

**【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7月2日提出
【計算期間】	第1特定期間 (自 2020年11月9日 至 2021年4月10日)
【ファンド名】	iFreeETF TOPIX(年4回決算型)
【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東証株価指数（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。

#### 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型投信	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券	MRF	
追加型投信	内外	不動産投信	ETF	特殊型
		その他資産 ( )		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款(以下「目論見書等」といいます。)において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信(リート)	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信(リート)以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信(リート)およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	MMF(マネー・マネージメント・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	MRF(マネー・リザーブ・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRF
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

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

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

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

#### < 信託の限度 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、10兆円に相当する株券および金銭を限度として追加信託することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、上記の限度を変更することができます。

#### < ファンドの特色 >

1

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

- 東証株価指数を構成する全銘柄の株式の時価総額構成比率の95%以上を構成する銘柄の株式を組入れることを原則とします。
- 上記に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行なうこと（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。

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

#### 東証株価指数（TOPIX）について

- ◆ 株式市場の動向を表わす指標には、東証株価指数（TOPIX）、日経平均株価、日経株価指数300等があります。このうち、TOPIXは、東京証券取引所の第1部に上場されてい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。
- ◆ TOPIXは、1968年1月4日（基準時）の時価総額を100として1969年7月1日から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） TOPIXの算出方法： 毎日の指数 = 当日の時価総額 ÷ 基準時の時価総額 × 100

（注2） 基準時の時価総額の修正方法：

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

- TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱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に関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有する。
- ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及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ない。また、㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- 「iFreeETF TOPIX (年4回決算型)」は、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではない。
- ㈱東京証券取引所は、「iFreeETF TOPIX (年4回決算型)」の購入者又は公衆に対し、「iFreeETF TOPIX (年4回決算型)」の説明、投資のアドバイスをする義務を負わない。
- ㈱東京証券取引所は、当社又は「iFreeETF TOPIX (年4回決算型)」の購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではない。
- 以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は「iFreeETF TOPIX (年4回決算型)」の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。

## 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、1口単位です。
  - 取引方法は、原則として株式と同様です。
- 追加設定は、株式により行ないます。
  - 追加設定にかかる受益権の取得申込者は、取得時のバスケット（東証株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの）を単位として、受益権を取得しなければならないものとしします。
  - 原則として、所定の方法に定められる金銭の支払い以外に、金銭によって受益権の取得申込を行なうことはできません。
- 受益権を株式と交換することができます。
  - 受益者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に対し、委託会社が定める一定口数の整数倍の受益権をもって、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換を申込みすることができます。
  - 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、4月、7月、10月の各10日です。

(注) 第1計算期間は、2021年1月10日までとします。

※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。

## 主な投資制限

- 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への投資は、行ないません。



## ●基準価額の動きに関する留意点

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

- (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) 株式および株価指数先物取引（株価指数先物取引を利用した場合）の最低取引単位の影響
- (g) 株式および株価指数先物取引（株価指数先物取引を利用した場合）の流動性低下時における売買対応の影響
- (h) 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
- (i) 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】

2020年11月9日 信託契約締結、当初設定、運用開始  
2020年11月10日 受益権を東京証券取引所に上場

## (3) 【ファンドの仕組み】

	名 称	関係業務の内容
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 1 ）の委託者であり、受益権の募集・発行、信託財産の運用指図、受益権とその信託財産に属する株式との交換の指図、信託財産の計算等を行ないます。
受託会社	みずほ信託銀行株式会社 （再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）	信託契約（ 1 ）の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。
取扱窓口	販売会社	受益権の募集、交換の取扱い等に関する委託会社および受託会社との三者間契約（ 2 ）に基づき、受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務等を行ないます。

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

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

< 委託会社等の概況（2021年4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。

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

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

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

市況動向、資産規模等によっては、上記の運用が行なえないことがあります。

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

## (2) 【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託財産を、主として株式に投資することを指図します。

前 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、交換、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託財産を次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

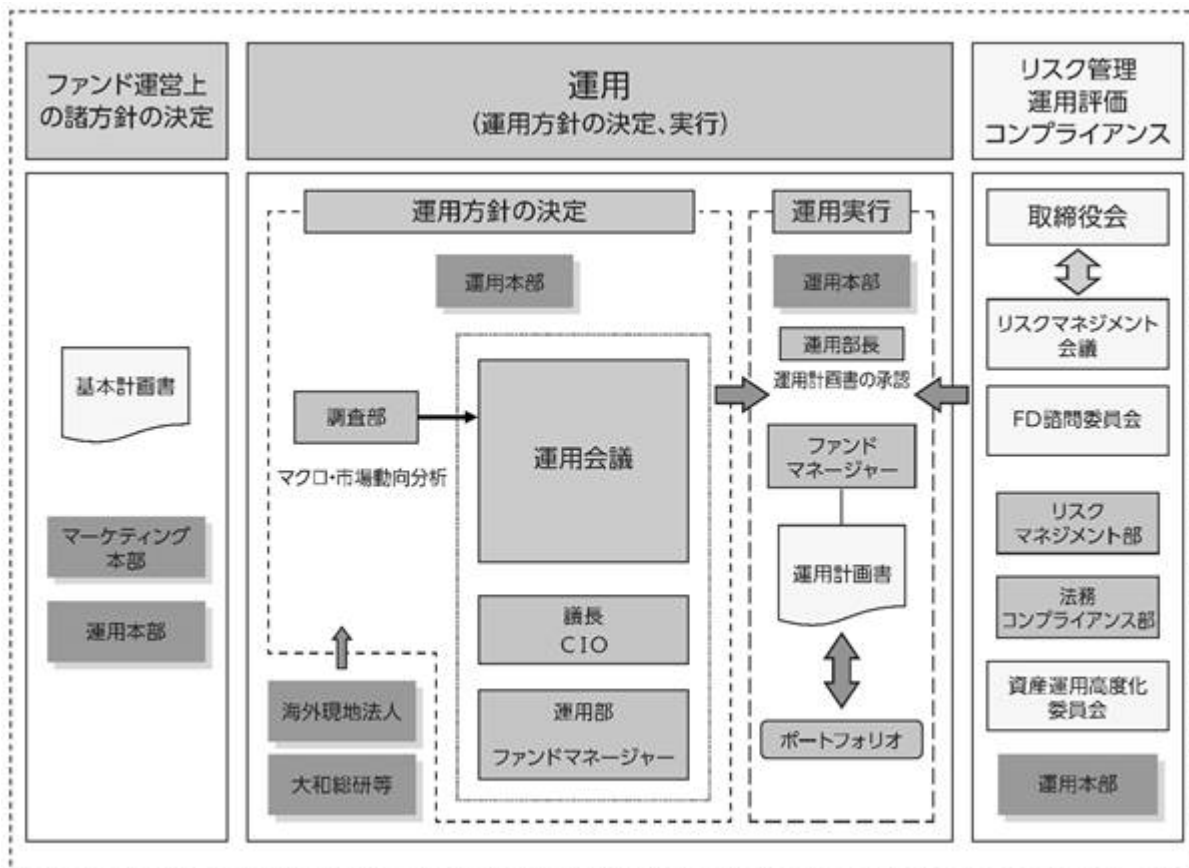
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

### (3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



## 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

### イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を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。

## リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体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部署の人員は40～50名程度です。

### イ．リスクマネジメント会議

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

### ロ．FD諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、ファンド組成・運用に関わる会議体等に対する牽制に資する事項について、取締役会に意見を述べます。

### ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

### 受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2021年4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、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとし、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、

##### 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、

ロ．前イ．に定める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、

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

### 3 【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

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

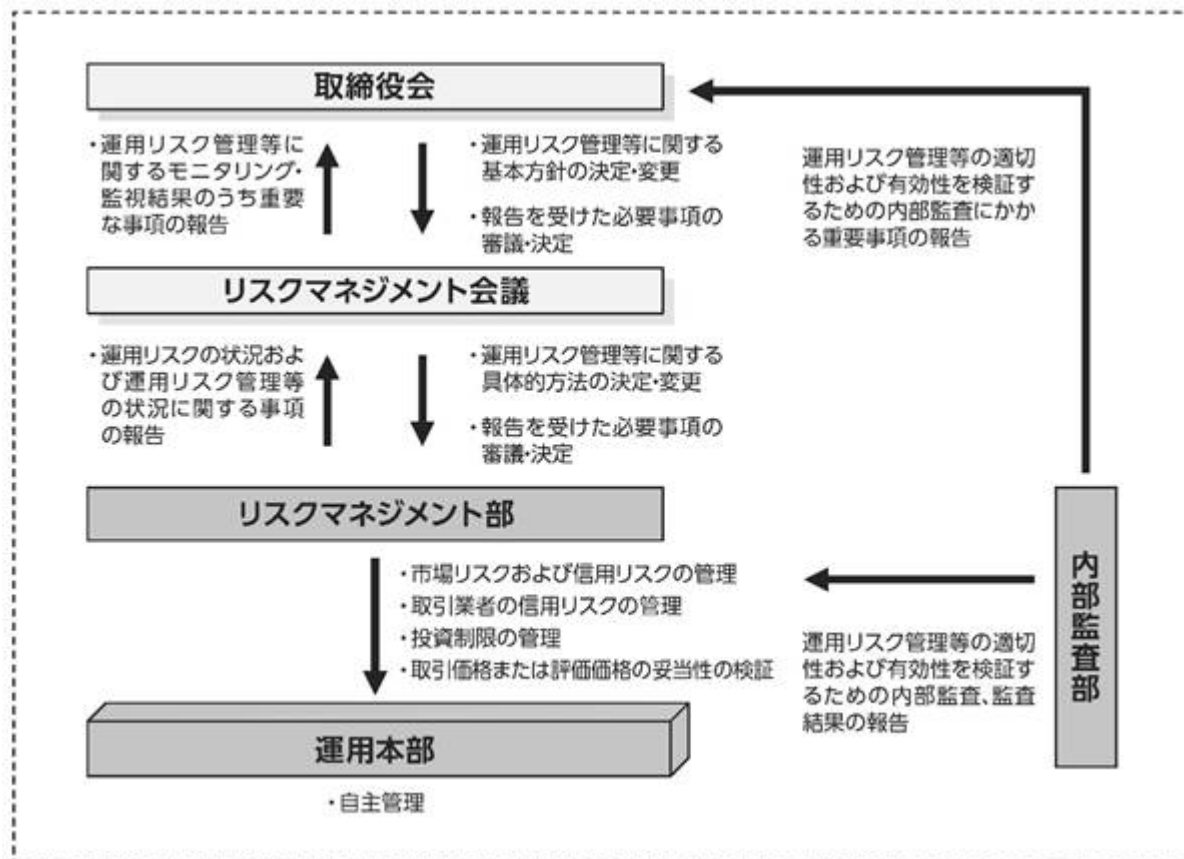
#### (2) その他の留意点

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

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

#### (3) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

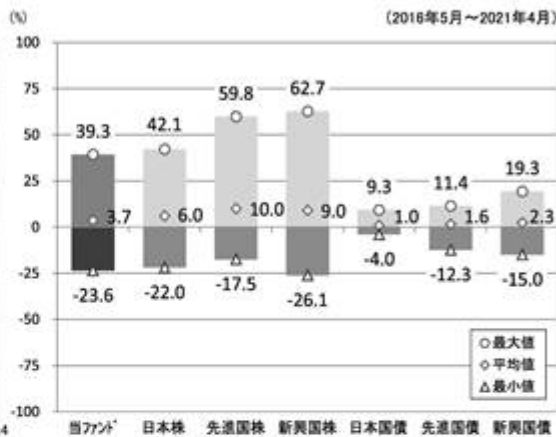
## 参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

### ※資産クラスについて

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

### ※指数について

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

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

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



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

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

## (2) 【換金(解約)手数料】

### 換金手数料

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

販売会社については、前(1)をご参照下さい。

信託財産留保額

ありません。

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

## (3) 【信託報酬等】

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

イ．信託財産の純資産総額に年率0.066%（税抜0.06%）以内を乗じて得た額

委託会社 年率0.04%（税抜）以内

受託会社 年率0.02%（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。

\* 毎年5月に率および委託会社、受託会社の配分を見直します。

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0.066%（税抜0.06%）

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0.04%（税抜）

受託会社 年率0.02%（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、年間165万円（税抜150万円）を下回る場合は、165万円（税抜150万円））となります。

\* 提出日現在、上場に係る費用は以下となります。

・年間上場料：毎年末の純資産総額に対して、最大0.00825%（税抜0.0075%）

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

信託財産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4月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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



## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】 (2021年4月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	15,951,450,780	98.57
内 日本	15,951,450,780	98.57
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	231,369,876	1.43
純資産総額	16,182,820,656	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	228,180,000	1.41
内 日本	228,180,000	1.41

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

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

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

## (2) 【投資資産】 (2021年4月30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	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
					また は 額面金額			
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	62,300	8,418.00 524,441,400	8,127.00 506,312,100	3.13
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	47,900	9,934.64 475,869,700	9,885.00 473,491,500	2.93
3	ソニーグループ	日本	株式	電気機 器	38,500	12,187.33 469,212,500	10,900.00 419,650,000	2.59
4	キーエンス	日本	株式	電気機 器	6,100	51,670.00 315,187,000	52,520.00 320,372,000	1.98

5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	414,400	582.88 241,547,040	578.00 239,523,200	1.48
6	任天堂	日本	株式	その他 製品	3,500	64,646.57 226,263,000	62,690.00 219,415,000	1.36
7	リクルートホールディングス	日本	株式	サービ ス業	42,200	5,197.52 219,335,600	4,939.00 208,425,800	1.29
8	信越化学	日本	株式	化学	11,200	19,631.65 219,874,500	18,450.00 206,640,000	1.28
9	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	70,400	2,842.69 200,125,700	2,755.00 193,952,000	1.20
10	日本電産	日本	株式	電気機 器	14,700	14,116.39 207,511,000	12,655.00 186,028,500	1.15
11	武田薬品	日本	株式	医薬品	51,000	3,741.05 190,794,000	3,635.00 185,385,000	1.15
12	ダイキン工業	日本	株式	機械	7,700	22,685.58 174,679,000	21,930.00 168,861,000	1.04
13	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	3,400	49,632.35 168,750,000	48,320.00 164,288,000	1.02
14	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	48,400	3,475.51 168,214,900	3,306.00 160,010,400	0.99
15	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	42,000	3,867.52 162,436,000	3,802.00 159,684,000	0.99
16	日立	日本	株式	電気機 器	29,500	5,125.62 151,206,000	5,381.00 158,739,500	0.98
17	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	48,400	3,221.94 155,942,300	3,232.00 156,428,800	0.97
18	村田製作所	日本	株式	電気機 器	17,900	9,087.99 162,675,100	8,703.00 155,783,700	0.96
19	HOYA	日本	株式	精密機 器	12,100	13,666.23 165,361,500	12,435.00 150,463,500	0.93
20	第一三共	日本	株式	医薬品	52,600	2,981.92 156,849,300	2,787.00 146,596,200	0.91
21	伊藤忠	日本	株式	卸売業	42,300	3,487.78 147,533,500	3,408.00 144,158,400	0.89
22	ファナック	日本	株式	電気機 器	5,300	27,941.60 148,090,500	25,175.00 133,427,500	0.82
23	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	82,100	1,556.95 127,826,386	1,535.00 126,023,500	0.78
24	SMC	日本	株式	機械	1,800	66,646.66 119,964,000	63,450.00 114,210,000	0.71

25	三井物産	日本	株式	卸売業	49,100	2,288.40 112,360,700	2,303.50 113,101,850	0.70
26	三菱商事	日本	株式	卸売業	36,900	3,041.94 112,247,800	3,020.00 111,438,000	0.69
27	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	23,700	4,340.82 102,877,600	4,699.00 111,366,300	0.69
28	東京海上HD	日本	株式	保険業	20,000	5,221.48 104,429,600	5,230.00 104,600,000	0.65
29	三菱電機	日本	株式	電気機器	61,500	1,663.64 102,314,100	1,682.00 103,443,000	0.64
30	花王	日本	株式	化学	14,600	7,309.38 106,717,000	7,007.00 102,302,200	0.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.57%
合計	98.57%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.17%
建設業	2.35%
食料品	3.24%
繊維製品	0.48%
パルプ・紙	0.24%
化学	7.33%
医薬品	5.15%
石油・石炭製品	0.42%
ゴム製品	0.61%
ガラス・土石製品	0.81%
鉄鋼	0.81%
非鉄金属	0.76%
金属製品	0.63%
機械	5.62%
電気機器	17.68%
輸送用機器	7.05%

精密機器	2.54%
その他製品	2.40%
電気・ガス業	1.27%
陸運業	3.32%
海運業	0.27%
空運業	0.45%
倉庫・運輸関連業	0.17%
情報・通信業	9.39%
卸売業	4.71%
小売業	4.58%
銀行業	4.98%
証券、商品先物取引業	0.82%
保険業	1.84%
その他金融業	1.09%
不動産業	1.94%
サービス業	5.36%
合計	98.57%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 030 6月	買建	12	235,200,000	228,180,000	1.41%

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

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)	東京証券取 引所 市場相場
2020年11月末日	18,439,947,245	-	1,755.4	-	1,758



12月末日	18,986,054,541	-	1,807.4	-	1,808
2021年1月末日	19,017,747,675	-	1,810.4	-	1,808
2月末日	19,609,495,430	-	1,866.7	-	1,865
3月末日	14,888,363,129	-	1,972.9	-	1,975
第1特定期間末 (2021年4月10日)	14,792,923,808	14,928,758,252	1,960.3	1,978.3	1,959
4月末日	16,182,820,656	-	1,899.3	-	1,897

(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特定期間	19.0

#### 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	19.3

#### (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	11,479,864	3,933,506

(注) 当初設定数量は6,179,514口です。

(参考情報) 運用実績

## ● iFreeETF TOPIX (年4回決算型)

2021年4月30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	18,993円
純資産総額	161億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-2.8%
3カ月間	5.9%
6カ月間	-
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	15.6%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 190円		設定来分配金合計額: 190円	
	第1期 21年1月	第2期 21年4月		
分配金	10円	180円		

