

【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】	平成26年10月3日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 白川 真
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山部 努 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】	03-5695-2111
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワ上場投信 - トピックス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続申込期間（平成26年10月4日から平成27年10月2日まで） 5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	名 称 株式会社東京証券取引所 所在地 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ダイワ上場投信 - トピックス

(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。

(3) 【発行(売出)価額の総額】

5兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

10口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

(注1) 営業日の午後3時まで取得申込みをした場合には、その翌営業日を取得申込受付日として取得申込みを受け付けます。

(注2) 基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

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

販売会社については、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 <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(6) 【申込単位】

委託会社は、取得申込みに適用される各銘柄の株式（以下「取得時のバスケット」といいます。）を所定の方法（ 1 ）によって提示するものとします。

受益権の取得申込者は、販売会社（ 2 ）に対し、取得時のバスケットを単位として受益権の取得申込みを行なうことができます。

取得時のバスケットは、日々変更されます。

原則として、所定の方法に定められる金銭の支払い以外に、金銭によって受益権の取得申込みを行なうことはできません。

（ 1 ）所定の方法

1. 委託会社は、取得申込受付日の3営業日前までに、取得申込受付日に適用される「取得時のバスケット」を定めます。原則として、取得時のバスケットは、取得申込可能日の毎日、午前8時45分を目処としてインターネット・サイト「<http://etf.daiwa-am.co.jp/>」に掲示します。

2. 「取得時のバスケット」1単位当たりの取得口数は、取得時のバスケットの評価額を取得申込受付日の基準価額で除して得た口数をもとに、委託会社が定めるもの（10口の整数倍とします。）とします。

3. 取得時のバスケットの評価額が、委託会社が定める口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額に満たない場合には、取得申込者はその差額に相当する金銭を支払うものとします。

4. 取得時のバスケットに取得申込者の自社株式等（自社が発行した株式またはその親会社（会社法第2条第1項第4号に規定する親会社をいいます。）が発行した株式をいいます。以下同じ。）が含まれている場合には、当該株式に代えて、当該株式の評価額に、これを信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該評価額に別に定める率を乗じて得た額を加算した金額の金銭を引渡すことによって、取得の申込みに応じることができるものとします。

取得申込者は、販売会社を通じて、委託会社に取得時のバスケットに自社株式等が含まれている旨を通知するものとします。この通知が取得申込時に行なわれなかった場合において、そのことによって取得申込者または信託財産その他に損害が生じた場合には、当該取得申込者がすべての責を負うものとします。

（ 2 ）販売会社

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(7) 【申込期間】

平成26年10月4日から平成27年10月2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。）

ただし、原則として、次の1.から4.までに該当する場合は、受益権の取得申込みの受付を停止します。

なお、次の1.から3.までに該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の取得申込みを受付けることがあります。

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

(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 <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、取得申込みにかかる取得時のバスケットの各銘柄の株式および金銭を、当該取得申込みにかかる信託が設定される日までに受託会社の当ファンドにかかる口座に交付および支払うことができるように販売会社に引渡し、販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、受託会社の指定するファンド口座に移管されます。(株式等に金銭が含まれる場合は、当該金銭については、販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、委託会社の口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込まれます。)

(10) 【払込取扱場所】

前(9)の引渡しは、販売会社において行なうものとします。販売会社については、前(6)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。

委託会社の営業日の午後3時まで取得申込みをした場合(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)、その翌営業日を取得申込受付日として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌々営業日の取得申込受付日としての取扱いとなります。

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

当ファンドの受益権は、東京証券取引所に上場されています。

委託会社および受託会社は、東京証券取引所の定める諸規則等を遵守し、同取引所が諸規則等に基づいて行なう受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置にしたがうものとします。

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。

ファンドの分配金の支払い、交換の請求は、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行なわれます。

(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、交換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、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を東証株価指数の変動率に一致させることを目的とします。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	独立区分	E T F
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	株式 一般
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	対象インデックス	T O P I X

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

- ・「株式 一般」...大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「年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
- ・「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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託の限度 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、5兆円に相当する株券および金銭を限度として追加信託することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、上記の限度を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1

信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を東証株価指数(TOPIX)の変動率に一致させることを目的として、東証株価指数に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式に投資します。

- 東証株価指数を構成する全銘柄の株式の時価総額構成比率の95%以上を構成する銘柄の株式を組入れることを原則とします。
- 上記に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行なうこと（有価証券指数等先物取引等を利用することを含みます。）があります。
- 市況動向、資産規模等によっては、上記の運用を行なえないことがあります。

東証株価指数（TOPIX）について

- ◆株式市場の動向を表わす指標には、東証株価指数（TOPIX）、日経平均株価、日経株価指数300等があります。このうち、TOPIXは、東京証券取引所の第1部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするものです。
- ◆TOPIXは、1968年（昭和43年）1月4日（基準時）の時価総額を100として1969年（昭和44年）7月1日から東京証券取引所が算出・公表しております（注1参照）。
- ◆新規上場、上場廃止、増資など市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して、指数の連続性を維持します（注2参照）。

（注1）TOPIXの算出方法：毎日の指数 = 当日の時価総額 ÷ 基準時の時価総額 × 100

（注2）基準時の時価総額の修正方法：

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

- TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下（株）東京証券取引所という。）の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は（株）東京証券取引所が有する。
- （株）東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができる。
- （株）東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をしない。
- （株）東京証券取引所は、TOPIX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ない。また（株）東京証券取引所は、TOPIX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、責任を負わない。
- 「ダイワ上場投信ートピックス」は、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用するが、「ダイワ上場投信ートピックス」の純資産価額とTOPIXの間に乖離が発生することがある。
- 「ダイワ上場投信ートピックス」は、（株）東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではない。
- （株）東京証券取引所は、「ダイワ上場投信ートピックス」の購入者または公衆に対し、「ダイワ上場投信ートピックス」の説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。
- 以上の項目に限らず、（株）東京証券取引所は「ダイワ上場投信ートピックス」の発行等または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。

2

当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

- 受益権は、東京証券取引所に上場され、株式と同様に売買することができます。
 - 売買単位は、10口単位です。
 - 取引方法は、原則として株式と同様です。
- 追加設定は、株式により行ないます。
 - 追加設定にかかる受益権の取得申込者は、取得時のバスケット（東証株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。
 - 原則として、所定の方法に定められる金銭の支払い以外に、金銭によって受益権の取得申込を行なうことはできません。

●受益権を株式と交換することができます。

- 受益者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に対し、委託会社が定める一定口数の整数倍の受益権をもって、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換を申込むことができます。
- 解約申込により受益権を換金することはできません。

●収益分配金は、名義登録受益者（計算期間終了日において氏名もしくは名称および住所が受託会社に登録されている者）に対して支払われます。

3

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●基準価額の動きに関する留意点

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

- 同指数が加重平均であるため、個別銘柄の組入比率を同指数構成銘柄の時価総額構成比率と全くの同一の比率とすることができないこと
- 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
- 株価指数先物取引と指数の動きの不一致（株価指数先物取引を利用した場合）
- 株式および株価指数先物取引（株価指数先物取引を利用した場合）の最低取引単位の影響
- 株式および株価指数先物取引（株価指数先物取引を利用した場合）の流動性低下時における売買対応の影響
- 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
- 追加設定時、および組入銘柄の配当金や権利処理等によって信託財産に現金が発生すること

(2) 【ファンドの沿革】

平成13年7月11日 信託契約締結、当初設定、運用開始
平成13年7月13日 受益証券を東京証券取引所に上場

(3) 【ファンドの仕組み】

	名 称	関係業務の内容
--	-----	---------

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

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

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

< 委託会社の概況（平成26年7月末日現在） >

- ・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

昭和34年12月12日	設立登記
昭和35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
昭和35年 4月 1日	営業開始
昭和60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。
平成 7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。
平成 7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。
平成19年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号)

・ 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

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

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

東証株価指数を構成する全銘柄の株式の時価総額構成比率の95%以上を構成する銘柄の株式を組入れることを原則とします。

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

市況動向、資産規模等によっては、上記の運用を行なえ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(5)に定めるものに限ります。)

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5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、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. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

6. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

なお、前1.の証券または証書を「株式」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。)

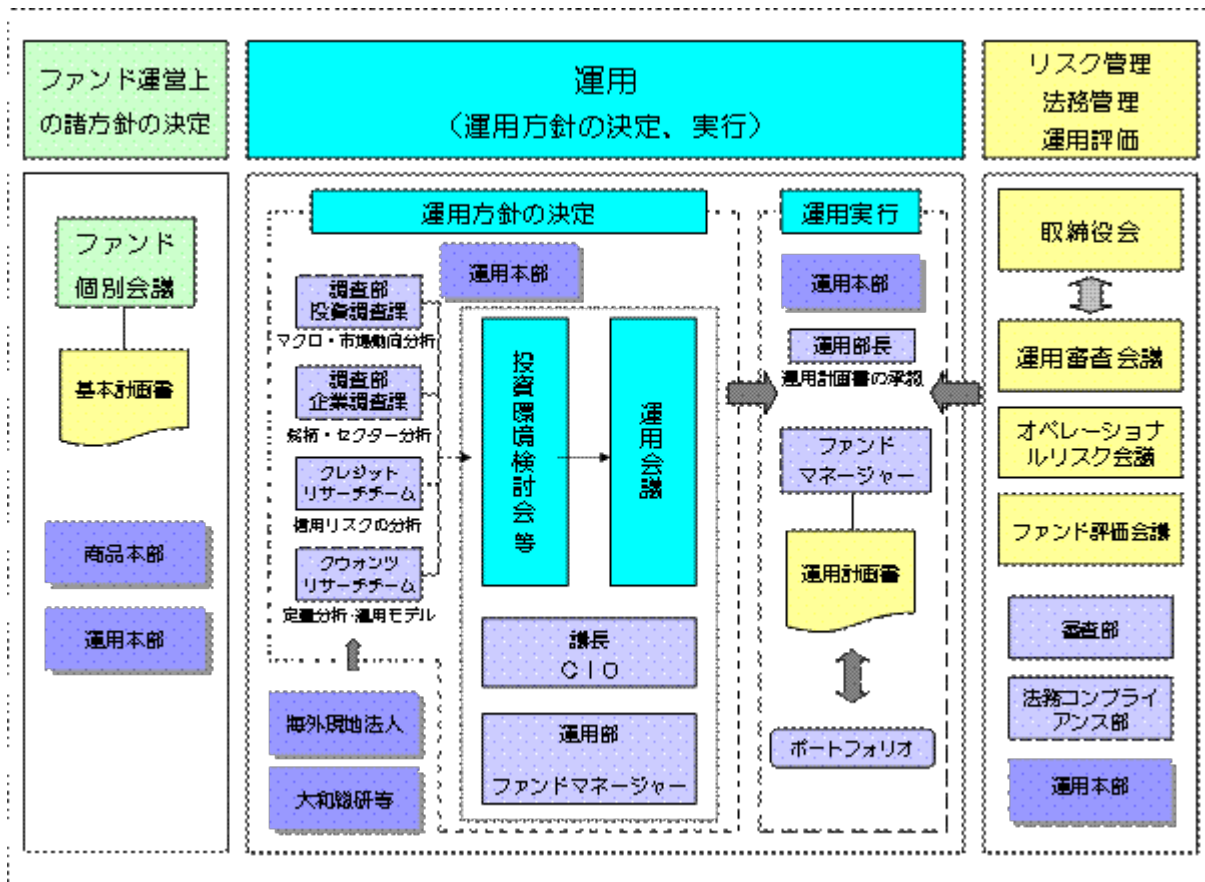
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（1～5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（1～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク会議

ファンド評価会議は、運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、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受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるオペレーショナルリスク会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

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。

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。

上記の運用体制は平成26年7月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資する株式の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち

ち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

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

先物取引等(信託約款)

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

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および公社債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。

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

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

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への投資は、行ないません。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動(価格変動リスク・信用リスク)

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります(発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投

資資金が回収できなくなることもあります。)。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

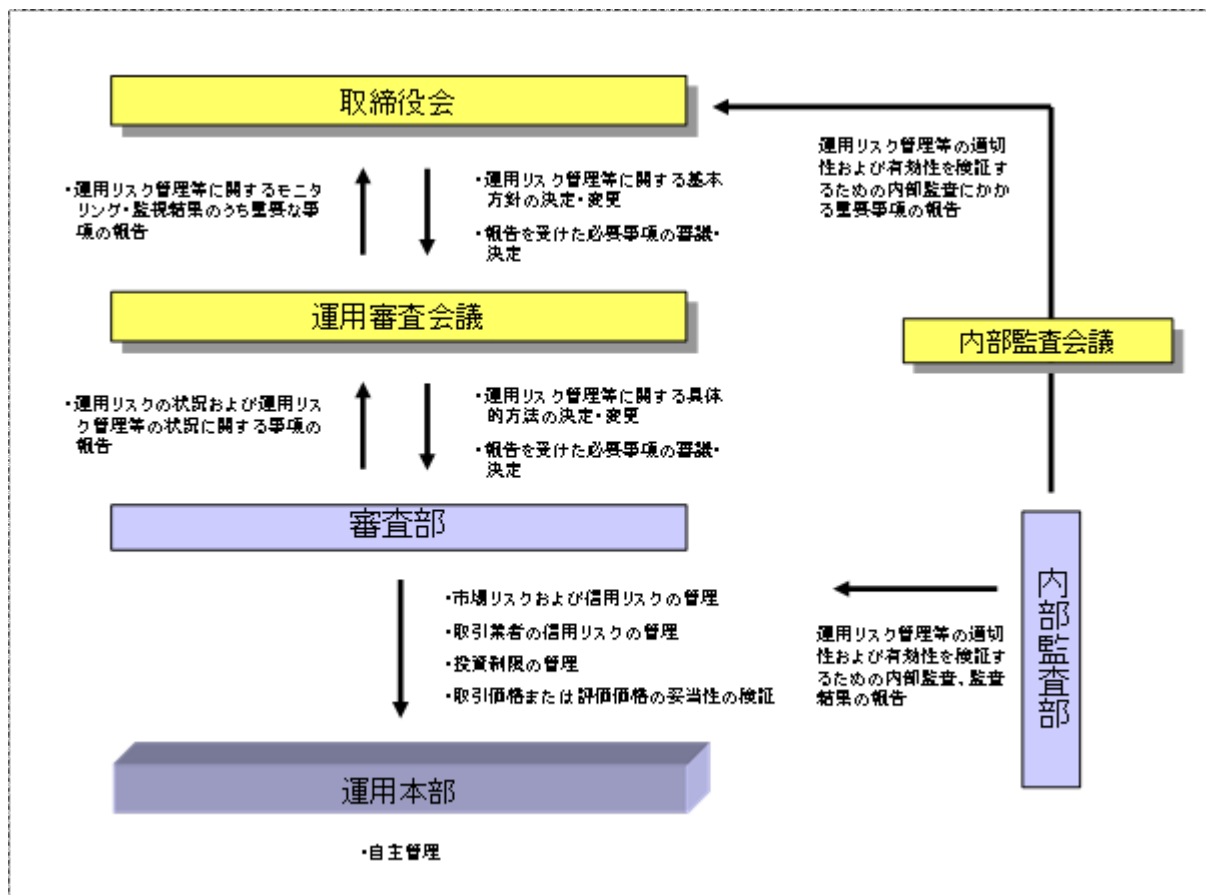
その他

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) 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。

(3) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

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

販売会社については、前(1)をご参照下さい。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、次のイ.の額にロ.の額を加算して得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

イ. 信託財産の純資産総額に年率10,000分の11.88（税抜10,000分の11）以内を乗じて得た額

ロ. 信託財産に属する株式の貸付けにかかる品貸料（貸付株券から発生する配当金相当額等を含まないものとし、株式の貸付けにあたって担保として現金を受入れた場合には、当該現金の運用により生じたとみなし得る収益を加算し、貸付けの相手方に支払う当該現金に対する利息額を控除するものとします（控除した額が負数のときは零とします。）。）に100分の54（税抜100分の50）以内の率を乗じて得た額。

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

イ. 年率10,000分の11.88（税抜10,000分の11）

ロ. 100分の54（税抜100分の50）

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

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

イ. 前 イ.の報酬

委託会社 年率10,000分の7.5（税抜）

受託会社 年率10,000分の3.5（税抜）

* 上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

ロ. 前 ロ.の報酬

委託会社 報酬の50%

受託会社 報酬の50%

(4) 【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担

とし、信託財産中から支弁します。なお、受益権の上場にかかる費用および東証株価指数の商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(以下「商標使用料」といいます。)ならびにこれらにかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。ただし、各計算期間において、信託財産中から支弁する受益権の上場にかかる費用および商標使用料の合計額は、信託財産の純資産総額に年率10,000分の6.48(税抜10,000分の6)を乗じて得た額を超えないものとします。

* 提出日現在、商標使用料は信託財産の純資産総額に、年率10,000分の3.24(税抜10,000分の3)以内を乗じて得た額(ただし、162万円(税抜150万円)を下回る場合は、162万円(税抜150万円))となります。

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は特定株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

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

ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%)となります。

受益権を譲渡して生じた損失金額は上場株式等の譲渡益および申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得と通算できます。

ロ．収益分配金の受取時

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

ただし、平成49年12月31日まで、収益分配金の受取時に、収益分配金に対する所得税の源泉徴収額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%)となります。

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

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

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

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

法人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

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

ロ．収益分配金の受取時

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

ただし、平成49年12月31日までは基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。

法人税等の計算において、税額控除制度が適用されます。

益金不算入の対象となります。益金不算入の取扱いは、株式の配当金と同様となります。

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

（ ）上記は、平成26年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成26年7月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,120,487,200,520	99.90
内 日本	1,120,487,200,520	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,075,422,742	0.10
純資産総額	1,121,562,623,262	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,059,850,000	0.09
内 日本	1,059,850,000	0.09

(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】（平成26年7月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	8,384,600	6,002.79 50,331,048,357	6,137.00 51,456,290,200	4.59
2 三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	45,508,600	604.94 27,530,182,706	615.60 28,015,094,160	2.50
3 ソフトバンク	日本	株式	情報・通 信業	2,950,600	7,485.94 22,088,028,052	7,572.00 22,341,943,200	1.99
4 本田技研	日本	株式	輸送用 機器	5,480,200	3,572.46 19,577,812,202	3,654.00 20,024,650,800	1.79
5 三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,545,700	4,151.68 18,872,313,696	4,260.00 19,364,682,000	1.73
6 日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	2,362,700	6,438.04 15,211,171,300	6,860.00 16,208,122,000	1.45

7	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	78,073,400	201.00 15,692,753,400	201.50 15,731,790,100	1.40
8	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	3,784,900	3,700.17 14,004,798,530	3,652.00 13,822,454,800	1.23
9	ファナック	日本	株式	電気機器	680,100	17,637.10 11,994,994,690	17,990.00 12,234,999,000	1.09
10	キヤノン	日本	株式	電気機器	3,535,200	3,261.71 11,530,815,186	3,392.00 11,991,398,400	1.07
11	日立	日本	株式	電気機器	14,675,000	763.89 11,210,198,060	808.70 11,867,672,500	1.06
12	武田薬品	日本	株式	医薬品	2,392,200	4,655.07 11,135,869,452	4,727.00 11,307,929,400	1.01
13	KDDI	日本	株式	情報・通信業	1,867,900	6,182.21 11,547,753,360	5,997.00 11,201,796,300	1.00
14	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	2,517,500	4,358.82 10,973,337,174	4,330.50 10,902,033,750	0.97
15	三井不動産	日本	株式	不動産業	3,157,000	3,381.84 10,676,481,840	3,444.50 10,874,286,500	0.97
16	三菱地所	日本	株式	不動産業	4,211,000	2,493.87 10,501,727,000	2,547.50 10,727,522,500	0.96
17	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	7,273,300	1,339.09 9,739,621,283	1,415.00 10,291,719,500	0.92
18	三菱商事	日本	株式	卸売業	4,695,700	2,115.85 9,935,407,390	2,186.00 10,264,800,200	0.92
19	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	1,118,500	8,107.52 9,068,261,552	8,322.00 9,308,157,000	0.83
20	三井物産	日本	株式	卸売業	5,442,100	1,630.96 8,875,863,828	1,666.00 9,066,538,600	0.81
21	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	4,958,300	1,753.00 8,691,899,900	1,824.00 9,043,939,200	0.81
22	パナソニック	日本	株式	電気機器	6,966,400	1,221.92 8,512,425,928	1,257.50 8,760,248,000	0.78
23	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	8,558,900	972.98 8,327,651,334	1,022.00 8,747,195,800	0.78
24	新日鐵住金	日本	株式	鉄鋼	26,988,000	308.96 8,338,293,440	314.10 8,476,930,800	0.76
25	三菱電機	日本	株式	電気機器	6,096,000	1,273.95 7,766,031,200	1,376.00 8,388,096,000	0.75

