

【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23年10月3日提出  
【計算期間】 第10計算期間  
（平成22年7月11日から平成23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ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
- ・「インデックス型」...目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの

##### (注2) 属性区分の定義

- ・「株式 一般」...大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「年1回」...目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「日本」...目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの

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

### < ファンドの特色 >

1

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

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

#### 東証株価指数(TOPIX)について

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

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

(注2) 基準時の時価総額の修正方法：

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

- 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。
- 「ダイワ上場投信ートピックス」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、「ダイワ上場投信ートピックス」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。
- 「ダイワ上場投信ートピックス」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、「ダイワ上場投信ートピックス」の購入者又は公衆に対し、「ダイワ上場投信ートピックス」の説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。
- 以上の項目に限らず、（株）東京証券取引所は「ダイワ上場投信ートピックス」の発行等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。

## 2

当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

●受益権は、東京証券取引所に上場され、株式と同様に売買することができます。

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

●追加設定は、株式により行ないます。

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

●受益権を株式と交換することができます。

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

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

3

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

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

|      | 名 称            | 関係業務の内容   |
|------|----------------|---|
| 委託会社 | 大和証券投資信託委託株式会社 | 当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 1 ）の委託者であり、受益権の募集・発行、信託財産の運用指図、受益権とその信託財産に属する株式との交換の指図、信託財産の計算等を行ないます。 |

|      |  |   |
|------|--|---|
| 受託会社 | 住友信託銀行株式会社<br>(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23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。<br>(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号) |

#### ・ 大株主の状況

| 名称             | 住所                | 所有株式数       | 比率       |
|----------------|-------------------|-------------|----------|
| 株式会社大和証券グループ本社 | 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 | 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。）

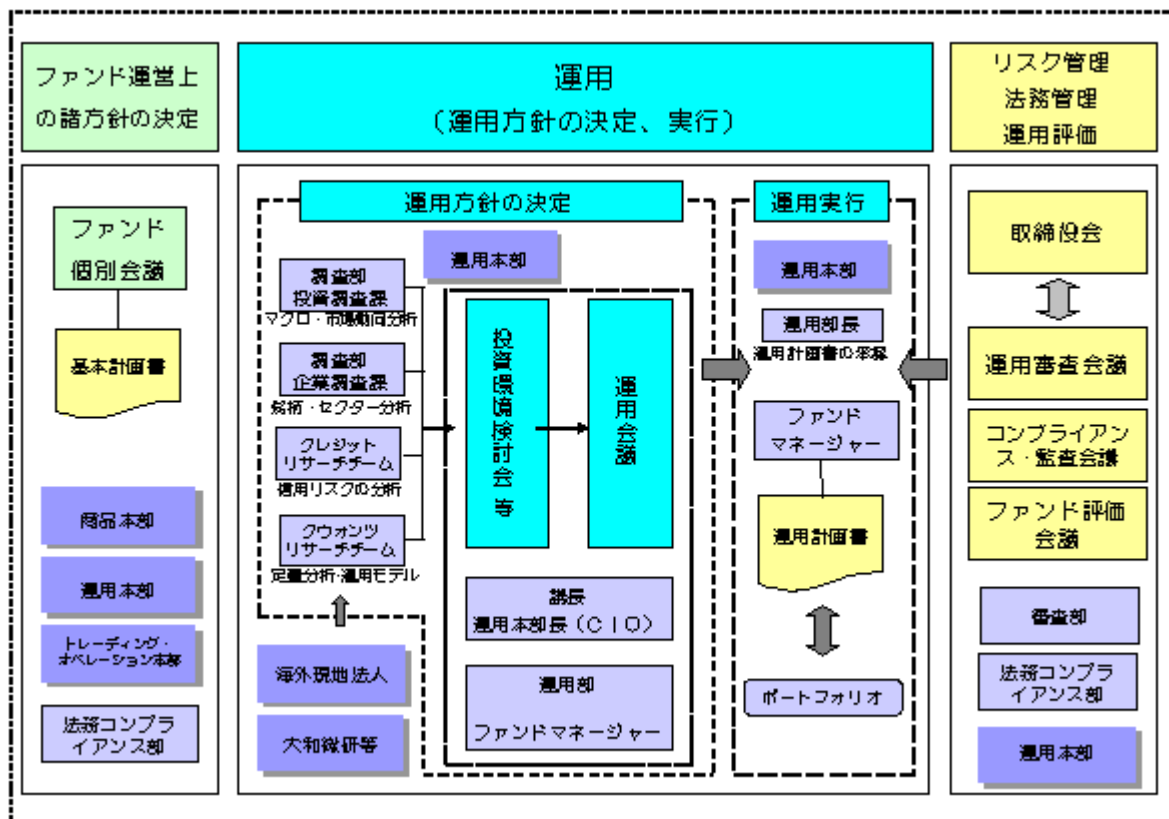
3. コール・ローン

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（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．基本的な運用方針の決定

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

#### ニ．運用計画書の作成・承認

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

### 職務権限

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

#### イ．運用本部長（CIO）（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。

#### ハ．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。

#### ニ．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20～30名程度です。

#### 受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成23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息、信託報酬その他これらに類する費用の額の合計額を控除した額の全額について行ないます。

#### (5) 【投資制限】

##### 株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

##### 投資する株式の範囲（信託約款）

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

先物取引等（信託約款）

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

有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

2．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

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

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

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への投資は、行ないません。

### 3 【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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すよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

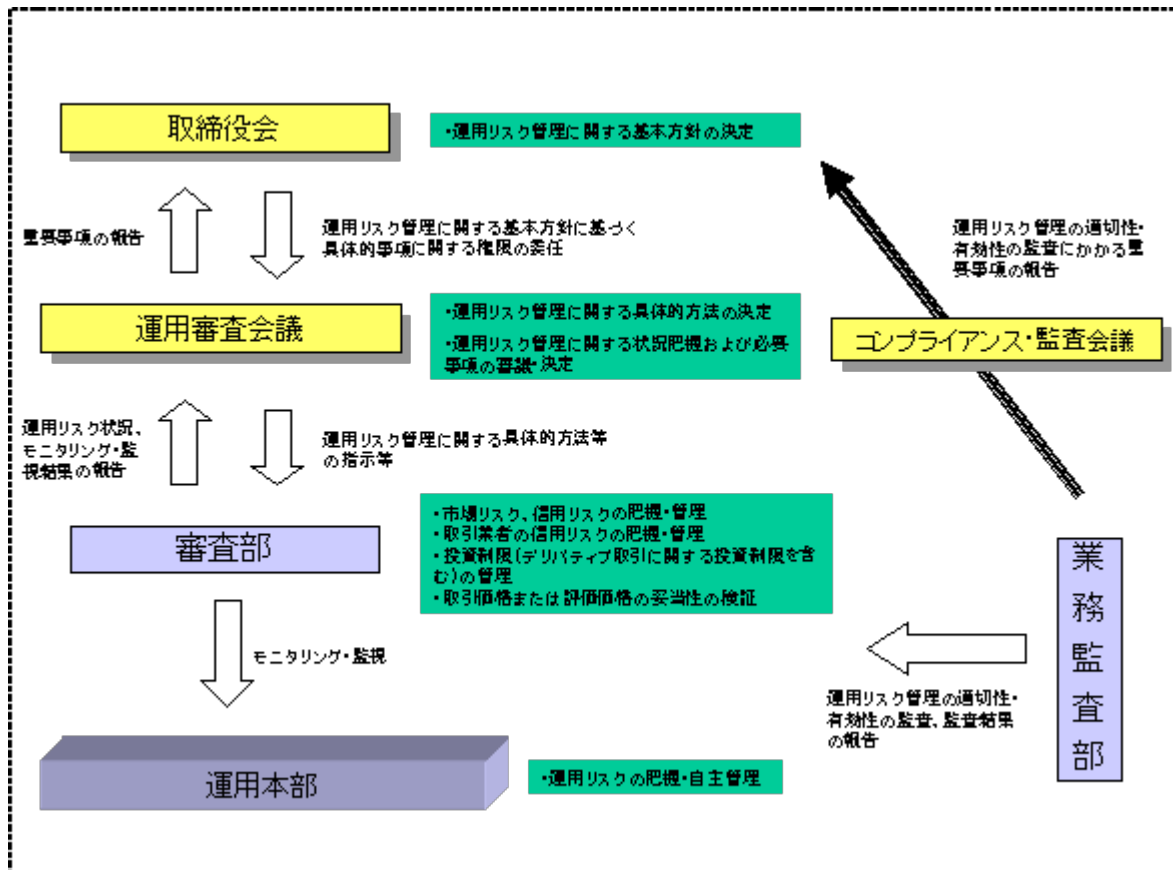
その他

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

## (2) その他の留意点

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

## (3) リスク管理体制



## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

## (2) 【換金（解約）手数料】

## 換金手数料

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

販売会社については、前(1)をご参照下さい。

## 信託財産留保額

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

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

イ. 信託財産の純資産総額に年率10,000分の11.55（税抜10,000分の11）以内を乗じて得た額

ロ. 信託財産に属する株式の貸付けにかかる品貸料（貸付株券から発生する配当金相当額等を含まないものとし、株式の貸付けにあたって担保として現金を受入れた場合には、当該現金の運用により生じたとみなし得る収益を加算し、貸付けの相手方に支払う当該現金に対する利息額を控除するもの）とします（控除した額が負数のときは零とします。）に100分の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. 年率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 年率10,000分の7.875（税抜10,000分の7.5）

受託会社 年率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東証株価指数の商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（以下「商標使用料」といいます。）ならびにこれらにかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。ただし、各計算期

間において、信託財産中から支弁する受益権の上場にかかる費用および商標使用料の合計額は、信託財産の純資産総額に年率10,000分の6.3(税抜10,000分の6)を乗じて得た額を超えないものとします。

提出日現在、商標使用料は信託財産の純資産総額に、年率10,000分の3.15(税抜10,000分の3)以内を乗じて得た額(ただし、157万5千円(税抜150万円)を下回る場合は、157万5千円(税抜150万円))となります。

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

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

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

## (5) 【課税上の取扱い】

課税上は特定株式投資信託として取扱われます。

### 個人の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25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25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。

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

### 法人の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25年12月31日までは7%(所得税7%)、平成26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。

（ ）上記は、平成23年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成23年7月29日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価（円）           | 投資比率（％） |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 株式                    | 228,336,048,815 | 99.83   |
| 内 日本                  | 228,336,048,815 | 99.83   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 399,364,882     | 0.17    |
| 純資産総額                 | 228,735,413,697 | 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） | 403,680,000 | 0.18    |
| 内 日本         | 403,680,000 | 0.18    |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

（注3）株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

## (2) 【投資資産】（平成23年7月29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<br>地域           | 種類<br>業種     | 株数、口数<br>または額面金額 | 簿価単価<br>簿価              | 評価単価<br>時価              | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率 |
|----|---------------------|--------------|------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|----------|
| 1  | トヨタ自動車<br>日本        | 株式<br>輸送用機器  | 2,596,000        | 3,443<br>8,938,939,900  | 3,155<br>8,190,380,000  | -<br>-                   | 3.58%    |
| 2  | 三菱UFJフィナンシャルG<br>日本 | 株式<br>銀行業    | 15,094,800       | 414<br>6,260,040,462    | 392<br>5,917,161,600    | -<br>-                   | 2.59%    |
| 3  | 本田技研<br>日本          | 株式<br>輸送用機器  | 1,704,800        | 3,258<br>5,555,340,146  | 3,080<br>5,250,784,000  | -<br>-                   | 2.30%    |
| 4  | キヤノン<br>日本          | 株式<br>電気機器   | 1,255,200        | 3,917<br>4,917,542,760  | 3,750<br>4,707,000,000  | -<br>-                   | 2.06%    |
| 5  | 三井住友フィナンシャルG<br>日本  | 株式<br>銀行業    | 1,515,300        | 2,567<br>3,890,663,784  | 2,434<br>3,688,240,200  | -<br>-                   | 1.61%    |
| 6  | 三菱商事<br>日本          | 株式<br>卸売業    | 1,556,000        | 2,098<br>3,265,016,624  | 2,063<br>3,210,028,000  | -<br>-                   | 1.40%    |
| 7  | みずほフィナンシャルG<br>日本   | 株式<br>銀行業    | 24,508,800       | 134<br>3,306,884,306    | 127<br>3,112,617,600    | -<br>-                   | 1.36%    |
| 8  | ファナック<br>日本         | 株式<br>電気機器   | 210,400          | 14,199<br>2,987,619,032 | 14,610<br>3,073,944,000 | -<br>-                   | 1.34%    |
| 9  | 武田薬品<br>日本          | 株式<br>医薬品    | 792,800          | 3,739<br>2,964,583,392  | 3,675<br>2,913,540,000  | -<br>-                   | 1.27%    |
| 10 | 日本電信電話<br>日本        | 株式<br>情報・通信業 | 749,000          | 3,884<br>2,909,818,141  | 3,800<br>2,846,200,000  | -<br>-                   | 1.24%    |
| 11 | ソフトバンク<br>日本        | 株式<br>情報・通信業 | 886,100          | 3,109<br>2,755,688,779  | 3,010<br>2,667,161,000  | -<br>-                   | 1.17%    |

|    |              |    |                      |           |                          |                          |        |       |
|----|--------------|----|----------------------|-----------|--------------------------|--------------------------|--------|-------|
| 12 | 三井物産         | 日本 | 株式<br>卸売業            | 1,721,500 | 1,434<br>2,468,748,051   | 1,455<br>2,504,782,500   | -<br>- | 1.10% |
| 13 | 小松製作所        | 日本 | 株式<br>機械             | 1,002,700 | 2,542<br>2,548,973,731   | 2,407<br>2,413,498,900   | -<br>- | 1.06% |
| 14 | エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 日本 | 株式<br>情報・通信業         | 16,432    | 144,201<br>2,369,520,558 | 141,500<br>2,325,128,000 | -<br>- | 1.02% |
| 15 | ソニー          | 日本 | 株式<br>電気機器           | 1,134,500 | 2,205<br>2,502,174,940   | 1,947<br>2,208,871,500   | -<br>- | 0.97% |
| 16 | 日立           | 日本 | 株式<br>電気機器           | 4,538,000 | 482<br>2,191,425,440     | 479<br>2,173,702,000     | -<br>- | 0.95% |
| 17 | パナソニック       | 日本 | 株式<br>電気機器           | 2,353,000 | 1,008<br>2,372,251,900   | 923<br>2,171,819,000     | -<br>- | 0.95% |
| 18 | 日産自動車        | 日本 | 株式<br>輸送用機器          | 2,552,800 | 869<br>2,220,170,216     | 822<br>2,098,401,600     | -<br>- | 0.92% |
| 19 | 三菱地所         | 日本 | 株式<br>不動産業           | 1,395,000 | 1,487<br>2,074,966,120   | 1,384<br>1,930,680,000   | -<br>- | 0.84% |
| 20 | 三菱電機         | 日本 | 株式<br>電気機器           | 2,021,000 | 942<br>1,905,112,250     | 907<br>1,833,047,000     | -<br>- | 0.80% |
| 21 | セブン&アイ・HLDGS | 日本 | 株式<br>小売業            | 834,200   | 2,247<br>1,874,485,527   | 2,195<br>1,831,069,000   | -<br>- | 0.80% |
| 22 | KDDI         | 日本 | 株式<br>情報・通信業         | 3,096     | 572,849<br>1,773,543,101 | 572,000<br>1,770,912,000 | -<br>- | 0.77% |
| 23 | 東京海上HD       | 日本 | 株式<br>保険業            | 757,100   | 2,378<br>1,801,035,320   | 2,275<br>1,722,402,500   | -<br>- | 0.75% |
| 24 | 東日本旅客鉄道      | 日本 | 株式<br>陸運業            | 351,300   | 4,814<br>1,691,499,360   | 4,840<br>1,700,292,000   | -<br>- | 0.74% |
| 25 | 日本たばこ産業      | 日本 | 株式<br>食料品            | 4,706     | 323,830<br>1,523,944,029 | 350,000<br>1,647,100,000 | -<br>- | 0.72% |
| 26 | 東芝           | 日本 | 株式<br>電気機器           | 3,988,000 | 423<br>1,690,175,320     | 400<br>1,595,200,000     | -<br>- | 0.70% |
| 27 | 野村ホールディングス   | 日本 | 株式<br>証券・商品先<br>物取引業 | 4,200,100 | 403<br>1,695,547,556     | 376<br>1,579,237,600     | -<br>- | 0.69% |
| 28 | 信越化学         | 日本 | 株式<br>化学             | 352,400   | 4,378<br>1,542,887,610   | 4,165<br>1,467,746,000   | -<br>- | 0.64% |
| 29 | 新日本製鐵        | 日本 | 株式<br>鉄鋼             | 5,552,000 | 266<br>1,481,617,300     | 260<br>1,443,520,000     | -<br>- | 0.63% |
| 30 | 任天堂          | 日本 | 株式<br>その他製品          | 115,600   | 16,453<br>1,902,071,511  | 12,290<br>1,420,724,000  | -<br>- | 0.62% |

(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        | 99.83% |
| 合計        | 99.83% |

(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     | 0.69% |
| 建設業    | 2.28% |
| 食料品    | 3.23% |
| 繊維製品   | 0.95% |

|            |        |
|------------|--------|
| パルプ・紙      | 0.36%  |
| 化学         | 6.06%  |
| 医薬品        | 4.71%  |
| 石油・石炭製品    | 0.95%  |
| ゴム製品       | 0.75%  |
| ガラス・土石製品   | 1.29%  |
| 鉄鋼         | 2.23%  |
| 非鉄金属       | 1.41%  |
| 金属製品       | 0.73%  |
| 機械         | 5.34%  |
| 電気機器       | 14.47% |
| 輸送用機器      | 10.30% |
| 精密機器       | 1.52%  |
| その他製品      | 1.61%  |
| 電気・ガス業     | 3.00%  |
| 陸運業        | 3.53%  |
| 海運業        | 0.49%  |
| 空運業        | 0.31%  |
| 倉庫・運輸関連業   | 0.23%  |
| 情報・通信業     | 5.99%  |
| 卸売業        | 5.55%  |
| 小売業        | 3.83%  |
| 銀行業        | 9.08%  |
| 証券・商品先物取引業 | 1.26%  |
| 保険業        | 2.55%  |
| その他金融業     | 0.80%  |
| 不動産業       | 2.42%  |
| サービス業      | 1.77%  |
| 合計         | 99.83% |

(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/<br>売建 | 数量 | 簿価          | 時価          | 投資<br>比率 |
|----------|----|-----------------|-----------|----|-------------|-------------|----------|
| 株価指数先物取引 | 日本 | TOPIX先物 2011年9月 | 買建        | 48 | 420,480,000 | 403,680,000 | 0.18%    |

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

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

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

|                          | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)<br>(円) | 東京証券<br>取引所<br>市場相場 |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------|
| 設定時<br>(平成13年7月11日)      | 4,996,055,395         | -                     | 1,250.0                        | -                              | -                   |
| 第1計算期間末<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(平成20年7月10日)  | 382,598,866,794       | 388,782,960,703       | 1,308.5                        | 1,329.7                        | 1,310               |
| 第8計算期間末<br>(平成21年7月10日)  | 169,610,147,395       | 174,789,556,053       | 875.7                          | 902.4                          | 877                 |
| 第9計算期間末<br>(平成22年7月10日)  | 212,389,754,464       | 215,702,142,160       | 865.0                          | 878.5                          | 865                 |
| 平成22年7月末日                | 209,496,323,836       | -                     | 853.2                          | -                              | 855                 |
| 8月末日                     | 195,312,603,283       | -                     | 808.4                          | -                              | 806                 |
| 9月末日                     | 202,901,747,467       | -                     | 839.9                          | -                              | 839                 |
| 10月末日                    | 198,371,089,996       | -                     | 821.1                          | -                              | 818                 |
| 11月末日                    | 210,514,008,077       | -                     | 871.4                          | -                              | 873                 |
| 12月末日                    | 219,974,401,396       | -                     | 910.5                          | -                              | 910                 |
| 平成23年1月末日                | 224,579,798,942       | -                     | 922.0                          | -                              | 921                 |
| 2月末日                     | 240,613,843,311       | -                     | 964.0                          | -                              | 965                 |
| 3月末日                     | 216,918,525,197       | -                     | 890.3                          | -                              | 885                 |
| 4月末日                     | 216,260,754,880       | -                     | 872.6                          | -                              | 870                 |
| 5月末日                     | 218,046,746,176       | -                     | 859.0                          | -                              | 857                 |
| 6月末日                     | 234,914,018,223       | -                     | 870.7                          | -                              | 871                 |
| 第10計算期間末<br>(平成23年7月10日) | 242,981,056,419       | 247,200,364,545       | 881.1                          | 896.4                          | 883                 |
| 7月末日                     | 228,735,413,697       | -                     | 847.8                          | -                              | 850                 |

(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 |
| 第9計算期間  | 13.4900 |
| 第10計算期間 | 15.3000 |

## 【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9計算期間  | 0.3    |
| 第10計算期間 | 3.6    |

[次△](#)

## (参考情報)

2011年7月29日現在  
基準価額・純資産の推移

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

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 8,478円  |
| 純資産総額 | 2,287億円 |

| 基準価額の騰落率 |        |
|----------|--------|
| 期間       | ファンド   |
| 1カ月間     | -0.9%  |
| 3カ月間     | -1.2%  |
| 6カ月間     | -6.5%  |
| 1年間      | 1.1%   |
| 3年間      | -31.7% |
| 5年間      | -41.8% |
| 設定来      | -23.2% |



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 153円 設定来分配金合計額: 1,397.4円

| 決算期 | 第1期   | 第2期    | 第3期   | 第4期    | 第5期    | 第6期    | 第7期    | 第8期    | 第9期    | 第10期  |
|-----|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
|     | 02年7月 | 03年7月  | 04年7月 | 05年7月  | 06年7月  | 07年7月  | 08年7月  | 09年7月  | 10年7月  | 11年7月 |
| 分配金 | 6.2円  | 106.8円 | 33.9円 | 143.9円 | 150.2円 | 189.6円 | 211.5円 | 267.4円 | 134.9円 | 153円  |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

