

【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27年10月2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】	山村 政 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3111
【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27年10月3日から平成28年10月3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27年10月3日から平成28年10月3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時までに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、言及をするものではない。
- （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みことができます。
- 解約申込により受益権を換金することはできません。

●収益分配金は、名義登録受益者（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27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。

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

(2) 【投資対象】

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、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

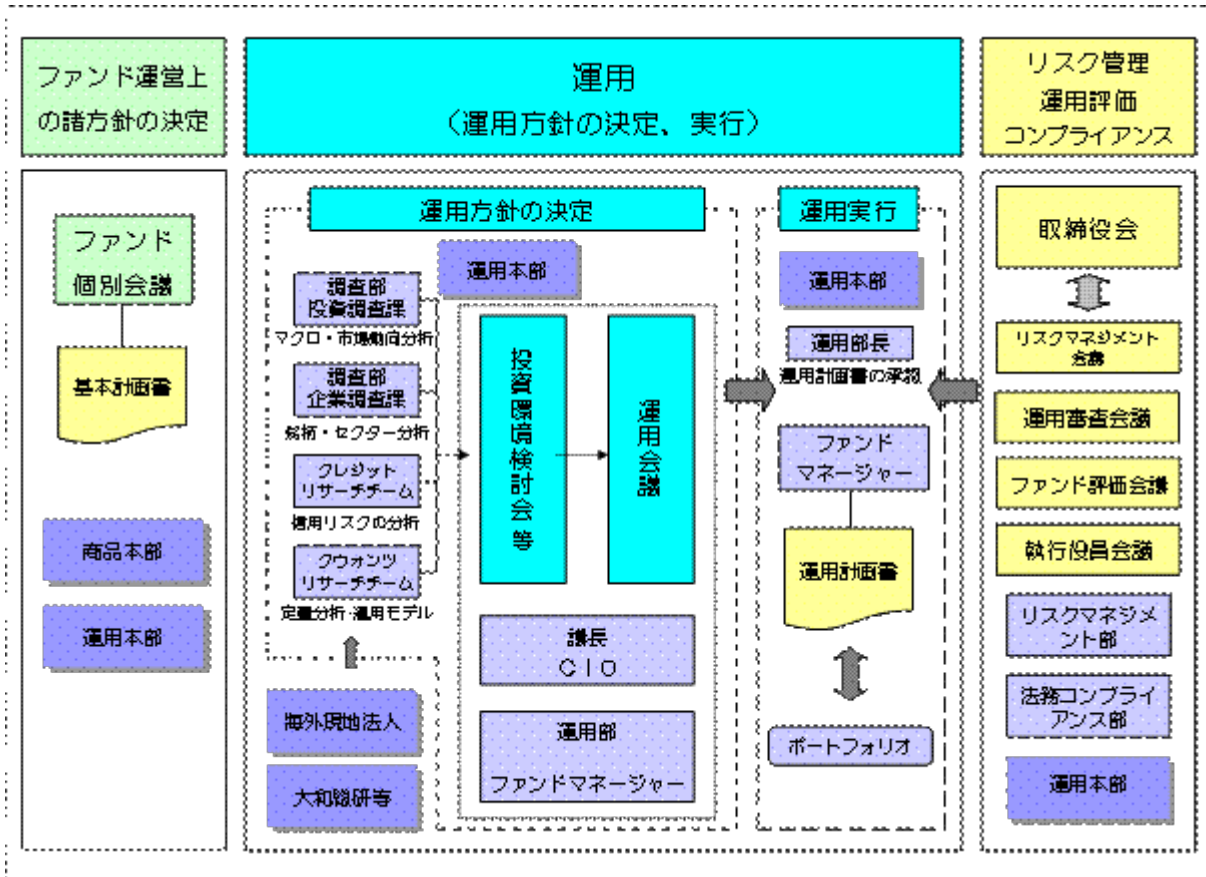
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから

提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的確な状況報告
- ・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、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ．ファンド評価会議

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

ロ．運用審査会議

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

ハ．リスクマネジメント会議

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

ニ．執行役員会議

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

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成27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号口に規定する外国金融商品市場のうち、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。

デリバティブ取引等（信託約款）

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

有価証券の貸付け（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式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、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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。

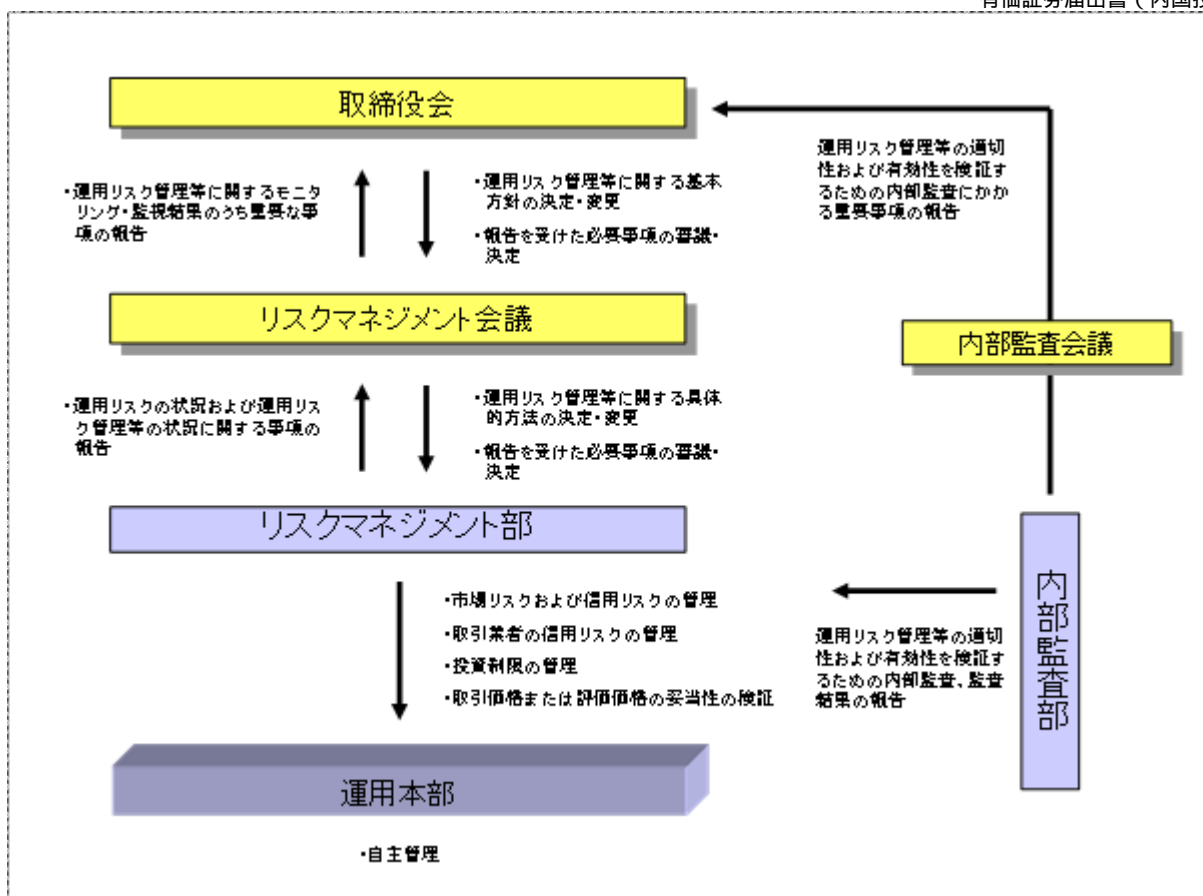
(2) その他の留意点

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。

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

(3) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

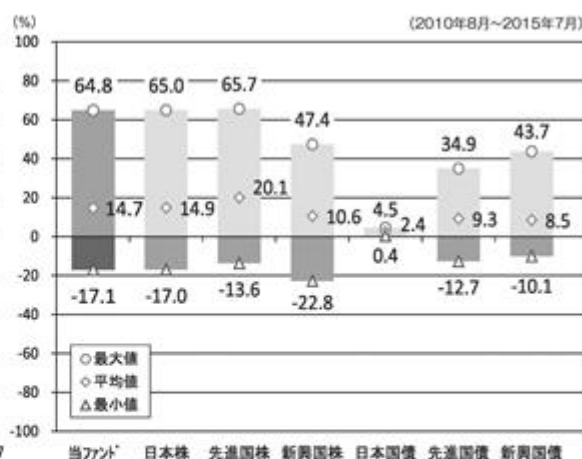
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

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

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

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

販売会社については、前(1)をご参照下さい。

信託財産留保額

ありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、次のイ.の額にロ.の額を加算して得た額とします。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%

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息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。

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得および譲渡所得等が追加されます。

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、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。

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27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27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	1,349,878,811,010	99.88
内 日本	1,349,878,811,010	99.88
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,606,389,472	0.12
純資産総額	1,351,485,200,482	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)	1,610,200,000	0.12
内 日本	1,610,200,000	0.12

(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27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	7,648,800	7,927.47 60,635,699,184	8,253.00 63,125,546,400	4.67
2	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	43,923,300	857.52 37,665,304,092	900.00 39,530,970,000	2.93
3	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,142,100	5,269.30 21,825,968,950	5,544.00 22,963,802,400	1.70
4	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	76,470,100	258.34 19,755,923,710	267.90 20,486,339,790	1.52
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	4,286,900	4,465.94 19,145,064,800	4,763.50 20,420,648,150	1.51

6	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2,896,800	6,924.38 20,058,546,778	6,881.00 19,932,880,800	1.47
7	本田技研	日本	株式	輸送用機器	4,994,800	3,832.20 19,141,073,870	3,979.50 19,876,806,600	1.47
8	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	3,672,100	4,352.14 15,981,512,084	4,813.50 17,675,653,350	1.31
9	KDDI	日本	株式	情報・通信業	5,565,600	3,001.88 16,707,308,394	3,150.50 17,534,422,800	1.30
10	ソニー	日本	株式	電気機器	3,892,000	3,430.61 13,351,973,104	3,533.00 13,750,436,000	1.02
11	武田薬品	日本	株式	医薬品	2,179,500	5,935.67 12,936,802,796	6,240.00 13,600,080,000	1.01
12	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	2,292,800	5,172.42 11,859,327,044	5,724.00 13,123,987,200	0.97
13	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	1,018,000	11,169.38 11,370,432,224	12,250.00 12,470,500,000	0.92
14	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	6,513,400	1,780.49 11,597,061,384	1,867.00 12,160,517,800	0.90
15	ファナック	日本	株式	電気機器	578,200	23,767.56 13,742,407,564	20,680.00 11,957,176,000	0.88
16	キヤノン	日本	株式	電気機器	2,984,500	3,864.91 11,534,846,898	3,972.00 11,854,434,000	0.88
17	東京海上HD	日本	株式	保険業	2,221,300	4,888.55 10,858,952,515	5,165.00 11,473,014,500	0.85
18	三菱商事	日本	株式	卸売業	4,202,100	2,616.58 10,995,142,710	2,679.50 11,259,526,950	0.83
19	三菱地所	日本	株式	不動産業	4,078,000	2,617.96 10,676,078,720	2,755.00 11,234,890,000	0.83
20	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	4,229,000	2,333.17 9,867,012,200	2,614.50 11,056,720,500	0.82
21	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	497,400	20,739.65 10,315,906,410	21,720.00 10,803,528,000	0.80
22	日立	日本	株式	電気機器	13,343,000	756.62 10,095,709,460	804.40 10,733,109,200	0.79
23	村田製作所	日本	株式	電気機器	582,800	19,183.39 11,180,081,330	18,400.00 10,723,520,000	0.79
24	三井不動産	日本	株式	不動産業	2,908,000	3,354.78 9,755,716,700	3,528.50 10,260,878,000	0.76

25	野村ホールディングス	日本	株式	証券、商品先物取引業	11,212,200	848.06 9,508,682,052	881.40 9,882,433,080	0.73
26	パナソニック	日本	株式	電気機器	6,774,300	1,574.41 10,665,574,392	1,457.00 9,870,155,100	0.73
27	花王	日本	株式	化学	1,565,200	5,752.10 9,003,199,860	6,291.00 9,846,673,200	0.73
28	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	7,801,000	1,188.12 9,268,563,912	1,198.50 9,349,498,500	0.69
29	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	1,959,400	4,423.75 8,667,913,282	4,678.00 9,166,073,200	0.68
30	第一生命	日本	株式	保険業	3,515,100	2,261.89 7,950,791,700	2,522.00 8,865,082,200	0.66

(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	99.88%
合計	99.88%

(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	0.08%
鉱業	0.38%
建設業	2.61%
食料品	4.50%
繊維製品	0.73%
パルプ・紙	0.23%
化学	5.89%
医薬品	4.97%
石油・石炭製品	0.47%
ゴム製品	0.91%
ガラス・土石製品	0.92%
鉄鋼	1.29%
非鉄金属	0.91%
金属製品	0.58%

機械	4.56%
電気機器	11.82%
輸送用機器	11.01%
精密機器	1.43%
その他製品	1.60%
電気・ガス業	2.33%
陸運業	4.21%
海運業	0.27%
空運業	0.69%
倉庫・運輸関連業	0.21%
情報・通信業	7.02%
卸売業	4.05%
小売業	4.87%
銀行業	9.72%
証券、商品先物取引業	1.43%
保険業	2.78%
その他金融業	1.35%
不動産業	2.85%
サービス業	3.21%
合計	99.88%

(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 2015年9月	買建	97	1,541,815,000	1,610,200,000	0.12%

(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
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
平成26年7月末日	1,121,562,623,262	-	1,326.1	-	1,326
8月末日	1,101,283,708,105	-	1,314.5	-	1,314
9月末日	1,080,521,087,277	-	1,373.8	-	1,372
10月末日	1,021,491,883,317	-	1,381.5	-	1,379
11月末日	1,031,043,243,351	-	1,461.1	-	1,458
12月末日	978,237,991,063	-	1,459.6	-	1,462
平成27年1月末日	986,440,812,231	-	1,467.4	-	1,469
2月末日	1,053,147,525,371	-	1,580.5	-	1,580
3月末日	1,126,185,442,124	-	1,612.9	-	1,616
4月末日	1,192,497,327,345	-	1,665.1	-	1,664
5月末日	1,340,466,041,280	-	1,750.2	-	1,749
6月末日	1,320,421,015,866	-	1,706.3	-	1,704
第14計算期間末 (平成27年7月10日)	1,279,925,104,350	1,298,892,337,720	1,633.0	1,657.2	1,632
7月末日	1,351,485,200,482	-	1,711.3	-	1,709

(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
第14計算期間	24.20

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第14計算期間	27.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第14計算期間	258,772,110	342,631,712

(参考情報) 運用実績

2015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	17,113円
純資産総額	13,514億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.8%
3カ月間	4.3%
6カ月間	18.3%
1年間	31.0%
3年間	138.4%
5年間	115.7%
設定来	63.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
※基準価額の計算において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: 242円

設定来分配金合計額: 2,056.4円

決算期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期
	04年7月	05年7月	06年7月	07年7月	08年7月	09年7月	10年7月	11年7月	12年7月	13年7月	14年7月	15年7月
分配金	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	242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。

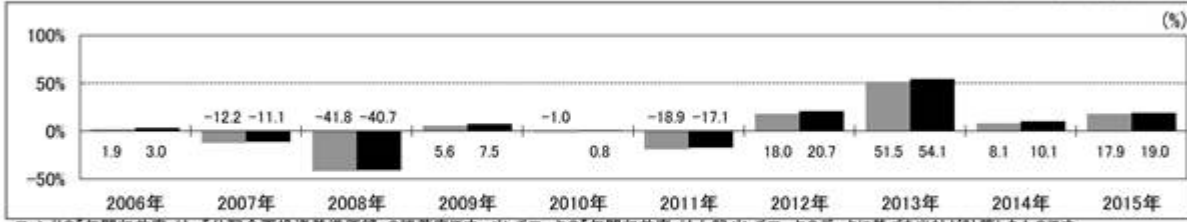
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,886	99.9%	電気機器	11.8%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.7%
国内株式先物	1	0.1%	輸送用機器	11.0%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.9%
不動産投資信託等	-	-	銀行業	9.7%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.7%
コール・ローン、その他	-	0.1%	情報・通信業	7.0%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.5%
合計	1,887	-	化学	5.9%	日本電信電話	情報・通信業	1.5%
株式市場・上場別構成			医薬品	5.0%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.5%
一部(東証・名証)		99.9%	小売業	4.9%	本田技研	輸送用機器	1.5%
二部(東証・名証)		-	機械	4.6%	日本たばこ産業	食料品	1.3%
新興市場他		-	食料品	4.5%	KDDI	情報・通信業	1.3%
その他		-	その他	35.5%	ソニー	電気機器	1.0%
合計		99.9%	合計	99.9%	合計		18.9%

※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



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

・2015年は7月31日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

- 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、取得申込みの受付の中止、取得申込みの受付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。

二．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14期計算期間（平成26年7月11日から平成27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13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	63,441,579,302	67,250,832,430
株式	² ₃ 1,122,765,596,200	² ₃ 1,278,250,047,993
派生商品評価勘定	9,530,062	-
未収入金	7,718,508,583	10,541,275,861
未収配当金	833,830,740	1,185,541,120
前払金	-	502,430,000
その他未収収益	⁴ 72,073,444	⁴ 38,567,121
流動資産合計	1,194,841,118,331	1,357,768,694,525
資産合計		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,139,352	74,381,034
前受金	194,534,000	-
未払金	3,193,460	423,837,367
未払収益分配金	14,229,125,046	18,967,233,370
未払受託者報酬	189,125,149	235,333,371
未払委託者報酬	387,415,774	483,955,565
未払利息	523,613	456,957
受入担保金	55,882,560,090	57,397,637,955
その他未払費用	221,310,826	260,754,556
流動負債合計	71,109,927,310	77,843,590,175
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 1,084,536,970,000	¹ 979,712,467,500
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	39,194,221,021	300,212,636,850
（分配準備積立金）	940,385,753	1,240,865,748
元本等合計	1,123,731,191,021	1,279,925,104,350
純資産合計	1,123,731,191,021	1,279,925,104,350
負債純資産合計	1,194,841,118,331	1,357,768,694,525

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	自 至	第13期 平成25年7月11日 平成26年7月10日	自 至	第14期 平成26年7月11日 平成27年7月10日
営業収益				
受取配当金		15,175,316,794		20,134,374,139
受取利息		27,641,510		33,370,018
有価証券売買等損益		82,593,459,094		237,708,985,252
派生商品取引等損益		740,376,711		1,125,587,248
その他収益		1,569,567,764		1,753,969,989
営業収益合計		99,106,361,873		259,756,286,646
営業費用				
支払利息		15,024,043		16,404,328
受託者報酬		364,644,346		452,093,161
委託者報酬		745,636,661		926,818,688
その他費用		221,628,771		258,684,604
営業費用合計		1,346,933,821		1,654,000,781
営業利益		97,759,428,052		258,102,285,865
経常利益		97,759,428,052		258,102,285,865
当期純利益		97,759,428,052		258,102,285,865
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		20,975,928,290		39,194,221,021
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,035,419,440		68,554,144,614
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,035,419,440		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		68,554,144,614
剰余金減少額又は欠損金増加額		27,395,573,135		46,670,781,280
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		46,670,781,280
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		27,395,573,135		-
分配金		2,14,229,125,046		2,18,967,233,370
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		39,194,221,021		300,212,636,850

(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14期	
	自	平成26年7月11日
	至	平成27年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金	原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第13期	第14期
	平成26年7月10日現在	平成27年7月10日現在
1. 1 期首元本額	956,555,088,750円	1,084,536,970,000円
期中追加設定元本額	627,433,200,000円	323,465,137,500円
期中一部交換元本額	499,451,318,750円	428,289,640,000円
2. 計算期間末日における受益権の総数	867,629,576口	783,769,974口
3. 2 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 52,459,252,500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 54,263,050,450円

