# 【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 2021年1月12日提出

大和アセットマネジメント株式会社 【発行者名】

【代表者の役職氏名】 取締役社長 松下 浩一

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 【本店の所在の場所】

【事務連絡者氏名】 西脇 保宏

連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3431

【届出の対象とした募集内国投資信託受 iFreeNEXT 日本小型株インデックス

益証券に係るファンドの名称】

【届出の対象とした募集内国投資信託受 10兆円を上限とします。

益証券の金額】

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

# 第一部 【証券情報】

#### (1) 【ファンドの名称】

iFreeNEXT 日本小型株インデックス

#### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託(契約型)の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

なお、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。

#### (3) 【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

#### (4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問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/

#### (5) 【申込手数料】

取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。

・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)

申込手数料には、消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)が課されます。

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

## (6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・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)

# (7) 【申込期間】

2021年1月13日から2021年7月12日まで(継続申込期間) (終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

#### (8) 【申込取扱場所】

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/

# (9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日(くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。)までに、取得申込代金(取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。)を販売会社において支払うものとします。

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

#### (10) 【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

#### (11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。 株式会社 証券保管振替機構

#### (12) 【その他】

受益権の取得申込者は、申込取扱場所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。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み(当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの)を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。)等における取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消すことができるものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします(以下同じ。)。

取得申込金額に利息は付きません。

# 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に 記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

#### (参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

# 第二部 【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、わが国の株式に投資し、日本の小型株市場の動きを捉える指数との連動をめざして運用を行ないます。

連動をめざす対象指数(ベンチマーク)の選定および変更は、当ファンドの商品性および運用上の 効率性等を勘案し、委託会社の判断で決定するものとします。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

# 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)	補足分類
単位型投信 追加型投信	国 内 海 外 内 外	株 式 債 券 不動産投信 その他資産 ( ) 資産複合	インデックス型 特殊型

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

# 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株 中小型株	年2回	日本		D# 00E
債券		北米	ファミリー	日経 225
一般 公債	年4回	欧州	ファンド	
社債 その他債券	年6回	アジア		TOPIX
クレジット属性 ( )	(隔月)	オセアニア		
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米		
その他資産 投資信託証券 \	10000000000000000000000000000000000000	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他
(株式 中小型株)/ 資産複合	日々	中近東		(TOPIX Small*)
( )	その他	(中東)		
資産配分固定型 資産配分変更型	( )	エマージング		

<sup>(</sup>注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

# (注1)商品分類の定義

<sup>※</sup>当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案し、委託会社の判断で変更する場合があります。

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

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

# (注2)属性区分の定義

日論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの 中小型株 目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの				有価証券届出書(内
古書の		株式	1111	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
中小型株 目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの (債券 一般 公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの公債 日論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。)に主として投資する旨の記載があるもの 社債 目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの その他債券 目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの 格付等クレ目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの 格付等クレ目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載がある。属性 不動産投信 目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年2回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの年4回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年1回(毎月)目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年1回(毎月)目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの日々日回(毎月)日論見書等において、年1回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々日回(毎月)日論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの日々日の日会見書等において、日々決算する旨の記載があるもの日々日記載日報があるもの日々決算する旨の記載があるもの日々日記載日報に表して、日々決算する旨の記載があるもの日々日記載日報に表して、日々決算する旨の記載があるもの日本記載があるもの日々記載日報に表して、主に対して、日本に対し、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対し、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対し、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対し、日本に対して、日本に対して、日本に対して、日本に対し	資産		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があ
あるもの   (債券				るもの
信券			中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載が
公債 目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債 (地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。)に主として投資する旨の記載があるもの 社債 目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの その他債券 目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの 格付等クレ目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載がある属性 不動産投信 目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合 目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につけては固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につけては、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載があるものにとする旨の記載があるもの年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月) 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月) 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月) 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの日々目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの日々目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの日々日				あるもの
(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。)に主として投資する旨の記載があるもの 社債 目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの その他債券 目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの 格付等クレ目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載がある属性 不動産投信 目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合 目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につけては固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 において、複数資産を投資対象とし、組入比率につけては、機動的な変更を行なう旨の記載があるものには、機動的な変更を行なう旨の記載があるものには、機動的な変更を行なう旨の記載があるものにとする旨の記載がないもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年4回 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月)目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月)目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの日々目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの日々目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの日々目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの日々日回		債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
す。)に主として投資する旨の記載があるもの 社債 目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの その他債券 目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの 格付等クレ目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの る属性 不動産投信 目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの 自論見書等において、年の決算する旨の記載があるもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する目の記載があるもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する目の記載があるもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する目の記載があるもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する目の記載があるもの 年1回 目論見書等において、年1回(毎月)決算する目の記載があるもの			公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債
社債 目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの その他債券 目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの 格付等クレ目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの。 をの他資産 目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの。 その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの。 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの。 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの。 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの。 日論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載があいもの。 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年4回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月)目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年1回(毎月)目論見書等において、年1回(毎月)決算する旨の記載があるもの年1回(毎月)目論見書等において、年1回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々				(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みま
る旨の記載があるもの その他債券 目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの 格付等クレ 目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載がある属性 不動産投信 目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 にいては、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載があるものに対しては、機動的な変更を行なう旨の記載があるもの年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年4回 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月) 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々				す。)に主として投資する旨の記載があるもの
その他債券 目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの格付等クレ目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載がある属性不動産投信 目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるものその他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につ分固定型 いては固定的とする旨の記載があるもの資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につ分変更型 いては、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年2回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月)目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年1回(毎月)目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年1回(毎月)目論見書等において、年1回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々 目論見書等において、年1回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々			社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資す
横付等クレ目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載がある。属性 不動産投信 目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につ分固定型 いては固定的とする旨の記載があるもの いては、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年2回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの年4回 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月)目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月)目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの				る旨の記載があるもの
格付等クレ目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載がある。属性 不動産投信 目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につけては固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 日論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年4回 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月) 目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの日々			その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投
ジットによる属性 不動産投信 目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合 目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものとする旨の記載がないもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年2回 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年4回 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月) 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの				資する旨の記載があるもの
本の大学学院   日論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの   日論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの   資産複合   日論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの   資産複合   資産配   日論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの   資産複合   資産配   日論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの   日論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年2回   日論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年4回   日論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年1回(隔月)   日論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの   日に関し、日には、日には、日には、日には、日には、日には、日には、日には、日には、日には			格付等クレ	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があ
不動産投信 目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合			ジットによ	るもの
る旨の記載があるもの その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合 目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 来算頻度 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年2回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの年4回 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月) 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの			る属性	
その他資産 目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合 目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につ いては固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配 目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につ いては、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの 年2回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの 年6回(隔月) 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの 年6回(隔月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの 年12回(毎月) 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの 日々 目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの		不動産	投信	目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資す
ト)以外に投資する旨の記載があるもの 資産複合 目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につ 分固定型 いては固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につ 分変更型 いては、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの 年2回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの 年4回 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの 年6回(隔月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの 年12回(毎月) 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの 日々 目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの				
資産複合 目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年2回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの年4回 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月) 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々 目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの		その他	資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リー
るもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につ 分固定型 いては固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につ 分変更型 いては、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 共算頻度 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの 年2回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの 年4回 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの 年6回(隔月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの 年12回(毎月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの 年12回(毎月) 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載がある もの				ト)以外に投資する旨の記載があるもの
資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につけては固定的とする旨の記載があるもの資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年4回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月) 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月) 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々 目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの		資産複	合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があ
分固定型 いては固定的とする旨の記載があるもの 資産複合 資産配目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 大算頻度 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの 年2回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの 年4回 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの 年6回(隔月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの 年12回(毎月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの 日2回 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの 日2回 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの				
資産複合 資産配 日論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 日論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの 年2回 日論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの 年4回 日論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの 年6回(隔月) 日論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの 年12回(毎月) 日論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの 日々 目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの		資産複	夏合 資産配	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率につ
分変更型 いては、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの 共算頻度 年1回 目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの 年2回 目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの 年4回 目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの 年6回(隔月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの 年12回(毎月) 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの 日々 目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの		分固定	!型	いては固定的とする旨の記載があるもの
定的とする旨の記載がないもの				
決算頻度年1回目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの年2回年4回目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年4回年6回(隔月)目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月)日論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々		分変更	型	Nては、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固
年2回目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの年4回目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月)目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月)目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの				
年4回       目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの年6回(隔月)       目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの年12回(毎月)         日会       目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの日々	決算頻度	年1回		
年6回(隔月) 目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの 年12回(毎月) 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載がある もの 日々 目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの		年2回		目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
年12回(毎月) 目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載がある もの 日々 目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの		年4回		目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの
もの         日々       目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの		年6回	(隔月)	目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
日々 目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの		年12回	(毎月)	目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載がある
		<u></u>		もの
その他上記属性にあてはまらないすべてのもの		日々		目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの
		その他		上記属性にあてはまらないすべてのもの

		有侧趾分庙山青(内)
投資対象 地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を 源泉とする旨の記載があるもの
池		
	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
		目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資
	' '	日調兄音寺にのいて、組入員座による投員収益が北木地域の員 産を源泉とする旨の記載があるもの
	区欠州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資
		産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くア
		ジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地
		域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の
1		資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域
		の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東(中東)	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の
		資産を源泉とする旨の記載があるもの
	>>> 4>	
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング
		地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があ
		るもの
投資形態	ファミリーファン	目論見書等において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズ
	۲	にのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資す
		るもの
1		「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファン
	ファンズ	ド・オブ・ファンズ
為替へッ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為
ジ		替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があ
		るものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
対象イン	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨
デックス		の記載があるもの
	TOPTX	目論見書等において、TOPIXに連動する運用成果をめざす
		旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめ
		ざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極
		的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは
		逆連動(一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。)をめざす
		上にからに対して、はとに対している。 アモのこ       旨の記載があるもの
	<b>女</b> 此什浑虫型	
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組
		みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還
		価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値
		により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があ
		るもの
	ロンガ・ショー	  目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求
		をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を
		めざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれ
1	1	にも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるも
		の

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

#### <信託金の限度額>

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、500億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### <ファンドの特色>

# わが国の株式に投資し、投資成果を対象指数(ベンチマーク)の動きに連動させることをめざします。

- ◆連動をめざす対象指数(ベンチマーク)の選定および変更は、当ファンドの商品性および運用上の 効率性等を勘案し、委託会社の判断で決定するものとします。対象指数(ベンチマーク)については 変更になる場合があります。
- ◆対象指数(ベンチマーク)は、TOPIX Small(トピックススモール)です。

#### ■TOPIX Smallについて

TOPIXの構成銘柄を一定の基準で規模ごとに細分化した浮動株時価総額加重型株価指数の一つです。TOPIX Smallは、東京証券取引所の市場第一部に上場する内国普通株式全銘柄の中から、TOPIX500構成銘柄を除いた全銘柄から構成される指数のことをいい、1998年4月1日を1000ポイントとして算出しています。

# 運用プロセス

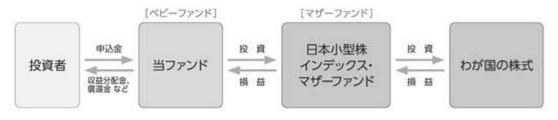


ポートフォリオの作成にあたっては、ベンチマークへの連動をめざしたポートフォリオを構築します。 また、運用の効率化を図るため、株価指数先物取引を利用することがあります。ただし株価指数 先物が存在しない等の理由から他の指数に連動する先物取引を利用する場合があります。 そのためベンチマークと基準価額の動きに乖離が発生する可能性があります。

# ファンドの仕組み

# ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド (当ファンド)とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用を マザーファンドで行なう仕組みです。



- マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。
   このため、マザーファンドにおいて、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。

当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、 償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色の運用が行なわれ ないことがあります。

# 分配方針

毎年10月18日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

(注) 第1計算期間は、2019年10月18日(休業日の場合翌営業日)までとします。

#### [分配方針]

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ②原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を 勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないこと があります。

# 主な投資制限

- ●マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ●株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への投資は、行ないません。
  - ① TOPIX Smallの指数値およびTOPIX Smallの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「㈱東京証券取引所」 といいます。)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 Smallに関するすべて の権利・ノウハウおよびTOPIX Smallの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有します。
  - ② ㈱東京証券取引所は、TOPIX Smallの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX Smallの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIX Small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 ㈱東京証券取引所は、TOPIX Smallの指数値およびTOPIX Small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 Small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 ㈱東京証券取引所は、TOPIX Small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、㈱東京証券取引所は、TOPIX Smallの指数値の算出または公表の誤謬、遅延 または中断に対し、責任を負いません。
  - ⑤ 本件インデックスファンドは、㈱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 ㈱東京証券取引所は、本件インデックスファンドの購入者または公衆に対し、本件インデックスファンドの 説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
  - ⑦ ㈱東京証券取引所は、当社または本件インデックスファンドの購入者のニーズを、TOPIX Small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、㈱東京証券取引所は本件インデックスファンドの設定、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。

## ●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、ベンチマークの動きに連動する投資成果をあげることをめざ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。

- 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れない場合があること
- ・運用管理費用(信託報酬)、売買委託手数料等の費用負担
- 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
- 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
- ・株価指数先物と指数の動きの不一致(先物を利用した場合)
- 株式および株価指数先物取引の最低取引単位の影響
- 株式および株価指数先物の流動性低下時における売買対応の影響
- ・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

# (2) 【ファンドの沿革】

2018年10月19日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

受益者 お申込者

収益分配金(注)、償還金など お申込金(3)

など

		大和アゼットマネジメント休式: 有価証券届出書(内国投資信語
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社 との契約( 1)に基づき、次の業務を行ないま す。 受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払い に関する事務
1	収益分配金、	償還金など お申込金(3)
委託会社	大和アセットマネジ メント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約(以下「信 託契約」といいます。)( 2)の委託者であり、 次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
		損益 信託金(3)
受託会社	三井住友信託銀行 株式会社 再信託受託会社: 株式会社日本カスト ディ銀行	信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分

損益 投資

信託財産の計算

投資対象

わが国の金融商品取引所上場株式 国内株式を対象とした株価指数先物 取引 など

(ファミリーファンド方式で運用を行ないます。)

- (注)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。
- 1:受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払い に関する事務の内容等が規定されています。
- 2:「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。
- 3:販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

- <委託会社の概況(2020年10月末日現在)>
- ・資本金の額 151億7,427万2,500円
- ・沿革

1959年12月12日 大和証券投資信託委託株式会社として設立

1960年 2月17日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

1960年 4月 1日 営業開始

1985年11月 8日 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。

1995年 5月31日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問

業の登録を受ける。

1995年 9月14日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任

契約にかかる業務の認可を受ける。

2007年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみ

なされる。

(金融商品取引業者登録番号:関東財務局長(金商)第352号)

2020年 4月 1日 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

#### ・大株主の状況

名 称	住所	所有	比率
		株式数	
		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】

#### 主要投資対象

日本小型株インデックス・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券を 主要投資対象とします。

#### 投資態度

イ.主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、日本の小型株市場の動きを捉える指数との連動をめざして運用を行ないます。

連動をめざす対象指数 (ベンチマーク)の選定および変更は、当ファンドの商品性および運用 上の効率性等を勘案し、委託会社の判断で決定するものとします。

- 口、マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。
- ハ. マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、マザーファンドにおいて、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 二.株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。) への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

ホ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれ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) 、 および に定めるものに限ります。)
- 八.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、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券(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除きます。)に投資することを指図することができます。

- 1. 株券または新株引受権証書
- 2. 国債証券
- 3. 地方債証券
- 4.特別の法律により法人の発行する債券
- 5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
- 6.特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいま す。)
- 7.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8.協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいい ます。)
- 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10. コマーシャル・ペーパー
- 11.新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および 新株予約権証券

- 12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
- 13.投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい ます。)
- 14.投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項 第11号で定めるものをいいます。)
- 15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16.オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
- 17. 預託証書 (金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19. 受益証券発行信託の受益証券 (金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
- 20.抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 21.外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前14.の証券のうち投資法人債券ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券(新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、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。

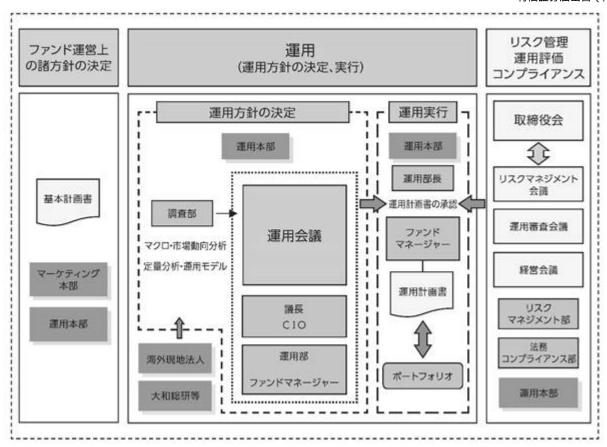
- 1. 預金
- 2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3. コール・ローン
- 4. 手形割引市場において売買される手形
- 5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6. 外国の者に対する権利で前5. の権利の性質を有するもの

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

# (3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

# イ.基本計画書の策定

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

口.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。

八.運用計画書の作成・承認

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

#### 職務権限

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

- イ.CIO(Chief Investment Officer)(3名) 運用最高責任者として、次の職務を遂行します。
  - ・基本的な運用方針の決定
  - ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定
- ロ. Deputy-CIO(0~5名程度)CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。
- ハ. インベストメント・オフィサー(0~5名程度)CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

二.運用部長(各運用部に1名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ. 運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ.ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

#### 運用審査会議、リスクマネジメント会議および経営会議

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. 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。

口. 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。

#### 八.経営会議

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2020年10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】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。

原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案 して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがありま す。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券(信託約款)

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式(信託約款)

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券等(信託約款)

イ.委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ.前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

投資信託証券(信託約款)

- イ.委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。)な投資信託証券(以下「上場投資信託証券」といいます。)を除きます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ロ.前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

投資する株式等の範囲(信託約款)

- イ.委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ロ.前イ.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権 証券で目論見書等において上場または登録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。
  - 同一銘柄の新株引受権証券等(信託約款)
- イ.委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ロ.前イ.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

信用取引(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、信用取引により株券を売り付けることの指 図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより 行なうことの指図をすることができるものとします。
- 口.前イ.の信用取引の指図は、次の1.から6.までに掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1.から6.までに掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  - 1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
  - 2. 株式分割により取得する株券
  - 3. 有償増資により取得する株券
  - 4. 売出しにより取得する株券
  - 5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第 236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予

約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商 法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)の新株予約 権に限ります。)の行使により取得可能な株券

6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託 財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前5.に定めるものを除き ます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等(信託約款)

- イ.委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号八に掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)。
- ロ.委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかか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。

スワップ取引(信託約款)

- イ.委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ロ.スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ.スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本ハ.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- 二.前八.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ホ.スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- へ.委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、 担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引(信託約款)

イ.委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの 指図をすることができます。

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

- 口.金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 八.金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかる保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2) の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八.において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 二.前八.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ホ.金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- へ.委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、 担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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。

有価証券の貸付け(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、公社債および投資 信託証券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。
  - 1.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。
  - 2.公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
  - 3. 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
- ロ.前イ.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に 相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ.委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への投資は、行ないません。

#### 信用リスク集中回避(信託約款)

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

#### 資金の借入れ(信託約款)

- イ.委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払 資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目 的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コー ル市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価 証券等の運用は行なわないものとします。
- 口.一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- 八.収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営 業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 二.借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## <参 考> マザーファンド(日本小型株インデックス・マザーファンド)の概要

## (1) 投資方針

#### 投資対象

わが国の金融商品取引所上場株式(上場予定を含みます。)および国内株式を対象とした株価指数 先物取引を主要投資対象とします。

#### 投資態度

イ.主として、わが国の株式に投資し、日本の小型株市場の動きを捉える指数との連動をめざして運用を行ないます。

連動をめざす対象指数 (ベンチマーク)の選定および変更は、当ファンドの商品性および運用 上の効率性等を勘案し、委託会社の判断で決定するものとします。

- 口、株式の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。
- 八.運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 二.当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

#### (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(3) 、 および に定めるものに限ります。)
  - 八.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、信託金を、主として次の有価証券(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除きます。)に投資することを指図します。

- 1. 株券または新株引受権証書
- 2. 国債証券
- 3. 地方債証券
- 4. 特別の法律により法人の発行する債券
- 5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引 受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
- 6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定める ものをいいます。)
- 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10. コマーシャル・ペーパー
- 11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。) および 新株予約権証券
- 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.の証券または証書の性質を有するもの
- 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい ます。)
- 14. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項 第11号で定めるものをいいます。)
- 15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
- 17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
- 20. 抵当証券 (金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、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
- 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6. 外国の者に対する権利で前5. の権利の性質を有するもの

#### (3) 主な投資制限

株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資信託証券への投資制限

投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

- イ.委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号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。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)。
- 口.委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかか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。

スワップ取引

- イ.委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ロ.スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ.スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- 二.スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ.委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、 担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引(信託約款)

- イ.委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの 指図をすることができます。
- 口.金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 八.金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 二、金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ.委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、 担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 3 【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

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。

小型株式については、株式市場全体の動きと比較して株価が大きく変動するリスクがあり、当ファンドの基準価額に影響する可能性があります。

その他

イ.解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ.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。

## (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等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、お買付け、ご換金の申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付け・ご換金の申込みを取消すことがあります。

ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込み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ご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

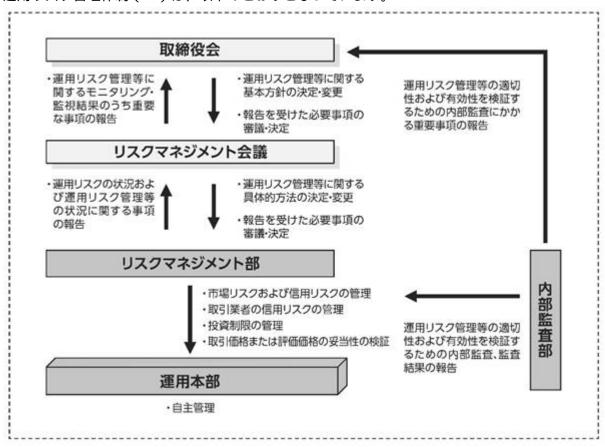
## (3) その他の留意点

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

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

#### (4) リスク管理体制

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。



- ※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。
- ※ファンドの年間騰客率は、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、円ペース)
- 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、円ペース)
- 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、円ペース)
- 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・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド(円ペース)

#### ※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情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 エマージング・マーケッツ 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】

取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。

・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)

申込手数料には、消費税等が課されます。

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

# (2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

#### (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.44%(税抜0.40%)を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日(6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。)および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。

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。信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.19%(税抜)	年率0.19%(税抜)	年率0.02%(税抜)

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

前 の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

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・運用報告

書の作成等の対価

販売会社:運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

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】

信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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。

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、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

( )「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。

#### <マザーファンドより支弁する手数料等>

信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する 費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

## (5) 【課税上の取扱い】

課税上は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.収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、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、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用があります。)を選択することもできます。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。

## 口.解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益(解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料(税込)を含む)を控除した利益)については、譲渡所得とみなされ、20%(所得税15%および地方税5%)の税率により、申告分離課税が適用されます。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。

#### 八.損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等(特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。)の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。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。一部解

約時および償還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。

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。

少額投資非課税制度「愛称:NISA(ニーサ)」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたNISAをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります(他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。)。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります(他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。)。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、 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

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として課税され、15%(所得税15%)の税率で源泉徴収 され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金(特別分配金)には課税されません。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15.315%(所得税15%および復興特別所得税0.315%)となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

#### <注1>個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等(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は含まれません。)が当該投資者の元本(個別元本)にあたります。

投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

投資者が元本払戻金(特別分配金)を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該 元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

#### <注2>収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

投資者が収益分配金を受取る際、イ.当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本 と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通 分配金となり、口.当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合

EDINET提出書類 大和アセットマネジメント株式会社(E06748) 有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

- ( ) 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( )上記は、2020年10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】 (2020年10月30日現在)

# 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		494,745,422	99.99
	内 日本	494,745,422	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		30,739	0.01
純資産総額		494,776,161	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】 (2020年10月30日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

# イ.主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	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	日本小型株インデックス・マザー ファンド	日本	親投資信託受益証券	517,949,563	0.9973 516,596,590		99.99

(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。

# 口.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
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

(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。

#### 八.投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

# 【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】

# (3) 【運用実績】

# 【純資産の推移】

	純資産総額	純資産総額	1口当たりの	1口当たりの
	(分配落)	(分配付)	純資産額	純資産額
	(円)	(円)	(分配落)(円)	(分配付)(円)
第1計算期間末 (2019年10月18日)	481,548,390	481,548,390	0.9494	0.9494
2019年10月末日	499,414,728	-	0.9845	1
11月末日	514,203,587	-	1.0103	1
12月末日	528,387,003	-	1.0309	1
2020年1月末日	507,751,900	-	0.9863	-
2月末日	438,392,461	-	0.8471	1
3月末日	430,630,923	-	0.8199	1
4月末日	448,809,377	-	0.8567	1
5月末日	483,847,245	-	0.9306	-
6月末日	479,064,125	-	0.9183	1
7月末日	457,045,179	-	0.8752	-
8月末日	489,860,219	-	0.9406	-
9月末日	515,849,419	-	0.9900	-
第2計算期間末 (2020年10月19日)	516,795,280	516,795,280	0.9886	0.9886
10月末日	494,776,161	-	0.9467	-

# 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)	
第1計算期間	0.0000	
第2計算期間	0.0000	

# 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	5.1
第2計算期間	4.1

# (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	36,675,380	29,487,560
第2計算期間	54,045,736	38,495,341

(注) 当初設定数量は500,000,000口です。

# (参考)マザーファンド

日本小型株インデックス・マザーファンド

# (1) 投資状況 (2020年10月30日現在)

# 投資状況

投	資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)	
株式		477,393,000	96.49	
	内 日本	477,393,000	96.49	
コール・ローン、その他	也の資産(負債控除後)	17,374,877	3.51	
純資産総額		494,767,877	100.00	

# その他の資産の投資状況

	投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取	双引(買建)	17,303,000	3.50
内 日本		17,303,000	3.50

- (注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
- (注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。
- (注3) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する 清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最 も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

# (2) 投資資産 (2020年10月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

# イ.主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 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	K A D O K A W A	日本	株式	情報·通 信業	600	2,901.00 1,740,600	·	0.38
2	タカラバイオ	日本	株式	化学	600	2,818.00 1,690,800	·	0.34
3	DCMホールディングス	日本	株式	小売業	1,300	1,448.30 1,882,800	,	0.34
4	チェンジ	日本	株式	情報·通 信業	200	8,240.00 1,648,000		0.33

						日叫此为旧	1山青(内国だ	又只口吐
5	NIPPO	日本	株式	建設業	600	2,800.00		0.33
				<b>=</b>		1,680,000	1,608,000	
6	エレコム	日本	株式	電気機器	300	4,936.66 1,481,000		0.32
				情報・通		16,740.00	15,390.00	
7	東映	日本	株式	信業	100	1,674,000	1,539,000	0.31
8	システナ	日本	株式	情報·通	800	1,987.62	1,897.00	0.31
L		山华	17/11/	信業	000	1,590,100	1,517,600	
9	大王製紙	  日本	株式	パルプ・	1,000	1,496.60	1,511.00	0.31
				紙		1,496,600		
10	   因幡電機産業	日本	株式	卸売業	600	2,600.00		0.30
						1,560,000		
11	日本瓦斯	日本	株式	小売業	300	5,210.00 1,563,000		0.30
						1,190.84	1,150.00	
12	ビックカメラ	日本	株式	小売業	1,300	1,548,100	1,495,000	0.30
			lu b	サービス		4,020.00	3,720.00	
13	共立メンテナンス 	日本	株式	業	400	1,608,000	1,488,000	0.30
14	デジタルガレージ	日本	株式	情報·通	400	3,690.00	3,705.00	0.30
Ľ	5 2 7 7 7 7	H **	17/17/	信業	100	1,476,000	1,482,000	
15	サカタのタネ	  日本	株式	水産·農	400	3,828.75	3,680.00	0.30
_				林業		1,531,500	1,472,000	
16	カチタス	日本	株式	不動産	500	3,315.00		0.30
				業 情報·通		1,657,500 5,130.00		
17	インターネットイニシアティブ	日本	株式	信業	300	1,539,000		0.28
				精密機		3,655.00		
18	東京精密	日本	株式	器	400	1,462,000	1,404,000	0.28
10	774=7-77	n.*	±#-±	小士光	200	7,030.00	6,860.00	0.20
19	ココカラファイン	日本	株式	小売業	200	1,406,000	1,372,000	0.28
20	ダイワボウHD	  日本	株式	卸売業	200	6,550.00	6,820.00	0.28
	7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7		171.20		255	1,310,000	1,364,000	
21	アサヒHD	日本	株式	非鉄金	400	3,620.00		0.27
				属		1,448,000	1,358,000	
22	ニチアス	  日本	株式	ガラス・ 土石製	600	2,439.00	2,256.00	0.27
	-//^	++	17/1/	品	000	1,463,400	1,353,600	
		<u> </u> .		サービス		16,930.00	13,510.00	
23	ベイカレントコンサルティング	日本	株式	業	100	1,693,000	1,351,000	0.27

