

【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】	2023年4月3日提出
【計算期間】	第19計算期間 (自 2022年7月11日 至 2023年1月10日)
【ファンド名】	ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials 2023年4月4日付けで、ファンドの名称を「iFreeETF TOPIX Ex-Financials」に変更します。
【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
	海外	債券	MRF	
追加型投信	内外	不動産投信	ETF	特殊型
		その他資産 ()		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	対象インデックス
株式	年1回	グローバル	
一般		日本	日経225
大型株	年2回	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		アフリカ	その他 (TOPIX Ex-Financials)
その他債券	日々	中近東 (中東)	
クレジット属性 ()	その他 ()	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、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として算出しております(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の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X 総研または株式会社J P X 総研の関連会社(以下「J P X」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。
- ② J P Xは、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは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 J P Xは、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ J P Xは、同指数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、J P Xは、同指数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 本件商品は、J P X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 J P Xは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦ J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および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、J P Xは本件商品の設定、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
2023年4月4日	ファンドの名称を「iFreeETF TOPIX Ex-Financials」に変更（従来は「ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials」）

(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（2023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す。)

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

委託会社は、信託財産を、主として株式に投資することを指図します。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

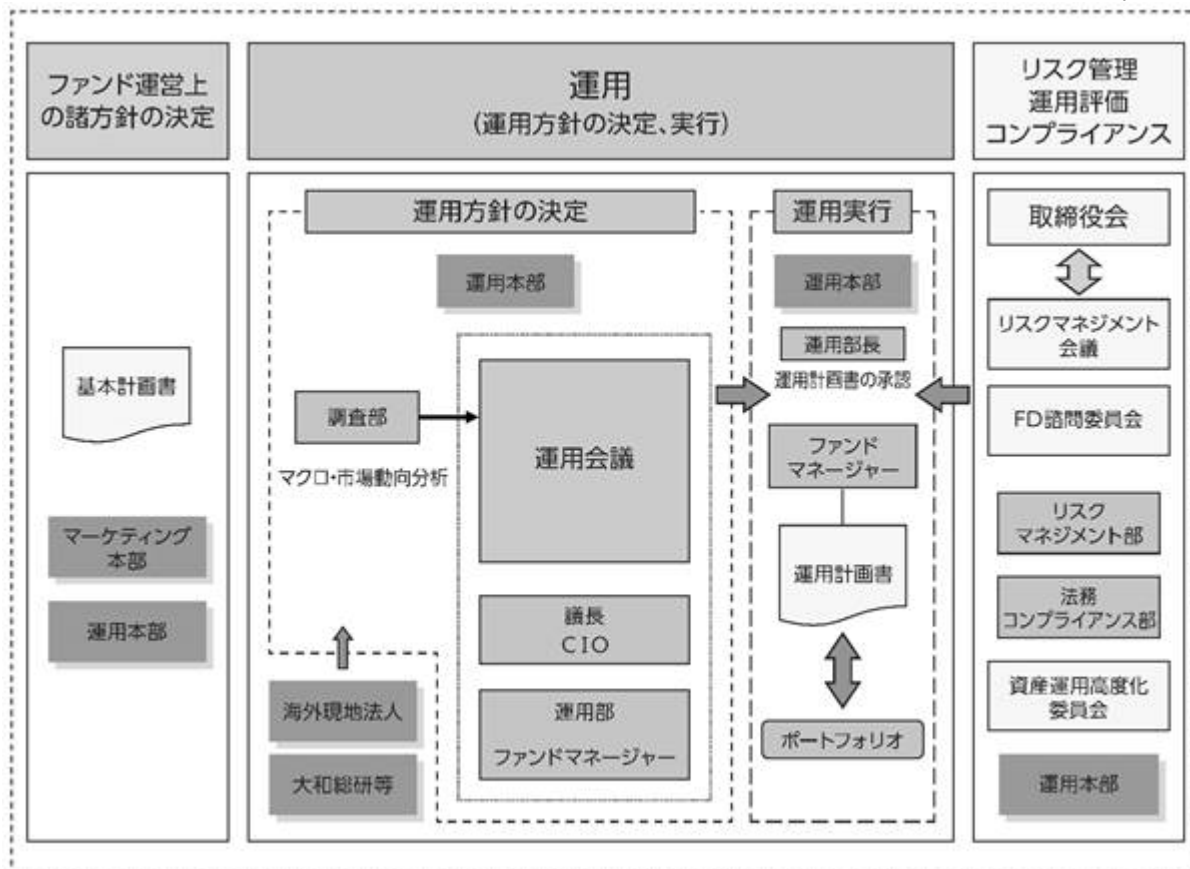
4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3)【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO (Chief Investment Officer) (1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35～45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2023年1月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

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

(5)【投資制限】

株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資する株式の範囲（信託約款）

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

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

先物取引等（信託約款）

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

デリバティブ取引等(信託約款)

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

株式の貸付け(信託約款)

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

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

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

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

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への投資は、行ないません。

信用リスク集中回避(信託約款)

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

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

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。

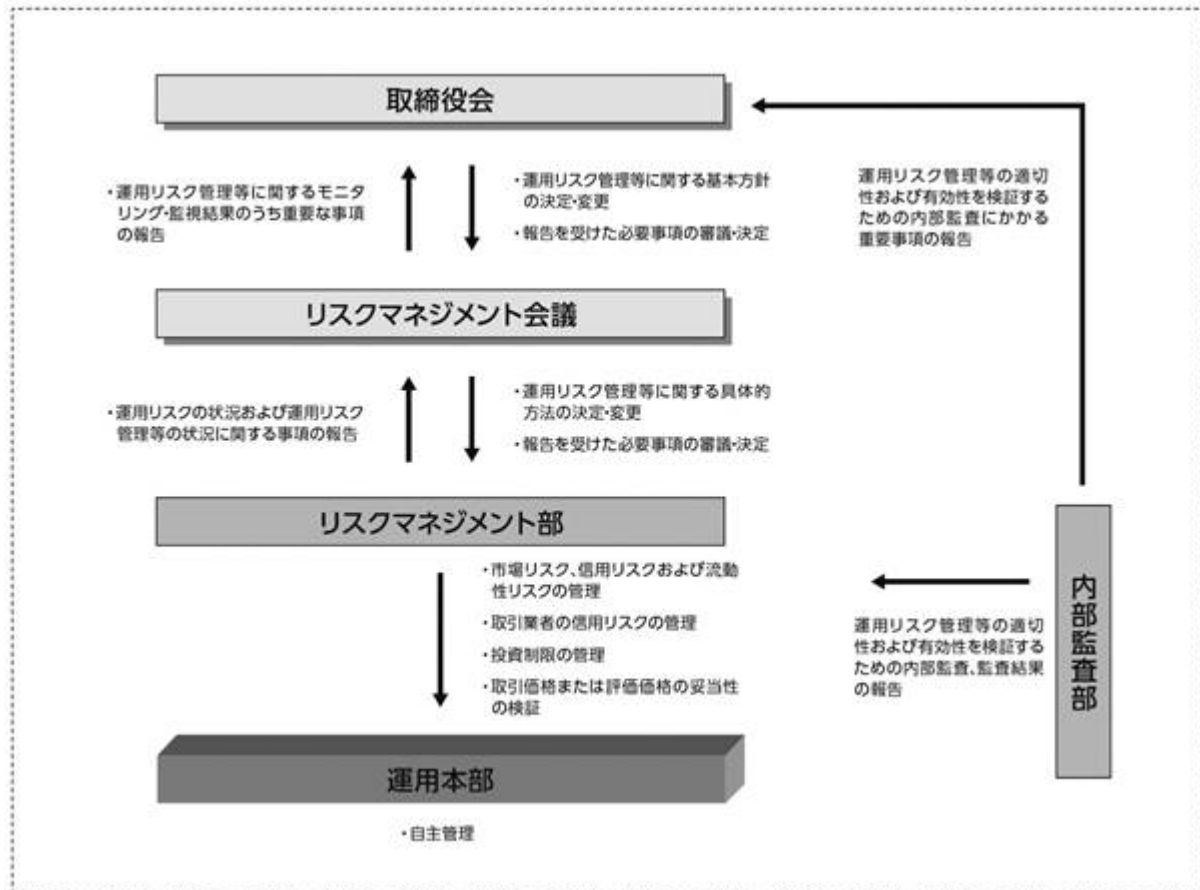
流動性リスクに関する事項

- ・ 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた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。

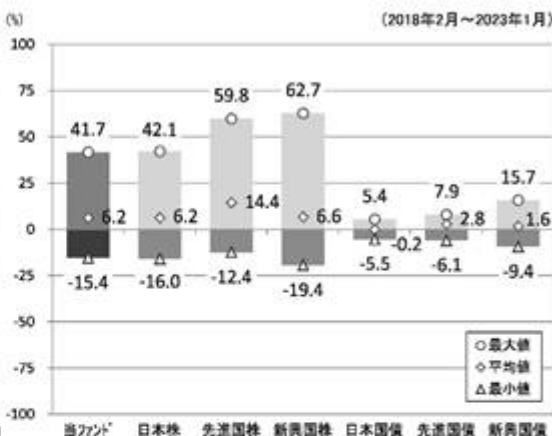
参考情報

- 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

●東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社「J P X」総研または株式会社「J P X」総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利は「J P X」が有します。「J P X」は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●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.（「MSCI」）が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドに基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。〔<https://www.daiwa-am.com.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>〕●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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同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、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、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。

* 提出日現在、上場にかかる費用は以下となります。

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

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

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

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は特定株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ. 受益権の売却時

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

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

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

ロ．収益分配金の受取時

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

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

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

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

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

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

法人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

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

ロ．収益分配金の受取時

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

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

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

() 上記は、2023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】（2023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	33,428,090,470	99.73
内 日本	33,428,090,470	99.73
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	89,684,458	0.27
純資産総額	33,517,774,928	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】（2023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 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	726,400	1,827.00 1,327,132,800	1,896.50 1,377,617,600	4.11
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	93,900	10,732.28 1,007,761,644	11,580.00 1,087,362,000	3.24
3	キーエンス	日本	株式	電気機器	13,200	52,240.00 689,568,000	59,280.00 782,496,000	2.33
4	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	170,000	3,696.00 628,320,000	3,892.00 661,640,000	1.97
5	武田薬品	日本	株式	医薬品	116,800	4,026.00 470,236,800	4,090.00 477,712,000	1.43
6	任天堂	日本	株式	その他製品	84,000	5,470.00 459,480,000	5,625.00 472,500,000	1.41
7	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	76,700	5,953.00 456,595,100	6,144.00 471,244,800	1.41
8	第一三共	日本	株式	医薬品	115,600	4,030.00 465,868,000	4,064.00 469,798,400	1.40
9	日立	日本	株式	電気機器	65,200	6,517.00 424,908,400	6,782.00 442,186,400	1.32

10	信越化学	日本	株式	化学	22,400	16,660.00 373,184,000	19,075.00 427,280,000	1.27
11	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	9,400	42,440.00 398,936,000	45,170.00 424,598,000	1.27
12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	101,700	4,208.00 427,953,600	4,144.00 421,444,800	1.26
13	KDDI	日本	株式	情報・通信業	102,500	3,921.00 401,902,500	4,059.00 416,047,500	1.24
14	HOYA	日本	株式	精密機器	28,700	12,655.00 363,198,500	14,200.00 407,540,000	1.22
15	三井物産	日本	株式	卸売業	103,500	3,742.00 387,297,000	3,820.00 395,370,000	1.18
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	87,500	4,226.00 369,775,000	4,336.00 379,400,000	1.13
17	伊藤忠	日本	株式	卸売業	87,700	4,019.00 352,466,300	4,183.00 366,849,100	1.09
18	ダイキン工業	日本	株式	機械	16,200	21,330.00 345,546,000	22,470.00 364,014,000	1.09
19	本田技研	日本	株式	輸送用機器	108,600	3,157.00 342,850,200	3,207.00 348,280,200	1.04
20	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	213,100	1,465.50 312,298,050	1,486.50 316,773,150	0.95
21	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	14,400	19,110.00 275,184,000	21,580.00 310,752,000	0.93
22	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	49,100	5,630.00 276,433,000	6,127.00 300,835,700	0.90
23	村田製作所	日本	株式	電気機器	40,100	6,962.00 279,176,200	7,394.00 296,499,400	0.88
24	ファナック	日本	株式	電気機器	12,800	19,910.00 254,848,000	22,905.00 293,184,000	0.87
25	SMC	日本	株式	機械	4,300	59,750.00 256,925,000	65,350.00 281,005,000	0.84
26	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	127,100	1,901.50 241,680,650	1,912.50 243,078,750	0.73
27	富士通	日本	株式	電気機器	13,100	17,650.00 231,215,000	18,510.00 242,481,000	0.72
28	日本電産	日本	株式	電気機器	33,000	6,928.00 228,624,000	7,170.00 236,610,000	0.71
29	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	85,700	2,605.00 223,248,500	2,655.00 227,533,500	0.68

30	キヤノン	日本	株式	電気機器	72,600	2,869.50 208,325,700	2,893.00 210,031,800	0.63
----	------	----	----	------	--------	-------------------------	-------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.73%
合計	99.73%

(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	0.34%
建設業	2.33%
食料品	3.95%
繊維製品	0.54%
パルプ・紙	0.22%
化学	7.12%
医薬品	6.08%
石油・石炭製品	0.55%
ゴム製品	0.80%
ガラス・土石製品	0.83%
鉄鋼	0.99%
非鉄金属	0.86%
金属製品	0.68%
機械	5.94%
電気機器	19.39%
輸送用機器	8.33%
精密機器	2.96%
その他製品	2.64%
電気・ガス業	1.37%
陸運業	3.40%
海運業	0.66%
空運業	0.54%
倉庫・運輸関連業	0.20%
情報・通信業	9.75%
卸売業	6.72%
小売業	5.06%

不動産業	2.09%
サービス業	5.31%
合計	99.73%

(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
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
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
2月末日	32,576,217,889	-	1,481.61	-	-
3月末日	33,979,057,785	-	1,545.41	-	-
4月末日	33,108,402,948	-	1,505.81	-	-
5月末日	33,401,176,546	-	1,519.13	-	-
6月末日	32,604,752,791	-	1,482.91	-	1,488
第18計算期間末 (2022年7月10日)	32,515,678,170	32,911,445,610	1,478.85	1,496.85	-
7月末日	33,486,051,384	-	1,522.99	-	1,523
8月末日	33,938,781,598	-	1,543.58	-	1,542
9月末日	31,986,318,928	-	1,454.78	-	-
10月末日	33,604,968,079	-	1,528.40	-	-
11月末日	34,451,354,634	-	1,566.89	-	1,562
12月末日	32,454,311,734	-	1,476.06	-	-
第19計算期間末 (2023年1月10日)	31,929,247,772	32,283,239,760	1,452.18	1,468.28	-
2023年1月末日	33,517,774,928	-	1,524.43	-	-

(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
第18計算期間	18.00
第19計算期間	16.10

【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
第18計算期間	4.9
第19計算期間	0.7

(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
第18計算期間	0	0
第19計算期間	0	0

(注) 当初設定数量は5,054,850口です。

(参考情報) 運用実績

● iFreeETF TOPIX Ex-Financials

2023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	152,443円
純資産総額	335億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	4.4%
3カ月間	0.8%
6カ月間	1.2%
1年間	4.8%
3年間	22.7%
5年間	19.3%
設定来	105.5%



※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: 3,410円 設定来分配金合計額: 36,780円

決算期	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	第18期	第19期
	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	22年7月	23年1月
分配金	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	1,800円	1,610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。

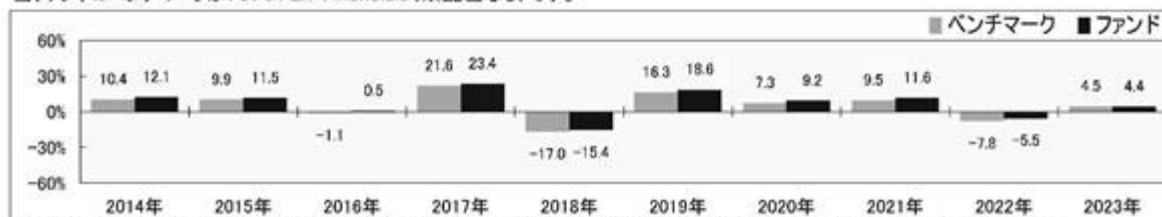
主要な資産の状況

※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	1,925	99.7%	電気機器	19.4%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.1%
国内株式先物	-	-	情報・通信業	9.7%	ソニーグループ	電気機器	3.2%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	8.3%	キーエンス	電気機器	2.3%
コール・ローン、その他	-	0.3%	化学	7.1%	日本電信電話	情報・通信業	2.0%
合計	1,925	100.0%	卸売業	6.7%	武田薬品	医薬品	1.4%
株式市場・上場別構成			医薬品	6.1%	任天堂	その他製品	1.4%
東証プライム市場		99.2%	機械	5.9%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.4%
東証スタンダード市場		0.6%	サービス業	5.3%	第一三共	医薬品	1.4%
東証グロース市場		-	小売業	5.1%	日立	電気機器	1.3%
地方市場・その他		-	その他	26.0%	信越化学	化学	1.3%
合計		99.7%	合計	99.7%	合計		19.9%

