

【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12月28日提出
【計算期間】	第2特定期間 (自 2021年4月11日 至 2021年10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 その他資産 () 資産複合	ETF	特殊型

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

東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所が算出・公表する株価指数で、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークであり、日本経済の動向を示すパラメーターとして経済指標、ETFの連動指標などに用いられています。

- 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「株式会社東京証券取引所」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株式会社東京証券取引所が有する。
- 株式会社東京証券取引所は、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。
- 株式会社東京証券取引所は、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。
- 株式会社東京証券取引所は、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、株式会社東京証券取引所は、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、株式会社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。
- 株式会社東京証券取引所は、「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。
- 株式会社東京証券取引所は、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、株式会社東京証券取引所は「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。

< 委託会社の概況（2021年10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せん。)

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

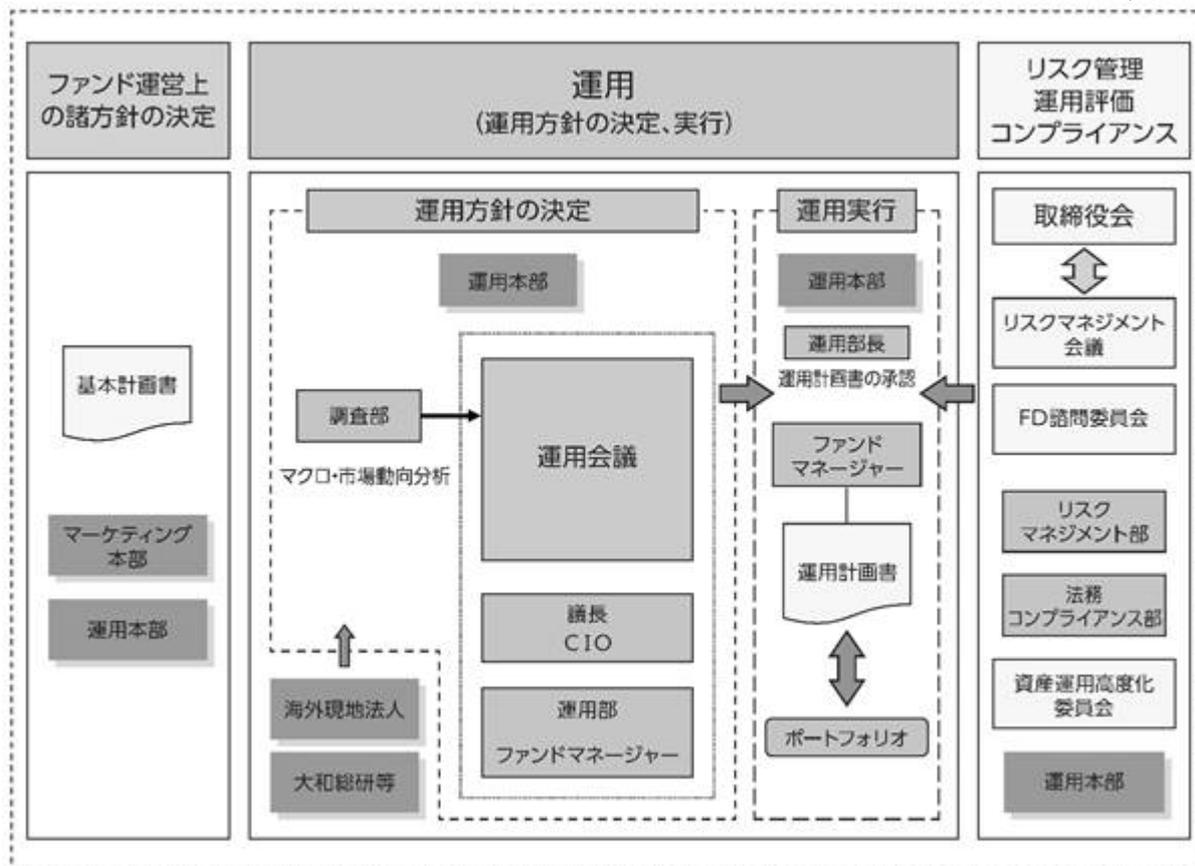
4. 手形割引市場において売買される手形

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。

二．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等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は45～55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10月29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ます。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

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

先物取引等（信託約款）

委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8

項第3号八に掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

デリバティブ取引等(信託約款)

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

株式の貸付け(信託約款)

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

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

ロ. 前イ. 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ます。

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

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への投資は、行ないません。

信用リスク集中回避(信託約款)

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

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

その他

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

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。くわしくは「第2 管理及び運営」をご参照下さい。

(3)その他の留意点

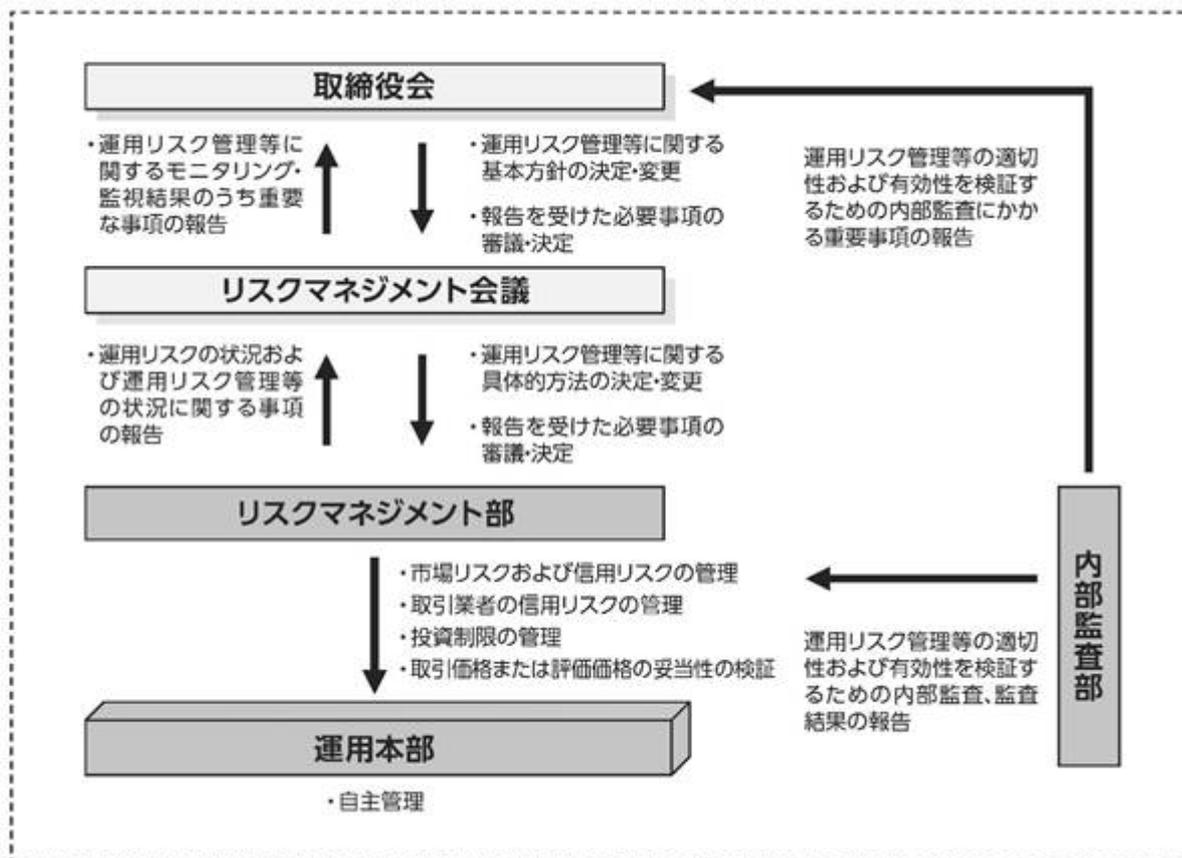
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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。

(4)リスク管理体制

<2021年12月31日まで>

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。

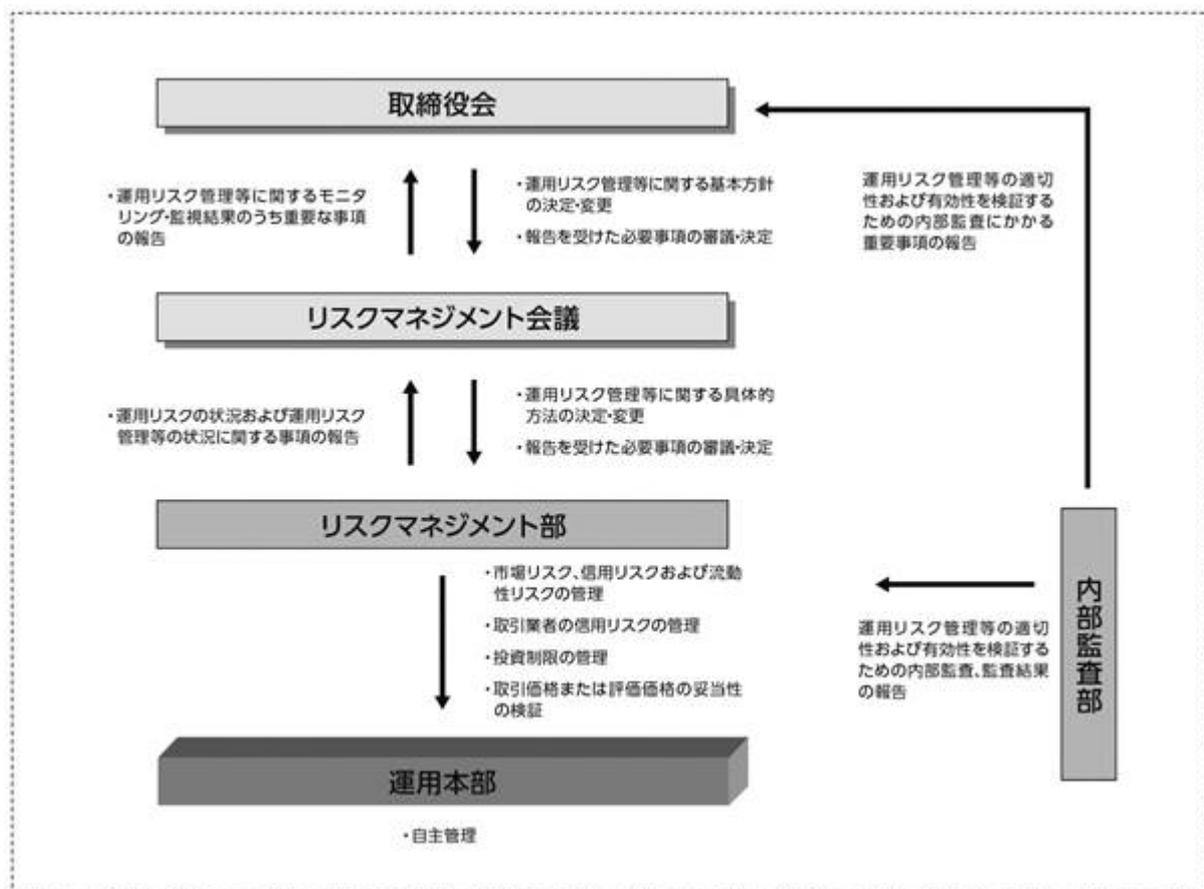


流動性リスクに対する管理体制

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。

<2022年1月1日から>

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



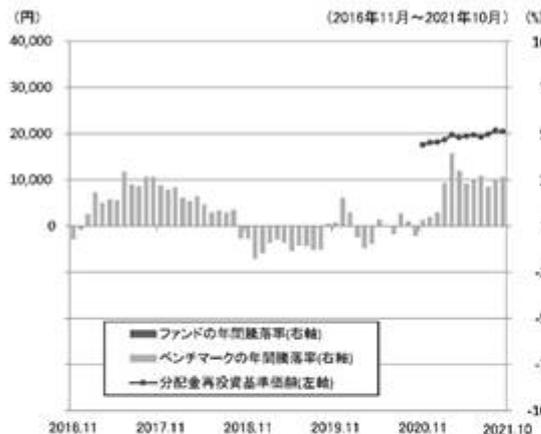
流動性リスクに対する管理体制

- ・ 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。
- ・ 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

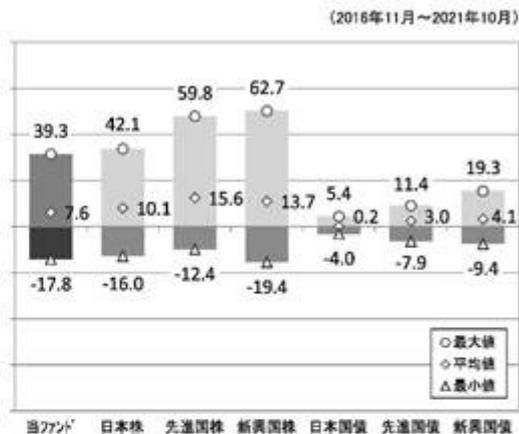
参考情報

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

販売会社については、下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号(コールセンター) 0120-106212(営業日の9:00~17:00)

ホームページ <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10月29日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10月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	24,665,366,630	98.89
内 日本	24,665,366,630	98.89
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	277,654,494	1.11
純資産総額	24,943,021,124	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)	278,950,000	1.12
内 日本	278,950,000	1.12

(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10月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	455,200	1,923.20 875,442,000	2,006.50 913,358,800	3.66
2 ソニーグループ	日本	株式	電気機 器	56,300	11,863.68 667,925,200	13,140.00 739,782,000	2.97
3 キーエンス	日本	株式	電気機 器	8,100	64,270.00 520,587,000	68,510.00 554,931,000	2.22
4 リクルートホールディングス	日本	株式	サービ ス業	66,200	6,911.15 457,518,400	7,572.00 501,266,400	2.01
5 三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	568,400	650.80 369,914,720	622.50 353,829,000	1.42

6	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	103,100	3,121.16 321,792,100	3,188.00 328,682,800	1.32
7	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	52,900	6,118.00 323,642,200	6,164.00 326,075,600	1.31
8	信越化学	日本	株式	化学	15,100	18,585.00 280,633,500	20,255.00 305,850,500	1.23
9	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	5,700	47,736.14 272,096,000	52,850.00 301,245,000	1.21
10	日本電産	日本	株式	電気機器	23,300	11,792.13 274,756,700	12,570.00 292,881,000	1.17
11	HOYA	日本	株式	精密機器	17,500	16,500.00 288,750,000	16,725.00 292,687,500	1.17
12	ダイキン工業	日本	株式	機械	11,400	23,960.00 273,144,000	24,890.00 283,746,000	1.14
13	日立	日本	株式	電気機器	43,200	6,344.71 274,091,500	6,554.00 283,132,800	1.14
14	任天堂	日本	株式	その他製品	5,100	50,640.00 258,264,000	50,200.00 256,020,000	1.03
15	三菱商事	日本	株式	卸売業	66,300	3,516.21 233,124,900	3,612.00 239,475,600	0.96
16	本田技研	日本	株式	輸送用機器	70,800	3,369.99 238,595,400	3,349.00 237,109,200	0.95
17	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	61,400	3,877.59 238,084,600	3,721.00 228,469,400	0.92
18	村田製作所	日本	株式	電気機器	26,400	8,520.00 224,928,000	8,653.00 228,439,200	0.92
19	KDDI	日本	株式	情報・通信業	64,300	3,670.00 235,981,000	3,528.00 226,850,400	0.91
20	武田薬品	日本	株式	医薬品	70,600	3,199.00 225,849,400	3,203.00 226,131,800	0.91
21	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	133,600	1,529.75 204,375,850	1,554.50 207,681,200	0.83
22	第一三共	日本	株式	医薬品	70,600	2,900.38 204,767,350	2,867.00 202,410,200	0.81
23	伊藤忠	日本	株式	卸売業	61,900	3,227.96 199,811,300	3,242.00 200,679,800	0.80
24	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	10,100	17,593.31 177,692,500	17,940.00 181,194,000	0.73
25	三井物産	日本	株式	卸売業	68,700	2,490.11 171,070,700	2,592.00 178,070,400	0.71

26	S M C	日本	株式	機械	2,600	62,840.00 163,384,000	67,940.00 176,644,000	0.71
27	ファナック	日本	株式	電 気 機 器	7,900	22,625.00 178,737,500	22,310.00 176,249,000	0.71
28	東京海上HD	日本	株式	保険業	29,200	6,042.85 176,451,400	5,998.00 175,141,600	0.70
29	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	113,400	1,569.50 177,981,300	1,505.00 170,667,000	0.68
30	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	34,600	4,768.35 164,985,100	4,782.00 165,457,200	0.66

(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	98.89%
合計	98.89%

(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	0.21%
建設業	2.27%
食料品	3.37%
繊維製品	0.47%
パルプ・紙	0.21%
化学	6.87%
医薬品	4.87%
石油・石炭製品	0.42%
ゴム製品	0.68%
ガラス・土石製品	0.78%
鉄鋼	0.79%
非鉄金属	0.70%
金属製品	0.62%
機械	5.35%
電気機器	18.51%
輸送用機器	7.89%
精密機器	2.83%
その他製品	2.16%

電気・ガス業	1.04%
陸運業	3.10%
海運業	0.45%
空運業	0.42%
倉庫・運輸関連業	0.17%
情報・通信業	8.34%
卸売業	5.01%
小売業	4.32%
銀行業	4.61%
証券、商品先物取引業	0.74%
保険業	1.94%
その他金融業	1.14%
不動産業	1.98%
サービス業	6.52%
合計	98.89%

(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 031 2月	買建	14	275,240,000	278,950,000	1.12%

(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
5月末日	16,403,442,087	-	1,925.2	-	1,925
6月末日	16,596,013,629	-	1,947.8	-	1,947
7月末日	19,925,927,272	-	1,903.1	-	1,903
8月末日	26,342,951,272	-	1,962.9	-	1,961
9月末日	25,511,385,232	-	2,048.3	-	2,056
第2特定期間末 (2021年10月10日)	24,453,924,991	24,653,207,039	1,963.4	1,979.4	1,965
10月末日	24,943,021,124	-	2,002.6	-	2,002