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

## 主要な資産の状況

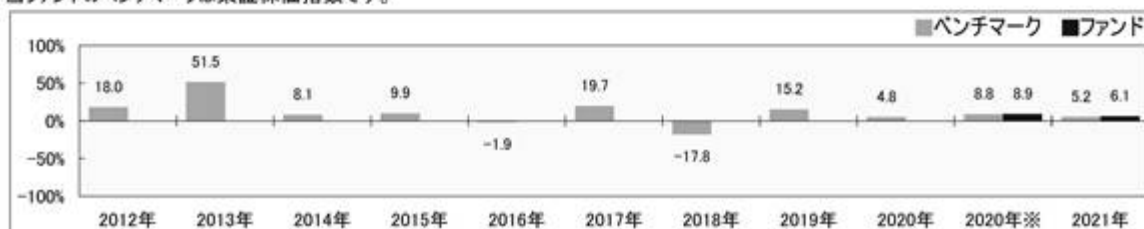
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,176	98.6%	電気機器	17.7%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.1%
国内株式先物	1	1.4%	情報・通信業	9.4%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.9%
不動産投資信託等	-	-	化学	7.3%	ソニーグループ	電気機器	2.6%
コール・ローン、その他	-	1.4%	輸送用機器	7.1%	キーエンス	電気機器	2.0%
合計	2,177	-	機械	5.6%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.5%
株式市場・上場別構成			サービス業	5.4%	TOPIX先物 0306月	-	1.4%
一部(東証・名証)		98.6%	医薬品	5.2%	任天堂	その他製品	1.4%
二部(東証・名証)		-	銀行業	5.0%	リクルートホールディングス	サービス業	1.3%
新興市場他		-	卸売業	4.7%	信越化学	化学	1.3%
その他		-	その他	31.3%	日本電信電話	情報・通信業	1.2%
合計		98.6%	合計	98.6%	合計		18.6%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。



・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。

・2020年※は設定日(11月9日)から年末、2021年は4月30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、）に、当該自社株式等を信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該金額に別に定める率を乗じて得た額を加算して得た金額の金銭をもって取得することができるものとします。

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

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

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

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

ないものとし、担保金が差入れられた場合には、委託会社は信託財産への担保金の受入れの指図を行なうものとします。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、前 に定める株式（前 、前 および前 に該当する場合の金銭を含みます。）または前 に定める担保金の引渡しと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。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、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、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.または2.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るとき

販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続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を行ないます。当該抹消にかかる手続および後 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10口当たりの価額をいいます。

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

#### （注）主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（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4月10日まで、4月11日から7月10日まで、7月11日から10月10日まで、および10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、2020年11月9日から2021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100万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。

#### 収益分配金および償還金の支払い

##### <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。
4. 社振法関係法令等に基づき、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益権の名義登録の手続きは原則として以下のとおりとします。
  - イ. 受益権は、前3.の取引参加者の振替口座簿に口数が記載または記録されることにより、当該振替口座簿に記載または記録された口数に応じた受益権が帰属します。
  - ロ. 前3.の取引参加者は、計算期間終了日までに当該取引参加者にかかる前イ.の受益権の受益者の氏名もしくは名称および住所その他受託会社が定める事項を書面等により受託会社に届出のものとします。また、届出た内容に変更が生じた場合は、当該取引参加者所定の方法による当該受益者からの申出に基づき、当該取引参加者はこれを受託会社に通知するものとします。

- 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、
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、
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、
7. 償還は、信託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「信託終了時受益者」といいます。）を信託終了日現在における受益者として、当該信託終了時受益者に、信託終了時の信託財産の純資産総額に相当する金銭を支払うことにより行ない、
8. 信託終了時受益者に交付する金銭の額は、信託終了時の基準価額（信託終了時の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。）に、当該信託終了時受益者に属する受益権の口数を乗じた額とします。なお、この場合における税法上の受益権1口あたり元本の額は、信託終了時において信託されている金額を受益権総口数で除した金額とします。
9. 前7.に規定する償還金の支払いは、原則として受託会社が、信託終了後40日以内の委託会社の指定する日から行なうものとし、信託終了時受益者は、受託会社から送付される領収書をゆうちょ銀行に持ち込む方式や受託会社から振り込まれる預金口座等をあらかじめ指定する方式などにより償還金を受領できます。
10. 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または支払開始日から10年経過した後に償還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、
11. 受託会社は、前10.の規定により委託会社に収益分配金または償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。
12. 受益者が、収益分配金については前6.に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに償還金については前9.に規定する支払開始日から10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。

#### 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か月未満であるため、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、当特定期間（2020年11月9日から2021年4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】

iFreeETF TOPIX(年4回決算型)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

		当 期 2021年4月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		260,820,300
株式	2	14,538,519,123
派生商品評価勘定		3,761,700
未収入金		4,577,300
未収配当金		133,693,277
流動資産合計		14,941,371,700
資産合計		14,941,371,700
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,158,850
前受金		5,630,000
未払収益分配金		135,834,444
未払受託者報酬		975,110
未払委託者報酬		1,950,194
未払利息		200
その他未払費用		2,899,094
流動負債合計		148,447,892
負債合計		148,447,892
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1	12,519,407,922
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		2,273,515,886
(分配準備積立金)		5,067,551
元本等合計		14,792,923,808
純資産合計		14,792,923,808
負債純資産合計		14,941,371,700

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当 期
	自 2020年11月9日
	至 2021年4月10日
<b>営業収益</b>	
受取配当金	159,521,519
受取利息	890
有価証券売買等損益	2,768,486,009
派生商品取引等損益	23,459,750
その他収益	1,450
<b>営業収益合計</b>	<b>2,951,469,618</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	28,171
受託者報酬	1,661,610
委託者報酬	3,323,196
その他費用	1 3,104,014
<b>営業費用合計</b>	<b>8,116,991</b>
<b>営業利益</b>	<b>2,943,352,627</b>
<b>経常利益</b>	<b>2,943,352,627</b>
<b>当期純利益</b>	<b>2,943,352,627</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>502,202,982</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	502,202,982
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>1,025,700,406</b>
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,025,700,406
<b>分配金</b>	<b>2 146,339,317</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>2,273,515,886</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 2020年11月9日	至 2021年4月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>特定期間</p> <p>当ファンドの当特定期間は、2020年11月9日から2021年4月10日までとなっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	当 期	
	2021年4月10日現在	
1. 1 期首元本額	10,251,813,726円	
期中追加設定元本額	8,793,280,650円	
期中一部交換元本額	6,525,686,454円	



2.	特定期間末日における受益権の総数		7,546,358口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。	
		株式	113,459,000円

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

区 分		当 期 自 2020年11月9日 至 2021年4月10日
1.	1 その他費用	主に、対象指数の商標の使用料であります。
2.	2 分配金の計算過程	<p>(自2020年11月9日 至2021年1月10日)</p> <p>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(24,101,707円)及び分配準備積立金(0円)の合計額から、経費(3,251,433円)を控除して計算される分配対象額は20,850,274円(10口当たり19円)であり、うち10,504,873円(10口当たり10円)を分配金額としております。</p> <p>(自2021年1月11日 至2021年4月10日)</p> <p>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(135,393,981円)及び分配準備積立金(10,345,401円)の合計額から、経費(4,837,387円)を控除して計算される分配対象額は140,901,995円(10口当たり186円)であり、うち135,834,444円(10口当たり180円)を分配金額としております。</p>

## ( 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	当 期 自 2020年11月9日 至 2021年4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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>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。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 2021年4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	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	当 期 2021年4月10日現在

種 類	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	652,795,498
合計	652,795,498

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 株式関連

種 類	当 期			
	2021年4月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数先物取引				
買  建	252,190,000	-	254,800,000	2,610,000
合計	252,190,000	-	254,800,000	2,610,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として特定期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、特定期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

当 期
自 2020年11月9日
至 2021年4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)

当 期
2021年4月10日現在

1口当たり純資産額 (10口当たり純資産額)	1,960.3円 (19,603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	100	2,988.00	298,800	
日本水産	6,900	529.00	3,650,100	
マルハニチロ	1,200	2,601.00	3,121,200	
ハウスイ	100	995.00	99,500	
雪国まいたけ	500	1,923.00	961,500	
カネコ種苗	100	1,657.00	165,700	
サカタのタネ	900	4,060.00	3,654,000	
ホクト	600	2,035.00	1,221,000	
ホクリヨウ	200	704.00	140,800	
ヒノキヤグループ	300	2,500.00	750,000	
ショーボンドHD	1,000	4,895.00	4,895,000	
ミライト・ホールディングス	2,500	1,836.00	4,590,000	
タマホーム	500	2,249.00	1,124,500	
サンヨーホームズ	100	767.00	76,700	
日本アクア	200	606.00	121,200	
ファーストコーポレーション	100	792.00	79,200	
ベステラ	200	1,737.00	347,400	
ROBOT HOME	1,300	188.00	244,400	
キャンディル	200	552.00	110,400	
スペースバリューHD	1,000	799.00	799,000	
住石ホールディングス	1,400	117.00	163,800	
日鉄鉱業	200	6,610.00	1,322,000	
三井松島HLDGS	200	942.00	188,400	
INPEX	26,900	754.00	20,282,600	
石油資源開発	800	2,065.00	1,652,000	
K&Oエナジーグループ	300	1,442.00	432,600	
ダイセキ環境ソリューション	200	911.00	182,200	
第一カッター興業	300	1,517.00	455,100	
明豊ファシリティワークス	100	667.00	66,700	
安藤・間	4,600	864.00	3,974,400	
東急建設	2,100	575.00	1,207,500	

コムシスホールディングス	2,600	3,535.00	9,191,000
ピーアールホールディングス	900	589.00	530,100
高松コンストラクショング P	500	2,197.00	1,098,500
東建コーポレーション	100	10,770.00	1,077,000
ソネック	100	848.00	84,800
ヤマウラ	200	921.00	184,200
オリエンタル白石	2,400	310.00	744,000
大成建設	5,300	4,230.00	22,419,000
大 林 組	16,900	1,063.00	17,964,700
清水建設	15,800	904.00	14,283,200
飛鳥建設	600	1,143.00	685,800
長谷工コーポレーション	5,500	1,614.00	8,877,000
松井建設	600	734.00	440,400
銭 高 組	100	4,875.00	487,500
鹿島建設	12,600	1,548.00	19,504,800
不動テトラ	500	1,958.00	979,000
大末建設	100	935.00	93,500
鉄建建設	300	1,874.00	562,200
西松建設	1,300	2,778.00	3,611,400
三井住友建設	4,200	486.00	2,041,200
大豊建設	300	3,995.00	1,198,500
前田建設	4,400	971.00	4,272,400
佐田建設	300	441.00	132,300
ナカノフドー建設	500	381.00	190,500
奥 村 組	800	2,862.00	2,289,600
東鉄工業	700	2,592.00	1,814,400
イチケン	200	2,013.00	402,600
富士ピー・エス	100	598.00	59,800
浅沼組	300	4,595.00	1,378,500
戸田建設	7,000	807.00	5,649,000
熊 谷 組	800	3,040.00	2,432,000
北野建設	100	2,537.00	253,700
植 木 組	200	1,505.00	301,000
矢作建設	800	827.00	661,600
ピーエス三菱	700	670.00	469,000
日本ハウスH L D G S	1,200	335.00	402,000
大東建託	1,800	12,840.00	23,112,000
新日本建設	700	856.00	599,200
N I P P O	1,400	3,035.00	4,249,000
東亜道路	100	4,225.00	422,500

前田道路	1,000	2,185.00	2,185,000
日本道路	200	8,050.00	1,610,000
東亜建設	500	2,432.00	1,216,000
日本国土開発	1,700	618.00	1,050,600
若築建設	200	1,329.00	265,800
東洋建設	2,000	567.00	1,134,000
五洋建設	7,300	893.00	6,518,900
世紀東急	800	896.00	716,800
福田組	100	5,190.00	519,000
日本ドライケミカル	200	1,687.00	337,400
住友林業	3,900	2,494.00	9,726,600
日本基礎技術	600	521.00	312,600
巴コーポレーション	800	399.00	319,200
大和ハウス	15,700	3,268.00	51,307,600
ライト工業	900	1,854.00	1,668,600
積水ハウス	18,500	2,374.50	43,928,250
日特建設	500	810.00	405,000
北陸電気工事	200	1,171.00	234,200
ユアテック	900	791.00	711,900
日本リーテック	300	1,904.00	571,200
四電工	100	2,890.00	289,000
中電工	800	2,384.00	1,907,200
関電工	2,900	954.00	2,766,600
きんでん	3,600	1,898.00	6,832,800
東京エネシス	500	912.00	456,000
トーエネック	200	3,810.00	762,000
住友電設	600	2,481.00	1,488,600
日本電設工業	1,000	1,948.00	1,948,000
協和エクシオ	2,500	2,995.00	7,487,500
新日本空調	500	2,333.00	1,166,500
日本工営	300	3,045.00	913,500
九電工	1,300	4,195.00	5,453,500
三機工業	1,300	1,430.00	1,859,000
日揮ホールディングス	5,700	1,315.00	7,495,500
中外炉工業	300	2,089.00	626,700
ヤマト	700	649.00	454,300
太平電業	400	2,671.00	1,068,400
高砂熱学	1,600	1,683.00	2,692,800
三晃金属	100	2,838.00	283,800
NECネットエスアイ	1,700	1,897.00	3,224,900

朝日工業社	200	2,979.00	595,800
明星工業	1,000	772.00	772,000
大 気 社	900	3,095.00	2,785,500
ダイダン	400	2,875.00	1,150,000
日比谷総合設備	700	1,916.00	1,341,200
ニッポン	1,600	1,613.00	2,580,800
日清製粉G本社	6,200	1,829.00	11,339,800
日東富士製粉	100	7,260.00	726,000
昭和産業	500	3,030.00	1,515,000
鳥越製粉	600	826.00	495,600
中部飼料	600	1,418.00	850,800
フィード・ワン	700	893.00	625,100
東洋精糖	100	1,208.00	120,800
日本甜菜糖	200	1,619.00	323,800
DM三井製糖ホールディ	500	1,865.00	932,500
塩水港精糖	600	234.00	140,400
日新製糖	200	1,807.00	361,400
L I F U L L	1,700	404.00	686,800
ミクシィ	900	2,840.00	2,556,000
ジェイエイシーリクルートメント	300	1,800.00	540,000
日本M&Aセンター	8,600	3,030.00	26,058,000
メンバーズ	200	2,664.00	532,800
中広	100	342.00	34,200
UTグループ	700	3,710.00	2,597,000
アイティメディア	200	1,974.00	394,800
タケエイ	500	1,301.00	650,500
E・Jホールディングス	300	1,098.00	329,400
夢真ビーネックスグループ	600	1,457.00	874,200
コシダカホールディングス	1,300	608.00	790,400
アルトナー	200	825.00	165,000
パソナグループ	500	1,881.00	940,500
C D S	200	1,501.00	300,200
リンクアンドモチベーション	800	662.00	529,600
G C A	600	839.00	503,400
エス・エム・エス	1,700	3,415.00	5,805,500
サニーサイドアップG	300	784.00	235,200
パーソルホールディングス	5,200	2,140.00	11,128,000
リニカル	200	760.00	152,000
クックパッド	1,700	314.00	533,800
エスクリ	200	409.00	81,800

アイ・ケイ・ケイ	200	717.00	143,400
森永製菓	1,400	3,850.00	5,390,000
中村屋	200	3,850.00	770,000
江崎グリコ	1,500	4,365.00	6,547,500
名糖産業	100	1,500.00	150,000
井村屋グループ	200	2,500.00	500,000
不二家	300	2,218.00	665,400
山崎製パン	4,000	1,731.00	6,924,000
第一屋製パン	100	971.00	97,100
モロゾフ	100	5,740.00	574,000
亀田製菓	200	4,710.00	942,000
寿スピリッツ	600	7,200.00	4,320,000
カルビー	2,400	2,791.00	6,698,400
森永乳業	900	5,660.00	5,094,000
六甲バター	300	1,650.00	495,000
ヤクルト	3,700	5,600.00	20,720,000
明治ホールディングス	3,500	6,940.00	24,290,000
雪印メグミルク	1,200	2,246.00	2,695,200
プリマハム	800	3,515.00	2,812,000
日本ハム	2,000	4,940.00	9,880,000
林兼産業	300	654.00	196,200
丸大食品	700	1,683.00	1,178,100
S Foods	600	3,650.00	2,190,000
柿安本店	300	2,584.00	775,200
伊藤ハム米久HLDGS	3,600	720.00	2,592,000
学情	300	1,529.00	458,700
スタジオアリス	200	2,272.00	454,400
クロスキャット	200	1,098.00	219,600
シミックホールディングス	200	1,541.00	308,200
エプロ	200	971.00	194,200
システナ	2,000	2,427.00	4,854,000
NJS	200	2,074.00	414,800
デジタルアーツ	200	10,010.00	2,002,000
日鉄ソリューションズ	800	3,730.00	2,984,000
総合警備保障	2,000	5,090.00	10,180,000
キューブシステム	200	1,200.00	240,000
いちご	5,900	315.00	1,858,500
エイジア	100	1,780.00	178,000
日本駐車場開発	5,300	159.00	842,700
コア	100	1,493.00	149,300



