株式	電気機 器	2,300	27,155.00 62,456,500	27,365.00 62,939,500	1.08
16	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	20,300	3,204.11 65,043,500	3,079.00 62,503,700	1.07
17	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	1,500	40,680.00 61,020,000	39,810.00 59,715,000	1.02
18	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	20,300	2,930.75 59,494,250	2,764.50 56,119,350	0.96
19	日立	日本	株式	電気機 器	12,400	4,322.83 53,603,200	4,306.00 53,394,400	0.91
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	17,800	3,090.66 55,013,800	2,997.50 53,355,500	0.91
21	SMC	日本	株式	機械	800	68,200.00 54,560,000	63,360.00 50,688,000	0.87
22	花王	日本	株式	化学	6,200	7,839.12 48,602,600	7,597.00 47,101,400	0.81
23	中外製薬	日本	株式	医薬品	8,100	5,535.54 44,837,900	5,472.00 44,323,200	0.76
24	オリエンタルランド	日本	株式	サービ ス業	2,600	16,120.00 41,912,000	16,350.00 42,510,000	0.73
25	三菱電機	日本	株式	電気機 器	25,800	1,638.59 42,275,700	1,594.50 41,138,100	0.70
26	三菱商事	日本	株式	卸売業	15,500	2,628.00 40,734,000	2,647.50 41,036,250	0.70
27	三井物産	日本	株式	卸売業	20,600	1,983.50 40,860,100	1,936.50 39,891,900	0.68
28	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	9,900	3,993.71 39,537,800	3,961.00 39,213,900	0.67
29	エムスリー	日本	株式	サービ ス業	4,300	10,545.00 45,343,500	8,811.00 37,887,300	0.65

30	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	22,300	1,625.95 36,258,700	1,692.50 37,742,750	0.65
----	---------	----	----	-----	--------	------------------------	------------------------	------

(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	99.81%
合計	99.81%

(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	0.17%
建設業	2.50%
食料品	3.88%
繊維製品	0.54%
パルプ・紙	0.28%
化学	8.39%
医薬品	6.56%
石油・石炭製品	0.45%
ゴム製品	0.62%
ガラス・土石製品	0.86%
鉄鋼	0.65%
非鉄金属	0.81%
金属製品	0.65%
機械	6.33%
電気機器	19.71%
輸送用機器	7.41%
精密機器	2.92%
その他製品	2.75%
電気・ガス業	1.48%
陸運業	3.74%
海運業	0.19%
空運業	0.44%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	10.12%
卸売業	4.97%
小売業	5.17%

不動産業	2.06%
サービス業	5.87%
合計	99.81%

(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	-
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
8月末日	8,926,597,846	-	1,272.80	-	1,266
9月末日	9,074,943,552	-	1,293.95	-	1,300
10月末日	8,811,376,337	-	1,256.37	-	1,255
11月末日	7,079,609,135	-	1,398.55	-	1,396
12月末日	8,702,660,306	-	1,441.51	-	-
第15計算期間末 (2021年1月10日)	8,840,790,593	8,909,614,251	1,464.39	1,475.79	1,453
2021年1月末日	5,847,061,692	-	1,431.74	-	-

(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

第15計算期間	11.40
---------	-------

【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
第15計算期間	21.9

(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
第15計算期間	1,950,560	4,883,202

(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

2021年1月29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	143,174円
純資産総額	58億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.1%
3カ月間	14.8%
6カ月間	22.1%
1年間	11.5%
3年間	8.5%
5年間	45.4%
設定来	86.9%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(100口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 2,270円 設定来分配金合計額: 31,950円

決算期	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	第15期
	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	21年1月
分配金	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	1,140円

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

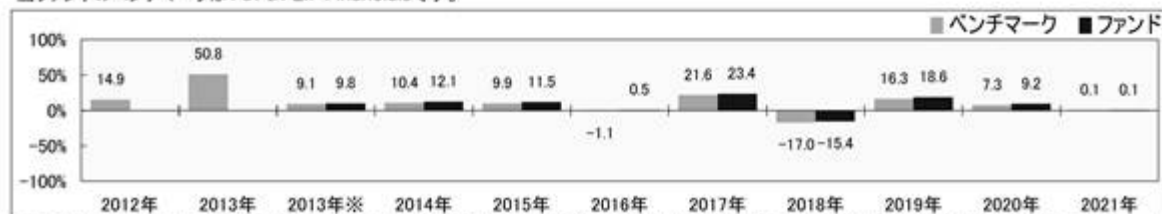
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,896	99.8%	電気機器	19.7%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.3%
国内株式先物	-	-	情報・通信業	10.1%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.8%
不動産投資信託等	-	-	化学	8.4%	ソニー	電気機器	2.8%
コール・ローン、その他	-	0.2%	輸送用機器	7.4%	キーエンス	電気機器	2.4%
合計	1,896	100.0%	医薬品	6.6%	任天堂	その他製品	1.6%
株式市場・上場別構成			機械	6.3%	日本電産	電気機器	1.5%
一部(東証・名証)		99.8%	サービス業	5.9%	信越化学	化学	1.5%
二部(東証・名証)		-	小売業	5.2%	リクルートホールディングス	サービス業	1.4%
新興市場他		-	卸売業	5.0%	武田薬品	医薬品	1.4%
その他		-	その他	25.3%	日本電信電話	情報・通信業	1.3%
合計		99.8%	合計	99.8%	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、2021年は1月29日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

受益権の取得申込者は、対象株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの（以下「取得時のバスケット」といいます。）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。また、当該取得時のバスケットの評価額（法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た額をいいます。以下同じ。）をもって、それに相当するものとして委託会社が定める一定口数の受益権を単位として取得するものとします。受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額とします。

受益権の取得申込者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後2時）までに取得申込みをした場合には、当日を取得申込受付日として委託会社は当該取得申込みを受付けます。

取得申込受付日に対応する取得時のバスケットを構成する各株式の銘柄名とその数量は、委託会社が取得申込受付日以前の別に定める期日に別に定める方法により提示するものとします。

前 の規定にかかわらず、受益権の取得申込者は、取得時のバスケットの評価額が取得する一定口数の受益権の評価額に満たない場合には、その差額に相当する部分を金銭をもって支払うものとします。

前 の規定にかかわらず、取得時のバスケットに受益権の取得申込者が発行した株式またはその親会社（会社法第2条第1項第4号に規定する親会社をいいます。以下同じ。）が発行した株式（以下本 において「自社株式等」といいます。）が含まれる場合には、当該取得申込者は当該自社株式等に代えて当該自社株式等に相当する金額（評価額により算出したものに限ります。）に、当該自社株式等を信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該金額に別に定める率を乗じて得た額を加算して得た金額の金銭をもって取得することができるものとします。

前 に該当する場合には、受益権の取得申込者は、販売会社を通じてその旨を委託会社に通知するものとします。この通知が取得申込みの際に行なわれなかった場合において、そのことによって当該取得申込者または信託財産その他に損害が生じた場合には、当該取得申込者がすべての責を負うものとします。

前 の規定にかかわらず、取得時のバスケットに、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは当該権利を取得することができる者が確定する日またはその前営業日に取得の申込みに応じて受益権の受渡しが行なわれることとなる株式（以下本 において「配当落ち株式等」といいます。）が含まれる場合には、当該取得申込者は当該配当落ち株式等に代えて当該配当落ち株式等に相当する金額（評価額により算出したものに限ります。）に、当該配当落ち株式等を信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該金額に別に定める率を乗じて得た額を加算して得た金額の金銭をもって取得することができるものとします。

販売会社は、取得申込みにかかる取得時のバスケットの各銘柄の株式を、取得申込みにかかる信託が設定される日までに、別に定める契約に基づき委託会社に代わって受託会社に引渡すものとします。

販売会社は、受益権の取得申込者が引渡すべき取得時のバスケットの各銘柄の一部の引渡日を別に定める方法に基づいて指定する場合には、担保金を差入れるものとします。なお、担保金に付利は行なわ

ないものとし、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。また、別に定める金融商品取引清算機関（金融商品取引法第2条第29項に規定する金融商品取引清算機関とし、以下「清算機関」といいます。）の業務方法書（以下「業務方法書」といいます。）に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受け付けによって生じる株式および金銭の委託会社への受渡または支払いの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、振替機関等における当該清算機関の名義の口座に口数の増加の記載または記録が行なわれ、取得申込者が自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座における口数の増加の記載または記録は、当該清算機関と販売会社（販売会社による清算機関への債務の負担の申込みにおいて、当該販売会社の委託を受けて金融商品取引法第2条第27項に定める有価証券等清算取次ぎが行なわれる場合には、当該有価証券等清算取次ぎを行なう金融商品取引業者または登録金融機関を含みます。）との間で振替機関等を介して行なわれます。別に定める金融商品取引清算機関は、株式会社日本証券クリアリング機構とします。

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
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4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）
4. 前1.から前3.までのほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

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す。

受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、前 に定める株式（前 、前 および前 に該当する場合の金銭を含みます。）または前 に定める担保金について、受入れまたは振替済みの通知を受けた場合、振替機関に対し当該受益権にかかる信託が行なわれた旨を通知するものとします。ただし、業務方法書に定めるところにより、当該株式および金銭の委託会社への受渡または

は支払いの債務を清算機関が負担する場合には、受託会社は、委託会社の指図に基づき、当該株式および金銭についての受入れまたは振替済みの通知にかかわらず、振替機関に対し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2時)までに交換請求をした場合には、当日を交換請求受付日として委託会社は当該交換請求を受付けます。

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3.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2.までに該当する場合であっても、委託会社の判断により、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変更および増減資等に伴う株数の変更日の2営業日前から起算して6営業日以内
2. 計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内(ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内)
3. 前1.から前2.までのほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めたとき

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。なお、業務方法書に定めるところにより、当該販売会社が、振替受益権の委託会社への受渡しの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、当該清算機関が振替受益権の抹消にかかる手続きを行ないません。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收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、交換請求の受付けの中止、交換請求の受付けの取消しまたはその両方を行なうことができます。

前 の規定により交換請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の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。ただし、業務方法書の定めるところにより、前 に掲げる交換の請求を受付けた販売会社が、振替受益権の委託会社への受渡しの債務の負担を当該清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、受託会社は、前 に掲げる手続きにかかわらず、委託会社の指図にしたがい、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式にかかる振替請求および金銭の交付を行なうものとします。別に定める期日から、受益者への交換株式の交付に際しては振替機関等の口座に前 の交換の請求を行なった受益者にかかる株数の増加の記載または記録が行なわれ、受益者への金銭の交付については販売会社において行なわれます。

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

< 買取り >

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

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

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注）主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

(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発します。
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します。
2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあっては、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

本の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本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、本の3.または本の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。ただし、業務方法書に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受け付けによって生じる株式および金銭の委託会社への受渡または支払いの債務の負担を当該清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合の信託契約締結当初または追加信託当初の受益者は当該清算機関とします。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

<支払方法>

1. 受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）を持分に応じて請求する権利を有します。
2. 受託会社は、計算期間終了日現在において、氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、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。

- 八．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15期計算期間(2020年7月11日から2021年1月10日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 2020年7月10日現在	第15期 2021年1月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	118,082,371	83,035,611
株式	10,846,064,770	8,824,607,430
未収配当金	16,779,656	12,340,097
流動資産合計	10,980,926,797	8,919,983,138
資産合計	10,980,926,797	8,919,983,138
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	101,358,796	68,823,658
未払受託者報酬	3,973,770	2,566,804
未払委託者報酬	10,331,882	6,673,733
未払利息	-	82
その他未払費用	5,764,589	1,128,268
流動負債合計	121,429,037	79,192,545
負債合計	121,429,037	79,192,545
純資産の部		
元本等		
元本	1 8,871,137,145	1 5,970,754,207
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,988,360,615	2,870,036,386
（分配準備積立金）	152,338	538,847
元本等合計	10,859,497,760	8,840,790,593
純資産合計	10,859,497,760	8,840,790,593
負債純資産合計	10,980,926,797	8,919,983,138

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期		第15期	
	自	2020年1月11日 至 2020年7月10日	自	2020年7月11日 至 2021年1月10日
営業収益				
受取配当金		117,944,733		80,179,955
受取利息		159		19
有価証券売買等損益		2,455,891,197		1,803,340,855
その他収益		42,527		18,435
営業収益合計		2,337,903,778		1,883,539,264
営業費用				
支払利息		12,486		6,513
受託者報酬		3,973,770		2,566,804
委託者報酬		10,331,882		6,673,733
その他費用		2,781,651		1,741,192
営業費用合計		17,099,789		10,988,242
営業利益又は営業損失()		2,355,003,567		1,872,551,022
経常利益又は経常損失()		2,355,003,567		1,872,551,022
当期純利益又は当期純損失()		2,355,003,567		1,872,551,022
期首剰余金又は期首欠損金()		7,822,101,696		1,988,360,615
剰余金増加額又は欠損金減少額		433,710,462		760,930,649
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		433,710,462		760,930,649
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,811,089,180		1,682,982,242
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,811,089,180		1,682,982,242
分配金		1 101,358,796		1 68,823,658
期末剰余金又は期末欠損金()		1,988,360,615		2,870,036,386

(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15期	
	自 2020年7月11日	至 2021年1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14期	第15期
	2020年7月10日現在	2021年1月10日現在
1. 1 期首元本額	21,701,918,755円	8,871,137,145円
期中追加設定元本額	1,927,699,460円	1,929,103,840円
期中一部交換元本額	14,758,481,070円	4,829,486,778円
2. 計算期間末日における受益権の総数	8,969,805口	6,037,163口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	自 2020年1月11日 至 2020年7月10日	自 2020年7月11日 至 2021年1月10日

1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(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。	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(80,191,896円)及び分配準備積立金(152,338円)の合計額から、経費(10,981,729円)を控除して計算される分配対象額は69,362,505円(100口当たり1,148円)であり、うち68,823,658円(100口当たり1,140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15期 自 2020年7月11日 至 2021年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 2021年1月10日現在
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額
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14期 2020年7月10日現在	第15期 2021年1月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	939,954,525	1,251,421,090
合計	939,954,525	1,251,421,090