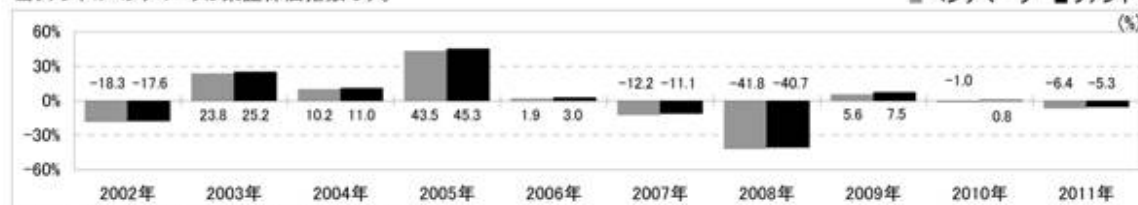
| 資産別構成        | 銘柄数   | 比率    | 株式東証33業種別構成 | 比率    | 組入上位10銘柄      | 業種名    | 比率    |
|--------------|-------|-------|-------------|-------|---------------|--------|-------|
| 国内株式         | 1,669 | 99.8% | 電気機器        | 14.5% | トヨタ自動車        | 輸送用機器  | 3.6%  |
| 国内株式先物       | 1     | 0.2%  | 輸送用機器       | 10.3% | 三菱UFJフィナンシャルG | 銀行業    | 2.6%  |
| 不動産投資信託等     | -     | -     | 銀行業         | 9.1%  | 本田技研          | 輸送用機器  | 2.3%  |
| コール・ローン、その他  | -     | -     | 化学          | 6.1%  | キヤノン          | 電気機器   | 2.1%  |
| 合計           | 1,670 | -     | 情報・通信業      | 6.0%  | 三井住友フィナンシャルG  | 銀行業    | 1.6%  |
| 株式市場・上場別構成   |       |       | 卸売業         | 5.6%  | 三菱商事          | 卸売業    | 1.4%  |
| 一部(東証・大証・名証) |       | 99.8% | 機械          | 5.3%  | みずほフィナンシャルG   | 銀行業    | 1.4%  |
| 二部(東証・大証・名証) |       | -     | 医薬品         | 4.7%  | ファナック         | 電気機器   | 1.3%  |
| 新興市場他        |       | 0.0%  | 小売業         | 3.8%  | 武田薬品          | 医薬品    | 1.3%  |
| その他          |       | -     | その他         | 34.5% | 日本電信電話        | 情報・通信業 | 1.2%  |
| 合計           |       | 99.8% | 合計          | 99.8% | 合計            |        | 18.8% |

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

■ベンチマーク ■ファンド (%)



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2011年は7月29日までの騰落率を表しています。

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

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

|         | 設定数量（口）     | 解約数量（口）     |
|---------|-------------|-------------|
| 第1計算期間  | 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 |
| 第9計算期間  | 65,756,800  | 13,908,027  |
| 第10計算期間 | 61,810,890  | 31,583,053  |

(注) 当初設定数量は3,996,800口です。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込（販売）手続等】

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

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

## 2 【換金（解約）手続等】

### < 解約 >

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

### < 交換 >

- イ. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、当該受益権と当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換（以下「交換」といいます。）を請求することができます。
- ロ. 受益者が交換の請求をするときは、販売会社に対し、委託会社が定める一定口数の整数倍の振替受益権をもって、販売会社所定の方法で行なうものとします。
- ハ. 交換を請求しようとする受益者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後3時）までに交換請求をした場合には、その翌営業日を交換請求受付日として委託会社は当該交換請求を受付けます。
- ニ. 委託会社は、交換に際し、信託財産に属する株式の評価額をもって、それに相当する口数の振替受益権と交換するものとします。交換に際し、振替受益権の価額は、交換請求受付日の基準価額とします。
- ホ. 前イ.にかかわらず、委託会社は、原則として、次の1.から4.までに該当する場合は、振替受益権の交換請求の受付けを停止します。なお、次の1.から3.までに該当する場合であっても、委託会社の判断により、振替受益権の交換請求を受付けることがあります。
  1. 東証株価指数構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日
  2. 東証株価指数構成銘柄の変更および増減資等に伴う株数の変更日の4営業日前から起算して8営業日以内
  3. 計算期間終了日の4営業日前から起算して5営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して6営業日以内）

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

#### < 買取り >

- イ. 販売会社は、次に該当する場合で、受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。ただし、2. の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。
1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権
  2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき

- ロ．前イ．の買取価額は、買取申込みを受付けた日の基準価額から、販売会社が定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を控除した価額とすることができます。
- ハ．販売会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することができます。
- ニ．前ハ．により受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取停止以前に行なった当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受付けたものとして、前ロ．に準じて計算されたものとします。

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

（注）主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東証株価指数に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式：

原則として金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

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

#### (4) 【計算期間】

毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が200万口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となったときまたは東証株価指数が廃止された場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
3. 委託会社は、前1.および前2.の各事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
4. 前3.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
5. 前4.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
6. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
7. 前4.から前6.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約する場合には適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前4.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合も同じとします。
8. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
9. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
10. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

前 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 1.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 4.または前 3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

#### 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。  
<http://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金にかかる請求権

##### <支払方法>

- イ. 受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）を持分に応じて請求する権利を有します。
  - ロ. 計算期間終了日において氏名もしくは名称および住所が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、受託会社は収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。この場合、名義登録受益者が当該計算期間終了日における振替制度移行後も受益証券を保有している所有者と異なる場合であっても、委託会社および受託会社は当該所有者に対して収益分配金の支払いおよびその他損害についてその責を負わないものとします。
- ハ. 受益者は、原則として前ロ.に規定する登録を当ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の取引参加者を經由して行なうものとします。この場合、当該取引参加者は、当該取引参加者が定め

る手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は前口．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、前八．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) 前八．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) 前八．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、前口．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．前口．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八．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、当該契約にしがた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、前口．の名義登録受益者にかかる収益分配金の未払い残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとします。

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

#### 信託終了時の交換等

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

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

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、「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間（平成21年7月11日から平成22年7月10日まで）及び第10期計算期間（平成22年7月11日から平成23年7月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

#### ダイワ上場投信 - トピックス

ダイワ上場投信 - トピックス  
(1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第9期<br>平成22年7月10日現在  | 第10期<br>平成23年7月10日現在 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| <b>資産の部</b>     |                      |                      |
| 流動資産            |                      |                      |
| コール・ローン         | 17,977,035,493       | 36,421,487,076       |
| 株式              | 3, 4 212,074,705,496 | 3, 4 242,543,435,766 |
| 派生商品評価勘定        | 3,251,288            | 33,571,790           |
| 未収入金            | 1,546,318,439        | 1,645,976,271        |
| 未収配当金           | 150,491,150          | 195,176,725          |
| 未収利息            | 54,596               | 188,154              |
| その他未収収益         | 5 8,681,230          | 5 11,098,563         |
| 差入委託証拠金         | 34,160,000           | -                    |
| 流動資産合計          | 231,794,697,692      | 280,850,934,345      |
| 資産合計            | 231,794,697,692      | 280,850,934,345      |
| <b>負債の部</b>     |                      |                      |
| 流動負債            |                      |                      |
| 前受金             | 24,372,000           | 226,315,000          |
| 未払金             | 1,772,118            | -                    |
| 未払収益分配金         | 3,312,387,696        | 4,219,308,126        |
| 未払受託者報酬         | 57,973,722           | 51,630,588           |
| 未払委託者報酬         | 101,419,785          | 98,099,465           |
| 未払利息            | 255,687              | 386,507              |
| 受入担保金           | 15,844,451,882       | 33,206,382,110       |
| その他未払費用         | 62,310,338           | 67,756,130           |
| 流動負債合計          | 19,404,943,228       | 37,869,877,926       |
| 負債合計            | 19,404,943,228       | 37,869,877,926       |
| <b>純資産の部</b>    |                      |                      |
| 元本等             |                      |                      |
| 元本              | 1 306,929,920,000    | 1 344,714,716,250    |
| 剰余金             |                      |                      |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2 94,540,165,536     | 2 101,733,659,831    |
| （分配準備積立金）       | 157,819,631          | 204,632,559          |
| 元本等合計           | 212,389,754,464      | 242,981,056,419      |
| 純資産合計           | 212,389,754,464      | 242,981,056,419      |
| 負債純資産合計         | 231,794,697,692      | 280,850,934,345      |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                         | 第9期                          |  | 第10期                         |  |
|-------------------------|------------------------------|--|------------------------------|--|
|                         | 自 平成21年7月11日<br>至 平成22年7月10日 |  | 自 平成22年7月11日<br>至 平成23年7月10日 |  |
| 営業収益                    |                              |  |                              |  |
| 受取配当金                   | 3,431,523,965                |  | 4,311,570,529                |  |
| 受取利息                    | 13,430,612                   |  | 17,767,345                   |  |
| 有価証券売買等損益               | 4,728,322,369                |  | 4,550,705,754                |  |
| 派生商品取引等損益               | 214,959,711                  |  | 242,214,191                  |  |
| その他収益                   | <sup>1</sup> 285,423,591     |  | <sup>1</sup> 308,071,815     |  |
| 営業収益合計                  | 1,212,903,912                |  | 9,430,329,634                |  |
| 営業費用                    |                              |  |                              |  |
| 支払利息                    | 7,899,049                    |  | 10,439,182                   |  |
| 受託者報酬                   | 116,535,570                  |  | 100,915,210                  |  |
| 委託者報酬                   | 199,697,467                  |  | 191,493,747                  |  |
| その他費用                   | <sup>2</sup> 64,343,612      |  | <sup>2</sup> 68,440,496      |  |
| 営業費用合計                  | 388,475,698                  |  | 371,288,635                  |  |
| 営業利益又は営業損失（ ）           | 1,601,379,610                |  | 9,059,040,999                |  |
| 経常利益又は経常損失（ ）           | 1,601,379,610                |  | 9,059,040,999                |  |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）         | 1,601,379,610                |  | 9,059,040,999                |  |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）         | 72,508,806,355               |  | 94,540,165,536               |  |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          | 4,162,522,206                |  | 11,298,695,558               |  |
| 当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 4,162,522,206                |  | 11,298,695,558               |  |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          | 21,280,114,081               |  | 23,331,922,726               |  |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 21,280,114,081               |  | 23,331,922,726               |  |
| 分配金                     | <sup>3</sup> 3,312,387,696   |  | <sup>3</sup> 4,219,308,126   |  |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）         | 94,540,165,536               |  | 101,733,659,831              |  |

## (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9期<br>自平成21年7月11日<br>至平成22年7月10日   | 第10期<br>自平成22年7月11日<br>至平成23年7月10日 |
|------------------------|---|------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | 株式<br><br>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。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 | 株式<br><br>同左                       |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br><br>同左                     |
| 3. 収益及び費用の計上基準         | 受取配当金<br>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<br>同左                        |

## (貸借対照表に関する注記)

| 区分                  | 第9期<br>平成22年7月10日現在  | 第10期<br>平成23年7月10日現在  |
|---------------------|--|---|
| 1. 1 期首元本額          | 242,118,953,750円   | 306,929,920,000円  |
| 期中追加設定元本額           | 82,196,000,000円  | 77,263,612,500円   |
| 期中一部交換元本額           | 17,385,033,750円  | 39,478,816,250円   |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 245,543,936口   | 275,771,773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94,540,165,536円であります。         | 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101,733,659,831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。<br>株式 15,410,341,461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。<br>株式 31,643,678,069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。<br>株式 62,400,000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。<br>株式 435,410,000円 |

|              |  |  |
|--------------|--|--|
| 6. 5 その他未収収益 | 貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分6,806,075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8,802,850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9期<br>自平成21年7月11日<br>至平成22年7月10日  | 第10期<br>自平成22年7月11日<br>至平成23年7月10日   |
|---------------|--|--|
| 1. 1 その他収益    | 主に、貸付有価証券に係る品貸料および配当金相当額であります。なお、貸付有価証券に係る配当金相当額118,393,853円が含まれております。   | 主に、貸付有価証券に係る品貸料および配当金相当額であります。なお、貸付有価証券に係る配当相当額227,197,840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。   |  |
| 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(3,722,479,119円)及び分配準備積立金(128,304,857円)の合計額から、経費(380,576,649円)を控除して計算される分配対象額は3,470,207,327円(10口当たり141.3円)であり、うち3,312,387,696円(10口当たり134.9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(4,626,970,507円)及び分配準備積立金(157,819,631円)の合計額から、経費(360,849,453円)を控除して計算される分配対象額は4,423,940,685円(10口当たり160.4円)であり、うち4,219,308,126円(10口当たり153.0円)を分配金額としております。 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 第9期<br>自平成21年7月11日<br>至平成22年7月10日  | 第10期<br>自平成22年7月11日<br>至平成23年7月10日 |
|-----------------|--|------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 | 同左                                 |

|                            |   |   |
|----------------------------|---|---|
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p>  | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | <p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>   | 同左  |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p> | 同左  |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                       | 第9期<br>平成22年7月10日現在  | 第10期<br>平成23年7月10日現在   |
|--------------------------|--|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | <p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>   | 同左   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コールローン等の金銭債権及び金銭債務</p> | <p>(1)有価証券<br/>同左</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>同左</p> <p>(3)コールローン等の金銭債権及び金銭債務</p> |

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

## （追加情報）

|   |   |
|---|---|
| <b>第9期</b><br>自 平成21年7月11日<br>至 平成22年7月10日  | <b>第10期</b><br>自 平成22年7月11日<br>至 平成23年7月10日 |
| 第9期計算期間（平成21年7月11日から平成22年7月10日まで）より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。 |   |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類 | 第9期<br>平成22年7月10日現在          | 第10期<br>平成23年7月10日現在         |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 当計算期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） | 当計算期間の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） |
| 株式  | 5,399,189,669                | 4,479,566,384                |
| 合計  | 5,399,189,669                | 4,479,566,384                |

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

| 種 類          | 第9期<br>平成22年7月10日 現在 |           |             |             | 第10期<br>平成23年7月10日 現在 |           |             |             |
|--------------|----------------------|-----------|-------------|-------------|-----------------------|-----------|-------------|-------------|
|              | 契約額等<br>（円）          | うち<br>1年超 | 時価<br>（円）   | 評価損益<br>（円） | 契約額等<br>（円）           | うち<br>1年超 | 時価<br>（円）   | 評価損益<br>（円） |
|              |                      |           |             |             |                       |           |             |             |
| 株価指数<br>先物取引 |                      |           |             |             |                       |           |             |             |
| 買 建          | 297,885,000          | -         | 301,175,000 | 3,290,000   | 395,626,000           | -         | 429,240,000 | 33,614,000  |
| 合計           | 297,885,000          | -         | 301,175,000 | 3,290,000   | 395,626,000           | -         | 429,240,000 | 33,614,000  |

## （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）

|  |   |
|--|---|
| <b>第9期</b><br>自 平成21年7月11日<br>至 平成22年7月10日 | <b>第10期</b><br>自 平成22年7月11日<br>至 平成23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9期<br>平成22年7月10日現在 | 第10期<br>平成23年7月10日現在 |
|---------------------------|---------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(10口当たり純資産額) | 865.0円<br>(8,650円)  | 881.1円<br>(8,811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             | 91,000    | 184     | 16,744,000    | 貸付株式数 35,000株              |
| 日本水産           | 266,700   | 269     | 71,742,300    | 貸付株式数 11,600株              |
| マルハニチロホールディングス | 457,000   | 129     | 58,953,000    | 貸付株式数 2,000株               |
| ハウスイ           | 16,000    | 97      | 1,552,000     | 貸付株式数 1,000株               |
| サカタのタネ         | 34,200    | 1,193   | 40,800,600    | 貸付株式数 100株                 |
| ホクト            | 23,500    | 1,787   | 41,994,500    | 貸付株式数 900株                 |
| ショーボンドHD       | 20,500    | 1,900   | 38,950,000    |                            |
| ミライト・ホールディングス  | 60,200    | 613     | 36,902,600    | 貸付株式数 8,200株               |
| 住石ホールディングス     | 64,200    | 112     | 7,190,400     | 貸付株式数 21,500株              |
| 日鉄鉱業           | 56,000    | 368     | 20,608,000    | 貸付株式数 1,000株               |
| 三井松島           | 133,000   | 172     | 22,876,000    | 貸付株式数 13,000株              |
| 国際石油開発帝石       | 2,344     | 612,000 | 1,434,528,000 | 貸付株式数 415株                 |
| 日本海洋掘削         | 5,500     | 2,951   | 16,230,500    | 貸付株式数 3,000株<br>(2,100株)   |
| 関東天然瓦斯         | 23,000    | 473     | 10,879,000    |                            |
| 石油資源開発         | 36,700    | 3,970   | 145,699,000   | 貸付株式数 5,000株               |
| ダイセキ環境ソリューション  | 19        | 203,500 | 3,866,500     | 貸付株式数 7株                   |
| 間組             | 89,800    | 111     | 9,967,800     |                            |
| 東急建設           | 82,160    | 215     | 17,664,400    | 貸付株式数 27,240株              |
| コムシスホールディングス   | 112,300   | 812     | 91,187,600    | 貸付株式数 14,700株              |
| ミサワホーム         | 27,300    | 507     | 13,841,100    | 貸付株式数 2,300株               |
| 高松コンストラクションGP  | 17,300    | 1,182   | 20,448,600    | 貸付株式数 400株                 |
| 東建コーポレーション     | 8,640     | 3,060   | 26,438,400    | 貸付株式数 1,340株               |
| ヤマウラ           | 9,500     | 206     | 1,957,000     |                            |
| 大成建設           | 1,097,000 | 189     | 207,333,000   | 貸付株式数 19,000株              |
| 大林組            | 694,000   | 358     | 248,452,000   |                            |
| 清水建設           | 657,000   | 343     | 225,351,000   | 貸付株式数 119,000株             |
| 飛島建設           | 669,000   | 30      | 20,070,000    |                            |
| 長谷工コーポレーション    | 1,446,500 | 62      | 89,683,000    |                            |
| 松井建設           | 25,000    | 311     | 7,775,000     |                            |
| 鹿島建設           | 1,017,000 | 245     | 249,165,000   | 貸付株式数 318,000株             |
| 不動テトラ          | 163,400   | 170     | 27,778,000    | 貸付株式数 96,200株<br>(43,700株) |
| 大末建設           | 82,000    | 65      | 5,330,000     | 貸付株式数 25,000株              |
| 鉄建建設           | 141,000   | 117     | 16,497,000    |                            |
| 安藤建設           | 77,000    | 108     | 8,316,000     | 貸付株式数 20,000株              |
| 太平工業           | 44,000    | 341     | 15,004,000    | 貸付株式数 8,000株               |
| 西松建設           | 303,000   | 123     | 37,269,000    | 貸付株式数 43,000株              |
| 三井住友建設         | 127,300   | 70      | 8,911,000     | 貸付株式数 23,300株              |

|           |         |       |             |       |                       |
|-----------|---------|-------|-------------|-------|-----------------------|
| 大豊建設      | 69,000  | 112   | 7,728,000   | 貸付株式数 | 23,000株               |
| 前田建設      | 142,000 | 255   | 36,210,000  | 貸付株式数 | 3,000株                |
| 佐田建設      | 80,000  | 82    | 6,560,000   | 貸付株式数 | 45,000株               |
| ナカノフドー建設  | 16,500  | 182   | 3,003,000   | 貸付株式数 | 6,000株                |
| 奥村組       | 220,000 | 290   | 63,800,000  | 貸付株式数 | 6,000株                |
| 大和小田急建設   | 11,000  | 226   | 2,486,000   |       |                       |
| 東鉄工業      | 29,000  | 751   | 21,779,000  |       |                       |
| イチケン      | 25,000  | 107   | 2,675,000   |       |                       |
| 浅沼組       | 74,000  | 87    | 6,438,000   | 貸付株式数 | 10,000株               |
| 戸田建設      | 248,000 | 296   | 73,408,000  | 貸付株式数 | 4,000株                |
| 熊谷組       | 173,000 | 82    | 14,186,000  |       |                       |
| 青木あすなろ建設  | 15,000  | 420   | 6,300,000   |       |                       |
| 北野建設      | 49,000  | 198   | 9,702,000   | 貸付株式数 | 9,000株                |
| 植木組       | 27,000  | 172   | 4,644,000   | 貸付株式数 | 10,000株               |
| 三井ホーム     | 25,000  | 432   | 10,800,000  |       |                       |
| 矢作建設      | 28,600  | 424   | 12,126,400  |       |                       |
| ピーエス三菱    | 14,600  | 321   | 4,686,600   | 貸付株式数 | 4,700株                |
| 大東建託      | 90,400  | 7,220 | 652,688,000 | 貸付株式数 | 10,500株               |
| 新日本建設     | 27,500  | 245   | 6,737,500   | 貸付株式数 | 9,200株                |
| NIPPO     | 52,000  | 660   | 34,320,000  | 貸付株式数 | 9,000株                |
| 東亜道路      | 43,000  | 176   | 7,568,000   | 貸付株式数 | 2,000株                |
| 前田道路      | 63,000  | 796   | 50,148,000  | 貸付株式数 | 12,000株               |
| 日本道路      | 69,000  | 241   | 16,629,000  |       |                       |
| 東亜建設      | 186,000 | 149   | 27,714,000  |       |                       |
| 若築建設      | 125,000 | 106   | 13,250,000  | 貸付株式数 | 55,000株               |
| 東洋建設      | 310,000 | 86    | 26,660,000  | 貸付株式数 | 125,000株<br>(10,000株) |
| 五洋建設      | 288,000 | 197   | 56,736,000  | 貸付株式数 | 169,500株              |
| 大林道路      | 26,000  | 199   | 5,174,000   |       |                       |
| 世紀東急      | 55,000  | 68    | 3,740,000   | 貸付株式数 | 30,000株               |
| 福田組       | 30,000  | 265   | 7,950,000   | 貸付株式数 | 11,000株               |
| 住友林業      | 159,300 | 740   | 117,882,000 | 貸付株式数 | 2,000株                |
| 日本基礎技術    | 29,700  | 329   | 9,771,300   | 貸付株式数 | 15,400株               |
| 日成ビルド工業   | 68,000  | 152   | 10,336,000  | 貸付株式数 | 36,000株               |
| エス・パイ・エル  | 108,000 | 67    | 7,236,000   | 貸付株式数 | 34,000株               |
| 巴コーポレーション | 31,300  | 314   | 9,828,200   | 貸付株式数 | 10,400株               |
| パナホーム     | 76,000  | 540   | 41,040,000  |       |                       |
| 大和ハウス     | 577,000 | 1,037 | 598,349,000 | 貸付株式数 | 40,000株               |
| ライト工業     | 48,200  | 302   | 14,556,400  |       |                       |
| 積水ハウス     | 695,000 | 756   | 525,420,000 | 貸付株式数 | 14,000株               |
| 日特建設      | 58,000  | 122   | 7,076,000   | 貸付株式数 | 22,000株               |
| 北陸電気工事    | 11,000  | 239   | 2,629,000   |       |                       |
| ユアテック     | 34,000  | 406   | 13,804,000  |       |                       |
| 西部電気工業    | 19,000  | 345   | 6,555,000   |       |                       |
| 四電工       | 19,000  | 357   | 6,783,000   |       |                       |
| 中電工       | 33,300  | 917   | 30,536,100  |       |                       |
| 関電工       | 105,000 | 390   | 40,950,000  | 貸付株式数 | 18,000株               |
| きんでん      | 154,000 | 694   | 106,876,000 | 貸付株式数 | 2,000株                |
| 東京エネシス    | 25,000  | 440   | 11,000,000  | 貸付株式数 | 1,000株                |
| トーエネック    | 31,000  | 465   | 14,415,000  |       |                       |
| 住友電設      | 16,000  | 450   | 7,200,000   | 貸付株式数 | 900株                  |
| 日本電設工業    | 41,000  | 846   | 34,686,000  | 貸付株式数 | 2,000株                |
| 協和エクシオ    | 83,100  | 792   | 65,815,200  | 貸付株式数 | 12,100株               |
| 新日本空調     | 16,200  | 430   | 6,966,000   |       |                       |
| 日本工営      | 72,000  | 278   | 20,016,000  |       |                       |

