

【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】	2022年4月1日提出
【計算期間】	第17計算期間 (自 2021年7月11日 至 2022年1月10日)
【ファンド名】	ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 小松 幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	名 称 株式会社東京証券取引所 所在地 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「TOPIX Ex-Financials」（以下「対象株価指数」という場合があります。）の変動率に一致させることを目的とします。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド

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

(注2) 属性区分の定義

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

投資対象地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東(中東)	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行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、2兆円に相当する株券および金銭を限度として追加信託することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、上記の限度を変更することができます。

< ファンドの特色 >

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

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

「TOPIX Ex-Financials」について

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

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

(注2) 基準時の時価総額の修正方法：

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

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

2 当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

●受益権は、東京証券取引所に上場され、株式と同様に売買することができます。

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

●追加設定は、株式により行ないます。

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

●受益権を株式と交換することができます。

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

●収益分配金は、名義登録受益者に対して支払われます。

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

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●基準価額の動きに関する留意点

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

- (a) 同指数が加重平均であるため、個別銘柄の組入比率を同指数構成銘柄の時価総額構成比率と全くの同一の比率とすることができないこと
- (b) 運用管理費用（信託報酬）、売買委託手数料等の費用負担
- (c) 株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- (d) 指数の算出に使用する株価と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- (e) 株価指数先物取引と指数の動きの不一致（株価指数先物取引を利用した場合）
- (f) 指数の構成銘柄の入替えおよび指数の算出方法の変更による影響
- (g) 追加設定時、および組入銘柄の配当金や権利処理等によって信託財産に現金が発生すること

(2)【ファンドの沿革】

2013年9月19日 信託契約締結、当初設定、運用開始
2013年9月20日 受益権を東京証券取引所に上場

(3)【ファンドの仕組み】

	名 称	関係業務の内容
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 1 ）の委託者であり、受益権の募集・発行、信託財産の運用指図、受益権とその信託財産に属する株式との交換の指図、信託財産の計算等を行いません。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）	信託契約（ 1 ）の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。
取扱窓口	販売会社	受益権の募集、交換の取扱い等に関する委託会社および受託会社との三者間契約（ 2 ）に基づき、受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務等を行いません。

1：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

2：受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務の内容等が規定されています。

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

< 委託会社の概況（2022年1月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

委託会社は、信託財産の運用にあたっては、次の基本方針にしたがって、その指図を行ないます。

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

対象株価指数を構成する銘柄のうち、時価総額構成比率95%以上を占める各銘柄の株式を組入れることを原則とします。

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

市況動向、資産規模等によっては、上記の運用が行なえないことがあります。

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

(2)【投資対象】

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

委託会社は、信託財産を、主として株式に投資することを指図します。

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

1. 預金

2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3. コール・ローン

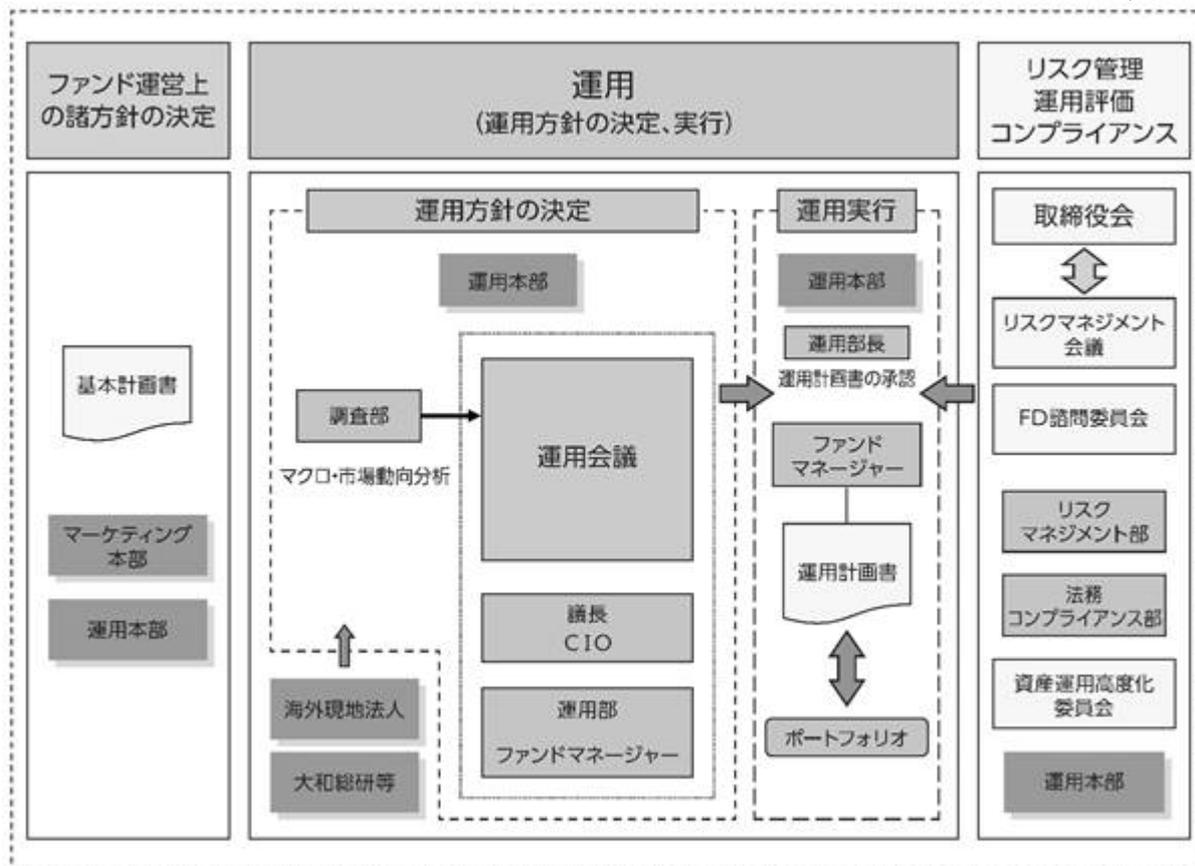
4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3)【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品担当役員の決裁により決定します。

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO (Chief Investment Officer) (3名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．Deputy-CIO (0～5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー (0～5名程度)

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体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2022年1月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

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

(5)【投資制限】

株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資する株式の範囲（信託約款）

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

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

先物取引等（信託約款）

委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口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.の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への投資は、行ないません。

信用リスク集中回避(信託約款)

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

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

その他

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

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

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

(2)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」をご参照ください。

(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。

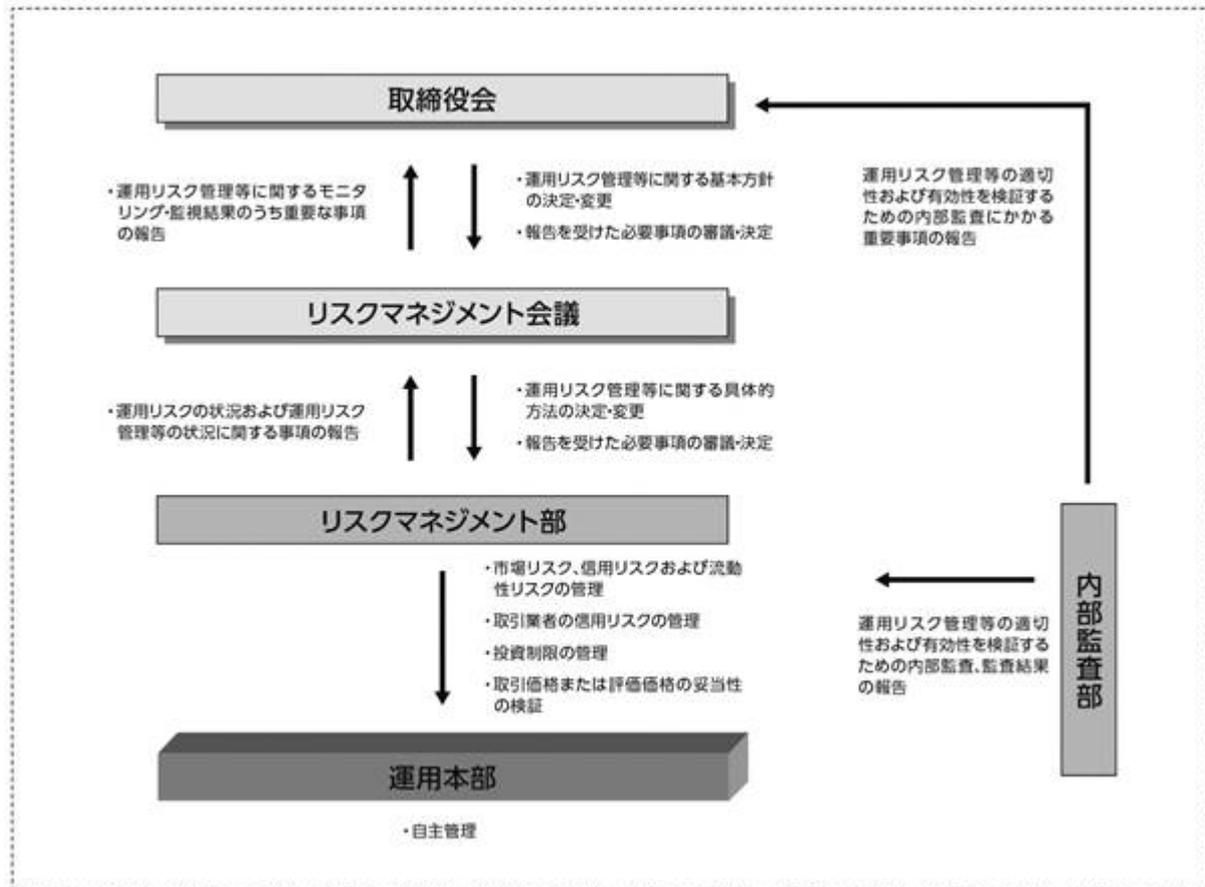
流動性リスクに関する事項

- ・ 当ファンドは、大量の解約が発生し短時間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制()は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

- ・ 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・検証などを行いません。
- ・ 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。

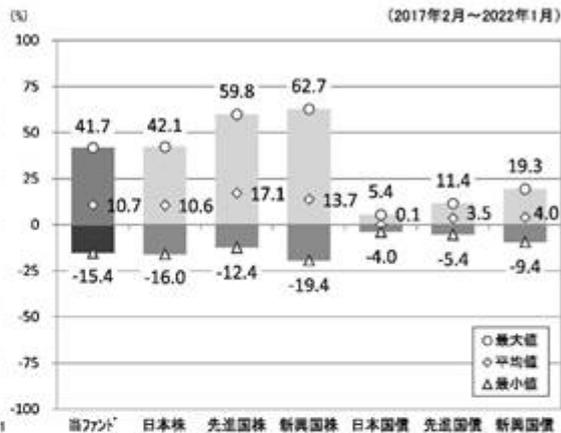
参考情報

- 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、野村証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証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社は、当該販売会社が定める申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税および地方消費税（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0.198%(税抜0.18%)以内を乗じて得た額

委託会社 年率0.13%(税抜)以内

受託会社 年率0.05%(税抜)以内

*上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

イ. 年率0.198%(税抜0.18%)

ロ. 55%(税抜50%)

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

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

イ. 前 イ.の報酬

委託会社 年率0.13%(税抜)

受託会社 年率0.05%(税抜)

*上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

ロ．前ロの報酬

委託会社 報酬の50%

受託会社 報酬の50%

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は特定株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

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

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

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

ロ．収益分配金の受取時

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

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

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

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

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

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

法人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

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

ロ．収益分配金の受取時

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

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

() 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

() 上記は、2022年1月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】（2022年1月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	32,622,900,530	99.70
内 日本	32,622,900,530	99.70
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	96,615,295	0.30
純資産総額	32,719,515,825	100.00

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

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

(2)【投資資産】（2022年1月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
					また は 額面金額			
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	709,700	2,307.50 1,637,632,750	2,245.50 1,593,631,350	4.87
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機 器	87,600	14,540.00 1,273,704,000	12,720.00 1,114,272,000	3.41
3	キーエンス	日本	株式	電気機 器	12,700	67,850.00 861,695,000	58,230.00 739,521,000	2.26
4	リクルートホールディングス	日本	株式	サービ ス業	103,200	6,380.00 658,416,000	5,595.00 577,404,000	1.76
5	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	8,900	64,920.00 577,788,000	54,730.00 487,097,000	1.49
6	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	143,800	3,295.00 473,821,000	3,267.00 469,794,600	1.44
7	信越化学	日本	株式	化学	23,500	19,835.00 466,122,500	19,040.00 447,440,000	1.37
8	任天堂	日本	株式	その他 製品	7,900	53,800.00 425,020,000	56,160.00 443,664,000	1.36
9	ダイキン工業	日本	株式	機械	17,700	25,805.00 456,748,500	23,825.00 421,702,500	1.29

10	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	82,400	5,489.00 452,293,600	5,011.00 412,906,400	1.26
11	HOYA	日本	株式	精密機器	27,400	16,180.00 443,332,000	14,755.00 404,287,000	1.24
12	三菱商事	日本	株式	卸売業	103,300	3,771.00 389,544,300	3,877.00 400,494,100	1.22
13	日立	日本	株式	電気機器	67,200	6,707.00 450,710,400	5,939.00 399,100,800	1.22
14	本田技研	日本	株式	輸送用機器	110,200	3,430.00 377,986,000	3,354.00 369,610,800	1.13
15	日本電産	日本	株式	電気機器	36,300	12,915.00 468,814,500	10,090.00 366,267,000	1.12
16	武田薬品	日本	株式	医薬品	110,000	3,196.00 351,560,000	3,328.00 366,080,000	1.12
17	KDDI	日本	株式	情報・通信業	100,100	3,524.00 352,752,400	3,645.00 364,864,500	1.12
18	伊藤忠	日本	株式	卸売業	96,400	3,564.00 343,569,600	3,667.00 353,498,800	1.08
19	村田製作所	日本	株式	電気機器	41,100	9,185.00 377,503,500	8,539.00 350,952,900	1.07
20	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	15,800	17,830.00 281,714,000	19,880.00 314,104,000	0.96
21	三井物産	日本	株式	卸売業	107,200	2,785.50 298,605,600	2,853.50 305,895,200	0.93
22	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	53,900	5,117.00 275,806,300	5,593.00 301,462,700	0.92
23	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	208,100	1,455.50 302,889,550	1,434.00 298,415,400	0.91
24	第一三共	日本	株式	医薬品	110,000	2,713.00 298,430,000	2,565.00 282,150,000	0.86
25	ファナック	日本	株式	電気機器	12,300	24,775.00 304,732,500	22,460.00 276,258,000	0.84
26	デンソー	日本	株式	輸送用機器	30,900	10,060.00 310,854,000	8,494.00 262,464,600	0.80
27	SMC	日本	株式	機械	4,100	75,580.00 309,878,000	63,390.00 259,899,000	0.79
28	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	121,400	1,854.50 225,136,300	1,850.50 224,650,700	0.69
29	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	40,200	5,082.00 204,296,400	5,013.00 201,522,600	0.62

30	三菱電機	日本	株式	電気機器	139,900	1,504.00 210,409,600	1,431.50 200,266,850	0.61
----	------	----	----	------	---------	-------------------------	-------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.70%
合計	99.70%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.10%
鉱業	0.31%
建設業	2.56%
食料品	3.76%
繊維製品	0.53%
パルプ・紙	0.26%
化学	7.47%
医薬品	5.31%
石油・石炭製品	0.48%
ゴム製品	0.79%
ガラス・土石製品	0.88%
鉄鋼	0.85%
非鉄金属	0.85%
金属製品	0.69%
機械	5.96%
電気機器	20.26%
輸送用機器	9.67%
精密機器	2.99%
その他製品	2.55%
電気・ガス業	1.25%
陸運業	3.32%
海運業	0.60%
空運業	0.45%
倉庫・運輸関連業	0.21%
情報・通信業	8.70%
卸売業	6.17%
小売業	4.66%

不動産業	2.14%
サービス業	5.94%
合計	99.70%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)	東京証券取 引所 市場相場
第1計算期間末 (2014年1月10日)	10,797,378,820	10,826,385,258	1,079.50	1,082.40	1,076
第2計算期間末 (2014年7月10日)	19,073,883,378	19,262,113,959	1,063.99	1,074.49	-
第3計算期間末 (2015年1月10日)	20,915,809,343	21,178,755,740	1,169.30	1,184.00	-
第4計算期間末 (2015年7月10日)	18,371,096,566	18,567,799,518	1,316.87	1,330.97	-
第5計算期間末 (2016年1月10日)	26,593,586,491	26,787,806,652	1,218.63	1,227.53	-
第6計算期間末 (2016年7月10日)	24,114,848,389	24,354,077,806	1,058.42	1,068.92	-
第7計算期間末 (2017年1月10日)	1,799,193,082	2,030,245,950	1,166.48	1,316.28	1,170
第8計算期間末 (2017年7月10日)	6,694,133,889	6,719,583,933	1,236.24	1,240.94	1,223
第9計算期間末 (2018年1月10日)	2,208,423,496	2,260,743,264	1,430.92	1,464.82	1,424
第10計算期間末 (2018年7月10日)	25,265,291,318	25,328,399,349	1,321.15	1,324.45	-
第11計算期間末 (2019年1月10日)	23,477,218,115	23,778,617,285	1,168.41	1,183.41	1,163