(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14期 2020年7月10日現在	第15期 2021年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第15期 自 2020年7月11日 至 2021年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第14期 2020年7月10日現在	第15期 2021年1月10日現在
1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,210.67円 (121,067円)	1,464.39円 (146,439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	2,999.00	599,800	
日本水産	5,100	436.00	2,223,600	
マルハニチロ	800	2,234.00	1,787,200	
雪国まいたけ	400	1,777.00	710,800	
カネコ種苗	200	1,598.00	319,600	
サカタのタネ	600	3,655.00	2,193,000	
ホクト	300	2,126.00	637,800	
ホクリヨウ	100	698.00	69,800	
ヒノキヤグループ	200	2,082.00	416,400	
ショーボンドHD	800	5,040.00	4,032,000	
ミライト・ホールディングス	1,600	1,758.00	2,812,800	
タマホーム	400	1,477.00	590,800	
サンヨーホームズ	100	749.00	74,900	
日本アクア	300	656.00	196,800	
ファーストコーポレーション	200	712.00	142,400	
ベステラ	100	1,811.00	181,100	
TATERU	1,000	178.00	178,000	
キャンディル	100	530.00	53,000	
スペースバリューHD	600	707.00	424,200	
住石ホールディングス	1,000	120.00	120,000	
日鉄鉱業	100	6,310.00	631,000	
三井松島HLDGS	300	754.00	226,200	
国際石油開発帝石	20,700	609.00	12,606,300	
石油資源開発	700	2,029.00	1,420,300	
K&Oエナジーグループ	300	1,445.00	433,500	
ダイセキ環境ソリューション	100	811.00	81,100	
第一カッター興業	200	1,417.00	283,400	
明豊ファシリティワークス	200	664.00	132,800	
安藤・間	3,000	741.00	2,223,000	
東急建設	1,500	514.00	771,000	
コムシスホールディングス	1,800	3,250.00	5,850,000	
ビーアールホールディングス	500	639.00	319,500	
高松コンストラクションGP	400	2,082.00	832,800	
東建コーポレーション	200	8,260.00	1,652,000	
ソネック	100	874.00	87,400	

ヤマウラ	300	930.00	279,000	
大成建設	3,900	3,555.00	13,864,500	
大林組	11,500	924.00	10,626,000	
清水建設	11,600	768.00	8,908,800	
飛鳥建設	300	1,080.00	324,000	
長谷工コーポレーション	4,500	1,213.00	5,458,500	
松井建設	400	720.00	288,000	
銭高組	100	4,135.00	413,500	
鹿島建設	9,000	1,413.00	12,717,000	
不動テトラ	400	1,751.00	700,400	
大末建設	200	849.00	169,800	
鉄建建設	300	1,863.00	558,900	
西松建設	1,000	2,343.00	2,343,000	
三井住友建設	2,700	442.00	1,193,400	
大豊建設	300	3,750.00	1,125,000	
前田建設	2,900	907.00	2,630,300	
佐田建設	300	450.00	135,000	
ナカノフドー建設	300	423.00	126,900	
奥村組	600	2,591.00	1,554,600	
東鉄工業	500	2,717.00	1,358,500	
イチケン	100	1,808.00	180,800	
富士ピー・エス	200	605.00	121,000	
浅沼組	200	4,115.00	823,000	
戸田建設	4,800	733.00	3,518,400	
熊谷組	500	2,742.00	1,371,000	
北野建設	100	2,465.00	246,500	
植木組	100	2,815.00	281,500	
矢作建設	500	890.00	445,000	
ピーエス三菱	300	615.00	184,500	
日本ハウスHLDGS	800	331.00	264,800	
大東建託	1,300	9,740.00	12,662,000	
新日本建設	500	847.00	423,500	
NIPPO	900	2,750.00	2,475,000	
東亜道路	100	3,830.00	383,000	
前田道路	1,200	1,725.00	2,070,000	
日本道路	100	7,750.00	775,000	
東亜建設	300	2,063.00	618,900	
日本国土開発	700	584.00	408,800	
若築建設	300	1,244.00	373,200	
東洋建設	1,300	463.00	601,900	

五洋建設	4,500	931.00	4,189,500
世紀東急	500	840.00	420,000
福 田 組	200	5,400.00	1,080,000
日本ドライケミカル	100	1,585.00	158,500
住友林業	2,900	2,126.00	6,165,400
日本基礎技術	400	493.00	197,200
巴コーポレーション	500	411.00	205,500
大和ハウス	11,400	3,095.00	35,283,000
ライト工業	700	1,764.00	1,234,800
積水ハウス	12,600	2,105.50	26,529,300
日特建設	400	795.00	318,000
北陸電気工事	300	1,252.00	375,600
ユアテック	700	816.00	571,200
日本リーテック	300	2,529.00	758,700
四電工	100	2,836.00	283,600
中電工	400	2,241.00	896,400
関 電 工	1,600	901.00	1,441,600
きんでん	2,700	1,703.00	4,598,100
東京エネシス	300	956.00	286,800
トーエネック	200	4,195.00	839,000
住友電設	400	2,636.00	1,054,400
日本電設工業	600	2,051.00	1,230,600
協和エクシオ	1,700	2,900.00	4,930,000
新日本空調	300	2,285.00	685,500
日本工営	300	2,820.00	846,000
九電工	900	3,340.00	3,006,000
三機工業	900	1,239.00	1,115,100
日揮ホールディングス	3,500	1,100.00	3,850,000
中外炉工業	200	1,714.00	342,800
ヤマト	300	732.00	219,600
太平電業	400	2,537.00	1,014,800
高砂熱学	1,100	1,570.00	1,727,000
三晃金属	100	2,887.00	288,700
NEC ネットズエスアイ	1,100	1,850.00	2,035,000
朝日工業社	100	2,999.00	299,900
明星工業	800	811.00	648,800
大 気 社	600	2,790.00	1,674,000
ダイダン	400	2,952.00	1,180,800
日比谷総合設備	300	1,900.00	570,000
ニッポン	1,100	1,665.00	1,831,500

日清製粉G本社	4,200	1,673.00	7,026,600
昭和産業	300	3,115.00	934,500
鳥越製粉	300	923.00	276,900
中部飼料	400	1,476.00	590,400
フィード・ワン	400	894.00	357,600
東洋精糖	100	1,227.00	122,700
日本甜菜糖	300	1,646.00	493,800
三井製糖	400	1,839.00	735,600
塩水港精糖	400	224.00	89,600
日新製糖	200	1,860.00	372,000
L I F U L L	1,200	372.00	446,400
ミクシィ	700	2,593.00	1,815,100
ジェイエシーリクルートメント	300	1,801.00	540,300
日本M&Aセンター	2,700	6,510.00	17,577,000
メンバーズ	100	2,663.00	266,300
UTグループ	400	3,125.00	1,250,000
アイティメディア	100	2,227.00	222,700
タケエイ	300	1,359.00	407,700
E・Jホールディングス	200	1,042.00	208,400
ビーネックスグループ	400	1,211.00	484,400
コシダカホールディングス	900	440.00	396,000
アルトナー	100	904.00	90,400
パソナグループ	300	2,232.00	669,600
C D S	100	1,374.00	137,400
リンクアンドモチベーション	800	531.00	424,800
G C A	400	731.00	292,400
エス・エム・エス	1,100	4,220.00	4,642,000
サニーサイドアップG	100	632.00	63,200
パーソルホールディングス	3,500	1,921.00	6,723,500
リニカル	200	786.00	157,200
クックパッド	1,200	312.00	374,400
エスクリ	100	314.00	31,400
アイ・ケイ・ケイ	200	623.00	124,600
森永製菓	900	3,865.00	3,478,500
中村屋	100	3,945.00	394,500
江崎グリコ	1,100	4,570.00	5,027,000
名糖産業	200	1,457.00	291,400
井村屋グループ	200	2,594.00	518,800
不二家	300	2,337.00	701,100
山崎製パン	2,700	1,726.00	4,660,200

第一屋製パン	100	982.00	98,200
モロゾフ	100	5,750.00	575,000
亀田製菓	300	4,900.00	1,470,000
寿スピリッツ	300	5,110.00	1,533,000
カルビー	1,700	3,120.00	5,304,000
森永乳業	700	5,080.00	3,556,000
六甲バター	300	1,846.00	553,800
ヤクルト	2,600	5,260.00	13,676,000
明治ホールディングス	2,500	7,320.00	18,300,000
雪印メグミルク	1,000	2,226.00	2,226,000
プリマハム	600	3,345.00	2,007,000
日本ハム	1,500	4,625.00	6,937,500
林兼産業	200	590.00	118,000
丸大食品	400	1,710.00	684,000
S Foods	400	3,475.00	1,390,000
柿安本店	200	2,697.00	539,400
伊藤ハム米久HLDGS	2,400	679.00	1,629,600
学情	200	1,356.00	271,200
スタジオアリス	200	1,974.00	394,800
クロスキャット	100	1,233.00	123,300
シミックホールディングス	300	1,428.00	428,400
エプコ	100	986.00	98,600
システナ	1,300	2,244.00	2,917,200
NJS	100	2,055.00	205,500
デジタルアーツ	200	9,710.00	1,942,000
日鉄ソリューションズ	500	3,325.00	1,662,500
総合警備保障	1,500	5,430.00	8,145,000
キューブシステム	300	1,259.00	377,700
いちご	4,600	310.00	1,426,000
エイジア	100	1,886.00	188,600
日本駐車場開発	4,100	147.00	602,700
コア	200	1,486.00	297,200
カカクコム	2,700	2,812.00	7,592,400
アイロムグループ	200	1,740.00	348,000
セントケア・ホールディング	300	881.00	264,300
サイネックス	100	666.00	66,600
ルネサンス	300	887.00	266,100
ディップ	500	2,676.00	1,338,000
SBSホールディングス	600	2,514.00	1,508,400
デジタルホールディングス	200	1,895.00	379,000

新日本科学	300	707.00	212,100
ツクイホールディングス	900	540.00	486,000
キャリアデザインセンター	100	977.00	97,700
ベネフィット・ワン	1,300	3,175.00	4,127,500
エムスリー	7,900	10,545.00	83,305,500
ツカダ・グローバルHOLD	300	250.00	75,000
アウトソーシング	2,100	1,358.00	2,851,800
ウェルネット	300	445.00	133,500
ワールドホールディングス	200	1,907.00	381,400
ディー・エヌ・エー	1,600	1,841.00	2,945,600
博報堂DYHLDGS	4,900	1,419.00	6,953,100
ぐるなび	600	492.00	295,200
タカミヤ	300	547.00	164,100
ジャパンベストレスキューS	300	881.00	264,300
ファンコミュニケーションズ	900	408.00	367,200
ライク	200	2,074.00	414,800
ビジネス・ブレークスルー	200	472.00	94,400
エスプール	500	782.00	391,000
WDBホールディングス	200	2,707.00	541,400
ティア	300	411.00	123,300
バリューコマース	300	3,400.00	1,020,000
インフォマート	3,900	918.00	3,580,200
サッポロホールディングス	1,300	1,973.00	2,564,900
アサヒグループホールディン	8,100	4,227.00	34,238,700
麒麟HD	15,800	2,292.50	36,221,500
宝ホールディングス	2,700	1,232.00	3,326,400
オエノンホールディングス	900	407.00	366,300
養命酒	100	1,873.00	187,300
コカ・コーラボトラーズJHD	2,900	1,544.00	4,477,600
サントリー食品インター	2,500	3,630.00	9,075,000
ダイドーグループHD	200	5,110.00	1,022,000
伊藤園	1,100	6,610.00	7,271,000
キーコーヒー	300	2,146.00	643,800
ユニカフェ	100	1,013.00	101,300
ジャパンフーズ	100	1,211.00	121,100
日清オイリオグループ	500	3,080.00	1,540,000
不二製油グループ	800	3,020.00	2,416,000
J-オイルミルズ	300	3,610.00	1,083,000
ローソン	900	4,920.00	4,428,000
サンエー	400	4,330.00	1,732,000

カワチ薬品	400	3,150.00	1,260,000
エービーシー・マート	600	5,690.00	3,414,000
ハードオフコーポレーション	200	764.00	152,800
高千穂交易	200	1,222.00	244,400
アスクル	300	3,905.00	1,171,500
ゲオホールディングス	700	1,228.00	859,600
アダストリア	500	1,949.00	974,500
ジーフット	300	429.00	128,700
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	402.00	40,200
オルバヘルスケアHLDGS	100	1,435.00	143,500
伊藤忠食品	100	5,480.00	548,000
くら寿司	200	5,830.00	1,166,000
キャンドゥ	200	1,918.00	383,600
エレマテック	300	1,075.00	322,500
バルグループHLDGS	300	1,196.00	358,800
JALUX	100	1,353.00	135,300
エディオン	1,600	1,029.00	1,646,400
あらた	400	4,910.00	1,964,000
サーラコーポレーション	800	591.00	472,800
ワッツ	200	839.00	167,800
トーマンデバイス	100	3,465.00	346,500
ハローズ	200	3,665.00	733,000
J Pホールディングス	1,100	284.00	312,400
フジオフードG本社	400	1,209.00	483,600
あみやき亭	100	2,920.00	292,000
東京エレクトロデバイス	200	3,300.00	660,000
ひらまつ	700	145.00	101,500
フィールズ	400	469.00	187,600
双日	20,000	243.00	4,860,000
アルフレッサホールディングス	4,000	1,952.00	7,808,000
大黒天物産	100	6,410.00	641,000
ハニーズホールディングス	300	1,011.00	303,300
ファーマライズHD	100	784.00	78,400
キッコーマン	2,800	7,260.00	20,328,000
味の素	8,100	2,400.00	19,440,000
キューピー	2,100	2,422.00	5,086,200
ハウス食品G本社	1,400	3,830.00	5,362,000
カゴメ	1,600	3,525.00	5,640,000
焼津水産化工	200	1,021.00	204,200
アリアケジャパン	300	7,160.00	2,148,000

ピエトロ	100	1,706.00	170,600
エバラ食品工業	100	2,443.00	244,300
ニチレイ	1,700	2,945.00	5,006,500
横浜冷凍	1,000	876.00	876,000
東洋水産	1,900	5,350.00	10,165,000
イトアンドHLDGS	200	1,791.00	358,200
大冷	100	1,940.00	194,000
ヨシムラ・フード・HLDGS	300	783.00	234,900
日清食品HD	1,600	9,110.00	14,576,000
永谷園ホールディングス	200	2,311.00	462,200
一正蒲鉾	200	1,159.00	231,800
フジッコ	400	2,011.00	804,400
ロックフィールド	400	1,531.00	612,400
日本たばこ産業	20,400	2,046.00	41,738,400
ケンコーマヨネーズ	300	1,810.00	543,000
わらべや日洋HD	300	1,642.00	492,600
なとり	300	1,886.00	565,800
イフジ産業	100	858.00	85,800
ピクルスコーポレーション	100	3,270.00	327,000
北の達人コーポ	1,300	470.00	611,000
ユーグレナ	1,500	807.00	1,210,500
スター・マイカ・HLDGS	200	1,372.00	274,400
ADワークスグループ	600	155.00	93,000
片倉工業	500	1,339.00	669,500
グンゼ	300	3,370.00	1,011,000
ヒューリック	7,700	1,115.00	8,585,500
神栄	100	1,912.00	191,200
ラサ商事	300	910.00	273,000
アルペン	400	2,324.00	929,600
ハブ	100	564.00	56,400
ラクーンホールディングス	200	1,712.00	342,400
クオールホールディングス	500	1,154.00	577,000
アルコニックス	300	1,460.00	438,000
神戸物産	2,600	3,065.00	7,969,000
ソリトンシステムズ	200	1,834.00	366,800
ジンスホールディングス	300	6,730.00	2,019,000
ビックカメラ	2,100	1,181.00	2,480,100
DCMホールディングス	2,000	1,129.00	2,258,000
ペッパーフードサービス	300	246.00	73,800
ハイパー	100	545.00	54,500