4.	3	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 486,150,000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 890,730,000円
5.	4	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68,897,160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35,033,508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13期		第14期	
	自 平成25年7月11日	至 平成26年7月10日	自 平成26年7月11日	至 平成27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448,896,727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620,842,824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(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円)であり、うち14,229,125,046円(10口当たり164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(20,905,309,818円)及び分配準備積立金(940,385,753円)の合計額から、経費(1,637,596,453円)を控除して計算される分配対象額は20,208,099,118円(10口当たり257円)であり、うち18,967,233,370円(10口当たり242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14期	
	自 平成26年7月11日	至 平成27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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第14期 平成27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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	第13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7月10日現在

種 類	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	76,245,556,551	206,990,913,449
合計	76,245,556,551	206,990,913,449

(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13期 平成26年7月10日 現在				第14期 平成27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	914,088,000	-	921,625,000	7,537,000	1,711,448,000	-	1,637,185,000	74,263,000
合計	914,088,000	-	921,625,000	7,537,000	1,711,448,000	-	1,637,185,000	74,263,000

(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14期 自 平成26年7月11日 至 平成27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13期 平成26年7月10日現在	第14期 平成27年7月10日現在
1口当たり純資産額 (10口当たり純資産額)	1,295.2円 (12,952円)	1,633.0円 (16,330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	263,000	277.00	72,851,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
日本水産	761,000	359.00	273,199,000	
マルハニチロ	125,800	2,076.00	261,160,800	貸付株式数 500株
ハウスイ	38,000	142.00	5,396,000	貸付株式数 22,000株
サカタのタネ	99,700	2,196.00	218,941,200	
ホクト	68,700	2,384.00	163,780,800	
ショーボンドHD	59,900	4,980.00	298,302,000	貸付株式数 3,600株 (3,600株)
ミライト・ホールディングス	190,400	1,360.00	258,944,000	
タマホーム	45,400	523.00	23,744,200	貸付株式数 17,800株 (9,100株)
サンヨーホームズ	7,400	613.00	4,536,200	
住石ホールディングス	170,900	121.00	20,678,900	貸付株式数 32,900株
日鉄鉱業	156,000	537.00	83,772,000	
三井松島	404,000	131.00	52,924,000	
国際石油開発帝石	3,261,800	1,349.00	4,400,168,200	
日本海洋掘削	16,900	3,275.00	55,347,500	貸付株式数 10,200株 (4,300株)
石油資源開発	87,300	3,700.00	323,010,000	
K&Oエナジーグループ	41,400	1,725.00	71,415,000	
ダイセキ環境ソリューション	6,500	2,133.00	13,864,500	貸付株式数 2,500株
安藤・間	413,100	639.00	263,970,900	
東急建設	219,800	883.00	194,083,400	
コムシスホールディングス	275,500	1,808.00	498,104,000	
ミサワホーム	73,100	1,057.00	77,266,700	
高松コンストラクションG P	45,900	2,604.00	119,523,600	

東建コーポレーション	23,100	7,560.00	174,636,000	貸付株式数	8,300株
ヤマウラ	29,000	493.00	14,297,000	貸付株式数	9,800株
大成建設	3,215,000	715.00	2,298,725,000		
大林組	1,857,000	942.00	1,749,294,000		
清水建設	1,894,000	1,034.00	1,958,396,000	貸付株式数	553,000株 (553,000株)
飛島建設	418,700	200.00	83,740,000	貸付株式数	163,500株 (115,800株)
長谷工コーポレーション	774,200	1,562.00	1,209,300,400		
松井建設	61,000	607.00	37,027,000		
銭高組	80,000	345.00	27,600,000	貸付株式数	32,000株
鹿島建設	2,721,000	591.00	1,608,111,000		
不動テトラ	468,500	189.00	88,546,500	貸付株式数	177,200株 (113,000株)
大末建設	23,700	733.00	17,372,100	貸付株式数	3,900株
鉄建建設	376,000	347.00	130,472,000	貸付株式数	182,000株
日鉄住金テックスエンジ	109,000	604.00	65,836,000		
西松建設	668,000	469.00	313,292,000		
三井住友建設	2,512,000	148.00	371,776,000		
大豊建設	153,000	564.00	86,292,000	貸付株式数	59,000株
前田建設	412,000	821.00	338,252,000		
佐田建設	213,000	127.00	27,051,000		
ナカノフドー建設	46,500	614.00	28,551,000		
奥村組	588,000	612.00	359,856,000		
大和小田急建設	33,500	1,131.00	37,888,500		
東鉄工業	74,300	2,449.00	181,960,700		
イチケン	61,000	250.00	15,250,000	貸付株式数	24,000株
浅沼組	199,000	172.00	34,228,000	貸付株式数	23,000株 (23,000株)
戸田建設	775,000	539.00	417,725,000		
熊谷組	777,000	332.00	257,964,000		
青木あすなろ建設	39,900	826.00	32,957,400		
北野建設	116,000	310.00	35,960,000		
植木組	69,000	231.00	15,939,000		
三井ホーム	72,000	551.00	39,672,000		
矢作建設	76,500	822.00	62,883,000	貸付株式数	2,700株
ピーエス三菱	65,200	404.00	26,340,800	貸付株式数	24,600株 (4,300株)
日本ハウスHLDGS	103,100	576.00	59,385,600	貸付株式数	40,100株 (10,700株)

大東建託	231,400	12,290.00	2,843,906,000	
新日本建設	73,700	566.00	41,714,200	
N I P P O	129,000	2,030.00	261,870,000	
東亜道路	109,000	448.00	48,832,000	
前田道路	194,000	2,144.00	415,936,000	
日本道路	168,000	596.00	100,128,000	
東亜建設	455,000	200.00	91,000,000	
若築建設	356,000	160.00	56,960,000	貸付株式数 134,000株
東洋建設	185,500	448.00	83,104,000	貸付株式数 62,600株
五洋建設	687,000	488.00	335,256,000	
大林道路	65,000	648.00	42,120,000	
世紀東急	89,100	532.00	47,401,200	
福 田 組	84,000	781.00	65,604,000	
日本ドライケミカル	7,200	2,391.00	17,215,200	
住友林業	456,600	1,460.00	666,636,000	
日本基礎技術	74,100	395.00	29,269,500	
日成ビルド工業	155,000	378.00	58,590,000	貸付株式数 21,000株
ヤマダ・エスバイエルホーム	280,000	93.00	26,040,000	貸付株式数 163,000株
巴コーポレーション	76,900	415.00	31,913,500	
パナホーム	231,000	821.00	189,651,000	
大和ハウス	1,813,000	2,848.50	5,164,330,500	貸付株式数 651,400株 (651,400株)
ライト工業	99,200	924.00	91,660,800	
積水ハウス	1,936,400	1,840.50	3,563,944,200	
日特建設	82,600	444.00	36,674,400	貸付株式数 31,200株
北陸電気工事	30,000	1,213.00	36,390,000	
ユアテック	89,000	845.00	75,205,000	
西部電気工業	46,000	457.00	21,022,000	
四電工	46,000	430.00	19,780,000	
中電工	88,600	2,264.00	200,590,400	貸付株式数 12,300株 (12,300株)
関 電 工	282,000	753.00	212,346,000	
きんでん	410,000	1,559.00	639,190,000	
東京エネシス	63,000	1,308.00	82,404,000	
トーエネック	79,000	747.00	59,013,000	
住友電設	48,000	1,644.00	78,912,000	
日本電設工業	100,900	2,165.00	218,448,500	
協和エクシオ	262,800	1,411.00	370,810,800	
新日本空調	50,700	1,028.00	52,119,600	

日本工営	175,000	451.00	78,925,000	
N D S	93,000	327.00	30,411,000	
九電工	104,000	2,070.00	215,280,000	貸付株式数 41,000株 (27,000株)
三機工業	125,200	941.00	117,813,200	
日 揮	622,000	2,278.00	1,416,916,000	
中外炉工業	171,000	261.00	44,631,000	
ヤマト	49,000	383.00	18,767,000	
太平電業	76,000	1,224.00	93,024,000	
高砂熱学	170,400	1,487.00	253,384,800	
三晃金属	55,000	226.00	12,430,000	
N E C ネットエスアイ	68,300	2,553.00	174,369,900	
朝日工業社	63,000	433.00	27,279,000	
明星工業	101,900	588.00	59,917,200	
大 氣 社	87,400	2,850.00	249,090,000	
ダイダン	75,000	799.00	59,925,000	
日比谷総合設備	79,800	1,617.00	129,036,600	
東芝プラントシステム	100,500	1,392.00	139,896,000	貸付株式数 10,600株 (10,600株)
日本製粉	380,000	768.00	291,840,000	
日清製粉G本社	678,900	1,624.00	1,102,533,600	
日東富士製粉	43,000	337.00	14,491,000	
昭和産業	255,000	481.00	122,655,000	
鳥越製粉	48,200	712.00	34,318,400	
中部飼料	59,200	923.00	54,641,600	
フィード・ワンH L D G S	372,500	174.00	64,815,000	
東洋精糖	85,000	117.00	9,945,000	
日本甜菜糖	316,000	197.00	62,252,000	
三井製糖	243,000	480.00	116,640,000	
塩水港精糖	66,100	256.00	16,921,600	
ネクスト	135,700	798.00	108,288,600	貸付株式数 1,000株
日本M & A センター	88,400	5,130.00	453,492,000	
ノバレーゼ	13,300	875.00	11,637,500	貸付株式数 5,000株
アコーディア・ゴルフ	217,000	1,166.00	253,022,000	
タケエイ	54,800	1,279.00	70,089,200	貸付株式数 8,800株
トラスト・テック	9,000	2,375.00	21,375,000	貸付株式数 2,500株
パソナグループ	42,600	1,081.00	46,050,600	貸付株式数 14,500株 (14,500株)
C D S	11,700	968.00	11,325,600	貸付株式数 1,800株

リンクアンドモチベーション	78,000	155.00	12,090,000	貸付株式数	27,800株
G C Aサヴィアン	44,600	1,468.00	65,472,800		
エス・エム・エス	64,700	1,578.00	102,096,600	貸付株式数	42,200株
テンプホールディングス	113,800	4,485.00	510,393,000	貸付株式数	44,600株 (4,400株)
リニカル	13,400	1,233.00	16,522,200	貸付株式数	4,700株
クックパッド	108,600	2,404.00	261,074,400	貸付株式数	40,800株
エスクリ	20,300	1,111.00	22,553,300		
アイ・ケイ・ケイ	30,600	570.00	17,442,000	貸付株式数	11,800株
森永製菓	543,000	511.00	277,473,000		
中村屋	129,000	460.00	59,340,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
江崎グリコ	143,000	5,960.00	852,280,000		
名糖産業	27,400	1,310.00	35,894,000		
不二家	354,000	194.00	68,676,000		
山崎製パン	446,000	1,879.00	838,034,000	貸付株式数	169,000株
第一屋製パン	75,000	116.00	8,700,000		
モロゾフ	86,000	390.00	33,540,000	貸付株式数	10,000株
亀田製菓	34,500	4,765.00	164,392,500		
寿スピリッツ	13,200	3,595.00	47,454,000	貸付株式数	5,200株 (700株)
カルビー	229,300	5,070.00	1,162,551,000		
森永乳業	540,000	444.00	239,760,000		
六甲バター	27,600	1,767.00	48,769,200	貸付株式数	14,000株
ヤクルト	332,000	7,010.00	2,327,320,000		
明治ホールディングス	183,400	16,080.00	2,949,072,000	貸付株式数	72,000株 (72,000株)
雪印メグミルク	145,700	1,527.00	222,483,900		
プリマハム	354,000	359.00	127,086,000		
日本ハム	448,000	2,916.00	1,306,368,000		
伊藤ハム	340,000	652.00	221,680,000	貸付株式数	128,000株
林兼産業	199,000	160.00	31,840,000	貸付株式数	78,000株
丸大食品	318,000	458.00	145,644,000		
米久	19,800	2,529.00	50,074,200		
S Foods	38,800	2,468.00	95,758,400	貸付株式数	8,900株 (600株)
学情	21,400	1,243.00	26,600,200	貸付株式数	8,400株 (4,800株)
スタジオアリス	26,500	2,120.00	56,180,000		

シミックホールディングス	26,000	1,640.00	42,640,000	貸付株式数 10,000株 (6,400株)
システナ	51,800	1,111.00	57,549,800	
N J S	11,600	1,459.00	16,924,400	
デジタルアーツ	29,100	1,699.00	49,440,900	
新日鉄住金 S O L	44,800	3,875.00	173,600,000	
総合警備保障	192,600	4,835.00	931,221,000	
キューブシステム	23,600	631.00	14,891,600	
日本駐車場開発	594,300	171.00	101,625,300	
コア	22,900	855.00	19,579,500	貸付株式数 9,000株
カカクコム	380,500	1,776.00	675,768,000	貸付株式数 133,700株
アイロムグループ	13,000	1,830.00	23,790,000	貸付株式数 4,800株 (1,000株)
ルネサンス	29,300	1,310.00	38,383,000	
ディップ	11,400	12,170.00	138,738,000	貸付株式数 4,400株
S B Sホールディングス	53,100	982.00	52,144,200	貸付株式数 20,800株
オプトホールディング	27,700	646.00	17,894,200	貸付株式数 4,700株
新日本科学	53,200	680.00	36,176,000	貸付株式数 20,900株 (5,000株)
ツクイ	68,400	960.00	65,664,000	貸付株式数 26,800株
総合臨床 H L D G S	29,500	475.00	14,012,500	貸付株式数 6,200株
キャリアデザインセンター	15,400	1,358.00	20,913,200	
エムスリー	499,700	2,546.00	1,272,236,200	貸付株式数 189,000株
ツカダ・グローバル H O L D	41,800	733.00	30,639,400	貸付株式数 16,300株 (700株)
アウトソーシング	24,200	2,167.00	52,441,400	
ウェルネット	20,200	2,895.00	58,479,000	
ディー・エヌ・エー	284,600	2,293.00	652,587,800	貸付株式数 72,200株
博報堂 D Y H L D G S	800,000	1,325.00	1,060,000,000	
ぐるなび	66,800	1,853.00	123,780,400	貸付株式数 26,200株 (4,100株)
エスアールジータカミヤ	45,600	700.00	31,920,000	貸付株式数 17,800株
一休	44,600	2,453.00	109,403,800	貸付株式数 10,500株
ジャパンベストレスキュー S	65,500	243.00	15,916,500	貸付株式数 5,100株 (5,100株)
ファンコミュニケーション ズ	132,000	827.00	109,164,000	貸付株式数 51,700株
ジェイコムホールディング ス	11,900	986.00	11,733,400	貸付株式数 4,400株
P G Mホールディングス	81,200	1,297.00	105,316,400	

WDBホールディングス	20,700	1,260.00	26,082,000	
ティア	24,200	722.00	17,472,400	
バリューコマース	46,500	542.00	25,203,000	
サッポロホールディングス	946,000	451.00	426,646,000	
アサヒグループホールディングン	1,244,600	3,734.50	4,647,958,700	
キリンHD	2,509,200	1,694.00	4,250,584,800	
宝ホールディングス	485,600	986.00	478,801,600	
オエノンホールディングス	142,000	216.00	30,672,000	
養命酒	36,000	995.00	35,820,000	
コカ・コーラウエスト	209,100	2,074.00	433,673,400	
コカ・コーライーストジャパン	190,200	2,064.00	392,572,800	
サントリー食品インター	375,200	5,040.00	1,891,008,000	
ダイドードリンコ	31,300	5,190.00	162,447,000	貸付株式数 9,600株 (9,600株)
伊藤園	183,700	2,504.00	459,984,800	貸付株式数 86,400株
キーコーヒー	53,100	2,004.00	106,412,400	
ユニカフェ	15,100	892.00	13,469,200	貸付株式数 4,600株
ジャパンフーズ	7,100	1,109.00	7,873,900	貸付株式数 2,600株
日清オイリオグループ	297,000	490.00	145,530,000	
不二製油	164,800	2,048.00	337,510,400	
かどや製油	5,400	2,677.00	14,455,800	貸付株式数 1,900株
J-オイルミルズ	259,000	401.00	103,859,000	
ローソン	206,100	8,130.00	1,675,593,000	貸付株式数 28,200株
サンエー	41,000	5,360.00	219,760,000	
ダイユーエイト	11,300	808.00	9,130,400	貸付株式数 3,900株
カワチ薬品	42,000	1,814.00	76,188,000	
エービーシー・マート	77,600	6,740.00	523,024,000	貸付株式数 22,200株 (1,600株)
ハードオフコーポレーション	26,300	1,397.00	36,741,100	
高千穂交易	20,900	1,071.00	22,383,900	貸付株式数 5,700株
アスクル	55,200	4,000.00	220,800,000	貸付株式数 21,700株 (1,100株)
ゲオホールディングス	102,900	1,551.00	159,597,900	
アダストリア	45,300	5,340.00	241,902,000	貸付株式数 400株 (400株)
シー・ヴィ・エス・バイエリア	63,000	153.00	9,639,000	貸付株式数 23,000株

伊藤忠食品	12,000	4,120.00	49,440,000	
くらコーポレーション	32,000	3,920.00	125,440,000	貸付株式数 9,400株
キャンドウ	27,900	1,539.00	42,938,100	貸付株式数 16,800株
エレマテック	25,400	2,723.00	69,164,200	
パル	31,800	3,760.00	119,568,000	
JALUX	13,900	2,245.00	31,205,500	貸付株式数 5,500株
エディオン	249,400	852.00	212,488,800	貸付株式数 97,600株
あらた	109,000	403.00	43,927,000	
サーラコーポレーション	45,900	580.00	26,622,000	
ワッツ	21,600	1,017.00	21,967,200	
トーメンデバイス	7,400	2,051.00	15,177,400	
J Pホールディングス	143,200	316.00	45,251,200	貸付株式数 54,200株
あみやき亭	8,600	4,930.00	42,398,000	
東京エレクトロデバイス	12,800	1,634.00	20,915,200	貸付株式数 5,100株
ひらまつ	75,100	811.00	60,906,100	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
フィールズ	35,700	1,908.00	68,115,600	貸付株式数 14,000株
双日	3,650,500	285.00	1,040,392,500	
ゲンキー	4,700	9,840.00	46,248,000	貸付株式数 1,400株
アルフレッサホールディングス	645,200	1,835.00	1,183,942,000	
サッポロドラッグストアー	4,100	1,749.00	7,170,900	貸付株式数 1,600株
大黒天物産	11,600	4,590.00	53,244,000	
ハニーズ	46,800	986.00	46,144,800	貸付株式数 16,100株 (16,100株)
ファーマライズHD	10,900	555.00	6,049,500	
キッコーマン	497,000	4,040.00	2,007,880,000	
味の素	1,428,000	2,653.00	3,788,484,000	
キューピー	315,000	2,463.00	775,845,000	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
ハウス食品G本社	229,200	2,243.00	514,095,600	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
カゴメ	222,200	1,939.00	430,845,800	貸付株式数 103,200株
焼津水産化工	29,100	1,000.00	29,100,000	
アリアケジャパン	54,800	5,110.00	280,028,000	
エバラ食品工業	9,000	2,009.00	18,081,000	貸付株式数 2,700株
ニチレイ	660,000	879.00	580,140,000	
横浜冷凍	133,900	967.00	129,481,300	貸付株式数 100株
東洋水産	323,400	4,400.00	1,422,960,000	
イトアンド	6,100	2,008.00	12,248,800	貸付株式数 1,600株