|               |         |         |             |       |                     |
|---------------|---------|---------|-------------|-------|---------------------|
| 日本電話施設        | 33,000  | 241     | 7,953,000   |       |                     |
| 九電工           | 42,000  | 529     | 22,218,000  | 貸付株式数 | 8,000株              |
| 三機工業          | 51,000  | 461     | 23,511,000  |       |                     |
| 日 揮           | 233,000 | 2,310   | 538,230,000 | 貸付株式数 | 42,000株             |
| 中外炉工業         | 74,000  | 279     | 20,646,000  | 貸付株式数 | 9,000株              |
| ヤマト           | 22,000  | 324     | 7,128,000   |       |                     |
| 太平電業          | 29,000  | 604     | 17,516,000  |       |                     |
| 高砂熱学          | 66,000  | 645     | 42,570,000  | 貸付株式数 | 200株<br>(200株)      |
| 三晃金属          | 25,000  | 391     | 9,775,000   | 貸付株式数 | 10,000株             |
| NEC ネットエスアイ   | 19,000  | 1,127   | 21,413,000  | 貸付株式数 | 2,900株              |
| 朝日工業社         | 25,000  | 369     | 9,225,000   |       |                     |
| アタカ大機         | 16,000  | 290     | 4,640,000   | 貸付株式数 | 5,000株              |
| 大 気 社         | 35,400  | 1,585   | 56,109,000  | 貸付株式数 | 100株                |
| ダイダン          | 29,000  | 515     | 14,935,000  | 貸付株式数 | 1,000株              |
| 日比谷総合設        | 30,500  | 807     | 24,613,500  |       |                     |
| 東芝プラントシステム    | 35,000  | 964     | 33,740,000  | 貸付株式数 | 19,000株             |
| 日本製粉          | 134,000 | 375     | 50,250,000  |       |                     |
| 日清製粉G本社       | 209,500 | 1,009   | 211,385,500 | 貸付株式数 | 6,500株              |
| 日東富士製粉        | 18,000  | 284     | 5,112,000   |       |                     |
| 昭和産業          | 87,000  | 232     | 20,184,000  | 貸付株式数 | 2,000株              |
| 鳥越製粉          | 19,800  | 696     | 13,780,800  | 貸付株式数 | 6,600株              |
| 協同飼料          | 80,000  | 92      | 7,360,000   |       |                     |
| 中部飼料          | 20,400  | 553     | 11,281,200  |       |                     |
| 日本配合飼料        | 71,000  | 100     | 7,100,000   |       |                     |
| 東洋精糖          | 33,000  | 101     | 3,333,000   |       |                     |
| 日本甜菜糖         | 128,000 | 182     | 23,296,000  |       |                     |
| 三井製糖          | 91,000  | 338     | 30,758,000  |       |                     |
| ネクスト          | 58      | 52,700  | 3,056,600   | 貸付株式数 | 19株                 |
| 日本M&Aセンター     | 46      | 411,000 | 18,906,000  | 貸付株式数 | 17株                 |
| ノバレーゼ         | 33      | 59,600  | 1,966,800   |       |                     |
| アコーディア・ゴルフ    | 608     | 58,800  | 35,750,400  |       |                     |
| パソナグループ       | 214     | 73,600  | 15,750,400  |       |                     |
| リンクアンドモチベーション | 42      | 47,500  | 1,995,000   |       |                     |
| テンプホールディングス   | 29,400  | 738     | 21,697,200  | 貸付株式数 | 11,100株<br>(7,400株) |
| 森永製菓          | 226,000 | 192     | 43,392,000  |       |                     |
| 中 村 屋         | 52,000  | 412     | 21,424,000  | 貸付株式数 | 4,000株              |
| 江崎グリコ         | 84,000  | 887     | 74,508,000  |       |                     |
| 名糖産業          | 10,200  | 1,037   | 10,577,400  | 貸付株式数 | 3,400株              |
| 不 二 家         | 132,000 | 148     | 19,536,000  | 貸付株式数 | 48,000株             |
| 山崎製パン         | 168,000 | 1,076   | 180,768,000 | 貸付株式数 | 11,000株             |
| 第一屋製パン        | 30,000  | 91      | 2,730,000   | 貸付株式数 | 10,000株             |
| モロゾフ          | 33,000  | 273     | 9,009,000   |       |                     |
| カルビー          | 13,800  | 3,020   | 41,676,000  | 貸付株式数 | 7,600株              |
| 森永乳業          | 193,000 | 352     | 67,936,000  | 貸付株式数 | 73,000株             |
| ヤクルト          | 124,100 | 2,354   | 292,131,400 | 貸付株式数 | 47,100株             |
| 明治ホールディングス    | 68,500  | 3,450   | 236,325,000 | 貸付株式数 | 9,900株              |
| 雪印メグミルク       | 45,400  | 1,538   | 69,825,200  | 貸付株式数 | 8,900株              |
| プリマハム         | 130,000 | 100     | 13,000,000  |       |                     |
| 日本ハム          | 161,000 | 1,156   | 186,116,000 | 貸付株式数 | 32,000株             |
| 伊藤ハム          | 127,000 | 318     | 40,386,000  | 貸付株式数 | 28,000株             |
| 林兼産業          | 74,000  | 83      | 6,142,000   | 貸付株式数 | 24,000株             |
| 丸大食品          | 102,000 | 255     | 26,010,000  |       |                     |
| 米 久           | 18,500  | 618     | 11,433,000  |       |                     |

|                |         |         |               |                            |
|----------------|---------|---------|---------------|----------------------------|
| S Foods        | 14,000  | 699     | 9,786,000     |                            |
| 学情             | 7,000   | 275     | 1,925,000     |                            |
| スタジオアリス        | 9,000   | 1,207   | 10,863,000    |                            |
| シミック           | 7,000   | 1,392   | 9,744,000     | 貸付株式数 2,300株               |
| システナ           | 203     | 72,600  | 14,737,800    | 貸付株式数 66株                  |
| NECフィールドディング   | 17,300  | 1,013   | 17,524,900    |                            |
| 新日鉄ソリューションズ    | 16,900  | 1,658   | 28,020,200    | 貸付株式数 3,300株               |
| 総合警備保障         | 78,500  | 930     | 73,005,000    |                            |
| 日本駐車場開発        | 2,209   | 4,495   | 9,929,455     | 貸付株式数 723株                 |
| コア             | 7,600   | 644     | 4,894,400     |                            |
| カカクコム          | 148     | 545,000 | 80,660,000    | 貸付株式数 78株                  |
| アイロムホールディングス   | 480     | 3,790   | 1,819,200     |                            |
| ルネサンス          | 9,600   | 367     | 3,523,200     |                            |
| 新日本科学          | 13,200  | 270     | 3,564,000     | 貸付株式数 5,100株<br>(1,200株)   |
| エムスリー          | 84      | 587,000 | 49,308,000    | 貸付株式数 44株                  |
| ベストプライダル       | 22      | 68,800  | 1,513,600     |                            |
| ディー・エヌ・エー      | 84,200  | 3,785   | 318,697,000   | 貸付株式数 46,600株              |
| 博報堂DYHLDGS     | 29,900  | 4,520   | 135,148,000   | 貸付株式数 330株                 |
| ぐるなび           | 11,800  | 840     | 9,912,000     | 貸付株式数 5,600株<br>(2,600株)   |
| 一休             | 153     | 38,550  | 5,898,150     | 貸付株式数 25株                  |
| ジャパンベストレスキューS  | 29      | 75,400  | 2,186,600     | 貸付株式数 1株                   |
| ジェイコムホールディングス  | 3,700   | 948     | 3,507,600     |                            |
| PGMホールディングス    | 456     | 43,700  | 19,927,200    | 貸付株式数 163株                 |
| サッポロホールディングス   | 327,000 | 333     | 108,891,000   | 貸付株式数 120,000株             |
| アサヒグループホールディング | 434,200 | 1,632   | 708,614,400   | 貸付株式数 1,200株               |
| キリンHD          | 928,000 | 1,138   | 1,056,064,000 |                            |
| 宝ホールディングス      | 193,000 | 427     | 82,411,000    |                            |
| オエノンホールディングス   | 59,000  | 187     | 11,033,000    |                            |
| 養命酒            | 17,000  | 747     | 12,699,000    |                            |
| 三国コカ・コ・ラ       | 24,000  | 709     | 17,016,000    |                            |
| コカ・コーラウエスト     | 71,400  | 1,568   | 111,955,200   |                            |
| コカコーラセントラルジャパン | 26,000  | 1,098   | 28,548,000    |                            |
| ダイドードリンコ       | 9,600   | 3,050   | 29,280,000    | 貸付株式数 300株                 |
| 伊藤園            | 70,200  | 1,444   | 101,368,800   | 貸付株式数 11,500株              |
| キーコーヒー         | 19,900  | 1,512   | 30,088,800    | 貸付株式数 7,000株               |
| ユニカフェ          | 5,100   | 364     | 1,856,400     |                            |
| ジャパンフーズ        | 2,800   | 808     | 2,262,400     |                            |
| 日清オイリオグループ     | 100,000 | 384     | 38,400,000    | 貸付株式数 3,000株               |
| 不二製油           | 56,200  | 1,228   | 69,013,600    | 貸付株式数 31,000株<br>(20,000株) |
| J-オイルミルズ       | 86,000  | 238     | 20,468,000    |                            |
| ローソン           | 70,800  | 4,190   | 296,652,000   | 貸付株式数 27,400株              |
| インターニックス       | 8,300   | 398     | 3,303,400     | 貸付株式数 1,400株               |
| サンエー           | 6,900   | 3,180   | 21,942,000    |                            |
| キリン堂           | 8,700   | 461     | 4,010,700     |                            |
| ダイユーエイト        | 2,700   | 543     | 1,466,100     |                            |
| カワチ薬品          | 14,200  | 1,616   | 22,947,200    | 貸付株式数 400株                 |
| エービーシー・マート     | 24,100  | 3,215   | 77,481,500    | 貸付株式数 5,900株               |
| ハードオフコーポレーション  | 9,800   | 412     | 4,037,600     |                            |
| 高千穂交易          | 8,500   | 861     | 7,318,500     |                            |
| アスクル           | 16,000  | 1,229   | 19,664,000    | 貸付株式数 8,800株<br>(1,800株)   |
| ゲオ             | 338     | 100,200 | 33,867,600    | 貸付株式数 133株                 |

|                |           |         |               |       |                      |
|----------------|-----------|---------|---------------|-------|----------------------|
| ポイント           | 17,210    | 3,460   | 59,546,600    | 貸付株式数 | 850株                 |
| シー・ヴィ・エス・ペイエリア | 12,000    | 103     | 1,236,000     |       |                      |
| 伊藤忠食品          | 4,900     | 2,880   | 14,112,000    |       |                      |
| くらコーポレーション     | 10,600    | 1,055   | 11,183,000    |       |                      |
| キャンドウ          | 88        | 75,400  | 6,635,200     | 貸付株式数 | 32株                  |
| エレマテック         | 16,200    | 1,157   | 18,743,400    |       |                      |
| パル             | 5,950     | 2,658   | 15,815,100    | 貸付株式数 | 1,000株               |
| JALUX          | 5,500     | 769     | 4,229,500     |       |                      |
| エディオン          | 74,500    | 778     | 57,961,000    | 貸付株式数 | 39,200株              |
| サーラコーポレーション    | 17,500    | 405     | 7,087,500     |       |                      |
| トーメンデバイス       | 2,500     | 1,978   | 4,945,000     |       |                      |
| バルス            | 95        | 73,100  | 6,944,500     | 貸付株式数 | 3株                   |
| あみやき亭          | 33        | 227,000 | 7,491,000     |       |                      |
| 東京エレクトロンデバイス   | 39        | 158,200 | 6,169,800     | 貸付株式数 | 8株                   |
| ひらまつ           | 38        | 118,900 | 4,518,200     | 貸付株式数 | 21株                  |
| 双日             | 1,364,400 | 157     | 214,210,800   | 貸付株式数 | 11,700株              |
| アルフレッサホールディングス | 53,300    | 3,190   | 170,027,000   | 貸付株式数 | 5,100株               |
| ハニーズ           | 17,890    | 909     | 16,262,010    | 貸付株式数 | 6,180株               |
| キッコーマン         | 188,000   | 867     | 162,996,000   | 貸付株式数 | 34,000株              |
| 味の素            | 629,000   | 990     | 622,710,000   | 貸付株式数 | 94,000株              |
| キュービー          | 119,600   | 1,047   | 125,221,200   | 貸付株式数 | 23,300株              |
| ハウス食品          | 82,200    | 1,378   | 113,271,600   | 貸付株式数 | 2,800株               |
| カゴメ            | 83,000    | 1,472   | 122,176,000   |       |                      |
| 焼津水産化工         | 10,800    | 759     | 8,197,200     | 貸付株式数 | 1,000株               |
| アリアケジャパン       | 18,800    | 1,644   | 30,907,200    |       |                      |
| ニチレイ           | 259,000   | 354     | 91,686,000    | 貸付株式数 | 11,000株              |
| 横浜冷凍           | 44,000    | 553     | 24,332,000    |       |                      |
| 東洋水産           | 100,000   | 1,887   | 188,700,000   | 貸付株式数 | 23,000株              |
| 日清食品HD         | 82,900    | 2,945   | 244,140,500   | 貸付株式数 | 34,400株              |
| 永谷園            | 20,000    | 831     | 16,620,000    |       |                      |
| フジッコ           | 24,000    | 976     | 23,424,000    |       |                      |
| ロックフィールド       | 11,200    | 1,289   | 14,436,800    |       |                      |
| 日本たばこ産業        | 4,810     | 324,000 | 1,558,440,000 | 貸付株式数 | 181株                 |
| わらべや日洋         | 12,800    | 940     | 12,032,000    |       |                      |
| なとり            | 10,600    | 823     | 8,723,800     |       |                      |
| 片倉工業           | 25,000    | 867     | 21,675,000    |       |                      |
| グンゼ            | 147,000   | 286     | 42,042,000    | 貸付株式数 | 1,000株               |
| 昭栄             | 37,100    | 719     | 26,674,900    | 貸付株式数 | 14,700株              |
| 神栄             | 25,000    | 143     | 3,575,000     |       |                      |
| 川島織物セルコン       | 78,000    | 71      | 5,538,000     | 貸付株式数 | 25,000株              |
| 山下医科器械         | 1,600     | 1,041   | 1,665,600     |       |                      |
| ラサ商事           | 8,700     | 362     | 3,149,400     |       |                      |
| アルペン           | 13,000    | 1,355   | 17,615,000    | 貸付株式数 | 5,300株               |
| アルコニックス        | 3,300     | 2,235   | 7,375,500     | 貸付株式数 | 1,200株               |
| ビックカメラ         | 529       | 44,500  | 23,540,500    | 貸付株式数 | 181株                 |
| DCMホールディングス    | 95,900    | 605     | 58,019,500    | 貸付株式数 | 35,400株<br>(11,500株) |
| MonotaRO       | 3,600     | 1,422   | 5,119,200     | 貸付株式数 | 800株<br>(800株)       |
| あいホールディングス     | 36,300    | 333     | 12,087,900    |       |                      |
| ユニバース          | 3,400     | 1,500   | 5,100,000     |       |                      |
| J. フロント リテイリング | 481,000   | 371     | 178,451,000   | 貸付株式数 | 95,000株              |
| ドトール・日レスHD     | 35,700    | 1,025   | 36,592,500    | 貸付株式数 | 4,700株               |
| マツモトキヨシHLDGS   | 37,800    | 1,708   | 64,562,400    | 貸付株式数 | 21,400株              |
| ココカラファイン       | 19,400    | 2,055   | 39,867,000    |       |                      |

|                   |           |         |               |       |                    |
|-------------------|-----------|---------|---------------|-------|--------------------|
| 三越伊勢丹H D          | 405,000   | 808     | 327,240,000   | 貸付株式数 | 111,600株           |
| 東洋紡績              | 792,000   | 120     | 95,040,000    |       |                    |
| ユニチカ              | 493,000   | 60      | 29,580,000    |       |                    |
| 富士紡ホールディングス       | 97,000    | 199     | 19,303,000    | 貸付株式数 | 52,000株            |
| 日清紡ホールディングス       | 138,000   | 797     | 109,986,000   | 貸付株式数 | 2,000株             |
| 倉敷紡績              | 206,000   | 161     | 33,166,000    |       |                    |
| ダイワボウH D          | 199,400   | 172     | 34,296,800    | 貸付株式数 | 70,000株            |
| シキボウ              | 132,000   | 92      | 12,144,000    |       |                    |
| 日東紡績              | 173,000   | 200     | 34,600,000    |       |                    |
| トヨタ紡織             | 72,200    | 1,366   | 98,625,200    | 貸付株式数 | 12,300株            |
| クリエイトS D H        | 8,600     | 1,792   | 15,411,200    | 貸付株式数 | 300株               |
| バイタルK S K H D     | 38,300    | 660     | 25,278,000    |       |                    |
| U K Cホールディングス     | 12,100    | 886     | 10,720,600    |       |                    |
| 丸善C H I H D       | 11,600    | 237     | 2,749,200     | 貸付株式数 | 4,700株             |
| T O K A Iホールディングス | 55,600    | 401     | 22,295,600    | 貸付株式数 | 22,100株            |
| 日本毛織              | 74,000    | 658     | 48,692,000    |       |                    |
| 大東紡織              | 31,000    | 73      | 2,263,000     | 貸付株式数 | 5,000株             |
| トーア紡コーポレーション      | 78,000    | 63      | 4,914,000     | 貸付株式数 | 24,000株            |
| ダイドーリミテッド         | 26,600    | 822     | 21,865,200    |       |                    |
| 東京建物不動産販          | 5,100     | 269     | 1,371,900     |       |                    |
| 野村不動産H L D G S    | 85,500    | 1,380   | 117,990,000   | 貸付株式数 | 19,200株            |
| 常和ホールディングス        | 3,300     | 1,311   | 4,326,300     |       |                    |
| ヒューリック            | 57,900    | 744     | 43,077,600    | 貸付株式数 | 7,800株             |
| 帝国繊維              | 22,000    | 512     | 11,264,000    |       |                    |
| ブックオフコーポレーション     | 12,500    | 731     | 9,137,500     |       |                    |
| 日本コークス工業          | 174,500   | 144     | 25,128,000    | 貸付株式数 | 3,000株             |
| ミタチ産業             | 4,600     | 416     | 1,913,600     |       |                    |
| J F E 商事H L D G S | 137,000   | 411     | 56,307,000    | 貸付株式数 | 13,000株            |
| あさひ               | 8,400     | 1,465   | 12,306,000    | 貸付株式数 | 4,300株<br>(3,200株) |
| サークルKサンクス         | 44,200    | 1,297   | 57,327,400    |       |                    |
| 日本調剤              | 2,570     | 2,844   | 7,309,080     |       |                    |
| コスモス薬品            | 10,300    | 3,500   | 36,050,000    | 貸付株式数 | 1,200株             |
| シップヘルスケアH D       | 26,500    | 1,559   | 41,313,500    | 貸付株式数 | 4,700株             |
| ソフトクリエイト          | 1,700     | 1,166   | 1,982,200     |       |                    |
| セブン&アイ・H L D G S  | 852,700   | 2,247   | 1,916,016,900 | 貸付株式数 | 121,000株           |
| ツルハホールディングス       | 18,200    | 3,925   | 71,435,000    | 貸付株式数 | 2,000株             |
| サンマルクホールディングス     | 6,200     | 3,145   | 19,499,000    |       |                    |
| フェリシモ             | 5,500     | 1,074   | 5,907,000     |       |                    |
| トリドール             | 75        | 115,300 | 8,647,500     | 貸付株式数 | 22株                |
| クスリのアオキ           | 2,800     | 1,126   | 3,152,800     | 貸付株式数 | 700株               |
| 帝人                | 821,000   | 360     | 295,560,000   | 貸付株式数 | 111,000株           |
| 東レ                | 1,674,000 | 615     | 1,029,510,000 | 貸付株式数 | 265,000株           |
| クラレ               | 319,200   | 1,219   | 389,104,800   | 貸付株式数 | 16,000株            |
| 旭化成               | 1,259,000 | 550     | 692,450,000   | 貸付株式数 | 24,000株            |
| サカイオーベックス         | 58,000    | 133     | 7,714,000     | 貸付株式数 | 20,000株            |
| 稲葉製作所             | 10,300    | 997     | 10,269,100    |       |                    |
| 宮地エンジニアリングG       | 63,000    | 101     | 6,363,000     | 貸付株式数 | 24,000株            |
| 三協・立山H L D G S    | 291,000   | 117     | 34,047,000    |       |                    |
| トーカロ              | 11,100    | 2,085   | 23,143,500    | 貸付株式数 | 2,200株             |
| アルファCO            | 6,200     | 962     | 5,964,400     |       |                    |
| SUMCO             | 132,200   | 1,407   | 186,005,400   | 貸付株式数 | 69,600株            |
| 川田テクノロジーズ         | 4,700     | 1,373   | 6,453,100     |       |                    |
| 住江織物              | 56,000    | 165     | 9,240,000     | 貸付株式数 | 21,000株            |
| 日本フェルト            | 12,000    | 385     | 4,620,000     |       |                    |