MonotaRO	2,600	5,250.00	13,650,000	
東京一番フーズ	100	581.00	58,100	
DDホールディングス	200	525.00	105,000	
あいホールディングス	500	2,005.00	1,002,500	
ディービーエックス	200	1,035.00	207,000	
きちりホールディングス	100	579.00	57,900	
アークランドサービスHD	300	2,092.00	627,600	
J. フロントリテイリング	4,300	822.00	3,534,600	
ドトール・日レスHD	600	1,463.00	877,800	
マツモトキヨシHLDGS	1,400	4,425.00	6,195,000	
ブロンコビリー	200	2,214.00	442,800	
ZOZO	2,500	2,732.00	6,830,000	
トレジャー・ファクトリー	100	695.00	69,500	
物語コーポレーション	100	11,420.00	1,142,000	
ココカラファイン	300	7,720.00	2,316,000	
三越伊勢丹HD	6,300	601.00	3,786,300	
東洋紡	1,500	1,400.00	2,100,000	
ユニチカ	1,000	401.00	401,000	
富士紡ホールディングス	200	3,905.00	781,000	
日清紡ホールディングス	2,500	770.00	1,925,000	
倉敷紡績	300	1,872.00	561,600	
ダイワボウHD	300	9,540.00	2,862,000	
シキボウ	200	1,019.00	203,800	
日東紡績	500	4,620.00	2,310,000	
トヨタ紡織	1,000	1,700.00	1,700,000	
マクニカ・富士エレHLDGS	900	1,952.00	1,756,800	
Hamee	200	1,926.00	385,200	
ラクト・ジャパン	200	2,832.00	566,400	
ウエルシアHD	2,200	4,040.00	8,888,000	
クリエイトSDH	600	3,990.00	2,394,000	
グリムス	100	1,871.00	187,100	
バイタルKSKHD	700	816.00	571,200	
八洲電機	400	981.00	392,400	
メディアスホールディングス	300	810.00	243,000	
レスターホールディングス	300	2,282.00	684,600	
ジューテックHD	100	1,004.00	100,400	
丸善CHI HD	400	380.00	152,000	
大光	200	674.00	134,800	
OCHIホールディングス	100	1,303.00	130,300	
TOKAIホールディングス	1,900	1,022.00	1,941,800	

黒谷	100	829.00	82,900
ミサワ	100	681.00	68,100
ティーライフ	100	1,162.00	116,200
Cominix	100	758.00	75,800
エー・ピーホールディングス	100	392.00	39,200
三洋貿易	300	1,013.00	303,900
チムニー	100	1,138.00	113,800
シュッピン	300	927.00	278,100
ビューティガレージ	100	2,552.00	255,200
オイシックス・ラ・大地	300	3,275.00	982,500
ウイン・パートナーズ	300	1,193.00	357,900
ネクステージ	500	1,542.00	771,000
ジョイフル本田	1,000	1,466.00	1,466,000
鳥貴族	200	1,404.00	280,800
ホットランド	300	1,175.00	352,500
すかいらくHD	4,000	1,556.00	6,224,000
SFPホールディングス	200	1,251.00	250,200
綿半ホールディングス	400	1,398.00	559,200
日本毛織	1,200	1,001.00	1,201,200
ダイトウボウ	600	111.00	66,600
トーア紡コーポレーション	200	463.00	92,600
ダイドーリミテッド	500	183.00	91,500
ヨシックス	100	1,865.00	186,500
ユナイテッド・スーパーマーケ	1,000	1,192.00	1,192,000
三栄建築設計	200	1,773.00	354,600
野村不動産HLDGS	2,200	2,275.00	5,005,000
三重交通グループHD	800	511.00	408,800
サムティ	500	1,707.00	853,500
ディア・ライフ	400	414.00	165,600
コーセーアールイー	100	663.00	66,300
日本商業開発	300	1,665.00	499,500
プレサンスコーポレーション	600	1,771.00	1,062,600
フィル・カンパニー	100	2,003.00	200,300
THEグローバル社	200	252.00	50,400
ハウスコム	100	1,349.00	134,900
日本管理センター	300	1,186.00	355,800
サンセイランディック	100	740.00	74,000
エストラスト	100	735.00	73,500
フージャースHD	800	659.00	527,200
オープンハウス	1,000	3,930.00	3,930,000

東急不動産HD	9,900	554.00	5,484,600
飯田GH D	3,000	2,127.00	6,381,000
イーグランド	100	807.00	80,700
ムゲンエステート	300	458.00	137,400
帝国繊維	400	2,327.00	930,800
日本コークス工業	3,100	97.00	300,700
ゴルフダイジェスト・オン	200	885.00	177,000
ミタチ産業	100	592.00	59,200
B E E N O S	200	2,846.00	569,200
あさひ	400	1,666.00	666,400
日本調剤	300	1,495.00	448,500
コスモス薬品	300	17,240.00	5,172,000
シップヘルスケアHD	600	5,700.00	3,420,000
トーエル	200	811.00	162,200
ソフトクリエイトHD	200	2,831.00	566,200
オンリー	100	428.00	42,800
セブン&アイ・H L D G S	14,500	3,992.00	57,884,000
クリエイト・レストランツ・ホール	2,000	593.00	1,186,000
明治電機工業	100	1,468.00	146,800
ツルハホールディングス	800	14,980.00	11,984,000
デリカフーズH L D G S	200	662.00	132,400
スターティアホールディングス	100	950.00	95,000
サンマルクホールディングス	400	1,384.00	553,600
フェリシモ	100	1,506.00	150,600
トリドールホールディングス	1,000	1,337.00	1,337,000
帝 人	2,900	1,954.00	5,666,600
東 レ	25,800	649.70	16,762,260
ク ラ レ	5,700	1,080.00	6,156,000
旭 化 成	23,800	1,103.00	26,251,400
サカイオーベックス	100	2,168.00	216,800
T O K Y O B A S E	300	476.00	142,800
稲葉製作所	300	1,419.00	425,700
宮地エンジニアリングG	100	2,511.00	251,100
トーカロ	1,000	1,504.00	1,504,000
アルファCO	200	1,044.00	208,800
S U M C O	4,800	2,347.00	11,265,600
川田テクノロジーズ	100	4,325.00	432,500
R S T E C H N O L O G I E S	100	6,140.00	614,000
信和	200	702.00	140,400
ビーロット	200	641.00	128,200

ファーストブラザーズ	100	931.00	93,100
ハウスドゥ	200	1,211.00	242,200
シーアールイー	100	1,296.00	129,600
プロパティエージェント	100	1,448.00	144,800
ケイアイスター不動産	100	2,564.00	256,400
アグレ都市デザイン	100	675.00	67,500
グッドコムアセット	200	1,306.00	261,200
ジェイ・エス・ビー	100	3,400.00	340,000
テンポイノベーション	100	839.00	83,900
グローバルリンクマネジメント	100	738.00	73,800
住江織物	100	2,102.00	210,200
日本フェルト	300	423.00	126,900
イチカワ	100	1,273.00	127,300
エコナックホールディングス	600	91.00	54,600
日東製網	100	1,483.00	148,300
芦森工業	100	955.00	95,500
アツギ	400	501.00	200,400
ウイルプラスHLDGS	100	712.00	71,200
JMホールディングス	400	2,346.00	938,400
コメダホールディングス	800	1,852.00	1,481,600
サツドラホールディングス	100	2,040.00	204,000
アレンザホールディングス	200	1,265.00	253,000
串カツ田中HLDGS	100	1,449.00	144,900
パロックジャパン	300	697.00	209,100
クスリのアオキHLDGS	300	9,120.00	2,736,000
ダイニック	200	818.00	163,600
共和レザー	300	652.00	195,600
力の源HD	200	549.00	109,800
スシローグローバルHLDGS	2,100	3,560.00	7,476,000
セーレン	1,000	1,660.00	1,660,000
ソトー	200	821.00	164,200
東海染工	100	1,134.00	113,400
小松マテーレ	600	1,020.00	612,000
ワコールホールディングス	900	2,041.00	1,836,900
ホギメディカル	400	3,290.00	1,316,000
クラウドディアHLDGS	100	271.00	27,100
T S Iホールディングス	1,200	217.00	260,400
マツオカコーポレーション	100	2,043.00	204,300
ワールド	500	1,237.00	618,500
T I S	3,600	2,133.00	7,678,800

J N Sホールディングス	200	531.00	106,200
電算システム	200	3,280.00	656,000
グリー	2,200	603.00	1,326,600
コーエーテクモHD	800	6,210.00	4,968,000
三菱総合研究所	200	4,185.00	837,000
ボルテージ	100	504.00	50,400
A G S	300	900.00	270,000
ファインデックス	400	1,159.00	463,600
ブレインパッド	100	4,280.00	428,000
K L a b	700	911.00	637,700
ポルトゥウィン・ピットクル	400	1,173.00	469,200
イーブックイニシアティブ	100	2,700.00	270,000
ネクソン	9,200	3,260.00	29,992,000
アイスタイル	1,000	397.00	397,000
エムアップホールディングス	100	2,398.00	239,800
エイチーム	300	1,130.00	339,000
エニグモ	100	1,215.00	121,500
テクノスジャパン	400	686.00	274,400
e n i s h	200	452.00	90,400
コロプラ	1,200	961.00	1,153,200
オルトプラス	300	400.00	120,000
ブロードリーフ	1,800	670.00	1,206,000
クロス・マーケティングG	200	368.00	73,600
デジタルハーツHLDGS	200	1,241.00	248,200
システム情報	200	1,137.00	227,400
メディアドゥ	100	7,780.00	778,000
じげん	1,000	382.00	382,000
ブイキューブ	300	3,450.00	1,035,000
エンカレッジ・テクノロジー	100	746.00	74,600
サイバーリンクス	200	2,364.00	472,800
ディー・エル・イー	400	305.00	122,000
フィックスターズ	300	941.00	282,300
C A R T A H O L D I N G S	200	1,268.00	253,600
オブティム	200	2,831.00	566,200
セレス	200	2,609.00	521,800
S H I F T	200	12,400.00	2,480,000
特種東海製紙	300	5,040.00	1,512,000
ティーガイア	400	1,937.00	774,800
セック	100	2,792.00	279,200
日本アジアグループ	300	837.00	251,100

テクマトリックス	400	2,072.00	828,800
プロシップ	100	1,561.00	156,100
ガンホー・オンライン・エンター	1,000	2,413.00	2,413,000
GMOペイメントゲートウェイ	800	14,060.00	11,248,000
ザッパラス	200	537.00	107,400
システムリサーチ	100	1,776.00	177,600
インターネットイニシアティブ	1,000	2,109.00	2,109,000
さくらインターネット	300	700.00	210,000
ヴィンクス	100	1,128.00	112,800
GMOグローバルサインHD	100	9,450.00	945,000
SRAホールディングス	300	2,594.00	778,200
システムインテグレータ	100	625.00	62,500
朝日ネット	300	873.00	261,900
eBASE	400	1,037.00	414,800
アバント	100	1,148.00	114,800
アドソル日進	200	3,370.00	674,000
フリービット	200	910.00	182,000
コムチュア	400	3,015.00	1,206,000
サイバーコム	100	1,640.00	164,000
アステリア	300	1,023.00	306,900
アイル	200	1,491.00	298,200
王子ホールディングス	15,000	673.00	10,095,000
日本製紙	1,600	1,272.00	2,035,200
三菱製紙	400	321.00	128,400
北越コーポレーション	2,400	430.00	1,032,000
中越パルプ	200	1,255.00	251,000
巴川製紙	100	827.00	82,700
大王製紙	1,500	2,100.00	3,150,000
阿波製紙	100	476.00	47,600
マークライنز	200	2,545.00	509,000
メディカル・データ・ビジ	100	2,979.00	297,900
gumi	400	829.00	331,600
ショーケース	100	973.00	97,300
モバイルファクトリー	100	973.00	97,300
テラスカイ	200	4,300.00	860,000
デジタル・インフォメーション	200	1,519.00	303,800
PCIホールディングス	200	1,620.00	324,000
パイプドHD	100	1,665.00	166,500
アイピーシー	100	1,093.00	109,300
ネオジャパン	100	1,981.00	198,100

ランドコンピュータ	100	1,122.00	112,200
ダブルスタンダード	100	4,285.00	428,500
オープンドア	200	1,403.00	280,600
マイネット	200	926.00	185,200
アカツキ	200	4,050.00	810,000
UBICOMホールディングス	100	3,815.00	381,500
カナミックネットワーク	100	731.00	73,100
ノムラシステムコーポレーション	200	367.00	73,400
レンゴー	3,400	883.00	3,002,200
トーモク	300	1,800.00	540,000
ザ・パック	400	2,700.00	1,080,000
チェンジ	800	3,450.00	2,760,000
シンクロ・フード	200	322.00	64,400
オークネット	300	1,371.00	411,300
セグエグループ	100	1,400.00	140,000
エイトレッド	100	2,625.00	262,500
AOI TYO HOLDINGS	300	422.00	126,600
マクロミル	800	673.00	538,400
ビーグリー	100	1,870.00	187,000
オロ	100	4,685.00	468,500
テモナ	100	994.00	99,400
ニーズウェル	100	670.00	67,000
サインポスト	100	904.00	90,400
昭和電工	2,800	2,251.00	6,302,800
住友化学	26,400	425.00	11,220,000
住友精化	200	4,200.00	840,000
日産化学	2,100	6,300.00	13,230,000
ラサ工業	200	2,380.00	476,000
クレハ	300	7,160.00	2,148,000
多木化学	200	6,450.00	1,290,000
テイカ	300	1,475.00	442,500
石原産業	700	673.00	471,100
片倉コープアグリ	100	1,210.00	121,000
日本曹達	500	3,075.00	1,537,500
東ソー	5,500	1,660.00	9,130,000
トクヤマ	1,000	2,538.00	2,538,000
セントラル硝子	800	2,387.00	1,909,600
東亜合成	2,200	1,192.00	2,622,400
大阪ソーダ	300	2,751.00	825,300
関東電化	900	818.00	736,200