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはTOPIX Ex-Financials(※配当なし)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。

・2023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け付けます。

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の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

<支払方法>

1. 受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）を持分に応じて請求する権利を有します。
2. 受託会社は、計算期間終了日現在において、氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。
3. 受益者は、原則として前2.に規定する登録を当ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の取引参加者（口座管理機関であるものに限り、以下同じ。）を経由して行なうものとします。この場合、当該取引参加者は、当該取引参加者が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。
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19期計算期間（2022年7月11日から2023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18期 2022年7月10日現在	第19期 2023年1月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	432,847,107	435,738,935
株式	32,466,128,970	31,823,290,490
未収配当金	54,314,111	62,929,649
流動資産合計	32,953,290,188	32,321,959,074
資産合計	32,953,290,188	32,321,959,074
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	395,767,440	353,991,988
未払受託者報酬	8,995,943	9,278,619
未払委託者報酬	23,389,543	24,124,504
未払利息	134	-
その他未払費用	9,458,958	5,316,191
流動負債合計	437,612,018	392,711,302
負債合計	437,612,018	392,711,302
純資産の部		
元本等		
元本	1 21,745,222,120	1 21,745,222,120
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,770,456,050	10,184,025,652
（分配準備積立金）	1,447,077	636,094
元本等合計	32,515,678,170	31,929,247,772
純資産合計	32,515,678,170	31,929,247,772
負債純資産合計	32,953,290,188	32,321,959,074

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第18期		第19期	
	自	2022年1月11日 至 2022年7月10日	自	2022年7月11日 至 2023年1月10日
営業収益				
受取配当金		433,724,181		394,399,922
受取利息		42		-
有価証券売買等損益		2,093,520,173		585,619,415
その他収益		184,604		159,078
営業収益合計		1,659,611,346		191,060,415
営業費用				
支払利息		12,156		41,583
受託者報酬		8,995,943		9,278,619
委託者報酬		23,389,543		24,124,504
その他費用		6,375,083		7,933,289
営業費用合計		38,772,725		41,377,995
営業損失()		1,698,384,071		232,438,410
経常損失()		1,698,384,071		232,438,410
当期純損失()		1,698,384,071		232,438,410
期首剰余金又は期首欠損金()		12,864,607,561		10,770,456,050
分配金		1 395,767,440		1 353,991,988
期末剰余金又は期末欠損金()		10,770,456,050		10,184,025,652

(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19期	
	自 2022年7月11日	至 2023年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第18期	第19期
	2022年7月10日現在	2023年1月10日現在
1. 1 期首元本額	21,745,222,120円	21,745,222,120円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部交換元本額	- 円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	21,987,080口	21,987,080口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第18期	第19期
	自 2022年1月11日	自 2022年7月11日
	至 2022年7月10日	至 2023年1月10日

1 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(433,896,671円)及び分配準備積立金(2,078,415円)の合計額から、経費(38,760,569円)を控除して計算される分配対象額は397,214,517円(100口当たり1,806円)であり、うち395,767,440円(100口当たり1,800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(394,517,417円)及び分配準備積立金(1,447,077円)の合計額から、経費(41,336,412円)を控除して計算される分配対象額は354,628,082円(100口当たり1,612円)であり、うち353,991,988円(100口当たり1,610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19期 自 2022年7月11日 至 2023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19期 2023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18期 2022年7月10日現在	第19期 2023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	2,064,197,853	601,189,682
合計	2,064,197,853	601,189,682

（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18期 2022年7月10日現在	第19期 2023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19期 自 2022年7月11日 至 2023年1月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第18期 2022年7月10日現在	第19期 2023年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,478.85円	1,452.18円
（100口当たり純資産額）	（147,885円）	（145,218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	3,715.00	1,857,500	
ニッスイ	17,700	526.00	9,310,200	
マルハニチロ	3,100	2,433.00	7,542,300	
雪国まいたけ	1,600	991.00	1,585,600	
カネコ種苗	500	1,417.00	708,500	
サカタのタネ	2,200	4,125.00	9,075,000	
ホクト	1,700	1,861.00	3,163,700	
ホクリヨウ	500	743.00	371,500	
ショーボンドHD	2,700	5,400.00	14,580,000	
ミライト・ワン	6,600	1,499.00	9,893,400	
タマホーム	1,400	2,437.00	3,411,800	
日本アクア	900	790.00	711,000	
ファーストコーポレーション	500	703.00	351,500	
ベステラ	500	943.00	471,500	
ROBOT HOME	3,300	160.00	528,000	
キャンディル	500	495.00	247,500	
住石ホールディングス	3,700	388.00	1,435,600	
日鉄鉱業	1,000	3,225.00	3,225,000	
三井松島HLDGS	900	3,030.00	2,727,000	
INPEX	64,300	1,371.00	88,155,300	
石油資源開発	2,700	3,800.00	10,260,000	
K&Oエナジーグループ	1,000	1,963.00	1,963,000	
ダイセキ環境ソリューション	500	937.00	468,500	
第一カッター興業	500	1,019.00	509,500	
明豊ファシリティワークス	500	706.00	353,000	
安藤・間	9,400	828.00	7,783,200	
東急建設	5,800	627.00	3,636,600	
コムシスホールディングス	6,600	2,296.00	15,153,600	
ピーアールホールディングス	2,600	327.00	850,200	
高松コンストラクションGP	1,400	1,908.00	2,671,200	
東建コーポレーション	500	7,400.00	3,700,000	
ヤマウラ	1,000	997.00	997,000	
オリエンタル白石	6,200	283.00	1,754,600	
大成建設	12,700	4,060.00	51,562,000	
大林組	43,700	949.00	41,471,300	
清水建設	41,300	683.00	28,207,900	
飛島建設	1,200	1,000.00	1,200,000	

長谷工コーポレーション	14,600	1,452.00	21,199,200	
松井建設	1,700	545.00	926,500	
鹿島建設	32,400	1,471.00	47,660,400	
不動テトラ	1,000	1,460.00	1,460,000	
大末建設	500	1,138.00	569,000	
鉄建建設	1,000	1,740.00	1,740,000	
西松建設	3,200	3,835.00	12,272,000	
三井住友建設	10,600	408.00	4,324,800	
大豊建設	1,000	4,010.00	4,010,000	
佐田建設	1,000	450.00	450,000	
ナカノフドー建設	1,000	317.00	317,000	
奥村組	2,200	2,943.00	6,474,600	
東鉄工業	1,700	2,548.00	4,331,600	
イチケン	500	1,768.00	884,000	
富士ピー・エス	500	433.00	216,500	
浅沼組	1,000	2,970.00	2,970,000	
戸田建設	18,200	687.00	12,503,400	
熊谷組	2,200	2,551.00	5,612,200	
北野建設	400	2,447.00	978,800	
植木組	400	1,316.00	526,400	
矢作建設	1,800	755.00	1,359,000	
ピーエス三菱	1,300	603.00	783,900	
日本ハウスHLDGS	3,200	358.00	1,145,600	
大東建託	4,500	13,560.00	61,020,000	
新日本建設	1,700	745.00	1,266,500	
東亜道路	500	5,750.00	2,875,000	
日本道路	400	5,720.00	2,288,000	
東亜建設	1,200	2,302.00	2,762,400	
日本国土開発	4,400	551.00	2,424,400	
若築建設	900	2,706.00	2,435,400	
東洋建設	4,900	840.00	4,116,000	
五洋建設	18,600	610.00	11,346,000	
世紀東急	2,200	791.00	1,740,200	
福田組	500	4,345.00	2,172,500	
日本ドライケミカル	500	1,466.00	733,000	
住友林業	10,900	2,309.00	25,168,100	
日本基礎技術	1,200	497.00	596,400	
巴コーポレーション	1,800	396.00	712,800	
大和ハウス	38,100	3,008.00	114,604,800	
ライト工業	2,700	1,830.00	4,941,000	

積水ハウス	40,600	2,340.00	95,004,000
日特建設	1,000	905.00	905,000
北陸電気工事	1,000	655.00	655,000
ユアテック	2,700	717.00	1,935,900
日本リーテック	1,000	877.00	877,000
四電工	400	1,708.00	683,200
中電工	2,200	2,052.00	4,514,400
関電工	7,100	828.00	5,878,800
きんでん	8,900	1,394.00	12,406,600
東京エネシス	1,300	914.00	1,188,200
トーエネック	500	3,420.00	1,710,000
住友電設	1,200	2,311.00	2,773,200
日本電設工業	2,200	1,518.00	3,339,600
エクシオグループ	6,600	2,212.00	14,599,200
新日本空調	1,200	1,844.00	2,212,800
日本工営	1,000	3,290.00	3,290,000
九電工	3,200	3,125.00	10,000,000
三機工業	3,200	1,499.00	4,796,800
日揮ホールディングス	14,500	1,634.00	23,693,000
中外炉工業	500	1,605.00	802,500
ヤマト	1,300	693.00	900,900
太平電業	1,000	3,335.00	3,335,000
高砂熱学	3,900	1,713.00	6,680,700
NEC ネットエスアイ	4,400	1,669.00	7,343,600
朝日工業社	1,000	1,967.00	1,967,000
明星工業	2,700	790.00	2,133,000
大気社	2,200	3,255.00	7,161,000
ダイダン	1,000	2,120.00	2,120,000
日比谷総合設備	1,300	1,879.00	2,442,700
ニッポン	4,000	1,588.00	6,352,000
日清製粉G本社	15,900	1,633.00	25,964,700
昭和産業	1,200	2,414.00	2,896,800
鳥越製粉	1,200	580.00	696,000
中部飼料	1,700	1,021.00	1,735,700
フィード・ワン	1,700	692.00	1,176,400
日本甜菜糖	900	1,620.00	1,458,000
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	196.00	333,200
ウェルネオシュガー	900	1,791.00	1,611,900
LIFULL	4,100	214.00	877,400

MIXI	3,300	2,446.00	8,071,800
ジェイエイシーリクルートメント	1,000	2,243.00	2,243,000
日本M&Aセンターホールデ	22,000	1,670.00	36,740,000
メンバーズ	500	1,955.00	977,500
UTグループ	1,800	2,399.00	4,318,200
アイティメディア	500	1,582.00	791,000
E・Jホールディングス	900	1,336.00	1,202,400
オープンアップグループ	3,500	1,631.00	5,708,500
コシダカホールディングス	3,400	979.00	3,328,600
アルトナー	500	1,029.00	514,500
パソナグループ	1,300	1,884.00	2,449,200
CDS	500	1,755.00	877,500
リンクアンドモチベーション	3,100	627.00	1,943,700
エス・エム・エス	4,400	3,230.00	14,212,000
サニーサイドアップG	500	517.00	258,500
パーソルホールディングス	13,300	2,731.00	36,322,300
リニカル	900	652.00	586,800
クックパッド	4,400	198.00	871,200
エスクリ	500	309.00	154,500
アイ・ケイ・ケイホールディンク	500	646.00	323,000
森永製菓	3,200	3,735.00	11,952,000
中村屋	500	3,040.00	1,520,000
江崎グリコ	3,900	3,495.00	13,630,500
名糖産業	500	1,630.00	815,000
井村屋グループ	900	2,194.00	1,974,600
不二家	1,000	2,484.00	2,484,000
山崎製パン	10,500	1,523.00	15,991,500
第一屋製パン	400	380.00	152,000
モロゾフ	800	3,320.00	2,656,000
亀田製菓	900	4,270.00	3,843,000
寿スピリッツ	1,300	8,120.00	10,556,000
カルビー	6,200	2,977.00	18,457,400
森永乳業	2,700	4,725.00	12,757,500
六甲バター	1,000	1,234.00	1,234,000
ヤクルト	9,800	8,860.00	86,828,000
明治ホールディングス	8,200	6,500.00	53,300,000
雪印メグミルク	3,400	1,717.00	5,837,800
プリマハム	1,800	2,085.00	3,753,000
日本ハム	5,400	3,595.00	19,413,000
林兼産業	500	460.00	230,000

丸大食品	1,300	1,393.00	1,810,900
S Foods	1,200	2,858.00	3,429,600
柿安本店	500	2,036.00	1,018,000
伊藤ハム米久HLDGS	8,900	679.00	6,043,100
学情	500	1,301.00	650,500
スタジオアリス	900	2,018.00	1,816,200
クロスキャット	1,000	1,317.00	1,317,000
シミックホールディングス	900	1,749.00	1,574,100
エプコ	500	679.00	339,500
システナ	19,600	398.00	7,800,800
NJS	500	2,033.00	1,016,500
デジタルアーツ	900	5,390.00	4,851,000
日鉄ソリューションズ	1,800	3,190.00	5,742,000
総合警備保障	5,400	3,385.00	18,279,000
キューブシステム	900	1,014.00	912,600
いちご	15,500	276.00	4,278,000
日本駐車場開発	14,700	284.00	4,174,800
コア	500	1,420.00	710,000
カカクコム	9,800	2,044.00	20,031,200
アイロムグループ	500	2,340.00	1,170,000
セントケア・ホールディング	1,000	803.00	803,000
サイネックス	100	555.00	55,500
ルネサンス	1,000	872.00	872,000
ディップ	2,200	3,605.00	7,931,000
SBSホールディングス	1,000	2,732.00	2,732,000
デジタルホールディングス	1,000	1,238.00	1,238,000
新日本科学	1,700	2,349.00	3,993,300
キャリアデザインセンター	500	1,475.00	737,500
ベネフィット・ワン	4,900	1,927.00	9,442,300
エムスリー	26,900	3,502.00	94,203,800
ツカダ・グローバルHOLD	1,100	350.00	385,000
アウトソーシング	7,600	939.00	7,136,400
ウェルネット	1,200	598.00	717,600
ワールドホールディングス	500	2,488.00	1,244,000
ディー・エヌ・エー	5,600	1,741.00	9,749,600
博報堂DYHLDGS	18,600	1,328.00	24,700,800
ぐるなび	2,200	377.00	829,400
タカミヤ	1,700	357.00	606,900
ジャパンベストレスキューS	1,000	822.00	822,000
ファンコミュニケーションズ	3,500	404.00	1,414,000

ライク	500	1,985.00	992,500
ビジネス・ブレイクスルー	600	373.00	223,800
エスプール	3,800	677.00	2,572,600
WDBホールディングス	500	2,123.00	1,061,500
ティア	900	416.00	374,400
アドウェイズ	2,100	495.00	1,039,500
バリューコマース	1,000	1,827.00	1,827,000
インフォマート	14,300	336.00	4,804,800
サッポロホールディングス	4,900	3,095.00	15,165,500
アサヒグループホールディング	30,200	4,057.00	122,521,400
麒麟HD	58,900	1,925.00	113,382,500
宝ホールディングス	10,500	1,012.00	10,626,000
オエノンホールディングス	3,900	234.00	912,600
養命酒	500	1,782.00	891,000
コカ・コーラボトラーズJHD	10,000	1,363.00	13,630,000
サントリー食品インター	9,300	4,335.00	40,315,500
ダイドーグループHD	900	4,590.00	4,131,000
伊藤園	4,400	4,430.00	19,492,000
キーコーヒー	1,300	2,045.00	2,658,500
ユニカフェ	500	901.00	450,500
日清オイリオグループ	1,700	3,090.00	5,253,000
不二製油グループ	3,400	1,981.00	6,735,400
J-オイルミルズ	1,200	1,494.00	1,792,800
ローソン	3,400	4,955.00	16,847,000
サンエー	1,000	4,045.00	4,045,000
カワチ薬品	1,000	2,243.00	2,243,000
エービーシー・マート	2,200	7,210.00	15,862,000
ハードオフコーポレーション	500	1,257.00	628,500
高千穂交易	500	2,181.00	1,090,500
アスクル	2,200	1,673.00	3,680,600
ゲオホールディングス	1,700	1,977.00	3,360,900
アダストリア	1,800	2,301.00	4,141,800
ジーフット	1,000	294.00	294,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	404.00	40,400
伊藤忠食品	500	4,780.00	2,390,000
くら寿司	1,200	2,998.00	3,597,600
キャンドゥ	500	2,207.00	1,103,500
エレマテック	1,000	1,527.00	1,527,000
IKホールディングス	500	393.00	196,500
パルグループHLDGS	1,200	2,543.00	3,051,600