26	野村ホールディングス	日本	株式	証券、商 品先物 取引業	12,302,800	675.92 8,315,835,269	660.30 8,123,538,840	0.72
27	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	546,100	14,790.37 8,077,022,264	14,750.00 8,054,975,000	0.72
28	東京海上HD	日本	株式	保険業	2,331,000	3,242.81 7,559,003,431	3,272.00 7,627,032,000	0.68
29	信越化学	日本	株式	化学	1,145,300	6,056.17 6,936,137,410	6,580.00 7,536,074,000	0.67
30	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	2,001,000	3,701.88 7,407,482,064	3,742.00 7,487,742,000	0.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.90%
合計	99.90%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.07%
鉱業	0.52%
建設業	2.75%
食料品	4.04%
繊維製品	0.70%
パルプ・紙	0.25%
化学	5.59%
医薬品	4.52%
石油・石炭製品	0.59%
ゴム製品	0.89%
ガラス・土石製品	1.03%
鉄鋼	1.67%
非鉄金属	1.08%
金属製品	0.66%
機械	5.33%
電気機器	12.80%

輸送用機器	11.52%
精密機器	1.41%
その他製品	1.41%
電気・ガス業	2.04%
陸運業	4.03%
海運業	0.33%
空運業	0.54%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	7.15%
卸売業	4.65%
小売業	4.12%
銀行業	9.06%
証券、商品先物取引業	1.50%
保険業	2.18%
その他金融業	1.34%
不動産業	3.33%
サービス業	2.59%
合計	99.90%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2014年9月	買建	82	1,051,773,799	1,059,850,000	0.09%

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

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)	東京証券取 引所 市場相場
第4計算期間末 (平成17年7月10日)	225,837,184,387	228,570,557,332	1,188.9	1,203.3	1,191
第5計算期間末 (平成18年7月10日)	354,879,041,066	358,181,582,085	1,614.0	1,629.0	1,613
第6計算期間末 (平成19年7月10日)	377,975,712,627	381,927,367,525	1,813.5	1,832.5	1,812
第7計算期間末 (平成20年7月10日)	382,598,866,794	388,782,960,703	1,308.5	1,329.7	1,310
第8計算期間末 (平成21年7月10日)	169,610,147,395	174,789,556,053	875.7	902.4	877
第9計算期間末 (平成22年7月10日)	212,389,754,464	215,702,142,160	865.0	878.5	865
第10計算期間末 (平成23年7月10日)	242,981,056,419	247,200,364,545	881.1	896.4	883
第11計算期間末 (平成24年7月10日)	293,772,258,294	299,715,502,142	766.2	781.7	767
第12計算期間末 (平成25年7月10日)	935,579,160,460	943,078,552,355	1,222.6	1,232.4	1,222
平成25年7月末日	858,260,857,798	-	1,157.6	-	1,156
8月末日	838,950,564,623	-	1,131.5	-	1,129
9月末日	855,720,545,184	-	1,229.9	-	1,229
10月末日	867,782,628,216	-	1,230.1	-	1,228
11月末日	881,024,636,701	-	1,296.4	-	1,294
12月末日	840,168,863,157	-	1,342.2	-	1,342
平成26年1月末日	782,373,400,144	-	1,258.0	-	1,256
2月末日	742,269,335,429	-	1,249.1	-	1,246
3月末日	741,480,263,132	-	1,251.9	-	1,253
4月末日	1,103,505,208,281	-	1,209.6	-	1,209
5月末日	1,121,515,767,638	-	1,250.5	-	1,247
6月末日	1,135,718,230,605	-	1,315.0	-	1,313
第13計算期間末 (平成26年7月10日)	1,123,731,191,021	1,137,960,316,067	1,295.2	1,311.6	1,294
7月末日	1,121,562,623,262	-	1,326.1	-	1,326

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

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第4計算期間	14.39
第5計算期間	15.02
第6計算期間	18.96
第7計算期間	21.15
第8計算期間	26.74
第9計算期間	13.49
第10計算期間	15.30
第11計算期間	15.50
第12計算期間	9.80
第13計算期間	16.40

【収益率の推移】

	収益率(%)
第4計算期間	3.7
第5計算期間	37.0
第6計算期間	13.5
第7計算期間	26.7
第8計算期間	31.0
第9計算期間	0.3
第10計算期間	3.6
第11計算期間	11.3
第12計算期間	60.8
第13計算期間	7.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第4計算期間	9,958,800	101,231,797
第5計算期間	83,669,700	53,742,942
第6計算期間	69,645,100	81,100,716
第7計算期間	153,441,900	69,470,370
第8計算期間	33,969,100	132,666,084
第9計算期間	65,756,800	13,908,027
第10計算期間	61,810,890	31,583,053
第11計算期間	147,354,900	39,691,586

第12計算期間	425,333,390	43,524,406
第13計算期間	501,946,560	399,561,055

(参考情報) 運用実績

2014年7月31日現在 ※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。
基準価額・純資産の推移

基準価額	13,261円
純資産総額	11,215億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.1%
3カ月間	11.0%
6カ月間	6.7%
1年間	16.0%
3年間	62.9%
5年間	49.6%
設定来	25.2%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 164円 設定来分配金合計額: 1,814.4円

決算期	第2期 03年7月	第3期 04年7月	第4期 05年7月	第5期 06年7月	第6期 07年7月	第7期 08年7月	第8期 09年7月	第9期 10年7月	第10期 11年7月	第11期 12年7月	第12期 13年7月	第13期 14年7月
分配金	106.8円	33.9円	143.9円	150.2円	189.6円	211.5円	267.4円	134.9円	153円	155円	98円	164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。

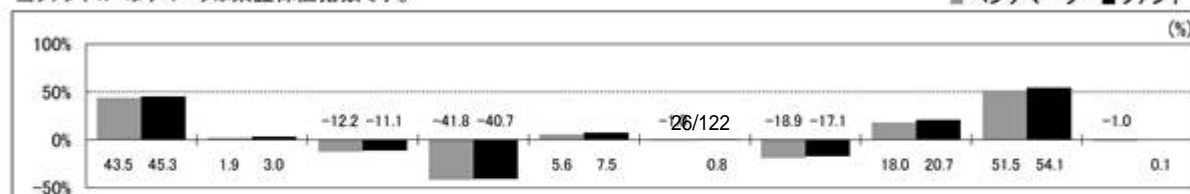
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,813	99.9%	電気機器	12.8%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.6%
国内株式先物	1	0.1%	輸送用機器	11.5%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.5%
不動産投資信託等	-	-	銀行業	9.1%	ソフトバンク	情報・通信業	2.0%
コール・ローン、その他	-	0.1%	情報・通信業	7.2%	本田技研	輸送用機器	1.8%
合計	1,814	-	化学	5.6%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.7%
株式市場・上場別構成			機械	5.3%	日本電信電話	情報・通信業	1.4%
一部(東証・名証)		99.9%	卸売業	4.6%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.4%
二部(東証・名証)		-	医薬品	4.5%	日本たばこ産業	食料品	1.2%
新興市場他		-	小売業	4.1%	ファナック	電気機器	1.1%
その他		-	その他	35.1%	キヤノン	電気機器	1.1%
合計		99.9%	合計	99.9%	合計		18.8%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■ベンチマーク ■ファンド



第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

- イ．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。
- ロ．受益権の取得申込者は、東証株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの（以下「取得時のバスケット」といいます。）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。また、当該取得時のバスケットの評価額（法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た額をいいます。以下同じ。）をもって、それに相当するものとして委託会社が定める一定口数の受益権を単位として取得するものとします。受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額とします。
- ハ．受益権の取得申込者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後3時）までに取得申込みをした場合には、その翌営業日を取得申込受付日として委託会社は当該取得申込みを受付けます。
- ニ．取得申込受付日に対応する取得時のバスケットを構成する各株式の銘柄名とその数量は、委託会社が取得申込受付日以前の別に定める期日に別に定める方法により提示するものとします。
- ホ．前ロ．にかかわらず、受益権の取得申込者は、取得時のバスケットの評価額が取得する一定口数の受益権の評価額に満たない場合には、その差額に相当する部分を金銭をもって支払うものとします。
- ヘ．前ロ．にかかわらず、取得時のバスケットに受益権の取得申込者が発行した株式またはその親会社（会社法第2条第1項第4号に規定する親会社をいいます。以下同じ。）が発行した株式（以下「自社株式等」といいます。）が含まれる場合には、当該取得申込者は当該自社株式等に代えて当該自社株式等に相当する金額（評価額により算出したものに限ります。）に、当該自社株式等を信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該金額に別に定める率を乗じて得た額を加算して得た金額の金銭をもって取得することができるものとします。
- ト．前ヘ．に該当する場合には、受益権の取得申込者は、販売会社を通じてその旨を委託会社に通知するものとします。この通知が取得申込みの際に行なわれなかった場合において、そのことによって当該取得申込者または信託財産その他に損害が生じた場合には、当該取得申込者がすべての責を負うものとします。
- チ．販売会社は、取得申込みにかかる取得時のバスケットの各銘柄の株式を、取得申込みにかかる信託が設定される日までに、別に定める契約に基づき委託会社に代わって受託会社に引渡すものとします。
- リ．販売会社は、受益権の取得申込者が引渡すべき取得時のバスケットの各銘柄の一部の引渡日を別に定める方法に基づいて指定する場合には、担保金を差入れるものとします。なお、担保金に付利は行なわないものとします。担保金が差入れられた場合には、委託会社は信託財産への担保金の受入れの指図を行なうものとします。
- ヌ．取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、前チ．に定める株式（前ホ．および前ヘ．に該当する場合の金銭を含みます。）または前リ．に定める担保金の引渡しと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- ル．委託会社は、原則として、次の1.から4.までに該当する場合は、受益権の取得申込みの受付を停止します。なお、次の1.から3.までに該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の取得申込みを受付けることがあります。

1. 東証株価指数構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内
 2. 東証株価指数構成銘柄の変更および増減資等に伴う株数の変更日の2営業日前から起算して6営業日以内
 3. 計算期間終了日の4営業日前から起算して5営業日以内(ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して6営業日以内)
 4. 前1.から前3.までのほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき
- フ. 販売会社は、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を、受益権の取得申込者から徴収することができるものとします。当該手数料は、販売会社ならびに受託会社が収受するものとします。
- ワ. 委託会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときおよび委託会社が必要と認めるときは、取得申込みの受付けの中止、取得申込みの受付けの取消しまたはその両方を行なうことができます。
- カ. 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、取得申込みにかかる取得時のバスケットの各銘柄の株式および金銭または担保金について、受入れまたは振替済みの通知を受けた場合は、振替機関に対し追加信託が行なわれた旨を通知するものとします。

2 【換金(解約)手続等】

<解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、信託期間中において信託契約の一部解約の実行を請求することはできません。

<交換>

- イ. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、当該受益権と当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換(以下「交換」といいます。)を請求することができます。
- ロ. 受益者が交換の請求をするときは、販売会社に対し、委託会社が定める一定口数の整数倍の振替受益権をもって、販売会社所定の方法で行なうものとします。
- ハ. 交換を請求しようとする受益者が、委託会社が別に定める時限(営業日の午後3時)までに交換請求をした場合には、その翌営業日を交換請求受付日として委託会社は当該交換請求を受付けます。
- ニ. 委託会社は、交換に際し、信託財産に属する株式の評価額をもって、それに相当する口数の振替受益権と交換するものとします。交換に際し、振替受益権の価額は、交換請求受付日の基準価額とします。
- ホ. 前イ.にかかわらず、委託会社は、原則として、次の1.から4.までに該当する場合は、振替受益権の交換請求の受付けを停止します。なお、次の1.から3.までに該当する場合であっても、委託会社の判断により、振替受益権の交換請求を受付けることがあります。

1. 東証株価指数構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日
2. 東証株価指数構成銘柄の変更および増減資等に伴う株数の変更日の4営業日前から起算して8営業日以内

3. 計算期間終了日の4営業日前から起算して5営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して6営業日以内）
4. 前1.から前3.までのほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき
- へ. 販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続きを行なうものとし、当該抹消にかかる手続きおよび後力. に掲げる交換株式にかかる振替請求が行なわれた後に、振替機関は、後ル. または後ヲ. に定める当該交換にかかる振替受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座に前イ. の交換の請求を行なった受益者にかかる当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- ト. 受託会社は、後ル. または後ヲ. の委託会社の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび後ヨ. に定める抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ、抹消したものとして取扱います。
- チ. 販売会社は、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を交換請求者から徴収することができるものとします。当該手数料は、販売会社ならびに受託会社が収受するものとします。
- リ. 委託会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときおよび委託会社が必要と認めるときは、交換請求の受付けの中止、交換請求の受付けの取消しまたはその両方を行なうことができます。
- ヌ. 前リ. により、交換請求の受付けを中止したときは、受益者は、当該受付中止以前に行なった当日の交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に交換の請求を受付けたものとして計算されるものとします。
- ル. 委託会社は、交換の請求を受付けた場合には、当該請求にかかる振替受益権と、当該振替受益権の信託財産に対する持分に相当する株式として委託会社が指定するものとの交換を行なうよう受託会社に指図します。
- ヲ. 前ル. にかかわらず、委託会社が指定する株式に自社株式等が含まれる場合には、原則として、委託会社は、前ル. の請求にかかる振替受益権の口数から当該自社株式等に相当する金額（評価額により算出したものから、当該株式売却および当該売却代金により信託財産中の株式の銘柄およびその数量を変更するための取引にかかる経費に相当する金額として、当該評価額に別に定める率を乗じて得た額を減じた金額とします。）に相当する口数を除いた口数の振替受益権と、当該振替受益権の持分に相当する株式（当該自社株式等を除きます。）を交換するよう受託会社に指図するものとします。
- ワ. 前ヲ. に該当する場合には、交換請求を行なう受益者は、販売会社を通じてその旨を委託会社に通知するものとします。この通知が交換請求の際に行なわれなかった場合において、そのことによって交換請求者または信託財産その他に損害が生じた場合には、交換請求者がすべての責を負うものとします。
- カ. 受託会社は、前へ. に掲げる手続きが行なわれたことを確認したときには、委託会社の指図にしたがい、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式にかかる振替請求を行なうものとし、受益者への交換株式の交付に際しては、別に定める期日から、振替機関等の口座に前イ. の交換の請求を行なった受益者にかかる株数の増加の記載または記録が行なわれます。
- ヨ. 委託会社は、交換請求受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したものとして取扱うこととし、受託会社は、当該受益権にかかる振替受益権が交換株式の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

< 買取り >

- イ．販売会社は、次に該当する場合で、受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。ただし、
- 2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。
 1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権
 2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき
- ロ．前イ．の買取価額は、買取申込みを受付けた日の基準価額から、販売会社が定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を控除した価額とすることができます。
- ハ．販売会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することができます。
- ニ．前ハ．により受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取停止以前に行なった当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受付けたものとして、前ロ．に準じて計算されたものとします。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した10口当たりの価額をいいます。

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

（注）主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <http://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7月11日から翌年7月10日までとします。

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が200万口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となったときまたは東証株価指数が廃止された場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
3. 委託会社は、前1.および前2.の各事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
4. 前3.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
5. 前4.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
6. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
7. 前4.から前6.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約する場合には適用しません。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4.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合も同じとします。
8. 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。
9. 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、この4.に該当する場合を除き、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。
10. 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

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ができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られ

たる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 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5.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

前 の1.から7.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 の4.または前 の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

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

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

<支払方法>

イ. 受益者は、収益分配金(分配金額は、委託会社が決定します。)を持分に応じて請求する権利を有します。

ロ．計算期間終了日において氏名もしくは名称および住所が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、受託会社は収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。この場合、名義登録受益者が当該計算期間終了日における振替制度移行後も受益証券を保有している所有者と異なる場合であっても、委託会社および受託会社は当該所有者に対して収益分配金の支払いおよびその他損害についてその責を負わないものとします。

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

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

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

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

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

ホ．追加信託時の受益者については、前ロ．に規定する登録を行なったうえで、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されるものとします。

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

ト．受託会社は、支払開始日から5年経過した後に、前ロ．の名義登録受益者にかかる収益分配金の未払い残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとします。

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

信託終了時の交換等

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

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

- 八．信託終了に際して、委託会社が信託終了に関して指定する販売会社は、その所有にかかるすべての受益権を交換請求するものとします。交換により引渡される株式に当該販売会社の自社株式等が含まれる場合には、委託会社は、受託会社に対しこれを売却する指図をするとともに、当該自社株式等の評価額に相当する口数の受益権を、受託会社は信託財産をもって買取るものとします。
- 二．受益者が、前イ．の交換について、交換開始日から10年間その交換の請求をしないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

交換請求権および買取請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成25年7月11日から平成26年7月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ上場投信 - トピックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 平成25年7月10日現在	第13期 平成26年7月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	30,566,239,359	63,441,579,302
株式	³ ⁴ 934,650,293,976	³ ⁴ 1,122,765,596,200
派生商品評価勘定	91,866,558	9,530,062
未収入金	3,460,646,545	7,718,508,583
未収配当金	713,952,870	833,830,740
その他未収収益	⁵ 22,881,015	⁵ 72,073,444
流動資産合計	969,505,880,323	1,194,841,118,331
資産合計		
	969,505,880,323	1,194,841,118,331
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,139,352
前受金	556,629,000	194,534,000
未払金	-	3,193,460
未払収益分配金	7,499,391,895	14,229,125,046
未払受託者報酬	116,621,694	189,125,149
未払委託者報酬	238,834,310	387,415,774
未払利息	269,706	523,613
受入担保金	25,392,615,053	55,882,560,090
その他未払費用	122,358,205	221,310,826
流動負債合計	33,926,719,863	71,109,927,310
負債合計		
	33,926,719,863	71,109,927,310
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 956,555,088,750	¹ 1,084,536,970,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 20,975,928,290	² 39,194,221,021
（分配準備積立金）	743,918,552	940,385,753
元本等合計	935,579,160,460	1,123,731,191,021
純資産合計		
	935,579,160,460	1,123,731,191,021
負債純資産合計		
	969,505,880,323	1,194,841,118,331

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	自 至	第12期 平成24年7月11日 平成25年7月10日	自 至	第13期 平成25年7月11日 平成26年7月10日
営業収益				
受取配当金		8,232,140,255		15,175,316,794
受取利息		22,267,920		27,641,510
有価証券売買等損益		185,169,889,627		82,593,459,094
派生商品取引等損益		1,231,137,500		740,376,711
その他収益		1 336,147,232		1 569,567,764
営業収益合計		194,991,582,534		99,106,361,873
営業費用				
支払利息		11,087,645		15,024,043
受託者報酬		181,375,780		364,644,346
委託者報酬		367,102,888		745,636,661
その他費用		122,478,043		221,628,771
営業費用合計		682,044,356		1,346,933,821
営業利益		194,309,538,178		97,759,428,052
経常利益		194,309,538,178		97,759,428,052
当期純利益		194,309,538,178		97,759,428,052
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		185,521,600,456		20,975,928,290
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,186,053,294		4,035,419,440
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,186,053,294		4,035,419,440
剰余金減少額又は欠損金増加額		30,450,527,411		27,395,573,135
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		30,450,527,411		27,395,573,135
分配金		2 7,499,391,895		2 14,229,125,046
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		20,975,928,290		39,194,221,021

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第13期	
	自 平成25年7月11日	至 平成26年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第12期	第13期
	平成25年7月10日現在	平成26年7月10日現在
1. 1 期首元本額	479,293,858,750円	956,555,088,750円
期中追加設定元本額	531,666,737,500円	627,433,200,000円
期中一部交換元本額	54,405,507,500円	499,451,318,750円
2. 計算期間末日における受益権の総数	765,244,071口	867,629,576口

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20,975,928,290円であります。	
4.	3	貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 24,623,111,170円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 52,459,252,500円
5.	4	差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 624,590,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 486,150,000円
6.	5	その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分20,711,600円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分68,897,160円が含まれております。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第12期	第13期
	自 平成24年7月11日 至 平成25年7月10日	自 平成25年7月11日 至 平成26年7月10日
1. 1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額267,128,821円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額448,896,727円が含まれております。
2. 2 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(8,579,467,762円)及び分配準備積立金(334,799,396円)の合計額から、経費(670,956,711円)を控除して計算される分配対象額は8,243,310,447円(10口当たり107.7円)であり、うち7,499,391,895円(10口当たり98.0円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額(15,757,502,025円)及び分配準備積立金(743,918,552円)の合計額から、経費(1,331,909,778円)を控除して計算される分配対象額は15,169,510,799円(10口当たり174.8円)であり、うち14,229,125,046円(10口当たり164.0円)を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	第13期
	自 平成25年7月11日 至 平成26年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、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行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 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	第13期
	平成26年7月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第12期 平成25年7月10日現在	第13期 平成26年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	176,354,232,646	76,245,556,551
合計	176,354,232,646	76,245,556,551

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	第12期 平成25年7月10日 現在				第13期 平成26年7月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	829,752,000	-	921,690,000	91,938,000	914,088,000	-	921,625,000	7,537,000
合計	829,752,000	-	921,690,000	91,938,000	914,088,000	-	921,625,000	7,537,000

