

【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】	平成31年4月3日提出
【計算期間】	第11計算期間 (自 平成30年7月11日 至 平成31年1月10日)
【ファンド名】	ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	松葉 恭明
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	名 称 株式会社東京証券取引所 所在地 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「TOPIX Ex-Financials」（以下「対象株価指数」という場合があります。）の変動率に一致させることを目的とします。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	独立区分	E T F
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	株式 一般
	決算頻度	年2回
	投資対象地域	日本
	対象インデックス	その他の指数（TOPIX Ex-Financials）

(注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「国内」...目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「株式」...目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「E T F」...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
- ・「インデックス型」...目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

- ・「株式 一般」...大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「年2回」...目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
- ・「日本」...目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「その他の指数」...日経225、T O P I Xにあてはまらないすべてのもの

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託の限度 >

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

< ファンドの特色 >

1

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

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

「TOPIX Ex-Financials」について

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

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

（注2）基準時の時価総額の修正方法：

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

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

2 当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

●受益権は、東京証券取引所に上場され、株式と同様に売買することができます。

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

●追加設定は、株式により行ないます。

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

●受益権を株式と交換することができます。

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

●収益分配金は、名義登録受益者に対して支払われます。

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

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

	名 称	関係業務の内容
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 1 ）の委託者であり、受益権の募集・発行、信託財産の運用指図、受益権とその信託財産に属する株式との交換の指図、信託財産の計算等を行ないます。
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）	信託契約（ 1 ）の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。
取扱窓口	販売会社	受益権の募集、交換の取扱い等に関する委託会社および受託会社との三者間契約（ 2 ）に基づき、受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務等を行ないます。

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

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

< 委託会社の概況（2019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	設立登記
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）

・大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
		株	%
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	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

二．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。

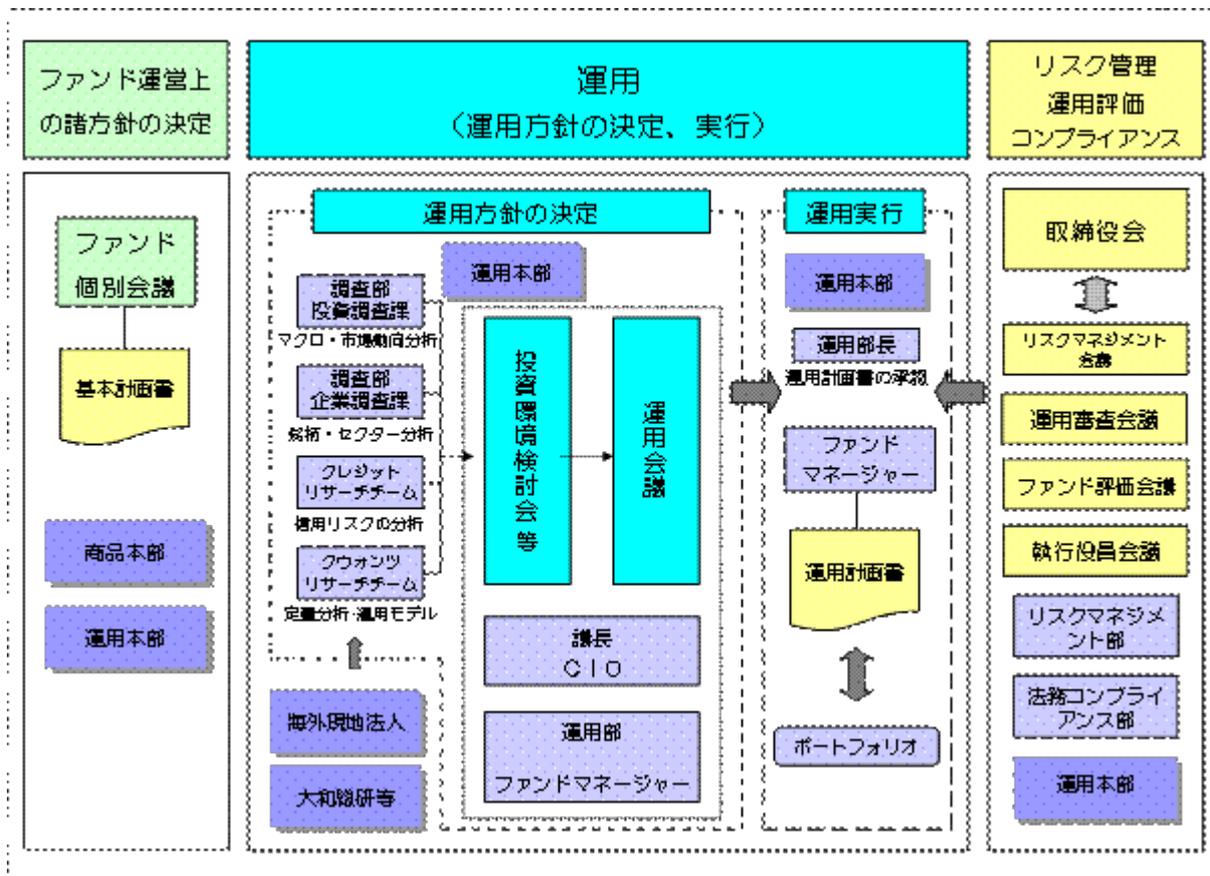
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ．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。

ニ．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。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時の的確な状況報告
- ・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承認します。

ホ．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。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

イ．ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

ロ．運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ハ．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。

二．執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2019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。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

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

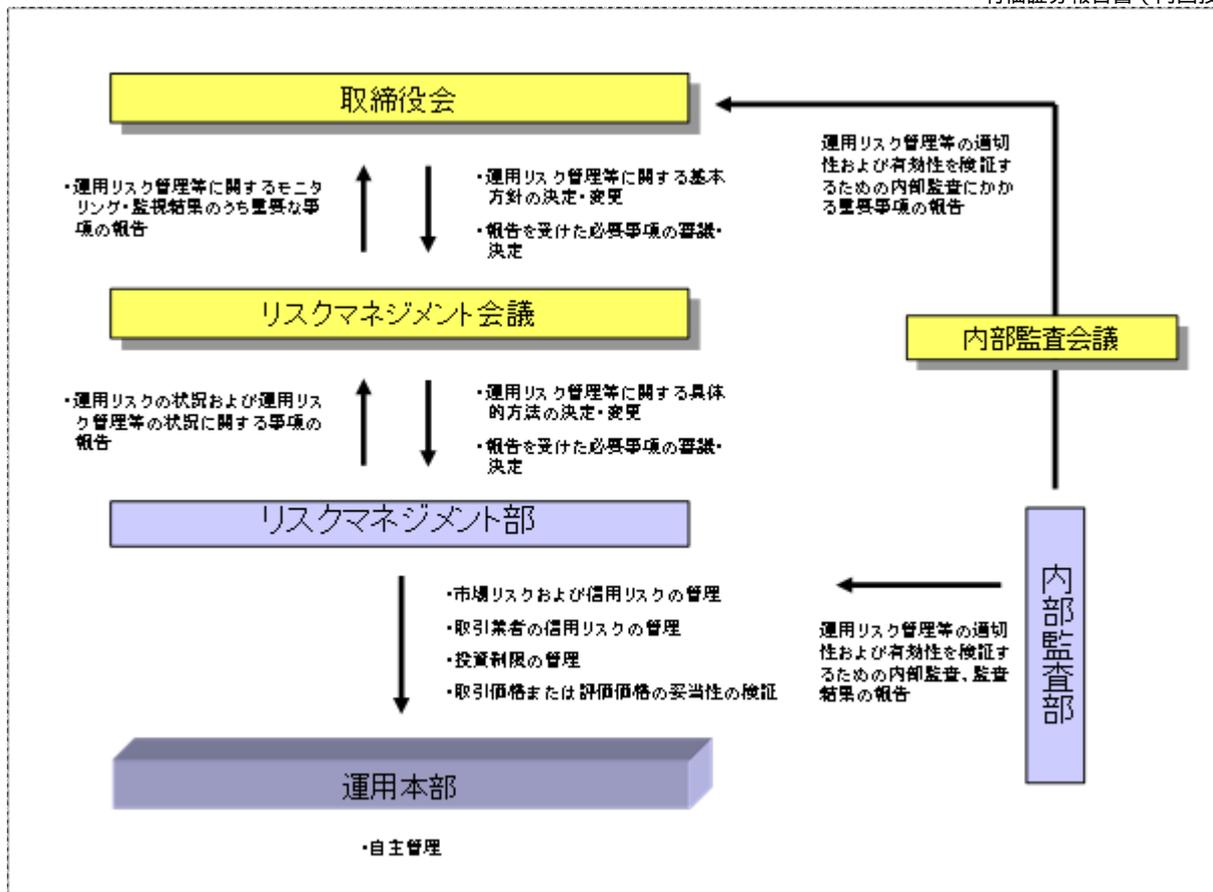
(2) その他の留意点

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

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

(3) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

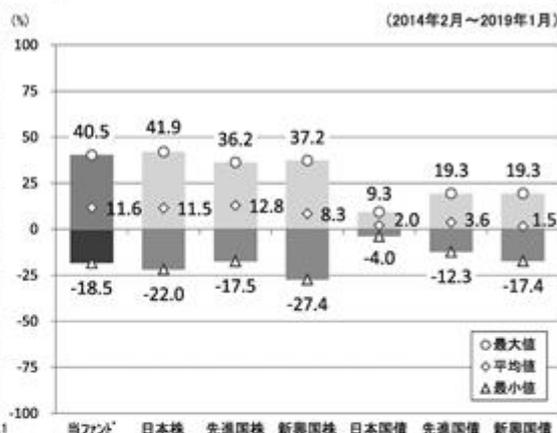
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- ※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
 ※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
 ※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
 ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
 ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
 ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

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

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

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

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

販売会社については、前(1)をご参照下さい。

信託財産留保額

ありません。

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

(3) 【信託報酬等】

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

イ. 信託財産の純資産総額に年率0.1944%¹(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54%²(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54%²(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0.1944%¹（税抜0.18%）

ロ．54%²（税抜50%）

1 消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.198%となります。

2 消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、55%となります。

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0.0324%¹（税抜0.03%）以内を乗じて得た額（ただし、86万4,000円²（税抜80万円）を下回る場合は86万4,000円²（税抜80万円））となります。

1 消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、0.033%となります。

2 消費税率が8%の場合の額です。消費税率が10%の場合は、88万円となります。

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

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は特定株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

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

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

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

ロ．収益分配金の受取時

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

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

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

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

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

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

法人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

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

ロ．収益分配金の受取時

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

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

- () 上記は、2019年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（2019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	24,138,055,430	99.78
内 日本	24,138,055,430	99.78
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	53,670,611	0.22
純資産総額	24,191,726,041	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】（2019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	134,900	6,704.00 904,369,600	6,675.00 900,457,500	3.72
2 ソニー	日本	株式	電気機 器	80,800	5,246.00 423,876,800	5,467.00 441,733,600	1.83
3 ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	49,300	7,589.00 374,137,700	8,526.00 420,331,800	1.74
4 日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	80,800	4,593.00 371,114,400	4,671.00 377,416,800	1.56
5 キーエンス	日本	株式	電気機 器	6,000	52,900.00 317,400,000	55,860.00 335,160,000	1.39
6 武田薬品	日本	株式	医薬品	76,000	4,311.12 327,645,200	4,389.00 333,564,000	1.38
7 本田技研	日本	株式	輸送用 機器	101,000	3,095.00 312,595,000	3,249.00 328,149,000	1.36
8 KDDI	日本	株式	情報・通 信業	103,600	2,688.50 278,528,600	2,723.00 282,102,800	1.17
9 三菱商事	日本	株式	卸売業	82,500	3,088.00 254,760,000	3,181.00 262,432,500	1.08

10	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	10,700	23,730.00 253,911,000	23,490.00 251,343,000	1.04
11	任天堂	日本	株式	その他 製品	7,300	29,795.00 217,503,500	33,830.00 246,959,000	1.02
12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービ ス業	82,200	2,880.50 236,777,100	2,912.50 239,407,500	0.99
13	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	49,200	4,926.00 242,359,200	4,739.00 233,158,800	0.96
14	花王	日本	株式	化学	29,000	7,373.00 213,817,000	7,672.00 222,488,000	0.92
15	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	84,600	2,570.50 217,464,300	2,605.50 220,425,300	0.91
16	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	21,100	10,055.00 212,160,500	10,080.00 212,688,000	0.88
17	ファナック	日本	株式	電気機 器	11,500	17,090.00 196,535,000	18,360.00 211,140,000	0.87
18	キヤノン	日本	株式	電気機 器	65,400	3,026.00 197,900,400	3,114.00 203,655,600	0.84
19	村田製作所	日本	株式	電気機 器	12,800	13,655.00 174,784,000	15,420.00 197,376,000	0.82
20	ダイキン工業	日本	株式	機械	16,600	12,110.00 201,026,000	11,765.00 195,299,000	0.81
21	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	70,400	2,654.00 186,841,600	2,750.00 193,600,000	0.80
22	信越化学	日本	株式	化学	21,000	8,575.00 180,075,000	9,176.00 192,696,000	0.80
23	日本電産	日本	株式	電気機 器	14,600	12,070.00 176,222,000	13,030.00 190,238,000	0.79
24	日立	日本	株式	電気機 器	54,700	3,080.00 168,476,000	3,413.00 186,691,100	0.77
25	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	112,100	1,503.50 168,542,350	1,609.50 180,424,950	0.75
26	三井物産	日本	株式	卸売業	98,600	1,739.50 171,514,700	1,772.50 174,768,500	0.72
27	三井不動産	日本	株式	不動産 業	63,600	2,473.00 157,282,800	2,637.00 167,713,200	0.69
28	伊藤忠	日本	株式	卸売業	83,700	1,926.00 161,206,200	1,991.50 166,688,550	0.69
29	三菱電機	日本	株式	電気機 器	121,500	1,240.50 150,720,750	1,365.50 165,908,250	0.69

30	三菱地所	日本	株式	不動産業	84,000	1,771.00 148,764,000	1,924.50 161,658,000	0.67
----	------	----	----	------	--------	-------------------------	-------------------------	------

(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	99.78%
合計	99.78%

(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	0.13%
鉱業	0.32%
建設業	3.38%
食料品	4.88%
繊維製品	0.74%
パルプ・紙	0.33%
化学	8.09%
医薬品	6.00%
石油・石炭製品	0.79%
ゴム製品	0.90%
ガラス・土石製品	1.04%
鉄鋼	1.14%
非鉄金属	0.91%
金属製品	0.67%
機械	5.58%
電気機器	14.48%
輸送用機器	9.30%
精密機器	2.14%
その他製品	2.35%
電気・ガス業	2.23%
陸運業	5.32%
海運業	0.19%
空運業	0.69%
倉庫・運輸関連業	0.22%
情報・通信業	9.08%
卸売業	5.71%
小売業	5.54%

不動産業	2.78%
サービス業	4.84%
合計	99.78%

(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
2018年1月末日	4,863,464,287	-	1,393.22	-	-
2月末日	4,694,046,866	-	1,344.68	-	1,341
3月末日	4,603,309,885	-	1,318.69	-	1,316
4月末日	4,754,251,877	-	1,361.93	-	1,356
5月末日	24,407,914,816	-	1,344.49	-	1,350

6月末日	25,567,211,807	-	1,336.94	-	1,335
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	-
7月末日	25,754,932,185	-	1,346.76	-	1,350
8月末日	25,505,548,196	-	1,333.72	-	1,332
9月末日	37,941,418,937	-	1,406.04	-	1,411
10月末日	25,456,575,128	-	1,266.92	-	1,268
11月末日	25,927,882,302	-	1,290.38	-	-
12月末日	23,376,945,353	-	1,163.42	-	1,160
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
2019年1月末日	24,191,726,041	-	1,203.97	-	1,207

(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

【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

(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

(注) 当初設定数量は5,054,850口です。

(参考情報) 運用実績

●ダイワ上場投信・TOPIX Ex-Financials

2019年1月31日現在

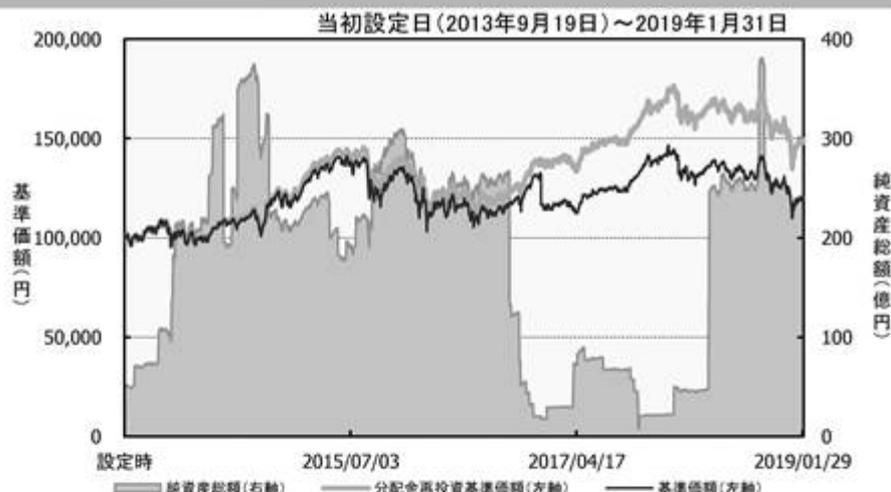
※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	120,397円
純資産総額	241億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	4.8%
3か月間	-3.7%
6か月間	-9.5%
1年間	-12.3%
3年間	17.6%
5年間	45.9%
設定来	51.1%