エディオン	5,700	1,260.00	7,182,000
あらた	1,000	4,010.00	4,010,000
サーラコーポレーション	2,700	709.00	1,914,300
ワッツ	900	710.00	639,000
ハローズ	500	3,000.00	1,500,000
J Pホールディングス	3,900	306.00	1,193,400
フジオフードG本社	1,400	1,374.00	1,923,600
あみやき亭	500	2,874.00	1,437,000
東京エレクトロニクス	500	6,850.00	3,425,000
ひらまつ	2,700	184.00	496,800
円谷フィールズホールディ	1,400	2,348.00	3,287,200
双日	15,000	2,457.00	36,855,000
アルフレッサホールディングス	14,200	1,588.00	22,549,600
大黒天物産	500	5,240.00	2,620,000
ハニーズホールディングス	1,000	1,481.00	1,481,000
ファーマライズHD	500	615.00	307,500
キッコーマン	8,900	6,600.00	58,740,000
味の素	31,000	3,866.00	119,846,000
ブルドックソ - ス	500	1,779.00	889,500
キューピー	7,800	2,334.00	18,205,200
ハウス食品G本社	5,400	2,639.00	14,250,600
カゴメ	5,300	2,922.00	15,486,600
焼津水産化工	900	827.00	744,300
アリアケジャパン	1,200	4,285.00	5,142,000
エバラ食品工業	500	2,985.00	1,492,500
ニチレイ	6,600	2,700.00	17,820,000
横浜冷凍	3,900	1,055.00	4,114,500
東洋水産	7,100	4,865.00	34,541,500
イトアンドHLDGS	500	2,305.00	1,152,500
ヨシムラ・フード・HLDGS	900	641.00	576,900
日清食品HD	5,300	10,160.00	53,848,000
永谷園ホールディングス	900	1,991.00	1,791,900
一正蒲鉾	500	713.00	356,500
フジッコ	1,300	1,862.00	2,420,600
ロックフィールド	1,300	1,467.00	1,907,100
日本たばこ産業	85,700	2,605.00	223,248,500
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,330.00	1,330,000
わらべや日洋HD	1,000	1,837.00	1,837,000
なとり	900	2,015.00	1,813,500
ファーマフーズ	1,200	1,239.00	1,486,800

北の達人コーポ	4,900	295.00	1,445,500
ユーグレナ	6,900	937.00	6,465,300
紀文食品	1,000	930.00	930,000
ピクルスホールディングス	1,000	1,142.00	1,142,000
スター・マイカ・HLDGS	1,800	710.00	1,278,000
ADワークスグループ	2,700	140.00	378,000
片倉工業	1,300	1,668.00	2,168,400
ゲンゼ	1,000	4,100.00	4,100,000
ヒューリック	29,200	1,029.00	30,046,800
ラサ商事	900	1,167.00	1,050,300
アルペン	1,000	1,939.00	1,939,000
ハブ	500	620.00	310,000
ラクーンホールディングス	1,000	1,107.00	1,107,000
クオールホールディングス	1,700	1,141.00	1,939,700
アルコニックス	1,300	1,322.00	1,718,600
神戸物産	10,600	3,715.00	39,379,000
ソリトンシステムズ	900	1,062.00	955,800
ジンスホールディングス	900	4,015.00	3,613,500
ビックカメラ	8,300	1,239.00	10,283,700
DCMホールディングス	8,400	1,173.00	9,853,200
ペッパーフードサービス	1,700	174.00	295,800
ハイパー	500	444.00	222,000
Monotaro	17,300	1,997.00	34,548,100
東京一番フーズ	500	473.00	236,500
DDホールディングス	900	695.00	625,500
あいホールディングス	1,800	2,077.00	3,738,600
ディービーエックス	500	1,026.00	513,000
きちりホールディングス	500	570.00	285,000
アークランドサービスHD	1,000	2,149.00	2,149,000
J. フロントリテイリング	16,400	1,169.00	19,171,600
ドトール・日レスHD	2,200	1,672.00	3,678,400
マツキヨココカラ&カンパニー	7,900	6,630.00	52,377,000
ブロンコビリー	900	2,409.00	2,168,100
ZOZO	9,700	3,185.00	30,894,500
トレジャー・ファクトリー	500	2,448.00	1,224,000
物語コーポレーション	900	6,440.00	5,796,000
三越伊勢丹HD	24,200	1,376.00	33,299,200
東洋紡	5,400	989.00	5,340,600
ユニチカ	3,900	240.00	936,000
富士紡ホールディングス	500	3,155.00	1,577,500

日清紡ホールディングス	8,400	959.00	8,055,600
倉敷紡績	1,200	2,090.00	2,508,000
ダイワボウHD	6,000	1,905.00	11,430,000
シキボウ	900	954.00	858,600
日東紡績	2,200	1,916.00	4,215,200
トヨタ紡織	3,900	1,776.00	6,926,400
マクニカホールディングス	3,200	3,185.00	10,192,000
Hamee	500	720.00	360,000
ラクト・ジャパン	500	2,184.00	1,092,000
ウエルシアHD	7,100	3,115.00	22,116,500
クリエイトSDH	2,200	3,205.00	7,051,000
グリムス	500	2,106.00	1,053,000
バイタルKSKHD	2,300	810.00	1,863,000
八洲電機	1,000	1,042.00	1,042,000
メディアスホールディングス	900	674.00	606,600
レスターホールディングス	1,300	2,038.00	2,649,400
ジューテックHD	500	1,167.00	583,500
丸善CHI HD	1,700	329.00	559,300
大光	500	661.00	330,500
OCHIホールディングス	500	1,256.00	628,000
TOKAIホールディングス	6,600	844.00	5,570,400
黒谷	500	582.00	291,000
ミサワ	500	644.00	322,000
Cominix	100	735.00	73,500
エー・ピーホールディングス	500	456.00	228,000
三洋貿易	1,300	1,084.00	1,409,200
チムニー	500	1,121.00	560,500
シュッピン	1,000	1,222.00	1,222,000
オイシックス・ラ・大地	1,700	2,324.00	3,950,800
ウイン・パートナーズ	1,000	972.00	972,000
ネクステージ	2,600	2,533.00	6,585,800
ジョイフル本田	3,900	1,925.00	7,507,500
鳥貴族ホールディングス	500	2,042.00	1,021,000
ホットランド	1,000	1,448.00	1,448,000
すかいらくHD	17,700	1,537.00	27,204,900
SFPホールディングス	900	1,780.00	1,602,000
綿半ホールディングス	1,000	1,317.00	1,317,000
日本毛織	4,000	940.00	3,760,000
ダイトウボウ	2,200	81.00	178,200
トーア紡コーポレーション	500	343.00	171,500

ダイドーリミテッド	1,700	275.00	467,500
ヨシックスホールディングス	400	2,148.00	859,200
ユナイテッド・スーパーマーケ	3,900	1,120.00	4,368,000
三栄建築設計	500	1,455.00	727,500
野村不動産HLDGS	7,900	2,814.00	22,230,600
三重交通グループHD	2,800	477.00	1,335,600
サムティ	1,800	2,101.00	3,781,800
ディア・ライフ	1,800	595.00	1,071,000
コーセーアールイー	500	808.00	404,000
地主	1,000	1,785.00	1,785,000
プレサンスコーポレーション	2,200	1,546.00	3,401,200
フィル・カンパニー	400	924.00	369,600
THEグローバル社	1,000	208.00	208,000
JPMC	500	991.00	495,500
サンセイランディック	500	825.00	412,500
フージャースHD	2,200	743.00	1,634,600
オープンハウスグループ	4,400	4,910.00	21,604,000
東急不動産HD	37,500	632.00	23,700,000
飯田GHD	11,500	2,016.00	23,184,000
ムゲンエステート	1,000	476.00	476,000
帝国繊維	1,700	1,504.00	2,556,800
日本コークス工業	12,000	87.00	1,044,000
ゴルフダイジェスト・オン	900	1,447.00	1,302,300
ミタチ産業	500	1,036.00	518,000
B E E N O S	900	1,911.00	1,719,900
あさひ	1,000	1,348.00	1,348,000
日本調剤	1,000	1,158.00	1,158,000
コスモス薬品	1,300	13,380.00	17,394,000
シップヘルスケアHD	4,800	2,566.00	12,316,800
トーエル	900	742.00	667,800
ソフトクリエイイトHD	500	3,025.00	1,512,500
セブン&アイ・HLDGS	49,100	5,630.00	276,433,000
クリエイイト・レストランツ・ホール	7,600	919.00	6,984,400
明治電機工業	500	1,049.00	524,500
ツルハホールディングス	3,100	9,850.00	30,535,000
デリカフーズHLDGS	500	493.00	246,500
スターティアホールディングス	400	925.00	370,000
サンマルクホールディングス	1,000	1,672.00	1,672,000
フェリシモ	500	1,006.00	503,000
トリドールホールディングス	3,400	2,657.00	9,033,800

帝人	12,800	1,280.00	16,384,000
東レ	90,300	737.50	66,596,250
クラレ	20,200	1,042.00	21,048,400
旭化成	82,700	926.80	76,646,360
TOKYO BASE	1,200	297.00	356,400
稲葉製作所	900	1,366.00	1,229,400
宮地エンジニアリングG	500	3,475.00	1,737,500
トーカロ	3,500	1,155.00	4,042,500
アルファCO	500	923.00	461,500
SUMCO	26,000	1,846.00	47,996,000
川田テクノロジーズ	500	3,255.00	1,627,500
RS TECHNOLOGIES	1,000	3,645.00	3,645,000
信和	900	785.00	706,500
ビーロット	900	526.00	473,400
ファーストブラザーズ	400	885.00	354,000
AND DOホールディングス	900	780.00	702,000
シーアールイー	500	1,109.00	554,500
ケイアイスター不動産	500	4,765.00	2,382,500
アグレ都市デザイン	500	1,542.00	771,000
グッドコムアセット	1,000	764.00	764,000
ジェイ・エス・ビー	400	4,185.00	1,674,000
ロードスターキャピタル	400	1,585.00	634,000
テンポイノベーション	500	1,038.00	519,000
住江織物	500	1,844.00	922,000
日本フェルト	900	400.00	360,000
エコナックホールディングス	2,200	86.00	189,200
芦森工業	400	1,235.00	494,000
アツギ	1,000	396.00	396,000
JMホールディングス	1,000	1,659.00	1,659,000
コメダホールディングス	3,200	2,399.00	7,676,800
アレンザホールディングス	900	1,001.00	900,900
串カツ田中HLDGS	500	1,701.00	850,500
パロックジャパン	1,000	833.00	833,000
クスリのアオキHLDGS	1,300	7,560.00	9,828,000
ダイニック	500	615.00	307,500
共和レザー	900	498.00	448,200
力の源HD	500	1,018.00	509,000
FOOD & LIFE COMPAN	7,900	2,785.00	22,001,500
アセンテック	500	434.00	217,000
セーレン	3,400	2,340.00	7,956,000

ソトー	500	815.00	407,500
小松マテーレ	2,200	761.00	1,674,200
ワコールホールディングス	3,400	2,364.00	8,037,600
ホギメディカル	1,700	3,285.00	5,584,500
クラウドシアHLDGS	500	315.00	157,500
T S Iホールディングス	4,000	433.00	1,732,000
マツオカコーポレーション	500	1,044.00	522,000
ワールド	1,700	1,308.00	2,223,600
T I S	13,700	3,465.00	47,470,500
J N Sホールディングス	1,000	313.00	313,000
グリー	8,400	697.00	5,854,800
コーエーテクモHD	6,800	2,320.00	15,776,000
三菱総合研究所	500	4,685.00	2,342,500
ボルテージ	500	313.00	156,500
A G S	900	678.00	610,200
ファインデックス	1,400	500.00	700,000
ブレインパッド	1,500	756.00	1,134,000
K L a b	2,700	438.00	1,182,600
ポルトゥウィンホールディン	1,700	850.00	1,445,000
ネクソン	33,500	3,005.00	100,667,500
アイスタイル	4,000	513.00	2,052,000
エムアップホールディングス	2,000	1,391.00	2,782,000
エイチーム	1,000	713.00	713,000
エニグモ	1,200	651.00	781,200
テクノスジャパン	1,000	466.00	466,000
e n i s h	1,000	352.00	352,000
コロプラ	4,400	615.00	2,706,000
オルトプラス	1,000	196.00	196,000
ブロードリーフ	6,700	432.00	2,894,400
クロス・マーケティングG	600	741.00	444,600
デジタルハーツHLDGS	500	1,723.00	861,500
システム情報	1,000	827.00	827,000
メディアドゥ	500	1,667.00	833,500
じげん	3,400	374.00	1,271,600
ブイキューブ	1,200	725.00	870,000
エンカレッジ・テクノロジー	500	493.00	246,500
サイバーリンクス	500	968.00	484,000
ディー・エル・イー	1,000	256.00	256,000
フィックスターズ	1,300	1,173.00	1,524,900
C A R T A H O L D I N G S	500	1,590.00	795,000

オプティム	1,000	1,018.00	1,018,000
セレス	500	946.00	473,000
S H I F T	700	23,760.00	16,632,000
特種東海製紙	900	2,810.00	2,529,000
ティーガイア	1,300	1,608.00	2,090,400
テクマトリックス	2,200	1,734.00	3,814,800
プロシップ	500	1,460.00	730,000
ガンホー・オンライン・エンター	3,400	2,098.00	7,133,200
GMOペイメントゲートウェイ	2,700	11,000.00	29,700,000
ザッパラス	600	363.00	217,800
システムリサーチ	500	2,120.00	1,060,000
インターネットイニシアティブ	7,000	2,345.00	16,415,000
さくらインターネット	1,300	485.00	630,500
ヴィンクス	500	1,468.00	734,000
GMOグローバルサインHD	500	4,130.00	2,065,000
S R Aホールディングス	900	2,960.00	2,664,000
システムインテグレータ	500	433.00	216,500
朝日ネット	1,400	575.00	805,000
e B A S E	1,700	558.00	948,600
アバントグループ	1,300	1,312.00	1,705,600
アドソル日進	500	1,307.00	653,500
ODKソリューションズ	400	600.00	240,000
フリービット	900	991.00	891,900
コムチュア	1,200	2,343.00	2,811,600
アステリア	1,000	747.00	747,000
アイル	900	1,725.00	1,552,500
王子ホールディングス	57,400	518.00	29,733,200
日本製紙	6,100	952.00	5,807,200
三菱製紙	1,800	280.00	504,000
北越コーポレーション	9,800	777.00	7,614,600
中越パルプ	500	986.00	493,000
巴川製紙	500	674.00	337,000
大王製紙	6,600	987.00	6,514,200
阿波製紙	500	367.00	183,500
マークライnz	900	2,525.00	2,272,500
メディカル・データ・ビジ	1,700	887.00	1,507,900
g u m i	1,700	919.00	1,562,300
ショーケース	500	314.00	157,000
モバイルファクトリー	500	887.00	443,500
テラスカイ	500	2,319.00	1,159,500

デジタル・インフォメーション	500	1,722.00	861,000
P C Iホールディングス	500	1,024.00	512,000
ネオジャパン	400	1,010.00	404,000
P R T I M E S	500	2,369.00	1,184,500
ラクス	4,000	1,627.00	6,508,000
ランドコンピュータ	400	921.00	368,400
ダブルスタンダード	400	2,249.00	899,600
オープンドア	900	1,813.00	1,631,700
マイネット	500	362.00	181,000
アカツキ	500	2,177.00	1,088,500
U B I C O Mホールディングス	500	2,127.00	1,063,500
カナミックネットワーク	1,200	528.00	633,600
ノムラシステムコーポレーション	2,000	116.00	232,000
レンゴー	14,200	888.00	12,609,600
トーモク	1,000	1,645.00	1,645,000
ザ・パック	1,000	2,397.00	2,397,000
チェンジ	2,600	2,087.00	5,426,200
シンクロ・フード	1,000	459.00	459,000
オークネット	900	1,800.00	1,620,000
キャピタル・アセット・プラン	400	573.00	229,200
セグエグループ	500	810.00	405,000
エイトレッド	400	1,421.00	568,400
マクロミル	2,700	1,089.00	2,940,300
ビーグリー	400	1,145.00	458,000
オロ	500	1,918.00	959,000
ユーザーローカル	400	1,279.00	511,600
テモナ	500	264.00	132,000
ニーズウェル	500	742.00	371,000
マネーフォワード	2,200	4,260.00	9,372,000
サインポスト	500	632.00	316,000
レゾナック・ホールディング	11,900	2,094.00	24,918,600
住友化学	100,800	472.00	47,577,600
住友精化	900	4,020.00	3,618,000
日産化学	6,600	5,820.00	38,412,000
ラサ工業	500	1,880.00	940,000
クレハ	1,300	8,200.00	10,660,000
多木化学	500	4,415.00	2,207,500
テイカ	1,000	1,157.00	1,157,000
石原産業	2,700	1,050.00	2,835,000
片倉コープアグリ	500	1,587.00	793,500