(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
第2特定期間	18.0

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	19.3
第2特定期間	1.1

(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
第2特定期間	9,804,737	4,895,967

(注) 当初設定数量は6,179,514口です。

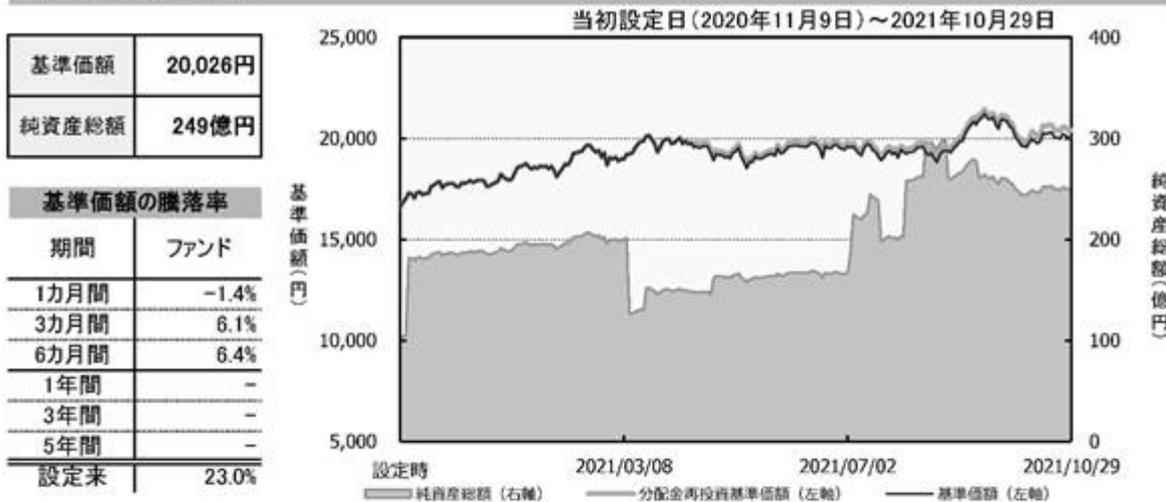
(参考情報) 運用実績

● iFreeETF TOPIX (年4回決算型)

2021年10月29日現在

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

基準価額・純資産の推移



※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)

直近1年間分配金合計額: 370円

設定来分配金合計額: 370円

決算期	第1期 21年1月	第2期 21年4月	第3期 21年7月	第4期 21年10月					
分配金	10円	180円	20円	160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

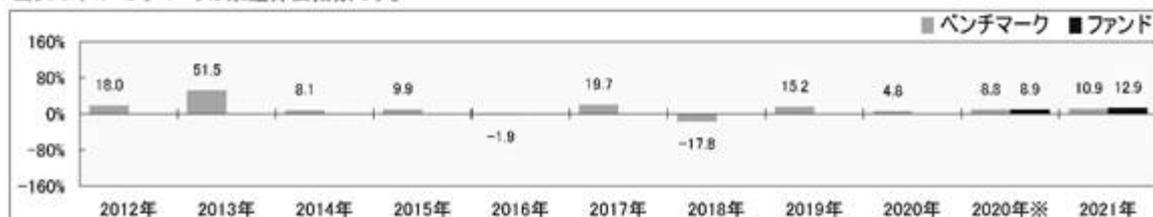
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	2,181	98.9%	電気機器	18.5%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.7%
国内株式先物	1	1.1%	情報・通信業	8.3%	ソニーグループ	電気機器	3.0%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	7.9%	キーエンス	電気機器	2.2%
コール・ローン、その他	-	1.1%	化学	6.9%	リクルートホールディングス	サービス業	2.0%
合計	2,182	-	サービス業	6.5%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.4%
株式 市場・上場別構成			機械	5.4%	日本電信電話	情報・通信業	1.3%
一部(東証・名証)		98.9%	卸売業	5.0%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.3%
二部(東証・名証)		-	医薬品	4.9%	信越化学	化学	1.2%
新興市場他		-	銀行業	4.6%	東京エレクトロン	電気機器	1.2%
その他		-	その他	30.9%	日本電産	電気機器	1.2%
合計		98.9%	合計	98.9%	合計		18.5%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額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10月29日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

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

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

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

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

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

販売会社は、受益権の取得申込者が引渡すべき取得時のバスケットの各銘柄の一部の引渡日を別に定める方法に基づいて指定する場合には、担保金を差入れるものとします。なお、担保金に付利は行なわないものとします。担保金が差入れられた場合には、委託会社は信託財産への担保金の受入れの指図を行なうものとします。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、前 に定める株式(前 、前 および前 に該当する場合の金銭を含みます。)または前 に定める担保金の引渡しと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。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付によって生じる株式および金銭の委託会社への受渡し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し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掲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、後掲または後掲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、後掲または後掲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掲に定める抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ、抹消したものととして取扱います。

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

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

前 の規定により交換請求の受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、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号(コールセンター) 0120-106212(営業日の9:00~17:00)

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

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあっては、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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

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

公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。
<https://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。ただし、業務方法書に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受け付けによって生じる株式および金銭の委託会社への受渡または支払いの債務の負担を当該清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合の信託契約締結当初または追加信託当初の受益者は当該清算機関とします。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

<支払方法>

1. 受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）を持分に応じて請求する権利を有します。
2. 受託会社は、計算期間終了日現在において、氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。
3. 受益者は、原則として前2.に規定する登録を当ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の取引参加者（口座管理機関であるものに限ります。以下同じ。）を経由して行なうものとします。この場合、当該取引参加者は、当該取引参加者が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は前2.に規定する登録を受託会社に対して直接行なうことができます。
4. 社振法関係法令等に基づき、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益権の名義登録の手続きは原則として以下のとおりとします。
 - イ．受益権は、前3.の取引参加者の振替口座簿に口数が記載または記録されることにより、当該振替口座簿に記載または記録された口数に応じた受益権が帰属します。
 - ロ．前3.の取引参加者は、計算期間終了日までに当該取引参加者にかかる前イ．の受益権の受益者の氏名もしくは名称および住所その他受託会社が定める事項を書面等により受託会社に届出のものとします。また、届出た内容に変更が生じた場合は、当該取引参加者所定の方法による当該受益者からの申出に基づき、当該取引参加者はこれを受託会社に通知するものとします。
 - ハ．前3.の取引参加者は、計算期間終了日現在の当該取引参加者にかかる前イ．の受益権の受益者の振替機関の定める事項を（当該取引参加者が直接口座管理機関でない場合はその上位機関を通じて）振替機関に報告するとともに、振替機関は業務規程等に基づき、これを受託会社に通知するものとします。
5. 信託契約締結当初および追加信託時の受益者については、前2.に規定する登録を行なったうえで、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されるものとします。
6. 前2.に規定する収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定した預金口座等に当該収益分配金を振込む方式により行なう

ものとし、なお、名義登録受益者が前3.に規定する取引参加者と別途収益分配金の取扱いにかかる契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとし、

7. 受託会社は、支払開始日から5年経過した後に、収益分配金について未払残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとし、
8. 受託会社は、前7.の規定により委託会社に収益分配金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。
9. 受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

信託終了時の交換等

1. 委託会社は、信託が終了することとなったときは、委託会社が別に定める一定口数以上の受益権を有する受益者に対しては、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権と引換えに交換するものとし、この場合は、「2 換金(解約)手続等」の規定に準じるものとし、
2. 委託会社が信託の終了に関して指定する販売会社は、委託会社が別に定める一定口数未満の受益権について買取るものとし、この場合には、当該販売会社が別に定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を徴することができるものとし、
3. 信託終了に際して、委託会社が信託終了に関して指定する販売会社は、その所有にかかるすべての受益権を交換請求するものとし、交換により引渡される株式に当該販売会社が発行した株式またはその親会社が発行した株式(以下本3.において「自社株式等」といいます。)が含まれる場合には、委託会社は、受託会社に対しこれを売却する指図をするとともに、当該自社株式等の評価額に相当する口数の受益権を、受託会社は信託財産をもって買取るものとし、
4. 受益者が、信託終了時の交換について信託終了日から10年間その交換請求をしないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

交換請求権および買取請求権

受益者は、保有する受益権について、交換または買取りを請求する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

第3 【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、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(2021年4月11日から2021年10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）

	前 期 2021年4月10日現在	当 期 2021年10月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	260,820,300	303,282,336
株式	2 14,538,519,123	2 24,150,985,087
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	205,996,602
前払金	-	25,290,000
流動資産合計	14,941,371,700	24,685,554,025
資産合計		
	14,941,371,700	24,685,554,025
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,158,850	13,373,250
前受金	5,630,000	-
未払金	-	8,291,000
未払収益分配金	135,834,444	199,282,048
未払受託者報酬	975,110	1,392,251
未払委託者報酬	1,950,194	2,784,518
未払利息	200	426
その他未払費用	2,899,094	6,505,541
流動負債合計	148,447,892	231,629,034
負債合計		
	148,447,892	231,629,034
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,519,407,922	1 20,663,057,352
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,273,515,886	3,790,867,639
（分配準備積立金）	5,067,551	12,224,751
元本等合計	14,792,923,808	24,453,924,991
純資産合計		
	14,792,923,808	24,453,924,991
負債純資産合計		
	14,941,371,700	24,685,554,025

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期 自 2020年11月9日 至 2021年4月10日	当 期 自 2021年4月11日 至 2021年10月10日
営業収益		
受取配当金	159,521,519	240,723,328
受取利息	890	1,248
有価証券売買等損益	2,768,486,009	114,808,189
派生商品取引等損益	23,459,750	6,780,200
その他収益	1,450	119,417
営業収益合計	2,951,469,618	348,871,982
営業費用		
支払利息	28,171	48,026
受託者報酬	1,661,610	2,298,672
委託者報酬	3,323,196	4,597,360
その他費用	1 3,104,014	1 4,510,435
営業費用合計	8,116,991	11,454,493
営業利益	2,943,352,627	337,417,489
経常利益	2,943,352,627	337,417,489
当期純利益	2,943,352,627	337,417,489
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	2,273,515,886
剰余金増加額又は欠損金減少額	502,202,982	2,834,713,801
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	2,834,713,801
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,025,700,406	1,432,547,237
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	1,432,547,237
分配金	2 146,339,317	2 222,232,300
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,273,515,886	3,790,867,639

(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 2021年4月11日	至 2021年10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>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	2021年4月10日現在	2021年10月10日現在
1. 1 期首元本額	10,251,813,726円	12,519,407,922円
期中追加設定元本額	8,793,280,650円	16,266,058,683円
期中一部交換元本額	6,525,686,454円	8,122,409,253円
2. 特定期間末日における受益権の総数	7,546,358口	12,455,128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	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 114,063,000円
----	---	---------------	---	---

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分		前 期 自 2020年11月9日 至 2021年4月10日	当 期 自 2021年4月11日 至 2021年10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	主に、対象指数の商標の使用料であります。
		(自2020年11月9日 至2021年1月10日) 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。	(自2021年4月11日 至2021年7月10日) 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(32,382,731円)及び分配準備積立金(5,067,551円)の合計額から、経費(4,541,407円)を控除して計算される分配対象額は32,908,875円(10口当たり28円)であり、うち22,950,252円(10口当たり20円)を分配金額としております。

	<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>	<p>（自2021年7月11日 至2021年10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（208,413,236円）及び分配準備積立金(9,958,623円)の合計額から、経費(6,865,060円)を控除して計算される分配対象額は211,506,799円（10口当たり169円）であり、うち199,282,048円（10口当たり160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 2021年4月11日 至 2021年10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	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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。 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。
--------------------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 2021年10月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)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。 (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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期 2021年4月10日現在	当 期 2021年10月10日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	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	429,928,821
合計	652,795,498	429,928,821

(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	前 期 2021年4月10日 現在			当 期 2021年10月10日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
	うち			うち		

		1年超				1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	252,190,000	-	254,800,000	2,610,000	308,265,000	-	294,900,000	13,365,000
合計	252,190,000	-	254,800,000	2,610,000	308,265,000	-	294,900,000	13,365,000

(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 2021年4月11日
至 2021年10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)

	前 期 2021年4月10日現在	当 期 2021年10月10日現在
1口当たり純資産額	1,960.3円	1,963.4円
(10口当たり純資産額)	(19,603円)	(19,634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	400	2,998.00	1,199,200	

日本水産	11,300	627.00	7,085,100
マルハニチロ	1,900	2,606.00	4,951,400
ハウスイ	100	940.00	94,000
雪国まいたけ	1,000	1,509.00	1,509,000
カネコ種苗	400	1,438.00	575,200
サカタのタネ	1,500	3,465.00	5,197,500
ホクト	1,000	1,965.00	1,965,000
ホクリヨウ	200	773.00	154,600
ヒノキヤグループ	300	2,192.00	657,600
ショーボンドHD	1,800	4,880.00	8,784,000
ミライト・ホールディングス	4,300	2,164.00	9,305,200
タマホーム	700	2,497.00	1,747,900
サンヨーホームズ	200	723.00	144,600
日本アクア	500	589.00	294,500
ファーストコーポレーション	400	810.00	324,000
ベステラ	300	1,481.00	444,300
ROBOT HOME	2,000	289.00	578,000
キャンディル	200	538.00	107,600
スペースバリューHD	1,500	867.00	1,300,500
住石ホールディングス	2,100	158.00	331,800
日鉄鉱業	300	6,530.00	1,959,000
三井松島HLDGS	600	1,369.00	821,400
INPEX	48,800	934.00	45,579,200
石油資源開発	1,600	2,186.00	3,497,600
K&Oエナジーグループ	600	1,628.00	976,800
ダイセキ環境ソリューション	300	1,973.00	591,900
第一カッター興業	300	1,275.00	382,500
明豊ファシリティワークス	400	903.00	361,200
安藤・間	7,800	796.00	6,208,800
東急建設	3,600	804.00	2,894,400
コムシスホールディングス	4,400	2,895.00	12,738,000
ビーアールホールディングス	1,700	449.00	763,300
高松コンストラクションGP	700	2,035.00	1,424,500
東建コーポレーション	400	9,510.00	3,804,000
ソネック	100	1,083.00	108,300
ヤマウラ	600	914.00	548,400
オリエンタル白石	4,100	280.00	1,148,000
大成建設	8,800	3,640.00	32,032,000
大林組	28,100	951.00	26,723,100
清水建設	26,400	864.00	22,809,600

飛島建設	800	1,100.00	880,000
長谷工コーポレーション	9,300	1,473.00	13,698,900
松井建設	1,100	735.00	808,500
銭高組	100	4,140.00	414,000
鹿島建設	20,600	1,457.00	30,014,200
不動テトラ	600	1,746.00	1,047,600
大末建設	400	945.00	378,000
鉄建建設	600	1,832.00	1,099,200
西松建設	2,000	3,510.00	7,020,000
三井住友建設	6,700	509.00	3,410,300
大豊建設	700	3,790.00	2,653,000
佐田建設	700	483.00	338,100
ナカノフドー建設	600	348.00	208,800
奥村組	1,600	3,000.00	4,800,000
東鉄工業	1,200	2,512.00	3,014,400
イチケン	200	1,934.00	386,800
富士ピー・エス	400	567.00	226,800
浅沼組	400	4,570.00	1,828,000
戸田建設	11,700	769.00	8,997,300
熊谷組	1,300	2,870.00	3,731,000
北野建設	200	2,215.00	443,000
植木組	300	1,458.00	437,400
矢作建設	1,200	789.00	946,800
ピーエス三菱	900	663.00	596,700
日本ハウスHLDGS	1,900	412.00	782,800
大東建託	3,100	13,110.00	40,641,000
新日本建設	1,200	854.00	1,024,800
NIPPO	2,300	4,095.00	9,418,500
東亜道路	200	4,660.00	932,000
日本道路	300	8,000.00	2,400,000
東亜建設	700	2,454.00	1,717,800
日本国土開発	2,800	599.00	1,677,200
若築建設	500	2,006.00	1,003,000
東洋建設	3,100	591.00	1,832,100
五洋建設	11,900	769.00	9,151,100
世紀東急	1,400	843.00	1,180,200
福田組	300	4,820.00	1,446,000
日本ドライケミカル	200	2,174.00	434,800
住友林業	7,200	2,067.00	14,882,400
日本基礎技術	800	551.00	440,800

巴コーポレーション	1,200	457.00	548,400	
大和ハウス	26,000	3,676.00	95,576,000	
ライト工業	1,600	1,971.00	3,153,600	
積水ハウス	30,500	2,341.00	71,400,500	
日特建設	700	713.00	499,100	
北陸電気工事	500	1,260.00	630,000	
ユアテック	1,600	713.00	1,140,800	
日本リーテック	600	1,520.00	912,000	
四電工	400	1,669.00	667,600	
中電工	1,300	2,282.00	2,966,600	
関電工	4,500	923.00	4,153,500	
きんでん	5,700	1,891.00	10,778,700	
東京エネシス	900	1,043.00	938,700	
トーエネック	300	3,555.00	1,066,500	
住友電設	800	2,230.00	1,784,000	
日本電設工業	1,600	1,862.00	2,979,200	
エクシオグループ	4,300	2,694.00	11,584,200	
新日本空調	700	2,377.00	1,663,900	
日本工営	500	3,395.00	1,697,500	
九電工	1,900	3,610.00	6,859,000	
三機工業	2,000	1,479.00	2,958,000	
日揮ホールディングス	9,300	1,066.00	9,913,800	
中外炉工業	300	1,729.00	518,700	
ヤマト	900	742.00	667,800	
太平電業	600	2,748.00	1,648,800	
高砂熱学	2,500	2,179.00	5,447,500	
三晃金属	100	2,486.00	248,600	
NEC ネットズエスアイ	2,900	2,054.00	5,956,600	
朝日工業社	200	3,310.00	662,000	
明星工業	1,900	723.00	1,373,700	
大気社	1,400	3,350.00	4,690,000	
ダイダン	600	2,549.00	1,529,400	
日比谷総合設備	900	1,926.00	1,733,400	
ニッポン	2,600	1,645.00	4,277,000	
日清製粉G本社	10,200	1,842.00	18,788,400	
日東富士製粉	200	3,185.00	637,000	
昭和産業	700	2,823.00	1,976,100	
鳥越製粉	800	769.00	615,200	
中部飼料	1,100	1,128.00	1,240,800	
フィード・ワン	1,200	750.00	900,000	