						13177777		~ / · i i i i i
24	AUT / LCDU	<del>_</del>	<del>1/1 - 1`</del>	小丰米	400	3,465.00	3,370.00	0.27
24	クリエイトS D H	日本	株式	小売業	400	1,386,000	1,348,000	
	\ = 7 ¬ ch .l.		+/+ <del>-  `</del>	红土米	500	2,718.40	2,688.00	0.27
25	トラスコ中山	日本	株式	卸売業	500	1,359,200	1,344,000	0.27
	<b>宁</b> 上 <i>各</i> 仁		+/+ <del>-  `</del>	/生\宝 <del>-  </del>	200	4,375.00	4,470.00	0.07
26	富士急行	日本	株式	陸運業	300	1,312,500	1,341,000	0.27
07	>= / □ + □ = : ハ.ガョ		+#- <del>-</del> +	z+n÷n <del>∀</del> ¥	000	1,585.00	1,483.00	0.07
21	ミライト·ホールディングス 	日本	株式	建設業	900	1,426,500	1,334,700	0.27
20	CHIET	n *	株式	情報·通	100	16,860.00	13,310.00	0.27
20	SHIFT	日本	が正し	信業	100	1,686,000	1,331,000	0.27
20	口大東フ		<del>1/1 -   `</del>	電気機	400	3,580.00	3,310.00	
29	日本電子	日本	株式	器	400	1,432,000	1,324,000	0.27
20	マニッ制変	日本	株式	化学	200	6,900.00	6,620.00	0.27
30	アース製薬	<b>□</b>	が下し	1 <del>0子</del> 	200	1,380,000	1,324,000	0.27

(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。

# 口.投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類			
株式	96.49%		
合計	96.49%		

(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。

# 八.投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.56%
鉱業	0.28%
建設業	5.26%
食料品	3.17%
繊維製品	1.59%
パルプ・紙	0.70%
化学	6.60%
医薬品	1.29%
石油・石炭製品	0.22%
ゴム製品	0.39%
ガラス・土石製品	1.70%
鉄鋼	0.84%
非鉄金属	1.01%
金属製品	1.54%
機械	6.39%

電気機器	6.77%
輸送用機器	1.85%
精密機器	1.25%
その他製品	2.31%
電気・ガス業	0.72%
陸運業	2.10%
海運業	0.29%
倉庫・運輸関連業	1.02%
情報・通信業	10.67%
卸売業	8.09%
小売業	11.44%
銀行業	3.99%
証券、商品先物取引業	0.79%
保険業	0.16%
その他金融業	1.43%
不動産業	2.57%
サービス業	9.51%
合計	96.49%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

# 投資不動産物件

該当事項はありません。

# その他投資資産の主要なもの

(単位:円)

種類	地域	資産名	買建/	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	ミニTOPIX先物 2020年12 月	買建	11	17,953,220	17,303,000	3.50%

- (注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
- (注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する 清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最 も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

# (参考情報)運用実績

#### ● iFreeNEXT 日本小型株インデックス

2020年10月30日現在

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

#### 基準価額・純資産の推移



<sup>※</sup>上記の「基準価額の騰落車」とは、 「分配金再投資基準価額」の機落率です。

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

#### 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

		直近1年	間分配金	合計額:	0円	設定	来分配金	合計額:	0円	24 65	
決算期	0.0000000000000000000000000000000000000	第 2 期 20年10月			pallate 1				0.000		
分配金	0円	0円									

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

#### 主要な資産の状況

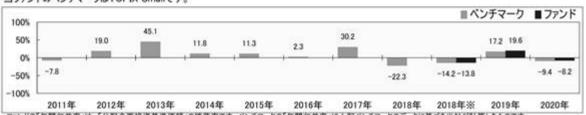
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,443	96.5%	小売業	11.4%	ミニTPX先物 0212月	-	3.5%
国内株式先物	1	3.5%	情報·通信業	10.7%	KADOKAWA	情報·通信業	0.4%
不動產投資信託等		-	サービス業	9.5%	タカラバイオ	化学	0.3%
コール・ローン、その他		3.5%	卸売業	8.1%	DCMホールディングス	小売業	0.3%
合計	1,444	-	電気機器	6.8%	チェンジ	情報·通信業	0.3%
株式 市場·上場別	開構成	比率	化学	6.6%	NIPPO	建設業	0.3%
一部(東証·名証)		96.5%	機械	6.4%	エレコム	電気機器	0.3%
二部(東証·名証)		-	建設業	5.3%	東映	情報·通信業	0.3%
新興市場他		-	銀行業	4.0%	システナ	情報·通信業	0.3%
その他		-	その他	27.8%	大王製紙	パルプ・紙	0.3%
合計		96.5%	合計	96.5%	合計		6.5%

<sup>※</sup>先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

#### 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはTOPIX Smallです。



<sup>・</sup>ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の機落率です。ペンチマークの「年間収益率」は上記ペンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2018年※は設定日(10月19日)から年末、2020年は10月30日までの機落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

<sup>・</sup>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

## 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。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約(以下「別に定める契約」といいます。)を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

お買付価額(1万口当たり)は、お買付申込受付日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

継続申込期間においては、委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み(当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの)を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消すことができるものとします。

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、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、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、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

### 2 【換金(解約)手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み(当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの)を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

#### <一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額(基準価額)は、販売会社または委託会社に問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/

委託会社は、金融商品取引所等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、一部解約請求の受付けを中止することができるほか、すでに受け付けた一部解約請求を取消すことができるものとします。一部解約請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の一部解約の価額は、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一部解約請求を受付けたものとして、当該計算日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約請求受付日から起算して4営業日 目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

一部解約請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

#### 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1万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1、注2)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1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要
  - ・マザーファンドの受益証券:計算日の基準価額で評価します。
- (注2)マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要
  - ・わが国の金融商品取引所上場株式:原則として当該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10月19日から翌年10月18日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始される ものとします。

## (5) 【その他】

信託の終了

- 1.委託会社は、受益権の口数が30億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、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信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

- 3.前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- 4.前2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- 5.前2.から前4.までの規定は、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2.から前4.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。
- 6.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。
- 7. 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。
- 8.受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更等

- 1.委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- 2.委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。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発します。
- 3.前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- 4.前2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- 5.書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

- 6.前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- 7.前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

# 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権 買取請求の規定の適用を受けません。

### 運用報告書

- 1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書)を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
- 2. 委託会社は、運用報告書(全体版)(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める 運用報告書)を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
  - ・委託会社のホームページ アドレス https://www.daiwa-am.co.jp/
- 3.前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、これを交付します。

## 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

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月(または3か月)前までに、委託会社および販売会社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。

収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金(分配金額は、委託会社が決定します。)および償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において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者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、 当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社 の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日において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者(信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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ならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

#### 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間 (2019年10月19日から2020年10月19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】

iFreeNEXT 日本小型株インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2019年10月18日現在	第2期 2020年10月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,048,057	1,248,334
親投資信託受益証券	481,519,519	516,764,627
未収入金	20,000	-
流動資産合計	482,587,576	518,012,961
資産合計	482,587,576	518,012,961
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,493	148,887
未払受託者報酬	49,864	52,730
未払委託者報酬	948,235	1,002,836
その他未払費用	12,594	13,228
流動負債合計	1,039,186	1,217,681
負債合計	1,039,186	1,217,681
純資産の部		
元本等		
元本	1 507,187,820	1 522,738,215
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 25,639,430	2 5,942,935
(分配準備積立金)	-	1,190,122
元本等合計	481,548,390	516,795,280
純資産合計	481,548,390	516,795,280
負債純資産合計	482,587,576	518,012,961

# (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 2018年10月19日 至 2019年10月18日	第2期 自 2019年10月19日 至 2020年10月19日
営業収益		
受取利息	1	4
有価証券売買等損益	23,149,481	23,310,108
営業収益合計	23,149,480	23,310,112
営業費用		
支払利息	196	99
受託者報酬	99,814	106,635
委託者報酬	1,898,164	2,027,714
その他費用	25,008	26,496
営業費用合計	2,023,182	2,160,944
営業利益又は営業損失()	25,172,662	21,149,168
経常利益又は経常損失()	25,172,662	21,149,168
当期純利益又は当期純損失( )	25,172,662	21,149,168
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	2,351,722	1,236,483
期首剰余金又は期首欠損金()	-	25,639,430
剰余金増加額又は欠損金減少額	85,212	2,043,585
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少 額	85,212	2,043,585
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,903,702	4,732,741
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加 額	2,903,702	4,732,741
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	25,639,430	5,942,935

# (3) 【注記表】

# (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

		第2期
	区分	自 2019年10月19日
		至 2020年10月19日
1.	有価証券の評価基準及び評価	親投資信託受益証券
	方法	
		移動平均法に基づき、時価で評価しております。
		時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて
		評価しております。
2.	その他財務諸表作成のための	計算期間末日
	基本となる重要な事項	
		2020年10月18日が休日のため、当計算期間末日を2020年10月19日と
		しております。このため、当計算期間は367日となっております。

# (貸借対照表に関する注記)

	区分		第1期	第2期
			2019年10月18日現在	2020年10月19日現在
1.	1	期首元本額	500,000,000円	507,187,820円
		期中追加設定元本額	36,675,380円	54,045,736円
		期中一部解約元本額	29,487,560円	38,495,341円
2.		計算期間末日における受益 権の総数	507,187,820□	522,738,215□
3.	2	元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は25,639,430円でありま	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は5,942,935円でありま
			す。	す。

# (損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第1期	第2期
区分	自 2018年10月19日	自 2019年10月19日
	至 2019年10月18日	至 2020年10月19日

			有 侧 证 分 屈 山 音 ( 内 国 及 貝 后 市
1	分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴	計算期間末における解約に伴
		う当期純利益金額分配後の配	う当期純利益金額分配後の配
		当等収益から費用を控除した	当等収益から費用を控除した
		額(0円)、解約に伴う当期	額(0円)、解約に伴う当期純
		純利益金額分配後の有価証券	利益金額分配後の有価証券売
		売買等損益から費用を控除	買等損益から費用を控除し、
		し、繰越欠損金を補填した額	繰越欠損金を補填した額
		(0円)、投資信託約款に規	(1,190,122円)、投資信託約
		定される収益調整金(0円)	款に規定される収益調整金(0
		及び分配準備積立金(0円)	円)及び分配準備積立金(0
		より分配対象額は0円(1万口	円)より分配対象額は
		当たり0.00円)であり、分配	1,190,122円(1万口当たり
		を行っておりません。	22.77円)であり、分配を行っ
			ておりません。

# (金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第2期
区分	自 2019年10月19日
	至 2020年10月19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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証
	券、デリバティブ取引に投資しております。
	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
6. 亚高语语信信息 7八八百字件的	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	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
についての補足説明	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
	<b>ं</b>

# 金融商品の時価等に関する事項

	区分	第2期
	<u> </u>	2020年10月19日現在
1.	金融商品の時価及び貸借対照表	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
	計上額との差額	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

	第1期	第2期	
	2019年10月18日現在	2020年10月19日現在	
種類	当計算期間の損益に	当計算期間の損益に	
	含まれた評価差額(円)	含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	21,299,150	24,129,275	
合計	21,299,150	24,129,275	

# (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1期	第2期
2019年10月18日現在	2020年10月19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2期
自 2019年10月19日
至 2020年10月19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1期	第2期	
	2019年10月18日現在	2020年10月19日現在	
1口当たり純資産額	0.9494円	0.9886円	

(9,886円)

# (4) 【附属明細表】

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

# (2) 株式以外の有価証券

種類	9 柘	券面総額	評価額	備考
1里 <del>  大</del> 貝	路 柄		(円)	伸写
親投資信託受益	日本小型株インデックス・マザーファ	518,111,718	516,764,627	
証券	ンド	010,111,710	010,704,027	
親投資信託受益証券 合計			516,764,627	
合計			516,764,627	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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。

### (参考)

当ファンドは、「日本小型株インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、 貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券で あります。

なお、当ファンドの計算期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「日本小型株インデックス・マザーファンド」の状況 以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### 貸借対照表

	2019年10月18日現在	2020年10月19日現在	
	金 額(円)	金 額(円)	
資産の部			
流動資産			
コール・ローン	4,680,305	10,256,822	
株式	473,157,500	499,112,700	

派生商品評価勘定			313,960	204,590
未収入金			-	3,350,000
未収配当金			3,475,480	3,263,010
前払金		,	-	4,500
差入委託証拠金			232,500	624,000
流動資産合計			481,859,745	516,815,622
資産合計			481,859,745	516,815,622
負債の部				
流動負債		·		
派生商品評価勘定		·	-	34,580
前受金		·	334,500	-
未払解約金		·	20,000	-
流動負債合計		,	354,500	34,580
負債合計			354,500	34,580
純資産の部				
元本等				
元本		1	504,949,161	518,111,718
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金(	)	2	23,443,916	1,330,676
元本等合計			481,505,245	516,781,042
純資産合計			481,505,245	516,781,042
負債純資産合計			481,859,745	516,815,622

# 注記表

# (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2019年10月19日
	至 2020年10月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価	(1)株式
方法	
	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事由をもって時価と認めた価額で評価して
	おります。

## (2)新株予約権証券

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事由をもって時価と認めた価額で評価して おります。

2. デリバティブ取引の評価基準 先物取引 及び評価方法

個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

3. 収益及び費用の計上基準

受取配当金

原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配 当金額を計上しております。

# (貸借対照表に関する注記)

		区分	2019年10月18日現在	2020年10月19日現在
1.	1. 1 期首		2018年10月19日	2019年10月19日
		期首元本額	499,950,000円	504,949,161円
		期中追加設定元本額	28,776,760円	40,326,640円
		期中一部解約元本額	23,777,599円	27,164,083円
		期末元本額の内訳		
	ファ	ンド名		
		iFreeNEXT 日本小型株イン	504,949,161円	518,111,718円
		デックス		
	計		504,949,161円	518,111,718円
2.		期末日における受益権の総数	504,949,161□	518,111,718□
3.	2	元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元	貸借対照表上の純資産額が元
			本総額を下回っており、その	本総額を下回っており、その
			差額は23,443,916円でありま	差額は1,330,676円でありま
			す。	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	自 2019年10月19日
	<u> </u>	至 2020年10月19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、デリバティ
		ブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティ
		ブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。
		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。
		信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約
		款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株
		価指数先物取引を利用しております。 
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
3.	立版向田に示るラスノ自注作的	
		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	  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
	についての補足説明	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。
		デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体が
		デリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

# 金融商品の時価等に関する事項

	区分	2020年10月19日現在
1.	金融商品の時価及び貸借対照表	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
	計上額との差額	と時価との差額はありません。
2.	金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。
		(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。
		(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

# (有価証券に関する注記)

#### 売買目的有価証券

-			
	2019年10月18日現在	2020年10月19日現在	
種類	当期間の損益に	当期間の損益に	
	含まれた評価差額(円)	含まれた評価差額(円)	
株式	31,471,534	10,265,333	
合計	31,471,534	10,265,333	

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年10月 19日から2019年10月18日まで、及び2019年10月19日から2020年10月19日まで)を指し ております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 株式関連

	2019年10月18日 現在			2020年10月19日 現在				
種 類	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち	(円)	(円)	(円)	うち	(円)	(円)
		1年超				1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	7,773,000	-	8,087,500	314,500	14,557,500	-	14,728,500	171,000
合計	7,773,000	-	8,087,500	314,500	14,557,500	-	14,728,500	171,000

# (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

# (1口当たり情報)

	2019年10月18日現在	2020年10月19日現在
1口当たり純資産額	0.9536円	0.9974円
(1万口当たり純資産額)	(9,536円)	(9,974円)

# 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	額(円)	備考
		単 価	金額	
極 洋	100	2,777.00	277,700	
カネコ種苗	100	1,549.00	154,900	
サカタのタネ	300	3,850.00	1,155,000	
ホクト	200	2,267.00	453,400	
ヒノキヤグループ	100	2,000.00	200,000	
ショーボンドHD	500	5,230.00	2,615,000	
ミライト・ホールディングス	900	1,585.00	1,426,500	
タマホーム	200	1,467.00	293,400	
日本アクア	100	722.00	72,200	
ファーストコーポレーション	100	722.00	72,200	
ベステラ	100	1,549.00	154,900	
TATERU	600	196.00	117,600	
スペースバリューHD	400	591.00	236,400	
住石ホールディングス	600	124.00	74,400	
日鉄鉱業	100	4,720.00	472,000	
三井松島HLDGS	100	719.00	71,900	
石油資源開発	400	1,710.00	684,000	
K & Oエナジーグループ	100	1,470.00	147,000	
ダイセキ環境ソリューション	100	719.00	71,900	
明豊ファシリティワークス	100	606.00	60,600	
安藤・間	1,700	695.00	1,181,500	
東急建設	800	477.00	381,600	
ビーアールホールディングス	300	718.00	215,400	
高松コンストラクション G P	200	2,185.00	437,000	
東建コーポレーション	100	8,060.00	806,000	
ヤマウラ	100	902.00	90,200	
飛島建設	200	1,090.00	218,000	
松井建設	300	722.00	216,600	

			有価証券届出書(内国	1女貝15計
不動テトラ	200	1,517.00	303,400	
大末建設	100	847.00	84,700	
鉄建建設	100	2,028.00	202,800	
大豊建設	200	3,175.00	635,000	
佐田建設	100	449.00	44,900	
ナカノフドー建設	200	417.00	83,400	
東鉄工業	300	2,719.00	815,700	
富士ピー・エス	100	592.00	59,200	
淺沼組	100	4,075.00	407,500	
熊 谷 組	300	2,527.00	758,100	,
矢作建設	300	867.00	260,100	
ピーエス三菱	200	587.00	117,400	
日本ハウスHLDGS	500	273.00	136,500	
新日本建設	300	913.00	273,900	
NIPPO	600	2,800.00	1,680,000	
日本道路	100	7,530.00	753,000	
東亜建設	200	1,831.00	366,200	
日本国土開発	500	580.00	290,000	
若築建設	100	1,200.00	120,000	,
東洋建設	700	424.00	296,800	
世紀東急	300	805.00	241,500	
福田組	100	4,830.00	483,000	,
日本ドライケミカル	100	1,415.00	141,500	
日本基礎技術	200	452.00	90,400	
巴コーポレーション	300	368.00	110,400	
ライト工業	400	1,549.00	619,600	
日特建設	200	773.00	154,600	
北陸電気工事	100	1,179.00	117,900	
ユアテック	400	651.00	260,400	
日本リーテック	100	2,411.00	241,100	
中電工	300	2,194.00	658,200	
関電工	900	844.00	759,600	
東京エネシス	200	753.00	150,600	
トーエネック	100	3,450.00	345,000	
住友電設	200	2,552.00	510,400	
日本電設工業	400	2,088.00	835,200	
新日本空調	200	2,236.00	447,200	
日本工営	100	2,744.00	274,400	
三機工業	500	1,173.00	586,500	
中外炉工業	100	1,490.00	149,000	
	-			

			有伽証券届出書(内国	1技具155
ヤマト	200	669.00	133,800	
太平電業	200	2,242.00	448,400	
高砂熱学	600	1,466.00	879,600	
NECネッツエスアイ	600	2,015.00	1,209,000	
明星工業	400	803.00	321,200	
大 氣 社	300	2,839.00	851,700	
ダイダン	200	2,664.00	532,800	
日比谷総合設備	200	1,753.00	350,600	
日本製粉	600	1,736.00	1,041,600	,
昭和産業	200	3,265.00	653,000	
鳥越製粉	200	1,030.00	206,000	,
中部飼料	300	1,576.00	472,800	
フィード・ワン	200	925.00	185,000	
日本甜菜糖	100	1,811.00	181,100	
三井製糖	200	1,924.00	384,800	
塩水港精糖	200	221.00	44,200	
日新製糖	100	1,908.00	190,800	
LIFULL	700	415.00	290,500	
ミクシィ	400	2,939.00	1,175,600	
ジェイエイシーリクルートメント	100	1,389.00	138,900	
メンバーズ	100	2,161.00	216,100	
UTグループ	200	3,785.00	757,000	
アイティメディア	100	2,765.00	276,500	
タケエイ	200	1,091.00	218,200	,
ビーネックスグループ	300	1,187.00	356,100	
コシダカホールディングス	500	444.00	222,000	
パソナグループ	200	1,908.00	381,600	
C D S	100	1,313.00	131,300	
リンクアンドモチベーション	400	418.00	167,200	
G C A	200	693.00	138,600	
サニーサイドアップG	100	677.00	67,700	
リニカル	100	794.00	79,400	
クックパッド	700	375.00	262,500	
エスクリ	100	355.00	35,500	
アイ・ケイ・ケイ	100	650.00	65,000	
中 村 屋	100	3,985.00	398,500	
名糖産業	100	1,456.00	145,600	
井村屋グループ	100	2,350.00	235,000	
不 二 家	100	2,327.00	232,700	
亀田製菓	100	5,190.00	519,000	
<u> </u>				

			有価証券届出書(内国	<u>国投資信計</u>
寿スピリッツ	200	5,150.00	1,030,000	
六甲バター	100	1,781.00	178,100	
プリマハム	300	3,135.00	940,500	
林兼産業	100	571.00	57,100	
丸大食品	200	1,699.00	339,800	
S Foods	200	3,480.00	696,000	
柿安本店	100	2,589.00	258,900	
伊藤八厶米久HLDGS	1,400	721.00	1,009,400	
学情	100	1,156.00	115,600	
スタジオアリス	100	1,950.00	195,000	
クロスキャット	100	1,535.00	153,500	
シミックホールディングス	100	1,354.00	135,400	
システナ	700	2,009.00	1,406,300	
デジタルアーツ	100	8,040.00	804,000	
日鉄ソリューションズ	300	3,200.00	960,000	
キューブシステム	100	1,530.00	153,000	
いちご	2,700	323.00	872,100	
日本駐車場開発	2,300	132.00	303,600	
コア	100	1,482.00	148,200	
アイロムグループ	100	1,915.00	191,500	
セントケア・ホールディング	100	735.00	73,500	
ルネサンス	100	878.00	87,800	
ディップ	300	2,202.00	660,600	
SBSホールディングス	200	2,380.00	476,000	
デジタルホールディングス	100	1,429.00	142,900	
新日本科学	200	709.00	141,800	
ツクイホールディングス	500	548.00	274,000	
キャリアデザインセンター	100	1,007.00	100,700	
ベネフィット・ワン	700	2,917.00	2,041,900	
ツカダ・グローバルHOLD	100	275.00	27,500	
アウトソーシング	1,200	1,098.00	1,317,600	
ウェルネット	200	587.00	117,400	
ワールドホールディングス	100	2,218.00	221,800	
ぐるなび	400	719.00	287,600	
タカミヤ	200	553.00	110,600	
ジャパンベストレスキューS	100	1,116.00	111,600	
ファンコミュニケーションズ	600	499.00	299,400	
ライク	100	2,124.00	212,400	
ビジネス・ブレークスルー	100	381.00	38,100	
エスプール	400	748.00	299,200	

			有価証券届出書(内国	国投資信託
WDBホールディングス	100	3,330.00	333,000	
ティア	100	399.00	39,900	
バリューコマース	100	3,755.00	375,500	
オエノンホールディングス	600	431.00	258,600	
養 命 酒	100	1,889.00	188,900	
ダイドーグループHD	100	5,300.00	530,000	
キーコーヒー	200	2,210.00	442,000	
ユニカフェ	100	1,015.00	101,500	
日清オイリオグループ	300	3,030.00	909,000	
J - オイルミルズ	100	3,840.00	384,000	
サンエー	200	4,335.00	867,000	
カワチ薬品	200	2,868.00	573,600	
ハードオフコーポレーション	100	670.00	67,000	
高千穂交易	100	949.00	94,900	
アスクル	200	4,435.00	887,000	
ゲオホールディングス	400	1,620.00	648,000	
アダストリア	300	1,709.00	512,700	
ジーフット	100	460.00	46,000	
伊藤忠食品	100	5,390.00	539,000	
くら寿司	100	6,280.00	628,000	
キャンドゥ	100	1,976.00	197,600	
エレマテック	200	988.00	197,600	
パルグループHLDGS	200	1,156.00	231,200	
JALUX	100	1,517.00	151,700	
エディオン	1,000	1,075.00	1,075,000	
あらた	200	5,100.00	1,020,000	
サーラコーポレーション	400	588.00	235,200	
ワッツ	100	794.00	79,400	
ハローズ	100	3,595.00	359,500	
JPホールディングス	600	315.00	189,000	
フジオフードG本社	200	1,424.00	284,800	
東京エレクトロンデバイス	100	3,235.00	323,500	
ひらまつ	400	205.00	82,000	
フィールズ	200	334.00	66,800	
大黒天物産	100	5,500.00	550,000	
ハニーズホールディングス	200	1,008.00	201,600	
ファーマライズHD	100	757.00	75,700	
  焼津水産化工	100	1,004.00	100,400	
  エバラ食品工業	100	2,419.00	241,900	
横浜冷凍	600	863.00	517,800	
	<u> </u>			

			有価証券届出書(内国	
イートアンドHLDGS	100	1,887.00	188,700	
ヨシムラ・フード・HLDGS	100	820.00	82,000	
永谷園ホールディングス	100	2,372.00	237,200	
一正蒲鉾	100	1,177.00	117,700	
フジッコ	200	2,037.00	407,400	
ロックフィールド	200	1,486.00	297,200	
ケンコーマヨネーズ	100	1,824.00	182,400	
わらべや日洋HD	100	1,513.00	151,300	
なとり	100	2,069.00	206,900	
北の達人コーポ	700	478.00	334,600	
ユーグレナ	900	900.00	810,000	
スター・マイカ・HLDGS	100	1,399.00	139,900	
A Dワークスグループ	300	157.00	47,100	
片倉工業	300	1,204.00	361,200	
グ ン ゼ	200	3,935.00	787,000	
ラサ商事	100	904.00	90,400	
アルペン	200	2,086.00	417,200	,
ハブ	100	623.00	62,300	
ラクーンホールディングス	100	2,320.00	232,000	
クオールホールディングス	300	1,169.00	350,700	,
アルコニックス	200	1,540.00	308,000	
ソリトンシステムズ	100	2,177.00	217,700	
ジンズホールディングス	100	8,370.00	837,000	
ビックカメラ	1,200	1,191.00	1,429,200	,
D C Mホールディングス	1,200	1,460.00	1,752,000	
ペッパーフードサービス	200	308.00	61,600	,
東京一番フーズ	100	566.00	56,600	,
D D ホールディングス	100	681.00	68,100	
あい ホールディングス	300	1,947.00	584,100	
ディーブイエックス	100	1,037.00	103,700	
きちりホールディングス	100	658.00	65,800	
アークランドサービスHD	200	2,040.00	408,000	
ドトール・日レスHD	300	1,519.00	455,700	
ブロンコビリー	100	2,329.00	232,900	
トレジャー・ファクトリー	100	727.00	72,700	
物語コーポレーション	100	11,070.00	1,107,000	
ココカラファイン	200	7,030.00	1,406,000	
ユニチカ	600	394.00	236,400	
富士紡ホールディングス	100	3,665.00	366,500	