第12計算期間末 (2019年7月10日)	26,825,499,875	27,109,809,141	1,217.16	1,230.06	-
第13計算期間末 (2020年1月10日)	29,524,020,451	29,866,335,853	1,345.47	1,361.07	-
第14計算期間末 (2020年7月10日)	10,859,497,760	10,960,856,556	1,210.67	1,221.97	1,207
第15計算期間末 (2021年1月10日)	8,840,790,593	8,909,614,251	1,464.39	1,475.79	1,453
2021年1月末日	5,847,061,692	-	1,431.74	-	-
2月末日	5,989,406,674	-	1,466.59	-	-
3月末日	6,316,781,733	-	1,546.75	-	-
4月末日	6,144,468,824	-	1,504.56	-	1,487
5月末日	7,697,882,099	-	1,521.03	-	1,505
6月末日	7,824,649,900	-	1,546.07	-	-
第16計算期間末 (2021年7月10日)	7,646,252,549	7,703,441,611	1,510.82	1,522.12	1,500
7月末日	6,127,822,360	-	1,500.25	-	-
8月末日	6,319,484,003	-	1,547.17	-	-
9月末日	3,436,914,908	-	1,611.49	-	-
10月末日	34,981,526,729	-	1,591.00	-	-
11月末日	33,732,001,202	-	1,534.17	-	-
12月末日	34,824,532,981	-	1,583.86	-	-
第17計算期間末 (2022年1月10日)	34,609,829,681	34,673,592,213	1,574.10	1,577.00	-
2022年1月末日	32,719,515,825	-	1,488.12	-	1,475

(注) 計算期間末日が休業日の場合は、前営業日の市場相場を記載しております。

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	2.90
第2計算期間	10.50
第3計算期間	14.70
第4計算期間	14.10
第5計算期間	8.90
第6計算期間	10.50
第7計算期間	149.80
第8計算期間	4.70
第9計算期間	33.90
第10計算期間	3.30

第11計算期間	15.00
第12計算期間	12.90
第13計算期間	15.60
第14計算期間	11.30
第15計算期間	11.40
第16計算期間	11.30
第17計算期間	2.90

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	9.4
第2計算期間	0.5
第3計算期間	11.3
第4計算期間	13.8
第5計算期間	6.8
第6計算期間	12.3
第7計算期間	24.4
第8計算期間	6.4
第9計算期間	18.5
第10計算期間	7.4
第11計算期間	10.4
第12計算期間	5.3
第13計算期間	11.8
第14計算期間	9.2
第15計算期間	21.9
第16計算期間	3.9
第17計算期間	4.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	10,002,220	0
第2計算期間	19,767,470	11,842,968
第3計算期間	14,884,100	14,923,312
第4計算期間	984,420	4,921,366
第5計算期間	8,858,210	986,284
第6計算期間	3,883,840	2,922,576
第7計算期間	0	21,241,345
第8計算期間	5,813,620	1,941,126

第9計算期間	967,650	4,839,197
第10計算期間	17,580,290	0
第11計算期間	7,860,980	6,891,348
第12計算期間	1,946,200	0
第13計算期間	6,815,690	6,911,873
第14計算期間	1,949,140	14,922,630
第15計算期間	1,950,560	4,883,202
第16計算期間	977,080	1,953,264
第17計算期間	19,854,320	2,928,219

(注) 当初設定数量は5,054,850口です。

(参考情報) 運用実績

●ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials

2022年1月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	148,812円
純資産総額	327億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-5.9%
3カ月間	-6.3%
6カ月間	-0.6%
1年間	4.9%
3年間	29.7%
5年間	41.8%
設定来	96.0%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(100口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 1,420円 設定来分配金合計額: 33,370円

決算期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期
	16年7月	17年1月	17年7月	18年1月	18年7月	19年1月	19年7月	20年1月	20年7月	21年1月	21年7月	22年1月
分配金	1,050円	14,980円	470円	3,390円	330円	1,500円	1,290円	1,560円	1,130円	1,140円	1,130円	290円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,938	99.7%	電気機器	20.3%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.9%
国内株式先物	-	-	輸送用機器	9.7%	ソニーグループ	電気機器	3.4%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	8.7%	キーエンス	電気機器	2.3%
コール・ローン、その他		0.3%	化学	7.5%	リクルートホールディングス	サービス業	1.8%
合計	1,938	100.0%	卸売業	6.2%	東京エレクトロン	電気機器	1.5%
株式市場・上場別構成			機械	6.0%	日本電信電話	情報・通信業	1.4%
一部(東証・名証)		99.7%	サービス業	5.9%	信越化学	化学	1.4%
二部(東証・名証)		-	医薬品	5.3%	任天堂	その他製品	1.4%
新興市場他		-	小売業	4.7%	ダイキン工業	機械	1.3%
その他		-	その他	25.6%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.3%
合計		99.7%	合計	99.7%	合計		20.5%

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはTOPIX Ex-Financialsです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
 ・2013年※は設定日(9月19日)から年末、2022年は1月31日までの騰落率を表しています。
 ・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

受益権の取得申込者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後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またはその両方を行なうことができます。

委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

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

び金銭についての受入れまたは振替済みの通知にかかわらず、振替機関に対し当該受益権にかかる信託が行なわれた旨を通知するものとします。

2【換金（解約）手続等】

<解約>

受益者は、自己に帰属する受益権（受託会社が「3 資産管理等の概要(5)」に規定する重大な信託約款の変更等に反対した受益者からの「3 資産管理等の概要(5)」の規定による請求により買取った受益権を除きます。）につき、信託期間中において、当ファンドの一部解約請求をすることはできません。

<交換>

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、当該受益権と当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換（以下「交換」といいます。）を請求することができます。

受益者が交換請求をするときは、販売会社に対し、委託会社が定める一定口数の整数倍の振替受益権をもって行なうものとします。

交換を請求しようとする受益者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後2時）までに交換請求をした場合には、当日を交換請求受付日として委託会社は当該交換請求を受付けます。

委託会社は、交換に際し、信託財産に属する株式の評価額をもって、それに相当する口数の受益権と交換するものとします。交換に際し、受益権の価額は、交換請求受付日の基準価額とします。

前 の規定にかかわらず、委託会社は、原則として、次の1.から3.までに該当する場合は、受益権の交換請求の受け付けを停止します。なお、次の1.から2.までに該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の交換請求を受け付けることがあります。

1. 対象株価指数構成銘柄の変更および増減資等に伴う株数の変更日の2営業日前から起算して6営業日以内
2. 計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）
3. 前1.から前2.までのほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

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せん。当該抹消にかかる手続および後 に掲げる交換株式にかかる振替請求が行なわれた後に、振替機関は、後 または後 に定める当該交換にかかる受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座に前 の交換の請求を行なった受益者にかかる当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

受託会社は、後 または後 の委託会社の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび後 に定める抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ、抹消したものととして取扱います。

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100口当たりの価額をいいます。

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

(注) 主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または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7月10日まで、および7月11日から翌年1月10日までとします。ただし、第1計算期間は、2013年9月19日から2014年1月10日までとします。

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が 200 万口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合または対象株価指数が廃止された場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。なお、受益権を上場したすべての金融商品取引所において当該受益権の上場が廃止された場合には、委託会社は、その廃止された日に、信託を終了するための手続きを開始するものとします。
3. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
4. 前3.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本4.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
5. 前3.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
6. 前3.から前5.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約するとき、あるいは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.から前5.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更等

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

する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

反対者の買取請求権

前 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 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 の3.または前 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付けによって生じる株式および金銭の委託会社への受渡または支払いの債務の負担を当該清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合の信託契約締結当初または追加信託当初の受益者は当該清算機関とします。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

<支払方法>

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

8. 受託会社は、前7.の規定により委託会社に収益分配金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。
9. 受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

信託終了時の交換等

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

交換請求権および買取請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間（2021年7月11日から2022年1月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 2021年7月10日現在	第17期 2022年1月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	81,971,659	60,463,264
株式	7,619,842,850	34,585,561,050
未収配当金	10,463,078	52,250,105
流動資産合計	7,712,277,587	34,698,274,419
資産合計	7,712,277,587	34,698,274,419
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	57,189,062	63,762,532
未払受託者報酬	1,852,157	5,837,384
未払委託者報酬	4,815,679	15,177,263
未払利息	94	39
その他未払費用	2,168,046	3,667,520
流動負債合計	66,025,038	88,444,738
負債合計	66,025,038	88,444,738
純資産の部		
元本等		
元本	1 5,005,308,231	1 21,745,222,120
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,640,944,318	12,864,607,561
（分配準備積立金）	414,995	2,078,415
元本等合計	7,646,252,549	34,609,829,681
純資産合計	7,646,252,549	34,609,829,681
負債純資産合計	7,712,277,587	34,698,274,419

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期		第17期	
	自	2021年1月11日 至 2021年7月10日	自	2021年7月11日 至 2022年1月10日
営業収益				
受取配当金		65,015,134		79,928,657
受取利息		2		8
有価証券売買等損益		187,428,118		929,420,750
その他収益		1 17,657		1 10,608,125
営業収益合計		252,460,911		1,019,957,540
営業費用				
支払利息		3,357		6,145
受託者報酬		1,852,157		5,837,384
委託者報酬		4,815,679		15,177,263
その他費用		1,296,390		4,090,046
営業費用合計		7,967,583		25,110,838
営業利益		244,493,328		994,846,702
経常利益		244,493,328		994,846,702
当期純利益		244,493,328		994,846,702
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,870,036,386		2,640,944,318
剰余金増加額又は欠損金減少額		513,944,080		11,147,966,612
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		513,944,080		11,147,966,612
剰余金減少額又は欠損金増加額		930,340,414		1,855,387,539
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		930,340,414		1,855,387,539
分配金		2 57,189,062		2 63,762,532
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,640,944,318		12,864,607,561

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第17期	
	自 2021年7月11日	至 2022年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第16期	第17期
	2021年7月10日現在	2022年1月10日現在
1. 1 期首元本額	5,970,754,207円	5,005,308,231円
期中追加設定元本額	966,332,120円	19,635,922,480円
期中一部交換元本額	1,931,778,096円	2,896,008,591円
2. 計算期間末日における受益権の総数	5,060,979口	21,987,080口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第16期	第17期
	自 2021年1月11日 至 2021年7月10日	自 2021年7月11日 至 2022年1月10日
1. 1 その他収益	該当事項はありません。	主に、受取和解金であります。

2. 2 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(65,029,436円)及び分配準備積立金(538,847円)の合計額から、経費(7,964,226円)を控除して計算される分配対象額は57,604,057円(100口当たり1,138円)であり、うち57,189,062円(100口当たり1,130円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(90,530,645円)及び分配準備積立金(414,995円)の合計額から、経費(25,104,693円)を控除して計算される分配対象額は65,840,947円(100口当たり299円)であり、うち63,762,532円(100口当たり290円)を分配金額としております。
---------------	---	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第17期 自 2021年7月11日 至 2022年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第17期 2022年1月10日現在
-----	----------------------

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第16期 2021年7月10日現在	第17期 2022年1月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	189,286,206	600,502,470
合計	189,286,206	600,502,470

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第16期 2021年7月10日現在	第17期 2022年1月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第17期 自 2021年7月11日 至 2022年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第16期 2021年7月10日現在	第17期 2022年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,510.82円	1,574.10円
(100口当たり純資産額)	(151,082円)	(157,410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	500	3,070.00	1,535,000	
日本水産	17,700	545.00	9,646,500	
マルハニチロ	3,100	2,410.00	7,471,000	
雪国まいたけ	1,600	1,212.00	1,939,200	
カネコ種苗	500	1,492.00	746,000	
サカタのタネ	2,200	3,295.00	7,249,000	
ホクト	1,700	1,926.00	3,274,200	
ホクリヨウ	500	701.00	350,500	
ヒノキヤグループ	500	2,068.00	1,034,000	
ショーボンドHD	2,700	5,040.00	13,608,000	
ミライト・ホールディングス	6,600	1,911.00	12,612,600	
タマホーム	1,400	2,253.00	3,154,200	
日本アクア	900	634.00	570,600	
ファーストコーポレーション	500	732.00	366,000	
ベステラ	500	1,332.00	666,000	
ROBOT HOME	3,300	228.00	752,400	
キャンディル	500	507.00	253,500	
スペースバリューHD	2,200	1,170.00	2,574,000	
住石ホールディングス	3,700	145.00	536,500	
日鉄鉱業	500	6,840.00	3,420,000	
三井松島HLDGS	900	1,847.00	1,662,300	
INPEX	76,400	1,031.00	78,768,400	
石油資源開発	2,700	2,626.00	7,090,200	
K&Oエナジーグループ	1,000	1,433.00	1,433,000	
ダイセキ環境ソリューション	500	1,330.00	665,000	
第一カッター興業	500	1,371.00	685,500	
明豊ファシリティワークス	500	819.00	409,500	
安藤・間	12,500	874.00	10,925,000	
東急建設	5,800	688.00	3,990,400	
コムシスホールディングス	6,600	2,621.00	17,298,600	
ビーアールホールディングス	2,600	345.00	897,000	
高松コンストラクションGP	1,400	1,963.00	2,748,200	
東建コーポレーション	500	9,330.00	4,665,000	
ヤマウラ	1,000	963.00	963,000	
オリエンタル白石	6,200	232.00	1,438,400	

大成建設	13,700	3,505.00	48,018,500
大林組	43,700	898.00	39,242,600
清水建設	41,300	730.00	30,149,000
飛島建設	1,200	1,026.00	1,231,200
長谷工コーポレーション	14,600	1,448.00	21,140,800
松井建設	1,700	743.00	1,263,100
鹿島建設	32,400	1,355.00	43,902,000
不動テトラ	1,000	1,664.00	1,664,000
大末建設	500	1,327.00	663,500
鉄建建設	1,000	1,824.00	1,824,000
西松建設	3,200	3,730.00	11,936,000
三井住友建設	10,600	437.00	4,632,200
大豊建設	1,000	3,980.00	3,980,000
佐田建設	1,000	466.00	466,000
ナカノフドー建設	1,000	341.00	341,000
奥村組	2,200	3,245.00	7,139,000
東鉄工業	1,700	2,476.00	4,209,200
イチケン	500	1,859.00	929,500
富士ピー・エス	500	482.00	241,000
浅沼組	500	5,470.00	2,735,000
戸田建設	18,200	724.00	13,176,800
熊谷組	2,200	2,914.00	6,410,800
北野建設	400	2,123.00	849,200
植木組	400	1,401.00	560,400
矢作建設	1,800	741.00	1,333,800
ピーエス三菱	1,300	607.00	789,100
日本ハウスHLDGS	3,200	470.00	1,504,000
大東建託	4,500	13,490.00	60,705,000
新日本建設	1,700	795.00	1,351,500
NIPPO	3,500	3,985.00	13,947,500
東亜道路	500	4,825.00	2,412,500
日本道路	400	8,280.00	3,312,000
東亜建設	1,200	2,394.00	2,872,800
日本国土開発	4,400	553.00	2,433,200
若築建設	900	1,803.00	1,622,700
東洋建設	4,900	568.00	2,783,200
五洋建設	18,600	646.00	12,015,600
世紀東急	2,200	810.00	1,782,000
福田組	500	4,295.00	2,147,500
日本ドライケミカル	500	1,978.00	989,000

住友林業	10,900	2,213.00	24,121,700
日本基礎技術	1,200	588.00	705,600
巴コーポレーション	1,800	485.00	873,000
大和ハウス	40,600	3,364.00	136,578,400
ライト工業	2,700	1,922.00	5,189,400
積水ハウス	47,700	2,490.00	118,773,000
日特建設	1,000	654.00	654,000
北陸電気工事	1,080	866.00	935,280
ユアテック	2,700	661.00	1,784,700
日本リーテック	1,000	1,505.00	1,505,000
四電工	400	1,681.00	672,400
中電工	2,200	2,115.00	4,653,000
関電工	7,100	877.00	6,226,700
きんでん	8,900	1,734.00	15,432,600
東京エネシス	1,300	1,032.00	1,341,600
トーエネック	500	3,315.00	1,657,500
住友電設	1,200	2,095.00	2,514,000
日本電設工業	2,200	1,583.00	3,482,600
エクシオグループ	6,600	2,428.00	16,024,800
新日本空調	1,200	2,193.00	2,631,600
日本工営	1,000	3,195.00	3,195,000
九電工	3,200	3,495.00	11,184,000
三機工業	3,200	1,442.00	4,614,400
日揮ホールディングス	14,500	1,044.00	15,138,000
中外炉工業	500	1,609.00	804,500
ヤマト	1,300	736.00	956,800
太平電業	1,000	2,842.00	2,842,000
高砂熱学	3,900	1,922.00	7,495,800
NEC ネットエスアイ	4,400	1,765.00	7,766,000
朝日工業社	500	3,090.00	1,545,000
明星工業	2,700	750.00	2,025,000
大気社	2,200	3,040.00	6,688,000
ダイダン	1,000	2,249.00	2,249,000
日比谷総合設備	1,300	1,977.00	2,570,100
ニッポン	4,000	1,655.00	6,620,000
日清製粉G本社	15,900	1,627.00	25,869,300
昭和産業	1,200	2,693.00	3,231,600
鳥越製粉	1,200	666.00	799,200
中部飼料	1,700	993.00	1,688,100
フィード・ワン	1,700	702.00	1,193,400