日清食品HD	262,000	5,290.00	1,385,980,000	貸付株式数 99,100株 (99,100株)
永谷園	53,000	1,076.00	57,028,000	
一正蒲鉾	21,500	1,027.00	22,080,500	貸付株式数 8,400株
フジッコ	54,000	2,315.00	125,010,000	
ロックフィールド	32,200	3,020.00	97,244,000	貸付株式数 2,800株
日本たばこ産業	3,452,400	4,327.50	14,940,261,000	
ケンコーマヨネーズ	20,100	1,672.00	33,607,200	
わらべや日洋	36,300	2,929.00	106,322,700	
なとり	28,400	1,449.00	41,151,600	貸付株式数 7,700株
ユーグレナ	206,500	1,625.00	335,562,500	貸付株式数 80,800株 (40,100株)
片倉工業	72,500	1,309.00	94,902,500	
グンゼ	460,000	320.00	147,200,000	
ヒューリック	1,014,400	1,090.00	1,105,696,000	
神栄	74,000	177.00	13,098,000	貸付株式数 6,000株
山下医科器械	3,800	1,770.00	6,726,000	
ラサ商事	25,500	596.00	15,198,000	
アルペン	47,700	1,915.00	91,345,500	貸付株式数 14,300株 (6,900株)
クオール	53,900	1,584.00	85,377,600	貸付株式数 19,600株
アルコニックス	30,900	1,880.00	58,092,000	
神戸物産	16,400	8,010.00	131,364,000	貸付株式数 5,500株 (1,500株)
ジェイアイエヌ	37,000	5,320.00	196,840,000	貸付株式数 1,700株
ビックカメラ	267,900	1,419.00	380,150,100	貸付株式数 104,900株 (25,000株)
DCMホールディングス	266,600	1,078.00	287,394,800	
Monotaro	95,900	5,240.00	502,516,000	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
東京一番フーズ	8,800	789.00	6,943,200	
あいホールディングス	86,500	1,972.00	170,578,000	
ディービーエックス	14,400	1,243.00	17,899,200	
きちり	12,900	695.00	8,965,500	貸付株式数 3,800株
アークランドサービス	5,700	5,850.00	33,345,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
J.フロントリテイリング	690,100	2,235.00	1,542,373,500	
ドトール・日レスHD	94,200	2,053.00	193,392,600	
マツモトキヨシHLDGS	121,800	5,180.00	630,924,000	

ブロンコビリー	17,400	2,478.00	43,117,200	貸付株式数	7,600株
スタートトゥデイ	169,000	3,400.00	574,600,000		
トレジャー・ファクトリー	11,200	1,468.00	16,441,600	貸付株式数	2,600株
物語コーポレーション	13,800	4,340.00	59,892,000		
ココカラファイン	55,300	3,985.00	220,370,500		
三越伊勢丹HD	1,084,300	2,082.00	2,257,512,600	貸付株式数	351,400株
東洋紡	2,292,000	180.00	412,560,000		
ユニチカ	1,678,000	55.00	92,290,000		
富士紡ホールディングス	282,000	262.00	73,884,000		
日清紡ホールディングス	368,000	1,353.00	497,904,000		
倉敷紡績	593,000	241.00	142,913,000		
ダイワボウHD	486,000	223.00	108,378,000		
シキボウ	332,000	123.00	40,836,000		
日東紡績	423,000	596.00	252,108,000	貸付株式数	86,000株 (86,000株)
トヨタ紡織	193,200	1,999.00	386,206,800	貸付株式数	82,500株
マクニカ・富士エレHLD GS	97,900	1,432.00	140,192,800		
ウエルシアHD	46,800	5,520.00	258,336,000		
クリエイトSDH	26,800	6,260.00	167,768,000		
バイタルKSKHD	102,400	870.00	89,088,000	貸付株式数	29,800株 (29,800株)
八洲電機	41,800	599.00	25,038,200	貸付株式数	7,000株
UKCホールディングス	35,000	2,374.00	83,090,000		
丸善CHI HD	63,500	398.00	25,273,000	貸付株式数	24,900株
OCHIホールディングス	12,500	1,262.00	15,775,000	貸付株式数	3,800株
TOKAIホールディング ス	266,300	491.00	130,753,300		
ミサワ	6,300	620.00	3,906,000	貸付株式数	1,500株
エー・ピーカンパニー	6,900	1,973.00	13,613,700	貸付株式数	1,500株
三洋貿易	29,900	1,615.00	48,288,500		
チムニー	11,800	3,080.00	36,344,000		
ウイン・パートナーズ	16,000	1,554.00	24,864,000		
ネクステージ	5,800	898.00	5,208,400	貸付株式数	2,300株 (2,300株)
ジョイフル本田	78,200	2,493.00	194,952,600	貸付株式数	21,400株
キリン堂ホールディングス	15,900	1,408.00	22,387,200		
すかいらーく	166,600	1,540.00	256,564,000	貸付株式数	55,300株
日本毛織	166,000	905.00	150,230,000		
大東紡織	79,000	81.00	6,399,000		

トーア紡コーポレーション	24,500	664.00	16,268,000	
ダイドーリミテッド	64,700	502.00	32,479,400	
ユナイテッド・スーパー マーケ	179,200	1,056.00	189,235,200	
三栄建築設計	21,800	1,064.00	23,195,200	
野村不動産HLDGS	327,800	2,531.00	829,661,800	
三重交通グループHD	95,800	455.00	43,589,000	貸付株式数 36,400株
日本商業開発	15,700	2,252.00	35,356,400	貸付株式数 4,900株
プレサンスコーポレーショ ン	16,800	3,850.00	64,680,000	
ユニゾホールディングス	29,800	5,170.00	154,066,000	貸付株式数 11,500株 (2,000株)
日本管理センター	34,800	1,943.00	67,616,400	貸付株式数 13,500株 (4,100株)
サンセイランディック	7,000	804.00	5,628,000	貸付株式数 2,100株
エストラスト	6,200	639.00	3,961,800	
フージャースHD	81,100	493.00	39,982,300	貸付株式数 30,600株
オープンハウス	77,600	1,956.00	151,785,600	貸付株式数 19,000株
東急不動産HD	1,429,400	949.00	1,356,500,600	貸付株式数 113,000株
飯田GHD	353,600	2,061.00	728,769,600	
帝国繊維	60,500	1,681.00	101,700,500	
ブックオフコーポレーショ ン	31,000	883.00	27,373,000	
日本コークス工業	518,800	112.00	58,105,600	
ミタチ産業	11,300	722.00	8,158,600	
あさひ	36,000	1,436.00	51,696,000	貸付株式数 14,100株 (7,500株)
日本調剤	6,200	6,550.00	40,610,000	
コスモス薬品	27,500	17,540.00	482,350,000	貸付株式数 10,800株 (4,000株)
シップヘルスケアHD	99,700	2,492.00	248,452,400	
トーエル	28,900	766.00	22,137,400	
一六堂	11,800	449.00	5,298,200	
ソフトクリエイトHD	16,100	920.00	14,812,000	
セブン&アイ・HLDGS	2,281,400	5,170.00	11,794,838,000	
薬王堂	6,500	3,420.00	22,230,000	貸付株式数 600株
クリエイト・レストラン ツ・ホール	37,900	2,775.00	105,172,500	貸付株式数 10,400株
明治電機工業	13,900	1,237.00	17,194,300	貸付株式数 5,500株
ツルハホールディングス	116,300	10,030.00	1,166,489,000	

デリカフーズ	8,200	1,033.00	8,470,600	
スターティア	5,000	1,676.00	8,380,000	
サンマルクホールディングス	39,100	4,010.00	156,791,000	
フェリシモ	12,400	1,241.00	15,388,400	
トリドール	58,400	1,559.00	91,045,600	
クスリのアオキ	43,100	5,720.00	246,532,000	
帝人	2,366,000	453.00	1,071,798,000	
東レ	4,479,000	968.30	4,337,015,700	貸付株式数 609,000株 (609,000株)
クラレ	913,300	1,417.00	1,294,146,100	
旭化成	3,610,000	921.40	3,326,254,000	
サカイオーベックス	138,000	198.00	27,324,000	
稲葉製作所	30,600	1,444.00	44,186,400	貸付株式数 11,800株
宮地エンジニアリングG	151,000	166.00	25,066,000	貸付株式数 64,000株
トーカロ	38,000	2,627.00	99,826,000	
アルファCO	18,200	1,271.00	23,132,200	
SUMCO	450,100	1,344.00	604,934,400	貸付株式数 141,700株
川田テクノロジーズ	10,000	4,525.00	45,250,000	
住江織物	143,000	322.00	46,046,000	
日本フェルト	30,600	516.00	15,789,600	
イチカワ	36,000	356.00	12,816,000	
日本バイリン	74,000	786.00	58,164,000	
エコナックホールディングス	174,000	107.00	18,618,000	
日東製網	60,000	155.00	9,300,000	
芦森工業	112,000	205.00	22,960,000	貸付株式数 29,000株
アツギ	475,000	112.00	53,200,000	
ダイニック	100,000	181.00	18,100,000	
共和レザー	37,800	915.00	34,587,000	
セーレン	144,200	1,202.00	173,328,400	
東海染工	73,000	127.00	9,271,000	
小松精練	95,200	550.00	52,360,000	
ワコールホールディングス	344,000	1,390.00	478,160,000	
ホギメディカル	36,400	6,340.00	230,776,000	
レナウン	139,100	183.00	25,455,300	貸付株式数 54,600株
クラウドディア	13,400	608.00	8,147,200	
T S Iホールディングス	258,300	818.00	211,289,400	
I Tホールディングス	180,800	2,711.00	490,148,800	
ネオス	13,200	658.00	8,685,600	貸付株式数 7,500株

電算システム	17,200	1,686.00	28,999,200	貸付株式数	6,700株
グリー	330,400	697.00	230,288,800	貸付株式数	139,100株
コーエーテクモHD	122,900	2,014.00	247,520,600		
三菱総合研究所	21,100	2,840.00	59,924,000		
ボルテージ	8,800	1,840.00	16,192,000	貸付株式数	4,500株
電算	5,400	2,237.00	12,079,800	貸付株式数	1,700株
A G S	8,000	999.00	7,992,000		
ファインデックス	31,000	1,277.00	39,587,000	貸付株式数	12,000株
ヒト・コミュニケーションズ	6,100	2,012.00	12,273,200	貸付株式数	2,200株
ブレインパッド	6,900	838.00	5,782,200	貸付株式数	1,400株 (500株)
K L a b	57,000	1,446.00	82,422,000	貸付株式数	24,600株
ポルトゥウィン・ピットクル	35,900	1,187.00	42,613,300		
イーブックイニシアティブ	11,000	956.00	10,516,000	貸付株式数	5,100株
ネクソン	515,100	1,561.00	804,071,100		
アイスタイル	23,100	1,185.00	27,373,500	貸付株式数	4,600株
エムアップ	13,700	708.00	9,699,600		
エイチーム	20,000	2,253.00	45,060,000	貸付株式数	7,800株
e n i s h	12,900	1,112.00	14,344,800	貸付株式数	5,000株 (900株)
コロプラ	149,900	2,311.00	346,418,900	貸付株式数	25,400株
モバイルクリエイト	31,600	775.00	24,490,000	貸付株式数	12,200株
オルトプラス	20,100	761.00	15,296,100	貸付株式数	3,400株
ブロードリーフ	44,300	1,241.00	54,976,300	貸付株式数	15,900株
ハーツユナイテッドグループ	14,900	1,945.00	28,980,500	貸付株式数	5,800株
特種東海製紙	336,000	298.00	100,128,000		
ベリサーブ	5,600	1,101.00	6,165,600		
ティーガイア	52,800	2,108.00	111,302,400		
日本アジアグループ	46,300	570.00	26,391,000		
豆蔵ホールディングス	42,300	615.00	26,014,500	貸付株式数	16,500株
テクマトリックス	23,400	910.00	21,294,000		
GMOペイメントゲートウェイ	46,600	4,100.00	191,060,000		
ザッパラス	30,400	543.00	16,507,200		
インターネットイニシアティブ	87,200	2,144.00	186,956,800		
GMOクラウド	10,600	911.00	9,656,600		

ビットアイル	61,800	462.00	28,551,600	貸付株式数	24,200株
S R Aホールディングス	28,800	2,281.00	65,692,800		
システムインテグレータ	6,900	613.00	4,229,700	貸付株式数	2,700株
パイブドピッツ	5,700	1,661.00	9,467,700	貸付株式数	1,300株
朝日ネット	54,200	515.00	27,913,000		
コムチュア	8,300	2,160.00	17,928,000		
王子ホールディングス	2,374,000	515.00	1,222,610,000		
日本製紙	279,300	2,048.00	572,006,400	貸付株式数	76,200株
三菱製紙	872,000	86.00	74,992,000		
北越紀州製紙	359,100	682.00	244,906,200		
中越パルプ	220,000	215.00	47,300,000	貸付株式数	86,000株 (86,000株)
巴川製紙	81,000	247.00	20,007,000	貸付株式数	31,000株 (7,000株)
大王製紙	256,000	1,131.00	289,536,000		
g u m i	53,300	1,337.00	71,262,100	貸付株式数	20,900株
レンゴー	499,000	471.00	235,029,000	貸付株式数	100,000株 (100,000株)
トーモク	166,000	272.00	45,152,000		
ザ・パック	40,900	2,317.00	94,765,300	貸付株式数	900株 (900株)
コ - プケミカル	78,000	99.00	7,722,000		
昭和電工	3,853,000	153.00	589,509,000		
住友化学	4,261,000	677.00	2,884,697,000		
日本化成	99,000	144.00	14,256,000		
住友精化	107,000	793.00	84,851,000		
日産化学	379,500	2,773.00	1,052,353,500		
ラサ工業	218,000	141.00	30,738,000	貸付株式数	48,000株
クレハ	405,000	448.00	181,440,000	貸付株式数	30,000株
多木化学	34,000	702.00	23,868,000		
テイカ	88,000	464.00	40,832,000		
石原産業	970,000	113.00	109,610,000		
片倉チツカリン	35,000	293.00	10,255,000		
日本曹達	371,000	745.00	276,395,000		
東ソー	1,468,000	652.00	957,136,000		
トクヤマ	889,000	222.00	197,358,000	貸付株式数	348,000株
セントラル硝子	590,000	503.00	296,770,000		
東亜合成	362,400	936.00	339,206,400		
ダイソー	230,000	425.00	97,750,000		
関東電化	124,000	832.00	103,168,000		

電気化学	1,199,000	507.00	607,893,000	
イビデン	362,400	1,979.00	717,189,600	
信越化学	1,038,000	7,271.00	7,547,298,000	
日本カ - バイド	197,000	207.00	40,779,000	
堺 化 学	234,000	406.00	95,004,000	
エア・ウォーター	499,000	2,048.00	1,021,952,000	
大陽日酸	743,100	1,368.00	1,016,560,800	貸付株式数 292,000株 (123,000株)
日本化学工業	214,000	213.00	45,582,000	
日本パ - カライジング	273,000	1,152.00	314,496,000	
高压ガス	78,000	634.00	49,452,000	
チタン工業	61,000	219.00	13,359,000	貸付株式数 4,000株
四国化成	76,000	943.00	71,668,000	
戸田工業	105,000	338.00	35,490,000	貸付株式数 42,000株
ステラ ケミファ	29,500	1,277.00	37,671,500	
保土谷化学	157,000	174.00	27,318,000	
日本触媒	448,000	1,593.00	713,664,000	
大日精化	240,000	568.00	136,320,000	
カネカ	781,000	829.00	647,449,000	
協和発酵キリン	692,000	1,659.00	1,148,028,000	
三菱瓦斯化学	995,000	637.00	633,815,000	
三井化学	2,630,000	434.00	1,141,420,000	
J S R	571,600	2,049.00	1,171,208,400	
東京応化工業	119,900	3,365.00	403,463,500	
大阪有機化学	41,200	682.00	28,098,400	
三菱ケミカルH L D G S	3,618,300	737.30	2,667,772,590	
日本合成化学	121,000	792.00	95,832,000	
ダイセル	814,000	1,510.00	1,229,140,000	
住友ベ - クライト	527,000	507.00	267,189,000	貸付株式数 86,000株 (86,000株)
積水化学	1,340,000	1,451.00	1,944,340,000	
日本ゼオン	489,000	1,062.00	519,318,000	貸付株式数 145,000株 (145,000株)
アイカ工業	173,000	2,680.00	463,640,000	
宇部興産	2,915,000	214.00	623,810,000	
積水樹脂	88,500	1,476.00	130,626,000	
タキロン	109,000	517.00	56,353,000	
旭有機材	204,000	252.00	51,408,000	
日立化成	285,900	2,092.00	598,102,800	
ニチバン	51,000	563.00	28,713,000	

リケンテクノス	92,300	479.00	44,211,700	
大倉工業	124,000	324.00	40,176,000	
積水化成品	149,000	415.00	61,835,000	
群栄化学	140,000	311.00	43,540,000	貸付株式数 7,000株
タイガース ポリマー	28,500	763.00	21,745,500	
ミライアル	20,800	1,287.00	26,769,600	貸付株式数 6,400株
ダイキアクシス	7,300	1,215.00	8,869,500	
ダイキョーニシカワ	16,800	4,070.00	68,376,000	
日本化薬	376,000	1,274.00	479,024,000	
カーリットホールディングス	45,200	582.00	26,306,400	貸付株式数 17,700株 (17,700株)
E P Sホールディングス	52,700	1,503.00	79,208,100	
パナソニック インフォシス	11,500	3,930.00	45,195,000	
プレステージ・インター	43,200	984.00	42,508,800	
フェイス	14,900	1,537.00	22,901,300	
ハイマックス	6,800	1,154.00	7,847,200	
アミューズ	16,000	3,865.00	61,840,000	
野村総合研究所	308,800	4,640.00	1,432,832,000	
ドリームインキュベータ	17,200	2,266.00	38,975,200	貸付株式数 6,700株
サイバネットシステム	43,900	434.00	19,052,600	
クイック	26,200	1,038.00	27,195,600	
T A C	28,600	211.00	6,034,600	
C Eホールディングス	7,000	1,135.00	7,945,000	
ケネディクス	774,900	436.00	337,856,400	貸付株式数 322,300株
電通	643,300	6,500.00	4,181,450,000	貸付株式数 54,900株 (54,900株)
インテージホールディングス	31,100	1,951.00	60,676,100	
テイクアンドギヴニーズ	22,400	789.00	17,673,600	
東邦システムサイエンス	14,600	643.00	9,387,800	
びあ	15,400	2,261.00	34,819,400	貸付株式数 4,600株
イオンファンタジー	17,000	1,997.00	33,949,000	貸付株式数 6,800株
ソースネクスト	27,200	695.00	18,904,000	貸付株式数 9,800株
ネクシィーズ	20,700	756.00	15,649,200	貸付株式数 5,000株 (3,000株)
メディカルシステムネット ワーク	48,100	462.00	22,222,200	
ティー・ワイ・オー	74,700	198.00	14,790,600	
日本精化	47,000	895.00	42,065,000	

A D E K A	266,800	1,604.00	427,947,200	
日油	472,000	965.00	455,480,000	
ミヨシ油脂	212,000	145.00	30,740,000	
新日本理化	90,200	259.00	23,361,800	
ハリマ化成グループ	48,300	472.00	22,797,600	
花 王	1,556,600	5,749.00	8,948,893,400	
第一工業製薬	110,000	347.00	38,170,000	貸付株式数 42,000株
ニイタカ	8,300	1,453.00	12,059,900	
三洋化成	165,000	844.00	139,260,000	
武田薬品	2,168,700	5,934.00	12,869,065,800	
アステラス製薬	6,480,800	1,780.00	11,535,824,000	
大日本住友製薬	409,600	1,364.00	558,694,400	貸付株式数 155,000株
塩野義製薬	903,700	4,870.00	4,401,019,000	
田辺三菱製薬	674,300	1,929.00	1,300,724,700	
わかもと製薬	59,000	259.00	15,281,000	
あすか製薬	68,200	1,269.00	86,545,800	
日本新薬	119,000	3,875.00	461,125,000	
ビオフェルミン製薬	8,500	2,820.00	23,970,000	貸付株式数 3,000株
中外製薬	576,200	4,325.00	2,492,065,000	
科研製薬	199,000	4,365.00	868,635,000	
エーザイ	763,300	8,323.00	6,352,945,900	
理研ビタミン	16,500	3,855.00	63,607,500	
ロート製薬	263,000	1,987.00	522,581,000	
小野薬品	262,900	13,540.00	3,559,666,000	
久光製薬	163,000	4,750.00	774,250,000	
有機合成薬品	36,000	274.00	9,864,000	
持田製薬	39,800	6,700.00	266,660,000	
参天製薬	1,063,800	1,689.00	1,796,758,200	
扶桑薬品	195,000	287.00	55,965,000	
日本ケミファ	66,000	648.00	42,768,000	
ツムラ	182,100	2,628.00	478,558,800	貸付株式数 32,600株
日医工	134,100	3,355.00	449,905,500	
テ ル モ	847,100	3,025.00	2,562,477,500	貸付株式数 77,600株
みらかホールディングス	147,200	5,920.00	871,424,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
キッセイ薬品工業	102,500	2,867.00	293,867,500	
生化学工業	110,600	1,961.00	216,886,600	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
栄研化学	47,700	2,355.00	112,333,500	
日水製薬	23,200	1,350.00	31,320,000	