			有価証券届出書(内国	国投資信託
ダイワボウ H D	200	6,550.00	1,310,000	
シキボウ	100	952.00	95,200	
日東紡績	300	4,300.00	1,290,000	
マクニカ・富士エレHLDGS	500	1,865.00	932,500	
Hamee	100	2,220.00	222,000	
ラクト・ジャパン	100	3,590.00	359,000	
クリエイトSDH	400	3,465.00	1,386,000	
バイタルKSKHD	400	1,033.00	413,200	
八洲電機	200	930.00	186,000	
メディアスホールディングス	100	897.00	89,700	
レスターホールディングス	200	2,216.00	443,200	
丸善CHI HD	200	372.00	74,400	
大光	100	705.00	70,500	
OCHIホールディングス	100	1,691.00	169,100	
TOKAIホールディングス	1,100	1,076.00	1,183,600	
三洋貿易	200	1,030.00	206,000	
チムニー	100	1,292.00	129,200	
シュッピン	100	938.00	93,800	
オイシックス・ラ・大地	200	3,505.00	701,000	
ウイン・パートナーズ	200	1,065.00	213,000	
ネクステージ	300	1,423.00	426,900	
ジョイフル本田	600	1,572.00	943,200	
鳥貴族	100	1,602.00	160,200	
キリン堂ホールディングス	100	3,490.00	349,000	
ホットランド	100	1,223.00	122,300	
SFPホールディングス	100	1,429.00	142,900	
綿半ホールディングス	200	1,386.00	277,200	
日本毛織	700	1,020.00	714,000	
ダイトウボウ	300	107.00	32,100	
トーア紡コーポレーション	100	494.00	49,400	
ダイドーリミテツド	300	198.00	59,400	
ユナイテッド・スーパーマーケ	600	1,119.00	671,400	
三栄建築設計	100	1,855.00	185,500	
三重交通グループH D	400	453.00	181,200	
サムティ	300	1,719.00	515,700	
ディア・ライフ	300	415.00	124,500	
コーセーアールイー	100	577.00	57,700	
日本商業開発	100	1,795.00	179,500	
プレサンスコーポレーション	300	1,488.00	446,400	
THEグローバル社	100	218.00	21,800	

			有価証券届出書(内国	投資信託
日本管理センター	100	1,289.00	128,900	
サンセイランディック	100	762.00	76,200	
フージャースHD	400	654.00	261,600	
ムゲンエステート	100	511.00	51,100	
帝国繊維	200	2,620.00	524,000	
日本コークス工業	1,800	64.00	115,200	
ゴルフダイジェスト・オン	100	795.00	79,500	
ミタチ産業	100	624.00	62,400	
BEENOS	100	1,827.00	182,700	
あさひ	200	1,789.00	357,800	
日本調剤	200	1,781.00	356,200	
トーエル	100	813.00	81,300	
ソフトクリエイトHD	100	3,275.00	327,500	
クリエイト・レストランツ・ホール	1,100	592.00	651,200	
明治電機工業	100	1,345.00	134,500	
デリカフーズHLDGS	100	615.00	61,500	
サンマルクホールディングス	200	1,608.00	321,600	
トリドールホールディングス	600	1,390.00	834,000	
サカイオーベックス	100	2,015.00	201,500	
TOKYO BASE	200	369.00	73,800	
稲葉製作所	100	1,375.00	137,500	
宮地エンジニアリングG	100	1,686.00	168,600	
トーカロ	600	1,099.00	659,400	
アルファCO	100	970.00	97,000	
RS TECHNOLOGIES	100	3,630.00	363,000	
信和	100	674.00	67,400	
ファーストブラザーズ	100	978.00	97,800	
ハウスドゥ	100	1,414.00	141,400	
シーアールイー	100	1,335.00	133,500	
ケイアイスター不動産	100	2,741.00	274,100	
住江織物	100	2,143.00	214,300	
日本フエルト	100	482.00	48,200	
エコナックホールディングス	400	93.00	37,200	
アツギ	200	569.00	113,800	
J Mホールディングス	100	2,520.00	252,000	
コメダホールディングス	500	1,836.00	918,000	
アレンザホールディングス	100	1,443.00	144,300	
バロックジャパン	200	669.00	133,800	
ダイニック	100	816.00	81,600	
共和レザー	100	601.00	60,100	

			有仙証券届出書(内国	1投資信託
力の源HD	100	629.00	62,900	
スシローグローバルHLDGS	1,100	2,846.00	3,130,600	
セーレン	500	1,593.00	796,500	
ソトー	100	945.00	94,500	
小松マテーレ	300	815.00	244,500	
ホギメディカル	200	3,420.00	684,000	
クラウディアHLDGS	100	293.00	29,300	
TSIホールディングス	700	279.00	195,300	
マツオカコーポレーション	100	2,261.00	226,100	
ワールド	300	1,363.00	408,900	
JNSホールディングス	100	678.00	67,800	
電算システム	100	3,935.00	393,500	
グリー	1,400	526.00	736,400	
コーエーテクモHD	400	5,230.00	2,092,000	
三菱総合研究所	100	4,270.00	427,000	
A G S	100	960.00	96,000	
ファインデックス	200	1,564.00	312,800	
ブレインパッド	100	4,350.00	435,000	,
KLab	400	956.00	382,400	,
ポールトゥウィン・ピットクル	300	1,002.00	300,600	
アイスタイル	600	405.00	243,000	
エムアップホールディングス	100	2,926.00	292,600	
エイチーム	100	880.00	88,000	
エニグモ	200	1,590.00	318,000	
テクノスジャパン	200	878.00	175,600	
enish	100	544.00	54,400	
コロプラ	700	918.00	642,600	
オルトプラス	200	476.00	95,200	
ブロードリーフ	1,000	543.00	543,000	
クロス・マーケティングG	100	370.00	37,000	
デジタルハーツHLDGS	100	1,145.00	114,500	
システム情報	100	1,328.00	132,800	,
メディアドゥ	100	8,510.00	851,000	
じげん	500	353.00	176,500	
ブイキューブ	100	2,538.00	253,800	
ディー・エル・イー	200	422.00	84,400	
フィックスターズ	200	1,051.00	210,200	
CARTA HOLDINGS	100	1,359.00	135,900	
オプティム	100	3,170.00	317,000	
セレス	100	2,341.00	234,100	
			•	

日日下下 100 16,860.00 1,686,000 1,686,000 1 452,000 1 452,000 1 452,000 1 452,000 1 452,000 1 452,000 1 452,000 1 452,000 1 452,000 1 452,000 1 1,945,00 1 389,000 1 1 477 7 200 312.00 62,400 1 455,600 1 1 477 7 200 1 1,945,00 1 455,600 1 1 49,500 1 1 4,539,000 1 1 4,539,000 1 1 4,539,000 1 1 4,500 1 1 4,600 1 1				有価証券届出書(内国	17月1日武
ディーガイア         200         1,945.00         389,000           日本アジアグループ         200         312.00         62,400           デクマトリックス         200         2,428.00         485,600           プロシップ         100         1,495.00         149,500           ザッパラス         100         427.00         42,700           システムリサーチ         100         1,896.00         189,600           インターネットイニシアティブ         300         5,130.00         1,539,000           さくらインターネット         200         800.00         160,000           ヴィンクス         100         1,300.00         130,000           SR Aホールディングス         100         2,373.00         237,300           システムインテグレータ         100         716.00         71,600           耐日ネット         200         1,020.00         204,000           自 A S E         200         1,229.00         245,800           アバント         200         1,233.00         246,600           アドソル目嘘         100         2,676.00         267,600           フリービット         100         1,011.00         101,100           コムチュア         200         2,901.00         580,200           アステリア         100         839.00<	SHIFT	100	16,860.00		
日本アジアグループ 200 312.00 62,400	特種東海製紙	100	4,520.00	452,000	
デクマトリックス         200         2,428.00         485,600           プロシップ         100         1,495.00         149,500           ザッパラス         100         427.00         42,700           システムリサーチ         100         1,896.00         189,600           インターネットイニシアティブ         300         5,130.00         1,539,000           さくらインターネット         200         800.00         160,000           ヴィンクス         100         1,300.00         130,000           S R Aホールディングス         100         716.00         71,600           朝日ネット         200         1,020.00         204,000           ウステムインテグレータ         100         716.00         71,600           朝日ネット         200         1,229.00         245,800           アバント         200         1,233.00         246,600           アドソル日進         100         1,611.00         101,100           コムチュア         200         2,901.00         880,200           アステリア         100         839.00         83,900           アイル         100         1,462.00         146,200           主製艇         300         332.00         99,600           北越コーポレーション         1,400         361.00	ティーガイア	200	1,945.00	389,000	
プロシップ 100 1,495.00 149,500 1 49,500 1	日本アジアグループ	200	312.00	62,400	
ザッパラス         100         427.00         42,700           システムリサーチ         100         1,896.00         189.600           インターネットイニシアティブ         300         5,130.00         1,539,000           さくらインターネット         200         800.00         160,000           ヴィンクス         100         1,300.00         330,000           S R Aホールディングス         100         716.00         71,600           朝日ネット         200         1,020.00         204,000           自 B A S E         200         1,229.00         245,800           アパント         200         1,233.00         266,600           アドソル日進         100         2,676.00         267,600           フリービット         100         1,011.00         101,100           コムチュア         200         2,901.00         580,200           アステリア         100         839.00         83,900           アステリア         100         1,462.00         146,200           三菱製紙         300         332.00         99,600           大北越コーボレーション         1,400         1,383.00         1349,000           中川戦紙         100         1,383.00         1349,000           大型紙         100         445.00	テクマトリックス	200	2,428.00	485,600	
システムリサーチ       100       1,896.00       189,600         インターネットイニシアティブ       300       5,130.00       1,539,000         さくらインターネット       200       800.00       160,000         ヴィンクス       100       1,300.00       130,000         S R Aホールディングス       100       716.00       71,600         朝日ネット       200       1,020.00       204,000         e B A S E       200       1,229.00       245,800         アバント       200       1,233.00       246,600         アドソル日進       100       1,011.00       101,100         コリーピット       100       1,011.00       101,100         コムチュア       200       2,901.00       580,200         アステリア       100       839.00       83,900         アステリア       100       1,482.00       146,200         三菱製紙       300       332.00       99,600         北越ノルブラション       1,400       361.00       505,400         中越バルブ       100       1,383.00       138,300         日川製紙       100       1,383.00       1342,800         阿波製紙       100       445.00       44,500         マクラインズ       200       3,140.00       628,000 <td>プロシップ</td> <td>100</td> <td>1,495.00</td> <td>149,500</td> <td></td>	プロシップ	100	1,495.00	149,500	
インターネットイニシアティブ 300 5.130.00 1.539,000 16くらインターネット 200 800.00 160,000 17くクス 100 1,300.00 130,000 130,000 17くクス 100 1,300.00 130,000 17くのの 2.373.00 237,300 237,300 237,300 237,300 237,300 237,300 237,300 237,300 237,300 237,300 237,300 237,300 237,300 237,300 237,300 247,000 18日ネット 200 1,020.00 204,000 204,000 20 8 A S E 200 1,229.00 245,800 アバント 200 1,233.00 246,600 アドンル日連 100 2,676.00 267,600 27,000 204,000	ザッパラス	100	427.00	42,700	
さくらインターネット 200 800.00 160,000 ガィンクス 100 1,300.00 130,000 SRAホールディングス 100 2,373.00 237,300 システムインデグレータ 100 716.00 71,600 列目ネット 200 1,020.00 244,000 e BASE 200 1,229.00 245,800 アバント 200 1,233.00 246,600 アドソル日進 100 2,676.00 267,600 フリービット 100 1,011.00 101,100 コムチュア 200 2,901.00 580,200 アステリア 100 839.00 83,900 アイル 100 1,462.00 146,200 三菱製紙 300 332.00 99,600 北越コーポレーション 1,400 361.00 505,400 中越バルブ 100 1,383.00 138,300 日川製紙 100 445.00 44,500 アークラインズ 100 445.00 44,500 アークラインズ 100 2,526.00 252,600 メディカル・データ・ビジ 200 3,140.00 628,000 夏u m i 300 946.00 283,800 モバイファクトリー 100 1,210.00 121,000 テラスカイ 100 1,210.00 152,100 オーブンドア 100 1,382.00 132,800 マイネット 100 1,211.00 121,100 アカツキ 100 4,860.00 486,000 カナミックネットワーク 100 897.00 89,700 トーモク 100 1,716.00 171,600 ザ・バック 200 2,925.00 585,000	システムリサーチ	100	1,896.00	189,600	
ヴィンクス       100       1,300.00       130,000         SRAホールディングス       100       2,373.00       237,300         システムインテグレータ       100       716.00       71,600         朝日ネット       200       1,020.00       204,000         e BASE       200       1,229.00       245,800         アバント       200       1,233.00       246,600         アドソル日進       100       2,676.00       267,600         フリーピット       100       1,011.00       101,100         コムチュア       200       2,901.00       580,200         アステリア       100       839.00       83,900         アイル       100       1,462.00       146,200         三菱製紙       300       332.00       99,600         北越コーポレーション       1,400       361.00       505,400         中越パルブ       100       1,383.00       138,300         世川製紙       100       1,492.00       1,342,800         所決製紙       100       949.00       34,900         大工製紙       100       4,526.00       252,600         メディカル・データ・ビジ       200       3,140.00       628,000         g u m i       300       946.00       283,800	インターネットイニシアティブ	300	5,130.00	1,539,000	
SRAボールディングス 100 2,373.00 237,300 システムインテグレータ 100 716.00 71,600 9月ネット 200 1,020.00 204,000 eBASE 200 1,229.00 245,800 アバント 200 1,233.00 246,600 アドソル日進 100 2,676.00 267,600 210,100 3	さくらインターネット	200	800.00	160,000	
システムインテグレータ       100       716.00       71,600         朝日ネット       200       1,020.00       204,000         e B A S E       200       1,229.00       245,800         アバント       200       1,233.00       246,600         アドソル日進       100       2,676.00       267,600         フリーピット       100       1,011.00       101,100         コムチュア       200       2,901.00       580,200         アステリア       100       839.00       83,900         アイル       100       1,462.00       146,200         三菱製紙       300       332.00       99,600         北越コーポレーション       1,400       361.00       505,400         中越パルブ       100       1,383.00       138,300         世川製紙       100       949.00       94,900         大工製紙       900       1,492.00       1,342,800         阿波製紙       100       445.00       44,500         マークラインズ       200       3,140.00       628,000         g u m i       300       946.00       283,800         モバイルファクトリー       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,521.00       152,100	ヴィンクス	100	1,300.00	130,000	
朝日ネット 200 1,020.00 204,000 e B A S E 200 1,229.00 245,800 アバント 200 1,233.00 246,600 アドソル日進 100 2,676.00 267,600 201,01,010 101,100 101,100 101,010 101,000 101,010 101,000 101,010 101,000 101,010 101,000 101,000 101,000 101,000 101,000 101,000 101,000 101,000 101,000 101,000 101,000 101,000 101,000 101,000 101,000 101,462.00 146,200 100 1,462.00 146,200 100 1,462.00 146,200 100 100 1,462.00 100 100 100 100 100 100 100 100 100	SRAホールディングス	100	2,373.00	237,300	
e B A S E       200       1,229.00       245,800         アバント       200       1,233.00       246,600         アドソル日進       100       2,676.00       267,600         フリーピット       100       1,011.00       101,100         コムチュア       200       2,901.00       580,200         アステリア       100       839.00       83,900         アイル       100       1,462.00       146,200         三菱製紙       300       332.00       99,600         北越コーポレーション       1,400       361.00       505,400         中越パルブ       100       1,383.00       138,300         世川製紙       100       949.00       94,900         大工製紙       900       1,492.00       1,342,800         阿波製紙       100       2,526.00       252,600         メディカル・データ・ビジ       200       3,140.00       628,000         gumi       300       946.00       283,800         モバイルファクトリー       100       1,521.00       152,100         オラスカイ       100       4,570.00       457,000         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,211.00       121,100	システムインテグレータ	100	716.00	71,600	
アドソル日建       200       1,233.00       246,600         アドソル日建       100       2,676.00       267,600         フリービット       100       1,011.00       101,100         コムチュア       200       2,901.00       580,200         アステリア       100       839.00       83,900         アイル       100       1,462.00       146,200         三菱製紙       300       332.00       99,600         北越コーポレーション       1,400       361.00       505,400         中越パルブ       100       1,383.00       138,300         巴川製紙       100       949.00       94,900         大工製紙       900       1,492.00       1,342,800         阿波製紙       100       2,526.00       252,600         メディカル・データ・ビジ       200       3,140.00       628,000         gumi       300       946.00       283,800         モバイルファクトリー       100       1,521.00       152,100         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オーブンドア       100       1,211.00       121,100         アカッキ       100       1,211.00       121,100         アカスナ       100       4,860.00       486,000 <t< td=""><td>朝日ネット</td><td>200</td><td>1,020.00</td><td>204,000</td><td></td></t<>	朝日ネット	200	1,020.00	204,000	
アドソル日進       100       2,676.00       267,600         フリーピット       100       1,011.00       101,100         コムチュア       200       2,901.00       580,200         アステリア       100       839.00       83,900         アイル       100       1,462.00       146,200         三菱製紙       300       332.00       99,600         北越コーポレーション       1,400       361.00       505,400         中越パルブ       100       1,383.00       138,300         巴川製紙       100       949.00       94,900         大王製紙       900       1,492.00       1,342,800         阿波製紙       100       445.00       44,500         マークラインズ       100       2,526.00       252,600         メディカル・データ・ビジ       200       3,140.00       628,000         gumi       300       946.00       283,800         モバイルファクトリー       100       1,210.00       152,100         デシスカイ       100       4,570.00       457,000         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,211.00       121,100         アカツキ       100       4,860.00       486,000 <tr< td=""><td>e B A S E</td><td>200</td><td>1,229.00</td><td>245,800</td><td></td></tr<>	e B A S E	200	1,229.00	245,800	
フリービット       100       1,011.00       101,100         コムチュア       200       2,901.00       580,200         アステリア       100       839.00       83,900         アイル       100       1,462.00       146,200         三菱製紙       300       332.00       99,600         北越コーポレーション       1,400       361.00       505,400         中越パルブ       100       1,383.00       138,300         巴川製紙       100       949.00       94,900         大工製紙       900       1,492.00       1,342,800         阿波製紙       100       445.00       44,500         マークラインズ       100       2,526.00       252,600         メディカル・データ・ビジ       200       3,140.00       628,000         gumi       300       946.00       283,800         モバイルファクトリー       100       1,210.00       121,000         デラスカイ       100       4,570.00       457,000         ボジタル・インフォメーション       100       1,521.00       132,800         マイネット       100       1,211.00       121,100         アカツキ       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700 <t< td=""><td>アバント</td><td>200</td><td>1,233.00</td><td>246,600</td><td></td></t<>	アバント	200	1,233.00	246,600	
コムチュア 200 2,901.00 580,200 アステリア 100 839.00 83,900 アイル 100 1,462.00 146,200 三菱製紙 300 332.00 99,600 北越コーポレーション 1,400 361.00 505,400 中越パルブ 100 1,383.00 138,300 円川製紙 100 949.00 94,900 大王製紙 900 1,492.00 1,342,800 阿波製紙 100 445.00 445.00 44,500 アークラインズ 100 2,526.00 252,600 メディカル・データ・ビジ 200 3,140.00 628,000 g u m i 300 946.00 283,800 モバイルファクトリー 100 1,210.00 121,000 デラスカイ 100 4,570.00 457,000 デジタル・インフォメーション 100 1,521.00 152,100 オープンドア 100 1,328.00 132,800 マイネット 100 4,860.00 486,000 カナミックネットワーク 100 897.00 89,700 トーモク 100 1,716.00 171,600 ザ・バック 200 2,925.00 585,000 585,000 ザ・バック 200 2,925.00 585,000	アドソル日進	100	2,676.00	267,600	
アステリア       100       839.00       83,900         アイル       100       1,462.00       146,200         三菱製紙       300       332.00       99,600         北越コーポレーション       1,400       361.00       505,400         中越パルプ       100       1,383.00       138,300         巴川製紙       100       949.00       94,900         大王製紙       900       1,492.00       1,342,800         阿波製紙       100       445.00       44,500         マークラインズ       100       2,526.00       252,600         メディカル・データ・ビジ       200       3,140.00       628,000         gumi       300       946.00       283,800         モバイルファクトリー       100       1,210.00       121,000         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       457,000         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,211.00       121,100         アカッキ       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700         トーモク       100       1,716.00       171,600         ザ・パック       200       2,925.00       585,000 <td>フリービット</td> <td>100</td> <td>1,011.00</td> <td>101,100</td> <td></td>	フリービット	100	1,011.00	101,100	
アイル       100       1,462.00       146,200         三菱製紙       300       332.00       99,600         北越コーポレーション       1,400       361.00       505,400         中越パルプ       100       1,383.00       138,300         巴川製紙       100       949.00       94,900         大王製紙       900       1,492.00       1,342,800         阿波製紙       100       445.00       44,500         マークラインズ       100       2,526.00       252,600         メディカル・データ・ビジ       200       3,140.00       628,000         gumi       300       946.00       283,800         モバイルファクトリー       100       1,210.00       121,000         デラスカイ       100       4,570.00       457,000         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,211.00       121,100         アカツキ       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700         トーモク       100       1,716.00       171,600         ザ・パック       200       2,925.00       585,000	コムチュア	200	2,901.00	580,200	
三菱製紙   300   332.00   99,600   北越コーポレーション   1,400   361.00   505,400   中越パルブ   100   1,383.00   138,300   日川製紙   100   949.00   94,900   人工製紙   900   1,492.00   1,342,800   阿波製紙   100   445.00   44,500   2,526.00   252,600   メディカル・データ・ビジ   200   3,140.00   628,000   g u m i   300   946.00   283,800   モバイルファクトリー   100   1,210.00   121,000   テラスカイ   100   4,570.00   457,000   ボジタル・インフォメーション   100   1,521.00   152,100   オープンドア   100   1,328.00   132,800   マイネット   100   4,860.00   486,000   カナミックネットワーク   100   897.00   89,700   トーモク   100   1,716.00   171,600   ザ・バック   200   2,925.00   585,000	アステリア	100	839.00	83,900	
北越コーポレーション       1,400       361.00       505,400         中越パルプ       100       1,383.00       138,300         巴川製紙       100       949.00       94,900         大王製紙       900       1,492.00       1,342,800         阿波製紙       100       445.00       44,500         マークラインズ       100       2,526.00       252,600         メディカル・データ・ビジ       200       3,140.00       628,000         gumi       300       946.00       283,800         モバイルファクトリー       100       1,210.00       121,000         デラスカイ       100       4,570.00       457,000         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,328.00       132,800         マイネット       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700         トーモク       100       1,716.00       171,600         ザ・パック       200       2,925.00       585,000	アイル	100	1,462.00	146,200	
中越パルプ       100       1,383.00       138,300         巴川製紙       100       949.00       94,900         大王製紙       900       1,492.00       1,342,800         阿波製紙       100       445.00       44,500         マークラインズ       100       2,526.00       252,600         メディカル・データ・ビジ       200       3,140.00       628,000         g u m i       300       946.00       283,800         モバイルファクトリー       100       1,210.00       121,000         デラスカイ       100       4,570.00       457,000         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,328.00       132,800         マイネット       100       1,211.00       121,100         アカツキ       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700         トーモク       100       1,716.00       171,600         ザ・パック       200       2,925.00       585,000	三菱製紙	300	332.00	99,600	
巴川製紙       100       949.00       94,900         大王製紙       900       1,492.00       1,342,800         阿波製紙       100       445.00       44,500         マークラインズ       100       2,526.00       252,600         メディカル・データ・ビジ       200       3,140.00       628,000         g u m i       300       946.00       283,800         モバイルファクトリー       100       1,210.00       121,000         デラスカイ       100       4,570.00       457,000         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,328.00       132,800         マイネット       100       1,211.00       121,100         アカツキ       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700         トーモク       100       1,716.00       171,600         ザ・パック       200       2,925.00       585,000	北越コーポレーション	1,400	361.00	505,400	
大王製紙 900 1,492.00 1,342,800 阿波製紙 100 445.00 44,500 マークラインズ 100 2,526.00 252,600 メディカル・データ・ビジ 200 3,140.00 628,000 g u m i 300 946.00 283,800 モバイルファクトリー 100 1,210.00 121,000 テラスカイ 100 4,570.00 457,000 デジタル・インフォメーション 100 1,521.00 152,100 オープンドア 100 1,328.00 132,800 マイネット 100 1,211.00 121,100 アカツキ 100 4,860.00 486,000 カナミックネットワーク 100 897.00 89,700 トーモク 100 1,716.00 171,600 ザ・パック 200 2,925.00 585,000	中越パルプ	100	1,383.00	138,300	
阿波製紙       100       445.00       44,500         マークラインズ       100       2,526.00       252,600         メディカル・データ・ビジ       200       3,140.00       628,000         g u m i       300       946.00       283,800         モバイルファクトリー       100       1,210.00       121,000         テラスカイ       100       4,570.00       457,000         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,328.00       132,800         マイネット       100       1,211.00       121,100         アカツキ       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700         トーモク       100       1,716.00       171,600         ザ・パック       200       2,925.00       585,000	巴川製紙	100	949.00	94,900	
マークラインズ 100 2,526.00 252,600 メディカル・データ・ビジ 200 3,140.00 628,000 g u m i 300 946.00 121,000 121,000 デラスカイ 100 4,570.00 457,000 デジタル・インフォメーション 100 1,328.00 132,800 マイネット 100 1,211.00 121,100 アカツキ 100 4,860.00 486,000 カナミックネットワーク 100 897.00 89,700 トーモク 100 1,716.00 171,600 が・パック 200 2,925.00 585,000	大王製紙	900	1,492.00	1,342,800	
メディカル・データ・ビジ 200 3,140.00 628,000 g u m i 300 946.00 283,800 モバイルファクトリー 100 1,210.00 121,000 テラスカイ 100 4,570.00 457,000 デジタル・インフォメーション 100 1,521.00 152,100 オープンドア 100 1,328.00 132,800 マイネット 100 1,211.00 121,100 アカツキ 100 4,860.00 486,000 カナミックネットワーク 100 897.00 89,700 トーモク 100 1,716.00 171,600 ザ・パック 200 2,925.00 585,000	阿波製紙	100	445.00	44,500	
g u m i     300     946.00     283,800       モバイルファクトリー     100     1,210.00     121,000       テラスカイ     100     4,570.00     457,000       デジタル・インフォメーション     100     1,521.00     152,100       オープンドア     100     1,328.00     132,800       マイネット     100     1,211.00     121,100       アカツキ     100     4,860.00     486,000       カナミックネットワーク     100     897.00     89,700       トーモク     100     1,716.00     171,600       ザ・パック     200     2,925.00     585,000	マークラインズ	100	2,526.00	252,600	
モバイルファクトリー       100       1,210.00       121,000         テラスカイ       100       4,570.00       457,000         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,328.00       132,800         マイネット       100       1,211.00       121,100         アカツキ       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700         トーモク       100       1,716.00       171,600         ザ・パック       200       2,925.00       585,000	メディカル・データ・ビジ	200	3,140.00	628,000	
テラスカイ       100       4,570.00       457,000         デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,328.00       132,800         マイネット       100       1,211.00       121,100         アカツキ       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700         トーモク       100       1,716.00       171,600         ザ・パック       200       2,925.00       585,000	gumi	300	946.00	283,800	
デジタル・インフォメーション       100       1,521.00       152,100         オープンドア       100       1,328.00       132,800         マイネット       100       1,211.00       121,100         アカツキ       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700         トーモク       100       1,716.00       171,600         ザ・パック       200       2,925.00       585,000	モバイルファクトリー	100	1,210.00	121,000	
オープンドア 100 1,328.00 132,800 マイネット 100 1,211.00 121,100 アカツキ 100 4,860.00 486,000 カナミックネットワーク 100 897.00 89,700 トーモク 100 1,716.00 171,600 ザ・パック 200 2,925.00 585,000	テラスカイ	100	4,570.00	457,000	
マイネット       100       1,211.00       121,100         アカツキ       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700         トーモク       100       1,716.00       171,600         ザ・パック       200       2,925.00       585,000	デジタル・インフォメーション	100	1,521.00	152,100	
アカツキ       100       4,860.00       486,000         カナミックネットワーク       100       897.00       89,700         トーモク       100       1,716.00       171,600         ザ・パック       200       2,925.00       585,000	オープンドア	100	1,328.00	132,800	
カナミックネットワーク 100 897.00 89,700 トーモク 100 1,716.00 171,600 ザ・パック 200 2,925.00 585,000	マイネット	100	1,211.00	121,100	
トーモク 100 1,716.00 171,600 ザ・パック 200 2,925.00 585,000	アカツキ	100	4,860.00	486,000	
ザ・パック 200 2,925.00 585,000	カナミックネットワーク	100	897.00	89,700	
	トーモク	100	1,716.00	171,600	
シンクロ・フード 100 323.00 32,300	ザ・パック	200	2,925.00	585,000	
	シンクロ・フード	100			

