

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長 殿
【提出日】 平成21年10月2日提出
【計算期間】 第8計算期間
(自 平成20年7月11日 至 平成21年7月10日)
【ファンド名】 ダイワ上場投信 - トピックス
【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 石橋 俊朗
【本店の所在の場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【事務連絡者氏名】 長谷川 英男
【連絡場所】 東京都中央区日本橋茅場町二丁目10番5号
【電話番号】 03-5695-2111
【縦覧に供する場所】 名 称 株式会社東京証券取引所
所在地 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を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。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
- ・「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・属性区分の定義について、くわしくは、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、金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. 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。
2. 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。
3. 前1.および前2.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。
4. 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。
5. 東証株価指数（T O P I X）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（T O P I X）、日経平均株価、日経株価指数300等があります。このうち、T O P I X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。

T O P I X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）T O P I X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：

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

- ・ T O P I X の指数値および T O P I X 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及び T O P I X 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、T O P I X の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、T O P I X の指数値の算出若しくは公表の停止又は T O P I X の商標の変更若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、T O P I X 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、T O P I X の指数値及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、T O P I X の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ・ 「ダイワ上場投信 - トピックス」は、T O P I X 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 - トピックス」の純資産価額と T O P I X の間に乖離が発生することがある。
- ・ 「ダイワ上場投信 - トピックス」は、（株）東京証券取引所により提供、保証又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 - トピックス」の購入者又は公衆に対し、「ダイワ上場投信 - 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 - トピックス」の発行等又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。

6. 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。

- (a) 同指数が加重平均であるため、個別銘柄の組入比率を同指数構成銘柄の時価総額構成比率と全くの同一の比率とすることができないこと
- (b) 信託報酬、売買委託手数料等の費用負担
- (c) 株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- (d) 指数の算出に使用する株価と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- (e) 株価指数先物取引と指数の動きの不一致（株価指数先物取引を利用した場合）
- (f) 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
- (g) 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
- (h) 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
- (i) 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

7. 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おります。その概要は、次のとおりです。

- (a) 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、100口単位です。
 - ・ 取引方法は、原則として株式と同様です。
- (b) 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みを行

なうことはできません。

(c) 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請求することができます。
- ・解約請求により受益権を換金することはできません。

(d) 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。

(2) 【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	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21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。

・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	2,608,525 株	100.00 %

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

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

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

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

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

市況動向、資産規模等によっては、上記の運用を行なえないことがあります。

(2) 【投資対象】

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第5号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

券に限ります。）

なお、前1.の証券または証書を「株式」といいます。

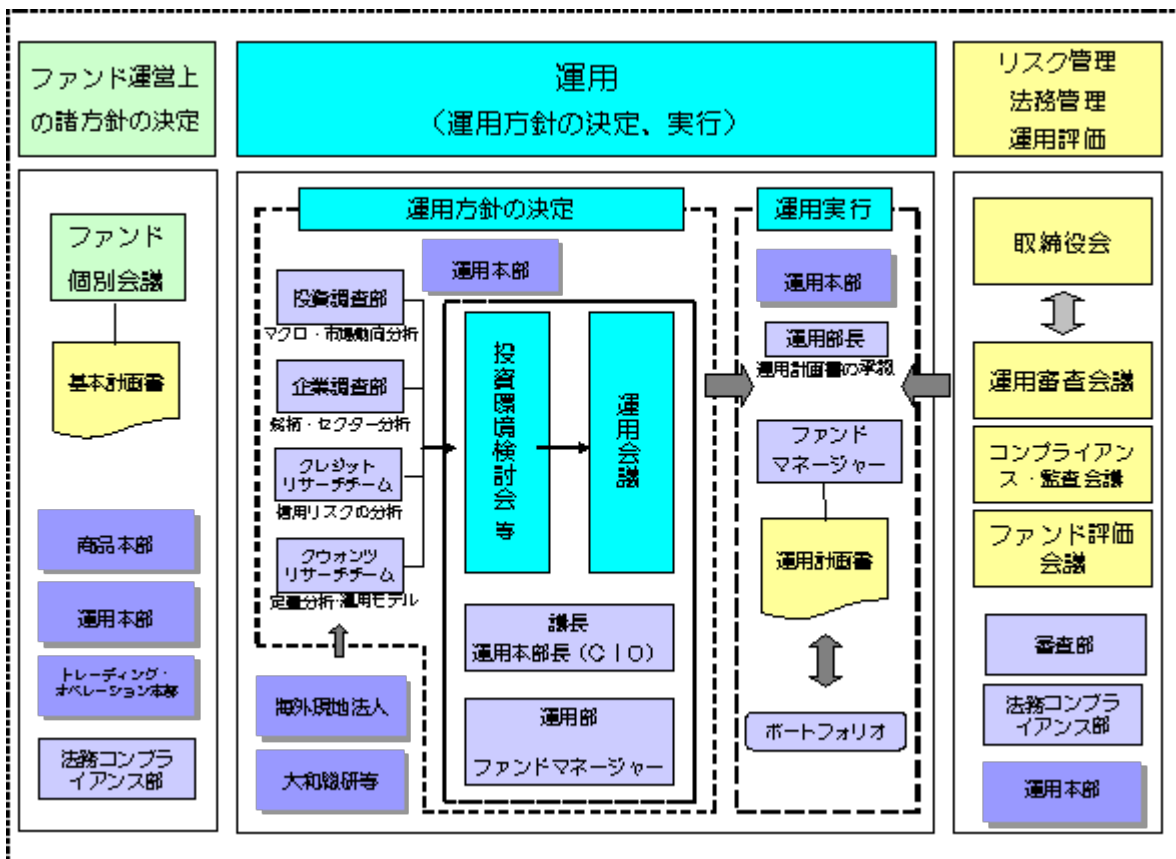
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者である運用本部長（C I O）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。

八．基本的な運用方針の決定

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

二．運用計画書の作成・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．運用本部長（C I O）（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．運用副本部長（1～5名程度）

C I Oを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

八．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。

二．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるコンプライアンス・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は15～25名程度です。

受託会社に対する管理体制

信託財産の管理業務を通じて、受託会社の信託事務の正確性・迅速性、システム対応力等を総合的に検証しています。また、年次で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ています。

上記の運用体制は平成21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、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、

先物取引等（信託約款）

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

有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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、

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、

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、

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、すべて受益者に帰属します。

投資家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せう、よろしく願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

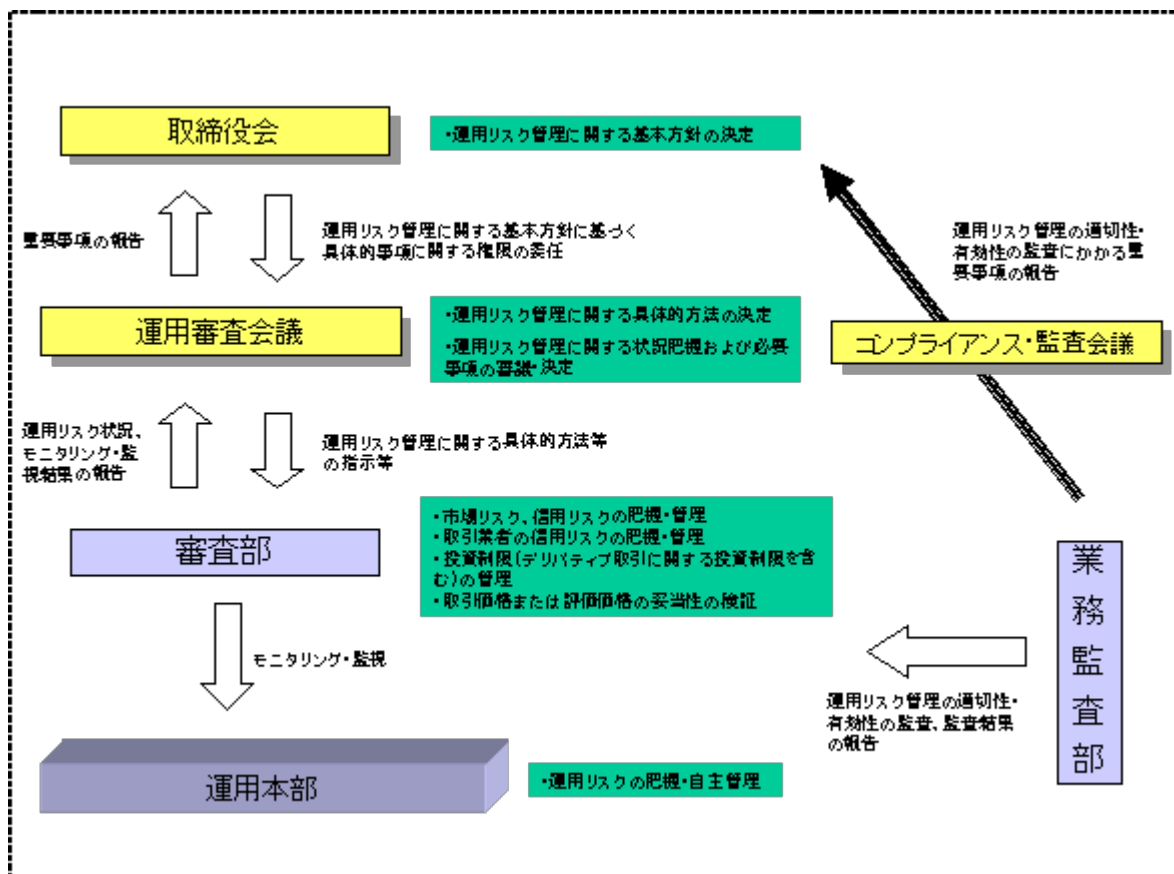
株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

(2) リスク管理体制



4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00、半休日は9:00~12:00)

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【換金(解約)手数料】

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。

(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。ただし、次のイ.の額は、信託財産の純資産総額に年10,000分の24.15(税抜10,000分の23)を乗じて得た額から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。)のうち受益者負担とした額を控除した額を超えないものとします。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10,000分の24.15(税抜10,000分の23)以内の率を乗じて得た額

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52.5(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10,000分の11.55(税抜10,000分の11)

ロ. 100分の52.5(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10,000分の7.875(税抜10,000分の7.5)

受託会社 年10,000分の3.675(税抜10,000分の3.5)

ロ. 前 ロ.の報酬

委託会社 報酬の50%

受託会社 報酬の50%

(4) 【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、受益権の上場にかかる費用および商標使用料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。

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。

(5) 【課税上の取扱い】

個人の受益者に対する課税

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21年1月1日から平成23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率が適用され、源泉徴収選択口座においては申告不要の特例があります。

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

ロ．収益分配金の受取時

収益分配金に対しては、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されますが、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税を選択することもできます。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。

ただし、平成21年1月1日から平成23年12月31日までは特例措置として、10%（所得税7%および地方税3%）の軽減税率による源泉徴収が行なわれます。

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

法人の受益者に対する課税

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

収益分配金に対しては、平成23年12月31日までは7%（所得税7%）、平成24年1月1日から15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。なお、地方税の源泉徴収はありません。

法人税の計算において、税額控除制度が適用されます。

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

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

- () 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21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	184,519,475,358	99.86
内 日本	184,519,475,358	99.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	251,853,335	0.14
純資産総額	184,771,328,693	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）	248,430,000	0.13
内 日本	248,430,000	0.13

（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、当該日にもっと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21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

（単位：円）

	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	評価単価 時価	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,936,900	3,430 6,644,967,000	3,990 7,728,231,000	- -	4.18%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	8,724,800	538 4,693,994,400	566 4,938,236,800	- -	2.67%
3	本田技研 日本	株式 輸送用機器	1,288,400	2,355 3,035,426,500	3,050 3,929,620,000	- -	2.13%
4	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	809,900	3,554 2,879,129,000	4,050 3,280,095,000	- -	1.78%
5	キャノン 日本	株式 電気機器	874,100	2,945 2,574,829,000	3,530 3,085,573,000	- -	1.67%
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	684,000	3,790 2,592,460,000	3,910 2,674,440,000	- -	1.45%
7	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,607,700	1,214 1,952,304,600	1,500 2,411,550,000	- -	1.31%
8	東京電力 日本	株式 電気・ガス業	950,000	2,474 2,351,180,000	2,425 2,303,750,000	- -	1.25%
9	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	10,473,900	203 2,129,681,404	215 2,251,888,500	- -	1.22%
10	ソニー 日本	株式 電気機器	799,400	2,230 1,782,992,000	2,675 2,138,395,000	- -	1.16%
11	武田薬品 日本	株式 医薬品	554,500	3,720 2,062,764,000	3,830 2,123,735,000	- -	1.15%

12	三菱商事	日本	株式 卸売業	1,111,600	1,592 1,770,046,300	1,890 2,100,924,000	- -	1.14%
13	任天堂	日本	株式 その他製品	79,600	25,951 2,065,706,000	25,590 2,036,964,000	- -	1.10%
14	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式 情報・通信業	14,402	140,695 2,026,292,100	137,200 1,975,954,400	- -	1.07%
15	野村ホールディングス	日本	株式 証券・商品先 物取引業	2,128,700	710 1,513,148,200	829 1,764,692,300	- -	0.96%
16	東京海上HD	日本	株式 保険業	640,300	2,470 1,581,796,000	2,750 1,760,825,000	- -	0.95%
17	三菱地所	日本	株式 不動産業	1,041,000	1,424 1,482,457,000	1,577 1,641,657,000	- -	0.89%
18	新日本製鐵	日本	株式 鉄鋼	4,143,000	328 1,359,212,000	379 1,570,197,000	- -	0.85%
19	JFEホールディングス	日本	株式 鉄鋼	402,700	2,921 1,176,376,000	3,810 1,534,287,000	- -	0.83%
20	東日本旅客鉄道	日本	株式 陸運業	280,900	5,919 1,662,728,000	5,430 1,525,287,000	- -	0.83%
21	三井物産	日本	株式 卸売業	1,281,500	1,049 1,344,493,000	1,187 1,521,140,500	- -	0.82%
22	信越化学	日本	株式 化学	263,000	4,201 1,104,904,000	5,100 1,341,300,000	- -	0.73%
23	関西電力	日本	株式 電気・ガス業	625,700	2,189 1,370,242,500	2,115 1,323,355,500	- -	0.72%
24	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式 小売業	594,100	2,120 1,259,550,500	2,220 1,318,902,000	- -	0.71%
25	日産自動車	日本	株式 輸送用機器	1,904,700	533 1,015,672,000	689 1,312,338,300	- -	0.71%
26	東芝	日本	株式 電気機器	2,976,000	337 1,004,031,000	420 1,249,920,000	- -	0.68%
27	ソフトバンク	日本	株式 情報・通信業	608,100	1,717 1,044,584,700	2,015 1,225,321,500	- -	0.66%
28	アステラス製薬	日本	株式 医薬品	334,200	3,310 1,106,202,000	3,610 1,206,462,000	- -	0.65%
29	富士フイルムHLDGS	日本	株式 化学	385,500	2,945 1,135,354,500	3,090 1,191,195,000	- -	0.64%
30	中部電力	日本	株式 電気・ガス業	510,500	2,304 1,176,688,500	2,280 1,163,940,000	- -	0.63%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.86%
合計	99.86%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.10%
鉱業	0.38%
建設業	2.12%
食料品	3.14%
繊維製品	0.93%

パルプ・紙	0.39%
化学	5.86%
医薬品	4.14%
石油・石炭製品	0.82%
ゴム製品	0.59%
ガラス・土石製品	1.19%
鉄鋼	2.81%
非鉄金属	1.28%
金属製品	0.68%
機械	4.44%
電気機器	13.78%
輸送用機器	10.10%
精密機器	1.49%
その他製品	2.34%
電気・ガス業	5.12%
陸運業	3.89%
海運業	0.55%
空運業	0.48%
倉庫・運輸関連業	0.25%
情報・通信業	5.69%
卸売業	4.61%
小売業	3.55%
銀行業	10.09%
証券・商品先物取引業	1.80%
保険業	2.39%
その他金融業	0.76%
不動産業	2.49%
サービス業	1.59%
合計	99.86%

(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 2009年9月	買建	26	226,997,941	248,430,000	0.13%

(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、当該日にもっと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
設定時 (平成13年7月11日)	4,996,055,395	-	1,250.0	-	-
第1計算期間末 (平成14年7月10日)	137,690,332,201	137,772,200,516	1,042.7	1,043.3	1,046
第2計算期間末 (平成15年7月10日)	99,879,477,172	100,969,945,072	978.2	988.9	981
第3計算期間末 (平成16年7月10日)	326,229,828,165	327,183,172,345	1,160.0	1,163.4	1,162
第4計算期間末 (平成17年7月10日)	225,837,184,387	228,570,557,332	1,188.9	1,203.3	1,191
第5計算期間末 (平成18年7月10日)	354,879,041,066	358,181,582,085	1,614.0	1,629.0	1,613
第6計算期間末 (平成19年7月10日)	377,975,712,627	381,927,367,525	1,813.5	1,832.5	1,812
第7計算期間末 (平成20年7月10日)	382,598,866,794	388,782,960,703	1,308.5	1,329.7	1,310
平成20年7月末日	386,408,875,860	-	1,321.5	-	1,324
8月末日	372,075,972,790	-	1,272.5	-	1,272
9月末日	336,115,407,135	-	1,111.5	-	1,115
10月末日	262,500,808,147	-	885.4	-	885
11月末日	246,394,276,197	-	853.3	-	854
12月末日	253,864,591,682	-	879.1	-	883
平成21年1月末日	220,081,541,400	-	812.4	-	811
2月末日	186,983,457,625	-	774.9	-	771
3月末日	182,115,212,877	-	800.7	-	801
4月末日	202,373,790,273	-	866.7	-	867
5月末日	216,737,049,240	-	928.2	-	925
6月末日	188,109,498,915	-	961.3	-	962
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
7月末日	184,771,328,693	-	953.9	-	953

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

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.6200
第2計算期間	10.6800
第3計算期間	3.3900
第4計算期間	14.3900
第5計算期間	15.0200

第6計算期間	18.9600
第7計算期間	21.1500
第8計算期間	26.7400

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	16.5
第2計算期間	5.2
第3計算期間	18.9
第4計算期間	3.7
第5計算期間	37.0
第6計算期間	13.5
第7計算期間	26.7
第8計算期間	31.0

第二部 【ファンドの詳細情報】

第1 【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

第2 【手続等】

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（営業日の正午）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、）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5.までの期日および期間については、受益権の取得申込みの受け付けを停止します。なお、次の1.から4.までに該当する期日および期間であっても、委託会社の判断により、受益権の取得申込みを受け付けることがあります。

- 1．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4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3営業日前から起算して5営業日以内
- 3．東証株価指数構成銘柄の株式移転および合併による東証株価指数からの除外実施日の前営業日から、当該移転後および合併後の新規銘柄の東証株価指数への採用日の翌々営業日までの間
- 4．計算期間終了日の前営業日
- 5．前1.から前4.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

ヲ．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。

ウ．委託会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときおよび委託会社が必要と認めるときは、取得申込みの受け付けの中止、取得申込みの受け付けの取消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、委託会社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（営業日の正午）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け付けます。

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5.までの期日および期間については、振替受益権の交換請求の受け付けを停止します。なお、次の1.から4.までに該当する期日および期間であっても、委託会社の判断により、振替受益権の交換請求を受け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2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各々前営業日から起算して3営業日以内
3. 東証株価指数構成銘柄の株式移転および合併による東証株価指数からの除外実施日の前営業日から、当該移転後および当該合併後の新規銘柄の東証株価指数への採用日の翌営業日までの間
4. 計算期間終了日の前営業日および前々営業日(当該計算期間終了日が休業日の場合であって、当該計算期間終了日の3営業日前の日が交換請求の受け付けを行なう日に該当する場合の当該日を加えます。)
5. 前1.から前4.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

ヘ．交換請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して後ル．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の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

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タ．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、交換請求の受け付けの中止、交換請求の受け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、交換請求の受け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け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、交換の請求を受け付けた場合には、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、前ヘ．による交換のための振替受益権の抹消の申請が振替機関に受け付けられたことを確認した場合に、委託会社の指図にしたがい、受益者が前イ．の請求を行なった販売会社に対する株式の振替機関等の口座への増加の記載または記録のための振替機関等への振替の請求等を行なうものとし、当

該販売会社に、別に定める期日から信託財産に属する株式の振替機関等の口座への増加の記載または記録を行ないます。

ヨ．販売会社は、前カ．により受託会社から振替機関等の口座への増加の記載または記録が行なわれた株式を、所定の手続きを経てすみやかに交付するものとします。

タ．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。

第3 【管理及び運営】

1 【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るほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。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。

- ・お電話によるお問い合わせ先（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、半休日は9:00～12:00）

・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、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す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。