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

分配の推移(100口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 1,830円											設定来分配金合計額: 26,830円
	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	
	14年1月	14年7月	15年1月	15年7月	16年1月	16年7月	17年1月	17年7月	18年1月	18年7月	19年1月	
分配金	290円	1,050円	1,470円	1,410円	890円	1,050円	14,980円	470円	3,390円	330円	1,500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があります。

主要な資産の状況

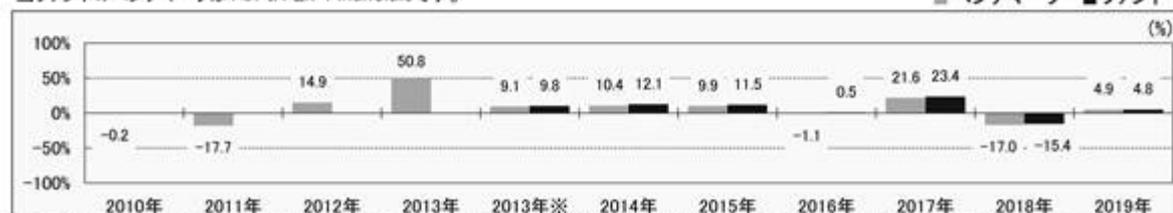
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	1,981	99.8%	電気機器	14.5%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.7%
国内株式先物	-	-	輸送用機器	9.3%	ソニー	電気機器	1.8%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	9.1%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.7%
コール・ローン、その他	-	0.2%	化学	8.1%	日本電信電話	情報・通信業	1.6%
合計	1,981	100.0%	医薬品	6.0%	キーエンス	電気機器	1.4%
株式市場・上場別構成			卸売業	5.7%	武田薬品	医薬品	1.4%
一部(東証・名証)		99.8%	機械	5.6%	本田技研	輸送用機器	1.4%
二部(東証・名証)		-	小売業	5.5%	KDDI	情報・通信業	1.2%
新興市場他		-	陸運業	5.3%	三菱商事	卸売業	1.1%
その他		-	その他	30.7%	東海旅客鉄道	陸運業	1.0%
合計		99.8%	合計	99.8%	合計		16.3%

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはTOPIX Ex-Financialsです。

■ベンチマーク ■ファンド



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

・2013年※は設定日(9月19日)から年末、2019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。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

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

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

受益権の取得申込者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後3時）までに取得申込みをした場合には、その翌営業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。

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の各々前営業日から起算して3営業日以内
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5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6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たとき

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、取得申込みの受付けの中止、取得申込みの受付けの取消しまたはその両方を行なうことができます。

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。

2 【換金(解約)手続等】

< 解約 >

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

< 交換 >

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

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

交換を請求しようとする受益者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後3時）までに交換請求をした場合には、その翌営業日を交換請求受付日として委託会社は当該交換請求を受付けます。

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

前 の規定にかかわらず、委託会社は、原則として、次の1.から4.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配当落日および権利落日の各々前営業日
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4営業日前から起算して8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5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6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、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続きを行なうものとします。当該抹消にかかる手続きおよび後 に掲げる交換株式にかかる振替請求が行なわれた後に、振替機関は、後 または後 に定める当該交換にかかる受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座に前 の交換の請求を行なった受益者にかかる当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

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

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

前 の規定により交換請求の受け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け付けたものとして計算されるものとします。

委託会社は、交換の請求を受け付けた場合には、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。別に定める期日から、受益者への交換株式の交付に際しては振替機関等の口座に前の交換の請求を行なった受益者にかかる株数の増加の記載または記録が行なわれ、受益者への金銭の交付については販売会社において行なわれます。

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

< 買取り >

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

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

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注）主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年1月11日から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、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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 1. から6. までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 1. の規定にしたがい重大な信託約款の変更等を行なう場合には、書面決議において当該解約または重大な信託約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、前 1. の3. または前 1. の2. に規定する書面に付記します。

公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<https://www.daiwa-am.co.jp/>

2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

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（以下「名義登録受益者」といいます。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。

3. 受益者は、原則として前2.に規定する登録を当ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の取引参加者（口座管理機関であるものに限り、以下同じ。）を経由して行なうものとします。この場合、当該取引参加者は、当該取引参加者が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は前2.に規定する登録を受託会社に対して直接行なうことができます。

4. 社振法関係法令等に基づき、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益権の名義登録の手続きは原則として以下のとおりとします。

イ. 受益権は、前3.の取引参加者の振替口座簿に口数が記載または記録されることにより、当該振替口座簿に記載または記録された口数に応じた受益権が帰属します。

ロ. 前3.の取引参加者は、計算期間終了日までに当該取引参加者にかかる前イ.の受益権の受益者の氏名もしくは名称および住所その他受託会社が定める事項を書面等により受託会社に届出のものとします。また、届出た内容に変更が生じた場合は、当該取引参加者所定の方法による当該受益者からの申出に基づき、当該取引参加者はこれを受託会社に通知するものとします。

ハ. 前3.の取引参加者は、計算期間終了日現在の当該取引参加者にかかる前イ.の受益権の受益者の振替機関の定める事項を（当該取引参加者が直接口座管理機関でない場合はその上位機関を通じて）振替機関に報告するとともに、振替機関は業務規程等に基づき、これを受託会社に通知するものとします。

5. 信託契約締結当初および追加信託時の受益者については、前2.に規定する登録を行なったうえで、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されるものとします。

6. 前2.に規定する収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定した預金口座等に当該収益分配金を振込む方式により行なうものとします。なお、名義登録受益者が前3.に規定する取引参加者と別途収益分配金の取扱いにかかる契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとします。

7. 受託会社は、支払開始日から5年経過した後に、収益分配金について未払残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとします。

8. 受託会社は、前7.の規定により委託会社に収益分配金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

9. 受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

信託終了時の交換等

1. 委託会社は、信託が終了することとなったときは、委託会社が別に定める一定口数以上の受益権を有する受益者に対しては、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権と引換えに交換するものとします。この場合は、「2 換金（解約）手続等」の規定に準じるものとします。

2. 委託会社が信託の終了に関して指定する販売会社は、委託会社が別に定める一定口数未満の受益権について買取るものとします。この場合には、当該販売会社が別に定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

3. 信託終了に際して、委託会社が信託終了に関して指定する販売会社は、その所有にかかるすべての受益権を交換請求するものとします。交換により引渡される株式に当該販売会社が発行した株式またはその親会社が発行した株式（以下本3.において「自社株式等」といいます。）が含まれる場合には、委託会社は、受託会社に対しこれを売却する指図をするとともに、当該自社株式等の評価額に相当する口数の受益権を、受託会社は信託財産をもって買取るものとします。
4. 受益者が、信託終了時の交換について信託終了日から10年間その交換請求をしないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

交換請求権および買取請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期計算期間(平成30年7月11日から平成31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10期 平成30年7月10日現在	第11期 平成31年1月10日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	5,876,970	-
コール・ローン	55,552,113	335,119,705
株式	25,224,767,820	23,429,437,500
未収入金	91,010,907	-
未収配当金	36,179,826	43,338,262
流動資産合計	25,413,387,636	23,807,895,467
資産合計	25,413,387,636	23,807,895,467
負債の部		
流動負債		
未払金	70,833,092	-
未払収益分配金	63,108,031	301,399,170
未払受託者報酬	3,218,844	7,184,385
未払委託者報酬	8,369,083	18,679,465
その他未払費用	2,567,268	3,414,332
流動負債合計	148,096,318	330,677,352
負債合計	148,096,318	330,677,352
純資産の部		
元本等		
元本	1 18,913,285,894	1 19,872,251,942
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,352,005,424	3,604,966,173
（分配準備積立金）	1,659,573	1,952,443
元本等合計	25,265,291,318	23,477,218,115
純資産合計	25,265,291,318	23,477,218,115
負債純資産合計	25,413,387,636	23,807,895,467

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期		第11期	
	自	平成30年1月11日 至 平成30年7月10日	自	平成30年7月11日 至 平成31年1月10日
営業収益				
受取配当金		78,485,123		332,323,547
受取利息		-		5
有価証券売買等損益		1,025,991,465		3,042,153,112
その他収益		38,154		337,515
営業収益合計		947,468,188		2,709,492,045
営業費用				
支払利息		5,037		34,844
受託者報酬		3,218,844		7,184,385
委託者報酬		8,369,083		18,679,465
その他費用		2,260,013		5,070,333
営業費用合計		13,852,977		30,969,027
営業損失()		961,321,165		2,740,461,072
経常損失()		961,321,165		2,740,461,072
当期純損失()		961,321,165		2,740,461,072
期首剰余金又は期首欠損金()		682,044,412		6,352,005,424
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,694,390,208		3,003,051,579
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,694,390,208		3,003,051,579
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		2,708,230,588
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		2,708,230,588
分配金		1 63,108,031		1 301,399,170
期末剰余金又は期末欠損金()		6,352,005,424		3,604,966,173

(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11期	
	自 平成30年7月11日	至 平成31年1月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)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。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</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。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</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10期	第11期
	平成30年7月10日現在	平成31年1月10日現在
1. 1 期首元本額	1,526,379,084円	18,913,285,894円
期中追加設定元本額	17,386,906,810円	7,774,509,220円
期中一部交換元本額	- 円	6,815,543,172円

2.	計算期間末日における受益権の総数	19,123,646口	20,093,278口
----	------------------	-------------	-------------

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第10期	第11期
	自 平成30年1月11日 至 平成30年7月10日	自 平成30年7月11日 至 平成31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（78,518,240円）及び分配準備積立金(97,304円)の合計額から、経費(13,847,940円)を控除して計算される分配対象額は64,767,604円（100口当たり338円）であり、うち63,108,031円（100口当たり330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（332,626,223円）及び分配準備積立金(1,659,573円)の合計額から、経費(30,934,183円)を控除して計算される分配対象額は303,351,613円（100口当たり1,509円）であり、うち301,399,170円（100口当たり1,500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11期
	自 平成30年7月11日 至 平成31年1月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第11期 平成31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10期 平成30年7月10日現在	第11期 平成31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	1,009,577,036	3,265,611,820
合計	1,009,577,036	3,265,611,820

（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10期 平成30年7月10日現在	第11期 平成31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11期

自 平成30年7月11日

至 平成31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10期	第11期
	平成30年7月10日現在	平成31年1月10日現在
1口当たり純資産額	1,321.15円	1,168.41円
（100口当たり純資産額）	（132,115円）	（116,841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	2,901.00	1,450,500	
日本水産	16,700	651.00	10,871,700	
マルハニチロ	2,400	3,790.00	9,096,000	
ハウスイ	100	850.00	85,000	
カネコ種苗	500	1,309.00	654,500	
サカタのタネ	2,000	3,395.00	6,790,000	
ホクト	1,400	1,985.00	2,779,000	
ホクリヨウ	200	624.00	124,800	
ヒノキヤグループ	300	2,090.00	627,000	
ショーボンドHD	1,300	7,650.00	9,945,000	
ミライト・ホールディングス	4,300	1,509.00	6,488,700	
タマホーム	1,000	1,054.00	1,054,000	
サンヨーホームズ	200	819.00	163,800	
日本アクア	400	418.00	167,200	
ファーストコーポレーション	500	724.00	362,000	
ベステラ	300	1,435.00	430,500	
TATERU	2,000	294.00	588,000	
スペースバリューHD	2,000	885.00	1,770,000	
住石ホールディングス	3,600	101.00	363,600	
日鉄鉱業	400	4,775.00	1,910,000	
三井松島HLDGS	700	1,395.00	976,500	
国際石油開発帝石	67,000	1,013.00	67,871,000	

石油資源開発	2,400	2,040.00	4,896,000	
K & Oエナジーグループ	800	1,473.00	1,178,400	
ダイセキ環境ソリューション	300	645.00	193,500	
第一カッター興業	200	1,773.00	354,600	
安藤・間	10,700	747.00	7,992,900	
東急建設	4,900	1,008.00	4,939,200	
コムシスホールディングス	5,900	2,742.00	16,177,800	
ミサワホーム	1,300	747.00	971,100	
ピーアールホールディングス	1,400	303.00	424,200	
高松コンストラクショング P	1,000	2,750.00	2,750,000	
東建コーポレーション	500	6,390.00	3,195,000	
ソネック	200	744.00	148,800	
ヤマウラ	600	968.00	580,800	
大成建設	13,700	4,805.00	65,828,500	
大 林 組	41,300	1,022.00	42,208,600	
清水建設	42,100	898.00	37,805,800	
飛鳥建設	1,200	1,424.00	1,708,800	
長谷工コーポレーション	17,200	1,209.00	20,794,800	
松井建設	1,500	737.00	1,105,500	
銭 高 組	200	5,240.00	1,048,000	
鹿島建設	32,300	1,472.00	47,545,600	
不動テトラ	1,000	1,740.00	1,740,000	
大末建設	500	969.00	484,500	
鉄建建設	800	2,580.00	2,064,000	
西松建設	3,000	2,504.00	7,512,000	
三井住友建設	9,900	666.00	6,593,400	
大豊建設	900	3,590.00	3,231,000	
前田建設	9,800	1,019.00	9,986,200	
佐田建設	900	400.00	360,000	
ナカノフドー建設	1,100	479.00	526,900	
奥 村 組	2,300	3,370.00	7,751,000	
東鉄工業	1,700	2,975.00	5,057,500	
イチケン	200	2,046.00	409,200	
富士ピー・エス	400	403.00	161,200	
浅沼組	500	2,947.00	1,473,500	
戸田建設	16,000	689.00	11,024,000	
熊 谷 組	2,000	3,410.00	6,820,000	
青木あすなろ建設	700	937.00	655,900	
北野建設	300	3,200.00	960,000	
植 木 組	200	2,271.00	454,200	

矢作建設	1,900	685.00	1,301,500
ピーエス三菱	1,400	571.00	799,400
日本ハウスHLDGS	2,600	420.00	1,092,000
大東建託	4,900	14,790.00	72,471,000
新日本建設	1,600	1,061.00	1,697,600
NIPPO	3,600	2,014.00	7,250,400
東亜道路	300	3,165.00	949,500
前田道路	4,300	2,167.00	9,318,100
日本道路	400	6,020.00	2,408,000
東亜建設	1,200	1,379.00	1,654,800
若築建設	700	1,563.00	1,094,100
東洋建設	5,000	380.00	1,900,000
五洋建設	16,400	623.00	10,217,200
世紀東急	2,000	612.00	1,224,000
福田組	400	4,080.00	1,632,000
日本ドライケミカル	300	1,225.00	367,500
住友林業	9,800	1,446.00	14,170,800
日本基礎技術	1,400	334.00	467,600
巴コーポレーション	1,700	349.00	593,300
大和ハウス	38,100	3,519.00	134,073,900
ライト工業	2,600	1,440.00	3,744,000
積水ハウス	42,200	1,635.00	68,997,000
日特建設	1,200	630.00	756,000
北陸電気工事	700	947.00	662,900
ユアテック	2,200	865.00	1,903,000
四電工	200	2,619.00	523,800
中電工	1,800	2,344.00	4,219,200
関電工	6,300	1,047.00	6,596,100
きんでん	9,200	1,781.00	16,385,200
東京エネシス	1,400	966.00	1,352,400
トーエネック	400	3,055.00	1,222,000
住友電設	1,000	1,771.00	1,771,000
日本電設工業	2,300	2,174.00	5,000,200
協和エクシオ	5,400	2,649.00	14,304,600
新日本空調	1,200	1,792.00	2,150,400
日本工営	800	2,474.00	1,979,200
九電工	2,700	3,880.00	10,476,000
三機工業	3,200	1,168.00	3,737,600
日揮	11,900	1,650.00	19,635,000
中外炉工業	400	2,016.00	806,400

ヤマト	1,200	493.00	591,600
太平電業	900	2,398.00	2,158,200
高砂熱学	3,500	1,813.00	6,345,500
三晃金属	200	2,835.00	567,000
NEC ネットエスアイ	1,300	2,458.00	3,195,400
朝日工業社	300	3,215.00	964,500
明星工業	2,500	689.00	1,722,500
大気社	1,900	2,892.00	5,494,800
ダイダン	900	2,438.00	2,194,200
日比谷総合設備	1,300	1,837.00	2,388,100
東芝プラントシステム	3,000	1,996.00	5,988,000
日本製粉	4,100	1,935.00	7,933,500
日清製粉G本社	13,900	2,279.00	31,678,100
日東富士製粉	100	5,640.00	564,000
昭和産業	1,100	3,005.00	3,305,500
鳥越製粉	1,100	824.00	906,400
中部飼料	1,500	1,212.00	1,818,000
フィード・ワン	8,300	180.00	1,494,000
東洋精糖	200	1,034.00	206,800
日本甜菜糖	700	1,838.00	1,286,600
三井製糖	1,000	2,962.00	2,962,000
塩水港精糖	1,300	221.00	287,300
日新製糖	600	2,105.00	1,263,000
LIFULL	4,100	744.00	3,050,400
ジェイエシーリクルートメント	900	2,021.00	1,818,900
日本M&Aセンター	8,800	2,452.00	21,577,600
メンバーズ	400	1,007.00	402,800
中広	100	570.00	57,000
タケエイ	1,200	652.00	782,400
E・Jホールディングス	100	1,011.00	101,100
トラスト・テック	600	2,993.00	1,795,800
コシダカホールディングス	3,100	1,209.00	3,747,900
アルトナー	200	660.00	132,000
パソナグループ	1,100	1,224.00	1,346,400
CDS	300	1,138.00	341,400
リンクアンドモチベーション	2,200	835.00	1,837,000
GCA	1,200	684.00	820,800
エス・エム・エス	4,300	1,771.00	7,615,300
パーソルホールディングス	11,700	1,803.00	21,095,100
リニカル	700	1,354.00	947,800