日本甜菜糖	900	1,707.00	1,536,300
DM三井製糖ホールディ	1,400	1,954.00	2,735,600
塩水港精糖	1,700	211.00	358,700
日新製糖	900	1,718.00	1,546,200
LIFULL	4,100	239.00	979,900
ミクシィ	3,300	2,042.00	6,738,600
ジェイエシーリクルートメント	1,000	2,009.00	2,009,000
日本M&Aセンターホルデ	22,000	2,540.00	55,880,000
メンバーズ	500	2,370.00	1,185,000
UTグループ	1,800	3,935.00	7,083,000
アイティメディア	500	1,700.00	850,000
E・Jホールディングス	900	1,214.00	1,092,600
夢真ビーネックスグルー	3,500	1,734.00	6,069,000
コシダカホールディングス	3,400	593.00	2,016,200
アルトナー	500	898.00	449,000
パソナグループ	1,300	2,940.00	3,822,000
CDS	500	1,569.00	784,500
リンクアンドモチベーション	3,100	493.00	1,528,300
エス・エム・エス	4,400	3,775.00	16,610,000
サニーサイドアップG	500	721.00	360,500
パーソルホールディングス	13,300	3,050.00	40,565,000
リニカル	900	700.00	630,000
クックパッド	4,400	257.00	1,130,800
エスクリ	500	385.00	192,500
アイ・ケイ・ケイホールディンク	500	593.00	296,500
森永製菓	3,200	3,735.00	11,952,000
中村屋	500	3,615.00	1,807,500
江崎グリコ	3,900	3,735.00	14,566,500
名糖産業	500	1,664.00	832,000
井村屋グループ	900	2,272.00	2,044,800
不二家	1,000	2,315.00	2,315,000
山崎製パン	10,500	1,566.00	16,443,000
第一屋製パン	400	548.00	219,200
モロゾフ	400	5,750.00	2,300,000
亀田製菓	900	4,230.00	3,807,000
寿スピリッツ	1,300	4,900.00	6,370,000
カルビー	6,200	2,729.00	16,919,800
森永乳業	2,700	5,520.00	14,904,000
六甲バター	1,000	1,563.00	1,563,000

ヤクルト	9,800	5,880.00	57,624,000
明治ホールディングス	9,300	7,090.00	65,937,000
雪印メグミルク	3,400	2,040.00	6,936,000
プリマハム	1,800	2,520.00	4,536,000
日本ハム	5,400	4,185.00	22,599,000
林兼産業	500	507.00	253,500
丸大食品	1,300	1,548.00	2,012,400
S Foods	1,200	3,495.00	4,194,000
柿安本店	500	2,805.00	1,402,500
伊藤ハム米久HLDGS	8,900	664.00	5,909,600
学情	500	1,015.00	507,500
スタジオアリス	900	2,058.00	1,852,200
クロスキャット	500	1,765.00	882,500
シミックホールディングス	900	1,488.00	1,339,200
エプコ	500	755.00	377,500
システナ	19,600	403.00	7,898,800
NJS	500	1,908.00	954,000
デジタルアーツ	900	7,660.00	6,894,000
日鉄ソリューションズ	1,800	3,425.00	6,165,000
総合警備保障	5,400	4,365.00	23,571,000
キューブシステム	900	994.00	894,600
いちご	15,500	281.00	4,355,500
日本駐車場開発	14,700	135.00	1,984,500
コア	500	1,574.00	787,000
カカコム	9,800	2,835.00	27,783,000
アイロムグループ	500	1,614.00	807,000
セントケア・ホールディング	1,000	752.00	752,000
サイネックス	100	606.00	60,600
ルネサンス	1,000	1,058.00	1,058,000
ディップ	2,200	3,710.00	8,162,000
SBSホールディングス	1,000	3,505.00	3,505,000
デジタルホールディングス	1,000	1,292.00	1,292,000
新日本科学	1,700	1,381.00	2,347,700
キャリアデザインセンター	500	955.00	477,500
ベネフィット・ワン	4,900	4,000.00	19,600,000
エムスリー	23,500	5,095.00	119,732,500
ツカダ・グローバルHOLD	1,100	273.00	300,300
アウトソーシング	7,600	1,493.00	11,346,800
ウェルネット	1,200	447.00	536,400
ワールドホールディングス	500	2,426.00	1,213,000

ディー・エヌ・エー	5,600	1,719.00	9,626,400
博報堂DYHLDGS	18,600	1,935.00	35,991,000
ぐるなび	2,200	397.00	873,400
タカミヤ	1,700	420.00	714,000
ジャパンベストレスキューS	1,000	875.00	875,000
ファンコミュニケーションズ	3,500	385.00	1,347,500
ライク	500	1,690.00	845,000
ビジネス・ブレークスルー	600	408.00	244,800
エスプール	3,800	1,068.00	4,058,400
WDBホールディングス	500	2,930.00	1,465,000
ティア	900	441.00	396,900
アドウェイズ	2,100	800.00	1,680,000
バリューコマース	1,000	4,065.00	4,065,000
インフォマート	14,300	867.00	12,398,100
サッポロホールディングス	4,900	2,227.00	10,912,300
アサヒグループホールディング	33,100	4,589.00	151,895,900
キリンHD	51,700	1,876.50	97,015,050
宝ホールディングス	10,500	1,211.00	12,715,500
オエノンホールディングス	3,900	341.00	1,329,900
養命酒	500	1,771.00	885,500
コカ・コーラボトラーズJHD	10,000	1,354.00	13,540,000
サントリー食品インター	9,300	4,315.00	40,129,500
ダイドーグループHD	900	4,870.00	4,383,000
伊藤園	4,400	6,260.00	27,544,000
キーコーヒー	1,300	2,041.00	2,653,300
ユニカフェ	500	981.00	490,500
日清オイリオグループ	1,700	2,904.00	4,936,800
不二製油グループ	3,400	2,347.00	7,979,800
J-オイルミルズ	1,200	1,687.00	2,024,400
ローソン	3,400	5,360.00	18,224,000
サンエー	1,000	4,065.00	4,065,000
カワチ薬品	1,000	2,220.00	2,220,000
エービーシー・マート	2,200	4,985.00	10,967,000
ハードオフコーポレーション	500	724.00	362,000
高千穂交易	500	1,519.00	759,500
アスクル	2,200	1,582.00	3,480,400
ゲオホールディングス	1,700	1,233.00	2,096,100
アダストリア	1,800	1,628.00	2,930,400
ジーフット	1,000	343.00	343,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	369.00	36,900

伊藤忠食品	500	4,945.00	2,472,500
くら寿司	1,200	3,700.00	4,440,000
キャンドウ	500	2,184.00	1,092,000
エレマテック	1,000	1,091.00	1,091,000
アイケイ	500	409.00	204,500
パルグループHLDGS	1,200	1,619.00	1,942,800
JALUX	500	2,550.00	1,275,000
エディオン	5,700	1,041.00	5,933,700
あらた	1,000	4,410.00	4,410,000
サーラコーポレーション	2,700	624.00	1,684,800
ワッツ	900	708.00	637,200
ハローズ	500	2,876.00	1,438,000
J Pホールディングス	3,900	242.00	943,800
フジオフードG本社	1,400	1,283.00	1,796,200
あみやき亭	500	2,970.00	1,485,000
東京エレクトロニクス	500	6,220.00	3,110,000
ひらまつ	2,700	176.00	475,200
フィールズ	1,400	518.00	725,200
双日	15,000	1,773.00	26,595,000
アルフレッサホールディングス	14,200	1,575.00	22,365,000
大黒天物産	500	5,250.00	2,625,000
ハニーズホールディングス	1,000	1,009.00	1,009,000
ファーマライズHD	500	733.00	366,500
キッコーマン	10,100	9,380.00	94,738,000
味の素	31,000	3,555.00	110,205,000
ブルドックソ - ス	500	2,041.00	1,020,500
キューピー	7,800	2,523.00	19,679,400
ハウス食品G本社	5,400	2,916.00	15,746,400
カゴメ	5,300	3,055.00	16,191,500
焼津水産化工	900	905.00	814,500
アリアケジャパン	1,200	6,200.00	7,440,000
エバラ食品工業	500	2,757.00	1,378,500
ニチレイ	6,600	2,670.00	17,622,000
横浜冷凍	3,900	840.00	3,276,000
東洋水産	7,100	4,995.00	35,464,500
イトアンドHLDGS	500	2,255.00	1,127,500
ヨシムラ・フード・HLDGS	900	571.00	513,900
日清食品HD	5,300	8,460.00	44,838,000
永谷園ホールディングス	900	1,936.00	1,742,400
一正蒲鉾	500	801.00	400,500

フジッコ	1,300	1,903.00	2,473,900
ロックフィールド	1,300	1,507.00	1,959,100
日本たばこ産業	75,000	2,332.50	174,937,500
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,331.00	1,331,000
わらべや日洋HD	1,000	2,027.00	2,027,000
なとり	900	2,002.00	1,801,800
ピクルスコーポレーション	1,000	1,683.00	1,683,000
ファーマフーズ	1,200	2,028.00	2,433,600
北の達人コーポ	4,900	313.00	1,533,700
ユーグレナ	6,900	685.00	4,726,500
紀文食品	1,000	965.00	965,000
スター・マイカ・HLDGS	900	1,285.00	1,156,500
ADワークスグループ	2,700	145.00	391,500
片倉工業	1,300	2,290.00	2,977,000
グンゼ	1,000	4,070.00	4,070,000
ヒューリック	29,200	1,084.00	31,652,800
ラサ商事	900	965.00	868,500
アルペン	1,000	2,182.00	2,182,000
ハブ	500	610.00	305,000
ラクーンホールディングス	1,000	1,323.00	1,323,000
クオールホールディングス	1,700	1,389.00	2,361,300
アルコニックス	1,300	1,391.00	1,808,300
神戸物産	10,600	3,925.00	41,605,000
ソリトンシステムズ	900	1,300.00	1,170,000
ジンスホールディングス	900	6,910.00	6,219,000
ビックカメラ	8,300	963.00	7,992,900
DCMホールディングス	8,400	1,095.00	9,198,000
ペッパーフードサービス	1,700	324.00	550,800
ハイパー	500	503.00	251,500
MonotaRO	17,300	2,046.00	35,395,800
東京一番フーズ	500	600.00	300,000
DDホールディングス	900	504.00	453,600
あいホールディングス	1,800	1,919.00	3,454,200
ディービーエックス	500	1,074.00	537,000
きちりホールディングス	500	384.00	192,000
アークランドサービスHD	1,000	2,212.00	2,212,000
J. フロント リテイリング	16,400	1,032.00	16,924,800
ドトール・日レスHD	2,200	1,588.00	3,493,600
マツキヨココカラ&カンパニー	7,900	4,110.00	32,469,000
ブロンコビリー	900	2,402.00	2,161,800

Z O Z O	7,900	3,410.00	26,939,000
トレジャー・ファクトリー	500	885.00	442,500
物語コーポレーション	900	6,200.00	5,580,000
三越伊勢丹HD	24,200	835.00	20,207,000
東洋紡	5,400	1,329.00	7,176,600
ユニチカ	3,900	309.00	1,205,100
富士紡ホールディングス	500	4,090.00	2,045,000
日清紡ホールディングス	8,400	916.00	7,694,400
倉敷紡績	1,200	1,926.00	2,311,200
ダイワボウHD	6,000	1,825.00	10,950,000
シキボウ	900	920.00	828,000
日東紡績	2,200	2,957.00	6,505,400
トヨタ紡織	3,900	2,398.00	9,352,200
マクニカ・富士エレHLDGS	3,200	2,665.00	8,528,000
H a m e e	500	1,205.00	602,500
ラクト・ジャパン	500	2,375.00	1,187,500
ウエルシアHD	7,100	3,500.00	24,850,000
クリエイトSDH	2,200	3,190.00	7,018,000
グリムス	500	2,278.00	1,139,000
バイタルKSKHD	2,300	798.00	1,835,400
八洲電機	1,000	981.00	981,000
メディアスホールディングス	900	915.00	823,500
レスターホールディングス	1,300	1,950.00	2,535,000
ジューテックHD	500	1,104.00	552,000
丸善CHI HD	1,700	363.00	617,100
大光	500	675.00	337,500
OCHIホールディングス	500	1,301.00	650,500
TOKAIホールディングス	6,600	879.00	5,801,400
黒谷	500	657.00	328,500
ミサワ	500	714.00	357,000
Cominix	100	726.00	72,600
エー・ピーホールディングス	500	443.00	221,500
三洋貿易	1,300	1,006.00	1,307,800
チムニー	500	1,125.00	562,500
シュッピン	1,000	1,027.00	1,027,000
オイシックス・ラ・大地	1,700	2,950.00	5,015,000
ウイン・パートナーズ	1,000	968.00	968,000
ネクステージ	2,600	2,682.00	6,973,200
ジョイフル本田	3,900	1,491.00	5,814,900
鳥貴族ホールディングス	500	1,673.00	836,500

ホットランド	1,000	1,248.00	1,248,000
すかいらーくHD	17,700	1,470.00	26,019,000
SFPホールディングス	900	1,358.00	1,222,200
綿半ホールディングス	1,000	1,255.00	1,255,000
日本毛織	4,000	925.00	3,700,000
ダイトウボウ	2,200	101.00	222,200
トーア紡コーポレーション	500	418.00	209,000
ダイドーリミテッド	1,700	140.00	238,000
ヨシックスホールディングス	400	1,877.00	750,800
ユナイテッド・スーパーマーケ	3,900	1,054.00	4,110,600
三栄建築設計	500	1,732.00	866,000
野村不動産HLDGS	7,900	2,645.00	20,895,500
三重交通グループHD	2,800	483.00	1,352,400
サムティ	1,800	2,078.00	3,740,400
ディア・ライフ	1,800	521.00	937,800
コーセーアールイー	500	734.00	367,000
日本商業開発	1,000	1,726.00	1,726,000
プレサンスコーポレーション	2,200	2,120.00	4,664,000
フィル・カンパニー	400	2,189.00	875,600
THEグローバル社	1,000	180.00	180,000
日本管理センター	500	978.00	489,000
サンセイランディック	500	805.00	402,500
フージャースHD	2,200	676.00	1,487,200
オープンハウスグループ	4,400	6,020.00	26,488,000
東急不動産HD	37,500	653.00	24,487,500
飯田GHD	11,500	2,726.00	31,349,000
ムゲンエステート	1,000	484.00	484,000
帝国繊維	1,700	2,125.00	3,612,500
日本コークス工業	12,000	135.00	1,620,000
ゴルフダイジェスト・オン	900	1,103.00	992,700
ミタチ産業	500	1,073.00	536,500
B E E N O S	900	2,206.00	1,985,400
あさひ	1,000	1,389.00	1,389,000
日本調剤	1,000	1,375.00	1,375,000
コスモス薬品	1,300	16,390.00	21,307,000
シップヘルスケアHD	4,800	2,618.00	12,566,400
トーエル	900	850.00	765,000
ソフトクリエイイトHD	500	3,900.00	1,950,000
セブン&アイ・HLDGS	53,900	5,117.00	275,806,300
クリエイイト・レストランツ・ホール	7,600	691.00	5,251,600

明治電機工業	500	1,273.00	636,500
ツルハホールディングス	3,100	10,990.00	34,069,000
デリカフーズHLDGS	500	593.00	296,500
スターティアホールディングス	400	888.00	355,200
サンマルクホールディングス	1,000	1,470.00	1,470,000
フェリシモ	500	1,394.00	697,000
トリドールホールディングス	3,400	2,328.00	7,915,200
帝人	12,800	1,451.00	18,572,800
東レ	99,300	705.40	70,046,220
クラレ	20,200	1,035.00	20,907,000
旭化成	90,900	1,121.50	101,944,350
TOKYO BASE	1,200	544.00	652,800
稲葉製作所	900	1,363.00	1,226,700
宮地エンジニアリングG	500	3,185.00	1,592,500
トーカロ	3,500	1,420.00	4,970,000
アルファCO	500	1,129.00	564,500
SUMCO	21,300	2,354.00	50,140,200
川田テクノロジーズ	500	4,205.00	2,102,500
RS TECHNOLOGIES	500	6,470.00	3,235,000
信和	900	832.00	748,800
ビーロッド	900	507.00	456,300
ファーストブラザーズ	400	922.00	368,800
AND DOホールディングス	900	867.00	780,300
シーアールイー	500	1,615.00	807,500
ケイアイスター不動産	500	8,220.00	4,110,000
アグレ都市デザイン	500	1,454.00	727,000
グッドコムアセット	500	1,094.00	547,000
ジェイ・エス・ビー	400	2,950.00	1,180,000
テンポイノベーション	500	859.00	429,500
住江織物	500	1,557.00	778,500
日本フェルト	900	430.00	387,000
エコナックホールディングス	2,200	89.00	195,800
芦森工業	400	920.00	368,000
アツギ	1,000	545.00	545,000
JMホールディングス	1,000	1,617.00	1,617,000
コメダホールディングス	3,200	2,032.00	6,502,400
アレンザホールディングス	900	1,108.00	997,200
串カツ田中HLDGS	500	1,932.00	966,000
パロックジャパン	1,000	858.00	858,000
クスリのアオキHLDGS	1,300	7,000.00	9,100,000