			有価証券届出書(内国	国投資信託
オークネット	100	1,516.00	151,600	
AOI TYO HOLDINGS	200	426.00	85,200	
マクロミル	400	750.00	300,000	
オロ	100	3,625.00	362,500	
住友精化	100	3,585.00	358,500	
ラサ工業	100	2,106.00	210,600	
クレハ	200	4,600.00	920,000	
多木化学	100	6,870.00	687,000	
テイカ	200	1,406.00	281,200	
石原産業	400	715.00	286,000	
片倉コープアグリ	100	1,254.00	125,400	
日本曹達	300	2,865.00	859,500	
大阪ソーダ	200	2,568.00	513,600	
関東電化	500	723.00	361,500	
日本力 - バイド	100	1,289.00	128,900	
堺 化 学	100	2,000.00	200,000	
第一稀元素化学工	200	719.00	143,800	
日本化学工業	100	2,365.00	236,500	
高圧ガス	300	816.00	244,800	
四国化成	300	1,164.00	349,200	
ステラ ケミファ	100	2,971.00	297,100	
保土谷化学	100	5,030.00	503,000	
大日精化	200	2,282.00	456,400	
大阪有機化学	200	2,555.00	511,000	
K Hネオケム	400	2,631.00	1,052,400	
<b>積水樹脂</b>	400	2,105.00	842,000	
タキロンシーアイ	500	699.00	349,500	
旭有機材	100	1,356.00	135,600	
ニチバン	100	1,664.00	166,400	
リケンテクノス	500	411.00	205,500	
大倉工業	100	1,849.00	184,900	
積水化成品	300	587.00	176,100	
タイガース ポリマー	100	424.00	42,400	
ミライアル	100	1,154.00	115,400	
ダイキアクシス	100	906.00	90,600	
ダイキョーニシカワ	400	631.00	252,400	
竹本容器	100	1,064.00	106,400	
森六ホールディングス	100	1,840.00	184,000	
カーリットホールディングス	200	511.00	102,200	
EPSホールディングス	300	989.00	296,700	
L F 3 小一ルテイング人	300	909.00	290,700	

			有価証券届出書(内国	投資信託
ソルクシーズ	100	1,153.00	115,300	
レッグス	100	1,135.00	113,500	
プレステージ・インター	800	888.00	710,400	
フェイス	100	979.00	97,900	
プロトコーポレーション	200	1,290.00	258,000	
アミューズ	100	2,725.00	272,500	
ドリームインキュベータ	100	1,451.00	145,100	
サイバネットシステム	200	959.00	191,800	
クイック	100	1,100.00	110,000	
TAC	100	218.00	21,800	
CEホールディングス	100	692.00	69,200	
ケネディクス	1,900	536.00	1,018,400	
インテージホールディングス	300	980.00	294,000	
テイクアンドギヴニーズ	100	612.00	61,200	
東邦システムサイエンス	100	930.00	93,000	
ぴあ	100	3,075.00	307,500	
イオンファンタジー	100	2,237.00	223,700	
ソースネクスト	1,000	319.00	319,000	
シーティーエス	200	961.00	192,200	
ネクシィーズグループ	100	1,054.00	105,400	
インフォコム	200	4,375.00	875,000	
メディカルシステムネットワーク	200	467.00	93,400	
日本精化	200	1,592.00	318,400	
扶桑化学工業	200	3,790.00	758,000	
ラクスル	100	4,640.00	464,000	
FIG	200	274.00	54,800	
ミヨシ油脂	100	1,137.00	113,700	
新日本理化	300	161.00	48,300	
ハリマ化成グループ	200	1,151.00	230,200	
イーソル	100	1,282.00	128,200	
アルテリア・ネットワークス	200	1,798.00	359,600	
第一工業製薬	100	3,910.00	391,000	
石原ケミカル	100	2,119.00	211,900	
日華化学	100	983.00	98,300	
三洋化成	100	4,795.00	479,500	
わかもと製薬	300	259.00	77,700	
ー あすか製薬	200	1,405.00	281,000	
理研ビタミン	200	1,420.00	284,000	
有機合成薬品	200	329.00	65,800	
扶桑薬品	100	2,698.00	269,800	
	I .			

日医工	600	1,111.00	888 800	
		.,	666,600	
生化学工業	400	1,001.00	400,400	
栄研化学	400	2,280.00	912,000	
日水製薬	100	1,105.00	110,500	
鳥居薬品	100	3,055.00	305,500	
J C R ファーマ	800	2,732.00	2,185,600	
東和薬品	300	2,017.00	605,100	
富士製薬工業	100	1,202.00	120,200	
ゼリア新薬工業	400	1,886.00	754,400	
キョーリン製薬HD	500	2,014.00	1,007,000	
大幸薬品	300	1,991.00	597,300	
ダイト	100	4,100.00	410,000	
大日本塗料	200	935.00	187,000	
神東塗料	200	174.00	34,800	
中国塗料	600	1,015.00	609,000	
日本特殊塗料	200	988.00	197,600	
藤倉化成	300	512.00	153,600	
太陽ホールディングス	200	5,540.00	1,108,000	
サカタインクス	500	1,127.00	563,500	
東洋インキSCホールディン	400	2,052.00	820,800	
T&K TOKA	200	824.00	164,800	
アルプス技研	200	2,065.00	413,000	
サニックス	400	250.00	100,000	
日本空調サービス	200	737.00	147,400	
フォーカスシステムズ	100	975.00	97,500	
明光ネットワークジャパン	200	668.00	133,600	
ファルコホールディングス	100	1,482.00	148,200	
クレスコ	200	1,307.00	261,400	
ラウンドワン	600	937.00	562,200	
ジャストシステム	300	7,080.00	2,124,000	
TDCVフト	200	1,130.00	226,000	
ビー・エム・エル	300	3,080.00	924,000	
りらいあコミュニケーショ	400	1,267.00	506,800	
IDホールディングス	100	1,424.00	142,400	
リソー教育	900	333.00	299,700	
早稲田アカデミー	100	994.00	99,400	
アルファシステムズ	100	3,440.00	344,000	
フューチャー	300	2,261.00	678,300	
CAC HOLDINGS	100	1,397.00	139,700	
SBテクノロジー	100	3,730.00	373,000	

			有価証券届出書(内国	国投資信託
トーセ	100	874.00	87,400	
オービックビジネスC	200	5,560.00	1,112,000	
アイティフォー	300	916.00	274,800	
東京個別指導学院	100	605.00	60,500	
クリーク・アンド・リバー社	100	1,093.00	109,300	
テー・オー・ダブリュー	400	311.00	124,400	
サイボウズ	200	3,300.00	660,000	
ソフトブレーン	100	868.00	86,800	
山田コンサルティング G P	100	1,112.00	111,200	
セントラルスポーツ	100	2,243.00	224,300	
パラカ	100	1,599.00	159,900	
電通国際情報 S	100	6,730.00	673,000	
ACCESS	200	844.00	168,800	
デジタルガレージ	400	3,690.00	1,476,000	
イーエムシステムズ	400	830.00	332,000	
ウェザーニューズ	100	5,530.00	553,000	
CIJ	100	904.00	90,400	
日本エンタープライズ	200	260.00	52,000	
wowow	100	2,942.00	294,200	
スカラ	200	935.00	187,000	
インテリジェント ウェイブ	100	787.00	78,700	
フルキャストホールディングス	200	1,806.00	361,200	
エン・ジャパン	400	2,724.00	1,089,600	
高砂香料	100	2,183.00	218,300	
マンダム	500	1,832.00	916,000	
ミルボン	300	5,340.00	1,602,000	
コタ	100	1,334.00	133,400	
ノエビアホールディングス	200	4,785.00	957,000	
エステー	100	2,095.00	209,500	
アグロカネショウ	100	1,642.00	164,200	
コニシ	300	1,490.00	447,000	
長谷川香料	300	2,121.00	636,300	
星光 P M C	100	654.00	65,400	
二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十	200	1,239.00	247,800	
メック	100	2,215.00	221,500	
日本高純度化学	100	2,588.00	258,800	
タカラバイオ	600	2,818.00	1,690,800	
J C N	300	3,275.00	982,500	
  新田ゼラチン	100	691.00	69,100	
デクセリアルズ	500	1,151.00	575,500	
	_	l .	·	ш

アース製業 200 6,900.00 1,380,000 1		1	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	有価証券届出書(内国	1技具155
大成ラミック 100 2,792.00 279,200 かミアイ化学 900 1,046.00 941,400 日本農薬 400 502.00 200,800 富士興産 100 813.00 813.00 1.678.00 503,400 ユジレイ学 100 1,361.00 136,100 ピーピー・カストロール 100 1,243.00 124,300 富士石油 600 185.00 111,000 MORESCO 100 1,066.00 425,500 425,500 アキレス 100 1,712.00 171,200 ブェクタ 200 2,290.00 458,000 グリエートメディック 100 1,025.00 122,500 住友理工 400 562.00 224,800 ラリンド・化学 400 604.00 241,600 日本地付帽子 100 1,265.00 125,500 日本地付帽子 100 1,255.00 287,100 日本山付帽子 100 1,255.00 125,500 日本山付帽子 100 1,255.00 125,500 日本山付帽子 100 1,255.00 155,600 日本山付帽子 100 1,255.00 155,600 日本山プリート 500 311.00 155,500 日本カンプリート 500 311.00 155,500 日本カンプリート 500 311.00 155,500 日本カンプリート 500 311.00 155,500 日本カーボン 100 1,265.00 140,000 日本カーボン 100 3,720.00 東洋栄素 100 1,806.00 156.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 東洋栄素 100 1,806.00 156,600 170,000 月グトーホールディングス 200 672.00 134,400 MARUMA 100 9,750.00 154,800 170,000 月グライルリフラクトリーズ 100 1,806.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 東洋栄素 100 1,806.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 東洋栄素 100 1,806.00 156,600 140,100 日本クイ 700.00 775,000 159,600 159,600 170,000 万列・アクイ 700.00 775,000 月列・アク・アク・アク・アク・アク・アク・アク・アク・アク・アク・アク・アク・アク・	アース製薬	200	6,900.00	1,380,000	
クミアイ化学       900       1,046.00       941,400         日本農業       400       502.00       200.800         富士興産       100       813.00       81,300         二チレキ       300       1,678.00       503,400         ユシロ化学       100       1,361.00       136,100         ビービー・カストロール       100       1,243.00       124,300         富士石油       600       185.00       111,000         MORESCO       100       1,006.00       100,600         藤倉コンボジット       200       348.00       69,600         オカモト       100       4,255.00       425,500         アキレス       100       1,712.00       71,200         フコ ク       100       649.00       64,900         ニッタ       200       2,290.00       458,000         クリエートメディック       100       1,026.00       102,500         住友理工       400       562.00       224.800         三ツ星ベルト       300       1,681.00       504.300         パンドー化学       40       604.00       241,600         日本板硝子       1,000       389.00       389,000         有沢製作所       300       957.00       287,100         日本山村硝子	北興化学	200	840.00	168,000	,
日本農薬 400 502.00 200,800 富士興産 100 813.00 81,300 81,300 31,678.00 503,400 1,678.00 503,400 1,678.00 136,100 ビービー・カストロール 100 1,243.00 124,300 富士石油 600 185.00 1111.000 600 藤富コンボジット 200 348.00 69,600 オカモト 100 4,255.00 425,500 7キレス 100 1,712.00 171,200 7リエートメディック 100 1,025.00 102,500 102,500 102,500 102,500 102,500 103,8	大成ラミック	100	2,792.00	279,200	
富士興産 100 813.00 81,300	クミアイ化学	900	1,046.00	941,400	
コチレキ 300 1,678.00 503,400 コシロ化学 100 1,361.00 136,100 ビービー・カストロール 100 1,243.00 124,300 富士石油 600 185.00 111,000 MORESCO 100 1,006.00 100,600 藤倉コンボジット 200 348.00 69,600 オカモト 100 4,255.00 425,500 アキレス 100 1,712.00 171,200 フョク 100 649.00 64,900 ニッタ 200 2,290.00 488,000 クリエートメディック 100 1,025.00 102,500 住友理工 400 562.00 224,800 三ツ星ベルト 300 1,681.00 504,300 バンドー化学 400 604.00 241,600 日本山村硝子 300 859.00 389,000 有別時所 300 957.00 287,100 日本出村硝子 100 1,255.00 125,500 日本出村硝子 100 1,255.00 125,500 日本出土イバー 100 1,255.00 125,500 日本コンクリート 500 311.00 155,500 日本コンクリート 500 311.00 155,500 アジアバイルHD 300 467.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,866.00 180,600 月リタケ 100 3,155.00 315,500 第元,000 日本リフラクトリーズ 200 798.00 159,600 イソライト 100 9,750.00 375,000 月末院業 300 319.00 95,700 257,000 東京院業 300 319.00 95,700 200 77,000 155,600 129,500 129,500 129,500 129,500 140,100 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,866.00 180,600 10	日本農薬	400	502.00	200,800	
コシロ化学 100 1,361.00 136,100 だーピー・カストロール 100 1,243.00 124,300 富士石油 600 185.00 111,000 MORESCO 100 1,006.00 100,600 勝倉コンボジット 200 348.00 69,600 オカモト 100 4,255.00 425,500 アキレス 100 1,712.00 171,200 7ッキレス 100 649.00 64,900 ラッタ 200 2,290.00 488,000 クリエートメディック 100 1,025.00 102,500 住友理工 400 562.00 224,800 三ツ星ベルト 300 1,681.00 504,300 バンドー化学 400 604.00 241,600 日本比付研子 1,000 389.00 389,000 有決製作所 300 957.00 287,100 日本出付研子 100 1,255.00 125,500 日本出付研子 100 1,255.00 155,400 日本上コ・ム 200 777.00 155,400 日本コンクリ・ト 500 311.00 155,500 三分七・サン 100 5,270.00 527,000 アジアパイルHD 300 467.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 140,100 日本カーボン 100 3,750.00 375,000 第7,000 第7,000 第7,000 第7,000 第7,000 第7,000 第7,000 159,600 140,100 日本月リフラクトリーズ 100 3,750.00 315,500 315,500 第京 319,00 47,800 東京窯業 300 319.00 95,700 29,700 175,000 1775,000 175,000 1775,000	富士興産	100	813.00	81,300	
ビービー・カストロール       100       1,243.00       124,300         富士石油       600       185.00       111,000         MORESCO       100       1,006.00       100,600         藤倉コンポジット       200       348.00       69,600         オカモト       100       4,255.00       425,500         アキレス       100       1,712.00       171,200         フ コ ク       100       649.00       64,900         ニッタ       200       2,290.00       458,000         クリエートメディック       100       1,025.00       102,500         性友理工       400       562.00       224,800         三ツ星ペルト       300       1,681.00       504,300         バンドー化学       400       604.00       241,600         日本板硝子       1,000       389.00       389,000         有沢製作所       300       957.00       287,100         日本山村硝子       100       859.00       85,900         オハラ       100       1,255.00       125,500         日本上コ・ム       200       777.00       155,400         日本ニコ・ム       200       777.00       155,400         日本ニコ・ム       200       777.00       155,500         日本ヒコ・ム </td <td>ニチレキ</td> <td>300</td> <td>1,678.00</td> <td>503,400</td> <td></td>	ニチレキ	300	1,678.00	503,400	
富士石油       600       185.00       111,000         MORESCO       100       1,006.00       100,600         藤倉コンボジット       200       348.00       69,600         オカモト       100       4,255.00       425,500         アキレス       100       1,712.00       171,200         フ コ ク       100       649.00       64,900         ニッタ       200       2,290.00       458,000         クリエートメディック       100       1,025.00       102,500         住友理工       400       562.00       224,800         ピンタペルト       300       1,681.00       504,300         パンドー化学       400       604.00       241,600         日本板硝子       1,000       389.00       389,000         有沢製作所       300       957.00       287,100         日本山村硝子       100       859.00       85,900         オハラ       100       1,255.00       125,500         日本とコ・ム       200       777.00       155,400         日本コンクリ・ト       500       311.00       155,500         三谷セキサン       100       5,270.00       372,000         アジアパイルトロ       30       467.00       140,100         日本カーボン <td>ユシロ化学</td> <td>100</td> <td>1,361.00</td> <td>136,100</td> <td></td>	ユシロ化学	100	1,361.00	136,100	
MORESCO 100 1,006.00 100,600 藤倉コンボジット 200 348.00 69,600 オカモト 100 4,255.00 425,500 アキレス 100 1,712.00 171,200 フコク 100 649.00 64,900 2,290.00 458,000 グリエートメディック 100 1,025.00 102,500 住友理工 400 562.00 224,800 三ツ星ベルト 300 1,681.00 504,300 バンド・化学 400 604.00 241,600 日本板硝子 1,000 389.00 389,000 有沢製作所 300 957.00 287,100 日本山村硝子 100 1,255.00 125,500 日本ヒコ・ム 200 777.00 155,400 日本コンクリ・ト 500 311.00 155,500 三谷セキサン 700 155,400 日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 180,600 月りタケ 100 3,155.00 315,500 日本ルデン 100 1,806.00 180,600 月リタケ 100 3,750.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 180,600 月リタケ 100 3,155.00 315,500 日本リフラクトリーズ 200 672.00 134,400 MARUWA 100 9,750.00 975,000 日カイスの0 159,600 イソライト 100 2,459.00 245,900 日カイスの0 159,600 イソライト 100 478.00 478.00 年京窯業 300 319.00 95,700 ニッカトー 100 700.00 775,000 アジミインコーボレーテッド 200 3,875.00 775,000 アジミインコーボレーテッド 200 3,875.00 775,000 アジミインコーボレーテッド 200 3,875.00 775,000	ビーピー・カストロール	100	1,243.00	124,300	
藤倉コンポジット 200 348.00 69,600 オカモト 100 4,255.00 425,500 アキレス 100 1,712.00 171,200 フ ク 100 649.00 64,900	富士石油	600	185.00	111,000	
オカモト 100 4,255.00 425,500 アキレス 100 1,712.00 171,200 フ 2 ク 100 649.00 64,900	MORESCO	100	1,006.00	100,600	
アキレス       100       1,712.00       171,200         フ コ ク       100       649.00       64,900         ニッタ       200       2,290.00       458,000         クリエートメディック       100       1,025.00       102,500         住友理工       400       562.00       224,800         三ツ星ベルト       300       1,681.00       504,300         パンドー化学       400       604.00       241,600         日本板硝子       1,000       389.00       389,000         有沢製作所       300       957.00       287,100         日本山村硝子       100       859.00       85,900         オハラ       100       1,255.00       125,500         日本ヒューム       200       777.00       155,400         日本コンクリート       500       311.00       155,500         日本コンクリート       300       467.00       140,100         日本カーボン       100       3,720.00       372,000         東洋炭素       100       1,806.00       180,600         ノリタケ       100       3,155.00       315,500         ダントーホールディングス       200       672.00       134,400         MARUMA       100       9,750.00       245,900         ヨータ	藤倉コンポジット	200	348.00	69,600	
フ コ ク       100       649.00       64,900         ニッタ       200       2,290.00       458,000         クリエートメディック       100       1,025.00       102,500         住友理工       400       562.00       224,800         三ツ星ベルト       300       1,681.00       504,300         パンドー化学       400       604.00       241,600         日本板硝子       1,000       389.00       389,000         有沢製作所       300       957.00       287,100         日本山村硝子       100       859.00       85,900         オハラ       100       1,255.00       125,500         日本ヒコ・ム       200       777.00       155,400         日本コンクリ・ト       500       311.00       155,500         三谷セキサン       100       5,270.00       527,000         アジアパイルHD       300       467.00       140,100         日本カーボン       100       3,720.00       372,000         東洋炭素       100       1,806.00       180,600         メリタケ       100       3,155.00       315,500         ダントーホールディングス       200       672.00       134,400         MARUWA       100       9,750.00       245,900         ヨ	オカモト	100	4,255.00	425,500	
ニッタ       200       2,290.00       458,000         クリエートメディック       100       1,025.00       102,500         住友理工       400       562.00       224,800         三ツ星ベルト       300       1,681.00       504,300         パンドー化学       400       604.00       241,600         日本板硝子       1,000       389.00       389,000         有沢製作所       300       957.00       287,100         日本山村硝子       100       859.00       85,900         オハラ       100       1,255.00       125,500         日本ヒユ・ム       200       777.00       155,400         日本コンクリ・ト       500       311.00       155,500         三谷セキサン       100       5,270.00       527,000         アジアパイルHD       300       467.00       140,100         日本カーボン       100       3,720.00       372,000         東洋炭素       100       1,806.00       180,600         ノリタケ       100       3,155.00       315,500         ダントーホールディングス       200       672.00       134,400         MARUWA       100       9,750.00       245,900         ヨータイ       200       798.00       159,600         イ	アキレス	100	1,712.00	171,200	
クリエートメディック       100       1,025.00       102,500         住友理工       400       562.00       224,800         三ツ星ベルト       300       1,681.00       504,300         パンドー化学       400       604.00       241,600         日本版硝子       1,000       389.00       389,000         有沢製作所       300       957.00       287,100         日本山村硝子       100       859.00       85,900         オハラ       100       1,255.00       125,500         日本ヒユ・ム       200       777.00       155,400         日本コンクリ・ト       500       311.00       155,500         三谷セキサン       100       5,270.00       527,000         アジアパイルHD       300       467.00       140,100         日本カーポン       100       3,720.00       372,000         東洋炭素       100       1,806.00       180,600         ノリタケ       100       3,155.00       315,500         ダントーホールディングス       200       672.00       134,400         MARUWA       100       9,750.00       245,900         ヨータイ       200       798.00       159,600         イソライト       100       478.00       47,800         東	フコク	100	649.00	64,900	
世友理工 400 562.00 224,800 三ツ星ベルト 300 1,681.00 504,300 バンドー化学 400 604.00 241,600 日本板硝子 1,000 389.00 389,000 有沢製作所 300 957.00 287,100 日本山村硝子 100 859.00 85,900 オハラ 100 1,255.00 125,500 日本ヒコ・ム 200 777.00 155,400 日本コンクリ・ト 500 311.00 155,500 三谷セキサン 100 5,270.00 527,000 アジアパイルHD 300 467.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 180,600 ノリタケ 100 3,155.00 315,500 315,500 第分 100 3,155.00 315,500 第分として、アジアパイルトプロングス 200 672.00 134,400 MARUWA 100 9,750.00 975,000 ヨータイ 200 798.00 159,600 イソライト 100 478.00 47,800 東京窯業 300 319.00 95,700 ニッカトー 100 700.00 775,000 アジアパロンディア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・ア・	ニッタ	200	2,290.00	458,000	
三ツ星ベルト       300       1,681.00       504,300         パンドー化学       400       604.00       241,600         日本板硝子       1,000       389.00       389,000         有沢製作所       300       957.00       287,100         日本山村硝子       100       859.00       85,900         オハラ       100       1,255.00       125,500         日本ヒュ・ム       200       777.00       155,400         日本コンクリ・ト       500       311.00       155,500         三谷セキサン       100       5,270.00       527,000         アジアパイルHD       300       467.00       140,100         日本カーボン       100       3,720.00       372,000         東洋炭素       100       1,806.00       180,600         ノリタケ       100       3,155.00       315,500         ダントーホールディングス       200       672.00       134,400         MARUWA       100       9,750.00       975,000         島川リフラクトリーズ       100       2,459.00       245,900         ヨータイ       200       798.00       159,600         イソライト       100       478.00       47,800         東京窯業       300       319.00       70,000         フジミ	クリエートメディック	100	1,025.00	102,500	
バンドー化学 400 604.00 241,600 日本板硝子 1,000 389.00 389,000 389,000 389,000 389,000 有沢製作所 300 957.00 287,100 日本山村硝子 100 859.00 85,900 125,500 日本ヒュ・ム 200 777.00 155,400 日本コンクリ・ト 500 311.00 155,500 三谷セキサン 100 5,270.00 527,000 アジアパイルHD 300 467.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 180,600 ノリタケ 100 3,155.00 315,500 315,500 ダントーホールディングス 200 672.00 134,400 MARUWA 100 9,750.00 975,000 日川リフラクトリーズ 100 2,459.00 245,900 ヨータイ 200 798.00 159,600 イソライト 100 478.00 47,800 東京窯業 300 319.00 95,700 アジアインコーポレーテッド 200 3,875.00 775,000	住友理工	400	562.00	224,800	
日本板硝子 1,000 389.00 389,000 有沢製作所 300 957.00 287,100 日本山村硝子 100 859.00 85,900 オハラ 100 1,255.00 125,500 日本ヒュ・ム 200 777.00 155,400 日本コンクリ・ト 500 311.00 155,500 三谷セキサン 100 5,270.00 527,000 アジアパイルHD 300 467.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 180,600 ノリタケ 100 3,155.00 315,500 ダントーホールディングス 200 672.00 134,400 MARUWA 100 9,750.00 975,000 品川リフラクトリーズ 100 2,459.00 245,900 ヨータイ 200 798.00 159,600 イソライト 100 478.00 47,800 東京窯業 300 319.00 95,700 ニッカトー 100 700.00 70,000 フジミインコーポレーテッド 200 3,875.00 775,000	三ツ星ベルト	300	1,681.00	504,300	
有沢製作所 300 957.00 287,100 日本山村硝子 100 859.00 85,900 オハラ 100 1,255.00 125,500 日本ヒユ・ム 200 777.00 155,400 日本コンクリ・ト 500 311.00 155,500 三谷セキサン 100 5,270.00 527,000 アジアパイルHD 300 467.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 180,600 ノリタケ 100 3,155.00 315,500 第27,000 第27	バンドー化学	400	604.00	241,600	
日本山村硝子 100 859.00 85,900 17八ラ 100 1,255.00 125,500 日本ヒユ・ム 200 777.00 155,400 日本コンクリ・ト 500 311.00 155,500 三谷セキサン 100 5,270.00 527,000 月本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 180,600 ノリタケ 100 3,155.00 315,500 315,500 第次トーホールディングス 200 672.00 134,400 MARUWA 100 9,750.00 975,000 日川リフラクトリーズ 100 2,459.00 245,900 ヨータイ 200 798.00 159,600 イソライト 100 478.00 47,800 東京窯業 300 319.00 95,700 ニッカトー 100 700.00 775,000	日本板硝子	1,000	389.00	389,000	
オハラ 100 1,255.00 125,500 125,500 日本ヒユ・ム 200 777.00 155,400 日本ヒユ・ム 200 777.00 155,400 日本コンクリ・ト 500 311.00 155,500 三谷セキサン 100 5,270.00 527,000 アジアパイルHD 300 467.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 180,600 ノリタケ 100 3,155.00 315,500 ダントーホールディングス 200 672.00 134,400 MARUWA 100 9,750.00 975,000 日川リフラクトリーズ 100 2,459.00 245,900 ヨータイ 200 798.00 159,600 イソライト 100 478.00 47,800 東京窯業 300 319.00 95,700 ニッカトー 100 700.00 70,000 フジミインコーポレーテッド 200 3,875.00 775,000	有沢製作所	300	957.00	287,100	
日本ヒユ・ム 200 777.00 155,400 日本コンクリ・ト 500 311.00 155,500 三谷セキサン 100 5,270.00 527,000 アジアパイルHD 300 467.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 180,600 ノリタケ 100 3,155.00 315,500 ダントーホールディングス 200 672.00 134,400 MARUWA 100 9,750.00 975,000 日川リフラクトリーズ 100 2,459.00 245,900 ヨータイ 200 798.00 159,600 イソライト 100 478.00 47,800 東京窯業 300 319.00 95,700 ニッカトー 100 700.00 70,000 フジミインコーポレーテッド 200 3,875.00 775,000	日本山村硝子	100	859.00	85,900	
日本コンクリ・ト 500 311.00 155,500 三谷セキサン 100 5,270.00 527,000 アジアパイルHD 300 467.00 140,100 日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 180,600 ノリタケ 100 3,155.00 315,500 ダントーホールディングス 200 672.00 134,400 MARUWA 100 9,750.00 975,000 日川リフラクトリーズ 100 2,459.00 245,900 コータイ 200 798.00 159,600 イソライト 100 478.00 47,800 東京窯業 300 319.00 95,700 フジミインコーポレーテッド 200 3,875.00 775,000	オハラ	100	1,255.00	125,500	
三谷セキサン       100       5,270.00       527,000         アジアパイルHD       300       467.00       140,100         日本カーボン       100       3,720.00       372,000         東洋炭素       100       1,806.00       180,600         ノリタケ       100       3,155.00       315,500         ダントーホールディングス       200       672.00       134,400         MARUWA       100       9,750.00       975,000         品川リフラクトリーズ       100       2,459.00       245,900         ヨータイ       200       798.00       159,600         イソライト       100       478.00       47,800         東京窯業       300       319.00       95,700         ニッカトー       100       700.00       70,000         フジミインコーポレーテッド       200       3,875.00       775,000	日本ヒユ - ム	200	777.00	155,400	
アジアパイルHD       300       467.00       140,100         日本カーボン       100       3,720.00       372,000         東洋炭素       100       1,806.00       180,600         ノリタケ       100       3,155.00       315,500         ダントーホールディングス       200       672.00       134,400         MARUWA       100       9,750.00       975,000         品川リフラクトリーズ       100       2,459.00       245,900         ヨータイ       200       798.00       159,600         イソライト       100       478.00       47,800         東京窯業       300       319.00       95,700         ニッカトー       100       700.00       70,000         フジミインコーポレーテッド       200       3,875.00       775,000	日本コンクリ - ト	500	311.00	155,500	
日本カーボン 100 3,720.00 372,000 東洋炭素 100 1,806.00 180,600 100 3,155.00 315,500 315,500 315,500 がントーホールディングス 200 672.00 134,400 MARUWA 100 9,750.00 975,000 日川リフラクトリーズ 100 2,459.00 245,900 コータイ 200 798.00 159,600 イソライト 100 478.00 47,800 東京窯業 300 319.00 95,700 フジミインコーポレーテッド 200 3,875.00 775,000	三谷セキサン	100	5,270.00	527,000	
東洋炭素     100     1,806.00     180,600       ノリタケ     100     3,155.00     315,500       ダントーホールディングス     200     672.00     134,400       MARUWA     100     9,750.00     975,000       品川リフラクトリーズ     100     2,459.00     245,900       ヨータイ     200     798.00     159,600       イソライト     100     478.00     47,800       東京窯業     300     319.00     95,700       ニッカトー     100     700.00     70,000       フジミインコーポレーテッド     200     3,875.00     775,000	アジアパイルHD	300	467.00	140,100	
ノリタケ     100     3,155.00     315,500       ダントーホールディングス     200     672.00     134,400       MARUWA     100     9,750.00     975,000       品川リフラクトリーズ     100     2,459.00     245,900       ヨータイ     200     798.00     159,600       イソライト     100     478.00     47,800       東京窯業     300     319.00     95,700       ニッカトー     100     700.00     70,000       フジミインコーポレーテッド     200     3,875.00     775,000	日本カーボン	100	3,720.00	372,000	
ダントーホールディングス       200       672.00       134,400         MARUWA       100       9,750.00       975,000         品川リフラクトリーズ       100       2,459.00       245,900         ヨータイ       200       798.00       159,600         イソライト       100       478.00       47,800         東京窯業       300       319.00       95,700         ニッカトー       100       700.00       70,000         フジミインコーポレーテッド       200       3,875.00       775,000	東洋炭素	100	1,806.00	180,600	
MARUWA1009,750.00975,000品川リフラクトリーズ1002,459.00245,900ヨータイ200798.00159,600イソライト100478.0047,800東京窯業300319.0095,700ニッカトー100700.0070,000フジミインコーポレーテッド2003,875.00775,000	ノリタケ	100	3,155.00	315,500	
品川リフラクトリーズ     100     2,459.00     245,900       ヨータイ     200     798.00     159,600       イソライト     100     478.00     47,800       東京窯業     300     319.00     95,700       ニッカトー     100     700.00     70,000       フジミインコーポレーテッド     200     3,875.00     775,000	ダントーホールディングス	200	672.00	134,400	
ヨータイ     200     798.00     159,600       イソライト     100     478.00     47,800       東京窯業     300     319.00     95,700       ニッカトー     100     700.00     70,000       フジミインコーポレーテッド     200     3,875.00     775,000	MARUWA	100	9,750.00	975,000	
イソライト100478.0047,800東京窯業300319.0095,700ニッカトー100700.0070,000フジミインコーポレーテッド2003,875.00775,000	品川リフラクトリーズ	100	2,459.00	245,900	
東京窯業300319.0095,700ニッカトー100700.0070,000フジミインコーポレーテッド2003,875.00775,000	ヨータイ	200	798.00	159,600	
ニッカトー     100     700.00     70,000       フジミインコーポレーテッド     200     3,875.00     775,000	イソライト	100	478.00	47,800	
フジミインコーポレーテッド 200 3,875.00 775,000	東京窯業	300	319.00	95,700	
	ニッカトー	100	700.00	70,000	
クニミネ工業 100 1,030.00 103,000	フジミインコーポレーテッド	200	3,875.00	775,000	
	クニミネ工業	100	1,030.00	103,000	