デンカ	1,300	4,200.00	5,460,000
イビデン	2,200	4,885.00	10,747,000
信越化学	6,400	19,020.00	121,728,000
日本カ - バイド	200	1,316.00	263,200
堺 化 学	300	2,026.00	607,800
第一稀元素化学工	400	952.00	380,800
エア・ウォーター	3,300	1,837.00	6,062,100
日本酸素HLDGS	3,400	2,090.00	7,106,000
日本化学工業	100	2,985.00	298,500
東邦アセチレン	100	1,573.00	157,300
日本パ - カライジング	1,800	1,102.00	1,983,600
高压ガス	600	839.00	503,400
チタン工業	100	1,962.00	196,200
四国化成	500	1,223.00	611,500
戸田工業	100	2,399.00	239,900
ステラ ケミファ	300	3,445.00	1,033,500
保土谷化学	200	5,360.00	1,072,000
日本触媒	600	6,000.00	3,600,000
大日精化	400	2,371.00	948,400
カネカ	900	3,595.00	3,235,500
協和キリン	3,700	2,835.00	10,489,500
三菱瓦斯化学	3,400	2,402.00	8,166,800
三井化学	3,200	3,010.00	9,632,000
J S R	3,300	3,130.00	10,329,000
東京応化工業	600	7,440.00	4,464,000
大阪有機化学	300	3,575.00	1,072,500
三菱ケミカルHLDGS	24,000	637.90	15,309,600
KHネオケム	600	2,656.00	1,593,600
ダイセル	4,900	760.00	3,724,000
住友ベ - クライト	600	3,890.00	2,334,000
積水化学	7,700	2,004.00	15,430,800
日本ゼオン	3,300	1,501.00	4,953,300
アイカ工業	1,100	3,585.00	3,943,500
宇部興産	1,800	1,918.00	3,452,400
積水樹脂	700	2,227.00	1,558,900
タキロンシーアイ	800	683.00	546,400
旭有機材	300	1,568.00	470,400
ニチバン	200	1,654.00	330,800
リケンテクノス	1,000	471.00	471,000
大倉工業	200	1,982.00	396,400

積水化成品	500	543.00	271,500
群栄化学	100	2,439.00	243,900
タイガース ポリマー	200	407.00	81,400
ミライアル	200	1,200.00	240,000
ダイキアクシス	200	1,171.00	234,200
ダイキョーニシカワ	800	858.00	686,400
竹本容器	200	927.00	185,400
森六ホールディングス	300	2,190.00	657,000
日本化薬	2,200	983.00	2,162,600
カーリットホールディングス	300	757.00	227,100
E P Sホールディングス	500	991.00	495,500
ソルクシーズ	200	991.00	198,200
レグス	100	1,641.00	164,100
プレステージ・インター	1,300	933.00	1,212,900
フェイス	200	840.00	168,000
プロトコーポレーション	400	1,051.00	420,400
ハイマックス	200	1,195.00	239,000
アミューズ	300	2,629.00	788,700
野村総合研究所	5,100	3,895.00	19,864,500
ドリームインキュベータ	100	1,407.00	140,700
サイバネットシステム	300	976.00	292,800
クイック	300	1,045.00	313,500
T A C	300	249.00	74,700
C Eホールディングス	300	581.00	174,300
ケネディクス	3,400	743.00	2,526,200
日本システム技術	100	1,490.00	149,000
電通グループ	4,000	3,050.00	12,200,000
インテージホールディングス	400	1,150.00	460,000
テイクアンドギヴニーズ	200	567.00	113,400
東邦システムサイエンス	100	936.00	93,600
ぴあ	100	2,684.00	268,400
イオンファンタジー	200	2,362.00	472,400
ソースネクスト	1,700	282.00	479,400
シーティーエス	400	940.00	376,000
ネクシーズグループ	200	872.00	174,400
インフォコム	400	3,340.00	1,336,000
メディカルシステムネットワーク	300	650.00	195,000
日本精化	400	1,455.00	582,000
扶桑化学工業	300	3,705.00	1,111,500
トリケミカル	100	17,460.00	1,746,000

ラクスル	300	4,510.00	1,353,000
F I G	400	268.00	107,200
A D E K A	1,600	1,783.00	2,852,800
日油	1,400	5,080.00	7,112,000
ミヨシ油脂	200	1,195.00	239,000
新日本理化	600	253.00	151,800
ハリマ化成グループ	400	1,066.00	426,400
イーソル	200	1,193.00	238,600
アルテリア・ネットワークス	400	1,569.00	627,600
ヒト・コミュニケーションズHD	100	1,393.00	139,300
トビラシステムズ	100	1,347.00	134,700
花 王	9,000	7,844.00	70,596,000
第一工業製薬	200	4,445.00	889,000
石原ケミカル	100	2,131.00	213,100
日華化学	200	939.00	187,800
ニイタカ	100	3,050.00	305,000
三洋化成	300	5,650.00	1,695,000
武田薬品	31,400	3,695.00	116,023,000
アステラス製薬	32,200	1,622.50	52,244,500
大日本住友製薬	2,700	1,577.00	4,257,900
塩野義製薬	4,800	5,841.00	28,036,800
わかもと製薬	400	244.00	97,600
あすか製薬	400	1,594.00	637,600
日本新薬	900	7,430.00	6,687,000
ビオフェルミン製薬	100	2,515.00	251,500
中外製薬	11,800	5,535.00	65,313,000
科研製薬	600	4,095.00	2,457,000
エーザイ	4,400	7,357.00	32,370,800
理研ビタミン	300	1,417.00	425,100
ロート製薬	1,900	3,040.00	5,776,000
小野薬品	8,500	3,127.00	26,579,500
久光製薬	900	6,370.00	5,733,000
有機合成薬品	400	312.00	124,800
持田製薬	500	3,945.00	1,972,500
参天製薬	6,900	1,686.00	11,633,400
扶桑薬品	200	2,766.00	553,200
日本ケミファ	100	2,234.00	223,400
ツムラ	1,100	3,300.00	3,630,000
日医工	1,000	1,009.00	1,009,000
テ ル モ	10,600	4,346.00	46,067,600

HUグループHD	900	2,866.00	2,579,400
キッセイ薬品工業	700	2,270.00	1,589,000
生化学工業	700	1,044.00	730,800
栄研化学	700	2,061.00	1,442,700
日水製薬	200	1,007.00	201,400
鳥居薬品	300	3,270.00	981,000
JCRファーマ	1,400	2,510.00	3,514,000
東和薬品	400	1,934.00	773,600
富士製薬工業	300	1,226.00	367,800
沢井製薬	800	4,780.00	3,824,000
ゼリア新薬工業	700	1,919.00	1,343,300
第一三共	32,400	3,645.00	118,098,000
キョーリン製薬HD	900	1,967.00	1,770,300
大幸薬品	400	1,663.00	665,200
ダイト	300	3,820.00	1,146,000
大塚ホールディングス	7,900	4,405.00	34,799,500
大正製薬HD	800	7,300.00	5,840,000
ペプチドリーム	1,900	5,840.00	11,096,000
大日本塗料	400	980.00	392,000
日本ペイントHOLD	3,000	10,580.00	31,740,000
関西ペイント	4,000	3,095.00	12,380,000
神東塗料	400	219.00	87,600
中国塗料	1,000	1,081.00	1,081,000
日本特殊塗料	400	1,273.00	509,200
藤倉化成	500	533.00	266,500
太陽ホールディングス	300	6,220.00	1,866,000
DIC	1,500	2,551.00	3,826,500
サカタインクス	800	1,158.00	926,400
東洋インキSCホールディング	800	1,917.00	1,533,600
T&K TOKA	400	864.00	345,600
アルプス技研	300	2,042.00	612,600
サニックス	600	299.00	179,400
ダイオーズ	100	950.00	95,000
日本空調サービス	300	772.00	231,600
オリエンタルランド	3,800	16,120.00	61,256,000
フォーカスシステムズ	300	937.00	281,100
ダスキン	1,000	2,814.00	2,814,000
パーク24	2,000	1,788.00	3,576,000
明光ネットワークジャパン	400	536.00	214,400
ファルコホールディングス	300	1,666.00	499,800

クレスコ	300	1,283.00	384,900
フジ・メディア・HD	3,400	1,154.00	3,923,600
秀英予備校	100	412.00	41,200
田谷	100	539.00	53,900
ラウンドワン	900	830.00	747,000
リゾートトラスト	1,600	1,484.00	2,374,400
オービック	1,300	21,670.00	28,171,000
ジャストシステム	600	7,270.00	4,362,000
TDCソフト	400	1,000.00	400,000
Zホールディングス	50,900	694.90	35,370,410
ビー・エム・エル	400	3,465.00	1,386,000
ワタベウェディング	100	275.00	27,500
トレンドマイクロ	2,000	5,830.00	11,660,000
りらいあコミュニケーション	600	1,350.00	810,000
IDホールディングス	200	1,248.00	249,600
リソー教育	1,600	311.00	497,600
日本オラクル	800	14,070.00	11,256,000
早稲田アカデミー	100	995.00	99,500
アルファシステムズ	100	3,670.00	367,000
フューチャー	400	1,779.00	711,600
CAC HOLDINGS	300	1,399.00	419,700
SBテクノロジー	200	3,565.00	713,000
トーセ	100	834.00	83,400
ユー・エス・エス	3,900	2,121.00	8,271,900
オービックビジネスC	300	6,840.00	2,052,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,600	3,730.00	5,968,000
アイティフォー	400	943.00	377,200
東京個別指導学院	200	593.00	118,600
東計電算	100	4,170.00	417,000
サイバーエージェント	2,300	7,370.00	16,951,000
楽天	16,400	999.00	16,383,600
エクスネット	100	969.00	96,900
クリーク・アンド・リバー社	200	1,125.00	225,000
モーニングスター	400	482.00	192,800
テー・オー・ダブリュー	500	260.00	130,000
大塚商会	2,000	5,250.00	10,500,000
サイボウズ	400	2,691.00	1,076,400
山田コンサルティンググループ	200	977.00	195,400
セントラルスポーツ	200	2,145.00	429,000
バラカ	100	1,607.00	160,700

電通国際情報S	600	3,510.00	2,106,000
A C C E S S	200	757.00	151,400
デジタルガレージ	700	4,005.00	2,803,500
イーエムシステムズ	500	978.00	489,000
ウェザーニューズ	200	5,170.00	1,034,000
C I J	300	889.00	266,700
ビジネスエンジニアリング	100	3,230.00	323,000
日本エンタープライズ	300	216.00	64,800
WOWOW	200	2,863.00	572,600
スカラ	300	819.00	245,700
インテリジェント ウェイブ	200	720.00	144,000
フルキャストホールディングス	300	1,578.00	473,400
エン・ジャパン	600	3,125.00	1,875,000
富士フイルムHLDGS	7,200	6,082.00	43,790,400
コニカミノルタ	8,100	398.00	3,223,800
資 生 堂	7,400	6,722.00	49,742,800
ライオン	4,800	2,464.00	11,827,200
高砂香料	300	2,496.00	748,800
マンダム	900	1,666.00	1,499,400
ミルボン	500	6,520.00	3,260,000
ファンケル	1,600	3,850.00	6,160,000
コーセー	700	16,350.00	11,445,000
コタ	300	1,444.00	433,200
シーボン	100	1,903.00	190,300
ポーラ・オルビスHD	1,500	2,144.00	3,216,000
ノエビアホールディングス	300	4,480.00	1,344,000
アジュバンコスメジャパン	100	1,030.00	103,000
エステー	300	1,984.00	595,200
アグロカネショウ	100	1,750.00	175,000
コ ニ シ	600	1,659.00	995,400
長谷川香料	700	2,107.00	1,474,900
星光PMC	300	802.00	240,600
小林製薬	1,100	12,360.00	13,596,000
荒川化学工業	300	1,290.00	387,000
メック	300	2,225.00	667,500
日本高純度化学	100	2,750.00	275,000
タカラバイオ	900	2,859.00	2,573,100
J C U	400	3,760.00	1,504,000
新田ゼラチン	300	673.00	201,900
O A Tアグリオ	100	1,311.00	131,100

デクセリアルズ	900	1,348.00	1,213,200
アース製薬	400	5,720.00	2,288,000
北興化学	300	1,213.00	363,900
大成ラミック	200	3,005.00	601,000
クミアイ化学	1,500	911.00	1,366,500
日本農薬	700	495.00	346,500
富士興産	100	1,030.00	103,000
ニチレキ	400	1,600.00	640,000
ユシロ化学	300	1,112.00	333,600
ビーピー・カストロール	200	1,240.00	248,000
富士石油	900	182.00	163,800
MORESCO	200	1,033.00	206,600
出光興産	4,100	2,342.00	9,602,200
E N E O Sホールディングス	55,000	405.60	22,308,000
コスモエネルギーHLDGS	1,000	2,002.00	2,002,000
横浜ゴム	2,100	1,608.00	3,376,800
TOYO TIRE	2,400	1,630.00	3,912,000
ブリヂストン	9,900	3,637.00	36,006,300
住友ゴム	3,200	938.00	3,001,600
藤倉コンポジット	300	385.00	115,500
オカモト	300	4,055.00	1,216,500
アキレス	300	1,455.00	436,500
フコク	200	687.00	137,400
ニッタ	400	2,262.00	904,800
クリエートメディック	200	1,016.00	203,200
住友理工	700	595.00	416,500
三ツ星ベルト	500	1,738.00	869,000
バンドー化学	700	671.00	469,700
AGC	3,600	3,725.00	13,410,000
日本板硝子	1,700	493.00	838,100
石塚硝子	100	1,912.00	191,200
有沢製作所	600	987.00	592,200
日本山村硝子	200	862.00	172,400
日本電気硝子	1,600	2,308.00	3,692,800
オハラ	200	1,959.00	391,800
住友大阪セメント	700	3,120.00	2,184,000
太平洋セメント	2,300	2,781.00	6,396,300
日本ヒュ-ム	300	812.00	243,600
日本コンクリ-ト	800	321.00	256,800
三谷セキサン	200	4,490.00	898,000