クックパッド	3,700	301.00	1,113,700
エスクリ	300	577.00	173,100
アイ・ケイ・ケイ	600	737.00	442,200
森永製菓	3,100	4,735.00	14,678,500
中村屋	300	4,285.00	1,285,500
江崎グリコ	3,700	5,480.00	20,276,000
名糖産業	600	1,293.00	775,800
井村屋グループ	500	2,445.00	1,222,500
不二家	700	2,311.00	1,617,700
山崎製パン	10,100	2,223.00	22,452,300
第一屋製パン	200	1,039.00	207,800
モロゾフ	200	5,070.00	1,014,000
亀田製菓	800	4,910.00	3,928,000
寿スピリッツ	1,300	4,295.00	5,583,500
カルビー	5,600	3,450.00	19,320,000
森永乳業	2,500	3,245.00	8,112,500
六甲バター	900	2,097.00	1,887,300
ヤクルト	9,100	7,530.00	68,523,000
明治ホールディングス	8,700	8,900.00	77,430,000
雪印メグミルク	3,000	2,963.00	8,889,000
プリマハム	1,700	2,055.00	3,493,500
日本ハム	5,300	4,485.00	23,770,500
林兼産業	400	616.00	246,400
丸大食品	1,300	1,788.00	2,324,400
S Foods	1,100	4,185.00	4,603,500
伊藤ハム米久HLDGS	7,900	662.00	5,229,800
学情	500	1,170.00	585,000
スタジオアリス	600	2,299.00	1,379,400
シミックホールディングス	600	1,649.00	989,400
システナ	4,300	1,303.00	5,602,900
NJS	300	1,569.00	470,700
デジタルアーツ	600	5,950.00	3,570,000
新日鉄住金SOL	1,800	2,635.00	4,743,000
総合警備保障	4,700	5,040.00	23,688,000
キューブシステム	600	597.00	358,200
いちご	15,400	322.00	4,958,800
エイジア	200	1,076.00	215,200
日本駐車場開発	14,600	142.00	2,073,200
コア	500	1,153.00	576,500
カカクコム	8,800	1,913.00	16,834,400

アイロムグループ	400	1,497.00	598,800
セントケア・ホールディング	600	544.00	326,400
サイネックス	200	678.00	135,600
ルネサンス	700	2,119.00	1,483,300
ディップ	1,900	1,897.00	3,604,300
SBSホールディングス	1,200	1,493.00	1,791,600
オプトホールディング	700	1,431.00	1,001,700
新日本科学	1,600	751.00	1,201,600
ツクイ	2,800	793.00	2,220,400
キャリアデザインセンター	300	1,046.00	313,800
ベネフィット・ワン	1,600	3,385.00	5,416,000
エムスリー	24,700	1,668.00	41,199,600
ツカダ・グローバルHOLD	700	599.00	419,300
プラス	100	575.00	57,500
アウトソーシング	6,200	1,121.00	6,950,200
ウェルネット	1,200	975.00	1,170,000
ワールドホールディングス	300	2,353.00	705,900
ディー・エヌ・エー	6,300	1,889.00	11,900,700
博報堂DYHLDGS	16,300	1,557.00	25,379,100
ぐるなび	1,700	712.00	1,210,400
エスアールジータカミヤ	1,200	728.00	873,600
ジャパンベストレスキューS	900	1,251.00	1,125,900
ファンコミュニケーションズ	3,200	550.00	1,760,000
ライク	500	1,242.00	621,000
ビジネス・ブレークスルー	500	324.00	162,000
WDBホールディングス	500	2,305.00	1,152,500
ティア	500	600.00	300,000
CDG	100	1,263.00	126,300
バリューコマース	800	1,270.00	1,016,000
インフォマート	6,400	989.00	6,329,600
サッポロホールディングス	4,500	2,440.00	10,980,000
アサヒグループホールディング	25,800	4,339.00	111,946,200
麒麟HD	55,800	2,369.50	132,218,100
宝ホールディングス	9,200	1,354.00	12,456,800
オエノンホールディングス	3,500	348.00	1,218,000
養命酒	400	2,141.00	856,400
コカ・コーラボトラーズJHD	9,400	3,205.00	30,127,000
サントリー食品インター	8,300	4,880.00	40,504,000
ダイドーグループHD	700	5,860.00	4,102,000
伊藤園	4,100	4,895.00	20,069,500

キーコーヒー	1,200	2,057.00	2,468,400
ユニカフェ	400	1,048.00	419,200
ジャパンフーズ	200	1,200.00	240,000
日清オイリオグループ	1,600	3,260.00	5,216,000
不二製油グループ	3,000	3,545.00	10,635,000
かどや製油	100	5,680.00	568,000
J - オイルミルズ	600	3,980.00	2,388,000
ローソン	3,100	6,990.00	21,669,000
サンエー	900	4,465.00	4,018,500
カワチ薬品	900	1,852.00	1,666,800
エービーシー・マート	1,900	6,200.00	11,780,000
ハードオフコーポレーション	500	843.00	421,500
高千穂交易	500	966.00	483,000
アスクル	1,100	2,255.00	2,480,500
ゲオホールディングス	1,800	1,600.00	2,880,000
アダストリア	1,700	2,159.00	3,670,300
ジーフット	700	670.00	469,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	705.00	141,000
伊藤忠食品	300	4,765.00	1,429,500
くらコーポレーション	700	5,360.00	3,752,000
キャンドゥ	600	1,621.00	972,600
エレマテック	600	1,975.00	1,185,000
パルグループHLDGS	600	3,075.00	1,845,000
JALUX	300	2,527.00	758,100
エディオン	5,100	1,087.00	5,543,700
あらた	700	4,215.00	2,950,500
サーラコーポレーション	2,500	604.00	1,510,000
ワッツ	400	706.00	282,400
トーメンデバイス	200	2,309.00	461,800
ハローズ	500	2,188.00	1,094,000
J Pホールディングス	3,400	259.00	880,600
あみやき亭	300	3,555.00	1,066,500
東京エレクトロデバイス	400	1,734.00	693,600
ひらまつ	2,400	370.00	888,000
フィールズ	1,100	762.00	838,200
双日	66,900	405.00	27,094,500
アルフレッサホールディングス	13,500	3,025.00	40,837,500
大黒天物産	300	4,045.00	1,213,500
ハニーズホールディングス	1,200	930.00	1,116,000
ファーマライズHD	300	592.00	177,600

キッコーマン	8,100	5,720.00	46,332,000
味の素	28,400	1,929.50	54,797,800
キューピー	6,900	2,512.00	17,332,800
ハウス食品G本社	4,700	3,855.00	18,118,500
カゴメ	4,900	2,943.00	14,420,700
焼津水産化工	600	1,069.00	641,400
アリアケジャパン	1,100	7,270.00	7,997,000
ピエトロ	200	1,642.00	328,400
エバラ食品工業	300	2,139.00	641,700
ニチレイ	6,400	3,080.00	19,712,000
横浜冷凍	3,200	949.00	3,036,800
東洋水産	6,300	3,880.00	24,444,000
イートアンド	400	1,567.00	626,800
大冷	100	1,730.00	173,000
ヨシムラ・フード・HLDGS	300	513.00	153,900
日清食品HD	5,200	6,810.00	35,412,000
永谷園ホールディングス	700	2,520.00	1,764,000
一正蒲鉾	500	1,068.00	534,000
フジッコ	1,300	2,352.00	3,057,600
ロックフィールド	1,300	1,637.00	2,128,100
日本たばこ産業	71,200	2,654.00	188,964,800
ケンコーマヨネーズ	700	1,982.00	1,387,400
わらべや日洋HD	800	1,881.00	1,504,800
なとり	700	1,650.00	1,155,000
イフジ産業	200	653.00	130,600
ピックルスコーポレーション	300	2,205.00	661,500
北の達人コーポ	4,800	376.00	1,804,800
ユーグレナ	4,900	598.00	2,930,200
片倉工業	1,500	1,165.00	1,747,500
グンゼ	900	4,455.00	4,009,500
ヒューリック	25,300	981.00	24,819,300
神栄	200	906.00	181,200
ラサ商事	600	831.00	498,600
アルペン	900	1,727.00	1,554,300
ハブ	400	890.00	356,000
ラクーンホールディングス	700	631.00	441,700
クオールホールディングス	1,800	1,664.00	2,995,200
アルコニックス	1,300	1,074.00	1,396,200
神戸物産	2,000	3,680.00	7,360,000
ソリトンシステムズ	700	755.00	528,500

ジーンズ	800	5,490.00	4,392,000
ビックカメラ	6,500	1,432.00	9,308,000
DCMホールディングス	6,500	1,149.00	7,468,500
ペッパーフードサービス	1,000	2,998.00	2,998,000
MonotaRO	7,600	2,650.00	20,140,000
東京一番フーズ	300	585.00	175,500
DDホールディングス	300	2,151.00	645,300
あいホールディングス	1,900	1,947.00	3,699,300
ディービエックス	500	1,073.00	536,500
きちりホールディングス	300	678.00	203,400
アークランドサービスHD	900	1,969.00	1,772,100
J. フロント リテイリング	15,500	1,295.00	20,072,500
ドトール・日レスHD	2,100	2,086.00	4,380,600
マツモトキヨシHLDGS	5,000	3,405.00	17,025,000
ブロンコビリー	600	2,691.00	1,614,600
ZOZO	13,100	2,184.00	28,610,400
トレジャー・ファクトリー	400	632.00	252,800
物語コーポレーション	300	9,050.00	2,715,000
ココカラファイン	1,400	5,220.00	7,308,000
三越伊勢丹HD	22,600	1,242.00	28,069,200
東洋紡	5,100	1,528.00	7,792,800
ユニチカ	3,500	483.00	1,690,500
富士紡ホールディングス	600	2,541.00	1,524,600
日清紡ホールディングス	6,800	867.00	5,895,600
倉敷紡績	1,100	2,466.00	2,712,600
ダイワボウHD	1,100	5,090.00	5,599,000
シキボウ	600	1,029.00	617,400
日東紡績	1,800	1,812.00	3,261,600
トヨタ紡織	4,300	1,716.00	7,378,800
マクニカ・富士エレHLDGS	3,400	1,399.00	4,756,600
Hamee	300	896.00	268,800
ラクト・ジャパン	300	6,830.00	2,049,000
ウエルシアHD	3,200	4,210.00	13,472,000
クリエイトSDH	1,800	2,647.00	4,764,600
バイタルKSKHD	2,300	1,158.00	2,663,400
八洲電機	900	751.00	675,900
メディアスホールディングス	700	678.00	474,600
UKCホールディングス	800	1,832.00	1,465,600
ジューテックHD	300	953.00	285,900
丸善CHI HD	1,400	335.00	469,000

大光	300	509.00	152,700
OCHIホールディングス	400	1,134.00	453,600
TOKAIホールディングス	6,400	888.00	5,683,200
黒谷	200	416.00	83,200
ミサワ	200	436.00	87,200
ティーライフ	200	927.00	185,400
Cominix	200	759.00	151,800
エー・ピーカンパニー	200	472.00	94,400
三洋貿易	600	1,780.00	1,068,000
チムニー	400	2,553.00	1,021,200
シュッピン	800	694.00	555,200
ビューティガレージ	200	1,440.00	288,000
ウイン・パートナーズ	800	993.00	794,400
ネクステージ	1,900	1,211.00	2,300,900
ジョイフル本田	3,500	1,415.00	4,952,500
鳥貴族	400	1,832.00	732,800
キリン堂ホールディングス	500	1,309.00	654,500
ホットランド	600	1,278.00	766,800
すかいらーくHD	11,300	1,780.00	20,114,000
綿半ホールディングス	500	2,184.00	1,092,000
日本毛織	4,000	834.00	3,336,000
ダイトウボウ	1,900	80.00	152,000
トーア紡コーポレーション	500	481.00	240,500
ダイドーリミテッド	1,400	310.00	434,000
ヨシックス	200	2,834.00	566,800
ユナイテッド・スーパーマーケ	3,500	1,170.00	4,095,000
三栄建築設計	500	1,596.00	798,000
スター・マイカ	600	1,542.00	925,200
野村不動産HLDGS	8,100	2,057.00	16,661,700
三重交通グループHD	2,500	609.00	1,522,500
サムティ	1,700	1,556.00	2,645,200
ディア・ライフ	1,500	429.00	643,500
コーセーアールイー	400	863.00	345,200
エー・ディー・ワークス	17,300	35.00	605,500
日本商業開発	800	1,489.00	1,191,200
プレサンスコーポレーション	1,900	1,368.00	2,599,200
ユニゾホールディングス	1,800	2,035.00	3,663,000
THEグローバル社	600	526.00	315,600
日本管理センター	800	857.00	685,600
サンセイランディック	300	794.00	238,200

エストラスト	200	712.00	142,400	
フージャースHD	2,700	637.00	1,719,900	
オープンハウス	2,000	3,890.00	7,780,000	
東急不動産HD	32,600	554.00	18,060,400	
飯田GHD	10,100	1,934.00	19,533,400	
イーグランド	200	669.00	133,800	
ムゲンエステート	800	541.00	432,800	
帝国繊維	1,400	2,191.00	3,067,400	
日本コークス工業	10,400	94.00	977,600	
ゴルフダイジェスト・オン	500	693.00	346,500	
ミタチ産業	300	702.00	210,600	
B E E N O S	300	1,238.00	371,400	
あさひ	1,000	1,414.00	1,414,000	
日本調剤	400	3,345.00	1,338,000	
コスモス薬品	600	18,640.00	11,184,000	
シップヘルスケアHD	2,500	4,050.00	10,125,000	
トーエル	600	729.00	437,400	
一六堂	300	509.00	152,700	
ソフトクリエイイトHD	500	1,357.00	678,500	
オンリー	200	1,012.00	202,400	
セブン&アイ・HLDGS	50,700	4,926.00	249,748,200	
薬王堂	500	2,801.00	1,400,500	
クリエイイト・レストランツ・ホール	3,300	1,214.00	4,006,200	
明治電機工業	400	1,725.00	690,000	
ツルハホールディングス	2,600	9,330.00	24,258,000	
デリカフーズHLDGS	200	1,371.00	274,200	
スターティアホールディングス	200	595.00	119,000	
サンマルクホールディングス	1,000	2,525.00	2,525,000	
フェリシモ	300	1,193.00	357,900	
トリドールホールディングス	1,500	1,893.00	2,839,500	
帝 人	9,800	1,796.00	17,600,800	
東 レ	93,400	784.10	73,234,940	
ク ラ レ	20,300	1,580.00	32,074,000	
旭 化 成	85,600	1,134.00	97,070,400	
サカイ オーベックス	300	1,859.00	557,700	
T O K Y O B A S E	1,100	558.00	613,800	
稲葉製作所	700	1,290.00	903,000	
宮地エンジニアリングG	400	1,879.00	751,600	
トーカロ	3,100	874.00	2,709,400	
アルファCO	400	1,236.00	494,400	

SUMCO	13,400	1,257.00	16,843,800
川田テクノロジーズ	300	7,000.00	2,100,000
RS TECHNOLOGIES	200	2,554.00	510,800
ビーロット	200	1,164.00	232,800
ファーストブラザーズ	300	1,251.00	375,300
ハウストゥ	400	1,079.00	431,600
シーアールイー	400	960.00	384,000
プロパティエージェント	100	906.00	90,600
ケイアイスター不動産	300	1,666.00	499,800
アグレ都市デザイン	100	597.00	59,700
グッドコムアセット	200	1,401.00	280,200
テンポイノベーション	100	1,488.00	148,800
住江織物	300	2,350.00	705,000
日本フェルト	700	450.00	315,000
イチカワ	200	1,381.00	276,200
エコナックホールディングス	2,100	106.00	222,600
日東製網	100	1,244.00	124,400
芦森工業	300	1,391.00	417,300
アツギ	1,000	965.00	965,000
ウイルプラスHLDGS	100	778.00	77,800
ジャパンミート	500	1,750.00	875,000
コメダホールディングス	2,800	2,098.00	5,874,400
サツドラホールディングス	200	1,866.00	373,200
デファクトスタンダード	100	493.00	49,300
ダイユー・リックHLDGS	700	953.00	667,100
パロックジャパン	1,000	898.00	898,000
クスリのアオキHLDGS	1,000	6,580.00	6,580,000
ダイニック	500	736.00	368,000
共和レザー	700	787.00	550,900
力の源HD	300	714.00	214,200
スシローグローバルHLDGS	1,300	6,000.00	7,800,000
LIXILピバ	1,000	1,674.00	1,674,000
セーレン	3,000	1,743.00	5,229,000
ソトー	500	957.00	478,500
東海染工	200	975.00	195,000
小松マテーレ	2,000	780.00	1,560,000
ワコールホールディングス	3,500	2,834.00	9,919,000
ホギメディカル	1,500	3,240.00	4,860,000
レナウン	3,500	97.00	339,500
クラウドディアHLDGS	300	462.00	138,600

T S Iホールディングス	4,400	707.00	3,110,800
マツオカコーポレーション	400	2,780.00	1,112,000
ワールド	900	1,569.00	1,412,100
T I S	4,000	4,540.00	18,160,000
ネオス	400	1,341.00	536,400
電算システム	500	2,360.00	1,180,000
グリー	6,500	462.00	3,003,000
コーエーテクモHD	2,500	1,833.00	4,582,500
三菱総合研究所	500	3,145.00	1,572,500
ボルテージ	200	529.00	105,800
電算	100	2,116.00	211,600
A G S	700	649.00	454,300
ファインデックス	1,000	527.00	527,000
ヒト・コミュニケーションズ	300	1,383.00	414,900
ブレインパッド	300	5,230.00	1,569,000
K L a b	2,100	896.00	1,881,600
ポルトゥウィン・ピットクル	1,600	879.00	1,406,400
イーブックイニシアティブ	200	1,574.00	314,800
ネクソン	30,700	1,580.00	48,506,000
アイスタイル	3,100	805.00	2,495,500
エムアップ	400	1,622.00	648,800
エイチーム	800	1,576.00	1,260,800
テクノスジャパン	1,000	746.00	746,000
e n i s h	400	485.00	194,000
コロプラ	3,400	738.00	2,509,200
オルトプラス	700	332.00	232,400
ブロードリーフ	6,000	558.00	3,348,000
クロス・マーケティングG	300	329.00	98,700
デジタルハーツHLDGS	500	1,422.00	711,000
メディアドゥHLDGS	300	2,028.00	608,400
じげん	1,300	526.00	683,800
ブイキューブ	600	381.00	228,600
サイバーリンクス	200	938.00	187,600
ディー・エル・イー	800	142.00	113,600
フィックスターズ	1,200	1,085.00	1,302,000
C A R T A H O L D I N G S	600	992.00	595,200
オプティム	300	4,750.00	1,425,000
セレス	400	1,591.00	636,400
特種東海製紙	800	4,115.00	3,292,000
ベリサーブ	100	4,325.00	432,500