鳥居薬品	39,500	3,150.00	124,425,000	
J C R ファーマ	43,900	2,774.00	121,778,600	貸付株式数 16,600株 (8,500株)
東和薬品	29,500	7,780.00	229,510,000	貸付株式数 9,500株 (9,500株)
富士製薬工業	14,800	2,126.00	31,464,800	
沢井製薬	90,500	6,900.00	624,450,000	
ゼリア新薬工業	118,500	1,703.00	201,805,500	
第一三共	1,946,400	2,420.50	4,711,261,200	貸付株式数 698,900株
キョーリン製薬HD	154,300	2,391.00	368,931,300	
大幸薬品	25,600	1,860.00	47,616,000	貸付株式数 10,000株
ダイト	25,800	2,451.00	63,235,800	
大塚ホールディングス	1,156,800	4,044.00	4,678,099,200	
大正製薬HD	139,200	8,110.00	1,128,912,000	
大日本塗料	331,000	179.00	59,249,000	
日本ペイントHOLD	500,900	3,525.00	1,765,672,500	
関西ペイント	702,000	1,885.00	1,323,270,000	
神東塗料	37,000	213.00	7,881,000	
中国塗料	150,000	946.00	141,900,000	
日本特殊塗料	44,000	850.00	37,400,000	
藤倉化成	78,600	550.00	43,230,000	
太陽ホールディングス	46,300	4,670.00	216,221,000	
D I C	2,319,000	282.00	653,958,000	
サカタインクス	118,200	1,024.00	121,036,800	
東洋インキSCホールディングン	556,000	472.00	262,432,000	
T & K TOKA	18,300	2,156.00	39,454,800	
アルプス技研	21,200	2,651.00	56,201,200	
サニックス	67,100	341.00	22,881,100	貸付株式数 45,600株 (7,000株)
ダイオーズ	10,800	1,162.00	12,549,600	貸付株式数 4,300株
日本空調サービス	28,200	1,018.00	28,707,600	
オリエンタルランド	624,000	7,371.00	4,599,504,000	貸付株式数 67,800株
ダスキン	163,200	2,048.00	334,233,600	
パーク24	274,500	2,086.00	572,607,000	貸付株式数 46,900株 (16,000株)
明光ネットワークジャパン	66,800	1,478.00	98,730,400	貸付株式数 19,900株
ファルコホールディングス	25,200	1,465.00	36,918,000	
クレスコ	11,000	2,064.00	22,704,000	
フジ・メディア・HD	567,900	1,608.00	913,183,200	

秀英予備校	10,600	798.00	8,458,800	貸付株式数	4,200株
田谷	8,800	768.00	6,758,400		
ラウンドワン	163,500	573.00	93,685,500		
リゾートトラスト	219,200	3,035.00	665,272,000	貸付株式数	3,800株 (3,800株)
オービック	188,000	5,650.00	1,062,200,000		
ジャストシステム	99,200	741.00	73,507,200		
TDCソフトウェアエンジニア	10,600	1,223.00	12,963,800		
ヤフー	3,908,600	470.00	1,837,042,000	貸付株式数	947,800株
ビー・エム・エル	34,000	3,650.00	124,100,000		
ワタベウェディング	17,000	500.00	8,500,000		
トレンドマイクロ	264,800	4,070.00	1,077,736,000		
もしもしホットライン	107,300	1,313.00	140,884,900		
インフォメーションディベロ	9,400	974.00	9,155,600		
リソー教育	88,500	296.00	26,196,000	貸付株式数	33,500株
日本オラクル	86,400	4,885.00	422,064,000		
早稲田アカデミー	7,800	851.00	6,637,800		
アルファシステムズ	16,200	1,800.00	29,160,000		
フューチャーアーキテクト	55,700	788.00	43,891,600		
CAC HOLDINGS	37,400	1,080.00	40,392,000	貸付株式数	7,200株 (7,200株)
ソフトバンク・テクノ	13,200	1,349.00	17,806,800	貸付株式数	6,100株
トーセ	13,100	908.00	11,894,800		
ユー・エス・エス	698,700	2,089.00	1,459,584,300		
オービックビジネスC	34,600	4,750.00	164,350,000	貸付株式数	13,100株 (13,100株)
伊藤忠テクノソリュー	123,500	2,896.00	357,656,000	貸付株式数	26,300株 (26,300株)
アイティフォー	65,600	453.00	29,716,800		
東京個別指導学院	27,900	656.00	18,302,400	貸付株式数	10,000株 (2,300株)
東計電算	8,800	2,041.00	17,960,800		
サイバーエージェント	141,000	5,460.00	769,860,000		
楽天	2,698,900	1,960.50	5,291,193,450		
エクスネット	4,400	1,512.00	6,652,800		
テー・オー・ダブリュー	34,700	558.00	19,362,600		
大塚商会	146,700	6,060.00	889,002,000		
総合メディカル	26,300	3,360.00	88,368,000		

サイボウズ	72,400	322.00	23,312,800	貸付株式数	26,000株
ソフトブレーン	75,200	166.00	12,483,200	貸付株式数	23,300株
セントラルスポーツ	19,700	2,265.00	44,620,500	貸付株式数	5,900株
パラカ	18,800	1,572.00	29,553,600	貸付株式数	4,600株
電通国際情報S	33,600	1,376.00	46,233,600		
イーエムシステムズ	7,200	2,199.00	15,832,800	貸付株式数	2,800株
ウェザーニューズ	14,700	4,175.00	61,372,500		
C I J	48,200	511.00	24,630,200	貸付株式数	7,300株
東洋ビジネスエンジ	4,800	1,404.00	6,739,200	貸付株式数	1,800株
日本エンタープライズ	47,000	333.00	15,651,000	貸付株式数	18,400株 (6,200株)
WOWOW	26,000	3,565.00	92,690,000	貸付株式数	10,000株
フュージョンパートナー	30,600	667.00	20,410,200		
フルキャストホールディングス	52,800	829.00	43,771,200		
富士フイルムHLDGS	1,324,500	4,293.00	5,686,078,500		
コニカミノルタ	1,293,700	1,448.00	1,873,277,600		
資生堂	1,029,500	2,696.00	2,775,532,000	貸付株式数	205,000株
ライオン	667,000	1,004.00	669,668,000	貸付株式数	262,000株
高砂香料	173,000	517.00	89,441,000		
マンダム	56,900	5,160.00	293,604,000		
ミルボン	34,100	4,065.00	138,616,500		
ファンケル	133,100	1,634.00	217,485,400	貸付株式数	50,200株
コーセー	92,300	10,330.00	953,459,000		
コタ	19,800	1,355.00	26,829,000		
ドクターシーラボ	39,300	4,400.00	172,920,000	貸付株式数	15,400株 (10,700株)
シーボン	5,900	2,666.00	15,729,400	貸付株式数	1,300株
ポーラ・オルビスHD	59,000	6,900.00	407,100,000	貸付株式数	6,400株 (6,400株)
ノエビアホールディングス	36,500	2,595.00	94,717,500		
アジュバンコスメジャパン	9,700	894.00	8,671,800	貸付株式数	3,800株
エステー	39,500	1,060.00	41,870,000		
アグロカネショウ	14,000	924.00	12,936,000		
コニシ	44,700	2,170.00	96,999,000		
長谷川香料	73,300	1,699.00	124,536,700	貸付株式数	10,000株 (10,000株)
星光PMC	31,700	903.00	28,625,100	貸付株式数	15,900株
小林製薬	93,500	8,960.00	837,760,000		
荒川化学工業	47,800	1,400.00	66,920,000		

メック	44,100	827.00	36,470,700	貸付株式数 500株 (500株)
日本高純度化学	14,700	2,421.00	35,588,700	
J C U	14,200	4,720.00	67,024,000	
新田ゼラチン	34,700	709.00	24,602,300	貸付株式数 14,300株
アース製薬	41,400	4,450.00	184,230,000	
イハラケミカル	88,000	1,413.00	124,344,000	
北興化学	55,000	481.00	26,455,000	
大成ラミック	14,700	2,871.00	42,203,700	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
クミアイ化学	119,100	913.00	108,738,300	貸付株式数 46,500株
日本農薬	131,100	1,100.00	144,210,000	
昭和シエル石油	518,600	1,078.00	559,050,800	
コスモ石油	1,600,000	190.00	304,000,000	
富士興産	21,000	555.00	11,655,000	
ニチレキ	64,000	1,002.00	64,128,000	
東燃ゼネラル石油	864,000	1,147.00	991,008,000	貸付株式数 25,000株 (25,000株)
ユシロ化学	31,000	1,342.00	41,602,000	
ビーピー・カストロール	23,700	1,294.00	30,667,800	貸付株式数 3,300株
富士石油	133,000	455.00	60,515,000	
MORESCO	13,500	2,032.00	27,432,000	貸付株式数 1,800株
出光興産	274,500	2,390.00	656,055,000	貸付株式数 64,400株
J Xホールディングス	6,422,600	505.40	3,245,982,040	
横浜ゴム	330,500	2,314.00	764,777,000	
東洋ゴム	261,900	2,496.00	653,702,400	
ブリヂストン	1,825,100	4,407.00	8,043,215,700	貸付株式数 279,000株 (279,000株)
住友ゴム	455,700	1,779.00	810,690,300	
藤倉ゴム	47,400	667.00	31,615,800	貸付株式数 18,600株 (1,600株)
オカモト	198,000	490.00	97,020,000	
アキレス	481,000	152.00	73,112,000	
フ コ ク	24,200	1,135.00	27,467,000	
ニッタ	55,600	3,130.00	174,028,000	
クリエートメディック	16,600	1,002.00	16,633,200	
住友理工	107,100	946.00	101,316,600	
三ツ星ベルト	132,000	878.00	115,896,000	
バンドー化学	211,000	496.00	104,656,000	
鬼怒川ゴム	114,000	626.00	71,364,000	

旭硝子	2,850,000	687.00	1,957,950,000	貸付株式数	217,000株
日本板硝子	2,791,000	120.00	334,920,000		
石塚硝子	67,000	210.00	14,070,000	貸付株式数	34,000株
有沢製作所	97,500	841.00	81,997,500		
日本山村硝子	229,000	181.00	41,449,000		
日本電気硝子	1,124,000	585.00	657,540,000		
オハラ	21,800	594.00	12,949,200	貸付株式数	2,300株
住友大阪セメント	1,074,000	448.00	481,152,000		
太平洋セメント	3,610,000	360.00	1,299,600,000		
デイ・シイ	59,300	414.00	24,550,200		
リゾートソリューション	51,000	305.00	15,555,000		
日本ヒューム	60,400	759.00	45,843,600		
日本コンクリート	99,100	504.00	49,946,400	貸付株式数	38,900株 (35,600株)
三谷セキサン	28,900	1,574.00	45,488,600	貸付株式数	9,900株
ジャパンパイル	77,000	776.00	59,752,000		
東海カーボン	492,000	353.00	173,676,000		
日本カーボン	284,000	365.00	103,660,000	貸付株式数	12,000株 (12,000株)
東洋炭素	32,000	1,863.00	59,616,000	貸付株式数	6,900株
ノリタケ	326,000	270.00	88,020,000		
TOTO	844,000	1,982.00	1,672,808,000		
日本碍子	731,000	3,060.00	2,236,860,000		
日本特殊陶業	498,600	3,105.00	1,548,153,000	貸付株式数	152,300株
ダントーホールディングス	67,000	183.00	12,261,000	貸付株式数	26,000株
MARUWA	15,400	2,686.00	41,364,400	貸付株式数	4,000株 (4,000株)
品川リフラクトリーズ	131,000	281.00	36,811,000		
黒崎播磨	112,000	256.00	28,672,000		
ヨータイ	31,000	359.00	11,129,000	貸付株式数	12,000株
イソライト	28,400	214.00	6,077,600	貸付株式数	10,700株
東京窯業	63,000	208.00	13,104,000		
ニッカトー	20,300	419.00	8,505,700		
フジミインコーポレーテッド	56,100	1,698.00	95,257,800		
エーアンドエーマテリアル	107,000	104.00	11,128,000		
ニチアス	257,000	729.00	187,353,000	貸付株式数	47,000株 (47,000株)
新日鐵住金	24,458,000	288.50	7,056,133,000		
神戸製鋼所	10,003,000	185.00	1,850,555,000		

中山製鋼所	429,000	85.00	36,465,000	
合同製鐵	294,000	205.00	60,270,000	
J F E ホールディングス	1,476,000	2,429.00	3,585,204,000	貸付株式数 68,200株
日新製鋼	244,900	1,404.00	343,839,600	貸付株式数 42,900株 (42,900株)
東京製鐵	292,700	829.00	242,648,300	貸付株式数 26,600株 (26,600株)
共英製鋼	61,600	2,034.00	125,294,400	
大和工業	128,800	2,516.00	324,060,800	
東京鐵鋼	103,000	563.00	57,989,000	
大阪製鐵	36,300	2,122.00	77,028,600	
淀川製鋼所	400,000	491.00	196,400,000	
東洋鋼鈑	138,400	564.00	78,057,600	
丸一鋼管	177,400	2,986.00	529,716,400	貸付株式数 67,100株
モリ工業	84,000	367.00	30,828,000	
大同特殊鋼	969,000	472.00	457,368,000	
日本高周波	227,000	109.00	24,743,000	貸付株式数 97,000株
日本冶金工	452,000	216.00	97,632,000	貸付株式数 193,000株
山陽特殊製鋼	344,000	503.00	173,032,000	
愛知製鋼	341,000	518.00	176,638,000	
日立金属	588,700	1,721.00	1,013,152,700	
日本金属	135,000	146.00	19,710,000	
大平洋金属	369,000	352.00	129,888,000	貸付株式数 112,000株 (8,000株)
新日本電工	327,300	271.00	88,698,300	貸付株式数 52,500株 (52,500株)
栗本鉄工所	299,000	246.00	73,554,000	
虹 技	73,000	195.00	14,235,000	貸付株式数 28,000株
日本鑄鉄管	50,000	217.00	10,850,000	
日本製鋼所	825,000	474.00	391,050,000	貸付株式数 322,000株 (225,000株)
三菱製鋼	376,000	245.00	92,120,000	
日亜鋼業	79,400	298.00	23,661,200	
日本精線	39,000	546.00	21,294,000	
大紀アルミニウム	89,000	373.00	33,197,000	
日本軽金属HD	1,403,000	197.00	276,391,000	
三井金属	1,573,000	297.00	467,181,000	
東邦亜鉛	326,000	356.00	116,056,000	
三菱マテリアル	3,610,000	435.00	1,570,350,000	貸付株式数 483,000株
住友鋳山	1,597,000	1,728.00	2,759,616,000	

DOWAホールディングス	691,000	1,122.00	775,302,000	
古河機金	892,000	218.00	194,456,000	貸付株式数 89,000株 (89,000株)
エス・サイエンス	280,200	49.00	13,729,800	
大阪チタニウム	55,300	3,025.00	167,282,500	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
東邦チタニウム	97,800	1,256.00	122,836,800	貸付株式数 8,900株 (1,200株)
UACJ	661,000	284.00	187,724,000	
古河電工	1,690,000	203.00	343,070,000	
住友電工	2,179,600	1,831.00	3,990,847,600	
フジクラ	805,000	649.00	522,445,000	
昭和電線HLDGS	635,000	90.00	57,150,000	貸付株式数 98,000株
東京特殊電線	7,400	1,212.00	8,968,800	
タツタ電線	108,300	493.00	53,391,900	
沖電線	54,000	266.00	14,364,000	貸付株式数 20,000株
カナレ電気	8,200	2,013.00	16,506,600	貸付株式数 2,400株
平河ヒューテック	12,200	1,326.00	16,177,200	貸付株式数 4,800株
リョービ	323,000	462.00	149,226,000	
アーステイ	67,000	996.00	66,732,000	
アサヒHD	86,200	1,969.00	169,727,800	
東洋製罐グループHD	411,000	1,879.00	772,269,000	貸付株式数 161,500株
ホッカンホールディングス	125,000	278.00	34,750,000	
コロナ	30,200	1,200.00	36,240,000	
横河ブリッジHLDGS	109,500	1,177.00	128,881,500	
OSJBHD	83,600	239.00	19,980,400	貸付株式数 30,000株 (10,900株)
駒井ハルテック	93,000	240.00	22,320,000	
高田機工	44,000	231.00	10,164,000	
三和ホールディングス	544,100	992.00	539,747,200	
文化シャツタ-	160,800	903.00	145,202,400	
三協立山	75,500	1,923.00	145,186,500	貸付株式数 29,400株
アルインコ	24,400	1,086.00	26,498,400	
東洋シャツタ-	12,800	947.00	12,121,600	
LIXILグループ	859,400	2,461.00	2,114,983,400	貸付株式数 49,700株
日本フィルコン	41,600	517.00	21,507,200	
ノーリツ	113,300	1,908.00	216,176,400	
長府製作所	61,700	2,712.00	167,330,400	
リンナイ	107,500	9,110.00	979,325,000	

ユニプレス	106,200	2,357.00	250,313,400	貸付株式数 10,000株 (10,000株)
ダイニチ工業	29,400	735.00	21,609,000	
日東精工	75,000	329.00	24,675,000	
三洋工業	65,000	214.00	13,910,000	
岡 部	114,900	957.00	109,959,300	
ジーテクト	51,400	1,145.00	58,853,000	
中国工業	8,000	805.00	6,440,000	
東 プ レ	111,200	2,140.00	237,968,000	貸付株式数 9,800株 (9,800株)
高周波熱錬	99,700	825.00	82,252,500	
東京製綱	391,000	228.00	89,148,000	貸付株式数 57,000株 (57,000株)
サンコール	33,000	674.00	22,242,000	
モリテックスチル	29,000	319.00	9,251,000	貸付株式数 8,000株
パイオラックス	29,200	6,930.00	202,356,000	
日本発条	502,500	1,251.00	628,627,500	貸付株式数 49,800株
中央発條	67,000	315.00	21,105,000	
アドバネクス	98,000	175.00	17,150,000	
三浦工業	258,000	1,378.00	355,524,000	
タ ク マ	185,000	735.00	135,975,000	
テクノプロ・ホールディング グ	81,200	3,165.00	256,998,000	
リブセンス	34,600	572.00	19,791,200	貸付株式数 13,200株
ジャパンマテリアル	23,900	1,711.00	40,892,900	貸付株式数 9,400株 (4,100株)
ベクトル	11,100	1,716.00	19,047,600	
ウチヤマホールディングス	33,100	489.00	16,185,900	
サクセスホールディングス	5,200	1,232.00	6,406,400	
キャリアリンク	6,300	1,839.00	11,585,700	貸付株式数 1,900株
アサンテ	17,200	1,549.00	26,642,800	貸付株式数 6,800株
N・フィールド	13,300	1,751.00	23,288,300	貸付株式数 5,300株
M&Aキャピタルパート ナー	1,300	3,165.00	4,114,500	
E R Iホールディングス	13,200	901.00	11,893,200	貸付株式数 1,300株
アビスト	5,800	1,399.00	8,114,200	
ウィルグループ	5,400	1,713.00	9,250,200	
リクルートホールディング ス	873,000	3,580.00	3,125,340,000	
ツ ガ ミ	151,000	597.00	90,147,000	貸付株式数 11,000株