2 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

< 支払方法 >

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

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

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

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

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

(b) 前ハ．の取引参加者は、計算期間終了日までに当該取引参加者にかかる前(a)の受益権の受益者の氏名もしくは名称および住所その他受託会社が定める事項を書面等により受託会社に届出するものとします。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、「第2 手続等」の「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。

ハ．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。

ニ．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、「第2 手続等」の「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

第4 【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7期計算期間（平成19年7月11日から平成20年7月10日まで）及び第8期計算期間（平成20年7月11日から平成21年7月10日まで）の財務諸表について、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

ダイワ上場投信 - トピックス
(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 平成20年7月10日現在	第8期 平成21年7月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	36,355,766,717	17,647,883,255
株式	3, 4 382,133,133,794	3, 4 168,641,002,053
未収入金	675,590,717	2,988,350,934
未収配当金	233,693,150	119,442,150
前払金	402,736,000	222,560,000
その他未収収益	5 32,429,388	5 12,759,223
差入委託証拠金	223,300,000	98,435,000
流動資産合計	420,056,649,766	189,730,432,615
資産合計		
420,056,649,766		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	34,267,641	75,794,356
未払金	389,076,786	159,892,792
未払収益分配金	6,184,093,909	5,179,408,658
未払受託者報酬	133,593,699	67,787,621
未払委託者報酬	219,493,778	109,618,661
未払利息	3,886,870	306,671
受入担保金	30,379,205,407	14,447,886,751
その他未払費用	114,164,882	79,589,710
流動負債合計	37,457,782,972	20,120,285,220
負債合計		
37,457,782,972		
純資産の部		
元本等		
元本	1 365,490,183,750	1 242,118,953,750
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 17,108,683,044	2 72,508,806,355
（分配準備積立金）	259,704,751	128,304,857
元本等合計	382,598,866,794	169,610,147,395
純資産合計		
382,598,866,794		
負債純資産合計		
420,056,649,766		
189,730,432,615		

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 平成19年7月11日 至 平成20年7月10日		自 平成20年7月11日 至 平成21年7月10日	
営業収益				
受取配当金	6,142,211,628		4,859,024,538	
受取利息	175,334,494		77,298,744	
有価証券売買等損益	120,730,439,146		129,434,998,125	
派生商品取引等損益	377,706,738		937,523,993	
その他収益	¹ 898,280,707		¹ 688,097,410	
営業収益合計	113,892,319,055		124,748,101,426	
営業費用				
支払利息	132,853,475		55,054,059	
受託者報酬	257,062,721		167,534,755	
委託者報酬	419,067,329		274,475,967	
その他費用	² 113,627,233		² 79,347,147	
営業費用合計	922,610,758		576,411,928	
営業損失()	114,814,929,813		125,324,513,354	
経常損失()	114,814,929,813		125,324,513,354	
当期純損失()	114,814,929,813		125,324,513,354	
期首剰余金又は期首欠損金()	117,449,941,377		17,108,683,044	
剰余金増加額又は欠損金減少額	33,715,086,375		50,923,080,686	
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-		50,923,080,686	
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	33,715,086,375		-	
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,057,320,986		10,036,648,073	
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,057,320,986		-	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-		10,036,648,073	
分配金	³ 6,184,093,909		³ 5,179,408,658	
期末剰余金又は期末欠損金()	17,108,683,044		72,508,806,355	

(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7期 自平成19年7月11日 至平成20年7月10日	第8期 自平成20年7月11日 至平成21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）、金融商品取引所が発表する基準値段、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。	株式 同左
2. デリバティブ等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。	先物取引 同左
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。	受取配当金 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第7期 平成20年7月10日現在	第8期 平成21年7月10日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	260,525,771,250円 191,802,375,000円 86,837,962,500円	365,490,183,750円 42,461,375,000円 165,832,605,000円
2. 計算期間末日における受益権の総数	292,392,147口	193,695,163口
3. 2 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は72,508,806,355円であります。
4. 3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 29,177,239,420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 13,437,845,250円

5.	4 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 99,600,000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 68,600,000円
6	5 貸付有価証券に係る未収配当金相当額	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分23,137,650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7,779,850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7期 自 平成19年7月11日 至 平成20年7月10日		第8期 自 平成20年7月11日 至 平成21年7月10日	
	1.	1 貸付有価証券に係る配当金相当額	貸付有価証券に係る配当金相当額474,068,595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414,771,249円が含まれております。
2.	2 その他費用	東証株価指数の商標使用料及び信託財産にかかる監査費用であります。	同左	
3.	3 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(7,082,973,354円)及び分配準備積立金(150,582,589円)の合計額から、経費(789,757,283円)を控除して計算される分配対象額は6,443,798,660円(10口当たり220.3円)であり、うち6,184,093,909円(10口当たり211.5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(5,569,366,633円)及び分配準備積立金(259,704,751円)の合計額から、経費(521,357,869円)を控除して計算される分配対象額は5,307,713,515円(10口当たり274.0円)であり、うち5,179,408,658円(10口当たり267.4円)を分配金額としております。	

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第7期 平成20年7月10日現在		第8期 平成21年7月10日現在	
	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	382,133,133,794	99,546,705,505	168,641,002,053	68,567,262,897
合計	382,133,133,794	99,546,705,505	168,641,002,053	68,567,262,897

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の状況に関する事項

区 分	第7期 自 平成19年7月11日 至 平成20年7月10日		第8期 自 平成20年7月11日 至 平成21年7月10日	
	1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。		同左

2. 取引に対する取組方針と取引の利用目的	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、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。	信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。	同左
4. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々ポジション、並びに評価金額及び評価損益の管理を行っております。なお、リスク管理はデリバティブだけに限定して行っておりません。デリバティブと現物資産等を総合し、各信託財産全体でのリスク管理をリスクの種類毎に行っております。	同左
5. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

取引の時価等に関する事項

株式関連

種 類	第7期 平成20年7月10日 現在				第8期 平成21年7月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	484,680,000	-	450,450,000	34,230,000	1,038,072,000	-	962,370,000	75,702,000
合計	484,680,000	-	450,450,000	34,230,000	1,038,072,000	-	962,370,000	75,702,000

(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7期 自 平成19年7月11日 至 平成20年7月10日	第8期 自 平成20年7月11日 至 平成21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。

同左

(1口当たり情報)

	第7期 平成20年7月10日現在	第8期 平成21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)	1,308.5円 (13,085円)	875.7円 (8,757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	71,000	194	13,774,000	
日本水産	194,400	242	47,044,800	貸付株式数 39,300株
マルハニチロホールディングス	309,000	139	42,951,000	貸付株式数 71,000株 (71,000)株
ハウスイ	12,000	133	1,596,000	貸付株式数 9,000株 (5,000)株
サカタのタネ	30,900	1,280	39,552,000	貸付株式数 19,200株 (19,200)株
ホクト	15,600	1,933	30,154,800	
ショーボンドHD	14,900	1,829	27,252,100	貸付株式数 1,600株
住石ホールディングス	46,800	98	4,586,400	貸付株式数 39,300株 (16,100)株
日鉄鉱業	43,000	370	15,910,000	
三井松島	52,000	120	6,240,000	貸付株式数 32,000株 (23,000)株
国際石油開発帝石	772	691,000	533,452,000	
関東天然瓦斯	20,000	530	10,600,000	
石油資源開発	24,000	4,600	110,400,000	貸付株式数 4,800株
ダイセキ環境ソリューション	13	183,000	2,379,000	貸付株式数 7株 (7)株
間組	70,100	118	8,271,800	
東急建設	59,880	279	16,706,520	
コムシスホールディングス	81,900	1,011	82,800,900	貸付株式数 21,000株
ミサワホーム	19,900	346	6,885,400	貸付株式数 9,700株
高松コンストラクションGP	12,700	1,425	18,097,500	
東建コーポレーション	6,300	2,850	17,955,000	貸付株式数 2,130株
ヤマウラ	7,000	189	1,323,000	
大成建設	747,000	205	153,135,000	
大林組	472,000	421	198,712,000	
清水建設	479,000	381	182,499,000	貸付株式数 102,000株 (102,000)株
飛島建設	429,500	43	18,468,500	貸付株式数 60,500株 (43,500)株
長谷工コーポレーション	828,500	84	69,594,000	
松井建設	19,000	368	6,992,000	
鹿島建設	692,000	269	186,148,000	貸付株式数 58,000株
不動テトラ	119,100	76	9,051,600	貸付株式数 87,900株 (49,700)株
大末建設	58,000	46	2,668,000	貸付株式数 12,000株 (12,000)株
鉄建建設	81,000	98	7,938,000	

安藤建設	54,000	142	7,668,000	貸付株式数	22,000株 (22,000)株
太平工業	15,000	283	4,245,000		
西松建設	195,000	128	24,960,000	貸付株式数	29,000株 (29,000)株
三井住友建設	90,000	94	8,460,000	貸付株式数	300株 (300)株
大豊建設	44,000	108	4,752,000	貸付株式数	29,000株 (29,000)株
前田建設	104,000	332	34,528,000		
佐田建設	61,000	54	3,294,000	貸付株式数	10,000株 (10,000)株
ナカノフドー建設	13,000	181	2,353,000	貸付株式数	2,500株 (2,500)株
奥村組	160,000	358	57,280,000		
大和小田急建設	8,000	210	1,680,000		
東鉄工業	20,000	598	11,960,000		
イチケン	18,000	119	2,142,000		
浅沼組	46,000	88	4,048,000	貸付株式数	8,000株 (8,000)株
戸田建設	181,000	354	64,074,000		
熊谷組	110,000	83	9,130,000	貸付株式数	39,000株
青木あすなる建設	11,500	484	5,566,000		
北野建設	37,000	225	8,325,000	貸付株式数	15,000株 (15,000)株
植木組	21,000	133	2,793,000	貸付株式数	3,000株 (3,000)株
三井ホーム	22,000	563	12,386,000		
矢作建設	21,000	599	12,579,000	貸付株式数	3,000株
ピーエス三菱	10,600	385	4,081,000	貸付株式数	7,600株 (7,600)株
大東建託	73,300	4,290	314,457,000		
新日本建設	22,900	154	3,526,600	貸付株式数	8,000株 (8,000)株
N I P P O	33,000	868	28,644,000		
東亜道路	32,000	180	5,760,000	貸付株式数	5,000株 (5,000)株
前田道路	45,000	920	41,400,000		
日本道路	53,000	260	13,780,000	貸付株式数	21,000株 (21,000)株
東亜建設	146,000	124	18,104,000		
若築建設	91,000	65	5,915,000	貸付株式数	15,000株 (15,000)株
東洋建設	221,000	52	11,492,000	貸付株式数	117,000株 (14,000)株
五洋建設	195,500	121	23,655,500	貸付株式数	27,000株 (27,000)株
大成口テック	29,000	142	4,118,000		
大林道路	20,000	210	4,200,000		
世紀東急	42,000	58	2,436,000	貸付株式数	6,000株 (6,000)株
福田組	23,000	170	3,910,000	貸付株式数	4,000株 (4,000)株
東北ミサワホーム	8,200	219	1,795,800	貸付株式数	3,200株 (1,700)株
住友林業	116,100	787	91,370,700	貸付株式数	39,600株
日本基礎技術	21,600	249	5,378,400		

日成ビルド工業	47,000	65	3,055,000	貸付株式数	8,000株 (8,000)株
エス・バイ・エル	87,000	56	4,872,000	貸付株式数	14,000株 (14,000)株
巴コーポレーション	22,900	247	5,656,300		
パナホーム	63,000	548	34,524,000		
大和ハウス	421,000	937	394,477,000		
ライト工業	35,100	239	8,388,900		
積水ハウス	475,000	871	413,725,000		
日特建設	44,000	66	2,904,000	貸付株式数	8,000株 (8,000)株
北陸電気工事	9,000	294	2,646,000		
コミュニチュア	15,000	601	9,015,000		
ユアテック	27,000	554	14,958,000	貸付株式数	5,000株
西部電気工業	14,000	460	6,440,000		
四電工	14,000	464	6,496,000		
中電工	24,400	1,528	37,283,200		
関電工	77,000	664	51,128,000	貸付株式数	37,000株
大明	23,100	887	20,489,700	貸付株式数	5,000株 (5,000)株
きんでん	99,000	771	76,329,000		
東京エネシス	19,000	775	14,725,000		
トーエネック	23,000	518	11,914,000		
住友電設	13,300	460	6,118,000		
日本電設工業	34,000	955	32,470,000		
協和エクシオ	60,000	915	54,900,000		
新日本空調	13,000	698	9,074,000		
日本工営	50,000	313	15,650,000		
東電通	25,000	177	4,425,000		
日本電話施設	28,000	277	7,756,000		
九電工	31,000	617	19,127,000		
三機工業	40,000	695	27,800,000	貸付株式数	13,000株
日揮	170,000	1,378	234,260,000		
中外炉工業	56,000	266	14,896,000		
ヤマト	16,000	328	5,248,000		
太平電業	24,000	881	21,144,000		
高砂熱学	45,000	806	36,270,000	貸付株式数	15,000株
日立プラントテクノロジー	46,000	437	20,102,000	貸付株式数	23,000株 (12,000)株
三晃金属	19,000	352	6,688,000	貸付株式数	13,000株 (8,000)株
NEC ネットエスアイ	14,000	1,148	16,072,000	貸付株式数	2,800株
朝日工業社	19,000	396	7,524,000		
アタカ大機	12,000	244	2,928,000		
大気社	24,100	1,068	25,738,800		
ダイダン	23,000	493	11,339,000		
日比谷総合設	22,300	843	18,798,900	貸付株式数	1,100株 (1,100)株
東芝プラントシステム	27,000	1,115	30,105,000		
日本製粉	106,000	458	48,548,000		
日清製粉G本社	153,000	1,081	165,393,000	貸付株式数	41,500株
日東富士製粉	13,000	291	3,783,000		
昭和産業	76,000	277	21,052,000	貸付株式数	33,000株
鳥越製粉	14,500	719	10,425,500		
日本農産工業	42,000	232	9,744,000	貸付株式数	28,000株 (18,000)株

協同飼料	57,000	119	6,783,000		
中部飼料	16,000	735	11,760,000		
日本配合飼料	46,000	104	4,784,000		
ユニ・チャーム ペットケア	9,600	2,955	28,368,000	貸付株式数	4,900株 (4,900)株
東洋精糖	28,000	111	3,108,000		
日本甜菜糖	93,000	228	21,204,000		
三井製糖	64,000	318	20,352,000		
日本M & Aセンター	24	331,000	7,944,000	貸付株式数	22株 (11)株
アコーディア・ゴルフ	393	73,800	29,003,400		
パソナグループ	156	63,000	9,828,000		
リンクアンドモチベーション	15	52,900	793,500		
テンプホールディングス	18,400	737	13,560,800		
森永製菓	177,000	200	35,400,000	貸付株式数	74,000株 (74,000)株
中村屋	39,000	458	17,862,000		
江崎グリコ	60,000	937	56,220,000		
名糖産業	6,600	1,251	8,256,600		
不二家	92,000	129	11,868,000	貸付株式数	11,000株
山崎製パン	113,000	1,089	123,057,000		
第一屋製パン	22,000	110	2,420,000	貸付株式数	7,000株 (7,000)株
モロゾフ	26,000	310	8,060,000		
雪印乳業	184,500	282	52,029,000		
森永乳業	141,000	378	53,298,000		
ヤクルト	90,400	1,748	158,019,200	貸付株式数	30,500株
明治ホールディングス	47,800	3,610	172,558,000		
プリマハム	94,000	108	10,152,000		
日本ハム	128,000	1,098	140,544,000		
伊藤ハム	127,000	319	40,513,000	貸付株式数	60,000株 (53,000)株
林兼産業	52,000	85	4,420,000	貸付株式数	36,000株 (20,000)株
丸大食品	67,000	248	16,616,000	貸付株式数	17,000株 (17,000)株
米久	16,000	922	14,752,000	貸付株式数	1,500株 (1,500)株
S Foods	9,000	784	7,056,000		
学情	6,300	321	2,022,300		
スタジオアリス	7,200	786	5,659,200	貸付株式数	1,400株
シミック	250	22,310	5,577,500	貸付株式数	120株
システムプロ	97	43,500	4,219,500	貸付株式数	35株
NECフィールドディング	12,700	1,338	16,992,600		
新日鉄ソリューションズ	9,900	1,456	14,414,400		
総合警備保障	52,500	1,025	53,812,500		
日本駐車場開発	1,610	6,170	9,933,700		
コア	5,300	585	3,100,500		
カカクコム	121	382,000	46,222,000		
アイロムホールディングス	350	5,200	1,820,000	貸付株式数	144株
ルネサンス	8,000	308	2,464,000		
セキュアードキャピタルJ	48	101,700	4,881,600	貸付株式数	12株 (5)株
新日本科学	5,700	327	1,863,900	貸付株式数	5,100株 (3,100)株

ソネット・エムスリー	73	318,000	23,214,000	貸付株式数	52株 (20)株
ディー・エヌ・エー	204	310,000	63,240,000	貸付株式数	73株 (32)株
博報堂DYHLDGS	21,800	4,880	106,384,000	貸付株式数	240株 (240)株
ぐるなび	83	275,400	22,858,200	貸付株式数	54株 (26)株
一休	111	37,550	4,168,050	貸付株式数	51株
ジャパンベストレスキューS	22	43,950	966,900	貸付株式数	1株 (1)株
ジェイコム	14	111,600	1,562,400	貸付株式数	2株 (2)株
パシフィックゴルフGRP	387	56,300	21,788,100		
サッポロホールディングス	239,000	505	120,695,000	貸付株式数	80,000株
アサヒビール	316,500	1,361	430,756,500		
麒麟HD	690,000	1,291	890,790,000		
宝ホールディングス	141,000	563	79,383,000	貸付株式数	105,000株 (105,000)株
オエノンホールディングス	46,000	207	9,522,000		
メルシャン	47,000	192	9,024,000		
養命酒	13,000	884	11,492,000		
三国コカ・コ・ラ	22,500	802	18,045,000		
四国コカ・コーラ	7,800	918	7,160,400		
コカ・コーラウエスト	51,900	1,842	95,599,800	貸付株式数	21,700株 (21,700)株
コカコーラセントラルジャパン	18,900	1,355	25,609,500	貸付株式数	5,600株
ダイドードリンコ	7,700	2,730	21,021,000	貸付株式数	7,100株 (3,100)株
伊藤園	46,900	1,498	70,256,200	貸付株式数	18,400株
キーコーヒー	13,700	1,545	21,166,500	貸付株式数	6,700株
ユニカフェ	3,900	1,008	3,931,200		
ジャパンフーズ	2,100	922	1,936,200		
日清オイリオグループ	72,000	549	39,528,000		
不二製油	45,000	1,116	50,220,000	貸付株式数	13,000株
J・オイルミルズ	62,000	331	20,522,000	貸付株式数	32,000株
ローソン	46,600	4,040	188,264,000	貸付株式数	8,700株
インターニックス	5,900	350	2,065,000		
サンエー	5,500	3,450	18,975,000		
麒麟堂	5,700	494	2,815,800		
ダイユーエイト	2,000	602	1,204,000		
カワチ薬品	10,300	1,781	18,344,300		
エービーシー・マート	15,600	2,565	40,014,000		
ハードオフコーポレーション	6,500	476	3,094,000		
高千穂交易	6,100	967	5,898,700		
アスクル	12,500	1,700	21,250,000	貸付株式数	7,000株 (5,200)株
ゲオ	273	72,700	19,847,100		
ポイント	13,360	5,470	73,079,200		
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	9,000	143	1,287,000		
伊藤忠食品	3,700	3,400	12,580,000		
くらコーポレーション	44	221,200	9,732,800	貸付株式数	18株 (18)株
キャンドウ	65	94,400	6,136,000	貸付株式数	49株 (28)株
高千穂電気	9,700	1,027	9,961,900	貸付株式数	2,900株