（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。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第13期 自 平成25年7月11日 至 平成26年7月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第12期 平成25年7月10日現在	第13期 平成26年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,222.6円	1,295.2円
（10口当たり純資産額）	(12,226円)	(12,952円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	268,000	259	69,412,000	貸付株式数 106,000株
日本水産	861,500	321	276,541,500	
マルハニチロ	133,800	1,611	215,551,800	
ハウスイ	49,000	133	6,517,000	貸付株式数 22,000株
サカタのタネ	103,400	1,372	141,864,800	
ホクト	77,700	2,003	155,633,100	
ショーボンドHD	62,200	4,470	278,034,000	貸付株式数 3,100株
ミライト・ホールディングス	198,900	982	195,319,800	
タマホーム	31,000	720	22,320,000	貸付株式数 11,300株
サンヨーホームズ	5,400	771	4,163,400	
住石ホールディングス	194,400	121	23,522,400	
日鉄鉱業	178,000	448	79,744,000	
三井松島	453,000	136	61,608,000	
国際石油開発帝石	3,408,200	1,497	5,102,075,400	
日本海洋掘削	17,500	4,915	86,012,500	貸付株式数 10,200株 (4,300株)
石油資源開発	99,900	3,940	393,606,000	
K & Oエナジーグループ	35,300	1,627	57,433,100	
ダイセキ環境ソリューション	6,200	1,631	10,112,200	
安藤・間	456,900	573	261,803,700	
東急建設	248,800	468	116,438,400	貸付株式数 92,000株

コムシスホールディングス	340,200	1,833	623,586,600	
ミサワホーム	75,200	1,284	96,556,800	
高松コンストラクショング P	52,900	1,685	89,136,500	
東建コーポレーション	25,600	4,660	119,296,000	
ヤマウラ	32,800	316	10,364,800	貸付株式数 5,000株
大成建設	3,543,000	548	1,941,564,000	
大林組	2,102,000	688	1,446,176,000	
清水建設	2,144,000	681	1,460,064,000	貸付株式数 550,000株
飛島建設	430,500	146	62,853,000	貸付株式数 128,300株
長谷工コーポレーション	934,700	776	725,327,200	
松井建設	77,000	412	31,724,000	
銭高組	82,000	282	23,124,000	貸付株式数 31,000株
鹿島建設	3,080,000	430	1,324,400,000	
不動テトラ	495,000	194	96,030,000	貸付株式数 186,500株
大末建設	263,000	99	26,037,000	貸付株式数 105,000株
鉄建建設	426,000	311	132,486,000	貸付株式数 182,000株
日鉄住金テックスエンジ	111,000	542	60,162,000	
西松建設	918,000	410	376,380,000	
三井住友建設	1,883,800	110	207,218,000	貸付株式数 587,400株
大豊建設	210,000	361	75,810,000	
前田建設	432,000	766	330,912,000	
佐田建設	241,000	113	27,233,000	貸付株式数 44,000株
ナカノフドー建設	53,600	309	16,562,400	
奥村組	621,000	497	308,637,000	
大和小田急建設	35,800	375	13,425,000	
東鉄工業	84,100	2,395	201,419,500	
イチケン	77,000	177	13,629,000	
浅沼組	210,000	120	25,200,000	貸付株式数 66,000株
戸田建設	815,000	388	316,220,000	貸付株式数 245,000株 (245,000株)
熊谷組	646,000	250	161,500,000	貸付株式数 232,000株
青木あすなろ建設	42,400	614	26,033,600	
北野建設	146,000	259	37,814,000	
植木組	87,000	214	18,618,000	
三井ホーム	90,000	488	43,920,000	
矢作建設	95,300	805	76,716,500	
ピーエス三菱	53,000	457	24,221,000	貸付株式数 21,100株
東日本ハウス	80,700	526	42,448,200	
大東建託	266,200	11,895	3,166,449,000	
新日本建設	83,400	311	25,937,400	貸付株式数 8,900株

N I P P O	162,000	1,687	273,294,000	
東亜道路	132,000	405	53,460,000	
前田道路	219,000	1,703	372,957,000	
日本道路	190,000	555	105,450,000	
東亜建設	612,000	177	108,324,000	
若築建設	370,000	134	49,580,000	貸付株式数 81,000株
東洋建設	217,700	372	80,984,400	貸付株式数 86,700株
五洋建設	833,300	341	284,155,300	貸付株式数 251,500株
大林道路	82,000	511	41,902,000	
世紀東急	354,000	114	40,356,000	
福 田 組	104,000	543	56,472,000	
日本ドライケミカル	6,300	2,320	14,616,000	
住友林業	482,400	1,209	583,221,600	貸付株式数 37,700株
日本基礎技術	77,900	359	27,966,100	
日成ビルド工業	180,000	299	53,820,000	貸付株式数 54,000株
ヤマダ・エスバイエルホーム	317,000	124	39,308,000	貸付株式数 163,000株
巴コーポレーション	87,100	421	36,669,100	
パナホーム	256,000	786	201,216,000	
大和ハウス	1,919,000	2,129	4,085,551,000	
ライト工業	146,000	726	105,996,000	
積水ハウス	1,858,600	1,377	2,559,292,200	
日特建設	85,300	375	31,987,500	
北陸電気工事	27,000	522	14,094,000	
ユアテック	109,000	626	68,234,000	
西部電気工業	58,000	483	28,014,000	
四電工	59,000	422	24,898,000	
中電工	101,200	1,514	153,216,800	
関 電 工	319,000	571	182,149,000	
きんでん	460,000	1,017	467,820,000	
東京エネシス	72,000	567	40,824,000	
トーエネック	99,000	599	59,301,000	
住友電設	48,400	1,135	54,934,000	
日本電設工業	114,200	1,596	182,263,200	
協和エクシオ	274,600	1,411	387,460,600	
新日本空調	58,900	748	44,057,200	
日本工営	219,000	503	110,157,000	
N D S	105,000	296	31,080,000	
九電工	129,000	981	126,549,000	
三機工業	142,000	751	106,642,000	
日 揮	696,000	3,088	2,149,248,000	

中外炉工業	182,000	225	40,950,000	
ヤマト	63,000	359	22,617,000	
太平電業	103,000	752	77,456,000	
高砂熱学	195,200	1,164	227,212,800	
三晃金属	77,000	231	17,787,000	
NEC ネットエスアイ	67,600	2,452	165,755,200	
朝日工業社	79,000	416	32,864,000	
明星工業	99,000	571	56,529,000	
大気社	92,900	2,341	217,478,900	
ダイダン	94,000	608	57,152,000	
日比谷総合設備	78,300	1,609	125,984,700	
東芝プラントシステム	113,800	1,496	170,244,800	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
日本製粉	430,000	529	227,470,000	
日清製粉G本社	698,600	1,214	848,100,400	
日東富士製粉	55,000	317	17,435,000	
昭和産業	278,000	371	103,138,000	
鳥越製粉	55,600	701	38,975,600	
協同飼料	242,000	102	24,684,000	
中部飼料	67,000	677	45,359,000	
日本配合飼料	214,000	116	24,824,000	
東洋精糖	105,000	101	10,605,000	
日本甜菜糖	354,000	188	66,552,000	
三井製糖	267,000	383	102,261,000	
塩水港精糖	41,400	277	11,467,800	
ネクスト	54,800	806	44,168,800	貸付株式数 21,800株
日本M&Aセンター	101,000	2,990	301,990,000	
ノバレーゼ	16,700	944	15,764,800	
アコーディア・ゴルフ	266,100	1,308	348,058,800	貸付株式数 56,100株
タケエイ	44,600	1,054	47,008,400	貸付株式数 14,100株
トラスト・テック	8,800	1,756	15,452,800	
パソナグループ	48,600	605	29,403,000	
CDS	9,700	1,059	10,272,300	
リンクアンドモチベーション	85,600	167	14,295,200	貸付株式数 17,600株
GCAサヴィアン	40,300	894	36,028,200	貸付株式数 2,900株
エス・エム・エス	35,900	2,887	103,643,300	貸付株式数 21,100株
テンプホールディングス	142,800	3,110	444,108,000	貸付株式数 40,900株
リニカル	12,100	970	11,737,000	
クックパッド	32,100	2,504	80,378,400	貸付株式数 17,200株
エスクリ	22,700	930	21,111,000	貸付株式数 1,000株

アイ・ケイ・ケイ	16,000	848	13,568,000	貸付株式数	4,200株
森永製菓	682,000	220	150,040,000		
中村屋	163,000	426	69,438,000	貸付株式数	48,000株 (48,000株)
江崎グリコ	243,000	1,593	387,099,000		
名糖産業	31,000	1,175	36,425,000		
不二家	401,000	197	78,997,000	貸付株式数	179,000株
山崎製パン	513,000	1,285	659,205,000	貸付株式数	205,000株
第一屋製パン	94,000	125	11,750,000	貸付株式数	37,000株
モロゾフ	106,000	343	36,358,000		
亀田製菓	39,000	3,280	127,920,000	貸付株式数	1,100株
寿スピリッツ	15,100	2,312	34,911,200		
カルビー	257,800	2,834	730,605,200		
森永乳業	592,000	370	219,040,000	貸付株式数	20,000株 (20,000株)
六甲バター	31,200	881	27,487,200	貸付株式数	14,000株
ヤクルト	410,000	5,350	2,193,500,000		
明治ホールディングス	207,600	6,910	1,434,516,000		
雪印メグミルク	151,200	1,310	198,072,000	貸付株式数	12,000株
プリマハム	346,000	268	92,728,000		
日本ハム	436,000	2,066	900,776,000		
伊藤ハム	376,000	445	167,320,000	貸付株式数	66,000株 (40,000株)
林兼産業	225,000	80	18,000,000	貸付株式数	80,000株
丸大食品	335,000	339	113,565,000		
米久	22,400	893	20,003,200		
S Foods	43,300	1,469	63,607,700		
学情	21,200	1,004	21,284,800	貸付株式数	6,500株
スタジオアリス	26,200	1,450	37,990,000	貸付株式数	4,100株
シミックホールディングス	24,600	1,772	43,591,200		
システナ	60,200	754	45,390,800		
デジタルアーツ	16,100	940	15,134,000	貸付株式数	6,200株
新日鉄住金SOL	51,500	2,745	141,367,500		
総合警備保障	237,800	2,422	575,951,600		
キューブシステム	13,400	899	12,046,600		
日本駐車場開発	670,600	122	81,813,200	貸付株式数	33,000株
コア	23,000	746	17,158,000		
カカクコム	391,200	1,668	652,521,600		
アイロムホールディングス	14,500	740	10,730,000	貸付株式数	8,400株
ルネサンス	28,300	918	25,979,400		

ディップ	10,300	3,330	34,299,000	
SBSホールディングス	46,200	590	27,258,000	
オプト	25,200	757	19,076,400	貸付株式数 10,400株
新日本科学	48,800	882	43,041,600	貸付株式数 17,600株
ツクイ	69,600	941	65,493,600	
総合臨床HLDGS	17,800	496	8,828,800	貸付株式数 600株
キャリアデザインセンター	15,100	1,015	15,326,500	
エムスリー	436,600	1,595	696,377,000	
ツカダ・グローバルHOLD	37,100	688	25,524,800	貸付株式数 15,100株
アウトソーシング	19,100	1,537	29,356,700	
ディー・エヌ・エー	351,500	1,328	466,792,000	貸付株式数 71,100株
博報堂DYHLDGS	905,600	1,015	919,184,000	
ぐるなび	90,800	1,708	155,086,400	貸付株式数 29,100株
一休	45,800	1,307	59,860,600	貸付株式数 13,900株
ジャパンベストレスキューS	40,900	301	12,310,900	貸付株式数 15,000株
ファンコミュニケーションズ	111,500	1,628	181,522,000	
ジェイコムホールディングス	13,300	740	9,842,000	貸付株式数 7,800株
PGMホールディングス	92,100	1,007	92,744,700	貸付株式数 27,800株
WDBホールディングス	7,100	1,335	9,478,500	
バリューコマース	41,100	1,056	43,401,600	貸付株式数 12,200株
サッポロホールディングス	1,139,000	428	487,492,000	
アサヒグループホールディング	1,408,900	3,266	4,601,467,400	貸付株式数 425,100株 (425,100株)
キリンHD	2,998,800	1,466	4,396,240,800	貸付株式数 904,800株
宝ホールディングス	547,000	889	486,283,000	
オエノンホールディングス	174,000	241	41,934,000	
養命酒	53,000	965	51,145,000	
コカ・コーラウエスト	216,500	1,750	378,875,000	貸付株式数 60,000株 (60,000株)
コカ・コーライーストジャパ ン	146,500	2,762	404,633,000	
サントリー食品インター	480,100	3,865	1,855,586,500	
ダイドードリンコ	32,200	4,680	150,696,000	
伊藤園	190,600	2,552	486,411,200	貸付株式数 86,400株
キーコーヒー	66,100	1,626	107,478,600	
ユニカフェ	18,900	647	12,228,300	
ジャパンフーズ	8,900	1,204	10,715,600	
日清オイリオグループ	303,000	361	109,383,000	貸付株式数 139,000株
不二製油	170,100	1,495	254,299,500	
かどや製油	6,800	2,651	18,026,800	貸付株式数 1,900株

Ｊ－オイルミルズ	282,000	331	93,342,000	
ローソン	253,200	7,760	1,964,832,000	
サンエー	46,100	3,110	143,371,000	
キリン堂	22,000	687	15,114,000	
ダイユーエイト	12,000	672	8,064,000	
カワチ薬品	43,000	1,878	80,754,000	
エービーシー・マート	87,600	5,340	467,784,000	貸付株式数 27,200株 (27,200株)
ハードオフコーポレーション	28,900	898	25,952,200	
高千穂交易	25,400	1,030	26,162,000	
アスクル	55,900	3,320	185,588,000	貸付株式数 32,600株 (11,500株)
ゲオホールディングス	105,600	870	91,872,000	
アダストリアホールディング	47,400	2,550	120,870,000	貸付株式数 15,200株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	79,000	154	12,166,000	貸付株式数 31,000株
伊藤忠食品	15,200	3,590	54,568,000	
くらコーポレーション	35,800	2,741	98,127,800	
キャンドゥ	28,300	1,559	44,119,700	貸付株式数 16,800株
エレマテック	27,800	1,912	53,153,600	
パル	35,500	2,733	97,021,500	
JALUX	17,400	1,241	21,593,400	
エディオン	282,800	678	191,738,400	貸付株式数 71,300株
あらた	139,000	341	47,399,000	
サーラコーポレーション	52,900	565	29,888,500	
ワッツ	24,000	997	23,928,000	
トーマンデバイス	9,200	1,787	16,440,400	
J Pホールディングス	108,700	425	46,197,500	貸付株式数 48,100株
あみやき亭	10,600	3,300	34,980,000	
東京エレクトロニクスデバイス	12,000	1,468	17,616,000	
ひらまつ	62,600	666	41,691,600	貸付株式数 28,900株
双日	4,132,200	174	719,002,800	
ゲンキー	6,100	2,952	18,007,200	貸付株式数 1,900株
アルフレッサホールディングス	182,600	6,310	1,152,206,000	
大黒天物産	14,700	2,697	39,645,900	
ハニーズ	48,800	1,040	50,752,000	貸付株式数 15,600株 (10,000株)
キッコーマン	572,000	2,139	1,223,508,000	貸付株式数 171,000株
味の素	1,616,000	1,581	2,554,896,000	

キューピー	356,600	1,713	610,855,800	
ハウス食品G本社	239,500	1,930	462,235,000	貸付株式数 70,500株
カゴメ	270,900	1,779	481,931,100	貸付株式数 105,600株
焼津水産化工	30,400	986	29,974,400	
アリアケジャパン	63,700	2,655	169,123,500	
ニチレイ	747,000	476	355,572,000	
横浜冷凍	152,800	834	127,435,200	
東洋水産	343,000	3,105	1,065,015,000	
イトアンド	5,800	1,615	9,367,000	
日清食品HD	273,800	5,270	1,442,926,000	
永谷園	67,000	1,022	68,474,000	
フジッコ	68,000	1,275	86,700,000	
ロックフィールド	36,000	1,917	69,012,000	貸付株式数 12,700株
日本たばこ産業	3,884,500	3,700	14,372,650,000	
ケンコーマヨネーズ	22,800	1,009	23,005,200	
わらべや日洋	41,100	1,990	81,789,000	
なとり	32,100	1,119	35,919,900	
片倉工業	75,800	1,327	100,586,600	
グンゼ	530,000	287	152,110,000	
ヒューリック	1,042,000	1,355	1,411,910,000	貸付株式数 324,800株
神栄	85,000	213	18,105,000	貸付株式数 15,000株 (7,000株)
山下医科器械	5,000	1,771	8,855,000	貸付株式数 700株
ラサ商事	26,500	483	12,799,500	
アルペン	49,400	1,732	85,560,800	貸付株式数 13,000株 (5,600株)
クオール	44,700	606	27,088,200	貸付株式数 10,300株
アルコニックス	18,500	2,927	54,149,500	
神戸物産	7,400	3,235	23,939,000	貸付株式数 4,200株
ジェイアイエヌ	31,800	2,963	94,223,400	貸付株式数 19,000株
ビックカメラ	232,000	772	179,104,000	貸付株式数 137,300株
DCMホールディングス	298,700	715	213,570,500	
MonotaRO	96,000	2,995	287,520,000	貸付株式数 30,500株
あいホールディングス	98,900	1,825	180,492,500	
きちり	12,300	509	6,260,700	
J.フロントリテイリング	1,458,000	682	994,356,000	
ドトール・日レスHD	108,100	1,767	191,012,700	貸付株式数 20,000株 (20,000株)
マツモトキヨシHLDGS	127,300	3,450	439,185,000	

ブロンコビリー	9,700	2,853	27,674,100	貸付株式数	3,800株
スタートトゥデイ	191,600	2,664	510,422,400		
物語コーポレーション	8,700	3,020	26,274,000		
ココカラファイン	64,300	2,924	188,013,200		
三越伊勢丹HD	1,227,100	1,251	1,535,102,100		
東洋紡	2,767,000	171	473,157,000		
ユニチカ	1,795,000	47	84,365,000		
富士紡ホールディングス	340,000	298	101,320,000		
日清紡ホールディングス	417,000	1,014	422,838,000		
倉敷紡績	671,000	180	120,780,000		
ダイワボウHD	561,000	195	109,395,000		
シキボウ	370,000	118	43,660,000		
日東紡績	481,000	405	194,805,000	貸付株式数	25,000株 (25,000株)
トヨタ紡織	218,700	1,077	235,539,900	貸付株式数	105,900株
ウエルシアHD	23,600	6,240	147,264,000		
クリエイトSDH	25,500	3,595	91,672,500		
バイタルKSKHD	115,900	816	94,574,400		
八洲電機	47,600	522	24,847,200	貸付株式数	14,200株
UKCホールディングス	39,600	1,603	63,478,800		
丸善CHI HD	53,900	358	19,296,200	貸付株式数	16,200株
TOKAIホールディングス	301,400	426	128,396,400		
エー・ピーカンパニー	6,600	1,957	12,916,200	貸付株式数	2,100株
三洋貿易	19,300	1,182	22,812,600	貸付株式数	8,400株
チムニー	11,300	2,001	22,611,300	貸付株式数	6,500株
ジョイフル本田	33,800	4,050	136,890,000	貸付株式数	10,500株
日本毛織	206,000	794	163,564,000		
大東紡織	99,000	75	7,425,000		
トーア紡コーポレーション	273,000	73	19,929,000		
ダイドーリミテッド	73,200	557	40,772,400		
東京建物不動産販	31,900	404	12,887,600	貸付株式数	9,300株 (9,300株)
三栄建築設計	17,500	894	15,645,000		
野村不動産HLDS	407,900	1,909	778,681,100		
プレサンスコーポレーション	10,700	2,967	31,746,900	貸付株式数	400株
常和ホールディングス	21,700	3,710	80,507,000	貸付株式数	6,900株 (6,900株)
フージャースHD	91,900	495	45,490,500	貸付株式数	5,900株
オープンハウス	24,000	2,189	52,536,000		
東急不動産HD	1,369,100	808	1,106,232,800		