オークマ	376,000	1,276.00	479,776,000	
東芝機械	315,000	520.00	163,800,000	
アマダホールディングス	862,100	1,220.00	1,051,762,000	
アイダエンジニア	125,700	1,236.00	155,365,200	
滝澤鉄工所	164,000	229.00	37,556,000	
富士機械製造	188,800	1,194.00	225,427,200	
牧野フライス	288,000	1,185.00	341,280,000	貸付株式数 113,000株 (77,000株)
オーエスジー	263,400	2,538.00	668,509,200	
ダイジェット	60,000	211.00	12,660,000	
旭ダイヤモンド	158,400	1,286.00	203,702,400	貸付株式数 56,800株
D M G 森精機	365,000	2,248.00	820,520,000	
ソデック	110,000	924.00	101,640,000	貸付株式数 43,200株
ディスコ	67,400	9,390.00	632,886,000	
日東工器	33,700	2,608.00	87,889,600	
パンチ工業	20,300	1,169.00	23,730,700	
豊田自動織機	503,200	6,460.00	3,250,672,000	
豊和工業	32,300	724.00	23,385,200	
大阪機工	224,000	174.00	38,976,000	
石川製作所	128,000	99.00	12,672,000	貸付株式数 83,000株
東洋機械金属	39,100	484.00	18,924,400	貸付株式数 5,200株
津田駒工業	126,000	134.00	16,884,000	貸付株式数 46,000株
エンシュウ	128,000	113.00	14,464,000	貸付株式数 51,000株
島精機製作所	81,600	1,854.00	151,286,400	貸付株式数 3,400株 (3,400株)
日阪製作所	73,000	1,052.00	76,796,000	
やまびこ	22,700	5,010.00	113,727,000	
ペガサスマシン製造	49,400	567.00	28,009,800	貸付株式数 14,500株
ナプテスコ	352,100	2,861.00	1,007,358,100	
三井海洋開発	58,700	1,856.00	108,947,200	貸付株式数 22,700株 (5,900株)
レオン自動機	43,000	540.00	23,220,000	
S M C	173,400	34,380.00	5,961,492,000	
新川	47,300	924.00	43,705,200	貸付株式数 18,500株
ホソカワミクロン	88,000	561.00	49,368,000	
ユニオンツール	25,000	3,735.00	93,375,000	
オイレス工業	68,500	2,173.00	148,850,500	
日精エーエスビー	21,100	2,170.00	45,787,000	貸付株式数 6,700株
サト - ホールディングス	71,900	3,150.00	226,485,000	
日本エアーテック	15,500	673.00	10,431,500	貸付株式数 5,700株

日精樹脂工業	41,800	1,041.00	43,513,800	
ワイエイシイ	23,200	978.00	22,689,600	
小松製作所	2,835,100	2,269.00	6,432,841,900	貸付株式数 1,330,000株 (1,330,000株)
住友重機械	1,582,000	652.00	1,031,464,000	貸付株式数 53,000株 (53,000株)
日立建機	258,400	2,007.00	518,608,800	貸付株式数 101,500株
日 工	72,000	424.00	30,528,000	
巴工業	23,500	1,650.00	38,775,000	貸付株式数 2,300株
井関農機	592,000	226.00	133,792,000	貸付株式数 232,000株 (149,000株)
T O W A	46,400	1,018.00	47,235,200	
丸山製作所	116,000	223.00	25,868,000	貸付株式数 46,000株
北川鉄工所	265,000	296.00	78,440,000	
シンニッタン	56,600	581.00	32,884,600	
クボタ	2,780,000	1,977.00	5,496,060,000	貸付株式数 1,052,000株 (1,052,000株)
荏原実業	15,700	1,407.00	22,089,900	貸付株式数 6,200株
東洋エンジニア	298,000	299.00	89,102,000	貸付株式数 117,000株 (86,000株)
三菱化工機	173,000	357.00	61,761,000	貸付株式数 67,000株
月島機械	101,800	1,237.00	125,926,600	
帝国電機製作所	38,500	980.00	37,730,000	
東京機械	217,000	75.00	16,275,000	
新東工業	131,100	1,086.00	142,374,600	
渋谷工業	47,400	2,042.00	96,790,800	貸付株式数 18,000株 (4,200株)
アイチ コーポレーション	81,800	728.00	59,550,400	
小森コーポレーション	140,600	1,478.00	207,806,800	
鶴見製作所	42,600	1,846.00	78,639,600	
住友精密	83,000	455.00	37,765,000	貸付株式数 8,000株
酒井重工業	100,000	238.00	23,800,000	
荏原製作所	1,198,000	557.00	667,286,000	
石井鉄工所	77,000	208.00	16,016,000	貸付株式数 5,000株
西島製作所	54,900	905.00	49,684,500	貸付株式数 31,200株
北越工業	55,400	847.00	46,923,800	貸付株式数 21,800株
千代田化工建	440,000	1,080.00	475,200,000	貸付株式数 172,000株
ダイキン工業	804,700	8,489.00	6,831,098,300	貸付株式数 10,000株
オルガノ	100,000	508.00	50,800,000	
ト - ヨ - カネツ	333,000	215.00	71,595,000	

栗田工業	327,100	2,798.00	915,225,800	貸付株式数 12,700株 (12,700株)
椿本チエイン	296,000	1,088.00	322,048,000	
大同工業	104,000	234.00	24,336,000	
日本コンベヤ	164,000	186.00	30,504,000	貸付株式数 65,000株 (5,000株)
日機装	179,100	1,190.00	213,129,000	
木村化工機	51,700	489.00	25,281,300	
新興プランテック	126,400	1,045.00	132,088,000	
アネスト岩田	85,700	737.00	63,160,900	
ダイフク	273,100	1,819.00	496,768,900	貸付株式数 107,200株 (21,800株)
サムコ	6,900	1,153.00	7,955,700	貸付株式数 3,000株
加藤製作所	108,000	685.00	73,980,000	
油研工業	99,000	256.00	25,344,000	
タダノ	267,000	1,760.00	469,920,000	
フジテック	160,900	1,380.00	222,042,000	
C K D	154,900	1,319.00	204,313,100	貸付株式数 13,500株 (13,500株)
キトー	60,300	1,162.00	70,068,600	貸付株式数 22,800株
平和	119,900	2,413.00	289,318,700	貸付株式数 2,200株
理想科学工業	67,100	2,228.00	149,498,800	
SANKYO	153,700	4,345.00	667,826,500	貸付株式数 45,700株 (45,700株)
日本金銭機械	49,700	1,606.00	79,818,200	貸付株式数 33,800株
マースエンジニアリング	31,200	2,066.00	64,459,200	
福島工業	30,300	2,251.00	68,205,300	
オーイズミ	18,300	762.00	13,944,600	貸付株式数 7,300株 (4,600株)
ダイコク電機	22,800	1,728.00	39,398,400	
竹内製作所	23,100	7,000.00	161,700,000	
アマノ	184,100	1,637.00	301,371,700	
JUKI	81,800	1,486.00	121,554,800	
サンデンホールディングス	337,000	525.00	176,925,000	貸付株式数 15,000株 (15,000株)
蛇の目マシン	522,000	122.00	63,684,000	
ブラザー工業	714,300	1,655.00	1,182,166,500	貸付株式数 280,200株
マックス	79,000	1,255.00	99,145,000	
モリタホールディングス	95,500	1,153.00	110,111,500	

グローリー	176,700	3,405.00	601,663,500	貸付株式数 20,000株 (20,000株)
新晃工業	38,500	1,235.00	47,547,500	
大和冷機工業	81,300	769.00	62,519,700	
セガサミーホールディングス	593,800	1,491.00	885,355,800	
日本ピストンリング	216,000	212.00	45,792,000	貸付株式数 44,000株 (2,000株)
リケン	238,000	444.00	105,672,000	
T P R	61,600	3,485.00	214,676,000	
ホシザキ電機	121,000	7,520.00	909,920,000	
大豊工業	43,900	1,488.00	65,323,200	
日本精工	1,135,000	1,720.00	1,952,200,000	
N T N	1,271,000	712.00	904,952,000	
ジェイテクト	589,000	2,155.00	1,269,295,000	
不二越	500,000	664.00	332,000,000	
ミネベア	820,000	1,879.00	1,540,780,000	
日本トムソン	172,000	629.00	108,188,000	貸付株式数 6,000株
T H K	367,500	2,485.00	913,237,500	
ユーシン精機	24,500	2,638.00	64,631,000	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
前澤給装工業	20,900	1,571.00	32,833,900	
イーグル工業	76,800	2,509.00	192,691,200	
前澤工業	40,400	412.00	16,644,800	貸付株式数 15,800株
日本ピラ - 工業	60,200	1,009.00	60,741,800	
キッツ	247,500	582.00	144,045,000	
日立	13,269,000	756.50	10,037,998,500	
東芝	11,633,000	377.20	4,387,967,600	貸付株式数 4,572,000株
三菱電機	5,526,000	1,470.50	8,125,983,000	
富士電機	1,537,000	506.00	777,722,000	
東洋電機製造	107,000	404.00	43,228,000	貸付株式数 41,000株
安川電機	676,000	1,510.00	1,020,760,000	貸付株式数 264,200株
シンフォニアテクノロジー	383,000	226.00	86,558,000	貸付株式数 44,000株
明電舎	495,000	426.00	210,870,000	
オリジン電気	73,000	395.00	28,835,000	
山洋電気	109,000	891.00	97,119,000	
デンヨー	47,100	1,977.00	93,116,700	
日立工機	147,800	954.00	141,001,200	貸付株式数 3,300株 (3,300株)

三桜工業	70,000	792.00	55,440,000		
マキタ	360,300	6,760.00	2,435,628,000		
東芝テック	396,000	616.00	243,936,000		
芝浦メカトロニクス	81,000	262.00	21,222,000	貸付株式数	24,000株
マブチモーター	158,200	7,160.00	1,132,712,000		
日本電産	607,600	9,220.00	5,602,072,000	貸付株式数	97,400株
東光高岳	27,900	1,572.00	43,858,800	貸付株式数	10,000株 (10,000株)
宮越ホールディングス	17,000	581.00	9,877,000	貸付株式数	6,300株
ダイヘン	302,000	597.00	180,294,000	貸付株式数	50,000株 (50,000株)
田淵電機	62,500	1,083.00	67,687,500	貸付株式数	17,800株
ヤーマン	6,300	1,531.00	9,645,300	貸付株式数	2,400株 (1,400株)
JVCケンウッド	405,400	289.00	117,160,600	貸付株式数	158,800株
ミマキエンジニアリング	33,000	831.00	27,423,000	貸付株式数	12,900株
第一精工	22,400	1,786.00	40,006,400		
日新電機	128,600	788.00	101,336,800	貸付株式数	16,000株 (16,000株)
大崎電気	87,000	645.00	56,115,000	貸付株式数	41,000株
オムロン	596,800	5,030.00	3,001,904,000		
日東工業	87,600	2,721.00	238,359,600		
I D E C	65,600	1,060.00	69,536,000		
不二電機工業	4,600	1,513.00	6,959,800	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
ジーエス・ユアサ コーポ	1,064,000	460.00	489,440,000	貸付株式数	418,000株
サクサホールディングス	125,000	282.00	35,250,000	貸付株式数	50,000株
メルコホールディングス	30,500	2,156.00	65,758,000	貸付株式数	11,500株 (3,200株)
テクノメディカ	11,100	2,731.00	30,314,100		
日本電気	7,151,000	366.00	2,617,266,000		
富士通	5,328,000	669.40	3,566,563,200		
沖電気	1,945,000	249.00	484,305,000		
岩崎通信機	242,000	90.00	21,780,000		
電気興業	142,000	550.00	78,100,000		
サンケン電気	280,000	712.00	199,360,000	貸付株式数	110,000株
ナカヨ	47,000	353.00	16,591,000		
アイホン	31,900	2,026.00	64,629,400		
ルネサスエレクトロニクス	285,900	775.00	221,572,500	貸付株式数	106,300株
セイコーエプソン	754,300	2,169.00	1,636,076,700		

ワコム	435,100	446.00	194,054,600	貸付株式数	170,600株
アルバック	93,200	1,750.00	163,100,000		
アクセル	25,500	1,731.00	44,140,500	貸付株式数	4,000株 (4,000株)
E I Z O	49,900	2,721.00	135,777,900	貸付株式数	1,900株
ジャパンディスプレイ	1,135,100	406.00	460,850,600	貸付株式数	445,400株
日本信号	152,400	1,273.00	194,005,200		
京三製作所	116,000	368.00	42,688,000		
能美防災	73,100	1,369.00	100,073,900		
ホーチキ	39,400	924.00	36,405,600	貸付株式数	15,400株
エレコム	23,100	2,700.00	62,370,000		
日本無線	106,000	403.00	42,718,000		
パナソニック	6,734,300	1,574.00	10,599,788,200		
シャープ	4,670,000	172.00	803,240,000	貸付株式数	1,835,000株
アンリツ	331,800	794.00	263,449,200		
富士通ゼネラル	153,000	1,477.00	225,981,000		
日立国際電気	130,000	1,676.00	217,880,000		
ソ ニ ー	3,631,100	3,420.00	12,418,362,000	貸付株式数	262,500株
T D K	333,500	8,660.00	2,888,110,000		
帝国通信工業	117,000	214.00	25,038,000		
ミツミ電機	195,200	776.00	151,475,200	貸付株式数	73,800株
タムラ製作所	213,000	452.00	96,276,000		
アルプス電気	436,100	3,450.00	1,504,545,000		
池上通信機	171,000	162.00	27,702,000	貸付株式数	66,000株
パイオニア	830,300	223.00	185,156,900		
日本電波工業	48,900	891.00	43,569,900	貸付株式数	18,600株
鈴木	12,000	696.00	8,352,000		
日本トリム	12,000	3,065.00	36,780,000	貸付株式数	4,800株 (4,800株)
ローランド ディー . ジー .	22,200	3,145.00	69,819,000		
日本コロムビア	16,900	404.00	6,827,600	貸付株式数	6,600株
フオスタ - 電機	64,700	2,495.00	161,426,500		
クラリオン	291,000	326.00	94,866,000	貸付株式数	112,000株
S M K	147,000	517.00	75,999,000	貸付株式数	3,000株 (3,000株)
ヨコオ	42,600	776.00	33,057,600		
東 光	111,000	325.00	36,075,000	貸付株式数	38,000株 (10,000株)

ティアック	298,000	45.00	13,410,000	貸付株式数 117,000株 (6,000株)
ホシデン	167,500	702.00	117,585,000	
ヒロセ電機	92,500	15,770.00	1,458,725,000	
日本航空電子	143,000	2,870.00	410,410,000	
T O A	59,300	1,305.00	77,386,500	
日立マクセル	109,800	1,875.00	205,875,000	
古野電気	65,700	832.00	54,662,400	貸付株式数 24,800株
ユニデンホールディングス	137,000	214.00	29,318,000	
アルパイン	130,700	2,069.00	270,418,300	
スミダコーポレーション	45,200	855.00	38,646,000	貸付株式数 14,000株
アイコム	30,600	2,909.00	89,015,400	
リオン	21,000	1,818.00	38,178,000	
船井電機	54,300	1,380.00	74,934,000	
横河電機	554,900	1,412.00	783,518,800	貸付株式数 216,900株
新電元工業	213,000	562.00	119,706,000	貸付株式数 34,000株 (34,000株)
アズビル	180,400	3,035.00	547,514,000	貸付株式数 4,900株 (4,900株)
東亜ディーケーケー	23,000	546.00	12,558,000	
日本光電工業	230,900	2,750.00	634,975,000	
チノー	19,700	1,225.00	24,132,500	
共和電業	67,400	487.00	32,823,800	
日本電子材料	23,700	714.00	16,921,800	貸付株式数 10,700株
堀場製作所	102,200	4,920.00	502,824,000	
アドバンテスト	376,700	1,231.00	463,717,700	貸付株式数 148,000株
小野測器	26,800	968.00	25,942,400	
エスペック	61,200	1,375.00	84,150,000	
パナソニックデバイス	47,500	797.00	37,857,500	
キーエンス	124,600	63,460.00	7,907,116,000	
日置電機	28,900	2,647.00	76,498,300	
シスメックス	428,200	7,170.00	3,070,194,000	
メガチップス	56,700	1,377.00	78,075,900	
O B A R A G R O U P	35,800	6,070.00	217,306,000	
イマジカ・ロボットHD	37,600	532.00	20,003,200	貸付株式数 14,600株
澤藤電機	31,000	228.00	7,068,000	
デンソー	1,365,200	5,775.00	7,884,030,000	
コーセル	80,300	1,374.00	110,332,200	貸付株式数 12,500株
新日本無線	35,000	702.00	24,570,000	
オプテックス	38,200	2,565.00	97,983,000	

千代田インテグレ	29,000	2,854.00	82,766,000	
レーザーテック	55,100	1,539.00	84,798,900	
スタンレー電気	396,600	2,386.00	946,287,600	
岩崎電気	171,000	254.00	43,434,000	
ウシオ電機	335,400	1,486.00	498,404,400	貸付株式数 89,500株 (89,500株)
岡谷電機	29,500	411.00	12,124,500	
ヘリオステクノH	49,600	408.00	20,236,800	貸付株式数 19,400株
日本セラミック	31,600	1,708.00	53,972,800	貸付株式数 12,400株
遠藤照明	25,400	1,329.00	33,756,600	貸付株式数 8,100株
日本デジタル研究所	45,800	1,625.00	74,425,000	
古河電池	34,000	759.00	25,806,000	貸付株式数 11,000株
双信電機	26,800	401.00	10,746,800	
山一電機	63,900	1,172.00	74,890,800	
図 研	39,900	1,158.00	46,204,200	
日本電子	235,000	514.00	120,790,000	貸付株式数 20,000株 (20,000株)
カ シ オ	553,900	2,419.00	1,339,884,100	貸付株式数 217,200株 (9,300株)
ファナック	575,300	23,765.00	13,672,004,500	
日本シイエムケイ	140,700	296.00	41,647,200	
エンプラス	25,000	4,875.00	121,875,000	
大真空	92,000	268.00	24,656,000	貸付株式数 31,000株 (9,000株)
ロ ー ム	272,400	7,510.00	2,045,724,000	
浜松ホトニクス	431,200	3,270.00	1,410,024,000	
三井ハイテック	72,900	779.00	56,789,100	
新光電気工業	208,200	813.00	169,266,600	
京 セ ラ	907,100	6,240.00	5,660,304,000	
協栄産業	59,000	200.00	11,800,000	貸付株式数 23,000株
太陽誘電	289,200	1,569.00	453,754,800	
村田製作所	579,800	19,180.00	11,120,564,000	貸付株式数 167,900株 (167,900株)
ユーシン	67,800	692.00	46,917,600	貸付株式数 39,700株 (2,400株)
双葉電子工業	93,200	2,082.00	194,042,400	
日東電工	447,200	9,373.00	4,191,605,600	
北陸電気工業	238,000	168.00	39,984,000	
東海理化電機	145,500	2,847.00	414,238,500	貸付株式数 7,000株 (7,000株)