東洋精糖	200	1,190.00	238,000
日本甜菜糖	500	1,651.00	825,500
D M三井製糖ホールディ	700	1,993.00	1,395,100
塩水港精糖	1,100	225.00	247,500
日新製糖	500	1,692.00	846,000
L I F U L L	2,600	362.00	941,200
ミクシィ	2,200	2,555.00	5,621,000
ジェイエイシーリクルートメント	700	2,193.00	1,535,100
日本M & Aセンターホールデ	14,100	3,205.00	45,190,500
メンバーズ	300	3,070.00	921,000
中広	100	397.00	39,700
U Tグループ	1,200	3,360.00	4,032,000
アイティメディア	300	2,300.00	690,000
E・Jホールディングス	500	1,326.00	663,000
夢真ビーネックスグループ	2,300	1,356.00	3,118,800
コシダカホールディングス	2,300	647.00	1,488,100
アルトナー	200	848.00	169,600
パソナグループ	900	3,150.00	2,835,000
C D S	200	1,594.00	318,800
リンクアンドモチベーション	1,800	1,040.00	1,872,000
G C A	1,200	1,396.00	1,675,200
エス・エム・エス	2,900	3,965.00	11,498,500
サニーサイドアップG	300	787.00	236,100
パーソルホールディングス	8,600	2,839.00	24,415,400
リニカル	500	758.00	379,000
クックパッド	2,700	248.00	669,600
エスクリ	300	566.00	169,800
アイ・ケイ・ケイ	500	682.00	341,000
森永製菓	2,100	4,125.00	8,662,500
中村屋	200	3,760.00	752,000
江崎グリコ	2,500	4,160.00	10,400,000
名糖産業	400	1,701.00	680,400
井村屋グループ	600	2,263.00	1,357,800
不二家	500	2,387.00	1,193,500
山崎製パン	6,800	1,916.00	13,028,800
第一屋製パン	200	784.00	156,800
モロゾフ	200	5,380.00	1,076,000
亀田製菓	600	4,540.00	2,724,000
寿スピリッツ	800	7,170.00	5,736,000
カルビー	4,100	2,709.00	11,106,900

森永乳業	1,700	6,620.00	11,254,000
六甲バター	700	1,660.00	1,162,000
ヤクルト	6,200	5,740.00	35,588,000
明治ホールディングス	5,900	7,210.00	42,539,000
雪印メグミルク	2,100	2,238.00	4,699,800
プリマハム	1,300	2,778.00	3,611,400
日本ハム	3,400	4,055.00	13,787,000
林兼産業	300	588.00	176,400
丸大食品	900	1,737.00	1,563,300
S Foods	800	2,898.00	2,318,400
柿安本店	300	2,660.00	798,000
伊藤ハム米久HLDGS	5,800	722.00	4,187,600
学情	400	1,249.00	499,600
スタジオアリス	500	2,254.00	1,127,000
クロスキャット	200	1,324.00	264,800
シミックホールディングス	500	1,492.00	746,000
エプコ	200	838.00	167,600
システナ	3,100	2,083.00	6,457,300
NJS	200	2,011.00	402,200
デジタルアーツ	600	8,810.00	5,286,000
日鉄ソリューションズ	1,300	3,565.00	4,634,500
総合警備保障	3,400	4,905.00	16,677,000
キューブシステム	500	1,004.00	502,000
いちご	9,800	361.00	3,537,800
WOW WORLD	100	1,772.00	177,200
日本駐車場開発	9,700	153.00	1,484,100
コア	400	1,522.00	608,800
カカクコム	6,300	3,810.00	24,003,000
アイロムグループ	300	2,000.00	600,000
セントケア・ホールディング	700	896.00	627,200
サイネックス	200	664.00	132,800
ルネサンス	600	1,175.00	705,000
ディップ	1,300	4,275.00	5,557,500
SBSホールディングス	600	3,960.00	2,376,000
デジタルホールディングス	600	1,828.00	1,096,800
新日本科学	1,000	921.00	921,000
キャリアデザインセンター	200	1,128.00	225,600
ベネフィット・ワン	3,100	5,350.00	16,585,000
エムスリー	15,100	7,312.00	110,411,200
ツカダ・グローバルHOLD	600	335.00	201,000

プラス	100	740.00	74,000
アウトソーシング	4,900	1,918.00	9,398,200
ウェルネット	800	519.00	415,200
ワールドホールディングス	400	2,847.00	1,138,800
ディー・エヌ・エー	3,600	2,124.00	7,646,400
博報堂D Y H L D G S	11,900	1,835.00	21,836,500
ぐるなび	1,500	566.00	849,000
タカミヤ	1,000	450.00	450,000
ジャパンベストレスキューS	600	1,163.00	697,800
ファンコミュニケーションズ	2,100	458.00	961,800
ライク	200	1,959.00	391,800
ビジネス・ブレークスルー	400	421.00	168,400
エスプール	2,400	1,162.00	2,788,800
W D B ホールディングス	400	3,425.00	1,370,000
手間いらず	100	6,210.00	621,000
ティア	500	488.00	244,000
C D G	100	1,529.00	152,900
アドウェイズ	1,400	783.00	1,096,200
バリューコマース	700	4,600.00	3,220,000
インフォマート	9,300	1,009.00	9,383,700
サッポロホールディングス	3,100	2,555.00	7,920,500
アサヒグループホールディン	21,200	5,536.00	117,363,200
麒麟HD	33,100	2,080.00	68,848,000
宝ホールディングス	6,700	1,558.00	10,438,600
オエノンホールディングス	2,600	376.00	977,600
養命酒	300	1,832.00	549,600
コカ・コーラボトラーズJHD	6,300	1,649.00	10,388,700
サントリー食品インター	6,000	4,635.00	27,810,000
ダイドーグループHD	500	5,660.00	2,830,000
伊藤園	2,800	7,190.00	20,132,000
キーコーヒー	900	2,195.00	1,975,500
ユニカフェ	300	1,060.00	318,000
ジャパンフーズ	100	1,224.00	122,400
日清オイリオグループ	1,100	3,070.00	3,377,000
不二製油グループ	2,200	2,661.00	5,854,200
かどや製油	100	4,160.00	416,000
J - オイルミルズ	800	1,855.00	1,484,000
ローソン	2,200	5,390.00	11,858,000
サンエー	600	4,010.00	2,406,000
カワチ薬品	700	2,288.00	1,601,600

エービーシー・マート	1,400	6,160.00	8,624,000
ハードオフコーポレーション	400	779.00	311,600
高千穂交易	400	1,177.00	470,800
アスクル	1,400	1,653.00	2,314,200
ゲオホールディングス	1,200	1,231.00	1,477,200
アダストリア	1,200	2,015.00	2,418,000
ジーフット	600	399.00	239,400
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	403.00	40,300
オルバヘルスケアHLDGS	200	1,554.00	310,800
伊藤忠食品	200	5,240.00	1,048,000
くら寿司	900	3,555.00	3,199,500
キャンドゥ	500	1,918.00	959,000
エレマテック	700	1,084.00	758,800
アイケイ	300	571.00	171,300
バルグループHLDGS	700	1,753.00	1,227,100
JALUX	300	1,680.00	504,000
エディオン	3,700	1,083.00	4,007,100
あらた	700	4,220.00	2,954,000
サーラコーポレーション	1,800	616.00	1,108,800
ワッツ	500	880.00	440,000
トーマンデバイス	100	4,820.00	482,000
ハローズ	400	2,843.00	1,137,200
J Pホールディングス	2,400	270.00	648,000
フジオフードG本社	700	1,360.00	952,000
あみやき亭	200	2,901.00	580,200
東京エレクトロンデバイス	300	7,050.00	2,115,000
ひらまつ	1,700	218.00	370,600
フィールズ	700	518.00	362,600
双日	9,740	1,889.00	18,398,860
アルフレッサホールディングス	9,200	1,662.00	15,290,400
大黒天物産	300	6,600.00	1,980,000
ハニーズホールディングス	700	1,032.00	722,400
ファーマライズHD	200	777.00	155,400
キッコーマン	6,500	8,650.00	56,225,000
味の素	21,400	3,238.00	69,293,200
ブルドックソ - ス	400	2,360.00	944,000
キューピー	5,000	2,518.00	12,590,000
ハウス食品G本社	3,300	3,410.00	11,253,000
カゴメ	3,400	2,867.00	9,747,800
焼津水産化工	500	992.00	496,000

アリアケジャパン	800	7,050.00	5,640,000
ピエトロ	100	1,755.00	175,500
エバラ食品工業	200	2,502.00	500,400
やまみ	100	2,032.00	203,200
ニチレイ	4,300	2,921.00	12,560,300
横浜冷凍	2,500	888.00	2,220,000
東洋水産	4,600	4,875.00	22,425,000
イトアンドHLDGS	300	2,396.00	718,800
大冷	100	1,939.00	193,900
ヨシムラ・フード・HLDGS	500	722.00	361,000
日清食品HD	3,500	8,870.00	31,045,000
永谷園ホールディングス	500	2,114.00	1,057,000
一正蒲鉾	400	922.00	368,800
フジッコ	1,000	1,903.00	1,903,000
ロックフィールド	900	1,704.00	1,533,600
日本たばこ産業	48,300	2,187.00	105,632,100
ケンコーマヨネーズ	600	1,565.00	939,000
わらべや日洋HD	600	2,446.00	1,467,600
なとり	500	1,923.00	961,500
イフジ産業	200	942.00	188,400
ピックルスコーポレーション	500	1,849.00	924,500
ファーマフーズ	800	2,690.00	2,152,000
北の達人コーポ	3,100	442.00	1,370,200
ユーグレナ	4,600	832.00	3,827,200
紀文食品	600	1,296.00	777,600
スター・マイカ・HLDGS	500	1,375.00	687,500
SREホールディングス	100	6,850.00	685,000
ADワークスグループ	1,800	160.00	288,000
片倉工業	1,000	1,696.00	1,696,000
グンゼ	600	4,180.00	2,508,000
ヒューリック	18,800	1,138.00	21,394,400
神栄	100	1,027.00	102,700
ラサ商事	500	936.00	468,000
アルペン	600	2,836.00	1,701,600
ハブ	300	750.00	225,000
ラクーンホールディングス	700	1,515.00	1,060,500
クオールホールディングス	1,200	1,444.00	1,732,800
アルコニックス	900	1,666.00	1,499,400
神戸物産	6,800	3,640.00	24,752,000
ソリトンシステムズ	500	1,439.00	719,500

ジズホールディングス	600	7,410.00	4,446,000
ビックカメラ	5,300	1,047.00	5,549,100
DCMホールディングス	5,500	1,093.00	6,011,500
ペッパーフードサービス	1,200	390.00	468,000
ハイパー	200	544.00	108,800
MonotaRO	11,200	2,478.00	27,753,600
東京一番フーズ	200	582.00	116,400
DDホールディングス	500	491.00	245,500
あいホールディングス	1,300	2,163.00	2,811,900
ディーブイエックス	300	1,065.00	319,500
きちりホールディングス	300	622.00	186,600
アークランドサービスHD	600	2,265.00	1,359,000
J. フロント リテイリング	10,500	1,047.00	10,993,500
ドトール・日レスHD	1,400	1,726.00	2,416,400
マツキヨココカラ&カンパニー	4,960	5,460.00	27,081,600
ブロンコビリー	500	2,492.00	1,246,000
ZOZO	5,200	3,990.00	20,748,000
トレジャー・ファクトリー	300	898.00	269,400
物語コーポレーション	500	7,630.00	3,815,000
三越伊勢丹HD	15,400	811.00	12,489,400
東洋紡	3,500	1,317.00	4,609,500
ユニチカ	2,600	362.00	941,200
富士紡ホールディングス	500	3,970.00	1,985,000
日清紡ホールディングス	5,500	858.00	4,719,000
倉敷紡績	700	1,918.00	1,342,600
ダイワボウHD	4,000	1,886.00	7,544,000
シキボウ	500	921.00	460,500
日東紡績	1,300	3,445.00	4,478,500
トヨタ紡織	2,600	1,964.00	5,106,400
マクニカ・富士エレHLDGS	2,100	2,456.00	5,157,600
Hamee	200	1,462.00	292,400
マーケットエンタープライズ	100	751.00	75,100
ラクト・ジャパン	300	2,797.00	839,100
ウエルシアHD	4,600	4,040.00	18,584,000
クリエイトSDH	1,300	3,715.00	4,829,500
グリムス	300	2,839.00	851,700
バイタルKSKHD	1,600	776.00	1,241,600
八洲電機	600	964.00	578,400
メディアスホールディングス	500	913.00	456,500
レスターホールディングス	900	1,861.00	1,674,900

ジュテックHD	200	1,109.00	221,800
丸善CHI HD	1,000	377.00	377,000
大光	400	699.00	279,600
OCHIホールディングス	300	1,282.00	384,600
TOKAIホールディングス	4,300	891.00	3,831,300
黒谷	300	702.00	210,600
ミサワ	200	667.00	133,400
ティーライフ	100	1,450.00	145,000
Cominix	200	723.00	144,600
エー・ピーホールディングス	200	470.00	94,000
三洋貿易	900	1,135.00	1,021,500
チムニー	300	1,470.00	441,000
シュッピン	600	1,185.00	711,000
ビューティガレージ	200	3,505.00	701,000
オイシックス・ラ・大地	1,200	4,425.00	5,310,000
ウイン・パートナーズ	600	979.00	587,400
ネクステージ	1,800	2,067.00	3,720,600
ジョイフル本田	2,600	1,578.00	4,102,800
鳥貴族ホールディングス	300	1,992.00	597,600
ホットランド	600	1,347.00	808,200
すかいらーくHD	11,400	1,564.00	17,829,600
SFPホールディングス	500	1,460.00	730,000
綿半ホールディングス	600	1,237.00	742,200
日本毛織	2,700	962.00	2,597,400
ダイトウボウ	1,400	99.00	138,600
トーア紡コーポレーション	300	428.00	128,400
ダイドーリミテッド	1,100	170.00	187,000
ヨシックスホールディングス	200	2,192.00	438,400
ユナイテッド・スーパーマーケ	2,600	1,054.00	2,740,400
三栄建築設計	400	1,978.00	791,200
野村不動産HLDGS	5,100	2,786.00	14,208,600
三重交通グループHD	1,800	542.00	975,600
サムティ	1,300	2,294.00	2,982,200
ディア・ライフ	1,100	582.00	640,200
コーセーアールイー	300	666.00	199,800
日本商業開発	600	1,730.00	1,038,000
プレサンスコーポレーション	1,500	1,820.00	2,730,000
フィル・カンパニー	200	3,170.00	634,000
THEグローバル社	600	207.00	124,200
ハウスコム	200	1,282.00	256,400

日本管理センター	500	1,187.00	593,500
サンセイランディック	300	820.00	246,000
エストラスト	100	651.00	65,100
フージャースHD	1,500	667.00	1,000,500
オープンハウス	2,800	6,480.00	18,144,000
東急不動産HD	24,100	664.00	16,002,400
飯田GHD	7,400	2,760.00	20,424,000
イーグランド	200	1,573.00	314,600
ムゲンエステート	600	482.00	289,200
帝国繊維	1,000	1,974.00	1,974,000
日本コークス工業	7,600	143.00	1,086,800
ゴルフダイジェスト・オン	500	1,303.00	651,500
ミタチ産業	300	856.00	256,800
B E E N O S	500	2,963.00	1,481,500
あさひ	600	1,325.00	795,000
日本調剤	600	1,618.00	970,800
コスモス薬品	900	18,860.00	16,974,000
シップヘルスケアHD	3,100	2,832.00	8,779,200
トーエル	500	839.00	419,500
ソフトクリエイトHD	400	3,245.00	1,298,000
オンリー	200	768.00	153,600
セブン&アイ・HLDGS	34,500	4,768.00	164,496,000
クリエイト・レストランツ・ホール	4,700	913.00	4,291,100
明治電機工業	300	1,320.00	396,000
ツルハホールディングス	1,900	13,920.00	26,448,000
デリカフーズHLDGS	400	630.00	252,000
スターティアホールディングス	200	1,421.00	284,200
サンマルクホールディングス	700	1,605.00	1,123,500
フェリシモ	200	1,507.00	301,400
トリドールホールディングス	2,200	2,593.00	5,704,600
帝 人	8,200	1,535.00	12,587,000
東 レ	63,500	713.50	45,307,250
ク ラ レ	12,900	1,044.00	13,467,600
旭 化 成	58,200	1,152.50	67,075,500
サカイオーベックス	300	3,795.00	1,138,500
T O K Y O B A S E	800	697.00	557,600
稲葉製作所	500	1,339.00	669,500
宮地エンジニアリングG	300	2,596.00	778,800
トーカロ	2,300	1,246.00	2,865,800
アルファCO	300	1,208.00	362,400