ティーガイア	1,200	2,119.00	2,542,800	
セック	200	3,565.00	713,000	
日本アジアグループ	1,300	332.00	431,600	
豆蔵ホールディングス	800	1,004.00	803,200	
テクマトリックス	800	1,656.00	1,324,800	
プロシップ	200	2,567.00	513,400	
ガンホー・オンライン・エンター	29,100	208.00	6,052,800	
GMOペイメントゲートウェイ	2,000	5,230.00	10,460,000	
ザッパラス	600	375.00	225,000	
システムリサーチ	200	2,730.00	546,000	
インターネットイニシアティブ	2,000	2,545.00	5,090,000	
さくらインターネット	1,400	448.00	627,200	
ヴィンクス	400	1,265.00	506,000	
GMOクラウド	300	3,060.00	918,000	
SRAホールディングス	600	2,541.00	1,524,600	
MINORIソリューションズ	200	1,578.00	315,600	
システムインテグレータ	400	805.00	322,000	
朝日ネット	1,000	501.00	501,000	
eBASE	400	1,653.00	661,200	
アバント	300	1,093.00	327,900	
アドソル日進	400	1,607.00	642,800	
フリービット	800	781.00	624,800	
コムチュア	700	2,422.00	1,695,400	
サイバーコム	200	2,095.00	419,000	
アステリア	600	733.00	439,800	
王子ホールディングス	54,200	599.00	32,465,800	
日本製紙	5,800	2,057.00	11,930,600	
三菱製紙	2,000	575.00	1,150,000	
北越コーポレーション	8,000	541.00	4,328,000	
中越パルプ	500	1,369.00	684,500	
巴川製紙	400	1,049.00	419,600	
大王製紙	5,900	1,319.00	7,782,100	
阿波製紙	300	431.00	129,300	
マークラインズ	400	1,301.00	520,400	
メディカル・データ・ビジ	1,100	906.00	996,600	
gumi	1,400	578.00	809,200	
ショーケース・ティービー	300	633.00	189,900	
モバイルファクトリー	300	1,071.00	321,300	
テラスカイ	100	3,515.00	351,500	
デジタル・インフォメーション	500	1,277.00	638,500	

PCIホールディングス	200	1,981.00	396,200
パイブドHD	200	964.00	192,800
アイビーシー	200	976.00	195,200
ネオジャパン	200	785.00	157,000
PR TIMES	100	2,097.00	209,700
ランドコンピュータ	100	992.00	99,200
ダブルスタンダード	100	3,435.00	343,500
オープンドア	600	2,736.00	1,641,600
マイネット	400	1,665.00	666,000
アカツキ	400	6,480.00	2,592,000
ベネフィットジャパン	100	695.00	69,500
UBICOMホールディングス	200	1,111.00	222,200
LINE	3,700	4,095.00	15,151,500
カナミックネットワーク	200	1,664.00	332,800
ノムラシステムコーポレーション	100	716.00	71,600
レンゴー	12,400	898.00	11,135,200
トーモク	700	1,699.00	1,189,300
ザ・パック	900	3,035.00	2,731,500
チェンジ	200	3,585.00	717,000
シンクロ・フード	500	554.00	277,000
オークネット	600	972.00	583,200
AOI TYO HOLDINGS	1,300	802.00	1,042,600
マクロミル	1,500	1,445.00	2,167,500
ビーグリー	200	752.00	150,400
オロ	100	4,315.00	431,500
昭和電工	8,000	3,595.00	28,760,000
住友化学	94,800	550.00	52,140,000
住友精化	600	4,180.00	2,508,000
日産化学	7,400	5,760.00	42,624,000
ラサ工業	400	1,303.00	521,200
クレハ	1,100	6,380.00	7,018,000
多木化学	400	5,390.00	2,156,000
テイカ	1,000	1,744.00	1,744,000
石原産業	2,300	1,084.00	2,493,200
片倉コープアグリ	300	1,150.00	345,000
日東エフシー	800	726.00	580,800
日本曹達	1,900	2,805.00	5,329,500
東ソー	18,600	1,428.00	26,560,800
トクヤマ	3,500	2,461.00	8,613,500
セントラル硝子	2,600	2,210.00	5,746,000

東亜合成	7,600	1,227.00	9,325,200
大阪ソーダ	1,300	2,505.00	3,256,500
関東電化	2,900	837.00	2,427,300
デンカ	4,700	3,250.00	15,275,000
イビデン	7,500	1,511.00	11,332,500
信越化学	21,200	8,575.00	181,790,000
日本カ-パイド	400	1,724.00	689,600
堺化学	800	2,147.00	1,717,600
第一稀元素化学工	1,000	821.00	821,000
エア・ウォーター	9,900	1,685.00	16,681,500
大陽日酸	9,900	1,794.00	17,760,600
日本化学工業	400	2,227.00	890,800
東邦アセチレン	200	1,282.00	256,400
日本パ-カラライジング	6,600	1,295.00	8,547,000
高压ガス	1,900	820.00	1,558,000
チタン工業	200	2,339.00	467,800
四国化成	2,000	1,063.00	2,126,000
戸田工業	300	2,180.00	654,000
ステラ ケミファ	700	2,690.00	1,883,000
保土谷化学	400	2,014.00	805,600
日本触媒	2,000	7,060.00	14,120,000
大日精化	1,000	2,744.00	2,744,000
カネカ	3,200	4,170.00	13,344,000
協和発酵キリン	15,400	2,165.00	33,341,000
三菱瓦斯化学	12,400	1,679.00	20,819,600
三井化学	10,900	2,500.00	27,250,000
J S R	12,100	1,664.00	20,134,400
東京応化工業	2,100	2,945.00	6,184,500
大阪有機化学	1,100	1,129.00	1,241,900
三菱ケミカルH L D G S	80,500	859.30	69,173,650
K H ネオケム	1,800	2,448.00	4,406,400
ダイセル	18,700	1,127.00	21,074,900
住友ベ-クライト	2,100	4,000.00	8,400,000
積水化学	26,300	1,585.00	41,685,500
日本ゼオン	10,900	1,028.00	11,205,200
アイカ工業	3,600	3,595.00	12,942,000
宇部興産	6,100	2,229.00	13,596,900
積水樹脂	2,000	1,963.00	3,926,000
タキロンシーアイ	2,600	575.00	1,495,000
旭有機材	800	1,475.00	1,180,000

日立化成	5,600	1,648.00	9,228,800
ニチバン	600	1,894.00	1,136,400
リケンテクノス	3,300	443.00	1,461,900
大倉工業	600	1,784.00	1,070,400
積水化成品	1,800	933.00	1,679,400
群栄化学	300	2,745.00	823,500
タイガース ポリマー	600	584.00	350,400
ミライアル	300	974.00	292,200
ダイキアクシス	400	911.00	364,400
ダイキョーニシカワ	2,500	1,113.00	2,782,500
竹本容器	400	1,411.00	564,400
森六ホールディングス	600	2,624.00	1,574,400
日本化薬	7,700	1,407.00	10,833,900
カーリットホールディングス	1,300	755.00	981,500
E P Sホールディングス	1,800	1,694.00	3,049,200
ソルクシーズ	500	603.00	301,500
レグス	300	902.00	270,600
プレステージ・インター	2,200	1,199.00	2,637,800
フェイス	500	864.00	432,000
ハイマックス	100	1,743.00	174,300
アミューズ	700	2,330.00	1,631,000
野村総合研究所	7,700	4,270.00	32,879,000
ドリームインキュベータ	400	1,341.00	536,400
サイバネットシステム	1,000	553.00	553,000
クイック	700	1,320.00	924,000
T A C	600	219.00	131,400
C Eホールディングス	300	693.00	207,900
ケネディクス	11,000	487.00	5,357,000
日本システム技術	200	1,518.00	303,600
電通	14,300	4,800.00	68,640,000
インテージホールディングス	1,500	863.00	1,294,500
テイクアンドギヴニーズ	400	1,660.00	664,000
東邦システムサイエンス	400	909.00	363,600
びあ	300	4,005.00	1,201,500
イオンファンタジー	400	2,331.00	932,400
ソースネクスト	4,600	623.00	2,865,800
シーティーエス	1,300	644.00	837,200
ネクシィーズグループ	400	1,821.00	728,400
インフォコム	500	3,875.00	1,937,500
メディカルシステムネットワーク	1,300	442.00	574,600

日本精化	1,000	1,051.00	1,051,000
扶桑化学工業	1,200	1,960.00	2,352,000
トリケミカル	300	3,775.00	1,132,500
F I G	1,100	308.00	338,800
A D E K A	5,900	1,672.00	9,864,800
日油	4,600	3,630.00	16,698,000
ミヨシ油脂	500	1,092.00	546,000
新日本理化	2,200	144.00	316,800
ハリマ化成グループ	1,000	955.00	955,000
花 王	29,800	7,373.00	219,715,400
第一工業製薬	400	2,543.00	1,017,200
石原ケミカル	300	1,605.00	481,500
日華化学	400	949.00	379,600
ニイタカ	200	1,374.00	274,800
三洋化成	800	5,070.00	4,056,000
武田薬品	48,500	4,200.00	203,700,000
アステラス製薬	113,300	1,503.50	170,346,550
大日本住友製薬	9,100	3,665.00	33,351,500
塩野義製薬	16,100	6,383.00	102,766,300
田辺三菱製薬	12,900	1,616.00	20,846,400
わかもと製薬	1,500	267.00	400,500
あすか製薬	1,500	1,177.00	1,765,500
日本新薬	3,200	6,250.00	20,000,000
バイオフェルミン製薬	200	2,485.00	497,000
中外製薬	12,800	6,550.00	83,840,000
科研製薬	2,200	5,260.00	11,572,000
エーザイ	14,700	8,571.00	125,993,700
理研ビタミン	600	3,570.00	2,142,000
ロート製薬	6,300	2,959.00	18,641,700
小野薬品	29,000	2,333.00	67,657,000
久光製薬	3,600	5,980.00	21,528,000
有機合成薬品	900	199.00	179,100
持田製薬	900	9,630.00	8,667,000
参天製薬	23,300	1,586.00	36,953,800
扶桑薬品	400	2,644.00	1,057,600
日本ケミファ	200	3,210.00	642,000
ツムラ	3,800	3,110.00	11,818,000
日医工	3,000	1,653.00	4,959,000
テ ル モ	17,400	6,061.00	105,461,400
みらかホールディングス	3,300	2,569.00	8,477,700

キッセイ薬品工業	2,200	2,926.00	6,437,200	
生化学工業	2,400	1,302.00	3,124,800	
栄研化学	2,200	2,391.00	5,260,200	
日水製薬	500	1,170.00	585,000	
鳥居薬品	700	2,550.00	1,785,000	
JCRファーマ	900	5,570.00	5,013,000	
東和薬品	600	7,780.00	4,668,000	
富士製薬工業	800	1,813.00	1,450,400	
沢井製薬	2,500	5,450.00	13,625,000	
ゼリア新薬工業	2,400	1,941.00	4,658,400	
第一三共	35,200	3,653.00	128,585,600	
キョーリン製薬HD	3,100	2,346.00	7,272,600	
大幸薬品	500	1,848.00	924,000	
ダイト	700	3,030.00	2,121,000	
大塚ホールディングス	23,400	4,556.00	106,610,400	
大正製薬HD	2,800	11,710.00	32,788,000	
ペプチドリーム	5,700	4,520.00	25,764,000	
大日本塗料	1,400	977.00	1,367,800	
日本ペイントHOLD	9,900	3,530.00	34,947,000	
関西ペイント	13,500	1,912.00	25,812,000	
神東塗料	900	161.00	144,900	
中国塗料	4,000	913.00	3,652,000	
日本特殊塗料	900	1,323.00	1,190,700	
藤倉化成	1,600	582.00	931,200	
太陽ホールディングス	1,000	3,135.00	3,135,000	
DIC	5,400	3,360.00	18,144,000	
サカタインクス	2,600	1,183.00	3,075,800	
東洋インキSCホールディン	2,500	2,461.00	6,152,500	
T&K TOKA	900	982.00	883,800	
アルプス技研	1,000	1,727.00	1,727,000	
サニックス	2,100	188.00	394,800	
ダイオーズ	300	1,289.00	386,700	
日本空調サービス	1,300	674.00	876,200	
オリエンタルランド	13,900	11,160.00	155,124,000	
フォーカスシステムズ	800	976.00	780,800	
ダスキン	3,200	2,472.00	7,910,400	
パーク24	7,100	2,618.00	18,587,800	
明光ネットワークジャパン	1,500	936.00	1,404,000	
ファルコホールディングス	600	1,465.00	879,000	
クレスコ	400	2,897.00	1,158,800	

フジ・メディア・HD	12,500	1,551.00	19,387,500
秀英予備校	300	480.00	144,000
田谷	200	620.00	124,000
ラウンドワン	3,600	1,145.00	4,122,000
リゾートトラスト	5,000	1,594.00	7,970,000
オービック	4,200	8,840.00	37,128,000
ジャストシステム	1,700	2,158.00	3,668,600
TDCソフト	1,100	775.00	852,500
ヤフー	78,600	291.00	22,872,600
ビー・エム・エル	1,500	2,838.00	4,257,000
ワタベウェディング	200	597.00	119,400
トレンドマイクロ	6,400	6,070.00	38,848,000
りらいあコミュニケーション	2,100	950.00	1,995,000
インフォメーションディベロ	300	1,289.00	386,700
リソー教育	6,000	444.00	2,664,000
日本オラクル	2,000	7,590.00	15,180,000
早稲田アカデミー	200	1,911.00	382,200
アルファシステムズ	400	2,630.00	1,052,000
フューチャー	1,600	1,519.00	2,430,400
CAC HOLDINGS	900	931.00	837,900
ソフトバンク・テクノ	500	1,765.00	882,500
トーセ	300	828.00	248,400
ユー・エス・エス	14,300	1,866.00	26,683,800
オービックビジネスC	1,200	4,245.00	5,094,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,500	2,182.00	12,001,000
アイティフォー	1,500	695.00	1,042,500
東京個別指導学院	400	1,236.00	494,400
東計電算	200	3,075.00	615,000
サイバーエージェント	7,200	4,175.00	30,060,000
楽天	54,700	809.00	44,252,300
エックスネット	200	822.00	164,400
クリーク・アンド・リバー社	700	980.00	686,000
テー・オー・ダブリュー	1,100	763.00	839,300
大塚商会	6,500	3,170.00	20,605,000
サイボウズ	1,400	661.00	925,400
ソフトブレーン	900	418.00	376,200
セントラルスポーツ	400	3,525.00	1,410,000
パラカ	300	1,610.00	483,000
電通国際情報S	700	2,820.00	1,974,000
デジタルガレージ	2,300	2,534.00	5,828,200

イーエムシステムズ	1,000	1,138.00	1,138,000
ウェザーニューズ	400	2,921.00	1,168,400
C I J	900	733.00	659,700
東洋ビジネスエンジ	100	1,834.00	183,400
日本エンタープライズ	1,200	174.00	208,800
WOWOW	600	3,075.00	1,845,000
スカラ	1,000	717.00	717,000
フルキャストホールディングス	1,200	1,750.00	2,100,000
エン・ジャパン	1,300	3,635.00	4,725,500
富士フイルムHLDGS	25,500	4,392.00	111,996,000
コニカミノルタ	26,900	1,016.00	27,330,400
資生堂	24,400	6,148.00	150,011,200
ライオン	17,100	2,165.00	37,021,500
高砂香料	800	3,420.00	2,736,000
マンダム	2,800	2,872.00	8,041,600
ミルボン	1,500	4,340.00	6,510,000
ファンケル	5,400	2,410.00	13,014,000
コーセー	2,100	15,240.00	32,004,000
コタ	600	1,404.00	842,400
シーズ・ホールディングス	1,400	5,870.00	8,218,000
シーボン	100	2,624.00	262,400
ポーラ・オルビスHD	5,200	2,787.00	14,492,400
ノエビアホールディングス	800	4,450.00	3,560,000
アジュバンコスメジャパン	300	951.00	285,300
エステー	900	1,830.00	1,647,000
アグロカネショウ	500	2,063.00	1,031,500
コニシ	2,200	1,610.00	3,542,000
長谷川香料	1,500	1,580.00	2,370,000
星光PMC	800	753.00	602,400
小林製薬	3,400	7,120.00	24,208,000
荒川化学工業	1,100	1,319.00	1,450,900
メック	800	1,031.00	824,800
日本高純度化学	300	2,220.00	666,000
タカラバイオ	3,200	2,659.00	8,508,800
JCU	1,600	1,434.00	2,294,400
新田ゼラチン	800	670.00	536,000
OATアグリオ	200	1,869.00	373,800
デクセリアルズ	3,200	827.00	2,646,400
アース製薬	900	5,070.00	4,563,000
北興化学	1,300	535.00	695,500