アジアパイルHD	500	477.00	238,500
東海カーボン	4,000	1,342.00	5,368,000
日本カーボン	200	3,935.00	787,000
東洋炭素	300	2,000.00	600,000
ノリタケ	300	3,115.00	934,500
TOTO	2,700	6,200.00	16,740,000
日本碍子	4,600	1,727.00	7,944,200
日本特殊陶業	2,800	1,892.00	5,297,600
ダントーホールディングス	400	471.00	188,400
MARUWA	200	11,790.00	2,358,000
品川リフラクトリーズ	100	2,613.00	261,300
黒崎播磨	100	4,625.00	462,500
ヨータイ	400	841.00	336,400
イソライト	200	508.00	101,600
東京窯業	400	357.00	142,800
ニッカトー	200	868.00	173,600
フジミインコーポレーテッド	300	3,910.00	1,173,000
クニミネ工業	200	1,276.00	255,200
エーアンドエーマテリアル	100	1,033.00	103,300
ニチアス	1,000	2,486.00	2,486,000
日本製鉄	16,200	1,458.00	23,619,600
神戸製鋼所	6,600	570.00	3,762,000
中山製鋼所	500	409.00	204,500
合同製鐵	300	2,051.00	615,300
JFEホールディングス	9,900	1,094.00	10,830,600
東京製鐵	1,800	697.00	1,254,600
共英製鋼	400	1,484.00	593,600
大和工業	800	2,924.00	2,339,200
東京鐵鋼	200	2,138.00	427,600
大阪製鐵	300	1,251.00	375,300
淀川製鋼所	500	2,135.00	1,067,500
丸一鋼管	1,200	2,371.00	2,845,200
モリ工業	100	2,401.00	240,100
大同特殊鋼	600	4,660.00	2,796,000
日本高周波	200	344.00	68,800
日本冶金工	400	1,817.00	726,800
山陽特殊製鋼	300	1,407.00	422,100
愛知製鋼	300	3,295.00	988,500
日立金属	3,900	1,575.00	6,142,500
日本金属	100	1,430.00	143,000

大平洋金属	300	2,378.00	713,400
新日本電工	2,300	306.00	703,800
栗本鉄工所	200	1,680.00	336,000
虹 技	100	1,090.00	109,000
日本製鋼所	1,100	3,345.00	3,679,500
三菱製鋼	400	727.00	290,800
日亜鋼業	500	295.00	147,500
日本精線	100	3,935.00	393,500
エンビプロHD	200	653.00	130,600
大紀アルミニウム	600	794.00	476,400
日本軽金属HD	800	2,029.00	1,623,200
三井金属	900	4,090.00	3,681,000
東邦亜鉛	200	2,558.00	511,600
三菱マテリアル	2,400	2,379.00	5,709,600
住友鉱山	4,600	5,142.00	23,653,200
DOWAホールディングス	900	4,130.00	3,717,000
古河機金	700	1,282.00	897,400
エス・サイエンス	1,600	39.00	62,400
大阪チタニウム	300	880.00	264,000
東邦チタニウム	700	990.00	693,000
UACJ	500	2,009.00	1,004,500
CKサンエツ	100	3,840.00	384,000
古河電工	1,100	2,925.00	3,217,500
住友電工	13,500	1,488.50	20,094,750
フジクラ	4,400	492.00	2,164,800
昭和電線HLDGS	400	1,861.00	744,400
東京特殊電線	100	2,488.00	248,800
タツタ電線	800	761.00	608,800
カナレ電気	100	1,686.00	168,600
平河ヒューテック	200	1,437.00	287,400
リョービ	400	1,285.00	514,000
アーステイ	500	371.00	185,500
アサヒHD	600	3,980.00	2,388,000
東洋製罐グループHD	2,300	1,164.00	2,677,200
ホッカンホールディングス	300	1,466.00	439,800
コロナ	300	1,007.00	302,100
横河ブリッジHLDGS	700	2,130.00	1,491,000
OSJB HD	1,800	283.00	509,400
駒井ハルテック	100	2,647.00	264,700
三和ホールディングス	3,500	1,249.00	4,371,500

文化シャツタ -	1,000	1,000.00	1,000,000	
三協立山	400	832.00	332,800	
アルインコ	300	952.00	285,600	
東洋シャツタ -	100	680.00	68,000	
L I X I L	5,300	2,440.00	12,932,000	
日本ファイルコン	400	535.00	214,000	
ノーリツ	800	1,640.00	1,312,000	
長府製作所	300	2,189.00	656,700	
リンナイ	700	12,010.00	8,407,000	
ユニプレス	700	1,048.00	733,600	
ダイニチ工業	300	981.00	294,300	
日東精工	500	455.00	227,500	
三洋工業	100	1,941.00	194,100	
岡 部	800	782.00	625,600	
ジーテクト	400	1,547.00	618,800	
東 プ レ	700	1,567.00	1,096,900	
高周波熱錬	700	494.00	345,800	
東京製綱	300	877.00	263,100	
サンコール	300	469.00	140,700	
モリテックスチル	400	467.00	186,800	
パイオラックス	500	1,599.00	799,500	
エイチワン	300	853.00	255,900	
日本発条	3,800	744.00	2,827,200	
中央発條	100	2,950.00	295,000	
アドバネクス	100	1,308.00	130,800	
三浦工業	1,500	6,160.00	9,240,000	
タ ク マ	1,200	2,083.00	2,499,600	
テクノプロ・ホールディング	700	9,180.00	6,426,000	
アトラ	100	312.00	31,200	
インターワークス	100	365.00	36,500	
アイ・アールジャパンHD	200	17,220.00	3,444,000	
K e e P e r 技研	400	2,308.00	923,200	
ファーストロジック	100	773.00	77,300	
三機サービス	100	979.00	97,900	
G u n o s y	300	738.00	221,400	
デザインワン・ジャパン	100	204.00	20,400	
イー・ガーディアン	200	3,045.00	609,000	
リブセンス	300	246.00	73,800	
ジャパンマテリアル	1,100	1,436.00	1,579,600	
ベクトル	400	984.00	393,600	

ウチヤマホールディングス	200	322.00	64,400
チャームケアコーポレーション	400	1,303.00	521,200
キャリアリンク	100	2,208.00	220,800
I B J	300	765.00	229,500
アサンテ	200	1,619.00	323,800
N・フィールド	300	832.00	249,600
バリューHR	200	1,634.00	326,800
M&Aキャピタルパートナー	300	5,560.00	1,668,000
ライドオンエクスプレスHD	200	2,150.00	430,000
E R Iホールディングス	100	620.00	62,000
アビスト	100	2,929.00	292,900
シグマクシス	300	1,731.00	519,300
ウィルグループ	300	970.00	291,000
エスクローAJ	500	332.00	166,000
メドピア	200	8,290.00	1,658,000
リクルートホールディングス	25,800	4,437.00	114,474,600
エラン	600	1,476.00	885,600
ツガミ	800	1,616.00	1,292,800
オークマ	400	6,120.00	2,448,000
芝浦機械	400	2,367.00	946,800
アマダ	4,600	1,180.00	5,428,000
アイダエンジニア	900	1,002.00	901,800
滝澤鉄工所	100	1,030.00	103,000
F U J I	1,500	2,833.00	4,249,500
牧野フライス	400	4,260.00	1,704,000
オーエスジー	1,700	2,065.00	3,510,500
ダイジェット	100	1,356.00	135,600
旭ダイヤモンド	900	472.00	424,800
D M G 森精機	2,300	1,682.00	3,868,600
ソディック	900	911.00	819,900
ディスコ	500	36,100.00	18,050,000
日東工器	300	1,817.00	545,100
日進工具	100	2,577.00	257,700
パンチ工業	300	436.00	130,800
富士ダイス	200	660.00	132,000
土木管理総合試験	200	332.00	66,400
ネットマーケティング	100	642.00	64,200
ベルシステム24HLDGS	600	1,682.00	1,009,200
鎌倉新書	300	1,030.00	309,000
S M N	100	754.00	75,400

LITALICO	200	3,885.00	777,000
グローバルキッズCOMP	100	928.00	92,800
エアトリ	200	1,274.00	254,800
アトラエ	100	2,784.00	278,400
ストライク	200	4,870.00	974,000
ソラスト	900	1,523.00	1,370,700
セラク	100	2,396.00	239,600
インソース	400	1,819.00	727,600
豊田自動織機	3,000	8,400.00	25,200,000
豊和工業	300	905.00	271,500
OKK	200	424.00	84,800
石川製作所	100	1,749.00	174,900
東洋機械金属	300	430.00	129,000
津田駒工業	100	910.00	91,000
エンシュウ	100	924.00	92,400
島精機製作所	600	1,755.00	1,053,000
オプトラ	400	2,217.00	886,800
NCホールディングス	100	560.00	56,000
イワキポンプ	200	836.00	167,200
フリー	300	1,125.00	337,500
ヤマシンフィルタ	800	1,115.00	892,000
日阪製作所	400	908.00	363,200
やまびこ	700	1,322.00	925,400
平田機工	200	8,070.00	1,614,000
ペガサスミシン製造	300	331.00	99,300
マルマエ	200	1,266.00	253,200
タツモ	200	1,429.00	285,800
ナブテスコ	2,100	4,880.00	10,248,000
三井海洋開発	300	2,063.00	618,900
レオン自動機	300	1,238.00	371,400
SMC	1,200	68,200.00	81,840,000
ホソカワミクロン	200	6,400.00	1,280,000
ユニオンツール	200	3,115.00	623,000
オイレス工業	400	1,661.00	664,400
日精エーエスビー	200	6,790.00	1,358,000
サト - ホールディングス	500	2,258.00	1,129,000
技研製作所	400	4,255.00	1,702,000
日本エアテック	100	1,650.00	165,000
カワタ	100	1,004.00	100,400
日精樹脂工業	400	950.00	380,000

オカダアイヨン	100	1,160.00	116,000	
ワイエイシイホールディングス	200	1,173.00	234,600	
小松製作所	17,000	3,052.00	51,884,000	
住友重機械	2,000	2,793.00	5,586,000	
日立建機	1,600	3,100.00	4,960,000	
日 工	500	718.00	359,000	
巴工業	200	2,028.00	405,600	
井関農機	300	1,415.00	424,500	
T O W A	300	2,165.00	649,500	
丸山製作所	100	1,543.00	154,300	
北川鉄工所	200	1,373.00	274,600	
シンニッタン	600	214.00	128,400	
ローツェ	200	7,300.00	1,460,000	
タカキタ	200	741.00	148,200	
クボタ	19,600	2,269.50	44,482,200	
荏原実業	100	4,050.00	405,000	
東洋エンジニア	500	466.00	233,000	
三菱化工機	200	3,320.00	664,000	
月島機械	700	1,480.00	1,036,000	
帝国電機製作所	400	1,213.00	485,200	
東京機械	200	279.00	55,800	
新東工業	1,000	784.00	784,000	
渋谷工業	300	3,680.00	1,104,000	
アイチ コーポレーション	600	920.00	552,000	
小森コーポレーション	900	725.00	652,500	
鶴見製作所	400	1,814.00	725,600	
住友精密	100	2,030.00	203,000	
日本ギア工業	100	295.00	29,500	
酒井重工業	100	2,326.00	232,600	
荏原製作所	1,500	3,595.00	5,392,500	
石井鉄工所	100	2,881.00	288,100	
西島製作所	300	867.00	260,100	
北越工業	300	1,091.00	327,300	
ダイキン工業	4,800	23,420.00	112,416,000	
オルガノ	200	6,320.00	1,264,000	
ト - ヨ - カネツ	200	2,222.00	444,400	
栗田工業	2,000	4,395.00	8,790,000	
椿本チエイン	500	2,854.00	1,427,000	
大同工業	200	745.00	149,000	
日 機 装	1,100	1,029.00	1,131,900	

木村化工機	400	613.00	245,200
レイズネクスト	600	1,233.00	739,800
アネスト岩田	600	1,101.00	660,600
ダイフク	1,900	13,110.00	24,909,000
サムコ	100	3,750.00	375,000
加藤製作所	300	960.00	288,000
油研工業	100	1,530.00	153,000
タダノ	1,800	944.00	1,699,200
フジテック	1,400	2,359.00	3,302,600
C K D	1,000	2,499.00	2,499,000
キトー	400	1,593.00	637,200
平和	1,000	1,426.00	1,426,000
理想科学工業	300	1,436.00	430,800
S A N K Y O	900	2,793.00	2,513,700
日本金銭機械	400	530.00	212,000
マースグループH L D G S	300	1,557.00	467,100
フクシマガリレイ	300	4,435.00	1,330,500
オーイズミ	200	419.00	83,800
ダイコク電機	200	886.00	177,200
竹内製作所	600	2,632.00	1,579,200
ア マ ノ	900	2,451.00	2,205,900
J U K I	500	529.00	264,500
サンデンホールディングス	500	365.00	182,500
蛇の目マシン	300	846.00	253,800
ブラザー工業	4,400	2,286.00	10,058,400
マックス	600	1,433.00	859,800
モリタホールディングス	700	1,769.00	1,238,300
グローリー	900	2,074.00	1,866,600
新晃工業	300	1,763.00	528,900
大和冷機工業	500	1,048.00	524,000
セガサミーホールディングス	3,600	1,603.00	5,770,800
日本ピストンリング	200	953.00	190,600
リ ケ ン	200	2,149.00	429,800
T P R	500	1,495.00	747,500
ツバキ・ナカシマ	800	1,223.00	978,400
ホシザキ	1,200	9,360.00	11,232,000
大豊工業	400	763.00	305,200
日本精工	6,900	924.00	6,375,600
N T N	8,400	263.00	2,209,200
ジェイテクト	3,500	874.00	3,059,000

不二越	300	4,550.00	1,365,000
ミネベアミツミ	6,900	2,179.00	15,035,100
日本トムソン	1,100	438.00	481,800
T H K	2,400	3,685.00	8,844,000
ユーシン精機	400	956.00	382,400
前澤給装工業	200	2,334.00	466,800
イーグル工業	400	1,015.00	406,000
前澤工業	300	471.00	141,300
日本ピラ - 工業	300	1,603.00	480,900
キッツ	1,500	665.00	997,500
日立	18,100	4,321.00	78,210,100
三菱電機	37,700	1,639.00	61,790,300
富士電機	2,200	3,990.00	8,778,000
東洋電機製造	200	1,188.00	237,600
安川電機	3,900	5,480.00	21,372,000
シンフォニア テクノロジー	500	1,498.00	749,000
明電舎	700	2,664.00	1,864,800
オリジン	100	1,363.00	136,300
山洋電気	200	5,870.00	1,174,000
デンヨー	300	2,229.00	668,700
ベイクレントコンサルティング	200	18,360.00	3,672,000
ORCHESTRA HLDGS	100	2,096.00	209,600
アイモバイル	100	1,391.00	139,100
キャリアインデックス	200	563.00	112,600
MS - Japan	100	1,051.00	105,100
船場	100	836.00	83,600
グレイステクノロジー	200	6,160.00	1,232,000
ジャパンエレベーターSHD	800	2,580.00	2,064,000
フルテック	100	1,355.00	135,500
グリーンズ	100	439.00	43,900
ツナググループHLDGS	100	303.00	30,300
GAMEWITH	100	579.00	57,900
ソウルドアウト	100	1,525.00	152,500
MS&CONSULTING	100	594.00	59,400
日総工産	300	707.00	212,100
キュービーネットHLDGS	200	1,381.00	276,200
RPAホールディングス	300	672.00	201,600
三桜工業	400	944.00	377,600
マキタ	4,800	5,150.00	24,720,000
東芝テック	400	3,820.00	1,528,000