飯田GHD	270,400	1,499	405,329,600	
帝国繊維	68,200	2,162	147,448,400	
ブックオフコーポレーション	34,000	838	28,492,000	貸付株式数 7,900株
日本コークス工業	528,500	118	62,363,000	
ミタチ産業	14,300	578	8,265,400	
あさひ	35,400	1,390	49,206,000	貸付株式数 10,600株
日本調剤	7,820	2,690	21,035,800	
コスモス薬品	31,800	11,180	355,524,000	貸付株式数 9,500株 (9,500株)
シップヘルスケアHD	88,000	3,360	295,680,000	
トーエル	32,700	653	21,353,100	
一六堂	8,800	450	3,960,000	
ソフトクリエイイトHD	20,100	854	17,165,400	
セブン&アイ・HLDGS	2,582,500	4,359	11,257,117,500	
クリエイイト・レストランツ・ホール	8,300	2,991	24,825,300	貸付株式数 3,000株
ツルハホールディングス	121,500	5,500	668,250,000	
スターティア	5,200	1,547	8,044,400	
サンマルクホールディングス	19,900	5,550	110,445,000	
フェリシモ	17,600	1,088	19,148,800	
トリドール	53,400	872	46,564,800	貸付株式数 18,200株
クスリのアオキ	18,300	3,400	62,220,000	
帝人	2,678,000	244	653,432,000	貸付株式数 23,000株
東レ	4,753,000	680	3,232,040,000	貸付株式数 1,422,000株
クラレ	1,041,100	1,311	1,364,882,100	貸付株式数 300株
旭化成	4,086,000	774	3,162,564,000	貸付株式数 500,000株 (500,000株)
サカイオーベックス	173,000	168	29,064,000	
稲葉製作所	27,100	1,447	39,213,700	貸付株式数 8,100株 (8,100株)
宮地エンジニアリングG	215,000	199	42,785,000	
トーカロ	39,900	1,748	69,745,200	
アルファCO	21,800	1,041	22,693,800	
SUMCO	404,000	959	387,436,000	貸付株式数 162,500株
川田テクノロジーズ	13,500	5,260	71,010,000	貸付株式数 3,500株
住江織物	179,000	311	55,669,000	
日本フェルト	36,300	468	16,988,400	
イチカワ	43,000	279	11,997,000	
日本バイリン	68,000	571	38,828,000	
エコナックホールディングス	183,000	47	8,601,000	

日東製網	76,000	156	11,856,000		
芦森工業	141,000	180	25,380,000	貸付株式数	9,000株
アツギ	546,000	110	60,060,000		
ダイニック	120,000	162	19,440,000		
共和レザー	42,800	503	21,528,400		
セーレン	175,700	903	158,657,100		
東海染工	91,000	118	10,738,000	貸付株式数	9,000株
小松精練	108,000	567	61,236,000	貸付株式数	1,000株
ワコールホールディングス	390,000	1,094	426,660,000		
ホギメディカル	41,300	5,460	225,498,000		
レナウン	156,600	124	19,418,400	貸付株式数	24,600株
クラウディア	7,500	1,273	9,547,500	貸付株式数	3,000株
T S Iホールディングス	314,800	705	221,934,000		
I Tホールディングス	221,700	1,885	417,904,500		
ネオス	12,900	927	11,958,300	貸付株式数	7,500株
電算システム	15,900	1,534	24,390,600	貸付株式数	5,700株
グリー	334,800	848	283,910,400	貸付株式数	198,100株 (8,100株)
コーエーテクモHD	121,900	1,381	168,343,900		
三菱総合研究所	23,900	2,352	56,212,800		
ボルテージ	9,100	1,356	12,339,600	貸付株式数	5,100株
電算	3,200	2,178	6,969,600	貸付株式数	1,700株
A G S	12,900	816	10,526,400		
ヒト・コミュニケーションズ	7,400	2,002	14,814,800	貸付株式数	2,200株
ブレインパッド	6,200	1,347	8,351,400	貸付株式数	600株
K L a b	41,900	1,285	53,841,500	貸付株式数	24,600株
ポルトゥウィン・ピットクル	35,700	1,189	42,447,300	貸付株式数	4,800株
イーブックイニシアティブ	9,000	1,184	10,656,000	貸付株式数	5,100株
ネクソン	515,200	993	511,593,600		
アイスタイル	18,000	416	7,488,000	貸付株式数	7,700株
エムアップ	10,400	880	9,152,000	貸付株式数	3,500株
エイチーム	6,800	6,100	41,480,000	貸付株式数	2,200株
e n i s h	9,200	1,584	14,572,800	貸付株式数	3,400株
コロプラ	107,600	2,652	285,355,200	貸付株式数	33,300株
モバイルクリエイト	6,400	3,600	23,040,000	貸付株式数	1,500株
オルトプラス	11,300	1,256	14,192,800	貸付株式数	3,400株
ブロードリーフ	50,800	1,916	97,332,800	貸付株式数	11,000株
ハーツユニテッドグループ	13,900	2,160	30,024,000		
特種東海製紙	372,000	225	83,700,000		

ドワンゴ	53,600	2,473	132,552,800	貸付株式数 32,100株 (7,200株)
ベリサーブ	2,900	1,805	5,234,500	
ティーガイア	61,400	923	56,672,200	
豆蔵ホールディングス	34,700	520	18,044,000	
テクマトリックス	18,600	639	11,885,400	
GMOペイメントゲートウェイ	23,600	4,215	99,474,000	貸付株式数 7,100株
ザッパラス	34,400	622	21,396,800	
インターネットイニシアティブ	90,700	2,421	219,584,700	貸付株式数 28,900株
ビットアイル	44,200	629	27,801,800	貸付株式数 18,600株
SRAホールディングス	28,600	1,571	44,930,600	
システムインテグレータ	6,300	712	4,485,600	
パイブドピッツ	4,400	1,558	6,855,200	
朝日ネット	56,800	512	29,081,600	
コムチュア	6,600	1,874	12,368,400	
王子ホールディングス	2,894,000	412	1,192,328,000	貸付株式数 40,000株
日本製紙	338,700	1,857	628,965,900	貸付株式数 102,200株
三菱製紙	932,000	88	82,016,000	貸付株式数 191,000株
北越紀州製紙	447,100	440	196,724,000	貸付株式数 134,900株
中越パルプ	247,000	185	45,695,000	
巴川製紙	101,000	193	19,493,000	貸付株式数 11,000株
大王製紙	229,000	882	201,978,000	貸付株式数 70,000株
レンゴー	526,000	465	244,590,000	
トーモク	206,000	294	60,564,000	
ザ・パック	45,800	2,080	95,264,000	貸付株式数 900株 (900株)
コ-プケミカル	98,000	116	11,368,000	貸付株式数 8,000株
昭和電工	4,362,000	143	623,766,000	貸付株式数 92,000株
住友化学	4,823,000	379	1,827,917,000	
日本化成	119,000	145	17,255,000	
住友精化	136,000	696	94,656,000	
日産化学	437,800	1,661	727,185,800	
ラサ工業	245,000	141	34,545,000	貸付株式数 92,000株
クレハ	454,000	535	242,890,000	
多木化学	34,000	732	24,888,000	貸付株式数 6,000株
テイカ	109,000	346	37,714,000	
石原産業	1,177,000	88	103,576,000	貸付株式数 467,000株
片倉チツカリン	34,000	266	9,044,000	

日本曹達	420,000	548	230,160,000	
東ソー	1,750,000	475	831,250,000	
トクヤマ	1,019,000	323	329,137,000	
セントラル硝子	626,000	374	234,124,000	
東亜合成	771,000	451	347,721,000	
ダイソー	255,000	356	90,780,000	
関東電化	156,000	251	39,156,000	
電気化学	1,267,000	385	487,795,000	
イビデン	380,900	2,016	767,894,400	
信越化学	1,175,000	6,056	7,115,800,000	
日本カ - バイド	191,000	274	52,334,000	貸付株式数 85,000株
堺 化 学	258,000	318	82,044,000	
エア・ウォーター	540,000	1,655	893,700,000	
大陽日酸	841,000	898	755,218,000	貸付株式数 268,000株 (123,000株)
日本化学工業	242,000	140	33,880,000	
日本パ - カライジング	154,500	2,234	345,153,000	
高压ガス	97,000	604	58,588,000	
チタン工業	76,000	231	17,556,000	貸付株式数 10,000株
四国化成	94,000	774	72,756,000	
戸田工業	116,000	301	34,916,000	貸付株式数 53,000株
ステラ ケミファ	33,400	1,315	43,921,000	
保土谷化学	196,000	184	36,064,000	
日本触媒	551,000	1,309	721,259,000	
大日精化	249,000	482	120,018,000	
カネカ	816,000	618	504,288,000	
協和発酵キリン	781,000	1,396	1,090,276,000	貸付株式数 234,000株
三菱瓦斯化学	1,033,000	625	645,625,000	
三井化学	2,978,000	268	798,104,000	貸付株式数 596,000株
J S R	600,900	1,755	1,054,579,500	貸付株式数 226,600株
東京応化工業	126,700	2,400	304,080,000	
大阪有機化学	43,600	460	20,056,000	
三菱ケミカルH L D G S	4,095,800	443	1,814,439,400	貸付株式数 1,309,300株
日本合成化学	134,000	823	110,282,000	
ダイセル	851,000	987	839,937,000	
住友ベ - クライト	511,000	399	203,889,000	
積水化学	1,345,000	1,217	1,636,865,000	
日本ゼオン	517,000	1,045	540,265,000	
アイカ工業	183,800	2,162	397,375,600	
宇部興産	3,300,000	173	570,900,000	

積水樹脂	91,900	1,410	129,579,000	
タキロン	153,000	584	89,352,000	
旭有機材	231,000	217	50,127,000	
日立化成	283,300	1,659	469,994,700	
ニチバン	64,000	370	23,680,000	
リケンテクノス	105,000	521	54,705,000	
大倉工業	157,000	333	52,281,000	
積水化成品	186,000	281	52,266,000	
群栄化学	175,000	397	69,475,000	貸付株式数 44,000株
タイガース ポリマー	32,200	529	17,033,800	
ミライアル	15,800	1,801	28,455,800	貸付株式数 6,400株
ダイキョーニシカワ	15,800	1,978	31,252,400	
日本化薬	456,000	1,289	587,784,000	貸付株式数 13,000株 (13,000株)
カーリットホールディングス	52,000	585	30,420,000	
イーピーエス	69,500	1,323	91,948,500	貸付株式数 26,500株
パナソニック インフォシス	12,100	2,759	33,383,900	
プレステージ・インター	43,800	857	37,536,600	
フェイス	18,600	1,064	19,790,400	
アミューズ	18,100	1,971	35,675,100	
野村総合研究所	349,600	3,035	1,061,036,000	貸付株式数 40,000株 (40,000株)
ドリームインキュベータ	17,200	1,606	27,623,200	
サイバネットシステム	50,300	367	18,460,100	
T A C	39,500	284	11,218,000	
ケネディクス	774,800	467	361,831,600	貸付株式数 230,400株
電通	616,200	4,110	2,532,582,000	貸付株式数 192,000株 (192,000株)
インテージホールディングス	33,300	1,432	47,685,600	
テイクアンドギヴニーズ	26,900	1,346	36,207,400	貸付株式数 8,600株
東邦システムサイエンス	10,100	836	8,443,600	
ぴあ	19,200	1,806	34,675,200	
イオンファンタジー	21,200	1,371	29,065,200	貸付株式数 7,900株
ソースネクスト	30,800	732	22,545,600	貸付株式数 13,700株
ネクシィーズ	23,400	853	19,960,200	貸付株式数 6,800株
メディカルシステムネット ワーク	50,400	364	18,345,600	貸付株式数 14,900株
ティー・ワイ・オー	43,200	186	8,035,200	
日本精化	54,100	700	37,870,000	

A D E K A	281,800	1,353	381,275,400	貸付株式数 84,400株 (84,400株)
日油	542,000	722	391,324,000	
ミヨシ油脂	240,000	141	33,840,000	
新日本理化	76,600	251	19,226,600	貸付株式数 34,700株
ハリマ化成グループ	55,700	463	25,789,100	
花 王	1,711,900	4,118	7,049,604,200	
第一工業製薬	115,000	453	52,095,000	貸付株式数 34,000株
三洋化成	206,000	728	149,968,000	
武田薬品	2,454,000	4,655	11,423,370,000	
アステラス製薬	7,461,500	1,339	9,990,948,500	
大日本住友製薬	463,700	1,140	528,618,000	
塩野義製薬	1,023,000	2,132	2,181,036,000	
田辺三菱製薬	545,200	1,481	807,441,200	貸付株式数 164,500株
わかもと製薬	74,000	254	18,796,000	
あすか製薬	75,500	1,140	86,070,000	
日本新薬	150,000	2,927	439,050,000	
バイオフェルミン製薬	10,600	2,630	27,878,000	貸付株式数 3,000株
中外製薬	652,200	2,847	1,856,813,400	
科研製薬	226,000	2,146	484,996,000	
エーザイ	806,400	4,195	3,382,848,000	貸付株式数 370,800株
ロート製薬	274,900	1,543	424,170,700	
小野薬品	297,600	8,810	2,621,856,000	
久光製薬	203,300	4,350	884,355,000	
有機合成薬品	35,000	263	9,205,000	
持田製薬	46,800	7,130	333,684,000	
参天製薬	240,600	5,790	1,393,074,000	
扶桑薬品	220,000	321	70,620,000	
日本ケミファ	91,000	505	45,955,000	
ツムラ	191,900	2,393	459,216,700	貸付株式数 60,800株
日医工	153,200	1,475	225,970,000	
テ ル モ	958,900	2,264	2,170,949,600	
みらかホールディングス	171,700	4,965	852,490,500	
キッセイ薬品工業	121,500	2,385	289,777,500	
生化学工業	136,500	1,274	173,901,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
栄研化学	50,700	1,745	88,471,500	
日水製薬	25,900	1,228	31,805,200	
鳥居薬品	44,500	3,115	138,617,500	
J C R ファーマ	36,100	2,419	87,325,900	貸付株式数 13,000株

東和薬品	33,400	4,020	134,268,000	
富士製薬工業	18,500	1,901	35,168,500	貸付株式数 500株
沢井製薬	102,300	5,960	609,708,000	
ゼリア新薬工業	103,200	2,468	254,697,600	
第一三共	2,065,600	1,855	3,831,688,000	
キョーリン製薬HD	174,700	2,057	359,357,900	
大幸薬品	31,200	1,621	50,575,200	
ダイト	21,600	1,865	40,284,000	
大塚ホールディングス	1,300,100	3,187	4,143,418,700	
大正製薬HD	156,800	7,440	1,166,592,000	
大日本塗料	369,000	157	57,933,000	
日本ペイント	567,000	2,208	1,251,936,000	貸付株式数 138,000株
関西ペイント	789,000	1,748	1,379,172,000	
神東塗料	26,000	215	5,590,000	
中国塗料	188,000	748	140,624,000	
日本特殊塗料	50,400	597	30,088,800	
藤倉化成	82,600	530	43,778,000	
太陽ホールディングス	53,300	3,080	164,164,000	
D I C	2,343,000	247	578,721,000	貸付株式数 100,000株 (100,000株)
サカタインクス	133,700	968	129,421,600	
東洋インキSCホールディング	589,000	488	287,432,000	
T & K TOKA	23,700	2,140	50,718,000	
アルプス技研	25,900	1,149	29,759,100	
サニックス	95,000	1,203	114,285,000	貸付株式数 45,600株 (7,000株)
ダイオーズ	11,500	986	11,339,000	
日本空調サービス	31,900	758	24,180,200	
オリエンタルランド	176,600	18,035	3,184,981,000	
ダスキン	172,700	1,939	334,865,300	
パーク24	324,200	1,868	605,605,600	貸付株式数 29,000株
明光ネットワークジャパン	64,800	1,297	84,045,600	
ファルコSDホールディングス	33,400	1,227	40,981,800	
クレスコ	14,000	1,234	17,276,000	
フジ・メディア・HD	597,000	1,647	983,259,000	
秀英予備校	10,400	325	3,380,000	
田谷	9,900	767	7,593,300	
ラウンドワン	185,400	606	112,352,400	
リゾートトラスト	220,900	2,072	457,704,800	

オービック	212,800	3,325	707,560,000	
ジャストシステム	85,100	839	71,398,900	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
TDCソフトウェアエンジニア	13,400	852	11,416,800	
ヤフー	4,424,300	454	2,008,632,200	
ビー・エム・エル	42,700	3,840	163,968,000	
ワタベウェディング	21,100	592	12,491,200	
トレンドマイクロ	275,000	3,435	944,625,000	
もしもしホットライン	121,400	988	119,943,200	貸付株式数 11,000株
リソー教育	73,400	235	17,249,000	貸付株式数 43,200株
日本オラクル	98,800	4,410	435,708,000	貸付株式数 3,000株
早稲田アカデミー	9,700	795	7,711,500	
アルファシステムズ	20,200	1,587	32,057,400	
フューチャーアーキテクト	64,800	590	38,232,000	
CAC HOLDINGS	37,000	1,127	41,699,000	
ソフトバンク・テクノ	14,500	1,606	23,287,000	貸付株式数 6,100株
トーセ	15,100	838	12,653,800	
ユー・エス・エス	790,900	1,735	1,372,211,500	
オービックビジネスC	31,300	3,350	104,855,000	貸付株式数 9,400株 (9,400株)
伊藤忠テクノソリューションズ	69,300	4,350	301,455,000	
アイティフォー	68,600	458	31,418,800	
東京個別指導学院	31,600	419	13,240,400	貸付株式数 11,900株
東計電算	10,800	1,421	15,346,800	
楽天	2,835,200	1,341	3,802,003,200	貸付株式数 882,400株
エクスネット	5,600	1,385	7,756,000	
テー・オー・ダブリュー	21,400	685	14,659,000	
大塚商会	165,400	4,830	798,882,000	
総合メディカル	14,900	4,600	68,540,000	
サイボウズ	82,000	385	31,570,000	貸付株式数 29,400株
ソフトブレーン	84,200	255	21,471,000	貸付株式数 11,700株
アグレックス	14,300	1,096	15,672,800	
セントラルスポーツ	20,000	1,642	32,840,000	
パラカ	15,300	785	12,010,500	貸付株式数 4,600株
電通国際情報S	37,400	1,280	47,872,000	
イーエムシステムズ	8,300	1,803	14,964,900	
ウェザーニューズ	17,100	3,230	55,233,000	貸付株式数 4,900株
C I J	51,900	438	22,732,200	
東洋ビジネスエンジ	6,000	1,413	8,478,000	

日本エンタープライズ	37,100	262	9,720,200	
WOWOW	18,900	3,985	75,316,500	
フルキャストホールディングス	62,100	412	25,585,200	貸付株式数 27,200株
富士フイルムHLDGS	1,499,300	2,885	4,325,480,500	
コニカミノルタ	1,652,200	1,008	1,665,417,600	
資生堂	1,165,300	1,847	2,152,309,100	
ライオン	755,000	589	444,695,000	
高砂香料	235,000	484	113,740,000	
マンダム	65,600	3,740	245,344,000	
ミルボン	38,600	3,335	128,731,000	
ファンケル	151,900	1,225	186,077,500	
コーセー	105,900	3,995	423,070,500	
コタ	18,700	1,299	24,291,300	
ドクターシーラボ	44,200	3,850	170,170,000	
シーボン	5,600	2,290	12,824,000	
ポーラ・オルビスHD	67,000	4,080	273,360,000	
ノエビアホールディングス	43,600	2,148	93,652,800	貸付株式数 8,400株
アジュバンコスメジャパン	8,400	990	8,316,000	
エステー	40,200	1,008	40,521,600	
コニシ	47,400	2,200	104,280,000	
長谷川香料	82,900	1,570	130,153,000	
星光PMC	26,400	1,201	31,706,400	貸付株式数 15,900株
小林製薬	107,400	6,350	681,990,000	貸付株式数 26,300株 (24,400株)
荒川化学工業	54,600	1,286	70,215,600	
メック	50,700	1,073	54,401,100	貸付株式数 16,200株
日本高純度化学	18,400	2,149	39,541,600	
JCU	9,600	6,820	65,472,000	
新田ゼラチン	39,300	919	36,116,700	貸付株式数 15,800株
アース製薬	47,100	3,900	183,690,000	
イハラケミカル	100,700	850	85,595,000	
北興化学	70,000	401	28,070,000	
大成ラミック	17,100	2,703	46,221,300	貸付株式数 3,200株
クミアイ化学	135,000	641	86,535,000	
日本農薬	146,300	1,170	171,171,000	
昭和シエル石油	585,500	1,144	669,812,000	
コスモ石油	1,811,000	208	376,688,000	
富士興産	22,100	654	14,453,400	
ニチレキ	80,000	1,034	82,720,000	