大成ラミック	400	2,955.00	1,182,000
クミアイ化学	5,100	647.00	3,299,700
日本農薬	2,900	498.00	1,444,200
昭和シエル石油	11,500	1,614.00	18,561,000
富士興産	500	595.00	297,500
ニチレキ	1,600	1,001.00	1,601,600
ユシロ化学	600	1,221.00	732,600
ビーピー・カストロール	400	1,258.00	503,200
富士石油	3,000	301.00	903,000
MORESCO	400	1,531.00	612,400
出光興産	9,500	3,775.00	35,862,500
JXTGホールディングス	209,200	594.30	124,327,560
コスモエネルギーHLDGS	3,600	2,436.00	8,769,600
横浜ゴム	7,100	2,162.00	15,350,200
TOYO TIRE	6,300	1,418.00	8,933,400
ブリヂストン	37,800	4,225.00	159,705,000
住友ゴム	11,000	1,351.00	14,861,000
藤倉ゴム	1,100	451.00	496,100
オカモト	900	5,810.00	5,229,000
アキレス	900	1,994.00	1,794,600
フコク	500	887.00	443,500
ニッタ	1,400	3,525.00	4,935,000
クリエートメディック	400	1,001.00	400,400
住友理工	2,400	980.00	2,352,000
三ツ星ベルト	1,600	2,071.00	3,313,600
バンドー化学	2,300	1,078.00	2,479,400
AGC	12,400	3,470.00	43,028,000
日本板硝子	5,900	868.00	5,121,200
石塚硝子	200	1,953.00	390,600
有沢製作所	1,900	769.00	1,461,100
日本山村硝子	500	1,558.00	779,000
日本電気硝子	5,300	2,710.00	14,363,000
オハラ	500	1,565.00	782,500
住友大阪セメント	2,500	4,570.00	11,425,000
太平洋セメント	7,800	3,520.00	27,456,000
リソルホールディングス	100	4,030.00	403,000
日本ヒューム	1,200	832.00	998,400
日本コンクリート	2,600	253.00	657,800
三谷セキサン	600	2,652.00	1,591,200
アジアパイルHD	1,700	585.00	994,500

東海カーボン	11,200	1,471.00	16,475,200
日本カーボン	600	4,105.00	2,463,000
東洋炭素	700	2,171.00	1,519,700
ノリタケ	700	4,795.00	3,356,500
TOTO	9,500	3,900.00	37,050,000
日本碍子	15,000	1,536.00	23,040,000
日本特殊陶業	10,400	2,130.00	22,152,000
ダントーホールディングス	1,000	109.00	109,000
MARUWA	400	5,640.00	2,256,000
品川リフラクトリーズ	300	3,670.00	1,101,000
黒崎播磨	200	6,590.00	1,318,000
ヨータイ	1,100	587.00	645,700
イソライト	600	472.00	283,200
東京窯業	1,600	360.00	576,000
ニッカトー	600	870.00	522,000
フジミインコーポレーテッド	1,100	2,182.00	2,400,200
クニミネ工業	400	805.00	322,000
エーアンドエーマテリアル	200	961.00	192,200
ニチアス	3,400	1,899.00	6,456,600
新日鐵住金	56,459	1,924.00	108,627,116
神戸製鋼所	22,200	804.00	17,848,800
中山製鋼所	1,700	461.00	783,700
合同製鐵	600	1,633.00	979,800
JFEホールディングス	32,800	1,797.50	58,958,000
東京製鐵	6,500	918.00	5,967,000
共英製鋼	1,400	1,720.00	2,408,000
大和工業	2,600	2,726.00	7,087,600
東京鐵鋼	500	1,139.00	569,500
大阪製鐵	800	1,774.00	1,419,200
淀川製鋼所	1,600	2,158.00	3,452,800
丸一鋼管	4,300	3,505.00	15,071,500
モリ工業	400	2,348.00	939,200
大同特殊鋼	2,000	4,450.00	8,900,000
日本高周波	400	538.00	215,200
日本冶金工	10,100	230.00	2,323,000
山陽特殊製鋼	1,500	2,295.00	3,442,500
愛知製鋼	700	3,505.00	2,453,500
日立金属	13,100	1,175.00	15,392,500
日本金属	300	1,089.00	326,700
大平洋金属	800	2,888.00	2,310,400

新日本電工	7,300	216.00	1,576,800
栗本鉄工所	600	1,359.00	815,400
虹 技	200	1,314.00	262,800
日本鑄鉄管	100	1,016.00	101,600
日本製鋼所	3,700	1,878.00	6,948,600
三菱製鋼	900	1,611.00	1,449,900
日亜鋼業	1,800	280.00	504,000
日本精線	200	3,295.00	659,000
エンビプロHD	300	478.00	143,400
大紀アルミニウム	2,000	573.00	1,146,000
日本軽金属HD	33,100	221.00	7,315,100
三井金属	3,300	2,324.00	7,669,200
東邦亜鉛	700	3,445.00	2,411,500
三菱マテリアル	8,000	2,974.00	23,792,000
住友鉱山	16,600	3,035.00	50,381,000
DOWAホールディングス	2,800	3,365.00	9,422,000
古河機金	2,000	1,262.00	2,524,000
エス・サイエンス	5,400	52.00	280,800
大阪チタニウム	1,400	1,634.00	2,287,600
東邦チタニウム	2,200	993.00	2,184,600
UACJ	1,800	2,214.00	3,985,200
CKサンエツ	200	2,204.00	440,800
古河電工	3,500	2,880.00	10,080,000
住友電工	45,400	1,483.00	67,328,200
フジクラ	14,700	435.00	6,394,500
昭和電線HLDGS	1,400	625.00	875,000
東京特殊電線	200	1,875.00	375,000
タツタ電線	2,400	474.00	1,137,600
カナレ電気	200	1,717.00	343,400
平河ビューテック	500	1,000.00	500,000
リョービ	1,500	2,725.00	4,087,500
アーステイ	1,500	627.00	940,500
アサヒHD	2,300	2,372.00	5,455,600
東洋製罐グループHD	7,700	2,595.00	19,981,500
ホッカンホールディングス	600	1,698.00	1,018,800
コロナ	700	1,087.00	760,900
横河ブリッジHLDGS	2,300	1,688.00	3,882,400
OSJB HD	6,100	301.00	1,836,100
駒井ハルテック	200	1,811.00	362,200
高田機工	100	2,677.00	267,700

三和ホールディングス	12,600	1,224.00	15,422,400	
文化シャツタ -	3,600	729.00	2,624,400	
三協立山	1,700	1,378.00	2,342,600	
アルインコ	1,000	950.00	950,000	
東洋シャツタ -	300	607.00	182,100	
L I X I Lグループ	17,900	1,415.00	25,328,500	
日本ファイルコン	900	565.00	508,500	
ノーリツ	2,700	1,551.00	4,187,700	
長府製作所	1,200	2,123.00	2,547,600	
リンナイ	2,200	7,080.00	15,576,000	
ユニプレス	2,400	1,834.00	4,401,600	
ダイニチ工業	700	665.00	465,500	
日東精工	1,700	475.00	807,500	
三洋工業	200	1,884.00	376,800	
岡 部	2,500	882.00	2,205,000	
ジーテクト	1,300	1,483.00	1,927,900	
中国工業	200	538.00	107,600	
東 プ レ	2,300	2,272.00	5,225,600	
高周波熱錬	2,300	845.00	1,943,500	
東京製綱	700	961.00	672,700	
サンコール	700	595.00	416,500	
モリテックスチル	900	410.00	369,000	
パイオラックス	1,900	2,244.00	4,263,600	
エイチワン	1,200	1,011.00	1,213,200	
日本発条	12,100	981.00	11,870,100	
中央発條	100	3,345.00	334,500	
アドバネクス	200	1,479.00	295,800	
三浦工業	5,300	2,536.00	13,440,800	
タ ク マ	4,400	1,345.00	5,918,000	
テクノプロ・ホールディング	2,200	4,860.00	10,692,000	
アトラ	200	435.00	87,000	
インターワークス	200	665.00	133,000	
アイ・アールジャパンHD	400	1,167.00	466,800	
K e e P e r 技研	400	956.00	382,400	
ファーストロジック	200	644.00	128,800	
三機サービス	200	1,629.00	325,800	
G u n o s y	700	2,781.00	1,946,700	
デザインワン・ジャパン	200	306.00	61,200	
イー・ガーディアン	600	1,996.00	1,197,600	
リブセンス	600	245.00	147,000	

ジャパンマテリアル	3,200	1,057.00	3,382,400
ベクトル	1,400	1,384.00	1,937,600
ウチヤマホールディングス	600	425.00	255,000
ライクキッズネクスト	200	722.00	144,400
キャリアリンク	400	340.00	136,000
I B J	800	796.00	636,800
アサンテ	500	2,042.00	1,021,000
N・フィールド	800	904.00	723,200
バリューHR	200	1,742.00	348,400
M&Aキャピタルパートナー	300	3,710.00	1,113,000
ライドオンエクスプレスHD	500	1,269.00	634,500
E R Iホールディングス	300	736.00	220,800
アビスト	200	3,110.00	622,000
シグマクシス	600	782.00	469,200
ウィルグループ	800	899.00	719,200
エスクローAJ	1,600	272.00	435,200
日本ビューホテル	400	1,106.00	442,400
リクルートホールディングス	84,100	2,880.50	242,250,050
エラン	800	1,263.00	1,010,400
ツガミ	2,700	636.00	1,717,200
オークマ	1,500	5,050.00	7,575,000
東芝機械	1,400	2,056.00	2,878,400
アマダホールディングス	18,800	1,015.00	19,082,000
アイダエンジニア	3,400	731.00	2,485,400
滝澤鉄工所	400	1,410.00	564,000
F U J I	3,600	1,311.00	4,719,600
牧野フライス	1,400	3,975.00	5,565,000
オーエスジー	6,000	2,146.00	12,876,000
ダイジェット	100	1,701.00	170,100
旭ダイヤモンド	3,200	620.00	1,984,000
D M G 森精機	7,700	1,268.00	9,763,600
ソディック	2,700	745.00	2,011,500
ディスコ	1,600	13,300.00	21,280,000
日東工器	700	2,174.00	1,521,800
日進工具	400	2,212.00	884,800
パンチ工業	800	480.00	384,000
富士ダイス	500	623.00	311,500
土木管理総合試験	500	489.00	244,500
ベルシステム24HLDGS	2,000	1,230.00	2,460,000
鎌倉新書	900	1,298.00	1,168,200

一蔵	100	566.00	56,600
LITALICO	300	1,735.00	520,500
グローバルグループ	100	900.00	90,000
エボラブルアジア	300	1,848.00	554,400
アトラエ	200	2,035.00	407,000
ストライク	300	1,671.00	501,300
ソラスト	2,900	1,080.00	3,132,000
セラク	300	523.00	156,900
インソース	400	1,777.00	710,800
豊田自動織機	9,900	5,290.00	52,371,000
豊和工業	700	742.00	519,400
OKK	500	797.00	398,500
石川製作所	300	1,130.00	339,000
東洋機械金属	900	544.00	489,600
津田駒工業	300	1,720.00	516,000
エンシュウ	300	1,006.00	301,800
島精機製作所	1,700	3,330.00	5,661,000
オプトラン	1,200	1,531.00	1,837,200
NCホールディングス	400	589.00	235,600
フリーー	1,000	1,059.00	1,059,000
ヤマシンフィルタ	2,100	647.00	1,358,700
日阪製作所	1,500	809.00	1,213,500
やまびこ	2,400	1,039.00	2,493,600
平田機工	600	5,330.00	3,198,000
ペガサスミシン製造	1,100	660.00	726,000
マルマエ	300	625.00	187,500
タツモ	400	703.00	281,200
ナプテスコ	6,700	2,442.00	16,361,400
三井海洋開発	1,300	2,378.00	3,091,400
レオン自動機	1,200	1,292.00	1,550,400
SMC	3,600	33,960.00	122,256,000
新川	900	365.00	328,500
ホソカワミクロン	400	3,940.00	1,576,000
ユニオンツール	500	2,940.00	1,470,000
オイレス工業	1,700	1,800.00	3,060,000
日精エーエスビー	400	3,490.00	1,396,000
サト - ホールディングス	1,500	2,633.00	3,949,500
技研製作所	800	3,345.00	2,676,000
日本エアータック	400	592.00	236,800
カワタ	200	1,265.00	253,000

日精樹脂工業	1,000	918.00	918,000	
オカダアイヨン	400	1,466.00	586,400	
ワイエイシイホールディングス	500	603.00	301,500	
小松製作所	55,700	2,536.50	141,283,050	
住友重機械	7,000	3,380.00	23,660,000	
日立建機	4,900	2,472.00	12,112,800	
日 工	300	2,320.00	696,000	
巴工業	500	2,364.00	1,182,000	
井関農機	1,200	1,586.00	1,903,200	
T O W A	1,100	607.00	667,700	
丸山製作所	300	1,311.00	393,300	
北川鉄工所	600	2,217.00	1,330,200	
シンニッタン	1,900	336.00	638,400	
ローツェ	500	1,456.00	728,000	
タカキタ	400	644.00	257,600	
クボタ	65,900	1,578.50	104,023,150	
荏原実業	400	1,790.00	716,000	
東洋エンジニア	1,600	704.00	1,126,400	
三菱化工機	400	1,477.00	590,800	
月島機械	2,400	1,373.00	3,295,200	
帝国電機製作所	900	1,230.00	1,107,000	
東京機械	500	393.00	196,500	
新東工業	2,900	917.00	2,659,300	
渋谷工業	1,100	3,605.00	3,965,500	
アイチ コーポレーション	2,100	597.00	1,253,700	
小森コーポレーション	3,300	1,130.00	3,729,000	
鶴見製作所	1,000	1,818.00	1,818,000	
住友精密	200	3,120.00	624,000	
酒井重工業	200	2,324.00	464,800	
荏原製作所	5,400	2,680.00	14,472,000	
石井鉄工所	200	1,784.00	356,800	
西島製作所	1,300	935.00	1,215,500	
北越工業	1,300	1,094.00	1,422,200	
千代田化工建	9,900	315.00	3,118,500	
ダイキン工業	16,800	12,110.00	203,448,000	
オルガノ	400	2,524.00	1,009,600	
ト - ヨ - カネツ	500	2,309.00	1,154,500	
栗田工業	6,700	2,635.00	17,654,500	
椿本チエイン	1,600	3,755.00	6,008,000	
大同工業	600	890.00	534,000	

日 機 装	4,000	954.00	3,816,000
木村化工機	1,000	355.00	355,000
新興プランテック	2,500	1,156.00	2,890,000
アネスト岩田	1,900	968.00	1,839,200
ダイフク	6,800	4,815.00	32,742,000
サムコ	300	918.00	275,400
加藤製作所	600	2,620.00	1,572,000
油研工業	200	1,871.00	374,200
タダノ	5,900	1,116.00	6,584,400
フジテック	4,500	1,166.00	5,247,000
C K D	3,400	958.00	3,257,200
キトー	900	1,532.00	1,378,800
平和	3,400	2,303.00	7,830,200
理想科学工業	1,100	1,642.00	1,806,200
S A N K Y O	3,100	4,180.00	12,958,000
日本金銭機械	1,400	995.00	1,393,000
マースグループH L D G S	800	2,239.00	1,791,200
福島工業	800	3,745.00	2,996,000
オーイズミ	500	356.00	178,000
ダイコク電機	600	1,552.00	931,200
竹内製作所	2,100	1,781.00	3,740,100
ア マ ノ	3,500	2,162.00	7,567,000
J U K I	1,700	1,111.00	1,888,700
サンデンホールディングス	1,500	804.00	1,206,000
蛇の目ミシン	1,100	486.00	534,600
ブラザー工業	16,000	1,697.00	27,152,000
マックス	1,900	1,424.00	2,705,600
モリタホールディングス	2,100	1,816.00	3,813,600
グローリー	3,400	2,567.00	8,727,800
新晃工業	1,100	1,486.00	1,634,600
大和冷機工業	1,800	1,081.00	1,945,800
セガサミーホールディングス	12,200	1,575.00	19,215,000
日本ピストンリング	400	1,837.00	734,800
リ ケ ン	600	4,775.00	2,865,000
T P R	1,700	2,249.00	3,823,300
ツバキ・ナカシマ	1,900	1,551.00	2,946,900
ホシザキ	3,600	7,840.00	28,224,000
大豊工業	1,000	980.00	980,000
日本精工	25,200	978.00	24,645,600
N T N	26,400	333.00	8,791,200

ジェイテクト	11,800	1,279.00	15,092,200
不二越	1,100	3,985.00	4,383,500
ミネベアミツミ	22,800	1,581.00	36,046,800
日本トムソン	3,600	498.00	1,792,800
T H K	7,700	2,066.00	15,908,200
ユーシン精機	1,000	862.00	862,000
前澤給装工業	500	1,893.00	946,500
イーグル工業	1,500	1,234.00	1,851,000
前澤工業	900	348.00	313,200
日本ピラ - 工業	1,200	1,277.00	1,532,400
キッツ	5,000	851.00	4,255,000
日立	55,300	3,080.00	170,324,000
三菱電機	122,900	1,240.50	152,457,450
富士電機	8,000	3,175.00	25,400,000
東洋電機製造	500	1,277.00	638,500
安川電機	14,200	2,642.00	37,516,400
シンフォニア テクノロジー	1,700	1,280.00	2,176,000
明電舎	2,400	1,371.00	3,290,400
オリジン電気	300	1,678.00	503,400
山洋電気	600	3,605.00	2,163,000
デンヨー	1,100	1,415.00	1,556,500
アイモバイル	300	743.00	222,900
キャリアインデックス	400	1,262.00	504,800
M S - J a p a n	500	1,268.00	634,000
船場	200	863.00	172,600
グレイステクノロジー	300	1,735.00	520,500
ジャパンエレベーターSHD	700	1,669.00	1,168,300
フルテック	100	1,111.00	111,100
グリーンズ	300	1,342.00	402,600
ツナグ・ソリューションズ	100	604.00	60,400
日総工産	300	1,861.00	558,300
キュービーネットHLDGS	600	1,901.00	1,140,600
三桜工業	1,600	620.00	992,000
マキタ	15,000	3,915.00	58,725,000
東芝テック	1,500	2,499.00	3,748,500
芝浦メカトロニクス	200	3,475.00	695,000
マブチモーター	3,400	3,475.00	11,815,000
日本電産	14,800	12,070.00	178,636,000
ユーエムシーエレクトロニクス	700	1,733.00	1,213,100
トレックス・セミコンダクター	400	1,152.00	460,800