|                 |           |         |             |       |                     |
|-----------------|-----------|---------|-------------|-------|---------------------|
| イチカワ            | 14,000    | 166     | 2,324,000   |       |                     |
| 日本バイリン          | 23,000    | 358     | 8,234,000   |       |                     |
| エコナックホールディングス   | 61,000    | 34      | 2,074,000   |       |                     |
| 日東製網            | 26,000    | 112     | 2,912,000   | 貸付株式数 | 4,000株              |
| 芦森工業            | 49,000    | 115     | 5,635,000   |       |                     |
| アツギ             | 169,000   | 102     | 17,238,000  |       |                     |
| ダイニック           | 39,000    | 141     | 5,499,000   |       |                     |
| 共和レザー           | 12,600    | 290     | 3,654,000   |       |                     |
| セーレン            | 53,900    | 531     | 28,620,900  |       |                     |
| 東海染工            | 29,000    | 90      | 2,610,000   | 貸付株式数 | 9,000株              |
| 小松精練            | 34,000    | 368     | 12,512,000  |       |                     |
| ワコールホールディングス    | 129,000   | 1,015   | 130,935,000 | 貸付株式数 | 52,000株             |
| ホギメディカル         | 11,500    | 3,605   | 41,457,500  | 貸付株式数 | 1,400株              |
| レナウン            | 41,500    | 157     | 6,515,500   | 貸付株式数 | 14,600株             |
| クラウドシア          | 2,100     | 1,200   | 2,520,000   |       |                     |
| T S Iホールディングス   | 89,100    | 552     | 49,183,200  | 貸付株式数 | 2,100株              |
| デジタルハーツ         | 13        | 126,700 | 1,647,100   |       |                     |
| I Tホールディングス     | 67,600    | 780     | 52,728,000  | 貸付株式数 | 8,400株              |
| グリー             | 68,500    | 1,833   | 125,560,500 | 貸付株式数 | 22,800株<br>(3,200株) |
| コーエーテクモHD       | 40,300    | 684     | 27,565,200  | 貸付株式数 | 1,000株              |
| 三菱総合研究所         | 7,900     | 1,497   | 11,826,300  |       |                     |
| 特種東海製紙          | 136,000   | 174     | 23,664,000  |       |                     |
| ドワンゴ            | 102       | 188,200 | 19,196,400  | 貸付株式数 | 37株<br>(14株)        |
| ベリサーブ           | 10        | 145,100 | 1,451,000   |       |                     |
| マクロミル           | 24,900    | 880     | 21,912,000  | 貸付株式数 | 10,000株             |
| ティーガイア          | 164       | 148,600 | 24,370,400  | 貸付株式数 | 54株                 |
| GMOペイメントゲートウェイ  | 43        | 277,100 | 11,915,300  | 貸付株式数 | 5株                  |
| ザッパラス           | 112       | 103,000 | 11,536,000  | 貸付株式数 | 22株                 |
| インターネットイニシアティブ  | 119       | 314,000 | 37,366,000  | 貸付株式数 | 47株                 |
| ソネットエンタテインメント   | 115       | 343,000 | 39,445,000  | 貸付株式数 | 60株                 |
| S R Aホールディングス   | 10,800    | 808     | 8,726,400   |       |                     |
| J B I Sホールディングス | 21,000    | 281     | 5,901,000   |       |                     |
| 朝日ネット           | 17,000    | 337     | 5,729,000   |       |                     |
| 王子製紙            | 956,000   | 411     | 392,916,000 | 貸付株式数 | 45,000株             |
| 三菱製紙            | 307,000   | 88      | 27,016,000  |       |                     |
| 北越紀州製紙          | 134,000   | 521     | 69,814,000  | 貸付株式数 | 35,000株             |
| 中越パルプ           | 82,000    | 140     | 11,480,000  |       |                     |
| 巴川製紙            | 35,000    | 202     | 7,070,000   | 貸付株式数 | 3,000株              |
| 大王製紙            | 91,000    | 670     | 60,970,000  |       |                     |
| 日本製紙G本社         | 104,400   | 1,919   | 200,343,600 | 貸付株式数 | 17,600株             |
| レンゴー            | 172,000   | 545     | 93,740,000  | 貸付株式数 | 38,000株             |
| トーモク            | 68,000    | 227     | 15,436,000  |       |                     |
| ザ・パック           | 12,800    | 1,293   | 16,550,400  |       |                     |
| コ・プケミカル         | 31,000    | 108     | 3,348,000   |       |                     |
| 昭和電工            | 1,344,000 | 170     | 228,480,000 |       |                     |
| 住友化学            | 1,486,000 | 410     | 609,260,000 | 貸付株式数 | 271,000株            |
| 日本化成            | 38,000    | 168     | 6,384,000   | 貸付株式数 | 14,000株             |
| 住友精化            | 44,000    | 436     | 19,184,000  | 貸付株式数 | 1,000株              |
| 日産化学            | 153,500   | 916     | 140,606,000 | 貸付株式数 | 26,000株             |
| ラサ工業            | 82,000    | 150     | 12,300,000  | 貸付株式数 | 29,000株             |
| クレハ             | 140,000   | 398     | 55,720,000  | 貸付株式数 | 57,000株             |
| テイカ             | 34,000    | 300     | 10,200,000  | 貸付株式数 | 2,000株              |
| 石原産業            | 363,000   | 110     | 39,930,000  | 貸付株式数 | 130,000株            |

|                 |           |         |               |       |                      |
|-----------------|-----------|---------|---------------|-------|----------------------|
| 片倉チツカリン         | 15,000    | 219     | 3,285,000     |       |                      |
| 日本曹達            | 129,000   | 355     | 45,795,000    | 貸付株式数 | 25,000株              |
| 東ソー             | 540,000   | 338     | 182,520,000   | 貸付株式数 | 98,000株              |
| トクヤマ            | 334,000   | 408     | 136,272,000   | 貸付株式数 | 9,000株               |
| セントラル硝子         | 207,000   | 388     | 80,316,000    | 貸付株式数 | 41,000株              |
| 東亜合成            | 243,000   | 426     | 103,518,000   |       |                      |
| ダイソー            | 86,000    | 286     | 24,596,000    | 貸付株式数 | 2,000株               |
| 関東電化            | 47,000    | 579     | 27,213,000    | 貸付株式数 | 26,000株<br>(7,000株)  |
| 電気化学            | 454,000   | 400     | 181,600,000   | 貸付株式数 | 66,000株              |
| イビデン            | 125,800   | 2,485   | 312,613,000   | 貸付株式数 | 26,600株              |
| 信越化学            | 360,200   | 4,380   | 1,577,676,000 | 貸付株式数 | 54,800株              |
| 日本カ - バイド       | 50,000    | 197     | 9,850,000     | 貸付株式数 | 17,000株              |
| 堺 化 学           | 61,000    | 370     | 22,570,000    |       |                      |
| エア・ウォーター        | 172,000   | 977     | 168,044,000   | 貸付株式数 | 66,000株<br>(57,000株) |
| 大陽日酸            | 284,000   | 641     | 182,044,000   | 貸付株式数 | 53,000株              |
| 日本化学工業          | 80,000    | 181     | 14,480,000    |       |                      |
| 日本パ - カライジング    | 49,000    | 1,216   | 59,584,000    | 貸付株式数 | 9,000株               |
| 高压ガス            | 30,000    | 466     | 13,980,000    |       |                      |
| チタン工業           | 24,000    | 483     | 11,592,000    | 貸付株式数 | 13,000株              |
| 四国化成            | 30,000    | 468     | 14,040,000    |       |                      |
| 戸田工業            | 30,000    | 825     | 24,750,000    | 貸付株式数 | 13,000株              |
| ステラ ケミファ        | 9,500     | 2,663   | 25,298,500    | 貸付株式数 | 4,100株<br>(1,500株)   |
| 保土谷化学           | 47,000    | 331     | 15,557,000    | 貸付株式数 | 10,000株              |
| 日本触媒            | 176,000   | 1,021   | 179,696,000   | 貸付株式数 | 11,000株              |
| 大日精化            | 78,000    | 403     | 31,434,000    |       |                      |
| カネカ             | 269,000   | 538     | 144,722,000   | 貸付株式数 | 3,000株               |
| 協和発酵キリン         | 261,000   | 822     | 214,542,000   | 貸付株式数 | 4,000株               |
| 三菱瓦斯化学          | 341,000   | 590     | 201,190,000   | 貸付株式数 | 21,000株              |
| 三井化学            | 983,000   | 294     | 289,002,000   | 貸付株式数 | 23,000株              |
| J S R           | 180,500   | 1,622   | 292,771,000   | 貸付株式数 | 38,100株              |
| 東京応化工業          | 38,900    | 1,760   | 68,464,000    | 貸付株式数 | 3,500株               |
| 三菱ケミカルH L D G S | 1,256,000 | 585     | 734,760,000   | 貸付株式数 | 198,000株             |
| 日本合成化学          | 49,000    | 562     | 27,538,000    | 貸付株式数 | 9,000株               |
| ダイセル化学          | 281,000   | 555     | 155,955,000   | 貸付株式数 | 51,000株              |
| 住友ベ - クライト      | 202,000   | 554     | 111,908,000   | 貸付株式数 | 36,000株              |
| 積水化学            | 450,000   | 701     | 315,450,000   | 貸付株式数 | 50,000株              |
| 日本ゼオン           | 199,000   | 779     | 155,021,000   | 貸付株式数 | 37,000株              |
| アイカ工業           | 62,700    | 1,105   | 69,283,500    | 貸付株式数 | 10,600株              |
| 宇部興産            | 906,000   | 266     | 240,996,000   |       |                      |
| 積水樹脂            | 29,000    | 831     | 24,099,000    | 貸付株式数 | 2,000株               |
| タキロン            | 49,000    | 304     | 14,896,000    |       |                      |
| 旭有機材            | 76,000    | 228     | 17,328,000    |       |                      |
| 日立化成            | 93,500    | 1,654   | 154,649,000   | 貸付株式数 | 18,400株              |
| ニチバン            | 21,000    | 284     | 5,964,000     |       |                      |
| リケンテクノス         | 36,000    | 290     | 10,440,000    |       |                      |
| 大倉工業            | 50,000    | 279     | 13,950,000    |       |                      |
| 積水化成品           | 48,000    | 358     | 17,184,000    |       |                      |
| 群栄化学            | 55,000    | 230     | 12,650,000    |       |                      |
| タイガース ポリマー      | 10,600    | 395     | 4,187,000     |       |                      |
| 日本カ - リット       | 17,000    | 445     | 7,565,000     |       |                      |
| 日本化薬            | 152,000   | 869     | 132,088,000   | 貸付株式数 | 30,000株              |
| イーピーエス          | 116       | 185,000 | 21,460,000    | 貸付株式数 | 42株                  |

|                 |         |        |               |                |
|-----------------|---------|--------|---------------|----------------|
| パナソニック電工 I S    | 3,900   | 2,267  | 8,841,300     |                |
| フェイス            | 690     | 10,420 | 7,189,800     | 貸付株式数 136株     |
| アミューズ           | 5,700   | 923    | 5,261,100     |                |
| 野村総合研究所         | 115,400 | 1,871  | 215,913,400   | 貸付株式数 22,700株  |
| ドリームインキュベータ     | 59      | 71,600 | 4,224,400     |                |
| サイバネットシステム      | 166     | 21,550 | 3,577,300     |                |
| T A C           | 11,900  | 222    | 2,641,800     | 貸付株式数 5,600株   |
| ケネディクス          | 2,351   | 16,320 | 38,368,320    | 貸付株式数 431株     |
| 電通              | 196,200 | 2,452  | 481,082,400   | 貸付株式数 104,500株 |
| インテージ           | 5,700   | 1,760  | 10,032,000    |                |
| テイクアンドギヴニーズ     | 1,081   | 6,130  | 6,626,530     | 貸付株式数 84株      |
| ぴあ              | 6,000   | 816    | 4,896,000     | 貸付株式数 1,800株   |
| シンプレクスホールディング   | 341     | 32,550 | 11,099,550    |                |
| イオンファンタジー       | 7,000   | 1,119  | 7,833,000     |                |
| ソースネクスト         | 37      | 17,510 | 647,870       | 貸付株式数 5株       |
| ネクシィーズ          | 862     | 2,203  | 1,898,986     | 貸付株式数 283株     |
| メディカルシステムネットワーク | 2,600   | 805    | 2,093,000     |                |
| 日本精化            | 17,900  | 539    | 9,648,100     |                |
| A D E K A       | 86,400  | 843    | 72,835,200    | 貸付株式数 700株     |
| 日油              | 184,000 | 363    | 66,792,000    |                |
| ミヨシ油脂           | 73,000  | 114    | 8,322,000     |                |
| ハリマ化成           | 18,300  | 671    | 12,279,300    | 貸付株式数 3,200株   |
| 花 王             | 573,700 | 2,156  | 1,236,897,200 | 貸付株式数 61,600株  |
| 第一工業製薬          | 34,000  | 272    | 9,248,000     |                |
| 三洋化成            | 58,000  | 652    | 37,816,000    | 貸付株式数 6,000株   |
| 武田薬品            | 810,300 | 3,740  | 3,030,522,000 | 貸付株式数 49,700株  |
| アステラス製薬         | 480,200 | 3,135  | 1,505,427,000 | 貸付株式数 27,700株  |
| 大日本住友製薬         | 153,100 | 780    | 119,418,000   | 貸付株式数 32,900株  |
| 塩野義製薬           | 315,300 | 1,366  | 430,699,800   | 貸付株式数 26,900株  |
| 田辺三菱製薬          | 180,000 | 1,363  | 245,340,000   | 貸付株式数 4,900株   |
| わかもと製薬          | 22,000  | 253    | 5,566,000     | 貸付株式数 3,000株   |
| あすか製薬           | 25,000  | 597    | 14,925,000    |                |
| 日本新薬            | 48,000  | 1,025  | 49,200,000    | 貸付株式数 4,000株   |
| 中外製薬            | 216,500 | 1,357  | 293,790,500   |                |
| 科研製薬            | 91,000  | 1,115  | 101,465,000   | 貸付株式数 14,000株  |
| エーザイ            | 266,300 | 3,140  | 836,182,000   | 貸付株式数 106,700株 |
| ロート製薬           | 98,000  | 915    | 89,670,000    |                |
| 小野薬品            | 105,800 | 4,370  | 462,346,000   | 貸付株式数 200株     |
| 久光製薬            | 61,000  | 3,430  | 209,230,000   | 貸付株式数 34,400株  |
| 有機合成薬品          | 16,000  | 198    | 3,168,000     |                |
| 持田製薬            | 84,000  | 874    | 73,416,000    |                |
| 大正製薬            | 172,000 | 1,805  | 310,460,000   | 貸付株式数 4,000株   |
| 参天製薬            | 67,000  | 3,185  | 213,395,000   | 貸付株式数 2,200株   |
| 扶桑薬品            | 73,000  | 223    | 16,279,000    |                |
| 日本ケミファ          | 31,000  | 312    | 9,672,000     | 貸付株式数 4,000株   |
| ツムラ             | 59,000  | 2,580  | 152,220,000   | 貸付株式数 22,900株  |
| 日医工             | 21,900  | 2,105  | 46,099,500    | 貸付株式数 3,000株   |
| テ ル モ           | 162,300 | 4,465  | 724,669,500   | 貸付株式数 19,000株  |
| みらかホールディングス     | 52,500  | 3,235  | 169,837,500   | 貸付株式数 2,800株   |
| キッセイ薬品工業        | 43,800  | 1,583  | 69,335,400    | 貸付株式数 5,400株   |
| 生化学工業           | 41,300  | 910    | 37,583,000    |                |
| 栄研化学            | 16,700  | 1,055  | 17,618,500    |                |
| 日水製薬            | 8,700   | 700    | 6,090,000     |                |
| 鳥居薬品            | 14,700  | 1,517  | 22,299,900    |                |
| 東和薬品            | 11,000  | 4,770  | 52,470,000    | 貸付株式数 600株     |

|                |         |         |               |       |                      |
|----------------|---------|---------|---------------|-------|----------------------|
| 沢井製薬           | 14,200  | 8,180   | 116,156,000   | 貸付株式数 | 2,600株               |
| ゼリア新薬工業        | 29,000  | 1,067   | 30,943,000    | 貸付株式数 | 11,000株              |
| 第一三共           | 727,500 | 1,617   | 1,176,367,500 | 貸付株式数 | 22,800株              |
| キョーリン製薬HD      | 55,000  | 1,627   | 89,485,000    | 貸付株式数 | 9,000株               |
| 大幸薬品           | 8,000   | 817     | 6,536,000     | 貸付株式数 | 3,300株               |
| ダイト            | 5,800   | 1,322   | 7,667,600     |       |                      |
| 大塚ホールディングス     | 500,800 | 2,143   | 1,073,214,400 | 貸付株式数 | 20,800株              |
| 大日本塗料          | 124,000 | 99      | 12,276,000    | 貸付株式数 | 49,000株              |
| 日本ペイント         | 186,000 | 650     | 120,900,000   | 貸付株式数 | 109,000株             |
| 関西ペイント         | 245,000 | 734     | 179,830,000   | 貸付株式数 | 34,000株<br>(30,000株) |
| トウペ            | 18,000  | 88      | 1,584,000     | 貸付株式数 | 8,000株               |
| 中国塗料           | 55,000  | 631     | 34,705,000    |       |                      |
| 日本特殊塗料         | 16,600  | 343     | 5,693,800     |       |                      |
| 藤倉化成           | 27,300  | 469     | 12,803,700    |       |                      |
| 太陽ホールディングス     | 15,900  | 2,446   | 38,891,400    | 貸付株式数 | 6,400株<br>(5,700株)   |
| D I C          | 825,000 | 192     | 158,400,000   |       |                      |
| サカタインクス        | 43,000  | 392     | 16,856,000    |       |                      |
| 東洋インキSCホールディング | 192,000 | 383     | 73,536,000    | 貸付株式数 | 30,000株              |
| アルプス技研         | 9,400   | 646     | 6,072,400     |       |                      |
| サニックス          | 31,300  | 373     | 11,674,900    | 貸付株式数 | 14,800株              |
| ダイオーズ          | 3,600   | 501     | 1,803,600     |       |                      |
| 日本空調サービス       | 5,100   | 737     | 3,758,700     |       |                      |
| オリエンタルランド      | 58,200  | 7,150   | 416,130,000   | 貸付株式数 | 34,200株              |
| ダスキン           | 60,500  | 1,581   | 95,650,500    | 貸付株式数 | 800株                 |
| パーク24          | 96,000  | 916     | 87,936,000    | 貸付株式数 | 26,500株              |
| 明光ネットワークジャパン   | 16,300  | 748     | 12,192,400    | 貸付株式数 | 3,500株               |
| ファルコSDホールディングス | 10,800  | 788     | 8,510,400     |       |                      |
| クレスコ           | 5,700   | 579     | 3,300,300     |       |                      |
| フジ・メディア・HD     | 2,123   | 121,100 | 257,095,300   | 貸付株式数 | 148株                 |
| 秀英予備校          | 3,300   | 330     | 1,089,000     |       |                      |
| 田谷             | 3,100   | 663     | 2,055,300     |       |                      |
| ラウンドワン         | 55,100  | 686     | 37,798,600    | 貸付株式数 | 32,400株              |
| リゾートトラスト       | 33,000  | 1,052   | 34,716,000    | 貸付株式数 | 4,500株               |
| オービック          | 7,030   | 16,070  | 112,972,100   | 貸付株式数 | 1,250株               |
| ティーディーシーソフトウェア | 4,300   | 736     | 3,164,800     |       |                      |
| ヤフー            | 14,924  | 27,970  | 417,424,280   | 貸付株式数 | 2,196株               |
| ビー・エム・エル       | 12,700  | 2,130   | 27,051,000    | 貸付株式数 | 1,100株               |
| ワタベウェディング      | 6,000   | 689     | 4,134,000     |       |                      |
| トレンドマイクロ       | 90,000  | 2,639   | 237,510,000   | 貸付株式数 | 15,900株              |
| もしもしホットライン     | 13,350  | 1,360   | 18,156,000    |       |                      |
| 東急コミュニティー      | 5,300   | 2,557   | 13,552,100    |       |                      |
| リソー教育          | 2,189   | 4,370   | 9,565,930     | 貸付株式数 | 497株                 |
| 日本オラクル         | 32,500  | 2,769   | 89,992,500    | 貸付株式数 | 6,400株               |
| アルファシステムズ      | 5,300   | 1,202   | 6,370,600     |       |                      |
| フューチャーアーキテクト   | 245     | 37,150  | 9,101,750     |       |                      |
| ウェアハウス         | 4,700   | 261     | 1,226,700     |       |                      |
| シーエーシー         | 12,600  | 645     | 8,127,000     |       |                      |
| ソフトバンク・テクノ     | 4,600   | 602     | 2,769,200     |       |                      |
| トーセ            | 4,800   | 552     | 2,649,600     |       |                      |
| ユー・エス・エス       | 28,120  | 6,320   | 177,718,400   | 貸付株式数 | 410株                 |
| オービックビジネスC     | 5,200   | 4,740   | 24,648,000    | 貸付株式数 | 100株                 |
| 日立ビジネスソリュー     | 6,100   | 759     | 4,629,900     |       |                      |
| 伊藤忠テクノソリュー     | 29,000  | 3,000   | 87,000,000    | 貸付株式数 | 700株                 |