芝浦メカトロニクス	100	4,835.00	483,500
マブチモーター	1,000	4,290.00	4,290,000
日本電産	9,100	14,025.00	127,627,500
ユーエムシーエレクトロニクス	300	450.00	135,000
トレックス・セミコンダクター	300	1,416.00	424,800
東光高岳	300	1,708.00	512,400
ダブル・スコープ	600	1,033.00	619,800
宮越ホールディングス	200	720.00	144,000
ダイヘン	400	5,030.00	2,012,000
ヤーマン	600	1,940.00	1,164,000
JVCケンウッド	3,000	169.00	507,000
ミマキエンジニアリング	300	481.00	144,300
I - P E X	200	1,987.00	397,400
日新電機	900	1,335.00	1,201,500
大崎電気	800	613.00	490,400
オムロン	3,400	9,540.00	32,436,000
日東工業	500	2,090.00	1,045,000
I D E C	500	1,889.00	944,500
正興電機製作所	100	2,295.00	229,500
不二電機工業	100	1,309.00	130,900
ジーエス・ユアサ コーポ	1,200	3,235.00	3,882,000
サクサホールディングス	100	1,396.00	139,600
メルコホールディングス	200	3,470.00	694,000
テクノメディカ	100	1,609.00	160,900
ダイヤモンドエレクトロクHD	100	1,354.00	135,400
日本電気	4,600	5,700.00	26,220,000
富士通	3,600	15,755.00	56,718,000
沖電気	1,600	1,012.00	1,619,200
岩崎通信機	200	852.00	170,400
電気興業	200	2,697.00	539,400
サンケン電気	400	4,945.00	1,978,000
ナカヨ	100	1,460.00	146,000
アイホン	300	1,699.00	509,700
ルネサスエレクトロニクス	15,900	1,149.00	18,269,100
セイコーエプソン	4,500	1,545.00	6,952,500
ワコム	2,500	949.00	2,372,500
アルバック	700	4,720.00	3,304,000
アクセル	200	733.00	146,600
E I Z O	400	3,565.00	1,426,000
ジャパンディスプレイ	10,600	46.00	487,600

日本信号	900	967.00	870,300
京三製作所	900	433.00	389,700
能美防災	500	2,246.00	1,123,000
ホーチキ	400	1,300.00	520,000
星和電機	200	712.00	142,400
エレコム	400	5,300.00	2,120,000
パナソニック	43,300	1,289.50	55,835,350
シャープ	4,300	1,700.00	7,310,000
アンリツ	2,400	2,455.00	5,892,000
富士通ゼネラル	1,000	2,781.00	2,781,000
ソニー	23,600	10,715.00	252,874,000
T D K	1,800	16,340.00	29,412,000
帝国通信工業	200	1,037.00	207,400
タムラ製作所	1,200	573.00	687,600
アルプスアルパイン	3,300	1,414.00	4,666,200
池上通信機	200	868.00	173,600
日本電波工業	300	656.00	196,800
鈴木	200	1,182.00	236,400
日本トリム	100	4,195.00	419,500
ローランド ディー . ジー .	300	1,876.00	562,800
フオスタ - 電機	300	1,379.00	413,700
S M K	100	3,095.00	309,500
ヨコオ	300	3,065.00	919,500
ティアック	300	111.00	33,300
ホシデン	1,000	994.00	994,000
ヒロセ電機	600	15,730.00	9,438,000
日本航空電子	900	1,583.00	1,424,700
T O A	400	896.00	358,400
マクセルホールディングス	800	1,374.00	1,099,200
古野電気	500	1,238.00	619,000
ユニデンホールディングス	100	2,222.00	222,200
スミダコーポレーション	400	1,070.00	428,000
アイコム	300	2,731.00	819,300
リオン	200	3,445.00	689,000
本多通信工業	400	490.00	196,000
船井電機	300	421.00	126,300
横河電機	3,300	2,271.00	7,494,300
新電元工業	200	2,629.00	525,800
アズビル	2,300	5,980.00	13,754,000
東亜ディーケーケー	200	834.00	166,800

日本光電工業	1,500	3,250.00	4,875,000
チノー	200	1,519.00	303,800
共和電業	300	390.00	117,000
日本電子材料	200	2,098.00	419,600
堀場製作所	800	6,390.00	5,112,000
アドバンテスト	2,800	8,430.00	23,604,000
小野測器	200	520.00	104,000
エスペック	300	2,045.00	613,500
キーエンス	3,400	58,770.00	199,818,000
日置電機	300	4,250.00	1,275,000
シスメックス	2,700	13,215.00	35,680,500
日本マイクロニクス	600	1,395.00	837,000
メガチップス	300	3,065.00	919,500
OBARA GROUP	200	4,115.00	823,000
IMAGICA GROUP	400	342.00	136,800
澤藤電機	100	2,198.00	219,800
デンソー	8,300	6,199.00	51,451,700
原田工業	200	854.00	170,800
コーセル	500	1,306.00	653,000
イリソ電子工業	300	4,305.00	1,291,500
オプテックスグループ	600	1,887.00	1,132,200
千代田インテグレ	200	1,833.00	366,600
アイ・オー・データ	200	1,053.00	210,600
レーザーテック	1,600	14,400.00	23,040,000
スタンレー電気	2,600	3,420.00	8,892,000
岩崎電気	200	1,439.00	287,800
ウシオ電機	2,300	1,344.00	3,091,200
岡谷電機	400	394.00	157,600
ヘリオステクノH	300	322.00	96,600
エノモト	100	1,488.00	148,800
日本セラミック	300	3,035.00	910,500
遠藤照明	200	522.00	104,400
古河電池	300	1,817.00	545,100
双信電機	200	469.00	93,800
山一電機	400	1,563.00	625,200
図研	300	2,792.00	837,600
日本電子	800	5,000.00	4,000,000
カシオ	3,300	1,807.00	5,963,100
ファナック	3,600	27,155.00	97,758,000
日本シイエムケイ	900	442.00	397,800

エンプラス	200	4,205.00	841,000
大真空	200	2,638.00	527,600
ローム	1,600	10,610.00	16,976,000
浜松ホトニクス	2,600	6,140.00	15,964,000
三井ハイテック	400	4,370.00	1,748,000
新光電気工業	1,200	2,556.00	3,067,200
京セラ	5,300	6,570.00	34,821,000
太陽誘電	1,600	5,190.00	8,304,000
村田製作所	11,000	10,070.00	110,770,000
双葉電子工業	600	932.00	559,200
日東電工	2,600	9,390.00	24,414,000
北陸電気工業	200	907.00	181,400
東海理化電機	900	1,773.00	1,595,700
ニチコン	1,300	1,445.00	1,878,500
日本ケミコン	400	2,022.00	808,800
K O A	500	1,556.00	778,000
三井E & S H D	1,400	378.00	529,200
日立造船	2,900	679.00	1,969,100
三菱重工業	6,100	3,287.00	20,050,700
川崎重工業	2,800	2,527.00	7,075,600
I H I	2,700	2,081.00	5,618,700
名村造船所	1,200	185.00	222,000
サノヤスホールディングス	400	168.00	67,200
スプリックス	200	779.00	155,800
マネジメントソリューションズ	100	2,031.00	203,100
プロレド・パートナーズ	100	3,490.00	349,000
カーブスホールディングス	800	762.00	609,600
フォーラムエンジニアリング	200	901.00	180,200
日本車輛	200	2,525.00	505,000
三菱ロジスネクスト	500	1,340.00	670,000
近畿車輛	100	1,300.00	130,000
日産自動車	43,100	544.10	23,450,710
いすゞ自動車	10,600	1,014.00	10,748,400
トヨタ自動車	42,100	7,939.00	334,231,900
日野自動車	4,500	931.00	4,189,500
三菱自動車工業	13,500	230.00	3,105,000
エフテック	300	660.00	198,000
レシップホールディングス	200	503.00	100,600
G M B	100	852.00	85,200
ファルテック	100	640.00	64,000

武蔵精密工業	900	1,769.00	1,592,100
日産車体	800	877.00	701,600
新明和工業	1,000	900.00	900,000
極東開発工業	700	1,459.00	1,021,300
トピー工業	400	1,265.00	506,000
ティラド	200	1,372.00	274,400
曙ブレーキ	2,100	127.00	266,700
タチエス	600	1,232.00	739,200
N O K	2,000	1,178.00	2,356,000
フタバ産業	1,000	538.00	538,000
K Y B	400	2,357.00	942,800
市光工業	500	704.00	352,000
大同メタル工業	700	523.00	366,100
プレス工業	1,800	311.00	559,800
ミクニ	400	275.00	110,000
太平洋工業	800	1,178.00	942,400
河西工業	500	394.00	197,000
アイシン精機	3,000	3,205.00	9,615,000
マ ツ ダ	10,800	745.00	8,046,000
今仙電機製作所	300	747.00	224,100
本田技研	29,700	2,933.50	87,124,950
スズキ	7,500	5,140.00	38,550,000
S U B A R U	11,400	2,110.00	24,054,000
安永	200	1,262.00	252,400
ヤマハ発動機	5,300	2,156.00	11,426,800
小糸製作所	2,200	7,080.00	15,576,000
T B K	400	470.00	188,000
エクセディ	500	1,324.00	662,000
ミツバ	700	471.00	329,700
豊田合成	1,200	3,010.00	3,612,000
愛三工業	600	564.00	338,400
盟和産業	100	901.00	90,100
日本プラスト	400	494.00	197,600
ヨ ロ ズ	300	1,159.00	347,700
エフ・シー・シー	600	1,779.00	1,067,400
新家工業	100	1,233.00	123,300
シマノ	1,400	24,450.00	34,230,000
テイ・エス テック	900	3,165.00	2,848,500
ダイレクトマーケティングミクス	100	2,712.00	271,200
ジャムコ	200	637.00	127,400

小野建	300	1,255.00	376,500
はるやまHLDGS	200	688.00	137,600
南陽	100	1,652.00	165,200
ノジマ	700	2,794.00	1,955,800
佐島電機	300	751.00	225,300
カップ・クリエイト	500	1,432.00	716,000
エコートレーディング	100	700.00	70,000
伯東	300	1,118.00	335,400
コンドーテック	400	1,126.00	450,400
中山福	300	541.00	162,300
ライトオン	400	662.00	264,800
ナガイレーベン	500	2,887.00	1,443,500
ジーンズメイト	100	300.00	30,000
三菱食品	400	2,865.00	1,146,000
良品計画	4,800	2,356.00	11,308,800
三城ホールディングス	300	304.00	91,200
松田産業	300	1,850.00	555,000
第一興商	500	3,490.00	1,745,000
メディパルHD	3,800	2,010.00	7,638,000
アドヴァン	500	1,245.00	622,500
SPK	200	1,272.00	254,400
萩原電気HLDGS	200	2,493.00	498,600
アルビス	200	2,533.00	506,600
アズワン	200	17,900.00	3,580,000
スズデン	200	1,243.00	248,600
尾家産業	100	1,263.00	126,300
シモジマ	300	1,464.00	439,200
ドウシシャ	300	1,936.00	580,800
小津産業	100	1,929.00	192,900
コナカ	400	286.00	114,400
高速	300	1,651.00	495,300
ハウスローゼ	100	1,675.00	167,500
G-7ホールディングス	300	2,313.00	693,900
たけびし	200	1,595.00	319,000
イオン北海道	400	1,043.00	417,200
コジマ	600	714.00	428,400
ヒマラヤ	200	957.00	191,400
コーナン商事	500	3,280.00	1,640,000
ネットワンシステムズ	1,400	3,490.00	4,886,000
エコス	200	2,211.00	442,200

ワタミ	400	838.00	335,200
マルシェ	100	499.00	49,900
リックス	100	1,558.00	155,800
システムソフト	900	91.00	81,900
パンパシフィックHD	8,000	2,321.00	18,568,000
丸文	300	525.00	157,500
西松屋チェーン	900	1,549.00	1,394,100
ゼンショーホールディングス	1,700	2,640.00	4,488,000
ハピネット	400	1,585.00	634,000
幸楽苑ホールディングス	300	1,544.00	463,200
ハークスレイ	100	887.00	88,700
橋本総業HLDGS	100	2,717.00	271,700
日本ライフライン	1,000	1,650.00	1,650,000
サイゼリヤ	600	1,869.00	1,121,400
タカショー	200	887.00	177,400
V Tホールディングス	1,400	438.00	613,200
マルカ	200	2,018.00	403,600
アルゴグラフィックス	400	3,170.00	1,268,000
魚力	100	1,798.00	179,800
IDOM	900	590.00	531,000
日本エム・ディ・エム	300	2,468.00	740,400
ポプラ	100	402.00	40,200
フジ・コーポレーション	100	2,250.00	225,000
ユナイテッドアローズ	300	1,430.00	429,000
進和	300	2,165.00	649,500
エスケイジャパン	100	474.00	47,400
ダイترون	200	1,601.00	320,200
ハイデイ日高	500	1,607.00	803,500
シークス	400	1,574.00	629,600
京都きもの友禅	300	219.00	65,700
コロワイド	1,200	1,541.00	1,849,200
ピーシーデポコーポ	500	587.00	293,500
田中商事	100	701.00	70,100
オーハシテクニカ	300	1,454.00	436,200
壱番屋	300	5,110.00	1,533,000
白銅	200	1,448.00	289,600
トップカルチャー	200	353.00	70,600
PLANT	100	748.00	74,800
スギホールディングス	800	7,000.00	5,600,000
薬王堂ホールディングス	200	2,879.00	575,800