日本曹達	1,800	4,085.00	7,353,000	
東ソー	19,800	1,579.00	31,264,200	
トクヤマ	3,900	1,782.00	6,949,800	
セントラル硝子	2,700	2,752.00	7,430,400	
東亜合成	7,900	1,108.00	8,753,200	
大阪ソーダ	1,300	3,825.00	4,972,500	
関東電化	3,200	927.00	2,966,400	
デンカ	4,900	2,998.00	14,690,200	
イビデン	6,600	5,030.00	33,198,000	
信越化学	22,400	16,660.00	373,184,000	
日本カ - バイド	500	1,281.00	640,500	
電算システムHD	500	2,083.00	1,041,500	
堺 化 学	1,000	1,751.00	1,751,000	
第一稀元素化学工	1,300	1,023.00	1,329,900	
エア・ウォーター	14,200	1,539.00	21,853,800	
日本酸素HLDGS	11,500	1,977.00	22,735,500	
日本化学工業	500	1,701.00	850,500	
日本パ - カライジング	7,100	916.00	6,503,600	
高压ガス	2,200	649.00	1,427,800	
四国化成ホールディング	1,700	1,291.00	2,194,700	
戸田工業	500	2,480.00	1,240,000	
ステラ ケミファ	900	2,472.00	2,224,800	
保土谷化学	500	2,770.00	1,385,000	
日本触媒	2,700	5,260.00	14,202,000	
大日精化	1,400	1,684.00	2,357,600	
カネカ	3,500	3,245.00	11,357,500	
協和キリン	16,400	2,875.00	47,150,000	
三菱瓦斯化学	9,900	1,813.00	17,948,700	
三井化学	12,000	3,035.00	36,420,000	
J S R	12,800	2,694.00	34,483,200	
東京応化工業	2,200	6,180.00	13,596,000	
大阪有機化学	1,200	1,950.00	2,340,000	
三菱ケミカルグループ	91,400	687.00	62,791,800	
K Hネオケム	2,200	2,714.00	5,970,800	
ダイセル	18,600	945.00	17,577,000	
住友ベ - クライト	2,200	3,920.00	8,624,000	
積水化学	28,700	1,835.00	52,664,500	
日本ゼオン	12,300	1,335.00	16,420,500	
アイカ工業	3,900	2,985.00	11,641,500	
U B E	7,100	1,928.00	13,688,800	

積水樹脂	2,200	1,821.00	4,006,200
タキロンシーアイ	3,200	501.00	1,603,200
旭有機材	900	2,724.00	2,451,600
ニチバン	900	1,807.00	1,626,300
リケンテクノス	3,400	476.00	1,618,400
大倉工業	900	1,801.00	1,620,900
積水化成製品	1,700	379.00	644,300
群栄化学	500	2,342.00	1,171,000
タイガース ポリマー	1,000	405.00	405,000
ミライアル	500	1,451.00	725,500
ダイキアクシス	500	652.00	326,000
ダイキョーニシカワ	3,100	545.00	1,689,500
竹本容器	500	729.00	364,500
森六ホールディングス	900	1,702.00	1,531,800
恵和	800	1,518.00	1,214,400
日本化薬	8,400	1,127.00	9,466,800
カーリットホールディングス	1,300	769.00	999,700
ソルクシーズ	1,400	351.00	491,400
C Lホールディングス	500	771.00	385,500
プレステージ・インター	4,900	688.00	3,371,200
フェイス	500	513.00	256,500
プロトコーポレーション	1,600	1,154.00	1,846,400
ハイマックス	500	1,416.00	708,000
アミューズ	900	1,682.00	1,513,800
野村総合研究所	26,500	3,135.00	83,077,500
ドリームインキュベータ	500	2,294.00	1,147,000
サイバネットシステム	1,000	956.00	956,000
クイック	1,000	2,037.00	2,037,000
T A C	1,100	201.00	221,100
C Eホールディングス	900	501.00	450,900
日本システム技術	800	1,659.00	1,327,200
電通グループ	13,700	4,100.00	56,170,000
インテージホールディングス	1,700	1,375.00	2,337,500
テイクアンドギヴニーズ	500	1,413.00	706,500
東邦システムサイエンス	500	995.00	497,500
ぴあ	500	3,065.00	1,532,500
イオンファンタジー	500	2,817.00	1,408,500
ソースネクスト	6,600	306.00	2,019,600
シーティーエス	1,300	768.00	998,400
ネクシィーズグループ	500	638.00	319,000

インフォコム	1,200	2,063.00	2,475,600
メディカルシステムネットワーク	1,200	409.00	490,800
日本精化	1,000	2,202.00	2,202,000
扶桑化学工業	900	3,450.00	3,105,000
トリケミカル	1,200	2,096.00	2,515,200
HEROZ	500	999.00	499,500
ラクスル	1,300	3,170.00	4,121,000
メルカリ	5,600	2,831.00	15,853,600
I P S	400	2,704.00	1,081,600
F I G	1,300	368.00	478,400
システムサポート	500	1,386.00	693,000
A D E K A	6,200	2,144.00	13,292,800
日油	4,700	5,160.00	24,252,000
ミヨシ油脂	500	912.00	456,000
新日本理化	2,200	244.00	536,800
ハリマ化成グループ	1,000	807.00	807,000
イーソル	900	771.00	693,900
アルテリア・ネットワークス	1,300	1,235.00	1,605,500
ウイングアーク1ST	900	2,003.00	1,802,700
ヒト・コミュニケーションズHD	400	1,451.00	580,400
サーバーワークス	100	2,441.00	244,100
トピラシステムズ	400	826.00	330,400
S a n s a n	5,200	1,245.00	6,474,000
L i n k - U	400	965.00	386,000
ギフトィ	1,400	1,746.00	2,444,400
花 王	32,300	5,099.00	164,697,700
第一工業製薬	500	1,948.00	974,000
石原ケミカル	1,000	1,206.00	1,206,000
日華化学	500	807.00	403,500
ニイタカ	500	1,947.00	973,500
三洋化成	900	4,005.00	3,604,500
J M D C	1,300	3,730.00	4,849,000
武田薬品	116,800	4,026.00	470,236,800
アステラス製薬	127,100	1,901.50	241,680,650
住友ファーマ	10,100	909.00	9,180,900
塩野義製薬	17,600	6,311.00	111,073,600
わかもと製薬	1,700	218.00	370,600
日本新薬	3,200	7,030.00	22,496,000
中外製薬	41,500	3,307.00	137,240,500
科研製薬	2,200	3,665.00	8,063,000

エーザイ	16,800	8,541.00	143,488,800	
理研ビタミン	1,200	1,841.00	2,209,200	
ロート製薬	13,200	2,170.00	28,644,000	
小野薬品	25,600	2,857.00	73,139,200	
久光製薬	3,900	3,645.00	14,215,500	
有機合成薬品	1,000	289.00	289,000	
持田製薬	1,800	3,190.00	5,742,000	
参天製薬	24,300	1,017.00	24,713,100	
扶桑薬品	500	1,934.00	967,000	
ツムラ	4,900	2,706.00	13,259,400	
日医工	3,900	64.00	249,600	
テルモ	42,100	3,569.00	150,254,900	
HUグループHD	3,500	2,800.00	9,800,000	
キッセイ薬品工業	2,700	2,453.00	6,623,100	
生化学工業	2,700	831.00	2,243,700	
栄研化学	2,700	1,620.00	4,374,000	
鳥居薬品	1,000	2,865.00	2,865,000	
JCRファーマ	3,900	1,493.00	5,822,700	
東和薬品	2,200	2,014.00	4,430,800	
富士製薬工業	1,000	1,008.00	1,008,000	
ゼリア新薬工業	2,700	2,091.00	5,645,700	
第一三共	115,600	4,030.00	465,868,000	
キョーリン製薬HD	3,200	1,645.00	5,264,000	
大幸薬品	2,100	367.00	770,700	
ダイト	1,000	2,418.00	2,418,000	
大塚ホールディングス	29,100	4,042.00	117,622,200	
大正製薬HD	3,500	5,280.00	18,480,000	
ペプチドリーム	7,500	1,983.00	14,872,500	
大日本塗料	1,700	761.00	1,293,700	
日本ペイントHOLD	51,700	1,151.00	59,506,700	
関西ペイント	14,200	1,590.00	22,578,000	
神東塗料	1,200	131.00	157,200	
中国塗料	3,200	959.00	3,068,800	
日本特殊塗料	1,000	861.00	861,000	
藤倉化成	1,700	413.00	702,100	
太陽ホールディングス	2,300	2,260.00	5,198,000	
DIC	5,700	2,345.00	13,366,500	
サカタインクス	2,700	1,024.00	2,764,800	
東洋インキSCホールディング	3,100	1,794.00	5,561,400	
T&K TOKA	1,000	1,260.00	1,260,000	

アルプス技研	1,200	2,037.00	2,444,400
サニックス	2,200	204.00	448,800
日本空調サービス	1,300	677.00	880,100
オリエンタルランド	14,400	19,110.00	275,184,000
フォーカスシステムズ	1,000	995.00	995,000
ダスキン	3,200	2,949.00	9,436,800
パーク24	7,600	2,128.00	16,172,800
明光ネットワークジャパン	1,700	615.00	1,045,500
ファルコホールディングス	500	1,683.00	841,500
クレスコ	1,000	1,695.00	1,695,000
フジ・メディア・HD	14,200	1,047.00	14,867,400
秀英予備校	500	431.00	215,500
田谷	500	530.00	265,000
ラウンドワン	13,200	465.00	6,138,000
リゾートトラスト	6,100	2,289.00	13,962,900
オービック	4,400	19,630.00	86,372,000
ジャストシステム	1,800	2,891.00	5,203,800
TDCソフト	1,400	1,420.00	1,988,000
Zホールディングス	199,800	336.80	67,292,640
ビー・エム・エル	1,700	3,220.00	5,474,000
トレンドマイクロ	7,500	6,020.00	45,150,000
りらいあコミュニケーション	2,200	970.00	2,134,000
IDホールディングス	900	903.00	812,700
リソー教育	6,600	365.00	2,409,000
日本オラクル	2,700	8,300.00	22,410,000
早稲田アカデミー	500	1,114.00	557,000
アルファシステムズ	500	3,805.00	1,902,500
フューチャー	2,600	1,581.00	4,110,600
CAC HOLDINGS	1,000	1,405.00	1,405,000
SBテクノロジー	500	1,855.00	927,500
トーセ	500	722.00	361,000
ユー・エス・エス	15,000	2,019.00	30,285,000
オービックビジネスC	1,300	4,260.00	5,538,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,100	3,040.00	18,544,000
アイティフォー	1,700	819.00	1,392,300
東京個別指導学院	1,400	531.00	743,400
サイバーエージェント	33,000	1,159.00	38,247,000
楽天グループ	68,400	619.00	42,339,600
クリーク・アンド・リバー社	900	1,919.00	1,727,100
モーニングスター	1,700	461.00	783,700

テー・オー・ダブリュー	2,200	283.00	622,600
大塚商会	7,500	4,190.00	31,425,000
サイボウズ	1,700	2,333.00	3,966,100
山田コンサルティングG P	900	1,151.00	1,035,900
セントラルスポーツ	500	2,359.00	1,179,500
パラカ	500	1,835.00	917,500
電通国際情報S	1,700	3,930.00	6,681,000
A C C E S S	1,600	863.00	1,380,800
デジタルガレージ	2,200	4,155.00	9,141,000
イーエムシステムズ	2,200	854.00	1,878,800
ウェザーニューズ	500	6,890.00	3,445,000
C I J	1,200	859.00	1,030,800
日本エンタープライズ	1,300	123.00	159,900
WOWOW	500	1,255.00	627,500
スカラ	1,200	704.00	844,800
インテリジェント ウェイブ	1,000	730.00	730,000
フルキャストホールディングス	1,200	2,619.00	3,142,800
エン・ジャパン	2,200	2,323.00	5,110,600
あすか製薬HD	1,700	1,266.00	2,152,200
サワイグループHD	3,100	3,900.00	12,090,000
富士フイルムH L D G S	26,100	6,583.00	171,816,300
コニカミノルタ	28,300	507.00	14,348,100
資 生 堂	27,700	6,690.00	185,313,000
ライオン	16,900	1,437.00	24,285,300
高砂香料	1,000	2,499.00	2,499,000
マンダム	3,100	1,403.00	4,349,300
ミルボン	1,700	5,660.00	9,622,000
ファンケル	5,300	2,665.00	14,124,500
コーセー	2,700	14,140.00	38,178,000
コタ	900	1,648.00	1,483,200
ポーラ・オルビスHD	6,100	1,839.00	11,217,900
ノエビアホールディングス	1,200	5,440.00	6,528,000
アジュバンホールディング	500	960.00	480,000
新日本製薬	500	1,364.00	682,000
エステー	1,000	1,475.00	1,475,000
アグロカネショウ	500	1,518.00	759,000
コ ニ シ	2,200	1,695.00	3,729,000
長谷川香料	2,200	2,810.00	6,182,000
星光P M C	900	529.00	476,100
小林製薬	3,900	8,680.00	33,852,000

荒川化学工業	1,200	949.00	1,138,800
メック	1,000	2,203.00	2,203,000
日本高純度化学	500	2,359.00	1,179,500
タカラバイオ	3,500	1,667.00	5,834,500
J C U	1,700	3,160.00	5,372,000
新田ゼラチン	1,000	830.00	830,000
O A Tアグリオ	800	1,450.00	1,160,000
デクセリアルズ	3,900	2,591.00	10,104,900
アース製薬	1,300	4,875.00	6,337,500
北興化学	1,200	795.00	954,000
大成ラミック	500	2,922.00	1,461,000
クミアイ化学	5,500	836.00	4,598,000
日本農薬	2,700	694.00	1,873,800
富士興産	500	1,197.00	598,500
ニチレキ	1,700	1,266.00	2,152,200
ユシロ化学	900	764.00	687,600
ビーピー・カストロール	500	864.00	432,000
富士石油	3,400	253.00	860,200
M O R E S C O	500	1,170.00	585,000
出光興産	15,500	2,963.00	45,926,500
E N E O Sホールディングス	239,700	445.30	106,738,410
コスモエネルギーH L D G S	4,400	3,500.00	15,400,000
テスホールディングス	1,000	1,076.00	1,076,000
インフロニアHD	17,200	1,003.00	17,251,600
横浜ゴム	7,900	2,005.00	15,839,500
T O Y O T I R E	7,600	1,490.00	11,324,000
ブリヂストン	42,400	4,704.00	199,449,600
住友ゴム	12,300	1,118.00	13,751,400
藤倉コンポジット	1,200	826.00	991,200
オカモト	900	3,625.00	3,262,500
アキレス	1,000	1,234.00	1,234,000
フ コ ク	500	1,013.00	506,500
ニッタ	1,300	2,763.00	3,591,900
クリエートメディック	500	871.00	435,500
住友理工	2,700	616.00	1,663,200
三ツ星ベルト	1,700	3,420.00	5,814,000
バンドー化学	2,700	937.00	2,529,900
A G C	12,800	4,550.00	58,240,000
日本板硝子	7,100	645.00	4,579,500
石塚硝子	400	1,430.00	572,000

有沢製作所	1,800	1,295.00	2,331,000	
日本山村硝子	500	533.00	266,500	
日本電気硝子	5,600	2,388.00	13,372,800	
オハラ	500	1,107.00	553,500	
住友大阪セメント	2,700	3,140.00	8,478,000	
太平洋セメント	7,900	2,024.00	15,989,600	
日本ヒユ-ム	1,200	634.00	760,800	
日本コンクリ-ト	3,200	218.00	697,600	
三谷セキサン	500	3,755.00	1,877,500	
アジアパイルHD	2,200	560.00	1,232,000	
東海カーボン	11,900	1,084.00	12,899,600	
日本カーボン	900	4,255.00	3,829,500	
東洋炭素	1,000	3,720.00	3,720,000	
ノリタケ	900	3,990.00	3,591,000	
TOTO	9,000	4,965.00	44,685,000	
日本碍子	15,400	1,676.00	25,810,400	
日本特殊陶業	10,600	2,438.00	25,842,800	
ダントーホールディングス	1,000	209.00	209,000	
MARUWA	400	16,550.00	6,620,000	
品川リフラクトリーズ	500	3,875.00	1,937,500	
黒崎播磨	400	5,380.00	2,152,000	
ヨータイ	1,000	1,352.00	1,352,000	
東京窯業	1,700	269.00	457,300	
ニッカトー	500	490.00	245,000	
フジインコーポレーテッド	1,200	6,530.00	7,836,000	
クニミネ工業	500	825.00	412,500	
エーアンドエーマテリアル	400	870.00	348,000	
ニチアス	3,400	2,339.00	7,952,600	
日本製鉄	62,000	2,368.00	146,816,000	
神戸製鋼所	25,300	650.00	16,445,000	
中山製鋼所	1,800	838.00	1,508,400	
合同製鐵	900	2,150.00	1,935,000	
JFEホールディングス	37,400	1,540.00	57,596,000	
東京製鐵	5,400	1,212.00	6,544,800	
共英製鋼	1,700	1,282.00	2,179,400	
大和工業	3,100	4,505.00	13,965,500	
東京鐵鋼	500	1,457.00	728,500	
大阪製鐵	900	1,141.00	1,026,900	
淀川製鋼所	1,700	2,485.00	4,224,500	
丸一鋼管	4,400	2,703.00	11,893,200	