SUMCO	11,300	2,092.00	23,639,600
川田テクノロジーズ	200	3,840.00	768,000
RS TECHNOLOGIES	300	5,320.00	1,596,000
ジェイテックコーポレーション	100	2,062.00	206,200
信和	500	710.00	355,000
ビーロット	600	537.00	322,200
ファーストブラザーズ	200	1,077.00	215,400
ハウスドゥ	500	1,007.00	503,500
シーアールイー	200	2,155.00	431,000
プロパティエージェント	200	2,787.00	557,400
ケイアイスター不動産	300	5,440.00	1,632,000
アグレ都市デザイン	200	1,383.00	276,600
グッドコムアセット	400	1,396.00	558,400
ジェイ・エス・ビー	200	2,866.00	573,200
テンポイノベーション	300	966.00	289,800
グローバルリンクマネジメント	200	1,054.00	210,800
フェイスネットワーク	100	1,275.00	127,500
住江織物	200	1,853.00	370,600
日本フェルト	500	445.00	222,500
イチカワ	100	1,333.00	133,300
エコナックホールディングス	1,600	92.00	147,200
日東製網	100	1,471.00	147,100
芦森工業	200	991.00	198,200
アツギ	600	634.00	380,400
ウイルプラスHLDGS	100	1,145.00	114,500
JMホールディングス	600	1,995.00	1,197,000
コメダホールディングス	1,900	2,107.00	4,003,300
サツドラホールディングス	100	2,256.00	225,600
アレンザホールディングス	700	1,326.00	928,200
串カツ田中HLDGS	300	2,184.00	655,200
パロックジャパン	700	850.00	595,000
クスリのアオキHLDGS	800	7,510.00	6,008,000
ダイニック	400	729.00	291,600
共和レザー	500	684.00	342,000
ピーバンドットコム	100	673.00	67,300
力の源HD	400	616.00	246,400
FOOD & LIFE COMPAN	5,200	4,965.00	25,818,000
アセンテック	200	1,256.00	251,200
セーレン	2,100	2,128.00	4,468,800
ソトー	400	823.00	329,200

東海染工	100	1,128.00	112,800
小松マテーレ	1,500	911.00	1,366,500
ワコールホールディングス	2,200	2,274.00	5,002,800
ホギメディカル	1,200	3,180.00	3,816,000
クラウドシアHLDGS	200	280.00	56,000
T S Iホールディングス	2,700	354.00	955,800
マツオカコーポレーション	300	1,375.00	412,500
ワールド	1,100	1,391.00	1,530,100
T I S	8,800	2,905.00	25,564,000
J N Sホールディングス	500	531.00	265,500
グリー	5,400	809.00	4,368,600
G M Oペパボ	100	2,855.00	285,500
コーエーテクモHD	2,300	4,930.00	11,339,000
三菱総合研究所	400	4,345.00	1,738,000
ボルテージ	300	442.00	132,600
電算	100	2,405.00	240,500
A G S	500	871.00	435,500
ファインデックス	700	965.00	675,500
ブレインパッド	200	5,700.00	1,140,000
K L a b	1,600	654.00	1,046,400
ポルトゥウィン・ピットクル	1,200	1,009.00	1,210,800
イーブックイニシアティブ	200	4,940.00	988,000
ネクソン	19,800	1,770.00	35,046,000
アイスタイル	2,700	427.00	1,152,900
エムアップホールディングス	200	3,540.00	708,000
エイチーム	700	1,574.00	1,101,800
エニグモ	800	1,188.00	950,400
テクノスジャパン	600	598.00	358,800
e n i s h	600	435.00	261,000
コロプラ	2,900	813.00	2,357,700
オルトプラス	700	402.00	281,400
ブロードリーフ	4,300	549.00	2,360,700
クロス・マーケティングG	400	840.00	336,000
デジタルハーツHLDGS	400	1,861.00	744,400
システム情報	600	936.00	561,600
メディアドゥ	400	4,330.00	1,732,000
じげん	2,200	403.00	886,600
ブイキューブ	900	1,535.00	1,381,500
エンカレッジ・テクノロジー	200	605.00	121,000
サイバーリンクス	300	1,366.00	409,800

ディー・エル・イー	700	284.00	198,800
フィックスターズ	900	776.00	698,400
CARTA HOLDINGS	400	2,445.00	978,000
オプティム	700	1,964.00	1,374,800
セレス	300	2,765.00	829,500
SHIFT	500	22,170.00	11,085,000
特種東海製紙	600	4,505.00	2,703,000
ティーガイア	900	2,047.00	1,842,300
セック	100	2,331.00	233,100
テクマトリックス	1,400	1,874.00	2,623,600
プロシップ	300	1,713.00	513,900
ガンホー・オンライン・エンター	2,400	2,041.00	4,898,400
GMOペイメントゲートウェイ	1,700	13,940.00	23,698,000
ザッパラス	400	532.00	212,800
システムリサーチ	300	1,883.00	564,900
インターネットイニシアティブ	2,300	3,700.00	8,510,000
さくらインターネット	900	603.00	542,700
ヴィンクス	300	970.00	291,000
GMOグローバルサインHD	200	4,540.00	908,000
SRAホールディングス	500	2,832.00	1,416,000
システムインテグレータ	300	627.00	188,100
朝日ネット	700	726.00	508,200
eBASE	1,000	809.00	809,000
アバント	900	1,576.00	1,418,400
アドソル日進	300	2,155.00	646,500
ODKソリューションズ	200	695.00	139,000
フリービット	600	1,366.00	819,600
コムチュア	800	2,889.00	2,311,200
サイバーコム	100	1,247.00	124,700
アステリア	700	704.00	492,800
アイル	500	1,823.00	911,500
王子ホールディングス	39,500	555.00	21,922,500
日本製紙	3,900	1,220.00	4,758,000
三菱製紙	1,200	360.00	432,000
北越コーポレーション	6,300	735.00	4,630,500
中越パルプ	400	1,190.00	476,000
巴川製紙	300	866.00	259,800
大王製紙	4,300	2,036.00	8,754,800
阿波製紙	200	392.00	78,400
マークラインズ	500	2,997.00	1,498,500

メディカル・データ・ビジ	1,100	1,468.00	1,614,800
gumi	1,200	817.00	980,400
ショーケース	200	613.00	122,600
モバイルファクトリー	200	1,049.00	209,800
テラスカイ	300	2,012.00	603,600
デジタル・インフォメーション	400	1,681.00	672,400
P C Iホールディングス	400	1,059.00	423,600
パイプドHD	200	2,797.00	559,400
アイビーシー	200	932.00	186,400
ネオジャパン	200	1,429.00	285,800
P R T I M E S	200	3,135.00	627,000
ラクス	2,700	3,380.00	9,126,000
ランドコンピュータ	150	813.00	121,950
ダブルスタンダード	200	3,630.00	726,000
オープンドア	600	2,612.00	1,567,200
マイネット	300	662.00	198,600
アカツキ	400	3,190.00	1,276,000
ベネフィットジャパン	100	2,548.00	254,800
U B I C O Mホールディングス	200	2,666.00	533,200
カナミックネットワーク	900	588.00	529,200
ノムラシステムコーポレーション	500	293.00	146,500
レンゴー	9,100	873.00	7,944,300
トーモク	600	1,955.00	1,173,000
ザ・パック	600	2,962.00	1,777,200
チェンジ	1,600	2,074.00	3,318,400
シンクロ・フード	600	390.00	234,000
オークネット	500	2,336.00	1,168,000
キャピタル・アセット・プラン	200	922.00	184,400
セグエグループ	200	793.00	158,600
エイトレッド	200	2,424.00	484,800
マクロミル	1,800	813.00	1,463,400
ビーグリー	200	1,602.00	320,400
オロ	300	3,540.00	1,062,000
ユーザーローカル	300	1,803.00	540,900
テモナ	200	767.00	153,400
ニーズウェル	200	703.00	140,600
マネーフォワード	1,300	7,800.00	10,140,000
サインポスト	200	1,192.00	238,400
昭和電工	6,600	2,610.00	17,226,000
住友化学	69,100	556.00	38,419,600

住友精化	500	3,405.00	1,702,500
日産化学	4,800	6,250.00	30,000,000
ラサ工業	300	1,822.00	546,600
クレハ	700	7,120.00	4,984,000
多木化学	400	6,280.00	2,512,000
テイカ	600	1,291.00	774,600
石原産業	1,600	1,201.00	1,921,600
片倉コープアグリ	200	1,178.00	235,600
日本曹達	1,200	3,420.00	4,104,000
東ソー	13,600	1,977.00	26,887,200
トクヤマ	2,600	2,103.00	5,467,800
セントラル硝子	1,700	2,075.00	3,527,500
東亜合成	5,000	1,266.00	6,330,000
大阪ソーダ	900	2,577.00	2,319,300
関東電化	2,100	967.00	2,030,700
デンカ	3,200	3,740.00	11,968,000
イビデン	4,400	5,660.00	24,904,000
信越化学	16,300	18,585.00	302,935,500
日本カ-バイド	400	1,337.00	534,800
電算システムHD	400	2,595.00	1,038,000
堺化学	700	2,281.00	1,596,700
第一稀元素化学工	900	1,418.00	1,276,200
エア・ウォーター	9,000	1,676.00	15,084,000
日本酸素HLDGS	7,200	2,660.00	19,152,000
日本化学工業	300	2,868.00	860,400
東邦アセチレン	100	1,268.00	126,800
日本パ-カラライジング	4,400	1,109.00	4,879,600
高压ガス	1,400	760.00	1,064,000
チタン工業	100	1,791.00	179,100
四国化成	1,100	1,371.00	1,508,100
戸田工業	200	2,969.00	593,800
ステラケミファ	500	2,855.00	1,427,500
保土谷化学	300	4,990.00	1,497,000
日本触媒	1,600	5,530.00	8,848,000
大日精化	700	2,595.00	1,816,500
カネカ	2,300	4,410.00	10,143,000
協和キリン	10,500	3,700.00	38,850,000
三菱瓦斯化学	8,800	2,159.00	18,999,200
三井化学	7,600	3,525.00	26,790,000
JSR	8,800	3,810.00	33,528,000

東京応化工業	1,500	6,490.00	9,735,000
大阪有機化学	700	3,245.00	2,271,500
三菱ケミカルHLDGS	58,700	958.10	56,240,470
KHネオケム	1,500	2,981.00	4,471,500
ダイセル	11,800	863.00	10,183,400
住友ベークライト	1,400	4,865.00	6,811,000
積水化学	18,400	1,815.00	33,396,000
日本ゼオン	8,000	1,482.00	11,856,000
アイカ工業	2,400	3,555.00	8,532,000
宇部興産	4,400	2,152.00	9,468,800
積水樹脂	1,300	2,081.00	2,705,300
タキロンシーアイ	1,900	616.00	1,170,400
旭有機材	500	1,409.00	704,500
ニチバン	500	1,800.00	900,000
リケンテクノス	2,100	556.00	1,167,600
大倉工業	500	2,137.00	1,068,500
積水化成成品	1,200	581.00	697,200
群栄化学	200	3,045.00	609,000
タイガース ポリマー	500	422.00	211,000
ミライアル	300	1,570.00	471,000
ダイキアクシス	400	990.00	396,000
ダイキョーニシカワ	1,800	645.00	1,161,000
竹本容器	300	912.00	273,600
森六ホールディングス	500	1,997.00	998,500
恵和	200	4,620.00	924,000
日本化薬	5,500	1,197.00	6,583,500
カーリットホールディングス	800	785.00	628,000
ソルクシーズ	800	524.00	419,200
レグス	200	1,755.00	351,000
プレステージ・インター	3,200	735.00	2,352,000
フェイス	300	693.00	207,900
プロトコーポレーション	1,000	1,530.00	1,530,000
ハイマックス	300	1,140.00	342,000
アミューズ	500	2,277.00	1,138,500
野村総合研究所	15,300	4,030.00	61,659,000
ドリームインキュベータ	300	816.00	244,800
サイバネットシステム	700	633.00	443,100
クイック	600	1,394.00	836,400
TAC	500	240.00	120,000
CEホールディングス	500	571.00	285,500

日本システム技術	200	1,803.00	360,600
電通グループ	8,800	4,205.00	37,004,000
インテージホールディングス	1,100	1,600.00	1,760,000
テイクアンドギヴニーズ	400	1,250.00	500,000
東邦システムサイエンス	300	1,010.00	303,000
ぴあ	300	4,080.00	1,224,000
イオンファンタジー	400	1,912.00	764,800
ソースネクスト	4,200	232.00	974,400
シーティーエス	900	771.00	693,900
ネクシィーズグループ	300	922.00	276,600
インフォコム	800	2,320.00	1,856,000
メディカルシステムネットワーク	700	669.00	468,300
日本精化	600	2,159.00	1,295,400
扶桑化学工業	600	4,835.00	2,901,000
トリケミカル	800	3,155.00	2,524,000
HEROZ	300	1,969.00	590,700
ラクスル	900	5,650.00	5,085,000
I P S	200	1,946.00	389,200
F I G	900	280.00	252,000
システムサポート	300	1,319.00	395,700
A D E K A	4,100	2,335.00	9,573,500
日油	3,300	5,980.00	19,734,000
ミヨシ油脂	400	1,324.00	529,600
新日本理化	1,500	361.00	541,500
ハリマ化成グループ	600	867.00	520,200
イーソル	600	910.00	546,000
アルテリア・ネットワークス	1,000	1,635.00	1,635,000
E D U L A B	100	2,358.00	235,800
東海ソフト	100	1,239.00	123,900
ウイングアーク1ST	500	2,227.00	1,113,500
ヒト・コミュニケーションズHD	200	1,780.00	356,000
サーバーワークス	100	4,010.00	401,000
東名	100	1,232.00	123,200
ヴィッツ	100	1,671.00	167,100
トビラシステムズ	200	1,225.00	245,000
S a n s a n	700	10,380.00	7,266,000
L i n k - U	200	1,255.00	251,000
ギフティ	700	4,240.00	2,968,000
花 王	19,800	6,635.00	131,373,000
第一工業製薬	300	3,085.00	925,500

石原ケミカル	400	1,313.00	525,200
日華化学	300	995.00	298,500
ニイタカ	200	2,259.00	451,800
三洋化成	600	5,620.00	3,372,000
ベース	200	4,630.00	926,000
武田薬品	74,600	3,199.00	238,645,400
アステラス製薬	77,700	1,943.00	150,971,100
大日本住友製薬	6,700	1,890.00	12,663,000
塩野義製薬	11,300	7,378.00	83,371,400
わかもと製薬	1,100	331.00	364,100
日本新薬	2,500	8,780.00	21,950,000
中外製薬	28,000	3,888.00	108,864,000
科研製薬	1,600	4,500.00	7,200,000
エーザイ	9,900	8,087.00	80,061,300
理研ビタミン	800	1,827.00	1,461,600
ロート製薬	4,300	3,370.00	14,491,000
小野薬品	20,600	2,425.50	49,965,300
久光製薬	2,600	4,125.00	10,725,000
有機合成薬品	600	321.00	192,600
持田製薬	1,200	3,305.00	3,966,000
参天製薬	15,600	1,513.00	23,602,800
扶桑薬品	300	2,411.00	723,300
日本ケミファ	100	2,187.00	218,700
ツムラ	3,000	3,440.00	10,320,000
日医工	2,500	932.00	2,330,000
テルモ	27,500	5,006.00	137,665,000
HUグループHD	2,400	2,867.00	6,880,800
キッセイ薬品工業	1,600	2,406.00	3,849,600
生化学工業	1,600	1,038.00	1,660,800
栄研化学	1,600	1,945.00	3,112,000
日水製薬	400	978.00	391,200
鳥居薬品	500	2,960.00	1,480,000
JCRファーマ	2,500	2,876.00	7,190,000
東和薬品	1,300	3,240.00	4,212,000
富士製薬工業	600	1,125.00	675,000
ゼリア新薬工業	1,700	2,015.00	3,425,500
第一三共	70,500	2,900.50	204,485,250
キョーリン製薬HD	1,900	1,782.00	3,385,800
大幸薬品	1,400	894.00	1,251,600
ダイト	600	3,165.00	1,899,000

大塚ホールディングス	18,600	4,835.00	89,931,000
大正製薬HD	2,200	6,560.00	14,432,000
ペプチドリーム	4,700	2,983.00	14,020,100
大日本塗料	1,000	860.00	860,000
日本ペイントHOLD	33,000	1,200.00	39,600,000
関西ペイント	9,900	2,679.00	26,522,100
神東塗料	600	190.00	114,000
中国塗料	2,100	870.00	1,827,000
日本特殊塗料	600	997.00	598,200
藤倉化成	1,200	536.00	643,200
太陽ホールディングス	1,200	2,666.00	3,199,200
DIC	3,700	3,050.00	11,285,000
サカタインクス	1,800	1,116.00	2,008,800
東洋インキSCホールディン	1,800	2,035.00	3,663,000
T&K TOKA	700	796.00	557,200
アルプス技研	700	2,024.00	1,416,800
サニックス	1,400	329.00	460,600
ダイオーズ	200	1,006.00	201,200
日本空調サービス	900	793.00	713,700
オリエンタルランド	9,100	17,555.00	159,750,500
フォーカスシステムズ	600	994.00	596,400
ダスキン	1,900	2,644.00	5,023,600
パーク24	4,700	1,802.00	8,469,400
明光ネットワークジャパン	1,000	624.00	624,000
ファルコホールディングス	400	1,745.00	698,000
クレスコ	600	1,964.00	1,178,400
フジ・メディア・HD	9,200	1,202.00	11,058,400
秀英予備校	200	413.00	82,600
田谷	200	559.00	111,800
ラウンドワン	3,000	1,475.00	4,425,000
リゾートトラスト	3,900	2,099.00	8,186,100
オービック	2,800	20,890.00	58,492,000
ジャストシステム	1,300	5,670.00	7,371,000
TDCソフト	700	1,336.00	935,200
Zホールディングス	120,900	691.90	83,650,710
ビー・エム・エル	1,100	4,130.00	4,543,000
トレンドマイクロ	4,700	6,060.00	28,482,000
りらいあコミュニケーション	1,300	1,199.00	1,558,700
IDホールディングス	500	943.00	471,500
リソー教育	4,300	437.00	1,879,100