			有価証券届出書(内国	国投資信託
ニチアス	600	2,439.00	1,463,400	
中山製鋼所	300	358.00	107,400	
合同製鐵	100	2,023.00	202,300	
東京製鐵	1,000	738.00	738,000	
共英製鋼	200	1,410.00	282,000	
東京鐵鋼	100	1,790.00	179,000	
大阪製鐵	100	1,117.00	111,700	
淀川製鋼所	300	1,990.00	597,000	, .
モリ工業	100	2,600.00	260,000	
日本高周波	100	353.00	35,300	
日本冶金工	200	1,570.00	314,000	
山陽特殊製鋼	200	1,100.00	220,000	
愛知製鋼	100	2,569.00	256,900	
大平洋金属	100	1,654.00	165,400	
新日本電工	1,400	233.00	326,200	
栗本鉄工所	100	1,899.00	189,900	
三菱製鋼	200	544.00	108,800	
日亜鋼業	300	300.00	90,000	
エンビプロHD	100	528.00	52,800	,
大紀アルミニウム	300	599.00	179,700	
東邦亜鉛	100	1,995.00	199,500	
古河機金	400	1,133.00	453,200	,
エス・サイエンス	900	46.00	41,400	
大阪チタニウム	200	894.00	178,800	
東邦チタニウム	400	681.00	272,400	,
UACJ	300	1,661.00	498,300	
昭和電線HLDGS	200	1,186.00	237,200	
タツタ電線	400	599.00	239,600	
平河ヒューテック	100	1,091.00	109,100	
リョービ	300	1,190.00	357,000	
アーレステイ	300	331.00	99,300	
アサヒHD	400	3,620.00	1,448,000	
ホッカンホールディングス	100	1,450.00	145,000	
コロナ	100	1,014.00	101,400	
横河ブリッジHLDGS	400	1,912.00	764,800	
OSJB HD	1,100	245.00	269,500	
文化シヤツタ -	600	860.00	516,000	,
三協立山	300	1,000.00	300,000	
アルインコ	200	955.00	191,000	,
	100	742.00	74,200	
	1	· -	,	

400 200 600
300
700
300
300
100
400
300
300
300
300
300
000
300
000
600
000
000
300
500
500
400
500
300
200
900
000
200
900
000
200
300
000
700
100
200
300
400
400
500
0 0 8 8 8 2 2 9 0 0 0 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1

			有価証券届出書(内国	1仅具 后司
FUJI	900	2,134.00	1,920,600	
牧野フライス	200	3,695.00	739,000	
旭ダイヤモンド	600	490.00	294,000	
ソデイツク	500	773.00	386,500	
日東工器	100	2,031.00	203,100	
日進工具	100	2,183.00	218,300	
パンチ工業	200	404.00	80,800	
冨士ダイス	100	640.00	64,000	
土木管理総合試験	100	377.00	37,700	
ネットマーケティング	100	620.00	62,000	
ベルシステム24HLDGS	300	1,689.00	506,700	
鎌倉新書	200	1,096.00	219,200	
LITALICO	100	3,135.00	313,500	
エアトリ	100	1,469.00	146,900	
アトラエ	100	2,710.00	271,000	
ストライク	100	6,570.00	657,000	
ソラスト	600	1,369.00	821,400	
セラク	100	2,654.00	265,400	
インソース	100	3,200.00	320,000	
豊和工業	100	822.00	82,200	
окк	100	361.00	36,100	
石川製作所	100	1,657.00	165,700	
東洋機械金属	200	405.00	81,000	
エンシュウ	100	983.00	98,300	
島精機製作所	300	1,744.00	523,200	
オプトラン	200	2,221.00	444,200	
N C ホールディングス	100	609.00	60,900	
イワキポンプ	100	870.00	87,000	
フリュー	200	1,364.00	272,800	
ヤマシンフィルタ	500	1,124.00	562,000	
日阪製作所	300	909.00	272,700	
やまびこ	400	1,365.00	546,000	
平田機工	100	6,610.00	661,000	
ペガサスミシン製造	200	293.00	58,600	
マルマエ	100	931.00	93,100	
タツモ	100	1,645.00	164,500	
三井海洋開発	200	1,589.00	317,800	
  レオン自動機	200	1,042.00	208,400	
ホソカワミクロン	100	5,240.00	524,000	
ユニオンツール	100	3,120.00	312,000	
L	L	•	•	

オイレス工業				有価証券届出書(内国	投資信託
サト・ホールディングス         300         2,204.00         661,200           技研製作所         200         3,950.00         790.000           日本エアーテック         100         1,720.00         172,000           カ ワ タ         100         884.00         184,400           日精樹間工業         200         888.00         177,600           オカダアイヨン         100         677.00         67,700           日 工         300         690.00         207,000           巴工業         100         2,053.00         205,300           井関農機         200         1,412.00         282,400           オ ス	オイレス工業	300	1,492.00	447,600	
技研製作所	日精エーエスビー	100	4,205.00	420,500	
日本エアーテック 100 1,720.00 172,000 172,000 170 9 100 884.00 884.00 884.00 884.00 177,600 174,000 175,000	サト - ホールディングス	300	2,204.00	661,200	
カワタ       100       884.00       88,400         日精齢間工業       200       888.00       177,600         オカダアイヨン       100       1,038.00       103,800         ワイエイシイホールディングス       100       677.00       67,700         日工       300       690.00       207,000         巴工業       100       2,053.00       205,300         日工       300       690.00       227,000         巴工業       100       1,412.00       282,400         TOWA       200       1,238.00       247,600         北川鉄工所       100       1,392.00       139,200         シンニッタン       300       210.00       63,000         ローツェ       100       5,130.00       513,000         タカキタ       100       627.00       62,700         建原実業       100       3,160.00       316,000         再除工業       100       1,286.00       188,600         月島機械       400       1,274.00       599,600         常国職機制所       200       1,097.00       219,400         東京機械       100       284.00       28,400         新東工業       500       713.00       336,500         アイチ コーボレーション	技研製作所	200	3,950.00	790,000	
日精樹朋工業 200 888.00 177,600 173,800 774 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	日本エアーテック	100	1,720.00	172,000	
オカダアイヨン	カワタ	100	884.00	88,400	
ワイエイシイホールディングス       100       677.00       67,700         日 工       300       690.00       207,000         巴工業       100       2,053.00       205,300         井関農機       200       1,412.00       282,400         T O W A       200       1,238.00       247,600         北川鉄工所       100       1,392.00       139,200         シンニッタン       300       210.00       63,000         ローツェ       100       5,130.00       513,000         ダカキタ       100       627.00       62,700         産原実業       100       3,160.00       316,000         東洋エンジニア       300       323.00       96,900         帝国電機製作       400       1,274.00       509,600         帝国電機製作所       20       1,097.00       219,400         東京機械       100       284.00       28,400         新東工業       500       713.00       356,500         渋合工業       200       3,320.00       664,000         アイチョーボレーション       500       726.00       363,000         鶴見製作所       200       1,755.00       351,000         日本ギア工業       100       295.00       29,500         西島製作所	日精樹脂工業	200	888.00	177,600	
日 工	オカダアイヨン	100	1,038.00	103,800	
巴工業       100       2,053.00       205,300         井関農機       200       1,412.00       282,400         TOWA       200       1,238.00       247,600         北川鉄工所       100       1,392.00       139,200         シンニッタン       300       210.00       63,000         ローツェ       100       5,130.00       513,000         タカキタ       100       627.00       62,700         建原実業       100       3,160.00       316,000         東洋エンジニア       300       323.00       96,900         三菱化工機       100       1,886.00       188,600         月島機械       400       1,274.00       509,600         帝国電機製作所       200       1,097.00       219,400         東京機械       100       284.00       28,400         新東工業       500       713.00       356,500         渋谷工業       200       3,320.00       664,000         アイチ コーポレーション       400       906.00       362,400         小森工業       100       295.00       29,500         西島製作所       200       1,755.00       351,000         日本ギア工業       100       295.00       210,400         オルガノ <td< td=""><td>ワイエイシイホールディングス</td><td>100</td><td>677.00</td><td>67,700</td><td></td></td<>	ワイエイシイホールディングス	100	677.00	67,700	
#開農機 200 1,412.00 282,400 TOWA 200 1,238.00 247,600 北川鉄工所 100 1,392.00 139,200 シンニッタン 300 210.00 63,000 ローツェ 100 5,130.00 513,000 をクカキタ 100 627.00 62,700 程原実業 100 3,160.00 316,000 更美工ンジニア 300 323.00 96,900 更養化 100 1,886.00 188,600 月島機械 400 1,274.00 509,600 東京機械 100 284.00 28,400 新東工業 500 713.00 366,500 所承工業 200 3,320.00 664,000 アイチ コーポレーション 400 906.00 362,400 小森コーポレーション 500 726.00 363,000 自見製作所 200 1,755.00 351,000 日本ギア工業 100 295.00 29,500 面島製作所 200 1,052.00 29,500 161,000 17.00 210,400 17.00 253.00 664,000 17.00 253.00 664,000 17.00 253.00 664,000 17.00 253.00 664,000 17.00 253.00 266,800 161,000 161,000 17.00 264.00 264.00 161,000 17.00 265.00 266,800 161,000 17.00 265.00 266,800 161,000 17.00 265.00 266,800 161,000 17.00 265.00 266,800 161,000 17.00 266.00 363,000 161,000 17.00 266.00 363,000 161,000 17.00 266.00 363,000 161,000 17.00 266.00 363,000 161,000 17.00 266.00 363,000 161,000 17.00 266.00 363,000 161,000 17.00 266.00 363,000 161,000 17.00 266.00 363,000 161,000 17.00 266.00 363,000 161,000 161,000 17.00 266.00 363,000 161,0	日工	300	690.00	207,000	
TOWA       200       1,238.00       247,600         北川鉄工所       100       1,392.00       139,200         シンニッタシ       300       210.00       63,000         ローツェ       100       5,130.00       513,000         タカキタ       100       627.00       62,700         産原実業       100       3,160.00       316,000         東洋エンジニア       300       323.00       96,900         三菱化工機       100       1,886.00       188,600         月島機械       400       1,274.00       509,600         帝国電機製作所       200       1,097.00       219,400         東京機械       100       284.00       28,400         新東工業       500       713.00       356,500         渋谷工業       200       3,320.00       664,000         アイチ コーポレーション       400       906.00       362,400         小森コーポレーション       500       726.00       363,000         鶴見製作所       200       1,755.00       351,000         日本ギア工業       100       295.00       29,500         西島製作所       200       1,052.00       210,400         オルガノ       100       5,690.00       569,000         ト・ヨ・カネツ <td>巴工業</td> <td>100</td> <td>2,053.00</td> <td>205,300</td> <td></td>	巴工業	100	2,053.00	205,300	
北川鉄工所	井関農機	200	1,412.00	282,400	
シンニッタン       300       210.00       63,000         ローツェ       100       5,130.00       513,000         タカキタ       100       627.00       62,700         荏原実業       100       3,160.00       316,000         東洋エンジニア       300       323.00       96,900         三菱化工機       100       1,886.00       188,600         月島機械       400       1,274.00       509,600         帝国電機製作所       200       1,097.00       219,400         東京機械       100       284.00       28,400         新東工業       500       713.00       356,500         渋谷工業       200       3,320.00       664,000         アイチ コーポレーション       400       906.00       362,400         小森コーポレーション       500       726.00       363,000         鶴見製作所       200       1,755.00       351,000         日本ギア工業       100       295.00       29,500         西島製作所       200       805.00       161,000         オルガノ       100       5,690.00       569,000         ト・ヨ・カネツ       100       2,268.00       226,800         村本チエイン       300       2,326.00       697,800         大同工業	TOWA	200	1,238.00	247,600	
ローツェ       100       5,130.00       513,000         タカキタ       100       627.00       62,700         産原実業       100       3,160.00       316,000         東洋エンジニア       300       323.00       96,900         三菱化工機       100       1,886.00       188,600         月島機械       400       1,274.00       509,600         帝国電機製作所       200       1,097.00       219,400         東京機械       100       284.00       386,500         渋谷工業       200       3,320.00       664,000         アイチ コーポレーション       400       906.00       362,400         小森コーポレーション       500       726.00       363,000         鶴見製作所       200       1,755.00       351,000         日本ギア工業       100       295.00       29,500         西島製作所       200       805.00       161,000         北越工業       200       1,052.00       210,400         オルガノ       100       5,690.00       569,000         ト・ヨ・カネツ       100       2,268.00       697,800         オに対土       100       588.00       58,800         日機装       600       1,050.00       630,000         木村化工機	北川鉄工所	100	1,392.00	139,200	
タカキタ       100       627.00       62,700         荏原実業       100       3,160.00       316,000         東洋エンジニア       300       323.00       96,900         三菱化工機       100       1,886.00       188,600         月島機械       400       1,274.00       509,600         帝国電機製作所       200       1,097.00       219,400         東京機械       100       284.00       28,400         新東工業       500       713.00       356,500         渋谷工業       200       3,320.00       664,000         アイチ コーポレーション       400       906.00       362,400         小森コーポレーション       500       726.00       363,000         自島製作所       200       1,755.00       351,000         日本ギア工業       100       295.00       29,500         西島製作所       200       805.00       161,000         北起工業       200       1,052.00       210,400         オルガノ       100       5,690.00       569,000         ト・ヨ・カネツ       100       2,268.00       226,800         橘本チエイン       300       2,326.00       630,000         木村化工機       200       422.00       84,400         レイズネクスト <td>シンニッタン</td> <td>300</td> <td>210.00</td> <td>63,000</td> <td></td>	シンニッタン	300	210.00	63,000	
荏原実業       100       3,160.00       316,000         東洋エンジニア       300       323.00       96,900         三菱化工機       100       1,886.00       188,600         月島機械       400       1,274.00       509,600         帝国電機製作所       200       1,097.00       219,400         東京機械       100       284.00       28,400         新東工業       500       713.00       356,500         渋谷工業       200       3,320.00       664,000         アイチ コーポレーション       400       906.00       362,400         小森コーボレーション       500       726.00       363,000         鶴見製作所       200       1,755.00       351,000         日本ギア工業       100       295.00       29,500         西島製作所       200       805.00       161,000         北越工業       200       1,052.00       210,400         オルガノ       100       5,690.00       569,000         ト-ヨ・カネツ       100       2,268.00       226,800         精本チエイン       300       2,326.00       697,800         大同工業       100       588.00       58,800         日機装       600       1,050.00       630,000         木村化工機 <td>ローツェ</td> <td>100</td> <td>5,130.00</td> <td>513,000</td> <td></td>	ローツェ	100	5,130.00	513,000	
東洋エンジニア       300       323.00       96,900         三菱化工機       100       1,886.00       188,600         月島機械       400       1,274.00       509,600         帝国電機製作所       200       1,097.00       219,400         東京機械       100       284.00       28,400         新東工業       500       713.00       356,500         渋谷工業       200       3,320.00       664,000         アイチ コーポレーション       400       906.00       362,400         小森コーポレーション       500       726.00       363,000         鶴見製作所       200       1,755.00       351,000         日本ギア工業       100       295.00       29,500         西島製作所       200       805.00       161,000         北越工業       200       1,052.00       210,400         オルガノ       100       5,690.00       569,000         ト-ヨ・カネツ       100       2,268.00       226,800         椿本チエイン       300       2,326.00       697,800         大同工業       100       588.00       58,800         日機装       600       1,050.00       630,000         木村化工機       200       422.00       84,400         レイズネクスト <td>タカキタ</td> <td>100</td> <td>627.00</td> <td>62,700</td> <td></td>	タカキタ	100	627.00	62,700	
三菱化工機       100       1,886.00       188,600         月島機械       400       1,274.00       509,600         帝国電機製作所       200       1,097.00       219,400         東京機械       100       284.00       28,400         新東工業       500       713.00       356,500         渋谷工業       200       3,320.00       664,000         アイチ コーポレーション       400       906.00       362,400         小森コーポレーション       500       726.00       363,000         鶴見製作所       200       1,755.00       351,000         日本ギア工業       100       295.00       29,500         西島製作所       200       805.00       161,000         北越工業       200       1,052.00       210,400         オルガノ       100       5,690.00       569,000         ト - ヨ - カネツ       100       2,268.00       226,800         椿本チエイン       300       2,326.00       697,800         大同工業       100       588.00       58,800         日 機 装       600       1,050.00       630,000         木村化工機       200       422.00       84,400         レイズネクスト       400       1,266.00       506,400         アネ	荏原実業	100	3,160.00	316,000	
月島機械       400       1,274.00       509,600         帝国電機製作所       200       1,097.00       219,400         東京機械       100       284.00       28,400         新東工業       500       713.00       356,500         渋谷工業       200       3,320.00       664,000         アイチ コーポレーション       400       906.00       362,400         小森コーポレーション       500       726.00       363,000         鶴見製作所       200       1,755.00       351,000         日本ギア工業       100       295.00       29,500         西島製作所       200       1,052.00       210,400         オルガノ       100       5,690.00       569,000         ト・ヨ・カネツ       100       2,268.00       226,800         椿本チエイン       300       2,326.00       697,800         大同工業       100       588.00       58,800         日 機 装       600       1,050.00       630,000         木村化工機       200       422.00       84,400         レイズネクスト       400       1,266.00       506,400         アネスト岩田       300       844.00       253,200	東洋エンジニア	300	323.00	96,900	
帝国電機製作所 200 1,097.00 219,400 東京機械 100 284.00 28,400 新東工業 500 713.00 356,500 渋谷工業 200 3,320.00 664,000 アイチ コーポレーション 400 906.00 362,400 小森コーポレーション 500 726.00 363,000 鶴見製作所 200 1,755.00 351,000 日本ギア工業 100 295.00 29,500 西島製作所 200 805.00 161,000 北越工業 200 1,052.00 210,400 オルガノ 100 5,690.00 569,000 ト・ヨ・カネツ 100 2,268.00 226,800 椿本チエイン 300 2,326.00 697,800 大同工業 100 588.00 58,800 日 機 装 600 1,050.00 630,000 木村化工機 200 422.00 84,400 レイズネクスト 400 1,266.00 506,400 アネスト岩田 300 844.00 253,200	三菱化工機	100	1,886.00	188,600	
東京機械 100 284.00 28,400 新東工業 500 713.00 356,500 渋谷工業 200 3,320.00 664,000 アイチ コーポレーション 400 906.00 362,400 小森コーポレーション 500 726.00 363,000 鶴見製作所 200 1,755.00 351,000 日本ギア工業 100 295.00 29,500 西島製作所 200 805.00 161,000 北越工業 200 1,052.00 210,400 オルガノ 100 5,690.00 569,000 ト・ヨ・カネツ 100 2,268.00 226,800 橋本チエイン 300 2,326.00 697,800 大同工業 100 588.00 58,800 日 機 装 600 1,050.00 630,000 木村化工機 200 422.00 84,400 レイズネクスト 400 1,266.00 506,400 アネスト岩田 300 844.00 253,200	月島機械	400	1,274.00	509,600	
新東工業 500 713.00 356,500 渋谷工業 200 3,320.00 664,000 アイチ コーポレーション 400 906.00 362,400 小森コーポレーション 500 726.00 363,000 鶴見製作所 200 1,755.00 351,000 日本ギア工業 100 295.00 29,500 酉島製作所 200 805.00 161,000 北越工業 200 1,052.00 210,400 オルガノ 100 5,690.00 569,000 ト・ヨ・カネツ 100 2,268.00 226,800 椿本チエイン 300 2,326.00 697,800 大同工業 100 588.00 58,800 日 機 装 600 1,050.00 630,000 木村化工機 200 422.00 84,400 レイズネクスト 400 1,266.00 506,400 アネスト岩田 300 844.00 253,200	帝国電機製作所	200	1,097.00	219,400	
渋谷工業2003,320.00664,000アイチ コーポレーション400906.00362,400小森コーポレーション500726.00363,000鶴見製作所2001,755.00351,000日本ギア工業100295.0029,500酉島製作所200805.00161,000北越工業2001,052.00210,400オルガノ1005,690.00569,000ト・ヨ・カネツ1002,268.00226,800椿本チエイン3002,326.00697,800大同工業100588.0058,800日 機 装6001,050.00630,000木村化工機200422.0084,400レイズネクスト4001,266.00506,400アネスト岩田300844.00253,200	東京機械	100	284.00	28,400	
アイチ コーポレーション       400       906.00       362,400         小森コーポレーション       500       726.00       363,000         鶴見製作所       200       1,755.00       351,000         日本ギア工業       100       295.00       29,500         酉島製作所       200       805.00       161,000         北越工業       200       1,052.00       210,400         オルガノ       100       5,690.00       569,000         ト・ヨ・カネツ       100       2,268.00       226,800         椿本チエイン       300       2,326.00       697,800         大同工業       100       588.00       58,800         日 機 装       600       1,050.00       630,000         木村化工機       200       422.00       84,400         レイズネクスト       400       1,266.00       506,400         アネスト岩田       300       844.00       253,200	新東工業	500	713.00	356,500	
小森コーポレーション500726.00363,000鶴見製作所2001,755.00351,000日本ギア工業100295.0029,500酉島製作所200805.00161,000北越工業2001,052.00210,400オルガノ1005,690.00569,000ト-ヨ-カネツ1002,268.00226,800椿本チエイン3002,326.00697,800大同工業100588.0058,800日 機 装6001,050.00630,000木村化工機200422.0084,400レイズネクスト4001,266.00506,400アネスト岩田300844.00253,200	渋谷工業	200	3,320.00	664,000	
鶴見製作所 200 1,755.00 351,000 日本ギア工業 100 295.00 29,500 西島製作所 200 805.00 161,000 北越工業 200 1,052.00 210,400 オルガノ 100 5,690.00 569,000 ト・ヨ・カネツ 100 2,268.00 226,800 様本チエイン 300 2,326.00 697,800 大同工業 100 588.00 58,800 日 機 装 600 1,050.00 630,000 木村化工機 200 422.00 84,400 レイズネクスト 400 1,266.00 506,400 アネスト岩田 300 844.00 253,200	アイチ コーポレーション	400	906.00	362,400	
日本ギア工業100295.0029,500酉島製作所200805.00161,000北越工業2001,052.00210,400オルガノ1005,690.00569,000ト・ヨ・カネツ1002,268.00226,800椿本チエイン3002,326.00697,800大同工業100588.0058,800日 機 装6001,050.00630,000木村化工機200422.0084,400レイズネクスト4001,266.00506,400アネスト岩田300844.00253,200	小森コーポレーション	500	726.00	363,000	
酉島製作所200805.00161,000北越工業2001,052.00210,400オルガノ1005,690.00569,000ト-ヨ-カネツ1002,268.00226,800椿本チエイン3002,326.00697,800大同工業100588.0058,800日機装6001,050.00630,000木村化工機200422.0084,400レイズネクスト4001,266.00506,400アネスト岩田300844.00253,200	鶴見製作所	200	1,755.00	351,000	
北越工業       200       1,052.00       210,400         オルガノ       100       5,690.00       569,000         ト・ヨ・カネツ       100       2,268.00       226,800         椿本チエイン       300       2,326.00       697,800         大同工業       100       588.00       58,800         日機装       600       1,050.00       630,000         木村化工機       200       422.00       84,400         レイズネクスト       400       1,266.00       506,400         アネスト岩田       300       844.00       253,200	日本ギア工業	100	295.00	29,500	
オルガノ       100       5,690.00       569,000         ト・ヨ・カネツ       100       2,268.00       226,800         椿本チエイン       300       2,326.00       697,800         大同工業       100       588.00       58,800         日 機 装       600       1,050.00       630,000         木村化工機       200       422.00       84,400         レイズネクスト       400       1,266.00       506,400         アネスト岩田       300       844.00       253,200	酉島製作所	200	805.00	161,000	
ト・ヨ・カネツ1002,268.00226,800椿本チエイン3002,326.00697,800大同工業100588.0058,800日機装6001,050.00630,000木村化工機200422.0084,400レイズネクスト4001,266.00506,400アネスト岩田300844.00253,200	北越工業	200	1,052.00	210,400	
椿本チエイン3002,326.00697,800大同工業100588.0058,800日機装6001,050.00630,000木村化工機200422.0084,400レイズネクスト4001,266.00506,400アネスト岩田300844.00253,200	オルガノ	100	5,690.00	569,000	
大同工業100588.0058,800日機装6001,050.00630,000木村化工機200422.0084,400レイズネクスト4001,266.00506,400アネスト岩田300844.00253,200	ト - ヨ - カネツ	100	2,268.00	226,800	
日機装6001,050.00630,000木村化工機200422.0084,400レイズネクスト4001,266.00506,400アネスト岩田300844.00253,200	椿本チエイン	300	2,326.00	697,800	
木村化工機200422.0084,400レイズネクスト4001,266.00506,400アネスト岩田300844.00253,200	大同工業	100	588.00	58,800	
レイズネクスト4001,266.00506,400アネスト岩田300844.00253,200	日 機 装	600	1,050.00	630,000	
アネスト岩田 300 844.00 253,200	木村化工機	200	422.00	84,400	
	レイズネクスト	400	1,266.00	506,400	
サムコ 100 2,938.00 293,800	アネスト岩田	300	844.00	253,200	
	サムコ	100	2,938.00	293,800	