モリ工業	500	2,756.00	1,378,000
大同特殊鋼	2,200	4,310.00	9,482,000
日本高周波	600	308.00	184,800
日本冶金工	1,000	4,230.00	4,230,000
山陽特殊製鋼	1,700	2,059.00	3,500,300
愛知製鋼	900	2,155.00	1,939,500
日本金属	500	889.00	444,500
大平洋金属	1,000	1,907.00	1,907,000
新日本電工	8,800	365.00	3,212,000
栗本鉄工所	500	1,706.00	853,000
日本製鋼所	4,400	2,596.00	11,422,400
三菱製鋼	1,000	993.00	993,000
日亜鋼業	2,200	244.00	536,800
エンピプロHD	1,000	698.00	698,000
大紀アルミニウム	2,200	1,270.00	2,794,000
日本軽金属HD	3,900	1,537.00	5,994,300
三井金属	3,500	3,140.00	10,990,000
東邦亜鉛	900	2,078.00	1,870,200
三菱マテリアル	9,300	2,084.00	19,381,200
住友鉱山	16,100	4,865.00	78,326,500
DOWAホールディングス	3,400	4,135.00	14,059,000
古河機金	2,200	1,252.00	2,754,400
エス・サイエンス	6,500	25.00	162,500
大阪チタニウム	1,300	3,850.00	5,005,000
東邦チタニウム	2,700	2,598.00	7,014,600
UACJ	2,200	2,332.00	5,130,400
CKサンエツ	500	3,955.00	1,977,500
古河電工	4,400	2,414.00	10,621,600
住友電工	48,100	1,481.50	71,260,150
フジクラ	16,700	968.00	16,165,600
昭和電線HLDGS	1,200	1,738.00	2,085,600
タツタ電線	2,600	714.00	1,856,400
平河ビューテック	900	1,109.00	998,100
リョービ	1,700	1,160.00	1,972,000
アーレステイ	1,700	442.00	751,400
アサヒHD	5,400	1,943.00	10,492,200
東洋製罐グループHD	8,800	1,570.00	13,816,000
ホッカンホールディングス	900	1,348.00	1,213,200
コロナ	900	863.00	776,700
横河ブリッジHLDGS	2,200	1,823.00	4,010,600

駒井ハルテック	500	1,473.00	736,500
三和ホールディングス	13,200	1,208.00	15,945,600
文化シャツタ -	3,900	1,114.00	4,344,600
三協立山	1,700	535.00	909,500
アルインコ	1,000	971.00	971,000
東洋シャツタ -	500	510.00	255,000
L I X I L	21,800	2,033.00	44,319,400
日本フィルコン	1,000	448.00	448,000
ノーリツ	2,700	1,421.00	3,836,700
長府製作所	1,300	1,896.00	2,464,800
リンナイ	2,700	9,600.00	25,920,000
ユニプレス	2,200	756.00	1,663,200
ダイニチ工業	500	651.00	325,500
日東精工	1,700	485.00	824,500
岡 部	2,700	707.00	1,908,900
ジーテクト	1,700	1,419.00	2,412,300
東 プ レ	2,700	1,152.00	3,110,400
高周波熱錬	2,700	653.00	1,763,100
東京製綱	1,000	855.00	855,000
サンコール	1,500	641.00	961,500
モリテックスチル	1,000	267.00	267,000
パイオラックス	2,200	1,719.00	3,781,800
エイチワン	1,200	607.00	728,400
日本発条	13,700	840.00	11,508,000
中央発條	800	721.00	576,800
三浦工業	6,100	3,070.00	18,727,000
タ ク マ	4,900	1,204.00	5,899,600
テクノプロ・ホールディング	7,800	3,415.00	26,637,000
アトラグループ	500	181.00	90,500
インターワークス	500	348.00	174,000
アイ・アールジャパンHD	500	1,754.00	877,000
K e e P e r 技研	1,000	3,310.00	3,310,000
ファーストロジック	500	870.00	435,000
三機サービス	400	929.00	371,600
G u n o s y	1,000	589.00	589,000
デザインワン・ジャパン	500	210.00	105,000
イー・ガーディアン	500	2,600.00	1,300,000
リブセンス	1,100	268.00	294,800
ジャパンマテリアル	4,000	2,212.00	8,848,000
ベクトル	1,700	1,274.00	2,165,800

ウチヤマホールディングス	600	270.00	162,000	
チャームケアコーポレーション	1,000	1,208.00	1,208,000	
キャリアリンク	500	2,640.00	1,320,000	
I B J	1,000	969.00	969,000	
アサンテ	500	1,601.00	800,500	
バリューHR	1,000	1,412.00	1,412,000	
M & Aキャピタルパートナー	900	4,655.00	4,189,500	
ライドオンエクスプレスHD	500	1,085.00	542,500	
E R Iホールディングス	500	1,165.00	582,500	
シグマクシス・ホールディング	1,800	1,187.00	2,136,600	
ウィルグループ	1,000	1,198.00	1,198,000	
エスクローAJ	1,800	144.00	259,200	
メドピア	1,000	1,306.00	1,306,000	
レアジョブ	400	905.00	362,000	
リクルートホールディングス	101,700	4,208.00	427,953,600	
エラン	1,700	932.00	1,584,400	
ツガミ	2,700	1,218.00	3,288,600	
オークマ	1,700	4,655.00	7,913,500	
芝浦機械	1,300	2,700.00	3,510,000	
アマダ	20,300	1,034.00	20,990,200	
アイダエンジニア	3,500	776.00	2,716,000	
TAKISAWA	500	1,076.00	538,000	
FUJII	5,800	1,981.00	11,489,800	
牧野フライス	1,700	4,305.00	7,318,500	
オーエスジー	6,300	1,801.00	11,346,300	
旭ダイヤモンド	3,500	695.00	2,432,500	
DMG森精機	8,400	1,811.00	15,212,400	
ソディック	3,200	728.00	2,329,600	
ディスコ	2,000	38,650.00	77,300,000	
日東工器	900	1,467.00	1,320,300	
日進工具	1,000	985.00	985,000	
パンチ工業	1,200	385.00	462,000	
富士ダイス	1,000	576.00	576,000	
土木管理総合試験	600	304.00	182,400	
ベルシステム24HLDGS	2,200	1,331.00	2,928,200	
鎌倉新書	1,300	942.00	1,224,600	
SMN	500	454.00	227,000	
エアトリ	900	2,578.00	2,320,200	
アトラエ	1,000	1,187.00	1,187,000	
ストライク	500	4,295.00	2,147,500	

ソラスト	3,200	678.00	2,169,600
セラク	500	1,143.00	571,500
インソース	2,400	1,360.00	3,264,000
豊田自動織機	10,500	7,340.00	77,070,000
豊和工業	900	945.00	850,500
ニデックオーケーケー	600	897.00	538,200
石川製作所	500	1,449.00	724,500
東洋機械金属	1,000	551.00	551,000
津田駒工業	500	589.00	294,500
エンシュウ	500	675.00	337,500
島精機製作所	2,200	1,788.00	3,933,600
オプトラン	1,700	2,465.00	4,190,500
NCホールディングス	500	2,039.00	1,019,500
イワキポンプ	1,000	1,190.00	1,190,000
フリー	1,200	1,039.00	1,246,800
ヤマシンフィルタ	2,700	502.00	1,355,400
日阪製作所	1,700	812.00	1,380,400
やまびこ	2,700	1,070.00	2,889,000
野村マイクロ・サイエンス	500	4,160.00	2,080,000
平田機工	500	5,540.00	2,770,000
ペガサスミシン製造	1,300	757.00	984,100
マルマエ	500	1,627.00	813,500
タツモ	500	1,625.00	812,500
ナブテスコ	7,900	3,360.00	26,544,000
三井海洋開発	1,300	1,332.00	1,731,600
レオン自動機	1,200	1,017.00	1,220,400
S M C	4,300	59,750.00	256,925,000
ホソカワミクロン	1,000	2,647.00	2,647,000
ユニオンツール	500	3,215.00	1,607,500
オイレス工業	1,800	1,445.00	2,601,000
日精エーエスビー	500	4,285.00	2,142,500
サト - ホールディングス	1,700	1,891.00	3,214,700
技研製作所	1,200	2,869.00	3,442,800
日本エアテック	500	1,041.00	520,500
カワタ	500	816.00	408,000
日精樹脂工業	1,000	925.00	925,000
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	1,881.00	940,500
小松製作所	62,600	2,851.00	178,472,600
住友重機械	7,900	2,641.00	20,863,900

日立建機	5,600	2,920.00	16,352,000
日 工	2,200	609.00	1,339,800
巴工業	500	2,279.00	1,139,500
井関農機	1,300	1,171.00	1,522,300
T O W A	1,200	1,796.00	2,155,200
丸山製作所	500	1,539.00	769,500
北川鉄工所	500	1,121.00	560,500
シンニッタン	1,800	221.00	397,800
ローツェ	500	7,680.00	3,840,000
タカキタ	500	395.00	197,500
クボタ	68,300	1,819.50	124,271,850
荏原実業	600	2,214.00	1,328,400
東洋エンジニア	1,700	592.00	1,006,400
三菱化工機	500	2,072.00	1,036,000
月島機械	2,700	951.00	2,567,700
帝国電機製作所	1,000	2,234.00	2,234,000
東京機械	600	539.00	323,400
新東工業	3,600	662.00	2,383,200
渋谷工業	1,200	2,271.00	2,725,200
アイチ コーポレーション	2,200	757.00	1,665,400
小森コーポレーション	3,500	803.00	2,810,500
鶴見製作所	1,000	1,946.00	1,946,000
日本ギア工業	500	359.00	179,500
酒井重工業	400	3,430.00	1,372,000
荏原製作所	5,700	4,780.00	27,246,000
西島製作所	1,300	1,421.00	1,847,300
北越工業	1,300	1,312.00	1,705,600
ダイキン工業	16,200	21,330.00	345,546,000
オルガノ	2,000	2,881.00	5,762,000
ト - ヨ - カネツ	500	2,548.00	1,274,000
栗田工業	7,600	5,470.00	41,572,000
椿本チエイン	2,200	2,967.00	6,527,400
大同工業	900	739.00	665,100
日 機 装	4,000	957.00	3,828,000
木村化工機	1,400	749.00	1,048,600
レイズネクスト	2,200	1,269.00	2,791,800
アネスト岩田	2,200	840.00	1,848,000
ダイフク	7,500	6,440.00	48,300,000
サムコ	500	3,265.00	1,632,500
加藤製作所	900	699.00	629,100

油研工業	400	1,799.00	719,600	
タダノ	6,600	900.00	5,940,000	
フジテック	4,900	2,969.00	14,548,100	
C K D	3,200	1,950.00	6,240,000	
平和	3,900	2,329.00	9,083,100	
理想科学工業	1,000	2,020.00	2,020,000	
S A N K Y O	3,500	4,925.00	17,237,500	
日本金銭機械	1,700	1,071.00	1,820,700	
マースグループH L D G S	1,000	2,215.00	2,215,000	
フクシマガリレイ	900	4,155.00	3,739,500	
オーイズミ	600	470.00	282,000	
ダイコク電機	500	1,896.00	948,000	
竹内製作所	2,200	2,791.00	6,140,200	
ア マ ノ	3,500	2,355.00	8,242,500	
J U K I	1,800	604.00	1,087,200	
サンデン	1,800	190.00	342,000	
ジャノメ	1,200	573.00	687,600	
ブラザー工業	17,100	1,963.00	33,567,300	
マックス	1,800	1,876.00	3,376,800	
モリタホールディングス	2,200	1,152.00	2,534,400	
グローリー	3,500	2,146.00	7,511,000	
新晃工業	1,200	1,457.00	1,748,400	
大和冷機工業	2,200	1,110.00	2,442,000	
セガサミーホールディングス	12,700	1,928.00	24,485,600	
日本ピストンリング	500	1,212.00	606,000	
リ ケ ン	500	2,254.00	1,127,000	
T P R	1,700	1,227.00	2,085,900	
ツバキ・ナカシマ	3,100	1,025.00	3,177,500	
ホシザキ	8,000	4,465.00	35,720,000	
大豊工業	1,400	607.00	849,800	
日本精工	28,700	696.00	19,975,200	
N T N	32,200	257.00	8,275,400	
ジェイテクト	13,300	915.00	12,169,500	
不 二 越	1,200	3,670.00	4,404,000	
ミネベアミツミ	24,200	2,036.00	49,271,200	
日本トムソン	3,900	528.00	2,059,200	
T H K	8,000	2,550.00	20,400,000	
ユーシン精機	1,000	664.00	664,000	
前澤給装工業	1,000	908.00	908,000	
イーグル工業	1,700	1,071.00	1,820,700	

前澤工業	1,000	614.00	614,000
日本ピラ - 工業	1,300	2,862.00	3,720,600
キッツ	4,800	787.00	3,777,600
日立	67,100	6,517.00	437,290,700
東芝	26,000	4,549.00	118,274,000
三菱電機	139,900	1,276.00	178,512,400
富士電機	8,300	5,180.00	42,994,000
東洋電機製造	500	848.00	424,000
安川電機	15,000	4,235.00	63,525,000
シンフォニアテクノロジー	1,700	1,470.00	2,499,000
明電舎	2,200	1,824.00	4,012,800
オリジン	500	1,219.00	609,500
山洋電気	900	5,670.00	5,103,000
デンヨー	1,200	1,489.00	1,786,800
PHCホールディングス	1,600	1,453.00	2,324,800
ソシオネクスト	1,400	6,830.00	9,562,000
ベйкаレントコンサルティング	9,000	4,275.00	38,475,000
ORCHESTRA HLDGS	500	1,870.00	935,000
アイモバイル	500	1,152.00	576,000
キャリアインデックス	500	311.00	155,500
MS - Japan	500	1,053.00	526,500
船場	500	710.00	355,000
ジャパンエレベーターSHD	3,900	1,603.00	6,251,700
グリーンズ	500	1,082.00	541,000
ツナググループHLDGS	500	471.00	235,500
GAMEWITH	500	307.00	153,500
MS&CONSULTING	100	613.00	61,300
ウェルビー	500	685.00	342,500
ミダックホールディングス	500	2,578.00	1,289,000
日総工産	1,000	562.00	562,000
キュービーネットHLDGS	500	1,339.00	669,500
RPAホールディングス	1,700	263.00	447,100
三桜工業	1,800	630.00	1,134,000
マキタ	17,000	3,090.00	52,530,000
東芝テック	1,300	3,515.00	4,569,500
芝浦メカトロニクス	400	10,410.00	4,164,000
マブチモーター	3,100	3,600.00	11,160,000
日本電産	33,000	6,928.00	228,624,000
ユーエムシーエレクトロニクス	1,000	471.00	471,000
トレックス・セミコンダクター	900	2,548.00	2,293,200

東光高岳	900	1,947.00	1,752,300	
ダブル・スコープ	3,700	1,350.00	4,995,000	
宮越ホールディングス	500	740.00	370,000	
ダイヘン	1,300	3,920.00	5,096,000	
ヤーマン	2,200	1,357.00	2,985,400	
JVCケンウッド	12,000	348.00	4,176,000	
ミマキエンジニアリング	1,200	596.00	715,200	
I - P E X	500	1,139.00	569,500	
日新電機	3,200	1,287.00	4,118,400	
大崎電気	2,700	508.00	1,371,600	
オムロン	11,500	6,515.00	74,922,500	
日東工業	2,200	2,245.00	4,939,000	
I D E C	1,700	2,805.00	4,768,500	
正興電機製作所	500	943.00	471,500	
ジーエス・ユアサ コーポ	4,900	2,126.00	10,417,400	
サクサホールディングス	500	1,180.00	590,000	
メルコホールディングス	500	2,967.00	1,483,500	
テクノメディカ	500	1,686.00	843,000	
ダイヤモンドエレクトリックHD	500	1,362.00	681,000	
日本電気	17,700	4,500.00	79,650,000	
富士通	13,100	17,650.00	231,215,000	
沖電気	5,600	699.00	3,914,400	
岩崎通信機	500	767.00	383,500	
電気興業	900	1,906.00	1,715,400	
サンケン電気	1,300	6,810.00	8,853,000	
ナカヨ	400	1,054.00	421,600	
アイホン	900	1,795.00	1,615,500	
ルネサスエレクトロニクス	81,500	1,220.50	99,470,750	
セイコーエプソン	17,200	1,942.00	33,402,400	
ワコム	10,100	586.00	5,918,600	
アルバック	2,700	5,790.00	15,633,000	
アクセル	500	1,609.00	804,500	
E I Z O	1,400	3,370.00	4,718,000	
ジャパンディスプレイ	47,900	40.00	1,916,000	
日本信号	3,200	990.00	3,168,000	
京三製作所	3,200	397.00	1,270,400	
能美防災	1,700	1,526.00	2,594,200	
ホーチキ	1,000	1,374.00	1,374,000	
星和電機	600	430.00	258,000	
エレコム	3,200	1,332.00	4,262,400	