東光高岳	600	1,367.00	820,200
ダブル・スコープ	1,800	1,191.00	2,143,800
宮越ホールディングス	500	988.00	494,000
ダイヘン	1,300	2,279.00	2,962,700
田淵電機	1,700	130.00	221,000
ヤーマン	1,800	1,323.00	2,381,400
JVCケンウッド	9,000	244.00	2,196,000
ミマキエンジニアリング	1,100	844.00	928,400
第一精工	500	1,136.00	568,000
日新電機	2,900	862.00	2,499,800
大崎電気	2,400	693.00	1,663,200
オムロン	13,100	3,910.00	51,221,000
日東工業	2,000	1,865.00	3,730,000
I D E C	1,600	1,913.00	3,060,800
不二電機工業	100	1,310.00	131,000
ジーエス・ユアサ コーポ	4,400	2,273.00	10,001,200
サクサホールディングス	300	1,806.00	541,800
メルコホールディングス	500	3,405.00	1,702,500
テクノメディカ	300	2,063.00	618,900
日本電気	15,900	3,585.00	57,001,500
富士通	11,800	6,870.00	81,066,000
沖電気	5,300	1,388.00	7,356,400
岩崎通信機	600	777.00	466,200
電気興業	600	2,363.00	1,417,800
サンケン電気	1,400	2,023.00	2,832,200
ナカヨ	200	1,434.00	286,800
アイホン	700	1,718.00	1,202,600
ルネサスエレクトロニクス	12,700	546.00	6,934,200
セイコーエプソン	15,300	1,606.00	24,571,800
ワコム	8,900	450.00	4,005,000
アルバック	2,800	3,300.00	9,240,000
アクセル	500	484.00	242,000
E I Z O	1,100	4,015.00	4,416,500
ジャパンディスプレイ	29,100	74.00	2,153,400
日本信号	3,100	897.00	2,780,700
京三製作所	2,600	419.00	1,089,400
能美防災	1,600	1,889.00	3,022,400
ホーチキ	800	1,091.00	872,800
星和電機	500	359.00	179,500
エレコム	1,100	2,776.00	3,053,600

パナソニック	140,400	1,039.50	145,945,800
シャープ	12,200	1,115.00	13,603,000
アンリツ	7,900	1,494.00	11,802,600
富士通ゼネラル	3,800	1,499.00	5,696,200
ソニー	82,400	5,246.00	432,270,400
T D K	6,400	7,360.00	47,104,000
帝国通信工業	500	1,164.00	582,000
タムラ製作所	4,700	513.00	2,411,100
アルプスアルパイン	12,728	2,113.00	26,894,264
池上通信機	400	1,185.00	474,000
パイオニア	20,500	65.00	1,332,500
日本電波工業	1,100	379.00	416,900
鈴木	600	559.00	335,400
日本トリム	200	5,830.00	1,166,000
ローランド ディー . ジー .	600	2,137.00	1,282,200
フオスタ - 電機	1,400	1,363.00	1,908,200
クラリオン	1,100	2,490.00	2,739,000
S M K	300	2,192.00	657,600
ヨコオ	900	1,333.00	1,199,700
ティアック	900	196.00	176,400
ホシデン	3,600	737.00	2,653,200
ヒロセ電機	1,800	10,970.00	19,746,000
日本航空電子	2,800	1,277.00	3,575,600
T O A	1,300	1,000.00	1,300,000
マクセルホールディングス	2,600	1,472.00	3,827,200
古野電気	1,600	1,191.00	1,905,600
ユニデンホールディングス	400	2,018.00	807,200
スミダコーポレーション	1,000	1,175.00	1,175,000
アイコム	700	2,147.00	1,502,900
リオン	600	1,789.00	1,073,400
本多通信工業	1,000	469.00	469,000
船井電機	1,200	588.00	705,600
横河電機	12,300	1,921.00	23,628,300
新電元工業	400	3,935.00	1,574,000
アズビル	7,900	2,205.00	17,419,500
東亜ディーケーケー	600	752.00	451,200
日本光電工業	5,400	3,490.00	18,846,000
チノ	400	1,208.00	483,200
共和電業	1,300	382.00	496,600
日本電子材料	500	635.00	317,500

堀場製作所	2,400	4,595.00	11,028,000	
アドバンテスト	8,400	2,234.00	18,765,600	
小野測器	600	580.00	348,000	
エスベック	1,100	1,831.00	2,014,100	
キーエンス	6,000	52,900.00	317,400,000	
日置電機	600	3,480.00	2,088,000	
シスメックス	9,600	5,490.00	52,704,000	
日本マイクロニクス	2,000	701.00	1,402,000	
メガチップス	1,000	2,542.00	2,542,000	
OBARA GROUP	700	3,860.00	2,702,000	
IMAGICA GROUP	1,000	506.00	506,000	
澤藤電機	100	1,411.00	141,100	
デンソー	27,300	5,077.00	138,602,100	
原田工業	400	787.00	314,800	
コーセル	1,700	955.00	1,623,500	
イリソ電子工業	1,100	4,115.00	4,526,500	
オプテックスグループ	2,200	1,825.00	4,015,000	
千代田インテグレ	500	1,994.00	997,000	
アイ・オー・データ	500	1,125.00	562,500	
レーザーテック	2,500	2,873.00	7,182,500	
スタンレー電気	8,700	3,065.00	26,665,500	
岩崎電気	500	1,344.00	672,000	
ウシオ電機	7,500	1,194.00	8,955,000	
岡谷電機	900	358.00	322,200	
ヘリオステクノH	1,100	626.00	688,600	
エノモト	300	816.00	244,800	
日本セラミック	1,200	2,415.00	2,898,000	
遠藤照明	600	707.00	424,200	
古河電池	900	678.00	610,200	
双信電機	600	354.00	212,400	
山一電機	900	1,192.00	1,072,800	
図 研	800	1,519.00	1,215,200	
日本電子	2,400	1,711.00	4,106,400	
カ シ オ	10,900	1,320.00	14,388,000	
ファナック	11,700	17,090.00	199,953,000	
日本シイエムケイ	3,100	662.00	2,052,200	
エンプラス	600	2,961.00	1,776,600	
大真空	400	898.00	359,200	
ロ - ム	5,900	6,970.00	41,123,000	
浜松ホトニクス	8,800	3,660.00	32,208,000	

三井ハイテック	1,400	883.00	1,236,200
新光電気工業	4,100	676.00	2,771,600
京セラ	18,700	5,606.00	104,832,200
協栄産業	100	1,583.00	158,300
太陽誘電	5,500	1,509.00	8,299,500
村田製作所	12,900	13,655.00	176,149,500
ユーシン	1,900	980.00	1,862,000
双葉電子工業	2,000	1,632.00	3,264,000
日東電工	9,300	5,587.00	51,959,100
北陸電気工業	500	952.00	476,000
東海理化電機	3,200	1,872.00	5,990,400
ニチコン	3,900	835.00	3,256,500
日本ケミコン	900	1,922.00	1,729,800
K O A	1,900	1,316.00	2,500,400
三井E & S H D	4,400	1,155.00	5,082,000
日立造船	9,700	360.00	3,492,000
三菱重工業	20,600	4,114.00	84,748,400
川崎重工業	9,600	2,464.00	23,654,400
I H I	9,400	3,140.00	29,516,000
名村造船所	3,700	468.00	1,731,600
サノヤスホールディングス	1,600	171.00	273,600
スプリックス	300	2,005.00	601,500
日本車輛	400	2,224.00	889,600
三菱ロジスネクスト	1,500	1,137.00	1,705,500
近畿車輛	200	2,029.00	405,800
日産自動車	145,000	897.80	130,181,000
いすゞ自動車	38,900	1,605.00	62,434,500
トヨタ自動車	137,000	6,704.00	918,448,000
日野自動車	15,300	1,075.00	16,447,500
三菱自動車工業	45,500	635.00	28,892,500
エフテック	900	930.00	837,000
レシップホールディングス	400	702.00	280,800
G M B	200	937.00	187,400
ファルテック	200	782.00	156,400
武蔵精密工業	2,900	1,517.00	4,399,300
日産車体	2,400	960.00	2,304,000
新明和工業	5,700	1,375.00	7,837,500
極東開発工業	2,400	1,449.00	3,477,600
日信工業	2,200	1,449.00	3,187,800
トピー工業	1,000	2,308.00	2,308,000

ティラド	400	2,297.00	918,800
曙ブレーキ	6,700	198.00	1,326,600
タチエス	2,100	1,487.00	3,122,700
N O K	6,600	1,553.00	10,249,800
フタバ産業	3,400	549.00	1,866,600
K Y B	1,300	2,773.00	3,604,900
市光工業	1,800	582.00	1,047,600
大同メタル工業	2,000	776.00	1,552,000
プレス工業	6,100	549.00	3,348,900
ミクニ	1,600	513.00	820,800
太平洋工業	2,600	1,512.00	3,931,200
ケーヒン	2,800	1,882.00	5,269,600
河西工業	1,500	834.00	1,251,000
アイシン精機	10,100	4,005.00	40,450,500
マ ッ ダ	38,600	1,173.00	45,277,800
今仙電機製作所	1,100	1,009.00	1,109,900
本田技研	103,700	3,095.00	320,951,500
スズキ	22,500	5,670.00	127,575,000
S U B A R U	38,200	2,390.50	91,317,100
安永	600	1,548.00	928,800
ヤマハ発動機	17,400	2,181.00	37,949,400
ショーワ	2,900	1,318.00	3,822,200
小糸製作所	7,400	5,810.00	42,994,000
T B K	1,500	402.00	603,000
エクセディ	1,700	2,560.00	4,352,000
ミツバ	2,300	646.00	1,485,800
豊田合成	4,000	2,301.00	9,204,000
愛三工業	1,900	732.00	1,390,800
盟和産業	200	1,025.00	205,000
日本プラスト	1,000	755.00	755,000
ヨ ロ ズ	1,100	1,395.00	1,534,500
エフ・シー・シー	2,200	2,611.00	5,744,200
新家工業	300	1,564.00	469,200
シマノ	5,000	15,880.00	79,400,000
テイ・エス テック	2,900	3,025.00	8,772,500
ジャムコ	600	2,398.00	1,438,800
小 野 建	1,100	1,630.00	1,793,000
はるやまH L D G S	600	851.00	510,600
ノ ジ マ	2,200	2,203.00	4,846,600
佐鳥電機	900	883.00	794,700

カップ・クリエイト	1,700	1,400.00	2,380,000
エコートレーディング	300	605.00	181,500
伯東	800	1,151.00	920,800
コンドーテック	900	952.00	856,800
中山福	700	520.00	364,000
ライトオン	1,000	865.00	865,000
ナガイレーベン	1,800	2,385.00	4,293,000
ジーンズメイト	400	377.00	150,800
三菱食品	1,300	2,911.00	3,784,300
良品計画	1,700	24,060.00	40,902,000
三城ホールディングス	1,500	447.00	670,500
松田産業	900	1,461.00	1,314,900
第一興商	1,800	5,270.00	9,486,000
メディパルHD	13,100	2,450.00	32,095,000
アドヴァン	1,800	904.00	1,627,200
SPK	300	2,314.00	694,200
萩原電気HLDGS	400	2,742.00	1,096,800
アルビス	500	2,428.00	1,214,000
アズワン	900	7,270.00	6,543,000
スズデン	400	1,229.00	491,600
尾家産業	400	1,238.00	495,200
シモジマ	700	1,086.00	760,200
ドウシシャ	1,100	1,740.00	1,914,000
小津産業	300	1,901.00	570,300
コナカ	1,500	455.00	682,500
高速	700	1,105.00	773,500
ハウスローゼ	100	1,857.00	185,700
G-7ホールディングス	400	2,190.00	876,000
たけびし	400	1,370.00	548,000
イオン北海道	1,200	795.00	954,000
コジマ	1,800	514.00	925,200
ヒマラヤ	400	932.00	372,800
コーナン商事	1,600	2,650.00	4,240,000
ネットワンシステムズ	4,300	1,942.00	8,350,600
エコス	400	1,833.00	733,200
ワタミ	1,600	1,399.00	2,238,400
マルシェ	300	755.00	226,500
リックス	300	1,453.00	435,900
システムソフト	2,900	93.00	269,700
ドンキホーテホールディング	7,800	6,550.00	51,090,000

丸文	1,100	714.00	785,400
西松屋チェーン	2,700	886.00	2,392,200
ゼンショーホールディングス	5,700	2,695.00	15,361,500
ハピネット	1,000	1,510.00	1,510,000
幸楽苑ホールディングス	800	2,408.00	1,926,400
ハークスレイ	300	1,100.00	330,000
橋本総業HLDGS	200	1,351.00	270,200
日本ライフライン	3,800	1,471.00	5,589,800
サイゼリヤ	2,000	1,921.00	3,842,000
タカショー	600	478.00	286,800
エクセル	500	1,977.00	988,500
V Tホールディングス	4,100	414.00	1,697,400
マルカキカイ	400	1,872.00	748,800
アルゴグラフィックス	500	3,650.00	1,825,000
魚力	300	1,448.00	434,400
IDOM	4,100	378.00	1,549,800
日本エム・ディ・エム	700	1,050.00	735,000
ポプラ	300	560.00	168,000
フジ・コーポレーション	200	2,070.00	414,000
ユナイテッドアローズ	1,400	3,690.00	5,166,000
進和	700	2,098.00	1,468,600
エスケイジャパン	300	886.00	265,800
ダイトロン	600	1,240.00	744,000
ハイデイ日高	1,600	2,201.00	3,521,600
シークス	1,500	1,358.00	2,037,000
京都きもの友禅	800	418.00	334,400
コロワイド	4,000	2,372.00	9,488,000
ピーシーデポコーポ	1,600	446.00	713,600
田中商事	400	555.00	222,000
オーハシテクニカ	700	1,247.00	872,900
壱番屋	900	4,395.00	3,955,500
白銅	400	1,577.00	630,800
トップカルチャー	400	286.00	114,400
PLANT	300	1,020.00	306,000
スギホールディングス	2,700	4,420.00	11,934,000
島津製作所	15,800	2,268.00	35,834,400
J M S	1,100	575.00	632,500
クボテック	300	223.00	66,900
長野計器	1,000	789.00	789,000
ブイ・テクノロジー	300	12,870.00	3,861,000

スター精密	2,100	1,532.00	3,217,200
東京計器	800	933.00	746,400
愛知時計	200	3,715.00	743,000
インターアクション	700	1,719.00	1,203,300
オーバル	1,200	227.00	272,400
東京精密	2,200	2,790.00	6,138,000
マニー	1,500	4,235.00	6,352,500
ニコン	21,400	1,616.00	34,582,400
トプコン	6,600	1,463.00	9,655,800
オリンパス	18,300	3,645.00	66,703,500
理研計器	1,100	2,062.00	2,268,200
S C R E E Nホールディングス	2,100	4,905.00	10,300,500
キヤノン電子	1,100	1,907.00	2,097,700
タムロン	1,100	1,625.00	1,787,500
H O Y A	24,700	6,425.00	158,697,500
シ ー ド	500	1,270.00	635,000
ノーリツ鋼機	1,000	1,546.00	1,546,000
エー・アンド・デイ	1,100	629.00	691,900
朝日インテック	4,400	4,510.00	19,844,000
キヤノン	66,200	3,026.00	200,321,200
リ コ ー	37,000	1,083.00	40,071,000
シチズン時計	13,400	553.00	7,410,200
リズム時計	400	1,899.00	759,600
大研医器	1,000	620.00	620,000
メニコン	1,700	2,784.00	4,732,800
シンシア	200	500.00	100,000
中本パックス	300	1,749.00	524,700
スノーピーク	400	1,250.00	500,000
パラマウントベッドHD	1,400	4,470.00	6,258,000
トランザクション	700	661.00	462,700
S H O B I	400	358.00	143,200
ニホンフラッシュ	500	1,669.00	834,500
前田工織	1,400	2,596.00	3,634,400
永大産業	1,600	429.00	686,400
アートネイチャー	1,300	617.00	802,100
バンダイナムコHLDGS	12,700	4,730.00	60,071,000
アイフィスジャパン	300	570.00	171,000
共立印刷	2,000	203.00	406,000
S H O E I	600	3,455.00	2,073,000
フランスベッドHLDGS	1,700	916.00	1,557,200