カカクコム	3,900	3,120.00	12,168,000
アイロムグループ	300	2,434.00	730,200
セントケア・ホールディング	300	1,260.00	378,000
サイネックス	100	690.00	69,000
ルネサンス	300	1,164.00	349,200
ディップ	800	2,868.00	2,294,400
S B Sホールディングス	500	2,699.00	1,349,500
デジタルホールディングス	300	2,005.00	601,500
新日本科学	600	711.00	426,600
ツクイホールディングス	1,300	921.00	1,197,300
キャリアデザインセンター	200	1,080.00	216,000
ベネフィット・ワン	1,900	2,839.00	5,394,100
エムスリー	9,200	8,097.00	74,492,400
ツカダ・グローバルHOLD	500	342.00	171,000
プラス	100	577.00	57,700
アウトソーシング	3,000	1,757.00	5,271,000
ウェルネット	600	589.00	353,400
ワールドホールディングス	200	2,873.00	574,600
ディー・エヌ・エー	2,200	2,219.00	4,881,800
博報堂D Y H L D G S	7,300	1,819.00	13,278,700
ぐるなび	1,000	590.00	590,000
タカミヤ	600	561.00	336,600
ジャパンベストレスキューS	500	821.00	410,500
ファンコミュニケーションズ	1,400	410.00	574,000
ライク	200	2,064.00	412,800
ビジネス・ブレークスルー	100	455.00	45,500
エスプール	1,300	1,068.00	1,388,400
W D Bホールディングス	100	2,514.00	251,400
手間いらず	100	5,670.00	567,000
ティア	200	484.00	96,800
C D G	100	1,565.00	156,500
アドウェイズ	600	821.00	492,600
バリューコマース	300	3,785.00	1,135,500
インフォマート	5,200	1,015.00	5,278,000
サッポロホールディングス	1,800	2,276.00	4,096,800
アサヒグループホールディン	11,900	4,757.00	56,608,300
麒麟HD	23,000	2,050.00	47,150,000
宝ホールディングス	4,000	1,513.00	6,052,000
オエノンホールディングス	1,600	399.00	638,400
養命酒	200	1,856.00	371,200

コカ・コーラボトラーズJHD	4,200	1,775.00	7,455,000
サントリー食品インター	3,600	3,920.00	14,112,000
ダイドーグループHD	200	5,240.00	1,048,000
伊藤園	1,700	6,410.00	10,897,000
キーコーヒー	600	2,097.00	1,258,200
ユニカフェ	200	1,025.00	205,000
ジャパンフーズ	100	1,228.00	122,800
日清オイリオグループ	700	3,165.00	2,215,500
不二製油グループ	1,300	2,947.00	3,831,100
かどや製油	100	4,040.00	404,000
J-オイルミルズ	400	1,896.00	758,400
ローソン	1,300	5,060.00	6,578,000
サンエー	500	4,500.00	2,250,000
カワチ薬品	300	2,775.00	832,500
エービーシー・マート	900	6,090.00	5,481,000
ハードオフコーポレーション	100	783.00	78,300
高千穂交易	100	1,113.00	111,300
アスクル	600	4,135.00	2,481,000
ゲオホールディングス	700	1,185.00	829,500
アダストリア	700	1,942.00	1,359,400
ジーフット	300	408.00	122,400
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	408.00	40,800
オルバヘルスケアHLDGS	100	1,669.00	166,900
伊藤忠食品	200	5,380.00	1,076,000
くら寿司	200	8,290.00	1,658,000
キャンドゥ	200	2,080.00	416,000
エレマテック	500	1,014.00	507,000
アイケイ	200	867.00	173,400
パルグループHLDGS	600	1,559.00	935,400
JALUX	200	1,663.00	332,600
エディオン	2,300	1,189.00	2,734,700
あらた	500	4,650.00	2,325,000
サーラコーポレーション	1,000	614.00	614,000
ワッツ	100	922.00	92,200
トーマンデバイス	100	4,190.00	419,000
ハローズ	100	2,851.00	285,100
JPホールディングス	1,500	311.00	466,500
フジオフードG本社	500	1,409.00	704,500
あみやき亭	200	2,894.00	578,800
東京エレクトロニクスデバイス	200	4,605.00	921,000

ひらまつ	900	157.00	141,300
フィールズ	600	560.00	336,000
双日	29,500	308.00	9,086,000
アルフレッサホールディングス	5,500	2,120.00	11,660,000
大黒天物産	200	7,710.00	1,542,000
ハニーズホールディングス	500	1,080.00	540,000
ファーマライズHD	200	808.00	161,600
キッコーマン	4,000	6,630.00	26,520,000
味の素	12,800	2,220.00	28,416,000
ブルドックソース	100	2,465.00	246,500
キューピー	3,000	2,581.00	7,743,000
ハウス食品G本社	2,200	3,650.00	8,030,000
カゴメ	2,200	3,370.00	7,414,000
焼津水産化工	200	986.00	197,200
アリアケジャパン	600	6,670.00	4,002,000
ピエトロ	100	1,803.00	180,300
エバラ食品工業	200	2,631.00	526,200
やまみ	100	2,102.00	210,200
ニチレイ	2,500	2,837.00	7,092,500
横浜冷凍	1,400	905.00	1,267,000
東洋水産	2,700	4,655.00	12,568,500
イトアンドHLDGS	300	1,976.00	592,800
大冷	100	1,951.00	195,100
ヨシムラ・フード・HLDGS	200	952.00	190,400
日清食品HD	2,100	8,100.00	17,010,000
永谷園ホールディングス	200	2,255.00	451,000
一正蒲鉾	100	1,292.00	129,200
フジッコ	500	1,933.00	966,500
ロックフィールド	500	1,643.00	821,500
日本たばこ産業	29,200	2,075.50	60,604,600
ケンコーマヨネーズ	300	1,811.00	543,300
わらべや日洋HD	300	1,689.00	506,700
なとり	200	1,940.00	388,000
イフジ産業	100	941.00	94,100
ピクルスコーポレーション	200	3,195.00	639,000
ファーマフーズ	500	3,310.00	1,655,000
北の達人コーポ	2,000	670.00	1,340,000
ユーグレナ	2,400	995.00	2,388,000
スター・マイカ・HLDGS	200	1,243.00	248,600
SREホールディングス	100	5,090.00	509,000

A Dワークスグループ	900	163.00	146,700	
片倉工業	700	1,525.00	1,067,500	
グ ン ゼ	400	4,055.00	1,622,000	
ヒューリック	11,400	1,286.00	14,660,400	
神 栄	100	1,253.00	125,300	
ラサ商事	200	915.00	183,000	
アルペン	500	2,530.00	1,265,000	
ハブ	200	708.00	141,600	
ラクーンホールディングス	300	2,984.00	895,200	
クオールホールディングス	700	1,530.00	1,071,000	
アルコニックス	500	1,598.00	799,000	
神戸物産	3,700	2,966.00	10,974,200	
ソリトンシステムズ	200	1,724.00	344,800	
ジンズホールディングス	200	8,430.00	1,686,000	
ビックカメラ	3,200	1,277.00	4,086,400	
D C Mホールディングス	3,200	1,140.00	3,648,000	
ペッパーフードサービス	600	298.00	178,800	
ハイパー	100	554.00	55,400	
M o n o t a R O	7,600	3,055.00	23,218,000	
東京一番フーズ	200	591.00	118,200	
D Dホールディングス	100	579.00	57,900	
あい ホールディングス	800	2,173.00	1,738,400	
ディーブイエックス	200	1,030.00	206,000	
きちりホールディングス	200	578.00	115,600	
アークランドサービスHD	500	2,297.00	1,148,500	
J . フロント リテイリング	6,400	1,011.00	6,470,400	
ドトール・日レスHD	900	1,704.00	1,533,600	
マツモトキヨシH L D G S	2,200	4,665.00	10,263,000	
ブロンコビリー	200	2,398.00	479,600	
Z O Z O	3,200	3,485.00	11,152,000	
トレジャー・ファクトリー	200	1,066.00	213,200	
物語コーポレーション	200	7,740.00	1,548,000	
ココカラファイン	600	8,030.00	4,818,000	
三越伊勢丹HD	9,400	734.00	6,899,600	
東洋紡	2,000	1,414.00	2,828,000	
ユニチカ	1,600	404.00	646,400	
富士紡ホールディングス	200	4,360.00	872,000	
日清紡ホールディングス	3,200	861.00	2,755,200	
倉敷紡績	600	1,860.00	1,116,000	
ダイワボウHD	3,000	1,726.00	5,178,000	

シキボウ	200	982.00	196,400
日東紡績	800	3,890.00	3,112,000
トヨタ紡織	1,600	1,888.00	3,020,800
マクニカ・富士エレHLDGS	1,400	2,257.00	3,159,800
Hamee	200	1,774.00	354,800
ラクト・ジャパン	100	2,750.00	275,000
ウエルシアHD	2,800	3,610.00	10,108,000
クリエイトSDH	800	3,540.00	2,832,000
グリムス	200	1,979.00	395,800
バイタルKSKHD	1,000	740.00	740,000
八洲電機	500	967.00	483,500
メディアスホールディングス	200	930.00	186,000
レスターホールディングス	700	2,013.00	1,409,100
ジューテックHD	200	1,011.00	202,200
丸善CHI HD	600	394.00	236,400
大光	100	698.00	69,800
OCHIホールディングス	200	1,300.00	260,000
TOKAIホールディングス	2,500	929.00	2,322,500
黒谷	200	795.00	159,000
ミサワ	200	719.00	143,800
ティーライフ	100	1,398.00	139,800
Cominix	100	764.00	76,400
エー・ピーホールディングス	100	452.00	45,200
三洋貿易	700	1,106.00	774,200
チムニー	200	1,262.00	252,400
シュッピン	300	1,132.00	339,600
ビューティガレージ	100	3,920.00	392,000
オイシックス・ラ・大地	600	2,979.00	1,787,400
ウイン・パートナーズ	400	1,033.00	413,200
ネクステージ	1,000	1,858.00	1,858,000
ジョイフル本田	1,600	1,417.00	2,267,200
鳥貴族ホールディングス	200	1,665.00	333,000
ホットランド	500	1,299.00	649,500
すかいらくHD	6,000	1,689.00	10,134,000
SFPホールディングス	200	1,426.00	285,200
綿半ホールディングス	500	1,280.00	640,000
日本毛織	1,600	1,017.00	1,627,200
ダイトウボウ	900	110.00	99,000
トーア紡コーポレーション	100	474.00	47,400
ダイドーリミテッド	700	184.00	128,800

ヨシックス	100	2,196.00	219,600
ユナイテッド・スーパーマーケ	1,600	1,174.00	1,878,400
三栄建築設計	100	2,013.00	201,300
野村不動産HLDGS	3,200	2,642.00	8,454,400
三重交通グループHD	1,000	479.00	479,000
サムティ	800	1,997.00	1,597,600
ディア・ライフ	800	465.00	372,000
コーセーアールイー	200	623.00	124,600
日本商業開発	300	1,718.00	515,400
プレサンスコーポレーション	900	1,758.00	1,582,200
フィル・カンパニー	100	2,275.00	227,500
THEグローバル社	300	265.00	79,500
ハウスコム	100	1,281.00	128,100
日本管理センター	200	1,299.00	259,800
サンセイランディック	200	886.00	177,200
エストラスト	100	714.00	71,400
フージャースHD	900	708.00	637,200
オープンハウス	1,600	4,895.00	7,832,000
東急不動産HD	14,500	641.00	9,294,500
飯田GHD	4,400	2,719.00	11,963,600
イーグランド	100	924.00	92,400
ムゲンエステート	300	504.00	151,200
帝国繊維	500	2,351.00	1,175,500
日本コークス工業	4,600	112.00	515,200
ゴルフダイジェスト・オン	200	1,367.00	273,400
ミタチ産業	200	681.00	136,200
B E E N O S	100	3,070.00	307,000
あさひ	500	1,520.00	760,000
日本調剤	300	1,737.00	521,100
コスモス薬品	700	16,570.00	11,599,000
シップヘルスケアHD	1,600	2,995.00	4,792,000
トーエル	200	945.00	189,000
ソフトクリエイトHD	100	2,716.00	271,600
オンリー	100	478.00	47,800
セブン&アイ・HLDGS	20,900	4,312.00	90,120,800
クリエイト・レストランツ・ホール	2,800	856.00	2,396,800
明治電機工業	300	1,436.00	430,800
ツルハホールディングス	1,200	13,590.00	16,308,000
デリカフーズHLDGS	100	641.00	64,100
スターティアホールディングス	100	1,244.00	124,400

サンマルクホールディングス	500	1,720.00	860,000
フェリシモ	200	1,260.00	252,000
トリドールホールディングス	1,300	1,690.00	2,197,000
帝人	5,100	1,848.00	9,424,800
東レ	38,500	680.60	26,203,100
クラレ	8,400	1,226.00	10,298,400
旭化成	35,200	1,232.50	43,384,000
サカイオーベックス	200	3,015.00	603,000
TOKYO BASE	600	737.00	442,200
稲葉製作所	200	1,531.00	306,200
宮地エンジニアリングG	200	2,334.00	466,800
トーカロ	1,300	1,538.00	1,999,400
アルファCO	300	1,152.00	345,600
SUMCO	6,900	2,824.00	19,485,600
川田テクノロジーズ	200	4,640.00	928,000
RS TECHNOLOGIES	200	7,050.00	1,410,000
ジェイテックコーポレーション	100	2,970.00	297,000
信和	200	820.00	164,000
ビーロット	200	684.00	136,800
ファーストブラザーズ	100	1,025.00	102,500
ハウズドゥ	200	1,116.00	223,200
シーアールイー	200	1,399.00	279,800
プロパティエージェント	100	2,218.00	221,800
ケイアイスター不動産	200	3,870.00	774,000
アグレ都市デザイン	100	999.00	99,900
グッドコムアセット	200	1,390.00	278,000
ジェイ・エス・ビー	100	3,150.00	315,000
テンポイノベーション	200	891.00	178,200
グローバルリンクマネジメント	100	968.00	96,800
住江織物	200	2,228.00	445,600
日本フェルト	200	446.00	89,200
イチカワ	100	1,374.00	137,400
エコナックホールディングス	800	95.00	76,000
日東製網	100	1,901.00	190,100
芦森工業	100	1,032.00	103,200
アツギ	500	545.00	272,500
ウイルプラスHLDGS	100	1,336.00	133,600
JMホールディングス	500	2,184.00	1,092,000
コメダホールディングス	1,200	1,962.00	2,354,400
サツドラホールディングス	100	2,290.00	229,000

アレンザホールディングス	200	1,380.00	276,000
串カツ田中HLDGS	200	1,913.00	382,600
バロックジャパン	300	794.00	238,200
クスリのアオキHLDGS	600	8,310.00	4,986,000
ダイニック	100	783.00	78,300
共和レザー	200	747.00	149,400
ピーバンドットコム	100	834.00	83,400
力の源HD	100	628.00	62,800
FOOD & LIFE COMPAN	2,900	5,340.00	15,486,000
アセンテック	200	1,635.00	327,000
セーレン	1,400	2,001.00	2,801,400
ソトー	100	820.00	82,000
東海染工	100	1,122.00	112,200
小松マテーレ	900	960.00	864,000
ワコールホールディングス	1,300	2,453.00	3,188,900
ホギメディカル	700	3,305.00	2,313,500
クラウドディアHLDGS	200	282.00	56,400
T S Iホールディングス	1,700	322.00	547,400
マツオカコーポレーション	200	1,922.00	384,400
ワールド	700	1,444.00	1,010,800
T I S	5,400	2,615.00	14,121,000
J N Sホールディングス	200	589.00	117,800
電算システム	100	3,315.00	331,500
グリー	3,200	579.00	1,852,800
コーエーテクモHD	1,300	5,200.00	6,760,000
三菱総合研究所	100	4,065.00	406,500
ボルテージ	200	643.00	128,600
電算	100	2,476.00	247,600
A G S	200	828.00	165,600
ファインデックス	500	1,152.00	576,000
ブレインパッド	200	5,350.00	1,070,000
K L a b	900	849.00	764,100
ポルトゥウィン・ピットクル	700	1,359.00	951,300
イーブックイニシアティブ	100	2,832.00	283,200
ネクソン	13,400	3,595.00	48,173,000
アイスタイル	1,700	476.00	809,200
エムアップホールディングス	200	3,185.00	637,000
エイチーム	300	1,717.00	515,100
エニグモ	600	1,427.00	856,200
テクノスジャパン	500	703.00	351,500



e n i s h	200	548.00	109,600
コロプラ	1,600	860.00	1,376,000
オルトプラス	300	525.00	157,500
ブロードリーフ	2,700	558.00	1,506,600
クロス・マーケティングG	100	529.00	52,900
デジタルハーツHLDGS	100	1,670.00	167,000
システム情報	500	1,072.00	536,000
メディアドゥ	100	7,030.00	703,000
じげん	1,200	426.00	511,200
ブイキューブ	200	2,950.00	590,000
エンカレッジ・テクノロジー	100	677.00	67,700
サイバーリンクス	200	1,670.00	334,000
ディー・エル・イー	500	328.00	164,000
フィックスターズ	500	1,035.00	517,500
CARTA HOLDINGS	100	1,533.00	153,300
オブティム	300	2,945.00	883,500
セレス	200	4,295.00	859,000
SHIFT	100	15,000.00	1,500,000
特種東海製紙	300	4,700.00	1,410,000
ティーガイア	500	1,914.00	957,000
セック	100	2,771.00	277,100
日本アジアグループ	600	927.00	556,200
テクマトリックス	900	2,117.00	1,905,300
プロシップ	200	1,382.00	276,400
ガンホー・オンライン・エンター	1,400	2,239.00	3,134,600
GMOペイメントゲートウェイ	1,200	15,180.00	18,216,000
ザッパラス	100	438.00	43,800
システムリサーチ	200	1,987.00	397,400
インターネットイニシアティブ	1,400	2,797.00	3,915,800
さくらインターネット	500	792.00	396,000
ヴィンクス	200	1,086.00	217,200
GMOグローバルサインHD	200	6,950.00	1,390,000
SRAホールディングス	200	2,670.00	534,000
システムインテグレータ	200	678.00	135,600
朝日ネット	500	799.00	399,500
eBASE	600	968.00	580,800
アバント	500	1,685.00	842,500
アドソル日進	300	2,945.00	883,500
ODKソリューションズ	100	791.00	79,100
フリービット	200	992.00	198,400