ダイニック	500	711.00	355,500
共和レザー	900	671.00	603,900
力の源HD	500	564.00	282,000
FOOD&LIFE COMPAN	7,900	4,035.00	31,876,500
アセンテック	500	871.00	435,500
セーレン	3,400	2,549.00	8,666,600
ソトー	500	796.00	398,000
小松マテーレ	2,200	1,259.00	2,769,800
ワコールホールディングス	3,400	2,102.00	7,146,800
ホギメディカル	1,700	3,135.00	5,329,500
クラウドシアHLDGS	500	241.00	120,500
T S Iホールディングス	4,000	334.00	1,336,000
マツオカコーポレーション	500	1,232.00	616,000
ワールド	1,700	1,137.00	1,932,900
T I S	13,700	3,165.00	43,360,500
J N Sホールディングス	1,000	449.00	449,000
グリー	8,400	809.00	6,795,600
コーエーテクモHD	3,400	4,335.00	14,739,000
三菱総合研究所	500	3,865.00	1,932,500
ボルテージ	500	345.00	172,500
A G S	900	852.00	766,800
ファインデックス	1,400	995.00	1,393,000
ブレインパッド	1,500	1,330.00	1,995,000
K L a b	2,700	471.00	1,271,700
ポールトゥウィン・ピットクル	1,700	976.00	1,659,200
ネクソン	30,900	2,172.00	67,114,800
アイスタイル	4,000	244.00	976,000
エムアップホールディングス	2,000	860.00	1,720,000
エイチーム	1,000	802.00	802,000
エニグモ	1,200	703.00	843,600
テクノスジャパン	1,000	528.00	528,000
e n i s h	1,000	378.00	378,000
コロプラ	4,400	641.00	2,820,400
オルトプラス	1,000	312.00	312,000
ブロードリーフ	6,700	397.00	2,659,900
クロス・マーケティングG	600	892.00	535,200
デジタルハーツHLDGS	500	1,996.00	998,000
システム情報	1,000	829.00	829,000
メディアドゥ	500	3,800.00	1,900,000
じげん	3,400	297.00	1,009,800

ブイキューブ	1,200	982.00	1,178,400
エンカレッジ・テクノロジー	500	584.00	292,000
サイバーリンクス	500	1,020.00	510,000
ディー・エル・イー	1,000	264.00	264,000
フィックスターズ	1,300	824.00	1,071,200
CARTA HOLDINGS	500	1,936.00	968,000
オプティム	1,000	1,176.00	1,176,000
セレス	500	2,190.00	1,095,000
SHIFT	700	18,170.00	12,719,000
特種東海製紙	900	4,050.00	3,645,000
ティーガイア	1,300	1,659.00	2,156,700
テクマトリックス	2,200	1,613.00	3,548,600
プロシップ	500	1,461.00	730,500
ガンホー・オンライン・エンター	3,400	2,465.00	8,381,000
GMOペイメントゲートウェイ	2,700	12,430.00	33,561,000
ザッパラス	600	531.00	318,600
システムリサーチ	500	1,931.00	965,500
インターネットイニシアティブ	3,500	4,380.00	15,330,000
さくらインターネット	1,300	557.00	724,100
ヴィンクス	500	955.00	477,500
GMOグローバルサインHD	500	3,820.00	1,910,000
SRAホールディングス	900	2,833.00	2,549,700
システムインテグレータ	500	563.00	281,500
朝日ネット	1,400	628.00	879,200
eBASE	1,700	591.00	1,004,700
アバント	1,300	1,134.00	1,474,200
アドソル日進	500	1,692.00	846,000
ODKソリューションズ	400	653.00	261,200
フリービット	900	952.00	856,800
コムチュア	1,200	3,020.00	3,624,000
アステリア	1,000	970.00	970,000
アイル	900	1,415.00	1,273,500
王子ホールディングス	61,800	555.00	34,299,000
日本製紙	6,100	1,148.00	7,002,800
三菱製紙	1,800	319.00	574,200
北越コーポレーション	9,800	705.00	6,909,000
中越パルプ	500	962.00	481,000
巴川製紙	500	857.00	428,500
大王製紙	6,600	1,870.00	12,342,000
阿波製紙	500	324.00	162,000

マークラインズ	900	2,630.00	2,367,000
メディカル・データ・ビジ	1,700	1,174.00	1,995,800
g u m i	1,700	633.00	1,076,100
ショーケース	500	457.00	228,500
モバイルファクトリー	500	809.00	404,500
テラスカイ	500	1,591.00	795,500
デジタル・インフォメーション	500	1,268.00	634,000
P C Iホールディングス	500	1,123.00	561,500
パイブドHD	500	2,236.00	1,118,000
ネオジャパン	400	1,293.00	517,200
P R T I M E S	500	2,751.00	1,375,500
ラクス	4,000	2,568.00	10,272,000
ランドコンピュータ	400	871.00	348,400
ダブルスタンダード	400	2,698.00	1,079,200
オープンドア	900	1,627.00	1,464,300
マイネット	500	548.00	274,000
アカツキ	500	2,805.00	1,402,500
U B I C O Mホールディングス	500	2,357.00	1,178,500
カナミックネットワーク	1,200	450.00	540,000
ノムラシステムコーポレーション	1,000	263.00	263,000
レンゴー	14,200	881.00	12,510,200
トーモク	1,000	1,770.00	1,770,000
ザ・パック	1,000	2,674.00	2,674,000
チェンジ	2,600	1,628.00	4,232,800
シンクロ・フード	1,000	311.00	311,000
オークネット	900	1,569.00	1,412,100
キャピタル・アセット・プラン	400	810.00	324,000
セグエグループ	500	736.00	368,000
エイトレッド	400	2,219.00	887,600
マクロミル	2,700	1,072.00	2,894,400
ビーグリー	400	1,383.00	553,200
オロ	500	2,657.00	1,328,500
ユーザーローカル	400	1,673.00	669,200
テモナ	500	440.00	220,000
ニーズウェル	500	582.00	291,000
マネーフォワード	2,200	5,640.00	12,408,000
サインポスト	500	999.00	499,500
昭和電工	11,900	2,588.00	30,797,200
住友化学	107,800	563.00	60,691,400
住友精化	900	3,160.00	2,844,000

日産化学	7,500	6,470.00	48,525,000
ラサ工業	500	1,657.00	828,500
クレハ	1,300	8,680.00	11,284,000
多木化学	500	5,650.00	2,825,000
テイカ	1,000	1,253.00	1,253,000
石原産業	2,700	1,183.00	3,194,100
片倉コープアグリ	500	1,112.00	556,000
日本曹達	1,800	3,315.00	5,967,000
東ソー	21,100	1,764.00	37,220,400
トクヤマ	3,900	1,828.00	7,129,200
セントラル硝子	2,700	2,178.00	5,880,600
東亜合成	7,900	1,177.00	9,298,300
大阪ソーダ	1,300	2,985.00	3,880,500
関東電化	3,200	1,116.00	3,571,200
デンカ	4,900	3,890.00	19,061,000
イビデン	6,600	6,600.00	43,560,000
信越化学	23,500	19,835.00	466,122,500
日本カ - バイド	500	1,307.00	653,500
電算システムHD	500	2,634.00	1,317,000
堺 化 学	1,000	2,297.00	2,297,000
第一稀元素化学工	1,300	1,225.00	1,592,500
エア・ウォーター	14,200	1,785.00	25,347,000
日本酸素HLDGS	11,500	2,539.00	29,198,500
日本化学工業	500	2,768.00	1,384,000
日本パ - カライジング	7,100	1,100.00	7,810,000
高圧ガス	2,200	777.00	1,709,400
四国化成	1,700	1,388.00	2,359,600
戸田工業	500	3,765.00	1,882,500
ステラ ケミファ	900	2,622.00	2,359,800
保土谷化学	500	5,860.00	2,930,000
日本触媒	2,700	5,360.00	14,472,000
大日精化	1,400	2,303.00	3,224,200
カネカ	3,500	3,815.00	13,352,500
協和キリン	16,400	3,065.00	50,266,000
三菱瓦斯化学	13,700	2,008.00	27,509,600
三井化学	12,000	3,285.00	39,420,000
J S R	13,700	4,170.00	57,129,000
東京応化工業	2,200	6,580.00	14,476,000
大阪有機化学	1,200	3,245.00	3,894,000
三菱ケミカルHLDGS	91,400	868.80	79,408,320

KHネオケム	2,200	3,145.00	6,919,000
ダイセル	18,600	825.00	15,345,000
住友ベークライト	2,200	5,800.00	12,760,000
積水化学	28,700	1,976.00	56,711,200
日本ゼオン	12,300	1,377.00	16,937,100
アイカ工業	3,900	3,365.00	13,123,500
宇部興産	7,100	2,083.00	14,789,300
積水樹脂	2,200	2,067.00	4,547,400
タキロンシーアイ	3,200	554.00	1,772,800
旭有機材	900	1,723.00	1,550,700
ニチバン	900	1,781.00	1,602,900
リケンテクノス	3,400	499.00	1,696,600
大倉工業	900	2,128.00	1,915,200
積水化成製品	1,700	480.00	816,000
群栄化学	500	3,705.00	1,852,500
タイガース ポリマー	1,000	461.00	461,000
ミライアル	500	1,777.00	888,500
ダイキアクシス	500	761.00	380,500
ダイキョーニシカワ	3,100	611.00	1,894,100
竹本容器	500	802.00	401,000
森六ホールディングス	900	1,896.00	1,706,400
恵和	400	5,810.00	2,324,000
日本化薬	8,400	1,165.00	9,786,000
カーリットホールディングス	1,300	712.00	925,600
ソルクシーズ	1,400	427.00	597,800
CLホールディングス	500	1,341.00	670,500
プレステージ・インター	4,900	682.00	3,341,800
フェイス	500	665.00	332,500
プロトコーポレーション	1,600	1,374.00	2,198,400
ハイマックス	500	1,109.00	554,500
アミューズ	900	2,046.00	1,841,400
野村総合研究所	26,500	4,345.00	115,142,500
ドリームインキュベータ	500	1,498.00	749,000
サイバネットシステム	1,000	678.00	678,000
クイック	1,000	1,378.00	1,378,000
TAC	1,100	221.00	243,100
CEホールディングス	900	457.00	411,300
日本システム技術	400	2,342.00	936,800
電通グループ	13,700	4,075.00	55,827,500
インテージホールディングス	1,700	1,603.00	2,725,100

テイクアンドギヴニーズ	500	915.00	457,500
東邦システムサイエンス	500	1,010.00	505,000
びあ	500	3,125.00	1,562,500
イオンファンタジー	500	1,808.00	904,000
ソースネクスト	6,600	167.00	1,102,200
シーティーエス	1,300	759.00	986,700
ネクシィーズグループ	500	682.00	341,000
インフォコム	1,200	2,140.00	2,568,000
メディカルシステムネットワーク	1,200	570.00	684,000
日本精化	1,000	2,320.00	2,320,000
扶桑化学工業	900	4,575.00	4,117,500
トリケミカル	1,200	3,450.00	4,140,000
HEROZ	500	1,186.00	593,000
ラクスル	1,300	4,670.00	6,071,000
I P S	400	2,105.00	842,000
F I G	1,300	306.00	397,800
システムサポート	500	1,095.00	547,500
A D E K A	6,200	2,482.00	15,388,400
日油	5,300	5,570.00	29,521,000
ミヨシ油脂	500	1,214.00	607,000
新日本理化	2,200	256.00	563,200
ハリマ化成グループ	1,000	821.00	821,000
イーソル	900	693.00	623,700
アルテリア・ネットワークス	1,300	1,475.00	1,917,500
ウイングアーク1ST	900	2,020.00	1,818,000
ヒト・コミュニケーションズHD	400	2,088.00	835,200
サーバーワークス	100	2,931.00	293,100
トピラシステムズ	400	787.00	314,800
S a n s a n	5,200	2,052.00	10,670,400
L i n k - U	400	939.00	375,600
ギフトィ	1,400	1,733.00	2,426,200
花 王	30,900	5,963.00	184,256,700
第一工業製薬	500	3,075.00	1,537,500
石原ケミカル	1,000	1,323.00	1,323,000
日華化学	500	821.00	410,500
ニイタカ	500	2,219.00	1,109,500
三洋化成	900	5,330.00	4,797,000
J M D C	1,300	5,930.00	7,709,000
武田薬品	110,000	3,196.00	351,560,000

アステラス製薬	121,400	1,854.50	225,136,300
大日本住友製薬	10,100	1,343.00	13,564,300
塩野義製薬	17,600	7,660.00	134,816,000
わかもと製薬	1,700	302.00	513,400
日本新薬	3,900	7,790.00	30,381,000
中外製薬	43,600	3,725.00	162,410,000
科研製薬	2,200	4,155.00	9,141,000
エーザイ	16,800	6,497.00	109,149,600
理研ビタミン	1,200	1,680.00	2,016,000
ロート製薬	6,600	3,325.00	21,945,000
小野薬品	32,400	2,738.50	88,727,400
久光製薬	3,900	4,085.00	15,931,500
有機合成薬品	1,000	280.00	280,000
持田製薬	1,800	3,405.00	6,129,000
参天製薬	24,300	1,409.00	34,238,700
扶桑薬品	500	2,507.00	1,253,500
ツムラ	4,900	3,295.00	16,145,500
日医工	3,900	733.00	2,858,700
テルモ	39,600	4,459.00	176,576,400
HUグループHD	3,500	2,899.00	10,146,500
キッセイ薬品工業	2,700	2,243.00	6,056,100
生化学工業	2,700	954.00	2,575,800
栄研化学	2,700	1,856.00	5,011,200
日水製薬	500	1,008.00	504,000
鳥居薬品	1,000	2,853.00	2,853,000
JCRファーマ	3,900	2,096.00	8,174,400
東和薬品	2,200	2,917.00	6,417,400
富士製薬工業	1,000	995.00	995,000
ゼリア新薬工業	2,700	1,945.00	5,251,500
第一三共	110,000	2,713.00	298,430,000
キョーリン製薬HD	3,200	1,799.00	5,756,800
大幸薬品	2,100	761.00	1,598,100
ダイト	1,000	2,923.00	2,923,000
大塚ホールディングス	29,100	4,248.00	123,616,800
大正製薬HD	3,500	5,250.00	18,375,000
ペプチドリーム	7,500	2,304.00	17,280,000
大日本塗料	1,700	827.00	1,405,900
日本ペイントHOLD	51,700	1,254.00	64,831,800
関西ペイント	15,400	2,496.00	38,438,400
神東塗料	1,200	174.00	208,800

中国塗料	3,200	947.00	3,030,400
日本特殊塗料	1,000	872.00	872,000
藤倉化成	1,700	492.00	836,400
太陽ホールディングス	2,300	3,425.00	7,877,500
D I C	5,700	2,971.00	16,934,700
サカティンクス	2,700	1,002.00	2,705,400
東洋インキS Cホールディン	3,100	1,909.00	5,917,900
T & K T O K A	1,000	802.00	802,000
アルプス技研	1,200	1,845.00	2,214,000
サニックス	2,200	231.00	508,200
ダイオーズ	400	1,006.00	402,400
日本空調サービス	1,300	796.00	1,034,800
オリエンタルランド	15,800	17,830.00	281,714,000
フォーカスシステムズ	1,000	948.00	948,000
ダスキン	3,200	2,745.00	8,784,000
パーク24	7,600	1,501.00	11,407,600
明光ネットワークジャパン	1,700	565.00	960,500
ファルコホールディングス	500	2,058.00	1,029,000
クレスコ	1,000	1,971.00	1,971,000
フジ・メディア・HD	14,200	1,136.00	16,131,200
秀英予備校	500	413.00	206,500
田谷	500	538.00	269,000
ラウンドワン	4,400	1,247.00	5,486,800
リゾートトラスト	6,100	1,837.00	11,205,700
オービック	4,400	19,820.00	87,208,000
ジャストシステム	1,800	4,975.00	8,955,000
T D C ソフト	1,400	1,061.00	1,485,400
Zホールディングス	199,800	638.40	127,552,320
ビー・エム・エル	1,700	3,690.00	6,273,000
トレンドマイクロ	7,500	5,970.00	44,775,000
りらいあコミュニケーション	2,200	991.00	2,180,200
I Dホールディングス	900	867.00	780,300
リソー教育	6,600	382.00	2,521,200
日本オラクル	2,700	8,620.00	23,274,000
早稲田アカデミー	500	1,045.00	522,500
アルファシステムズ	500	3,775.00	1,887,500
フューチャー	2,600	1,560.00	4,056,000
C A C H O L D I N G S	1,000	1,378.00	1,378,000
S Bテクノロジー	500	2,379.00	1,189,500
トーセ	500	722.00	361,000