島津製作所	4,300	4,020.00	17,286,000
J M S	300	969.00	290,700
クボテック	100	380.00	38,000
長野計器	300	994.00	298,200
ブイ・テクノロジー	200	6,390.00	1,278,000
スター精密	600	1,638.00	982,800
東京計器	300	953.00	285,900
愛知時計	100	4,390.00	439,000
インターアクション	300	1,948.00	584,400
オーバル	300	327.00	98,100
東京精密	700	5,150.00	3,605,000
マニー	1,400	2,850.00	3,990,000
ニコン	6,100	751.00	4,581,100
トプコン	1,900	1,419.00	2,696,100
オリンパス	21,000	2,097.00	44,037,000
理研計器	300	3,150.00	945,000
S C R E E Nホールディングス	600	7,950.00	4,770,000
キヤノン電子	300	1,504.00	451,200
タムロン	400	1,940.00	776,000
H O Y A	7,500	14,075.00	105,562,500
シ ー ド	200	623.00	124,600
ノーリツ鋼機	300	2,287.00	686,100
エー・アンド・デイ	300	1,327.00	398,100
朝日インテック	4,200	3,690.00	15,498,000
キヤノン	18,800	1,995.00	37,506,000
リ コ ー	9,300	694.00	6,454,200
シチズン時計	4,300	311.00	1,337,300
リズム	100	651.00	65,100
大研医器	300	567.00	170,100
メニコン	500	6,590.00	3,295,000
中本パックス	100	1,657.00	165,700
スノーピーク	300	1,763.00	528,900
パラマウントベッドHD	400	4,710.00	1,884,000
トランザクション	300	951.00	285,300
粧美堂	100	399.00	39,900
ニホンフラッシュ	300	1,314.00	394,200
前田工織	400	2,774.00	1,109,600
永大産業	500	279.00	139,500
アートネイチャー	400	661.00	264,400
バンダイナムコHLDGS	3,900	9,025.00	35,197,500

アイフィスジャパン	100	729.00	72,900
共立印刷	600	118.00	70,800
SHOEI	300	4,005.00	1,201,500
フランスベッドHLDGS	500	940.00	470,000
マーベラス	500	911.00	455,500
パイロットコーポレーション	600	2,987.00	1,792,200
萩原工業	300	1,505.00	451,500
エイベックス	600	1,123.00	673,800
トッパン・フォームズ	800	1,077.00	861,600
フジシールインターナショナル	900	2,035.00	1,831,500
タカラトミー	1,600	899.00	1,438,400
廣済堂	300	729.00	218,700
エステールホールディングス	100	621.00	62,100
レック	400	1,315.00	526,000
タカノ	200	595.00	119,000
三光合成	400	399.00	159,600
プロネクサス	300	1,077.00	323,100
ホクシン	300	113.00	33,900
ウッドワン	200	1,066.00	213,200
大建工業	300	1,710.00	513,000
きもと	600	177.00	106,200
凸版印刷	5,100	1,504.00	7,670,400
大日本印刷	4,800	1,938.00	9,302,400
共同印刷	100	3,230.00	323,000
NISSHA	800	1,465.00	1,172,000
藤森工業	300	4,760.00	1,428,000
ヴィア・ホールディングス	400	218.00	87,200
TAKARA & COMPANY	200	1,763.00	352,600
前澤化成工業	300	987.00	296,100
未来工業	300	1,741.00	522,300
アシックス	3,000	1,941.00	5,823,000
ツツミ	100	2,186.00	218,600
ウェーブロックHLDGS	200	765.00	153,000
ジェイエスピー	300	1,793.00	537,900
ニチハ	500	3,325.00	1,662,500
エフピコ	900	4,335.00	3,901,500
小松ウオール工業	100	1,762.00	176,200
ヤマハ	2,300	6,200.00	14,260,000
河合楽器	100	3,155.00	315,500
クリナップ	300	483.00	144,900

ピジヨン	2,400	4,380.00	10,512,000	
天馬	300	2,083.00	624,900	
オリバー	100	2,482.00	248,200	
キングジム	400	863.00	345,200	
象印マホービン	1,100	1,837.00	2,020,700	
リンテック	1,000	2,359.00	2,359,000	
信越ポリマー	700	971.00	679,700	
東リ	900	246.00	221,400	
イトーキ	800	345.00	276,000	
任天堂	2,300	65,370.00	150,351,000	
三菱鉛筆	600	1,376.00	825,600	
松風	200	1,923.00	384,600	
タカラスタンダ-ド	800	1,562.00	1,249,600	
コクヨ	1,800	1,435.00	2,583,000	
ナカバヤシ	300	640.00	192,000	
ニフコ	1,400	4,150.00	5,810,000	
立川ブラインド	200	1,332.00	266,400	
グロープライド	200	4,240.00	848,000	
オカムラ	1,300	947.00	1,231,100	
バルカー	400	2,099.00	839,600	
MUTOHホールディングス	100	1,522.00	152,200	
伊藤忠	26,000	3,091.00	80,366,000	
丸紅	37,600	727.00	27,335,200	
スクロール	500	817.00	408,500	
高島	100	1,627.00	162,700	
ヨンドシーホールディングス	300	1,967.00	590,100	
三陽商会	200	614.00	122,800	
長瀬産業	2,100	1,562.00	3,280,200	
ナイガイ	200	341.00	68,200	
蝶理	300	1,585.00	475,500	
豊田通商	4,000	4,400.00	17,600,000	
オンワ-ドホールディングス	2,100	215.00	451,500	
三共生興	500	490.00	245,000	
兼松	1,400	1,325.00	1,855,000	
美津濃	300	2,063.00	618,900	
ツカモトコーポレーション	100	1,506.00	150,600	
ルックホールディングス	200	974.00	194,800	
三井物産	32,200	1,983.50	63,868,700	
日本紙パルプ	300	3,645.00	1,093,500	
東京エレクトロン	2,400	40,680.00	97,632,000	

カメイ	400	1,210.00	484,000
東都水産	100	3,845.00	384,500
OUGホールディングス	100	2,877.00	287,700
スターゼン	200	4,290.00	858,000
セイコーHD	500	1,355.00	677,500
山 善	1,500	1,050.00	1,575,000
椿本興業	100	3,900.00	390,000
住友商事	22,800	1,427.50	32,547,000
日本ユニシス	1,100	4,060.00	4,466,000
内田洋行	200	4,440.00	888,000
三菱商事	24,300	2,628.00	63,860,400
第一実業	200	4,240.00	848,000
キヤノンマーケティングJPN	1,000	2,318.00	2,318,000
西華産業	300	1,412.00	423,600
佐藤商事	400	917.00	366,800
菱洋エレクトロ	300	3,190.00	957,000
東京産業	300	615.00	184,500
ユアサ商事	300	3,425.00	1,027,500
神鋼商事	100	1,900.00	190,000
トルク	300	250.00	75,000
阪和興業	700	2,907.00	2,034,900
正栄食品	300	3,655.00	1,096,500
カナデン	400	1,315.00	526,000
菱電商事	300	1,563.00	468,900
ニプロ	2,600	1,225.00	3,185,000
フルサト工業	300	1,292.00	387,600
岩谷産業	1,000	7,110.00	7,110,000
ナイス	200	1,517.00	303,400
昭光通商	100	614.00	61,400
ニチモウ	100	1,919.00	191,900
極東貿易	100	1,359.00	135,900
イ ワ キ	500	530.00	265,000
兼松エレクトロニクス	300	4,150.00	1,245,000
三愛石油	1,000	1,149.00	1,149,000
稲畑産業	900	1,434.00	1,290,600
G S Iクレオス	100	1,821.00	182,100
明和産業	300	456.00	136,800
クワザワホールディングス	200	612.00	122,400
キムラタン	1,800	25.00	45,000
ヤマエ久野	400	1,153.00	461,200

ゴ - ルドウィン	700	6,730.00	4,711,000	
ユニ・チャ - ム	8,000	5,005.00	40,040,000	
デサント	700	1,935.00	1,354,500	
キ ン グ	200	546.00	109,200	
ワ キ タ	800	1,044.00	835,200	
ヤマトインタ - ナショナル	300	332.00	99,600	
東邦ホールディングス	1,200	1,857.00	2,228,400	
サンゲツ	1,000	1,589.00	1,589,000	
ミツウロコグループ	500	1,435.00	717,500	
シナネンホールディングス	200	3,015.00	603,000	
伊藤忠エネクス	900	1,084.00	975,600	
サンリオ	1,000	1,447.00	1,447,000	
サンワ テクノス	300	980.00	294,000	
リョーサン	400	1,950.00	780,000	
新光商事	600	765.00	459,000	
トーホー	200	1,886.00	377,200	
三信電気	300	2,007.00	602,100	
東陽テクニカ	400	1,174.00	469,600	
モスフード サービス	500	2,920.00	1,460,000	
加賀電子	300	2,383.00	714,900	
三益半導体	400	2,707.00	1,082,800	
都築電気	200	1,645.00	329,000	
ソーダニツカ	300	543.00	162,900	
立花エレテック	400	1,639.00	655,600	
木曽路	500	2,329.00	1,164,500	
S R S ホールディングス	400	800.00	320,000	
千 趣 会	700	316.00	221,200	
タカキユー	400	156.00	62,400	
リテールパートナーズ	400	1,565.00	626,000	
ケーヨー	800	744.00	595,200	
上新電機	400	2,871.00	1,148,400	
日本瓦斯	600	5,730.00	3,438,000	
ロイヤルホールディングス	600	1,676.00	1,005,600	
いなげや	400	1,862.00	744,800	
島 忠	700	5,490.00	3,843,000	
チヨダ	300	918.00	275,400	
ライフコーポレーション	400	3,800.00	1,520,000	
リンガーハット	400	2,249.00	899,600	
M r M a x H D	500	801.00	400,500	
テンアライド	300	314.00	94,200	

AOKIホールディングス	800	529.00	423,200
オークワ	600	1,307.00	784,200
コメリ	600	3,030.00	1,818,000
青山商事	800	585.00	468,000
しまむら	400	11,770.00	4,708,000
はせがわ	300	296.00	88,800
高島屋	2,600	882.00	2,293,200
松屋	800	748.00	598,400
エイチ・ツー・オーリテイリング	1,700	699.00	1,188,300
近鉄百貨店	200	3,150.00	630,000
丸井グループ	3,300	1,804.00	5,953,200
アクシアルリテイリング	400	5,260.00	2,104,000
井筒屋	300	175.00	52,500
イオン	14,100	3,376.00	47,601,600
イズミ	800	3,925.00	3,140,000
フォーバル	200	883.00	176,600
平和堂	800	2,216.00	1,772,800
フジ	400	2,040.00	816,000
ヤオコー	400	7,200.00	2,880,000
ゼビオホールディングス	400	815.00	326,000
ケースホールディングス	3,500	1,409.00	4,931,500
PALTAC	600	5,720.00	3,432,000
三谷産業	500	478.00	239,000
OLYMPICグループ	200	941.00	188,200
日産東京販売HD	500	268.00	134,000
アドバンテッジリスクマネ	200	640.00	128,000
三井不動産	17,800	2,104.50	37,460,100
三菱地所	26,100	1,679.00	43,821,900
平和不動産	700	3,950.00	2,765,000
東京建物	4,000	1,486.00	5,944,000
ダイビル	900	1,274.00	1,146,600
京阪神ビルディング	600	1,916.00	1,149,600
住友不動産	8,400	3,169.00	26,619,600
太平洋興発	200	640.00	128,000
テーオーシー	700	727.00	508,900
東京楽天地	100	4,180.00	418,000
レオパレス21	4,700	137.00	643,900
スターツコーポレーション	500	2,861.00	1,430,500
フジ住宅	400	656.00	262,400
空港施設	300	494.00	148,200

明和地所	300	578.00	173,400
ゴールドクレスト	400	1,608.00	643,200
リログループ	1,900	2,481.00	4,713,900
エスリード	200	1,446.00	289,200
日神グループHLDGS	500	415.00	207,500
日本エスコン	700	805.00	563,500
タカラレーベン	1,600	312.00	499,200
AVANTIA	300	884.00	265,200
イオンモール	1,800	1,707.00	3,072,600
毎日コムネット	100	700.00	70,000
ファースト住建	200	1,063.00	212,600
ランド	19,700	9.00	177,300
カチタス	800	3,155.00	2,524,000
東祥	300	1,538.00	461,400
トーセイ	500	1,097.00	548,500
穴吹興産	100	1,643.00	164,300
サンフロンティア不動産	500	885.00	442,500
エフ・ジェー・ネクスト	400	1,001.00	400,400
インテリックス	100	552.00	55,200
ランドビジネス	200	330.00	66,000
サンネクスタグループ	100	968.00	96,800
グランディハウス	400	425.00	170,000
東武鉄道	4,100	3,005.00	12,320,500
相鉄ホールディングス	1,200	2,422.00	2,906,400
東急	9,100	1,230.00	11,193,000
京浜急行	4,700	1,752.00	8,234,400
小田急電鉄	5,500	3,090.00	16,995,000
京王電鉄	2,000	7,750.00	15,500,000
京成電鉄	2,600	3,330.00	8,658,000
富士急行	500	4,390.00	2,195,000
新京成電鉄	100	2,216.00	221,600
東日本旅客鉄道	6,700	6,599.00	44,213,300
西日本旅客鉄道	3,400	5,289.00	17,982,600
東海旅客鉄道	3,100	14,250.00	44,175,000
西武ホールディングス	5,000	966.00	4,830,000
鴻池運輸	600	1,006.00	603,600
西日本鉄道	1,000	3,015.00	3,015,000
ハマキョウレックス	400	2,943.00	1,177,200
サカイ引越センター	300	5,120.00	1,536,000
近鉄グループHLDGS	3,500	4,460.00	15,610,000

阪急阪神HLDGS	4,600	3,385.00	15,571,000
南海電鉄	1,600	2,518.00	4,028,800
京阪ホールディングス	1,500	4,905.00	7,357,500
神戸電鉄	100	3,630.00	363,000
名古屋鉄道	2,800	2,693.00	7,540,400
山陽電鉄	300	1,991.00	597,300
ランコム	100	9,730.00	973,000
日本通運	1,200	7,060.00	8,472,000
ヤマトホールディングス	5,900	2,711.00	15,994,900
山九	900	4,090.00	3,681,000
日新	400	1,251.00	500,400
丸運	300	253.00	75,900
丸全昭和運輸	400	3,625.00	1,450,000
センコーグループHLDGS	1,900	1,034.00	1,964,600
トナミホールディングス	100	6,100.00	610,000
ニッコンホールディングス	1,300	2,168.00	2,818,400
福山通運	400	4,370.00	1,748,000
セイノーホールディングス	2,700	1,490.00	4,023,000
エスライン	100	917.00	91,700
神奈川中央交通	100	3,935.00	393,500
日立物流	600	3,190.00	1,914,000
丸和運輸機関	600	2,225.00	1,335,000
C&Fロジホールディングス	300	2,170.00	651,000
日本郵船	2,900	2,567.00	7,444,300
商船三井	2,200	3,255.00	7,161,000
川崎汽船	1,000	2,271.00	2,271,000
NSユニテッド海運	300	1,421.00	426,300
明治海運	300	399.00	119,700
飯野海運	1,600	446.00	713,600
共栄タンカー	100	899.00	89,900
九州旅客鉄道	3,100	2,180.00	6,758,000
SGホールディングス	7,400	2,969.00	21,970,600
日本航空	8,100	1,908.00	15,454,800
ANAホールディングス	8,900	2,184.00	19,437,600
パスコ	100	1,421.00	142,100
西本WISMETTACHD	100	2,492.00	249,200
GENKYDRUGSTORES	200	4,125.00	825,000
コア商事HLDGS	200	1,410.00	282,000
国際紙パルプ商事	900	249.00	224,100
ナルミヤ・インターナショナル	100	781.00	78,100