コムチュア	600	2,691.00	1,614,600
サイバーコム	100	1,571.00	157,100
アステリア	300	863.00	258,900
アイル	200	1,905.00	381,000
王子ホールディングス	23,900	725.00	17,327,500
日本製紙	2,400	1,291.00	3,098,400
三菱製紙	800	360.00	288,000
北越コーポレーション	3,800	574.00	2,181,200
中越パルプ	100	1,254.00	125,400
巴川製紙	200	823.00	164,600
大王製紙	2,500	1,907.00	4,767,500
阿波製紙	200	463.00	92,600
マークラインズ	100	2,905.00	290,500
メディカル・データ・ピジ	500	2,140.00	1,070,000
g u m i	700	928.00	649,600
ショーケース	200	965.00	193,000
モバイルファクトリー	200	1,627.00	325,400
テラスカイ	200	3,495.00	699,000
デジタル・インフォメーション	100	2,254.00	225,400
P C Iホールディングス	100	1,546.00	154,600
パイブドHD	200	1,949.00	389,800
アイビーシー	100	1,063.00	106,300
ネオジャパン	100	1,831.00	183,100
P R T I M E S	200	3,845.00	769,000
ランドコンピュータ	100	1,136.00	113,600
ダブルスタンダード	100	4,045.00	404,500
オーブンドア	200	1,886.00	377,200
マイネット	200	856.00	171,200
アカツキ	100	4,460.00	446,000
ベネフィットジャパン	100	1,839.00	183,900
U B I C O Mホールディングス	200	3,260.00	652,000
カナミックネットワーク	600	760.00	456,000
ノムラシステムコーポレーション	100	309.00	30,900
レンゴー	5,400	924.00	4,989,600
トーモク	300	1,893.00	567,900
ザ・パック	500	2,979.00	1,489,500
チェンジ	700	3,710.00	2,597,000
シンクロ・フード	200	414.00	82,800
オークネット	200	1,338.00	267,600
キャピタル・アセット・プラン	100	1,262.00	126,200

セグエグループ	200	1,360.00	272,000
エイトレッド	100	2,359.00	235,900
AOI TYO HOLDINGS	700	628.00	439,600
マクロミル	1,000	908.00	908,000
ビーグリー	100	1,527.00	152,700
オロ	200	3,760.00	752,000
ユーザーローカル	100	5,050.00	505,000
テモナ	200	859.00	171,800
ニーズウェル	100	662.00	66,200
サインポスト	200	1,101.00	220,200
昭和電工	3,900	3,330.00	12,987,000
住友化学	41,800	564.00	23,575,200
住友精化	200	4,070.00	814,000
日産化学	2,900	6,100.00	17,690,000
ラサ工業	200	2,261.00	452,200
クレハ	500	7,890.00	3,945,000
多木化学	100	6,150.00	615,000
テイカ	400	1,456.00	582,400
石原産業	800	913.00	730,400
片倉コープアグリ	200	1,240.00	248,000
日本曹達	700	3,445.00	2,411,500
東ソー	8,200	2,130.00	17,466,000
トクヤマ	1,600	2,829.00	4,526,400
セントラル硝子	900	2,311.00	2,079,900
東亜合成	3,100	1,295.00	4,014,500
大阪ソーダ	700	2,650.00	1,855,000
関東電化	1,400	913.00	1,278,200
デンカ	2,000	4,335.00	8,670,000
イビデン	2,600	5,350.00	13,910,000
信越化学	9,900	19,710.00	195,129,000
日本カ-バイド	300	1,284.00	385,200
堺化学	300	2,078.00	623,400
第一稀元素化学工	600	1,364.00	818,400
エア・ウォーター	5,300	1,939.00	10,276,700
日本酸素HLDGS	4,300	2,140.00	9,202,000
日本化学工業	200	3,075.00	615,000
東邦アセチレン	100	1,314.00	131,400
日本パ-カラライジング	2,800	1,146.00	3,208,800
高圧ガス	900	742.00	667,800
チタン工業	100	2,102.00	210,200

四国化成	700	1,335.00	934,500
戸田工業	200	2,082.00	416,400
ステラ ケミファ	200	3,305.00	661,000
保土谷化学	200	4,780.00	956,000
日本触媒	800	6,260.00	5,008,000
大日精化	500	2,469.00	1,234,500
カネカ	1,300	4,660.00	6,058,000
協和キリン	5,300	3,280.00	17,384,000
三菱瓦斯化学	5,400	2,666.00	14,396,400
三井化学	4,600	3,555.00	16,353,000
J S R	5,400	3,530.00	19,062,000
東京応化工業	1,000	7,570.00	7,570,000
大阪有機化学	600	4,370.00	2,622,000
三菱ケミカルH L D G S	35,500	832.00	29,536,000
K H ネオケム	900	2,691.00	2,421,900
ダイセル	7,200	875.00	6,300,000
住友ベークライト	900	4,435.00	3,991,500
積水化学	11,200	2,143.00	24,001,600
日本ゼオン	4,700	1,717.00	8,069,900
アイカ工業	1,500	4,055.00	6,082,500
宇部興産	2,800	2,293.00	6,420,400
積水樹脂	900	2,135.00	1,921,500
タキロンシーアイ	1,200	693.00	831,600
旭有機材	200	1,470.00	294,000
ニチバン	200	1,884.00	376,800
リケンテクノス	1,400	521.00	729,400
大倉工業	200	2,089.00	417,800
積水化成品	700	592.00	414,400
群栄化学	200	2,442.00	488,400
タイガース ポリマー	200	465.00	93,000
ミライアル	200	1,396.00	279,200
ダイキアクシス	300	951.00	285,300
ダイキョーニシカワ	1,200	750.00	900,000
竹本容器	300	881.00	264,300
森六ホールディングス	200	2,179.00	435,800
恵和	100	2,692.00	269,200
日本化薬	3,200	1,047.00	3,350,400
カーリットホールディングス	600	714.00	428,400
E P S ホールディングス	700	1,145.00	801,500
ソルクシーズ	100	943.00	94,300

レグス	200	1,712.00	342,400
プレステージ・インター	2,000	822.00	1,644,000
フェイス	200	803.00	160,600
プロトコーポレーション	600	1,246.00	747,600
ハイマックス	200	1,230.00	246,000
アミューズ	200	2,436.00	487,200
野村総合研究所	9,700	3,310.00	32,107,000
ドリームインキュベータ	200	1,069.00	213,800
サイバネットシステム	300	903.00	270,900
クイック	300	1,201.00	360,300
T A C	200	248.00	49,600
C Eホールディングス	200	588.00	117,600
日本システム技術	100	1,501.00	150,100
電通グループ	5,800	3,525.00	20,445,000
インテージホールディングス	600	1,349.00	809,400
テイクアンドギヴニーズ	100	901.00	90,100
東邦システムサイエンス	200	922.00	184,400
ぴあ	200	2,931.00	586,200
イオンファンタジー	100	2,230.00	223,000
ソースネクスト	2,400	361.00	866,400
シーティーエス	500	889.00	444,500
ネクシィーズグループ	200	1,117.00	223,400
インフォコム	600	3,020.00	1,812,000
メディカルシステムネットワーク	600	822.00	493,200
日本精化	400	1,489.00	595,600
扶桑化学工業	500	4,340.00	2,170,000
トリケミカル	700	3,985.00	2,789,500
H E R O Z	200	3,090.00	618,000
ラクスル	500	5,420.00	2,710,000
I P S	100	2,838.00	283,800
F I G	500	275.00	137,500
システムサポート	200	1,560.00	312,000
A D E K A	2,300	2,245.00	5,163,500
日油	2,100	5,960.00	12,516,000
ミヨシ油脂	100	1,270.00	127,000
新日本理化	900	294.00	264,600
ハリマ化成グループ	500	951.00	475,500
イーソル	200	1,302.00	260,400
アルテリア・ネットワークス	500	1,633.00	816,500
E D U L A B	100	7,910.00	791,000

東海ソフト	100	1,173.00	117,300
ヒト・コミュニケーションズHD	100	1,940.00	194,000
トビラシステムズ	100	1,449.00	144,900
Sansan	300	10,140.00	3,042,000
ギフトィ	100	3,450.00	345,000
花王	12,900	7,335.00	94,621,500
第一工業製薬	300	3,815.00	1,144,500
石原ケミカル	200	2,189.00	437,800
日華化学	300	957.00	287,100
ニイタカ	200	2,744.00	548,800
三洋化成	200	5,440.00	1,088,000
ベース	100	6,350.00	635,000
武田薬品	45,000	3,750.00	168,750,000
アステラス製薬	47,000	1,636.50	76,915,500
大日本住友製薬	3,900	1,921.00	7,491,900
塩野義製薬	6,900	5,850.00	40,365,000
わかもと製薬	600	387.00	232,200
日本新薬	1,600	7,740.00	12,384,000
バイオフェルミン製薬	100	2,795.00	279,500
中外製薬	17,100	4,358.00	74,521,800
科研製薬	1,000	4,300.00	4,300,000
エーザイ	6,000	7,313.00	43,878,000
理研ビタミン	600	1,344.00	806,400
ロート製薬	2,500	2,905.00	7,262,500
小野薬品	12,500	2,802.00	35,025,000
久光製薬	1,600	6,750.00	10,800,000
有機合成薬品	500	299.00	149,500
持田製薬	800	4,165.00	3,332,000
参天製薬	9,500	1,510.00	14,345,000
扶桑薬品	200	2,495.00	499,000
日本ケミファ	100	2,456.00	245,600
ツムラ	1,700	3,970.00	6,749,000
日医工	1,600	950.00	1,520,000
テルモ	16,500	4,017.00	66,280,500
HUグループHD	1,400	3,430.00	4,802,000
キッセイ薬品工業	800	2,332.00	1,865,600
生化学工業	800	1,008.00	806,400
栄研化学	800	2,069.00	1,655,200
日水製薬	100	979.00	97,900
鳥居薬品	300	2,883.00	864,900

J C R ファーマ	1,500	3,225.00	4,837,500
東和薬品	800	2,325.00	1,860,000
富士製薬工業	300	1,254.00	376,200
ゼリア新薬工業	900	2,058.00	1,852,200
第一三共	46,400	2,990.00	138,736,000
キョーリン製薬HD	1,300	1,895.00	2,463,500
大幸薬品	600	1,244.00	746,400
ダイト	300	3,515.00	1,054,500
大塚ホールディングス	11,300	4,516.00	51,030,800
大正製薬HD	1,400	6,650.00	9,310,000
ペプチドリーム	2,900	4,925.00	14,282,500
大日本塗料	500	883.00	441,500
日本ペイントHOLD	21,500	1,562.00	33,583,000
関西ペイント	6,000	2,894.00	17,364,000
神東塗料	500	209.00	104,500
中国塗料	1,400	995.00	1,393,000
日本特殊塗料	500	1,048.00	524,000
藤倉化成	700	553.00	387,100
太陽ホールディングス	400	6,110.00	2,444,000
D I C	2,200	2,907.00	6,395,400
サカタインクス	1,200	1,038.00	1,245,600
東洋インキSCホールディン	1,200	2,121.00	2,545,200
T & K TOKA	500	820.00	410,000
アルプス技研	500	2,102.00	1,051,000
サニックス	900	316.00	284,400
ダイオーズ	100	989.00	98,900
日本空調サービス	700	730.00	511,000
オリエンタルランド	5,400	16,280.00	87,912,000
フォーカスシステムズ	300	959.00	287,700
ダスキン	1,300	2,751.00	3,576,300
パーク24	2,800	2,001.00	5,602,800
明光ネットワークジャパン	600	621.00	372,600
ファルコホールディングス	100	1,675.00	167,500
クレスコ	300	1,643.00	492,900
フジ・メディア・HD	5,400	1,326.00	7,160,400
秀英予備校	200	421.00	84,200
田谷	100	555.00	55,500
ラウンドワン	1,700	1,133.00	1,926,100
リゾートトラスト	2,400	1,762.00	4,228,800
オービック	1,700	19,960.00	33,932,000

ジャストシステム	800	6,190.00	4,952,000
TDCソフト	600	1,014.00	608,400
Zホールディングス	73,000	545.90	39,850,700
ビー・エム・エル	600	3,685.00	2,211,000
ワタベウェディング	100	269.00	26,900
トレンドマイクロ	2,800	5,510.00	15,428,000
りらいあコミュニケーション	800	1,420.00	1,136,000
IDホールディングス	100	1,371.00	137,100
リソー教育	2,700	320.00	864,000
日本オラクル	1,000	10,670.00	10,670,000
早稲田アカデミー	100	878.00	87,800
アルファシステムズ	200	3,690.00	738,000
フューチャー	600	2,019.00	1,211,400
CAC HOLDINGS	300	1,463.00	438,900
SBテクノロジー	100	3,205.00	320,500
トーセ	200	833.00	166,600
ユー・エス・エス	5,700	2,119.00	12,078,300
オービックビジネスC	700	5,790.00	4,053,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,500	3,565.00	8,912,500
アイティフォー	700	814.00	569,800
東京個別指導学院	500	648.00	324,000
東計電算	100	4,525.00	452,500
サイバーエージェント	12,400	1,920.00	23,808,000
楽天グループ	24,000	1,319.00	31,656,000
エックスネット	100	1,069.00	106,900
クリーク・アンド・リバー社	200	1,573.00	314,600
モーニングスター	500	489.00	244,500
テー・オー・ダブリュー	1,000	342.00	342,000
大塚商会	2,800	5,310.00	14,868,000
サイボウズ	600	2,474.00	1,484,400
山田コンサルティングGP	200	1,143.00	228,600
セントラルスポーツ	100	2,427.00	242,700
パラカ	200	1,672.00	334,400
電通国際情報S	600	4,155.00	2,493,000
ACCESS	600	818.00	490,800
デジタルガレージ	900	4,770.00	4,293,000
イーエムシステムズ	900	896.00	806,400
ウェザーニューズ	200	5,450.00	1,090,000
CIJ	300	929.00	278,700
ビジネスエンジニアリング	100	3,725.00	372,500



日本エンタープライズ	700	253.00	177,100
WOWOW	200	2,833.00	566,600
スカラ	600	763.00	457,800
インテリジェント ウェイブ	200	698.00	139,600
フルキャストホールディングス	500	1,952.00	976,000
エン・ジャパン	1,000	3,360.00	3,360,000
あすか製薬HD	600	1,378.00	826,800
サワイグループHD	1,300	5,100.00	6,630,000
富士フイルムHLDGS	9,400	6,722.00	63,186,800
コニカミノルタ	11,100	598.00	6,637,800
資生堂	10,700	7,483.00	80,068,100
ライオン	7,000	2,167.00	15,169,000
高砂香料	300	2,651.00	795,300
マンダム	1,200	2,059.00	2,470,800
ミルボン	700	6,040.00	4,228,000
ファンケル	2,100	3,750.00	7,875,000
コーセー	900	15,810.00	14,229,000
コタ	220	1,528.00	336,160
シーボン	100	1,983.00	198,300
ポーラ・オルビスHD	2,300	2,614.00	6,012,200
ノエビアホールディングス	500	4,955.00	2,477,500
アジュバンコスメジャパン	200	1,028.00	205,600
新日本製薬	200	2,233.00	446,600
エステー	300	1,936.00	580,800
アグロカネショウ	100	1,581.00	158,100
コニシ	900	1,754.00	1,578,600
長谷川香料	800	2,205.00	1,764,000
星光PMC	200	800.00	160,000
小林製薬	1,500	10,200.00	15,300,000
荒川化学工業	500	1,299.00	649,500
メック	300	2,439.00	731,700
日本高純度化学	200	2,760.00	552,000
タカラバイオ	1,400	2,891.00	4,047,400
JCU	600	4,200.00	2,520,000
新田ゼラチン	300	665.00	199,500
OATアグリオ	100	1,414.00	141,400
デクセリアルズ	1,500	1,943.00	2,914,500
アース製薬	500	6,540.00	3,270,000
北興化学	600	1,118.00	670,800
大成ラミック	200	2,875.00	575,000

クミアイ化学	2,200	994.00	2,186,800
日本農薬	900	597.00	537,300
富士興産	200	1,203.00	240,600
ニチレキ	600	1,588.00	952,800
ユシロ化学	200	1,154.00	230,800
ビーピー・カストロール	100	1,427.00	142,700
富士石油	1,200	228.00	273,600
MORESCO	100	1,148.00	114,800
出光興産	6,000	2,728.00	16,368,000
ENEOSホールディングス	81,400	478.70	38,966,180
コスモエネルギーHLDGS	1,600	2,432.00	3,891,200
横浜ゴム	3,200	1,987.00	6,358,400
TOYO TIRE	2,800	1,944.00	5,443,200
ブリヂストン	14,300	4,397.00	62,877,100
住友ゴム	4,900	1,317.00	6,453,300
藤倉コンポジット	600	517.00	310,200
オカモト	300	4,080.00	1,224,000
アキレス	300	1,469.00	440,700
フコク	100	770.00	77,000
ニッタ	500	2,685.00	1,342,500
クリエートメディック	300	1,003.00	300,900
住友理工	1,000	724.00	724,000
三ツ星ベルト	600	1,816.00	1,089,600
バンドー化学	800	770.00	616,000
AGC	5,100	4,795.00	24,454,500
日本板硝子	2,900	620.00	1,798,000
石塚硝子	100	1,985.00	198,500
有沢製作所	800	987.00	789,600
日本山村硝子	100	985.00	98,500
日本電気硝子	2,100	2,698.00	5,665,800
オハラ	100	1,719.00	171,900
住友大阪セメント	900	3,620.00	3,258,000
太平洋セメント	3,100	2,793.00	8,658,300
リソルホールディングス	100	3,920.00	392,000
日本ヒュ-ム	600	741.00	444,600
日本コンクリ-ト	1,200	410.00	492,000
三谷セキサン	200	4,030.00	806,000
アジアパイルHD	900	524.00	471,600
東海カーボン	5,300	1,844.00	9,773,200
日本カーボン	200	4,700.00	940,000