パル	3,800	1,719	6,532,200		
JALUX	4,200	1,282	5,384,400	貸付株式数	2,600株 (700)株
エディオン	59,300	547	32,437,100	貸付株式数	29,700株 (6,700)株
サーラコーポレーション	14,500	496	7,192,000	貸付株式数	8,500株 (8,500)株
トーマンデバイス	1,900	1,219	2,316,100		
バルス	77	73,000	5,621,000	貸付株式数	63株 (34)株
あみやき亭	26	141,500	3,679,000	貸付株式数	6株
双日	922,800	184	169,795,200		
アルフレッサホールディングス	29,700	4,480	133,056,000		
ハニーズ	10,430	738	7,697,340	貸付株式数	2,110株
キッコーマン	147,000	925	135,975,000	貸付株式数	3,000株
味の素	458,000	772	353,576,000		
キューピー	87,200	995	86,764,000		
ハウス食品	62,200	1,378	85,711,600	貸付株式数	32,700株
カゴメ	65,200	1,575	102,690,000		
焼津水産化工	8,500	994	8,449,000		
アリアケジャパン	13,800	1,489	20,548,200		
ニチレイ	189,000	375	70,875,000		
横浜冷凍	32,000	595	19,040,000		
東洋水産	66,000	2,055	135,630,000		
日清食品HD	53,600	2,915	156,244,000		
永谷園	15,000	870	13,050,000		
フジッコ	18,000	1,083	19,494,000		
ロックフィールド	8,100	1,196	9,687,600		
日本たばこ産業	3,739	272,900	1,020,373,100		
わらべや日洋	8,500	1,139	9,681,500		
なとり	7,200	776	5,587,200		
片倉工業	18,100	869	15,728,900	貸付株式数	8,300株
グンゼ	108,000	421	45,468,000	貸付株式数	21,000株
昭栄	25,100	699	17,544,900		
神栄	19,000	150	2,850,000		
川島織物セルコン	55,000	85	4,675,000	貸付株式数	43,000株 (22,000)株
山下医科器械	1,100	1,055	1,160,500		
ラサ商事	6,300	347	2,186,100		
アルペン	11,400	1,675	19,095,000		
ビックカメラ	360	34,950	12,582,000	貸付株式数	98株
DCM JAPAN HLDGS	74,500	625	46,562,500		
あいホールディングス	34,400	314	10,801,600	貸付株式数	15,400株 (15,400)株
ユニバース	1,900	1,253	2,380,700		
J. フロント リテイリング	376,000	436	163,936,000	貸付株式数	131,000株
ドトール・日レスHD	21,300	1,296	27,604,800		
マツモトキヨシHLDGS	27,500	2,085	57,337,500	貸付株式数	14,600株
ココカラファイン HD	8,400	1,525	12,810,000		
三越伊勢丹HD	271,900	937	254,770,300	貸付株式数	181,200株 (89,300)株
東洋紡績	523,000	160	83,680,000	貸付株式数	167,000株
ユニチカ	356,000	79	28,124,000		
富士紡ホールディングス	64,000	111	7,104,000		

日清紡ホールディングス	112,000	1,090	122,080,000		
倉敷紡績	162,000	188	30,456,000	貸付株式数	52,000株
ダイワボウHD	111,000	316	35,076,000	貸付株式数	81,000株 (45,000)株
シキボウ	102,000	151	15,402,000		
日東紡績	150,000	166	24,900,000	貸付株式数	49,000株 (49,000)株
トヨタ紡織	52,600	1,533	80,635,800	貸付株式数	19,200株
クリエイトSDH	4,900	1,860	9,114,000	貸付株式数	800株 (800)株
バイタルKSKHD	18,300	516	9,442,800		
日本毛織	51,000	659	33,609,000		
大東紡織	24,000	88	2,112,000	貸付株式数	9,000株 (4,000)株
トーア紡コーポレーション	56,000	76	4,256,000	貸付株式数	17,000株
ダイドーリミテッド	21,100	618	13,039,800		
御幸ホールディングス	15,000	314	4,710,000		
東京建物不動産販	6,500	258	1,677,000		
野村不動産HLDG S	42,100	1,490	62,729,000	貸付株式数	20,400株
ヒューリック	41,100	524	21,536,400	貸付株式数	17,100株 (17,100)株
帝国繊維	16,000	456	7,296,000		
ブックオフコーポレーション	8,200	1,104	9,052,800	貸付株式数	1,000株
日本コークス工業	96,000	106	10,176,000	貸付株式数	19,000株
ミタチ産業	3,100	500	1,550,000		
JFE商事HLDG S	100,000	328	32,800,000		
あさひ	2,500	2,985	7,462,500	貸付株式数	1,500株 (1,100)株
サークルKサンクス	36,300	1,531	55,575,300	貸付株式数	14,800株
日本調剤	2,620	1,725	4,519,500		
コスモス薬品	5,400	1,938	10,465,200		
グリーンホスピタルサプライ	138	49,500	6,831,000	貸付株式数	103株 (59)株
セブン&アイ・HLDG S	593,200	2,120	1,257,584,000		
ツルハホールディングス	11,100	3,130	34,743,000	貸付株式数	5,400株
サンマルクホールディングス	4,400	3,070	13,508,000		
フェリシモ	4,200	1,716	7,207,200		
トリドール	24	171,800	4,123,200	貸付株式数	3株
帝人	644,000	277	178,388,000		
東レ	1,048,000	448	469,504,000	貸付株式数	495,000株
三菱レイヨン	393,000	244	95,892,000		
クラレ	232,500	1,071	249,007,500		
旭化成	983,000	459	451,197,000		
サカイオーベックス	45,000	95	4,275,000	貸付株式数	18,000株 (4,000)株
稲葉製作所	7,500	993	7,447,500		
宮地エンジニアリングG	45,000	88	3,960,000	貸付株式数	15,000株 (7,000)株
三協・立山HLDG S	197,000	87	17,139,000	貸付株式数	40,000株
トーカロ	9,600	1,316	12,633,600		
アルファCO	5,000	515	2,575,000	貸付株式数	2,000株 (2,000)株
SUMCO	84,300	1,454	122,572,200	貸付株式数	16,000株
川田テクノロジーズ	3,800	1,591	6,045,800		
住江織物	40,000	152	6,080,000	貸付株式数	23,000株 (23,000)株

日本フエルト	8,900	423	3,764,700		
イチカワ	11,000	249	2,739,000		
日本バイリン	21,000	469	9,849,000	貸付株式数	6,000株
エコナック	43,000	52	2,236,000	貸付株式数	36,000株 (18,000)株
日東製網	19,000	124	2,356,000	貸付株式数	2,000株 (2,000)株
芦森工業	37,000	148	5,476,000	貸付株式数	12,000株 (12,000)株
アツギ	145,000	128	18,560,000		
ダイニック	30,000	170	5,100,000		
共和レザー	9,200	393	3,615,600		
セーレン	39,300	479	18,824,700	貸付株式数	12,600株
東海染工	22,000	92	2,024,000		
小松精練	26,000	337	8,762,000		
ワコールホールディングス	94,000	1,193	112,142,000	貸付株式数	45,000株
ホギメディカル	7,600	4,980	37,848,000		
サンエー・インターナショナル	6,500	855	5,557,500		
レナウン	26,700	211	5,633,700	貸付株式数	11,100株 (11,100)株
クラウディア	1,600	1,395	2,232,000		
ITホールディングス	48,400	1,655	80,102,000		
コーエーテクモHD	22,700	685	15,549,500		
特種東海HLDGS	107,000	249	26,643,000	貸付株式数	2,000株 (2,000)株
ドワンゴ	74	147,900	10,944,600	貸付株式数	56株 (35)株
ベリサーブ	7	176,000	1,232,000	貸付株式数	3株 (3)株
マクロミル	84	106,200	8,920,800	貸付株式数	21株
ティーガイア	120	139,000	16,680,000		
GMOペイメントゲートウェイ	24	119,600	2,870,400		
ザッパラス	46	184,000	8,464,000	貸付株式数	35株 (18)株
インターネットイニシアティブ	87	195,900	17,043,300		
ソネットエンタテインメント	84	193,300	16,237,200		
SRAホールディングス	7,000	839	5,873,000		
JBISホールディングス	16,900	365	6,168,500		
朝日ネット	11,000	294	3,234,000		
王子製紙	647,000	390	252,330,000		
三菱製紙	224,000	129	28,896,000		
北越製紙	90,000	443	39,870,000		
中越パルプ	59,000	225	13,275,000	貸付株式数	4,000株 (4,000)株
巴川製紙	24,000	216	5,184,000	貸付株式数	18,000株 (10,000)株
大王製紙	65,000	788	51,220,000	貸付株式数	4,000株
紀州製紙	49,000	85	4,165,000	貸付株式数	39,000株 (20,000)株
日本製紙G本社	73,500	2,330	171,255,000		
レンゴー	123,000	592	72,816,000	貸付株式数	50,000株
トーモク	47,000	204	9,588,000		
ザ・パック	10,000	1,404	14,040,000		
コ・プケミカル	21,000	187	3,927,000	貸付株式数	19,000株 (8,000)株
昭和電工	817,000	159	129,903,000		

住友化学	1,161,000	402	466,722,000		
日本化成	29,000	155	4,495,000		
住友精化	29,000	380	11,020,000		
日産化学	106,000	1,061	112,466,000		
ラサ工業	63,000	120	7,560,000	貸付株式数	28,000株
クレハ	102,000	518	52,836,000		
テイカ	26,000	277	7,202,000		
石原産業	245,000	101	24,745,000		
片倉チツカリン	12,000	331	3,972,000		
日本曹達	94,000	406	38,164,000		
東ソー	422,000	260	109,720,000	貸付株式数	96,000株
トクヤマ	193,000	659	127,187,000		
セントラル硝子	161,000	346	55,706,000		
東亜合成	173,000	261	45,153,000		
ダイソー	62,000	239	14,818,000	貸付株式数	26,000株 (26,000)株
関東電化	35,000	459	16,065,000	貸付株式数	25,000株 (25,000)株
電気化学	331,000	277	91,687,000		
イビデン	105,800	2,600	275,080,000		
信越化学	262,600	4,200	1,102,920,000		
日本カ - バイド	34,000	98	3,332,000		
堺 化 学	52,000	379	19,708,000		
エア・ウォーター	113,000	1,019	115,147,000	貸付株式数	22,000株 (22,000)株
大陽日酸	245,000	875	214,375,000		
日本化学工業	52,000	243	12,636,000	貸付株式数	18,000株
日本パ - カライジング	37,000	986	36,482,000		
高压ガス	23,000	514	11,822,000		
チタン工業	20,000	248	4,960,000	貸付株式数	14,000株 (7,000)株
四国化成	23,000	445	10,235,000		
戸田工業	25,000	373	9,325,000		
ステラ ケミファ	7,500	3,190	23,925,000	貸付株式数	5,400株 (2,900)株
保土谷化学	39,000	225	8,775,000	貸付株式数	36,000株 (16,000)株
日本触媒	105,000	733	76,965,000	貸付株式数	3,000株
大日精化	55,000	253	13,915,000		
カネカ	196,000	635	124,460,000		
協和発酵キリン	216,000	1,026	221,616,000		
三菱瓦斯化学	271,000	471	127,641,000		
三井化学	481,000	282	135,642,000		
J S R	143,500	1,706	244,811,000		
東京応化工業	30,500	1,896	57,828,000	貸付株式数	18,900株 (13,000)株
三菱ケミカルH L D G S	915,500	383	350,636,500		
日本合成化学	41,000	454	18,614,000		
ダイセル化学	205,000	529	108,445,000		
住友ベ - クライト	160,000	444	71,040,000	貸付株式数	36,000株
積水化学	353,000	526	185,678,000		
日本ゼオン	136,000	345	46,920,000		
アイカ工業	49,000	881	43,169,000		
宇部興産	660,000	255	168,300,000		
積水樹脂	22,000	772	16,984,000		
タキロン	37,000	300	11,100,000		

旭有機材	54,000	249	13,446,000		
日立化成	68,200	1,587	108,233,400	貸付株式数	28,500株 (28,500)株
ニチバン	17,000	315	5,355,000		
リケンテクノス	28,000	213	5,964,000		
大倉工業	38,000	238	9,044,000		
積水化成品	41,000	349	14,309,000		
群栄化学	42,000	217	9,114,000		
タイガース ポリマー	7,700	407	3,133,900		
日本カ-リット	12,500	475	5,937,500		
日本化薬	111,000	692	76,812,000		
イーピーエス	42	370,000	15,540,000	貸付株式数	33株 (18)株
パナソニック電工 I S	3,000	1,992	5,976,000		
フェイス	615	8,100	4,981,500		
アミューズ	3,900	982	3,829,800	貸付株式数	1,200株
野村総合研究所	73,600	2,115	155,664,000		
ドリームインキュベータ	46	76,000	3,496,000		
サイバネットシステム	121	36,550	4,422,550	貸付株式数	36株 (1)株
T A C	7,800	422	3,291,600	貸付株式数	2,500株
ケネディクス	417	36,200	15,095,400	貸付株式数	230株 (46)株
電通	156,000	1,837	286,572,000	貸付株式数	70,000株
インテージ	3,700	1,622	6,001,400	貸付株式数	1,500株 (1,500)株
テイクアンドギヴニーズ	423	11,330	4,792,590	貸付株式数	382株 (169)株
ぴあ	3,700	1,195	4,421,500	貸付株式数	2,100株 (700)株
シンプレクス・テクノロジー	248	44,600	11,060,800	貸付株式数	63株
イオンファンタジー	4,800	1,015	4,872,000	貸付株式数	1,800株 (1,800)株
ソースネクスト	13	28,200	366,600		
ネクシィーズ	627	3,390	2,125,530	貸付株式数	329株
日本精化	13,000	572	7,436,000		
A D E K A	67,800	837	56,748,600		
日油	138,000	376	51,888,000	貸付株式数	59,000株 (59,000)株
ミヨシ油脂	52,000	145	7,540,000		
ハリマ化成	13,000	400	5,200,000		
花 王	404,000	2,065	834,260,000		
第一工業製薬	26,000	238	6,188,000	貸付株式数	11,000株 (11,000)株
三洋化成	46,000	483	22,218,000		
武田薬品	553,700	3,720	2,059,764,000		
アステラス製薬	353,400	3,310	1,169,754,000		
大日本住友製薬	111,600	847	94,525,200		
塩野義製薬	230,000	1,888	434,240,000		
田辺三菱製薬	157,000	1,151	180,707,000		
わかもと製薬	18,000	346	6,228,000		
あすか製薬	17,000	806	13,702,000		
日本新薬	39,000	1,121	43,719,000		
中外製薬	209,300	1,837	384,484,100		
科研製薬	65,000	850	55,250,000		
エーザイ	194,100	3,330	646,353,000		

ロート製薬	71,000	1,106	78,526,000	貸付株式数	24,000株
小野薬品	79,100	4,200	332,220,000		
久光製薬	48,900	3,190	155,991,000		
有機合成薬品	12,000	282	3,384,000	貸付株式数	5,000株
持田製薬	65,000	923	59,995,000		
大正製薬	150,000	1,847	277,050,000		
参天製薬	48,800	2,940	143,472,000		
エスエス製薬	38,000	504	19,152,000	貸付株式数	7,000株 (7,000)株
扶桑薬品	51,000	304	15,504,000		
日本ケミファ	25,000	318	7,950,000	貸付株式数	7,000株
ツムラ	46,300	3,020	139,826,000	貸付株式数	23,300株
テルモ	108,400	4,250	460,700,000		
みらかホールディングス	30,000	2,440	73,200,000		
キッセイ薬品工業	32,000	2,290	73,280,000		
生化学工業	30,100	1,066	32,086,600		
栄研化学	10,200	811	8,272,200		
日水製薬	6,300	804	5,065,200		
鳥居薬品	9,400	1,753	16,478,200		
東和薬品	6,400	4,760	30,464,000	貸付株式数	2,700株
沢井製薬	10,300	5,300	54,590,000	貸付株式数	3,000株
ゼリア新薬工業	23,000	1,015	23,345,000	貸付株式数	17,000株 (6,000)株
第一三共	464,000	1,663	771,632,000		
キョーリン	39,000	1,503	58,617,000		
大日本塗料	90,000	105	9,450,000	貸付株式数	38,000株 (38,000)株
日本ペイント	174,000	467	81,258,000	貸付株式数	92,000株
関西ペイント	178,000	677	120,506,000		
トウペ	13,000	116	1,508,000	貸付株式数	8,000株 (8,000)株
中国塗料	45,000	672	30,240,000	貸付株式数	14,000株
日本特殊塗料	12,100	339	4,101,900		
藤倉化成	18,400	503	9,255,200		
太陽インキ製造	11,600	2,095	24,302,000	貸付株式数	8,300株 (5,000)株
D I C	519,000	134	69,546,000	貸付株式数	216,000株 (216,000)株
サカタインクス	32,000	336	10,752,000		
東洋インキ	156,000	320	49,920,000		
アルプス技研	6,700	532	3,564,400		
サニックス	22,900	117	2,679,300	貸付株式数	11,600株 (4,000)株
ダイオーズ	2,900	475	1,377,500		
日本空調サービス	3,500	739	2,586,500		
オリエンタルランド	42,500	6,450	274,125,000		
ダスキン	47,300	1,647	77,903,100		
パーク24	89,900	818	73,538,200		
明光ネットワークジャパン	13,000	473	6,149,000		
ファルコバイオシステムズ	8,100	757	6,131,700		
クレスコ	4,300	490	2,107,000		
フジ・メディア・HD	1,547	135,800	210,082,600		
秀英予備校	3,100	473	1,466,300		
田谷	2,400	718	1,723,200		
ラウンドワン	23,300	912	21,249,600	貸付株式数	4,400株 (4,400)株

リゾートトラスト	26,600	1,108	29,472,800	貸付株式数	7,500株
オービック	4,660	15,090	70,319,400		
ティーディーシーソフトウェア	3,200	708	2,265,600		
ヤフー	10,865	28,520	309,869,800		
ビー・エム・エル	8,200	2,285	18,737,000		
ワタベウェディング	4,600	1,533	7,051,800		
トレンドマイクロ	71,500	3,090	220,935,000	貸付株式数	30,000株 (30,000)株
もしもしホットライン	11,350	2,055	23,324,250	貸付株式数	500株
東急コミュニティー	4,000	2,185	8,740,000		
リソー教育	1,595	4,190	6,683,050		
日本オラクル	23,800	3,700	88,060,000	貸付株式数	7,600株
アルファシステムズ	4,000	2,135	8,540,000		
フューチャーアーキテクト	178	40,900	7,280,200	貸付株式数	65株 (65)株
ウェアハウス	4,000	485	1,940,000		
シーエーシー	8,100	714	5,783,400		
ソフトバンク・テクノ	3,500	683	2,390,500		
トーセ	3,600	627	2,257,200		
ユー・エス・エス	21,400	4,980	106,572,000		
オービックビジネスC	4,700	3,770	17,719,000	貸付株式数	3,300株 (3,300)株
日立ビジネスソリュー	4,600	610	2,806,000		
伊藤忠テクノソリュー	18,500	2,710	50,135,000	貸付株式数	7,800株
アイティフォー	16,500	404	6,666,000		
東京個別指導学院	12,200	155	1,891,000		
東計電算	3,100	1,108	3,434,800		
カルチュア・コンビニエンス	72,200	798	57,615,600	貸付株式数	65,200株 (30,100)株
エクスネット	15	136,200	2,043,000		
テー・オー・ダブリュー	3,400	559	1,900,600		
大塚商会	11,800	4,620	54,516,000	貸付株式数	5,300株
総合メディカル	3,600	2,050	7,380,000	貸付株式数	700株 (100)株
サイボウズ	222	18,780	4,169,160	貸付株式数	21株 (21)株
ソフトブレーン	217	4,460	967,820	貸付株式数	200株 (86)株
アグレックス	2,900	861	2,496,900		
セントラルスポーツ	4,300	870	3,741,000		
電通国際情報S	10,700	618	6,612,600		
ウェザーニューズ	3,900	1,576	6,146,400	貸付株式数	1,600株 (1,600)株
C I J	14,700	298	4,380,600	貸付株式数	5,700株 (5,700)株
フルキャストホールディングス	129	8,700	1,122,300	貸付株式数	106株 (75)株
富士フイルムHLDS	384,900	2,945	1,133,530,500		
コニカミノルタHLDS	397,500	908	360,930,000		
資生堂	268,000	1,470	393,960,000		
ライオン	182,000	436	79,352,000	貸付株式数	84,000株
高砂香料	55,000	516	28,380,000		
マンダム	15,800	2,345	37,051,000		
ミルボン	6,400	2,175	13,920,000	貸付株式数	2,300株
ファンケル	27,400	1,158	31,729,200		
コーセー	25,500	1,964	50,082,000	貸付株式数	6,500株