東燃ゼネラル石油	988,000	931	919,828,000	貸付株式数	91,000株
ユシロ化学	35,300	1,328	46,878,400		
ピーピー・カストロール	26,600	654	17,396,400	貸付株式数	7,900株
富士石油	167,000	312	52,104,000	貸付株式数	4,700株
MORESCO	16,700	1,660	27,722,000	貸付株式数	4,800株
出光興産	310,800	2,182	678,165,600	貸付株式数	26,100株
JXホールディングス	7,270,200	531	3,860,476,200		
横浜ゴム	732,000	862	630,984,000	貸付株式数	219,000株
東洋ゴム	270,700	1,780	481,846,000		
ブリヂストン	2,053,000	3,702	7,600,206,000	貸付株式数	619,400株 (619,400株)
住友ゴム	510,900	1,462	746,935,800		
藤倉ゴム	41,000	898	36,818,000	貸付株式数	12,200株
オカモト	229,000	360	82,440,000		
アキレス	518,000	148	76,664,000		
フコク	26,900	973	26,173,700		
ニッタ	64,700	2,358	152,562,600		
クリエートメディック	20,600	982	20,229,200		
東海ゴム工業	121,200	1,025	124,230,000		
三ツ星ベルト	166,000	620	102,920,000		
バンドー化学	238,000	420	99,960,000		
鬼怒川ゴム	115,000	506	58,190,000		
旭硝子	3,227,000	594	1,916,838,000		
日本板硝子	3,159,000	139	439,101,000		
石塚硝子	85,000	223	18,955,000	貸付株式数	34,000株
有沢製作所	109,200	744	81,244,800		
日本山村硝子	256,000	166	42,496,000		
日本電気硝子	1,353,000	576	779,328,000	貸付株式数	408,000株
オハラ	24,700	582	14,375,400	貸付株式数	2,300株
住友大阪セメント	1,216,000	374	454,784,000		
太平洋セメント	3,847,000	397	1,527,259,000		
デイ・シイ	67,200	514	34,540,800		
リポートソリューション	54,000	234	12,636,000		
日本ヒューム	62,700	687	43,074,900		
日本コンクリート	108,000	508	54,864,000	貸付株式数	52,000株 (10,000株)
三谷セキサン	32,800	1,565	51,332,000	貸付株式数	9,900株
ジャパンパイル	58,500	854	49,959,000		
東海カーボン	568,000	298	169,264,000		

日本カーボン	343,000	187	64,141,000	貸付株式数 76,000株 (20,000株)
東洋炭素	36,300	2,409	87,446,700	貸付株式数 6,900株
ノリタケ	362,000	277	100,274,000	
TOTO	962,000	1,341	1,290,042,000	
日本碍子	827,000	2,335	1,931,045,000	
日本特殊陶業	564,000	2,873	1,620,372,000	
ダントーホールディングス	87,000	121	10,527,000	
MARUWA	16,800	4,020	67,536,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
品川リフラクトリーズ	165,000	226	37,290,000	
黒崎播磨	142,000	234	33,228,000	
ヨータイ	30,000	331	9,930,000	貸付株式数 12,000株
イソライト	23,700	193	4,574,100	貸付株式数 10,700株
東京窯業	79,000	214	16,906,000	
ニッカトー	23,000	406	9,338,000	
フジミインコーポレーテッド	59,600	1,350	80,460,000	
エーアンドエーマテリアル	136,000	122	16,592,000	
ニチアス	316,000	668	211,088,000	貸付株式数 100,000株 (100,000株)
新日鐵住金	27,686,000	309	8,554,974,000	
神戸製鋼所	10,447,000	157	1,640,179,000	
中山製鋼所	361,000	85	30,685,000	貸付株式数 146,000株
合同製鐵	333,000	151	50,283,000	
JFEホールディングス	1,670,700	2,084	3,481,738,800	
日新製鋼	277,300	1,310	363,263,000	
東京製鐵	361,400	501	181,061,400	貸付株式数 136,200株
共英製鋼	61,000	1,874	114,314,000	
大和工業	135,500	3,115	422,082,500	
東京鐵鋼	136,000	499	67,864,000	
大阪製鐵	32,800	1,761	57,760,800	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
淀川製鋼所	460,000	449	206,540,000	
東洋鋼鈑	157,000	586	92,002,000	
丸一鋼管	219,100	2,782	609,536,200	
モリ工業	97,000	412	39,964,000	
大同特殊鋼	1,097,000	515	564,955,000	貸付株式数 412,000株
日本高周波	254,000	102	25,908,000	貸付株式数 97,000株
日本冶金工	511,700	304	155,556,800	貸付株式数 193,000株
山陽特殊製鋼	352,000	482	169,664,000	貸付株式数 22,000株

愛知製鋼	345,000	412	142,140,000	
日立金属	583,000	1,590	926,970,000	
日本金属	169,000	142	23,998,000	貸付株式数 49,000株
大太平洋金属	452,000	525	237,300,000	貸付株式数 4,000株
新日本電工	270,000	317	85,590,000	
栗本鉄工所	338,000	241	81,458,000	
虹 技	77,000	216	16,632,000	貸付株式数 23,000株
日本鋳鉄管	70,000	233	16,310,000	
日本製鋼所	938,000	441	413,658,000	貸付株式数 299,000株
三菱製鋼	395,000	225	88,875,000	
日亜鋼業	90,000	321	28,890,000	
日本精線	50,000	484	24,200,000	
大紀アルミニウム	102,000	297	30,294,000	
日本軽金属HD	1,482,300	158	234,203,400	
三井金属	1,669,000	301	502,369,000	
東邦亜鉛	363,000	445	161,535,000	
三菱マテリアル	4,086,000	370	1,511,820,000	
住友鉱山	1,694,000	1,716	2,906,904,000	
DOWAホールディングス	711,000	977	694,647,000	
古河機金	1,100,000	208	228,800,000	貸付株式数 97,000株 (97,000株)
エス・サイエンス	219,600	47	10,321,200	
大阪チタニウム	70,500	2,559	180,409,500	貸付株式数 27,300株 (26,200株)
東邦チタニウム	110,700	778	86,124,600	貸付株式数 50,900株 (8,100株)
UACJ	832,000	387	321,984,000	
古河電工	2,059,000	216	444,744,000	貸付株式数 33,000株
住友電工	2,467,200	1,489	3,673,660,800	
フジクラ	1,051,000	511	537,061,000	
昭和電線HLDGS	838,000	107	89,666,000	
東京特殊電線	93,000	166	15,438,000	
タツタ電線	95,400	614	58,575,600	貸付株式数 53,000株
沖 電 線	68,000	237	16,116,000	
カナレ電気	9,400	1,640	15,416,000	
平河ヒューテック	14,100	877	12,365,700	
リョービ	399,000	336	134,064,000	
アーレステイ	55,800	877	48,936,600	
アサヒHD	98,600	1,767	174,226,200	
東洋製罐グループHD	465,300	1,556	724,006,800	

ホッカホールディングス	157,000	290	45,530,000	
コロナ	34,100	1,181	40,272,100	
横河ブリッジHLDGS	123,900	1,412	174,946,800	
OSJBHD	142,800	142	20,277,600	貸付株式数 53,800株
駒井ハルテック	121,000	290	35,090,000	
高田機工	56,000	200	11,200,000	
三和ホールディングス	534,000	713	380,742,000	
文化シャツタ-	154,000	879	135,366,000	
三協立山	79,700	1,978	157,646,600	
東洋シャツタ-	17,400	857	14,911,800	
LIXILグループ	912,000	2,648	2,414,976,000	
日本ファイルコン	43,800	460	20,148,000	
ノーリツ	128,300	1,990	255,317,000	
長府製作所	69,200	2,631	182,065,200	
リンナイ	101,400	9,540	967,356,000	
ユニプレス	101,400	2,363	239,608,200	
ダイニチ工業	33,300	730	24,309,000	貸付株式数 13,200株
日東精工	93,000	387	35,991,000	
三洋工業	82,000	208	17,056,000	
岡部	128,900	1,208	155,711,200	
中国工業	10,000	773	7,730,000	貸付株式数 3,900株
東プレ	125,900	1,323	166,565,700	
高周波熱錬	95,500	745	71,147,500	
東京製綱	441,000	163	71,883,000	貸付株式数 26,000株 (17,000株)
サンコール	45,000	649	29,205,000	
モリテックスチル	32,900	328	10,791,200	
パイオラックス	30,500	3,915	119,407,500	
日本発条	521,400	1,002	522,442,800	貸付株式数 157,300株 (157,300株)
中央発條	84,000	322	27,048,000	
アドバネクス	129,000	176	22,704,000	貸付株式数 23,000株
三浦工業	97,300	3,705	360,496,500	
タクマ	205,000	654	134,070,000	
リブセンス	32,900	1,099	36,157,100	貸付株式数 19,000株
ジャパンマテリアル	6,800	3,210	21,828,000	
サクセスホールディングス	4,000	1,651	6,604,000	
アサンテ	12,400	1,329	16,479,600	
ERIホールディングス	12,300	1,160	14,268,000	
ツガミ	204,000	542	110,568,000	貸付株式数 77,000株

オークマ	426,000	949	404,274,000	貸付株式数	149,000株
東芝機械	352,000	464	163,328,000	貸付株式数	105,000株 (105,000株)
アマダ	975,900	1,009	984,683,100		
アイダエンジニア	143,000	1,009	144,287,000	貸付株式数	43,100株 (43,100株)
滝澤鉄工所	159,000	230	36,570,000		
富士機械製造	199,200	868	172,905,600		
牧野フライス	326,000	862	281,012,000	貸付株式数	122,000株
オーエスジー	269,900	1,806	487,439,400		
ダイジェット	76,000	159	12,084,000		
旭ダイヤモンド	168,100	1,648	277,028,800	貸付株式数	30,700株
D M G 森精機	360,900	1,408	508,147,200		
ディスコ	71,400	6,730	480,522,000		
日東工器	37,400	2,060	77,044,000		
パンチ工業	10,200	983	10,026,600		
豊田自動織機	569,600	5,250	2,990,400,000		
豊和工業	36,200	773	27,982,600		
大阪機工	250,000	155	38,750,000		
石川製作所	149,000	116	17,284,000	貸付株式数	85,000株
東洋機械金属	48,300	547	26,420,100		
津田駒工業	159,000	153	24,327,000	貸付株式数	23,000株
エンシュウ	160,000	130	20,800,000	貸付株式数	72,000株
島精機製作所	85,300	1,922	163,946,600	貸付株式数	27,300株 (27,300株)
日阪製作所	82,600	918	75,826,800		
やまびこ	25,300	3,955	100,061,500		
ペガサスマシン製造	60,000	448	26,880,000		
ナプテスコ	298,900	2,220	663,558,000		
三井海洋開発	53,700	2,425	130,222,500	貸付株式数	16,200株
レオン自動機	61,000	451	27,511,000	貸付株式数	9,000株
S M C	187,300	27,255	5,104,861,500	貸付株式数	3,300株
新川	54,300	477	25,901,100	貸付株式数	17,100株
ホソカワミクロン	108,000	663	71,604,000		
ユニオンツール	27,300	2,784	76,003,200	貸付株式数	11,200株 (11,200株)
オイレス工業	62,000	2,278	141,236,000		
日精エーエスビー	18,400	1,722	31,684,800	貸付株式数	6,700株
サト - ホールディングス	68,100	2,634	179,375,400	貸付株式数	21,800株
日本エアーテック	19,300	472	9,109,600		

日精樹脂工業	47,600	612	29,131,200	
ワイエイシイ	25,700	641	16,473,700	
小松製作所	3,055,200	2,310	7,057,512,000	貸付株式数 1,796,000株 (1,796,000株)
住友重機械	1,790,000	478	855,620,000	
日立建機	334,200	2,008	671,073,600	貸付株式数 100,800株
日 工	98,000	504	49,392,000	貸付株式数 2,000株
巴工業	22,900	1,634	37,418,600	貸付株式数 2,300株
井関農機	670,000	262	175,540,000	貸付株式数 201,000株 (201,000株)
T O W A	53,500	625	33,437,500	貸付株式数 8,800株
丸山製作所	147,000	249	36,603,000	
北川鉄工所	300,000	176	52,800,000	
シンニッタン	62,000	448	27,776,000	
クボタ	3,400,000	1,393	4,736,200,000	
荏原実業	17,700	1,460	25,842,000	
東洋エンジニア	367,000	452	165,884,000	
三菱化工機	215,000	407	87,505,000	貸付株式数 64,000株
月島機械	106,300	1,123	119,374,900	
帝国電機製作所	22,500	2,803	63,067,500	貸付株式数 2,200株 (2,000株)
東京機械	228,000	86	19,608,000	貸付株式数 73,000株
新東工業	153,800	710	109,198,000	
渋谷工業	41,400	2,984	123,537,600	
アイチ コーポレーション	92,600	474	43,892,400	
小森コーポレーション	159,200	1,388	220,969,600	
鶴見製作所	48,600	1,376	66,873,600	
住友精密	103,000	415	42,745,000	貸付株式数 31,000株
酒井重工業	120,000	331	39,720,000	
荏原製作所	1,446,000	649	938,454,000	
石井鉄工所	96,000	234	22,464,000	貸付株式数 20,000株
西島製作所	69,300	917	63,548,100	貸付株式数 31,200株
北越工業	48,000	573	27,504,000	
千代田化工建	556,000	1,215	675,540,000	貸付株式数 167,000株 (167,000株)
ダイキン工業	853,900	6,685	5,708,321,500	貸付株式数 370,800株 (370,800株)
オルガノ	101,000	530	53,530,000	貸付株式数 24,000株 (17,000株)
ト - ヨ - カネツ	348,000	260	90,480,000	

栗田工業	393,500	2,354	926,299,000	貸付株式数	148,300株
椿本チエイン	335,000	872	292,120,000		
大同工業	124,000	259	32,116,000		
日本コンベヤ	204,000	131	26,724,000		
日機装	202,700	1,179	238,983,300		
木村化工機	60,000	513	30,780,000	貸付株式数	7,900株
新興プランテック	143,900	788	113,393,200		
アネスト岩田	106,100	692	73,421,200		
ダイフク	264,900	1,423	376,952,700		
サムコ	8,200	1,082	8,872,400	貸付株式数	3,000株
加藤製作所	148,000	690	102,120,000		
油研工業	119,000	246	29,274,000		
タダノ	268,000	1,689	452,652,000		
フジテック	182,100	1,056	192,297,600		
C K D	175,200	921	161,359,200		
キトー	36,300	2,537	92,093,100		
平和	135,700	2,216	300,711,200		
理想科学工業	48,300	2,856	137,944,800		
SANKYO	189,600	3,920	743,232,000		
日本金銭機械	57,600	1,780	102,528,000	貸付株式数	33,800株
マースエンジニアリング	35,100	2,001	70,235,100		
福島工業	34,100	1,579	53,843,900		
オーイズミ	21,900	954	20,892,600	貸付株式数	6,600株
ダイコク電機	25,400	1,670	42,418,000		
アマノ	178,700	1,160	207,292,000		
JUKI	402,000	220	88,440,000	貸付株式数	121,000株
サンデン	351,000	565	198,315,000	貸付株式数	105,000株 (105,000株)
蛇の目ミシン	607,000	90	54,630,000		
ブラザー工業	808,600	1,782	1,440,925,200		
マックス	98,000	1,105	108,290,000		
モリタホールディングス	108,000	946	102,168,000		
グローリー	186,600	3,295	614,847,000	貸付株式数	11,900株
新晃工業	43,600	1,086	47,349,600		
大和冷機工業	90,000	705	63,450,000		
セガサミーホールディングス	672,200	1,978	1,329,611,600		
日本ピストンリング	242,000	198	47,916,000		
リケン	246,000	454	111,684,000		
T P R	69,100	2,440	168,604,000		
ホシザキ電機	136,900	5,230	715,987,000		

大豊工業	44,400	1,120	49,728,000	
日本精工	1,392,000	1,337	1,861,104,000	貸付株式数 433,000株 (433,000株)
N T N	1,448,000	464	671,872,000	
ジェイテクト	664,600	1,749	1,162,385,400	
不二越	581,000	738	428,778,000	
ミネベア	853,000	1,179	1,005,687,000	
日本トムソン	200,000	514	102,800,000	
T H K	390,000	2,494	972,660,000	
ユーシン精機	27,000	2,444	65,988,000	貸付株式数 13,500株
前澤給装工業	23,700	1,370	32,469,000	
イーグル工業	75,500	1,818	137,259,000	
前澤工業	45,300	299	13,544,700	
日本ピラ - 工業	66,600	845	56,277,000	
キッツ	280,600	569	159,661,400	
日立	15,054,000	764	11,501,256,000	
東芝	12,346,000	472	5,827,312,000	
三菱電機	6,256,000	1,274	7,970,144,000	
富士電機	1,740,000	506	880,440,000	
東洋電機製造	132,000	426	56,232,000	
安川電機	686,100	1,266	868,602,600	貸付株式数 84,000株
シンフォニア テクノロジー	370,000	164	60,680,000	
明電舎	575,000	422	242,650,000	
オリジン電気	91,000	347	31,577,000	
山洋電気	96,000	769	73,824,000	
デンヨー	61,500	1,596	98,154,000	
日立工機	167,300	864	144,547,200	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
三桜工業	79,100	724	57,268,400	
マキタ	407,900	6,090	2,484,111,000	
東芝テック	392,000	709	277,928,000	
芝浦メカトロニクス	109,000	316	34,444,000	
マブチモーター	88,100	8,000	704,800,000	
日本電産	676,200	6,481	4,382,452,200	貸付株式数 216,100株 (180,500株)
東光高岳	34,500	1,444	49,818,000	貸付株式数 15,600株
宮越ホールディングス	21,100	250	5,275,000	貸付株式数 3,300株
ダイヘン	361,000	464	167,504,000	
ヤーマン	7,900	1,353	10,688,700	貸付株式数 2,400株
JVCケンウッド	432,000	232	100,224,000	

第一精工	22,700	1,800	40,860,000	貸付株式数	7,500株
日新電機	121,000	650	78,650,000		
大崎電気	97,000	573	55,581,000	貸付株式数	41,000株
オムロン	705,800	4,245	2,996,121,000		
日東工業	91,900	2,185	200,801,500		
I D E C	81,700	921	75,245,700		
ジーエス・ユアサ コーポ	1,205,000	686	826,630,000		
サクサホールディングス	158,000	163	25,754,000		
メルコホールディングス	30,200	2,149	64,899,800	貸付株式数	9,400株
テクノメディカ	14,000	2,389	33,446,000		
日本電気	8,600,000	355	3,053,000,000		
富士通	6,031,000	766	4,619,746,000		
沖電気	2,414,000	216	521,424,000		
岩崎通信機	281,000	93	26,133,000		
電気興業	178,000	653	116,234,000		
サンケン電気	340,000	830	282,200,000	貸付株式数	102,000株 (102,000株)
ナカヨ通信機	61,000	411	25,071,000		
アイホン	35,800	2,013	72,065,400		
ルネサスエレクトロニクス	323,800	772	249,973,600	貸付株式数	190,400株 (62,500株)
セイコーエプソン	426,900	4,310	1,839,939,000		
ワコム	492,500	553	272,352,500	貸付株式数	157,400株
アルバック	106,700	2,058	219,588,600		
アクセル	31,300	1,485	46,480,500	貸付株式数	6,000株 (2,200株)
ピクセラ	24,900	142	3,535,800	貸付株式数	9,300株
E I Z O	57,400	2,726	156,472,400		
ジャパンディスプレイ	1,051,200	614	645,436,800		
日本信号	163,200	964	157,324,800		
京三製作所	146,000	386	56,356,000		
能美防災	83,000	1,607	133,381,000		
ホーチキ	45,000	817	36,765,000		
エレコム	22,800	2,599	59,257,200		
日本無線	161,000	444	71,484,000		
パナソニック	7,146,600	1,222	8,733,145,200		
シャープ	4,511,000	325	1,466,075,000	貸付株式数	1,798,000株
アンリツ	363,500	1,128	410,028,000		
富士通ゼネラル	149,000	1,195	178,055,000		
日立国際電気	119,000	1,432	170,408,000		

ソ ニ ー	3,448,300	1,688	5,820,730,400	貸付株式数 1,411,500株
T D K	377,500	4,800	1,812,000,000	
帝国通信工業	148,000	183	27,084,000	
ミツミ電機	237,900	750	178,425,000	
タムラ製作所	240,000	390	93,600,000	
アルプス電気	458,400	1,420	650,928,000	
池上通信機	198,000	117	23,166,000	貸付株式数 79,000株
パイオニア	867,500	259	224,682,500	貸付株式数 112,100株
日本電波工業	56,400	1,018	57,415,200	
日本トリム	13,500	3,720	50,220,000	貸付株式数 7,800株
ローランド ディー . ジー .	26,800	3,795	101,706,000	
日本コロムビア	30,600	609	18,635,400	
フオスタ - 電機	63,000	1,267	79,821,000	
クラリオン	374,000	312	116,688,000	
S M K	184,000	413	75,992,000	貸付株式数 55,000株
ヨコオ	52,600	529	27,825,400	
東 光	147,000	297	43,659,000	貸付株式数 80,000株
ティアック	337,000	66	22,242,000	貸付株式数 126,000株 (6,000株)
ホシデン	183,600	639	117,320,400	
ヒロセ電機	108,800	14,710	1,600,448,000	
日本航空電子	161,000	2,413	388,493,000	
T O A	67,100	1,252	84,009,200	
日立マクセル	108,500	1,772	192,262,000	貸付株式数 13,000株 (13,000株)
古野電気	59,500	676	40,222,000	貸付株式数 21,200株
ユニデン	196,000	261	51,156,000	
アルパイン	135,500	1,569	212,599,500	貸付株式数 20,000株 (20,000株)
スミダコーポレーション	51,800	685	35,483,000	
アイコム	34,400	2,520	86,688,000	
リオン	17,700	1,495	26,461,500	
船井電機	63,200	1,108	70,025,600	貸付株式数 23,800株 (5,800株)
横河電機	678,300	1,274	864,154,200	
新電元工業	201,000	579	116,379,000	
アズビル	189,700	2,534	480,699,800	貸付株式数 52,900株 (52,900株)
東亜ディーケーケー	23,200	523	12,133,600	
日本光電工業	133,300	5,130	683,829,000	