マーベラス	1,800	858.00	1,544,400
パイロットコーポレーション	2,100	5,350.00	11,235,000
萩原工業	700	1,501.00	1,050,700
エイベックス	2,100	1,510.00	3,171,000
トッパン・フォームズ	2,600	904.00	2,350,400
フジシールインターナショナル	2,800	3,770.00	10,556,000
タカラトミー	5,100	1,099.00	5,604,900
廣済堂	1,100	413.00	454,300
エステールホールディングス	300	650.00	195,000
アーク	4,700	75.00	352,500
レック	1,300	1,617.00	2,102,100
タカノ	500	815.00	407,500
三光合成	900	326.00	293,400
プロネクサス	1,100	996.00	1,095,600
ホクシン	800	148.00	118,400
ウッドワン	400	1,100.00	440,000
大建工業	900	1,940.00	1,746,000
き も と	2,100	184.00	386,400
凸版印刷	17,300	1,695.00	29,323,500
大日本印刷	17,300	2,415.00	41,779,500
図書印刷	1,200	761.00	913,200
共同印刷	400	2,417.00	966,800
N I S S H A	2,500	1,355.00	3,387,500
光村印刷	100	2,150.00	215,000
藤森工業	1,100	2,890.00	3,179,000
ヴィア・ホールディングス	1,500	684.00	1,026,000
宝印刷	600	1,690.00	1,014,000
前澤化成工業	800	1,069.00	855,200
アシックス	12,200	1,456.00	17,763,200
ツ ツ ミ	400	1,900.00	760,000
ウェーブロックHLDGS	300	696.00	208,800
ジェイ エス ピー	700	2,176.00	1,523,200
ニ チ ハ	1,700	2,705.00	4,598,500
エフピコ	1,000	6,140.00	6,140,000
小松ウオール工業	400	1,996.00	798,400
ヤマハ	7,300	4,725.00	34,492,500
河合楽器	400	3,030.00	1,212,000
クリナップ	1,100	633.00	696,300
ピジヨン	7,400	4,335.00	32,079,000
天馬	800	1,783.00	1,426,400

兼松サステック	100	1,547.00	154,700
キングジム	1,000	837.00	837,000
象印マホービン	2,300	1,044.00	2,401,200
リンテック	2,900	2,358.00	6,838,200
信越ポリマー	2,200	697.00	1,533,400
東リ	3,100	265.00	821,500
イトーキ	2,300	602.00	1,384,600
任天堂	7,600	29,795.00	226,442,000
三菱鉛筆	2,000	2,207.00	4,414,000
松風	600	1,084.00	650,400
タカラスタンダード	2,500	1,715.00	4,287,500
コクヨ	5,900	1,605.00	9,469,500
ナカバヤシ	1,200	543.00	651,600
ニフコ	4,900	2,541.00	12,450,900
立川ブラインド	500	1,044.00	522,000
グローブライド	600	2,605.00	1,563,000
オカムラ	4,300	1,367.00	5,878,100
バルカー	1,000	2,228.00	2,228,000
MUTOHホールディングス	200	1,928.00	385,600
伊藤忠	86,300	1,926.00	166,213,800
丸紅	119,400	798.30	95,317,020
スクロール	1,900	407.00	773,300
高島	200	1,794.00	358,800
ヨンドシーホールディングス	1,300	2,085.00	2,710,500
三陽商会	700	1,635.00	1,144,500
長瀬産業	6,800	1,531.00	10,410,800
ナイガイ	400	512.00	204,800
蝶理	800	1,638.00	1,310,400
豊田通商	13,500	3,330.00	44,955,000
オンワードホールディングス	7,500	614.00	4,605,000
三共生興	2,100	405.00	850,500
兼松	4,800	1,326.00	6,364,800
美津濃	1,200	2,444.00	2,932,800
ツカモトコーポレーション	200	1,052.00	210,400
ユニー・ファミリーマートHD	3,400	13,010.00	44,234,000
ルックホールディングス	400	1,034.00	413,600
三井物産	99,700	1,739.50	173,428,150
日本紙パルプ	700	4,160.00	2,912,000
東京エレクトロン	8,200	13,390.00	109,798,000
日立ハイテクノロジーズ	3,700	3,570.00	13,209,000

カメイ	1,600	1,242.00	1,987,200
東都水産	200	2,158.00	431,600
OUGホールディングス	200	2,475.00	495,000
スターゼン	400	3,800.00	1,520,000
セイコーHD	1,900	2,242.00	4,259,800
山 善	4,700	1,064.00	5,000,800
椿本興業	300	3,095.00	928,500
住友商事	71,600	1,602.00	114,703,200
日本ユニシス	3,800	2,473.00	9,397,400
内田洋行	600	2,564.00	1,538,400
三菱商事	84,900	3,088.00	262,171,200
第一実業	500	3,415.00	1,707,500
キヤノンマーケティングJPN	3,500	1,957.00	6,849,500
西華産業	700	1,495.00	1,046,500
佐藤商事	1,100	911.00	1,002,100
菱洋エレクトロ	1,200	1,543.00	1,851,600
東京産業	1,200	503.00	603,600
ユアサ商事	1,200	3,080.00	3,696,000
神鋼商事	300	2,482.00	744,600
小林産業	700	275.00	192,500
阪和興業	2,100	2,921.00	6,134,100
正栄食品	600	2,698.00	1,618,800
カナデン	1,200	1,218.00	1,461,600
菱電商事	1,000	1,405.00	1,405,000
ニプロ	8,500	1,364.00	11,594,000
フルサト工業	700	1,615.00	1,130,500
岩谷産業	2,700	3,705.00	10,003,500
すてきナイスグループ	500	904.00	452,000
昭光通商	400	632.00	252,800
ニチモウ	200	1,656.00	331,200
極東貿易	400	1,521.00	608,400
イ ワ キ	1,400	404.00	565,600
兼松エレクトロニクス	700	3,215.00	2,250,500
三愛石油	3,300	1,025.00	3,382,500
稲畑産業	2,900	1,422.00	4,123,800
G S Iクレオス	300	1,292.00	387,600
明和産業	1,100	392.00	431,200
キムラタン	5,900	23.00	135,700
ゴ - ルドウイン	1,100	10,630.00	11,693,000
ユニ・チャ - ム	26,100	3,265.00	85,216,500

デサント	2,900	1,850.00	5,365,000
キング	600	454.00	272,400
ワキタ	2,600	1,096.00	2,849,600
ヤマトインタ - ナショナル	800	410.00	328,000
東邦ホールディングス	3,600	2,762.00	9,943,200
サンゲツ	3,700	2,075.00	7,677,500
ミツウロコグループ	1,800	765.00	1,377,000
シナネンホールディングス	500	2,390.00	1,195,000
伊藤忠エネクス	2,700	987.00	2,664,900
サンリオ	3,700	2,205.00	8,158,500
サンワテクノス	700	1,009.00	706,300
リョーサン	1,300	2,942.00	3,824,600
新光商事	1,100	1,729.00	1,901,900
トーホー	500	2,146.00	1,073,000
三信電気	1,000	1,852.00	1,852,000
東陽テクニカ	1,400	812.00	1,136,800
モスフードサービス	1,600	2,854.00	4,566,400
加賀電子	1,200	1,991.00	2,389,200
三益半導体	900	1,264.00	1,137,600
ソーダニツカ	1,200	531.00	637,200
立花エレテック	900	1,561.00	1,404,900
木曽路	1,500	2,511.00	3,766,500
S R Sホールディングス	1,400	993.00	1,390,200
千趣会	2,200	253.00	556,600
タカキュー	900	177.00	159,300
ケーヨー	2,200	524.00	1,152,800
上新電機	1,400	2,437.00	3,411,800
日本瓦斯	2,200	3,850.00	8,470,000
ロイヤルホールディングス	2,100	2,632.00	5,527,200
東天紅	100	1,203.00	120,300
いなげや	1,300	1,400.00	1,820,000
島忠	2,700	2,981.00	8,048,700
チヨダ	1,300	1,807.00	2,349,100
ライフコーポレーション	900	2,181.00	1,962,900
リンガーハット	1,500	2,308.00	3,462,000
MrMaxHD	1,700	472.00	802,400
テンアライド	1,100	403.00	443,300
AOKIホールディングス	2,400	1,280.00	3,072,000
オークワ	1,700	1,054.00	1,791,800
コメリ	1,900	2,451.00	4,656,900

青山商事	2,300	2,692.00	6,191,600
しまむら	1,400	8,460.00	11,844,000
はせがわ	600	411.00	246,600
高島屋	9,500	1,470.00	13,965,000
松屋	2,400	1,053.00	2,527,200
エイチ・ツー・オーリテイリング	6,200	1,623.00	10,062,600
近鉄百貨店	500	3,525.00	1,762,500
パルコ	1,200	1,070.00	1,284,000
丸井グループ	10,200	2,211.00	22,552,200
アクシアルリテイリング	1,000	3,685.00	3,685,000
井筒屋	600	190.00	114,000
イオン	46,600	2,197.00	102,380,200
イズミ	2,500	5,500.00	13,750,000
フオーバル	500	857.00	428,500
平和堂	2,500	2,601.00	6,502,500
フジ	1,500	1,967.00	2,950,500
ヤオコー	1,400	6,160.00	8,624,000
ゼビオホールディングス	1,500	1,262.00	1,893,000
ケーズホールディングス	12,600	1,029.00	12,965,400
PALTAC	2,200	5,070.00	11,154,000
三谷産業	1,400	281.00	393,400
OLYMPICグループ	700	661.00	462,700
日産東京販売HD	1,800	330.00	594,000
アドバンテッジリスクマネ	500	884.00	442,000
三井不動産	64,300	2,473.00	159,013,900
三菱地所	84,900	1,771.00	150,357,900
平和不動産	2,300	1,801.00	4,142,300
東京建物	13,200	1,165.00	15,378,000
ダイビル	3,600	1,070.00	3,852,000
京阪神ビルディング	2,200	880.00	1,936,000
住友不動産	27,300	4,021.00	109,773,300
太平洋興発	500	766.00	383,000
テーオーシー	2,800	768.00	2,150,400
東京楽天地	200	4,835.00	967,000
レオパレス21	15,400	452.00	6,960,800
スターツコーポレーション	1,600	2,418.00	3,868,800
フジ住宅	1,500	830.00	1,245,000
空港施設	1,400	521.00	729,400
明和地所	700	585.00	409,500
ゴールドクレスト	1,000	1,625.00	1,625,000

リログループ	6,400	2,710.00	17,344,000
日本エスリード	500	1,477.00	738,500
日神不動産	1,800	454.00	817,200
日本エスコン	2,200	760.00	1,672,000
タカラレーベン	5,700	311.00	1,772,700
サンヨーハウジ 名古屋	700	959.00	671,300
イオンモール	6,100	1,743.00	10,632,300
毎日コムネット	200	770.00	154,000
ファースト住建	500	1,202.00	601,000
ランド	49,500	10.00	495,000
カチタス	1,400	2,799.00	3,918,600
東祥	700	3,205.00	2,243,500
トーセイ	1,700	930.00	1,581,000
穴吹興産	100	2,760.00	276,000
サンフロンティア不動産	1,700	1,085.00	1,844,500
エフ・ジェー・ネクスト	1,100	898.00	987,800
インテリックス	300	649.00	194,700
ランドビジネス	600	797.00	478,200
グランディハウス	1,100	408.00	448,800
東武鉄道	13,000	3,090.00	40,170,000
相鉄ホールディングス	4,200	3,385.00	14,217,000
東京急行	33,400	1,869.00	62,424,600
京浜急行	16,800	1,828.00	30,710,400
小田急電鉄	19,700	2,519.00	49,624,300
京王電鉄	6,900	6,440.00	44,436,000
京成電鉄	9,200	3,510.00	32,292,000
富士急行	1,700	3,225.00	5,482,500
新京成電鉄	300	2,168.00	650,400
東日本旅客鉄道	21,900	10,055.00	220,204,500
西日本旅客鉄道	11,000	8,060.00	88,660,000
東海旅客鉄道	11,000	23,730.00	261,030,000
西武ホールディングス	15,700	1,947.00	30,567,900
鴻池運輸	2,000	1,605.00	3,210,000
西日本鉄道	3,400	2,843.00	9,666,200
ハマキョウレックス	900	3,770.00	3,393,000
サカイ引越センター	600	6,010.00	3,606,000
近鉄グループHLDGS	11,600	4,910.00	56,956,000
阪急阪神HLDGS	15,500	3,820.00	59,210,000
南海電鉄	5,200	2,983.00	15,511,600
京阪ホールディングス	5,200	4,665.00	24,258,000

神戸電鉄	300	3,990.00	1,197,000
名古屋鉄道	9,300	2,922.00	27,174,600
山陽電鉄	900	2,205.00	1,984,500
トランコム	300	5,540.00	1,662,000
日本通運	4,600	6,420.00	29,532,000
ヤマトホールディングス	20,400	3,036.00	61,934,400
山 九	3,200	5,160.00	16,512,000
日 新	1,000	1,880.00	1,880,000
丸 運	700	297.00	207,900
丸全昭和運輸	900	2,657.00	2,391,300
センコーグループHLDGS	6,400	859.00	5,497,600
トナミホールディングス	300	6,000.00	1,800,000
ニッコンホールディングス	4,400	2,742.00	12,064,800
日石輸送	100	2,875.00	287,500
福山通運	1,500	4,360.00	6,540,000
セイノーホールディングス	8,700	1,490.00	12,963,000
エスライン	300	1,051.00	315,300
神奈川中央交通	300	3,750.00	1,125,000
日立物流	2,600	3,140.00	8,164,000
丸和運輸機関	600	2,834.00	1,700,400
C & F ロジホールディングス	1,200	1,210.00	1,452,000
日本郵船	9,700	1,775.00	17,217,500
商船三井	6,900	2,511.00	17,325,900
川崎汽船	3,600	1,430.00	5,148,000
NSユナイテッド海運	600	3,030.00	1,818,000
明治海運	1,200	332.00	398,400
飯野海運	5,500	405.00	2,227,500
共栄タンカー	100	1,581.00	158,100
九州旅客鉄道	9,800	3,730.00	36,554,000
SGホールディングス	11,000	3,030.00	33,330,000
日本航空	21,300	3,900.00	83,070,000
ANAホールディングス	21,300	3,906.00	83,197,800
パスコ	200	749.00	149,800
西本WISMETTACHD	300	4,430.00	1,329,000
ヤマシタヘルスケアHLDGS	100	1,182.00	118,200
GENKY DRUGSTORES	500	3,050.00	1,525,000
国際紙パルプ商事	2,100	245.00	514,500
総合メディカルHD	1,100	2,015.00	2,216,500
ブックオフGHD	600	767.00	460,200
三菱倉庫	4,000	2,709.00	10,836,000

三井倉庫HOLD	1,400	1,879.00	2,630,600
住友倉庫	4,400	1,380.00	6,072,000
渋沢倉庫	600	1,600.00	960,000
ヤマタネ	600	1,652.00	991,200
東陽倉庫	2,100	282.00	592,200
乾汽船	1,000	749.00	749,000
日本トランスシティ	2,600	435.00	1,131,000
ケイヒン	200	1,255.00	251,000
中央倉庫	700	1,025.00	717,500
川西倉庫	200	1,263.00	252,600
安田倉庫	1,000	777.00	777,000
東洋埠頭	400	1,434.00	573,600
宇徳	1,000	537.00	537,000
上組	7,200	2,302.00	16,574,400
サンリツ	300	633.00	189,900
キムラユニティー	300	1,003.00	300,900
キューソー流通システム	300	2,094.00	628,200
近鉄エクスプレス	2,200	1,653.00	3,636,600
東海運	700	291.00	203,700
エーアイテイー	800	984.00	787,200
内外トランスライン	400	1,379.00	551,600
日本コンセプト	300	999.00	299,700
東京放送HD	8,000	1,814.00	14,512,000
日本テレビHLDS	11,100	1,711.00	18,992,100
朝日放送グループHD	1,200	725.00	870,000
テレビ朝日HD	3,300	2,097.00	6,920,100
スカパーJSATHD	9,200	483.00	4,443,600
テレビ東京HD	1,000	2,378.00	2,378,000
日本BS放送	400	1,126.00	450,400
ビジョン	400	3,920.00	1,568,000
USEN-NEXT HLDGS	500	928.00	464,000
ワイヤレスゲート	500	438.00	219,000
コネクシオ	900	1,366.00	1,229,400
日本通信	10,300	107.00	1,102,100
クロップス	200	629.00	125,800
日本電信電話	82,500	4,593.00	378,922,500
KDDI	106,300	2,688.50	285,787,550
光通信	1,400	17,030.00	23,842,000
NTTドコモ	86,600	2,570.50	222,605,300
エムティーアイ	1,400	567.00	793,800

GMOインターネット	4,400	1,440.00	6,336,000	
アйдママーケティングコミュ	300	457.00	137,100	
カドカワ	3,500	1,161.00	4,063,500	
学研ホールディングス	400	4,045.00	1,618,000	
ゼンリン	2,400	2,376.00	5,702,400	
昭文社	600	484.00	290,400	
インプレスホールディングス	1,000	134.00	134,000	
東京電力HD	98,100	727.00	71,318,700	
中部電力	37,600	1,749.00	65,762,400	
関西電力	50,200	1,757.00	88,201,400	
中国電力	17,000	1,490.00	25,330,000	
北陸電力	12,000	1,005.00	12,060,000	
東北電力	28,800	1,529.00	44,035,200	
四国電力	11,100	1,390.00	15,429,000	
九州電力	25,300	1,351.00	34,180,300	
北海道電力	11,500	773.00	8,889,500	
沖縄電力	2,300	2,169.00	4,988,700	
電源開発	9,800	2,674.00	26,205,200	
エフオン	700	844.00	590,800	
イーレックス	2,100	601.00	1,262,100	
レノバ	1,300	1,006.00	1,307,800	
東京瓦斯	24,100	2,891.00	69,673,100	
大阪瓦斯	23,900	2,113.00	50,500,700	
東邦瓦斯	6,100	4,785.00	29,188,500	
北海道瓦斯	700	1,518.00	1,062,600	
広島ガス	2,500	348.00	870,000	
西部瓦斯	1,400	2,612.00	3,656,800	
静岡ガス	3,800	895.00	3,401,000	
メタウォーター	600	2,947.00	1,768,200	
アイネット	700	1,463.00	1,024,100	
松竹	800	10,710.00	8,568,000	
東宝	7,900	4,070.00	32,153,000	
エイチ・アイ・エス	2,100	3,870.00	8,127,000	
東映	500	13,520.00	6,760,000	
ラックランド	200	2,141.00	428,200	
NTTデータ	32,100	1,237.00	39,707,700	
共立メンテナンス	1,800	4,710.00	8,478,000	
イチネンホールディングス	1,200	1,180.00	1,416,000	
建設技術研究所	800	1,516.00	1,212,800	
スペース	800	1,208.00	966,400	