東洋炭素	200	2,074.00	414,800
ノリタケ	200	3,520.00	704,000
TOTO	3,900	6,460.00	25,194,000
日本碍子	6,000	2,064.00	12,384,000
日本特殊陶業	4,200	1,847.00	7,757,400
ダントーホールディングス	500	345.00	172,500
MARUWA	100	11,290.00	1,129,000
品川リフラクトリーズ	200	2,916.00	583,200
黒崎播磨	100	4,805.00	480,500
ヨータイ	400	1,047.00	418,800
イソライト	100	681.00	68,100
東京窯業	700	328.00	229,600
ニッカトー	100	719.00	71,900
フジミインコーポレーテッド	500	4,625.00	2,312,500
クニミネ工業	200	1,270.00	254,000
エーアンドエーマテリアル	100	1,050.00	105,000
ニチアス	1,300	2,802.00	3,642,600
日本製鉄	25,500	1,842.50	46,983,750
神戸製鋼所	9,800	752.00	7,369,600
中山製鋼所	700	442.00	309,400
合同製鐵	200	2,109.00	421,800
JFEホールディングス	15,400	1,338.00	20,605,200
東京製鐵	2,000	937.00	1,874,000
共英製鋼	500	1,628.00	814,000
大和工業	1,200	3,300.00	3,960,000
東京鐵鋼	100	1,975.00	197,500
大阪製鐵	200	1,349.00	269,800
淀川製鋼所	700	2,464.00	1,724,800
丸一鋼管	1,600	2,516.00	4,025,600
モリ工業	200	2,562.00	512,400
大同特殊鋼	900	4,890.00	4,401,000
日本高周波	100	429.00	42,900
日本冶金工	500	1,994.00	997,000
山陽特殊製鋼	600	1,634.00	980,400
愛知製鋼	200	3,625.00	725,000
日立金属	5,000	1,893.00	9,465,000
日本金属	200	1,157.00	231,400
大平洋金属	300	2,230.00	669,000
新日本電工	3,500	378.00	1,323,000
栗本鉄工所	100	1,762.00	176,200

虹 技	100	1,184.00	118,400
日本鑄鉄管	100	1,469.00	146,900
日本製鋼所	1,700	2,660.00	4,522,000
三菱製鋼	500	879.00	439,500
日亜鋼業	800	325.00	260,000
日本精線	100	3,625.00	362,500
エンビプロHD	100	1,006.00	100,600
大紀アルミニウム	800	1,012.00	809,600
日本軽金属HD	1,400	2,128.00	2,979,200
三井金属	1,400	3,890.00	5,446,000
東邦亜鉛	200	2,322.00	464,400
三菱マテリアル	3,700	2,555.00	9,453,500
住友鉱山	6,900	4,928.00	34,003,200
DOWAホールディングス	1,300	4,720.00	6,136,000
古河機金	900	1,315.00	1,183,500
エス・サイエンス	2,400	42.00	100,800
大阪チタニウム	700	959.00	671,300
東邦チタニウム	800	976.00	780,800
UACJ	800	2,612.00	2,089,600
CKサンエツ	200	3,815.00	763,000
古河電工	1,700	2,992.00	5,086,400
住友電工	18,700	1,667.00	31,172,900
フジクラ	6,600	530.00	3,498,000
昭和電線HLDGS	600	1,751.00	1,050,600
東京特殊電線	100	2,606.00	260,600
タツタ電線	800	628.00	502,400
カナレ電気	100	1,819.00	181,900
平河ビューテック	200	1,311.00	262,200
リョービ	600	1,669.00	1,001,400
アーレステイ	600	469.00	281,400
アサヒHD	1,800	2,287.00	4,116,600
東洋製罐グループHD	3,500	1,370.00	4,795,000
ホッカンホールディングス	200	1,442.00	288,400
コロナ	200	937.00	187,400
横河ブリッジHLDGS	1,000	2,068.00	2,068,000
駒井ハルテック	200	2,093.00	418,600
高田機工	100	2,666.00	266,600
三和ホールディングス	5,000	1,420.00	7,100,000
文化シャツタ -	1,600	1,007.00	1,611,200
三協立山	700	854.00	597,800

アルインコ	300	998.00	299,400
東洋シャツタ -	200	648.00	129,600
L I X I L	7,300	3,170.00	23,141,000
日本ファイルコン	300	515.00	154,500
ノーリツ	1,100	1,711.00	1,882,100
長府製作所	700	2,129.00	1,490,300
リンナイ	1,000	11,900.00	11,900,000
ユニプレス	900	1,060.00	954,000
ダイニチ工業	200	840.00	168,000
日東精工	600	586.00	351,600
三洋工業	100	1,878.00	187,800
岡 部	1,000	772.00	772,000
ジーテクト	600	1,502.00	901,200
東 プ レ	900	1,521.00	1,368,900
高周波熱錬	900	579.00	521,100
東京製綱	400	1,190.00	476,000
サンコール	500	455.00	227,500
モリテックスチル	500	456.00	228,000
パイオラックス	800	1,577.00	1,261,600
エイチワン	600	843.00	505,800
日本発条	5,400	814.00	4,395,600
中央発條	400	950.00	380,000
アドバネクス	100	1,485.00	148,500
三浦工業	2,300	6,060.00	13,938,000
タ ク マ	1,700	2,413.00	4,102,100
テクノプロ・ホールディング	900	8,740.00	7,866,000
アトラグループ	200	355.00	71,000
インターワークス	200	383.00	76,600
アイ・アールジャパンHD	100	14,990.00	1,499,000
K e e P e r 技研	300	2,234.00	670,200
ファーストロジック	100	776.00	77,600
三機サービス	100	1,136.00	113,600
G u n o s y	300	832.00	249,600
デザインワン・ジャパン	200	250.00	50,000
イー・ガーディアン	100	2,927.00	292,700
リブセンス	200	232.00	46,400
ジャパンマテリアル	1,600	1,373.00	2,196,800
ベクトル	600	1,328.00	796,800
ウチヤマホールディングス	200	390.00	78,000
チャームケアコーポレーション	400	1,325.00	530,000

キャリアリンク	200	2,615.00	523,000
I B J	500	969.00	484,500
アサンテ	100	1,771.00	177,100
N・フィールド	300	1,197.00	359,100
バリューHR	100	1,628.00	162,800
M&Aキャピタルパートナー	500	5,420.00	2,710,000
ライドオンエクスプレスHD	100	1,742.00	174,200
E R Iホールディングス	200	598.00	119,600
アビスト	100	2,976.00	297,600
シグマクシス	200	1,882.00	376,400
ウィルグループ	300	1,098.00	329,400
エスクローAJ	800	307.00	245,600
メドピア	100	6,250.00	625,000
レアジョブ	100	2,113.00	211,300
リクルートホールディングス	37,200	5,223.00	194,295,600
エラン	700	1,418.00	992,600
ツガミ	1,100	1,698.00	1,867,800
オークマ	600	6,440.00	3,864,000
芝浦機械	700	2,784.00	1,948,800
アマダ	7,900	1,233.00	9,740,700
アイダエンジニア	1,400	988.00	1,383,200
滝澤鉄工所	200	1,120.00	224,000
F U J I	2,100	2,937.00	6,167,700
牧野フライス	600	4,320.00	2,592,000
オーエスジー	2,700	1,992.00	5,378,400
ダイジェット	100	1,324.00	132,400
旭ダイヤモンド	1,400	532.00	744,800
D M G 森精機	3,500	1,790.00	6,265,000
ソディック	1,200	1,037.00	1,244,400
ディスコ	700	37,850.00	26,495,000
日東工器	200	1,926.00	385,200
日進工具	200	1,560.00	312,000
パンチ工業	500	608.00	304,000
富士ダイス	200	670.00	134,000
土木管理総合試験	200	345.00	69,000
ネットマーケティング	100	588.00	58,800
日本郵政	39,200	930.00	36,456,000
ベルシステム24HLDGS	900	1,768.00	1,591,200
鎌倉新書	600	1,407.00	844,200
S M N	200	783.00	156,600

一蔵	100	416.00	41,600
グローバルキッズCOMP	100	1,043.00	104,300
エアトリ	200	2,189.00	437,800
アトラエ	400	1,779.00	711,600
ストライク	100	4,760.00	476,000
ソラスト	1,400	1,450.00	2,030,000
セラク	200	2,032.00	406,400
インソース	500	2,540.00	1,270,000
豊田自動織機	4,300	9,460.00	40,678,000
豊和工業	200	862.00	172,400
OKK	100	451.00	45,100
石川製作所	200	1,828.00	365,600
東洋機械金属	400	471.00	188,400
津田駒工業	100	923.00	92,300
エンシュウ	200	938.00	187,600
島精機製作所	800	2,368.00	1,894,400
オプトラ	600	3,085.00	1,851,000
NCホールディングス	200	714.00	142,800
イワキポンプ	300	894.00	268,200
フリー	600	1,063.00	637,800
ヤマシンフィルタ	1,000	876.00	876,000
日阪製作所	600	862.00	517,200
やまびこ	1,000	1,241.00	1,241,000
平田機工	200	7,490.00	1,498,000
ペガサスミシン製造	700	487.00	340,900
マルマエ	100	1,595.00	159,500
タツモ	100	2,029.00	202,900
ナプテスコ	3,200	5,470.00	17,504,000
三井海洋開発	500	2,263.00	1,131,500
レオン自動機	600	1,211.00	726,600
SMC	1,600	66,740.00	106,784,000
ホソカワミクロン	300	6,610.00	1,983,000
ユニオンツール	100	3,710.00	371,000
オイレス工業	800	1,648.00	1,318,400
日精エーエスビー	200	5,600.00	1,120,000
サト - ホールディングス	700	2,773.00	1,941,100
技研製作所	600	5,030.00	3,018,000
日本エアテック	200	1,265.00	253,000
カワタ	200	935.00	187,000
日精樹脂工業	500	943.00	471,500

オカダアイヨン	200	1,205.00	241,000
ワイエイシイホールディングス	100	994.00	99,400
小松製作所	24,500	3,381.00	82,834,500
住友重機械	3,100	3,225.00	9,997,500
日立建機	2,500	3,480.00	8,700,000
日 工	800	717.00	573,600
巴工業	100	2,120.00	212,000
井関農機	700	1,658.00	1,160,600
T O W A	600	2,273.00	1,363,800
丸山製作所	200	1,712.00	342,400
北川鉄工所	100	1,587.00	158,700
シンニッタン	600	273.00	163,800
ローツェ	100	9,150.00	915,000
タカキタ	300	656.00	196,800
クボタ	28,500	2,466.50	70,295,250
荏原実業	200	4,920.00	984,000
東洋エンジニア	700	763.00	534,100
三菱化工機	200	2,794.00	558,800
月島機械	900	1,296.00	1,166,400
帝国電機製作所	400	1,293.00	517,200
東京機械	100	494.00	49,400
新東工業	1,400	754.00	1,055,600
渋谷工業	600	3,475.00	2,085,000
アイチ コーポレーション	800	849.00	679,200
小森コーポレーション	1,300	762.00	990,600
鶴見製作所	500	1,726.00	863,000
住友精密	100	2,272.00	227,200
日本ギア工業	100	323.00	32,300
酒井重工業	100	2,149.00	214,900
荏原製作所	2,200	5,100.00	11,220,000
石井鉄工所	100	2,951.00	295,100
西島製作所	700	861.00	602,700
北越工業	700	1,086.00	760,200
ダイキン工業	6,800	22,775.00	154,870,000
オルガノ	200	7,260.00	1,452,000
ト - ヨ - カネツ	100	2,644.00	264,400
栗田工業	2,900	4,905.00	14,224,500
椿本チエイン	800	2,973.00	2,378,400
大同工業	200	898.00	179,600
日 機 装	1,700	1,144.00	1,944,800



木村化工機	500	766.00	383,000
レイズネクスト	1,000	1,176.00	1,176,000
アネスト岩田	1,000	1,019.00	1,019,000
ダイフク	3,000	11,210.00	33,630,000
サムコ	200	3,600.00	720,000
加藤製作所	200	1,118.00	223,600
油研工業	100	1,672.00	167,200
タダノ	2,700	1,152.00	3,110,400
フジテック	1,900	2,332.00	4,430,800
C K D	1,400	2,493.00	3,490,200
キトー	500	1,804.00	902,000
平和	1,500	1,832.00	2,748,000
理想科学工業	500	1,356.00	678,000
S A N K Y O	1,400	2,933.00	4,106,200
日本金銭機械	500	622.00	311,000
マースグループH L D G S	300	1,638.00	491,400
フクシマガリレイ	300	4,265.00	1,279,500
オーイズミ	100	404.00	40,400
ダイコク電機	100	1,008.00	100,800
竹内製作所	1,000	2,945.00	2,945,000
ア マ ノ	1,400	2,686.00	3,760,400
J U K I	800	931.00	744,800
サンデンホールディングス	800	386.00	308,800
蛇の目マシン	600	865.00	519,000
ブラザー工業	6,600	2,403.00	15,859,800
マックス	700	1,579.00	1,105,300
モリタホールディングス	900	1,703.00	1,532,700
グローリー	1,400	2,370.00	3,318,000
新晃工業	600	2,269.00	1,361,400
大和冷機工業	900	1,116.00	1,004,400
セガサミーホールディングス	5,000	1,724.00	8,620,000
日本ピストンリング	100	1,164.00	116,400
リ ケ ン	200	2,452.00	490,400
T P R	700	1,585.00	1,109,500
ツバキ・ナカシマ	1,000	1,603.00	1,603,000
ホシザキ	1,600	10,670.00	17,072,000
大豊工業	500	1,040.00	520,000
日本精工	11,100	1,098.00	12,187,800
N T N	12,500	338.00	4,225,000
ジェイテクト	5,200	1,101.00	5,725,200

不二越	600	4,665.00	2,799,000
ミネベアミツミ	9,400	2,879.00	27,062,600
日本トムソン	1,500	667.00	1,000,500
T H K	3,400	4,075.00	13,855,000
ユーシン精機	300	894.00	268,200
前澤給装工業	200	1,155.00	231,000
イーグル工業	600	1,221.00	732,600
前澤工業	300	603.00	180,900
日本ピラ - 工業	700	1,839.00	1,287,300
キッツ	1,700	671.00	1,140,700
日立	26,000	5,135.00	133,510,000
東芝	7,900	4,265.00	33,693,500
三菱電機	54,200	1,664.00	90,188,800
富士電機	3,200	5,080.00	16,256,000
東洋電機製造	100	1,317.00	131,700
安川電機	5,800	5,910.00	34,278,000
シンフォニアテクノロジー	700	1,341.00	938,700
明電舎	1,000	2,542.00	2,542,000
オリジン	200	1,375.00	275,000
山洋電気	200	5,900.00	1,180,000
デンヨー	500	2,008.00	1,004,000
ベйкаレントコンサルティング	300	26,420.00	7,926,000
ORCHESTRA HLDGS	200	3,100.00	620,000
アイモバイル	300	1,464.00	439,200
キャリアインデックス	100	646.00	64,600
MS - Japan	100	1,139.00	113,900
船場	100	891.00	89,100
グレイステクノロジー	400	3,225.00	1,290,000
ジャパンエレベーターSHD	1,500	2,381.00	3,571,500
フルテック	100	1,488.00	148,800
グリーンズ	300	564.00	169,200
ツナググループHLDGS	100	310.00	31,000
GAMEWITH	200	681.00	136,200
ソウルドアウト	200	1,661.00	332,200
MS&CONSULTING	100	618.00	61,800
ウェルビー	200	1,526.00	305,200
エル・ティー・エス	100	4,220.00	422,000
ミダック	200	4,675.00	935,000
日総工産	400	816.00	326,400
キュービーネットHLDGS	100	1,809.00	180,900

R P Aホールディングス	500	666.00	333,000
三桜工業	800	1,155.00	924,000
マキタ	7,000	4,885.00	34,195,000
東芝テック	500	4,335.00	2,167,500
芝浦メカトロニクス	100	5,880.00	588,000
マブチモーター	1,500	4,835.00	7,252,500
日本電産	13,000	14,180.00	184,340,000
ユーエムシーエレクトロニクス	300	999.00	299,700
トレックス・セミコンダクター	200	1,806.00	361,200
東光高岳	200	1,586.00	317,200
ダブル・スコープ	1,000	696.00	696,000
宮越ホールディングス	100	901.00	90,100
ダイヘン	500	4,975.00	2,487,500
ヤーマン	900	1,528.00	1,375,200
J V C ケンウッド	4,600	221.00	1,016,600
ミマキエンジニアリング	600	668.00	400,800
I - P E X	200	2,042.00	408,400
日新電機	1,400	1,225.00	1,715,000
大崎電気	1,000	605.00	605,000
オムロン	4,500	9,220.00	41,490,000
日東工業	800	1,987.00	1,589,600
I D E C	700	1,811.00	1,267,700
正興電機製作所	200	1,973.00	394,600
不二電機工業	100	1,293.00	129,300
ジーエス・ユアサ コーポ	2,000	3,040.00	6,080,000
サクサホールディングス	200	1,572.00	314,400
メルコホールディングス	300	3,860.00	1,158,000
テクノメディカ	200	1,677.00	335,400
ダイヤモンドエレクトリックHD	200	3,035.00	607,000
日本電気	7,000	6,600.00	46,200,000
富士通	4,900	16,695.00	81,805,500
沖電気	2,200	1,144.00	2,516,800
岩崎通信機	100	904.00	90,400
電気興業	200	2,683.00	536,600
サンケン電気	600	5,380.00	3,228,000
ナカヨ	100	1,533.00	153,300
アイホン	200	1,793.00	358,600
ルネサスエレクトロニクス	23,200	1,258.00	29,185,600
セイコーエプソン	6,700	1,811.00	12,133,700
ワコム	3,800	745.00	2,831,000