日本オラクル	1,800	10,110.00	18,198,000
早稲田アカデミー	400	987.00	394,800
アルファシステムズ	300	4,225.00	1,267,500
フューチャー	900	2,688.00	2,419,200
C A C H O L D I N G S	600	1,632.00	979,200
S B テ ク ノ ロ ジ ー	300	2,858.00	857,400
トーセ	300	780.00	234,000
ユー・エス・エス	9,600	1,795.00	17,232,000
オービックビジネスC	800	5,710.00	4,568,000
伊藤忠テクノソリュー	4,000	3,490.00	13,960,000
アイティフォー	1,100	836.00	919,600
東京個別指導学院	700	652.00	456,400
東計電算	100	4,520.00	452,000
サイバーエージェント	21,100	2,109.00	44,499,900
楽天グループ	43,900	1,100.00	48,290,000
エックスネット	100	1,007.00	100,700
クリーク・アンド・リバー社	500	1,804.00	902,000
モーニングスター	1,200	520.00	624,000
テー・オー・ダブリュー	1,500	334.00	501,000
大塚商会	4,700	5,480.00	25,756,000
サイボウズ	1,200	2,406.00	2,887,200
山田コンサルティングG P	500	1,137.00	568,500
セントラルスポーツ	300	2,418.00	725,400
パラカ	200	1,647.00	329,400
電通国際情報S	1,300	3,975.00	5,167,500
A C C E S S	1,100	936.00	1,029,600
デジタルガレージ	1,500	4,895.00	7,342,500
イーエムシステムズ	1,500	763.00	1,144,500
ウェザーニューズ	300	6,490.00	1,947,000
C I J	600	855.00	513,000
ビジネスエンジニアリング	100	3,445.00	344,500
日本エンタープライズ	900	205.00	184,500
WOWOW	500	2,449.00	1,224,500
スカラ	700	739.00	517,300
インテリジェント ウェイブ	600	610.00	366,000
フルキャストホールディングス	700	2,575.00	1,802,500
エン・ジャパン	1,500	4,180.00	6,270,000
あすか製薬HD	1,000	1,021.00	1,021,000
サワイグループHD	1,900	5,110.00	9,709,000
富士フイルムH L D G S	15,700	8,701.00	136,605,700

コニカミノルタ	18,200	614.00	11,174,800
資生堂	16,700	7,821.00	130,610,700
ライオン	10,800	1,895.00	20,466,000
高砂香料	600	2,923.00	1,753,800
マンダム	1,800	1,609.00	2,896,200
ミルボン	1,100	6,510.00	7,161,000
ファンケル	3,200	3,765.00	12,048,000
コーセー	1,700	14,000.00	23,800,000
コタ	600	1,561.00	936,600
シーボン	100	1,859.00	185,900
ポーラ・オルビスHD	3,800	2,547.00	9,678,600
ノエビアホールディングス	700	5,460.00	3,822,000
アジュバンホールディング	200	1,155.00	231,000
新日本製薬	300	1,827.00	548,100
エステー	600	1,714.00	1,028,400
アグロカネショウ	300	1,399.00	419,700
コニシ	1,500	1,835.00	2,752,500
長谷川香料	1,600	2,673.00	4,276,800
星光PMC	600	806.00	483,600
小林製薬	2,500	8,740.00	21,850,000
荒川化学工業	700	1,222.00	855,400
メック	700	2,841.00	1,988,700
日本高純度化学	300	2,892.00	867,600
タカラバイオ	2,300	2,869.00	6,598,700
JCU	1,000	4,155.00	4,155,000
新田ゼラチン	600	623.00	373,800
OATアグリオ	200	1,893.00	378,600
デクセリアルズ	2,500	2,005.00	5,012,500
アース製薬	700	6,590.00	4,613,000
北興化学	800	1,028.00	822,400
大成ラミック	300	2,733.00	819,900
クミアイ化学	3,300	843.00	2,781,900
日本農薬	1,600	517.00	827,200
富士興産	300	966.00	289,800
ニチレキ	1,000	1,327.00	1,327,000
ユシロ化学	500	1,160.00	580,000
ビーピー・カストロール	300	1,424.00	427,200
富士石油	2,200	282.00	620,400
MORESCO	400	1,204.00	481,600
出光興産	10,000	3,120.00	31,200,000

ENEOSホールディングス	134,900	448.70	60,529,630
コスモエネルギーHLDGS	2,900	2,467.00	7,154,300
テスホールディングス	600	2,214.00	1,328,400
インフロニアHD	11,104	930.00	10,326,720
横浜ゴム	5,200	1,986.00	10,327,200
TOYO TIRE	4,700	1,894.00	8,901,800
ブリヂストン	25,800	5,166.00	133,282,800
住友ゴム	8,000	1,414.00	11,312,000
藤倉コンポジット	700	762.00	533,400
オカモト	600	4,070.00	2,442,000
アキレス	700	1,313.00	919,100
フコク	400	1,013.00	405,200
ニッタ	900	2,600.00	2,340,000
クリエートメディック	300	980.00	294,000
住友理工	1,800	734.00	1,321,200
三ツ星ベルト	1,100	1,993.00	2,192,300
バンドー化学	1,600	892.00	1,427,200
AGC	8,200	5,570.00	45,674,000
日本板硝子	4,500	549.00	2,470,500
石塚硝子	200	2,089.00	417,800
有沢製作所	1,200	875.00	1,050,000
日本山村硝子	400	900.00	360,000
日本電気硝子	3,600	2,678.00	9,640,800
オハラ	400	1,407.00	562,800
住友大阪セメント	1,600	3,310.00	5,296,000
太平洋セメント	5,100	2,380.00	12,138,000
リソルホールディングス	100	4,075.00	407,500
日本ヒユ-ム	800	750.00	600,000
日本コンクリ-ト	1,900	301.00	571,900
三谷セキサン	500	7,550.00	3,775,000
アジアパイルHD	1,400	463.00	648,200
東海カーボン	7,500	1,366.00	10,245,000
日本カーボン	500	4,080.00	2,040,000
東洋炭素	600	2,832.00	1,699,200
ノリタケ	500	4,810.00	2,405,000
TOTO	6,400	5,200.00	33,280,000
日本碍子	9,900	1,835.00	18,166,500
日本特殊陶業	6,800	1,715.00	11,662,000
ダントーホールディングス	600	259.00	155,400
MARUWA	300	10,340.00	3,102,000

品川リフラクトリーズ	200	3,855.00	771,000
黒崎播磨	200	4,550.00	910,000
ヨータイ	600	1,255.00	753,000
イソライト	400	823.00	329,200
東京窯業	1,100	323.00	355,300
ニッカトー	400	762.00	304,800
フジミインコーポレーテッド	700	6,340.00	4,438,000
クニミネ工業	300	1,101.00	330,300
エーアンドエーマテリアル	200	971.00	194,200
ニチアス	2,200	2,548.00	5,605,600
日本製鉄	42,400	1,916.00	81,238,400
神戸製鋼所	16,200	654.00	10,594,800
中山製鋼所	1,200	422.00	506,400
合同製鐵	500	1,532.00	766,000
J F Eホールディングス	25,600	1,617.00	41,395,200
東京製鐵	3,400	1,108.00	3,767,200
共英製鋼	1,000	1,384.00	1,384,000
大和工業	1,800	3,485.00	6,273,000
東京鐵鋼	400	1,564.00	625,600
大阪製鐵	500	1,106.00	553,000
淀川製鋼所	1,200	2,370.00	2,844,000
丸一鋼管	2,900	2,525.00	7,322,500
モリ工業	300	2,368.00	710,400
大同特殊鋼	1,500	4,710.00	7,065,000
日本高周波	400	401.00	160,400
日本冶金工	600	2,526.00	1,515,600
山陽特殊製鋼	1,000	1,696.00	1,696,000
愛知製鋼	500	2,695.00	1,347,500
日立金属	8,300	2,150.00	17,845,000
日本金属	200	1,004.00	200,800
大平洋金属	600	1,942.00	1,165,200
新日本電工	5,700	319.00	1,818,300
栗本鉄工所	400	1,649.00	659,600
虹 技	100	1,085.00	108,500
日本鑄鉄管	100	1,230.00	123,000
日本製鋼所	2,700	2,976.00	8,035,200
三菱製鋼	600	1,137.00	682,200
日亜鋼業	1,300	293.00	380,900
日本精線	100	4,640.00	464,000
エンビプロHD	400	2,092.00	836,800

大紀アルミニウム	1,300	1,658.00	2,155,400
日本軽金属HD	2,400	1,899.00	4,557,600
三井金属	2,400	3,070.00	7,368,000
東邦亜鉛	500	2,599.00	1,299,500
三菱マテリアル	5,800	2,181.00	12,649,800
住友鉱山	11,400	4,025.00	45,885,000
DOWAホールディングス	2,200	4,320.00	9,504,000
古河機金	1,500	1,202.00	1,803,000
エス・サイエンス	4,300	33.00	141,900
大阪チタニウム	900	791.00	711,900
東邦チタニウム	1,600	1,160.00	1,856,000
UACJ	1,400	2,685.00	3,759,000
CKサンエツ	200	2,944.00	588,800
古河電工	2,800	2,438.00	6,826,400
住友電工	30,900	1,486.00	45,917,400
フジクラ	10,700	648.00	6,933,600
昭和電線HLDGS	800	2,132.00	1,705,600
東京特殊電線	100	2,761.00	276,100
タツタ電線	1,600	532.00	851,200
カナレ電気	100	1,712.00	171,200
平河ヒューテック	500	1,153.00	576,500
リョービ	1,100	1,219.00	1,340,900
アーレステイ	1,100	443.00	487,300
アサヒHD	3,300	2,013.00	6,642,900
東洋製罐グループHD	5,600	1,340.00	7,504,000
ホッカンホールディングス	500	1,479.00	739,500
コロナ	500	904.00	452,000
横河ブリッジHLDGS	1,500	2,358.00	3,537,000
駒井ハルテック	200	1,691.00	338,200
高田機工	100	2,835.00	283,500
三和ホールディングス	8,300	1,353.00	11,229,900
文化シャツタ -	2,600	1,118.00	2,906,800
三協立山	1,100	774.00	851,400
アルインコ	600	989.00	593,400
東洋シャツタ -	200	663.00	132,600
LIXIL	12,200	2,905.00	35,441,000
日本ファイルコン	700	538.00	376,600
ノーリツ	1,700	1,827.00	3,105,900
長府製作所	900	2,025.00	1,822,500
リンナイ	1,800	11,640.00	20,952,000

ユニプレス	1,500	884.00	1,326,000
ダイニチ工業	500	750.00	375,000
日東精工	1,100	637.00	700,700
三洋工業	100	1,882.00	188,200
岡 部	1,800	686.00	1,234,800
ジーテクト	1,100	1,400.00	1,540,000
東 プ レ	1,700	1,249.00	2,123,300
高周波熱錬	1,700	607.00	1,031,900
東京製綱	600	917.00	550,200
サンコール	700	439.00	307,300
モリテックスチル	600	437.00	262,200
パイオラックス	1,300	1,533.00	1,992,900
エイチワン	800	718.00	574,400
日本発条	8,800	821.00	7,224,800
中央発條	500	1,022.00	511,000
アドバネクス	100	1,204.00	120,400
三浦工業	3,800	4,225.00	16,055,000
タ ク マ	3,000	1,505.00	4,515,000
テクノプロ・ホールディング	5,100	3,380.00	17,238,000
アトラグループ	200	310.00	62,000
インターワークス	300	408.00	122,400
アイ・アールジャパンHD	400	11,680.00	4,672,000
K e e P e r 技研	600	3,230.00	1,938,000
ファーストロジック	200	802.00	160,400
三機サービス	200	1,097.00	219,400
G u n o s y	600	712.00	427,200
デザインワン・ジャパン	200	252.00	50,400
イー・ガーディアン	400	3,055.00	1,222,000
リブセンス	500	219.00	109,500
ジャパンマテリアル	2,600	1,365.00	3,549,000
ベクトル	1,100	1,187.00	1,305,700
ウチヤマホールディングス	500	370.00	185,000
チャームケアコーポレーション	600	1,648.00	988,800
キャリアリンク	300	1,700.00	510,000
I B J	700	1,084.00	758,800
アサンテ	300	1,748.00	524,400
バリューHR	400	1,742.00	696,800
M & Aキャピタルパートナー	700	6,070.00	4,249,000
ライドオンエクスプレスHD	400	1,521.00	608,400
E R Iホールディングス	300	1,463.00	438,900

アビスト	100	2,861.00	286,100
シグマクシス・ホールディング	500	2,644.00	1,322,000
ウィルグループ	700	1,291.00	903,700
エスクローA J	1,300	216.00	280,800
メドピア	700	3,640.00	2,548,000
レアジョブ	200	1,369.00	273,800
リクルートホールディングス	61,300	6,870.00	421,131,000
エラン	1,200	1,186.00	1,423,200
ツガミ	1,900	1,526.00	2,899,400
オークマ	1,000	5,270.00	5,270,000
芝浦機械	900	2,602.00	2,341,800
アマダ	12,900	1,117.00	14,409,300
アイダエンジニア	2,300	968.00	2,226,400
滝澤鉄工所	300	1,122.00	336,600
F U J I	3,500	2,618.00	9,163,000
牧野フライス	1,000	3,985.00	3,985,000
オーエスジー	4,100	1,847.00	7,572,700
ダイジェット	100	1,197.00	119,700
旭ダイヤモンド	2,300	664.00	1,527,200
D M G 森精機	5,300	1,884.00	9,985,200
ソディック	1,900	851.00	1,616,900
ディスコ	1,200	29,770.00	35,724,000
日東工器	500	1,966.00	983,000
日進工具	700	1,389.00	972,300
パンチ工業	700	601.00	420,700
富士ダイス	500	648.00	324,000
土木管理総合試験	400	354.00	141,600
ネットマーケティング	400	523.00	209,200
日本郵政	64,800	929.60	60,238,080
ベルシステム24HLDGS	1,500	1,626.00	2,439,000
鎌倉新書	800	880.00	704,000
S M N	200	725.00	145,000
一蔵	100	539.00	53,900
グローバルキッズCOMP	200	806.00	161,200
エアトリ	600	4,115.00	2,469,000
アトラエ	600	2,355.00	1,413,000
ストライク	300	4,105.00	1,231,500
ソラスト	2,100	1,404.00	2,948,400
セラク	300	2,286.00	685,800
インソース	800	2,093.00	1,674,400

豊田自動織機	7,200	8,830.00	63,576,000
豊和工業	500	811.00	405,500
OKK	400	277.00	110,800
石川製作所	200	1,558.00	311,600
東洋機械金属	600	515.00	309,000
津田駒工業	200	836.00	167,200
エンシュウ	200	734.00	146,800
島精機製作所	1,300	2,185.00	2,840,500
オプトラ	1,100	2,231.00	2,454,100
NCホールディングス	300	1,188.00	356,400
イワキポンプ	600	924.00	554,400
フリー	800	1,643.00	1,314,400
ヤマシンフィルタ	1,800	615.00	1,107,000
日阪製作所	1,100	841.00	925,100
やまびこ	1,800	1,195.00	2,151,000
野村マイクロ・サイエンス	200	4,425.00	885,000
平田機工	500	6,660.00	3,330,000
ペガサスミシン製造	900	464.00	417,600
マルマエ	400	1,893.00	757,200
タツモ	400	1,529.00	611,600
ナプテスコ	5,100	3,895.00	19,864,500
三井海洋開発	900	1,862.00	1,675,800
レオン自動機	800	1,471.00	1,176,800
SMC	2,600	62,840.00	163,384,000
ホソカワミクロン	600	3,150.00	1,890,000
ユニオンツール	400	3,650.00	1,460,000
オイレス工業	1,200	1,649.00	1,978,800
日精エーエスビー	300	3,735.00	1,120,500
サト - ホールディングス	1,200	2,529.00	3,034,800
技研製作所	700	4,795.00	3,356,500
日本エアーテック	400	1,222.00	488,800
カワタ	300	1,261.00	378,300
日精樹脂工業	600	1,082.00	649,200
オカダアイヨン	300	1,310.00	393,000
ワイエイシイホールディングス	400	863.00	345,200
小松製作所	40,600	2,644.00	107,346,400
住友重機械	5,100	2,874.00	14,657,400
日立建機	4,200	3,155.00	13,251,000
日工	1,300	658.00	855,400
巴工業	400	2,434.00	973,600

井関農機	800	1,553.00	1,242,400
TOWA	800	2,242.00	1,793,600
丸山製作所	200	1,533.00	306,600
北川鉄工所	400	1,563.00	625,200
シンニッタン	1,100	237.00	260,700
ローツェ	400	7,500.00	3,000,000
タカキタ	300	646.00	193,800
クボタ	43,800	2,305.00	100,959,000
荏原実業	400	2,658.00	1,063,200
東洋エンジニア	1,200	867.00	1,040,400
三菱化工機	300	2,415.00	724,500
月島機械	1,700	1,130.00	1,921,000
帝国電機製作所	600	1,376.00	825,600
東京機械	200	1,618.00	323,600
新東工業	2,100	755.00	1,585,500
渋谷工業	700	2,972.00	2,080,400
アイチ コーポレーション	1,500	761.00	1,141,500
小森コーポレーション	2,300	816.00	1,876,800
鶴見製作所	600	1,705.00	1,023,000
住友精密	100	2,352.00	235,200
日本ギア工業	400	310.00	124,000
酒井重工業	200	2,566.00	513,200
荏原製作所	3,700	5,690.00	21,053,000
石井鉄工所	100	3,000.00	300,000
西島製作所	900	892.00	802,800
北越工業	900	950.00	855,000
ダイキン工業	11,400	23,960.00	273,144,000
オルガノ	300	6,350.00	1,905,000
ト - ヨ - カネツ	400	2,585.00	1,034,000
栗田工業	4,800	5,160.00	24,768,000
椿本チエイン	1,300	3,350.00	4,355,000
大同工業	500	1,036.00	518,000
日 機 装	2,700	972.00	2,624,400
木村化工機	700	712.00	498,400
レイズネクスト	1,500	1,205.00	1,807,500
アネスト岩田	1,500	904.00	1,356,000
ダイフク	4,900	9,930.00	48,657,000
サムコ	200	2,719.00	543,800
加藤製作所	500	838.00	419,000
油研工業	200	1,741.00	348,200