|                |           |         |               |       |                    |
|----------------|-----------|---------|---------------|-------|--------------------|
| アイティフォー        | 22,600    | 283     | 6,395,800     |       |                    |
| 東京個別指導学院       | 13,900    | 162     | 2,251,800     | 貸付株式数 | 5,500株             |
| 東計電算           | 3,400     | 1,069   | 3,634,600     |       |                    |
| エクスネット         | 18        | 125,500 | 2,259,000     |       |                    |
| テー・オー・ダブリュー    | 6,100     | 448     | 2,732,800     | 貸付株式数 | 2,400株             |
| 大塚商会           | 16,200    | 5,280   | 85,536,000    | 貸付株式数 | 3,200株             |
| 総合メディカル        | 4,300     | 2,624   | 11,283,200    | 貸付株式数 | 300株               |
| サイボウズ          | 272       | 19,860  | 5,401,920     | 貸付株式数 | 8株                 |
| ソフトブレーン        | 298       | 10,780  | 3,212,440     | 貸付株式数 | 101株               |
| アグレックス         | 4,600     | 750     | 3,450,000     | 貸付株式数 | 1,600株             |
| セントラルスポーツ      | 6,300     | 947     | 5,966,100     |       |                    |
| 電通国際情報S        | 12,500    | 502     | 6,275,000     |       |                    |
| ウェザーニューズ       | 5,800     | 2,161   | 12,533,800    | 貸付株式数 | 900株               |
| C I J          | 20,300    | 264     | 5,359,200     |       |                    |
| WOWOW          | 60        | 154,500 | 9,270,000     |       |                    |
| フルキャストホールディングス | 178       | 23,200  | 4,129,600     | 貸付株式数 | 67株                |
| 富士フイルムHLDGS    | 462,000   | 2,515   | 1,161,930,000 | 貸付株式数 | 36,800株            |
| コニカミノルタHLDGS   | 545,500   | 688     | 375,304,000   | 貸付株式数 | 9,000株             |
| 資生堂            | 359,100   | 1,539   | 552,654,900   | 貸付株式数 | 72,300株            |
| ライオン           | 249,000   | 446     | 111,054,000   |       |                    |
| 高砂香料           | 71,000    | 391     | 27,761,000    |       |                    |
| マンダム           | 21,700    | 2,303   | 49,975,100    |       |                    |
| ミルボン           | 11,500    | 2,469   | 28,393,500    |       |                    |
| ファンケル          | 41,800    | 1,108   | 46,314,400    |       |                    |
| コーセー           | 38,900    | 2,102   | 81,767,800    | 貸付株式数 | 5,400株             |
| ドクターシーラボ       | 144       | 415,500 | 59,832,000    | 貸付株式数 | 57株<br>(8株)        |
| ポーラ・オルビスHD     | 19,800    | 2,111   | 41,797,800    | 貸付株式数 | 10,600株            |
| エステー           | 10,300    | 865     | 8,909,500     |       |                    |
| コニシ            | 16,900    | 1,140   | 19,266,000    | 貸付株式数 | 100株               |
| 長谷川香料          | 27,400    | 1,300   | 35,620,000    | 貸付株式数 | 9,000株             |
| 小林製薬           | 30,000    | 4,090   | 122,700,000   | 貸付株式数 | 5,900株             |
| 荒川化学工業         | 16,700    | 818     | 13,660,600    | 貸付株式数 | 100株               |
| メック            | 14,200    | 359     | 5,097,800     |       |                    |
| 日本高純度化学        | 58        | 216,300 | 12,545,400    | 貸付株式数 | 14株                |
| 荏原ユージライト       | 2,900     | 3,050   | 8,845,000     | 貸付株式数 | 1,300株             |
| アース製薬          | 15,500    | 2,793   | 43,291,500    | 貸付株式数 | 6,100株             |
| イハラケミカル        | 37,000    | 286     | 10,582,000    | 貸付株式数 | 7,000株             |
| 北興化学           | 21,000    | 241     | 5,061,000     |       |                    |
| 大成ラミック         | 5,800     | 2,374   | 13,769,200    |       |                    |
| クミアイ化学         | 44,000    | 244     | 10,736,000    | 貸付株式数 | 15,000株            |
| 日本農薬           | 44,000    | 374     | 16,456,000    |       |                    |
| 昭和シエル石油        | 193,300   | 769     | 148,647,700   | 貸付株式数 | 28,800株            |
| コスモ石油          | 598,000   | 241     | 144,118,000   | 貸付株式数 | 29,000株            |
| 富士興産           | 79,000    | 77      | 6,083,000     | 貸付株式数 | 26,000株            |
| ニチレキ           | 25,000    | 399     | 9,975,000     | 貸付株式数 | 5,000株             |
| 東燃ゼネラル石油       | 325,000   | 1,000   | 325,000,000   | 貸付株式数 | 4,000株             |
| ユシロ化学          | 10,700    | 1,118   | 11,962,600    | 貸付株式数 | 2,100株             |
| ビーピー・カストロール    | 8,800     | 336     | 2,956,800     |       |                    |
| AOCホールディングス    | 55,200    | 585     | 32,292,000    | 貸付株式数 | 6,700株<br>(5,900株) |
| MORESCO        | 3,300     | 900     | 2,970,000     |       |                    |
| 出光興産           | 25,700    | 9,060   | 232,842,000   | 貸付株式数 | 200株               |
| JXホールディングス     | 2,400,500 | 551     | 1,322,675,500 | 貸付株式数 | 215,900株           |
| 横浜ゴム           | 242,000   | 477     | 115,434,000   | 貸付株式数 | 43,000株            |

|               |           |       |               |       |                        |
|---------------|-----------|-------|---------------|-------|------------------------|
| 東洋ゴム          | 179,000   | 209   | 37,411,000    | 貸付株式数 | 31,000株                |
| ブリヂストン        | 677,900   | 1,954 | 1,324,616,600 |       |                        |
| 住友ゴム          | 152,400   | 1,029 | 156,819,600   |       |                        |
| 藤倉ゴム          | 13,500    | 322   | 4,347,000     |       |                        |
| オカモト          | 79,000    | 319   | 25,201,000    |       |                        |
| アキレス          | 174,000   | 116   | 20,184,000    |       |                        |
| フコク           | 9,000     | 761   | 6,849,000     |       |                        |
| ニッタ           | 19,200    | 1,600 | 30,720,000    | 貸付株式数 | 1,000株                 |
| クリエートメディック    | 5,900     | 797   | 4,702,300     |       |                        |
| 東海ゴム工業        | 33,200    | 1,052 | 34,926,400    | 貸付株式数 | 6,600株                 |
| 三ツ星ベルト        | 52,000    | 421   | 21,892,000    |       |                        |
| バンドー化学        | 77,000    | 351   | 27,027,000    |       |                        |
| 鬼怒川ゴム         | 50,000    | 600   | 30,000,000    | 貸付株式数 | 27,000株                |
| 旭硝子           | 1,065,000 | 962   | 1,024,530,000 | 貸付株式数 | 29,000株                |
| 日本板硝子         | 927,000   | 254   | 235,458,000   | 貸付株式数 | 106,000株               |
| 石塚硝子          | 27,000    | 148   | 3,996,000     |       |                        |
| 有沢製作所         | 33,500    | 453   | 15,175,500    |       |                        |
| 日本山村硝子        | 93,000    | 211   | 19,623,000    |       |                        |
| 日本電気硝子        | 446,000   | 1,092 | 487,032,000   | 貸付株式数 | 2,000株                 |
| オハラ           | 8,200     | 900   | 7,380,000     |       |                        |
| 住友大阪セメント      | 411,000   | 224   | 92,064,000    | 貸付株式数 | 11,000株                |
| 太平洋セメント       | 914,000   | 163   | 148,982,000   | 貸付株式数 | 538,000株               |
| デイ・シイ         | 22,200    | 237   | 5,261,400     | 貸付株式数 | 4,300株                 |
| リゾートソリューション   | 18,000    | 141   | 2,538,000     |       |                        |
| 日本ヒュ-ム        | 17,000    | 317   | 5,389,000     | 貸付株式数 | 2,000株                 |
| 日本コンクリ-ト      | 31,000    | 214   | 6,634,000     | 貸付株式数 | 11,000株<br>(11,000株)   |
| 東海カーボン        | 188,000   | 447   | 84,036,000    | 貸付株式数 | 38,000株                |
| 日本カーボン        | 99,000    | 236   | 23,364,000    | 貸付株式数 | 14,000株                |
| 東洋炭素          | 12,000    | 4,120 | 49,440,000    | 貸付株式数 | 6,000株                 |
| ノリタケ          | 112,000   | 325   | 36,400,000    | 貸付株式数 | 3,000株                 |
| TOTO          | 309,000   | 631   | 194,979,000   | 貸付株式数 | 181,000株               |
| 日本碍子          | 260,000   | 1,474 | 383,240,000   | 貸付株式数 | 47,000株                |
| 日本特殊陶業        | 190,000   | 1,146 | 217,740,000   | 貸付株式数 | 2,000株                 |
| ダントーホールディングス  | 29,000    | 100   | 2,900,000     | 貸付株式数 | 10,000株                |
| MARUWA        | 4,800     | 3,405 | 16,344,000    | 貸付株式数 | 2,600株                 |
| 品川リフラクトリーズ    | 52,000    | 246   | 12,792,000    |       |                        |
| 黒崎播磨          | 45,000    | 348   | 15,660,000    |       |                        |
| 東京窯業          | 25,000    | 176   | 4,400,000     |       |                        |
| ニッカトー         | 7,600     | 472   | 3,587,200     |       |                        |
| フジミインコーポレーテッド | 19,500    | 971   | 18,934,500    |       |                        |
| エーアンドエーマテリアル  | 44,000    | 96    | 4,224,000     | 貸付株式数 | 23,000株                |
| ニチアス          | 104,000   | 479   | 49,816,000    | 貸付株式数 | 2,000株                 |
| 新日本製鐵         | 5,675,000 | 267   | 1,515,225,000 | 貸付株式数 | 827,000株               |
| 住友金属工業        | 4,007,000 | 184   | 737,288,000   | 貸付株式数 | 176,000株               |
| 神戸製鋼所         | 2,997,000 | 185   | 554,445,000   | 貸付株式数 | 121,000株               |
| 日新製鋼          | 829,000   | 157   | 130,153,000   | 貸付株式数 | 146,000株<br>(145,000株) |
| 中山製鋼所         | 110,000   | 115   | 12,650,000    |       |                        |
| 合同製鐵          | 121,000   | 212   | 25,652,000    | 貸付株式数 | 10,000株                |
| JFEホールディングス   | 512,300   | 2,198 | 1,126,035,400 | 貸付株式数 | 85,100株                |
| 東京製鐵          | 119,300   | 845   | 100,808,500   | 貸付株式数 | 54,100株                |
| 共英製鋼          | 23,000    | 1,253 | 28,819,000    |       |                        |
| 大和工業          | 49,400    | 2,542 | 125,574,800   | 貸付株式数 | 2,300株                 |
| 東京鐵鋼          | 44,000    | 233   | 10,252,000    |       |                        |

|              |           |       |             |       |          |
|--------------|-----------|-------|-------------|-------|----------|
| 大阪製鐵         | 13,600    | 1,530 | 20,808,000  |       |          |
| 淀川製鋼所        | 165,000   | 347   | 57,255,000  | 貸付株式数 | 2,000株   |
| 東洋鋼鈑         | 50,000    | 371   | 18,550,000  |       |          |
| 住友鋼管         | 14,600    | 568   | 8,292,800   |       |          |
| 丸一鋼管         | 72,300    | 2,035 | 147,130,500 | 貸付株式数 | 11,800株  |
| モリ工業         | 33,000    | 340   | 11,220,000  |       |          |
| 大同特殊鋼        | 362,000   | 541   | 195,842,000 | 貸付株式数 | 52,000株  |
| 日本高周波        | 85,000    | 112   | 9,520,000   |       |          |
| 日本金属工業       | 159,000   | 94    | 14,946,000  | 貸付株式数 | 59,000株  |
| 日本冶金工        | 111,500   | 223   | 24,864,500  | 貸付株式数 | 42,000株  |
| 山陽特殊鋼        | 107,000   | 517   | 55,319,000  |       |          |
| 愛知製鋼         | 115,000   | 552   | 63,480,000  | 貸付株式数 | 40,000株  |
| 日立金属         | 141,000   | 1,081 | 152,421,000 | 貸付株式数 | 31,000株  |
| 日本金属         | 54,000    | 168   | 9,072,000   | 貸付株式数 | 4,000株   |
| 大平洋金属        | 151,000   | 618   | 93,318,000  | 貸付株式数 | 30,000株  |
| 日本電工         | 78,000    | 534   | 41,652,000  | 貸付株式数 | 29,000株  |
| 栗本鉄工所        | 112,000   | 165   | 18,480,000  | 貸付株式数 | 51,000株  |
| 旭テック         | 156,000   | 26    | 4,056,000   | 貸付株式数 | 38,000株  |
| 日本鑄鉄管        | 23,000    | 215   | 4,945,000   | 貸付株式数 | 4,000株   |
| 日本製鋼所        | 332,000   | 585   | 194,220,000 | 貸付株式数 | 61,000株  |
| 三菱製鋼         | 131,000   | 270   | 35,370,000  | 貸付株式数 | 26,000株  |
| 日亜鋼業         | 29,000    | 214   | 6,206,000   |       |          |
| 日本精線         | 17,000    | 436   | 7,412,000   |       |          |
| 日本軽金属        | 489,000   | 168   | 82,152,000  | 貸付株式数 | 8,000株   |
| 大紀アルミニウム     | 32,000    | 246   | 7,872,000   |       |          |
| 三井金属         | 625,000   | 282   | 176,250,000 | 貸付株式数 | 35,000株  |
| 東邦亜鉛         | 121,000   | 396   | 47,916,000  | 貸付株式数 | 62,000株  |
| 三菱マテリアル      | 1,349,000 | 257   | 346,693,000 | 貸付株式数 | 40,000株  |
| 住友鉱山         | 597,000   | 1,347 | 804,159,000 | 貸付株式数 | 103,000株 |
| DOWAホールディングス | 258,000   | 529   | 136,482,000 | 貸付株式数 | 145,000株 |
| 古河機金         | 363,000   | 84    | 30,492,000  | 貸付株式数 | 117,000株 |
| 大阪チタニウム      | 23,600    | 5,700 | 134,520,000 | 貸付株式数 | 11,800株  |
| 東邦チタニウム      | 35,100    | 2,352 | 82,555,200  | 貸付株式数 | 19,400株  |
| 住友軽金属        | 364,000   | 91    | 33,124,000  | 貸付株式数 | 14,000株  |
| 古河スカイ        | 87,000    | 302   | 26,274,000  | 貸付株式数 | 17,000株  |
| 古河電工         | 680,000   | 332   | 225,760,000 | 貸付株式数 | 125,000株 |
| 住友電工         | 763,700   | 1,217 | 929,422,900 | 貸付株式数 | 16,600株  |
| フジクラ         | 324,000   | 386   | 125,064,000 | 貸付株式数 | 59,000株  |
| 昭和電線HLDGS    | 258,000   | 102   | 26,316,000  | 貸付株式数 | 126,000株 |
| 東京特殊電線       | 30,000    | 107   | 3,210,000   | 貸付株式数 | 10,000株  |
| タツタ電線        | 38,000    | 412   | 15,656,000  | 貸付株式数 | 19,000株  |
| 日立電線         | 167,000   | 204   | 34,068,000  | 貸付株式数 | 88,000株  |
| 沖電線          | 22,000    | 185   | 4,070,000   | 貸付株式数 | 11,000株  |
| カナレ電気        | 2,300     | 1,262 | 2,902,600   |       |          |
| 平河ヒューテック     | 4,100     | 841   | 3,448,100   |       |          |
| リョービ         | 121,000   | 378   | 45,738,000  | 貸付株式数 | 24,000株  |
| アサヒHD        | 30,200    | 1,637 | 49,437,400  | 貸付株式数 | 3,000株   |
| 東洋製罐         | 152,800   | 1,398 | 213,614,400 | 貸付株式数 | 30,300株  |
| ホッカンホールディングス | 50,000    | 243   | 12,150,000  |       |          |
| コロナ          | 9,900     | 897   | 8,880,300   |       |          |
| 横河ブリッジHLDGS  | 36,000    | 525   | 18,900,000  | 貸付株式数 | 5,000株   |
| 日本橋梁         | 7,600     | 232   | 1,763,200   | 貸付株式数 | 3,800株   |
| 駒井ハルテック      | 41,000    | 221   | 9,061,000   | 貸付株式数 | 13,000株  |
| サクラダ         | 188,000   | 22    | 4,136,000   | 貸付株式数 | 67,000株  |
| 高田機工         | 19,000    | 195   | 3,705,000   |       |          |

|            |         |        |             |       |                      |
|------------|---------|--------|-------------|-------|----------------------|
| 三和ホールディングス | 215,000 | 289    | 62,135,000  | 貸付株式数 | 1,000株               |
| 文化シヤツタ -   | 53,000  | 231    | 12,243,000  |       |                      |
| 東洋シヤツタ -   | 4,200   | 331    | 1,390,200   |       |                      |
| 住生活グループ    | 261,000 | 2,014  | 525,654,000 | 貸付株式数 | 13,800株              |
| 日本フィルコン    | 15,600  | 449    | 7,004,400   |       |                      |
| ノーリツ       | 39,300  | 1,628  | 63,980,400  | 貸付株式数 | 6,400株               |
| 長府製作所      | 20,800  | 2,027  | 42,161,600  |       |                      |
| リンナイ       | 34,800  | 5,930  | 206,364,000 | 貸付株式数 | 2,700株               |
| ユニプレス      | 26,600  | 2,200  | 58,520,000  | 貸付株式数 | 1,300株               |
| ダイニチ工業     | 11,000  | 719    | 7,909,000   | 貸付株式数 | 700株                 |
| 日東精工       | 28,000  | 222    | 6,216,000   |       |                      |
| 三洋工業       | 26,000  | 160    | 4,160,000   |       |                      |
| 岡 部        | 42,500  | 412    | 17,510,000  |       |                      |
| 日立ツール      | 12,400  | 880    | 10,912,000  |       |                      |
| 中国工業       | 31,000  | 98     | 3,038,000   | 貸付株式数 | 17,000株              |
| 東 プ レ      | 41,600  | 848    | 35,276,800  | 貸付株式数 | 8,200株               |
| 高周波熱錬      | 28,700  | 680    | 19,516,000  |       |                      |
| 東京製綱       | 146,000 | 312    | 45,552,000  | 貸付株式数 | 81,000株<br>(11,000株) |
| パイオラックス    | 9,200   | 1,881  | 17,305,200  | 貸付株式数 | 1,100株               |
| 日本発条       | 157,000 | 839    | 131,723,000 | 貸付株式数 | 14,000株              |
| 中央発條       | 27,000  | 304    | 8,208,000   |       |                      |
| アドバネクス     | 41,000  | 80     | 3,280,000   | 貸付株式数 | 13,000株              |
| 三浦工業       | 34,800  | 2,320  | 80,736,000  | 貸付株式数 | 800株                 |
| タ ク マ      | 79,000  | 419    | 33,101,000  | 貸付株式数 | 43,000株              |
| ツ ガ ミ      | 58,000  | 512    | 29,696,000  | 貸付株式数 | 22,000株              |
| オークマ       | 141,000 | 823    | 116,043,000 | 貸付株式数 | 78,000株              |
| 東芝機械       | 128,000 | 446    | 57,088,000  | 貸付株式数 | 14,000株              |
| ア マ ダ      | 305,000 | 644    | 196,420,000 | 貸付株式数 | 1,000株               |
| アイダエンジニア   | 55,800  | 394    | 21,985,200  | 貸付株式数 | 7,200株               |
| 牧野フライス     | 100,000 | 764    | 76,400,000  | 貸付株式数 | 1,000株               |
| オーエスジー     | 95,200  | 1,160  | 110,432,000 |       |                      |
| ダイジェット     | 24,000  | 151    | 3,624,000   |       |                      |
| 旭ダイヤモンド    | 44,000  | 1,792  | 78,848,000  | 貸付株式数 | 16,000株              |
| 森精機製作所     | 114,000 | 1,040  | 118,560,000 | 貸付株式数 | 63,100株              |
| ディスコ       | 21,800  | 5,040  | 109,872,000 | 貸付株式数 | 12,100株              |
| 日東工器       | 12,600  | 1,944  | 24,494,400  | 貸付株式数 | 100株                 |
| 豊田自動織機     | 188,100 | 2,690  | 505,989,000 | 貸付株式数 | 29,100株              |
| 豊和工業       | 113,000 | 77     | 8,701,000   | 貸付株式数 | 41,000株              |
| 大阪機工       | 73,000  | 117    | 8,541,000   |       |                      |
| 石川製作所      | 45,000  | 70     | 3,150,000   | 貸付株式数 | 16,000株              |
| 東洋機械金属     | 17,100  | 236    | 4,035,600   | 貸付株式数 | 6,200株               |
| 津田駒工業      | 50,000  | 225    | 11,250,000  | 貸付株式数 | 19,000株              |
| エンシュウ      | 47,000  | 113    | 5,311,000   | 貸付株式数 | 10,000株              |
| 島精機製作所     | 28,200  | 2,069  | 58,345,800  | 貸付株式数 | 8,800株               |
| 日阪製作所      | 26,000  | 1,112  | 28,912,000  |       |                      |
| やまびこ       | 8,500   | 982    | 8,347,000   |       |                      |
| ペガサスミシン製造  | 21,300  | 238    | 5,069,400   |       |                      |
| ナプテスコ      | 81,600  | 2,037  | 166,219,200 | 貸付株式数 | 16,000株              |
| 三井海洋開発     | 17,800  | 1,418  | 25,240,400  | 貸付株式数 | 6,000株<br>(900株)     |
| レオン自動機     | 20,000  | 194    | 3,880,000   |       |                      |
| S M C      | 64,500  | 14,820 | 955,890,000 | 貸付株式数 | 12,700株              |
| 新川         | 15,400  | 671    | 10,333,400  | 貸付株式数 | 1,700株               |
| ホソカワミクロン   | 33,000  | 431    | 14,223,000  |       |                      |