ドクターシーラボ	105	160,100	16,810,500	貸付株式数	20株
エステー	11,000	973	10,703,000		
コニシ	12,400	756	9,374,400		
長谷川香料	17,800	1,205	21,449,000	貸付株式数	9,000株 (9,000)株
小林製薬	21,900	3,610	79,059,000	貸付株式数	7,000株
荒川化学工業	13,200	1,026	13,543,200		
メック	10,500	557	5,848,500		
日本高純度化学	41	310,000	12,710,000	貸付株式数	38株 (22)株
荏原ユーザライト	1,700	1,710	2,907,000		
アース製薬	12,200	2,535	30,927,000		
イハラケミカル	29,000	354	10,266,000		
北興化学	17,000	316	5,372,000		
大成ラミック	4,400	2,070	9,108,000		
クミアイ化学	41,000	414	16,974,000	貸付株式数	2,000株
日本農薬	33,000	834	27,522,000	貸付株式数	4,000株 (4,000)株
新日本石油	1,095,000	484	529,980,000		
昭和シエル石油	123,300	960	118,368,000		
コスモ石油	436,000	281	122,516,000		
富士興産	56,000	86	4,816,000	貸付株式数	35,000株 (24,000)株
ニチレキ	19,000	373	7,087,000		
東燃ゼネラル石油	238,000	899	213,962,000	貸付株式数	99,000株 (99,000)株
ユシロ化学	7,800	1,285	10,023,000	貸付株式数	5,000株 (3,300)株
ビーピー・カストロール	5,100	314	1,601,400	貸付株式数	2,100株 (300)株
新日鉱ホールディングス	651,000	423	275,373,000		
AOCホールディングス	36,500	794	28,981,000	貸付株式数	10,700株
出光興産	18,700	7,370	137,819,000		
横浜ゴム	192,000	474	91,008,000		
東洋ゴム	161,000	185	29,785,000		
ブリヂストン	494,100	1,531	756,467,100		
住友ゴム	135,300	811	109,728,300		
藤倉ゴム	9,900	368	3,643,200		
オカモト	64,000	334	21,376,000		
アキレス	128,000	146	18,688,000		
フコク	7,400	469	3,470,600		
ニッタ	14,000	1,399	19,586,000	貸付株式数	6,500株 (6,500)株
クリエートメディック	4,500	910	4,095,000		
東海ゴム	29,200	993	28,995,600		
三ツ星ベルト	45,000	399	17,955,000	貸付株式数	22,000株
バンドー化学	55,000	241	13,255,000		
鬼怒川ゴム	38,000	145	5,510,000		
旭硝子	777,000	727	564,879,000		
日本板硝子	501,000	250	125,250,000		
石塚硝子	20,000	203	4,060,000		
有沢製作所	21,300	571	12,162,300		
日本山村硝子	72,000	266	19,152,000		
日本電気硝子	256,000	994	254,464,000		
オハラ	7,100	1,313	9,322,300	貸付株式数	3,000株
住友大阪セメント	300,000	185	55,500,000	貸付株式数	53,000株

太平洋セメント	622,000	153	95,166,000		
デイ・シイ	12,900	298	3,844,200		
リゾートソリューション	13,000	157	2,041,000	貸付株式数	4,000株
日本ヒュ-ム	12,000	298	3,576,000		
日本コンクリ-ト	24,000	165	3,960,000	貸付株式数	10,000株 (10,000)株
東海カーボン	137,000	444	60,828,000	貸付株式数	29,000株
日本カーボン	77,000	239	18,403,000	貸付株式数	33,000株
東洋炭素	6,600	3,450	22,770,000	貸付株式数	5,000株 (2,800)株
ノリタケ	81,000	323	26,163,000	貸付株式数	12,000株 (12,000)株
TOTO	243,000	613	148,959,000	貸付株式数	49,000株
日本碍子	189,000	1,934	365,526,000		
日本特殊陶業	139,000	918	127,602,000		
ダントーホールディングス	21,000	133	2,793,000	貸付株式数	7,000株
MARUWA	4,700	1,681	7,900,700		
日本セラテック	26	38,400	998,400		
品川白煉瓦	43,000	236	10,148,000		
黒崎播磨	38,000	179	6,802,000	貸付株式数	9,000株 (9,000)株
東京窯業	19,000	206	3,914,000		
ニッカトー	5,900	561	3,309,900		
フジミインコーポレーテッド	15,800	1,581	24,979,800	貸付株式数	7,100株 (300)株
エーアンドエーマテリアル	33,000	90	2,970,000		
ニチアス	76,000	303	23,028,000	貸付株式数	11,000株 (11,000)株
新日本製鐵	4,136,000	328	1,356,608,000		
住友金属工業	2,696,000	226	609,296,000		
神戸製鋼所	2,184,000	160	349,440,000		
日新製鋼	604,000	183	110,532,000	貸付株式数	201,000株
中山製鋼所	86,000	206	17,716,000		
合同製鐵	96,000	261	25,056,000	貸付株式数	3,000株 (3,000)株
JFEホールディングス	402,100	2,920	1,174,132,000		
東京製鐵	65,200	1,050	68,460,000		
共英製鋼	12,600	2,420	30,492,000		
大和工業	37,000	2,505	92,685,000		
東京鐵鋼	31,000	337	10,447,000	貸付株式数	12,000株 (12,000)株
大阪製鐵	9,900	1,617	16,008,300		
淀川製鋼所	121,000	441	53,361,000		
東洋鋼鈑	33,000	393	12,969,000		
住友鋼管	10,700	515	5,510,500		
丸一鋼管	43,900	1,764	77,439,600	貸付株式数	27,200株 (20,200)株
モリ工業	27,000	216	5,832,000		
大同特殊鋼	244,000	344	83,936,000	貸付株式数	77,000株
日本高周波	61,000	97	5,917,000		
日本金属工業	108,000	204	22,032,000	貸付株式数	83,000株 (41,000)株
日本冶金工	87,000	428	37,236,000	貸付株式数	31,500株 (31,500)株
山陽特殊鋼	78,000	324	25,272,000	貸付株式数	38,000株
愛知製鋼	84,000	326	27,384,000		

日立金属	103,000	725	74,675,000	貸付株式数	11,000株
日本金属	41,000	147	6,027,000	貸付株式数	11,000株
大平洋金属	110,000	652	71,720,000	貸付株式数	50,000株
日本電工	61,000	557	33,977,000	貸付株式数	44,000株 (26,000)株
栗本鉄工所	68,000	96	6,528,000	貸付株式数	24,000株 (11,000)株
旭テック	61,000	46	2,806,000	貸付株式数	45,000株 (26,000)株
日本鑄鉄管	15,000	129	1,935,000		
日本製鋼所	226,000	1,073	242,498,000	貸付株式数	38,000株
三菱製鋼	95,000	212	20,140,000		
日亜鋼業	24,000	309	7,416,000		
日本精線	12,000	266	3,192,000	貸付株式数	2,000株
日本軽金属	382,000	91	34,762,000		
大紀アルミニウム	24,000	210	5,040,000		
三井金属	455,000	220	100,100,000		
東邦亜鉛	83,000	342	28,386,000	貸付株式数	41,000株
三菱マテリアル	957,000	250	239,250,000		
住友鉱山	408,000	1,229	501,432,000		
DOWAホールディングス	199,000	349	69,451,000	貸付株式数	182,000株 (182,000)株
古河機金	265,000	109	28,885,000	貸付株式数	76,000株
エス・サイエンス	763,000	2	1,526,000		
大阪チタニウム	15,500	3,140	48,670,000	貸付株式数	12,800株 (8,600)株
東邦チタニウム	25,600	1,498	38,348,800	貸付株式数	5,800株
住友軽金属	223,000	91	20,293,000		
古河スカイ	74,000	167	12,358,000		
古河電工	495,000	425	210,375,000	貸付株式数	78,000株
住友電工	519,600	1,011	525,315,600		
フジクラ	236,000	438	103,368,000	貸付株式数	48,000株
三菱電線工業	101,000	95	9,595,000	貸付株式数	21,000株
昭和電線HLDGS	188,000	109	20,492,000		
東京特殊電線	21,000	106	2,226,000		
タツタ電線	36,000	240	8,640,000		
日立電線	122,000	288	35,136,000	貸付株式数	46,000株
沖電線	16,000	150	2,400,000		
カナレ電気	1,700	1,029	1,749,300		
平河ヒューテック	4,500	670	3,015,000		
リョービ	96,000	233	22,368,000		
アサヒHD	22,000	1,667	36,674,000		
東洋製罐	121,500	1,883	228,784,500		
ホッカンホールディングス	38,000	246	9,348,000		
コロナ	7,000	1,150	8,050,000		
横河ブリッジHLDGS	30,000	758	22,740,000		
日本橋梁	4,900	220	1,078,000	貸付株式数	1,600株 (1,600)株
松尾橋梁	8,000	118	944,000		
駒井鉄工	24,000	209	5,016,000		
ハルテック	14,000	92	1,288,000		
サクラダ	80,000	28	2,240,000	貸付株式数	31,000株 (7,000)株
高田機工	12,000	244	2,928,000	貸付株式数	3,000株 (3,000)株
三和ホールディングス	157,000	332	52,124,000	貸付株式数	55,000株

文化シャツタ -	40,000	357	14,280,000		
東洋シャツタ -	3,600	742	2,671,200		
住生活グループ	190,200	1,368	260,193,600		
日本フィルコン	11,400	468	5,335,200		
ノーリツ	26,100	1,007	26,282,700	貸付株式数	16,200株 (11,900)株
長府製作所	16,800	1,877	31,533,600		
リンナイ	30,400	3,940	119,776,000	貸付株式数	22,500株 (13,700)株
ユニプレス	20,800	1,041	21,652,800	貸付株式数	8,000株 (8,000)株
ダイニチ工業	8,900	664	5,909,600		
日東精工	21,000	238	4,998,000		
三洋工業	21,000	180	3,780,000		
岡 部	30,900	377	11,649,300		
日立ツール	9,000	849	7,641,000		
中国工業	22,000	109	2,398,000	貸付株式数	9,000株 (9,000)株
東 プ レ	32,800	744	24,403,200		
高周波熱錬	23,000	689	15,847,000	貸付株式数	6,000株
東京製綱	114,000	282	32,148,000	貸付株式数	70,000株 (48,000)株
パイオラックス	6,600	1,542	10,177,200		
日本発条	103,000	599	61,697,000		
中央発條	20,000	253	5,060,000		
アドバネクス	28,000	81	2,268,000	貸付株式数	13,000株
三浦工業	23,400	2,200	51,480,000	貸付株式数	8,500株
タ ク マ	61,000	223	13,603,000		
ツ ガ ミ	45,000	190	8,550,000	貸付株式数	28,000株 (28,000)株
オークマ	95,000	394	37,430,000		
東芝機械	86,000	311	26,746,000	貸付株式数	50,000株 (50,000)株
ア マ ダ	241,000	541	130,381,000		
アイダエンジニア	40,700	294	11,965,800	貸付株式数	10,200株
牧野フライス	72,000	284	20,448,000	貸付株式数	30,000株 (30,000)株
オーエスジー	64,800	760	49,248,000	貸付株式数	47,800株 (25,000)株
ダイジェット	18,000	155	2,790,000		
旭ダイヤモンド	38,000	581	22,078,000	貸付株式数	11,000株 (11,000)株
森精機製作所	67,600	899	60,772,400	貸付株式数	34,100株 (20,400)株
ディスコ	14,100	3,990	56,259,000	貸付株式数	5,400株
日東工器	9,200	1,828	16,817,600		
豊田自動織機	121,800	2,225	271,005,000		
豊和工業	88,000	63	5,544,000	貸付株式数	58,000株 (31,000)株
大阪機工	49,000	95	4,655,000	貸付株式数	20,000株 (20,000)株
石川製作所	33,000	69	2,277,000	貸付株式数	32,000株 (15,000)株
東洋機械金属	9,700	139	1,348,300		
オ - エム製作所	11,000	362	3,982,000		
津田駒工業	38,000	170	6,460,000		

エンシュウ	39,000	103	4,017,000	貸付株式数	27,000株 (17,000)株
島精機製作所	18,800	2,060	38,728,000	貸付株式数	8,100株 (8,100)株
日本スピンドル	21,000	175	3,675,000		
日阪製作所	17,000	967	16,439,000	貸付株式数	15,000株 (7,000)株
やまびこ	5,500	1,274	7,007,000		
ペガサスミシン製造	13,300	173	2,300,900		
ナプテスコ	63,000	873	54,999,000		
三井海洋開発	10,500	1,520	15,960,000	貸付株式数	9,500株 (6,100)株
レオン自動機	16,000	248	3,968,000		
S M C	47,000	9,450	444,150,000	貸付株式数	19,600株 (19,600)株
新川	13,800	1,308	18,050,400	貸付株式数	4,800株
ホソカワミクロン	24,000	413	9,912,000	貸付株式数	12,000株
ユニオンツール	8,600	2,240	19,264,000	貸付株式数	7,400株 (3,600)株
オイレス工業	17,400	1,356	23,594,400		
サトー	16,500	880	14,520,000		
日本エアーテック	4,600	498	2,290,800		
日精樹脂工業	12,500	268	3,350,000		
ワイエイシイ	6,600	573	3,781,800		
小松製作所	700,300	1,336	935,600,800		
住友重機械	396,000	378	149,688,000		
日立建機	80,400	1,420	114,168,000	貸付株式数	39,100株
日 工	22,000	275	6,050,000		
巴工業	5,800	1,210	7,018,000		
井関農機	158,000	363	57,354,000	貸付株式数	41,000株 (41,000)株
T O W A	13,800	551	7,603,800	貸付株式数	5,100株 (2,500)株
丸山製作所	35,000	195	6,825,000	貸付株式数	29,000株 (15,000)株
北川鉄工所	72,000	121	8,712,000	貸付株式数	30,000株 (30,000)株
シンニッタン	13,600	274	3,726,400		
クボタ	721,000	715	515,515,000		
荏原実業	3,700	1,312	4,854,400		
東洋エンジニア	99,000	291	28,809,000	貸付株式数	30,000株
三菱化工機	45,000	244	10,980,000	貸付株式数	22,000株
月島機械	23,000	543	12,489,000		
帝国電機製作所	5,600	2,075	11,620,000	貸付株式数	3,700株 (2,400)株
東京機械	46,000	174	8,004,000	貸付株式数	35,000株 (18,000)株
新東工業	31,700	652	20,668,400		
渋谷工業	8,700	730	6,351,000		
アイチ コーポレーション	26,000	450	11,700,000	貸付株式数	10,800株 (10,800)株
小森コーポレーション	44,700	1,027	45,906,900		
鶴見製作所	12,000	638	7,656,000		
住友精密	27,000	366	9,882,000	貸付株式数	10,000株 (10,000)株
酒井重工業	30,000	159	4,770,000		
荏原製作所	336,000	278	93,408,000		

石井鉄工所	23,000	180	4,140,000	貸付株式数	12,000株 (6,000)株
西島製作所	14,000	1,296	18,144,000		
千代田化工建	134,000	670	89,780,000	貸付株式数	29,000株
ダイキン工業	164,400	2,965	487,446,000		
オルガノ	27,000	698	18,846,000	貸付株式数	8,000株
ト・ヨ・カネツ	97,000	188	18,236,000		
栗田工業	86,900	2,955	256,789,500		
椿本チエイン	81,000	292	23,652,000		
大同工業	29,000	162	4,698,000		
T C M	40,000	130	5,200,000	貸付株式数	9,000株 (9,000)株
日本コンベヤ	52,000	87	4,524,000	貸付株式数	28,000株 (14,000)株
日機装	44,000	714	31,416,000		
木村化工機	14,300	783	11,196,900	貸付株式数	6,700株
新興プランテック	28,100	685	19,248,500		
アネスト岩田	30,000	262	7,860,000	貸付株式数	4,000株 (4,000)株
ダイフク	64,000	609	38,976,000		
加藤製作所	33,000	223	7,359,000	貸付株式数	14,000株 (14,000)株
油研工業	27,000	150	4,050,000		
タダノ	72,000	410	29,520,000	貸付株式数	31,000株
フジテック	44,000	454	19,976,000		
シーケーディ	42,200	434	18,314,800		
キトー	35	100,100	3,503,500		
平和	28,000	1,047	29,316,000		
理想科学工業	12,200	1,026	12,517,200		
SANKYO	41,100	5,070	208,377,000		
日本金銭機械	16,600	898	14,906,800		
マースエンジニアリング	7,400	2,915	21,571,000		
福島工業	4,600	734	3,376,400		
キヤノンファインテック	13,900	1,219	16,944,100		
アビリット	24,700	115	2,840,500	貸付株式数	3,700株 (3,700)株
オーイズミ	5,000	218	1,090,000		
ダイコク電機	6,200	1,262	7,824,400	貸付株式数	2,200株
アマノ	45,600	869	39,626,400		
JUKI	79,000	112	8,848,000	貸付株式数	53,000株 (33,000)株
サンデン	85,000	247	20,995,000		
蛇の目ミシン	145,000	70	10,150,000	貸付株式数	118,000株 (61,000)株
ブラザー工業	181,600	782	142,011,200		
シルバー精工	358,000	8	2,864,000	貸付株式数	307,000株 (127,000)株
マックス	26,000	1,020	26,520,000	貸付株式数	7,000株 (7,000)株
モリタホールディングス	24,000	382	9,168,000		
グローリー	45,700	1,836	83,905,200	貸付株式数	15,700株
大和冷機工業	24,000	431	10,344,000		
セガサミーホールディングス	172,100	1,199	206,347,900		
日本ピストンリング	57,000	101	5,757,000	貸付株式数	20,000株
リケン	69,000	274	18,906,000	貸付株式数	34,000株

帝国ピストン	18,300	410	7,503,000	貸付株式数	7,600株 (7,600)株
ホシザキ電機	30,300	1,036	31,390,800	貸付株式数	8,000株 (8,000)株
大豊工業	11,900	694	8,258,600		
日本精工	309,000	424	131,016,000		
N T N	264,000	328	86,592,000		
ジェイテクト	150,200	875	131,425,000		
不二越	151,000	175	26,425,000	貸付株式数	2,000株 (2,000)株
ミネベア	224,000	358	80,192,000		
日本トムソン	45,000	408	18,360,000	貸付株式数	9,000株
T H K	93,900	1,333	125,168,700		
ユーシン精機	6,500	1,397	9,080,500	貸付株式数	1,400株
前澤給装工業	6,100	1,451	8,851,100		
イーグル工業	19,000	359	6,821,000		
前澤工業	12,000	174	2,088,000	貸付株式数	3,800株 (3,800)株
日本ピラ - 工業	16,000	324	5,184,000		
キッツ	66,000	309	20,394,000		
日立	2,519,000	272	685,168,000		
東芝	2,931,000	336	984,816,000	貸付株式数	393,000株
三菱電機	1,405,000	561	788,205,000		
富士電機H L D G S	349,000	137	47,813,000		
東洋電機製造	30,000	658	19,740,000	貸付株式数	24,000株 (10,000)株
安川電機	165,000	601	99,165,000	貸付株式数	69,000株 (69,000)株
シンフォニア テクノロジー	97,000	216	20,952,000	貸付株式数	60,000株 (46,000)株
明電舎	138,000	477	65,826,000	貸付株式数	84,000株 (57,000)株
オリジン電気	20,000	280	5,600,000		
デンヨー	15,400	745	11,473,000		
日立工機	49,200	788	38,769,600	貸付株式数	15,900株 (15,900)株
三桜工業	19,100	474	9,053,400		
マキタ	91,600	2,005	183,658,000		
東芝テック	108,000	343	37,044,000		
芝浦メカトロニクス	27,000	372	10,044,000	貸付株式数	12,000株
マブチモーター	22,600	4,450	100,570,000		
日本電産	74,600	6,020	449,092,000		
高岳製作所	58,000	262	15,196,000	貸付株式数	32,000株 (12,000)株
ダイヘン	76,000	302	22,952,000	貸付株式数	46,000株 (33,000)株
J V C ケンウッドH D	560,500	58	32,509,000		
日新電機	30,000	450	13,500,000	貸付株式数	18,000株 (13,000)株
大崎電気	23,000	905	20,815,000		
オムロン	178,800	1,266	226,360,800		
日東工業	22,600	942	21,289,200		
I D E C	19,700	698	13,750,600	貸付株式数	4,600株
エルピーダメモリ	72,800	951	69,232,800	貸付株式数	27,600株
ジーエス・ユアサ コーポ	241,000	773	186,293,000	貸付株式数	197,000株 (183,000)株