ユー・エス・エス	15,000	1,897.00	28,455,000
オービックビジネスC	1,300	4,570.00	5,941,000
伊藤忠テクノソリュー	6,100	3,555.00	21,685,500
アイティフォー	1,700	797.00	1,354,900
東京個別指導学院	1,400	636.00	890,400
サイバーエージェント	33,000	1,812.00	59,796,000
楽天グループ	68,400	1,152.00	78,796,800
クリーク・アンド・リバー社	900	1,849.00	1,664,100
モーニングスター	1,700	626.00	1,064,200
テー・オー・ダブリュー	2,200	299.00	657,800
大塚商会	7,500	5,260.00	39,450,000
サイボウズ	1,700	1,619.00	2,752,300
山田コンサルティングG P	900	1,105.00	994,500
セントラルスポーツ	500	2,374.00	1,187,000
バラカ	500	1,579.00	789,500
電通国際情報S	1,700	3,605.00	6,128,500
A C C E S S	1,600	671.00	1,073,600
デジタルガレージ	2,200	4,870.00	10,714,000
イーエムシステムズ	2,200	718.00	1,579,600
ウェザーニューズ	500	8,170.00	4,085,000
C I J	1,000	843.00	843,000
日本エンタープライズ	1,300	180.00	234,000
WOWOW	500	1,720.00	860,000
スカラ	1,200	642.00	770,400
インテリジェント ウェイブ	1,000	526.00	526,000
フルキャストホールディングス	1,200	2,072.00	2,486,400
エン・ジャパン	2,200	3,000.00	6,600,000
あすか製薬HD	1,700	988.00	1,679,600
サワイグループHD	3,100	4,480.00	13,888,000
富士フイルムH L D G S	24,700	8,691.00	214,667,700
コニカミノルタ	28,300	532.00	15,055,600
資 生 堂	26,000	6,353.00	165,178,000
ライオン	16,900	1,538.00	25,992,200
高砂香料	1,000	2,794.00	2,794,000
マンダム	3,100	1,396.00	4,327,600
ミルボン	1,700	5,710.00	9,707,000
ファンケル	5,300	3,255.00	17,251,500
コーセー	2,700	12,620.00	34,074,000
コタ	900	1,605.00	1,444,500
ポーラ・オルビスHD	6,100	1,866.00	11,382,600

ノエビアホールディングス	1,200	5,290.00	6,348,000
アジュバンホールディング	500	1,139.00	569,500
新日本製薬	500	1,134.00	567,000
エステー	1,000	1,534.00	1,534,000
アグロカネショウ	500	1,232.00	616,000
コニシ	2,200	1,723.00	3,790,600
長谷川香料	2,200	2,635.00	5,797,000
星光PMC	900	686.00	617,400
小林製薬	3,900	8,930.00	34,827,000
荒川化学工業	1,200	1,168.00	1,401,600
メック	1,000	3,655.00	3,655,000
日本高純度化学	500	2,581.00	1,290,500
タカラバイオ	3,500	2,588.00	9,058,000
JCU	1,700	5,230.00	8,891,000
新田ゼラチン	1,000	584.00	584,000
OATアグリオ	400	1,860.00	744,000
デクセリアルズ	3,900	3,970.00	15,483,000
アース製薬	1,300	6,170.00	8,021,000
北興化学	1,200	905.00	1,086,000
大成ラミック	500	2,776.00	1,388,000
クミアイ化学	5,500	787.00	4,328,500
日本農薬	2,700	495.00	1,336,500
富士興産	500	1,013.00	506,500
ニチレキ	1,700	1,387.00	2,357,900
ユシロ化学	900	1,099.00	989,100
ビーピー・カストロール	500	1,331.00	665,500
富士石油	3,400	258.00	877,200
MORESCO	500	1,156.00	578,000
出光興産	15,500	3,120.00	48,360,000
ENEOSホールディングス	210,300	448.20	94,256,460
コスモエネルギーHLDGS	4,400	2,287.00	10,062,800
テスホールディングス	1,000	1,746.00	1,746,000
インフロニアHD	17,200	1,070.00	18,404,000
横浜ゴム	7,900	1,894.00	14,962,600
TOYO TIRE	7,600	1,842.00	13,999,200
ブリヂストン	40,200	5,082.00	204,296,400
住友ゴム	12,300	1,199.00	14,747,700
藤倉コンポジット	1,200	938.00	1,125,600
オカモト	900	4,090.00	3,681,000
アキレス	1,000	1,257.00	1,257,000

フコク	500	1,009.00	504,500
ニッタ	1,300	2,911.00	3,784,300
クリエートメディック	500	968.00	484,000
住友理工	2,700	620.00	1,674,000
三ツ星ベルト	1,700	2,113.00	3,592,100
バンドー化学	2,700	889.00	2,400,300
A G C	12,800	5,360.00	68,608,000
日本板硝子	7,100	535.00	3,798,500
石塚硝子	400	2,110.00	844,000
有沢製作所	1,800	1,009.00	1,816,200
日本山村硝子	500	790.00	395,000
日本電気硝子	5,600	2,885.00	16,156,000
オハラ	500	1,216.00	608,000
住友大阪セメント	2,700	3,565.00	9,625,500
太平洋セメント	7,900	2,320.00	18,328,000
日本ヒユ-ム	1,200	707.00	848,400
日本コンクリ-ト	3,200	279.00	892,800
三谷セキサン	500	6,570.00	3,285,000
アジアパイルHD	2,200	448.00	985,600
東海カーボン	11,900	1,256.00	14,946,400
日本カーボン	900	4,205.00	3,784,500
東洋炭素	1,000	3,095.00	3,095,000
ノリタケ	900	4,865.00	4,378,500
T O T O	10,200	5,190.00	52,938,000
日本碍子	15,400	1,996.00	30,738,400
日本特殊陶業	10,600	2,063.00	21,867,800
ダントーホールディングス	1,000	221.00	221,000
M A R U W A	400	16,130.00	6,452,000
品川リフラクトリーズ	500	4,065.00	2,032,500
黒崎播磨	400	4,580.00	1,832,000
ヨータイ	1,000	1,243.00	1,243,000
イソライト	500	1,197.00	598,500
東京窯業	1,700	307.00	521,900
ニッカトー	500	693.00	346,500
フジミインコーポレーテッド	1,200	7,540.00	9,048,000
クニミネ工業	500	1,030.00	515,000
エーアンドエーマテリアル	400	912.00	364,800
ニチアス	3,400	2,777.00	9,441,800
日本製鉄	62,000	2,022.00	125,364,000
神戸製鋼所	25,300	602.00	15,230,600

中山製鋼所	1,800	447.00	804,600
合同製鐵	900	1,421.00	1,278,900
J F Eホールディングス	37,400	1,605.00	60,027,000
東京製鐵	5,400	1,417.00	7,651,800
共英製鋼	1,700	1,516.00	2,577,200
大和工業	3,100	3,780.00	11,718,000
東京鐵鋼	500	1,384.00	692,000
大阪製鐵	900	1,199.00	1,079,100
淀川製鋼所	1,700	2,551.00	4,336,700
丸一鋼管	4,400	2,618.00	11,519,200
モリ工業	500	2,782.00	1,391,000
大同特殊鋼	2,200	4,365.00	9,603,000
日本高周波	600	347.00	208,200
日本冶金工	1,000	2,377.00	2,377,000
山陽特殊製鋼	1,700	2,229.00	3,789,300
愛知製鋼	900	2,590.00	2,331,000
日立金属	13,200	2,143.00	28,287,600
日本金属	500	1,041.00	520,500
大平洋金属	1,000	2,150.00	2,150,000
新日本電工	8,800	304.00	2,675,200
栗本鉄工所	500	1,564.00	782,000
日本製鋼所	4,400	4,090.00	17,996,000
三菱製鋼	1,000	1,071.00	1,071,000
日亜鋼業	2,200	268.00	589,600
エンビプロHD	500	1,747.00	873,500
大紀アルミニウム	2,200	1,629.00	3,583,800
日本軽金属HD	3,900	1,779.00	6,938,100
三井金属	3,500	3,185.00	11,147,500
東邦亜鉛	900	2,293.00	2,063,700
三菱マテリアル	9,300	2,036.00	18,934,800
住友鉱山	17,700	4,552.00	80,570,400
DOWAホールディングス	3,400	4,845.00	16,473,000
古河機金	2,200	1,266.00	2,785,200
エス・サイエンス	6,500	25.00	162,500
大阪チタニウム	1,300	806.00	1,047,800
東邦チタニウム	2,700	936.00	2,527,200
UACJ	2,200	2,745.00	6,039,000
CKサンエツ	500	4,195.00	2,097,500
古河電工	4,400	2,377.00	10,458,800
住友電工	48,100	1,626.00	78,210,600

フジクラ	16,700	576.00	9,619,200
昭和電線HLDGS	1,200	1,749.00	2,098,800
タツタ電線	2,600	485.00	1,261,000
平河ビューテック	900	1,170.00	1,053,000
リョービ	1,700	1,205.00	2,048,500
アーレステイ	1,700	412.00	700,400
アサヒHD	5,400	2,102.00	11,350,800
東洋製罐グループHD	8,800	1,398.00	12,302,400
ホッカンホールディングス	900	1,435.00	1,291,500
コロナ	900	900.00	810,000
横河ブリッジHLDGS	2,200	2,215.00	4,873,000
駒井ハルテック	500	2,511.00	1,255,500
三和ホールディングス	13,200	1,255.00	16,566,000
文化シャツタ -	3,900	1,074.00	4,188,600
三協立山	1,700	724.00	1,230,800
アルインコ	1,000	964.00	964,000
東洋シャツタ -	500	553.00	276,500
LIXIL	21,800	2,983.00	65,029,400
日本ファイルコン	1,000	525.00	525,000
ノーリツ	2,700	1,685.00	4,549,500
長府製作所	1,300	2,031.00	2,640,300
リンナイ	2,700	10,350.00	27,945,000
ユニプレス	2,200	865.00	1,903,000
ダイニチ工業	500	729.00	364,500
日東精工	1,700	616.00	1,047,200
岡 部	2,700	743.00	2,006,100
ジーテクト	1,700	1,433.00	2,436,100
東 プ レ	2,700	1,267.00	3,420,900
高周波熱錬	2,700	605.00	1,633,500
東京製綱	1,000	926.00	926,000
サンコール	1,500	619.00	928,500
モリテックスチル	1,000	371.00	371,000
パイオラックス	2,200	1,805.00	3,971,000
エイチワン	1,200	668.00	801,600
日本発条	13,700	982.00	13,453,400
中央発條	800	843.00	674,400
三浦工業	6,100	3,700.00	22,570,000
タ ク マ	4,900	1,411.00	6,913,900
テクノプロ・ホールディング	7,800	3,495.00	27,261,000
アトラグループ	500	280.00	140,000

インターワークス	500	390.00	195,000
アイ・アールジャパンHD	500	5,770.00	2,885,000
K e e P e r 技研	1,000	2,058.00	2,058,000
ファーストロジック	500	828.00	414,000
三機サービス	400	1,007.00	402,800
G u n o s y	1,000	780.00	780,000
デザインワン・ジャパン	500	186.00	93,000
イー・ガーディアン	500	3,145.00	1,572,500
リブセンス	1,100	175.00	192,500
ジャパンマテリアル	4,000	1,855.00	7,420,000
ベクトル	1,700	1,066.00	1,812,200
ウチヤマホールディングス	600	307.00	184,200
チャームケアコーポレーション	1,000	1,329.00	1,329,000
キャリアリンク	500	1,210.00	605,000
I B J	1,000	830.00	830,000
アサンテ	500	1,712.00	856,000
バリューHR	500	2,766.00	1,383,000
M & A キャピタルパートナー	900	4,805.00	4,324,500
ライドオンエクスプレスHD	500	1,560.00	780,000
E R I ホールディングス	500	1,239.00	619,500
シグマクシス・ホールディング	900	2,282.00	2,053,800
ウィルグループ	1,000	1,273.00	1,273,000
エスクローAJ	1,800	165.00	297,000
メドピア	1,000	3,185.00	3,185,000
レアジョブ	400	819.00	327,600
リクルートホールディングス	103,200	6,380.00	658,416,000
エラン	1,700	1,031.00	1,752,700
ツ ガ ミ	2,700	1,670.00	4,509,000
オークマ	1,700	5,210.00	8,857,000
芝浦機械	1,300	3,760.00	4,888,000
アマダ	20,300	1,185.00	24,055,500
アイダエンジニア	3,500	1,061.00	3,713,500
滝澤鉄工所	500	1,169.00	584,500
F U J I	5,800	2,666.00	15,462,800
牧野フライス	1,700	4,080.00	6,936,000
オーエスジー	6,300	1,872.00	11,793,600
旭ダイヤモンド	3,500	646.00	2,261,000
D M G 森精機	8,400	1,981.00	16,640,400
ソディック	3,200	811.00	2,595,200
ディスコ	2,000	35,350.00	70,700,000

日東工器	900	1,786.00	1,607,400
日進工具	1,000	1,536.00	1,536,000
パンチ工業	1,200	524.00	628,800
富士ダイス	1,000	620.00	620,000
土木管理総合試験	600	322.00	193,200
ネットマーケティング	500	394.00	197,000
ベルシステム24HLDGS	2,200	1,217.00	2,677,400
鎌倉新書	1,300	565.00	734,500
SMN	500	621.00	310,500
エアトリ	900	2,443.00	2,198,700
アトラエ	1,000	2,022.00	2,022,000
ストライク	500	4,660.00	2,330,000
ソラスト	3,200	1,155.00	3,696,000
セラク	500	1,503.00	751,500
インソース	1,200	2,346.00	2,815,200
豊田自動織機	11,500	9,710.00	111,665,000
豊和工業	900	775.00	697,500
OKK	600	1,154.00	692,400
石川製作所	500	1,384.00	692,000
東洋機械金属	1,000	527.00	527,000
津田駒工業	500	640.00	320,000
エンシュウ	500	604.00	302,000
島精機製作所	2,200	1,997.00	4,393,400
オプトラン	1,700	2,456.00	4,175,200
NCホールディングス	500	1,616.00	808,000
イワキポンプ	1,000	1,010.00	1,010,000
フリー	1,200	1,281.00	1,537,200
ヤマシンフィルタ	2,700	483.00	1,304,100
日阪製作所	1,700	829.00	1,409,300
やまびこ	2,700	1,212.00	3,272,400
野村マイクロ・サイエンス	500	5,100.00	2,550,000
平田機工	500	6,450.00	3,225,000
ペガサスミシン製造	1,300	518.00	673,400
マルマエ	500	2,918.00	1,459,000
タツモ	500	1,516.00	758,000
ナブテスコ	7,900	3,580.00	28,282,000
三井海洋開発	1,300	1,466.00	1,905,800
レオン自動機	1,200	1,240.00	1,488,000
SMC	4,100	75,580.00	309,878,000
ホソカワミクロン	1,000	3,300.00	3,300,000

ユニオンツール	500	3,915.00	1,957,500
オイレス工業	1,800	1,678.00	3,020,400
日精エーエスビー	500	3,265.00	1,632,500
サト - ホールディングス	1,700	2,126.00	3,614,200
技研製作所	1,200	4,040.00	4,848,000
日本エアーテック	500	1,134.00	567,000
カワタ	500	1,204.00	602,000
日精樹脂工業	1,000	1,022.00	1,022,000
オカダアイヨン	500	1,524.00	762,000
ワイエイシイホールディングス	500	1,090.00	545,000
小松製作所	63,500	2,889.00	183,451,500
住友重機械	7,900	2,994.00	23,652,600
日立建機	6,600	3,470.00	22,902,000
日工	2,200	618.00	1,359,600
巴工業	500	2,244.00	1,122,000
井関農機	1,300	1,433.00	1,862,900
TOWA	1,200	3,055.00	3,666,000
丸山製作所	500	1,526.00	763,000
北川鉄工所	500	1,454.00	727,000
シンニッタン	1,800	232.00	417,600
ローツェ	500	11,080.00	5,540,000
タカキタ	500	616.00	308,000
クボタ	68,300	2,606.00	177,989,800
荏原実業	600	2,371.00	1,422,600
東洋エンジニア	1,700	705.00	1,198,500
三菱化工機	500	2,221.00	1,110,500
月島機械	2,700	1,088.00	2,937,600
帝国電機製作所	1,000	1,481.00	1,481,000
東京機械	600	977.00	586,200
新東工業	3,600	716.00	2,577,600
渋谷工業	1,200	2,892.00	3,470,400
アイチ コーポレーション	2,200	840.00	1,848,000
小森コーポレーション	3,500	715.00	2,502,500
鶴見製作所	1,000	1,683.00	1,683,000
日本ギア工業	500	264.00	132,000
酒井重工業	400	2,673.00	1,069,200
荏原製作所	5,700	6,410.00	36,537,000
西島製作所	1,300	938.00	1,219,400
北越工業	1,300	992.00	1,289,600
ダイキン工業	17,700	25,805.00	456,748,500