アルバック	900	5,090.00	4,581,000
アクセル	100	966.00	96,600
E I Z O	500	4,025.00	2,012,500
ジャパンディスプレイ	18,400	48.00	883,200
日本信号	1,400	976.00	1,366,400
京三製作所	1,200	406.00	487,200
能美防災	700	2,182.00	1,527,400
ホーチキ	500	1,357.00	678,500
星和電機	200	607.00	121,400
エレコム	1,200	2,407.00	2,888,400
パナソニック	57,700	1,377.50	79,481,750
シャープ	7,200	1,918.00	13,809,600
アンリツ	3,200	2,471.00	7,907,200
富士通ゼネラル	1,700	3,040.00	5,168,000
ソニーグループ	34,000	12,230.00	415,820,000
T D K	2,700	16,780.00	45,306,000
帝国通信工業	100	1,076.00	107,600
タムラ製作所	2,000	511.00	1,022,000
アルプスアルパイン	4,400	1,392.00	6,124,800
池上通信機	200	876.00	175,200
日本電波工業	600	774.00	464,400
鈴木	100	1,246.00	124,600
日本トリム	200	4,095.00	819,000
ローランド ディー . ジー .	200	1,790.00	358,000
フオスタ - 電機	500	1,259.00	629,500
S M K	200	2,805.00	561,000
ヨコオ	400	2,834.00	1,133,600
ティアック	300	145.00	43,500
ホシデン	1,500	1,118.00	1,677,000
ヒロセ電機	900	17,970.00	16,173,000
日本航空電子	1,300	1,716.00	2,230,800
T O A	600	892.00	535,200
マクセルホールディングス	1,000	1,439.00	1,439,000
古野電気	700	1,165.00	815,500
ユニデンホールディングス	200	2,563.00	512,600
スミダコーポレーション	500	1,089.00	544,500
アイコム	100	2,731.00	273,100
リオン	100	3,025.00	302,500
本多通信工業	500	502.00	251,000
船井電機	600	918.00	550,800

横河電機	5,300	2,096.00	11,108,800
新電元工業	100	3,275.00	327,500
アズビル	3,600	4,850.00	17,460,000
東亜ディーケーケー	200	819.00	163,800
日本光電工業	2,200	3,200.00	7,040,000
チノール	200	1,429.00	285,800
共和電業	500	398.00	199,000
日本電子材料	100	2,144.00	214,400
堀場製作所	1,000	7,080.00	7,080,000
アドバンテスト	3,900	10,800.00	42,120,000
小野測器	100	556.00	55,600
エスペック	600	1,882.00	1,129,200
キーエンス	5,400	51,810.00	279,774,000
日置電機	200	4,365.00	873,000
シスメックス	4,300	11,135.00	47,880,500
日本マイクロニクス	800	1,859.00	1,487,200
メガチップス	700	3,710.00	2,597,000
OBARA GROUP	200	3,930.00	786,000
IMAGICA GROUP	500	534.00	267,000
澤藤電機	100	2,431.00	243,100
デンソー	11,900	7,114.00	84,656,600
原田工業	100	872.00	87,200
コーセル	600	1,094.00	656,400
イリソ電子工業	500	5,140.00	2,570,000
オプテックスグループ	900	1,690.00	1,521,000
千代田インテグレ	100	1,917.00	191,700
アイ・オー・データ	300	1,121.00	336,300
レーザーテック	2,400	18,240.00	43,776,000
スタンレー電気	3,800	3,280.00	12,464,000
岩崎電気	100	1,523.00	152,300
ウシオ電機	2,900	1,470.00	4,263,000
岡谷電機	400	394.00	157,600
ヘリオステクノH	600	381.00	228,600
エノモト	200	2,288.00	457,600
日本セラミック	700	2,728.00	1,909,600
遠藤照明	200	655.00	131,000
古河電池	400	1,680.00	672,000
双信電機	200	455.00	91,000
山一電機	300	1,518.00	455,400
図研	300	2,902.00	870,600

日本電子	900	4,495.00	4,045,500
カシオ	4,300	2,124.00	9,133,200
ファナック	4,700	28,095.00	132,046,500
日本シイエムケイ	1,200	468.00	561,600
エンプラス	100	4,240.00	424,000
大真空	300	2,545.00	763,500
ローム	2,300	11,760.00	27,048,000
浜松ホトニクス	3,900	6,630.00	25,857,000
三井ハイテック	600	5,000.00	3,000,000
新光電気工業	1,700	3,565.00	6,060,500
京セラ	8,300	7,210.00	59,843,000
協栄産業	100	1,375.00	137,500
太陽誘電	2,500	5,610.00	14,025,000
村田製作所	15,800	9,107.00	143,890,600
双葉電子工業	1,000	927.00	927,000
日東電工	3,600	9,720.00	34,992,000
北陸電気工業	100	946.00	94,600
東海理化電機	1,400	1,854.00	2,595,600
ニチコン	1,600	1,181.00	1,889,600
日本ケミコン	700	1,852.00	1,296,400
K O A	700	1,614.00	1,129,800
三井E & S H D	2,000	552.00	1,104,000
日立造船	4,200	831.00	3,490,200
三菱重工業	8,400	3,360.00	28,224,000
川崎重工業	4,300	2,660.00	11,438,000
I H I	3,600	2,207.00	7,945,200
名村造船所	1,700	213.00	362,100
サノヤスホールディングス	600	159.00	95,400
スプリックス	200	944.00	188,800
マネジメントソリューションズ	200	2,176.00	435,200
プロレド・パートナーズ	100	3,245.00	324,500
AND FACTORY	100	736.00	73,600
テノ・ホールディングス	100	1,163.00	116,300
フロンティア・マネジメント	100	1,923.00	192,300
ギークス	100	1,712.00	171,200
カープスホールディングス	1,400	1,012.00	1,416,800
フォーラムエンジニアリング	200	1,085.00	217,000
日本車輛	100	2,499.00	249,900
三菱ロジスネクスト	700	1,257.00	879,900
近畿車輛	100	1,362.00	136,200

F P G	1,700	671.00	1,140,700
島根銀行	300	668.00	200,400
じもとホールディングス	300	737.00	221,100
全国保証	1,300	5,260.00	6,838,000
めぶきフィナンシャルG	27,800	247.00	6,866,600
ジャパンインベストメントA	200	1,501.00	300,200
東京きらぼしF G	600	1,288.00	772,800
九州フィナンシャルG	11,000	458.00	5,038,000
かんぽ生命保険	6,600	2,212.00	14,599,200
ゆうちょ銀行	15,000	1,000.00	15,000,000
富山第一銀行	1,400	296.00	414,400
コンコルディア・フィナンシャル	32,600	431.00	14,050,600
ジェイリース	300	898.00	269,400
西日本フィナンシャルHD	3,500	739.00	2,586,500
マーキュリアインベストメント	100	794.00	79,400
イントラスト	200	671.00	134,200
日本モーゲージサービス	200	1,148.00	229,600
C a s a	200	970.00	194,000
アルヒ	800	1,875.00	1,500,000
プレミアグループ	100	2,711.00	271,100
日産自動車	64,000	573.60	36,710,400
いすゞ自動車	15,700	1,149.00	18,039,300
トヨタ自動車	54,900	8,418.00	462,148,200
日野自動車	6,800	949.00	6,453,200
三菱自動車工業	20,000	306.00	6,120,000
エフテック	300	736.00	220,800
レシップホールディングス	100	578.00	57,800
G M B	100	930.00	93,000
ファルテック	100	794.00	79,400
武蔵精密工業	1,300	2,126.00	2,763,800
日産車体	800	783.00	626,400
新明和工業	1,500	982.00	1,473,000
極東開発工業	800	1,690.00	1,352,000
トピー工業	500	1,345.00	672,500
ティラド	200	1,914.00	382,800
曙ブレーキ	3,000	186.00	558,000
タチエス	900	1,192.00	1,072,800
N O K	2,700	1,447.00	3,906,900
フタバ産業	1,300	589.00	765,700
K Y B	600	2,910.00	1,746,000

市光工業	800	712.00	569,600
大同メタル工業	1,200	582.00	698,400
プレス工業	2,800	337.00	943,600
ミクニ	700	315.00	220,500
太平洋工業	1,200	1,229.00	1,474,800
河西工業	700	435.00	304,500
アイシン	3,900	3,985.00	15,541,500
マ ッ ダ	16,900	894.00	15,108,600
今仙電機製作所	600	747.00	448,200
本田技研	42,700	3,215.00	137,280,500
スズキ	10,700	4,797.00	51,327,900
S U B A R U	15,500	2,103.50	32,604,250
安永	200	1,242.00	248,400
ヤマハ発動機	7,500	2,807.00	21,052,500
小糸製作所	3,100	7,310.00	22,661,000
T B K	600	436.00	261,600
エクセディ	700	1,629.00	1,140,300
ミツバ	900	665.00	598,500
豊田合成	1,700	2,838.00	4,824,600
愛三工業	900	686.00	617,400
盟和産業	100	909.00	90,900
日本プラスト	500	576.00	288,000
ヨ ロ ズ	500	1,286.00	643,000
エフ・シー・シー	900	1,809.00	1,628,100
新家工業	200	1,664.00	332,800
シマノ	2,100	26,465.00	55,576,500
テイ・エス テック	2,800	1,613.00	4,516,400
3 3 F G	500	1,331.00	665,500
第四北越フィナンシャルG	900	2,395.00	2,155,500
ひろぎんH L D G S	7,900	620.00	4,898,000
ダイレクトマーケティングミクス	300	3,575.00	1,072,500
ポピンズホールディング	100	4,230.00	423,000
L I T A L I C O	100	4,155.00	415,500
ジャムコ	200	970.00	194,000
小 野 建	600	1,381.00	828,600
はるやまH L D G S	100	671.00	67,100
南 陽	200	1,690.00	338,000
ノ ジ マ	800	2,837.00	2,269,600
佐鳥電機	300	798.00	239,400
カップ・クリエイト	700	1,501.00	1,050,700



エコートレーディング	200	655.00	131,000
伯東	300	1,295.00	388,500
コンドーテック	500	1,030.00	515,000
中山福	200	503.00	100,600
ライトオン	500	711.00	355,500
ナガイレーベン	700	2,703.00	1,892,100
三菱食品	500	2,943.00	1,471,500
良品計画	7,100	2,563.00	18,197,300
三城ホールディングス	600	280.00	168,000
松田産業	400	2,228.00	891,200
第一興商	800	4,500.00	3,600,000
メディパルHD	5,400	2,195.00	11,853,000
アドヴァン	700	1,020.00	714,000
S P K	100	1,302.00	130,200
萩原電気H L D G S	100	2,579.00	257,900
アルビス	200	2,401.00	480,200
アズワン	300	14,010.00	4,203,000
スズデン	300	1,259.00	377,700
尾家産業	200	1,280.00	256,000
シモジマ	300	1,240.00	372,000
ドウシシャ	600	1,898.00	1,138,800
小津産業	200	2,091.00	418,200
コナカ	600	330.00	198,000
高速	200	1,448.00	289,600
ハウス ローゼ	100	1,680.00	168,000
G - 7ホールディングス	200	2,757.00	551,400
たけびし	300	1,496.00	448,800
イオン北海道	700	1,200.00	840,000
コジマ	1,000	771.00	771,000
ヒマラヤ	300	990.00	297,000
コーナン商事	800	3,210.00	2,568,000
ネットワンシステムズ	2,100	3,520.00	7,392,000
エコス	100	1,871.00	187,100
ワタミ	700	958.00	670,600
マルシェ	200	486.00	97,200
リックス	200	1,540.00	308,000
システムソフト	1,200	171.00	205,200
パンパシフィックHD	10,600	2,581.00	27,358,600
丸文	600	530.00	318,000
西松屋チェーン	1,200	1,766.00	2,119,200

ゼンショーホールディングス	2,800	2,941.00	8,234,800
ハピネット	500	1,542.00	771,000
幸楽苑ホールディングス	300	1,697.00	509,100
ハークスレイ	200	915.00	183,000
橋本総業HLDGS	200	2,594.00	518,800
日本ライフライン	1,600	1,396.00	2,233,600
サイゼリヤ	800	2,296.00	1,836,800
タカショー	300	779.00	233,700
VTホールディングス	2,100	439.00	921,900
マルカ	200	2,016.00	403,200
アルゴグラフィックス	500	3,180.00	1,590,000
魚力	200	1,894.00	378,800
IDOM	1,700	705.00	1,198,500
日本エム・ディ・エム	200	2,212.00	442,400
ポブラ	200	337.00	67,400
フジ・コーポレーション	200	2,642.00	528,400
ユナイテッドアローズ	600	2,005.00	1,203,000
進和	200	2,117.00	423,400
エスケイジャパン	200	469.00	93,800
ダイトロン	100	1,851.00	185,100
ハイデイ日高	800	1,778.00	1,422,400
シークス	700	1,591.00	1,113,700
京都きもの友禅	300	260.00	78,000
コロワイド	1,700	1,893.00	3,218,100
ピーシーデポコーポ	600	490.00	294,000
田中商事	200	692.00	138,400
オーハシテクニカ	200	1,588.00	317,600
壱番屋	300	4,860.00	1,458,000
白銅	100	1,753.00	175,300
トップカルチャー	100	356.00	35,600
PLANT	200	743.00	148,600
スギホールディングス	1,000	8,500.00	8,500,000
ダイコー通産	100	1,775.00	177,500
薬王堂ホールディングス	100	2,585.00	258,500
島津製作所	6,900	4,115.00	28,393,500
JMS	500	963.00	481,500
クボテック	200	373.00	74,600
長野計器	400	1,079.00	431,600
ブイ・テクノロジー	200	5,910.00	1,182,000
スター精密	900	1,669.00	1,502,100

東京計器	300	926.00	277,800
愛知時計	100	4,315.00	431,500
インターアクション	200	2,476.00	495,200
オーバル	600	284.00	170,400
東京精密	1,000	5,600.00	5,600,000
マニー	2,100	2,838.00	5,959,800
ニコン	8,300	1,060.00	8,798,000
トプコン	2,800	1,429.00	4,001,200
オリンパス	30,000	2,314.50	69,435,000
理研計器	600	2,843.00	1,705,800
S C R E E Nホールディングス	800	10,790.00	8,632,000
キヤノン電子	600	1,763.00	1,057,800
タムロン	500	2,252.00	1,126,000
H O Y A	10,700	13,705.00	146,643,500
シード	100	816.00	81,600
ノーリツ鋼機	600	2,705.00	1,623,000
エー・アンド・デイ	500	1,390.00	695,000
朝日インテック	5,800	3,145.00	18,241,000
キヤノン	26,900	2,576.00	69,294,400
リコー	13,700	1,160.00	15,892,000
シチズン時計	6,900	379.00	2,615,100
リズム	200	870.00	174,000
大研医器	500	565.00	282,500
メニコン	900	7,170.00	6,453,000
シンシア	100	1,021.00	102,100
中本パックス	200	1,631.00	326,200
スノーピーク	200	3,800.00	760,000
パラマウントベッドHD	1,200	2,244.00	2,692,800
トランザクション	200	1,350.00	270,000
粧美堂	200	411.00	82,200
ニホンフラッシュ	600	1,378.00	826,800
前田工織	500	3,340.00	1,670,000
永大産業	700	296.00	207,200
アートネイチャー	600	670.00	402,000
バンダイナムコHLDGS	4,500	8,455.00	38,047,500
アイフィスジャパン	200	752.00	150,400
共立印刷	1,000	136.00	136,000
S H O E I	600	4,470.00	2,682,000
フランスベッドHLDGS	700	940.00	658,000
マーベラス	900	907.00	816,300

パイロットコーポレーション	800	3,505.00	2,804,000
萩原工業	200	1,478.00	295,600
エイベックス	1,000	1,451.00	1,451,000
トッパン・フォームズ	900	1,120.00	1,008,000
フジシールインターナショナル	1,100	2,463.00	2,709,300
タカラトミー	2,300	993.00	2,283,900
廣済堂	300	1,007.00	302,100
エステールホールディングス	200	627.00	125,400
レック	600	1,295.00	777,000
タカノ	300	639.00	191,700
三光合成	500	437.00	218,500
プロネクサス	600	1,185.00	711,000
ホクシン	300	123.00	36,900
ウッドワン	300	1,240.00	372,000
大建工業	300	2,077.00	623,100
き も と	900	221.00	198,900
凸版印刷	8,200	1,928.00	15,809,600
大日本印刷	6,500	2,292.00	14,898,000
共同印刷	200	2,892.00	578,400
N I S S H A	1,100	1,338.00	1,471,800
光村印刷	100	1,734.00	173,400
藤森工業	600	4,395.00	2,637,000
ヴィア・ホールディングス	600	211.00	126,600
TAKARA & COMPANY	200	1,906.00	381,200
前澤化成工業	300	1,108.00	332,400
未来工業	100	1,841.00	184,100
アシックス	4,700	1,800.00	8,460,000
ツ ツ ミ	200	2,119.00	423,800
ウェーブロックHLDGS	300	767.00	230,100
ジェイ エス ピー	200	1,832.00	366,400
ニ チ ハ	800	3,170.00	2,536,000
ローランド	200	4,310.00	862,000
エフピコ	900	4,465.00	4,018,500
小松ウオール工業	200	1,931.00	386,200
ヤマハ	3,100	6,340.00	19,654,000
河合楽器	200	3,420.00	684,000
クリナップ	600	525.00	315,000
ピジヨン	3,600	4,085.00	14,706,000
天馬	400	2,271.00	908,400
オリバー	200	2,892.00	578,400