チノー	110,000	298	32,780,000	
共和電業	76,000	542	41,192,000	
日本電子材料	26,800	502	13,453,600	貸付株式数 10,700株
堀場製作所	115,700	3,630	419,991,000	
アドバンテスト	426,400	1,205	513,812,000	貸付株式数 191,600株
小野測器	31,500	1,024	32,256,000	
エスペック	64,700	898	58,100,600	
パナソニックデバイス	54,600	497	27,136,200	
キーエンス	141,700	43,385	6,147,654,500	貸付株式数 8,700株
日置電機	32,700	1,728	56,505,600	
シスメックス	524,300	3,650	1,913,695,000	
メガチップス	56,000	1,481	82,936,000	貸付株式数 18,800株 (18,800株)
OBARA GROUP	40,500	4,405	178,402,500	
イマジカ・ロボットHD	32,400	502	16,264,800	
日本電産コパル電子	64,500	890	57,405,000	
澤藤電機	31,000	221	6,851,000	
デンソー	1,545,400	4,682	7,235,562,800	
コーセル	90,900	1,305	118,624,500	
新日本無線	46,000	438	20,148,000	貸付株式数 6,000株
オプテックス	40,700	2,194	89,295,800	
千代田インテグレ	26,800	1,608	43,094,400	
レーザーテック	47,300	1,004	47,489,200	貸付株式数 12,300株
スタンレー電気	450,400	2,616	1,178,246,400	
岩崎電気	228,000	244	55,632,000	貸付株式数 6,000株
ウシオ電機	379,700	1,244	472,346,800	
岡谷電機	33,400	380	12,692,000	
ヘリオステクノH	53,200	325	17,290,000	
日本セラミック	35,500	1,638	58,149,000	貸付株式数 11,000株
遠藤照明	25,000	1,500	37,500,000	貸付株式数 8,100株
日本デジタル研究所	45,800	1,812	82,989,600	
古河電池	45,000	697	31,365,000	貸付株式数 11,000株
双信電機	30,300	382	11,574,600	
山一電機	67,900	633	42,980,700	貸付株式数 39,900株
図研	40,700	1,025	41,717,500	
日本電子	223,000	446	99,458,000	
カシオ	650,300	1,577	1,025,523,100	貸付株式数 207,900株
ファナック	697,800	17,640	12,309,192,000	
日本シイエムケイ	147,000	282	41,454,000	
エンプラス	21,200	7,610	161,332,000	

大真空	89,000	383	34,087,000	貸付株式数	21,000株
ローム	330,400	5,720	1,889,888,000		
浜松ホトニクス	246,200	4,900	1,206,380,000	貸付株式数	28,000株 (20,000株)
三井ハイテック	82,500	710	58,575,000		
新光電気工業	210,000	880	184,800,000		
京セラ	1,100,100	4,823	5,305,782,300		
協栄産業	74,000	187	13,838,000		
太陽誘電	304,200	1,104	335,836,800	貸付株式数	91,800株
村田製作所	656,300	9,511	6,242,069,300		
ユーシン	87,000	593	51,591,000	貸付株式数	39,700株 (2,400株)
双葉電子工業	115,900	1,683	195,059,700		
日東電工	540,000	4,712	2,544,480,000		
北陸電気工業	249,000	165	41,085,000		
東海理化電機	164,700	2,025	333,517,500		
ニチコン	196,900	780	153,582,000		
日本ケミコン	436,000	273	119,028,000	貸付株式数	74,000株
K O A	78,500	981	77,008,500		
三井造船	2,421,000	209	505,989,000	貸付株式数	200,000株 (200,000株)
日立造船	491,700	538	264,534,600		
佐世保重工業	439,000	116	50,924,000	貸付株式数	175,000株
三菱重工業	11,139,000	649	7,229,211,000		
川崎重工業	4,871,000	397	1,933,787,000		
I H I	4,350,000	471	2,048,850,000		
名村造船所	91,200	925	84,360,000	貸付株式数	34,900株
サノヤホールディングス	57,100	214	12,219,400	貸付株式数	19,900株
日本車輛	228,000	398	90,744,000	貸付株式数	105,000株
ニチユ三菱フォークリフト	72,000	653	47,016,000	貸付株式数	21,000株
近畿車輛	107,000	307	32,849,000		
F P G	41,300	913	37,706,900	貸付株式数	9,200株
島根銀行	13,000	1,317	17,121,000		
じもとホールディングス	442,900	217	96,109,300		
全国保証	147,100	2,796	411,291,600		
足利ホールディングス	235,700	425	100,172,500		
日産自動車	8,780,300	973	8,543,231,900		
いすゞ自動車	3,625,000	678	2,457,750,000		
トヨタ自動車	8,705,900	6,003	52,261,517,700	貸付株式数	250,000株 (250,000株)

日野自動車	781,200	1,418	1,107,741,600	
三菱自動車工業	2,238,300	1,104	2,471,083,200	
エフテック	22,300	1,331	29,681,300	
レシップホールディングス	20,100	900	18,090,000	
GMB	7,100	1,428	10,138,800	貸付株式数 1,900株
武蔵精密工業	66,700	2,574	171,685,800	
日産車体	305,400	1,677	512,155,800	
新明和工業	249,000	878	218,622,000	
極東開発工業	107,900	1,488	160,555,200	
日信工業	127,100	2,015	256,106,500	
トピー工業	514,000	210	107,940,000	
ティラド	242,000	283	68,486,000	
曙ブレーキ	290,500	490	142,345,000	貸付株式数 130,400株
タチエス	92,000	1,658	152,536,000	
N O K	302,600	2,026	613,067,600	
フタバ産業	190,500	486	92,583,000	貸付株式数 8,000株
カヤバ工業	551,000	468	257,868,000	貸付株式数 22,000株
シロキ工業	138,000	218	30,084,000	
市光工業	149,000	165	24,585,000	
大同メタル工業	87,000	1,393	121,191,000	
プレス工業	242,000	390	94,380,000	
カルソニックカンセイ	425,000	653	277,525,000	
太平洋工業	127,400	820	104,468,000	
ケーヒン	143,700	1,601	230,063,700	
河西工業	84,400	781	65,916,400	
アイシン精機	572,300	3,920	2,243,416,000	
富士機工	72,000	458	32,976,000	
マ ッ ダ	9,321,000	496	4,623,216,000	
ダイハツ	663,700	1,742	1,156,165,400	
今仙電機製作所	45,400	1,463	66,420,200	貸付株式数 13,700株
本田技研	5,629,200	3,573	20,113,131,600	
スズキ	1,307,600	3,274	4,281,082,400	
富士重工業	2,128,700	2,881	6,132,784,700	
ヤマハ発動機	951,200	1,803	1,715,013,600	
ショーワ	147,600	1,206	178,005,600	
小糸製作所	343,500	2,655	911,992,500	
T B K	69,000	542	37,398,000	
エクセディ	75,500	3,020	228,010,000	
ミツバ	114,000	1,727	196,878,000	
豊田合成	202,000	2,079	419,958,000	

愛三工業	76,300	856	65,312,800	
ヨロズ	45,400	2,254	102,331,600	
エフ・シー・シー	102,200	1,915	195,713,000	貸付株式数 25,000株 (25,000株)
新家工業	141,000	156	21,996,000	
シマノ	270,100	11,100	2,998,110,000	
タカタ	112,600	2,096	236,009,600	
テイ・エス テック	131,800	3,020	398,036,000	
小野建	53,600	1,131	60,621,600	
はるやま商事	25,500	715	18,232,500	
佐島電機	47,800	706	33,746,800	
カップ・クリエイトHD	90,600	1,066	96,579,600	貸付株式数 34,100株 (16,900株)
エコトレーディング	15,200	703	10,685,600	
伯東	36,800	1,046	38,492,800	
コンドーテック	50,300	688	34,606,400	
中山福	35,300	806	28,451,800	
ライトオン	45,500	767	34,898,500	貸付株式数 13,600株
ナガイレーベン	83,300	2,041	170,015,300	貸付株式数 6,800株
ジーンズメイト	19,700	218	4,294,600	貸付株式数 7,900株
三菱食品	67,700	2,511	169,994,700	
良品計画	65,400	12,300	804,420,000	貸付株式数 20,900株 (1,500株)
三城ホールディングス	76,200	494	37,642,800	
松田産業	44,600	1,279	57,043,400	
メディパルHD	617,400	1,355	836,577,000	
アドヴァン	31,400	1,106	34,728,400	
S P K	14,200	1,882	26,724,400	
アズワン	40,200	3,105	124,821,000	
スズデン	22,100	638	14,099,800	
尾家産業	19,800	849	16,810,200	
シモジマ	42,400	1,096	46,470,400	
ドウシシャ	65,300	1,794	117,148,200	
コナカ	72,600	755	54,813,000	
高速	36,300	909	32,996,700	
ハウス ローゼ	6,900	1,383	9,542,700	
G - 7ホールディングス	18,100	966	17,484,600	
イオン北海道	37,200	618	22,989,600	
コジマ	90,800	311	28,238,800	
ヒマラヤ	14,400	1,070	15,408,000	貸付株式数 1,300株

コーナン商事	80,300	1,021	81,986,300	貸付株式数	17,800株
黒田電気	88,100	1,614	142,193,400		
ネットワンシステムズ	233,800	680	158,984,000	貸付株式数	108,500株
エコス	20,900	748	15,633,200		
ワタミ	72,900	1,422	103,663,800	貸付株式数	42,900株
マルシェ	14,900	848	12,635,200	貸付株式数	5,900株
ドンキホーテホールディング	191,900	5,310	1,018,989,000		
丸文	54,300	623	33,828,900		
西松屋チェーン	121,600	832	101,171,200		
ゼンショーホールディングス	251,400	1,030	258,942,000	貸付株式数	149,100株
ハピネット	36,700	1,756	64,445,200	貸付株式数	11,700株 (6,500株)
幸楽苑	37,000	1,381	51,097,000	貸付株式数	8,300株
トーメンエレクトロニクス	31,400	1,648	51,747,200		
ハークスレイ	17,100	855	14,620,500		
サイゼリヤ	91,400	1,258	114,981,200	貸付株式数	27,500株 (23,300株)
エクセル	27,500	1,843	50,682,500		
マルカキカイ	19,900	1,356	26,984,400		
アルゴグラフィックス	23,000	1,732	39,836,000		
ガリバーインターナショナル	207,600	779	161,720,400		
日本エム・ディ・エム	51,400	344	17,681,600	貸付株式数	15,500株
ポプラ	15,400	565	8,701,000	貸付株式数	6,200株
ユナイテッドアローズ	79,900	3,780	302,022,000		
進和	36,100	1,319	47,615,900		
エスケイジャパン	14,600	260	3,796,000	貸付株式数	3,100株
ダイトエレクトロン	27,900	408	11,383,200	貸付株式数	11,200株
ハイデイ日高	39,000	2,456	95,784,000		
シークス	39,200	1,774	69,540,800		
京都きもの友禅	38,500	1,018	39,193,000		
コロワイド	204,700	1,262	258,331,400	貸付株式数	71,200株
田中商事	18,900	651	12,303,900		
オーハシテクニカ	31,500	1,000	31,500,000		
壱番屋	24,500	4,370	107,065,000		
マクニカ	31,700	3,420	108,414,000		
白銅	20,000	957	19,140,000		
トップカルチャー	22,900	472	10,808,800		
P L A N T	11,100	1,050	11,655,000	貸付株式数	2,300株
スギホールディングス	110,700	4,560	504,792,000	貸付株式数	23,300株
島津製作所	797,000	963	767,511,000		

J M S	113,000	299	33,787,000	
クボテック	16,100	271	4,363,100	
ショットモリテックス	13,500	280	3,780,000	貸付株式数 3,100株 (2,000株)
長野計器	40,000	706	28,240,000	
ブイ・テクノロジー	12,900	3,665	47,278,500	貸付株式数 4,100株
スター精密	118,800	1,445	171,666,000	
東京計器	216,000	260	56,160,000	貸付株式数 76,000株
愛知時計	82,000	303	24,846,000	
オーバル	45,800	326	14,930,800	
東京精密	112,000	1,774	198,688,000	
マニー	17,300	5,820	100,686,000	
ニコン	1,167,900	1,564	1,826,595,600	貸付株式数 440,400株
トプコン	167,900	2,315	388,688,500	
オリンパス	931,800	3,620	3,373,116,000	
理研計器	54,900	1,090	59,841,000	
大日本スクリーン	592,000	486	287,712,000	
キヤノン電子	57,400	1,877	107,739,800	貸付株式数 17,300株 (17,300株)
タムロン	48,100	2,350	113,035,000	貸付株式数 15,400株 (14,300株)
HOYA	1,520,800	3,359	5,108,367,200	
ノーリツ鋼機	56,200	660	37,092,000	
エー・アンド・デイ	56,700	554	31,411,800	貸付株式数 4,200株
キヤノン	3,626,700	3,261	11,826,668,700	貸付株式数 300,000株
リコー	1,880,800	1,165	2,191,132,000	
シチズンホールディングス	769,900	795	612,070,500	
リズム時計	274,000	153	41,922,000	
大研医器	21,600	1,829	39,506,400	貸付株式数 6,800株
パラマウントベッドHD	59,900	3,130	187,487,000	貸付株式数 19,100株 (1,100株)
SHOBI	18,700	425	7,947,500	貸付株式数 3,100株
前田工織	44,400	1,244	55,233,600	貸付株式数 17,900株
永大産業	82,000	480	39,360,000	
アートネイチャー	20,000	3,050	61,000,000	貸付株式数 6,000株
ダンロップスポーツ	33,900	1,218	41,290,200	
バンダイナムコHLDGS	689,900	2,345	1,617,815,500	
共立印刷	112,800	299	33,727,200	
フランスベッドHLDGS	392,000	186	72,912,000	
マーベラス	93,700	1,199	112,346,300	

パイロットコーポレーション	54,400	4,430	240,992,000	
萩原工業	10,600	1,566	16,599,600	
エイベックス・グループHD	113,000	1,748	197,524,000	
トッパン・フォームズ	111,600	1,040	116,064,000	
フジシールインターナショナル	76,000	2,990	227,240,000	
タカラトミー	205,700	561	115,397,700	貸付株式数 14,700株 (11,800株)
廣済堂	58,100	431	25,041,100	
アーク	185,200	162	30,002,400	貸付株式数 73,800株
レック	20,400	1,092	22,276,800	
タカノ	27,200	602	16,374,400	
プロネクサス	63,500	811	51,498,500	
ホクシン	44,000	137	6,028,000	貸付株式数 3,400株
ウッドワン	105,000	298	31,290,000	
大建工業	250,000	280	70,000,000	
きもと	95,700	376	35,983,200	
凸版印刷	1,766,000	783	1,382,778,000	
大日本印刷	1,905,000	1,076	2,049,780,000	
図書印刷	101,000	509	51,409,000	貸付株式数 31,000株
共同印刷	193,000	347	66,971,000	
日本写真印刷	104,900	1,636	171,616,400	貸付株式数 61,600株 (10,800株)
光村印刷	59,000	262	15,458,000	
藤森工業	56,100	3,405	191,020,500	
宝印刷	35,200	801	28,195,200	
前澤化成工業	45,400	1,075	48,805,000	
アシックス	621,400	2,234	1,388,207,600	貸付株式数 247,000株
ツツミ	31,200	2,607	81,338,400	
ジェイエスピー	42,700	1,790	76,433,000	
ニチハ	79,100	1,113	88,038,300	
ローランド	60,200	1,835	110,467,000	
エフピコ	64,500	3,415	220,267,500	貸付株式数 20,600株
小松ウオール工業	21,200	2,778	58,893,600	
ヤマハ	459,700	1,598	734,600,600	
河合楽器	216,000	205	44,280,000	
クリナップ	63,800	924	58,951,200	
ピジョン	102,400	5,500	563,200,000	
天馬	52,100	1,558	81,171,800	
兼松日産農林	97,000	151	14,647,000	

キングジム	52,000	759	39,468,000	貸付株式数	16,500株
リンテック	148,700	2,058	306,024,600		
T A S A K I	11,700	1,094	12,799,800	貸付株式数	4,500株
信越ポリマー	128,400	485	62,274,000		
東 リ	169,000	229	38,701,000		
イトーキ	131,700	801	105,491,700		
任 天 堂	385,200	12,450	4,795,740,000		
三菱鉛筆	51,500	2,787	143,530,500		
松 風	30,500	931	28,395,500		
タカラスタンダ - ド	253,000	923	233,519,000		
コ ク ヨ	325,100	891	289,664,100		
ナカバヤシ	132,000	206	27,192,000		
ニ フ コ	146,200	3,365	491,963,000		
グローブライド	326,000	127	41,402,000		
岡村製作所	240,000	883	211,920,000		
日本バルカー	265,000	285	75,525,000		
M U T O Hホールディングス	85,000	519	44,115,000	貸付株式数	18,000株
伊 藤 忠	4,925,200	1,301	6,407,685,200	貸付株式数	600,000株 (600,000株)
丸 紅	5,401,000	736	3,975,136,000		
スクロール	79,800	275	21,945,000		
高 島	113,000	240	27,120,000	貸付株式数	51,000株
ヨンドシーホールディングス	46,300	2,175	100,702,500		
三陽商会	342,000	228	77,976,000		
長瀬産業	349,500	1,269	443,515,500		
ナイガイ	239,000	70	16,730,000	貸付株式数	74,000株
蝶 理	39,300	1,294	50,854,200		
豊田通商	687,700	2,883	1,982,639,100		
オンワ - ドホールディングス	437,000	725	316,825,000	貸付株式数	164,000株
三共生興	104,900	417	43,743,300		
兼 松	1,312,000	177	232,224,000		
美 津 濃	310,000	602	186,620,000		
ツカモトコーポレーション	109,000	139	15,151,000		
ファミリーマート	208,600	4,470	932,442,000	貸付株式数	32,200株
ルック	111,000	276	30,636,000	貸付株式数	47,000株
三井物産	5,582,800	1,631	9,105,546,800		
日本紙パルプ	321,000	336	107,856,000		
東京エレクトロン	561,300	7,189	4,035,185,700		
日立ハイテクノロジーズ	187,300	2,441	457,199,300		
カメイ	79,600	778	61,928,800		

東都水産	108,000	194	20,952,000	
OUGホールディングス	89,000	227	20,203,000	
スターゼン	222,000	288	63,936,000	
セイコーHD	402,000	404	162,408,000	
山 善	236,900	758	179,570,200	貸付株式数 30,000株 (30,000株)
椿本興業	69,000	305	21,045,000	
住友商事	3,643,400	1,353	4,929,520,200	
日本ユニシス	148,600	844	125,418,400	
内田洋行	152,000	373	56,696,000	
三菱商事	4,817,200	2,116	10,193,195,200	
第一実業	140,000	532	74,480,000	
キャノンマーケティングJPN	176,100	1,942	341,986,200	
西華産業	202,000	271	54,742,000	
佐藤商事	55,000	704	38,720,000	
菱洋エレクトロ	71,200	1,170	83,304,000	
東京産業	61,300	407	24,949,100	
ユアサ商事	630,000	215	135,450,000	
神鋼商事	155,000	239	37,045,000	
小林産業	41,600	297	12,355,200	
阪和興業	617,000	424	261,608,000	
カナデン	61,000	743	45,323,000	
菱電商事	89,000	757	67,373,000	
ニプロ	333,000	885	294,705,000	貸付株式数 195,800株 (51,600株)
フルサト工業	33,900	1,345	45,595,500	
岩谷産業	681,000	735	500,535,000	
すてきナイスグループ	257,000	215	55,255,000	
昭光通商	199,000	148	29,452,000	
ニチモウ	96,000	179	17,184,000	
極東貿易	70,000	214	14,980,000	
イワキ	93,000	217	20,181,000	
兼松エレクトロニクス	38,900	1,433	55,743,700	
三愛石油	144,000	778	112,032,000	
稲畑産業	151,900	934	141,874,600	
G S Iクレオス	163,000	144	23,472,000	貸付株式数 64,000株
明和産業	56,800	439	24,935,200	貸付株式数 5,600株
キムラタン	2,170,000	10	21,700,000	
ゴ-ルドウイン	150,000	451	67,650,000	