オルガノ	500	8,700.00	4,350,000
ト - ヨ - カネツ	500	2,532.00	1,266,000
栗田工業	7,600	5,290.00	40,204,000
椿本チエイン	2,200	3,205.00	7,051,000
大同工業	900	999.00	899,100
日 機 装	4,000	821.00	3,284,000
木村化工機	1,400	817.00	1,143,800
レイズネクスト	2,200	1,180.00	2,596,000
アネスト岩田	2,200	890.00	1,958,000
ダイフク	7,500	9,500.00	71,250,000
サムコ	500	2,610.00	1,305,000
加藤製作所	900	817.00	735,300
油研工業	400	1,700.00	680,000
タダノ	6,600	1,144.00	7,550,400
フジテック	4,900	2,511.00	12,303,900
C K D	3,200	2,257.00	7,222,400
キトー	1,400	1,876.00	2,626,400
平和	3,900	1,938.00	7,558,200
理想科学工業	1,000	2,123.00	2,123,000
S A N K Y O	3,500	3,015.00	10,552,500
日本金銭機械	1,700	651.00	1,106,700
マースグループH L D G S	1,000	1,647.00	1,647,000
フクシマガリレイ	900	4,700.00	4,230,000
オーイズミ	600	390.00	234,000
ダイコク電機	500	1,227.00	613,500
竹内製作所	2,200	2,862.00	6,296,400
ア マ ノ	3,500	2,588.00	9,058,000
J U K I	1,800	830.00	1,494,000
サンデン	1,800	225.00	405,000
ジャノメ	1,200	696.00	835,200
ブラザー工業	17,100	2,222.00	37,996,200
マックス	1,800	1,899.00	3,418,200
モリタホールディングス	2,200	1,319.00	2,901,800
グローリー	3,500	2,230.00	7,805,000
新晃工業	1,200	1,968.00	2,361,600
大和冷機工業	2,200	1,254.00	2,758,800
セガサミーホールディングス	12,700	1,838.00	23,342,600
日本ピストンリング	500	1,336.00	668,000
リ ケ ン	500	2,687.00	1,343,500
T P R	1,700	1,476.00	2,509,200

ツバキ・ナカシマ	3,100	1,526.00	4,730,600
ホシザキ	4,000	8,650.00	34,600,000
大豊工業	1,400	912.00	1,276,800
日本精工	28,700	814.00	23,361,800
N T N	32,200	253.00	8,146,600
ジェイテクト	13,300	1,069.00	14,217,700
不二越	1,200	4,190.00	5,028,000
ミネベアミツミ	24,200	3,150.00	76,230,000
日本トムソン	3,900	662.00	2,581,800
T H K	8,000	2,920.00	23,360,000
ユーシン精機	1,000	746.00	746,000
前澤給装工業	1,000	1,011.00	1,011,000
イーグル工業	1,700	1,121.00	1,905,700
前澤工業	1,000	611.00	611,000
日本ピラ - 工業	1,300	3,485.00	4,530,500
キッツ	4,800	726.00	3,484,800
日立	67,200	6,707.00	450,710,400
東芝	24,500	4,844.00	118,678,000
三菱電機	139,900	1,504.00	210,409,600
富士電機	8,300	6,190.00	51,377,000
東洋電機製造	500	1,037.00	518,500
安川電機	15,000	5,500.00	82,500,000
シンフォニアテクノロジー	1,700	1,284.00	2,182,800
明電舎	2,200	2,690.00	5,918,000
オリジン	500	1,267.00	633,500
山洋電気	900	5,770.00	5,193,000
デンヨー	1,200	1,754.00	2,104,800
PHCホールディングス	1,600	2,041.00	3,265,600
ベイクレントコンサルティング	900	38,000.00	34,200,000
ORCHESTRA HLDGS	500	3,110.00	1,555,000
アイモバイル	500	1,189.00	594,500
キャリアインデックス	500	790.00	395,000
MS - Japan	500	904.00	452,000
船場	500	750.00	375,000
グレイステクノロジー	1,200	378.00	453,600
ジャパンエレベーターSHD	3,900	1,956.00	7,628,400
グリーンズ	500	468.00	234,000
ツナググループHLDGS	500	257.00	128,500
GAMEWITH	500	453.00	226,500
ソウルドアウト	500	1,119.00	559,500

MS & CONSULTING	100	746.00	74,600
ウェルビー	500	1,232.00	616,000
ミダックホールディングス	500	3,545.00	1,772,500
日総工産	1,000	833.00	833,000
キュービーネットHLDGS	500	1,675.00	837,500
RPAホールディングス	1,700	334.00	567,800
三桜工業	1,800	965.00	1,737,000
マキタ	17,000	4,826.00	82,042,000
東芝テック	1,300	4,540.00	5,902,000
芝浦メカトロニクス	400	9,290.00	3,716,000
マブチモーター	3,100	3,865.00	11,981,500
日本電産	36,300	12,915.00	468,814,500
ユーエムシーエレクトロニクス	1,000	450.00	450,000
トレックス・セミコンダクター	900	3,135.00	2,821,500
東光高岳	900	1,464.00	1,317,600
ダブル・スコープ	3,700	846.00	3,130,200
宮越ホールディングス	500	988.00	494,000
ダイヘン	1,300	4,565.00	5,934,500
ヤーマン	2,200	920.00	2,024,000
JVCケンウッド	12,000	181.00	2,172,000
ミマキエンジニアリング	1,200	882.00	1,058,400
I - P E X	500	1,937.00	968,500
日新電機	3,200	1,606.00	5,139,200
大崎電気	2,700	473.00	1,277,100
オムロン	11,500	10,790.00	124,085,000
日東工業	2,200	1,564.00	3,440,800
I D E C	1,700	2,669.00	4,537,300
正興電機製作所	500	1,183.00	591,500
ジーエス・ユアサ コーポ	4,900	2,529.00	12,392,100
サクサホールディングス	500	1,333.00	666,500
メルコホールディングス	500	3,940.00	1,970,000
テクノメディカ	500	1,652.00	826,000
ダイヤモンドエレクトリックHD	500	1,222.00	611,000
日本電気	17,700	5,240.00	92,748,000
富士通	12,600	18,760.00	236,376,000
沖電気	5,600	896.00	5,017,600
岩崎通信機	500	814.00	407,000
電気興業	900	2,433.00	2,189,700
サンケン電気	1,700	5,910.00	10,047,000
ナカヨ	400	1,156.00	462,400

アイホン	900	2,124.00	1,911,600
ルネサスエレクトロニクス	75,500	1,415.00	106,832,500
セイコーエプソン	17,200	2,062.00	35,466,400
ワコム	10,100	900.00	9,090,000
アルバック	2,700	6,720.00	18,144,000
アクセル	500	1,142.00	571,000
E I Z O	1,400	4,100.00	5,740,000
ジャパンディスプレイ	47,900	36.00	1,724,400
日本信号	3,200	905.00	2,896,000
京三製作所	3,200	448.00	1,433,600
能美防災	1,700	2,147.00	3,649,900
ホーチキ	1,000	1,268.00	1,268,000
星和電機	600	516.00	309,600
エレコム	3,200	1,500.00	4,800,000
パナソニック	149,200	1,315.50	196,272,600
シャープ	18,500	1,346.00	24,901,000
アンリツ	8,300	1,783.00	14,798,900
富士通ゼネラル	4,400	2,738.00	12,047,200
ソニーグループ	87,600	14,540.00	1,273,704,000
T D K	20,200	4,510.00	91,102,000
帝国通信工業	500	1,333.00	666,500
タムラ製作所	4,900	676.00	3,312,400
アルプスアルパイン	11,500	1,176.00	13,524,000
池上通信機	500	663.00	331,500
日本電波工業	1,200	1,570.00	1,884,000
鈴木	500	891.00	445,500
メイコー	1,000	4,565.00	4,565,000
日本トリム	500	3,265.00	1,632,500
ローランド ディー・ジー・	1,000	3,530.00	3,530,000
フオスタ - 電機	1,300	741.00	963,300
S M K	500	2,252.00	1,126,000
ヨコオ	1,400	2,850.00	3,990,000
ティアック	1,100	161.00	177,100
ホシデン	3,500	1,155.00	4,042,500
ヒロセ電機	2,200	18,320.00	40,304,000
日本航空電子	3,200	2,009.00	6,428,800
T O A	1,700	799.00	1,358,300
マクセル	2,700	1,419.00	3,831,300
古野電気	1,700	1,171.00	1,990,700
ユニデンホールディングス	500	3,550.00	1,775,000

スミダコーポレーション	1,200	1,190.00	1,428,000
アイコム	500	2,376.00	1,188,000
リオン	500	2,220.00	1,110,000
本多通信工業	1,000	428.00	428,000
横河電機	14,200	2,044.00	29,024,800
新電元工業	500	3,735.00	1,867,500
アズビル	8,200	5,100.00	41,820,000
東亜ディーケーケー	900	880.00	792,000
日本光電工業	5,700	3,060.00	17,442,000
チノール	500	1,635.00	817,500
共和電業	1,300	387.00	503,100
日本電子材料	500	2,926.00	1,463,000
堀場製作所	2,700	6,570.00	17,739,000
アドバンテスト	10,600	10,710.00	113,526,000
小野測器	500	486.00	243,000
エスベック	1,200	2,118.00	2,541,600
キーエンス	12,700	67,850.00	861,695,000
日置電機	900	7,890.00	7,101,000
シスメックス	11,800	12,710.00	149,978,000
日本マイクロニクス	2,600	1,760.00	4,576,000
メガチップス	1,300	4,865.00	6,324,500
OBARA GROUP	500	3,385.00	1,692,500
IMAGICA GROUP	1,400	617.00	863,800
デンソー	30,900	10,060.00	310,854,000
原田工業	500	978.00	489,000
コーセル	1,700	837.00	1,422,900
イリソ電子工業	1,200	4,410.00	5,292,000
オプテックスグループ	2,200	1,592.00	3,502,400
千代田インテグレ	500	1,992.00	996,000
アイ・オー・データ	500	757.00	378,500
レーザーテック	6,200	32,220.00	199,764,000
スタンレー電気	9,800	2,892.00	28,341,600
岩崎電気	500	2,293.00	1,146,500
ウシオ電機	7,100	1,852.00	13,149,200
岡谷電機	1,000	323.00	323,000
ヘリオステクノH	1,200	309.00	370,800
エノモト	500	1,798.00	899,000
日本セラミック	1,300	2,747.00	3,571,100
遠藤照明	1,000	1,044.00	1,044,000
古河電池	1,000	1,384.00	1,384,000

双信電機	1,000	808.00	808,000
山一電機	1,000	2,260.00	2,260,000
函 研	1,000	3,475.00	3,475,000
日本電子	2,700	7,800.00	21,060,000
カ シ オ	11,100	1,469.00	16,305,900
ファナック	12,400	24,775.00	307,210,000
日本シイエムケイ	3,200	657.00	2,102,400
エンプラス	500	2,820.00	1,410,000
大真空	2,000	1,411.00	2,822,000
ロ - ム	6,300	10,550.00	66,465,000
浜松ホトニクス	10,200	6,930.00	70,686,000
三井ハイテック	1,300	10,290.00	13,377,000
新光電気工業	4,900	5,310.00	26,019,000
京 セ ラ	19,700	7,176.00	141,367,200
太陽誘電	6,100	6,700.00	40,870,000
村田製作所	41,100	9,185.00	377,503,500
双葉電子工業	2,200	692.00	1,522,400
日東電工	8,400	9,020.00	75,768,000
北陸電気工業	500	1,428.00	714,000
東海理化電機	3,500	1,608.00	5,628,000
ニチコン	4,400	1,271.00	5,592,400
日本ケミコン	1,300	1,763.00	2,291,900
K O A	1,800	1,598.00	2,876,400
三井E & S H D	5,400	397.00	2,143,800
日立造船	11,000	807.00	8,877,000
三菱重工業	22,000	2,951.00	64,922,000
川崎重工業	11,000	2,208.00	24,288,000
I H I	9,300	2,417.00	22,478,100
名村造船所	4,400	214.00	941,600
サノヤホールディングス	1,700	125.00	212,500
スプリックス	500	1,651.00	825,500
マネジメントソリューションズ	500	3,305.00	1,652,500
プロレド・パートナーズ	400	914.00	365,600
A N D F A C T O R Y	400	388.00	155,200
フロンティア・マネジメント	400	692.00	276,800
カーブスホールディングス	3,500	750.00	2,625,000
フォーラムエンジニアリング	900	838.00	754,200
日本車輛	500	2,061.00	1,030,500
三菱ロジスネクスト	1,700	1,111.00	1,888,700
一家ホールディングス	400	513.00	205,200

フルサト・マルカHD	1,400	2,337.00	3,271,800
ヤマエグループHD	1,000	1,034.00	1,034,000
藤久ホールディングス	500	805.00	402,500
日産自動車	165,200	629.00	103,910,800
いすゞ自動車	43,900	1,477.00	64,840,300
トヨタ自動車	709,700	2,307.50	1,637,632,750
日野自動車	17,600	1,019.00	17,934,400
三菱自動車工業	51,700	335.00	17,319,500
エフテック	1,000	607.00	607,000
レシップホールディングス	500	565.00	282,500
GMB	400	776.00	310,400
ファルテック	500	701.00	350,500
武蔵精密工業	3,200	1,976.00	6,323,200
日産車体	2,200	722.00	1,588,400
新明和工業	3,900	891.00	3,474,900
極東開発工業	2,200	1,528.00	3,361,600
トピー工業	1,400	1,157.00	1,619,800
ティラド	500	2,915.00	1,457,500
曙ブレーキ	7,700	191.00	1,470,700
タチエス	2,200	1,306.00	2,873,200
N O K	6,600	1,297.00	8,560,200
フタバ産業	3,400	470.00	1,598,000
K Y B	1,700	3,265.00	5,550,500
市光工業	1,800	548.00	986,400
大同メタル工業	3,100	627.00	1,943,700
プレス工業	7,100	407.00	2,889,700
ミクニ	1,700	406.00	690,200
太平洋工業	3,100	1,260.00	3,906,000
河西工業	1,700	327.00	555,900
アイシン	10,100	4,725.00	47,722,500
マ ッ ダ	43,700	980.00	42,826,000
今仙電機製作所	1,200	598.00	717,600
本田技研	110,200	3,430.00	377,986,000
スズキ	32,000	4,635.00	148,320,000
S U B A R U	40,200	2,206.00	88,681,200
安永	900	929.00	836,100
ヤマハ発動機	18,100	2,962.00	53,612,200
小糸製作所	7,700	6,390.00	49,203,000
T B K	1,700	396.00	673,200
エクセディ	1,700	1,724.00	2,930,800

ミツバ	2,700	445.00	1,201,500
豊田合成	4,400	2,651.00	11,664,400
愛三工業	2,200	816.00	1,795,200
日本プラスト	1,400	561.00	785,400
ヨロズ	1,200	1,103.00	1,323,600
エフ・シー・シー	2,200	1,567.00	3,447,400
新家工業	500	1,678.00	839,000
シマノ	5,700	30,520.00	173,964,000
テイ・エス テック	6,600	1,496.00	9,873,600
ダイレクトマーケティングミクス	1,800	1,436.00	2,584,800
ポピンズホールディング	400	2,707.00	1,082,800
LITALICO	1,000	3,355.00	3,355,000
ジャムコ	1,000	928.00	928,000
小野建	1,200	1,670.00	2,004,000
はるやまHLDGS	500	496.00	248,000
南陽	500	1,867.00	933,500
ノジマ	2,700	2,384.00	6,436,800
佐鳥電機	1,000	1,079.00	1,079,000
カッパ・クリエイト	1,800	1,327.00	2,388,600
エコートレーディング	500	631.00	315,500
伯東	1,000	2,650.00	2,650,000
コンドーテック	1,000	1,022.00	1,022,000
中山福	900	357.00	321,300
ライトオン	1,000	711.00	711,000
ナガイレーベン	1,700	2,178.00	3,702,600
三菱食品	1,300	2,833.00	3,682,900
良品計画	15,900	1,724.00	27,411,600
三城ホールディングス	1,700	226.00	384,200
松田産業	1,000	2,392.00	2,392,000
第一興商	2,600	3,400.00	8,840,000
メディパルHD	13,700	2,113.00	28,948,100
アドヴァングループ	1,300	967.00	1,257,100
SPK	500	1,351.00	675,500
萩原電気HLDGS	500	2,010.00	1,005,000
アルビス	500	2,205.00	1,102,500
アズワン	1,800	6,910.00	12,438,000
スズデン	500	1,783.00	891,500
尾家産業	500	975.00	487,500
シモジマ	1,000	1,082.00	1,082,000
ドウシシャ	1,200	1,553.00	1,863,600