|              |           |        |               |       |                        |
|--------------|-----------|--------|---------------|-------|------------------------|
| ユニオンツール      | 11,900    | 1,707  | 20,313,300    | 貸付株式数 | 4,700株                 |
| オレス工業        | 21,800    | 1,585  | 34,553,000    |       |                        |
| サトー          | 20,500    | 1,099  | 22,529,500    | 貸付株式数 | 100株                   |
| 日本エアーテック     | 6,000     | 402    | 2,412,000     |       |                        |
| 日精樹脂工業       | 17,000    | 256    | 4,352,000     |       |                        |
| ワイエイシイ       | 9,300     | 973    | 9,048,900     | 貸付株式数 | 1,600株                 |
| 小松製作所        | 1,024,800 | 2,543  | 2,606,066,400 | 貸付株式数 | 438,700株<br>(358,800株) |
| 住友重機械        | 552,000   | 553    | 305,256,000   | 貸付株式数 | 35,000株                |
| 日立建機         | 96,600    | 1,806  | 174,459,600   | 貸付株式数 | 56,800株                |
| 日工           | 28,000    | 301    | 8,428,000     |       |                        |
| 巴工業          | 8,100     | 1,680  | 13,608,000    |       |                        |
| 井関農機         | 221,000   | 206    | 45,526,000    | 貸付株式数 | 103,000株               |
| TOWA         | 20,900    | 520    | 10,868,000    |       |                        |
| 丸山製作所        | 47,000    | 178    | 8,366,000     | 貸付株式数 | 15,000株                |
| 北川鉄工所        | 99,000    | 158    | 15,642,000    |       |                        |
| シンニッタン       | 20,500    | 369    | 7,564,500     |       |                        |
| クボタ          | 907,000   | 757    | 686,599,000   | 貸付株式数 | 162,000株               |
| 荏原実業         | 4,900     | 1,239  | 6,071,100     |       |                        |
| 東洋エンジニア      | 136,000   | 306    | 41,616,000    | 貸付株式数 | 27,000株                |
| 三菱化工機        | 63,000    | 198    | 12,474,000    |       |                        |
| 月島機械         | 33,000    | 726    | 23,958,000    | 貸付株式数 | 7,000株                 |
| 帝国電機製作所      | 7,300     | 1,698  | 12,395,400    | 貸付株式数 | 1,100株                 |
| 東京機械         | 61,000    | 74     | 4,514,000     |       |                        |
| 新東工業         | 43,500    | 838    | 36,453,000    | 貸付株式数 | 16,200株                |
| 渋谷工業         | 12,200    | 894    | 10,906,800    | 貸付株式数 | 400株                   |
| アイチ コーポレーション | 35,700    | 408    | 14,565,600    | 貸付株式数 | 7,000株                 |
| 小森コーポレーション   | 56,900    | 727    | 41,366,300    |       |                        |
| 鶴見製作所        | 16,000    | 605    | 9,680,000     |       |                        |
| 住友精密         | 35,000    | 558    | 19,530,000    | 貸付株式数 | 21,000株                |
| 酒井重工業        | 39,000    | 169    | 6,591,000     |       |                        |
| 荏原製作所        | 349,000   | 484    | 168,916,000   | 貸付株式数 | 116,000株               |
| 石井鉄工所        | 30,000    | 182    | 5,460,000     | 貸付株式数 | 16,000株                |
| 西島製作所        | 24,900    | 1,222  | 30,427,800    | 貸付株式数 | 13,600株                |
| 千代田化工建       | 150,000   | 963    | 144,450,000   | 貸付株式数 | 33,000株                |
| ダイキン工業       | 225,600   | 2,913  | 657,172,800   | 貸付株式数 | 34,600株                |
| オルガノ         | 35,000    | 623    | 21,805,000    | 貸付株式数 | 14,000株                |
| ト・ヨ・カネツ      | 116,000   | 211    | 24,476,000    | 貸付株式数 | 44,000株                |
| 栗田工業         | 119,200   | 2,382  | 283,934,400   | 貸付株式数 | 19,200株                |
| 椿本チエイン       | 110,000   | 501    | 55,110,000    | 貸付株式数 | 14,000株                |
| 大同工業         | 42,000    | 173    | 7,266,000     |       |                        |
| 日本コンベヤ       | 63,000    | 86     | 5,418,000     |       |                        |
| 日機装          | 72,000    | 715    | 51,480,000    | 貸付株式数 | 8,000株                 |
| 木村化工機        | 19,600    | 396    | 7,761,600     | 貸付株式数 | 8,400株                 |
| 新興プランテック     | 44,500    | 870    | 38,715,000    | 貸付株式数 | 17,400株                |
| アネスト岩田       | 35,000    | 417    | 14,595,000    |       |                        |
| ダイフク         | 86,500    | 536    | 46,364,000    | 貸付株式数 | 9,000株                 |
| 加藤製作所        | 47,000    | 245    | 11,515,000    | 貸付株式数 | 18,000株                |
| 油研工業         | 35,000    | 229    | 8,015,000     | 貸付株式数 | 19,000株                |
| タダノ          | 91,000    | 471    | 42,861,000    | 貸付株式数 | 39,000株                |
| フジテック        | 57,000    | 461    | 26,277,000    |       |                        |
| シーケーディ       | 57,900    | 747    | 43,251,300    |       |                        |
| キトー          | 58        | 73,000 | 4,234,000     |       |                        |
| 平和           | 44,700    | 1,310  | 58,557,000    |       |                        |
| 理想科学工業       | 16,100    | 1,294  | 20,833,400    |       |                        |

|               |           |       |               |       |                            |
|---------------|-----------|-------|---------------|-------|----------------------------|
| SANKYO        | 62,600    | 4,270 | 267,302,000   | 貸付株式数 | 2,000株                     |
| 日本金銭機械        | 18,900    | 677   | 12,795,300    |       |                            |
| マースエンジニアリング   | 10,200    | 1,296 | 13,219,200    |       |                            |
| 福島工業          | 6,100     | 984   | 6,002,400     |       |                            |
| オーイズミ         | 7,200     | 247   | 1,778,400     | 貸付株式数 | 3,700株                     |
| ダイコク電機        | 8,500     | 815   | 6,927,500     |       |                            |
| アマノ           | 57,300    | 755   | 43,261,500    | 貸付株式数 | 1,300株                     |
| JUKI          | 124,000   | 223   | 27,652,000    | 貸付株式数 | 69,000株                    |
| サンデン          | 117,000   | 397   | 46,449,000    |       |                            |
| 蛇の目マシン        | 198,000   | 67    | 13,266,000    |       |                            |
| ブラザー工業        | 267,000   | 1,232 | 328,944,000   | 貸付株式数 | 25,800株                    |
| マックス          | 34,000    | 1,006 | 34,204,000    |       |                            |
| モリタホールディングス   | 34,000    | 497   | 16,898,000    |       |                            |
| グローリー         | 57,200    | 1,842 | 105,362,400   | 貸付株式数 | 20,200株                    |
| 大和冷機工業        | 28,000    | 391   | 10,948,000    |       |                            |
| セガサミーホールディングス | 204,900   | 1,666 | 341,363,400   | 貸付株式数 | 42,800株                    |
| 日本ピストンリング     | 81,000    | 186   | 15,066,000    | 貸付株式数 | 27,000株                    |
| リケン           | 82,000    | 348   | 28,536,000    |       |                            |
| 帝国ピストン        | 25,100    | 947   | 23,769,700    | 貸付株式数 | 4,900株                     |
| ホシザキ電機        | 41,600    | 1,728 | 71,884,800    | 貸付株式数 | 7,500株                     |
| 大豊工業          | 14,400    | 786   | 11,318,400    | 貸付株式数 | 2,800株                     |
| 日本精工          | 460,000   | 802   | 368,920,000   | 貸付株式数 | 40,000株                    |
| NTN           | 478,000   | 469   | 224,182,000   | 貸付株式数 | 86,000株                    |
| ジェイテクト        | 219,400   | 1,192 | 261,524,800   | 貸付株式数 | 23,100株                    |
| 不二越           | 208,000   | 508   | 105,664,000   | 貸付株式数 | 8,000株                     |
| ミネベア          | 307,000   | 438   | 134,466,000   | 貸付株式数 | 55,000株                    |
| 日本トムソン        | 71,000    | 666   | 47,286,000    |       |                            |
| THK           | 137,300   | 2,145 | 294,508,500   | 貸付株式数 | 25,300株                    |
| ユースン精機        | 10,300    | 1,703 | 17,540,900    | 貸付株式数 | 3,300株                     |
| 前澤給装工業        | 7,700     | 1,194 | 9,193,800     |       |                            |
| イーグル工業        | 25,000    | 1,017 | 25,425,000    | 貸付株式数 | 1,000株                     |
| 前澤工業          | 15,100    | 276   | 4,167,600     | 貸付株式数 | 5,300株                     |
| 日本ピラ - 工業     | 22,000    | 635   | 13,970,000    |       |                            |
| キッツ           | 84,900    | 448   | 38,035,200    | 貸付株式数 | 18,000株                    |
| 日立            | 4,638,000 | 483   | 2,240,154,000 | 貸付株式数 | 1,969,000株<br>(1,100,000株) |
| 東芝            | 4,076,000 | 424   | 1,728,224,000 | 貸付株式数 | 334,000株                   |
| 三菱電機          | 2,066,000 | 943   | 1,948,238,000 | 貸付株式数 | 148,000株                   |
| 富士電機          | 622,000   | 260   | 161,720,000   | 貸付株式数 | 120,000株                   |
| 東洋電機製造        | 34,000    | 376   | 12,784,000    | 貸付株式数 | 18,000株<br>(6,000株)        |
| 安川電機          | 227,000   | 909   | 206,343,000   | 貸付株式数 | 45,000株                    |
| シンフォニアテクノロジー  | 124,000   | 268   | 33,232,000    | 貸付株式数 | 66,000株                    |
| 明電舎           | 204,000   | 357   | 72,828,000    | 貸付株式数 | 95,000株                    |
| オリジン電気        | 27,000    | 399   | 10,773,000    | 貸付株式数 | 5,000株                     |
| デンヨー          | 19,300    | 1,066 | 20,573,800    | 貸付株式数 | 9,300株                     |
| 日立工機          | 55,200    | 736   | 40,627,200    |       |                            |
| 三桜工業          | 23,800    | 683   | 16,255,400    | 貸付株式数 | 600株                       |
| マキタ           | 134,700   | 3,870 | 521,289,000   | 貸付株式数 | 4,100株                     |
| 東芝テック         | 129,000   | 356   | 45,924,000    | 貸付株式数 | 5,000株                     |
| 芝浦メカトロニクス     | 35,000    | 317   | 11,095,000    | 貸付株式数 | 13,000株                    |
| マブチモーター       | 28,100    | 4,140 | 116,334,000   | 貸付株式数 | 11,700株<br>(9,700株)        |
| 日本電産          | 102,300   | 7,700 | 787,710,000   | 貸付株式数 | 18,300株                    |
| 高岳製作所         | 82,000    | 256   | 20,992,000    | 貸付株式数 | 43,000株                    |

|              |           |         |               |       |                      |
|--------------|-----------|---------|---------------|-------|----------------------|
| ダイヘン         | 113,000   | 313     | 35,369,000    | 貸付株式数 | 20,000株              |
| JVCケンウッドHD   | 97,200    | 417     | 40,532,400    | 貸付株式数 | 12,300株              |
| 第一精工         | 5,400     | 3,055   | 16,497,000    |       |                      |
| 日新電機         | 33,000    | 750     | 24,750,000    | 貸付株式数 | 6,000株               |
| 大崎電気         | 28,000    | 799     | 22,372,000    | 貸付株式数 | 15,000株              |
| オムロン         | 230,000   | 2,258   | 519,340,000   | 貸付株式数 | 19,800株              |
| 日東工業         | 30,900    | 927     | 28,644,300    | 貸付株式数 | 6,700株               |
| I D E C      | 24,500    | 924     | 22,638,000    |       |                      |
| エルピーダメモリ     | 183,500   | 908     | 166,618,000   | 貸付株式数 | 113,200株             |
| ジーエス・ユアサ コーポ | 398,000   | 556     | 221,288,000   | 貸付株式数 | 161,000株             |
| サクサホールディングス  | 50,000    | 136     | 6,800,000     | 貸付株式数 | 1,000株               |
| メルコホールディングス  | 11,400    | 2,163   | 24,658,200    | 貸付株式数 | 2,000株               |
| テクノメディカ      | 15        | 307,500 | 4,612,500     |       |                      |
| 日本電気         | 2,673,000 | 190     | 507,870,000   |       |                      |
| 富士通          | 1,991,000 | 483     | 961,653,000   | 貸付株式数 | 370,000株             |
| 沖電気          | 751,000   | 82      | 61,582,000    | 貸付株式数 | 2,000株               |
| 岩崎通信機        | 91,000    | 87      | 7,917,000     |       |                      |
| 電気興業         | 60,000    | 358     | 21,480,000    |       |                      |
| サンケン電気       | 121,000   | 478     | 57,838,000    | 貸付株式数 | 22,000株              |
| ナカヨ通信機       | 20,000    | 190     | 3,800,000     |       |                      |
| アイホン         | 13,300    | 1,496   | 19,896,800    |       |                      |
| ルネサスエレクトロニクス | 53,500    | 712     | 38,092,000    | 貸付株式数 | 32,500株<br>(14,400株) |
| セイコーエプソン     | 141,000   | 1,387   | 195,567,000   | 貸付株式数 | 22,800株              |
| ワコム          | 406       | 95,800  | 38,894,800    | 貸付株式数 | 141株                 |
| アルバック        | 38,000    | 1,963   | 74,594,000    | 貸付株式数 | 7,500株               |
| アクセル         | 7,800     | 1,590   | 12,402,000    | 貸付株式数 | 2,500株               |
| ピクセラ         | 8,500     | 235     | 1,997,500     | 貸付株式数 | 2,500株               |
| ナナオ          | 17,300    | 1,582   | 27,368,600    |       |                      |
| 日本信号         | 48,100    | 609     | 29,292,900    |       |                      |
| 京三製作所        | 43,000    | 468     | 20,124,000    |       |                      |
| 能美防災         | 26,000    | 505     | 13,130,000    |       |                      |
| ホーチキ         | 19,000    | 412     | 7,828,000     |       |                      |
| マスプロ電工       | 14,300    | 668     | 9,552,400     |       |                      |
| 日本無線         | 62,000    | 240     | 14,880,000    | 貸付株式数 | 28,000株              |
| パナソニック       | 2,405,000 | 1,009   | 2,426,645,000 | 貸付株式数 | 478,100株             |
| シャープ         | 926,000   | 756     | 700,056,000   | 貸付株式数 | 182,000株             |
| アンリツ         | 90,000    | 721     | 64,890,000    | 貸付株式数 | 53,000株              |
| 富士通ゼネラル      | 48,000    | 538     | 25,824,000    | 貸付株式数 | 27,000株              |
| 日立国際電気       | 46,000    | 651     | 29,946,000    | 貸付株式数 | 26,000株              |
| ソニー          | 1,159,700 | 2,207   | 2,559,457,900 | 貸付株式数 | 202,500株             |
| T D K        | 116,300   | 4,530   | 526,839,000   | 貸付株式数 | 19,600株              |
| 帝国通信工業       | 47,000    | 155     | 7,285,000     | 貸付株式数 | 10,000株              |
| 宮越商事         | 5,700     | 264     | 1,504,800     | 貸付株式数 | 2,100株               |
| ミツミ電機        | 72,900    | 860     | 62,694,000    | 貸付株式数 | 12,100株              |
| タムラ製作所       | 60,000    | 260     | 15,600,000    | 貸付株式数 | 31,000株              |
| アルプス電気       | 163,000   | 848     | 138,224,000   | 貸付株式数 | 9,800株               |
| 池上通信機        | 62,000    | 68      | 4,216,000     | 貸付株式数 | 33,000株              |
| パイオニア        | 292,800   | 387     | 113,313,600   | 貸付株式数 | 23,500株              |
| 日本電波工業       | 16,000    | 1,105   | 17,680,000    | 貸付株式数 | 6,100株               |
| 日本トリム        | 2,300     | 2,175   | 5,002,500     | 貸付株式数 | 500株                 |
| ローランド ディー・ジー | 9,100     | 1,105   | 10,055,500    |       |                      |
| 日本コロムビア      | 166,000   | 35      | 5,810,000     | 貸付株式数 | 59,000株              |
| 山水電気         | 1,320,000 | 2       | 2,640,000     |       |                      |
| フオスタ - 電機    | 19,400    | 1,580   | 30,652,000    | 貸付株式数 | 3,300株               |

|              |         |        |               |       |                      |
|--------------|---------|--------|---------------|-------|----------------------|
| クラリオン        | 109,000 | 154    | 16,786,000    | 貸付株式数 | 43,000株<br>(37,000株) |
| S M K        | 58,000  | 357    | 20,706,000    | 貸付株式数 | 6,000株               |
| ヨコオ          | 17,200  | 504    | 8,668,800     | 貸付株式数 | 1,000株               |
| 東 光          | 90,000  | 191    | 17,190,000    | 貸付株式数 | 47,000株              |
| ティアック        | 111,000 | 36     | 3,996,000     |       |                      |
| ホシデン         | 51,300  | 722    | 37,038,600    |       |                      |
| ヒロセ電機        | 33,200  | 8,230  | 273,236,000   | 貸付株式数 | 6,600株               |
| 日本航空電子       | 46,000  | 585    | 26,910,000    | 貸付株式数 | 19,000株              |
| T O A        | 24,000  | 519    | 12,456,000    |       |                      |
| ユニデン         | 58,000  | 352    | 20,416,000    | 貸付株式数 | 1,000株               |
| アルパイン        | 40,300  | 1,165  | 46,949,500    | 貸付株式数 | 7,900株               |
| スミダコーポレーション  | 12,800  | 771    | 9,868,800     |       |                      |
| アイコム         | 11,400  | 2,085  | 23,769,000    | 貸付株式数 | 2,200株               |
| 船井電機         | 18,400  | 2,210  | 40,664,000    | 貸付株式数 | 9,500株               |
| 横河電機         | 206,700 | 722    | 149,237,400   | 貸付株式数 | 40,600株              |
| 新電元工業        | 73,000  | 373    | 27,229,000    | 貸付株式数 | 13,000株              |
| 山武           | 57,800  | 1,802  | 104,155,600   | 貸付株式数 | 4,900株               |
| 日本光電工業       | 38,200  | 2,051  | 78,348,200    | 貸付株式数 | 6,900株               |
| チ ノ ー        | 37,000  | 233    | 8,621,000     |       |                      |
| 共和電業         | 21,000  | 277    | 5,817,000     |       |                      |
| 日本電子材料       | 8,800   | 482    | 4,241,600     |       |                      |
| 堀場製作所        | 35,900  | 2,662  | 95,565,800    | 貸付株式数 | 3,200株               |
| アドバンテスト      | 140,800 | 1,570  | 221,056,000   | 貸付株式数 | 27,600株              |
| 小野測器         | 22,000  | 230    | 5,060,000     |       |                      |
| エスベック        | 21,400  | 605    | 12,947,000    |       |                      |
| パナソニック電工SUNX | 18,100  | 500    | 9,050,000     |       |                      |
| キーエンス        | 46,100  | 22,560 | 1,040,016,000 | 貸付株式数 | 2,900株               |
| 日置電機         | 9,900   | 1,605  | 15,889,500    |       |                      |
| シスメックス       | 72,200  | 3,020  | 218,044,000   | 貸付株式数 | 10,800株              |
| メガチップス       | 18,500  | 1,298  | 24,013,000    | 貸付株式数 | 2,400株               |
| O B A R A    | 14,700  | 1,170  | 17,199,000    | 貸付株式数 | 2,900株               |
| 日本電産コパル電子    | 21,300  | 558    | 11,885,400    |       |                      |
| ミヤチテクノス      | 10,000  | 655    | 6,550,000     | 貸付株式数 | 400株                 |
| 東京電波         | 5,800   | 570    | 3,306,000     | 貸付株式数 | 1,900株               |
| 澤藤電機         | 11,000  | 282    | 3,102,000     |       |                      |
| デンソー         | 453,600 | 2,923  | 1,325,872,800 | 貸付株式数 | 9,600株               |
| コーセル         | 30,000  | 1,400  | 42,000,000    | 貸付株式数 | 12,200株              |
| 日立メディコ       | 15,000  | 972    | 14,580,000    | 貸付株式数 | 2,000株               |
| 新日本無線        | 15,000  | 215    | 3,225,000     | 貸付株式数 | 5,000株               |
| オプテックス       | 14,200  | 1,050  | 14,910,000    |       |                      |
| 千代田インテグレ     | 8,700   | 1,081  | 9,404,700     |       |                      |
| 東光電気         | 12,000  | 371    | 4,452,000     | 貸付株式数 | 3,000株               |
| スタンレー電気      | 139,600 | 1,409  | 196,696,400   | 貸付株式数 | 3,100株               |
| 岩崎電気         | 75,000  | 247    | 18,525,000    | 貸付株式数 | 6,000株               |
| ウシオ電機        | 125,400 | 1,548  | 194,119,200   | 貸付株式数 | 20,900株              |
| 岡谷電機         | 11,000  | 397    | 4,367,000     |       |                      |
| ヘリオステクノH     | 18,900  | 219    | 4,139,100     |       |                      |
| 日本セラミック      | 13,500  | 1,650  | 22,275,000    | 貸付株式数 | 4,800株               |
| 新神戸電機        | 16,000  | 1,283  | 20,528,000    | 貸付株式数 | 8,000株<br>(4,000株)   |
| 日本デジタル研究所    | 17,300  | 979    | 16,936,700    | 貸付株式数 | 300株                 |
| 古河電池         | 15,000  | 582    | 8,730,000     | 貸付株式数 | 2,000株               |
| 双信電機         | 10,000  | 488    | 4,880,000     | 貸付株式数 | 200株                 |
| 山一電機         | 20,900  | 272    | 5,684,800     | 貸付株式数 | 3,600株               |