タダノ	4,300	1,130.00	4,859,000
フジテック	3,000	2,513.00	7,539,000
C K D	2,000	2,146.00	4,292,000
キトー	700	1,548.00	1,083,600
平和	2,500	2,044.00	5,110,000
理想科学工業	600	2,262.00	1,357,200
S A N K Y O	2,100	2,759.00	5,793,900
日本金銭機械	1,000	718.00	718,000
マースグループH L D G S	600	1,617.00	970,200
フクシマガリレイ	700	4,660.00	3,262,000
オーイズミ	400	388.00	155,200
ダイコク電機	400	1,204.00	481,600
竹内製作所	1,500	2,652.00	3,978,000
ア マ ノ	2,300	2,619.00	6,023,700
J U K I	1,200	810.00	972,000
サンデンホールディングス	1,300	288.00	374,400
ジャノメ	800	734.00	587,200
ブラザー工業	10,900	2,384.00	25,985,600
マックス	1,200	1,805.00	2,166,000
モリタホールディングス	1,500	1,463.00	2,194,500
グローリー	2,300	2,378.00	5,469,400
新晃工業	800	2,065.00	1,652,000
大和冷機工業	1,300	1,221.00	1,587,300
セガサミーホールディングス	8,100	1,562.00	12,652,200
日本ピストンリング	400	1,361.00	544,400
リ ケ ン	400	2,670.00	1,068,000
T P R	1,200	1,432.00	1,718,400
ツバキ・ナカシマ	1,900	1,453.00	2,760,700
ホシザキ	2,600	9,860.00	25,636,000
大豊工業	700	815.00	570,500
日本精工	18,400	776.00	14,278,400
N T N	20,700	253.00	5,237,100
ジェイテクト	8,600	981.00	8,436,600
不 二 越	700	4,150.00	2,905,000
ミネベアミツミ	15,400	2,679.00	41,256,600
日本トムソン	2,500	531.00	1,327,500
T H K	5,200	2,441.00	12,693,200
ユーシン精機	600	764.00	458,400
前澤給装工業	700	1,034.00	723,800
イーグル工業	1,100	1,192.00	1,311,200

前澤工業	600	764.00	458,400
日本ピラ - 工業	900	2,476.00	2,228,400
キッツ	3,100	742.00	2,300,200
日立	43,100	6,344.00	273,426,400
東芝	17,800	4,900.00	87,220,000
三菱電機	89,600	1,509.00	135,206,400
富士電機	5,400	4,810.00	25,974,000
東洋電機製造	400	1,103.00	441,200
安川電機	9,600	5,170.00	49,632,000
シンフォニアテクノロジー	1,200	1,149.00	1,378,800
明電舎	1,500	2,418.00	3,627,000
オリジン	300	1,275.00	382,500
山洋電気	500	6,370.00	3,185,000
デンヨー	700	2,028.00	1,419,600
ベйкаレントコンサルティング	600	46,300.00	27,780,000
ORCHESTRA HLDGS	200	4,250.00	850,000
アイモバイル	300	1,454.00	436,200
キャリアインデックス	400	899.00	359,600
MS - Japan	400	1,008.00	403,200
船場	200	804.00	160,800
グレイステクノロジー	800	1,086.00	868,800
ジャパニエレベーターSHD	2,500	2,399.00	5,997,500
フルテック	100	1,407.00	140,700
グリーンズ	300	542.00	162,600
ツナググループHLDGS	200	366.00	73,200
GAMEWITH	300	519.00	155,700
ソウルドアウト	200	1,576.00	315,200
MS&CONSULTING	100	612.00	61,200
ウェルビー	300	1,470.00	441,000
エル・ティー・エス	100	3,270.00	327,000
ミダックホールディングス	400	5,060.00	2,024,000
日総工産	700	694.00	485,800
キュービーネットHLDGS	400	1,860.00	744,000
RPAホールディングス	1,000	577.00	577,000
三桜工業	1,200	1,005.00	1,206,000
マキタ	11,700	5,650.00	66,105,000
東芝テック	900	4,590.00	4,131,000
芝浦メカトロニクス	200	6,430.00	1,286,000
マブチモーター	2,100	3,765.00	7,906,500
日本電産	21,600	11,745.00	253,692,000

ユーエムシーエレクトロニクス	500	660.00	330,000
トレックス・セミコンダクター	500	2,438.00	1,219,000
東光高岳	500	1,436.00	718,000
ダブル・スコープ	2,600	834.00	2,168,400
宮越ホールディングス	400	1,214.00	485,600
ダイヘン	1,000	4,520.00	4,520,000
ヤーマン	1,500	1,228.00	1,842,000
JVCケンウッド	7,800	201.00	1,567,800
ミマキエンジニアリング	800	935.00	748,000
I - P E X	500	1,959.00	979,500
日新電機	2,100	1,316.00	2,763,600
大崎電気	1,800	544.00	979,200
オムロン	7,500	10,190.00	76,425,000
日東工業	1,300	1,692.00	2,199,600
I D E C	1,200	2,053.00	2,463,600
正興電機製作所	300	1,355.00	406,500
不二電機工業	200	1,270.00	254,000
ジーエス・ユアサ コーポ	3,200	2,468.00	7,897,600
サクサホールディングス	200	1,428.00	285,600
メルコホールディングス	300	4,660.00	1,398,000
テクノメディカ	200	1,613.00	322,600
ダイヤモンドエレクトリックHD	300	2,172.00	651,600
日本電気	11,400	6,010.00	68,514,000
富士通	8,000	19,620.00	156,960,000
沖電気	3,600	972.00	3,499,200
岩崎通信機	400	891.00	356,400
電気興業	500	2,515.00	1,257,500
サンケン電気	1,000	5,690.00	5,690,000
ナカヨ	200	1,410.00	282,000
アイホン	500	2,351.00	1,175,500
ルネサスエレクトロニクス	48,400	1,311.00	63,452,400
セイコーエプソン	11,100	2,159.00	23,964,900
ワコム	6,500	698.00	4,537,000
アルバック	1,700	6,070.00	10,319,000
アクセル	400	705.00	282,000
E I Z O	700	4,250.00	2,975,000
ジャパンディスプレイ	30,600	34.00	1,040,400
日本信号	2,100	955.00	2,005,500
京三製作所	1,900	480.00	912,000
能美防災	1,200	2,029.00	2,434,800

ホーチキ	600	1,212.00	727,200
星和電機	400	514.00	205,600
エレコム	2,000	1,774.00	3,548,000
パナソニック	95,700	1,275.00	122,017,500
シャープ	11,900	1,351.00	16,076,900
アンリツ	5,400	1,984.00	10,713,600
富士通ゼネラル	2,800	2,808.00	7,862,400
ソニーグループ	56,100	11,860.00	665,346,000
T D K	12,900	3,645.00	47,020,500
帝国通信工業	400	1,365.00	546,000
タムラ製作所	3,200	732.00	2,342,400
アルプスアルパイン	7,300	1,131.00	8,256,300
池上通信機	300	785.00	235,500
日本電波工業	800	869.00	695,200
鈴木	400	882.00	352,800
メイコー	700	2,883.00	2,018,100
日本トリム	200	3,510.00	702,000
ローランド ディー . ジー .	600	2,888.00	1,732,800
フオスタ - 電機	900	893.00	803,700
S M K	200	2,309.00	461,800
ヨコオ	700	2,361.00	1,652,700
ティアック	600	119.00	71,400
ホシデン	2,300	940.00	2,162,000
ヒロセ電機	1,400	17,540.00	24,556,000
日本航空電子	2,000	1,579.00	3,158,000
T O A	1,000	806.00	806,000
マクセル	1,800	1,296.00	2,332,800
古野電気	1,100	1,230.00	1,353,000
ユニデンホールディングス	200	3,220.00	644,000
スミダコーポレーション	800	1,199.00	959,200
アイコム	400	2,355.00	942,000
リオン	400	2,456.00	982,400
本多通信工業	700	454.00	317,800
横河電機	9,000	1,984.00	17,856,000
新電元工業	400	3,815.00	1,526,000
アズビル	6,100	4,475.00	27,297,500
東亜ディーケーケー	500	863.00	431,500
日本光電工業	3,700	3,630.00	13,431,000
チノール	300	1,428.00	428,400
共和電業	800	392.00	313,600

日本電子材料	400	1,759.00	703,600
堀場製作所	1,700	7,400.00	12,580,000
アドバンテスト	6,700	9,090.00	60,903,000
小野測器	400	523.00	209,200
エスペック	800	2,258.00	1,806,400
キーエンス	8,800	64,270.00	565,576,000
日置電機	500	8,810.00	4,405,000
シスメックス	7,000	13,515.00	94,605,000
日本マイクロニクス	1,600	1,308.00	2,092,800
メガチップス	900	3,280.00	2,952,000
OBARA GROUP	400	3,630.00	1,452,000
IMAGICA GROUP	900	513.00	461,700
澤藤電機	100	2,035.00	203,500
デンソー	19,700	7,304.00	143,888,800
原田工業	400	948.00	379,200
コーセル	1,100	918.00	1,009,800
イリソ電子工業	700	4,365.00	3,055,500
オプテックスグループ	1,500	1,424.00	2,136,000
千代田インテグレ	400	2,060.00	824,000
アイ・オー・データ	400	938.00	375,200
レーザーテック	4,000	24,140.00	96,560,000
スタンレー電気	6,300	2,716.00	17,110,800
岩崎電気	400	2,059.00	823,600
ウシオ電機	4,600	2,046.00	9,411,600
岡谷電機	600	343.00	205,800
ヘリオステクノH	800	322.00	257,600
エノモト	300	1,747.00	524,100
日本セラミック	800	2,919.00	2,335,200
遠藤照明	500	1,154.00	577,000
古河電池	600	1,520.00	912,000
双信電機	500	745.00	372,500
山一電機	600	1,558.00	934,800
函 研	600	4,175.00	2,505,000
日本電子	1,700	8,120.00	13,804,000
カ シ オ	7,200	1,649.00	11,872,800
ファナック	7,900	22,625.00	178,737,500
日本シイエムケイ	1,900	421.00	799,900
エンプラス	400	3,015.00	1,206,000
大真空	300	4,125.00	1,237,500
ロ - ム	3,700	9,760.00	36,112,000

浜松ホトニクス	6,500	6,400.00	41,600,000
三井ハイテック	900	7,060.00	6,354,000
新光電気工業	3,100	3,490.00	10,819,000
京セラ	13,700	6,627.00	90,789,900
協栄産業	100	1,402.00	140,200
太陽誘電	4,000	6,070.00	24,280,000
村田製作所	26,400	8,520.00	224,928,000
双葉電子工業	1,600	758.00	1,212,800
日東電工	5,500	7,500.00	41,250,000
北陸電気工業	400	1,010.00	404,000
東海理化電機	2,400	1,579.00	3,789,600
ニチコン	2,900	1,018.00	2,952,200
日本ケミコン	900	2,003.00	1,802,700
K O A	1,200	1,580.00	1,896,000
三井E & S H D	3,500	512.00	1,792,000
日立造船	7,100	837.00	5,942,700
三菱重工業	14,100	2,947.00	41,552,700
川崎重工業	7,000	2,444.00	17,108,000
I H I	6,000	2,715.00	16,290,000
名村造船所	2,700	237.00	639,900
サノヤスホールディングス	1,100	133.00	146,300
スプリックス	300	1,153.00	345,900
マネジメントソリューションズ	500	3,415.00	1,707,500
プロレド・パートナーズ	200	1,535.00	307,000
AND FACTORY	200	457.00	91,400
テノ・ホールディングス	100	953.00	95,300
フロンティア・マネジメント	200	1,001.00	200,200
ピアラ	100	772.00	77,200
コプロ・ホールディングス	100	1,221.00	122,100
ギークス	200	1,443.00	288,600
カープスホールディングス	2,300	888.00	2,042,400
フォーラムエンジニアリング	600	941.00	564,600
日本車輛	400	2,066.00	826,400
三菱ロジスネクスト	1,200	1,095.00	1,314,000
近畿車輛	200	1,095.00	219,000
一家ホールディングス	200	573.00	114,600
フルサト・マルカHD	887	1,971.00	1,748,277
ヤマエグループHD	600	1,129.00	677,400
F P G	3,000	691.00	2,073,000
島根銀行	300	584.00	175,200

じもとホールディングス	600	681.00	408,600
全国保証	2,300	5,240.00	12,052,000
めぶきフィナンシャルG	46,000	245.00	11,270,000
ジャパンインベストメントA	600	1,296.00	777,600
東京きらぼしFG	1,100	1,570.00	1,727,000
九州フィナンシャルG	18,000	410.00	7,380,000
かんぽ生命保険	11,000	2,015.00	22,165,000
ゆうちょ銀行	25,100	969.00	24,321,900
あんしん保証	300	318.00	95,400
富山第一銀行	2,100	297.00	623,700
コンコルディア・フィナンシャル	53,800	465.00	25,017,000
ジェイリース	300	2,107.00	632,100
西日本フィナンシャルHD	5,700	716.00	4,081,200
イントラスト	300	786.00	235,800
日本モーゲージサービス	500	1,043.00	521,500
C a s a	300	968.00	290,400
アルヒ	1,300	1,289.00	1,675,700
プレミアグループ	400	3,330.00	1,332,000
日産自動車	105,700	535.90	56,644,630
いすゞ自動車	23,800	1,485.00	35,343,000
トヨタ自動車	454,000	1,923.00	873,042,000
日野自動車	11,200	1,097.00	12,286,400
三菱自動車工業	33,200	304.00	10,092,800
エフテック	700	611.00	427,700
レシップホールディングス	400	572.00	228,800
G M B	200	883.00	176,600
ファルテック	200	699.00	139,800
武蔵精密工業	2,000	1,949.00	3,898,000
日産車体	1,300	786.00	1,021,800
新明和工業	2,500	936.00	2,340,000
極東開発工業	1,600	1,635.00	2,616,000
トピー工業	700	1,196.00	837,200
ティラド	300	3,080.00	924,000
曙ブレーキ	4,900	213.00	1,043,700
タチエス	1,400	1,286.00	1,800,400
N O K	4,300	1,296.00	5,572,800
フタバ産業	2,200	464.00	1,020,800
K Y B	1,000	3,015.00	3,015,000
市光工業	1,100	570.00	627,000
大同メタル工業	1,800	592.00	1,065,600

プレス工業	4,400	334.00	1,469,600
ミクニ	1,100	320.00	352,000
太平洋工業	1,800	1,111.00	1,999,800
河西工業	1,200	366.00	439,200
アイシン	6,600	4,030.00	26,598,000
マ ッ ダ	28,100	930.00	26,133,000
今仙電機製作所	700	684.00	478,800
本田技研	70,600	3,370.00	237,922,000
スズキ	17,800	4,825.00	85,885,000
S U B A R U	25,700	2,086.00	53,610,200
安永	500	1,178.00	589,000
ヤマハ発動機	11,700	3,080.00	36,036,000
小糸製作所	5,400	6,450.00	34,830,000
T B K	1,100	403.00	443,300
エクセディ	1,200	1,698.00	2,037,600
ミツバ	1,700	630.00	1,071,000
豊田合成	2,900	2,219.00	6,435,100
愛三工業	1,400	790.00	1,106,000
盟和産業	100	1,004.00	100,400
日本プラスト	700	635.00	444,500
ヨ ロ ズ	700	1,169.00	818,300
エフ・シー・シー	1,500	1,586.00	2,379,000
新家工業	200	1,693.00	338,600
シマノ	3,600	30,210.00	108,756,000
テイ・エス テック	4,200	1,445.00	6,069,000
3 3 F G	700	1,422.00	995,400
第四北越フィナンシャルG	1,500	2,623.00	3,934,500
ひろぎんH L D G S	13,000	645.00	8,385,000
マーキュリアホールディングス	300	757.00	227,100
おきなわF G	800	2,546.00	2,036,800
ダイレクトマーケティングミクス	500	4,160.00	2,080,000
ポピンズホールディング	200	3,360.00	672,000
L I T A L I C O	800	3,145.00	2,516,000
十六F G	1,100	2,170.00	2,387,000
北國F H D	800	2,081.00	1,664,800
ジャムコ	600	1,018.00	610,800
小 野 建	800	1,582.00	1,265,600
はるやまH L D G S	400	574.00	229,600
南 陽	200	1,875.00	375,000
ノ ジ マ	1,600	2,884.00	4,614,400

佐島電機	600	925.00	555,000
カップ・クリエイト	1,200	1,348.00	1,617,600
エコートレーディング	200	643.00	128,600
伯東	600	1,791.00	1,074,600
コンドーテック	600	982.00	589,200
中山福	500	418.00	209,000
ライトオン	600	711.00	426,600
ナガイレーベン	1,200	2,378.00	2,853,600
三菱食品	900	2,922.00	2,629,800
良品計画	10,200	2,296.00	23,419,200
三城ホールディングス	1,100	260.00	286,000
松田産業	600	2,830.00	1,698,000
第一興商	1,700	4,025.00	6,842,500
メディパルHD	8,900	2,105.00	18,734,500
アドヴァングループ	900	939.00	845,100
SPK	400	1,404.00	561,600
萩原電気HLDGS	400	2,128.00	851,200
アルビス	300	2,363.00	708,900
アズワン	700	15,440.00	10,808,000
スズデン	300	1,497.00	449,100
尾家産業	300	1,096.00	328,800
シモジマ	600	1,166.00	699,600
ドウシシャ	800	1,705.00	1,364,000
小津産業	200	1,913.00	382,600
コナカ	1,000	338.00	338,000
高速	500	1,586.00	793,000
ハウスローゼ	100	1,668.00	166,800
G-7ホールディングス	1,000	2,093.00	2,093,000
たけびし	300	1,494.00	448,200
イオン北海道	1,200	1,133.00	1,359,600
コジマ	1,500	625.00	937,500
ヒマラヤ	300	1,042.00	312,600
コーナン商事	1,300	3,650.00	4,745,000
ネットワンシステムズ	3,600	3,610.00	12,996,000
エコス	400	1,926.00	770,400
ワタミ	1,200	1,032.00	1,238,400
マルシェ	300	475.00	142,500
リックス	200	1,488.00	297,600
システムソフト	1,900	150.00	285,000
パンパシフィックHD	17,700	2,396.00	42,409,200