パナソニック ホールディング	158,500	1,096.50	173,795,250	
シャープ	16,000	983.00	15,728,000	
アンリツ	8,300	1,251.00	10,383,300	
富士通ゼネラル	4,400	3,075.00	13,530,000	
ソニーグループ	93,100	10,725.00	998,497,500	
T D K	20,200	4,330.00	87,466,000	
帝国通信工業	500	1,370.00	685,000	
タムラ製作所	4,900	715.00	3,503,500	
アルプスアルパイン	11,500	1,213.00	13,949,500	
池上通信機	500	524.00	262,000	
日本電波工業	1,200	1,519.00	1,822,800	
鈴木	500	839.00	419,500	
メイコー	1,000	2,605.00	2,605,000	
日本トリム	500	2,635.00	1,317,500	
ローランド ディー . ジー .	1,000	2,792.00	2,792,000	
フオスタ - 電機	1,300	872.00	1,133,600	
S M K	500	2,306.00	1,153,000	
ヨコオ	1,400	2,150.00	3,010,000	
ティアック	1,100	116.00	127,600	
ホシデン	3,500	1,536.00	5,376,000	
ヒロセ電機	2,200	16,190.00	35,618,000	
日本航空電子	3,200	2,121.00	6,787,200	
T O A	1,700	756.00	1,285,200	
マクセル	2,700	1,354.00	3,655,800	
古野電気	1,700	937.00	1,592,900	
スミダコーポレーション	1,200	1,445.00	1,734,000	
アイコム	500	2,571.00	1,285,500	
リオン	500	1,762.00	881,000	
横河電機	14,200	2,112.00	29,990,400	
新電元工業	500	3,145.00	1,572,500	
アズビル	8,200	3,325.00	27,265,000	
東亜ディーケーケー	900	781.00	702,900	
日本光電工業	5,700	3,150.00	17,955,000	
チ ノ ー	500	1,755.00	877,500	
共和電業	1,300	333.00	432,900	
日本電子材料	500	1,405.00	702,500	
堀場製作所	2,700	5,790.00	15,633,000	
アドバンテスト	10,600	8,670.00	91,902,000	
小野測器	500	385.00	192,500	
エスベック	1,200	1,862.00	2,234,400	

キーエンス	13,200	52,240.00	689,568,000	
日置電機	900	6,170.00	5,553,000	
シスメックス	10,600	7,910.00	83,846,000	
日本マイクロニクス	2,600	1,339.00	3,481,400	
メガチップス	1,300	2,526.00	3,283,800	
O B A R A G R O U P	500	3,585.00	1,792,500	
I M A G I C A G R O U P	1,400	638.00	893,200	
デンソー	27,300	6,545.00	178,678,500	
原田工業	500	842.00	421,000	
コーセル	1,700	1,000.00	1,700,000	
イリソ電子工業	1,200	4,340.00	5,208,000	
オプテックスグループ	2,200	1,848.00	4,065,600	
千代田インテグレ	500	2,177.00	1,088,500	
レーザーテック	6,500	23,010.00	149,565,000	
スタンレー電気	9,800	2,543.00	24,921,400	
岩崎電気	500	2,282.00	1,141,000	
ウシオ電機	7,100	1,638.00	11,629,800	
岡谷電機	1,000	250.00	250,000	
ヘリオステクノH	1,200	478.00	573,600	
エノモト	500	1,708.00	854,000	
日本セラミック	1,300	2,313.00	3,006,900	
遠藤照明	1,000	725.00	725,000	
古河電池	1,000	1,062.00	1,062,000	
双信電機	1,000	361.00	361,000	
山一電機	1,000	1,739.00	1,739,000	
図 研	1,000	2,963.00	2,963,000	
日本電子	2,700	3,550.00	9,585,000	
カ シ オ	11,100	1,309.00	14,529,900	
ファナック	12,800	19,910.00	254,848,000	
日本シイエムケイ	3,200	469.00	1,500,800	
エンプラス	500	3,585.00	1,792,500	
大真空	2,000	699.00	1,398,000	
ロ - ム	6,300	9,720.00	61,236,000	
浜松ホトニクス	10,200	6,430.00	65,586,000	
三井ハイテック	1,300	6,550.00	8,515,000	
新光電気工業	4,100	3,750.00	15,375,000	
京 セ ラ	20,900	6,506.00	135,975,400	
太陽誘電	6,100	4,200.00	25,620,000	
村田製作所	40,100	6,962.00	279,176,200	
双葉電子工業	2,200	526.00	1,157,200	

日東電工	9,600	7,700.00	73,920,000
北陸電気工業	500	1,229.00	614,500
東海理化電機	3,500	1,399.00	4,896,500
ニチコン	4,400	1,228.00	5,403,200
日本ケミコン	1,300	1,581.00	2,055,300
K O A	1,800	1,871.00	3,367,800
三井E & S H D	5,400	382.00	2,062,800
日立造船	11,000	801.00	8,811,000
三菱重工業	23,400	4,990.00	116,766,000
川崎重工業	11,000	2,932.00	32,252,000
I H I	9,300	3,660.00	34,038,000
名村造船所	4,400	383.00	1,685,200
サノヤスホールディングス	1,700	124.00	210,800
スプリックス	500	879.00	439,500
マネジメントソリューションズ	500	3,295.00	1,647,500
プロレド・パートナーズ	400	496.00	198,400
AND FACTORY	400	361.00	144,400
フロンティア・マネジメント	400	1,282.00	512,800
カーブスホールディングス	3,500	851.00	2,978,500
フォーラムエンジニアリング	900	835.00	751,500
FAST FITNESS JAP	200	1,135.00	227,000
日本車輛	500	1,910.00	955,000
三菱ロジスネクスト	1,700	652.00	1,108,400
一家ホールディングス	400	619.00	247,600
フルサト・マルカHD	1,400	3,200.00	4,480,000
ヤマエグループHD	1,000	1,409.00	1,409,000
ジャパクラフトホールディ	500	613.00	306,500
日産自動車	187,900	431.20	81,022,480
いすゞ自動車	38,500	1,524.00	58,674,000
トヨタ自動車	726,400	1,827.00	1,327,132,800
日野自動車	17,600	500.00	8,800,000
三菱自動車工業	51,700	498.00	25,746,600
エフテック	1,000	508.00	508,000
レシップホールディングス	500	455.00	227,500
G M B	400	704.00	281,600
ファルテック	500	594.00	297,000
武蔵精密工業	3,200	1,563.00	5,001,600
日産車体	2,200	806.00	1,773,200
新明和工業	3,900	1,024.00	3,993,600
極東開発工業	2,200	1,427.00	3,139,400

トピー工業	1,400	1,548.00	2,167,200
ティラド	500	2,562.00	1,281,000
曙ブレーキ	7,700	150.00	1,155,000
タチエス	2,200	1,123.00	2,470,600
N O K	6,600	1,172.00	7,735,200
フタバ産業	3,400	345.00	1,173,000
K Y B	1,700	3,415.00	5,805,500
市光工業	1,800	359.00	646,200
大同メタル工業	3,100	477.00	1,478,700
プレス工業	7,100	418.00	2,967,800
ミクニ	1,700	323.00	549,100
太平洋工業	3,100	999.00	3,096,900
河西工業	1,700	133.00	226,100
アイシン	10,100	3,525.00	35,602,500
マ ッ ダ	43,700	1,007.00	44,005,900
今仙電機製作所	1,200	626.00	751,200
本田技研	108,600	3,157.00	342,850,200
スズキ	24,300	4,275.00	103,882,500
S U B A R U	40,200	2,068.50	83,153,700
安永	900	658.00	592,200
ヤマハ発動機	20,800	3,010.00	62,608,000
小糸製作所	15,400	2,060.00	31,724,000
T B K	1,700	239.00	406,300
エクセディ	1,700	1,608.00	2,733,600
ミツバ	2,700	452.00	1,220,400
豊田合成	4,400	2,029.00	8,927,600
愛三工業	2,200	683.00	1,502,600
日本プラスト	1,400	400.00	560,000
ヨ ロ ズ	1,200	696.00	835,200
エフ・シー・シー	2,200	1,334.00	2,934,800
新家工業	500	2,018.00	1,009,000
シマノ	5,100	21,115.00	107,686,500
テイ・エス テック	6,600	1,504.00	9,926,400
ダイレクトマーケティングミクス	1,800	1,524.00	2,743,200
ポピンス	400	1,683.00	673,200
L I T A L I C O	1,000	2,229.00	2,229,000
ジャムコ	1,000	1,390.00	1,390,000
小 野 建	1,200	1,452.00	1,742,400
はるやまH L D G S	500	434.00	217,000
南 陽	500	1,912.00	956,000

ノジマ	5,400	1,361.00	7,349,400
佐島電機	1,000	1,250.00	1,250,000
カップ・クリエイト	1,800	1,394.00	2,509,200
エコートレーディング	500	701.00	350,500
伯東	1,000	4,075.00	4,075,000
コンドーテック	1,000	975.00	975,000
中山福	900	320.00	288,000
ライトオン	1,000	605.00	605,000
ナガイレーベン	1,700	1,875.00	3,187,500
三菱食品	1,300	3,015.00	3,919,500
良品計画	15,900	1,409.00	22,403,100
パリミキホールディングス	1,700	265.00	450,500
松田産業	1,000	2,243.00	2,243,000
第一興商	2,600	3,850.00	10,010,000
メディパルHD	13,700	1,669.00	22,865,300
アドヴァングループ	1,300	808.00	1,050,400
S P K	500	1,378.00	689,000
萩原電気HLDGS	500	2,402.00	1,201,000
アルビス	500	2,350.00	1,175,000
アズワン	1,800	5,420.00	9,756,000
スズデン	500	2,218.00	1,109,000
尾家産業	500	931.00	465,500
シモジマ	1,000	939.00	939,000
ドウシシャ	1,200	1,611.00	1,933,200
小津産業	500	1,527.00	763,500
コナカ	1,700	337.00	572,900
高速	900	1,700.00	1,530,000
G - 7ホールディングス	1,400	1,547.00	2,165,800
たけびし	500	1,520.00	760,000
イオン北海道	1,700	1,109.00	1,885,300
コジマ	2,200	565.00	1,243,000
ヒマラヤ	500	938.00	469,000
コーナン商事	1,800	3,325.00	5,985,000
ネットワンシステムズ	5,600	3,285.00	18,396,000
エコス	500	1,806.00	903,000
ワタミ	1,700	966.00	1,642,200
マルシェ	500	390.00	195,000
リックス	500	2,182.00	1,091,000
システムソフト	3,300	91.00	300,300
パンパシフィックHD	31,400	2,333.00	73,256,200

丸文	1,200	932.00	1,118,400
西松屋チェーン	3,200	1,485.00	4,752,000
ゼンショーホールディングス	6,700	3,245.00	21,741,500
ハピネット	1,400	1,948.00	2,727,200
幸楽苑ホールディングス	1,000	1,043.00	1,043,000
ハークスレイ	600	825.00	495,000
橋本総業HLDGS	1,000	1,007.00	1,007,000
日本ライフライン	4,400	893.00	3,929,200
サイゼリヤ	2,200	2,933.00	6,452,600
タカショー	1,000	714.00	714,000
V Tホールディングス	5,400	471.00	2,543,400
アルゴグラフィックス	1,000	3,550.00	3,550,000
魚力	500	2,101.00	1,050,500
IDOM	4,900	672.00	3,292,800
日本エム・ディ・エム	900	836.00	752,400
ポプラ	500	142.00	71,000
フジ・コーポレーション	1,000	1,285.00	1,285,000
ユナイテッドアローズ	1,700	1,786.00	3,036,200
進和	900	1,980.00	1,782,000
エスケイジャパン	500	603.00	301,500
ダイトロン	500	2,242.00	1,121,000
ハイデイ日高	2,200	1,908.00	4,197,600
シークス	1,700	1,288.00	2,189,600
YU-WA CREATION H	1,100	198.00	217,800
コロワイド	5,200	1,766.00	9,183,200
ピーシーデポコーポ	1,700	271.00	460,700
田中商事	500	556.00	278,000
オーハシテクニカ	900	1,408.00	1,267,200
壱番屋	1,000	4,560.00	4,560,000
白銅	500	2,481.00	1,240,500
トップカルチャー	600	180.00	108,000
PLANT	500	648.00	324,000
スギホールディングス	2,700	5,680.00	15,336,000
薬王堂ホールディングス	500	2,859.00	1,429,500
島津製作所	16,100	3,650.00	58,765,000
J M S	1,200	485.00	582,000
クボテック	500	202.00	101,000
長野計器	1,000	1,072.00	1,072,000
ブイ・テクノロジー	500	2,600.00	1,300,000
スター精密	2,200	1,587.00	3,491,400

東京計器	1,000	1,257.00	1,257,000
インターアクション	900	1,588.00	1,429,200
オーバル	1,200	448.00	537,600
東京精密	2,200	4,370.00	9,614,000
マニー	5,600	1,915.00	10,724,000
ニコン	21,100	1,176.00	24,813,600
トプコン	7,100	1,512.00	10,735,200
オリンパス	82,700	2,423.50	200,423,450
理研計器	1,200	4,270.00	5,124,000
S C R E E Nホールディングス	2,200	8,930.00	19,646,000
キヤノン電子	1,200	1,503.00	1,803,600
タムロン	1,000	2,943.00	2,943,000
H O Y A	28,700	12,655.00	363,198,500
シ ー ド	500	495.00	247,500
ノーリツ鋼機	1,200	2,348.00	2,817,600
A & Dホロンホールディングス	1,200	1,010.00	1,212,000
朝日インテック	15,400	2,115.00	32,571,000
キヤノン	72,600	2,869.50	208,325,700
リ コ ー	35,700	974.00	34,771,800
シチズン時計	17,700	576.00	10,195,200
リズム	500	1,613.00	806,500
大研医器	1,400	447.00	625,800
メニコン	4,400	2,715.00	11,946,000
K Y O R I T S U	2,200	120.00	264,000
中本パックス	500	1,587.00	793,500
スノーピーク	1,800	2,366.00	4,258,800
パラマウントベッドHD	2,600	2,471.00	6,424,600
トランザクション	900	1,183.00	1,064,700
粧美堂	500	352.00	176,000
ニホンフラッシュ	1,200	873.00	1,047,600
前田工織	1,300	3,110.00	4,043,000
永大産業	1,700	220.00	374,000
アートネイチャー	1,200	731.00	877,200
バンダイナムコHLDGS	12,500	8,186.00	102,325,000
アイフィスジャパン	500	598.00	299,000
S H O E I	1,200	4,995.00	5,994,000
フランスベッドHLDGS	1,700	947.00	1,609,900
マーベラス	2,200	680.00	1,496,000
パイロットコーポレーション	2,300	4,690.00	10,787,000
萩原工業	900	1,158.00	1,042,200