ユニ・チャーム	401,900	6,102	2,452,393,800	
デサント	149,000	884	131,716,000	
キング	32,500	434	14,105,000	
ワキタ	89,600	1,245	111,552,000	
ヤマトインタ-ナショナル	40,600	458	18,594,800	貸付株式数 100株
東邦ホールディングス	197,600	1,967	388,679,200	
サンゲツ	109,300	2,707	295,875,100	
ミツウロコグループ	99,300	611	60,672,300	
シナネン	132,000	430	56,760,000	
伊藤忠エネクス	136,200	741	100,924,200	
サンリオ	155,500	2,802	435,711,000	貸付株式数 70,600株
サンワテクノス	33,200	1,027	34,096,400	
リョーサン	91,800	2,117	194,340,600	
新光商事	67,600	917	61,989,200	
トーホー	124,000	391	48,484,000	貸付株式数 37,000株 (37,000株)
三信電気	73,900	823	60,819,700	
東陽テクニカ	85,100	1,184	100,758,400	
モスフードサービス	80,200	2,211	177,322,200	貸付株式数 5,000株 (2,000株)
加賀電子	55,700	1,241	69,123,700	
三益半導体	55,200	952	52,550,400	
ソーダニツカ	64,000	451	28,864,000	
立花エレテック	36,800	1,409	51,851,200	
木曽路	75,500	1,992	150,396,000	貸付株式数 6,000株
サトレストランシステムズ	57,500	852	48,990,000	
千趣会	111,000	863	95,793,000	
タカキユー	47,500	223	10,592,500	
ケーヨー	104,000	495	51,480,000	貸付株式数 47,000株 (16,200株)
アデランス	78,100	1,562	121,992,200	
上新電機	134,000	970	129,980,000	
日本瓦斯	92,000	2,323	213,716,000	貸付株式数 1,500株
ベスト電器	198,700	144	28,612,800	貸付株式数 10,000株
マルエツ	121,000	378	45,738,000	貸付株式数 9,000株
ロイヤルホールディングス	103,000	1,715	176,645,000	
東天紅	45,000	182	8,190,000	
いなげや	68,500	1,042	71,377,000	
島忠	139,800	2,376	332,164,800	

チヨダ	72,700	2,297	166,991,900	貸付株式数 14,000株 (10,000株)
ライフコーポレーション	46,100	1,730	79,753,000	貸付株式数 13,800株
カ ス ミ	126,300	764	96,493,200	
リンガーハット	60,000	1,676	100,560,000	貸付株式数 18,100株
さが美	48,000	100	4,800,000	
MR MAX	61,500	333	20,479,500	
テンアライド	46,500	328	15,252,000	貸付株式数 8,300株 (5,000株)
AOKIホールディングス	106,300	1,388	147,544,400	
オークワ	97,000	981	95,157,000	
コメリ	95,100	2,560	243,456,000	
青山商事	155,000	2,671	414,005,000	
しまむら	70,700	10,360	732,452,000	
CFSコーポレーション	40,400	525	21,210,000	
はせがわ	18,900	626	11,831,400	
高島屋	835,000	947	790,745,000	
松屋	124,200	1,087	135,005,400	貸付株式数 14,900株 (4,000株)
エイチ・ツー・オーリテイリング	503,000	784	394,352,000	
近鉄百貨店	236,000	384	90,624,000	貸付株式数 105,000株
丸栄	101,000	165	16,665,000	貸付株式数 36,000株
ニッセンHD	122,700	375	46,012,500	貸付株式数 55,200株
パルコ	59,100	891	52,658,100	
丸井グループ	804,600	940	756,324,000	
クレディセゾン	504,200	2,100	1,058,820,000	
アクシアルリテイリング	34,100	1,721	58,686,100	
井筒屋	334,000	73	24,382,000	貸付株式数 81,000株
ダイエー	381,000	298	113,538,000	
イオン	2,462,200	1,155	2,843,841,000	
ユニーグループ・HD	591,100	626	370,028,600	
イズミ	137,900	3,185	439,211,500	
東武ストア	79,000	282	22,278,000	貸付株式数 6,000株
平和堂	125,100	1,617	202,286,700	
フジ	68,300	2,113	144,317,900	貸付株式数 15,000株
ヤオコー	31,100	5,830	181,313,000	
ゼビオ	74,400	1,951	145,154,400	
ケーズホールディングス	130,400	2,852	371,900,800	貸付株式数 41,500株
Palta	86,400	1,396	120,614,400	

OLYMPICグループ	36,100	1,076	38,843,600	貸付株式数	4,800株
日産東京販売HD	90,600	307	27,814,200		
新生銀行	5,342,000	217	1,159,214,000	貸付株式数	1,702,000株
あおぞら銀行	3,205,000	336	1,076,880,000		
三菱UFJフィナンシャルG	46,769,400	605	28,295,487,000		
りそなホールディングス	5,868,200	589	3,456,369,800		
三井住友トラストHD	12,130,000	453	5,494,890,000		
三井住友フィナンシャルG	4,668,900	4,152	19,385,272,800		
第四銀行	781,000	371	289,751,000		
北越銀行	667,000	210	140,070,000		
西日本シティ銀行	2,166,000	251	543,666,000		
千葉銀行	2,381,000	731	1,740,511,000		
横浜銀行	4,015,000	594	2,384,910,000		
常陽銀行	2,241,000	542	1,214,622,000		
群馬銀行	1,372,000	599	821,828,000		
武蔵野銀行	98,500	3,495	344,257,500		
千葉興業銀行	128,100	754	96,587,400		
筑波銀行	256,500	355	91,057,500		
東京都民銀行	108,900	1,224	133,293,600		
七十七銀行	968,000	532	514,976,000		
青森銀行	450,000	291	130,950,000	貸付株式数	64,000株 (64,000株)
秋田銀行	424,000	281	119,144,000		
山形銀行	368,000	477	175,536,000	貸付株式数	114,000株 (50,000株)
岩手銀行	40,400	4,840	195,536,000	貸付株式数	10,500株
東邦銀行	549,000	372	204,228,000		
東北銀行	314,000	149	46,786,000		
みちのく銀行	330,000	219	72,270,000		
ふくおかフィナンシャルG	2,505,000	496	1,242,480,000		
静岡銀行	1,809,000	1,132	2,047,788,000		
十六銀行	773,000	378	292,194,000		
スルガ銀行	602,000	1,948	1,172,696,000		
八十二銀行	1,131,000	626	708,006,000		
山梨中央銀行	393,000	463	181,959,000		
大垣共立銀行	772,000	281	216,932,000	貸付株式数	50,000株 (50,000株)
福井銀行	528,000	248	130,944,000		
北國銀行	687,000	341	234,267,000		

清水銀行	20,900	2,770	57,893,000	
滋賀銀行	580,000	611	354,380,000	
南都銀行	596,000	413	246,148,000	
百五銀行	552,000	408	225,216,000	
京都銀行	1,178,000	921	1,084,938,000	
紀陽銀行	242,300	1,389	336,554,700	
三重銀行	251,000	230	57,730,000	
ほくほくフィナンシャルG	4,200,000	210	882,000,000	
広島銀行	1,822,000	496	903,712,000	
山陰合同銀行	372,000	734	273,048,000	貸付株式数 3,000株
中国銀行	444,200	1,541	684,512,200	
鳥取銀行	196,000	214	41,944,000	
伊予銀行	660,300	1,023	675,486,900	
百十四銀行	677,000	359	243,043,000	
四国銀行	443,000	229	101,447,000	
阿波銀行	505,000	567	286,335,000	
鹿児島銀行	429,000	678	290,862,000	
大分銀行	379,000	363	137,577,000	
宮崎銀行	411,000	331	136,041,000	
肥後銀行	504,000	549	276,696,000	
佐賀銀行	367,000	230	84,410,000	
十八銀行	375,000	267	100,125,000	貸付株式数 112,000株 (112,000株)
沖縄銀行	45,400	4,320	196,128,000	
琉球銀行	119,700	1,443	172,727,100	
八千代銀行	28,300	3,275	92,682,500	
セブン銀行	2,313,100	414	957,623,400	
みずほフィナンシャルG	80,153,000	201	16,110,753,000	
高知銀行	239,000	148	35,372,000	貸付株式数 45,000株 (45,000株)
山口フィナンシャルG	616,000	1,057	651,112,000	
アクリーティブ	42,200	205	8,651,000	
芙蓉総合リース	64,700	4,470	289,209,000	
興銀リース	107,700	2,673	287,882,100	
東京センチュリーリース	145,000	3,375	489,375,000	
SBIホールディングス	741,500	1,238	917,977,000	貸付株式数 237,000株
日本証券金融	270,900	599	162,269,100	
アイフル	1,123,100	593	665,998,300	貸付株式数 338,900株
日本アジア投資	419,000	90	37,710,000	貸付株式数 167,000株
ポケットカード	61,600	787	48,479,200	

長野銀行	202,000	186	37,572,000	
名古屋銀行	558,000	397	221,526,000	
北洋銀行	930,100	422	392,502,200	
愛知銀行	22,300	5,290	117,967,000	
第三銀行	348,000	180	62,640,000	
中京銀行	251,000	180	45,180,000	
東日本銀行	262,000	258	67,596,000	
大光銀行	219,000	226	49,494,000	
愛媛銀行	358,000	239	85,562,000	
トマト銀行	238,000	175	41,650,000	
みなと銀行	559,000	187	104,533,000	
京葉銀行	508,000	509	258,572,000	
関西アーバン銀行	860,000	123	105,780,000	
栃木銀行	310,000	426	132,060,000	
北日本銀行	19,200	2,574	49,420,800	
東和銀行	738,000	100	73,800,000	
福島銀行	759,000	87	66,033,000	
大東銀行	395,000	125	49,375,000	
リコーリース	42,500	2,801	119,042,500	貸付株式数 16,000株 (16,000株)
イオンフィナンシャルサー ビス	361,000	2,422	874,342,000	貸付株式数 114,700株
アコム	1,240,100	420	520,842,000	貸付株式数 374,200株
ジャックス	367,000	519	190,473,000	
オリコ	1,379,400	260	358,644,000	貸付株式数 416,300株
日立キャピタル	121,200	2,727	330,512,400	
アプラスフィナンシャル	219,100	159	34,836,900	貸付株式数 131,100株
オリックス	3,816,500	1,650	6,297,225,000	
三菱UFJリース	1,565,900	593	928,578,700	
ジャフコ	84,400	4,475	377,690,000	
トモニホールディングス	473,700	429	203,217,300	
大和証券G本社	6,116,000	854	5,223,064,000	
野村ホールディングス	12,621,300	676	8,531,998,800	
岡三証券グループ	485,000	752	364,720,000	
丸三証券	183,300	785	143,890,500	貸付株式数 84,100株 (84,100株)
東洋証券	246,000	297	73,062,000	
東海東京HD	653,900	725	474,077,500	
光世証券	147,000	222	32,634,000	貸付株式数 66,000株
水戸証券	180,100	368	66,276,800	

いちよし証券	120,800	1,353	163,442,400	
松井証券	313,800	985	309,093,000	貸付株式数 28,000株
N K S Jホールディングス	1,371,400	2,661	3,649,295,400	
だいこう証券ビジ	28,900	639	18,467,100	
日本取引所グループ	906,500	2,442	2,213,673,000	
マネックスG	670,500	343	229,981,500	貸付株式数 252,700株
カブドットコム証券	239,400	486	116,348,400	貸付株式数 48,100株
極東証券	76,400	1,681	128,428,400	貸付株式数 44,900株
岩井コスモホールディング	58,300	1,131	65,937,300	
フィデアホール	355,300	212	75,323,600	貸付株式数 133,900株
池田泉州HD	463,100	512	237,107,200	
M S & A D	1,845,000	2,356	4,346,820,000	
マネースクウェア・ジャパン	15,900	1,051	16,710,900	
S O N Y F H	591,400	1,691	1,000,057,400	
マネーパートナーズGP	46,000	248	11,408,000	
小林洋行	17,600	253	4,452,800	貸付株式数 3,300株
第一生命	3,125,200	1,428	4,462,785,600	貸付株式数 937,700株
東京海上HD	2,391,400	3,243	7,755,310,200	
イー・ギャランティ	17,900	2,016	36,086,400	貸付株式数 7,200株
アサックス	10,600	1,309	13,875,400	
N E C キャピタルソリューション	20,900	1,975	41,277,500	
T & Dホールディングス	2,117,800	1,332	2,820,909,600	
三井不動産	3,240,000	3,382	10,957,680,000	
三菱地所	4,321,000	2,494	10,776,574,000	
平和不動産	124,500	1,555	193,597,500	
東京建物	1,275,000	932	1,188,300,000	
ダイビル	181,600	1,077	195,583,200	
京阪神ビルディング	102,300	543	55,548,900	
住友不動産	1,479,000	4,314	6,380,406,000	
太平洋興発	228,000	100	22,800,000	貸付株式数 121,000株
大京	1,038,000	230	238,740,000	貸付株式数 93,000株
テーオーシー	212,700	746	158,674,200	
東京楽天地	101,000	510	51,510,000	
レオパレス21	709,600	498	353,380,800	
フジ住宅	78,700	624	49,108,800	
空港施設	74,600	696	51,921,600	
明和地所	30,300	446	13,513,800	貸付株式数 1,400株
住友不動産販売	44,300	3,135	138,880,500	
ゴールドクレスト	48,700	2,167	105,532,900	貸付株式数 12,700株

リコ・ホールディング	24,300	6,700	162,810,000	
日本エスリード	24,000	1,024	24,576,000	
日神不動産	82,100	402	33,004,200	
タカラレーベン	202,000	386	77,972,000	貸付株式数 76,800株
サンヨーハウジ 名古屋	32,300	1,125	36,337,500	
イオンモール	398,300	2,634	1,049,122,200	
ファースト住建	16,500	1,319	21,763,500	貸付株式数 5,500株
ランド	144,900	13	1,883,700	
東祥	13,900	1,961	27,257,900	
トーセイ	84,400	707	59,670,800	
穴吹興産	31,000	333	10,323,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	383,500	1,149	440,641,500	貸付株式数 114,700株
サンフロンティア不動産	58,100	1,143	66,408,300	貸付株式数 34,100株
エフ・ジェー・ネクスト	24,200	481	11,640,200	
ランドビジネス	31,200	405	12,636,000	
グランディハウス	35,700	345	12,316,500	
東武鉄道	3,551,000	524	1,860,724,000	
相鉄ホールディングス	1,072,000	385	412,720,000	
東京急行	3,681,000	727	2,676,087,000	
京浜急行	1,607,000	904	1,452,728,000	
小田急電鉄	1,999,000	972	1,943,028,000	
京王電鉄	1,748,000	796	1,391,408,000	
京成電鉄	938,000	1,006	943,628,000	
富士急行	171,000	1,177	201,267,000	貸付株式数 8,000株
新京成電鉄	80,000	380	30,400,000	
東日本旅客鉄道	1,150,800	8,108	9,330,686,400	
西日本旅客鉄道	564,400	4,525	2,553,910,000	
東海旅客鉄道	560,100	14,790	8,283,879,000	
西武ホールディングス	498,400	2,015	1,004,276,000	貸付株式数 155,100株 (31,100株)
鴻池運輸	33,000	1,840	60,720,000	
西日本鉄道	802,000	411	329,622,000	
ハマキョウレックス	17,900	3,170	56,743,000	
サカイ引越センター	10,100	3,450	34,845,000	貸付株式数 3,000株
近畿日本鉄道	6,295,000	372	2,341,740,000	貸付株式数 503,000株
阪急阪神HLDGS	4,198,000	577	2,422,246,000	
南海電鉄	1,304,000	447	582,888,000	
京阪電鉄	1,317,000	424	558,408,000	
神戸電鉄	153,000	359	54,927,000	
名糖運輸	25,600	671	17,177,600	

名古屋鉄道	2,203,000	420	925,260,000	貸付株式数 823,000株 (823,000株)
山陽電鉄	228,000	460	104,880,000	
トランコム	18,000	4,050	72,900,000	
日本通運	2,476,000	491	1,215,716,000	
ヤマトホールディングス	1,148,000	2,058	2,362,584,000	貸付株式数 367,000株
山 九	760,000	519	394,440,000	
日 新	236,000	293	69,148,000	
丸 運	39,400	248	9,771,200	
丸全昭和運輸	209,000	349	72,941,000	
センコー	247,000	525	129,675,000	貸付株式数 112,000株 (112,000株)
トナミホールディングス	123,000	246	30,258,000	
日本梱包運輸	191,000	1,731	330,621,000	
日石輸送	71,000	234	16,614,000	
福山通運	370,000	570	210,900,000	貸付株式数 110,000株 (99,000株)
セイノーホールディングス	442,000	1,152	509,184,000	
神奈川中央交通	73,000	511	37,303,000	
日立物流	130,300	1,552	202,225,600	
日本郵船	5,285,000	292	1,543,220,000	貸付株式数 26,000株
商船三井	3,514,000	372	1,307,208,000	
川崎汽船	2,737,000	215	588,455,000	
N S ユナイテッド海運	262,000	245	64,190,000	貸付株式数 107,000株
乾 汽 船	74,300	318	23,627,400	貸付株式数 12,000株
明治海運	55,900	375	20,962,500	
飯野海運	258,900	589	152,492,100	
共栄タンカー	52,000	210	10,920,000	貸付株式数 20,000株
第一中央汽船	456,000	93	42,408,000	貸付株式数 171,000株
日本航空	528,300	5,820	3,074,706,000	
A N A ホールディングス	12,294,000	244	2,999,736,000	貸付株式数 3,834,000株
スカイマーク	132,900	281	37,344,900	貸付株式数 50,900株
パスコ	57,000	454	25,878,000	貸付株式数 25,000株
三菱倉庫	410,000	1,512	619,920,000	
三井倉庫	314,000	443	139,102,000	貸付株式数 75,000株
住友倉庫	419,000	572	239,668,000	
渋沢倉庫	148,000	351	51,948,000	
ヤマタネ	308,000	179	55,132,000	
東陽倉庫	106,000	262	27,772,000	
日本トランスシティ	130,000	335	43,550,000	

ケイヒン	112,000	156	17,472,000	
中央倉庫	35,500	892	31,666,000	貸付株式数 12,500株
安田倉庫	48,600	1,032	50,155,200	
東洋埠頭	180,000	223	40,140,000	
宇徳	50,600	375	18,975,000	
上組	746,000	948	707,208,000	
サンリツ	15,200	526	7,995,200	
キムラユニティー	14,100	959	13,521,900	
キューソー流通システム	17,200	1,028	17,681,600	
郵船ロジスティクス	57,400	1,107	63,541,800	
近鉄エクスプレス	55,900	4,295	240,090,500	
東海運	33,700	262	8,829,400	
エーアイテイー	23,000	768	17,664,000	貸付株式数 7,000株
東京放送HD	332,900	1,204	400,811,600	貸付株式数 11,800株
日本テレビHD	614,900	1,728	1,062,547,200	
テレビ朝日HD	155,900	1,866	290,909,400	
スカパーJSATHD	468,500	592	277,352,000	
テレビ東京HD	50,300	1,549	77,914,700	
コネクシオ	54,200	879	47,641,800	
クロップス	4,200	554	2,326,800	
日本電信電話	2,425,700	6,437	15,614,230,900	
KDDI	1,916,300	6,182	11,846,566,600	
光通信	55,600	7,270	404,212,000	
NTTドコモ	5,086,700	1,753	8,916,985,100	
GMOインターネット	205,900	1,149	236,579,100	
学研ホールディングス	206,000	281	57,886,000	
ゼンリン	81,600	1,161	94,737,600	
昭文社	36,500	669	24,418,500	
KADOKAWA	60,200	2,949	177,529,800	貸付株式数 20,700株 (20,700株)
インプレスホールディングス	43,600	127	5,537,200	
東京電力	5,306,000	410	2,175,460,000	
中部電力	2,061,100	1,242	2,559,886,200	
関西電力	2,552,500	988	2,521,870,000	
中国電力	864,800	1,363	1,178,722,400	
北陸電力	612,800	1,320	808,896,000	
東北電力	1,562,700	1,179	1,842,423,300	
四国電力	563,300	1,378	776,227,400	貸付株式数 223,800株
九州電力	1,381,500	1,205	1,664,707,500	
北海道電力	585,400	854	499,931,600	貸付株式数 180,200株

沖縄電力	40,800	3,445	140,556,000	
電源開発	388,200	3,225	1,251,945,000	
東京瓦斯	7,128,000	591	4,212,648,000	
大阪瓦斯	6,474,000	429	2,777,346,000	
東邦瓦斯	1,591,000	565	898,915,000	
北海道瓦斯	118,000	285	33,630,000	貸付株式数 8,000株
西部瓦斯	697,000	262	182,614,000	
静岡瓦斯	163,300	695	113,493,500	
アイネット	25,600	852	21,811,200	
松竹	406,000	950	385,700,000	貸付株式数 60,000株
東宝	440,500	2,393	1,054,116,500	
エイチ・アイ・エス	106,500	3,345	356,242,500	
東映	253,000	544	137,632,000	
AOI Pro.	27,900	675	18,832,500	
NTTデータ	435,800	3,805	1,658,219,000	
共立メンテナンス	32,300	4,465	144,219,500	
イチネンホールディングス	68,400	802	54,856,800	
建設技術研究所	37,500	1,308	49,050,000	
スペース	32,300	1,045	33,753,500	
アインファーマシーズ	34,100	4,695	160,099,500	貸付株式数 1,900株
燦ホールディングス	13,000	1,412	18,356,000	
スバル興業	47,000	390	18,330,000	
東京テアトル	247,000	144	35,568,000	貸付株式数 54,000株
よみうりランド	130,000	459	59,670,000	
東京都競馬	447,000	295	131,865,000	貸付株式数 135,000株
常磐興産	220,000	150	33,000,000	貸付株式数 58,000株
カナモト	82,400	4,045	333,308,000	
東京ドーム	484,000	473	228,932,000	
DTS	58,800	1,863	109,544,400	
スクウェア・エニックス・HD	224,500	1,936	434,632,000	
シーイーシー	36,400	710	25,844,000	
カプコン	157,000	1,727	271,139,000	貸付株式数 59,500株
西尾レントオール	34,500	4,060	140,070,000	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
アゴーラ・ホスピタリティーG	265,000	45	11,925,000	
日本空港ビルデング	213,300	2,960	631,368,000	
トランス・コスモス	85,300	2,202	187,830,600	
乃村工藝社	128,100	946	121,182,600	