サクサホールディングス	38,000	192	7,296,000		
メルコホールディングス	8,300	1,177	9,769,100	貸付株式数	4,300株
テクノメディカ	11	283,100	3,114,100		
日本電気	1,518,000	319	484,242,000		
富士通	1,548,000	494	764,712,000		
沖電気	480,000	90	43,200,000		
岩崎通信機	64,000	107	6,848,000	貸付株式数	24,000株
電気興業	40,000	478	19,120,000		
サンケン電気	88,000	352	30,976,000	貸付株式数	32,000株
ナカヨ通信機	16,000	208	3,328,000		
アイホン	10,600	1,516	16,069,600	貸付株式数	10,100株 (9,400)株
NECエレクトロニクス	28,900	817	23,611,300		
セイコーエプソン	114,000	1,368	155,952,000		
ワコム	296	196,300	58,104,800	貸付株式数	111株
アルバック	24,100	2,410	58,081,000	貸付株式数	20,200株 (9,600)株
ピクセラ	5,500	240	1,320,000	貸付株式数	3,800株 (2,900)株
ナナオ	12,800	1,879	24,051,200		
日本信号	37,900	764	28,955,600		
京三製作所	35,000	377	13,195,000	貸付株式数	9,000株 (9,000)株
能美防災	20,000	852	17,040,000	貸付株式数	10,000株
ホーチキ	15,000	592	8,880,000	貸付株式数	4,000株
マスプロ電工	11,400	841	9,587,400		
日本無線	57,000	238	13,566,000	貸付株式数	7,000株
パナソニック	1,605,300	1,214	1,948,834,200		
シャープ	727,000	895	650,665,000	貸付株式数	357,000株
アンリツ	71,000	390	27,690,000	貸付株式数	30,000株 (30,000)株
富士通ゼネラル	36,000	262	9,432,000	貸付株式数	9,000株
日立国際電気	44,000	679	29,876,000	貸付株式数	9,000株
ソニー	798,200	2,230	1,779,986,000		
T D K	78,700	4,130	325,031,000		
帝国通信工業	36,000	239	8,604,000		
三洋電機	1,488,000	212	315,456,000	貸付株式数	338,000株
宮越商事	3,600	711	2,559,600	貸付株式数	2,900株 (2,200)株
ミツミ電機	53,200	1,907	101,452,400		
タムラ製作所	46,000	394	18,124,000	貸付株式数	19,000株 (19,000)株
アルプス電気	127,300	470	59,831,000	貸付株式数	7,800株 (7,600)株
池上通信機	44,000	87	3,828,000	貸付株式数	39,000株 (20,000)株
パイオニア	117,800	242	28,507,600	貸付株式数	102,200株 (52,400)株
日本電波工業	11,600	2,040	23,664,000		
日本トリム	2,150	1,913	4,112,950	貸付株式数	750株 (350)株
ローランド ディー . ジー .	5,700	1,232	7,022,400	貸付株式数	2,700株 (500)株
コロムビアミュージックエンタ	102,000	41	4,182,000	貸付株式数	38,000株 (16,000)株
山水電気	892,000	6	5,352,000	貸付株式数	142,000株 (142,000)株

フオスタ - 電機	14,600	1,179	17,213,400		
クラリオン	64,000	85	5,440,000	貸付株式数	13,000株
S M K	44,000	422	18,568,000		
ヨコオ	12,700	477	6,057,900	貸付株式数	4,900株 (4,900)株
東 光	67,000	159	10,653,000	貸付株式数	20,000株
ティアック	66,000	51	3,366,000	貸付株式数	10,000株 (10,000)株
ホシデン	37,400	1,242	46,450,800	貸付株式数	26,700株 (16,300)株
ヒロセ電機	26,200	9,920	259,904,000	貸付株式数	11,400株 (11,400)株
日本航空電子	35,000	565	19,775,000	貸付株式数	17,000株
T O A	18,000	658	11,844,000		
日立マクセル	32,600	1,137	37,066,200	貸付株式数	16,500株
ユニデン	44,000	254	11,176,000	貸付株式数	24,000株 (6,000)株
アルパイン	32,600	833	27,155,800		
スミダコーポレーション	10,300	632	6,509,600		
島田理化工業	8,100	156	1,263,600	貸付株式数	200株 (200)株
アイコム	8,300	2,020	16,766,000		
船井電機	13,500	4,150	56,025,000		
横河電機	163,200	621	101,347,200		
新電元工業	50,000	205	10,250,000		
山武	38,600	1,875	72,375,000		
日本光電工業	29,900	1,396	41,740,400		
チノー	29,000	259	7,511,000		
共和電業	16,000	262	4,192,000		
日本電子材料	5,800	521	3,021,800		
堀場製作所	21,900	2,215	48,508,500	貸付株式数	7,700株
アドバンテスト	102,600	1,651	169,392,600	貸付株式数	21,200株 (21,200)株
小野測器	17,000	423	7,191,000		
エスベック	14,300	628	8,980,400		
サンクス	13,200	294	3,880,800	貸付株式数	11,900株 (5,500)株
キーエンス	31,000	18,490	573,190,000	貸付株式数	6,300株
日置電機	7,100	1,693	12,020,300	貸付株式数	3,000株
シスメックス	28,800	3,420	98,496,000	貸付株式数	17,400株 (12,000)株
メガチップス	13,800	2,110	29,118,000	貸付株式数	6,200株
O B A R A	9,700	791	7,672,700	貸付株式数	4,100株 (4,100)株
日本電産コパル電子	15,500	496	7,688,000	貸付株式数	10,700株 (6,500)株
ミヤチテクノス	7,300	750	5,475,000		
東京電波	4,300	633	2,721,900		
澤藤電機	9,000	183	1,647,000		
デンソー	330,600	2,460	813,276,000		
コーセル	20,100	1,072	21,547,200		
日立メディコ	11,000	1,080	11,880,000		
新日本無線	11,000	245	2,695,000		
オプテックス	10,300	931	9,589,300		
千代田インテグレ	7,900	1,018	8,042,200	貸付株式数	3,300株 (3,300)株

東光電気	11,000	280	3,080,000		
スタンレー電気	105,600	1,774	187,334,400		
岩崎電気	48,000	205	9,840,000		
ウシオ電機	84,800	1,530	129,744,000	貸付株式数	15,400株
岡谷電機	8,100	295	2,389,500		
ヘリオステクノH	12,800	216	2,764,800		
日本セラミック	11,100	1,022	11,344,200		
新神戸電機	14,000	872	12,208,000	貸付株式数	4,000株
日本デジタル研究所	14,100	1,211	17,075,100		
古河電池	11,000	860	9,460,000	貸付株式数	10,000株 (4,000)株
双信電機	7,200	330	2,376,000	貸付株式数	4,500株 (3,000)株
山一電機	12,500	251	3,137,500		
函 研	10,400	765	7,956,000		
日本電子	54,000	353	19,062,000		
カ シ オ	143,500	716	102,746,000	貸付株式数	33,600株 (10,000)株
ファナック	145,500	7,110	1,034,505,000		
F D K	65,000	155	10,075,000	貸付株式数	43,000株 (27,000)株
日本シイエムケイ	29,500	855	25,222,500	貸付株式数	4,700株
エンプラス	8,800	1,380	12,144,000		
ロ ー ム	75,500	6,350	479,425,000		
浜松ホトニクス	54,800	1,742	95,461,600	貸付株式数	11,100株
三井ハイテック	19,900	931	18,526,900		
新光電気工業	44,200	1,116	49,327,200	貸付株式数	8,900株
京 セ ラ	134,100	6,790	910,539,000		
協栄産業	18,000	211	3,798,000		
日本インター	16,200	227	3,677,400	貸付株式数	11,400株 (6,200)株
太陽誘電	73,000	1,055	77,015,000	貸付株式数	32,000株
村田製作所	168,500	4,030	679,055,000		
ユーシン	17,900	467	8,359,300		
双葉電子工業	26,600	1,619	43,065,400		
日東電工	138,100	2,735	377,703,500		
北陸電気工業	68,000	186	12,648,000		
パナソニック電工	246,000	848	208,608,000		
東海理化電機	39,600	1,603	63,478,800	貸付株式数	16,500株 (16,500)株
ニチコン	47,400	1,233	58,444,200		
日本ケミコン	77,000	314	24,178,000		
K O A	20,800	697	14,497,600		
三井造船	544,000	206	112,064,000	貸付株式数	174,000株
日立造船	670,000	110	73,700,000	貸付株式数	415,000株 (279,500)株
佐世保重工業	91,000	189	17,199,000	貸付株式数	34,000株 (34,000)株
三菱重工業	2,681,000	351	941,031,000		
川崎重工業	1,249,000	232	289,768,000	貸付株式数	230,000株
I H I	1,029,000	142	146,118,000		
日本車輛	67,000	506	33,902,000	貸付株式数	44,000株 (29,000)株
日本輸送機	18,000	253	4,554,000		
近畿車輛	26,000	690	17,940,000	貸付株式数	10,000株 (10,000)株

日産自動車	1,901,800	533	1,013,659,400	
いすゞ自動車	714,000	135	96,390,000	
トヨタ自動車	1,934,100	3,430	6,633,963,000	
日野自動車	215,000	262	56,330,000	
三菱自動車工業	3,365,000	163	548,495,000	貸付株式数 1,957,000株 (1,148,000)株
エフテック	4,900	731	3,581,900	
武蔵精密工業	14,500	1,643	23,823,500	
トヨタ車体	32,800	1,620	53,136,000	貸付株式数 6,500株
日産車体	49,000	788	38,612,000	
関東自動車	22,900	819	18,755,100	
新明和工業	66,000	335	22,110,000	
極東開発工業	30,000	389	11,670,000	
日信工業	27,500	1,111	30,552,500	貸付株式数 17,700株 (11,500)株
トピー工業	135,000	211	28,485,000	
ティラド	45,000	205	9,225,000	
曙ブレーキ	41,500	447	18,550,500	貸付株式数 28,600株 (24,200)株
タチエス	19,600	738	14,464,800	
N O K	80,900	1,147	92,792,300	貸付株式数 50,100株 (33,800)株
フタバ産業	32,700	308	10,071,600	
カヤバ工業	104,000	180	18,720,000	
シロキ工業	29,000	176	5,104,000	
市光工業	36,000	160	5,760,000	貸付株式数 9,000株
大同メタル工業	25,000	358	8,950,000	貸付株式数 20,000株 (11,000)株
プレス工業	57,000	152	8,664,000	貸付株式数 15,000株 (15,000)株
カルソニックカンセイ	89,000	190	16,910,000	
太平洋工業	31,000	369	11,439,000	貸付株式数 4,000株 (4,000)株
ケーヒン	34,600	1,221	42,246,600	
河西工業	20,000	220	4,400,000	
アイシン精機	137,700	2,055	282,973,500	
富士機工	17,000	113	1,921,000	貸付株式数 15,000株 (11,000)株
マ ッ ダ	597,000	216	128,952,000	
ダイハツ	159,000	1,000	159,000,000	
愛知機械	38,000	278	10,564,000	
今仙電機製作所	10,800	1,000	10,800,000	
本田技研	1,286,500	2,355	3,029,707,500	
スズキ	304,400	2,125	646,850,000	貸付株式数 61,600株
富士重工業	512,000	339	173,568,000	
ヤマハ発動機	174,100	968	168,528,800	貸付株式数 35,100株
ショーワ	32,000	385	12,320,000	
小糸製作所	75,000	1,108	83,100,000	
T B K	17,000	155	2,635,000	
エクセディ	18,200	1,796	32,687,200	
ミツバ	28,000	319	8,932,000	
豊田合成	42,500	2,610	110,925,000	
愛三工業	18,200	731	13,304,200	
ヨロズ	10,000	1,010	10,100,000	貸付株式数 5,200株
エフ・シー・シー	22,100	1,230	27,183,000	
新家工業	34,000	156	5,304,000	

シマノ	58,300	3,500	204,050,000	貸付株式数	11,200株
タカタ	26,800	1,434	38,431,200	貸付株式数	11,100株 (11,100)株
テイ・エス テック	23,100	1,333	30,792,300		
小野建	11,900	903	10,745,700		
はるやま商事	6,800	441	2,998,800		
佐島電機	10,900	590	6,431,000		
カッパクリエイト	8,700	2,235	19,444,500		
エコートレーディング	3,100	954	2,957,400		
伯東	9,000	893	8,037,000		
中山福	9,300	594	5,524,200		
ライトオン	11,100	918	10,189,800	貸付株式数	2,800株 (2,800)株
ナガイレーベン	7,800	1,837	14,328,600		
ジーンズメイト	4,100	571	2,341,100		
菱食	14,200	2,055	29,181,000		
良品計画	15,700	3,920	61,544,000		
三城ホールディングス	21,000	928	19,488,000	貸付株式数	7,100株
松田産業	10,800	1,341	14,482,800	貸付株式数	5,300株
メディセオ・パルタックHD	160,000	1,195	191,200,000		
アドヴァン	10,100	597	6,029,700		
S P K	3,500	1,181	4,133,500		
アズワン	9,700	1,690	16,393,000		
スズデン	4,500	482	2,169,000		
尾家産業	4,400	805	3,542,000		
シモジマ	10,200	1,220	12,444,000		
ドウシシャ	7,900	1,478	11,676,200		
コナカ	17,500	292	5,110,000		
高速	8,800	607	5,341,600		
ハウス ローゼ	1,500	1,236	1,854,000		
G - 7ホールディングス	4,400	396	1,742,400		
イオン北海道	9,300	298	2,771,400		
コジマ	20,000	446	8,920,000	貸付株式数	9,400株
コーナン商事	17,400	911	15,851,400		
黒田電気	21,400	1,184	25,337,600	貸付株式数	13,400株 (8,900)株
ネットワンシステムズ	361	165,000	59,565,000	貸付株式数	62株
エコス	4,700	674	3,167,800		
ワタミ	19,500	1,885	36,757,500	貸付株式数	7,400株 (800)株
マルシェ	3,600	723	2,602,800		
ドン・キホーテ	26,900	1,880	50,572,000	貸付株式数	11,700株 (11,200)株
丸文	11,800	674	7,953,200	貸付株式数	4,900株 (4,900)株
メガネトップ	8,400	1,455	12,222,000		
西松屋チェーン	39,000	928	36,192,000	貸付株式数	4,600株
ゼンショー	50,000	534	26,700,000	貸付株式数	41,200株 (20,900)株
ハピネット	3,900	1,176	4,586,400		
幸楽苑	9,100	1,117	10,164,700	貸付株式数	3,800株 (3,800)株
トーマンエレクトロニクス	4,500	993	4,468,500		
ユニマットライフ	5,700	914	5,209,800		
ハークスレイ	4,100	890	3,649,000		
サイゼリヤ	16,400	1,556	25,518,400		

エクセル	6,300	962	6,060,600		
マルカキカイ	4,400	703	3,093,200		
アルゴグラフィックス	5,700	1,095	6,241,500		
ガリバーインターナショナル	3,500	4,680	16,380,000	貸付株式数	2,100株 (2,100)株
日本エム・ディ・エム	12,400	194	2,405,600		
ポブラ	4,200	667	2,801,400		
ユナイテッドアローズ	20,000	610	12,200,000	貸付株式数	11,800株 (11,200)株
進和	8,100	1,255	10,165,500		
エスケイジャパン	3,500	189	661,500	貸付株式数	1,500株 (1,500)株
ダイトエレクトロン	6,200	460	2,852,000		
ハイデイ日高	6,400	1,018	6,515,200		
シークス	9,400	429	4,032,600	貸付株式数	3,000株
京都きもの友禅	9,500	804	7,638,000		
コロワイド	32,500	576	18,720,000	貸付株式数	18,000株 (14,000)株
田中商事	4,500	460	2,070,000		
オーハシテクニカ	9,500	582	5,529,000		
壱番屋	5,000	2,090	10,450,000	貸付株式数	3,900株 (2,200)株
マクニカ	5,800	1,471	8,531,800		
白銅	4,500	514	2,313,000		
トップカルチャー	4,400	360	1,584,000		
スギホールディングス	23,700	2,025	47,992,500	貸付株式数	17,400株 (9,900)株
島津製作所	166,000	684	113,544,000		
J M S	25,000	361	9,025,000		
アロカ	9,300	974	9,058,200		
クボテック	39	28,540	1,113,060	貸付株式数	27株 (16)株
モリテックス	3,900	357	1,392,300		
長野計器	9,000	711	6,399,000		
スター精密	28,600	901	25,768,600	貸付株式数	1,100株 (1,100)株
東京計器	49,000	126	6,174,000		
愛知時計	17,000	255	4,335,000		
日本電産トーソク	4,500	718	3,231,000		
東京精密	28,200	1,221	34,432,200	貸付株式数	20,200株 (11,800)株
ニコン	262,000	1,513	396,406,000		
トプコン	34,700	457	15,857,900	貸付株式数	31,700株 (14,500)株
オリンパス	164,900	2,065	340,518,500	貸付株式数	37,700株 (37,700)株
理研計器	12,200	638	7,783,600		
大日本スクリーン	166,000	268	44,488,000		
キヤノン電子	13,600	1,322	17,979,200		
タムロン	13,200	1,232	16,262,400	貸付株式数	2,900株 (2,900)株
HOYA	345,700	1,908	659,595,600		
ノーリツ鋼機	13,500	845	11,407,500		
エー・アンド・デイ	12,500	500	6,250,000	貸付株式数	10,300株 (4,800)株
キヤノン	872,800	2,945	2,570,396,000		

リ コ ー	487,000	1,131	550,797,000		
日本電産コパル	14,600	907	13,242,200	貸付株式数	13,200株 (6,100)株
日本電産サンキョー	45,000	515	23,175,000	貸付株式数	13,000株
シチズンホールディングス	195,600	443	86,650,800	貸付株式数	81,600株 (81,600)株
リズム時計	73,000	135	9,855,000	貸付株式数	45,000株 (33,000)株
S R Iスポーツ	95	77,000	7,315,000		
バンダイナムコHLDGS	163,600	1,033	168,998,800		
共立印刷	13,200	156	2,059,200		
フランスベッドHLDGS	101,000	145	14,645,000		
パイロットコーポレーション	141	114,600	16,158,600		
エイベックス・グループHD	28,000	852	23,856,000	貸付株式数	20,700株 (11,700)株
トッパン・フォームズ	32,300	1,222	39,470,600	貸付株式数	9,900株
フジシールインターナショナル	16,900	1,651	27,901,900		
タカラトミー	45,000	710	31,950,000	貸付株式数	19,900株
廣済堂	12,800	261	3,340,800	貸付株式数	4,900株 (4,900)株
アーク	44,600	87	3,880,200	貸付株式数	15,900株 (15,900)株
スルガ	4,100	1,094	4,485,400	貸付株式数	100株 (100)株
アロン化成	11,000	339	3,729,000		
タカノ	5,700	596	3,397,200		
プロネクス	18,400	686	12,622,400		
ホクシン	11,900	149	1,773,100		
ウッドワン	30,000	267	8,010,000		
大建工業	66,000	156	10,296,000	貸付株式数	24,000株 (24,000)株
き も と	12,800	543	6,950,400	貸付株式数	10,700株 (5,900)株
凸版印刷	458,000	924	423,192,000		
大日本印刷	458,000	1,230	563,340,000		
図書印刷	32,000	235	7,520,000		
共同印刷	48,000	314	15,072,000		
日本写真印刷	23,200	4,350	100,920,000	貸付株式数	15,600株 (6,200)株
光村印刷	14,000	344	4,816,000		
藤森工業	10,500	1,290	13,545,000		
宝印刷	7,200	850	6,120,000		
前澤化成工業	11,000	1,038	11,418,000	貸付株式数	1,900株 (1,900)株
コ ン ビ	9,000	704	6,336,000	貸付株式数	5,000株 (1,000)株
アシックス	149,000	850	126,650,000		
ツ ツ ミ	5,500	1,890	10,395,000		
ジェイ エス ピー	10,300	774	7,972,200		
ニ チ ハ	17,400	730	12,702,000		
ローランド	10,800	1,096	11,836,800		
エフピコ	7,900	4,350	34,365,000		
小松ウオール工業	5,400	1,133	6,118,200		
ヤマハ	119,900	1,073	128,652,700		
河合楽器	54,000	118	6,372,000	貸付株式数	33,000株 (25,000)株

クリナップ	16,000	530	8,480,000	貸付株式数	3,300株
ピジョン	9,500	3,230	30,685,000		
天馬	11,100	1,155	12,820,500	貸付株式数	2,200株
パラマウントベッド	14,800	1,429	21,149,200	貸付株式数	6,000株 (1,500)株
兼松日産農林	23,000	146	3,358,000	貸付株式数	14,000株 (10,000)株
キングジム	11,500	704	8,096,000	貸付株式数	4,200株 (4,200)株
リンテック	28,600	1,722	49,249,200	貸付株式数	11,900株 (11,900)株
田崎真珠	23,000	116	2,668,000	貸付株式数	11,000株
信越ポリマー	30,900	490	15,141,000		
東リ	41,000	208	8,528,000		
イトーキ	31,700	277	8,780,900		
任天堂	79,500	25,950	2,063,025,000		
三菱鉛筆	14,200	1,172	16,642,400		
タカラスタンダ-ド	68,000	562	38,216,000		
コクヨ	78,200	822	64,280,400		
ナカバヤシ	35,000	215	7,525,000		
ニフコ	32,700	1,475	48,232,500		
ダイワ精工	75,000	126	9,450,000	貸付株式数	26,000株
サンウエーブ	21,000	270	5,670,000	貸付株式数	8,000株 (8,000)株
岡村製作所	63,000	604	38,052,000		
日本バルカー	60,000	203	12,180,000		
MUTOHホールディングス	18,000	148	2,664,000		
伊藤忠	1,111,000	591	656,601,000		
丸紅	1,300,000	385	500,500,000		
ムトウ	17,400	398	6,925,200		
高島	28,000	149	4,172,000	貸付株式数	7,000株
F & A アクアホールディングス	12,900	1,006	12,977,400		
三陽商会	70,000	305	21,350,000	貸付株式数	57,000株 (28,000)株
長瀬産業	78,000	932	72,696,000		
ナイガイ	44,000	55	2,420,000	貸付株式数	19,000株 (19,000)株
蝶理	93,000	111	10,323,000	貸付株式数	64,000株 (33,000)株
豊田通商	148,900	1,270	189,103,000		
オンワードホールディングス	105,000	600	63,000,000	貸付株式数	65,000株 (65,000)株
三共生興	25,200	238	5,997,600	貸付株式数	4,000株 (4,000)株
兼松	316,000	88	27,808,000		
美津濃	74,000	426	31,524,000	貸付株式数	21,000株
シルバーオックス	15,000	108	1,620,000	貸付株式数	6,000株 (6,000)株
ツカモトコーポレーション	25,000	90	2,250,000	貸付株式数	9,000株 (9,000)株
ファミリーマート	45,700	3,060	139,842,000		
ルック	24,000	99	2,376,000	貸付株式数	4,000株
三井物産	1,279,600	1,049	1,342,300,400		
日本紙パルプ	77,000	312	24,024,000		
東京エレクトロン	109,800	4,270	468,846,000		