キングジム	500	946.00	473,000
象印マホービン	1,500	1,952.00	2,928,000
リンテック	1,200	2,515.00	3,018,000
信越ポリマー	900	1,030.00	927,000
東リ	1,300	251.00	326,300
イトーキ	1,000	397.00	397,000
任天堂	3,100	64,850.00	201,035,000
三菱鉛筆	1,000	1,556.00	1,556,000
松風	100	2,040.00	204,000
タカラスタンダード	1,200	1,631.00	1,957,200
コクヨ	2,500	1,758.00	4,395,000
ナカバヤシ	600	613.00	367,800
ニフコ	2,100	3,985.00	8,368,500
立川ブラインド	100	1,328.00	132,800
グローブライド	200	4,570.00	914,000
オカムラ	2,100	1,280.00	2,688,000
バルカー	500	2,160.00	1,080,000
MUTOHホールディングス	100	1,608.00	160,800
伊藤忠	37,300	3,495.00	130,363,500
丸紅	52,700	911.30	48,025,510
スクロール	800	1,007.00	805,600
高島	100	1,772.00	177,200
ヨンドシーホールディングス	600	1,891.00	1,134,600
三陽商会	200	763.00	152,600
長瀬産業	3,000	1,728.00	5,184,000
ナイガイ	100	345.00	34,500
蝶理	300	1,642.00	492,600
豊田通商	5,400	4,805.00	25,947,000
オンワ - ドホールディングス	3,100	293.00	908,300
三共生興	800	525.00	420,000
兼松	2,100	1,462.00	3,070,200
美津濃	700	2,215.00	1,550,500
ツカモトコーポレーション	100	1,453.00	145,300
ルックホールディングス	300	1,247.00	374,100
三井物産	43,300	2,290.00	99,157,000
日本紙パルプ	200	3,595.00	719,000
東京エレクトロン	3,000	49,730.00	149,190,000
カメイ	700	1,236.00	865,200
東都水産	100	4,415.00	441,500
OUGホールディングス	100	2,814.00	281,400

スターゼン	200	2,358.00	471,600
セイコーHD	800	1,942.00	1,553,600
山 善	2,000	1,019.00	2,038,000
椿本興業	100	3,675.00	367,500
住友商事	33,700	1,544.50	52,049,650
日本ユニシス	1,800	3,410.00	6,138,000
内田洋行	100	4,900.00	490,000
三菱商事	32,500	3,046.00	98,995,000
第一実業	100	4,125.00	412,500
キヤノンマーケティングJPN	1,300	2,493.00	3,240,900
西華産業	200	1,624.00	324,800
佐藤商事	500	995.00	497,500
菱洋エレクトロ	500	2,699.00	1,349,500
東京産業	600	612.00	367,200
ユアサ商事	700	3,055.00	2,138,500
神鋼商事	200	2,213.00	442,600
トルク	200	261.00	52,200
阪和興業	1,000	3,295.00	3,295,000
正栄食品	300	4,435.00	1,330,500
カナデン	500	1,184.00	592,000
菱電商事	400	1,658.00	663,200
ニプロ	4,000	1,309.00	5,236,000
フルサト工業	200	1,344.00	268,800
岩谷産業	1,400	6,870.00	9,618,000
ナイス	100	1,777.00	177,700
昭光通商	200	796.00	159,200
ニチモウ	100	2,054.00	205,400
極東貿易	200	1,389.00	277,800
イワキ	700	657.00	459,900
兼松エレクトロニクス	200	3,750.00	750,000
三愛石油	1,200	1,253.00	1,503,600
稲畑産業	1,400	1,655.00	2,317,000
G S Iクレオス	400	1,261.00	504,400
明和産業	600	483.00	289,800
クワザワホールディングス	300	626.00	187,800
キムラタン	3,000	26.00	78,000
ヤマエ久野	400	1,173.00	469,200
ゴ-ルドウイン	900	6,950.00	6,255,000
ユニ・チャ-ム	11,400	4,566.00	52,052,400
デサント	1,000	1,997.00	1,997,000

キング	200	573.00	114,600
ワキタ	1,000	1,040.00	1,040,000
ヤマトインタ - ナショナル	600	341.00	204,600
東邦ホールディングス	1,600	1,952.00	3,123,200
サンゲツ	1,400	1,587.00	2,221,800
ミツウロコグループ	800	1,342.00	1,073,600
シナネンホールディングス	100	2,925.00	292,500
伊藤忠エネクス	1,300	1,059.00	1,376,700
サンリオ	1,500	1,775.00	2,662,500
サンワテクノス	300	1,164.00	349,200
リョーサン	500	2,196.00	1,098,000
新光商事	700	779.00	545,300
トーホー	100	1,830.00	183,000
三信電気	200	1,996.00	399,200
東陽テクニカ	500	1,096.00	548,000
モスフード サービス	800	3,160.00	2,528,000
加賀電子	600	2,506.00	1,503,600
三益半導体	500	2,940.00	1,470,000
都築電気	300	1,776.00	532,800
ソーダニツカ	600	553.00	331,800
立花エレテック	500	1,625.00	812,500
木曽路	700	2,364.00	1,654,800
S R Sホールディングス	600	840.00	504,000
千趣会	900	378.00	340,200
タカキュー	500	144.00	72,000
リテールパートナーズ	600	1,365.00	819,000
ケーヨー	900	715.00	643,500
上新電機	600	3,055.00	1,833,000
日本瓦斯	2,700	1,947.00	5,256,900
ロイヤルホールディングス	1,000	1,996.00	1,996,000
東天紅	100	994.00	99,400
いなげや	500	1,654.00	827,000
チヨダ	500	963.00	481,500
ライフコーポレーション	500	3,355.00	1,677,500
リンガーハット	600	2,318.00	1,390,800
MrMaxHD	700	714.00	499,800
テンアライド	600	332.00	199,200
AOKIホールディングス	1,000	625.00	625,000
オークワ	900	1,187.00	1,068,300
コメリ	900	2,949.00	2,654,100

青山商事	1,300	840.00	1,092,000
しまむら	600	11,530.00	6,918,000
はせがわ	200	313.00	62,600
高島屋	3,900	1,129.00	4,403,100
松屋	1,200	924.00	1,108,800
エイチ・ツー・オーリテイリング	2,400	827.00	1,984,800
近鉄百貨店	100	3,285.00	328,500
丸井グループ	4,500	2,085.00	9,382,500
クレディセゾン	3,200	1,322.00	4,230,400
アクシアルリテイリング	500	4,615.00	2,307,500
井筒屋	200	245.00	49,000
イオン	20,600	3,212.00	66,167,200
イズミ	1,000	4,320.00	4,320,000
フオーバル	100	820.00	82,000
平和堂	900	2,328.00	2,095,200
フジ	600	2,071.00	1,242,600
ヤオコー	500	6,970.00	3,485,000
ゼビオホールディングス	600	904.00	542,400
ケーズホールディングス	4,700	1,527.00	7,176,900
PALTAC	900	5,820.00	5,238,000
三谷産業	700	455.00	318,500
OLYMPICグループ	200	841.00	168,200
日産東京販売HD	800	252.00	201,600
新生銀行	4,300	1,711.00	7,357,300
あおぞら銀行	3,100	2,425.00	7,517,500
三菱UFJフィナンシャルG	365,400	582.60	212,882,040
りそなホールディングス	61,508	449.20	27,629,393
三井住友トラストHD	10,200	3,748.00	38,229,600
三井住友フィナンシャルG	37,000	3,873.00	143,301,000
千葉銀行	17,800	701.00	12,477,800
群馬銀行	11,100	366.00	4,062,600
武蔵野銀行	800	1,728.00	1,382,400
千葉興業銀行	1,300	281.00	365,300
筑波銀行	2,200	176.00	387,200
七十七銀行	1,700	1,449.00	2,463,300
青森銀行	500	2,420.00	1,210,000
秋田銀行	200	1,413.00	282,600
山形銀行	500	1,057.00	528,500
岩手銀行	300	2,231.00	669,300
東邦銀行	4,700	229.00	1,076,300



東北銀行	200	1,053.00	210,600	
みちのく銀行	300	1,019.00	305,700	
ふくおかフィナンシャルG	4,800	1,998.00	9,590,400	
静岡銀行	12,900	854.00	11,016,600	
十六銀行	600	2,092.00	1,255,200	
スルガ銀行	4,600	400.00	1,840,000	
八十二銀行	12,100	374.00	4,525,400	
山梨中央銀行	600	867.00	520,200	
大垣共立銀行	1,000	2,065.00	2,065,000	
福井銀行	500	1,846.00	923,000	
北國銀行	600	2,564.00	1,538,400	
清水銀行	100	1,628.00	162,800	
富山銀行	100	2,808.00	280,800	
滋賀銀行	1,000	2,309.00	2,309,000	
南都銀行	800	1,836.00	1,468,800	
百五銀行	4,700	311.00	1,461,700	
京都銀行	2,000	6,440.00	12,880,000	
紀陽銀行	2,000	1,531.00	3,062,000	
ほくほくフィナンシャルG	3,500	979.00	3,426,500	
山陰合同銀行	3,400	523.00	1,778,200	
中国銀行	4,600	885.00	4,071,000	
鳥取銀行	200	1,113.00	222,600	
伊予銀行	7,000	620.00	4,340,000	
百十四銀行	500	1,576.00	788,000	
四国銀行	800	741.00	592,800	
阿波銀行	800	2,279.00	1,823,200	
大分銀行	200	2,021.00	404,200	
宮崎銀行	300	2,251.00	675,300	
佐賀銀行	200	1,415.00	283,000	
沖縄銀行	600	2,870.00	1,722,000	
琉球銀行	1,200	741.00	889,200	
セブン銀行	17,800	245.00	4,361,000	
みずほフィナンシャルG	72,400	1,560.00	112,944,000	
高知銀行	100	799.00	79,900	
山口フィナンシャルG	6,700	686.00	4,596,200	
芙蓉総合リース	500	7,330.00	3,665,000	
みずほリース	900	3,330.00	2,997,000	
東京センチュリー	1,300	7,380.00	9,594,000	
SBIホールディングス	6,500	3,055.00	19,857,500	
日本証券金融	2,300	811.00	1,865,300	

アイフル	9,000	308.00	2,772,000
日本アジア投資	500	256.00	128,000
長野銀行	200	1,256.00	251,200
名古屋銀行	500	2,972.00	1,486,000
北洋銀行	8,000	290.00	2,320,000
愛知銀行	300	2,874.00	862,200
中京銀行	100	1,689.00	168,900
大光銀行	300	1,467.00	440,100
愛媛銀行	700	970.00	679,000
トマト銀行	100	1,078.00	107,800
京葉銀行	2,300	434.00	998,200
栃木銀行	2,500	183.00	457,500
北日本銀行	200	1,861.00	372,200
東和銀行	800	633.00	506,400
福島銀行	600	241.00	144,600
大東銀行	200	630.00	126,000
リコーリース	500	3,460.00	1,730,000
イオンフィナンシャルサービス	3,200	1,462.00	4,678,400
アコム	10,700	513.00	5,489,100
ジャックス	500	2,228.00	1,114,000
オリコ	14,400	146.00	2,102,400
オリックス	33,500	1,821.50	61,020,250
三菱HCキャピタル	19,240	636.00	12,236,640
ジャフコグループ	900	7,070.00	6,363,000
九州リースサービス	200	683.00	136,600
トモニホールディングス	4,200	309.00	1,297,800
大和証券G本社	40,100	575.00	23,057,500
野村ホールディングス	81,500	585.00	47,677,500
岡三証券グループ	4,600	455.00	2,093,000
丸三証券	1,600	653.00	1,044,800
東洋証券	1,700	191.00	324,700
東海東京HD	5,800	406.00	2,354,800
光世証券	200	753.00	150,600
水戸証券	1,400	313.00	438,200
いちよし証券	1,000	599.00	599,000
松井証券	2,700	932.00	2,516,400
SOMPOホールディングス	9,500	4,138.00	39,311,000
日本取引所グループ	14,300	2,875.00	41,112,500
マネックスG	4,700	989.00	4,648,300
極東証券	700	848.00	593,600

岩井コスモホールディング	700	1,742.00	1,219,400
藍澤證券	800	1,027.00	821,600
フィデアホール	5,200	130.00	676,000
池田泉州HD	6,200	172.00	1,066,400
アニコムホールディングス	1,500	987.00	1,480,500
MS&AD	12,900	3,185.00	41,086,500
マネーパートナーズGP	500	261.00	130,500
スパークス・グループ	2,400	321.00	770,400
小林洋行	200	282.00	56,400
第一生命HLDGS	28,200	1,998.00	56,343,600
東京海上HD	17,600	5,206.00	91,625,600
アドバンテッジリスクマネ	200	714.00	142,800
イー・ギャランティ	600	2,105.00	1,263,000
アサックス	200	705.00	141,000
NECキャピタルソリューション	100	2,000.00	200,000
T&Dホールディングス	15,900	1,371.00	21,798,900
アドバンスクリエイト	400	1,042.00	416,800
三井不動産	24,400	2,437.50	59,475,000
三菱地所	35,100	1,905.00	66,865,500
平和不動産	1,000	3,640.00	3,640,000
東京建物	5,300	1,683.00	8,919,900
ダイビル	1,300	1,345.00	1,748,500
京阪神ビルディング	1,000	1,504.00	1,504,000
住友不動産	12,000	3,795.00	45,540,000
太平洋興発	100	689.00	68,900
テーオーシー	1,000	774.00	774,000
東京楽天地	100	4,815.00	481,500
レオパレス21	4,400	154.00	677,600
スターツコーポレーション	600	2,900.00	1,740,000
フジ住宅	600	720.00	432,000
空港施設	600	586.00	351,600
明和地所	200	669.00	133,800
ゴールドクレスト	600	1,681.00	1,008,600
リログループ	2,800	2,359.00	6,605,200
エスリード	100	1,684.00	168,400
日神グループHLDGS	800	493.00	394,400
日本エスコン	900	795.00	715,500
タカラレーベン	2,200	365.00	803,000
AVANTIA	200	911.00	182,200
イオンモール	2,800	1,803.00	5,048,400

毎日コムネット	200	767.00	153,400
ファースト住建	100	1,389.00	138,900
ランド	29,100	12.00	349,200
カチタス	1,300	3,245.00	4,218,500
東祥	300	1,863.00	558,900
トーセイ	700	1,132.00	792,400
穴吹興産	200	2,093.00	418,600
サンフロンティア不動産	600	949.00	569,400
エフ・ジェー・ネクスト	600	1,084.00	650,400
インテリックス	200	776.00	155,200
ランドビジネス	300	378.00	113,400
サンネクスタグループ	200	1,013.00	202,600
グランディハウス	300	461.00	138,300
東武鉄道	5,700	2,925.00	16,672,500
相鉄ホールディングス	1,800	2,392.00	4,305,600
東急	13,600	1,424.00	19,366,400
京浜急行	6,900	1,514.00	10,446,600
小田急電鉄	8,800	2,963.00	26,074,400
京王電鉄	3,000	7,280.00	21,840,000
京成電鉄	4,000	3,515.00	14,060,000
富士急行	700	5,900.00	4,130,000
新京成電鉄	200	2,162.00	432,400
東日本旅客鉄道	9,500	7,450.00	70,775,000
西日本旅客鉄道	4,800	5,918.00	28,406,400
東海旅客鉄道	4,500	15,840.00	71,280,000
西武ホールディングス	6,500	1,155.00	7,507,500
鴻池運輸	900	1,179.00	1,061,100
西日本鉄道	1,500	2,902.00	4,353,000
ハマキョウレックス	500	3,110.00	1,555,000
サカイ引越センター	100	4,910.00	491,000
近鉄グループHLDGS	5,100	4,155.00	21,190,500
阪急阪神HLDGS	6,900	3,450.00	23,805,000
南海電鉄	2,300	2,482.00	5,708,600
京阪ホールディングス	2,300	4,380.00	10,074,000
神戸電鉄	200	3,590.00	718,000
名古屋鉄道	4,300	2,565.00	11,029,500
山陽電鉄	300	1,864.00	559,200
アルプス物流	300	915.00	274,500
トランコム	200	8,810.00	1,762,000
日本通運	1,700	8,170.00	13,889,000

ヤマトホールディングス	7,300	3,070.00	22,411,000
山 九	1,200	4,855.00	5,826,000
日 新	500	1,443.00	721,500
丸 運	200	274.00	54,800
丸全昭和運輸	500	3,185.00	1,592,500
センコーグループHLDGS	2,800	1,041.00	2,914,800
トナミホールディングス	200	5,400.00	1,080,000
ニッコンホールディングス	1,600	2,186.00	3,497,600
日石輸送	100	2,670.00	267,000
福山通運	600	4,410.00	2,646,000
セイノーホールディングス	3,900	1,530.00	5,967,000
エスライン	200	906.00	181,200
神奈川中央交通	200	3,675.00	735,000
日立物流	1,200	3,535.00	4,242,000
丸和運輸機関	1,000	1,937.00	1,937,000
C & F ロジホールディングス	600	1,812.00	1,087,200
日本郵船	4,200	4,155.00	17,451,000
商船三井	3,100	4,215.00	13,066,500
川崎汽船	1,600	2,817.00	4,507,200
NSユナイテッド海運	100	1,941.00	194,100
明治海運	700	496.00	347,200
飯野海運	2,400	528.00	1,267,200
共栄タンカー	100	987.00	98,700
九州旅客鉄道	3,900	2,454.00	9,570,600
SGホールディングス	9,700	2,509.00	24,337,300
日本航空	12,400	2,338.00	28,991,200
ANAホールディングス	13,900	2,458.50	34,173,150
パスコ	100	1,453.00	145,300
西本WISMETTAC HD	200	2,900.00	580,000
シルバーライフ	100	2,440.00	244,000
ヤマシタヘルスケアHLDGS	100	2,143.00	214,300
一家ダイニングプロジ	100	565.00	56,500
GENKY DRUGSTORES	100	3,860.00	386,000
コア商事HLDGS	200	1,769.00	353,800
国際紙パルプ商事	1,200	247.00	296,400
ナルミヤ・インターナショナル	100	1,265.00	126,500
ブックオフGHD	200	1,005.00	201,000
ギフト	100	2,413.00	241,300
三菱倉庫	1,700	3,385.00	5,754,500
三井倉庫HOLD	700	2,265.00	1,585,500