ニチコン	173,000	919.00	158,987,000	
日本ケミコン	441,000	356.00	156,996,000	
K O A	76,400	1,203.00	91,909,200	
三井造船	2,139,000	206.00	440,634,000	貸付株式数 427,000株 (427,000株)
日立造船	432,000	678.00	292,896,000	
三菱重工業	9,262,000	695.90	6,445,425,800	
川崎重工業	4,013,000	543.00	2,179,059,000	
I H I	3,981,000	533.00	2,121,873,000	
名村造船所	153,900	979.00	150,668,100	
サノヤホールディングス	67,100	240.00	16,104,000	
日本車輛	201,000	328.00	65,928,000	貸付株式数 90,000株
ニチュ三菱フォークリフト	63,600	561.00	35,679,600	貸付株式数 7,800株 (7,800株)
近畿車輛	75,000	342.00	25,650,000	貸付株式数 29,000株
F P G	161,000	890.00	143,290,000	貸付株式数 62,900株
島根銀行	10,500	1,525.00	16,012,500	
じもとホールディングス	391,300	211.00	82,564,300	
全国保証	141,800	4,325.00	613,285,000	
足利ホールディングス	343,100	503.00	172,579,300	
東京T YフィナンシャルG	70,200	3,940.00	276,588,000	
日産自動車	7,756,700	1,188.00	9,214,959,600	貸付株式数 228,900株
いすゞ自動車	1,746,900	1,553.50	2,713,809,150	
トヨタ自動車	7,624,000	7,925.00	60,420,200,000	
日野自動車	788,700	1,402.00	1,105,757,400	
三菱自動車工業	2,025,300	1,016.00	2,057,704,800	貸付株式数 61,700株
エフテック	31,700	1,202.00	38,103,400	貸付株式数 11,400株
レシップホールディングス	16,500	854.00	14,091,000	貸付株式数 6,600株
G M B	7,300	1,238.00	9,037,400	貸付株式数 1,900株
ファルテック	6,700	1,495.00	10,016,500	
武蔵精密工業	58,900	2,129.00	125,398,100	貸付株式数 21,200株 (21,200株)
日産車体	242,800	1,535.00	372,698,000	貸付株式数 22,800株 (22,800株)
新明和工業	223,000	1,093.00	243,739,000	
極東開発工業	102,700	1,263.00	129,710,100	
日信工業	101,100	1,987.00	200,885,700	貸付株式数 7,600株 (7,600株)
トピー工業	447,000	290.00	129,630,000	
ティラド	215,000	226.00	48,590,000	

曙ブレーキ	233,300	383.00	89,353,900	貸付株式数	88,300株
タチエス	86,600	1,665.00	144,189,000		
N O K	267,400	3,625.00	969,325,000		
フタバ産業	167,600	544.00	91,174,400		
カヤバ工業	619,000	401.00	248,219,000		
シロキ工業	109,000	352.00	38,368,000		
市光工業	118,000	277.00	32,686,000	貸付株式数	43,000株 (43,000株)
大同メタル工業	77,100	1,141.00	87,971,100		
プレス工業	273,900	533.00	145,988,700	貸付株式数	107,600株
ミクニ	52,000	541.00	28,132,000		
カルソニックカンセイ	420,000	830.00	348,600,000		
太平洋工業	112,500	1,146.00	128,925,000	貸付株式数	44,200株
ケーヒン	126,200	1,608.00	202,929,600	貸付株式数	9,900株 (9,900株)
河西工業	67,800	1,368.00	92,750,400		
アイシン精機	505,600	4,935.00	2,495,136,000		
富士機工	63,900	689.00	44,027,100		
マ ッ ダ	1,646,800	2,388.50	3,933,381,800	貸付株式数	410,000株
ダイハツ	659,600	1,691.00	1,115,383,600	貸付株式数	259,200株 (44,100株)
今仙電機製作所	46,100	1,226.00	56,518,600	貸付株式数	2,500株 (2,500株)
本田技研	4,972,900	3,831.50	19,053,666,350		
スズキ	1,155,200	4,000.00	4,620,800,000		
富士重工業	1,880,500	4,414.50	8,301,467,250		
安永	16,700	572.00	9,552,400	貸付株式数	6,300株
ヤマハ発動機	780,400	2,628.00	2,050,891,200		
ショーワ	129,500	1,147.00	148,536,500		
小糸製作所	331,100	4,555.00	1,508,160,500		
T B K	70,700	533.00	37,683,100		
エクセディ	75,000	2,910.00	218,250,000		
ミツバ	101,700	2,991.00	304,184,700		
豊田合成	178,500	2,668.00	476,238,000		
愛三工業	84,900	1,109.00	94,154,100		
盟和産業	39,000	139.00	5,421,000		
ヨロズ	50,300	2,458.00	123,637,400		
エフ・シー・シー	81,200	1,789.00	145,266,800	貸付株式数	22,300株 (22,300株)
新家工業	105,000	169.00	17,745,000		

シマノ	238,600	16,550.00	3,948,830,000		
タカタ	99,900	1,229.00	122,777,100	貸付株式数	39,200株
テイ・エス テック	116,700	3,120.00	364,104,000	貸付株式数	3,700株 (3,700株)
ジャムコ	20,700	3,640.00	75,348,000		
小野建	46,600	1,136.00	52,937,600		
はるやま商事	22,600	735.00	16,611,000		
佐鳥電機	42,700	830.00	35,441,000		
カップ・クリエイトHD	85,000	1,157.00	98,345,000	貸付株式数	33,400株 (32,900株)
エコトレーディング	11,100	677.00	7,514,700	貸付株式数	4,400株
伯東	37,300	1,414.00	52,742,200		
コンドーテック	39,600	772.00	30,571,200		
中山福	31,200	856.00	26,707,200	貸付株式数	12,200株
ライトオン	40,600	990.00	40,194,000	貸付株式数	500株 (500株)
ナガイレーベン	78,700	2,450.00	192,815,000		
ジーンズメイト	15,800	260.00	4,108,000	貸付株式数	6,300株
三菱食品	59,800	2,589.00	154,822,200		
良品計画	67,400	25,240.00	1,701,176,000	貸付株式数	5,600株 (5,600株)
三城ホールディングス	67,300	464.00	31,227,200		
松田産業	39,700	1,412.00	56,056,400		
メディパルHD	545,400	1,875.00	1,022,625,000		
アドヴァン	27,700	1,719.00	47,616,300		
SPK	10,900	2,291.00	24,971,900		
萩原電気	13,400	1,990.00	26,666,000	貸付株式数	4,000株
アルビス	11,600	2,056.00	23,849,600		
アズワン	39,000	4,055.00	158,145,000		
スズデン	15,900	901.00	14,325,900	貸付株式数	6,200株
尾家産業	15,900	881.00	14,007,900		
シモジマ	33,300	1,011.00	33,666,300		
ドウシシャ	70,500	2,071.00	146,005,500		
小津産業	9,900	1,965.00	19,453,500	貸付株式数	3,900株
コナカ	64,100	674.00	43,203,400		
高速	32,400	882.00	28,576,800		
ハウス ローゼ	5,400	1,417.00	7,651,800		
G-7ホールディングス	10,500	1,505.00	15,802,500		
たけびし	17,200	1,076.00	18,507,200	貸付株式数	6,800株
イオン北海道	34,400	660.00	22,704,000	貸付株式数	9,500株

コジマ	80,200	366.00	29,353,200	
ヒマラヤ	15,200	1,141.00	17,343,200	
コーナン商事	82,900	1,508.00	125,013,200	
黒田電気	93,400	2,242.00	209,402,800	
ネットワンシステムズ	221,300	802.00	177,482,600	
エコス	17,100	1,003.00	17,151,300	
ワタミ	64,400	1,012.00	65,172,800	貸付株式数 41,200株
マルシェ	11,800	888.00	10,478,400	貸付株式数 5,900株
ドンキホーテホールディング	352,000	5,050.00	1,777,600,000	貸付株式数 69,100株
丸文	47,300	914.00	43,232,200	
西松屋チェーン	107,500	1,188.00	127,710,000	
ゼンショーホールディングス	280,500	1,134.00	318,087,000	貸付株式数 105,800株
ハピネット	33,000	1,235.00	40,755,000	
幸楽苑ホールディングス	34,200	1,540.00	52,668,000	貸付株式数 3,400株 (3,400株)
ハークスレイ	13,700	1,006.00	13,782,200	
橋本総業	9,100	1,358.00	12,357,800	貸付株式数 3,600株
サイゼリヤ	88,700	2,722.00	241,441,400	
エクセル	24,900	1,375.00	34,237,500	貸付株式数 9,800株
V Tホールディングス	169,000	690.00	116,610,000	
マルカキカイ	16,000	1,929.00	30,864,000	
アルゴグラフィックス	22,700	1,863.00	42,290,100	
魚力	14,200	2,296.00	32,603,200	
ガリバーインターナショナル	164,600	1,133.00	186,491,800	貸付株式数 64,400株 (19,400株)
日本エム・ディ・エム	44,700	517.00	23,109,900	貸付株式数 17,500株
ポプラ	12,200	546.00	6,661,200	貸付株式数 6,200株
ユナイテッドアローズ	71,300	4,290.00	305,877,000	
進和	32,200	2,112.00	68,006,400	
エスケイジャパン	11,600	229.00	2,656,400	貸付株式数 4,600株
ダイトエレクトロン	24,900	845.00	21,040,500	貸付株式数 11,200株
ハイデイ日高	41,300	2,904.00	119,935,200	
シークス	34,600	3,010.00	104,146,000	貸付株式数 13,600株 (5,000株)
京都きもの友禅	31,900	1,011.00	32,250,900	貸付株式数 12,500株 (3,300株)
コロワイド	180,800	1,841.00	332,852,800	貸付株式数 50,100株 (21,900株)

田中商事	15,100	741.00	11,189,100	
オーハシテクニカ	33,400	1,541.00	51,469,400	
壱番屋	24,700	4,975.00	122,882,500	貸付株式数 2,600株
白銅	15,600	1,434.00	22,370,400	
トップカルチャー	19,600	511.00	10,015,600	貸付株式数 6,600株
P L A N T	12,300	1,448.00	17,810,400	貸付株式数 3,300株
スギホールディングス	97,800	6,090.00	595,602,000	
島津製作所	660,000	1,787.00	1,179,420,000	
J M S	93,000	298.00	27,714,000	貸付株式数 37,000株
クボテック	10,600	849.00	8,999,400	貸付株式数 4,000株
モリテックス	10,700	238.00	2,546,600	貸付株式数 1,100株
長野計器	35,300	768.00	27,110,400	
ブイ・テクノロジー	9,800	3,635.00	35,623,000	貸付株式数 3,800株
スター精密	104,900	1,863.00	195,428,700	
東京計器	173,000	251.00	43,423,000	
愛知時計	66,000	356.00	23,496,000	
オーバル	52,500	284.00	14,910,000	貸付株式数 20,600株
東京精密	99,400	2,486.00	247,108,400	
マニー	15,100	8,180.00	123,518,000	
ニコン	1,031,700	1,426.00	1,471,204,200	貸付株式数 405,500株
トプコン	166,400	2,734.00	454,937,600	
オリンパス	823,100	4,450.00	3,662,795,000	
理研計器	47,800	1,299.00	62,092,200	
S C R E E Nホールディングス	510,000	723.00	368,730,000	
キヤノン電子	49,900	2,306.00	115,069,400	
タムロン	42,200	2,516.00	106,175,200	貸付株式数 16,500株 (16,500株)
H O Y A	1,315,000	4,794.00	6,304,110,000	
ノーリツ鋼機	48,700	661.00	32,190,700	
エー・アンド・デイ	49,100	478.00	23,469,800	貸付株式数 4,200株
キヤノン	3,203,900	3,864.00	12,379,869,600	
リ コ ー	1,661,600	1,209.50	2,009,705,200	
シチズンホールディングス	680,200	828.00	563,205,600	
リズム時計	241,000	176.00	42,416,000	
大研医器	38,200	1,130.00	43,166,000	貸付株式数 12,000株
パラマウントベッドHD	58,300	3,550.00	206,965,000	貸付株式数 22,000株 (22,000株)
トランザクション	4,000	1,296.00	5,184,000	
S H O B I	16,700	409.00	6,830,300	

前田工織	60,800	1,037.00	63,049,600	貸付株式数 9,700株 (9,700株)
永大産業	71,000	447.00	31,737,000	
アートネイチャー	39,800	1,033.00	41,113,400	貸付株式数 12,000株
ダンロップスポーツ	34,800	1,153.00	40,124,400	
バンダイナムコHLDGS	609,500	2,352.00	1,433,544,000	
共立印刷	100,100	301.00	30,130,100	
フランスベッドHLDGS	385,000	184.00	70,840,000	
マーベラス	90,800	1,419.00	128,845,200	貸付株式数 35,600株 (4,600株)
パイロットコーポレーション	94,600	4,675.00	442,255,000	
萩原工業	10,500	2,001.00	21,010,500	
エイベックス・グループHD	108,100	2,006.00	216,848,600	
トッパン・フォームズ	98,700	1,600.00	157,920,000	
フジシールインターナショナル	67,100	3,510.00	235,521,000	貸付株式数 10,600株 (10,600株)
タカラトミー	198,300	671.00	133,059,300	貸付株式数 77,800株 (11,800株)
廣済堂	50,000	562.00	28,100,000	
AS-MEエステール	13,200	770.00	10,164,000	
アーク	174,300	123.00	21,438,900	貸付株式数 68,400株
レック	19,600	1,335.00	26,166,000	
タカノ	24,300	814.00	19,780,200	
プロネクサス	51,600	767.00	39,577,200	
ホクシン	43,300	137.00	5,932,100	貸付株式数 16,400株
ウッドワン	85,000	273.00	23,205,000	
大建工業	216,000	311.00	67,176,000	
きもと	103,400	282.00	29,158,800	貸付株式数 37,200株 (37,200株)
凸版印刷	1,560,000	1,006.00	1,569,360,000	
大日本印刷	1,635,000	1,267.50	2,072,362,500	
図書印刷	81,000	425.00	34,425,000	貸付株式数 31,000株 (10,000株)
共同印刷	154,000	343.00	52,822,000	
日本写真印刷	91,500	2,002.00	183,183,000	貸付株式数 30,600株 (5,100株)
光村印刷	46,000	253.00	11,638,000	
藤森工業	48,600	3,455.00	167,913,000	
宝印刷	28,900	1,206.00	34,853,400	貸付株式数 10,400株

前澤化成工業	40,500	1,239.00	50,179,500	
アシックス	514,600	3,140.00	1,615,844,000	貸付株式数 215,600株
ツ ツ ミ	27,600	2,628.00	72,532,800	
ジェイ エス ピー	42,700	1,919.00	81,941,300	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
ニ チ ハ	76,800	1,653.00	126,950,400	
エフピコ	50,000	4,275.00	213,750,000	
小松ウオール工業	15,300	2,323.00	35,541,900	
ヤマハ	406,100	2,517.00	1,022,153,700	
河合楽器	17,400	2,188.00	38,071,200	貸付株式数 6,900株
クリナップ	50,400	860.00	43,344,000	
ピジョン	313,100	3,575.00	1,119,332,500	
天馬	44,500	1,934.00	86,063,000	
兼松日産農林	71,000	152.00	10,792,000	貸付株式数 24,000株
キングジム	45,200	811.00	36,657,200	貸付株式数 17,700株
リンテック	130,400	2,608.00	340,083,200	
T A S A K I	9,500	2,268.00	21,546,000	貸付株式数 4,500株
信越ポリマー	113,400	531.00	60,215,400	
東 リ	134,000	294.00	39,396,000	
イトーキ	116,300	655.00	76,176,500	
任 天 堂	340,300	19,515.00	6,640,954,500	貸付株式数 34,200株
三菱鉛筆	41,400	5,370.00	222,318,000	
松 風	27,000	1,286.00	34,722,000	
タカラスタンダ - ド	228,000	802.00	182,856,000	
コ ク ヨ	287,000	1,013.00	290,731,000	
ナカバヤシ	107,000	229.00	24,503,000	
ニ フ コ	128,300	5,060.00	649,198,000	
グローブライド	268,000	166.00	44,488,000	
岡村製作所	211,400	1,033.00	218,376,200	
日本バルカー	240,000	317.00	76,080,000	
M U T O Hホールディング ス	68,000	362.00	24,616,000	貸付株式数 24,000株 (6,000株)
伊 藤 忠	4,565,100	1,466.00	6,692,436,600	
丸 紅	4,771,100	674.50	3,218,106,950	
スクロール	70,700	292.00	20,644,400	
高 島	93,000	268.00	24,924,000	
ヨンドシーホールディング ス	41,300	2,724.00	112,501,200	
三陽商会	317,000	325.00	103,025,000	貸付株式数 20,000株 (20,000株)

長瀬産業	306,100	1,561.00	477,822,100	
ナイガイ	211,000	63.00	13,293,000	貸付株式数 8,000株
蝶理	34,700	1,816.00	63,015,200	
豊田通商	607,500	3,155.00	1,916,662,500	
オンワードホールディングス	414,000	763.00	315,882,000	貸付株式数 162,000株
三共生興	91,500	502.00	45,933,000	
兼松	1,087,000	203.00	220,661,000	
美津濃	296,000	570.00	168,720,000	
ツカモトコーポレーション	89,000	142.00	12,638,000	貸付株式数 35,000株
ファミリーマート	184,400	5,690.00	1,049,236,000	貸付株式数 69,700株
ルック	90,000	206.00	18,540,000	貸付株式数 19,000株
三井物産	4,623,700	1,588.50	7,344,747,450	
日本紙パルプ	284,000	336.00	95,424,000	
東京エレクトロン	464,800	7,727.00	3,591,509,600	
日立ハイテクノロジーズ	189,100	3,120.00	589,992,000	
カメイ	71,000	1,069.00	75,899,000	
東都水産	82,000	196.00	16,072,000	
OUGホールディングス	78,000	253.00	19,734,000	
スターゼン	211,000	374.00	78,914,000	
セイコーHD	391,000	630.00	246,330,000	
山善	208,700	1,019.00	212,665,300	
椿本興業	55,000	355.00	19,525,000	
住友商事	3,218,700	1,380.50	4,443,415,350	
日本ユニシス	150,500	1,245.00	187,372,500	貸付株式数 54,200株 (12,500株)
内田洋行	120,000	418.00	50,160,000	
三菱商事	4,179,800	2,616.00	10,934,356,800	
第一実業	119,000	656.00	78,064,000	
キヤノンマーケティングJPN	155,500	2,020.00	314,110,000	
西華産業	163,000	300.00	48,900,000	
佐藤商事	47,700	789.00	37,635,300	
菱洋エレクトロ	62,900	1,488.00	93,595,200	
東京産業	52,700	477.00	25,137,900	貸付株式数 3,800株
ユアサ商事	46,800	2,759.00	129,121,200	
神鋼商事	123,000	256.00	31,488,000	
小林産業	36,000	234.00	8,424,000	
阪和興業	530,000	518.00	274,540,000	
カナデン	46,800	965.00	45,162,000	

菱電商事	78,000	927.00	72,306,000	
ニプロ	353,000	1,211.00	427,483,000	
フルサト工業	30,000	1,756.00	52,680,000	
岩谷産業	604,000	756.00	456,624,000	
すてきナイスグループ	232,000	201.00	46,632,000	
昭光通商	175,000	114.00	19,950,000	貸付株式数 69,000株
ニチモウ	77,000	189.00	14,553,000	
極東貿易	56,000	304.00	17,024,000	貸付株式数 6,000株
イワキ	74,000	223.00	16,502,000	
兼松エレクトロニクス	34,400	1,913.00	65,807,200	
三愛石油	126,000	794.00	100,044,000	
稲畑産業	129,800	1,246.00	161,730,800	
G S Iクレオス	130,000	130.00	16,900,000	貸付株式数 42,000株
明和産業	42,600	397.00	16,912,200	
キムラタン	2,576,000	9.00	23,184,000	
ゴ-ルドウイン	119,000	806.00	95,914,000	
ユニ・チャ-ム	1,171,800	2,777.00	3,254,088,600	
デサント	131,000	1,736.00	227,416,000	
キング	28,700	428.00	12,283,600	
ワキタ	116,000	1,191.00	138,156,000	
ヤマトインタ-ナショナル	37,600	424.00	15,942,400	
東邦ホールディングス	188,000	2,742.00	515,496,000	
サンゲツ	186,600	1,851.00	345,396,600	
ミツウロコグループ	86,800	606.00	52,600,800	
シナネン	109,000	462.00	50,358,000	
伊藤忠エネクス	120,300	1,124.00	135,217,200	
サンリオ	152,800	3,265.00	498,892,000	貸付株式数 70,600株
サンワテクノス	34,700	1,320.00	45,804,000	
リョ-サン	90,700	3,070.00	278,449,000	
新光商事	64,000	1,261.00	80,704,000	
トーホー	110,000	486.00	53,460,000	
三信電気	75,400	1,199.00	90,404,600	
東陽テクニカ	79,800	988.00	78,842,400	
モスフードサービス	71,400	2,490.00	177,786,000	
加賀電子	48,300	1,493.00	72,111,900	
三益半導体	42,600	1,163.00	49,543,800	
ソーダニツカ	54,600	511.00	27,900,600	
立花エレテック	40,200	1,358.00	54,591,600	
木曽路	66,700	2,008.00	133,933,600	貸付株式数 23,900株
サトレストラシステムズ	50,100	916.00	45,891,600	貸付株式数 18,800株