エイベックス	2,200	1,649.00	3,627,800	
フジシールインターナショナル	3,100	1,608.00	4,984,800	
タカラトミー	6,200	1,235.00	7,657,000	
広済堂ホールディングス	1,000	1,875.00	1,875,000	
エステールホールディングス	500	625.00	312,500	
レック	1,700	942.00	1,601,400	
タカノ	500	661.00	330,500	
三光合成	1,300	424.00	551,200	
プロネクサス	800	945.00	756,000	
ホクシン	1,100	147.00	161,700	
ウッドワン	500	891.00	445,500	
大建工業	1,000	2,082.00	2,082,000	
きもと	2,200	219.00	481,800	
凸版印刷	17,300	1,915.00	33,129,500	
大日本印刷	16,400	2,601.00	42,656,400	
共同印刷	500	2,727.00	1,363,500	
N I S S H A	3,100	1,846.00	5,722,600	
藤森工業	1,200	3,030.00	3,636,000	
ヴィア・ホールディングス	1,700	100.00	170,000	
TAKARA & COMPANY	900	2,024.00	1,821,600	
前澤化成工業	1,000	1,331.00	1,331,000	
未来工業	500	1,448.00	724,000	
アシックス	12,300	2,895.00	35,608,500	
ツツミ	500	1,865.00	932,500	
ウェーブロックHLDGS	500	612.00	306,000	
ジェイ エス ピー	1,000	1,492.00	1,492,000	
ニチハ	1,800	2,605.00	4,689,000	
ローランド	900	3,440.00	3,096,000	
エフピコ	2,700	3,575.00	9,652,500	
小松ウオール工業	500	1,821.00	910,500	
ヤマハ	8,300	4,770.00	39,591,000	
河合楽器	500	2,510.00	1,255,000	
クリナップ	1,200	637.00	764,400	
ピジョン	8,500	2,070.00	17,595,000	
天馬	1,000	2,024.00	2,024,000	
キングジム	1,400	870.00	1,218,000	
象印マホービン	3,900	1,440.00	5,616,000	
リンテック	3,200	2,127.00	6,806,400	
信越ポリマー	2,200	1,133.00	2,492,600	
東リ	3,400	228.00	775,200	

イトーキ	2,800	604.00	1,691,200	
任 天 堂	84,000	5,470.00	459,480,000	
三菱鉛筆	2,200	1,365.00	3,003,000	
松 風	500	2,172.00	1,086,000	
タカラスタンダ - ド	3,100	1,344.00	4,166,400	
コ ク ヨ	6,600	1,768.00	11,668,800	
ナカバヤシ	1,300	471.00	612,300	
ニ フ コ	4,700	3,040.00	14,288,000	
立川ブラインド	500	1,136.00	568,000	
グローブライド	1,400	2,505.00	3,507,000	
オカムラ	4,900	1,383.00	6,776,700	
バルカー	1,400	2,647.00	3,705,800	
伊 藤 忠	87,700	4,019.00	352,466,300	
丸 紅	110,500	1,487.50	164,368,750	
スクロール	1,800	708.00	1,274,400	
ヨンドシーホールディングス	1,200	1,698.00	2,037,600	
三陽商会	900	1,367.00	1,230,300	
長瀬産業	7,600	1,956.00	14,865,600	
ナイガイ	600	260.00	156,000	
蝶 理	1,000	2,166.00	2,166,000	
豊田通商	12,300	4,855.00	59,716,500	
オンワ - ドホールディングス	8,300	315.00	2,614,500	
三共生興	2,200	469.00	1,031,800	
兼 松	5,400	1,466.00	7,916,400	
美 津 濃	1,300	2,690.00	3,497,000	
ツカモトコーポレーション	400	1,359.00	543,600	
ルックホールディングス	500	2,560.00	1,280,000	
三井物産	103,500	3,742.00	387,297,000	
日本紙パルプ	900	4,635.00	4,171,500	
東京エレクトロン	9,400	42,440.00	398,936,000	
カメイ	1,700	1,182.00	2,009,400	
スターゼン	1,000	2,045.00	2,045,000	
セイコーグループ	1,800	2,970.00	5,346,000	
山 善	5,400	1,010.00	5,454,000	
椿本興業	400	3,785.00	1,514,000	
住友商事	87,000	2,147.50	186,832,500	
B I P R O G Y	4,900	3,225.00	15,802,500	
内田洋行	500	4,500.00	2,250,000	
三菱商事	87,500	4,226.00	369,775,000	
第一実業	500	4,360.00	2,180,000	

キヤノンマーケティング J P N	3,400	2,870.00	9,758,000	
西華産業	900	1,560.00	1,404,000	
佐藤商事	1,400	1,198.00	1,677,200	
菱洋エレクトロ	1,000	2,384.00	2,384,000	
東京産業	1,200	732.00	878,400	
ユアサ商事	1,300	3,525.00	4,582,500	
神鋼商事	500	5,050.00	2,525,000	
トルク	1,100	201.00	221,100	
阪和興業	2,700	3,670.00	9,909,000	
正栄食品	900	3,850.00	3,465,000	
カナデン	1,400	1,070.00	1,498,000	
菱電商事	1,000	1,677.00	1,677,000	
ニプロ	10,500	1,010.00	10,605,000	
岩谷産業	3,100	5,360.00	16,616,000	
ナイス	500	1,392.00	696,000	
極東貿易	1,000	1,355.00	1,355,000	
アステナホールディングス	1,700	423.00	719,100	
兼松エレクトロニクス	900	4,345.00	3,910,500	
三愛オプテ	3,400	1,230.00	4,182,000	
稲畑産業	3,200	2,372.00	7,590,400	
G S I クレオス	1,000	1,467.00	1,467,000	
明和産業	1,200	647.00	776,400	
クワザワホールディングス	500	421.00	210,500	
キムラタン	7,600	21.00	159,600	
ゴ - ルドウイン	2,200	9,100.00	20,020,000	
ユニ・チャ - ム	27,000	4,765.00	128,655,000	
デサント	2,200	3,270.00	7,194,000	
キ ン グ	1,000	492.00	492,000	
ワ キ タ	2,700	1,159.00	3,129,300	
ヤマトインタ - ナショナル	1,500	239.00	358,500	
東邦ホールディングス	4,400	2,061.00	9,068,400	
サンゲツ	3,500	2,125.00	7,437,500	
ミツウロコグループ	2,200	1,071.00	2,356,200	
シナネンホールディングス	500	3,750.00	1,875,000	
伊藤忠エネクス	3,200	1,042.00	3,334,400	
サンリオ	3,900	4,635.00	18,076,500	
サンワ テクノス	1,000	1,548.00	1,548,000	
リョーサン	1,300	2,812.00	3,655,600	
新光商事	1,800	1,161.00	2,089,800	
トーホー	500	1,617.00	808,500	

三信電気	900	2,308.00	2,077,200
東陽テクニカ	1,300	1,314.00	1,708,200
モスフード サービス	1,800	3,045.00	5,481,000
加賀電子	1,200	4,015.00	4,818,000
三益半導体	1,000	2,387.00	2,387,000
都築電気	500	1,282.00	641,000
ソーダニツカ	1,200	700.00	840,000
立花エレテック	1,000	1,739.00	1,739,000
木曽路	1,700	2,056.00	3,495,200
S R S ホールディングス	1,700	874.00	1,485,800
千 趣 会	2,700	379.00	1,023,300
タカキユー	1,200	76.00	91,200
リテールパートナーズ	1,700	1,197.00	2,034,900
ケーヨー	2,700	879.00	2,373,300
上新電機	1,700	1,925.00	3,272,500
日本瓦斯	6,600	1,972.00	13,015,200
ロイヤルホールディングス	2,200	2,387.00	5,251,400
いなげや	1,300	1,212.00	1,575,600
チヨダ	1,300	760.00	988,000
ライフコーポレーション	1,200	2,555.00	3,066,000
リンガーハット	1,700	2,229.00	3,789,300
Mr Max HD	1,700	647.00	1,099,900
テンアライド	1,200	253.00	303,600
A O K I ホールディングス	2,800	681.00	1,906,800
オークワ	2,200	865.00	1,903,000
コメリ	2,200	2,681.00	5,898,200
青山商事	3,200	895.00	2,864,000
しまむら	1,700	12,670.00	21,539,000
はせがわ	900	328.00	295,200
高 島 屋	10,000	1,808.00	18,080,000
松 屋	3,200	1,032.00	3,302,400
エイチ・ツー・オーリテイリング	6,600	1,271.00	8,388,600
近鉄百貨店	500	2,518.00	1,259,000
丸井グループ	11,500	2,131.00	24,506,500
アクシアル リテイリング	1,400	3,295.00	4,613,000
井 筒 屋	1,100	389.00	427,900
イオン	48,300	2,701.00	130,458,300
イ ズ ミ	2,700	2,853.00	7,703,100
フォーバル	500	975.00	487,500
平 和 堂	2,700	2,067.00	5,580,900

フジ	1,700	1,824.00	3,100,800
ヤオコー	1,700	6,730.00	11,441,000
ゼビオホールディングス	1,700	910.00	1,547,000
ケーズホールディングス	12,100	1,110.00	13,431,000
PALTA C	2,200	4,560.00	10,032,000
三谷産業	1,700	303.00	515,100
OLYMPICグループ	900	515.00	463,500
日産東京販売HD	2,200	288.00	633,600
アドバンテッジリスクマネ	900	367.00	330,300
三井不動産	57,200	2,354.00	134,648,800
三菱地所	78,800	1,656.00	130,492,800
平和不動産	2,200	3,565.00	7,843,000
東京建物	13,700	1,562.00	21,399,400
京阪神ビルディング	2,200	1,304.00	2,868,800
住友不動産	23,600	3,006.00	70,941,600
太平洋興発	500	812.00	406,000
テーオーシー	2,700	632.00	1,706,400
レオパレス21	11,500	289.00	3,323,500
スターツコーポレーション	1,700	2,485.00	4,224,500
フジ住宅	1,700	643.00	1,093,100
空港施設	1,300	512.00	665,600
明和地所	500	709.00	354,500
ゴールドクレスト	1,200	1,628.00	1,953,600
リログループ	7,500	2,090.00	15,675,000
エスリード	500	1,841.00	920,500
日神グループHLDGS	2,200	429.00	943,800
日本エスコン	2,700	756.00	2,041,200
MIRARTHホールディング	5,700	369.00	2,103,300
AVANTIA	900	787.00	708,300
イオンモール	7,100	1,678.00	11,913,800
毎日コムネット	500	685.00	342,500
ファースト住建	500	1,019.00	509,500
ランド	75,000	9.00	675,000
カチタス	3,400	2,896.00	9,846,400
東祥	1,000	1,093.00	1,093,000
トーセイ	1,700	1,350.00	2,295,000
穴吹興産	500	1,986.00	993,000
サンフロンティア不動産	1,700	1,081.00	1,837,700
FJネクストホールディングス	1,200	959.00	1,150,800
インテリックス	500	508.00	254,000

ランドビジネス	600	223.00	133,800
サンネクスタグループ	500	955.00	477,500
グランディハウス	1,000	555.00	555,000
東武鉄道	14,500	2,958.00	42,891,000
相鉄ホールディングス	4,900	2,195.00	10,755,500
東急	35,300	1,600.00	56,480,000
京浜急行	18,100	1,338.00	24,217,800
小田急電鉄	20,800	1,609.00	33,467,200
京王電鉄	7,300	4,625.00	33,762,500
京成電鉄	10,100	3,560.00	35,956,000
富士急行	1,800	4,625.00	8,325,000
東日本旅客鉄道	22,700	7,294.00	165,573,800
西日本旅客鉄道	15,800	5,485.00	86,663,000
東海旅客鉄道	10,500	15,755.00	165,427,500
西武ホールディングス	16,700	1,437.00	23,997,900
鴻池運輸	2,200	1,501.00	3,302,200
西日本鉄道	3,900	2,390.00	9,321,000
ハマキョウレックス	1,000	2,986.00	2,986,000
サカイ引越センター	500	4,225.00	2,112,500
近鉄グループHLDGS	13,200	4,170.00	55,044,000
阪急阪神HLDGS	16,600	3,740.00	62,084,000
南海電鉄	6,200	2,772.00	17,186,400
京阪ホールディングス	5,700	3,465.00	19,750,500
神戸電鉄	500	3,115.00	1,557,500
名古屋鉄道	14,200	2,119.00	30,089,800
山陽電鉄	1,000	2,102.00	2,102,000
アルプス物流	1,000	1,110.00	1,110,000
トランコム	400	7,170.00	2,868,000
ヤマトホールディングス	18,600	2,026.00	37,683,600
山 九	3,400	4,640.00	15,776,000
日 新	1,000	2,081.00	2,081,000
丸 運	1,100	216.00	237,600
丸全昭和運輸	1,000	2,965.00	2,965,000
センコーグループHLDGS	7,500	936.00	7,020,000
トナミホールディングス	500	3,525.00	1,762,500
ニッコンホールディングス	4,400	2,288.00	10,067,200
福山通運	1,700	2,973.00	5,054,100
セイノーホールディングス	9,800	1,144.00	11,211,200
エスライン	500	791.00	395,500
神奈川中央交通	500	3,150.00	1,575,000

日立物流	800	8,890.00	7,112,000	
A Z - C O M丸和ホールディ	2,700	1,602.00	4,325,400	
C & F ロジホールディングス	1,200	1,118.00	1,341,600	
日本郵船	35,400	3,039.00	107,580,600	
商船三井	21,900	3,210.00	70,299,000	
川崎汽船	11,700	2,731.00	31,952,700	
N S ユナイテッド海運	500	3,705.00	1,852,500	
明治海運	1,300	673.00	874,900	
飯野海運	6,100	872.00	5,319,200	
九州旅客鉄道	10,100	2,831.00	28,593,100	
S G ホールディングス	25,200	1,765.00	44,478,000	
N I P P O N E X P R E S S	4,400	7,200.00	31,680,000	
日本航空	30,400	2,643.00	80,347,200	
A N A ホールディングス	33,700	2,761.50	93,062,550	
ビーウィズ	400	1,080.00	432,000	
パスコ	400	1,336.00	534,400	
T R E ホールディングス	2,100	1,407.00	2,954,700	
人・夢・技術グループ	500	1,585.00	792,500	
西本W I S M E T T A C H D	500	3,505.00	1,752,500	
シルバーライフ	400	1,762.00	704,800	
G E N K Y D R U G S T O R E S	500	3,630.00	1,815,000	
コア商事H L D G S	1,000	604.00	604,000	
K P P グループホールディン	3,300	823.00	2,715,900	
ナルミヤ・インターナショナル	400	898.00	359,200	
ブックオフG H D	900	1,316.00	1,184,400	
三菱倉庫	4,400	2,900.00	12,760,000	
三井倉庫H O L D	1,300	3,540.00	4,602,000	
住友倉庫	4,900	1,904.00	9,329,600	
渋沢倉庫	900	2,039.00	1,835,100	
ヤマタネ	500	1,679.00	839,500	
東陽倉庫	2,200	252.00	554,400	
乾汽船	900	1,973.00	1,775,700	
日本トランスシティ	3,200	483.00	1,545,600	
ケイヒン	400	1,468.00	587,200	
中央倉庫	900	933.00	839,700	
川西倉庫	400	991.00	396,400	
安田倉庫	1,000	921.00	921,000	
ファイズホールディングス	400	799.00	319,600	
東洋埠頭	500	1,242.00	621,000	
上組	7,400	2,603.00	19,262,200	

サンリツ	500	723.00	361,500
キムラユニティー	1,000	779.00	779,000
キューソー流通システム	1,000	943.00	943,000
東海運	900	278.00	250,200
エーアイテイー	1,000	1,371.00	1,371,000
内外トランスライン	500	2,071.00	1,035,500
ショーエイコーポ	500	560.00	280,000
日本コンセプト	500	1,485.00	742,500
TBSホールディングス	9,300	1,486.00	13,819,800
日本テレビHLD S	11,500	1,018.00	11,707,000
朝日放送グループHD	1,300	630.00	819,000
テレビ朝日HD	4,400	1,300.00	5,720,000
スカパーJ S A T H D	8,900	477.00	4,245,300
テレビ東京HD	1,000	1,838.00	1,838,000
日本BS放送	500	871.00	435,500
ビジョン	2,100	1,420.00	2,982,000
スマートバリュー	500	420.00	210,000
USEN-NEXT HLDGS	1,200	2,169.00	2,602,800
ワイヤレスゲート	500	240.00	120,000
コネクシオ	900	1,909.00	1,718,100
日本通信	12,000	220.00	2,640,000
クロップス	500	949.00	474,500
日本電信電話	170,000	3,696.00	628,320,000
KDDI	102,500	3,921.00	401,902,500
ソフトバンク	213,100	1,465.50	312,298,050
光通信	1,600	17,810.00	28,496,000
エムティーアイ	1,200	505.00	606,000
GMOインターネットグループ	4,900	2,408.00	11,799,200
ファイバーゲート	500	864.00	432,000
アйдママーケティングコミュ	500	273.00	136,500
KADOKAWA	7,000	2,350.00	16,450,000
学研ホールディングス	1,700	911.00	1,548,700
ゼンリン	2,700	801.00	2,162,700
昭文社ホールディングス	600	284.00	170,400
インプレスホールディングス	1,600	212.00	339,200
東京電力HD	104,800	436.00	45,692,800
中部電力	48,800	1,274.00	62,171,200
関西電力	52,900	1,219.00	64,485,100
中国電力	20,300	668.00	13,560,400
北陸電力	12,800	519.00	6,643,200