日立ハイテクノロジーズ	51,500	1,603	82,554,500	貸付株式数	800株 (800)株
カメイ	18,000	514	9,252,000		
東都水産	24,000	153	3,672,000		
日本マタイ	25,000	98	2,450,000		
スターゼン	46,000	221	10,166,000	貸付株式数	21,000株 (21,000)株
セイコーHD	52,000	252	13,104,000		
山 善	57,000	412	23,484,000		
椿本興業	17,000	226	3,842,000		
住友商事	876,900	888	778,687,200		
日本ユニシス	35,900	757	27,176,300		
内田洋行	33,000	330	10,890,000		
三菱商事	1,109,900	1,592	1,766,960,800		
第一実業	32,000	351	11,232,000	貸付株式数	5,000株 (5,000)株
キヤノンマーケティングJPN	56,500	1,435	81,077,500		
西華産業	63,000	211	13,293,000		
佐藤商事	13,200	505	6,666,000		
菱洋エレクトロ	15,000	782	11,730,000		
東京産業	14,500	284	4,118,000		
ユアサ商事	162,000	112	18,144,000	貸付株式数	57,000株
神鋼商事	37,000	151	5,587,000		
阪和興業	148,000	323	47,804,000		
カナデン	16,000	498	7,968,000		
菱電商事	21,000	514	10,794,000		
ニプロ	35,800	1,993	71,349,400		
フルサト工業	9,200	698	6,421,600		
岩谷産業	164,000	262	42,968,000	貸付株式数	14,000株 (14,000)株
すてきナイスグループ	60,000	172	10,320,000		
昭光通商	50,000	108	5,400,000	貸付株式数	38,000株 (22,000)株
ニチモウ	21,000	170	3,570,000	貸付株式数	18,000株 (9,000)株
富士通ビジネス	8,700	1,727	15,024,900		
極東貿易	17,000	145	2,465,000	貸付株式数	7,000株 (7,000)株
イワキ	16,000	196	3,136,000		
兼松エレクトロニクス	9,400	902	8,478,800		
三愛石油	36,000	438	15,768,000		
稲畑産業	39,600	395	15,642,000	貸付株式数	9,300株
G S Iクレオス	39,000	103	4,017,000		
明和産業	11,700	179	2,094,300	貸付株式数	4,700株
ゴ・ルドウイン	36,000	241	8,676,000	貸付株式数	10,000株
東京スタイル	50,000	746	37,300,000		
ユニ・チャ・ム	32,200	7,360	236,992,000	貸付株式数	13,100株 (13,100)株
デサント	43,000	456	19,608,000		
ヤマトインタ・ナショナル	10,300	402	4,140,600		
東邦ホールディングス	34,100	1,088	37,100,800		
サンゲツ	25,600	2,030	51,968,000		
ミツウロコ	24,200	547	13,237,400	貸付株式数	1,600株 (1,600)株
シナネン	35,000	492	17,220,000		
伊藤忠エネクス	38,200	581	22,194,200		

ザ・トーカイ	35,000	409	14,315,000	貸付株式数	14,000株 (14,000)株
サンリオ	41,200	814	33,536,800	貸付株式数	8,100株
サンワテクノス	7,200	464	3,340,800		
リョーサン	22,600	2,225	50,285,000	貸付株式数	8,600株
新光商事	15,100	830	12,533,000		
トーホー	28,000	344	9,632,000		
三信電気	17,000	804	13,668,000		
東陽テクニカ	14,700	921	13,538,700		
モスフードサービス	20,900	1,553	32,457,700		
加賀電子	16,100	1,137	18,305,700		
三益半導体	11,600	1,099	12,748,400		
ソーダニツカ	14,000	302	4,228,000		
立花エレテック	9,800	816	7,996,800		
木曽路	17,000	1,900	32,300,000		
千趣会	26,700	685	18,289,500		
タカキユー	11,500	161	1,851,500		
ケーヨー	30,600	488	14,932,800	貸付株式数	11,300株
アデランスホールディングス	17,500	1,139	19,932,500	貸付株式数	4,600株
上新電機	35,000	702	24,570,000	貸付株式数	33,000株 (14,000)株
日本瓦斯	15,900	1,397	22,212,300	貸付株式数	7,200株 (7,200)株
ベスト電器	46,500	443	20,599,500	貸付株式数	12,500株
マルエツ	30,000	440	13,200,000	貸付株式数	5,000株
ロイヤルホールディングス	24,800	1,017	25,221,600	貸付株式数	8,900株
東天紅	11,000	171	1,881,000	貸付株式数	2,000株
いなげや	17,000	915	15,555,000		
島忠	33,600	1,974	66,326,400		
チヨダ	21,400	1,329	28,440,600	貸付株式数	5,500株 (2,000)株
鈴丹	3,700	243	899,100	貸付株式数	3,300株 (1,400)株
ライフコーポレーション	9,500	1,601	15,209,500		
カスミ	30,400	433	13,163,200		
リンガーハット	11,300	1,221	13,797,300	貸付株式数	8,300株 (4,700)株
さが美	11,000	152	1,672,000		
MR MAX	16,700	460	7,682,000		
テンアライド	9,900	310	3,069,000	貸付株式数	4,900株
AOKIホールディングス	16,100	1,005	16,180,500		
オークワ	21,000	1,122	23,562,000		
コメリ	20,300	2,155	43,746,500		
青山商事	37,800	1,556	58,816,800		
しまむら	15,400	7,980	122,892,000		
CFSコーポレーション	18,000	559	10,062,000		
高島屋	201,000	717	144,117,000	貸付株式数	84,000株 (84,000)株
丸善	74,000	91	6,734,000	貸付株式数	12,000株 (12,000)株
松屋	29,900	942	28,165,800	貸付株式数	28,400株 (28,400)株
エイチ・ツー・オーリテイリング	97,000	526	51,022,000	貸付株式数	36,000株
丸栄	21,000	162	3,402,000	貸付株式数	9,000株 (9,000)株
ニッセンHD	35,600	317	11,285,200	貸付株式数	7,200株

パルコ	42,400	724	30,697,600	貸付株式数	13,500株
丸井グループ	193,600	615	119,064,000	貸付株式数	40,000株
クレディセゾン	127,500	1,003	127,882,500		
原信ナルスHLDGS	8,900	982	8,739,800		
セディナ	103,200	177	18,266,400	貸付株式数	23,100株
井筒屋	80,000	54	4,320,000	貸付株式数	36,000株 (36,000)株
ダイエー	68,750	394	27,087,500	貸付株式数	62,200株 (28,700)株
イズミヤ	44,000	570	25,080,000		
イオン	598,700	856	512,487,200		
ユニー	111,400	737	82,101,800		
イズミ	40,300	1,185	47,755,500		
東武ストア	20,000	305	6,100,000		
平和堂	30,100	1,220	36,722,000		
フジ	16,500	1,683	27,769,500		
ヤオコー	8,400	2,960	24,864,000	貸付株式数	2,700株
ゼビオ	15,700	1,892	29,704,400	貸付株式数	4,700株
ケーズホールディングス	26,100	2,365	61,726,500		
OLYMPIC	9,800	613	6,007,400		
東日カーライフグループ	25,000	123	3,075,000	貸付株式数	15,000株 (10,000)株
新生銀行	867,000	130	112,710,000	貸付株式数	175,000株
あおぞら銀行	540,000	124	66,960,000	貸付株式数	218,000株
三菱UFJフィナンシャルG	8,711,800	538	4,686,948,400		
りそなホールディングス	479,600	1,300	623,480,000	貸付株式数	408,900株 (158,900)株
中央三井トラストHD	758,000	313	237,254,000		
三井住友フィナンシャルG	801,600	3,550	2,845,680,000		
第四銀行	208,000	374	77,792,000		
北越銀行	168,000	182	30,576,000		
西日本シティ銀行	484,000	227	109,868,000		
札幌北洋ホール	224,000	250	56,000,000		
千葉銀行	586,000	586	343,396,000		
横浜銀行	1,018,000	500	509,000,000		
常陽銀行	577,000	456	263,112,000		
群馬銀行	347,000	535	185,645,000		
武蔵野銀行	22,500	3,240	72,900,000		
千葉興業銀行	28,500	893	25,450,500	貸付株式数	900株
関東つくば銀行	42,300	310	13,113,000		
東京都民銀行	28,100	1,680	47,208,000	貸付株式数	5,700株
七十七銀行	251,000	525	131,775,000		
青森銀行	92,000	361	33,212,000	貸付株式数	14,000株 (14,000)株
秋田銀行	102,000	346	35,292,000		
山形銀行	90,000	470	42,300,000		
岩手銀行	10,000	5,330	53,300,000		
東邦銀行	116,000	407	47,212,000		
荘内銀行	73,000	168	12,264,000		
東北銀行	76,000	153	11,628,000		
みちのく銀行	75,000	201	15,075,000		
ふくおかフィナンシャルG	643,000	395	253,985,000		
静岡銀行	465,000	911	423,615,000		
十六銀行	192,000	337	64,704,000		
スルガ銀行	173,000	898	155,354,000		
八十二銀行	281,000	516	144,996,000		

山梨中央銀行	99,000	501	49,599,000		
大垣共立銀行	170,000	408	69,360,000	貸付株式数	34,000株
福井銀行	127,000	304	38,608,000	貸付株式数	62,000株
北國銀行	172,000	340	58,480,000		
清水銀行	4,700	3,710	17,437,000	貸付株式数	1,900株
滋賀銀行	139,000	559	77,701,000	貸付株式数	47,000株
南都銀行	147,000	516	75,852,000	貸付株式数	15,000株
百五銀行	146,000	465	67,890,000		
京都銀行	257,000	882	226,674,000	貸付株式数	84,000株
三重銀行	65,000	357	23,205,000	貸付株式数	22,000株
池田銀行	13,600	3,710	50,456,000	貸付株式数	6,000株
ほくほくフィナンシャルG	1,041,000	221	230,061,000		
広島銀行	438,000	380	166,440,000		
山陰合同銀行	90,000	805	72,450,000		
中国銀行	122,000	1,258	153,476,000	貸付株式数	6,000株 (6,000)株
鳥取銀行	47,000	252	11,844,000		
伊予銀行	170,000	948	161,160,000		
百十四銀行	174,000	438	76,212,000		
四国銀行	108,000	346	37,368,000	貸付株式数	34,000株
阿波銀行	132,000	541	71,412,000	貸付株式数	59,000株 (32,000)株
鹿児島銀行	104,000	676	70,304,000		
大分銀行	81,000	477	38,637,000		
宮崎銀行	77,000	352	27,104,000	貸付株式数	17,000株
肥後銀行	118,000	546	64,428,000		
佐賀銀行	91,000	324	29,484,000		
十八銀行	95,000	282	26,790,000		
沖縄銀行	12,200	3,270	39,894,000		
琉球銀行	31,200	1,026	32,011,200		
住友信託	1,409,000	450	634,050,000		
みずほ信託銀行	1,409,000	110	154,990,000		
八千代銀行	8,900	2,805	24,964,500		
みずほフィナンシャルG	8,495,400	202	1,716,070,800	貸付株式数	7,525,000株 (3,525,000)株
紀陽ホールディングス	588,000	117	68,796,000	貸付株式数	116,000株
山口フィナンシャルG	138,000	1,239	170,982,000		
フィデック	59	12,410	732,190	貸付株式数	46株 (25)株
芙蓉総合リース	15,600	1,920	29,952,000		
興銀リース	20,700	1,255	25,978,500		
東京センチュリーリース	34,900	921	32,142,900		
SBIホールディングス	11,757	17,730	208,451,610		
日本証券金融	56,900	656	37,326,400	貸付株式数	10,000株
大阪証券金融	17,300	193	3,338,900		
アイフル	78,100	318	24,835,800	貸付株式数	57,050株 (32,000)株
日本アジア投資	63,000	67	4,221,000	貸付株式数	28,000株 (28,000)株
ポケットカード	13,900	243	3,377,700		
長野銀行	53,000	217	11,501,000		
名古屋銀行	142,000	427	60,634,000		
愛知銀行	5,200	8,040	41,808,000		
第三銀行	91,000	238	21,658,000		
中京銀行	68,000	297	20,196,000		
東日本銀行	78,000	213	16,614,000		

愛媛銀行	93,000	254	23,622,000		
トマト銀行	56,000	217	12,152,000		
みなと銀行	154,000	134	20,636,000		
京葉銀行	133,000	503	66,899,000		
関西アーバン銀行	149,000	162	24,138,000		
栃木銀行	80,000	470	37,600,000		
北日本銀行	4,600	2,650	12,190,000		
香川銀行	54,000	406	21,924,000		
東和銀行	130,000	57	7,410,000	貸付株式数	106,000株 (43,000)株
徳島銀行	43,000	478	20,554,000		
福島銀行	183,000	63	11,529,000	貸付株式数	1,000株 (1,000)株
大東銀行	100,000	77	7,700,000	貸付株式数	5,000株 (5,000)株
武富士	94,430	441	41,643,630	貸付株式数	78,020株 (43,090)株
リコーリース	10,200	1,703	17,370,600		
イオン クレジットサービス	66,000	1,056	69,696,000		
N I Sグループ	92,000	45	4,140,000	貸付株式数	72,100株 (34,500)株
ア コ ム	67,150	2,100	141,015,000	貸付株式数	60,810株 (28,020)株
プロミス	69,350	1,034	71,707,900	貸付株式数	62,750株 (28,950)株
ロプロ	58,700	24	1,408,800	貸付株式数	46,800株 (26,700)株
ジャックス	90,000	194	17,460,000		
日立キャピタル	35,000	1,135	39,725,000		
オリックス	74,450	5,230	389,373,500	貸付株式数	52,080株 (30,560)株
三菱U F Jリース	37,690	2,640	99,501,600		
ジャフコ	22,600	2,695	60,907,000	貸付株式数	15,800株 (10,400)株
大和証券G本社	1,001,000	516	516,516,000	貸付株式数	172,000株
野村ホールディングス	2,112,300	710	1,499,733,000		
みずほ証券	380,000	265	100,700,000		
みずほインベスタズ証	346,000	103	35,638,000	貸付株式数	99,000株 (99,000)株
岡三証券グループ	127,000	426	54,102,000		
丸三証券	49,300	565	27,854,500		
東洋証券	54,000	225	12,150,000		
東海東京HD	174,000	319	55,506,000	貸付株式数	38,000株
光世証券	35,000	107	3,745,000	貸付株式数	33,000株 (15,000)株
水戸証券	46,000	267	12,282,000		
いちよし証券	33,200	705	23,406,000		
松井証券	113,300	814	92,226,200	貸付株式数	93,600株 (47,300)株
だいこう証券ビジ	6,100	591	3,605,100	貸付株式数	900株
マネックスG	767	37,850	29,030,950	貸付株式数	262株
カブドットコム証券	319	120,500	38,439,500	貸付株式数	64株
極東証券	18,400	418	7,691,200		
岩井証券	15,200	871	13,239,200		
三井住友海上HD	354,500	2,340	829,530,000		
SONY FH	529	244,600	129,393,400		

小林洋行	4,200	345	1,449,000		
日本興亜損害保険	573,000	526	301,398,000		
損害保険ジャパン	693,000	575	398,475,000		
ニッセイ同和損害保険	164,000	444	72,816,000		
あいおい損害保険	389,000	436	169,604,000		
富士火災	178,000	109	19,402,000	貸付株式数	109,000株 (109,000)株
東京海上HD	639,300	2,470	1,579,071,000		
アサックス	16	82,200	1,315,200	貸付株式数	1株 (1)株
NECキャピタルソリューション	4,700	1,248	5,865,600		
T&Dホールディングス	217,600	2,485	540,736,000		
三井不動産	659,000	1,534	1,010,906,000		
三菱地所	1,040,000	1,424	1,480,960,000		
平和不動産	105,000	296	31,080,000	貸付株式数	43,500株
東京建物	223,000	447	99,681,000		
ダイビル	38,200	802	30,636,400	貸付株式数	18,800株
サンケイビル	22,400	572	12,812,800		
東急不動産	299,000	370	110,630,000		
京阪神不動産	19,000	424	8,056,000		
住友不動産	378,000	1,565	591,570,000		
東宝不動産	15,600	474	7,394,400		
太平洋興発	44,000	75	3,300,000	貸付株式数	7,000株
有楽土地	14,000	210	2,940,000	貸付株式数	3,000株 (2,000)株
大京	161,000	138	22,218,000	貸付株式数	36,000株
テーオーシー	57,600	359	20,678,400		
東京楽天地	27,000	389	10,503,000		
レオパレス21	104,400	801	83,624,400		
フジ住宅	17,200	264	4,540,800		
空港施設	15,400	499	7,684,600		
明和地所	7,200	522	3,758,400		
住友不動産販売	6,680	4,190	27,989,200	貸付株式数	1,350株 (1,350)株
ゴールドクレスト	11,710	2,210	25,879,100	貸付株式数	2,370株
東栄住宅	11,300	530	5,989,000	貸付株式数	4,700株
日本エスリード	4,800	863	4,142,400	貸付株式数	1,300株
東急リバブル	15,700	928	14,569,600		
飯田産業	7,300	1,125	8,212,500	貸付株式数	4,500株 (3,700)株
日神不動産	8,800	333	2,930,400	貸付株式数	3,300株 (1,400)株
アーネストワン	24,500	360	8,820,000	貸付株式数	8,100株
タカラレーベン	7,300	179	1,306,700	貸付株式数	6,100株 (3,000)株
サンヨーハウジ 名古屋	59	97,400	5,746,600		
イオンモール	67,700	1,801	121,927,700		
フージャースコーポレーション	122	5,480	668,560		
サンシティ	251	2,515	631,265	貸付株式数	226株 (105)株
ゼクス	106	718	76,108	貸付株式数	55株 (17)株
タクトホーム	79	31,600	2,496,400	貸付株式数	11株 (11)株
ランド	4,800	96	460,800		
リサ・パートナーズ	208	75,700	15,745,600	貸付株式数	48株

エヌ・ティ・ティ都市開発	923	90,000	83,070,000	貸付株式数	73株
サンフロンティア不動産	139	24,630	3,423,570	貸付株式数	47株 (47)株
大和システム	6,600	193	1,273,800	貸付株式数	5,200株 (2,500)株
ランドビジネス	100	28,380	2,838,000	貸付株式数	25株 (25)株
東武鉄道	642,000	556	356,952,000		
相模鉄道	208,000	392	81,536,000		
東京急行	827,000	456	377,112,000		
京浜急行	381,000	740	281,940,000		
小田急電鉄	482,000	806	388,492,000	貸付株式数	333,000株 (216,000)株
京王電鉄	391,000	554	216,614,000	貸付株式数	117,000株
京成電鉄	242,000	562	136,004,000		
富士急行	41,000	417	17,097,000		
新京成電鉄	20,000	345	6,900,000		
東日本旅客鉄道	280,500	5,920	1,660,560,000		
西日本旅客鉄道	1,402	316,000	443,032,000		
東海旅客鉄道	1,206	585,000	705,510,000		
アートコーポレーション	3,300	1,513	4,992,900	貸付株式数	2,800株 (1,400)株
西日本鉄道	197,000	353	69,541,000		
ハマキョウレックス	4,600	2,220	10,212,000	貸付株式数	1,800株 (1,100)株
サカイ引越センター	2,700	2,225	6,007,500		
近畿鉄道	1,360,000	429	583,440,000	貸付株式数	566,000株
阪急阪神HLDGS	1,010,000	436	440,360,000		
南海電鉄	315,000	414	130,410,000		
京阪電鉄	339,000	402	136,278,000	貸付株式数	115,000株
名糖運輸	6,100	787	4,800,700		
名古屋鉄道	527,000	301	158,627,000	貸付株式数	168,000株
日本通運	646,000	384	248,064,000		
ヤマトホールディングス	299,000	1,273	380,627,000		
山九	183,000	366	66,978,000		
日新	55,000	222	12,210,000		
丸運	10,800	261	2,818,800		
丸全昭和運輸	46,000	275	12,650,000		
センコー	50,000	348	17,400,000	貸付株式数	24,000株 (24,000)株
トナミホールディングス	35,000	251	8,785,000		
日本梱包運輸	42,000	1,012	42,504,000	貸付株式数	13,000株
日石輸送	17,000	192	3,264,000		
福山通運	117,000	422	49,374,000	貸付株式数	33,000株
セイノーホールディングス	116,000	719	83,404,000		
神奈川中央交通	18,000	510	9,180,000		
日立物流	31,300	1,126	35,243,800	貸付株式数	9,400株
日本郵船	805,000	380	305,900,000		
商船三井	789,000	542	427,638,000		
川崎汽船	358,000	348	124,584,000		
新和海運	60,000	249	14,940,000	貸付株式数	44,000株 (25,000)株
乾汽船	17,900	648	11,599,200		
明治海運	13,500	493	6,655,500	貸付株式数	9,700株 (5,400)株
飯野海運	72,700	495	35,986,500		