			有価証券届出書(内国	国技具活动
加藤製作所	100	1,037.00	103,700	
フジテック	800	2,475.00	1,980,000	
CKD	600	1,767.00	1,060,200	
キトー	200	1,289.00	257,800	
平和	600	1,710.00	1,026,000	
理想科学工業	200	1,355.00	271,000	
日本金銭機械	200	542.00	108,400	
マースグループHLDGS	100	1,652.00	165,200	
フクシマガリレイ	100	3,880.00	388,000	
オーイズミ	100	409.00	40,900	
ダイコク電機	100	997.00	99,700	
竹内製作所	400	2,428.00	971,200	
JUKI	300	449.00	134,700	
サンデンホールディングス	300	316.00	94,800	
蛇の目ミシン	200	583.00	116,600	
マックス	300	1,510.00	453,000	
モリタホールディングス	400	1,982.00	792,800	
新晃工業	200	1,501.00	300,200	
大和冷機工業	300	932.00	279,600	
日本ピストンリング	100	1,028.00	102,800	
リケン	100	2,637.00	263,700	
TPR	300	1,305.00	391,500	
ツバキ・ナカシマ	400	864.00	345,600	
大豊工業	200	551.00	110,200	
日本トムソン	600	364.00	218,400	
ユーシン精機	200	705.00	141,000	
前澤給装工業	100	2,271.00	227,100	
イーグル工業	300	796.00	238,800	
前澤工業	100	452.00	45,200	
日本ピラ - 工業	200	1,539.00	307,800	
キッツ	900	580.00	522,000	
東洋電機製造	100	1,176.00	117,600	
シンフォニア テクノロジー	300	1,171.00	351,300	
明 電 舎	400	1,585.00	634,000	
オリジン	100	1,350.00	135,000	
山洋電気	100	4,650.00	465,000	
デンヨー	200	2,328.00	465,600	
ベイカレントコンサルティング	100	16,930.00	1,693,000	
アイモバイル	100	1,537.00	153,700	
キャリアインデックス	100	574.00	57,400	
<u> </u>				

			有価証券届出書(内国	国投資信託
MS-Japan	100	826.00	82,600	
グレイステクノロジー	100	5,730.00	573,000	
ジャパンエレベーターSHD	200	4,270.00	854,000	
グリーンズ	100	511.00	51,100	
日総工産	100	839.00	83,900	
キュービーネットHLDGS	100	1,705.00	170,500	
RPAホールディングス	100	822.00	82,200	
三桜工業	300	600.00	180,000	
東芝テック	300	4,300.00	1,290,000	
ユーエムシーエレクトロニクス	100	342.00	34,200	
トレックス・セミコンダクター	100	1,297.00	129,700	
東光高岳	100	1,069.00	106,900	
ダブル・スコープ	300	785.00	235,500	
宮越ホールディングス	100	715.00	71,500	
ダイヘン	200	4,095.00	819,000	
ヤーマン	300	1,526.00	457,800	
JVCケンウッド	1,700	145.00	246,500	
ミマキエンジニアリング	200	425.00	85,000	
I-PEX	100	2,002.00	200,200	
日新電機	500	1,090.00	545,000	
大崎電気	400	620.00	248,000	
日東工業	300	2,013.00	603,900	
IDEC	300	1,859.00	557,700	
メルコホールディングス	100	2,487.00	248,700	
岩崎通信機	100	832.00	83,200	
電気興業	100	2,571.00	257,100	
サンケン電気	200	2,723.00	544,600	
アイホン	100	1,479.00	147,900	
ワコム	1,400	669.00	936,600	
アクセル	100	911.00	91,100	
EIZO	200	3,780.00	756,000	
ジャパンディスプレイ	6,200	51.00	316,200	
日本信号	500	990.00	495,000	
京三製作所	500	429.00	214,500	
能美防災	300	2,312.00	693,600	
ホーチキ	200	1,256.00	251,200	
星和電機	100	625.00	62,500	
エレコム	200	4,835.00	967,000	
帝国通信工業	100	1,119.00	111,900	
タムラ製作所	700	545.00	381,500	
	ı		l .	

			有伽証券届出書(内国	<u>對投資信計</u>
池上通信機	100	810.00	81,000	
日本電波工業	200	425.00	85,000	
鈴木	100	678.00	67,800	
ローランド ディー・ジー・	100	1,315.00	131,500	
フオスタ - 電機	200	1,245.00	249,000	
S M K	100	2,635.00	263,500	
ヨコオ	100	2,590.00	259,000	
ティアック	200	119.00	23,800	
ホシデン	600	955.00	573,000	
日本航空電子	500	1,511.00	755,500	
Т О А	200	819.00	163,800	
マクセルホールディングス	500	1,063.00	531,500	
古野電気	300	1,220.00	366,000	
ユニデンホールディングス	100	1,985.00	198,500	
スミダコーポレーション	200	879.00	175,800	
アイコム	100	2,719.00	271,900	
リオン	100	2,468.00	246,800	
本多通信工業	200	521.00	104,200	
船井電機	200	469.00	93,800	
新電元工業	100	1,953.00	195,300	
東亜ディーケーケー	100	833.00	83,300	
チ ノ ー	100	1,339.00	133,900	
共和電業	200	411.00	82,200	
日本電子材料	100	1,956.00	195,600	
小野測器	100	526.00	52,600	
エスペック	200	1,769.00	353,800	
日置電機	100	3,740.00	374,000	
日本マイクロニクス	400	1,087.00	434,800	
メガチップス	200	3,040.00	608,000	
OBARA GROUP	100	3,660.00	366,000	
IMAGICA GROUP	200	381.00	76,200	
原田工業	100	876.00	87,600	
コーセル	300	1,050.00	315,000	
イリソ電子工業	200	4,455.00	891,000	
オプテックスグループ	300	1,648.00	494,400	
千代田インテグレ	100	1,661.00	166,100	
アイ・オー・データ	100	1,026.00	102,600	
岩崎電気	100	1,440.00	144,000	
岡谷電機	200	362.00	72,400	
ヘリオステクノH	200	320.00	64,000	
L			<u> </u>	

有価証券屆				<u> 投資信託</u>
エノモト	100	1,131.00	113,100	
日本セラミック	200	2,537.00	507,400	
遠藤照明	100	631.00	63,100	
古河電池	200	1,048.00	209,600	
双信電機	100	417.00	41,700	
山一電機	200	1,396.00	279,200	
図研	100	2,754.00	275,400	
日本電子	400	3,580.00	1,432,000	
日本シイエムケイ	500	478.00	239,000	
エンプラス	100	2,214.00	221,400	
大真空	100	2,304.00	230,400	
三井ハイテック	200	2,110.00	422,000	
新光電気工業	700	2,003.00	1,402,100	
双葉電子工業	300	915.00	274,500	
北陸電気工業	100	927.00	92,700	
ニチコン	700	830.00	581,000	
日本ケミコン	200	1,357.00	271,400	
к о а	300	1,232.00	369,600	
三井 E & S H D	800	376.00	300,800	
日立造船	1,700	422.00	717,400	
名村造船所	700	160.00	112,000	
サノヤスホールディングス	300	177.00	53,100	
スプリックス	100	886.00	88,600	
カーブスホールディングス	500	637.00	318,500	
フォーラムエンジニアリング	100	822.00	82,200	
日本車輌	100	2,655.00	265,500	
三菱ロジスネクスト	300	960.00	288,000	
FPG	600	533.00	319,800	
じもとホールディングス	100	994.00	99,400	
東京きらぼしF G	300	1,157.00	347,100	
富山第一銀行	500	302.00	151,000	
ジェイリース	100	824.00	82,400	
マーキュリアインベストメント	100	657.00	65,700	
イントラスト	100	979.00	97,900	
Casa	100	1,280.00	128,000	
アルヒ	300	1,930.00	579,000	
プレミアグループ	100	2,164.00	216,400	
エフテック	100	538.00	53,800	
レシップホールディングス	100	554.00	55,400	
武蔵精密工業	500	1,177.00	588,500	

			有価証券届出書(内国	投資信託
日産車体	400	909.00	363,600	
新明和工業	600	870.00	522,000	
極東開発工業	400	1,384.00	553,600	
トピー工業	200	1,092.00	218,400	
ティラド	100	1,275.00	127,500	
曙ブレーキ	1,200	147.00	176,400	
タチエス	300	1,096.00	328,800	
フタバ産業	600	551.00	330,600	
КҮВ	200	2,187.00	437,400	
市光工業	300	481.00	144,300	
大同メタル工業	400	532.00	212,800	
プレス工業	1,100	298.00	327,800	
ミクニ	300	263.00	78,900	
太平洋工業	400	999.00	399,600	
河西工業	300	382.00	114,600	
今仙電機製作所	200	662.00	132,400	
安永	100	1,183.00	118,300	
ТВК	300	434.00	130,200	
エクセディ	300	1,308.00	392,400	
ミツバ	400	392.00	156,800	
愛三工業	300	479.00	143,700	
日本プラスト	200	428.00	85,600	
ョ ロ ズ	200	1,128.00	225,600	
エフ・シー・シー	300	2,027.00	608,100	
関西みらNFG	1,200	427.00	512,400	
3 3 F G	200	1,340.00	268,000	
ジャムコ	100	659.00	65,900	
小野建	200	1,171.00	234,200	
はるやまHLDGS	100	675.00	67,500	
<b>ノ</b> ジ マ	400	2,823.00	1,129,200	
佐鳥電機	100	835.00	83,500	
カッパ・クリエイト	300	1,476.00	442,800	
伯東	100	1,178.00	117,800	
コンドーテック	200	1,084.00	216,800	
中山福	100	500.00	50,000	
ライトオン	200	624.00	124,800	
ナガイレーベン	300	2,655.00	796,500	
ジーンズメイト	100	414.00	41,400	
三菱食品	200	2,802.00	560,400	
三城ホールディングス	200	273.00	54,600	
			·	

			有価証券届出書(内国	1投資信計
松田産業	200	1,497.00	299,400	
アドヴァン	300	1,349.00	404,700	
萩原電気HLDGS	100	2,215.00	221,500	
アルビス	100	2,613.00	261,300	
アズワン	100	15,540.00	1,554,000	
スズデン	100	1,178.00	117,800	
尾家産業	100	1,572.00	157,200	
シモジマ	100	1,400.00	140,000	
ドウシシャ	200	2,010.00	402,000	
コナカ	200	257.00	51,400	
高速	100	1,551.00	155,100	
G - 7ホールディングス	200	2,422.00	484,400	
たけびし	100	1,553.00	155,300	
イオン北海道	300	886.00	265,800	
コジマ	400	681.00	272,400	
ヒマラヤ	100	853.00	85,300	
コーナン商事	300	3,640.00	1,092,000	
エコス	100	2,407.00	240,700	
ワタミ	300	976.00	292,800	
マルシェ	100	556.00	55,600	
システムソフト	500	102.00	51,000	
丸文	200	525.00	105,000	
西松屋チェーン	500	1,598.00	799,000	
ハピネット	200	1,459.00	291,800	
幸楽苑ホールディングス	100	1,744.00	174,400	
日本ライフライン	600	1,373.00	823,800	
サイゼリヤ	300	1,917.00	575,100	
タカショー	100	698.00	69,800	
VTホールディングス	900	397.00	357,300	
マルカ	100	2,188.00	218,800	
アルゴグラフィックス	200	3,385.00	677,000	
魚力	100	1,664.00	166,400	
IDOM	600	623.00	373,800	
日本エム・ディ・エム	100	2,128.00	212,800	
ポプラ	100	417.00	41,700	
フジ・コーポレーション	100	2,413.00	241,300	
 ユナイテッドアローズ	200	1,448.00	289,600	
<u></u> 進和	100	1,960.00	196,000	
ダイトロン	100	1,580.00	158,000	
 ハイデイ日高	300	1,699.00	509,700	
			•	

			有価証券届出書(内国	<b>国投資信託</b>
シークス	300	1,277.00	383,100	
京都きもの友禅	100	225.00	22,500	
ピーシーデポコーポ	300	660.00	198,000	
田中商事	100	698.00	69,800	
オーハシテクニカ	100	1,430.00	143,000	
壱番屋	100	5,340.00	534,000	
白銅	100	1,334.00	133,400	
トップカルチャー	100	396.00	39,600	
PLANT	100	862.00	86,200	
薬王堂ホールディングス	100	2,535.00	253,500	
J M S	200	892.00	178,400	
クボテック	100	318.00	31,800	,
長野計器	200	847.00	169,400	
ブイ・テクノロジー	100	4,800.00	480,000	
スター精密	300	1,429.00	428,700	
東京計器	100	913.00	91,300	
インターアクション	100	1,754.00	175,400	,
オーバル	200	222.00	44,400	
東京精密	400	3,655.00	1,462,000	
理研計器	200	2,774.00	554,800	,
キヤノン電子	200	1,417.00	283,400	
タムロン	200	1,536.00	307,200	
シード	100	655.00	65,500	
ノーリツ鋼機	200	1,956.00	391,200	,
エー・アンド・デイ	200	659.00	131,800	
リズム	100	635.00	63,500	
大研医器	200	524.00	104,800	
メニコン	300	7,180.00	2,154,000	
中本パックス	100	1,618.00	161,800	
スノーピーク	100	2,036.00	203,600	
パラマウントベッドHD	200	4,220.00	844,000	
トランザクション	100	1,001.00	100,100	
粧美堂	100	360.00	36,000	
ニホンフラッシュ	200	1,315.00	263,000	
前田工繊	200	2,774.00	554,800	
永大産業	300	304.00	91,200	
アートネイチャー	200	635.00	127,000	
アイフィスジャパン	100	745.00	74,500	
共立印刷	400	130.00	52,000	
	400	130.00	32,000	

			有価証券届出書(内国	1投資信託
フランスベッドHLDGS	300	887.00	266,100	
マーベラス	300	795.00	238,500	
萩原工業	100	1,575.00	157,500	
エイベックス	400	1,103.00	441,200	
トッパン・フォームズ	500	1,018.00	509,000	
フジシールインターナショナル	500	2,050.00	1,025,000	
タカラトミー	1,000	960.00	960,000	
廣済堂	200	651.00	130,200	
エステールホールディングス	100	611.00	61,100	
レック	200	1,534.00	306,800	
タカノ	100	597.00	59,700	
三光合成	200	295.00	59,000	
プロネクサス	200	1,121.00	224,200	
ホクシン	100	117.00	11,700	
ウッドワン	100	1,215.00	121,500	
大建工業	100	1,879.00	187,900	
きもと	400	166.00	66,400	
共同印刷	100	2,591.00	259,100	
NISSHA	400	1,301.00	520,400	
藤森工業	200	4,330.00	866,000	
ヴィア・ホールディングス	300	295.00	88,500	
TAKARA & COMPANY	100	2,109.00	210,900	
前澤化成工業	100	985.00	98,500	
未来工業	100	1,943.00	194,300	
ツッミ	100	2,344.00	234,400	
ウェーブロックHLDGS	100	760.00	76,000	
ジェイ エス ピー	100	1,625.00	162,500	
ニチハ	300	3,125.00	937,500	
小松ウオール工業	100	1,749.00	174,900	
河合楽器	100	2,612.00	261,200	
クリナップ	200	500.00	100,000	
天馬	100	1,851.00	185,100	,
キングジム	200	885.00	177,000	
象印マホービン	600	1,830.00	1,098,000	
信越ポリマー	400	919.00	367,600	,
東リ	500	262.00	131,000	
イトーキ	500	347.00	173,500	
三菱鉛筆	400	1,344.00	537,600	
松風	100	1,399.00	139,900	
タカラスタンダ・ド	400	1,438.00	575,200	

			有伽証券届出書(内国	1投資信計
ナカバヤシ	200	648.00	129,600	
立川ブラインド	100	1,224.00	122,400	
グローブライド	100	3,350.00	335,000	
オカムラ	700	739.00	517,300	
バルカー	200	1,845.00	369,000	
スクロール	300	988.00	296,400	
ヨンドシーホールディングス	200	1,767.00	353,400	
三陽商会	100	486.00	48,600	
ナイガイ	100	380.00	38,000	
蝶 理	100	1,625.00	162,500	
オンワ - ドホールディングス	1,300	220.00	286,000	
三共生興	300	440.00	132,000	
兼松	800	1,292.00	1,033,600	
美 津 濃	200	1,846.00	369,200	
ルックホールディングス	100	843.00	84,300	
日本紙パルプ	100	3,735.00	373,500	
カメイ	300	1,080.00	324,000	
スターゼン	100	4,010.00	401,000	
セイコーHD	300	1,389.00	416,700	
山善	800	1,120.00	896,000	
内田洋行	100	5,560.00	556,000	
第一実業	100	3,745.00	374,500	
西華産業	100	1,398.00	139,800	
佐藤商事	200	986.00	197,200	
菱洋エレクトロ	200	2,877.00	575,400	
東京産業	200	557.00	111,400	
ユアサ商事	200	3,255.00	651,000	
神鋼商事	100	1,848.00	184,800	
トルク	100	284.00	28,400	
正栄食品	100	4,035.00	403,500	
カナデン	200	1,505.00	301,000	
菱電商事	200	1,538.00	307,600	
フルサト工業	100	1,404.00	140,400	
ナイス	100	1,258.00	125,800	
昭光通商	100	615.00	61,500	
極東貿易	100	1,423.00	142,300	
1 D =	300	541.00	162,300	,
兼松エレクトロニクス	100	4,290.00	429,000	
三愛石油	500	1,056.00	528,000	
稲畑産業	500	1,301.00	650,500	
<u> </u>			ı l	