東北電力	32,600	662.00	21,581,200	
四国電力	11,500	724.00	8,326,000	
九州電力	30,900	715.00	22,093,500	
北海道電力	13,200	445.00	5,874,000	
沖縄電力	2,700	1,020.00	2,754,000	
電源開発	11,000	1,990.00	21,890,000	
エフオン	1,000	488.00	488,000	
イーレックス	2,200	2,064.00	4,540,800	
レノバ	2,200	2,206.00	4,853,200	
東京瓦斯	26,900	2,460.00	66,174,000	
大阪瓦斯	25,300	2,020.00	51,106,000	
東邦瓦斯	7,100	2,352.00	16,699,200	
北海道瓦斯	900	1,617.00	1,455,300	
広島ガス	3,200	335.00	1,072,000	
西部ガスHLDGS	1,700	1,668.00	2,835,600	
静岡ガス	3,500	1,040.00	3,640,000	
メタウォーター	1,700	1,622.00	2,757,400	
アイネット	900	1,298.00	1,168,200	
松竹	900	11,420.00	10,278,000	
東宝	7,900	4,810.00	37,999,000	
エイチ・アイ・エス	3,100	2,124.00	6,584,400	
東映	400	16,940.00	6,776,000	
ラックランド	500	2,873.00	1,436,500	
NTTデータ	41,600	1,904.00	79,206,400	
共立メンテナンス	2,200	5,900.00	12,980,000	
イチネンホールディングス	1,300	1,229.00	1,597,700	
建設技術研究所	1,000	3,080.00	3,080,000	
スペース	1,000	875.00	875,000	
アインホールディングス	2,200	5,890.00	12,958,000	
燦ホールディングス	500	1,709.00	854,500	
ピー・シー・エー	400	1,331.00	532,400	
東京テアトル	500	1,115.00	557,500	
タナベコンサルティンググル	400	631.00	252,400	
ビジネスB太田昭和	500	1,819.00	909,500	
ナガワ	400	7,450.00	2,980,000	
東京都競馬	1,000	3,740.00	3,740,000	
常磐興産	500	1,204.00	602,000	
カナモト	2,200	2,229.00	4,903,800	
DTS	2,700	2,912.00	7,862,400	
スクウェア・エニックス・HD	5,700	6,160.00	35,112,000	

シーイーシー	1,300	1,471.00	1,912,300	
カプコン	12,000	4,080.00	48,960,000	
西尾レントオール	1,200	3,000.00	3,600,000	
アイ・エス・ビー	500	1,168.00	584,000	
アゴーラ ホスピタリティーG	8,100	22.00	178,200	
日本空港ビルデング	4,900	6,550.00	32,095,000	
トランス・コスモス	1,200	3,200.00	3,840,000	
乃村工藝社	5,700	921.00	5,249,700	
ジャステック	1,000	1,142.00	1,142,000	
S C S K	9,900	2,004.00	19,839,600	
藤田観光	500	3,095.00	1,547,500	
K N T - C Tホールディングス	900	1,648.00	1,483,200	
日本管財	1,300	2,462.00	3,200,600	
トーカイ	1,200	1,867.00	2,240,400	
セコム	14,100	7,330.00	103,353,000	
N S W	500	2,021.00	1,010,500	
セントラル警備保障	500	2,225.00	1,112,500	
アイネス	1,200	1,316.00	1,579,200	
丹青社	2,700	705.00	1,903,500	
メイテック	5,100	2,352.00	11,995,200	
T K C	2,200	3,425.00	7,535,000	
富士ソフト	1,300	7,480.00	9,724,000	
応用地質	1,300	2,123.00	2,759,900	
船井総研ホールディン	2,700	2,647.00	7,146,900	
N S D	4,400	2,193.00	9,649,200	
進学会ホールディングス	500	299.00	149,500	
オ オ バ	1,000	650.00	650,000	
コナミグループ	4,900	5,890.00	28,861,000	
いであ	500	1,670.00	835,000	
学 究 社	500	1,809.00	904,500	
ベネッセホールディングス	4,900	1,936.00	9,486,400	
イオンディライト	1,700	2,925.00	4,972,500	
ナック	500	926.00	463,000	
福井コンピュータH L D S	500	2,672.00	1,336,000	
ダイセキ	2,600	4,410.00	11,466,000	
ステップ	500	1,746.00	873,000	
日鉄物産	900	9,260.00	8,334,000	
泉州電業	1,000	2,980.00	2,980,000	
元気寿司	500	3,070.00	1,535,000	
トラスコ中山	2,800	1,994.00	5,583,200	

ヤマダホールディングス	49,400	461.00	22,773,400
オートバックスセブン	4,900	1,414.00	6,928,600
モリト	1,000	715.00	715,000
アークランズ	2,200	1,578.00	3,471,600
ニトリホールディングス	5,800	16,535.00	95,903,000
グルメ杵屋	1,000	988.00	988,000
愛眼	1,200	167.00	200,400
ケーユーホールディングス	900	1,287.00	1,158,300
吉野家ホールディングス	4,400	2,280.00	10,032,000
加藤産業	2,200	3,460.00	7,612,000
北恵	500	673.00	336,500
イノテック	900	1,283.00	1,154,700
イエローハット	2,700	1,708.00	4,611,600
松屋フーズHLDGS	700	3,865.00	2,705,500
JBCホールディングス	1,000	1,766.00	1,766,000
JKホールディングス	1,200	994.00	1,192,800
サガミホールディングス	2,100	1,191.00	2,501,100
日伝	1,200	1,681.00	2,017,200
関西フードマーケット	1,000	1,230.00	1,230,000
ミロク情報サービス	1,300	1,452.00	1,887,600
北沢産業	1,000	191.00	191,000
杉本商事	900	1,895.00	1,705,500
因幡電機産業	3,500	2,645.00	9,257,500
王将フードサービス	900	5,920.00	5,328,000
プレナス	1,300	2,633.00	3,422,900
ミニストップ	1,000	1,404.00	1,404,000
アークス	2,700	2,083.00	5,624,100
バローホールディングス	2,700	1,757.00	4,743,900
東テック	500	3,280.00	1,640,000
ミスミグループ本社	21,100	2,862.00	60,388,200
アルテック	1,000	308.00	308,000
ベルク	900	5,350.00	4,815,000
大庄	900	1,040.00	936,000
タキヒヨー	500	863.00	431,500
ファーストリテイリング	2,100	80,310.00	168,651,000
ソフトバンクグループ	76,700	5,953.00	456,595,100
蔵王産業	400	1,745.00	698,000
スズケン	5,700	3,385.00	19,294,500
サンドラッグ	5,400	3,850.00	20,790,000
サックスバーホールディング	1,200	739.00	886,800

ジェコス	1,000	840.00	840,000	
ヤマザワ	500	1,297.00	648,500	
やまや	500	2,494.00	1,247,000	
グローセル	1,300	407.00	529,100	
ベルーナ	3,100	671.00	2,080,100	
合計			31,823,290,490	

(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】

2023年1月31日

資産総額	33,921,961,816円
負債総額	404,186,888円
純資産総額（ - ）	33,517,774,928円
発行済数量	21,987,080口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1,524.43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）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

2023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。

2023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	88	306,528
追加型株式投資信託	773	21,171,806
株式投資信託 合計	861	21,478,334
単位型公社債投資信託	82	164,674
追加型公社債投資信託	14	1,419,620
公社債投資信託 合計	96	1,584,294
総合計	957	23,062,628

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。

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63期事業年度（2021年4月1日から2022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64期事業年度に係る中間会計期間（2022年4月1日から2022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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,860	3,168
有価証券	333	486
前払費用	237	332
未収委託者報酬	13,150	13,811
未収収益	49	52
関係会社短期貸付金	18,700	24,900
その他	207	45
流動資産計	37,539	42,799
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	224	203
	6	4

器具備品	218	198
無形固定資産	1,937	1,770
ソフトウェア	1,882	1,738
ソフトウェア仮勘定	54	31
投資その他の資産	16,121	16,617
投資有価証券	10,159	10,755
関係会社株式	3,705	3,705
出資金	183	177
長期差入保証金	1,068	1,067
繰延税金資産	973	885
その他	30	26
固定資産計	18,283	18,591
資産合計	55,822	61,390

(単位:百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	68	65
未払金	8,405	9,856
未払収益分配金	13	26
未払償還金	39	12
未払手数料	4,734	4,917
その他未払金	2	4,900
未払費用	3,777	4,246
未払法人税等	804	980
未払消費税等	631	1,016
賞与引当金	950	866
その他	88	2
流動負債計	14,725	17,033
固定負債		
退職給付引当金	2,452	2,399
役員退職慰労引当金	74	13
その他	3	1
固定負債計	2,530	2,415
負債合計	17,256	19,449
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	10,574	13,925
利益剰余金合計	10,948	14,299
株主資本合計	37,618	40,969
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	947	971
評価・換算差額等合計	947	971
純資産合計	38,566	41,941
負債・純資産合計	55,822	61,390

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	65,487	74,402
その他営業収益	419	545
営業収益計	65,906	74,948
営業費用		
支払手数料	27,965	31,234
広告宣伝費	624	650
調査費	8,245	9,104
調査費	1,134	1,252
委託調査費	7,110	7,851
委託計算費	1,501	1,729
営業雑経費	1,870	2,051
通信費	240	189
印刷費	478	468
協会費	51	46
諸会費	14	15
その他営業雑経費	1,084	1,331
営業費用計	40,207	44,768

一般管理費		
給料	5,991	5,948
役員報酬	351	306
給料・手当	4,293	4,281
賞与	395	493
賞与引当金繰入額	950	866
福利厚生費	893	867
交際費	32	46
旅費交通費	37	48
租税公課	472	527
不動産賃借料	1,302	1,300
退職給付費用	449	408
役員退職慰労引当金繰入額	28	10
固定資産減価償却費	661	606
諸経費	1,763	1,864
一般管理費計	11,631	11,628
営業利益	14,067	18,551

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	578	327
有価証券償還益	42	40
その他	68	264
営業外収益計	689	631
営業外費用		
投資有価証券売却損	69	59
有価証券償還損	47	0
その他	24	34
営業外費用計	141	93
経常利益	14,616	19,089
特別損失		
システム刷新関連費用	547	-
関係会社整理損失	267	-
投資有価証券評価損	45	331
特別損失計	860	331
税引前当期純利益	13,756	18,757
法人税、住民税及び事業税	4,476	5,950
法人税等調整額	109	69

法人税等合計	4,366	6,019
当期純利益	9,389	12,738

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	-	-	-	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 9,388
当期純利益	-	-	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	24	24	24
当期変動額合計	24	24	3,374
当期末残高	971	971	41,941

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. 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。

当社は証券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。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 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、翌事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）を適用する予定であります。

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(会計方針の変更に関する注記)

(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。)等を当事業年度の期首から適用し、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。これによる当事業年度の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載しておりません。

(未適用の会計基準等)

- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日)

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2023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

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響については、現時点で評価中であります。

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物	35百万円	37百万円
器具備品	259百万円	283百万円

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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
未払金	3,473百万円	4,694百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(2022年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,900百万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 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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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
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

(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

2022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	12,737百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,883円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月24日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

前事業年度（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）2019年適用指針第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、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（2022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）	66	-	-	66
資産合計	66	-	-	66

（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486百万円、投資有価証券10,022百万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、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	1,677	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（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。

当事業年度（2022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（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。

当事業年度(2022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	66	55	11
(2)その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	454
小計	3,753	4,208	454
合計	10,575	9,180	1,395

(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 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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、証券投資信託について331百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
退職給付債務の期首残高	2,574	百万円	2,452	百万円
勤務費用	155		152	
退職給付の支払額	378		303	
その他	101		98	
退職給付債務の期末残高	2,452		2,399	

(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
非積立型制度の退職給付債務	2,452	百万円	2,399	百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452		2,399	
退職給付引当金	2,452		2,399	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452		2,399	

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
勤務費用	155	百万円	152	百万円
その他	108		67	
確定給付制度に係る退職給付費用	263		219	

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186百万円、当事業年度189百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	(2021年3月31日)		(2022年3月31日)	
繰延税金資産				
退職給付引当金	750		734	
賞与引当金	243		227	

未払事業税	170	213
投資有価証券評価損	128	144
システム関連費用	155	111
出資金評価損	94	94
その他	298	437
繰延税金資産小計	1,841	1,963
評価性引当額	254	356
繰延税金資産合計	1,586	1,607
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	453	562
繰延税金負債合計	612	722
繰延税金資産の純額	973	885

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（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。

当事業年度（2022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。

（収益認識関係）

（1）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が74,402百万円、その他545百万円であります。

（2）収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

（3）顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載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 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取(注)	19,300 0	関係会社短期貸付金	18,700 -

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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 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)	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

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 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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)	1,900	-	-

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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)	14,917	未払手数料	3,321
							不動産の賃借料(注4)	527	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	株大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	527	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2) 不動産の賃借料(注3)	15,348 1,062	未払手数料 長期差入保証金	3,028 1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	1,065	未払費用	91

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) 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4) 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。

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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,784.79円	1株当たり純資産額	16,078.50円
1株当たり当期純利益	3,599.54円	1株当たり当期純利益	4,883.43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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益(百万円)	9,389	12,738
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 (2022年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		3,876
有価証券		498
未収委託者報酬		12,633
関係会社短期貸付金		16,600
その他		557
流動資産合計		34,165
固定資産		
有形固定資産	1	196
無形固定資産		
ソフトウェア		1,443
その他		141
無形固定資産合計		1,584
投資その他の資産		
投資有価証券		7,533
関係会社株式		3,482
繰延税金資産		887
その他		1,267
投資その他の資産合計		13,170
固定資産合計		14,950
資産合計		49,116

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2022年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		5,646

未払費用	4,193
未払法人税等	1,623
賞与引当金	486
その他	2 655
流動負債合計	12,605
固定負債	
退職給付引当金	2,344
役員退職慰労引当金	33
その他	1
固定負債合計	2,379
負債合計	14,984
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	6,692
利益剰余金合計	7,067
株主資本合計	33,737
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	394
評価・換算差額等合計	394
純資産合計	34,131
負債・純資産合計	49,116

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間
	(自 2022年4月1日
	至 2022年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	35,926
その他営業収益	281

営業収益合計		36,208
営業費用		
支払手数料		15,088
その他営業費用		6,970
営業費用合計		22,059
一般管理費	1	5,766
営業利益		8,382
営業外収益	2	579
営業外費用	3	274
経常利益		8,686
特別利益		-
特別損失	4	460
税引前中間純利益		8,226
法人税、住民税及び事業税		2,472
法人税等調整額		248
中間純利益		5,505

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,737	12,737	12,737
中間純利益	-	-	-	5,505	5,505	5,505
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	-	-	-	7,232	7,232	7,232
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,692	7,067	33,737

	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	971	971	41,941
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,737
中間純利益	-	-	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	576	576	576
当中間期変動額合計	576	576	7,809
当中間期末残高	394	394	34,131

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。

当社は証券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。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

(会計方針の変更)

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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いたしました。この変更による当中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

(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、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日。以下「実務対応報告第42号」という。)に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2022年9月30日現在)
有形固定資産	326百万円

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（2022年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,122百万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 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	302百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券売却益	268百万円
有価証券償還益	149百万円
為替差益	114百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券売却損	244百万円

4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券評価損	237百万円
関係会社整理損失	222百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	12,737	4,883	2022年3月31日	2022年6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2022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。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
有価証券及び投資有価証券	57	7,306	-	7,364
資産合計	57	7,306	-	7,364

(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

有価証券及び投資有価証券

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。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。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	1,454
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2022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 1,454百万円）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	57	55	2
（2）その他	4,614	3,570	1,043
小計	4,671	3,625	1,046
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	2,692	3,171	478
小計	2,692	3,171	478
合計	7,364	6,797	567

（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）

（１）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が35,926百万円、その他281百万円であります。

（２）収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

（３）顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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

内国籍証券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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022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 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,084.78円
1株当たり中間純利益	2,110.46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 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,505
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,505
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

2022年4月1日付で、定款について次の変更を致しました。

- ・ 監査役の人数の変更（4名以内から5名以内に変更）

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名 称	資本金の額 (2022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)	
	シティグループ証券株式会社	96,307百万円	(注1)	
	J P モルガン証券株式会社	73,272百万円	(注1)	
	野村證券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	バークレイズ証券株式会社	38,945百万円	(注1)	
	BNPパリバ証券株式会社	102,025百万円	(注1)	
	BofA証券株式会社	83,140百万円	(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)	
	モルガン・スタンレーMUF 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。
- (注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

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）

2022年10月3日

（書類名）

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

2022年5月23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	公認会計士	間瀬	友未
業務執行社員			
指定有限責任社員	公認会計士	深井	康治
業務執行社員			

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2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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

2023年2月24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2022年7月11日から2023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2023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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

2022年11月28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	公認会計士	間瀬 友未
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	深井 康治
業務執行社員		

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2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022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（2022年4月1日から2022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. 上記の監査報告書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。