丸文	700	736.00	515,200
西松屋チェーン	1,900	1,448.00	2,751,200
ゼンショーホールディングス	4,700	2,611.00	12,271,700
ハピネット	700	1,487.00	1,040,900
幸楽苑ホールディングス	600	1,481.00	888,600
ハークスレイ	400	481.00	192,400
橋本総業HLDGS	200	2,135.00	427,000
日本ライフライン	2,900	1,304.00	3,781,600
サイゼリヤ	1,300	2,739.00	3,560,700
タカショー	600	823.00	493,800
V Tホールディングス	3,300	518.00	1,709,400
アルゴグラフィックス	600	3,270.00	1,962,000
魚力	300	2,070.00	621,000
IDOM	3,000	893.00	2,679,000
日本エム・ディ・エム	600	2,168.00	1,300,800
ポプラ	200	217.00	43,400
フジ・コーポレーション	500	1,202.00	601,000
ユナイテッドアローズ	1,000	2,147.00	2,147,000
進和	600	2,351.00	1,410,600
エスケイジャパン	200	555.00	111,000
ダイトロン	400	2,170.00	868,000
ハイデイ日高	1,300	1,671.00	2,172,300
シークス	1,300	1,179.00	1,532,700
YU-WA CREATION H	600	250.00	150,000
コロワイド	3,000	1,688.00	5,064,000
ピーシーデポコーポ	1,000	444.00	444,000
田中商事	300	664.00	199,200
オーハシテクニカ	500	1,545.00	772,500
壱番屋	700	4,500.00	3,150,000
白銅	300	2,970.00	891,000
トップカルチャー	300	340.00	102,000
PLANT	200	721.00	144,200
スギホールディングス	1,800	8,070.00	14,526,000
ダイコー通産	100	1,200.00	120,000
薬王堂ホールディングス	400	2,398.00	959,200
島津製作所	11,600	4,590.00	53,244,000
J M S	700	786.00	550,200
クボテック	200	304.00	60,800
長野計器	600	1,216.00	729,600
ブイ・テクノロジー	500	4,320.00	2,160,000

スター精密	1,400	1,505.00	2,107,000
東京計器	600	1,006.00	603,600
愛知時計	100	4,575.00	457,500
インターアクション	500	2,498.00	1,249,000
オーバル	800	261.00	208,800
東京精密	1,500	4,270.00	6,405,000
マニー	3,600	2,037.00	7,333,200
ニコン	13,700	1,210.00	16,577,000
トプコン	4,500	1,810.00	8,145,000
オリンパス	47,000	2,329.00	109,463,000
理研計器	800	2,927.00	2,341,600
S C R E E Nホールディングス	1,600	9,080.00	14,528,000
キヤノン電子	800	1,615.00	1,292,000
タムロン	700	2,478.00	1,734,600
H O Y A	17,500	16,500.00	288,750,000
シ ー ド	400	691.00	276,400
ノーリツ鋼機	800	2,313.00	1,850,400
エー・アンド・デイ	700	1,008.00	705,600
朝日インテック	9,800	2,854.00	27,969,200
キヤノン	44,600	2,707.00	120,732,200
リ コ ー	22,900	1,147.00	26,266,300
シチズン時計	11,400	489.00	5,574,600
リズム	300	1,445.00	433,500
大研医器	700	586.00	410,200
メニコン	2,800	3,920.00	10,976,000
シンシア	100	602.00	60,200
中本パックス	200	1,800.00	360,000
スノーピーク	600	4,860.00	2,916,000
パラマウントベッドHD	1,800	2,173.00	3,911,400
トランザクション	500	1,106.00	553,000
粧美堂	300	414.00	124,200
ニホンフラッシュ	700	1,097.00	767,900
前田工織	1,000	3,050.00	3,050,000
永大産業	1,200	298.00	357,600
アートネイチャー	800	714.00	571,200
バンダイナムコHLDGS	7,400	8,005.00	59,237,000
アイフィスジャパン	200	694.00	138,800
共立印刷	1,500	167.00	250,500
S H O E I	800	4,620.00	3,696,000
フランスベッドHLDGS	1,100	906.00	996,600

マーベラス	1,400	709.00	992,600
パイロットコーポレーション	1,500	4,150.00	6,225,000
萩原工業	600	1,542.00	925,200
エイベックス	1,500	1,504.00	2,256,000
トッパン・フォームズ	1,600	1,029.00	1,646,400
フジシールインターナショナル	1,900	2,389.00	4,539,100
タカラトミー	4,000	1,059.00	4,236,000
広済堂ホールディングス	700	1,115.00	780,500
エステールホールディングス	300	651.00	195,300
レック	1,000	1,082.00	1,082,000
タカノ	300	734.00	220,200
三光合成	900	448.00	403,200
プロネクサス	700	1,049.00	734,300
ホクシン	600	167.00	100,200
ウッドワン	300	1,078.00	323,400
大建工業	700	2,230.00	1,561,000
きもと	1,400	239.00	334,600
凸版印刷	13,600	1,857.00	25,255,200
大日本印刷	10,600	2,763.00	29,287,800
共同印刷	300	2,671.00	801,300
N I S S H A	1,900	1,660.00	3,154,000
光村印刷	100	1,554.00	155,400
藤森工業	800	4,630.00	3,704,000
ヴィア・ホールディングス	1,100	191.00	210,100
TAKARA & COMPANY	500	1,773.00	886,500
前澤化成工業	600	1,248.00	748,800
未来工業	300	1,613.00	483,900
アシックス	8,000	2,481.00	19,848,000
ツ ツ ミ	200	2,200.00	440,000
ウェーブロックHLDGS	300	671.00	201,300
ジェイ エス ピー	600	1,597.00	958,200
ニチハ	1,200	3,120.00	3,744,000
ローランド	600	5,120.00	3,072,000
エフピコ	1,700	3,880.00	6,596,000
小松ウオール工業	300	1,892.00	567,600
ヤマハ	5,400	6,750.00	36,450,000
河合楽器	300	3,365.00	1,009,500
クリナップ	800	548.00	438,400
ピジヨン	5,500	2,667.00	14,668,500
天馬	700	2,746.00	1,922,200

兼松サステック	100	1,771.00	177,100
キングジム	700	877.00	613,900
象印マホービン	2,400	1,574.00	3,777,600
リンテック	1,900	2,471.00	4,694,900
信越ポリマー	1,400	990.00	1,386,000
東リ	2,200	236.00	519,200
イトーキ	1,700	376.00	639,200
任天堂	5,100	50,640.00	258,264,000
三菱鉛筆	1,500	1,394.00	2,091,000
松風	400	1,999.00	799,600
タカラスタンド	1,800	1,548.00	2,786,400
コクヨ	4,300	1,815.00	7,804,500
ナカバヤシ	900	571.00	513,900
ニフコ	3,300	3,450.00	11,385,000
立川ブラインド	400	1,263.00	505,200
グローブライド	1,000	3,805.00	3,805,000
オカムラ	3,100	1,559.00	4,832,900
バルカー	700	2,110.00	1,477,000
MUTOHホールディングス	100	1,577.00	157,700
伊藤忠	61,800	3,228.00	199,490,400
丸紅	87,000	925.70	80,535,900
スクロール	1,300	870.00	1,131,000
高島	200	1,835.00	367,000
ヨンドシーホールディングス	800	1,773.00	1,418,400
三陽商会	500	917.00	458,500
長瀬産業	4,800	1,867.00	8,961,600
ナイガイ	300	329.00	98,700
蝶理	600	1,831.00	1,098,600
豊田通商	8,900	4,600.00	40,940,000
オンワードホールディングス	5,300	313.00	1,658,900
三共生興	1,300	544.00	707,200
兼松	3,500	1,363.00	4,770,500
美津濃	900	2,594.00	2,334,600
ツカモトコーポレーション	200	1,389.00	277,800
ルックホールディングス	300	1,369.00	410,700
三井物産	68,600	2,490.00	170,814,000
日本紙パルプ	500	3,715.00	1,857,500
東京エレクトロン	5,300	47,380.00	251,114,000
カメイ	1,100	1,210.00	1,331,000
東都水産	100	5,270.00	527,000

OUGホールディングス	200	2,739.00	547,800
スターゼン	700	2,127.00	1,488,900
セイコーHD	1,300	2,251.00	2,926,300
山 善	3,400	1,057.00	3,593,800
椿本興業	200	3,695.00	739,000
住友商事	55,700	1,575.00	87,727,500
日本ユニシス	3,100	2,966.00	9,194,600
内田洋行	400	5,030.00	2,012,000
三菱商事	53,700	3,505.00	188,218,500
第一実業	400	4,985.00	1,994,000
キヤノンマーケティングJPN	2,200	2,477.00	5,449,400
西華産業	500	1,632.00	816,000
佐藤商事	700	1,213.00	849,100
菱洋エレクトロ	900	2,319.00	2,087,100
東京産業	800	690.00	552,000
ユアサ商事	900	3,005.00	2,704,500
神鋼商事	200	3,360.00	672,000
トルク	500	226.00	113,000
阪和興業	1,800	3,205.00	5,769,000
正栄食品	600	4,195.00	2,517,000
カナデン	700	1,004.00	702,800
菱電商事	600	1,718.00	1,030,800
ニプロ	6,700	1,145.00	7,671,500
岩谷産業	2,100	6,780.00	14,238,000
ナイス	400	1,661.00	664,400
ニチモウ	100	2,003.00	200,300
極東貿易	300	2,420.00	726,000
アステナホールディングス	1,200	634.00	760,800
兼松エレクトロニクス	500	3,735.00	1,867,500
三愛石油	2,200	1,429.00	3,143,800
稲畑産業	2,100	1,679.00	3,525,900
G S Iクレオス	500	1,020.00	510,000
明和産業	800	776.00	620,800
クワザワホールディングス	300	659.00	197,700
キムラタン	4,900	24.00	117,600
ゴ - ルドウィン	1,500	6,690.00	10,035,000
ユニ・チャ - ム	17,300	4,719.00	81,638,700
デザート	1,500	3,735.00	5,602,500
キ ン グ	500	536.00	268,000
ワ キ タ	1,800	1,061.00	1,909,800

ヤマトインタ - ナショナル	700	322.00	225,400
東邦ホールディングス	2,900	1,817.00	5,269,300
サンゲツ	2,400	1,540.00	3,696,000
ミツウロコグループ	1,300	1,392.00	1,809,600
シナネンホールディングス	400	3,510.00	1,404,000
伊藤忠エネクス	1,900	1,015.00	1,928,500
サンリオ	2,500	2,486.00	6,215,000
サンワ テクノス	600	1,416.00	849,600
リョーサン	1,000	2,177.00	2,177,000
新光商事	1,200	834.00	1,000,800
トーホー	400	1,606.00	642,400
三信電気	500	1,656.00	828,000
東陽テクニカ	800	1,113.00	890,400
モスフード サービス	1,200	3,195.00	3,834,000
加賀電子	800	2,841.00	2,272,800
三益半導体	600	2,278.00	1,366,800
都築電気	400	1,699.00	679,600
ソーダニツカ	800	625.00	500,000
立花エレテック	600	1,504.00	902,400
木曽路	1,100	2,231.00	2,454,100
S R S ホールディングス	1,200	767.00	920,400
千 趣 会	1,600	394.00	630,400
タカキユー	600	131.00	78,600
リテールパートナーズ	1,100	1,176.00	1,293,600
ケーヨー	1,700	792.00	1,346,400
上新電機	1,000	2,413.00	2,413,000
日本瓦斯	4,300	1,477.00	6,351,100
ロイヤルホールディングス	1,500	2,119.00	3,178,500
東 天 紅	100	1,137.00	113,700
いなげや	1,000	1,361.00	1,361,000
チヨダ	800	804.00	643,200
ライフコーポレーション	800	4,075.00	3,260,000
リンガーハット	1,100	2,354.00	2,589,400
Mr Max HD	1,200	649.00	778,800
テンアライド	800	312.00	249,600
A O K I ホールディングス	1,700	718.00	1,220,600
オークワ	1,400	1,153.00	1,614,200
コメリ	1,400	2,659.00	3,722,600
青山商事	1,900	831.00	1,578,900
しまむら	1,000	9,580.00	9,580,000

はせがわ	500	261.00	130,500
高島屋	6,500	1,211.00	7,871,500
松屋	1,900	1,028.00	1,953,200
エイチ・ツー・オーリテイリング	4,200	908.00	3,813,600
近鉄百貨店	400	2,591.00	1,036,400
丸井グループ	7,500	2,170.00	16,275,000
クレディセゾン	5,200	1,490.00	7,748,000
アクシアルリテイリング	700	3,730.00	2,611,000
井筒屋	500	310.00	155,000
イオン	33,900	2,661.50	90,224,850
イズミ	1,800	3,620.00	6,516,000
フォーバル	300	1,115.00	334,500
平和堂	1,700	2,027.00	3,445,900
フジ	1,100	2,073.00	2,280,300
ヤオコー	1,000	6,590.00	6,590,000
ゼビオホールディングス	1,100	1,065.00	1,171,500
ケーズホールディングス	7,500	1,203.00	9,022,500
PALTAC	1,400	5,110.00	7,154,000
三谷産業	1,200	369.00	442,800
OLYMPICグループ	500	768.00	384,000
日産東京販売HD	1,300	243.00	315,900
新生銀行	7,200	1,900.00	13,680,000
あおぞら銀行	5,300	2,712.00	14,373,600
三菱UFJフィナンシャルG	604,900	650.80	393,668,920
りそなホールディングス	98,600	452.20	44,586,920
三井住友トラストHD	16,700	3,839.00	64,111,300
三井住友フィナンシャルG	61,200	3,878.00	237,333,600
千葉銀行	29,500	743.00	21,918,500
群馬銀行	18,200	370.00	6,734,000
武蔵野銀行	1,300	1,830.00	2,379,000
千葉興業銀行	2,200	283.00	622,600
筑波銀行	3,700	180.00	666,000
七十七銀行	2,800	1,292.00	3,617,600
青森銀行	600	2,165.00	1,299,000
秋田銀行	600	1,466.00	879,600
山形銀行	1,000	847.00	847,000
岩手銀行	600	1,688.00	1,012,800
東邦銀行	7,900	215.00	1,698,500
東北銀行	500	1,013.00	506,500
みちのく銀行	600	886.00	531,600

ふくおかフィナンシャルG	8,000	2,138.00	17,104,000
静岡銀行	21,600	940.00	20,304,000
スルガ銀行	7,800	433.00	3,377,400
八十二銀行	19,900	404.00	8,039,600
山梨中央銀行	1,000	860.00	860,000
大垣共立銀行	1,800	1,990.00	3,582,000
福井銀行	700	1,481.00	1,036,700
清水銀行	400	1,643.00	657,200
富山銀行	200	2,130.00	426,000
滋賀銀行	1,800	1,947.00	3,504,600
南都銀行	1,300	2,030.00	2,639,000
百五銀行	8,000	334.00	2,672,000
京都銀行	3,100	5,240.00	16,244,000
紀陽銀行	3,100	1,574.00	4,879,400
ほくほくフィナンシャルG	5,900	865.00	5,103,500
山陰合同銀行	5,500	574.00	3,157,000
中国銀行	7,600	874.00	6,642,400
鳥取銀行	300	1,110.00	333,000
伊予銀行	11,800	583.00	6,879,400
百十四銀行	900	1,547.00	1,392,300
四国銀行	1,300	750.00	975,000
阿波銀行	1,400	2,172.00	3,040,800
大分銀行	500	1,902.00	951,000
宮崎銀行	600	2,125.00	1,275,000
佐賀銀行	500	1,483.00	741,500
琉球銀行	1,900	782.00	1,485,800
セブン銀行	29,500	251.00	7,404,500
みずほフィナンシャルG	120,200	1,569.50	188,653,900
高知銀行	300	803.00	240,900
山口フィナンシャルG	11,000	669.00	7,359,000
芙蓉総合リース	900	7,660.00	6,894,000
みずほリース	1,400	3,550.00	4,970,000
東京センチュリー	2,000	6,190.00	12,380,000
SBIホールディングス	10,900	2,721.00	29,658,900
日本証券金融	3,700	855.00	3,163,500
アイフル	14,800	403.00	5,964,400
日本アジア投資	700	236.00	165,200
長野銀行	300	1,130.00	339,000
名古屋銀行	700	2,657.00	1,859,900
北洋銀行	13,300	252.00	3,351,600

愛知銀行	300	3,695.00	1,108,500
中京銀行	300	1,425.00	427,500
大光銀行	300	1,407.00	422,100
愛媛銀行	1,200	795.00	954,000
トマト銀行	400	1,055.00	422,000
京葉銀行	3,800	444.00	1,687,200
栃木銀行	4,300	181.00	778,300
北日本銀行	300	1,585.00	475,500
東和銀行	1,600	541.00	865,600
福島銀行	1,000	259.00	259,000
大東銀行	500	702.00	351,000
リコーリース	700	3,740.00	2,618,000
イオンフィナンシャルサービス	5,500	1,547.00	8,508,500
アコム	17,500	414.00	7,245,000
ジャックス	1,000	3,015.00	3,015,000
オリコ	24,000	171.00	4,104,000
オリックス	53,600	2,115.50	113,390,800
三菱HCキャピタル	30,600	587.00	17,962,200
ジャフコグループ	1,100	7,240.00	7,964,000
九州リースサービス	500	608.00	304,000
トモニホールディングス	6,800	328.00	2,230,400
大和証券G本社	66,800	658.60	43,994,480
野村ホールディングス	135,100	545.30	73,670,030
岡三証券グループ	7,500	396.00	2,970,000
丸三証券	2,600	626.00	1,627,600
東洋証券	3,000	167.00	501,000
東海東京HD	9,400	405.00	3,807,000
光世証券	200	590.00	118,000
水戸証券	2,400	300.00	720,000
いちよし証券	1,800	672.00	1,209,600
松井証券	4,300	816.00	3,508,800
SOMPOホールディングス	15,600	4,956.00	77,313,600
日本取引所グループ	23,900	2,774.00	66,298,600
マネックスG	8,000	626.00	5,008,000
極東証券	1,200	804.00	964,800
岩井コスモホールディング	900	1,396.00	1,256,400
アイザワ証券グループ	1,600	1,024.00	1,638,400
フィデアホール	860	1,219.00	1,048,340
池田泉州HD	10,200	169.00	1,723,800
アニコムホールディングス	2,500	904.00	2,260,000