千趣会	100,800	829.00	83,563,200	貸付株式数 29,100株 (29,100株)
タカキュー	37,800	210.00	7,938,000	貸付株式数 14,800株
ケーヨー	102,000	555.00	56,610,000	貸付株式数 28,300株 (7,400株)
アデランス	63,900	1,028.00	65,689,200	
上新電機	106,000	933.00	98,898,000	
日本瓦斯	86,600	3,900.00	337,740,000	
ベスト電器	175,600	160.00	28,096,000	貸付株式数 63,200株
ロイヤルホールディングス	89,900	2,005.00	180,249,500	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
東天紅	34,000	183.00	6,222,000	貸付株式数 13,000株
いなげや	60,700	1,447.00	87,832,900	
島忠	141,100	3,310.00	467,041,000	
チヨダ	64,300	2,966.00	190,713,800	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
ライフコーポレーション	34,400	3,030.00	104,232,000	
リンガーハット	51,700	2,642.00	136,591,400	貸付株式数 4,100株 (4,100株)
さが美	37,000	190.00	7,030,000	貸付株式数 14,000株
MR MAX	52,900	405.00	21,424,500	貸付株式数 20,800株
テナアライド	44,900	387.00	17,376,300	
AOKIホールディングス	124,700	1,585.00	197,649,500	
オークワ	77,000	966.00	74,382,000	
コメリ	92,100	2,667.00	245,630,700	
青山商事	123,600	4,730.00	584,628,000	
しまむら	63,300	11,600.00	734,280,000	
CFSコーポレーション	35,700	1,102.00	39,341,400	
はせがわ	17,300	550.00	9,515,000	
高島屋	793,000	1,080.00	856,440,000	
松屋	109,700	2,177.00	238,816,900	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	257,800	2,521.00	649,913,800	
近鉄百貨店	208,000	333.00	69,264,000	貸付株式数 79,000株
丸栄	81,000	131.00	10,611,000	貸付株式数 32,000株
ニッセンHD	80,100	221.00	17,702,100	貸付株式数 44,900株
パルコ	50,900	1,152.00	58,636,800	
丸井グループ	573,800	1,695.00	972,591,000	
クレディセゾン	445,500	2,765.00	1,231,807,500	貸付株式数 56,600株
アクシアルリテイリング	41,900	3,465.00	145,183,500	

井筒屋	295,000	75.00	22,125,000	貸付株式数	37,000株
イオン	2,249,200	1,753.00	3,942,847,600	貸付株式数	605,500株
ユニグループ・HD	522,200	781.00	407,838,200		
イズミ	121,700	5,350.00	651,095,000		
東武ストア	63,000	320.00	20,160,000	貸付株式数	24,000株 (3,000株)
フォーバル	9,300	1,708.00	15,884,400		
平和堂	110,500	2,597.00	286,968,500		
フジ	60,600	2,307.00	139,804,200	貸付株式数	15,000株
ヤオコー	61,800	5,310.00	328,158,000		
ゼビオ	74,000	2,196.00	162,504,000	貸付株式数	20,200株 (20,200株)
ケースホールディングス	125,000	3,890.00	486,250,000	貸付株式数	15,200株 (15,200株)
P a l t a c	86,300	2,068.00	178,468,400		
三谷産業	56,800	466.00	26,468,800	貸付株式数	22,300株
O L Y M P I Cグループ	32,100	754.00	24,203,400		
日産東京販売HD	90,300	353.00	31,875,900		
新生銀行	5,191,000	256.00	1,328,896,000	貸付株式数	73,000株
あおぞら銀行	3,681,000	463.00	1,704,303,000		
三菱UFJフィナンシャルG	43,759,800	857.30	37,515,276,540		
りそなホールディングス	6,380,400	654.70	4,177,247,880		
三井住友トラストHD	12,056,000	540.40	6,515,062,400	貸付株式数	444,000株
三井住友フィナンシャルG	4,124,600	5,268.00	21,728,392,800		
第四銀行	690,000	500.00	345,000,000		
北越銀行	589,000	240.00	141,360,000		
西日本シティ銀行	1,914,000	343.00	656,502,000		
千葉銀行	2,097,000	919.00	1,927,143,000		
横浜銀行	3,658,000	759.90	2,779,714,200		
常陽銀行	1,972,000	683.00	1,346,876,000		
群馬銀行	1,284,000	871.00	1,118,364,000		
武蔵野銀行	86,100	4,545.00	391,324,500		
千葉興業銀行	114,400	813.00	93,007,200	貸付株式数	44,400株
筑波銀行	226,600	388.00	87,920,800		
七十七銀行	909,000	727.00	660,843,000		
青森銀行	424,000	388.00	164,512,000		
秋田銀行	361,000	374.00	135,014,000		
山形銀行	328,000	510.00	167,280,000	貸付株式数	89,000株

岩手銀行	38,100	5,230.00	199,263,000	貸付株式数	12,900株
東邦銀行	478,000	533.00	254,774,000		
東北銀行	294,000	169.00	49,686,000		
みちのく銀行	272,000	212.00	57,664,000	貸付株式数	68,000株
ふくおかフィナンシャルG	2,213,000	616.00	1,363,208,000		
静岡銀行	1,598,000	1,274.00	2,035,852,000		
十六銀行	683,000	472.00	322,376,000		
スルガ銀行	575,800	2,528.00	1,455,622,400		
八十二銀行	987,000	887.00	875,469,000		
山梨中央銀行	338,000	548.00	185,224,000		
大垣共立銀行	682,000	426.00	290,532,000		
福井銀行	458,000	253.00	115,874,000		
北國銀行	607,000	431.00	261,617,000		
清水銀行	16,900	3,320.00	56,108,000		
滋賀銀行	532,000	631.00	335,692,000	貸付株式数	194,000株
南都銀行	513,000	415.00	212,895,000		
百五銀行	510,000	571.00	291,210,000		
京都銀行	1,041,000	1,362.00	1,417,842,000		
紀陽銀行	214,100	1,769.00	378,742,900		
三重銀行	243,000	277.00	67,311,000		
ほくほくフィナンシャルG	3,711,000	266.00	987,126,000		
広島銀行	1,609,000	698.00	1,123,082,000		
山陰合同銀行	331,000	1,138.00	376,678,000		
中国銀行	386,600	1,842.00	712,117,200		
鳥取銀行	157,000	222.00	34,854,000		
伊予銀行	583,300	1,438.00	838,785,400		
百十四銀行	599,000	413.00	247,387,000		
四国銀行	419,000	264.00	110,616,000	貸付株式数	112,000株
阿波銀行	440,000	754.00	331,760,000		
鹿児島銀行	379,000	811.00	307,369,000		
大分銀行	334,000	516.00	172,344,000	貸付株式数	12,000株
宮崎銀行	363,000	422.00	153,186,000		
肥後銀行	439,000	724.00	317,836,000		
佐賀銀行	331,000	290.00	95,990,000		
十八銀行	335,000	359.00	120,265,000	貸付株式数	112,000株 (112,000株)
沖縄銀行	42,800	5,010.00	214,428,000		
琉球銀行	112,300	1,753.00	196,861,900		
セブン銀行	1,839,200	549.00	1,009,720,800		
みずほフィナンシャルG	76,101,100	258.30	19,656,914,130		

高知銀行	211,000	161.00	33,971,000	
山口フィナンシャルG	530,000	1,460.00	773,800,000	貸付株式数 144,000株
アクリーティブ	37,300	689.00	25,699,700	貸付株式数 3,700株
芙蓉総合リース	55,600	4,885.00	271,606,000	
興銀リース	102,400	2,773.00	283,955,200	
東京センチュリーリース	127,300	3,710.00	472,283,000	
S B Iホールディングス	655,000	1,608.00	1,053,240,000	
日本証券金融	240,200	677.00	162,615,400	貸付株式数 41,400株 (41,400株)
アイフル	912,600	367.00	334,924,200	貸付株式数 358,600株
日本アジア投資	391,000	57.00	22,287,000	
ポケットカード	40,700	527.00	21,448,900	貸付株式数 14,600株
長野銀行	162,000	226.00	36,612,000	貸付株式数 60,000株
名古屋銀行	483,000	470.00	227,010,000	貸付株式数 189,000株 (92,000株)
北洋銀行	821,700	526.00	432,214,200	
愛知銀行	19,700	6,580.00	129,626,000	
第三銀行	308,000	193.00	59,444,000	貸付株式数 116,000株
中京銀行	224,000	227.00	50,848,000	
東日本銀行	238,000	446.00	106,148,000	
大光銀行	183,000	233.00	42,639,000	
愛媛銀行	321,000	267.00	85,707,000	
トマト銀行	210,000	195.00	40,950,000	
みなと銀行	484,000	304.00	147,136,000	
京葉銀行	443,000	604.00	267,572,000	
関西アーバン銀行	76,000	1,387.00	105,412,000	
栃木銀行	274,000	669.00	183,306,000	
北日本銀行	15,400	3,340.00	51,436,000	
東和銀行	762,000	114.00	86,868,000	
福島銀行	671,000	98.00	65,758,000	
大東銀行	349,000	169.00	58,981,000	
リコーリース	42,800	3,675.00	157,290,000	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	357,700	3,405.00	1,217,968,500	貸付株式数 13,400株
アコム	1,095,600	482.00	528,079,200	貸付株式数 430,500株 (40,400株)
ジャックス	301,000	556.00	167,356,000	
オリコ	1,260,400	208.00	262,163,200	貸付株式数 150,000株
日立キャピタル	107,100	3,145.00	336,829,500	

アプラスフィナンシャル	261,500	132.00	34,518,000	
オリックス	3,861,200	1,745.50	6,739,724,600	
三菱UFJリース	1,383,400	633.00	875,692,200	
ジャフコ	74,600	5,000.00	373,000,000	
トモニホールディングス	418,500	532.00	222,642,000	
大和証券G本社	5,103,000	885.90	4,520,747,700	
野村ホールディングス	11,149,900	847.90	9,454,000,210	
岡三証券グループ	457,000	839.00	383,423,000	
丸三証券	172,500	1,312.00	226,320,000	
東洋証券	210,000	362.00	76,020,000	
東海東京HD	625,900	876.00	548,288,400	
光世証券	117,000	217.00	25,389,000	貸付株式数 66,000株
水戸証券	168,100	421.00	70,770,100	
いちよし証券	114,400	1,135.00	129,844,000	
松井証券	277,200	1,067.00	295,772,400	
損保ジャパン興亜HD	1,211,500	4,118.00	4,988,957,000	
だいこう証券ビジ	26,300	970.00	25,511,000	貸付株式数 9,900株 (9,900株)
日本取引所グループ	800,800	3,970.00	3,179,176,000	
マネックスG	641,700	319.00	204,702,300	
カブドットコム証券	483,500	397.00	191,949,500	
極東証券	73,100	1,763.00	128,875,300	
岩井コスモホールディング	54,300	1,466.00	79,603,800	
藍澤證券	76,500	804.00	61,506,000	
フィデアホール	324,200	267.00	86,561,400	貸付株式数 133,900株
池田泉州HD	519,600	534.00	277,466,400	
アニコムホールディングス	30,500	1,951.00	59,505,500	貸付株式数 11,800株
MS&AD	1,738,600	3,651.00	6,347,628,600	
マネースクウェアHD	17,900	1,467.00	26,259,300	貸付株式数 1,200株
SONY FH	522,500	2,271.00	1,186,597,500	
マネーパートナーズGP	54,200	416.00	22,547,200	貸付株式数 19,600株
小林洋行	14,100	320.00	4,512,000	貸付株式数 3,300株
第一生命	3,494,500	2,261.00	7,901,064,500	
東京海上HD	2,209,600	4,886.50	10,797,210,400	
イー・ギャランティ	14,300	2,398.00	34,291,400	
アサックス	8,600	1,515.00	13,029,000	
NECキャピタルソリューション	22,200	1,790.00	39,738,000	
T&Dホールディングス	1,987,800	1,746.50	3,471,692,700	

三井不動産	2,890,000	3,354.00	9,693,060,000	
三菱地所	4,056,000	2,617.00	10,614,552,000	貸付株式数 223,000株
平和不動産	103,100	1,750.00	180,425,000	
東京建物	595,667	1,609.00	958,428,203	
ダイビル	140,300	1,077.00	151,103,100	
京阪神ビルディング	89,300	710.00	63,403,000	
住友不動産	1,298,000	4,219.50	5,476,911,000	
太平洋興発	214,000	92.00	19,688,000	貸付株式数 14,000株
大京	860,000	203.00	174,580,000	
テーオーシー	187,900	788.00	148,065,200	
東京楽天地	81,000	503.00	40,743,000	
レオパレス21	596,500	649.00	387,128,500	
スターツコーポレーション	62,500	1,878.00	117,375,000	
フジ住宅	69,500	679.00	47,190,500	貸付株式数 27,300株
空港施設	65,900	644.00	42,439,600	
明和地所	31,200	596.00	18,595,200	貸付株式数 400株
住友不動産販売	39,300	3,005.00	118,096,500	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
ゴールドクレスト	48,200	2,431.00	117,174,200	
リロ・ホールディング	19,700	12,540.00	247,038,000	
日本エスリード	21,200	1,250.00	26,500,000	
日神不動産	72,500	422.00	30,595,000	
タカラレーベン	241,600	701.00	169,361,600	
サンヨーハウジ 名古屋	30,600	1,227.00	37,546,200	
イオンモール	351,900	2,230.00	784,737,000	貸付株式数 11,600株
ファースト住建	20,300	1,351.00	27,425,300	貸付株式数 7,900株
ランド	197,200	20.00	3,944,000	
東祥	11,000	2,776.00	30,536,000	
トーセイ	75,400	818.00	61,677,200	
穴吹興産	44,000	232.00	10,208,000	貸付株式数 17,000株
エヌ・ティ・ティ都市開発	338,800	1,176.00	398,428,800	
サンフロンティア不動産	58,700	908.00	53,299,600	貸付株式数 24,200株
エフ・ジェー・ネクスト	41,400	595.00	24,633,000	貸付株式数 3,000株
ランドビジネス	36,300	387.00	14,048,100	
グランディハウス	46,800	398.00	18,626,400	
東武鉄道	2,953,000	548.00	1,618,244,000	
相鉄ホールディングス	934,000	678.00	633,252,000	
東京急行	3,002,000	847.00	2,542,694,000	
京浜急行	1,514,000	950.00	1,438,300,000	
小田急電鉄	1,770,000	1,165.00	2,062,050,000	

京王電鉄	1,544,000	923.00	1,425,112,000	
京成電鉄	825,000	1,453.00	1,198,725,000	
富士急行	136,000	1,042.00	141,712,000	貸付株式数 54,000株
新京成電鉄	64,000	405.00	25,920,000	
東日本旅客鉄道	1,012,800	11,165.00	11,307,912,000	
西日本旅客鉄道	531,900	8,047.00	4,280,199,300	
東海旅客鉄道	494,800	20,730.00	10,257,204,000	
西武ホールディングス	440,300	2,792.00	1,229,317,600	貸付株式数 37,300株
鴻池運輸	68,300	1,371.00	93,639,300	
西日本鉄道	715,000	561.00	401,115,000	
ハマキョウレックス	15,600	4,550.00	70,980,000	
サカイ引越センター	8,600	4,860.00	41,796,000	貸付株式数 3,400株
近鉄グループHLDGS	5,561,000	424.00	2,357,864,000	貸付株式数 1,258,000株
阪急阪神HLDGS	3,709,000	729.00	2,703,861,000	
南海電鉄	1,233,000	546.00	673,218,000	
京阪電鉄	1,234,000	713.00	879,842,000	
神戸電鉄	121,000	356.00	43,076,000	
名糖運輸	22,600	712.00	16,091,200	
名古屋鉄道	2,011,000	459.00	923,049,000	貸付株式数 503,000株 (357,000株)
山陽電鉄	201,000	465.00	93,465,000	
トランコム	14,400	6,220.00	89,568,000	
日本通運	2,137,000	582.00	1,243,734,000	
ヤマトホールディングス	971,500	2,386.00	2,317,999,000	貸付株式数 138,600株
山 九	671,000	610.00	409,310,000	
日 新	209,000	342.00	71,478,000	
丸 運	29,800	259.00	7,718,200	
丸全昭和運輸	169,000	417.00	70,473,000	
センコー	244,000	760.00	185,440,000	貸付株式数 112,000株 (112,000株)
トナミホールディングス	104,000	396.00	41,184,000	
日本梱包運輸	180,800	1,992.00	360,153,600	
日石輸送	56,000	235.00	13,160,000	
福山通運	335,000	639.00	214,065,000	貸付株式数 131,000株 (114,000株)
セイノーホールディングス	427,600	1,296.00	554,169,600	
神奈川中央交通	58,000	592.00	34,336,000	
日立物流	115,100	1,988.00	228,818,800	
丸和運輸機関	5,000	3,350.00	16,750,000	
日本郵船	4,668,000	330.00	1,540,440,000	

商船三井	2,895,000	374.00	1,082,730,000	貸付株式数	1,132,000株
川崎汽船	2,418,000	277.00	669,786,000		
N S ユナイテッド海運	238,000	259.00	61,642,000	貸付株式数	77,000株
明治海運	48,500	399.00	19,351,500		
飯野海運	285,800	549.00	156,904,200		
共栄タンカー	40,000	201.00	8,040,000	貸付株式数	20,000株
第一中央汽船	441,000	37.00	16,317,000	貸付株式数	171,000株
日本航空	1,058,000	4,230.00	4,475,340,000		
A N A ホールディングス	10,860,000	339.90	3,691,314,000		
パスコ	45,000	339.00	15,255,000	貸付株式数	16,000株
三菱倉庫	362,000	1,679.00	607,798,000	貸付株式数	142,000株
三井倉庫H O L D	320,000	396.00	126,720,000		
住友倉庫	403,000	662.00	266,786,000		
渋沢倉庫	129,000	349.00	45,021,000		
ヤマタネ	273,000	198.00	54,054,000		
東陽倉庫	86,000	277.00	23,822,000		
乾汽船	36,900	934.00	34,464,600		
日本トランスシティ	113,000	419.00	47,347,000		
ケイヒン	92,000	200.00	18,400,000		
中央倉庫	31,900	957.00	30,528,300	貸付株式数	11,400株
安田倉庫	42,600	1,002.00	42,685,200		
東洋埠頭	157,000	205.00	32,185,000		
宇徳	44,100	541.00	23,858,100		
上 組	659,000	1,084.00	714,356,000		
サンリツ	12,000	555.00	6,660,000		
キムラユニティー	12,600	1,240.00	15,624,000		
キューソー流通システム	13,800	2,180.00	30,084,000		
郵船ロジスティクス	49,900	1,319.00	65,818,100		
近鉄エクスプレス	48,500	5,060.00	245,410,000	貸付株式数	18,300株 (2,500株)
東海運	29,800	283.00	8,433,400		
エーアイテイー	25,400	1,139.00	28,930,600	貸付株式数	700株
内外トランスライン	11,800	1,235.00	14,573,000		
東京放送H D	326,700	1,762.00	575,645,400	貸付株式数	127,900株 (126,700株)
日本テレビH L D S	497,900	2,165.00	1,077,953,500		
朝日放送	52,400	947.00	49,622,800		
テレビ朝日H D	149,000	1,893.00	282,057,000	貸付株式数	58,200株 (18,400株)
スカパーJ S A T H D	413,900	633.00	261,998,700		