|          |           |        |               |       |                      |
|----------|-----------|--------|---------------|-------|----------------------|
| 図 研      | 11,900    | 581    | 6,913,900     |       |                      |
| 日本電子     | 76,000    | 268    | 20,368,000    | 貸付株式数 | 29,000株              |
| カ シ オ    | 196,800   | 586    | 115,324,800   | 貸付株式数 | 109,000株             |
| ファナック    | 215,000   | 14,200 | 3,053,000,000 | 貸付株式数 | 59,200株<br>(20,000株) |
| 日本シイエムケイ | 40,400    | 316    | 12,766,400    |       |                      |
| エンプラス    | 10,400    | 1,143  | 11,887,200    | 貸付株式数 | 5,200株               |
| ロ ー ム    | 101,800   | 4,735  | 482,023,000   | 貸付株式数 | 3,000株               |
| 浜松ホトニクス  | 80,600    | 3,520  | 283,712,000   | 貸付株式数 | 4,400株               |
| 三井ハイテック  | 24,500    | 420    | 10,290,000    |       |                      |
| 新光電気工業   | 52,000    | 770    | 40,040,000    | 貸付株式数 | 18,700株              |
| 京 セ ラ    | 171,800   | 8,480  | 1,456,864,000 | 貸付株式数 | 1,300株               |
| 協栄産業     | 22,000    | 157    | 3,454,000     |       |                      |
| 太陽誘電     | 93,000    | 1,071  | 99,603,000    | 貸付株式数 | 22,000株              |
| 村田製作所    | 216,700   | 5,420  | 1,174,514,000 | 貸付株式数 | 33,500株              |
| ユーシン     | 24,800    | 720    | 17,856,000    |       |                      |
| 双葉電子工業   | 35,300    | 1,483  | 52,349,900    | 貸付株式数 | 1,900株               |
| 日東電工     | 178,300   | 4,190  | 747,077,000   | 貸付株式数 | 18,400株              |
| 北陸電気工業   | 83,000    | 166    | 13,778,000    |       |                      |
| 東海理化電機   | 48,300    | 1,544  | 74,575,200    | 貸付株式数 | 13,900株              |
| ニチコン     | 65,000    | 1,316  | 85,540,000    | 貸付株式数 | 34,500株              |
| 日本ケミコン   | 128,000   | 504    | 64,512,000    | 貸付株式数 | 22,000株              |
| K O A    | 26,000    | 950    | 24,700,000    |       |                      |
| 三井造船     | 799,000   | 177    | 141,423,000   | 貸付株式数 | 282,000株             |
| 日立造船     | 868,000   | 127    | 110,236,000   | 貸付株式数 | 89,000株<br>(88,500株) |
| 佐世保重工業   | 135,000   | 149    | 20,115,000    |       |                      |
| 三菱重工業    | 3,462,000 | 384    | 1,329,408,000 | 貸付株式数 | 186,000株             |
| 川崎重工業    | 1,607,000 | 317    | 509,419,000   | 貸付株式数 | 294,000株             |
| I H I    | 1,411,000 | 212    | 299,132,000   | 貸付株式数 | 266,000株             |
| 日本車輛     | 75,000    | 358    | 26,850,000    | 貸付株式数 | 28,000株              |
| 日本輸送機    | 23,000    | 211    | 4,853,000     | 貸付株式数 | 7,000株               |
| 近畿車輛     | 30,000    | 323    | 9,690,000     | 貸付株式数 | 5,000株               |
| 日産自動車    | 2,609,200 | 870    | 2,270,004,000 | 貸付株式数 | 385,700株             |
| いすゞ自動車   | 1,197,000 | 388    | 464,436,000   | 貸付株式数 | 458,000株             |
| トヨタ自動車   | 2,653,400 | 3,445  | 9,140,963,000 | 貸付株式数 | 112,000株             |
| 日野自動車    | 258,000   | 477    | 123,066,000   | 貸付株式数 | 77,000株              |
| 三菱自動車工業  | 4,262,000 | 106    | 451,772,000   | 貸付株式数 | 1,437,000株           |
| エフテック    | 7,200     | 1,296  | 9,331,200     | 貸付株式数 | 600株                 |
| 武蔵精密工業   | 19,800    | 2,175  | 43,065,000    | 貸付株式数 | 3,600株               |
| トヨタ車体    | 37,500    | 1,349  | 50,587,500    |       |                      |
| 日産車体     | 81,000    | 616    | 49,896,000    | 貸付株式数 | 16,000株              |
| 関東自動車    | 31,300    | 780    | 24,414,000    | 貸付株式数 | 6,200株               |
| 新明和工業    | 92,000    | 328    | 30,176,000    | 貸付株式数 | 3,000株               |
| 極東開発工業   | 38,400    | 467    | 17,932,800    |       |                      |
| 日信工業     | 42,000    | 1,474  | 61,908,000    | 貸付株式数 | 4,800株               |
| トピー工業    | 169,000   | 225    | 38,025,000    | 貸付株式数 | 54,000株              |
| ティラド     | 73,000    | 382    | 27,886,000    | 貸付株式数 | 34,000株<br>(22,000株) |
| 曙ブレーキ    | 95,900    | 443    | 42,483,700    | 貸付株式数 | 56,500株              |
| タチエス     | 27,000    | 1,517  | 40,959,000    | 貸付株式数 | 4,100株               |
| N O K    | 99,900    | 1,404  | 140,259,600   | 貸付株式数 | 51,800株              |
| フタバ産業    | 58,300    | 588    | 34,280,400    |       |                      |
| カヤバ工業    | 129,000   | 618    | 79,722,000    | 貸付株式数 | 75,000株              |
| シロキ工業    | 45,000    | 281    | 12,645,000    | 貸付株式数 | 24,000株              |

|            |           |       |               |       |                    |
|------------|-----------|-------|---------------|-------|--------------------|
| 市光工業       | 48,000    | 202   | 9,696,000     | 貸付株式数 | 5,000株             |
| 大同メタル工業    | 30,000    | 821   | 24,630,000    | 貸付株式数 | 5,000株             |
| プレス工業      | 95,000    | 406   | 38,570,000    | 貸付株式数 | 19,000株            |
| カルソニックカンセイ | 105,000   | 495   | 51,975,000    | 貸付株式数 | 61,000株            |
| 太平洋工業      | 41,000    | 407   | 16,687,000    | 貸付株式数 | 8,000株             |
| ケーヒン       | 42,700    | 1,772 | 75,664,400    | 貸付株式数 | 7,500株             |
| 河西工業       | 24,000    | 542   | 13,008,000    | 貸付株式数 | 5,000株             |
| アイシン精機     | 170,100   | 3,125 | 531,562,500   |       |                    |
| 富士機工       | 23,000    | 326   | 7,498,000     | 貸付株式数 | 7,000株             |
| マ ッ ダ      | 1,598,000 | 222   | 354,756,000   | 貸付株式数 | 766,000株           |
| ダイハツ       | 219,000   | 1,314 | 287,766,000   | 貸付株式数 | 23,000株            |
| 愛知機械       | 45,000    | 318   | 14,310,000    | 貸付株式数 | 1,000株             |
| 今仙電機製作所    | 14,000    | 1,117 | 15,638,000    | 貸付株式数 | 8,200株<br>(5,300株) |
| 本田技研       | 1,742,500 | 3,260 | 5,680,550,000 | 貸付株式数 | 4,900株             |
| スズキ        | 431,800   | 1,871 | 807,897,800   | 貸付株式数 | 75,200株            |
| 富士重工業      | 653,000   | 640   | 417,920,000   | 貸付株式数 | 60,000株            |
| ヤマハ発動機     | 315,600   | 1,545 | 487,602,000   | 貸付株式数 | 44,600株            |
| ショーワ       | 43,900    | 587   | 25,769,300    | 貸付株式数 | 25,800株            |
| 小糸製作所      | 103,000   | 1,378 | 141,934,000   | 貸付株式数 | 13,000株            |
| T B K      | 20,000    | 480   | 9,600,000     |       |                    |
| エクセディ      | 24,900    | 2,809 | 69,944,100    | 貸付株式数 | 9,100株             |
| ミツバ        | 36,000    | 775   | 27,900,000    | 貸付株式数 | 7,000株             |
| 豊田合成       | 58,300    | 1,834 | 106,922,200   | 貸付株式数 | 10,600株            |
| 愛三工業       | 24,900    | 819   | 20,393,100    | 貸付株式数 | 4,200株             |
| ヨ ロ ズ      | 12,400    | 1,790 | 22,196,000    | 貸付株式数 | 4,500株<br>(4,500株) |
| エフ・シー・シー   | 30,400    | 1,935 | 58,824,000    | 貸付株式数 | 5,300株             |
| 新家工業       | 45,000    | 129   | 5,805,000     |       |                    |
| シマノ        | 78,200    | 4,375 | 342,125,000   | 貸付株式数 | 800株               |
| タカタ        | 32,000    | 2,502 | 80,064,000    | 貸付株式数 | 6,200株             |
| テイ・エス テック  | 39,200    | 1,542 | 60,446,400    |       |                    |
| 小 野 建      | 17,600    | 731   | 12,865,600    |       |                    |
| はるやま商事     | 9,500     | 453   | 4,303,500     |       |                    |
| 佐鳥電機       | 15,000    | 514   | 7,710,000     |       |                    |
| カッパクリエイト   | 14,950    | 1,685 | 25,190,750    | 貸付株式数 | 4,900株             |
| エコートレーディング | 4,900     | 770   | 3,773,000     | 貸付株式数 | 1,600株             |
| 伯東         | 12,400    | 805   | 9,982,000     |       |                    |
| コンドーテック    | 7,200     | 941   | 6,775,200     |       |                    |
| 中山福        | 11,700    | 600   | 7,020,000     |       |                    |
| ライトオン      | 15,200    | 439   | 6,672,800     |       |                    |
| ナガイレーベン    | 11,400    | 2,375 | 27,075,000    | 貸付株式数 | 4,200株             |
| ジーンズメイト    | 6,200     | 231   | 1,432,200     |       |                    |
| 三菱食品       | 19,500    | 1,900 | 37,050,000    |       |                    |
| 良品計画       | 23,400    | 3,915 | 91,611,000    | 貸付株式数 | 8,400株             |
| 三城ホールディングス | 25,200    | 770   | 19,404,000    | 貸付株式数 | 8,300株             |
| 松田産業       | 14,800    | 1,217 | 18,011,600    | 貸付株式数 | 500株               |
| メディパルHD    | 188,200   | 758   | 142,655,600   | 貸付株式数 | 27,800株            |
| アドヴァン      | 12,100    | 749   | 9,062,900     |       |                    |
| S P K      | 4,300     | 1,290 | 5,547,000     |       |                    |
| アズワン       | 13,300    | 1,665 | 22,144,500    |       |                    |
| スズデン       | 6,200     | 506   | 3,137,200     |       |                    |
| 尾家産業       | 6,200     | 792   | 4,910,400     |       |                    |
| シモジマ       | 14,000    | 1,100 | 15,400,000    |       |                    |
| ドウシシャ      | 9,600     | 2,178 | 20,908,800    | 貸付株式数 | 1,000株             |

|               |         |         |             |       |                    |
|---------------|---------|---------|-------------|-------|--------------------|
| コナカ           | 24,000  | 383     | 9,192,000   |       |                    |
| 高速            | 12,100  | 629     | 7,610,900   |       |                    |
| ハウス ローゼ       | 2,000   | 1,241   | 2,482,000   |       |                    |
| G - 7ホールディングス | 5,000   | 400     | 2,000,000   |       |                    |
| イオン北海道        | 14,800  | 339     | 5,017,200   |       |                    |
| コジマ           | 25,000  | 538     | 13,450,000  | 貸付株式数 | 11,800株            |
| コーナン商事        | 19,600  | 1,535   | 30,086,000  | 貸付株式数 | 8,000株             |
| 黒田電気          | 27,200  | 939     | 25,540,800  |       |                    |
| ネットワンシステムズ    | 496     | 155,000 | 76,880,000  | 貸付株式数 | 37株                |
| エコス           | 6,900   | 456     | 3,146,400   |       |                    |
| ワタミ           | 24,100  | 1,674   | 40,343,400  | 貸付株式数 | 9,900株             |
| マルシェ          | 5,100   | 700     | 3,570,000   |       |                    |
| ドン・キホーテ       | 39,500  | 2,755   | 108,822,500 | 貸付株式数 | 17,900株            |
| 丸文            | 16,200  | 398     | 6,447,600   |       |                    |
| メガネトップ        | 21,400  | 943     | 20,180,200  | 貸付株式数 | 3,400株             |
| 西松屋チェーン       | 44,600  | 684     | 30,506,400  |       |                    |
| ゼンショー         | 77,700  | 986     | 76,612,200  | 貸付株式数 | 42,300株            |
| ハピネット         | 5,200   | 981     | 5,101,200   |       |                    |
| 幸楽苑           | 12,500  | 1,129   | 14,112,500  | 貸付株式数 | 4,300株<br>(4,300株) |
| トーマンエレクトロニクス  | 8,300   | 1,067   | 8,856,100   |       |                    |
| ハークスレイ        | 5,400   | 549     | 2,964,600   |       |                    |
| サイゼリヤ         | 27,200  | 1,550   | 42,160,000  | 貸付株式数 | 7,500株<br>(3,400株) |
| エクセル          | 9,900   | 823     | 8,147,700   |       |                    |
| マルカキカイ        | 6,200   | 640     | 3,968,000   |       |                    |
| アルゴグラフィックス    | 7,400   | 1,090   | 8,066,000   |       |                    |
| ガリバーインターナショナル | 5,480   | 3,700   | 20,276,000  | 貸付株式数 | 820株               |
| 日本エム・ディ・エム    | 16,900  | 200     | 3,380,000   |       |                    |
| ポプラ           | 5,500   | 441     | 2,425,500   | 貸付株式数 | 1,900株             |
| ユナイテッドアローズ    | 19,000  | 1,646   | 31,274,000  | 貸付株式数 | 5,300株<br>(1,000株) |
| 進和            | 11,200  | 920     | 10,304,000  |       |                    |
| エスケイジャパン      | 4,700   | 264     | 1,240,800   |       |                    |
| ダイトエレクトロン     | 8,800   | 681     | 5,992,800   |       |                    |
| ハイデイ日高        | 8,900   | 1,242   | 11,053,800  |       |                    |
| シークス          | 12,900  | 1,218   | 15,712,200  |       |                    |
| 京都きもの友禅       | 13,000  | 912     | 11,856,000  | 貸付株式数 | 5,500株             |
| コロワイド         | 67,500  | 486     | 32,805,000  | 貸付株式数 | 26,000株            |
| 田中商事          | 5,900   | 521     | 3,073,900   | 貸付株式数 | 3,300株             |
| オーハシテクニカ      | 11,300  | 642     | 7,254,600   |       |                    |
| 壱番屋           | 8,200   | 2,544   | 20,860,800  | 貸付株式数 | 2,900株<br>(2,900株) |
| マクニカ          | 9,300   | 1,826   | 16,981,800  | 貸付株式数 | 3,400株             |
| 白銅            | 6,200   | 824     | 5,108,800   |       |                    |
| トップカルチャー      | 7,300   | 368     | 2,686,400   |       |                    |
| スギホールディングス    | 32,400  | 2,110   | 68,364,000  | 貸付株式数 | 18,000株            |
| 島津製作所         | 247,000 | 733     | 181,051,000 | 貸付株式数 | 18,000株            |
| J M S         | 29,000  | 283     | 8,207,000   |       |                    |
| クボテック         | 43      | 35,200  | 1,513,600   | 貸付株式数 | 9株                 |
| モリテックス        | 4,400   | 390     | 1,716,000   | 貸付株式数 | 100株               |
| 長野計器          | 13,500  | 729     | 9,841,500   |       |                    |
| ブイ・テクノロジー     | 27      | 647,000 | 17,469,000  | 貸付株式数 | 15株                |
| スター精密         | 37,000  | 872     | 32,264,000  |       |                    |
| 東京計器          | 71,000  | 119     | 8,449,000   |       |                    |

|                |           |         |               |       |                     |
|----------------|-----------|---------|---------------|-------|---------------------|
| 愛知時計           | 22,000    | 277     | 6,094,000     |       |                     |
| 日本電産トソク        | 12,300    | 936     | 11,512,800    | 貸付株式数 | 6,600株              |
| 東京精密           | 39,700    | 1,583   | 62,845,100    | 貸付株式数 | 15,800株             |
| ニコン            | 359,900   | 1,925   | 692,807,500   | 貸付株式数 | 211,900株            |
| トプコン           | 47,600    | 447     | 21,277,200    | 貸付株式数 | 23,300株             |
| オリンパス          | 243,600   | 2,743   | 668,194,800   | 貸付株式数 | 143,400株            |
| 理研計器           | 16,600    | 719     | 11,935,400    |       |                     |
| 大日本スクリーン       | 228,000   | 713     | 162,564,000   | 貸付株式数 | 122,000株            |
| キヤノン電子         | 18,800    | 2,202   | 41,397,600    |       |                     |
| タムロン           | 18,100    | 1,893   | 34,263,300    | 貸付株式数 | 2,900株              |
| HOYA           | 474,300   | 1,885   | 894,055,500   | 貸付株式数 | 65,300株             |
| ノーリツ鋼機         | 18,500    | 451     | 8,343,500     |       |                     |
| エー・アンド・デイ      | 19,800    | 393     | 7,781,400     | 貸付株式数 | 600株                |
| キヤノン           | 1,283,000 | 3,920   | 5,029,360,000 | 貸付株式数 | 23,100株             |
| リコー            | 621,000   | 926     | 575,046,000   | 貸付株式数 | 12,000株             |
| 日本電産コパル        | 16,100    | 992     | 15,971,200    | 貸付株式数 | 2,900株              |
| 日本電産サンキョー      | 48,000    | 556     | 26,688,000    |       |                     |
| シチズンホールディングス   | 224,700   | 491     | 110,327,700   | 貸付株式数 | 44,100株             |
| リズム時計          | 102,000   | 119     | 12,138,000    |       |                     |
| 大研医器           | 2,200     | 891     | 1,960,200     |       |                     |
| SRIスポーツ        | 13,000    | 862     | 11,206,000    |       |                     |
| バンダイナムコHLDGS   | 230,900   | 980     | 226,282,000   | 貸付株式数 | 44,100株             |
| 共立印刷           | 18,800    | 145     | 2,726,000     |       |                     |
| フランスベッドHLDGS   | 138,000   | 103     | 14,214,000    |       |                     |
| パイロットコーポレーション  | 180       | 155,700 | 28,026,000    |       |                     |
| エイベックス・グループHD  | 38,500    | 1,084   | 41,734,000    |       |                     |
| トッパン・フォームズ     | 44,200    | 663     | 29,304,600    |       |                     |
| フジシールインターナショナル | 21,200    | 1,795   | 38,054,000    | 貸付株式数 | 3,800株              |
| タカラトミー         | 61,800    | 729     | 45,052,200    | 貸付株式数 | 12,000株             |
| 廣済堂            | 16,000    | 237     | 3,792,000     |       |                     |
| アーク            | 69,900    | 92      | 6,430,800     | 貸付株式数 | 23,700株             |
| レック            | 5,400     | 1,405   | 7,587,000     |       |                     |
| タカノ            | 8,100     | 492     | 3,985,200     |       |                     |
| プロネクサス         | 22,700    | 397     | 9,011,900     |       |                     |
| ホクシン           | 14,500    | 138     | 2,001,000     |       |                     |
| ウッドワン          | 33,000    | 305     | 10,065,000    |       |                     |
| 大建工業           | 84,000    | 274     | 23,016,000    |       |                     |
| きもと            | 19,100    | 766     | 14,630,600    | 貸付株式数 | 3,400株              |
| 凸版印刷           | 582,000   | 643     | 374,226,000   | 貸付株式数 | 47,000株             |
| 大日本印刷          | 629,000   | 949     | 596,921,000   | 貸付株式数 | 26,000株             |
| 図書印刷           | 31,000    | 149     | 4,619,000     |       |                     |
| 共同印刷           | 60,000    | 198     | 11,880,000    |       |                     |
| 日本写真印刷         | 37,500    | 1,557   | 58,387,500    | 貸付株式数 | 16,400株<br>(5,100株) |
| 光村印刷           | 19,000    | 259     | 4,921,000     |       |                     |
| 藤森工業           | 15,500    | 1,162   | 18,011,000    |       |                     |
| 宝印刷            | 11,600    | 620     | 7,192,000     |       |                     |
| 前澤化成工業         | 15,100    | 796     | 12,019,600    |       |                     |
| アシックス          | 191,000   | 1,198   | 228,818,000   | 貸付株式数 | 59,200株             |
| ツツミ            | 9,000     | 1,955   | 17,595,000    | 貸付株式数 | 200株                |
| ジェイエスピー        | 14,100    | 1,364   | 19,232,400    | 貸付株式数 | 500株                |
| ニチハ            | 21,500    | 726     | 15,609,000    | 貸付株式数 | 11,400株             |
| ローランド          | 19,500    | 772     | 15,054,000    | 貸付株式数 | 500株                |
| エフピコ           | 10,600    | 5,140   | 54,484,000    | 貸付株式数 | 4,200株              |
| 小松ウオール工業       | 7,700     | 794     | 6,113,800     |       |                     |