小津産業	500	1,943.00	971,500
コナカ	1,700	333.00	566,100
高速	900	1,555.00	1,399,500
G - 7ホールディングス	1,400	1,604.00	2,245,600
たけびし	500	1,464.00	732,000
イオン北海道	1,700	1,221.00	2,075,700
コジマ	2,200	513.00	1,128,600
ヒマラヤ	500	1,010.00	505,000
コーナン商事	1,800	3,385.00	6,093,000
ネットワンシステムズ	5,600	2,907.00	16,279,200
エコス	500	1,874.00	937,000
ワタミ	1,700	865.00	1,470,500
マルシェ	500	383.00	191,500
リックス	500	1,472.00	736,000
システムソフト	3,300	121.00	399,300
パンパシフィックHD	27,500	1,571.00	43,202,500
丸文	1,200	783.00	939,600
西松屋チェーン	3,200	1,362.00	4,358,400
ゼンショーホールディングス	7,600	2,694.00	20,474,400
ハピネット	1,400	1,490.00	2,086,000
幸楽苑ホールディングス	1,000	1,395.00	1,395,000
ハークスレイ	600	436.00	261,600
橋本総業HLDS	500	2,023.00	1,011,500
日本ライフライン	4,400	1,100.00	4,840,000
サイゼリヤ	2,200	2,804.00	6,168,800
タカショー	1,000	751.00	751,000
VTホールディングス	5,400	464.00	2,505,600
アルゴグラフィックス	1,000	3,260.00	3,260,000
魚力	500	2,018.00	1,009,000
IDOM	4,900	747.00	3,660,300
日本エム・ディ・エム	900	1,736.00	1,562,400
ポプラ	500	144.00	72,000
フジ・コーポレーション	1,000	1,180.00	1,180,000
ユナイテッドアローズ	1,700	1,785.00	3,034,500
進和	900	2,140.00	1,926,000
エスケイジャパン	500	453.00	226,500
ダイトロン	500	2,101.00	1,050,500
ハイデイ日高	2,200	1,707.00	3,755,400
シークス	1,700	1,510.00	2,567,000
YU-WA CREATION H	1,100	204.00	224,400

コロワイド	5,200	1,609.00	8,366,800
ピーシーデポコーポ	1,700	301.00	511,700
田中商事	500	641.00	320,500
オーハシテクニカ	900	1,347.00	1,212,300
壱番屋	1,000	4,605.00	4,605,000
白銅	500	2,890.00	1,445,000
トップカルチャー	600	278.00	166,800
P L A N T	500	715.00	357,500
スギホールディングス	2,700	6,930.00	18,711,000
薬王堂ホールディングス	500	2,187.00	1,093,500
島津製作所	18,100	4,335.00	78,463,500
J M S	1,200	608.00	729,600
クボテック	500	275.00	137,500
長野計器	1,000	1,522.00	1,522,000
ブイ・テクノロジー	500	3,600.00	1,800,000
スター精密	2,200	1,551.00	3,412,200
東京計器	1,000	1,014.00	1,014,000
インターアクション	900	2,424.00	2,181,600
オーバル	1,200	253.00	303,600
東京精密	2,200	5,000.00	11,000,000
マニー	5,600	1,580.00	8,848,000
ニコン	21,100	1,290.00	27,219,000
トプコン	7,100	1,592.00	11,303,200
オリンパス	73,300	2,525.00	185,082,500
理研計器	1,200	5,380.00	6,456,000
S C R E E Nホールディングス	2,200	12,200.00	26,840,000
キヤノン電子	1,200	1,626.00	1,951,200
タムロン	1,000	2,868.00	2,868,000
H O Y A	27,400	16,180.00	443,332,000
シ ー ド	500	559.00	279,500
ノーリツ鋼機	1,200	2,527.00	3,032,400
エー・アンド・デイ	1,200	1,152.00	1,382,400
朝日インテック	15,400	2,303.00	35,466,200
キヤノン	69,400	2,804.00	194,597,600
リ コ ー	35,700	1,063.00	37,949,100
シチズン時計	17,700	497.00	8,796,900
リズム	500	1,227.00	613,500
大研医器	1,400	543.00	760,200
メニコン	4,400	3,060.00	13,464,000
中本パックス	500	1,723.00	861,500

スノーピーク	1,800	2,865.00	5,157,000
パラマウントベッドHD	2,600	1,935.00	5,031,000
トランザクション	900	1,048.00	943,200
粧美堂	500	386.00	193,000
ニホンフラッシュ	1,200	1,041.00	1,249,200
前田工織	1,300	3,680.00	4,784,000
永大産業	1,700	285.00	484,500
アートネイチャー	1,200	707.00	848,400
バンダイナムコHLDGS	12,500	8,627.00	107,837,500
アイフィスジャパン	500	693.00	346,500
共立印刷	2,200	136.00	299,200
SHOEI	1,200	4,485.00	5,382,000
フランスベッドHLDGS	1,700	901.00	1,531,700
マーベラス	2,200	721.00	1,586,200
パイロットコーポレーション	2,300	4,210.00	9,683,000
萩原工業	900	1,258.00	1,132,200
エイベックス	2,200	1,363.00	2,998,600
トッパン・フォームズ	2,700	1,548.00	4,179,600
フジシールインターナショナル	3,100	2,220.00	6,882,000
タカラトミー	6,200	1,123.00	6,962,600
広済堂ホールディングス	1,000	752.00	752,000
エステールホールディングス	500	630.00	315,000
レック	1,700	881.00	1,497,700
タカノ	500	709.00	354,500
三光合成	1,300	395.00	513,500
プロネクサス	800	1,088.00	870,400
ホクシン	1,100	151.00	166,100
ウッドワン	500	1,051.00	525,500
大建工業	1,000	2,144.00	2,144,000
きもと	2,200	224.00	492,800
凸版印刷	21,100	2,123.00	44,795,300
大日本印刷	16,400	2,865.00	46,986,000
共同印刷	500	2,848.00	1,424,000
NISSHA	3,100	1,614.00	5,003,400
藤森工業	1,200	4,190.00	5,028,000
ヴィア・ホールディングス	1,700	144.00	244,800
TAKARA & COMPANY	900	1,945.00	1,750,500
前澤化成工業	1,000	1,285.00	1,285,000
未来工業	500	1,552.00	776,000
アシックス	12,300	2,444.00	30,061,200

ツ ツ ミ	500	1,864.00	932,000
ウェーブロックHLDGS	500	737.00	368,500
ジェイ エス ピー	1,000	1,634.00	1,634,000
ニ チ ハ	1,800	3,010.00	5,418,000
ローランド	900	3,765.00	3,388,500
エフピコ	2,700	3,910.00	10,557,000
小松ウオール工業	500	1,928.00	964,000
ヤマハ	8,300	5,580.00	46,314,000
河合楽器	500	3,280.00	1,640,000
クリナップ	1,200	543.00	651,600
ピジョン	8,500	2,377.00	20,204,500
天馬	1,000	2,616.00	2,616,000
キングジム	1,400	885.00	1,239,000
象印マホービン	3,900	1,395.00	5,440,500
リンテック	3,200	2,688.00	8,601,600
信越ポリマー	2,200	1,110.00	2,442,000
東 リ	3,400	214.00	727,600
イトーキ	2,800	350.00	980,000
任 天 堂	7,900	53,800.00	425,020,000
三菱鉛筆	2,200	1,224.00	2,692,800
松 風	500	1,969.00	984,500
タカラスタンダ - ド	3,100	1,426.00	4,420,600
コ ク ヨ	6,600	1,731.00	11,424,600
ナカバヤシ	1,300	514.00	668,200
ニ フ コ	5,300	3,780.00	20,034,000
立川ブラインド	500	1,129.00	564,500
グローブライド	1,400	3,075.00	4,305,000
オカムラ	4,900	1,281.00	6,276,900
バルカー	1,400	2,675.00	3,745,000
伊 藤 忠	96,400	3,564.00	343,569,600
丸 紅	136,000	1,118.50	152,116,000
スクロール	1,800	848.00	1,526,400
ヨンドシーホールディングス	1,200	1,694.00	2,032,800
三陽商会	900	859.00	773,100
長瀬産業	7,600	1,895.00	14,402,000
ナイガイ	600	300.00	180,000
蝶 理	1,000	1,830.00	1,830,000
豊田通商	13,700	5,340.00	73,158,000
オンワ - ドホールディングス	8,300	301.00	2,498,300
三共生興	2,200	561.00	1,234,200

兼 松	5,400	1,288.00	6,955,200
美 津 濃	1,300	2,216.00	2,880,800
ツカモトコーポレーション	400	1,284.00	513,600
ルックホールディングス	500	1,196.00	598,000
三井物産	107,200	2,785.50	298,605,600
日本紙パルプ	900	4,060.00	3,654,000
東京エレクトロン	8,900	64,920.00	577,788,000
カメイ	1,700	1,056.00	1,795,200
スターゼン	1,000	2,001.00	2,001,000
セイコーHD	1,800	2,207.00	3,972,600
山 善	5,400	1,049.00	5,664,600
椿本興業	400	4,140.00	1,656,000
住友商事	87,000	1,708.50	148,639,500
日本ユニシス	4,900	3,060.00	14,994,000
内田洋行	500	5,100.00	2,550,000
三菱商事	103,300	3,771.00	389,544,300
第一実業	500	4,880.00	2,440,000
キヤノンマーケティングJPN	3,400	2,293.00	7,796,200
西華産業	900	1,623.00	1,460,700
佐藤商事	1,400	1,163.00	1,628,200
菱洋エレクトロ	1,000	2,399.00	2,399,000
東京産業	1,200	770.00	924,000
ユアサ商事	1,300	2,940.00	3,822,000
神鋼商事	500	3,375.00	1,687,500
トルク	1,100	205.00	225,500
阪和興業	2,700	3,195.00	8,626,500
正栄食品	900	3,820.00	3,438,000
カナデン	1,400	1,032.00	1,444,800
菱電商事	1,000	1,775.00	1,775,000
ニプロ	10,500	1,074.00	11,277,000
岩谷産業	3,100	5,840.00	18,104,000
ナイス	500	1,738.00	869,000
極東貿易	500	2,557.00	1,278,500
アステナホールディングス	1,700	484.00	822,800
兼松エレクトロニクス	900	3,870.00	3,483,000
三愛石油	3,400	1,347.00	4,579,800
稲畑産業	3,200	1,685.00	5,392,000
G S Iクレオス	1,000	1,239.00	1,239,000
明和産業	1,200	1,117.00	1,340,400
クワザワホールディングス	500	615.00	307,500

キムラタン	7,600	18.00	136,800	
ゴ-ルドウイン	2,200	6,430.00	14,146,000	
ユニ・チャ-ム	27,000	4,878.00	131,706,000	
デサント	2,200	4,105.00	9,031,000	
キング	1,000	528.00	528,000	
ワキタ	2,700	1,073.00	2,897,100	
ヤマトインタ-ナショナル	1,500	286.00	429,000	
東邦ホールディングス	4,400	1,704.00	7,497,600	
サンゲツ	3,500	1,630.00	5,705,000	
ミツウロコグループ	2,200	1,173.00	2,580,600	
シナネンホールディングス	500	3,465.00	1,732,500	
伊藤忠エネクス	3,200	1,009.00	3,228,800	
サンリオ	3,900	2,401.00	9,363,900	
サンワテクノス	1,000	1,474.00	1,474,000	
リョ-サン	1,300	2,260.00	2,938,000	
新光商事	1,800	894.00	1,609,200	
トーホ-	500	1,225.00	612,500	
三信電気	900	1,465.00	1,318,500	
東陽テクニカ	1,300	1,112.00	1,445,600	
モスフードサービス	1,800	3,095.00	5,571,000	
加賀電子	1,200	3,190.00	3,828,000	
三益半導体	1,000	2,577.00	2,577,000	
都築電気	500	1,688.00	844,000	
ソーダニツカ	1,200	809.00	970,800	
立花エレテック	1,000	1,562.00	1,562,000	
木曽路	1,700	2,190.00	3,723,000	
S R Sホールディングス	1,700	759.00	1,290,300	
千趣会	2,700	388.00	1,047,600	
タカキュー	1,200	116.00	139,200	
リテールパートナーズ	1,700	1,337.00	2,272,900	
ケーヨー	2,700	851.00	2,297,700	
上新電機	1,700	2,110.00	3,587,000	
日本瓦斯	6,600	1,606.00	10,599,600	
ロイヤルホールディングス	2,200	1,822.00	4,008,400	
いなげや	1,300	1,373.00	1,784,900	
チヨダ	1,300	780.00	1,014,000	
ライフコーポレーション	1,200	3,315.00	3,978,000	
リンガーハット	1,700	2,167.00	3,683,900	
MrMaxHD	1,700	611.00	1,038,700	
テンアライド	1,200	305.00	366,000	

AOKIホールディングス	2,800	617.00	1,727,600
オークワ	2,200	941.00	2,070,200
コメリ	2,200	2,575.00	5,665,000
青山商事	3,200	685.00	2,192,000
しまむら	1,700	9,580.00	16,286,000
はせがわ	900	283.00	254,700
高島屋	10,000	1,069.00	10,690,000
松屋	3,200	807.00	2,582,400
エイチ・ツー・オーリテイリング	6,600	800.00	5,280,000
近鉄百貨店	500	2,576.00	1,288,000
丸井グループ	11,500	2,196.00	25,254,000
アクシアルリテイリング	1,400	3,370.00	4,718,000
井筒屋	1,100	372.00	409,200
イオン	52,900	2,682.50	141,904,250
イズミ	2,700	3,265.00	8,815,500
フォーバル	500	902.00	451,000
平和堂	2,700	1,939.00	5,235,300
フジ	1,700	1,938.00	3,294,600
ヤオコー	1,700	6,860.00	11,662,000
ゼビオホールディングス	1,700	911.00	1,548,700
ケーズホールディングス	12,100	1,092.00	13,213,200
PALTAC	2,200	4,650.00	10,230,000
三谷産業	1,700	317.00	538,900
OLYMPICグループ	900	691.00	621,900
日産東京販売HD	2,200	229.00	503,800
アドバンテッジリスクマネ	900	871.00	783,900
三井不動産	62,800	2,305.50	144,785,400
三菱地所	90,500	1,611.00	145,795,500
平和不動産	2,200	3,955.00	8,701,000
東京建物	13,700	1,703.00	23,331,100
ダイビル	3,500	2,206.00	7,721,000
京阪神ビルディング	2,200	1,533.00	3,372,600
住友不動産	29,000	3,394.00	98,426,000
太平洋興発	500	628.00	314,000
テーオーシー	2,700	675.00	1,822,500
レオパレス21	11,500	177.00	2,035,500
スターツコーポレーション	1,700	2,473.00	4,204,100
フジ住宅	1,700	683.00	1,161,100
空港施設	1,300	544.00	707,200
明和地所	500	597.00	298,500

ゴールドクレスト	1,200	1,607.00	1,928,400
リログループ	7,500	1,978.00	14,835,000
エスリード	500	1,703.00	851,500
日神グループHLDGS	2,200	503.00	1,106,600
日本エスコ	2,700	775.00	2,092,500
タカラレーベン	5,700	293.00	1,670,100
AVANTIA	900	895.00	805,500
イオンモール	7,100	1,630.00	11,573,000
毎日コムネット	500	710.00	355,000
ファースト住建	500	1,201.00	600,500
ランド	75,000	10.00	750,000
カチタス	3,400	4,080.00	13,872,000
東祥	1,000	1,512.00	1,512,000
トーセイ	1,700	1,009.00	1,715,300
穴吹興産	500	1,905.00	952,500
サンフロンティア不動産	1,700	1,001.00	1,701,700
FJネクストホールディングス	1,200	1,005.00	1,206,000
インテリックス	500	644.00	322,000
ランドビジネス	600	270.00	162,000
サンネクスタグループ	500	1,017.00	508,500
グランディハウス	1,000	493.00	493,000
東武鉄道	14,500	2,638.00	38,251,000
相鉄ホールディングス	4,900	2,069.00	10,138,100
東急	35,300	1,525.00	53,832,500
京浜急行	18,100	1,141.00	20,652,100
小田急電鉄	20,800	2,113.00	43,950,400
京王電鉄	7,900	5,030.00	39,737,000
京成電鉄	10,500	2,997.00	31,468,500
富士急行	1,800	3,955.00	7,119,000
新京成電鉄	500	2,030.00	1,015,000
東日本旅客鉄道	24,700	6,821.00	168,478,700
西日本旅客鉄道	17,000	4,777.00	81,209,000
東海旅客鉄道	11,500	14,785.00	170,027,500
西武ホールディングス	16,700	1,056.00	17,635,200
鴻池運輸	2,200	1,217.00	2,677,400
西日本鉄道	3,900	2,551.00	9,948,900
ハマキョウレックス	1,000	2,896.00	2,896,000
サカイ引越センター	500	4,370.00	2,185,000
近鉄グループHLDGS	13,200	3,225.00	42,570,000
阪急阪神HLDGS	17,600	3,240.00	57,024,000