ジャステック	35,500	831	29,500,500	
S C S K	146,800	2,811	412,654,800	
藤田観光	175,000	382	66,850,000	貸付株式数 20,000株 (20,000株)
K N T - C Tホールディングス	208,000	194	40,352,000	
日本管財	27,000	2,461	66,447,000	
トーカイ	27,800	2,937	81,648,600	
白 洋 舎	68,000	241	16,388,000	
セコム	679,700	6,210	4,220,937,000	
日本システムウエア	23,200	719	16,680,800	
セントラル警備保障	28,000	1,126	31,528,000	
アイネス	83,900	777	65,190,300	
丹青社	81,500	571	46,536,500	
メイテック	88,400	3,115	275,366,000	
T K C	51,900	2,151	111,636,900	
アサツー ディ・ケイ	114,500	2,690	308,005,000	貸付株式数 34,200株
富士ソフト	78,300	2,158	168,971,400	
応用地質	62,600	1,643	102,851,800	
船井総研ホールディン	67,000	913	61,171,000	
N S D	131,000	1,365	178,815,000	
進学会	27,200	378	10,281,600	
丸紅建材リース	53,000	209	11,077,000	
コナミ	278,700	2,274	633,763,800	貸付株式数 26,200株
ベネッセホールディングス	218,900	4,145	907,340,500	貸付株式数 69,900株
イオンディライト	63,100	2,336	147,401,600	
ナック	32,700	1,501	49,082,700	
福井コンピュータH L D S	8,400	872	7,324,800	
ニチイ学館	141,800	895	126,911,000	貸付株式数 20,000株 (20,000株)
ダイセキ	96,400	1,897	182,870,800	
ステップ	18,200	807	14,687,400	
日鉄住金物産	406,000	388	157,528,000	
元気寿司	19,000	1,993	37,867,000	
トラスコ中山	69,800	2,486	173,522,800	
ヤマダ電機	2,440,300	361	880,948,300	貸付株式数 780,100株
オートバックスセブン	209,600	1,685	353,176,000	
アークランドサカモト	40,200	2,137	85,907,400	
ニトリホールディングス	244,500	5,700	1,393,650,000	貸付株式数 44,500株

グルメ杵屋	44,000	878	38,632,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
愛眼	49,100	275	13,502,500	
ケーユーホールディングス	25,700	642	16,499,400	
吉野家ホールディングス	167,300	1,436	240,242,800	貸付株式数 66,900株
加藤産業	88,700	2,272	201,526,400	
イノテック	56,600	483	27,337,800	
イエローハット	53,300	2,309	123,069,700	
富士エレクトロニクス	31,700	1,325	42,002,500	
松屋フーズ	28,600	1,892	54,111,200	貸付株式数 12,000株
JBCホールディングス	51,600	797	41,125,200	
JKホールディングス	55,500	559	31,024,500	
サガミチェーン	78,000	979	76,362,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
日伝	27,000	2,476	66,852,000	
関西スーパーマーケット	45,500	867	39,448,500	
ミロク情報サービス	40,600	495	20,097,000	
北沢産業	50,900	186	9,467,400	
杉本商事	33,200	1,009	33,498,800	
因幡電機産業	85,100	3,380	287,638,000	
王将フードサービス	31,100	4,600	143,060,000	貸付株式数 6,600株 (6,600株)
プレナス	68,600	2,316	158,877,600	
ミニストップ	45,200	1,605	72,546,000	
アークス	105,300	2,109	222,077,700	
バロー	133,000	1,698	225,834,000	
バイテック	20,900	833	17,409,700	
ミスミグループ本社	247,400	2,994	740,715,600	
江守グループHD	18,500	1,883	34,835,500	貸付株式数 7,800株
藤久	4,800	1,642	7,881,600	
アルテック	32,100	228	7,318,800	貸付株式数 11,400株
ベルク	30,400	2,762	83,964,800	
大庄	27,600	1,390	38,364,000	
タキヒヨー	103,000	422	43,466,000	
ファーストリテイリング	123,600	33,505	4,141,218,000	
ソフトバンク	3,031,600	7,486	22,694,557,600	
スズケン	255,500	3,585	915,967,500	
サンドラッグ	130,500	4,420	576,810,000	
東京デリカ	30,900	2,087	64,488,300	貸付株式数 5,200株
ジェコス	42,500	1,150	48,875,000	

ヤマザワ	14,400	1,646	23,702,400	
やまや	12,200	1,825	22,265,000	貸付株式数 500株
ベルーナ	153,900	501	77,103,900	
合計			1,122,765,596,200	

(注) 1. 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられており
ます。

トヨタ自動車	30,000株	三菱UFJフィナンシャルG	300,000株
三井住友フィナンシャルG	30,000株		

2. 貸付株式数のうち(括弧書)の数字は、委託者の利害関係人である大和証券株式会社に対する
貸付であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成26年7月31日

資産総額	1,190,850,498,216円
負債総額	69,287,874,954円
純資産総額（ - ）	1,121,562,623,262円
発行済数量	845,734,162口
1単位当たり純資産額（ / ）	1,326.1円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 名義登録と収益分配金の支払い

計算期間終了日において氏名もしくは名称および住所が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、受託会社は収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。この場合、名義登録受益者が当該計算期間終了日における振替制度移行後も受益証券を保有している所有者と異なる場合であっても、委託会社および受託会社は当該所有者に対して収益分配金の支払いおよびその他損害についてその責を負わないものとします。

(3) 受益者に対する特典

ありません。

(4) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(5) 受益証券の再発行

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

(6) 受益権の譲渡

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

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

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

(7) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(8) 受益権の再分割

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【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

平成26年7月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

取締役会は、3名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク会議

ファンド評価会議は、運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を

把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、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受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるオペレーショナルリスク会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、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。

平成26年7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	13	165,320
追加型株式投資信託	521	10,026,856
株式投資信託 合計	534	10,192,176
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	3,155,324
公社債投資信託 合計	17	3,155,324
総合計	551	13,347,500

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。

なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の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、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

3．財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	14,380,327	15,186,222
有価証券	9,427,636	15,003,765
前払金	207	453
前払費用	142,919	157,453
未収入金	521,825	-
未収委託者報酬	7,183,011	8,265,950
未収収益	106,914	103,432
貯蔵品	9,551	14,492
繰延税金資産	491,727	674,141
その他	8,445	597
流動資産計	32,272,567	39,406,511
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物（純額）	254,258	252,417
器具備品（純額）	26,257	23,555
リース資産（純額）	222,274	224,362
リース資産（純額）	5,726	4,499
無形固定資産	3,194,512	2,991,462
ソフトウェア	3,132,238	2,910,918
ソフトウェア仮勘定	50,423	68,693
電話加入権	11,850	11,850
投資その他の資産	15,113,434	15,077,046

投資有価証券		8,342,934		8,338,733
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		136,315		129,405
従業員に対する長期貸付金		92,527		68,396
差入保証金		1,000,820		997,594
長期前払費用		7,376		6,484
投資不動産（純額）	1	402,340	1	398,402
貸倒引当金		9,950		3,040
固定資産計		18,562,205		18,320,926
資産合計		50,834,773		57,727,438

（単位:千円）

	前事業年度 （平成25年3月31日現在）	当事業年度 （平成26年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
リース債務	1,227	1,227
預り金	56,491	53,677
未払金	6,795,899	8,998,456
未払収益分配金	10,333	7,931
未払償還金	113,002	77,698
未払手数料	3,764,501	4,277,412
その他未払金	2 2,908,061	2 4,635,414
未払費用	3,383,551	3,463,796
未払法人税等	588,040	1,530,565
未払消費税等	189,139	530,831
賞与引当金	841,300	955,600
流動負債計	11,855,648	15,534,154
固定負債		
リース債務	4,494	3,272
退職給付引当金	1,935,442	1,959,451
役員退職慰労引当金	67,410	80,280
繰延税金負債	1,740,407	1,789,543
固定負債計	3,747,753	3,832,547
負債合計	15,603,402	19,366,702
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727

資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	7,722,723	10,821,849
利益剰余金合計	8,097,020	11,196,146
株主資本合計	34,767,020	37,866,146
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	464,350	494,589
評価・換算差額等合計	464,350	494,589
純資産合計	35,231,371	38,360,735
負債・純資産合計	50,834,773	57,727,438

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成24年4月1日	(自	平成25年4月1日
	至	平成25年3月31日)	至	平成26年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		73,498,726		84,771,977
その他営業収益		526,465		788,473
営業収益計		74,025,191		85,560,451
営業費用				
支払手数料		41,213,272		47,520,063
広告宣伝費		604,864		668,841
公告費		949		533
受益証券発行費		-		25
調査費		8,116,701		8,246,807
調査費		824,915		741,792
委託調査費		7,291,786		7,505,015
委託計算費		807,090		735,588
営業雑経費		1,280,599		1,322,711
通信費		206,564		249,081
印刷費		404,023		477,092
協会費		53,643		54,190
諸会費		11,281		11,711
その他営業雑経費		605,086		530,634
営業費用計		52,023,478		58,494,570
一般管理費				
給料		5,264,128		5,708,541
役員報酬		249,180		243,000
給料・手当		3,782,533		3,785,717

賞与	391,114	724,223
賞与引当金繰入額	841,300	955,600
福利厚生費	809,254	793,740
交際費	55,806	37,951
寄付金	636	-
旅費交通費	196,147	191,623
租税公課	206,178	222,767
不動産賃借料	887,968	1,182,703
退職給付費用	469,713	373,920
役員退職慰労引当金繰入額	38,970	33,750
固定資産減価償却費	1,181,438	963,183
諸経費	1,094,627	1,354,169
一般管理費計	10,204,869	10,862,351
営業利益	11,796,843	16,203,530

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1 257,704	1 144,660
有価証券利息	11,102	13,966
受取利息	10,598	9,117
時効成立分配金・償還金	21,305	44,877
投資有価証券売却益	279,443	64,122
有価証券償還益	101,052	63,228
その他	44,912	34,445
営業外収益計	726,118	374,418
営業外費用		
時効成立後支払分配金・償還金	19,392	16,985
投資有価証券売却損	36,469	3,171
有価証券償還損	33,338	18,848
投資不動産管理費用	16,271	16,864
貯蔵品廃棄損	9,990	9,503
その他	13,120	9,343
営業外費用計	128,584	74,716
経常利益	12,394,377	16,503,232
特別利益		
投資有価証券売却益	39,827	-
固定資産売却益	31	-
その他	16,466	-

特別利益計		56,325		-
特別損失				
固定資産除却損	2	129,816	2	888
本社移転関連費用		1,099,913		-
その他		14,428		-
特別損失計		1,244,158		888
税引前当期純利益		11,206,544		16,502,343
法人税、住民税及び事業税		4,286,691		6,525,874
法人税等調整額		109,902		150,022
法人税等合計		4,176,789		6,375,851
当期純利益		7,029,755		10,126,492

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174,272	11,495,727	974,297	7,715,116	8,089,414	34,759,414
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,022,149	△7,022,149	△7,022,149
当期純利益	-	-	-	7,029,755	7,029,755	7,029,755
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	7,606	7,606	7,606
当期末残高	15,174,272	11,495,727	974,297	7,722,723	8,097,020	34,767,020

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	33,879	53,783	87,663	34,847,077
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△7,022,149
当期純利益	-	-	-	7,029,755
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	430,470	△53,783	376,686	376,686
当期変動額合計	430,470	△53,783	376,686	384,293
当期末残高	464,350	-	464,350	35,231,371

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,722,723	8,097,020	34,767,020
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027,366	△7,027,366	△7,027,366
当期純利益	-	-	-	10,126,492	10,126,492	10,126,492
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,099,125	3,099,125	3,099,125
当期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	10,821,849	11,196,146	37,866,146

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	464,350	-	464,350	35,231,371
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△7,027,366
当期純利益	-	-	-	10,126,492
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	30,238	-	30,238	30,238
当期変動額合計	30,238	-	30,238	3,129,364
当期末残高	494,589	-	494,589	38,360,735

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

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）有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く）

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 8～47年

器具備品 4～20年

（会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、当事業年度より有形固定資産（投資不動産を含む）の減価償却方法を定率法から定額法に変更いたしました。

この変更は、本社移転を契機に当社の有形固定資産の使用実態を見直した結果、当社において使用する有形固定資産は安定的に使用されており、その投資効果は、耐用年数の期間中に平均的・安定的に発現するものであるため、定額法が当社の企業活動をより適切に反映した減価償却方法であると判断したためであります。

この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微です。

（２）無形固定資産（リース資産を除く）

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）長期前払費用

定額法によっております。

（４）リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

３．引当金の計上基準

（１）貸倒引当金

債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

（２）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。

（３）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度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。

（４）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．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「貯蔵品廃棄損」は重要性が増したため当事業年度より区分掲記することとしました。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、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた23,111千円は、「貯蔵品廃棄損」9,990千円、「その他」13,120千円として組替えております。

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
建物	15,528千円	18,230千円
器具備品	250,072千円	249,761千円
リース資産	409千円	1,636千円
投資建物	724,130千円	729,348千円
投資器具備品	23,691千円	24,180千円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
未払金	2,883,398千円	4,508,988千円

3 保証債務

前事業年度（平成25年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,591,590千円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成26年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719,900千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)
受取配当金	185,280千円	-

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)
建物	546千円	-
器具備品	128,892千円	888千円
無形固定資産(その他)	377千円	-
計	129,816千円	888千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年 6月25日 定時株主総会	普通株式	7,022	2,692	平成24年 3月31日	平成24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

平成25年 6月24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	7,027百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	2,694円
基準日	平成25年 3月31日
効力発生日	平成25年 6月25日

当事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年6月24日 定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

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

平成26年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	10,126百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,882円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月26日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「証券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。証券投資信託は余資運用及び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、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(平成25年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	14,380,327	14,380,327	-
(2) 未収委託者報酬	7,183,011	7,183,011	-
(3) 未収入金	521,825	521,825	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	16,711,401	16,711,401	-
資産計	38,796,567	38,796,567	-
(1) 未払手数料	3,764,501	3,764,501	-
(2) その他未払金	2,908,061	2,908,061	-
(3) 未払費用(*)	2,782,587	2,782,587	-
負債計	9,455,149	9,455,149	-

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

当事業年度(平成26年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	15,186,222	15,186,222	-
(2) 未収委託者報酬	8,265,950	8,265,950	-
(3) 未収入金	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	22,283,329	22,283,329	-
資産計	45,735,503	45,735,503	-
(1) 未払手数料	4,277,412	4,277,412	-
(2) その他未払金	4,635,414	4,635,414	-
(3) 未払費用(*)	2,678,610	2,678,610	-
負債計	11,591,437	11,591,437	-

(*) 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、(2) 未収委託者報酬、並びに(3) 未収入金

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。

- (4) 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、投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

負 債

- (1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,059,169	1,059,169
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069	5,141,069
(3) 差入保証金	1,000,820	997,594

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

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成25年3月31日現在）

(単位：千円)

	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	14,380,327	-	-	-
未収委託者報酬	7,183,011	-	-	-
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	-	1,434,397	4,840,276	-
合計	21,563,339	1,434,397	4,840,276	-

当事業年度（平成26年3月31日現在）

(単位：千円)

	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	15,186,222	-	-	-
未収委託者報酬	8,265,950	-	-	-
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	-	1,498,464	3,978,251	97,038
合計	23,452,173	1,498,464	3,978,251	97,038

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成25年3月31日現在)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141,069千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成26年3月31日現在)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141,069千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(平成25年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	93,459	55,101	38,357
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	6,224,312	5,440,857	783,455
小計	6,317,771	5,495,959	821,812
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	10,393,629	10,493,953	100,323
小計	10,393,629	10,493,953	100,323
合計	16,711,401	15,989,912	721,489

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,059,169千円)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(平成26年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	113,247	55,101	58,145
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	5,625,179	4,873,552	751,626
小計	5,738,426	4,928,653	809,772

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	16,544,903	16,586,202	41,299
小計	16,544,903	16,586,202	41,299
合計	22,283,329	21,514,856	768,472

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,059,169千円）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 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1) 株式	141,128	39,827	-
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	28,114,625	279,443	36,469
合計	28,255,753	319,271	36,469

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他			
証券投資信託の受益証券	24,501,921	64,122	3,171
合計	24,501,921	64,122	3,171

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、その他有価証券（非上場株式）について3,220千円の減損処理を行っております。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

退職給付債務	1,935,442千円
退職給付引当金	1,935,442千円

3. 退職給付費用に関する事項

勤務費用	301,777千円
その他	167,935千円
退職給付費用	469,713千円

(注) 「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

期首における退職給付債務	1,935,442千円
勤務費用	201,327千円
退職給付の支払額	177,317千円
期末における退職給付債務	1,959,451千円

(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

積立型制度の退職給付債務	-
年金資産	-
非積立型制度の退職給付債務	1,959,451千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,959,451千円
退職給付引当金	1,959,451千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,959,451千円

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	201,327千円
確定給付制度に係る退職給付費用	201,327千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172,593千円でありました。

(表示方法の変更)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を当事業年度より適用し（ただし、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めを除く。）、（退職給付関係）注記の表示方法を変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、（退職給付関係）の注記の組替えは行っておりません。

(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的主要原因別内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	837,121	833,243
退職給付引当金	693,199	698,348
未払事業税	154,219	335,386
賞与引当金	280,855	287,721
連結法人間取引(譲渡損)	264,269	141,925
投資有価証券評価損	128,953	128,953
繰延資産	157,330	121,437
出資金評価損	114,425	116,888
未払社会保険料	43,411	38,787
器具備品	33,316	33,316
役員退職慰労引当金	24,920	28,611
その他	29,627	24,709
繰延税金資産小計	2,761,651	2,789,330
評価性引当額	1,323,069	1,200,725
繰延税金資産合計	1,438,582	1,588,604
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428,233	2,428,233
その他有価証券評価差額金	257,138	273,883
その他	1,888	1,888
繰延税金負債合計	2,687,261	2,704,006
繰延税金負債の純額	1,248,679	1,115,401

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

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。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について前事業年度の38.01%から35.64%に変更されております。

この変更による影響は軽微であります。

(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

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25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(千円)	科目	期末残高(千円)
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)	1,591,590	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
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)	1,719,900	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	20,510,864	未払手数料	2,758,584
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	1,205,721	未払費用	82,519
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	1,194,567	長期差入保証金	971,157
									未収入金	511,559

(注) 1. 上記の金額のうち、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。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 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。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

(2) 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。

(3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,994,992	未払手数料	3,216,077
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	678,054	未払費用	393,881

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	978,984	長期差入保証金	971,157
-------------	------------	--------	-----	--------	---	---------	---------	---------	---------	---------

(注) 1. 上記の金額のうち、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。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 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。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- (2) 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。
- (3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

2. 親会社に関する注記

(株)大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1 株当たり情報)

前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
1株当たり純資産額	13,506.24円	1株当たり純資産額	14,705.91円
1株当たり当期純利益	2,694.91円	1株当たり当期純利益	3,882.07円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注) 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益(千円)	7,029,755	10,126,492
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(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（平成26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 (平成26年3月末日 現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式 会社	4,500	
クレディ・スイス証券株式会社	78,100	
ゴールドマン・サックス証券会社	83,616	
J . P . モルガン証券株式会社	50,275	
シティグループ証券株式会社	96,307	
ソシエテ ジェネラル証券会社 東京支店	31,703	
ドイツ証券株式会社	72,728	
野村證券株式会社	10,000	
パークレイズ証券株式会社	32,945	
B N P パリバ証券株式会社	102,025	
みずほ証券株式会社	125,167	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	
メリルリンチ日本証券株式会社	119,440	
モルガン・スタンレーM U F G 証券株式会社	62,149	
U B S 証券株式会社	46,450	

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せん。

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

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成26年3月末日現在）

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

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

第3 【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。

- (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。

独立監査人の監査報告書

平成26年 5月26日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第55期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成26年8月13日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ上場投信 - トピックスの平成25年7月11日から平成26年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ上場投信 - トピックスの平成26年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。