太平洋海運	28,000	101	2,828,000	貸付株式数	9,000株 (5,000)株
共栄タンカー	13,000	257	3,341,000	貸付株式数	10,000株 (3,000)株
第一中央汽船	99,000	242	23,958,000	貸付株式数	93,000株 (69,000)株
全日本空輸	1,572,000	277	435,444,000	貸付株式数	1,143,000株 (608,000)株
日本航空	2,171,000	171	371,241,000	貸付株式数	908,000株 (906,000)株
パスコ	17,000	176	2,992,000	貸付株式数	5,000株 (5,000)株
国際航業HLDGS	11,000	281	3,091,000		
三菱倉庫	107,000	1,006	107,642,000	貸付株式数	22,000株
三井倉庫	65,000	370	24,050,000		
住友倉庫	119,000	432	51,408,000		
渋沢倉庫	46,000	359	16,514,000	貸付株式数	21,000株 (12,000)株
ヤマタネ	80,000	133	10,640,000		
東陽倉庫	26,000	197	5,122,000		
日本トランスシティ	31,000	264	8,184,000		
ケイヒン	31,000	120	3,720,000		
安田倉庫	10,800	684	7,387,200	貸付株式数	3,600株 (3,600)株
東洋埠頭	43,000	161	6,923,000	貸付株式数	36,000株 (19,000)株
宇徳	10,900	297	3,237,300		
上組	180,000	760	136,800,000		
サンリツ	4,200	698	2,931,600		
キムラユニティー	3,400	746	2,536,400		
キューソー流通システム	4,100	905	3,710,500		
郵船航空サービス	11,800	1,147	13,534,600	貸付株式数	6,300株 (6,300)株
近鉄エクスプレス	13,500	2,185	29,497,500	貸付株式数	5,600株 (5,600)株
東海運	9,500	238	2,261,000		
バンテック	68	87,500	5,950,000		
東京放送HD	89,000	1,457	129,673,000		
日本テレビ放送網	14,230	10,730	152,687,900		
テレビ朝日	376	139,800	52,564,800	貸付株式数	76株
テレビ東京	5,600	2,790	15,624,000	貸付株式数	4,200株 (2,400)株
スカパーJSA THD	1,128	35,000	39,480,000		
アイ・ティー・シーネットワーク	31	175,600	5,443,600		
イー・アクセス	673	72,100	48,523,300		
NECモバイルリング	5,200	1,860	9,672,000		
日本電信電話	683,000	3,790	2,588,570,000		
KDDI	2,306	519,000	1,196,814,000		
光通信	19,100	2,095	40,014,500	貸付株式数	8,000株 (8,000)株
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	14,381	140,700	2,023,406,700		
インボイス	8,190	1,630	13,349,700	貸付株式数	4,324株 (1,853)株
GMOインターネット	28,200	375	10,575,000	貸付株式数	17,400株 (14,800)株
学習研究社	46,000	181	8,326,000	貸付株式数	29,000株 (21,000)株

ゼンリン	21,400	1,354	28,975,600	貸付株式数	9,600株
昭文社	8,100	642	5,200,200		
角川グループHLDGS	12,700	2,055	26,098,500	貸付株式数	11,000株 (5,800)株
インプレスホールディングス	12,200	188	2,293,600	貸付株式数	9,000株 (5,100)株
東京電力	948,600	2,475	2,347,785,000		
中部電力	509,800	2,305	1,175,089,000		
関西電力	624,800	2,190	1,368,312,000		
中国電力	225,500	2,010	453,255,000		
北陸電力	154,500	2,255	348,397,500		
東北電力	376,100	2,025	761,602,500		
四国電力	155,800	2,920	454,936,000		
九州電力	332,500	2,080	691,600,000		
北海道電力	140,900	1,878	264,610,200		
沖縄電力	10,600	5,290	56,074,000		
電源開発	109,000	2,930	319,370,000		
東京瓦斯	1,905,000	355	676,275,000		
大阪瓦斯	1,614,000	323	521,322,000		
東邦瓦斯	393,000	399	156,807,000		
北海道瓦斯	29,000	243	7,047,000		
西部瓦斯	170,000	251	42,670,000		
静岡瓦斯	46,500	548	25,482,000		
アイネット	7,000	523	3,661,000		
松竹	82,000	763	62,566,000	貸付株式数	32,000株 (19,000)株
東宝	106,000	1,576	167,056,000		
エイチ・アイ・エス	14,300	2,070	29,601,000	貸付株式数	4,000株
東映	61,000	479	29,219,000		
葵プロモーション	7,000	512	3,584,000		
ベンチャーリンク	78,500	21	1,648,500	貸付株式数	47,300株 (12,500)株
NTTデータ	918	292,500	268,515,000		
共立メンテナンス	6,300	1,585	9,985,500	貸付株式数	1,400株
イチネンホールディングス	14,900	415	6,183,500		
建設技術研究所	8,600	568	4,884,800		
燦ホールディングス	3,400	1,689	5,742,600		
スバル興業	11,000	298	3,278,000		
東京テアトル	54,000	181	9,774,000	貸付株式数	24,000株 (11,000)株
吉本興業	23,700	959	22,728,300		
ホリプロ	5,300	762	4,038,600		
よみうりランド	35,000	282	9,870,000	貸付株式数	18,000株 (14,000)株
東京都競馬	108,000	152	16,416,000		
常磐興産	49,000	150	7,350,000	貸付株式数	22,000株 (22,000)株
カナモト	18,000	485	8,730,000		
東京ドーム	116,000	299	34,684,000	貸付株式数	16,000株 (16,000)株
DTS	14,000	913	12,782,000		
スクウェア・エニックス・HD	37,700	2,185	82,374,500	貸付株式数	30,000株 (30,000)株
シーイーシー	8,800	691	6,080,800		
日立ソフトウェア	21,100	1,731	36,524,100		
カプコン	31,500	1,669	52,573,500		

東海観光	61,000	35	2,135,000		
日本空港ビルデング	35,700	1,147	40,947,900	貸付株式数	7,900株
トランス・コスモス	20,500	1,107	22,693,500	貸付株式数	15,100株 (8,400)株
乃村工藝社	31,000	271	8,401,000	貸付株式数	7,000株 (7,000)株
ジャステック	7,700	497	3,826,900		
住商情報システム	15,200	1,469	22,328,800		
藤田観光	46,000	382	17,572,000	貸付株式数	15,000株 (3,000)株
近畿日本ツーリスト	46,000	101	4,646,000	貸付株式数	42,000株 (19,000)株
日本管財	5,600	1,403	7,856,800	貸付株式数	3,300株 (1,900)株
白洋舎	16,000	254	4,064,000		
セコム	152,700	4,070	621,489,000		
C S Kホールディングス	45,000	400	18,000,000	貸付株式数	31,300株 (18,800)株
日本システムウエア	5,400	341	1,841,400		
セントラル警備保障	6,800	937	6,371,600		
日立情報	12,100	2,090	25,289,000		
アイネス	17,900	631	11,294,900		
丹青社	15,000	271	4,065,000		
メイテック	26,300	1,508	39,660,400	貸付株式数	18,400株 (11,000)株
T K C	14,200	1,812	25,730,400	貸付株式数	2,400株 (2,400)株
アサツー ディ・ケイ	31,700	2,055	65,143,500	貸付株式数	6,400株
富士ソフト	18,400	1,796	33,046,400	貸付株式数	5,000株
ソラン	15,100	537	8,108,700		
応用地質	18,000	957	17,226,000		
船井総合研究所	19,800	491	9,721,800		
日システム	26,300	925	24,327,500	貸付株式数	7,900株
進学会	7,500	338	2,535,000		
丸紅建材リース	14,000	140	1,960,000		
コナミ	67,100	1,738	116,619,800		
ベネッセコーポレーション	54,700	4,360	238,492,000		
イオンディライト	11,600	1,515	17,574,000	貸付株式数	4,300株
ナック	3,900	862	3,361,800		
福井コンピュータ	3,200	299	956,800	貸付株式数	1,300株 (1,300)株
ニチイ学館	37,500	1,030	38,625,000		
ダイセキ	23,200	1,959	45,448,800	貸付株式数	16,600株 (10,600)株
元気寿司	4,600	1,190	5,474,000		
トラスコ中山	17,000	1,502	25,534,000	貸付株式数	7,700株 (6,400)株
ヤマダ電機	72,150	5,570	401,875,500		
オートバックスセブン	22,800	3,340	76,152,000		
アークランドサカモト	10,600	991	10,504,600		
ニトリ	32,100	6,880	220,848,000		
ユーエスシー	5,700	1,062	6,053,400		
グルメ杵屋	11,000	618	6,798,000		
愛眼	11,800	526	6,206,800		
吉野家ホールディングス	341	109,900	37,475,900	貸付株式数	219株 (111)株

日商エレクトロニクス	1,300	979	1,272,700	
加藤産業	21,400	1,511	32,335,400	
イエローハット	15,200	561	8,527,200	貸付株式数 6,100株 (6,100)株
富士エレクトロニクス	8,400	850	7,140,000	
松屋フーズ	7,000	1,290	9,030,000	
JBCホールディングス	11,400	700	7,980,000	
JKホールディングス	12,200	469	5,721,800	
ユニダックス	8,500	399	3,391,500	
サガミチェーン	18,000	891	16,038,000	貸付株式数 5,000株
日伝	6,000	2,670	16,020,000	貸付株式数 1,600株 (1,600)株
北沢産業	12,000	185	2,220,000	
杉本商事	8,000	895	7,160,000	
因幡電機産業	14,000	2,210	30,940,000	
セシール	15,800	184	2,907,200	貸付株式数 2,200株 (2,200)株
住金物産	77,000	219	16,863,000	
プレナス	18,700	1,401	26,198,700	貸付株式数 2,700株 (1,000)株
ミニストップ	11,000	1,577	17,347,000	
イメージホールディングス	4,400	256	1,126,400	貸付株式数 2,000株 (2,000)株
アークス	17,600	1,383	24,340,800	
バロー	29,500	782	23,069,000	
ミスミグループ本社	49,900	1,376	68,662,400	貸付株式数 41,200株 (19,100)株
江守商事	2,900	648	1,879,200	
アルテック	6,300	224	1,411,200	
ベルク	6,400	816	5,222,400	
大庄	8,900	1,314	11,694,600	
タキヒヨー	26,000	446	11,596,000	貸付株式数 14,000株 (2,000)株
ファーストリテイリング	29,700	11,590	344,223,000	
ソフトバンク	606,600	1,717	1,041,532,200	貸付株式数 270,000株
スズケン	52,700	2,765	145,715,500	
サンドラッグ	28,300	2,050	58,015,000	貸付株式数 13,000株
ジェコス	10,200	456	4,651,200	
ヤマザワ	3,900	1,263	4,925,700	
やまや	2,800	783	2,192,400	
ベルーナ	18,500	389	7,196,500	貸付株式数 14,000株 (7,750)株
合計	216,550,279		168,641,002,053	

[次へ](#)

(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 20,000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エスエムピーシー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(デリバティブ取引等関係に関する注記)」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21年7月31日

資産総額	203,676,802,961円	
負債総額	18,905,474,268円	
純資産総額（ - ）	184,771,328,693円	
発行済数量	193,695,163口	
1単位当たり純資産額（ / ）		953.9円

第5 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	141,997,800	13,948,930
第2計算期間	0	29,941,934
第3計算期間	181,118,700	1,999,964
第4計算期間	9,958,800	101,231,797
第5計算期間	83,669,700	53,742,942
第6計算期間	69,645,100	81,100,716
第7計算期間	153,441,900	69,470,370
第8計算期間	33,969,100	132,666,084

（注）当初設定数量は3,996,800口です。

第三部 【特別情報】

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21年7月末日現在、資本金の額は151億7,427万2,500円です。なお、発行可能株式総数は799万9,980株であり、260万8,525株を発行済みです。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

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

けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるコンプライアンス・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに「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っています。

平成21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（公募）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	13	50,812
追加型株式投資信託	260	5,252,317
株式投資信託 合計	273	5,303,129
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	3,059,462
公社債投資信託 合計	17	3,059,462
総合計	290	8,362,591

3 【委託会社等の経理状況】

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

なお、前事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則に基づき、当事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）は、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び当事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、あずさ監査法人により受けております。

3. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,398,882	3,961,462
有価証券	32,206,041	28,233,112
前払金	3,357	453
前払費用	96,205	84,549
未収入金	75,494	20,722
未収消費税等	-	27,138
未収委託者報酬	8,899,037	5,273,080
未収収益	136,888	25,476
貯蔵品	83,453	38,909
繰延税金資産	779,955	227,536
デリバティブ資産	1,172,830	-
その他	30,104	2,030
流動資産計	46,882,252	37,894,473
固定資産		
有形固定資産	1	1,252,162
建物（純額）	388,414	349,484
器具備品（純額）	1,229,446	900,893
建設仮勘定	735	1,785
無形固定資産	1,989,254	1,980,730
ソフトウェア	1,976,209	1,967,944
電話加入権	11,850	11,850
その他	1,194	936
投資その他の資産	8,890,810	8,317,769
投資有価証券	7,690,544	7,780,508
関係会社株式	737,012	737,012

出資金		166,719		178,806
従業員に対する長期貸付金		176,298		155,692
差入保証金		633,855		618,264
長期前払費用		10,039		8,394
投資不動産（純額）		593,270		579,162
その他		43		-
貸倒引当金	3	1,116,972	3	1,740,069
固定資産計		12,498,661		11,550,663
資産合計		59,380,914		49,445,137

（単位：千円）

	前事業年度 （平成20年3月31日現在）	当事業年度 （平成21年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	50,693	48,999
未払金	10,302,751	5,335,193
未払収益分配金	27,011	32,233
未払償還金	332,721	278,950
未払手数料	4,943,985	2,896,691
その他未払金	2 4,999,033	2 2,127,318
未払費用	2,177,782	1,528,570
未払法人税等	1,402,832	442,052
未払消費税等	425,013	-
前受収益	39,700	-
賞与引当金	480,300	223,000
その他	22,096	1,951
流動負債計	14,901,170	7,579,766
固定負債		
退職給付引当金	988,898	1,150,011
役員退職慰労引当金	46,260	62,520
繰延税金負債	2,300,289	1,767,537
固定負債計	3,335,448	2,980,068
負債合計	18,236,618	10,559,835
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金	11,702,152	9,659,553
利益剰余金合計	14,876,450	12,833,851
株主資本合計	41,546,450	39,503,851

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	402,154	618,549
評価・換算差額等合計	402,154	618,549
純資産合計	41,144,295	38,885,301
負債・純資産合計	59,380,914	49,445,137

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月31日)	当事業年度 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,506,998	67,765,880
その他営業収益	572,557	391,449
営業収益計	83,079,556	68,157,330
営業費用		
支払手数料	48,784,763	40,411,927
広告宣伝費	1,542,009	836,270
公告費	9,189	2,131
受益証券発行費	41,501	4,887
調査費	4,197,737	4,089,629
調査費	672,732	752,522
委託調査費	3,525,004	3,337,107
委託計算費	642,326	657,069
営業雑経費	2,103,482	1,828,907
通信費	283,069	264,500
印刷費	918,929	908,407
協会費	40,717	49,882
諸会費	10,258	11,279
その他営業雑経費	850,507	594,837
営業費用計	57,321,011	47,830,823
一般管理費		
給料	4,208,378	3,940,850
役員報酬	185,100	149,400
給料・手当	3,139,424	3,408,724
賞与	403,553	159,726
賞与引当金繰入額	480,300	223,000
福利厚生費	548,953	573,052
交際費	85,291	89,101
寄付金	1,796	630
旅費交通費	231,428	233,872
租税公課	427,247	328,325
不動産賃借料	666,919	730,467
退職給付費用	309,416	310,345
役員退職慰労引当金繰入額	33,405	26,700
固定資産減価償却費	713,538	1,012,489
諸経費	1,349,328	904,760
一般管理費計	8,575,704	8,150,595
営業利益	17,182,840	12,175,911

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)		当事業年度 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		205,108		33,852
有価証券利息		473,605		350,432
受取利息		4,674		4,904
時効成立分配金・償還金		117,919		38,525
有価証券償還益		226,585		26,762
為替差益		-		721,935
デリバティブ評価益		1,150,268		-
その他		27,266		20,641
営業外収益計		2,205,428		1,197,054
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		58,372		127,439
貯蔵品廃棄損		161,462		74,887
為替差損		1,632,650		-
デリバティブ損失		-		885,196
貸倒引当金繰入額		-	3	621,387
その他		41,095		50,066
営業外費用計		1,893,580		1,758,977
経常利益		17,494,688		11,613,987
特別利益				
投資有価証券売却益	1	2,241,103		2,157
ゴルフ会員権売却益		13,021		-
特別利益計		2,254,124		2,157
特別損失				
投資有価証券売却損		21,921		2,298
投資有価証券評価損		-		218,872
投資有価証券清算損		-		10,639
固定資産除売却損	2	44,642	2	11,886
貸倒引当金繰入額	3	1,113,972		-
その他	4	3,737	4	42,274
特別損失計		1,184,273		285,971
税引前当期純利益		18,564,539		11,330,173
法人税、住民税及び事業税		6,901,995		4,648,684
法人税等調整額		997,192		168,125
法人税等合計		7,899,187		4,816,810
当期純利益		10,665,351		6,513,363

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
前期末残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
特別償却準備金		
前期末残高	2,261	-
当期変動額		
特別償却準備金の取崩	2,261	-
当期変動額合計	2,261	-
当期末残高	-	-
別途積立金		
前期末残高	2,800,000	2,800,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	2,800,000	2,800,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	8,834,028	11,702,152
当期変動額		
特別償却準備金の取崩	2,261	-
剰余金の配当	7,799,489	8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363

当期変動額合計	2,868,123	2,042,599
当期末残高	11,702,152	9,659,553

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
利益剰余金合計		
前期末残高	12,010,588	14,876,450
当期変動額		
剰余金の配当	7,799,489	8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363
当期変動額合計	2,865,862	2,042,599
当期末残高	14,876,450	12,833,851
株主資本合計		
前期末残高	38,680,588	41,546,450
当期変動額		
剰余金の配当	7,799,489	8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363
当期変動額合計	2,865,862	2,042,599
当期末残高	41,546,450	39,503,851
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	562,216	402,154
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	964,370	216,395
当期変動額合計	964,370	216,395
当期末残高	402,154	618,549
評価・換算差額等合計		
前期末残高	562,216	402,154
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	964,370	216,395
当期変動額合計	964,370	216,395
当期末残高	402,154	618,549
純資産合計		
前期末残高	39,242,804	41,144,295
当期変動額		
剰余金の配当	7,799,489	8,555,962
当期純利益	10,665,351	6,513,363
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	964,370	216,395
当期変動額合計	1,901,491	2,258,994
当期末残高	41,144,295	38,885,301

重要な会計方針

4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 債権等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。</p> <p>(2) 賞与引当金 役員およ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。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。</p> <p>(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。</p>	<p>(1) 貸倒引当金 同左</p> <p>(2) 賞与引当金 同左</p> <p>(3) 退職給付引当金 同左</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金 同左</p>
5. リース取引の処理方法	<p>リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p>	
6. その他財務諸表作成のための重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。ただし、固定資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は投資その他の資産に計上し、5年間で均等償却を行っております。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。</p>	<p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 同左</p>

会計方針の変更

<p>前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)</p>	<p>当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)</p>
---	---

	<p>（リース取引に関する会計基準）</p> <p>当事業年度より、「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準第13号（平成5年6月17日（企業会計審議会第一部会）、平成19年3月30日改正））及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第16号（平成6年1月18日（日本公認会計士協会 会計制度委員会）、平成19年3月30日改正））を適用しております。</p> <p>なお、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借処理に係る方法に準じた会計処理を適用しております。</p> <p>当該変更に伴う損益に与える影響はありません。</p>
--	---