GSIクレオス 100 1,888.00 189,800				有価証券届出書(内国	1技具活动
クワザワホールディングス         100         555.00         55,500           キムラタン         1,100         27.00         29,700           ヤマエ久野         200         1,183.00         236,600           デサント         400         1,670.00         668,000           キング         100         584.00         58,400           フキタ         400         1,050.00         420,000           ヤマトインタ・ナショナル         100         333.00         33,300           ミッウロコグループ         300         1,267.00         380,100           シナネンホールディングス         100         3,075.00         307,500           伊藤忠エネクス         500         976.00         488,000           サンワ テクノス         100         855.00         85,500           リョーサン         200         2,055.00         411,000           新光商事         300         871.00         261,300           トーホー         100         1,841.00         184,100           重属を気         100         2,077.00         207,700           東陽テクニカ         200         3,885.00         477,000           東京半導体         200         2,184.00         436,800           エムキョ体         200         570.00         114,000 <td>GSIクレオス</td> <td>100</td> <td>1,898.00</td> <td>189,800</td> <td></td>	GSIクレオス	100	1,898.00	189,800	
キムラタン         1,100         27.00         29,700           ヤマエ久野         200         1,183.00         236,600           デサント         400         1,670.00         668,000           キング         100         584.00         58,400           ワキタ         400         1,050.00         420,000           ヤマトインタ・ナショナル         100         333.00         333.00           ミッウロコグルーブ         300         1,267.00         380,100           シナネンホールディングス         100         3,075.00         307,500           伊藤忠エネクス         500         976.00         488,000           サンワ テクノス         100         855.00         85,600           リョーサン         200         2,055.00         411,000           新光商事         300         871.00         184,100           三信電気         100         2,077.00         207,700           東陽テクニカ         200         989.00         197,800           モスフード サービス         300         2,819.00         845,700           加資電子         200         2,184.00         436,800           三益半導体         200         2,785.00         477,000           都築電電子         200         1,757.00         351,400 </td <td>明和産業</td> <td>200</td> <td>414.00</td> <td>82,800</td> <td></td>	明和産業	200	414.00	82,800	
ヤマエ久野         200         1,183.00         236,600           デサント         400         1,670.00         668,000           キング         100         584.00         58,400           ワキタ         400         1,050.00         420,000           ヤマトインタ・ナショナル         100         333.00         33,300           ミッウロコグルーブ         300         1,267.00         380,100           シナネンホールディングス         100         3,075.00         307,500           伊藤忠エネクス         500         976.00         488,000           サンワ テクノス         100         855.00         85,500           リョーサン         200         2,055.00         411,000           新光商事         300         871.00         261,300           トーホー         100         1,841.00         184,100           三信電気         100         2,077.00         207,700           東陽テクニカ         200         2,819.00         845,700           加賀電子         200         2,184.00         436,800           三益半導体         200         2,385.00         477,000           都築電気         100         1,767.00         351,400           大管電外         200         1,757.00         351,400	クワザワホールディングス	100	555.00	55,500	
デサント       400       1,670.00       668,000         キ ン グ       100       584.00       58,400         ワ キ タ       400       1,050.00       420,000         ヤマトインタ・ナショナル       100       333.00       33,300         ミッウロコグループ       300       1,267.00       380,100         シナネンホールディングス       100       3,075.00       376.00         サンワ テクノス       100       855.00       85,500         リョーサン       200       2,055.00       411,000         新光商事       300       871.00       261,300         トーホー       100       1,841.00       184,100         三信電気       100       2,077.00       207,700         東陽テクニカ       200       989.00       197,800         モスフード サービス       300       2,819.00       845,700         加賀電子       200       2,184.00       436,800         三益半導体       200       2,385.00       477,000         都築電気       100       1,709.00       170,900         ソーダニッカ       200       1,757.00       351,400         木曽路       300       2,529.00       758,700         京を表ホールディングス       200       1,757.00       351,400 <t< td=""><td>キムラタン</td><td>1,100</td><td>27.00</td><td>29,700</td><td></td></t<>	キムラタン	1,100	27.00	29,700	
キング       100       584.00       58,400         ワキタ       400       1,050.00       420,000         ヤマトインタ・ナショナル       100       333.00       33,300         ミッウロコグルーブ       300       1,267.00       380,100         シナネンホールディングス       100       3,075.00       307,500         伊藤忠エネクス       500       976.00       488,000         サンワ テクノス       100       855.00       85,500         リョーサン       200       2,055.00       411,000         野米商事       300       871.00       261,300         トーホー       100       1,841.00       184,100         三信電気       100       2,077.00       207,700         東陽テクニカ       200       989.00       197,800         モスフード サービス       300       2,819.00       845,700         加賀電子       200       2,385.00       477,000         都築電気       100       1,709.00       170,900         ソーダニカー       200       2,385.00       477,000         都築電気       100       1,757.00       351,400         シーダニカー       200       388.00       179,600         テアールディングス       200       388.00       179,600	ヤマエ久野	200	1,183.00	236,600	
ワ キ タ       400       1,050.00       420,000         ヤマトインタ・ナショナル       100       333.00       33,300         ミッウロコグループ       300       1,267.00       380,100         シナネンホールディングス       100       3,075.00       307,500         伊藤忠エネクス       500       976.00       488,000         サンワ テクノス       100       855.00       85,500         リョーサン       200       2,055.00       411,000         新光商事       300       871.00       261,300         トーホー       100       1,841.00       184,100         三信電気       100       2,077.00       207,770         東陽テクニカ       200       2,819.00       845,700         加賀電子       200       2,184.00       436,800         三益半導体       200       2,385.00       477,000         都築電気       100       1,709.00       170,900         ソーダニツカ       200       1,757.00       351,400         本曽路       300       2,529.00       758,700         S R S ホールディングス       200       898.00       179,600         オ 趣会       400       380.00       152,000         カナニー       400       732.00       292,800	デサント	400	1,670.00	668,000	
ヤマトインタ・ナショナル 100 333.00 33,300 ミッウロコグループ 300 1,267.00 380,100 シナネンホールディングス 100 3,075.00 37,500 伊藤忠エネクス 500 976.00 488,000 サンワ テクノス 100 855.00 85,500 19 -	キ ン グ	100	584.00	58,400	
ミッウロコグループ         300         1,267.00         380,100           シナネンホールディングス         100         3,075.00         307,500           伊藤忠エネクス         500         976.00         488,000           サンワ テクノス         100         855.00         85,500           リョーサン         200         2,055.00         411,000           新光商事         300         871.00         261,300           トーホー         100         1,841.00         184,100           三信電気         100         2,077.00         207,700           東陽テクニカ         200         989.00         197,800           モスフード サービス         300         2,819.00         845,700           加質電子         200         2,184.00         436,800           三益半導体         200         2,385.00         477,000           都築電気         100         1,709.00         170,900           ソーダニツカ         200         570.00         114,000           立花エレテック         200         1,757.00         351,400           本曽路         300         2,529.00         758,700           S R S ホールディングス         200         898.00         179,600           サールバートナーズ         300         1,470.00	ワ キ タ	400	1,050.00	420,000	
シナネンホールディングス       100       3,075.00       307,500         伊藤忠エネクス       500       976.00       488,000         サンワ テクノス       100       855.00       85,500         リョーサン       200       2,055.00       411,000         新光商事       300       871.00       261,300         トーホー       100       1,841.00       184,100         三信電気       100       2,077.00       207,700         東陽テクニカ       200       989.00       197,800         モスフード サービス       300       2,819.00       845,700         加賀電子       200       2,184.00       436,800         三益半導体       200       2,385.00       477,000         都築電気       100       1,709.00       170,900         ソーダニッカ       200       570.00       114,000         立たエレテック       200       1,757.00       351,400         本箇路       300       2,529.00       758,700         S R S ホールディングス       200       898.00       179,600         千 趣 会       400       380.00       152,000         タカキュー       400       380.00       152,000         リテールパートナーズ       300       1,470.00       441,000 <tr< td=""><td>ヤマトインタ - ナシヨナル</td><td>100</td><td>333.00</td><td>33,300</td><td>,</td></tr<>	ヤマトインタ - ナシヨナル	100	333.00	33,300	,
伊藤忠エネクス 500 976.00 488,000 サンワ テクノス 100 855.00 85,500 リョーサン 200 2,055.00 411,000 新光商事 300 871.00 261,300 トーホー 100 1,841.00 184,100 三信電気 100 2,077.00 207,700 東陽テクニカ 200 989.00 197,800 モスフード サービス 300 2,819.00 845,700 加賀電子 200 2,385.00 477,000 都築電気 100 1,709.00 170,900 サーダニックカ 200 570.00 114,000 立花エレテック 200 1,757.00 351,400 木曽路 300 2,529.00 758,700 SRSホールディングス 200 898.00 179,600 サーダニック 300 170,900 170,900 サーダニック 300 2,529.00 758,700 170,900 サーダニック 300 170,900 170,900 サーダニック 300 170,900 170,900 サーダニック 300 2,529.00 758,700 170,900	ミツウロコグループ	300	1,267.00	380,100	
サンワ テクノス 100 855.00 85,500 19ョーサン 200 2,055.00 411,000 3	シナネンホールディングス	100	3,075.00	307,500	
リョーサン       200       2,055.00       411,000         新光商事       300       871.00       261,300         トーホー       100       1,841.00       184,100         三信電気       100       2,077.00       207,700         東陽テクニカ       200       989.00       197,800         モスフード サービス       300       2,819.00       845,700         加賀電子       200       2,184.00       436,800         三益半導体       200       2,385.00       477,000         都築電気       100       1,709.00       170,900         ソーダニツカ       200       570.00       114,000         立花エレテック       200       1,757.00       351,400         木曽路       300       2,529.00       758,700         S R S ホールディングス       200       898.00       179,600         干 趣 会       400       380.00       152,000         サテールパートナーズ       300       1,470.00       441,000         ケーヨー       400       732.00       292,800         上新電機       200       2,626.00       525,200         日本瓦斯       300       5,210.00       1,563,000         ロイヤルホールディングス       400       1,858.00       557,400	伊藤忠エネクス	500	976.00	488,000	
新光商事 300 871.00 261,300 トーホー 100 1,841.00 184,100 三信電気 100 2,077.00 207,700 東陽テクニカ 200 989.00 197,800 元 2スフード サービス 300 2,819.00 845,700 加賀電子 200 2,184.00 436,800 三益半導体 200 2,385.00 477,000 都築電気 100 1,709.00 170,900 ブイスのり 114,000 立花エレテック 200 1,757.00 351,400 木曽路 300 2,529.00 758,700 SRSホールディングス 200 898.00 179,600 千 趣 会 400 380.00 152,000 グカキュー 200 1,40.00 28,000 リテールパートナーズ 300 1,470.00 441,000 ケーヨー 400 732.00 292,800 上新電機 200 2,626.00 525,200 日本瓦斯 300 1,821.00 728,400 いなげや 300 1,858.00 577,400 テオタブーボレーション 200 3,860.00 772,000 リテスのり 1,532.00 ライフコーボレーション 200 3,860.00 772,000 リアスのり リテスのり 1,553.00 アスのり 1,553.00 アス	サンワ テクノス	100	855.00	85,500	
トーホー 100 1,841.00 184,100 三信電気 100 2,077.00 207,700 東陽テクニカ 200 989.00 197,800 177,800 元子フード サービス 300 2,819.00 845,700 加賀電子 200 2,184.00 436,800 三益半導体 200 2,385.00 477,000 都築電気 100 1,709.00 170,900 ブーダニツカ 200 570.00 114,000 立花エレテック 200 1,757.00 351,400 未曽路 300 2,529.00 758,700 SRSホールディングス 200 898.00 179,600 千 趣 会 400 380.00 152,000 グラキュー 200 140.00 28,000 リテールパートナーズ 300 1,470.00 441,000 ケーヨー 400 732.00 292,800 上新電機 200 2,626.00 525,200 日本瓦斯 300 5,210.00 1,563,000 ロイヤルホールディングス 400 1,821.00 728,400 いなげや 300 1,858.00 557,400 テヨダ 200 966.00 193,200 ライフコーボレーション 200 3,860.00 772,000 リンガーハツト 300 2,221.00 666,300 Mr Ma X H D 300 743.00 222,900 テンアライド 200 357.00 71,400	リョーサン	200	2,055.00	411,000	
三信電気       100       2,077.00       207,700         東陽テクニカ       200       989.00       197,800         モスフード サービス       300       2,819.00       845,700         加賀電子       200       2,184.00       436,800         三益半導体       200       2,385.00       477,000         都築電気       100       1,709.00       170,900         ソーダニツカ       200       570.00       114,000         立花エレテック       200       1,757.00       351,400         木曽路       300       2,529.00       758,700         S R Sホールディングス       200       898.00       179,600         干 趣 会       400       380.00       152,000         タカキュー       200       140.00       28,000         リテールパートナーズ       300       1,470.00       441,000         ケーヨー       400       732.00       292,800         上新電機       200       2,626.00       525,200         日本瓦斯       300       5,210.00       1,563,000         ロイヤルホールディングス       400       1,821.00       728,400         いなげや       300       1,858.00       557,400         デヨダ       200       3,860.00       772,000	新光商事	300	871.00	261,300	
東陽テクニカ 200 989.00 197,800 Eスフード サービス 300 2,819.00 845,700 Mpg電子 200 2,184.00 436,800 三益半導体 200 2,385.00 477,000 都築電気 100 1,709.00 170,900 ソーダニツカ 200 570.00 114,000 立花エレテック 200 1,757.00 351,400 木曽路 300 2,529.00 758,700 SR Sホールディングス 200 898.00 179,600 千 趣 会 400 380.00 152,000 タカキユー 200 140.00 28,000 リテールパートナーズ 300 1,470.00 441,000 ケーヨー 400 732.00 292,800 上新電機 200 2,626.00 525,200 日本瓦斯 300 5,210.00 1,563,000 ロイヤルホールディングス 400 1,821.00 728,400 いなげや 300 1,858.00 557,400 チョダ 200 966.00 193,200 ライフコーポレーション 200 3,860.00 772,000 リンガーハツト 300 2,221.00 666,300 Mr Ma X H D 300 743.00 222,900 テンアライド 200 357.00 71,400	トーホー	100	1,841.00	184,100	
モスフード サービス       300       2,819.00       845,700         加賀電子       200       2,184.00       436,800         三益半導体       200       2,385.00       477,000         都築電気       100       1,709.00       170,900         ソーダニツカ       200       570.00       114,000         立花エレテック       200       1,757.00       351,400         木曽路       300       2,529.00       758,700         S R S ホールディングス       200       898.00       179,600         干 趣 会       400       380.00       152,000         タカキユー       200       140.00       28,000         リテールパートナーズ       300       1,470.00       441,000         ケーヨー       400       732.00       292,800         上新電機       200       2,626.00       525,200         日本瓦斯       300       5,210.00       1,563,000         ロイヤルホールディングス       400       1,821.00       728,400         いなげや       300       1,858.00       557,400         チョダ       200       966.00       193,200         ライフコーポレーション       200       3,860.00       772,000         リンガーハツト       300       743.00       222,900	三信電気	100	2,077.00	207,700	
加賀電子 200 2,184.00 436,800 三益半導体 200 2,385.00 477,000 都築電気 100 1,709.00 170,900 ソーダニツカ 200 570.00 114,000 立花エレテック 200 1,757.00 351,400 木曽路 300 2,529.00 758,700 SRSホールディングス 200 898.00 179,600 千趣 会 400 380.00 152,000 グカキユー 200 140.00 28,000 リテールパートナーズ 300 1,470.00 441,000 ケーヨー 400 732.00 292,800 上新電機 200 2,626.00 525,200 日本瓦斯 300 5,210.00 1,563,000 ロイヤルホールディングス 400 1,821.00 728,400 いなげや 300 1,858.00 557,400 チョダ 200 966.00 193,200 ライフコーポレーション 200 3,860.00 772,000 リンガーハツト 300 2,221.00 666,300 Mr Ma x H D 300 743.00 222,900 テンアライド 200 357.00 71,400	東陽テクニカ	200	989.00	197,800	
三益半導体       200       2,385.00       477,000         都築電気       100       1,709.00       170,900         ソーダニツカ       200       570.00       114,000         立花エレテック       200       1,757.00       351,400         木曽路       300       2,529.00       758,700         SRSホールディングス       200       898.00       179,600         干 趣 会       400       380.00       152,000         タカキユー       200       140.00       28,000         リテールパートナーズ       300       1,470.00       441,000         ケーヨー       400       732.00       292,800         上新電機       200       2,626.00       525,200         日本瓦斯       300       5,210.00       1,563,000         ロイヤルホールディングス       400       1,821.00       728,400         いなげや       300       1,858.00       557,400         チヨダ       200       3,860.00       772,000         リンガーハツト       300       2,221.00       666,300         M r M a x H D       300       743.00       222,900         テンアライド       200       357.00       71,400	モスフード サービス	300	2,819.00	845,700	
都築電気 100 1,709.00 170,900 170,900 200 570.00 114,000 立花エレテック 200 1,757.00 351,400 未曽路 300 2,529.00 758,700 SRSホールディングス 200 898.00 179,600 千 趣 会 400 380.00 152,000 9カキュー 200 140.00 28,000 リテールパートナーズ 300 1,470.00 441,000 ケーヨー 400 732.00 292,800 上新電機 200 2,626.00 525,200 日本瓦斯 300 5,210.00 1,563,000 ロイヤルホールディングス 400 1,821.00 728,400 いなげや 300 1,858.00 557,400 チョダ 200 966.00 193,200 ライフコーボレーション 200 3,860.00 772,000 リンガーハツト 300 2,221.00 666,300 MrMaxHD 300 743.00 222,900 テンアライド 200 357.00 71,400	加賀電子	200	2,184.00	436,800	
ソーダニツカ       200       570.00       114,000         立花エレテック       200       1,757.00       351,400         木曽路       300       2,529.00       758,700         S R S ホールディングス       200       898.00       179,600         干 趣 会       400       380.00       152,000         タカキュー       200       140.00       28,000         リテールパートナーズ       300       1,470.00       441,000         ケーヨー       400       732.00       292,800         上新電機       200       2,626.00       525,200         日本瓦斯       300       5,210.00       1,563,000         ロイヤルホールディングス       400       1,821.00       728,400         いなげや       300       1,858.00       557,400         チヨダ       200       3,860.00       772,000         リンガーハツト       300       2,221.00       666,300         M r M a x H D       300       743.00       222,900         テンアライド       200       357.00       71,400	三益半導体	200	2,385.00	477,000	
立花エレテック       200       1,757.00       351,400         木曽路       300       2,529.00       758,700         SRSホールディングス       200       898.00       179,600         千趣会       400       380.00       152,000         タカキュー       200       140.00       28,000         リテールパートナーズ       300       1,470.00       441,000         ケーヨー       400       732.00       292,800         上新電機       200       2,626.00       525,200         日本瓦斯       300       5,210.00       1,563,000         ロイヤルホールディングス       400       1,821.00       728,400         いなげや       300       1,858.00       557,400         チヨダ       200       966.00       193,200         ライフコーポレーション       200       3,860.00       772,000         リンガーハツト       300       2,221.00       666,300         Mr Max HD       300       743.00       222,900         テンアライド       200       357.00       71,400	都築電気	100	1,709.00	170,900	
木曽路   300   2,529.00   758,700   SRSホールディングス   200   898.00   179,600   日本瓦斯   300   2,626.00   1,821.00	ソーダニツカ	200	570.00	114,000	
SRSホールディングス       200       898.00       179,600         干趣会       400       380.00       152,000         タカキユー       200       140.00       28,000         リテールパートナーズ       300       1,470.00       441,000         ケーヨー       400       732.00       292,800         上新電機       200       2,626.00       525,200         日本瓦斯       300       5,210.00       1,563,000         ロイヤルホールディングス       400       1,821.00       728,400         いなげや       300       1,858.00       557,400         チヨダ       200       966.00       193,200         ライフコーボレーション       200       3,860.00       772,000         リンガーハツト       300       2,221.00       666,300         Mr Max H D       300       743.00       222,900         テンアライド       200       357.00       71,400	立花エレテック	200	1,757.00	351,400	
千趣会       400       380.00       152,000         タカキユー       200       140.00       28,000         リテールパートナーズ       300       1,470.00       441,000         ケーヨー       400       732.00       292,800         上新電機       200       2,626.00       525,200         日本瓦斯       300       5,210.00       1,563,000         ロイヤルホールディングス       400       1,821.00       728,400         いなげや       300       1,858.00       557,400         チヨダ       200       966.00       193,200         ライフコーポレーション       200       3,860.00       772,000         リンガーハツト       300       2,221.00       666,300         M r M a x H D       300       743.00       222,900         テンアライド       200       357.00       71,400	木曽路	300	2,529.00	758,700	
タカキュー       200       140.00       28,000         リテールパートナーズ       300       1,470.00       441,000         ケーヨー       400       732.00       292,800         上新電機       200       2,626.00       525,200         日本瓦斯       300       5,210.00       1,563,000         ロイヤルホールディングス       400       1,821.00       728,400         いなげや       300       1,858.00       557,400         チヨダ       200       966.00       193,200         ライフコーポレーション       200       3,860.00       772,000         リンガーハツト       300       2,221.00       666,300         M r M a x H D       300       743.00       222,900         テンアライド       200       357.00       71,400	SRSホールディングス	200	898.00	179,600	
リテールパートナーズ       300       1,470.00       441,000         ケーヨー       400       732.00       292,800         上新電機       200       2,626.00       525,200         日本瓦斯       300       5,210.00       1,563,000         ロイヤルホールディングス       400       1,821.00       728,400         いなげや       300       1,858.00       557,400         チヨダ       200       966.00       193,200         ライフコーポレーション       200       3,860.00       772,000         リンガーハツト       300       2,221.00       666,300         M r M a x H D       300       743.00       222,900         テンアライド       200       357.00       71,400	千 趣 会	400	380.00	152,000	
ケーヨー400732.00292,800上新電機2002,626.00525,200日本瓦斯3005,210.001,563,000ロイヤルホールディングス4001,821.00728,400いなげや3001,858.00557,400チョダ200966.00193,200ライフコーポレーション2003,860.00772,000リンガーハツト3002,221.00666,300M r M a x H D300743.00222,900テンアライド200357.0071,400	タカキユー	200	140.00	28,000	
上新電機 200 2,626.00 525,200 日本瓦斯 300 5,210.00 1,563,000 ロイヤルホールディングス 400 1,821.00 728,400 いなげや 300 1,858.00 557,400 チョダ 200 966.00 193,200 ライフコーポレーション 200 3,860.00 772,000 リンガーハツト 300 2,221.00 666,300 Mr Max HD 300 743.00 222,900 テンアライド 200 357.00 71,400	リテールパートナーズ	300	1,470.00	441,000	
日本瓦斯 300 5,210.00 1,563,000 ロイヤルホールディングス 400 1,821.00 728,400 いなげや 300 1,858.00 557,400 チョダ 200 966.00 193,200 ライフコーポレーション 200 3,860.00 772,000 リンガーハツト 300 2,221.00 666,300 Mr Max HD 300 743.00 222,900 テンアライド 200 357.00 71,400	ケーヨー	400	732.00	292,800	
ロイヤルホールディングス 400 1,821.00 728,400 いなげや 300 1,858.00 557,400 チヨダ 200 966.00 193,200 ライフコーポレーション 200 3,860.00 772,000 リンガーハツト 300 2,221.00 666,300 Mr Max HD 300 743.00 222,900 テンアライド 200 357.00 71,400	上新電機	200	2,626.00	525,200	
いなげや       300       1,858.00       557,400         チヨダ       200       966.00       193,200         ライフコーポレーション       200       3,860.00       772,000         リンガーハツト       300       2,221.00       666,300         M r M a x H D       300       743.00       222,900         テンアライド       200       357.00       71,400	日本瓦斯	300	5,210.00	1,563,000	
チヨダ       200       966.00       193,200         ライフコーポレーション       200       3,860.00       772,000         リンガーハツト       300       2,221.00       666,300         M r M a x H D       300       743.00       222,900         テンアライド       200       357.00       71,400	ロイヤルホールディングス	400	1,821.00	728,400	
ライフコーポレーション       200       3,860.00       772,000         リンガーハツト       300       2,221.00       666,300         MrMaxHD       300       743.00       222,900         テンアライド       200       357.00       71,400	いなげや	300	1,858.00	557,400	
リンガーハツト       300       2,221.00       666,300         M r M a x H D       300       743.00       222,900         テンアライド       200       357.00       71,400	チヨダ	200	966.00	193,200	
M r M a x H D     300     743.00     222,900       テンアライド     200     357.00     71,400	ライフコーポレーション	200	3,860.00	772,000	
テンアライド 200 357.00 71,400	リンガーハツト	300	2,221.00	666,300	
	MrMaxHD	300	743.00	222,900	
A O K I ホールディングス 400 485.00 194,000	テンアライド	200	357.00	71,400	
	AOKIホールディングス	400	485.00	194,000	

			有価証券届出書(内国	国投資信託
オークワ	300	1,430.00	429,000	
コメリ	300	3,120.00	936,000	
青山商事	400	529.00	211,600	
はせがわ	100	300.00	30,000	
松屋	400	700.00	280,000	
近鉄百貨店	100	3,185.00	318,500	
アクシアル リテイリング	200	4,540.00	908,000	
井 筒 屋	100	179.00	17,900	
フオーバル	100	924.00	92,400	
平 和 堂	400	2,276.00	910,400	
フ ジ	300	1,942.00	582,600	
ヤオコー	200	7,500.00	1,500,000	
ゼビオホールディングス	300	733.00	219,900	
三谷産業	300	407.00	122,100	
OLYMPICグループ	100	991.00	99,100	
日産東京販売 H D	300	257.00	77,100	
武蔵野銀行	300	1,602.00	480,600	
千葉興業銀行	500	270.00	135,000	
筑波銀行	900	189.00	170,100	
青森銀行	200	2,454.00	490,800	
秋田銀行	100	1,561.00	156,100	
山形銀行	200	1,381.00	276,200	
岩手銀行	100	2,471.00	247,100	
東邦銀行	1,900	232.00	440,800	
東北銀行	100	1,118.00	111,800	
みちのく銀行	100	1,263.00	126,300	
十六銀行	300	1,976.00	592,800	
山梨中央銀行	200	859.00	171,800	
大垣共立銀行	400	2,347.00	938,800	
福井銀行	200	1,868.00	373,600	
北國銀行	200	3,030.00	606,000	
清水銀行	100	1,781.00	178,100	
南都銀行	300	1,942.00	582,600	
百五銀行	1,900	331.00	628,900	
紀陽銀行	700	1,569.00	1,098,300	
山陰合同銀行	1,200	547.00	656,400	
鳥取銀行	100	1,145.00	114,500	
百十四銀行	200	1,760.00	352,000	
四国銀行	300	742.00	222,600	
阿波銀行	300	2,529.00	758,700	

			有価証券届出書(内国持	投資信託
大分銀行	100	2,510.00	251,000	
宮崎銀行	100	2,362.00	236,200	
佐賀銀行	100	1,335.00	133,500	
沖縄銀行	200	3,050.00	610,000	
琉球銀行	500	893.00	446,500	
高知銀行	100	753.00	75,300	
芙蓉総合リース	200	6,260.00	1,252,000	
みずほリース	300	2,774.00	832,200	
日本証券金融	900	517.00	465,300	
アイフル	3,200	287.00	918,400	
日本アジア投資	200	226.00	45,200	
長野銀行	100	1,418.00	141,800	
名古屋銀行	200	2,791.00	558,200	
北洋銀行	3,200	229.00	732,800	
愛知銀行	100	2,994.00	299,400	
中京銀行	100	2,169.00	216,900	
大光銀行	100	1,300.00	130,000	
愛媛銀行	300	1,179.00	353,700	
トマト銀行	100	1,048.00	104,800	
京葉銀行	900	489.00	440,100	
栃木銀行	1,000	185.00	185,000	
北日本銀行	100	1,990.00	199,000	
東和銀行	400	716.00	286,400	
福島銀行	200	238.00	47,600	
大東銀行	100	615.00	61,500	
リコーリース	200	2,812.00	562,400	
ジャックス	200	1,726.00	345,200	
オリコ	5,700	115.00	655,500	
アプラスフィナンシャル	1,000	78.00	78,000	
九州 リースサービス	100	619.00	61,900	
トモニホールディングス	1,600	332.00	531,200	
岡三証券グループ	1,800	365.00	657,000	
丸三証券	600	506.00	303,600	
東洋証券	800	124.00	99,200	
東海東京HD	2,400	285.00	684,000	
光世証券	100	709.00	70,900	
水戸証券	600	221.00	132,600	
いちよし証券	400	470.00	188,000	
マネックスG	1 600	280.00	448,000	
\\\ \\ \	1,600	200.00	440,000	

			有価証券届出書(内国	国投資信託
岩井コスモホールディング	200	1,389.00	277,800	
藍澤證券	400	705.00	282,000	
フィデアホール	2,000	109.00	218,000	
池田泉州 H D	2,400	168.00	403,200	
アニコム ホールディングス	800	1,218.00	974,400	
マネーパートナーズG P	200	202.00	40,400	
スパークス・グループ	700	250.00	175,000	
小林洋行	100	265.00	26,500	
アドバンテッジリスクマネ	100	765.00	76,500	
イー・ギャランティ	200	2,281.00	456,200	
アサックス	100	754.00	75,400	
NECキャピタルソリューション	100	1,874.00	187,400	
平和不動産	400	3,100.00	1,240,000	
ダイビル	500	1,245.00	622,500	
京阪神ビルディング	300	1,793.00	537,900	
太平洋興発	100	617.00	61,700	
テーオーシー	400	662.00	264,800	
レオパレス 2 1	2,800	165.00	462,000	
スターツコーポレーション	300	2,439.00	731,700	
フジ住宅	200	537.00	107,400	
空港施設	200	475.00	95,000	
明和地所	100	493.00	49,300	
ゴールドクレスト	200	1,356.00	271,200	
エスリード	100	1,373.00	137,300	
日神グループHLDGS	300	419.00	125,700	
日本エスコン	400	985.00	394,000	
タカラレーベン	1,000	309.00	309,000	
AVANTIA	100	872.00	87,200	
毎日コムネット	100	721.00	72,100	
ファースト住建	100	1,082.00	108,200	
ランド	11,400	9.00	102,600	
カチタス	500	3,315.00	1,657,500	
東祥	100	1,339.00	133,900	
トーセイ	300	1,072.00	321,600	
サンフロンティア不動産	300	897.00	269,100	
エフ・ジェー・ネクスト	200	943.00	188,600	
インテリックス	100	514.00	51,400	
ランドビジネス	100	328.00	32,800	
サンネクスタグループ	100	1,021.00	102,100	
グランディハウス	200	374.00	74,800	
L	1		ļ	

			有価証券届出書(内国	国投資信託
富士急行	300	4,375.00	1,312,500	
新京成電鉄	100	2,158.00	215,800	
鴻池運輸	300	1,145.00	343,500	
ハマキョウレックス	200	3,135.00	627,000	
サカイ引越センター	100	5,140.00	514,000	
山陽電鉄	100	2,096.00	209,600	
トランコム	100	7,640.00	764,000	
日新	200	1,550.00	310,000	
丸運	100	247.00	24,700	
丸全昭和運輸	200	3,370.00	674,000	
センコーグループHLDGS	1,100	973.00	1,070,300	
福山通運	300	4,655.00	1,396,500	
エスライン	100	981.00	98,100	
日立物流	400	3,405.00	1,362,000	
丸和運輸機関	200	4,660.00	932,000	
C & F ロジホールディングス	200	1,741.00	348,200	
川崎汽船	600	1,335.00	801,000	
NSユナイテッド海運	100	1,479.00	147,900	
明治海運	200	395.00	79,000	
飯野海運	1,000	381.00	381,000	
GENKY DRUGSTORES	100	3,845.00	384,500	
国際紙パルプ商事	500	280.00	140,000	
ブックオフGHD	100	863.00	86,300	
三井倉庫HOLD	200	1,932.00	386,400	
住友倉庫	700	1,301.00	910,700	
渋沢倉庫	100	2,239.00	223,900	
ヤマタネ	100	1,367.00	136,700	
東陽倉庫	400	332.00	132,800	
乾汽船	100	917.00	91,700	
日本トランスシティ	400	600.00	240,000	
中央倉庫	100	1,200.00	120,000	
安田倉庫	200	958.00	191,600	
東洋埠頭	100	1,498.00	149,800	
宇徳	200	489.00	97,800	
キムラユニティー	100	1,091.00	109,100	
キユーソー流通システム	100	1,726.00	172,600	
近鉄エクスプレス	400	2,396.00	958,400	
東海運	100	312.00	31,200	
エーアイテイー	100	1,070.00	107,000	
内外トランスライン	100	1,239.00	123,900	

			有価証券届出書(内国	<u>国投資信託</u>
日本コンセプト	100	1,506.00	150,600	
朝日放送グループHD	200	707.00	141,400	
スカパーJSATHD	1,400	455.00	637,000	
テレビ東京 H D	200	2,399.00	479,800	
日本BS放送	100	1,082.00	108,200	
ビジョン	200	975.00	195,000	
スマートバリュー	100	1,124.00	112,400	
USEN-NEXT HLDGS	100	1,420.00	142,000	
ワイヤレスゲート	100	779.00	77,900	
コネクシオ	100	1,219.00	121,900	
日本通信	1,600	215.00	344,000	
エムティーアイ	200	928.00	185,600	
GMOインターネット	800	3,000.00	2,400,000	
ファイバーゲート	100	2,451.00	245,100	
アイドママーケティングコミュ	100	420.00	42,000	
KADOKAWA	600	2,901.00	1,740,600	
学研ホールディングス	400	1,524.00	609,600	
ゼンリン	400	1,225.00	490,000	
昭文社ホールディングス	100	484.00	48,400	
インプレスホールディングス	200	183.00	36,600	
沖縄電力	400	1,594.00	637,600	
エフオン	100	895.00	89,500	
イーレックス	300	1,313.00	393,900	
レノバ	400	1,552.00	620,800	
北海道瓦斯	100	1,548.00	154,800	
広島ガス	400	376.00	150,400	
西部瓦斯	200	2,625.00	525,000	
静岡ガス	600	936.00	561,600	
メタウォーター	200	2,314.00	462,800	
アイネット	100	1,547.00	154,700	
エイチ・アイ・エス	300	1,677.00	503,100	
東映	100	16,740.00	1,674,000	
共立メンテナンス	300	4,065.00	1,219,500	
イチネンホールディングス	200	1,301.00	260,200	
建設技術研究所	100	1,910.00	191,000	
スペース	100	780.00	78,000	
長大	100	1,273.00	127,300	
燦ホールディングス	100	1,192.00	119,200	
東京テアトル	100	1,279.00	127,900	
ナガワ	100	7,520.00	752,000	
				<del></del>