長 大	500	697.00	348,500
アインホールディングス	1,600	7,880.00	12,608,000
燦ホールディングス	300	2,238.00	671,400
ピー・シー・エー	200	1,887.00	377,400
スバル興業	100	5,360.00	536,000
東京テアトル	500	1,238.00	619,000
タナベ経営	200	1,249.00	249,800
ビジネスB太田昭和	200	1,894.00	378,800
ナ ガ ワ	300	5,530.00	1,659,000
よみうりランド	300	3,935.00	1,180,500
東京都競馬	800	2,713.00	2,170,400
常磐興産	500	1,649.00	824,500
カナモト	1,700	2,940.00	4,998,000
東京ドーム	4,400	935.00	4,114,000
D T S	1,300	3,635.00	4,725,500
スクウェア・エニックス・HD	5,600	3,240.00	18,144,000
シーイーシー	1,300	1,736.00	2,256,800
カプコン	5,200	2,125.00	11,050,000
西尾レントオール	1,200	3,395.00	4,074,000
アイ・エス・ビー	200	1,610.00	322,000
アゴーラ・ホスピタリティーG	6,500	26.00	169,000
日本空港ビルデング	3,900	3,755.00	14,644,500
トランス・コスモス	1,300	2,217.00	2,882,100
乃村工藝社	2,700	2,511.00	6,779,700
ジャステック	700	887.00	620,900
S C S K	3,200	4,005.00	12,816,000
藤田観光	500	2,869.00	1,434,500
K N T - C Tホールディングス	600	1,229.00	737,400
日本管財	1,300	1,953.00	2,538,900
トーカイ	1,100	2,736.00	3,009,600
白 洋 舎	100	2,818.00	281,800
セコム	12,500	9,346.00	116,825,000
日本システムウエア	400	1,754.00	701,600
セントラル警備保障	600	4,775.00	2,865,000
アイネス	1,500	1,179.00	1,768,500
丹青社	2,200	1,057.00	2,325,400
メイテック	1,500	4,690.00	7,035,000
T K C	1,000	4,005.00	4,005,000
富士ソフト	1,800	4,300.00	7,740,000
応用地質	1,300	1,187.00	1,543,100

船井総研ホールディング	2,400	1,684.00	4,041,600
N S D	2,000	2,123.00	4,246,000
進学会ホールディングス	500	541.00	270,500
丸紅建材リース	100	1,830.00	183,000
オ オ バ	900	647.00	582,300
コナミホールディングス	4,900	4,895.00	23,985,500
いであ	200	980.00	196,000
学 究 社	400	1,472.00	588,800
ベネッセホールディングス	4,300	2,756.00	11,850,800
イオンディライト	1,400	3,950.00	5,530,000
ナック	700	1,049.00	734,300
福井コンピュータH L D S	400	1,510.00	604,000
ニチイ学館	1,700	1,022.00	1,737,400
ダイセキ	2,000	2,293.00	4,586,000
ステップ	400	1,294.00	517,600
日鉄住金物産	900	4,605.00	4,144,500
泉州電業	400	2,845.00	1,138,000
元気寿司	300	4,440.00	1,332,000
トラスコ中山	2,500	2,854.00	7,135,000
ヤマダ電機	36,900	531.00	19,593,900
オートバックスセブン	4,800	1,833.00	8,798,400
モリト	900	793.00	713,700
アークランドサカモト	2,100	1,348.00	2,830,800
ニトリホールディングス	5,200	14,775.00	76,830,000
グルメ杵屋	900	1,158.00	1,042,200
愛 眼	1,000	298.00	298,000
ケーユーホールディングス	600	814.00	488,400
吉野家ホールディングス	4,200	1,815.00	7,623,000
加藤産業	1,900	3,125.00	5,937,500
北恵	200	1,021.00	204,200
イノテック	800	991.00	792,800
イエローハット	1,100	2,596.00	2,855,600
松屋フーズH L D G S	600	3,635.00	2,181,000
J B C Cホールディングス	900	1,478.00	1,330,200
J Kホールディングス	1,100	564.00	620,400
サガミホールディングス	1,600	1,363.00	2,180,800
日 伝	1,000	1,597.00	1,597,000
関西スーパーマーケット	900	996.00	896,400
ミロク情報サービス	1,200	2,410.00	2,892,000
北沢産業	900	250.00	225,000

杉本商事	700	1,788.00	1,251,600	
因幡電機産業	1,700	4,260.00	7,242,000	
王将フードサービス	900	7,310.00	6,579,000	
ブレナス	1,400	1,877.00	2,627,800	
ミニストップ	900	2,014.00	1,812,600	
アークス	2,300	2,552.00	5,869,600	
パローホールディングス	2,600	2,673.00	6,949,800	
バイテックホールディングス	500	1,810.00	905,000	
東 テ ク	400	1,994.00	797,600	
ミスミグループ本社	15,100	2,340.00	35,334,000	
藤 久	100	788.00	78,800	
アルテック	900	251.00	225,900	
ベ ル ク	600	4,945.00	2,967,000	
大 庄	600	1,592.00	955,200	
タキヒヨー	400	1,694.00	677,600	
ファーストリテイリング	1,600	52,060.00	83,296,000	
ソフトバンクグループ	50,400	7,589.00	382,485,600	
蔵王産業	200	1,311.00	262,200	
スズケン	5,500	5,800.00	31,900,000	
サンドラッグ	4,600	3,445.00	15,847,000	
サックスパーホールディング	1,000	1,097.00	1,097,000	
ジェコス	800	1,034.00	827,200	
ヤマザワ	300	1,785.00	535,500	
や ま や	200	2,115.00	423,000	
ルネサスイーストン	1,100	401.00	441,100	
ベルーナ	3,000	977.00	2,931,000	
合計			23,429,437,500	

(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】

2019年1月31日

資産総額	24,754,156,041円
負債総額	562,430,000円
純資産総額（ - ）	24,191,726,041円
発行済数量	20,093,278口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1,203.97円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 名義登録と収益分配金の支払い

受託会社は、計算期間終了日現在において、氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。

(3) 受益者に対する特典

ありません。

(4) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(5) 受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(6) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

前 の申請のある場合には、前 の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前 の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

前 の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(7) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(8) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、交換請求の受付け、交換株式の交付等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第二部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2019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、役付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. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者であるCIO (Chief Investment Officer) が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

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. ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2019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	80	164,657
追加型株式投資信託	715	14,961,679
株式投資信託 合計	795	15,126,336
単位型公社債投資信託	30	114,211
追加型公社債投資信託	14	1,402,192
公社債投資信託 合計	44	1,516,404
総合計	839	16,642,740

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59期事業年度（平成29年4月1日から平成30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60期事業年度に係る中間会計期間（2018年4月1日から2018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 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,260	28,709
有価証券	110	0
前払費用	190	201
未収委託者報酬	10,453	12,368
未収収益	72	82
繰延税金資産	439	552
その他	34	47
流動資産計	42,560	41,962
固定資産		
有形固定資産	1 229	1 213
建物	15	12
器具備品	214	200
無形固定資産	2,650	2,614
ソフトウェア	2,323	2,456
ソフトウェア仮勘定	327	158
投資その他の資産	12,353	15,066

投資有価証券	5,920	8,600
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	185	183
長期差入保証金	1,050	1,072
繰延税金資産	31	45
その他	37	34
固定資産計	15,234	17,894
資産合計	57,795	59,856

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	79	65
未払金	9,466	9,747
未払収益分配金	7	8
未払償還金	59	59
未払手数料	4,453	5,202
その他未払金	2	2
未払費用	4,077	4,148
未払法人税等	980	850
未払消費税等	223	583
賞与引当金	945	1,012
その他	3	335
流動負債計	15,776	16,744
固定負債		
退職給付引当金	2,318	2,350
役員退職慰労引当金	151	125
その他	7	5
固定負債計	2,477	2,481
負債合計	18,254	19,225
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	12,231	13,370
利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	79,747	82,510
その他営業収益	727	733
営業収益計	80,474	83,244
営業費用		
支払手数料	40,110	40,392
広告宣伝費	549	673
調査費	9,436	9,816
調査費	904	955
委託調査費	8,531	8,860
委託計算費	793	839
営業雑経費	1,375	1,579
通信費	251	249
印刷費	501	500
協会費	50	53
諸会費	13	13
その他営業雑経費	557	762
営業費用計	52,265	53,300
一般管理費		
給料	5,833	5,840
役員報酬	416	377
給料・手当	3,940	3,973

賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195
租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316
役員退職慰労引当金繰入額	60	46
固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31 日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	92	75
投資有価証券売却益	224	210
有価証券償還益	94	17
その他	69	55
営業外収益計	481	359
営業外費用		
投資有価証券売却損	24	0
その他	75	29
営業外費用計	100	29
経常利益	16,935	18,741
特別損失		
MMF等償還関連費用	305	-
関係会社整理損失	-	333
特別損失計	305	333
税引前当期純利益	16,629	18,407
法人税、住民税及び事業税	6,501	5,843
法人税等調整額	1,405	106
法人税等合計	5,096	5,737
当期純利益	11,533	12,670

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	13,261	13,261	13,261
当期純利益	-	-	-	11,533	11,533	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,728	1,728	1,728
当期末残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

	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	280	280	41,284
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	13,261
当期純利益	-	-	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	15	15	15
当期変動額合計	15	15	1,743
当期末残高	264	264	39,540

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414

	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	264	264	39,540
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	40,631

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

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	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各事業年度毎に各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

(3) 役員退職慰労引当金

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

4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取利息」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取利息」12百万円、「その他」56百万円は、「その他」69百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	26百万円	29百万円
器具備品	264百万円	235百万円

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 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
未払金	4,877百万円	4,406百万円

3 保証債務

前事業年度（平成29年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,685百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成30年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万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（自平成28年4月1日至平成29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
平成28年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 3月31日	平成28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

平成29年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	11,532百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,421円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月27日

当事業年度（自平成29年4月1日至平成30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
平成29年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 3月31日	平成29年 6月27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

平成30年6月25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	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月26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、株式は上場株式、非上場株式並びに子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、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されており、

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

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）参照のこと）。

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	31,260	31,260	-
(2) 未収委託者報酬	10,453	10,453	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	5,060	5,060	-
資産計	46,774	46,774	-
(1) 未払手数料	(4,453)	(4,453)	-
(2) その他未払金	(4,946)	(4,946)	-
(3) 未払費用(*2)	(3,409)	(3,409)	-
負債計	(12,809)	(12,809)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度（平成30年3月31日）

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	28,709	28,709	-
(2) 未収委託者報酬	12,368	12,368	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,631	7,631	-
資産計	48,709	48,709	-
(1) 未払手数料	(5,202)	(5,202)	-
(2) その他未払金	(4,476)	(4,476)	-
(3) 未払費用(*2)	(3,286)	(3,286)	-
負債計	(12,965)	(12,965)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項(有価証券関係)をご参照下さい。

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) 其他有価証券 非上場株式	970	970
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	1,050	1,072

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成29年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,260	-	-	-
未収委託者報酬	10,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	110	2,876	1,139	110
合計	41,824	2,876	1,139	110

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

(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(平成29年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,129百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成30年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,129百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(平成29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	122	55	67
(2) その他 証券投資信託	3,107	2,697	410
小計	3,230	2,752	478
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	1,829	1,926	96

小計	1,829	1,926	96
合計	5,060	4,679	381

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「其他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(平成30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	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「其他有価証券」には含めておりません。

3. 売却した其他有価証券

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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	50	-	1
(2) その他 証券投資信託	4,371	224	23
合計	4,421	224	24

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

（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 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
退職給付債務の期首 残高	2,209百万円	2,318百万円
勤務費用	202	159
退職給付の支払額	122	166
その他	29	38
退職給付債務の期末 残高	2,318	2,350

（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 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,318百万円	2,350百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350
退職給付引当金	2,318	2,350
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350

（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 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
勤務費用	202百万円	159百万円

その他	87	24
確定給付制度に係る退職給付費用	289	184

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173百万円、当事業年度171百万円であります。

（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 （平成29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金		719
	709	
賞与引当金	224	244
未払事業税	169	162
出資金評価損	98	94
投資有価証券評価損	65	68
連結法人間取引（譲渡損）	5	5
その他	185	308
繰延税金資産小計	1,458	1,602
評価性引当額	201	200
繰延税金資産合計	1,257	1,402
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	639	639
その他有価証券評価差額金	146	164
繰延税金負債合計	786	804
繰延税金資産の純額	470	598

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（平成29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（平成30年3月31日）

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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)	1,685	-	-

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等に関するMASへ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られております。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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)	1,701	-	-

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等に関するMASへ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られております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,238	未払手数料	3,298
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)	768	未払費用	218
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,036	長期差入保証金	1,028

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 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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。

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 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,158.25円	1株当たり純資産額	15,576.40円
1株当たり当期純利益	4,421.51円	1株当たり当期純利益	4,857.40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 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,533	12,670
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 (2018年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		21,097
有価証券		0
未収委託者報酬		12,445
その他		2,329
流動資産合計		35,872
固定資産		
有形固定資産	1	199
無形固定資産		
ソフトウェア		2,162
その他		449
無形固定資産合計		2,612
投資その他の資産		
投資有価証券		7,521
関係会社株式		1,836
繰延税金資産		964
その他		1,286
投資その他の資産合計		11,608
固定資産合計		14,420
資産合計		50,293

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2018年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		7,165
未払費用		3,666

未払法人税等	859
賞与引当金	611
その他	2
流動負債合計	12,855
固定負債	
退職給付引当金	2,335
役員退職慰労引当金	144
その他	3
固定負債合計	2,483
負債合計	15,338
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,643
利益剰余金合計	8,017
株主資本合計	34,687
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	267
評価・換算差額等合計	267
純資産合計	34,955
負債・純資産合計	50,293

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	39,713
その他営業収益	351
営業収益合計	40,065
営業費用	
支払手数料	18,868
その他営業費用	6,357

営業費用合計		25,226
一般管理費	1	5,925
営業利益		8,913
営業外収益	2	418
営業外費用	3	86
経常利益		9,244
特別利益		-
特別損失	4	29
税引前中間純利益		9,215
法人税、住民税及び事業税		2,628
法人税等調整額		125
中間純利益		6,462

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414
会計方針の変更による累積的影響額				480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
中間純利益	-	-	-	6,462	6,462	6,462
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	-	-	-	6,207	6,207	6,207
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,643	8,017	34,687

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	216	216	40,631
会計方針の変更による累積的影響額			480
会計方針の変更を反映した当期首残高			41,112
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
中間純利益	-	-	6,462
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	50	50	50
当中間期変動額合計	50	50	6,156
当中間期末残高	267	267	34,955

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

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

時価のあるもの

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。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

「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 平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の期首残高が480百万円増加しております。

(表示方法の変更)

(『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)等を当中間会計期間の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

当中間会計期間

(2018年9月30日現在)

有形固定資産	280百万円
--------	--------

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(2018年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,743百万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 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	436百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
有価証券償還益	132百万円
投資有価証券売却益	124百万円
為替差益	104百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
有価証券償還損	32百万円
投資有価証券売却損	24百万円
固定資産除却損	13百万円

4 特別損失の主要項目

当中間会計期間

(自 2018年4月1日
至 2018年9月30日)

関係会社整理損失 29百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年3月31日	2018年6月26日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2018年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません(注2)参照のこと)。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	21,097	21,097	-
(2) 未収委託者報酬	12,445	12,445	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,551	6,551	-
資産合計	40,094	40,094	-
(1) 未払金	(7,096)	(7,096)	-
(2) 未払費用(*2)	(3,089)	(3,089)	-
負債合計	(10,186)	(10,186)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金及び（2）未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（3）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負 債

（1）未払金及び（2）未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	970
子会社株式	1,836
差入保証金	1,071

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

（有価証券関係）

当中間会計期間（2018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 1,836百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

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	129	55	74
（2）その他			

証券投資信託	4,148	3,765	383
小計	4,277	3,820	457
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			
証券投資信託	2,274	2,378	104
小計	2,274	2,378	104
合計	6,551	6,198	352

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,400.41円
1株当たり中間純利益	2,477.30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おりません。

(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 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
中間純利益(百万円)	6,462
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,462
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 (2018年3月 末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,500	
クレディ・スイス証券株式会社	78,100	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616	
J P モルガン証券株式会社	73,272	
シティグループ証券株式会社	96,307	
野村證券株式会社	10,000	
B N P パリバ証券株式会社	102,025	
みずほ証券株式会社	125,167	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	
メリルリンチ日本証券株式会社	119,440	
モルガン・スタンレーM U F G 証券株式会社	62,149	

2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務等を行いません。

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

(提出年月日)	(書類名)
2018年10月3日	有価証券届出書、有価証券報告書

独立監査人の監査報告書

平成30年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

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証券投資信託委託株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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、大和証券投資信託委託株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべ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。

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

平成31年2月8日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 間瀬 友未 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

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の平成30年7月11日から平成31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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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の平成31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すべ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。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小倉 加奈子 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治 印

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証券投資信託委託株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018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。

中間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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

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、大和証券投資信託委託株式会社の2018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（2018年4月1日から2018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。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。