ブックオフGHD	300	849.00	254,700
三菱倉庫	1,100	3,155.00	3,470,500
三井倉庫HOLD	400	2,380.00	952,000
住友倉庫	1,300	1,354.00	1,760,200
渋沢倉庫	300	2,279.00	683,700
ヤマタネ	200	1,356.00	271,200
東陽倉庫	600	323.00	193,800
乾汽船	300	978.00	293,400
日本トランスシティ	800	554.00	443,200
ケイヒン	100	1,309.00	130,900
中央倉庫	300	1,118.00	335,400
川西倉庫	100	1,133.00	113,300
安田倉庫	400	981.00	392,400
ファイズホールディングス	100	1,092.00	109,200
東洋埠頭	100	1,403.00	140,300
宇徳	400	500.00	200,000
上組	2,000	1,898.00	3,796,000
サンリツ	100	677.00	67,700
キムラユニティー	100	1,101.00	110,100
キューソー流通システム	100	1,615.00	161,500
近鉄エクスプレス	800	2,524.00	2,019,200
東海運	300	311.00	93,300
エーアイテイー	300	961.00	288,300
内外トランスライン	200	1,239.00	247,800
ショーエイコーポ	100	1,014.00	101,400
日本コンセプト	100	1,676.00	167,600
TBSホールディングス	2,200	1,906.00	4,193,200
日本テレビHLD S	3,000	1,151.00	3,453,000
朝日放送グループHD	300	706.00	211,800
テレビ朝日HD	1,000	1,809.00	1,809,000
スカパーJ S A T H D	2,400	481.00	1,154,400
テレビ東京HD	400	2,411.00	964,400
日本BS放送	200	1,140.00	228,000
ビジョン	300	941.00	282,300
スマートバリュー	100	935.00	93,500
USEN-NEXT HLDGS	200	1,419.00	283,800
ワイヤレスゲート	200	605.00	121,000
コネクシオ	300	1,454.00	436,200
日本通信	2,800	171.00	478,800
クロップス	100	771.00	77,100

日本電信電話	49,400	2,816.50	139,135,100	
KDDI	27,000	3,204.00	86,508,000	
ソフトバンク	33,000	1,347.00	44,451,000	
光通信	400	21,970.00	8,788,000	
エムティーアイ	300	832.00	249,600	
GMOインターネット	1,500	3,440.00	5,160,000	
ファイバーゲート	100	2,285.00	228,500	
アイドママーケティングコミュ	100	416.00	41,600	
KADOKAWA	900	3,415.00	3,073,500	
学研ホールディングス	400	1,710.00	684,000	
ゼンリン	800	1,276.00	1,020,800	
昭文社ホールディングス	200	458.00	91,600	
インプレスホールディングス	400	172.00	68,800	
東京電力HD	29,300	301.00	8,819,300	
中部電力	11,200	1,299.50	14,554,400	
関西電力	13,800	1,019.50	14,069,100	
中国電力	5,200	1,256.00	6,531,200	
北陸電力	3,300	699.00	2,306,700	
東北電力	9,300	875.00	8,137,500	
四国電力	3,300	718.00	2,369,400	
九州電力	7,500	934.00	7,005,000	
北海道電力	3,400	399.00	1,356,600	
沖縄電力	700	1,423.00	996,100	
電源開発	2,900	1,695.00	4,915,500	
エフオン	300	1,278.00	383,400	
イーレックス	500	1,928.00	964,000	
レノバ	600	4,765.00	2,859,000	
東京瓦斯	7,000	2,398.00	16,786,000	
大阪瓦斯	7,100	2,120.00	15,052,000	
東邦瓦斯	1,800	6,790.00	12,222,000	
北海道瓦斯	300	1,568.00	470,400	
広島ガス	800	380.00	304,000	
西部瓦斯	400	3,245.00	1,298,000	
静岡ガス	1,000	1,076.00	1,076,000	
メタウォーター	300	2,314.00	694,200	
アイネット	200	1,592.00	318,400	
松竹	200	14,280.00	2,856,000	
東宝	2,100	4,390.00	9,219,000	
エイチ・アイ・エス	500	1,604.00	802,000	
東映	200	17,320.00	3,464,000	

ラックランド	100	2,336.00	233,600
N T Tデータ	9,600	1,485.00	14,256,000
共立メンテナンス	600	3,840.00	2,304,000
イチネンホールディングス	400	1,287.00	514,800
建設技術研究所	300	2,370.00	711,000
スペース	300	799.00	239,700
長 大	200	1,637.00	327,400
アインホールディングス	400	6,700.00	2,680,000
燦ホールディングス	200	1,207.00	241,400
ピー・シー・エー	100	4,375.00	437,500
東京テアトル	200	1,276.00	255,200
タナベ経営	100	1,347.00	134,700
ビジネス B 太田昭和	200	1,682.00	336,400
ナ ガ ワ	100	9,930.00	993,000
よみうりランド	100	6,040.00	604,000
東京都競馬	300	4,640.00	1,392,000
常磐興産	200	1,395.00	279,000
カナモト	600	2,245.00	1,347,000
東京ドーム	1,500	1,298.00	1,947,000
D T S	900	2,164.00	1,947,600
スクウェア・エニックス・HD	1,500	5,950.00	8,925,000
シーイーシー	300	1,516.00	454,800
カプコン	1,700	6,700.00	11,390,000
西尾レントオール	300	2,167.00	650,100
アイ・エス・ピー	200	1,386.00	277,200
アゴーラ・ホスピタリティーG	2,500	23.00	57,500
日本空港ビルデング	1,100	6,220.00	6,842,000
トランス・コスモス	300	2,560.00	768,000
乃村工藝社	1,500	850.00	1,275,000
ジャステック	300	1,368.00	410,400
S C S K	900	5,790.00	5,211,000
藤田観光	200	1,315.00	263,000
K N T - C Tホールディングス	300	928.00	278,400
日本管財	300	2,073.00	621,900
トーカイ	300	2,016.00	604,800
セコム	3,800	9,650.00	36,670,000
日本システムウエア	200	2,134.00	426,800
セントラル警備保障	200	3,710.00	742,000
アイネス	300	1,422.00	426,600
丹青社	700	806.00	564,200

メイテック	400	5,390.00	2,156,000	
T K C	400	7,630.00	3,052,000	
富士ソフト	400	5,180.00	2,072,000	
応用地質	300	1,280.00	384,000	
船井総研ホールディング	800	2,486.00	1,988,800	
N S D	1,100	2,161.00	2,377,100	
進学会ホールディングス	200	467.00	93,400	
オ オ バ	300	750.00	225,000	
コナミホールディングス	1,300	5,970.00	7,761,000	
いであ	100	1,829.00	182,900	
学 究 社	100	1,315.00	131,500	
ベネッセホールディングス	1,200	2,026.00	2,431,200	
イオンディライト	400	2,680.00	1,072,000	
ナック	300	981.00	294,300	
福井コンピュータH L D S	200	3,885.00	777,000	
ダイセキ	600	3,555.00	2,133,000	
ステップ	200	1,567.00	313,400	
日鉄物産	300	3,860.00	1,158,000	
泉州電業	100	3,285.00	328,500	
元気寿司	100	2,269.00	226,900	
トラスコ中山	800	2,797.00	2,237,600	
ヤマダホールディングス	11,100	549.00	6,093,900	
オートバックスセブン	1,400	1,409.00	1,972,600	
モリト	300	624.00	187,200	
アークランドサカモト	600	1,652.00	991,200	
ニトリホールディングス	1,600	22,990.00	36,784,000	
グルメ杵屋	300	969.00	290,700	
愛 眼	400	235.00	94,000	
ケーユーホールディングス	200	827.00	165,400	
吉野家ホールディングス	1,200	1,919.00	2,302,800	
加藤産業	600	3,535.00	2,121,000	
北恵	100	860.00	86,000	
イノテック	300	1,018.00	305,400	
イエローハット	700	1,669.00	1,168,300	
松屋フーズH L D G S	200	3,350.00	670,000	
J B C Cホールディングス	300	1,439.00	431,700	
J Kホールディングス	300	833.00	249,900	
サガミホールディングス	500	1,161.00	580,500	
日 伝	200	2,315.00	463,000	
関西スーパーマーケット	400	1,213.00	485,200	

ミロク情報サービス	300	2,069.00	620,700	
北沢産業	400	273.00	109,200	
杉本商事	300	2,493.00	747,900	
因幡電機産業	1,000	2,635.00	2,635,000	
王将フードサービス	300	5,680.00	1,704,000	
プレナス	400	1,752.00	700,800	
ミニストップ	400	1,452.00	580,800	
アークス	800	2,400.00	1,920,000	
バローホールディングス	900	2,704.00	2,433,600	
東 テ ク	200	2,825.00	565,000	
ミスミグループ本社	4,500	3,420.00	15,390,000	
アルテック	400	327.00	130,800	
ベ ル ク	200	6,040.00	1,208,000	
大 庄	300	958.00	287,400	
タキヒヨー	100	1,919.00	191,900	
ファーストリテイリング	500	91,730.00	45,865,000	
ソフトバンクグループ	29,400	7,988.00	234,847,200	
蔵王産業	100	1,363.00	136,300	
スズケン	1,500	3,805.00	5,707,500	
サンドラッグ	1,400	4,090.00	5,726,000	
サックスパーホールディング	300	541.00	162,300	
ジェコス	300	977.00	293,100	
ヤマザワ	100	1,770.00	177,000	
や ま や	100	2,208.00	220,800	
グローセル	300	465.00	139,500	
ベルーナ	800	1,101.00	880,800	
合計			8,824,607,430	

(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】

2021年1月29日

資産総額	6,191,861,340円
負債総額	344,799,648円
純資産総額(-)	5,847,061,692円
発行済数量	4,083,899口
1単位当たり純資産額(/)	1,431.74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

2021年1月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．運用審査会議、リスクマネジメント会議および経営会議

・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。

・経営会議

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。

2021年1月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	43	73,578
追加型株式投資信託	729	19,120,560
株式投資信託 合計	772	19,194,138
単位型公社債投資信託	50	183,629
追加型公社債投資信託	14	1,569,196
公社債投資信託 合計	64	1,752,825
総合計	836	20,946,964

3 【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第61期事業年度（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。

また、第62期事業年度に係る中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (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	217
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 3,882	2 3,530
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					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		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 その他有価証券のうち満期があるもの	21,900 267	- 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、記載しておりません。

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、記載しておりません。

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	当事業年度
	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	(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	当事業年度
	(2019年3月31日)	(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㈱	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	㈱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いません。

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 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。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (2020年9月30日)	
資産の部		
流動資産		
現金・預金		2,811
有価証券		12,910
未収委託者報酬		11,357
その他		360
流動資産合計		27,439
固定資産		
有形固定資産	1	226
無形固定資産		
ソフトウェア		1,720
その他		687
無形固定資産合計		2,408
投資その他の資産		
投資有価証券		10,638
関係会社株式		3,972
繰延税金資産		1,053
その他		1,286
投資その他の資産合計		16,951
固定資産合計		19,586
資産合計		47,025

(単位:百万円)

当中間会計期間
(2020年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金	5,860
未払費用	3,365
未払法人税等	594
賞与引当金	571
その他	2

流動負債合計	11,000
--------	--------

固定負債

退職給付引当金	2,609
役員退職慰労引当金	110
その他	4

固定負債合計	2,724
--------	-------

負債合計

負債合計	13,724
------	--------

純資産の部

株主資本

資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495

利益剰余金

利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	5,784

利益剰余金合計	6,158
---------	-------

株主資本合計

株主資本合計	32,828
--------	--------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	472
--------------	-----

評価・換算差額等合計	472
------------	-----

純資産合計

純資産合計	33,301
-------	--------

負債・純資産合計

負債・純資産合計	47,025
----------	--------

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

当中間会計期間

(自 2020年4月1日
至 2020年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		31,426
その他営業収益		214
営業収益合計		31,641
営業費用		
支払手数料		13,509
その他営業費用		5,825
営業費用合計		19,334
一般管理費	1	5,708
営業利益		6,597
営業外収益	2	239
営業外費用	3	156
経常利益		6,679
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		6,679
法人税、住民税及び事業税		2,071
法人税等調整額		8
中間純利益		4,599

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	10,564	10,564	10,564

中間純利益	-	-	-	4,599	4,599	4,599
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	5,965	5,965	5,965
当中間期末残高	15,174	11,495	374	5,784	6,158	32,828

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	363	363	38,430
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	10,564
中間純利益	-	-	4,599
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	836	836	836
当中間期変動額合計	836	836	5,128
当中間期末残高	472	472	33,301

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	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、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．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。

（追加情報）

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2020年9月30日現在)
有形固定資産	316百万円

2 消費税等の取扱い

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

3 保証債務

当中間会計期間(2020年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,623百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	327百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
投資有価証券売却益	203百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
為替差損	63百万円
有価証券償還損	46百万円
投資有価証券売却損	33百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2020年6月23日 定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年3月31日	2020年6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2020年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

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

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

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券(1)	60			60
資産合計	60			60

(1) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券410百万円、投資有価証券9,911百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価格によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項(有価証券関係)をご参照下さい。

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

(単位:百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,944
関連会社株式	2,027

(有価証券関係)

当中間会計期間(2020年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(中間貸借対照表計上額 1,944百万円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	60	55	5
(2) その他	7,989	7,141	847
小計	8,049	7,196	852
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他	14,833	15,006	173
小計	14,833	15,006	173
合計	22,882	22,203	679

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

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

[関連情報]

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	12,766.41円
1株当たり中間純利益	1,763.16円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
中間純利益(百万円)	4,599
普通株式に係る中間純利益(百万円)	4,599
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2020年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	
BofA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10月2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

2021年2月5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7月11日から2021年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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2021年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

独立監査人の中間監査報告書

2020年11月20日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未	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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。