東京都競馬 100 5,600.00 560,000 常磐興産 100 1,478.00 147,800 カナモト 300 2,352.00 705,600 東京ドーム 800 802.00 641,600 DTS 500 2,277.00 1,138,500 シーイーシー 200 1,646.00 329,200 西尾レントオール 200 2,195.00 439,000 アゴーラ・ホスピタリティーG 1,300 27.00 35,100 トランス・コスモス 200 2,830.00 566,000 ジャステック 100 1,514.00 151,400 藤田観光 100 1,565.00 156,500 KNT - CTホールディングス 100 1,115.00 111,500 上一カイ 200 2,075.00 415,000 トーカイ 200 2,075.00 415,000 トーカイ 200 2,075.00 420,400 日本システムウエア 100 2,077.00 207,700 セントラル警備保障 100 3,635.00 363,500 アイネス 200 6,940.00 1,388,000 富士ソフト 300 5,780.00 1,734,000 富士ソフト	
カナモト 東京ドーム       300       2,352.00       705,600         東京ドーム       800       802.00       641,600         DTS       500       2,277.00       1,138,500         シーイーシー       200       1,646.00       329,200         西尾レントオール       200       2,195.00       439,000         アゴーラ・ホスピタリティーG       1,300       27.00       35,100         トランス・コスモス       200       2,830.00       566,000         万村工藝社       900       740.00       666,000         ジャステック       100       1,514.00       151,400         藤田観光       100       1,565.00       156,500         KNT - CTホールディングス       100       1,115.00       111,500         日本管財       200       2,075.00       415,00         トーカイ       200       2,077.00       207,70         セントラル警備保障       100       3,635.00       363,50         アイネス       200       1,643.00       328,60         アイネス       200       6,940.00       1,388,00	
東京ドーム 800 802.00 641,600 DTS 500 2,277.00 1,138,500 シーイーシー 200 1,646.00 329,200 西尾レントオール 200 2,195.00 439,000 アゴーラ・ホスピタリティーG 1,300 27.00 35,100 トランス・コスモス 200 2,830.00 566,000 グヤステック 100 1,514.00 151,400 藤田観光 100 1,565.00 156,500 KNT-CTホールディングス 100 1,115.00 111,500 上一カイ 200 2,075.00 415,000 トーカイ 200 2,102.00 420,400 日本システムウエア 100 3,635.00 363,500 アイネス 200 1,643.00 328,600 円青社 400 767.00 306,800 TKC 200 6,940.00 1,388,000	
DTS       500       2,277.00       1,138,50         シーイーシー       200       1,646.00       329,20         西尾レントオール       200       2,195.00       439,00         アゴーラ・ホスピタリティーG       1,300       27.00       35,10         トランス・コスモス       200       2,830.00       566,00         万村工藝社       900       740.00       666,00         ジャステック       100       1,514.00       151,40         藤田観光       100       1,565.00       156,50         KNT - CTホールディングス       100       1,115.00       111,50         日本管財       200       2,075.00       415,00         トーカイ       200       2,075.00       420,40         日本システムウエア       100       2,077.00       207,70         セントラル警備保障       100       3,635.00       363,50         アイネス       200       1,643.00       328,60         アイネス       200       6,940.00       1,388,00	
シーイーシー       200       1,646.00       329,20         西尾レントオール       200       2,195.00       439,00         アゴーラ・ホスピタリティーG       1,300       27.00       35,10         トランス・コスモス       200       2,830.00       566,00         乃村工藝社       900       740.00       666,00         ジャステック       100       1,514.00       151,40         藤田観光       100       1,565.00       156,50         KNT - C Tホールディングス       100       1,115.00       111,50         日本管財       200       2,075.00       415,00         トーカイ       200       2,075.00       420,40         日本システムウエア       100       2,077.00       207.70         セントラル警備保障       100       3,635.00       363,50         アイネス       200       1,643.00       328,60         円青社       400       767.00       306,80         T K C       200       6,940.00       1,388,00	
西尾レントオール 200 2,195.00 439,000 アゴーラ・ホスピタリティーG 1,300 27.00 35,100 トランス・コスモス 200 2,830.00 566,000 万村工藝社 900 740.00 666,000 ジャステック 100 1,514.00 151,400 藤田観光 100 1,565.00 156,500 KNT - CTホールディングス 100 1,115.00 111,500 111,500 日本管財 200 2,075.00 415,000 トーカイ 200 2,102.00 420,400 日本システムウエア 100 3,635.00 363,500 アイネス 200 1,643.00 328,600 アイネス 200 6,940.00 1,388,000 TKC 200 6,940.00 1,388,000	
アゴーラ・ホスピタリティーG       1,300       27.00       35,10         トランス・コスモス       200       2,830.00       566,00         乃村工藝社       900       740.00       666,00         ジャステック       100       1,514.00       151,40         藤田観光       100       1,565.00       156,50         KNT-CTホールディングス       100       1,115.00       111,50         日本管財       200       2,075.00       415,00         トーカイ       200       2,102.00       420,40         日本システムウエア       100       2,077.00       207,70         セントラル警備保障       100       3,635.00       363,50         アイネス       200       1,643.00       328,60         丹青社       400       767.00       306,80         TKC       200       6,940.00       1,388,00	
トランス・コスモス2002,830.00566,00乃村工藝社900740.00666,00ジャステック1001,514.00151,40藤田観光1001,565.00156,50KNT - CTホールディングス1001,115.00111,50日本管財2002,075.00415,00トーカイ2002,102.00420,40日本システムウエア1002,077.00207,70セントラル警備保障1003,635.00363,50アイネス2001,643.00328,60丹青社400767.00306,80TKC2006,940.001,388,00	
乃村工藝社       900       740.00       666,00         ジャステック       100       1,514.00       151,40         藤田観光       100       1,565.00       156,50         KNT - CTホールディングス       100       1,115.00       111,50         日本管財       200       2,075.00       415,00         トーカイ       200       2,102.00       420,40         日本システムウエア       100       2,077.00       207,70         セントラル警備保障       100       3,635.00       363,50         アイネス       200       1,643.00       328,60         丹青社       400       767.00       306,80         T K C       200       6,940.00       1,388,00	+
ジャステック       100       1,514.00       151,40         藤田観光       100       1,565.00       156,50         KNT - CTホールディングス       100       1,115.00       111,50         日本管財       200       2,075.00       415,00         トーカイ       200       2,102.00       420,40         日本システムウエア       100       2,077.00       207,70         セントラル警備保障       100       3,635.00       363,50         アイネス       200       1,643.00       328,60         丹青社       400       767.00       306,80         T K C       200       6,940.00       1,388,00	)
藤田観光 100 1,565.00 156,500 KNT-CTホールディングス 100 1,115.00 111,500 111,500 日本管財 200 2,075.00 415,000 トーカイ 200 2,102.00 420,400 日本システムウエア 100 2,077.00 207,700 セントラル警備保障 100 3,635.00 363,500 アイネス 200 1,643.00 328,600 円青社 400 767.00 306,800 TKC 200 6,940.00 1,388,000	1
KNT-CTホールディングス1001,115.00111,500日本管財2002,075.00415,000トーカイ2002,102.00420,400日本システムウエア1002,077.00207,700セントラル警備保障1003,635.00363,500アイネス2001,643.00328,600丹青社400767.00306,800TKC2006,940.001,388,000	
日本管財2002,075.00415,000トーカイ2002,102.00420,400日本システムウエア1002,077.00207,700セントラル警備保障1003,635.00363,500アイネス2001,643.00328,600丹青社400767.00306,800T K C2006,940.001,388,000	
トーカイ2002,102.00420,40日本システムウエア1002,077.00207,70セントラル警備保障1003,635.00363,50アイネス2001,643.00328,60丹青社400767.00306,80T K C2006,940.001,388,00	
日本システムウエア1002,077.00207,70セントラル警備保障1003,635.00363,50アイネス2001,643.00328,60丹青社400767.00306,80TKC2006,940.001,388,00	
セントラル警備保障1003,635.00363,500アイネス2001,643.00328,600丹青社400767.00306,800TKC2006,940.001,388,000	
アイネス     200     1,643.00     328,600       丹青社     400     767.00     306,800       T K C     200     6,940.00     1,388,000	,
丹青社     400     767.00     306,800       T K C     200     6,940.00     1,388,000	
T K C 200 6,940.00 1,388,00	,
宣士ソフト 300 5 780 00 1 734 00	1
<b>国エノフト</b>	,
応用地質 200 1,262.00 252,40	
船井総研ホールディン 400 2,441.00 976,40	,
N S D 700 1,950.00 1,365,000	
進学会ホールディングス 100 465.00 46,50	
オオバ 100 743.00 74,30	,
学 究 社 100 1,083.00 108,30	
イオンディライト 300 3,060.00 918,00c	
ナック 100 961.00 96,10	1
福井コンピュータH L D S 100 3,160.00 316,00	1
ニチイ学館 200 1,666.00 333,20	
ダイセキ 300 2,832.00 849,60	
ステップ 100 1,551.00 155,10	
日鉄物産 100 3,120.00 312,000	
泉州電業 100 3,195.00 319,500	
元気寿司 100 2,356.00 235,60	
トラスコ中山 400 2,728.00 1,091,200	
モリト 200 686.00 137,20	$\overline{}$
アークランドサカモト 300 2,262.00 678,60	) [
グルメ杵屋 100 974.00 97,40	+

n				
愛・眼	200	231.00	46,200	
ケーユーホールディングス	100	825.00	82,500	
加藤産業	300	3,675.00	1,102,500	
イノテック	100	1,016.00	101,600	
イエローハット	400	1,814.00	725,600	
松屋フーズHLDGS	100	3,550.00	355,000	
JBCCホールディングス	200	1,609.00	321,800	
JKホールディングス	200	832.00	166,400	
サガミホールディングス	300	1,285.00	385,500	
日伝	200	2,301.00	460,200	
関西スーパーマーケット	200	1,289.00	257,800	
ミロク情報サービス	200	2,253.00	450,600	
北沢産業	200	284.00	56,800	
杉本商事	100	1,897.00	189,700	
因幡電機産業	600	2,600.00	1,560,000	
王将フードサービス	200	5,970.00	1,194,000	
プレナス	200	1,733.00	346,600	
ミニストップ	200	1,410.00	282,000	
アークス	400	2,411.00	964,400	
バローホールディングス	500	2,619.00	1,309,500	
東 テ ク	100	2,367.00	236,700	
アルテック	200	298.00	59,600	
ベルク	100	6,730.00	673,000	
大 庄	100	1,197.00	119,700	
タキヒヨー	100	1,830.00	183,000	
サックスバーホールディング	200	567.00	113,400	,
ジェコス	100	929.00	92,900	
グローセル	200	407.00	81,400	
ベルーナ	500	950.00	475,000	
合計			499,112,700	

- (2) 株式以外の有価証券 該当事項はありません。
- 第2 信用取引契約残高明細表 該当事項はありません。
- 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表 「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

EDINET提出書類 大和アセットマネジメント株式会社(E06748) 有価証券届出書 ( 内国投資信託受益証券 )

# 2 【ファンドの現況】

# 【純資産額計算書】

2020年10月30日

資産総額495,644,516円負債総額868,355円純資産総額( - )494,776,161円発行済数量522,644,849口1単位当たり純資産額( / )0.9467円

(参考) 日本小型株インデックス・マザーファンド

#### 純資産額計算書

2020年10月30日

資産総額 526,107,987円 負債総額 31,340,110円 純資産総額( - ) 494,767,877円 発行済数量 517,949,563口 1単位当たり純資産額( / ) 0.9552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) 受益者に対する特典 ありません。
- (3) 譲渡制限の内容 譲渡制限はありません。

### (4) 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。

#### (5) 受益権の譲渡

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

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

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

#### (6) 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。

### (7) 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。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

# (8) 償還金

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

償還金は、償還日において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者(償還日以前 において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された 受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則 として取得申込者とします。)に支払います。

# (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、 一部解約請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法 その他の法令等にしたがって取扱われます。

# 第三部 【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

2020年10月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株 発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に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.商品会議

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

#### 口. 商品担当役員

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

#### 八. 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。

# 二.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. 運用審査会議、リスクマネジメント会議および経営会議

・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。

・経営会議

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。

2020年10月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託(親投資信託を除きます。)は次のとおりです。

基本的性格	本数 (本)	純資産額の合計額(百万円)
単位型株式投資信託	49	78,815
追加型株式投資信託	714	16,924,703
株式投資信託 合計	763	17,003,518
単位型公社債投資信託	38	127,237
追加型公社債投資信託	14	1,437,527
公社債投資信託 合計	52	1,564,764
総合計	815	18,568,282

#### 3 【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)は、改正府令附則第3条第1項 ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第61期事業年度(2019年4月1日から2020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62期事業年度に係る中間会計期間(2020年4月1日から2020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】

		( , , ,
	前事業年度 (2019年 3 月31日)	当事業年度 (2020年 3 月31日)
 資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,489	2,741
有価証券	554	22,167
前払費用	214	205
未収委託者報酬	11,468	10,847
未収収益	98	63
その他	56	62
流動資産計	40,882	36,088
固定資産		
有形固定資産	1 206	1 217
建物	10	7
器具備品	195	209
無形固定資産	2,821	2,362

		有侧趾分曲山青 ( 内国权具信託)
ソフトウェア	2,804	2,028
ソフトウェア仮勘定	17	333
投資その他の資産	12,799	15,844
投資有価証券	8,493	9,153
関係会社株式	1,836	3,972
出資金	183	183
長期差入保証金	1,070	1,069
繰延税金資産	1,183	1,431
その他	31	33
固定資産計	15,827	18,424
 資産合計	56,709	54,512

(単位:百万円)

	前事業年度 (2019年 3 月31日)	当事業年度 (2020年 3 月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	75	69
未払金	8,548	7,573
未払収益分配金	15	14
未払償還金	40	39
未払手数料	4,610	3,988
その他未払金	2 3,882	2 3,530
未払費用	3,735	3,830
未払法人税等	726	656
未払消費税等	255	590
賞与引当金	725	688
その他	2	Ę
流動負債計	14,070	13,414
固定負債		
退職給付引当金	2,389	2,574
役員退職慰労引当金	103	88
その他	2	5
固定負債計	2,496	2,667
負債合計	16,567	16,082
純資産の部		

株主資本

		日间此为旧山自(四日汉县旧山)
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	13,052	11,749
利益剰余金合計	13,426	12,123
株主資本合計	40,096	38,793
 評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	46	363
 評価・換算差額等合計	46	363
——— 純資産合計	40,142	38,430
 負債・純資産合計	56,709	54,512

# (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	76,052	69,550
その他営業収益	673	583
営業収益計	76,725	70,134
営業費用		
支払手数料	35,789	31,120
広告宣伝費	694	745
調査費	9,066	8,858
調査費	1,057	1,188
委託調査費	8,009	7,670
委託計算費	1,351	1,410
営業雑経費	1,557	1,770
通信費	228	240
印刷費	513	524
協会費	55	56
諸会費	13	13
その他営業雑経費	746	936
営業費用計	48,459	43,906

一般管理費

		日间证为旧山首 ( 7) 自汉县后心
給料	5,755	5,793
役員報酬	373	374
給料・手当	4,145	4,335
賞与	510	395
賞与引当金繰入額	725	688
福利厚生費	796	838
交際費	64	62
旅費交通費	178	154
租税公課	472	451
不動産賃借料	1,291	1,299
退職給付費用	374	368
役員退職慰労引当金繰入額	34	37
固定資産減価償却費	907	925
諸経費	1,819	1,770
一般管理費計	11,693	11,702
営業利益	16,572	14,525
·		

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31 日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	38	912
投資有価証券売却益	215	214
有価証券償還益	133	24
その他	134	78
営業外収益計	521	1,230
営業外費用		
有価証券償還損	32	71
投資有価証券売却損	40	1
その他	60	54
営業外費用計	132	127
経常利益	16,961	15,629
特別損失		
システム刷新関連費用	-	537
投資有価証券評価損	-	48
関係会社整理損失	29	-
特別損失計	29	585
税引前当期純利益	16,931	15,043
法人税、住民税及び事業税	5,076	4,555
法人税等調整額	15	78

		131HH 23 HH 1 (13H 32 2 1 H 1 2 2
法人税等合計	5,060	4,477
当期純利益	11,870	10,566

# (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本剰余金			利益剰余金		
				その他利益		
	資本金	資本準備金	利益準備金	剰余金	利益剰余金	株主資本合計
		貝平竿佣立	<b>利益华</b> 佣金	繰越利益	合計	
				剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	•	•	•	12,669	12,669	12,669
当期純利益	•	ı	ı	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の						
項目の当期変動	-	-	-	-	-	-
額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	評価・換	算差額等	
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	ı	1	12,669
当期純利益	ı	1	11,870
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

当事業年度(自 2019年4月1日至 2020年3月31日)

	株主資本					
	資本剰余金利益剰余金					
				その他利益		
	資本金	· ② * 淮 # 今	到共進供令	剰余金	利益剰余金	株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	繰越利益	合計	
				剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当期変動額						
剰余金の配当	•	-	-	11,868	11,868	11,868
当期純利益	•	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の						
項目の当期変動	-	-	-	-	-	-
額(純額)						
当期変動額合計		-	-	1,302	1,302	1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	評価・換	算差額等		
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計	
当期首残高	46	46	40,142	
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	11,868	
当期純利益	•	-	10,566	
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	410	410	410	
当期変動額合計	410	410	410	
当期末残高	363	363	38,430	

# 注記事項

# (重要な会計方針)

- 1.有価証券の評価基準及び評価方法
  - (1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。

# (2) その他有価証券

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 8~18年

器具備品 4~17年

(2)無形固定資産

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

#### 3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

#### 4.消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5.連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

6.連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

#### (未適用の会計基準等)

- 1. 収益認識に関する会計基準等
  - ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2018年3月30日)

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

### (1) 概要

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

ステップ1:顧客との契約を識別する。

ステップ2:契約における履行義務を識別する。

ステップ3:取引価格を算定する。

ステップ4:契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5:履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

# (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- 2. 時価の算定に関する会計基準等
  - ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日)
  - ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年 7月4日)
  - ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)

# (1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品
- (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

#### (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」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。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」の「その他」に表示していた172百万円は、「受取配当金」38百万円、「その他」134百万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

10/1/		
	前事業年度	当事業年度
	(2019年3月31日)	(2020年3月31日)
建物	31百万円	34百万円
器具備品	264百万円	276百万円

# 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	当事業年度
	(2019年3月31日)	(2020年3月31日)
 未払金	3,788百万円	

#### 3 保証債務

### 前事業年度(2019年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

# 当事業年度(2020年3月31日)

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

# (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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
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

(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 2019年6月21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
 11,868百万円
 配当の原資
 利益剰余金
 1 株当たり配当額
 4,550円
 基準日
 2019年3月31日
 効力発生日
 2019年6月24日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

# 2.配当に関する事項

# (1) 配当金支払額

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

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの 2020年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり 提案しております。

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

# (金融商品関係)

#### 1.金融商品の状況に関する事項

#### (1)金融商品に対する取組方針

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

# (2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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関係す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(2019年3月31日)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金・預金		28,489	28,489	-
(2)未収委託者報酬		11,468	11,468	-
(3)有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券		8,380	8,380	-
資産計		48,338	48,338	-
(1)未払手数料		(4,610)	(4,610)	-

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

(2)その他未払金	(3,882)	(3,882)	-
(3)未払費用(*2)	(2,805)	(2,805)	-
負債計	(11,298)	(11,298)	-

- (\*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(2020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		2,741	2,741	-
(2)未収委託者報酬		10,847	10,847	-
(3)有価証券及び投資有価証券				
有価証券		21,900	21,900	-
その他有価証券		8,754	8,754	-
資産計		44,243	44,243	-
(1)未払手数料		(3,988)	(3,988)	-
(2)その他未払金		(3,530)	(3,530)	-
(3)未払費用(*2)		(2,889)	(2,889)	-
負債計		(10,408)	(10,408)	-

- (\*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

区分	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 ( 2020年 3 月31日 )	
(1)その他有価証券			
非上場株式	666	666	
(2)子会社株式及び関連会社株式			
非上場株式	1,836	3,972	

1,069

有価証券届出書(内国投資信託受益証券) (3)長期差入保証金 1,070

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(2019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	28,489	-	1	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
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	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

# 当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以由	1 年超	5 年超	40Ʊ77
	1 年以内	5 年以内	10年以内	10年超
現金・預金	2,741	-	-	-
未収委託者報酬	10,847	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
有価証券	21,900	-	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの	267	3,463	1,184	-
合計	35,756	3,463	1,184	-

## (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(2019年3月31日)

子会社株式(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。

# 当事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,944百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額 2,027百万 円)は、市場価格がなく、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 ( 2019年 3 月31日 )

	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	(百万円)	(百万円)	(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	87	55	32
(2)その他	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原 価を超えないもの			
その他	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がなく、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。

# 当事業年度(2020年3月31日)

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

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がなく、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。

# 3.売却したその他有価証券

# 前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額	
作里犬只	(百万円)	(百万円)	(百万円)	
(1)株式	389	86	-	
(2)その他				
証券投資信託	3,517	128	40	
合計	3,907	215	40	

# 当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

   種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
<b>作里犬</b> 只	(百万円)	(百万円)	(百万円)
(1)株式	-	-	-
(2)その他			

証券投資信託	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

# 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、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

# (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

	・/ 区域福刊 頂切が新日/2同じ新小/2同び調査状							
		前事業年度	当事業年度					
	(自	2018年4月1日	(自 2019年4月1日					
	至	2019年 3 月31日)	至 2020年3月31日)					
退職給付債務の期		2,350百万	2,389百					
首残高		円	万円					
勤務費用		158	159					
退職給付の支払 額		171	183					
その他		52	207					
退職給付債務の期 末残高		2,389	2,574					

# (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	2018年4月1日	(自	2019年4月1日
	至	2019年3月31日)	至	2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務		2,389百万円		2,574百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額		2,389		2,574
退職給付引当金		2,389		2,574

貸借対照表に計上された負債と		
	2,389	2.574
資産の姉頞	2,000	2,014

# (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 2018年4月1日 (自			2019年4月1日		
	至	2019年3月31日)	至	2020年3月31日)		
勤務費用		158百万円		159百万円		
その他		41		27		
確定給付制度に係る退職給付費用		199		187		

## 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174百万円、当事業年度181百万円であります。

# (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) 当事業年度 前事業年度 (2019年3月31日) (2020年3月31日) 繰延税金資産 退職給付引当金 788 731 システム関連費用 170 198 177 賞与引当金 182 129 未払事業税 141 94 94 出資金評価損 32 47 投資有価証券評価損 399 その他 240 1,592 1,835 繰延税金資産小計 評価性引当額 164 173 繰延税金資産合計 1,428 1,661 繰延税金負債 連結法人間取引(譲渡 159 159 益) その他有価証券評価差 85 71 額金 繰延税金負債合計 244 230 繰延税金資産の純額 1,183 1,431

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

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(2019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(2020年3月31日)

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

#### (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 2018年4月1日 至 2019年3月31日) 該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) 該当事項はありません。

# [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 2018年4月1日 至 2019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)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有) 直接91.0	経営管理	有償減資 (注2)	3,293	-	-

# 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。
- (注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

# 当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

# 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (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 2018年4月1日 至 2019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 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円) (注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受 益証券の募集販 売	証券投資信託 の代行手数料 (注2)	19,975	未払手数料	3,400
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)	1,052	未払費用	173

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

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)	1,063	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。

# 当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
- (注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。
- (注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定して おります。
- (注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。
- 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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額 15,389.06円	1株当たり純資産額 14,732.52円
1株当たり当期純利益 4,550.81円	1株当たり当期純利益 4,050.66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おりません。

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,870	10,566
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 (2020年9月30日)

資産の部	
流動資産	
現金・預金	2,811
有価証券	12,910
未収委託者報酬	11,357
その他	360
流動資産合計	27,439
固定資産	
有形固定資産	1 226
無形固定資産	
ソフトウエア	1,720
その他	687
無形固定資産合計	2,408
投資その他の資産	_
投資有価証券	10,638
関係会社株式	3,972
繰延税金資産	1,053
その他	1,286
投資その他の資産合計	16,951
固定資産合計	19,586
資産合計	47,025

# (単位:百万円)

# 当中間会計期間 (2020年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	5,860
未払費用	3,365
未払法人税等	594
賞与引当金	571
その他	2 608
流動負債合計	11,000
固定負債	
退職給付引当金	2,609
役員退職慰労引当金	110
その他	4
固定負債合計	2,724
負債合計	13,724
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	5,784
利益剰余金合計	6,158
株主資本合計	32,828
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	472
評価・換算差額等合計	472
純資産合計	33,301
負債・純資産合計	47,025

# (2)中間損益計算書

(単位:百万円)

当中間会計期間

(自 2020年4月1日

至 2020年9月30日)

至 2020年 9 月30日)
31,426
214
31,641
13,509
5,825
19,334
1 5,708
6,597
2 239
3 156
6,679
-
-
6,679
2,071
8
4,599

# (3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2020年4月1日至 2020年9月30日)

(単位:百万円)

		資本剰余金利益剰余金				
				その他利益		
	資本金	次十准件人	利益準備金	剰余金	利益剰余金	株主資本合計
		資本準備金	<b>利益等佣</b> 並	繰越利益	合計	
				剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	10,564	10,564	10,564

有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

中間純利益	ı	1	-	4,599	4,599	4,599
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	-	-	-	5,965	5,965	5,965
当中間期末残高	15,174	11,495	374	5,784	6,158	32,828

	評価・換	算差額等	
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	363	363	38,430
当中間期変動額			
剰余金の配当	ı	ı	10,564
中間純利益	ı	ı	4,599
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	836	836	836
当中間期変動額合計	836	836	5,128
当中間期末残高	472	472	33,301

# 注記事項

# (重要な会計方針)

- 1.有価証券の評価基準及び評価方法
  - (1)子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

- 2. 固定資産の減価償却の方法
  - (1)有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8~18年

器具備品 4~17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エアについては、社内における利用可能期間(5年間)に基づく定額法によっております。

#### 3.引当金の計上基準

#### (1)賞与引当金

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

#### (2)退職給付引当金

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

#### (3)役員退職慰労引当金

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

## 4.消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

#### 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## 6.連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

#### (追加情報)

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

63百万円 46百万円

33百万円

# (中間貸借対照表関係)

# 1 減価償却累計額

当中間会計期間 (2020年9月30日現在) 有形固定資産 316百万円

# 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(2020年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,623百万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

ı	/似			
			当中間会計期間	
		(自	2020年4月 1日	
		至	2020年9月30日)	
			11百万	一
	無形固定資産		327百万	門
2	営業外収益の主要項目			
			当中間会計期間	
		(自	2020年4月 1日	
		至	2020年9月30日)	
	投資有価証券売却益		203百万	万円
3	営業外費用の主要項目			
			当中間会計期間	
		(自	2020年4月 1日	
		至	2020年9月30日)	

# (中間株主資本等変動計算書関係)

為替差損

有価証券償還損

投資有価証券売却損

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

(単位:千株)

# 1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	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	1	-	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
2020年 6 月23日 定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年3月31日	2020年 6 月24日

## (金融商品関係)

当中間会計期間(2020年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

レベル1の時価:観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当

該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価:観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価

の算定に係るインプットを用いて算定した時価

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

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

低いレベルに時価を分類しております。

# (1)時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額(*1)			
	レベル 1	レベル 2	レベル3	合計
投資有価証券(1)	60			60
資産合計	60			60

- ( 1)時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券410百万円、投資有価証券9,911百万円は上記の表に含めておりません。
- (2)時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1)時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

# 投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価格によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項(有価証券関係)をご参照下さい。

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

(単位:百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,944
関連会社株式	2,027

# (有価証券関係)

当中間会計期間(2020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 1,944百万円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

#### 2. その他有価証券

	中間貸借対照表	取得原価	差額
	計上額(百万円)	(百万円)	(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	60	55	5
(2)その他	7,989	7,141	847
小計	8,049	7,196	852
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	14,833	15,006	173
小計	14,833	15,006	173
合計	22,882	22,203	679

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

## (セグメント情報等)

# 「セグメント情報 ]

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020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 2020年4月1日 至 2020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 :	2020年4月1日
至:	2020年9月30日)
1 株当たり純資産額	12,766.41円
1 株当たり中間純利益	1,763.16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 2020年4月1日	
至 2020年9月30日)	
中間純利益(百万円)	4,599
普通株式に係る中間純利益(百万円)	4,599
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

2020年2月17日付で、Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.への出資を行い、当該会社を子会社といたしました。

2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 商号の変更 (大和アセットマネジメント株式会社に変更)
- b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

## 第2 【その他の関係法人の概況】

## 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (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 (2020年3月末日現在)

事業の内容

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

# (2) 販売会社

名称	資本金の額 単位:百万円 (2020年3月 末日現在)	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196	
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める
岡三オンライン証券株式会社	2,500	第一種金融商品取引業を
松井証券株式会社	11,945	営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	
株式会社ジャパンネット銀行	37,250	(注1)
三井住友信託銀行株式会社	342,037	(注2)

(注1)銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注2)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 【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ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

## 3 【資本関係】

該当事項はありません。

#### < 再信託受託会社の概要 >

名称:株式会社日本カストディ銀行

資本金の額:51,000百万円(2020年7月27日現在)

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 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
- ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨 使用開始日を記載することがあります。

届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日 次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその 旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス(当該アドレスをコード化した図形等も含みます。)を掲載することがあります。

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。
- (5) 交付目論見書に「投資家のみなさまへ」として、以下の内容を記載することがあります。

# 投資家のみなさまへ \infty

iFreeNEXTは、特色のあるセクターや特定分野に焦点を絞った指数を対象として、 お客さまに幅広い選択肢を提供しているファンドシリーズです。

当ファンドは、日本の小型株市場に連動する投資成果をめざすインデックスファンドです。 小型株市場の企業は、規模は小さいものの高い成長性を持つと私どもは考えており、 そうした企業から構成される指数への連動をめざすことで、その成長性を享受することを 目的としております。

このような趣旨にご賛同いただけるお客さまの資産運用、資産形成の一助となれば 幸いです。

# 独立監査人の監査報告書

2020年 5 月22日

大和アセットマネジメント株式会社 取締役会 御中

# 有限責任 あずさ監査法人

# 東京事務所

#### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社(旧社名大和証券投資信託委託株式会社)の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社(旧社名 大和証券投資信託委託株式会社)の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

# 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

# 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

- (注)1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- (注)2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2020年11月20日

大和アセットマネジメント株式会社 取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

公認会計士

深井 康治 印

業務執行社員

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 小林 英

小林 英之 印

# 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているiFreeNEXT 日本小型株インデックスの2019年10月19日から2020年10月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、iFreeNEXT 日本小型株インデックスの2020年10月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 監査意見の根拠

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

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

- (注)1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- (注)2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年11月20日

大和アセットマネジメント株式会社 取締役会 御中

# 有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

公認会計士 間瀬 友未 印

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 深井 康治 印

業務執行社員

# 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2020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(2020年4月1日から2020年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

# 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成 基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。 監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

EDINET提出書類 大和アセットマネジメント株式会社(E06748) 有価証券届出書(内国投資信託受益証券)

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。