テレビ東京HD	43,800	1,833.00	80,285,400	貸付株式数	17,100株
日本BS放送	8,600	1,046.00	8,995,600	貸付株式数	3,400株
コネクシオ	38,400	1,321.00	50,726,400		
クロップス	5,400	510.00	2,754,000		
日本電信電話	4,268,300	4,465.50	19,060,093,650		
KDDI	5,540,400	3,001.00	16,626,740,400		
光通信	48,200	8,360.00	402,952,000		
NTTドコモ	4,206,200	2,332.00	9,808,858,400		
エムティーアイ	69,400	773.00	53,646,200		
GMOインターネット	184,700	1,763.00	325,626,100		
KADOKAWA・DWA NGO	133,800	1,477.00	197,622,600		
学研ホールディングス	165,000	245.00	40,425,000		
ゼンリン	72,100	1,498.00	108,005,800		
昭文社	32,700	914.00	29,887,800		
インプレスホールディング ス	38,500	191.00	7,353,500	貸付株式数	13,800株 (13,800株)
東京電力	4,687,500	682.00	3,196,875,000		
中部電力	1,690,800	1,823.50	3,083,173,800		
関西電力	2,255,000	1,371.00	3,091,605,000	貸付株式数	280,300株
中国電力	764,000	1,735.00	1,325,540,000		
北陸電力	541,300	1,770.00	958,101,000		
東北電力	1,380,600	1,622.00	2,239,333,200		
四国電力	497,600	1,792.00	891,699,200	貸付株式数	55,600株
九州電力	1,220,400	1,515.00	1,848,906,000	貸付株式数	479,600株
北海道電力	517,200	1,411.00	729,769,200		
沖縄電力	54,100	3,005.00	162,570,500		
電源開発	400,600	4,135.00	1,656,481,000		
東京瓦斯	6,717,000	642.80	4,317,687,600		
大阪瓦斯	5,720,000	473.50	2,708,420,000		
東邦瓦斯	1,393,000	712.00	991,816,000		
北海道瓦斯	102,000	287.00	29,274,000	貸付株式数	40,000株
広島ガス	87,200	462.00	40,286,400		
西部瓦斯	622,000	287.00	178,514,000		
静岡ガス	156,900	830.00	130,227,000		
メタウォーター	34,000	2,998.00	101,932,000		
アイネット	27,900	1,121.00	31,275,900		
松竹	359,000	1,079.00	387,361,000		
東宝	389,100	2,883.00	1,121,775,300		
エイチ・アイ・エス	92,800	4,175.00	387,440,000		

東映	203,000	816.00	165,648,000	
AOI Pro.	25,200	1,018.00	25,653,600	
NTTデータ	336,900	5,220.00	1,758,618,000	
共立メンテナンス	34,400	7,350.00	252,840,000	貸付株式数 12,500株 (12,500株)
イチネンホールディングス	60,400	1,095.00	66,138,000	貸付株式数 17,900株 (17,900株)
建設技術研究所	34,000	1,127.00	38,318,000	貸付株式数 9,900株
スペース	31,100	1,136.00	35,329,600	貸付株式数 8,300株
アインファーマシーズ	65,700	5,260.00	345,582,000	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
燦ホールディングス	10,500	1,714.00	17,997,000	
ピー・シー・エー	6,100	1,505.00	9,180,500	貸付株式数 2,400株
スバル興業	36,000	424.00	15,264,000	
東京テアトル	220,000	139.00	30,580,000	
よみうりランド	105,000	419.00	43,995,000	貸付株式数 42,000株 (42,000株)
東京都競馬	395,000	275.00	108,625,000	
常磐興産	212,000	151.00	32,012,000	
カナモト	80,500	2,916.00	234,738,000	
東京ドーム	395,000	499.00	197,105,000	
DTS	54,700	2,596.00	142,001,200	
スクウェア・エニックス・HD	209,100	2,863.00	598,653,300	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
シーイーシー	35,500	1,081.00	38,375,500	
カプコン	139,400	2,346.00	327,032,400	貸付株式数 4,500株 (4,500株)
西尾レントオール	45,700	2,870.00	131,159,000	
アイ・エス・ビー	5,500	855.00	4,702,500	貸付株式数 2,100株
アゴラ・ホスピタリティーG	257,000	45.00	11,565,000	
日本空港ビルデング	188,400	6,010.00	1,132,284,000	貸付株式数 74,000株
トランス・コスモス	75,300	3,030.00	228,159,000	
乃村工藝社	113,100	1,511.00	170,894,100	
ジャステック	32,600	1,115.00	36,349,000	
SCSK	128,800	3,670.00	472,696,000	
藤田観光	209,000	387.00	80,883,000	貸付株式数 79,000株
KNT-CTホールディングス	279,000	153.00	42,687,000	
日本管財	28,300	2,647.00	74,910,100	

トーカイ	25,500	4,020.00	102,510,000	
白洋舎	54,000	269.00	14,526,000	
セコム	560,400	7,972.00	4,467,508,800	
日本システムウエア	20,500	1,063.00	21,791,500	貸付株式数 7,300株
セントラル警備保障	25,400	1,351.00	34,315,400	
アイネス	74,100	1,268.00	93,958,800	
丹青社	66,500	1,138.00	75,677,000	
メイテック	77,300	4,540.00	350,942,000	
T K C	49,200	3,310.00	162,852,000	
アサツー ディ・ケイ	101,300	2,723.00	275,839,900	
富士ソフト	75,900	2,422.00	183,829,800	
応用地質	60,600	1,583.00	95,929,800	
船井総研ホールディング	64,600	1,512.00	97,675,200	
N S D	126,700	1,558.00	197,398,600	
進学会	24,100	625.00	15,062,500	
丸紅建材リース	41,000	246.00	10,086,000	
コナミ	221,600	2,317.00	513,447,200	
ベネッセホールディングス	210,300	3,095.00	650,878,500	
イオンディライト	54,300	3,810.00	206,883,000	
ナック	38,500	990.00	38,115,000	貸付株式数 15,100株 (3,300株)
福井コンピュータH L D S	13,300	847.00	11,265,100	貸付株式数 5,300株
ニチイ学館	112,800	1,039.00	117,199,200	貸付株式数 40,600株 (20,000株)
ダイセキ	91,700	2,353.00	215,770,100	
ステップ	18,300	1,013.00	18,537,900	
日鉄住金物産	359,000	420.00	150,780,000	
元気寿司	15,200	2,412.00	36,662,400	
トラスコ中山	62,300	4,075.00	253,872,500	
ヤマダ電機	2,155,800	460.00	991,668,000	貸付株式数 847,300株 (41,200株)
オートバックスセブン	193,900	1,983.00	384,503,700	貸付株式数 8,600株 (8,600株)
アークランドサカモト	39,100	2,532.00	99,001,200	
ニトリホールディングス	235,600	9,820.00	2,313,592,000	
グルメ杵屋	39,000	964.00	37,596,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
愛眼	42,900	253.00	10,853,700	貸付株式数 10,800株
ケーユーホールディングス	28,400	736.00	20,902,400	貸付株式数 1,500株
吉野家ホールディングス	153,600	1,390.00	213,504,000	

加藤産業	84,300	2,637.00	222,299,100	
イノテック	49,000	467.00	22,883,000	
イエローハット	50,100	2,261.00	113,276,100	
松屋フーズ	26,200	2,320.00	60,784,000	
JBCホールディングス	44,900	773.00	34,707,700	
JKホールディングス	53,200	583.00	31,015,600	
サガミチェーン	62,000	1,218.00	75,516,000	貸付株式数 22,000株 (22,000株)
日伝	22,600	2,863.00	64,703,800	
関西スーパーマーケット	40,600	813.00	33,007,800	
ミロク情報サービス	35,800	785.00	28,103,000	
北沢産業	44,300	183.00	8,106,900	
杉本商事	29,300	1,407.00	41,225,100	
因幡電機産業	80,600	4,025.00	324,415,000	
王将フードサービス	40,000	4,045.00	161,800,000	貸付株式数 3,900株
ブレナス	60,900	2,081.00	126,732,900	
ミニストップ	40,300	2,203.00	88,780,900	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
アークス	93,500	2,490.00	232,815,000	
バロ-	117,500	2,911.00	342,042,500	
パイテック	16,800	1,384.00	23,251,200	貸付株式数 6,700株
ミスミグループ本社	611,300	1,694.00	1,035,542,200	
藤久	3,700	1,686.00	6,238,200	
アルテック	39,900	244.00	9,735,600	貸付株式数 14,200株
ベルク	24,200	3,870.00	93,654,000	
大庄	25,500	1,519.00	38,734,500	貸付株式数 8,000株 (4,000株)
タキヒヨー	82,000	451.00	36,982,000	
ファーストリテイリング	109,200	54,010.00	5,897,892,000	
ソフトバンクグループ	2,884,100	6,924.00	19,969,508,400	
蔵王産業	6,900	1,436.00	9,908,400	
スズケン	248,200	3,790.00	940,678,000	
サンドラッグ	115,200	6,780.00	781,056,000	
サックスパーホールディング グ	40,900	2,082.00	85,153,800	
ジェコス	37,500	1,214.00	45,525,000	
ヤマザワ	10,300	1,727.00	17,788,100	
やまや	8,500	2,058.00	17,493,000	
ルネサスイーストン	26,700	577.00	15,405,900	
ベルーナ	135,900	666.00	90,509,400	

合計			1,278,250,047,993	
----	--	--	-------------------	--

(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	60,000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27年7月31日

資産総額	1,426,741,380,991円
負債総額	75,256,180,509円
純資産総額（ - ）	1,351,485,200,482円
発行済数量	789,764,542口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1,711.3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27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、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27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	26	190,055
追加型株式投資信託	583	12,272,198
株式投資信託 合計	609	12,462,253
単位型公社債投資信託	1	6,181
追加型公社債投資信託	17	3,367,012
公社債投資信託 合計	18	3,373,192
総合計	627	15,835,445

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。
- 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26年4月1日から平成27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、従来、千円単位で記載しておりましたが、当事業年度より百万円単位で記載することに変更しております。
- なお、記載金額は表示単位未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	15,186	31,438
有価証券	15,003	4,878
前払費用	157	139
未収委託者報酬	8,265	10,295
未収収益	103	110
繰延税金資産	674	585
その他	15	153
流動資産計	39,406	47,600
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	252	255
器具備品	23	21
器具備品	228	234
無形固定資産	2,991	2,759
ソフトウェア	2,910	2,758
ソフトウェア仮勘定	68	1
電話加入権	11	-
投資その他の資産	15,077	12,979
投資有価証券	8,338	6,667
関係会社株式	5,141	5,129
出資金	129	124
長期差入保証金	997	996
投資不動産	1	1
投資不動産	398	-
その他	74	60

貸倒引当金	3	-
固定資産計	18,320	15,995
資産合計	57,727	63,596

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	53	64
未払金	8,998	9,172
未払収益分配金	7	5
未払償還金	77	72
未払手数料	4,277	4,965
その他未払金	2	2
未払費用	3,463	4,162
未払法人税等	1,530	1,133
未払消費税等	530	1,429
賞与引当金	955	1,092
その他	1	747
流動負債計	15,534	17,801
固定負債		
退職給付引当金	1,959	2,072
役員退職慰労引当金	80	101
繰延税金負債	1,789	1,745
その他	3	2
固定負債計	3,832	3,920
負債合計	19,366	21,722
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	10,821	14,126
利益剰余金合計	11,196	14,501
株主資本合計	37,866	41,171

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	494	702
評価・換算差額等合計	494	702
純資産合計	38,360	41,873
負債・純資産合計	57,727	63,596

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	84,771	90,924
その他営業収益	788	933
営業収益計	85,560	91,858
営業費用		
支払手数料	47,520	49,978
広告宣伝費	668	670
調査費	8,246	9,013
調査費	741	867
委託調査費	7,505	8,146
委託計算費	735	756
営業雑経費	1,323	1,289
通信費	249	252
印刷費	477	481
協会費	54	53
諸会費	11	13
その他営業雑経費	531	488
営業費用計	58,494	61,709
一般管理費		
給料	5,708	5,881
役員報酬	243	289
給料・手当	3,785	3,803
賞与	724	695
賞与引当金繰入額	955	1,092
福利厚生費	793	831
交際費	37	45
旅費交通費	191	176
租税公課	222	259
不動産賃借料	1,182	1,180
退職給付費用	373	383
役員退職慰労引当金繰入額	33	38

固定資産減価償却費	963	1,032
諸経費	1,354	1,372
一般管理費計	10,862	11,201
営業利益	16,203	18,948

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	144	1	1,226
受取利息		9		20
その他		220		372
営業外収益計		374		1,620
営業外費用				
投資有価証券売却損		3		84
その他		71		67
営業外費用計		74		152
経常利益		16,503		20,416
特別利益				
固定資産売却益		-		7
特別利益計		-		7
特別損失				
外国税関連費用		-		746
その他		0		26
特別損失計		0		772
税引前当期純利益		16,502		19,651
法人税、住民税及び事業税		6,525		6,238
法人税等調整額		150		17
法人税等合計		6,375		6,220
当期純利益		10,126		13,431

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
			繰越利益 剰余金			
当期首残高	15,174	11,495	374	7,722	8,097	34,767
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027	△7,027	△7,027
当期純利益	-	-	-	10,126	10,126	10,126
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	3,099	3,099
当期末残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	464	464	35,231
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△7,027
当期純利益	-	-	10,126
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	30	30	30
当期変動額合計	30	30	3,129
当期末残高	494	494	38,360

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,126	△10,126	△10,126
当期純利益	-	-	-	13,431	13,431	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,304	3,304	3,304
当期末残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	494	494	38,360
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,126
当期純利益	-	-	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	208	208	208
当期変動額合計	208	208	3,513
当期末残高	702	702	41,873

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

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	8～47年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 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毎に各人別の勤務費用が確定するためであります。

また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

(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. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(貸借対照表)

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「流動資産」に表示していた「貯蔵品」14百万円、「前払金」0百万円、「その他」0百万円は、「その他」15百万円として組替えております。

前事業年度において、「有形固定資産」に独立掲記しておりました「リース資産」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「有形固定資産」の「器具備品」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「有形固定資産」に表示していた「リース資産」4百万円、「器具備品」224百万円は、「器具備品」228百万円として組替えております。

前事業年度において、「投資その他の資産」に独立掲記しておりました「従業員に対する長期貸付金」、「長期前払費用」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「投資その他の資産」に表示していた「従業員に対する長期貸付金」68百万円、「長期前払費用」6百万円は、「その他」74百万円として組替えております。

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「流動負債」に表示していた「リース債務」1百万円は、「その他」1百万円として組替えております。

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「固定負債」に表示していた「リース債務」3百万円は、「その他」3百万円として組替えております。

（損益計算書）

前事業年度において、「営業費用」に独立掲記しておりました「公告費」、「受益証券発行費」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業費用」の「その他営業雑経費」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業費用」に表示していた「公告費」0百万円、「受益証券発行費」0百万円、「その他営業雑経費」530百万円は、「その他営業雑経費」531百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「有価証券利息」、「投資有価証券売却益」、「有価証券償還益」、「時効成立分配金・償還金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「有価証券利息」13百万円、「投資有価証券売却益」64百万円、「有価証券償還益」63百万円、「時効成立分配金・償還金」44百万円、「その他」34百万円は、「その他」220百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」に独立掲記しておりました「有価証券償還損」、「時効成立後支払分配金・償還金」、「投資不動産管理費用」、「貯蔵品廃棄損」は、金額的重要性が乏し

いため、当事業年度より「営業外費用」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」に表示していた「有価証券償還損」18百万円、「時効成立後支払分配金・償還金」16百万円、「投資不動産管理費用」16百万円、「貯蔵品廃棄損」9百万円、「その他」9百万円は、「その他」71百万円として組替えております。

前事業年度において、「特別損失」に独立掲記しておりました「固定資産除却損」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「特別損失」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「特別損失」に表示していた「固定資産除却損」0百万円は、「その他」0百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	18百万円	20百万円
器具備品	251百万円	275百万円
投資建物	729百万円	-
投資器具備品	24百万円	-

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
未払金	4,508百万円	4,084百万円

3 保証債務

前事業年度(平成26年3月31日)

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

当事業年度(平成27年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,834百万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25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)	当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)
受取配当金	-	1,065百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27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26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26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27年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	13,428百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,148円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月24日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「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リスクマネジメント会議において報告を行っております。

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：百万円）

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

(*) 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27年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	31,438	31,438	-
(2) 未収委託者報酬	10,295	10,295	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	10,520	10,520	-
資産計	52,254	52,254	-
(1) 未払手数料	4,965	4,965	-
(2) その他未払金	4,127	4,127	-
(3) 未払費用(*)	3,366	3,366	-
負債計	12,460	12,460	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,059	1,025
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,141	5,129
(3) 長期差入保証金	997	996

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26年3月31日）

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	15,186	-	-	-
未収委託者報酬	8,265	-	-	-
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	3,978	97
合計	23,452	1,498	3,978	97

当事業年度（平成27年3月31日）

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,438	-	-	-
未収委託者報酬	10,295	-	-	-
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	6	1,591	3,790	84
合計	41,740	1,591	3,790	84

(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26年3月31日）

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成26年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	113	55	58
(2) その他 証券投資信託	5,625	4,873	751
小計	5,738	4,928	809
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	16,544	16,586	41
小計	16,544	16,586	41
合計	22,283	21,514	768

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,059百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	164	55	109
(2) その他 証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
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	5,779	5,793	14
小計	5,779	5,793	14
合計	10,520	9,482	1,038

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,025百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
その他 証券投資信託	24,501	64	3
合計	24,501	64	3

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	32	-	1
(2) その他 証券投資信託	34,371	145	84
合計	34,404	145	85

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,935百万円	1,959百万円
勤務費用	201	212
退職給付の支払額	217	118
その他	39	18
退職給付債務の期末残高	1,959	2,072

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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	1,959百万円	2,072百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072
退職給付引当金	1,959	2,072
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
勤務費用	201百万円	212百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	201	212

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度172百万円、当事業年度170百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度	当事業年度
	(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)
繰延税金資産		
減損損失	833	-
退職給付引当金	698	670
賞与引当金	287	305
外国税関連費用	-	241
未払事業税	335	231
連結法人間取引(譲渡損)	141	128
投資有価証券評価損	128	105
出資金評価損	116	103
その他	246	206
繰延税金資産小計	2,789	1,992
評価性引当額	1,200	613
繰延税金資産合計	1,588	1,379
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428	2,203

その他有価証券評価差額金	273	335
その他	1	-
繰延税金負債合計	2,704	2,539
繰延税金負債の純額	1,115	1,159

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率	-	35.64%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	1.14%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	2.02%
評価性引当額の増減額	-	2.67%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	0.51%
その他	-	0.07%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	31.65%

(注) 前事業年度においては、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以下であるため記載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27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から平成27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は33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が44百万円、繰延税金負債（長期）が180百万円、法人税等調整額が100百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が34百万円増加しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,719	-	-

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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,834	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	--------------	------	---------	-------	---	---

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(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,994	未払手数料	3,216
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	未払費用	393
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	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	28,838	未払手数料	3,751
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	685	未払費用	348
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	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

前事業年度 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		当事業年度 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
1株当たり純資産額	14,705.91円	1株当たり純資産額	16,052.69円
1株当たり当期純利益	3,882.07円	1株当たり当期純利益	5,148.94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25年4月1日 至 平成26年3月31日）	当事業年度 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）
当期純利益（百万円）	10,126	13,431
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

平成27年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 代表取締役の人数の変更（4名以内に変更）

平成27年6月26日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 取締役（業務執行取締役等であるものを除く。）の責任を法令の定める限度に制限する契約を締結できる旨の規定の新設

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27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27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	73,272	
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	
野村証券株式会社	10,000	
バ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U F J 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27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27年 5月28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26年4月1日から平成27年3月31日までの第56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27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27年8月7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26年7月11日から平成27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27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。