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 （平成20年3月31日現在）	当事業年度 （平成21年3月31日現在）																
<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>735,161千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>1,604,537千円</td> </tr> <tr> <td>投資建物</td> <td>662,012千円</td> </tr> <tr> <td>投資器具備品</td> <td>26,457千円</td> </tr> </table> <p>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。 未払金 4,620,908千円</p> <p>3 投資その他の資産に計上されております貸倒引当金は、主に外貨建資産担保債券（投資有価証券）に対するものであります。</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務145,120千円に対して保証を行っております。</p>	建物	735,161千円	器具備品	1,604,537千円	投資建物	662,012千円	投資器具備品	26,457千円	<p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>776,838千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>1,691,069千円</td> </tr> <tr> <td>投資建物</td> <td>675,647千円</td> </tr> <tr> <td>投資器具備品</td> <td>26,929千円</td> </tr> </table> <p>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。 未払金 1,848,998千円</p> <p>3 同左</p> <p>4 保証債務 子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore)Ltd.の債務711,260千円に対して保証を行っております。</p>	建物	776,838千円	器具備品	1,691,069千円	投資建物	675,647千円	投資器具備品	26,929千円
建物	735,161千円																
器具備品	1,604,537千円																
投資建物	662,012千円																
投資器具備品	26,457千円																
建物	776,838千円																
器具備品	1,691,069千円																
投資建物	675,647千円																
投資器具備品	26,929千円																

（損益計算書関係）

前事業年度 （自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）	当事業年度 （自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）
<p>1 関係会社との取引 投資有価証券売却益 2,067,950千円</p> <p>2 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。 固定資産除売却損 器具備品 44,642千円</p>	<p>2 固定資産除売却損の内容は次のとおりであります。 固定資産除売却損 器具備品 11,886千円</p>

<p>3 貸倒引当金繰入額に関する注記 保有している外貨建資産担保債券の1銘柄について、清算事象が生じているため、当該銘柄の回収不能見込額を算定し、その見積金額を貸倒引当金として計上しております。 なお、貸倒引当金の計上基準については重要な会計方針に記載しております。</p> <p>4 特別損失の「その他」の主な内訳 会社清算損 3,069千円 保証金の返還に伴う損失 668千円</p>	<p>3 同左</p> <p>4 特別損失の「その他」の主な内訳 受益証券予備券廃棄損 21,160千円 ゴルフ会員権評価損 19,403千円</p>
---	---

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20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)

	前事業年度末 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19年6月22日 定時株主総会	普通株式	7,799	2,990	平成19年 3月31日	平成19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20年6月20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通り提案しております。

剰余金の配当の総額 8,555百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 3,280円

基準日 平成20年3月31日

効力発生日 平成20年6月23日

当事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21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)

	前事業年度末 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20年6月20日 定時株主総会	普通株式	8,555	3,280	平成20年 3月31日	平成20年 6月23日

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

平成21年6月19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通り提案しております。

剰余金の配当の総額	6,495百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	2,490円
基準日	平成21年3月31日
効力発生日	平成21年6月22日

(リース取引関係)

前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
(借主側) リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引	(借主側) リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引
(1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額	(1)リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額
器具備品	器具備品
取得価額相当額 4,599千円	取得価額相当額 4,599千円
減価償却累計額相当額 2,299	減価償却累計額相当額 3,613
期末残高相当額 2,299	期末残高相当額 985
なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。	なお、取得価額相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。
(2)未経過リース料期末残高相当額	(2)未経過リース料期末残高相当額
1年以内 1,314千円	1年以内 985千円
1年超 985	1年超 -
合計 2,299	合計 985
なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。	なお、未経過リース料期末残高相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。

<p>(3)支払リース料及び減価償却費相当額 支払リース料 1,314千円 減価償却費相当額 1,314千円</p> <p>(4)減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p>	<p>(3)支払リース料及び減価償却費相当額 支払リース料 1,314千円 減価償却費相当額 1,314千円</p> <p>(4)減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p>
---	---

(有価証券関係)

1. その他有価証券で時価のあるもの

種類	前事業年度 (平成20年3月31日現在)			当事業年度 (平成21年3月31日現在)		
	取得原価 (千円)	貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)	取得原価 (千円)	貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの						
(1)株式	55,101	73,804	18,702	55,101	67,520	12,418
(2)債券	50,000	50,105	105	-	-	-
(3)その他						
証券投資信託の受 益証券	3,110,512	3,238,991	128,479	1,732,000	1,815,427	83,427
小計	3,215,614	3,362,900	147,286	1,787,101	1,882,948	95,846
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの						
(1)債券	13,669,870	11,886,801	1,783,068	-	-	-
(2)その他						
証券投資信託の受 益証券	2,816,910	2,591,485	225,424	3,766,074	2,627,319	1,138,755
小計	16,486,780	14,478,287	2,008,493	3,766,074	2,627,319	1,138,755
合計	19,702,395	17,841,188	1,861,206	5,553,176	4,510,267	1,042,909

(注) その他有価証券で時価のあるものについて、当事業年度において218,872千円の減損処理を行っております。

なお、有価証券の減損にあたって、当事業年度末における時価の下落率が取得原価の50%以上の場合は、著しい下落かつ回復する見込みがないと判断して、減損処理を行っております。また、時価の下落率が取得原価の30%以上50%未満の場合は、時価の推移及び発行会社の財政状態等を総合的に勘案して回復可能性を検討し、回復見込みがないと判断されたものについては、減損処理を行っておりません。

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

	前事業年度 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	当事業年度 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
売却額(千円)	3,892,206	190,340
売却益の合計額(千円)	2,241,103	2,157
売却損の合計額(千円)	21,921	2,298

3. 時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

種類	前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21年3月31日現在)
	貸借対照表計上額 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)
子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	737,012	737,012
小計	737,012	737,012
その他有価証券		
非上場株式	1,314,612	1,172,137
外貨建資産担保債券	2,504,860	2,098,103
MMF・中期国債ファンド	18,235,925	28,233,112
小計	22,055,397	31,503,352
合計	22,792,409	32,240,364

4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定額

前事業年度（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）

	1年以内（千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超（千円）
(1)債券				
社債	150,000	-	-	-
その他	13,569,000	-	-	-
(2)その他				
証券投資信託 の受益証券	1,023,578	434,463	1,611,490	86,955
合計	14,742,578	434,463	1,611,490	86,955

当事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）

	1年以内（千円）	1年超5年以内 （千円）	5年超10年以内 （千円）	10年超（千円）
その他				
証券投資信託の 受益証券	-	376,553	1,729,191	-
合計	-	376,553	1,729,191	-

（デリバティブ取引関係）

1. 取引の状況に関する事項

前事業年度 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	当事業年度 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)

<p>(1) 取引の内容及び利用目的 当社が利用しているデリバティブ取引は為替予約取引であり、当社が保有する外貨建資産担保債券に係る為替変動リスクを軽減するために利用しております。</p> <p>(2) 取引に対する取組方針 為替予約取引については将来の為替変動リスクの軽減を目的としているため、対象資産である外貨建資産担保債券の保有残高の範囲内で行うこととしており、投機目的ではありません。</p> <p>(3) 取引に係るリスクの内容 為替予約取引に係るリスクとして、為替相場の変動による市場リスクを有しております。また、信用度の高い国内大手証券会社を取引先としており、取引先の契約不履行に係る信用リスクはほとんどないと判断しております。</p> <p>(4) 取引に係るリスク管理体制 為替予約取引開始にあたっては、事前に取締役会等の会議体にて承認を得ることとしております。 なお、事後体制としまして、財務部長は毎月、為替予約取引の内容を含んだ財務報告を執行役員会議で行っております。また、財務部内にて取引の状況について適切に把握、管理しております。</p>	<p>(1) 取引の内容及び利用目的 同左</p> <p>(2) 取引に対する取組方針 同左</p> <p>(3) 取引に係るリスクの内容 同左</p> <p>(4) 取引に係るリスク管理体制 同左</p>
--	---

2. 取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	前事業年度 (平成20年3月31日現在)				当事業年度 (平成21年3月31日現在)			
		契約額等 (千円)	契約額等 のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)	契約額等 (千円)	契約額等 のうち 1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	16,334,748	-	1,150,268	1,150,268	410,852	-	1,622	1,622

(注) 時価の算定方法は、各通貨のキャッシュ・フローを計算し、現在価値に割り引き邦貨換算した額となっております。

(退職給付関係)

前事業年度 (平成20年3月31日現在)		当事業年度 (平成21年3月31日現在)	
1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。		1. 採用している退職給付制度の概要 同左	
2. 退職給付債務に関する事項		2. 退職給付債務に関する事項	
退職給付債務	988,898千円	退職給付債務	1,150,011千円
退職給付引当金	988,898千円	退職給付引当金	1,150,011千円

<p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">152,041千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">157,375</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;">309,416</td> </tr> </table> <p>なお、「その他」のうち確定拠出年金への掛金支払額は106,630千円であります。</p>	勤務費用	152,041千円	その他	157,375	<hr/>		退職給付費用	309,416	<p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">168,703千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">141,642</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;">310,345</td> </tr> </table> <p>なお、「その他」のうち確定拠出年金への掛金支払額は118,690千円であります。</p>	勤務費用	168,703千円	その他	141,642	<hr/>		退職給付費用	310,345
勤務費用	152,041千円																
その他	157,375																
<hr/>																	
退職給付費用	309,416																
勤務費用	168,703千円																
その他	141,642																
<hr/>																	
退職給付費用	310,345																

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21年3月31日現在)																																																																																																												
<p>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</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">繰延税金資産</td> <td style="text-align: right;">千円</td> </tr> <tr> <td>減損損失</td> <td style="text-align: right;">887,301</td> </tr> <tr> <td>貸倒引当金</td> <td style="text-align: right;">454,496</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">402,382</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">332,390</td> </tr> <tr> <td>株式譲渡損繰延</td> <td style="text-align: right;">287,965</td> </tr> <tr> <td>その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">275,900</td> </tr> <tr> <td>投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">214,784</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">168,660</td> </tr> <tr> <td>出資金評価損</td> <td style="text-align: right;">118,268</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">38,093</td> </tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td> <td style="text-align: right;">18,823</td> </tr> <tr> <td>未払社会保険料</td> <td style="text-align: right;">18,208</td> </tr> <tr> <td>前受収益</td> <td style="text-align: right;">16,153</td> </tr> <tr> <td>一括償却資産</td> <td style="text-align: right;">10,048</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">23,392</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;">3,266,871</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">1,947,529</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">1,319,341</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債</td> <td></td> </tr> <tr> <td>株式譲渡益繰延</td> <td style="text-align: right;">2,837,113</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">2,562</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right;">2,839,675</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債の純額</td> <td style="text-align: right;">1,520,333</td> </tr> </table>	繰延税金資産	千円	減損損失	887,301	貸倒引当金	454,496	退職給付引当金	402,382	未払事業税	332,390	株式譲渡損繰延	287,965	その他有価証券評価差額金	275,900	投資有価証券評価損	214,784	賞与引当金	168,660	出資金評価損	118,268	器具備品	38,093	役員退職慰労引当金	18,823	未払社会保険料	18,208	前受収益	16,153	一括償却資産	10,048	その他	23,392	<hr/>		繰延税金資産小計	3,266,871	評価性引当額	1,947,529	<hr/>		繰延税金資産合計	1,319,341	繰延税金負債		株式譲渡益繰延	2,837,113	その他	2,562	<hr/>		繰延税金負債合計	2,839,675	<hr/>		繰延税金負債の純額	1,520,333	<p>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</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">繰延税金資産</td> <td style="text-align: right;">千円</td> </tr> <tr> <td>減損損失</td> <td style="text-align: right;">886,012</td> </tr> <tr> <td>貸倒引当金</td> <td style="text-align: right;">708,034</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">467,939</td> </tr> <tr> <td>その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">424,359</td> </tr> <tr> <td>投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">303,843</td> </tr> <tr> <td>株式譲渡損繰延</td> <td style="text-align: right;">287,965</td> </tr> <tr> <td>出資金評価損</td> <td style="text-align: right;">126,163</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">108,049</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">90,738</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">38,093</td> </tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td> <td style="text-align: right;">25,439</td> </tr> <tr> <td>未払社会保険料</td> <td style="text-align: right;">11,283</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">31,981</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;">3,509,905</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">2,210,636</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">1,299,269</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債</td> <td></td> </tr> <tr> <td>株式譲渡益繰延</td> <td style="text-align: right;">2,837,113</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">2,156</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right;">2,839,269</td> </tr> <tr> <td colspan="2"><hr/></td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債の純額</td> <td style="text-align: right;">1,540,000</td> </tr> </table>	繰延税金資産	千円	減損損失	886,012	貸倒引当金	708,034	退職給付引当金	467,939	その他有価証券評価差額金	424,359	投資有価証券評価損	303,843	株式譲渡損繰延	287,965	出資金評価損	126,163	未払事業税	108,049	賞与引当金	90,738	器具備品	38,093	役員退職慰労引当金	25,439	未払社会保険料	11,283	その他	31,981	<hr/>		繰延税金資産小計	3,509,905	評価性引当額	2,210,636	<hr/>		繰延税金資産合計	1,299,269	繰延税金負債		株式譲渡益繰延	2,837,113	その他	2,156	<hr/>		繰延税金負債合計	2,839,269	<hr/>		繰延税金負債の純額	1,540,000
繰延税金資産	千円																																																																																																												
減損損失	887,301																																																																																																												
貸倒引当金	454,496																																																																																																												
退職給付引当金	402,382																																																																																																												
未払事業税	332,390																																																																																																												
株式譲渡損繰延	287,965																																																																																																												
その他有価証券評価差額金	275,900																																																																																																												
投資有価証券評価損	214,784																																																																																																												
賞与引当金	168,660																																																																																																												
出資金評価損	118,268																																																																																																												
器具備品	38,093																																																																																																												
役員退職慰労引当金	18,823																																																																																																												
未払社会保険料	18,208																																																																																																												
前受収益	16,153																																																																																																												
一括償却資産	10,048																																																																																																												
その他	23,392																																																																																																												
<hr/>																																																																																																													
繰延税金資産小計	3,266,871																																																																																																												
評価性引当額	1,947,529																																																																																																												
<hr/>																																																																																																													
繰延税金資産合計	1,319,341																																																																																																												
繰延税金負債																																																																																																													
株式譲渡益繰延	2,837,113																																																																																																												
その他	2,562																																																																																																												
<hr/>																																																																																																													
繰延税金負債合計	2,839,675																																																																																																												
<hr/>																																																																																																													
繰延税金負債の純額	1,520,333																																																																																																												
繰延税金資産	千円																																																																																																												
減損損失	886,012																																																																																																												
貸倒引当金	708,034																																																																																																												
退職給付引当金	467,939																																																																																																												
その他有価証券評価差額金	424,359																																																																																																												
投資有価証券評価損	303,843																																																																																																												
株式譲渡損繰延	287,965																																																																																																												
出資金評価損	126,163																																																																																																												
未払事業税	108,049																																																																																																												
賞与引当金	90,738																																																																																																												
器具備品	38,093																																																																																																												
役員退職慰労引当金	25,439																																																																																																												
未払社会保険料	11,283																																																																																																												
その他	31,981																																																																																																												
<hr/>																																																																																																													
繰延税金資産小計	3,509,905																																																																																																												
評価性引当額	2,210,636																																																																																																												
<hr/>																																																																																																													
繰延税金資産合計	1,299,269																																																																																																												
繰延税金負債																																																																																																													
株式譲渡益繰延	2,837,113																																																																																																												
その他	2,156																																																																																																												
<hr/>																																																																																																													
繰延税金負債合計	2,839,269																																																																																																												
<hr/>																																																																																																													
繰延税金負債の純額	1,540,000																																																																																																												
<p>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</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">40.69%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.20</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.52</td> </tr> <tr> <td>住民税均等割</td> <td style="text-align: right;">0.02</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">2.45</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	40.69%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.20	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.52	住民税均等割	0.02	評価性引当額	2.45	<p>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</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">40.69%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.35</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.13</td> </tr> <tr> <td>住民税均等割</td> <td style="text-align: right;">0.03</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">2.32</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	40.69%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.35	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.13	住民税均等割	0.03	評価性引当額	2.32																																																																																								
法定実効税率 (調整)	40.69%																																																																																																												
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.20																																																																																																												
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.52																																																																																																												
住民税均等割	0.02																																																																																																												
評価性引当額	2.45																																																																																																												
法定実効税率 (調整)	40.69%																																																																																																												
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.35																																																																																																												
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.13																																																																																																												
住民税均等割	0.03																																																																																																												
評価性引当額	2.32																																																																																																												

その他	0.29	その他	0.74
税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.55	税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.52

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

1. 親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	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(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	178,324	持ち株会社	100.0	役員2人	経営管理	有価証券の売却 売却代金 売却益	3,153,487 2,067,950	- -	- -

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

有価証券の売却価格は、修正簿価純資産方式により決定しており、支払条件は現金一括払いであります。

2. 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	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(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の 子会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	なし	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	31,893,085	未払手数料	3,927,855
親会社の 子会社	大和証券エスエムピーシー(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	なし	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	1,197,059	未払手数料	82,472
								為替予約	25,434,342	-	-
親会社の 子会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	なし	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,074,141	その他未払金	321,615

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (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。
- (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兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- (3) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。
- (4) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

当事業年度(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

(追加情報)

当事業年度より、平成18年10月17日公表の「関連当事者の開示に関する会計基準」(企業会計基準第11号)及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第13号)を適用しております。

なお、これによる開示対象範囲の変更はありません。

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	100.0	経営管理	債務保証	711,260	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
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	25,915,828	未払手数料	2,154,948
同一の親会社をもつ会社	大和証券エスエムピーシー(株)	東京都千代田区	255,700	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	980,553	未払手数料	58,506
							為替予約	17,314,889	-	-
同一の親会社をもつ会社	株大和総研	東京都江東区	1,000	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	544,950	その他未払金	197,190

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

(2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

(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。

(4) 株大和総研との取引金額には、株大和総研ホールディングス(旧・株大和総研)分社化前の取引金額が含まれております。

2. 親会社に関する注記

(株)大和証券グループ本社（東京証券取引所、大阪証券取引所、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19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
1株当たり純資産額 15,773.01円 1株当たり当期純利益 4,088.65円 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額 については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。	1株当たり純資産額 14,907.00円 1株当たり当期純利益 2,496.95円 同左

(注) 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19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
当期純利益(千円)	10,665,351	6,513,363
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)

前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
該当事項はありません。	同左

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うことを内容とした運用を行うこと(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うことを内容とした運用を行うこと(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うことを内容とした運用を行うこと。

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21年4月2日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 株主名簿管理人の廃止

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または重要な影響を及ぼすことが予想される事実

提出日前1年以内において、訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または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 住友信託銀行株式会社

資本金の額 287,537百万円（平成21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21年3月末日現在)	事業の内容
大和証券エスエムビーシー株式会社	255,700	(注1)
カリヨン証券会社 東京支店	26,500	(注2)
クレディ スイス証券株式会社	78,100	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。
ゴールドマン・サックス証券会社	83,616	
J.P.モルガン証券株式会社	50,275	
シティグループ証券株式会社	96,308	
ソシエテ ジェネラル証券会社 東京支店	26,703	
ドイツ証券株式会社	72,728	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。
野村證券株式会社	10,000	
パークレイズ・キャピタル証券株式会社	32,945	(注2)
ピー・エヌ・ピー・パリバ証券会社 東京支店	80,800	
みずほ証券株式会社	() 125,167	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。
みずほインベスターズ証券株式会社	80,288	
三菱UFJ証券株式会社	65,518	
メリルリンチ日本証券株式会社	141,261	
モルガン・スタンレー証券株式会社	99,299	
UBS証券会社 東京支店	60,000	

() 資本金の額は、平成21年5月7日現在のものです。

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 外国証券業者に関する法律に基づき証券業を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

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

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

ないます。

3 【資本関係】

該当ありません。

<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21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（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【参考情報】

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

（提出年月日）	（書類名）
平成20年10月3日	有価証券届出書・同添付書類、有価証券報告書（第7期）・同添付書類
平成20年11月27日	有価証券届出書の訂正届出書
平成21年3月24日	有価証券届出書の訂正届出書
平成21年4月3日	半期報告書（第8期中）、有価証券届出書の訂正届出書
平成21年5月1日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成21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

あずさ監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	山元 太志 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	久野 佳樹 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、「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20年7月11日から平成21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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21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。

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） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 公認会計士 堀内 巧 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 小澤 陽 一 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、「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20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を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。

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)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。

独立監査人の監査報告書

平成20年8月8日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	山元 太志 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	久野 佳樹 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、「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19年7月11日から平成20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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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20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。

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） 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月20日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	堀内 巧 印
----------------	-------	--------

指定社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 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19年4月1日から平成20年3月31日までの第49期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を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。

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)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。