M S & A D	21,500	3,740.00	80,410,000
マネーパートナーズG P	900	214.00	192,600
スパークス・グループ	4,100	278.00	1,139,800
小林洋行	300	265.00	79,500
第一生命H L D G S	43,500	2,491.50	108,380,250
東京海上H D	29,100	6,043.00	175,851,300
アドバンテッジリスクマネ	500	1,040.00	520,000
イー・ギャランティ	1,000	2,373.00	2,373,000
アサックス	500	703.00	351,500
N E C キャピタルソリューション	400	2,085.00	834,000
T & D ホールディングス	26,500	1,547.00	40,995,500
アドバンスクリエイト	500	1,080.00	540,000
三井不動産	40,300	2,532.00	102,039,600
三菱地所	58,100	1,715.00	99,641,500
平和不動産	1,500	3,570.00	5,355,000
東京建物	8,700	1,652.00	14,372,400
ダイビル	2,200	1,533.00	3,372,600
京阪神ビルディング	1,500	1,380.00	2,070,000
住友不動産	19,900	4,013.00	79,858,700
太平洋興発	400	681.00	272,400
テーオーシー	1,600	646.00	1,033,600
東京楽天地	200	4,025.00	805,000
レオパレス2 1	7,300	238.00	1,737,400
スターツコーポレーション	1,000	2,649.00	2,649,000
フジ住宅	1,000	683.00	683,000
空港施設	900	565.00	508,500
明和地所	400	610.00	244,000
ゴールドクレスト	800	1,645.00	1,316,000
リログループ	4,700	2,297.00	10,795,900
エスリード	400	1,637.00	654,800
日神グループH L D G S	1,300	512.00	665,600
日本エスコン	1,700	793.00	1,348,100
タカラレーベン	3,700	319.00	1,180,300
A V A N T I A	500	866.00	433,000
イオンモール	4,400	1,648.00	7,251,200
毎日コムネット	300	774.00	232,200
ファースト住建	400	1,297.00	518,800
ランド	48,100	12.00	577,200
カチタス	2,200	3,880.00	8,536,000
東祥	600	1,866.00	1,119,600

トーセイ	1,200	1,157.00	1,388,400
穴吹興産	200	2,043.00	408,600
サンフロンティア不動産	1,100	1,081.00	1,189,100
FJネクストホールディングス	800	1,020.00	816,000
インテリックス	200	759.00	151,800
ランドビジネス	400	268.00	107,200
サンネクスタグループ	300	998.00	299,400
グランディハウス	600	489.00	293,400
東武鉄道	9,300	2,866.00	26,653,800
相鉄ホールディングス	3,100	2,154.00	6,677,400
東急	22,600	1,603.00	36,227,800
京浜急行	11,500	1,301.00	14,961,500
小田急電鉄	14,300	2,429.00	34,734,700
京王電鉄	5,000	5,560.00	27,800,000
京成電鉄	6,800	3,530.00	24,004,000
富士急行	1,200	4,590.00	5,508,000
新京成電鉄	200	2,065.00	413,000
東日本旅客鉄道	15,800	7,308.00	115,466,400
西日本旅客鉄道	10,000	5,412.00	54,120,000
東海旅客鉄道	7,500	16,980.00	127,350,000
西武ホールディングス	10,800	1,341.00	14,482,800
鴻池運輸	1,400	1,217.00	1,703,800
西日本鉄道	2,500	2,723.00	6,807,500
ハマキョウレックス	600	3,200.00	1,920,000
サカイ引越センター	400	4,690.00	1,876,000
近鉄グループHLDGS	8,500	3,650.00	31,025,000
阪急阪神HLDGS	11,300	3,400.00	38,420,000
南海電鉄	4,100	2,288.00	9,380,800
京阪ホールディングス	3,800	3,010.00	11,438,000
神戸電鉄	200	3,380.00	676,000
名古屋鉄道	6,900	1,977.00	13,641,300
山陽電鉄	700	1,973.00	1,381,100
アルプス物流	600	1,045.00	627,000
トランコム	300	8,240.00	2,472,000
日本通運	3,000	7,500.00	22,500,000
ヤマトホールディングス	11,900	2,718.00	32,344,200
山 九	2,200	5,080.00	11,176,000
日 新	600	1,585.00	951,000
丸 運	500	267.00	133,500
丸全昭和運輸	600	3,305.00	1,983,000

センコーグループHLDGS	4,700	1,005.00	4,723,500
トナミホールディングス	200	4,650.00	930,000
ニッコンホールディングス	2,900	2,221.00	6,440,900
日石輸送	100	2,678.00	267,800
福山通運	1,100	4,745.00	5,219,500
セイノーホールディングス	6,400	1,354.00	8,665,600
エスライン	300	919.00	275,700
神奈川中央交通	200	3,450.00	690,000
日立物流	1,800	4,625.00	8,325,000
丸和運輸機関	1,800	1,555.00	2,799,000
C&Fロジホールディングス	800	1,636.00	1,308,800
日本郵船	7,100	7,390.00	52,469,000
商船三井	5,000	6,690.00	33,450,000
川崎汽船	2,600	5,170.00	13,442,000
NSユナイテッド海運	400	3,680.00	1,472,000
明治海運	900	729.00	656,100
飯野海運	4,000	528.00	2,112,000
共栄タンカー	200	1,027.00	205,400
九州旅客鉄道	6,600	2,606.00	17,199,600
SGホールディングス	16,000	2,889.00	46,224,000
日本航空	20,700	2,517.00	52,101,900
ANAホールディングス	22,900	2,719.00	62,265,100
パスコ	200	1,540.00	308,000
TREホールディングス	1,116	1,420.00	1,584,720
人・夢・技術グループ	400	2,040.00	816,000
西本WISMETTAC HD	200	3,735.00	747,000
シルバーライフ	200	1,543.00	308,600
ヤマシタヘルスケアHLDGS	100	2,109.00	210,900
GENKY DRUGSTORES	400	5,170.00	2,068,000
コア商事HLDGS	700	711.00	497,700
国際紙パルプ商事	1,800	372.00	669,600
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,059.00	211,800
ブックオフGHD	600	972.00	583,200
ギフト	100	2,960.00	296,000
三菱倉庫	3,000	3,175.00	9,525,000
三井倉庫HOLD	900	2,341.00	2,106,900
住友倉庫	3,000	1,799.00	5,397,000
渋沢倉庫	500	2,144.00	1,072,000
ヤマタネ	400	1,575.00	630,000
東陽倉庫	1,400	328.00	459,200

乾汽船	600	2,265.00	1,359,000
日本トランスシティ	1,800	587.00	1,056,600
ケイヒン	200	1,440.00	288,000
中央倉庫	600	980.00	588,000
川西倉庫	200	1,143.00	228,600
安田倉庫	700	976.00	683,200
ファイズホールディングス	200	714.00	142,800
東洋埠頭	300	1,450.00	435,000
宇徳	700	524.00	366,800
上組	4,600	2,295.00	10,557,000
サンリツ	200	823.00	164,600
キムラユニティー	200	1,425.00	285,000
キューソー流通システム	200	1,808.00	361,600
近鉄エクスプレス	1,600	2,703.00	4,324,800
東海運	500	335.00	167,500
エーアイティー	600	1,167.00	700,200
内外トランスライン	400	2,116.00	846,400
ショーエイコーポ	200	812.00	162,400
日本コンセプト	300	1,793.00	537,900
TBSホールディングス	5,800	1,776.00	10,300,800
日本テレビHLD S	7,300	1,286.00	9,387,800
朝日放送グループHD	800	718.00	574,400
テレビ朝日HD	2,700	1,825.00	4,927,500
スカパーJ S A T H D	5,800	440.00	2,552,000
テレビ東京HD	600	2,202.00	1,321,200
日本BS放送	300	1,115.00	334,500
ビジョン	1,500	1,528.00	2,292,000
スマートバリュー	200	648.00	129,600
USEN-NEXT HLDGS	800	3,245.00	2,596,000
ワイヤレスゲート	400	392.00	156,800
コネクシオ	500	1,547.00	773,500
日本通信	7,800	209.00	1,630,200
クロップス	200	972.00	194,400
日本電信電話	102,900	3,121.00	321,150,900
KDDI	70,600	3,670.00	259,102,000
ソフトバンク	79,900	1,517.50	121,248,250
光通信	1,000	18,060.00	18,060,000
エムティーアイ	800	736.00	588,800
GMOインターネット	3,100	2,831.00	8,776,100
ファイバーゲート	300	1,478.00	443,400

アイドママーケティングコミュ	200	372.00	74,400
KADOKAWA	2,300	6,320.00	14,536,000
学研ホールディングス	1,200	1,138.00	1,365,600
ゼンリン	1,600	1,048.00	1,676,800
昭文社ホールディングス	400	496.00	198,400
インプレスホールディングス	700	275.00	192,500
東京電力HD	76,000	360.00	27,360,000
中部電力	27,500	1,322.00	36,355,000
関西電力	33,900	1,105.00	37,459,500
中国電力	13,000	1,013.00	13,169,000
北陸電力	8,200	604.00	4,952,800
東北電力	21,000	820.00	17,220,000
四国電力	7,500	781.00	5,857,500
九州電力	19,800	850.00	16,830,000
北海道電力	8,400	537.00	4,510,800
沖縄電力	1,800	1,438.00	2,588,400
電源開発	7,100	1,630.00	11,573,000
エフオン	600	867.00	520,200
イーレックス	1,300	2,569.00	3,339,700
レノバ	1,500	4,520.00	6,780,000
東京瓦斯	17,200	2,029.50	34,907,400
大阪瓦斯	16,300	2,009.00	32,746,700
東邦瓦斯	4,400	4,385.00	19,294,000
北海道瓦斯	500	1,517.00	758,500
広島ガス	1,900	366.00	695,400
西部ガスHLDGS	1,000	2,338.00	2,338,000
静岡ガス	2,300	1,315.00	3,024,500
メタウォーター	1,000	1,821.00	1,821,000
アイネット	500	1,269.00	634,500
松竹	600	12,340.00	7,404,000
東宝	5,200	5,200.00	27,040,000
エイチ・アイ・エス	1,900	2,622.00	4,981,800
東映	300	21,780.00	6,534,000
ラックランド	300	2,829.00	848,700
NTTデータ	23,400	2,093.00	48,976,200
共立メンテナンス	1,400	4,230.00	5,922,000
イチネンホールディングス	900	1,282.00	1,153,800
建設技術研究所	600	2,585.00	1,551,000
スペース	700	937.00	655,900
アインホールディングス	1,300	6,490.00	8,437,000

燦ホールディングス	400	1,467.00	586,800
ピー・シー・エー	300	1,821.00	546,300
スバル興業	100	8,070.00	807,000
東京テアトル	400	1,240.00	496,000
タナベ経営	400	750.00	300,000
ビジネスB太田昭和	300	1,780.00	534,000
ナガワ	300	12,130.00	3,639,000
東京都競馬	700	4,315.00	3,020,500
常磐興産	400	1,426.00	570,400
カナモト	1,500	2,568.00	3,852,000
D T S	1,900	2,492.00	4,734,800
スクウェア・エニックス・HD	3,800	5,910.00	22,458,000
シーイーシー	900	1,291.00	1,161,900
カプコン	7,600	2,936.00	22,313,600
西尾レントオール	800	2,811.00	2,248,800
アイ・エス・ビー	400	1,218.00	487,200
アゴーラ ホスピタリティーG	4,700	25.00	117,500
日本空港ビルデング	3,100	5,460.00	16,926,000
トランス・コスモス	800	3,520.00	2,816,000
乃村工藝社	3,700	1,010.00	3,737,000
ジャステック	600	1,256.00	753,600
S C S K	6,000	2,279.00	13,674,000
藤田観光	400	2,515.00	1,006,000
K N T - C Tホールディングス	500	1,719.00	859,500
日本管財	900	2,651.00	2,385,900
トーカイ	800	2,175.00	1,740,000
白洋舎	100	2,050.00	205,000
セコム	8,400	8,038.00	67,519,200
日本システムウエア	300	2,364.00	709,200
セントラル警備保障	400	2,798.00	1,119,200
アイネス	800	1,539.00	1,231,200
丹青社	1,600	920.00	1,472,000
メイテック	1,000	6,200.00	6,200,000
T K C	1,500	3,315.00	4,972,500
富士ソフト	900	5,570.00	5,013,000
応用地質	900	1,515.00	1,363,500
船井総研ホールディン	1,800	2,877.00	5,178,600
N S D	2,900	1,938.00	5,620,200
進学会ホールディングス	400	409.00	163,600
丸紅建材リース	100	1,807.00	180,700

オオバ	600	828.00	496,800
コナミホールディングス	3,200	6,220.00	19,904,000
いであ	200	1,992.00	398,400
学究社	300	1,397.00	419,100
ベネッセホールディングス	3,100	2,562.00	7,942,200
イオンディライト	1,000	3,490.00	3,490,000
ナック	400	967.00	386,800
福井コンピュータHLD S	400	4,170.00	1,668,000
ダイセキ	1,800	5,000.00	9,000,000
ステップ	300	1,933.00	579,900
日鉄物産	700	4,870.00	3,409,000
泉州電業	300	4,495.00	1,348,500
元気寿司	300	2,798.00	839,400
トラスコ中山	1,900	2,744.00	5,213,600
ヤマダホールディングス	29,600	473.00	14,000,800
オートバックスセブン	3,200	1,537.00	4,918,400
モリト	600	671.00	402,600
アークランドサカモト	1,400	1,759.00	2,462,600
ニトリホールディングス	3,500	20,870.00	73,045,000
グルメ杵屋	700	984.00	688,800
愛眼	700	219.00	153,300
ケーユーホールディングス	500	1,073.00	536,500
吉野家ホールディングス	2,900	2,146.00	6,223,400
加藤産業	1,300	3,255.00	4,231,500
北恵	200	1,029.00	205,800
イノテック	500	1,335.00	667,500
イエローハット	1,700	1,907.00	3,241,900
松屋フーズHLDGS	500	3,680.00	1,840,000
JBC Cホールディングス	600	1,565.00	939,000
J Kホールディングス	800	810.00	648,000
サガミホールディングス	1,300	1,011.00	1,314,300
日伝	700	2,281.00	1,596,700
関西スーパーマーケット	600	1,907.00	1,144,200
ミロク情報サービス	800	1,673.00	1,338,400
北沢産業	600	251.00	150,600
杉本商事	500	2,507.00	1,253,500
因幡電機産業	2,300	2,648.00	6,090,400
王将フードサービス	600	5,980.00	3,588,000
ブレナス	1,000	2,111.00	2,111,000
ミニストップ	600	1,405.00	843,000

アークス	1,700	2,240.00	3,808,000	
パローホールディングス	1,800	2,391.00	4,303,800	
東 テ ク	300	2,564.00	769,200	
ミスミグループ本社	11,100	4,455.00	49,450,500	
藤 久	200	773.00	154,600	
アルテック	600	316.00	189,600	
ベ ル ク	500	5,740.00	2,870,000	
大 庄	500	1,044.00	522,000	
タキヒヨー	300	1,773.00	531,900	
ファーストリテイリング	1,200	72,480.00	86,976,000	
ソフトバンクグループ	69,800	6,118.00	427,036,400	
蔵王産業	200	1,736.00	347,200	
スズケン	3,700	3,250.00	12,025,000	
サンドラッグ	3,300	3,515.00	11,599,500	
サックスパーホールディング	700	561.00	392,700	
ジェコス	700	882.00	617,400	
ヤマザワ	200	1,719.00	343,800	
や ま や	200	2,415.00	483,000	
グローセル	900	406.00	365,400	
ベルーナ	1,800	824.00	1,483,200	
合計			24,150,985,087	

(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	キーエンス	500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10月29日

資産総額	25,684,087,117円
負債総額	741,065,993円
純資産総額（ - ）	24,943,021,124円
発行済数量	12,455,128口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2,002.6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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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、上記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。

上記の振替について、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、交換有価証券の交付等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2021年10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10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	57	164,997
追加型株式投資信託	765	21,786,221
株式投資信託 合計	822	21,951,218
単位型公社債投資信託	76	209,609
追加型公社債投資信託	14	1,481,079
公社債投資信託 合計	90	1,690,688
総合計	912	23,641,906

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)
資産の部		
流動資産		
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
流動資産計	36,088	37,539
固定資産		
有形固定資産	1	224
建物	7	6
器具備品	209	218
無形固定資産	2,362	1,937
ソフトウェア	2,028	1,882
ソフトウェア仮勘定	333	54
投資その他の資産	15,844	16,121
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)
負債の部		
流動負債		
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	2
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	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						
剰余金の配当	-	-	-	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			
剰余金の配当	-	-	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よう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 (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)
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 (2020年3月31日)	当事業年度 (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	㈱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㈱	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	㈱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㈱	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。

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】

	名 称	資本金の額 (2021年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カスト ディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	エービーエヌ・アム ロ・クリアリング証券 株式会社	5,505百万円	(注1)	
	ゴールドマン・サック ス証券株式会社	83,616百万円	(注1)	
	シティグループ証券株 式会社	96,307百万円	(注1)	
	野村證券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	B N P パリバ証券株式 会社	102,025百万円	(注1)	
	みずほ証券株式会社	125,167百万円	(注1)	
	三菱UFJモルガン・ スタンレー証券株式会 社	40,500百万円	(注1)	
	BofA証券株式会社	83,140百万円	(注1)	

(注1) 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。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 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。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

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。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部(信託財産の管理等)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。

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)
2021年4月26日	臨時報告書
2021年7月2日	有価証券報告書、有価証券届出書の訂正届出書
2021年7月27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11月12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2021年4月11日から2021年10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10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。