住友倉庫	1,800	1,495.00	2,691,000
渋沢倉庫	200	2,198.00	439,600
ヤマタネ	100	1,488.00	148,800
東陽倉庫	900	340.00	306,000
乾汽船	200	1,099.00	219,800
日本トランスシティ	1,200	524.00	628,800
ケイヒン	100	1,375.00	137,500
中央倉庫	200	1,121.00	224,200
川西倉庫	100	1,165.00	116,500
安田倉庫	500	955.00	477,500
ファイズホールディングス	100	943.00	94,300
東洋埠頭	200	1,513.00	302,600
宇徳	300	507.00	152,100
上組	2,800	2,166.00	6,064,800
サンリツ	200	732.00	146,400
キムラユニティー	200	1,186.00	237,200
キューソー流通システム	200	1,621.00	324,200
近鉄エクスプレス	900	2,790.00	2,511,000
東海運	200	358.00	71,600
エーアイテイー	300	999.00	299,700
内外トランスライン	300	1,478.00	443,400
ショーエイコーポ	200	1,105.00	221,000
日本コンセプト	200	1,687.00	337,400
TBSホールディングス	3,600	2,203.00	7,930,800
日本テレビHLD S	4,400	1,413.00	6,217,200
朝日放送グループHD	600	711.00	426,600
テレビ朝日HD	1,700	2,043.00	3,473,100
スカパーJ S A T H D	3,600	491.00	1,767,600
テレビ東京HD	400	2,397.00	958,800
日本BS放送	300	1,137.00	341,100
ビジョン	600	1,009.00	605,400
スマートバリュー	200	875.00	175,000
USEN-NEXT HLDGS	100	2,452.00	245,200
ワイヤレスゲート	100	449.00	44,900
コネクシオ	200	1,388.00	277,600
日本通信	4,600	271.00	1,246,600
クロップス	100	913.00	91,300
日本電信電話	62,100	2,848.00	176,860,800
KDDI	42,700	3,490.00	149,023,000
ソフトバンク	48,200	1,442.50	69,528,500

光通信	600	22,480.00	13,488,000
エムティーアイ	600	824.00	494,400
GMOインターネット	2,000	3,550.00	7,100,000
ファイバーゲート	200	1,820.00	364,000
アйдママーケティングコミュ	200	462.00	92,400
KADOKAWA	1,400	4,510.00	6,314,000
学研ホールディングス	700	1,413.00	989,100
ゼンリン	900	1,297.00	1,167,300
昭文社ホールディングス	100	464.00	46,400
インプレスホールディングス	500	253.00	126,500
東京電力HD	46,000	356.00	16,376,000
中部電力	16,600	1,348.50	22,385,100
関西電力	20,600	1,115.50	22,979,300
中国電力	7,800	1,290.00	10,062,000
北陸電力	5,000	726.00	3,630,000
東北電力	12,700	1,031.00	13,093,700
四国電力	4,500	828.00	3,726,000
九州電力	12,000	1,052.00	12,624,000
北海道電力	5,000	470.00	2,350,000
沖縄電力	1,000	1,451.00	1,451,000
電源開発	4,200	1,867.00	7,841,400
エフオン	300	1,120.00	336,000
イーレックス	800	1,932.00	1,545,600
レノバ	1,000	3,195.00	3,195,000
東京瓦斯	10,400	2,313.00	24,055,200
大阪瓦斯	9,900	2,061.00	20,403,900
東邦瓦斯	2,700	6,450.00	17,415,000
北海道瓦斯	200	1,531.00	306,200
広島ガス	1,100	390.00	429,000
西部ガスHLDGS	600	2,778.00	1,666,800
静岡ガス	1,600	921.00	1,473,600
メタウォーター	600	2,284.00	1,370,400
アイネット	200	1,473.00	294,600
松竹	300	13,160.00	3,948,000
東宝	3,200	4,700.00	15,040,000
エイチ・アイ・エス	800	2,192.00	1,753,600
東映	200	23,440.00	4,688,000
ラックランド	200	2,473.00	494,600
NTTデータ	14,100	1,753.00	24,717,300
共立メンテナンス	900	3,515.00	3,163,500

イチネンホールディングス	700	1,350.00	945,000
建設技術研究所	300	2,516.00	754,800
スペース	300	930.00	279,000
長 大	100	1,805.00	180,500
アインホールディングス	800	6,970.00	5,576,000
燦ホールディングス	100	1,109.00	110,900
ピー・シー・エー	100	4,300.00	430,000
東京テアトル	100	1,251.00	125,100
タナベ経営	100	1,392.00	139,200
ビジネスB太田昭和	300	1,840.00	552,000
ナ ガ ワ	200	8,560.00	1,712,000
東京都競馬	300	6,020.00	1,806,000
常磐興産	100	1,403.00	140,300
カナモト	1,000	2,822.00	2,822,000
D T S	1,000	2,553.00	2,553,000
スクウェア・エニックス・HD	2,300	6,120.00	14,076,000
シーイーシー	500	1,454.00	727,000
カプコン	4,600	3,775.00	17,365,000
西尾レントオール	600	3,090.00	1,854,000
アイ・エス・ビー	100	1,286.00	128,600
アゴーラ・ホスピタリティーG	2,800	26.00	72,800
日本空港ビルデング	1,800	5,260.00	9,468,000
トランス・コスモス	600	3,080.00	1,848,000
乃村工藝社	2,200	914.00	2,010,800
ジャステック	300	1,258.00	377,400
S C S K	1,300	6,510.00	8,463,000
藤田観光	100	1,949.00	194,900
K N T - C Tホールディングス	200	998.00	199,600
日本管財	700	2,179.00	1,525,300
トーカイ	600	2,501.00	1,500,600
白 洋 舎	100	2,390.00	239,000
セコム	5,100	9,392.00	47,899,200
日本システムウエア	200	2,099.00	419,800
セントラル警備保障	100	3,365.00	336,500
アイネス	600	1,404.00	842,400
丹青社	900	875.00	787,500
メイテック	600	5,850.00	3,510,000
T K C	1,000	3,505.00	3,505,000
富士ソフト	500	5,590.00	2,795,000
応用地質	500	1,322.00	661,000



船井総研ホールディング	1,000	2,126.00	2,126,000
N S D	1,600	1,857.00	2,971,200
進学会ホールディングス	100	433.00	43,300
丸紅建材リース	100	1,884.00	188,400
オ オ バ	300	865.00	259,500
コナミホールディングス	2,000	6,880.00	13,760,000
いであ	200	1,785.00	357,000
学 究 社	200	1,306.00	261,200
ベネッセホールディングス	2,000	2,548.00	5,096,000
イオンディライト	600	3,250.00	1,950,000
ナック	100	937.00	93,700
福井コンピュータH L D S	100	4,570.00	457,000
ダイセキ	900	4,160.00	3,744,000
ステップ	300	1,600.00	480,000
日鉄物産	300	3,925.00	1,177,500
泉州電業	200	3,510.00	702,000
元気寿司	200	2,661.00	532,200
トラスコ中山	1,300	2,797.00	3,636,100
ヤマダホールディングス	17,900	584.00	10,453,600
オートバックスセブン	2,100	1,492.00	3,133,200
モリト	400	632.00	252,800
アーランドサカモト	900	1,670.00	1,503,000
ニトリホールディングス	2,100	20,340.00	42,714,000
グルメ杵屋	300	942.00	282,600
愛 眼	500	228.00	114,000
ケーユーホールディングス	200	1,035.00	207,000
吉野家ホールディングス	1,700	2,169.00	3,687,300
加藤産業	800	3,450.00	2,760,000
北恵	200	955.00	191,000
イノテック	200	1,346.00	269,200
イエローハット	900	1,851.00	1,665,900
松屋フーズH L D G S	200	3,465.00	693,000
J B C Cホールディングス	300	1,441.00	432,300
J Kホールディングス	600	833.00	499,800
サガミホールディングス	700	1,098.00	768,600
日 伝	500	2,137.00	1,068,500
関西スーパーマーケット	500	1,102.00	551,000
ミロク情報サービス	600	2,007.00	1,204,200
北沢産業	300	266.00	79,800
杉本商事	200	2,284.00	456,800

因幡電機産業	1,400	2,686.00	3,760,400	
王将フードサービス	300	5,730.00	1,719,000	
ブレナス	500	1,862.00	931,000	
ミニストップ	500	1,425.00	712,500	
アークス	900	2,316.00	2,084,400	
パローホールディングス	1,000	2,437.00	2,437,000	
東 テ ク	200	2,843.00	568,600	
ミスミグループ本社	6,700	3,235.00	21,674,500	
藤 久	200	787.00	157,400	
アルテック	400	334.00	133,600	
ベ ル ク	200	6,110.00	1,222,000	
大 庄	200	992.00	198,400	
タキヒヨー	200	1,793.00	358,600	
ファーストリテイリング	700	87,890.00	61,523,000	
ソフトバンクグループ	42,200	9,950.00	419,890,000	
蔵王産業	100	1,385.00	138,500	
スズケン	2,300	4,095.00	9,418,500	
サンドラッグ	2,100	3,985.00	8,368,500	
サックスパーホールディング	500	599.00	299,500	
ジェコス	300	946.00	283,800	
ヤマザワ	200	1,741.00	348,200	
や ま や	200	2,311.00	462,200	
グローセル	500	431.00	215,500	
ベルーナ	1,200	1,173.00	1,407,600	
合計			14,538,519,123	

(注) 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

ソニーグループ	2,500株	トヨタ自動車	4,000株
本田技研	3,000株	三菱UFJフィナンシャルG	30,000株
三井住友フィナンシャルG	3,000株	KDDI	3,000株

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2021年4月30日

資産総額	16,345,334,209円
負債総額	162,513,553円
純資産総額( - )	16,182,820,656円
発行済数量	8,520,515口
1単位当たり純資産額( / )	1,899.3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、交換株式の交付および償還金の支払い等については、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4月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

## ホ．リスクマネジメント会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年4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	44	90,031
追加型株式投資信託	744	20,409,346
株式投資信託 合計	788	20,499,377
単位型公社債投資信託	57	169,969
追加型公社債投資信託	14	1,535,589
公社債投資信託 合計	71	1,705,558
総合計	859	22,204,935



## 3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金	2,741	4,860
有価証券	22,167	333
前払費用	205	237
未収委託者報酬	10,847	13,150
未収収益	63	49
関係会社短期貸付金	-	18,700
その他	62	207
<b>流動資産計</b>	<b>36,088</b>	<b>37,539</b>
<b>固定資産</b>		
<b>有形固定資産</b>	<b>1</b>	<b>1</b>
建物	7	6
器具備品	209	218
<b>無形固定資産</b>	<b>2,362</b>	<b>1,937</b>
ソフトウェア	2,028	1,882
ソフトウェア仮勘定	333	54
<b>投資その他の資産</b>	<b>15,844</b>	<b>16,121</b>
投資有価証券	9,153	10,159
関係会社株式	3,972	3,705
出資金	183	183
長期差入保証金	1,069	1,068
繰延税金資産	1,431	973
その他	33	30

固定資産計	18,424	18,283
資産合計	54,512	55,822

(単位:百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	69	68
未払金	7,573	8,405
未払収益分配金	14	13
未払償還金	39	39
未払手数料	3,988	4,734
その他未払金	2 3,530	2 3,617
未払費用	3,830	3,777
未払法人税等	656	804
未払消費税等	590	631
賞与引当金	688	950
その他	5	88
流動負債計	13,414	14,725
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,574	2,452
役員退職慰労引当金	88	74
その他	5	3
固定負債計	2,667	2,530
負債合計	16,082	17,256
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,749	10,574
利益剰余金合計	12,123	10,948
株主資本合計	38,793	37,618

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	363	947
評価・換算差額等合計	363	947
純資産合計	38,430	38,566
負債・純資産合計	54,512	55,822

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	69,550	65,487
その他営業収益	583	419
営業収益計	70,134	65,906
営業費用		
支払手数料	31,120	27,965
広告宣伝費	745	624
調査費	8,858	8,245
調査費	1,188	1,134
委託調査費	7,670	7,110
委託計算費	1,410	1,501
営業雑経費	1,770	1,870
通信費	240	240
印刷費	524	478
協会費	56	51
諸会費	13	14
その他営業雑経費	936	1,084
営業費用計	43,906	40,207
一般管理費		
給料	5,793	5,991
役員報酬	374	351
給料・手当	4,335	4,293
賞与	395	395
賞与引当金繰入額	688	950
福利厚生費	838	893
交際費	62	32
旅費交通費	154	37
租税公課	451	472
不動産賃借料	1,299	1,302

退職給付費用	368	449
役員退職慰労引当金繰入額	37	28
固定資産減価償却費	925	661
諸経費	1,770	1,763
一般管理費計	11,702	11,631
営業利益	14,525	14,067

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31 日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	214	578
有価証券償還益	24	42
その他	991	68
営業外収益計	1,230	689
営業外費用		
投資有価証券売却損	1	69
有価証券償還損	71	47
その他	54	24
営業外費用計	127	141
経常利益	15,629	14,616
特別損失		
システム刷新関連費用	537	547
関係会社整理損失	-	267
投資有価証券評価損	48	45
特別損失計	585	860
税引前当期純利益	15,043	13,756
法人税、住民税及び事業税	4,555	4,476
法人税等調整額	78	109
法人税等合計	4,477	4,366
当期純利益	10,566	9,389

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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	利益剰余金 合計	
				剰余金 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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	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	利益剰余金 合計	
				剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

当期変動額						
残余金の配当	-	-	-	10,564	10,564	10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,175	1,175	1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	評価・換算差額等		純資産合計
	其他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	363	363	38,430
当期変動額			
残余金の配当	-	-	10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

## 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）其他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

#### 2．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 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。この結果、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

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。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7 - 4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（未適用の会計基準等）

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

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

（表示方法の変更）

（損益計算書関係）

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。

この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」912百万円、「その他」78百万円は、「その他」991百万円として組替えております。

（注記に関する表示方法の変更）

「会計上の見積りの開示に関する会計基準」（企業会計基準第31号 2020年3月31日。以下「見積り会計基準」という）が公表日以後終了する事業年度における年度末に係る財務諸表から適用できることになったことに伴い、当事業年度末から適用し、（重要な会計上の見積り）を開示しております。

見積り会計基準の適用については、見積り会計基準第11項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、会計基準第6項及び第7項に定める注記事項について、前事業年度における財務諸表に関する注記を省略しております。

（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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	34百万円	35百万円
器具備品	276百万円	259百万円

## 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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
未払金	3,397百万円	3,473百万円

## 3 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（2021年3月31日）

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

#### 2. 配当に関する事項

##### （1）配当金支払額

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

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

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

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

#### （金融商品関係）

##### 1. 金融商品の状況に関する事項

###### （1）金融商品に対する取組方針

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

###### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 市場リスクの管理

##### ( ) 為替変動リスクの管理

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

##### ( ) 価格変動リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価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。

前事業年度(2020年3月31日)

### (1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
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267百万円、投資有価証券8,426百万円は上記の表に含めておりません。

( 2 ) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

当事業年度( 2021年3月31日)

( 1 ) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

( 単位：百万円 )

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券( 1 )	85	-	-	85
資産合計	85	-	-	85

( 1 ) 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333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

( 2 ) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

( 注1 ) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、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額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貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中の投資有価証券には含めておりません。

( 単位：百万円 )

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,944	1,677
関連会社株式	2,027	2,027

( 有価証券関係 )

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（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、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2021年3月31日）

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

## 2. その他有価証券

前事業年度（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、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	85	55	30
(2) その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	160
小計	2,561	2,721	160
合計	9,826	8,474	1,352

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

## 3. 売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

#### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

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

(退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

##### 2. 確定給付制度

###### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	183	378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

###### (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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,574百万円	2,452百万円

貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,574	2,452
退職給付引当金	2,574	2,452
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,574	2,452

## (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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	159百万円	155百万円
その他	27	108
確定給付制度に係る退職給付費用	187	263

## 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181百万円、当事業年度186百万円であります。

## (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
	(2020年3月31日)	(2021年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	788	750
賞与引当金	177	243
未払事業税	129	170
システム関連費用	198	155
投資有価証券評価損	47	128
出資金評価損	94	94
その他	399	298
繰延税金資産小計	1,835	1,841
評価性引当額	173	254
繰延税金資産合計	1,661	1,586
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	71	453

繰延税金負債合計	230	612
繰延税金資産の純額	1,431	973

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(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。

当事業年度(2021年3月31日)

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

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。



## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## ( 関連当事者情報 )

## 1 . 関連当事者との取引

## ( ア ) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の 名称	住所	資本金また は出資金 (百万円)	事業 の内 容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万 円)	科目	期末残高 (百万 円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会 社	(株)大和証 券グルー プ本社	東京都 千代田 区	247,397	証券 持株 会社 業	被所有 100.0	あり	経営管 理	資金の貸付  利息の受取 (注)	19,300  0	関係会 社短期 貸付金	18,700  -

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## ( イ ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,727	-	-
-----	--	-----------	-----	---------	-----------	------	---------	-------	---	---

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

## 前事業年度(自 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。

## 当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売  本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)  不動産の賃借料(注4)	14,917  527	未払手数料  長期差入保証金	3,321  1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研 ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	883	未払費用	179

同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	527	-	-
-------------	------------	--------	-----	--------	---	---------	-------------	-----	---	---

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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。

(注5) 大和プロパティ株式会社は、2020年10月1日付で大和証券株式会社を存続会社とする吸収合併により消滅しております。このため、取引金額は関連当事者であった期間の金額を記載しております。

## 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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,732.52円	1株当たり純資産額	14,784.79円
1株当たり当期純利益	4,050.66円	1株当たり当期純利益	3,599.54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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,556	9,389
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

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

提出日前1年以内において、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に該当する事実はありません。

##### 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 みずほ信託銀行株式会社

資本金の額 247,369百万円（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	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616	
野村証券株式会社	10,000	
BNP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	

### 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）

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11月9日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年1月18日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年1月25日	臨時報告書



**独立監査人の監査報告書**

2021年5月21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**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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2021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5月14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 竹内 知明 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iFreeETF TOPIX(年4回決算型)の2020年11月9日から2021年4月10日までの特定期間の財務諸表、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、iFreeETF TOPIX(年4回決算型)の2021年4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特定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。