南海電鉄	6,200	2,174.00	13,478,800
京阪ホールディングス	5,700	2,675.00	15,247,500
神戸電鉄	500	3,155.00	1,577,500
名古屋鉄道	11,000	1,808.00	19,888,000
山陽電鉄	1,000	2,000.00	2,000,000
アルプス物流	1,000	1,051.00	1,051,000
トランコム	400	8,680.00	3,472,000
ヤマトホールディングス	18,600	2,688.00	49,996,800
山 九	3,400	4,775.00	16,235,000
日 新	1,000	1,641.00	1,641,000
丸 運	1,100	252.00	277,200
丸全昭和運輸	1,000	3,185.00	3,185,000
センコーグループHLDGS	7,500	937.00	7,027,500
トナミホールディングス	500	3,750.00	1,875,000
ニッコンホールディングス	4,400	2,170.00	9,548,000
福山通運	1,700	3,835.00	6,519,500
セイノーホールディングス	9,800	1,155.00	11,319,000
エスライン	500	893.00	446,500
神奈川中央交通	500	3,345.00	1,672,500
日立物流	2,700	5,340.00	14,418,000
丸和運輸機関	2,700	1,498.00	4,044,600
C & F ロジホールディングス	1,200	1,565.00	1,878,000
日本郵船	11,000	9,330.00	102,630,000
商船三井	7,300	9,190.00	67,087,000
川崎汽船	3,900	7,860.00	30,654,000
NSユニテッド海運	500	3,540.00	1,770,000
明治海運	1,300	758.00	985,400
飯野海運	6,100	553.00	3,373,300
九州旅客鉄道	10,100	2,337.00	23,603,700
SGホールディングス	25,200	2,645.00	66,654,000
NIPPON EXPRESS	4,400	7,290.00	32,076,000
日本航空	30,400	2,141.00	65,086,400
ANAホールディングス	33,700	2,372.00	79,936,400
パスコ	400	1,328.00	531,200
TREホールディングス	2,100	1,593.00	3,345,300
人・夢・技術グループ	500	1,855.00	927,500
西本WISMETTACHD	500	3,060.00	1,530,000
シルバーライフ	400	1,232.00	492,800
GENKY DRUGSTORES	500	5,040.00	2,520,000
コア商事HLDGS	1,000	651.00	651,000

国際紙パルプ商事	3,300	321.00	1,059,300
ナルミヤ・インターナショナル	400	966.00	386,400
ブックオフGHD	900	1,004.00	903,600
三菱倉庫	4,400	2,827.00	12,438,800
三井倉庫HOLD	1,300	2,474.00	3,216,200
住友倉庫	4,900	1,932.00	9,466,800
渋沢倉庫	900	2,230.00	2,007,000
ヤマタネ	500	1,609.00	804,500
東陽倉庫	2,200	316.00	695,200
乾汽船	900	2,562.00	2,305,800
日本トランスシティ	3,200	626.00	2,003,200
ケイヒン	400	1,379.00	551,600
中央倉庫	900	979.00	881,100
川西倉庫	400	1,060.00	424,000
安田倉庫	1,000	967.00	967,000
ファイズホールディングス	400	550.00	220,000
東洋埠頭	500	1,416.00	708,000
宇徳	1,000	724.00	724,000
上組	7,400	2,215.00	16,391,000
サンリツ	500	867.00	433,500
キムラユニティー	500	1,302.00	651,000
キューソー流通システム	1,000	903.00	903,000
近鉄エクスプレス	2,700	3,005.00	8,113,500
東海運	900	307.00	276,300
エーアイテイー	1,000	1,420.00	1,420,000
内外トランスライン	500	2,092.00	1,046,000
ショーエイコーポ	500	662.00	331,000
日本コンセプト	500	1,684.00	842,000
TBSホールディングス	9,300	1,619.00	15,056,700
日本テレビHLD S	11,500	1,200.00	13,800,000
朝日放送グループHD	1,300	698.00	907,400
テレビ朝日HD	4,400	1,431.00	6,296,400
スカパーJ S A T H D	8,900	429.00	3,818,100
テレビ東京HD	1,000	2,024.00	2,024,000
日本BS放送	500	1,112.00	556,000
ビジョン	2,100	1,071.00	2,249,100
スマートバリュー	500	481.00	240,500
USEN-NEXT HLDGS	1,200	2,812.00	3,374,400
ワイヤレスゲート	500	339.00	169,500
コネクシオ	900	1,447.00	1,302,300

日本通信	12,000	191.00	2,292,000
クロップス	500	973.00	486,500
日本電信電話	143,800	3,295.00	473,821,000
KDDI	100,100	3,524.00	352,752,400
ソフトバンク	208,100	1,455.50	302,889,550
光通信	1,800	17,620.00	31,716,000
エムティーアイ	1,200	616.00	739,200
GMOインターネット	4,900	2,623.00	12,852,700
ファイバーゲート	500	1,133.00	566,500
アイドママーケティングコミュ	500	289.00	144,500
KADOKAWA	7,000	2,689.00	18,823,000
学研ホールディングス	1,700	1,036.00	1,761,200
ゼンリン	2,700	1,016.00	2,743,200
昭文社ホールディングス	600	442.00	265,200
インプレスホールディングス	1,600	214.00	342,400
東京電力HD	104,800	294.00	30,811,200
中部電力	42,900	1,210.00	51,909,000
関西電力	52,900	1,099.00	58,137,100
中国電力	20,300	931.00	18,899,300
北陸電力	12,800	583.00	7,462,400
東北電力	32,600	809.00	26,373,400
四国電力	11,500	809.00	9,303,500
九州電力	30,900	852.00	26,326,800
北海道電力	13,200	510.00	6,732,000
沖縄電力	2,700	1,432.00	3,866,400
電源開発	11,000	1,462.00	16,082,000
エフオン	1,000	619.00	619,000
イーレックス	2,200	1,871.00	4,116,200
レノバ	2,200	1,830.00	4,026,000
東京瓦斯	26,900	2,104.00	56,597,600
大阪瓦斯	25,300	1,950.00	49,335,000
東邦瓦斯	7,100	3,010.00	21,371,000
北海道瓦斯	900	1,509.00	1,358,100
広島ガス	3,200	360.00	1,152,000
西部ガスHLDGS	1,700	2,132.00	3,624,400
静岡ガス	3,500	1,012.00	3,542,000
メタウォーター	1,700	1,975.00	3,357,500
アイネット	900	1,330.00	1,197,000
松竹	900	11,720.00	10,548,000
東宝	7,900	4,705.00	37,169,500

エイチ・アイ・エス	3,100	1,805.00	5,595,500
東映	400	16,100.00	6,440,000
ラックランド	500	2,901.00	1,450,500
NTTデータ	36,800	2,295.00	84,456,000
共立メンテナンス	2,200	3,815.00	8,393,000
イチネンホールディングス	1,300	1,322.00	1,718,600
建設技術研究所	1,000	2,456.00	2,456,000
スペース	1,000	909.00	909,000
アインホールディングス	2,200	5,850.00	12,870,000
燦ホールディングス	500	1,507.00	753,500
ピー・シー・エー	400	1,595.00	638,000
東京テアトル	500	1,205.00	602,500
タナベ経営	400	661.00	264,400
ビジネスB太田昭和	500	1,804.00	902,000
ナガワ	400	10,640.00	4,256,000
東京都競馬	1,000	4,050.00	4,050,000
常磐興産	500	1,360.00	680,000
カナモト	2,200	2,418.00	5,319,600
DTS	2,700	2,458.00	6,636,600
スクウェア・エニックス・HD	5,700	5,980.00	34,086,000
シーイーシー	1,300	1,070.00	1,391,000
カプコン	12,000	2,575.00	30,900,000
西尾レントオール	1,200	2,806.00	3,367,200
アイ・エス・ビー	500	969.00	484,500
アゴーラホスピタリティーズG	8,100	22.00	178,200
日本空港ビルデング	4,900	4,530.00	22,197,000
トランス・コスモス	1,200	3,195.00	3,834,000
乃村工藝社	5,700	907.00	5,169,900
ジャステック	1,000	1,029.00	1,029,000
SCSK	9,900	2,203.00	21,809,700
藤田観光	500	2,244.00	1,122,000
KNT-CTホールディングス	900	1,311.00	1,179,900
日本管財	1,300	2,820.00	3,666,000
トーカイ	1,200	1,981.00	2,377,200
セコム	13,200	7,929.00	104,662,800
日本システムウエア	500	2,266.00	1,133,000
セントラル警備保障	500	2,375.00	1,187,500
アイネス	1,200	1,517.00	1,820,400
丹青社	2,700	771.00	2,081,700
メイテック	1,700	6,650.00	11,305,000

T K C	2,200	3,265.00	7,183,000
富士ソフト	1,300	5,300.00	6,890,000
応用地質	1,300	2,075.00	2,697,500
船井総研ホールディング	2,700	2,333.00	6,299,100
N S D	4,400	1,991.00	8,760,400
進学会ホールディングス	500	294.00	147,000
オ オ バ	1,000	769.00	769,000
コナミホールディングス	4,900	5,540.00	27,146,000
いであ	500	1,762.00	881,000
学 究 社	500	1,535.00	767,500
ベネッセホールディングス	4,900	2,243.00	10,990,700
イオンディライト	1,700	3,215.00	5,465,500
ナック	500	956.00	478,000
福井コンピュータH L D S	500	3,195.00	1,597,500
ダイセキ	2,600	4,370.00	11,362,000
ステップ	500	1,934.00	967,000
日鉄物産	900	5,160.00	4,644,000
泉州電業	500	6,360.00	3,180,000
元気寿司	500	2,496.00	1,248,000
トラスコ中山	2,800	2,679.00	7,501,200
ヤマダホールディングス	46,300	395.00	18,288,500
オートバックスセブン	4,900	1,410.00	6,909,000
モリト	1,000	735.00	735,000
アークランドサカモト	2,200	1,613.00	3,548,600
ニトリホールディングス	5,300	17,460.00	92,538,000
グルメ杵屋	1,000	988.00	988,000
愛 眼	1,200	176.00	211,200
ケーユーホールディングス	900	1,063.00	956,700
吉野家ホールディングス	4,400	2,257.00	9,930,800
加藤産業	2,200	3,365.00	7,403,000
北恵	500	914.00	457,000
イノテック	900	1,597.00	1,437,300
イエローハット	2,700	1,643.00	4,436,100
松屋フーズH L D G S	700	3,590.00	2,513,000
J B C Cホールディングス	1,000	1,712.00	1,712,000
J Kホールディングス	1,200	1,074.00	1,288,800
サガミホールディングス	2,100	1,026.00	2,154,600
日 伝	1,200	2,219.00	2,662,800
関西スーパーマーケット	1,000	1,030.00	1,030,000
ミロク情報サービス	1,300	1,327.00	1,725,100

北沢産業	1,000	231.00	231,000	
杉本商事	900	2,311.00	2,079,900	
因幡電機産業	3,500	2,739.00	9,586,500	
王将フードサービス	900	6,020.00	5,418,000	
プレナス	1,300	2,019.00	2,624,700	
ミニストップ	1,000	1,407.00	1,407,000	
アークス	2,700	2,138.00	5,772,600	
パローホールディングス	2,700	2,142.00	5,783,400	
東 テ ク	500	2,467.00	1,233,500	
ミスミグループ本社	17,200	4,355.00	74,906,000	
アルテック	1,000	268.00	268,000	
ベ ル ク	900	5,520.00	4,968,000	
大 庄	900	970.00	873,000	
タキヒヨー	500	1,528.00	764,000	
ファーストリテイリング	1,800	60,670.00	109,206,000	
ソフトバンクグループ	82,400	5,489.00	452,293,600	
蔵王産業	400	1,837.00	734,800	
スズケン	5,700	3,300.00	18,810,000	
サンドラッグ	5,400	3,050.00	16,470,000	
サックスパーホールディング	1,200	513.00	615,600	
ジェコス	1,000	814.00	814,000	
ヤマザワ	500	1,600.00	800,000	
や ま や	500	2,435.00	1,217,500	
グローセル	1,300	405.00	526,500	
ベルーナ	3,100	708.00	2,194,800	
合計			34,585,561,050	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年1月31日

資産総額	32,791,326,293円
負債総額	71,810,468円
純資産総額（ - ）	32,719,515,825円
発行済数量	21,987,080口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1,488.12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

2022年1月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. 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。

2022年1月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	65	192,036
追加型株式投資信託	781	20,567,313
株式投資信託 合計	846	20,759,349
単位型公社債投資信託	78	213,110
追加型公社債投資信託	14	1,441,583
公社債投資信託 合計	92	1,654,693
総合計	938	22,414,042

3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）は、改政府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第62期事業年度（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。

また、第63期事業年度に係る中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (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	217	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 3,530	2 3,617
未払費用	3,830	3,777
未払法人税等	656	804
未払消費税等	590	631
賞与引当金	688	950
その他	5	88
流動負債計	13,414	14,725
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					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	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 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	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
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	363	363	38,430
当期変動額			
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) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

6. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2

月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

(追加情報)

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。この結果、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日)第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(未適用の会計基準等)

収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2018年3月30日)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2018年3月30日)

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

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

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

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

(注記に関する表示方法の変更)

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

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

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

3 保証債務

前事業年度(2020年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2021年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				

普通株式	2,608	-	-	2,608
合 計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年 3月31日	2019年 6月24日

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

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

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

効力発生日

2021年6月23日

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

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

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

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

前事業年度(2020年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表	計上額	時価	差額
投資有価証券(1)		60	60	-
資産合計		60	60	-

(1) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券267百万円、投資有価証券8,426百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

当事業年度(2021年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

(1) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表さ

れている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

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

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

2．その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	60	55	5
（2）その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	764
小計	27,589	28,354	764
合計	30,654	31,181	526

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

当事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	85	55	30

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	183	378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,574百万円	2,452百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,574	2,452
退職給付引当金	2,574	2,452
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,574	2,452

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (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	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	19,300 0	関係会社短期貸付金 -	18,700 -

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,603	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,727	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)(注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	16,953	未払手数料	2,984
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,031	未払費用	224
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,061	長期差入保証金	1,054

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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㈱	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	㈱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㈱	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す。

(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。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2021年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		2,139
有価証券		250
未収委託者報酬		13,857
関係会社短期貸付金		16,300
その他		369
流動資産合計		32,916
固定資産		

有形固定資産	1	211
無形固定資産		
ソフトウェア		1,633
その他		134
無形固定資産合計		1,768
投資その他の資産		
投資有価証券		11,373
関係会社株式		3,705
繰延税金資産		786
その他		1,246
投資その他の資産合計		17,111
固定資産合計		19,091
資産合計		52,007

(単位:百万円)

当中間会計期間
(2021年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		7,322
未払費用		3,879
未払法人税等		795
賞与引当金		711
その他	2	927

流動負債合計		13,635
--------	--	--------

固定負債

退職給付引当金		2,475
役員退職慰労引当金		92
その他		2

固定負債合計		2,571
--------	--	-------

負債合計

負債合計		16,206
------	--	--------

純資産の部

株主資本

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

利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,594
利益剰余金合計	7,968
株主資本合計	34,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,162
評価・換算差額等合計	1,162
純資産合計	35,801
負債・純資産合計	52,007

(2)中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		37,075
その他営業収益		295
営業収益合計		37,371
営業費用		
支払手数料		15,707
その他営業費用		6,525
営業費用合計		22,233
一般管理費	1	5,737
営業利益		9,400
営業外収益	2	228
営業外費用	3	87
経常利益		9,540
特別利益		-
特別損失	4	129
税引前中間純利益		9,411
法人税、住民税及び事業税		2,910
法人税等調整額		92
中間純利益		6,407

(3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	9,388	9,388	9,388
中間純利益	-	-	-	6,407	6,407	6,407
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	2,980	2,980	2,980
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,594	7,968	34,638

	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	947	947	38,566
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	9,388
中間純利益	-	-	6,407
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	214	214	214
当中間期変動額合計	214	214	2,765
当中間期末残高	1,162	1,162	35,801

注記事項

(重要な会計方針)

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（２）無形固定資産

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

3．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

4．収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

当社は投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。

当社の日々のサービス提供時に当履行義務が充足されるため、一定期間にわたり収益を認識しております。

5. 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。

6. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

7. 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。

(会計方針の変更)

(収益認識に関する会計基準等の適用)

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。これによる当中間会計期間の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2021年9月30日現在)
有形固定資産	307百万円

2 消費税等の取扱い

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

3 保証債務

当中間会計期間(2021年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,726百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
有形固定資産	12百万円
無形固定資産	289百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
投資有価証券売却益	117百万円
時効成立分配金・償還金	28百万円
受取配当金	26百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
投資有価証券売却損	58百万円
未収入金清算費用	9百万円

4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
投資有価証券評価損	102百万円
出資金評価損	27百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

合計	2,608	-	-	2,608
----	-------	---	---	-------

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2021年6月22日 定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年3月31日	2021年6月23日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、2019年7月4日公表の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、「2019年適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

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

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

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	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) 2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券250百万円、投資有価証券10,621百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、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、2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価格によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

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

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,677
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2021年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額（百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	85	55	30
（2）その他	7,691	5,841	1,850
小計	7,777	5,896	1,881
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,179	3,398	219
小計	3,179	3,398	219
合計	10,956	9,294	1,661

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

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

注記事項（セグメント情報等）に記載のとおり、単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えており、かつ、内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、セグメント情報に追加しての記載は行っておりません。

〔セグメント情報等〕

〔セグメント情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

〔関連情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

〔1株当たり情報〕

当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,724.67円

1株当たり中間純利益

2,456.52円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
中間純利益(百万円)	6,407
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,407
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(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)	
	クレディ・スイス証券株式会社	78,100百万円	(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)	
	J P モルガン証券株式会社	73,272百万円	(注1)	
	シティグループ証券株式会社	96,307百万円	(注1)	
	野村証券株式会社	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)	
	モルガン・スタンレーM U F G証券株式会社	62,149百万円	(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10月1日	有価証券報告書、有価証券届出書

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

2022年2月10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 知明指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 宮田 世紀**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financialsの2021年7月11日から2022年1月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financialsの2022年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月25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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井	康治

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。