|                |           |        |               |       |                      |
|----------------|-----------|--------|---------------|-------|----------------------|
| ヤマハ            | 164,500   | 949    | 156,110,500   | 貸付株式数 | 19,100株              |
| 河合楽器           | 77,000    | 170    | 13,090,000    |       |                      |
| クリナップ          | 21,100    | 528    | 11,140,800    |       |                      |
| ピジョン           | 14,300    | 2,727  | 38,996,100    | 貸付株式数 | 2,300株               |
| 天馬             | 19,000    | 831    | 15,789,000    |       |                      |
| パラマウントベッド      | 16,200    | 2,247  | 36,401,400    | 貸付株式数 | 500株                 |
| 兼松日産農林         | 30,000    | 162    | 4,860,000     | 貸付株式数 | 13,000株<br>(11,000株) |
| キングジム          | 17,000    | 625    | 10,625,000    | 貸付株式数 | 400株                 |
| リンテック          | 44,200    | 2,264  | 100,068,800   | 貸付株式数 | 25,900株              |
| 田崎真珠           | 36,000    | 61     | 2,196,000     | 貸付株式数 | 11,000株              |
| 信越ポリマー         | 42,400    | 443    | 18,783,200    |       |                      |
| 東リ             | 53,000    | 172    | 9,116,000     |       |                      |
| イトーキ           | 43,600    | 188    | 8,196,800     |       |                      |
| 任天堂            | 118,100   | 16,470 | 1,945,107,000 | 貸付株式数 | 9,800株               |
| 三菱鉛筆           | 17,400    | 1,467  | 25,525,800    |       |                      |
| タカラスタンダード      | 95,000    | 613    | 58,235,000    |       |                      |
| コクヨ            | 107,300   | 605    | 64,916,500    | 貸付株式数 | 1,600株               |
| ナカバヤシ          | 43,000    | 216    | 9,288,000     | 貸付株式数 | 25,000株<br>(16,000株) |
| ニフコ            | 41,400    | 2,132  | 88,264,800    | 貸付株式数 | 17,800株              |
| グローブライド        | 92,000    | 93     | 8,556,000     |       |                      |
| 岡村製作所          | 79,000    | 539    | 42,581,000    | 貸付株式数 | 26,000株              |
| 日本バルカー         | 90,000    | 251    | 22,590,000    |       |                      |
| MUTOHホールディングス  | 24,000    | 180    | 4,320,000     | 貸付株式数 | 8,000株               |
| 伊藤忠            | 1,422,900 | 880    | 1,252,152,000 | 貸付株式数 | 192,200株             |
| 丸紅             | 1,783,000 | 571    | 1,018,093,000 | 貸付株式数 | 215,000株             |
| スクロール          | 28,600    | 271    | 7,750,600     |       |                      |
| 高島             | 33,000    | 262    | 8,646,000     | 貸付株式数 | 11,000株              |
| F&Aアクアホールディングス | 15,500    | 790    | 12,245,000    |       |                      |
| 三陽商会           | 105,000   | 244    | 25,620,000    | 貸付株式数 | 20,000株              |
| 長瀬産業           | 115,400   | 999    | 115,284,600   | 貸付株式数 | 3,700株               |
| ナイガイ           | 57,000    | 36     | 2,052,000     | 貸付株式数 | 2,000株               |
| 蝶理             | 138,000   | 101    | 13,938,000    |       |                      |
| 豊田通商           | 227,100   | 1,431  | 324,980,100   | 貸付株式数 | 26,500株              |
| オンワ-ドホールディングス  | 144,000   | 691    | 99,504,000    | 貸付株式数 | 26,000株              |
| 三共生興           | 34,600    | 278    | 9,618,800     |       |                      |
| 兼松             | 461,000   | 81     | 37,341,000    | 貸付株式数 | 61,000株              |
| 美津濃            | 102,000   | 377    | 38,454,000    | 貸付株式数 | 1,000株               |
| ツカモトコーポレーション   | 34,000    | 91     | 3,094,000     | 貸付株式数 | 12,000株              |
| ファミリーマート       | 68,900    | 2,956  | 203,668,400   | 貸付株式数 | 4,600株               |
| ルック            | 34,000    | 135    | 4,590,000     | 貸付株式数 | 4,000株               |
| 三井物産           | 1,759,600 | 1,434  | 2,523,266,400 | 貸付株式数 | 128,800株             |
| 日本紙バルブ         | 116,000   | 289    | 33,524,000    |       |                      |
| 東京エレクトロン       | 162,200   | 4,565  | 740,443,000   | 貸付株式数 | 3,400株               |
| 日立ハイテクノロジーズ    | 61,800    | 1,807  | 111,672,600   | 貸付株式数 | 26,300株              |
| カメイ            | 23,000    | 356    | 8,188,000     | 貸付株式数 | 5,000株               |
| 東都水産           | 32,000    | 136    | 4,352,000     |       |                      |
| スターゼン          | 68,000    | 245    | 16,660,000    |       |                      |
| セイコーHD         | 108,000   | 275    | 29,700,000    | 貸付株式数 | 19,000株              |
| 山善             | 78,200    | 596    | 46,607,200    | 貸付株式数 | 25,400株              |
| 椿本興業           | 20,000    | 220    | 4,400,000     |       |                      |
| 住友商事           | 1,122,800 | 1,117  | 1,254,167,600 | 貸付株式数 | 204,800株             |
| 日本ユニシス         | 56,300    | 489    | 27,530,700    | 貸付株式数 | 1,300株               |
| 内田洋行           | 43,000    | 261    | 11,223,000    |       |                      |

|                |           |       |               |       |                      |
|----------------|-----------|-------|---------------|-------|----------------------|
| 三菱商事           | 1,590,400 | 2,099 | 3,338,249,600 | 貸付株式数 | 129,900株             |
| 第一実業           | 43,000    | 451   | 19,393,000    | 貸付株式数 | 9,000株               |
| キャノンマーケティングJPN | 67,800    | 943   | 63,935,400    | 貸付株式数 | 26,600株<br>(26,600株) |
| 西華産業           | 76,000    | 216   | 16,416,000    |       |                      |
| 佐藤商事           | 18,100    | 490   | 8,869,000     |       |                      |
| 菱洋エレクトロ        | 24,800    | 835   | 20,708,000    |       |                      |
| 東京産業           | 19,000    | 261   | 4,959,000     |       |                      |
| ユアサ商事          | 208,000   | 132   | 27,456,000    | 貸付株式数 | 61,000株              |
| 神鋼商事           | 49,000    | 198   | 9,702,000     |       |                      |
| 阪和興業           | 189,000   | 364   | 68,796,000    | 貸付株式数 | 17,000株              |
| カナデン           | 20,000    | 531   | 10,620,000    |       |                      |
| 菱電商事           | 31,000    | 524   | 16,244,000    |       |                      |
| ニプロ            | 41,000    | 1,503 | 61,623,000    | 貸付株式数 | 22,400株              |
| フルサト工業         | 12,000    | 566   | 6,792,000     |       |                      |
| 岩谷産業           | 226,000   | 288   | 65,088,000    | 貸付株式数 | 37,000株              |
| すてきナイスグループ     | 89,000    | 165   | 14,685,000    |       |                      |
| 昭光通商           | 72,000    | 116   | 8,352,000     | 貸付株式数 | 23,000株              |
| ニチモウ           | 28,000    | 145   | 4,060,000     |       |                      |
| 極東貿易           | 24,000    | 240   | 5,760,000     | 貸付株式数 | 12,000株              |
| イワキ            | 21,000    | 220   | 4,620,000     |       |                      |
| 兼松エレクトロニクス     | 12,900    | 847   | 10,926,300    |       |                      |
| 三愛石油           | 47,000    | 470   | 22,090,000    |       |                      |
| 稲畑産業           | 54,300    | 512   | 27,801,600    |       |                      |
| G S Iクレオス      | 52,000    | 124   | 6,448,000     | 貸付株式数 | 28,000株              |
| 明和産業           | 16,100    | 281   | 4,524,100     |       |                      |
| ゴールドウイン        | 47,000    | 263   | 12,361,000    | 貸付株式数 | 6,000株               |
| ユニ・チャーム        | 119,400   | 3,530 | 421,482,000   | 貸付株式数 | 23,400株              |
| デサント           | 52,000    | 400   | 20,800,000    |       |                      |
| ヤマトインタ・ナショナル   | 13,000    | 396   | 5,148,000     |       |                      |
| 東邦ホールディングス     | 62,200    | 813   | 50,568,600    |       |                      |
| サンゲツ           | 36,100    | 1,978 | 71,405,800    |       |                      |
| ミツウロコ          | 32,700    | 486   | 15,892,200    | 貸付株式数 | 300株                 |
| シナネン           | 43,000    | 363   | 15,609,000    |       |                      |
| 伊藤忠エネクス        | 45,000    | 453   | 20,385,000    |       |                      |
| サンリオ           | 57,100    | 3,040 | 173,584,000   | 貸付株式数 | 33,600株              |
| サンワテクノス        | 9,900     | 914   | 9,048,600     |       |                      |
| リョーサン          | 33,100    | 1,756 | 58,123,600    | 貸付株式数 | 5,100株               |
| 新光商事           | 19,000    | 660   | 12,540,000    |       |                      |
| トーヨー           | 42,000    | 315   | 13,230,000    |       |                      |
| 三信電気           | 25,200    | 655   | 16,506,000    | 貸付株式数 | 4,200株               |
| 東陽テクニカ         | 27,800    | 886   | 24,630,800    |       |                      |
| モスフードサービス      | 26,700    | 1,522 | 40,637,400    |       |                      |
| 加賀電子           | 20,200    | 893   | 18,038,600    |       |                      |
| 三益半導体          | 18,200    | 936   | 17,035,200    | 貸付株式数 | 1,200株               |
| ソーダニツカ         | 21,000    | 336   | 7,056,000     |       |                      |
| 立花エレテック        | 12,300    | 810   | 9,963,000     | 貸付株式数 | 200株                 |
| 木曽路            | 23,300    | 1,520 | 35,416,000    | 貸付株式数 | 9,400株<br>(8,600株)   |
| 千趣会            | 36,700    | 495   | 18,166,500    | 貸付株式数 | 1,300株               |
| タカキユー          | 15,000    | 151   | 2,265,000     |       |                      |
| ケーヨー           | 38,100    | 466   | 17,754,600    | 貸付株式数 | 14,900株              |
| アデランス          | 23,200    | 793   | 18,397,600    | 貸付株式数 | 5,600株<br>(5,200株)   |

|                 |            |       |               |       |                        |
|-----------------|------------|-------|---------------|-------|------------------------|
| 上新電機            | 43,000     | 883   | 37,969,000    | 貸付株式数 | 15,000株<br>(15,000株)   |
| 日本瓦斯            | 19,300     | 1,098 | 21,191,400    |       |                        |
| ベスト電器           | 63,500     | 237   | 15,049,500    |       |                        |
| マルエツ            | 41,000     | 300   | 12,300,000    |       |                        |
| ロイヤルホールディングス    | 31,400     | 839   | 26,344,600    | 貸付株式数 | 11,700株                |
| 東天紅             | 15,000     | 132   | 1,980,000     |       |                        |
| いなげや            | 22,000     | 869   | 19,118,000    |       |                        |
| 島忠              | 40,200     | 1,979 | 79,555,800    | 貸付株式数 | 7,800株                 |
| チヨダ             | 26,700     | 1,294 | 34,549,800    |       |                        |
| 鈴丹              | 4,900      | 134   | 656,600       | 貸付株式数 | 900株                   |
| ライフコーポレーション     | 12,900     | 1,446 | 18,653,400    |       |                        |
| カスミ             | 41,700     | 465   | 19,390,500    |       |                        |
| リンガーハット         | 15,600     | 1,103 | 17,206,800    | 貸付株式数 | 5,100株                 |
| さが美             | 16,000     | 98    | 1,568,000     |       |                        |
| MR MAX          | 20,300     | 282   | 5,724,600     |       |                        |
| テナライド           | 13,600     | 260   | 3,536,000     | 貸付株式数 | 4,900株                 |
| AOKIホールディングス    | 18,800     | 1,286 | 24,176,800    | 貸付株式数 | 3,200株                 |
| オークワ            | 28,000     | 860   | 24,080,000    |       |                        |
| コメリ             | 27,900     | 2,293 | 63,974,700    | 貸付株式数 | 4,800株                 |
| 青山商事            | 51,900     | 1,456 | 75,566,400    | 貸付株式数 | 2,200株                 |
| しまむら            | 21,300     | 7,710 | 164,223,000   | 貸付株式数 | 7,700株                 |
| CFSコーポレーション     | 19,000     | 388   | 7,372,000     |       |                        |
| 高島屋             | 276,000    | 578   | 159,528,000   | 貸付株式数 | 158,000株               |
| 松屋              | 37,600     | 468   | 17,596,800    | 貸付株式数 | 14,700株                |
| エイチ・ツー・オーリテイリング | 119,000    | 632   | 75,208,000    | 貸付株式数 | 33,000株<br>(20,000株)   |
| 丸栄              | 32,000     | 88    | 2,816,000     | 貸付株式数 | 12,000株                |
| ニッセンHD          | 40,700     | 475   | 19,332,500    |       |                        |
| パルコ             | 52,900     | 695   | 36,765,500    |       |                        |
| 丸井グループ          | 265,700    | 630   | 167,391,000   | 貸付株式数 | 44,200株                |
| クレディセゾン         | 154,600    | 1,373 | 212,265,800   | 貸付株式数 | 28,000株                |
| 原信ナルスHLDGS      | 12,100     | 1,267 | 15,330,700    |       |                        |
| 井筒屋             | 110,000    | 52    | 5,720,000     |       |                        |
| ダイエー            | 94,350     | 310   | 29,248,500    | 貸付株式数 | 41,900株                |
| イズミヤ            | 71,000     | 344   | 24,424,000    |       |                        |
| イオン             | 718,700    | 983   | 706,482,100   | 貸付株式数 | 144,000株<br>(118,000株) |
| ユニー             | 165,500    | 785   | 129,917,500   | 貸付株式数 | 30,200株                |
| イズミ             | 48,900     | 1,225 | 59,902,500    | 貸付株式数 | 10,900株                |
| 東武ストア           | 26,000     | 258   | 6,708,000     |       |                        |
| 平和堂             | 41,300     | 1,015 | 41,919,500    |       |                        |
| フジ              | 22,600     | 1,727 | 39,030,200    | 貸付株式数 | 7,500株                 |
| ヤオコー            | 9,000      | 2,503 | 22,527,000    |       |                        |
| ゼビオ             | 24,600     | 1,839 | 45,239,400    | 貸付株式数 | 1,900株                 |
| ケーズホールディングス     | 46,900     | 3,715 | 174,233,500   | 貸付株式数 | 7,700株                 |
| Palta           | 12,900     | 1,493 | 19,259,700    | 貸付株式数 | 2,200株                 |
| OLYMPIC         | 13,500     | 551   | 7,438,500     |       |                        |
| 日産東京販売HD        | 29,000     | 106   | 3,074,000     | 貸付株式数 | 9,000株                 |
| 新生銀行            | 1,099,000  | 87    | 95,613,000    | 貸付株式数 | 2,000株                 |
| あおぞら銀行          | 741,000    | 189   | 140,049,000   | 貸付株式数 | 265,000株               |
| 三菱UFJフィナンシャルG   | 15,428,500 | 415   | 6,402,827,500 | 貸付株式数 | 497,500株               |
| りそなホールディングス     | 1,258,000  | 412   | 518,296,000   | 貸付株式数 | 222,700株               |
| 三井住友トラストHD      | 3,891,000  | 298   | 1,159,518,000 | 貸付株式数 | 254,000株               |
| 三井住友フィナンシャルG    | 1,554,100  | 2,569 | 3,992,482,900 | 貸付株式数 | 278,100株               |

|              |           |       |             |       |                      |
|--------------|-----------|-------|-------------|-------|----------------------|
| 第四銀行         | 265,000   | 257   | 68,105,000  |       |                      |
| 北越銀行         | 228,000   | 172   | 39,216,000  |       |                      |
| 西日本シティ銀行     | 715,000   | 250   | 178,750,000 |       |                      |
| 札幌北洋ホール      | 307,400   | 363   | 111,586,200 | 貸付株式数 | 37,800株              |
| 千葉銀行         | 804,000   | 512   | 411,648,000 | 貸付株式数 | 91,000株              |
| 横浜銀行         | 1,397,000 | 410   | 572,770,000 | 貸付株式数 | 83,000株              |
| 常陽銀行         | 785,000   | 349   | 273,965,000 | 貸付株式数 | 25,000株              |
| 群馬銀行         | 465,000   | 440   | 204,600,000 | 貸付株式数 | 70,000株              |
| 武蔵野銀行        | 32,900    | 2,794 | 91,922,600  | 貸付株式数 | 11,900株<br>(11,100株) |
| 千葉興業銀行       | 39,000    | 455   | 17,745,000  |       |                      |
| 筑波銀行         | 90,000    | 262   | 23,580,000  |       |                      |
| 東京都民銀行       | 38,500    | 1,089 | 41,926,500  | 貸付株式数 | 5,500株               |
| 七十七銀行        | 344,000   | 379   | 130,376,000 | 貸付株式数 | 46,000株              |
| 青森銀行         | 162,000   | 269   | 43,578,000  |       |                      |
| 秋田銀行         | 140,000   | 242   | 33,880,000  | 貸付株式数 | 7,000株               |
| 山形銀行         | 124,000   | 384   | 47,616,000  | 貸付株式数 | 44,000株              |
| 岩手銀行         | 13,800    | 3,240 | 44,712,000  | 貸付株式数 | 2,100株               |
| 東邦銀行         | 171,000   | 183   | 31,293,000  |       |                      |
| 東北銀行         | 110,000   | 119   | 13,090,000  |       |                      |
| みちのく銀行       | 102,000   | 155   | 15,810,000  |       |                      |
| ふくおかフィナンシャルG | 827,000   | 352   | 291,104,000 | 貸付株式数 | 131,000株             |
| 静岡銀行         | 615,000   | 758   | 466,170,000 | 貸付株式数 | 91,000株              |
| 十六銀行         | 255,000   | 251   | 64,005,000  |       |                      |
| スルガ銀行        | 215,000   | 722   | 155,230,000 | 貸付株式数 | 39,000株              |
| 八十二銀行        | 376,000   | 468   | 175,968,000 | 貸付株式数 | 132,000株             |
| 山梨中央銀行       | 125,000   | 358   | 44,750,000  | 貸付株式数 | 6,000株               |
| 大垣共立銀行       | 272,000   | 251   | 68,272,000  |       |                      |
| 福井銀行         | 174,000   | 234   | 40,716,000  |       |                      |
| 北國銀行         | 227,000   | 286   | 64,922,000  | 貸付株式数 | 4,000株               |
| 清水銀行         | 6,900     | 2,920 | 20,148,000  |       |                      |
| 滋賀銀行         | 190,000   | 469   | 89,110,000  | 貸付株式数 | 29,000株              |
| 南都銀行         | 188,000   | 412   | 77,456,000  |       |                      |
| 百五銀行         | 183,000   | 328   | 60,024,000  |       |                      |
| 京都銀行         | 365,000   | 759   | 277,035,000 | 貸付株式数 | 19,000株              |
| 三重銀行         | 91,000    | 197   | 17,927,000  |       |                      |
| ほくほくフィナンシャルG | 1,428,000 | 166   | 237,048,000 |       |                      |
| 広島銀行         | 601,000   | 359   | 215,759,000 | 貸付株式数 | 205,000株             |
| 山陰合同銀行       | 121,000   | 610   | 73,810,000  | 貸付株式数 | 4,000株               |
| 中国銀行         | 167,000   | 1,033 | 172,511,000 | 貸付株式数 | 30,000株              |
| 鳥取銀行         | 61,000    | 160   | 9,760,000   |       |                      |
| 伊予銀行         | 218,000   | 768   | 167,424,000 | 貸付株式数 | 6,000株               |
| 百十四銀行        | 239,000   | 298   | 71,222,000  |       |                      |
| 四国銀行         | 147,000   | 259   | 38,073,000  |       |                      |
| 阿波銀行         | 168,000   | 519   | 87,192,000  |       |                      |
| 鹿児島銀行        | 132,000   | 545   | 71,940,000  |       |                      |
| 大分銀行         | 132,000   | 244   | 32,208,000  |       |                      |
| 宮崎銀行         | 136,000   | 190   | 25,840,000  |       |                      |
| 肥後銀行         | 160,000   | 470   | 75,200,000  |       |                      |
| 佐賀銀行         | 124,000   | 207   | 25,668,000  |       |                      |
| 十八銀行         | 130,000   | 222   | 28,860,000  |       |                      |
| 沖縄銀行         | 15,400    | 3,730 | 57,442,000  | 貸付株式数 | 300株                 |
| 琉球銀行         | 42,900    | 1,052 | 45,130,800  |       |                      |
| みずほ信託銀行      | 1,934,000 | 74    | 143,116,000 | 貸付株式数 | 31,000株              |
| 八千代銀行        | 10,700    | 2,385 | 25,519,500  |       |                      |

|               |            |        |               |       |                     |
|---------------|------------|--------|---------------|-------|---------------------|
| みずほフィナンシャルG   | 25,052,800 | 135    | 3,382,128,000 | 貸付株式数 | 131,100株            |
| 紀陽ホールディングス    | 808,000    | 112    | 90,496,000    |       |                     |
| 山口フィナンシャルG    | 203,000    | 787    | 159,761,000   | 貸付株式数 | 1,000株              |
| フィデック         | 121        | 10,010 | 1,211,210     |       |                     |
| 芙蓉総合リース       | 19,200     | 2,842  | 54,566,400    | 貸付株式数 | 6,300株              |
| 興銀リース         | 28,400     | 1,999  | 56,771,600    | 貸付株式数 | 700株                |
| 東京センチュリーリース   | 47,900     | 1,560  | 74,724,000    |       |                     |
| S B Iホールディングス | 24,301     | 8,160  | 198,296,160   | 貸付株式数 | 1,145株              |
| 日本証券金融        | 84,100     | 519    | 43,647,900    | 貸付株式数 | 16,500株             |
| 大阪証券金融        | 23,700     | 160    | 3,792,000     |       |                     |
| アイフル          | 168,400    | 132    | 22,228,800    | 貸付株式数 | 81,550株             |
| 日本アジア投資       | 139,000    | 90     | 12,510,000    | 貸付株式数 | 30,000株             |
| ポケットカード       | 19,100     | 267    | 5,099,700     | 貸付株式数 | 6,300株              |
| 長野銀行          | 71,000     | 184    | 13,064,000    |       |                     |
| 名古屋銀行         | 183,000    | 255    | 46,665,000    | 貸付株式数 | 13,000株             |
| 愛知銀行          | 6,800      | 4,485  | 30,498,000    | 貸付株式数 | 300株                |
| 第三銀行          | 124,000    | 197    | 24,428,000    |       |                     |
| 中京銀行          | 84,000     | 195    | 16,380,000    |       |                     |
| 東日本銀行         | 107,000    | 168    | 17,976,000    |       |                     |
| 大光銀行          | 77,000     | 269    | 20,713,000    | 貸付株式数 | 31,000株             |
| 愛媛銀行          | 128,000    | 235    | 30,080,000    |       |                     |
| トマト銀行         | 79,000     | 148    | 11,692,000    |       |                     |
| みなと銀行         | 211,000    | 146    | 30,806,000    |       |                     |
| 京葉銀行          | 167,000    | 432    | 72,144,000    | 貸付株式数 | 3,000株              |
| 関西アーバン銀行      | 284,000    | 146    | 41,464,000    | 貸付株式数 | 103,000株            |
| 栃木銀行          | 102,000    | 313    | 31,926,000    | 貸付株式数 | 3,000株              |
| 北日本銀行         | 6,000      | 1,848  | 11,088,000    | 貸付株式数 | 100株                |
| 東和銀行          | 219,000    | 102    | 22,338,000    |       |                     |
| 福島銀行          | 251,000    | 42     | 10,542,000    |       |                     |
| 大東銀行          | 130,000    | 50     | 6,500,000     |       |                     |
| リコーリース        | 14,000     | 1,902  | 26,628,000    | 貸付株式数 | 2,800株              |
| イオン クレジットサービス | 90,600     | 1,133  | 102,649,800   | 貸付株式数 | 4,100株              |
| N I Sグループ     | 152,700    | 6      | 916,200       |       |                     |
| アコム           | 40,950     | 1,369  | 56,060,550    | 貸付株式数 | 1,030株              |
| プロミス          | 103,800    | 721    | 74,839,800    | 貸付株式数 | 57,450株             |
| ジャックス         | 135,000    | 234    | 31,590,000    | 貸付株式数 | 5,000株              |
| オリコ           | 280,000    | 96     | 26,880,000    | 貸付株式数 | 34,500株             |
| 日立キャピタル       | 48,000     | 1,146  | 55,008,000    | 貸付株式数 | 5,800株              |
| オリックス         | 106,050    | 8,180  | 867,489,000   | 貸付株式数 | 19,440株             |
| 三菱UFJリース      | 51,710     | 3,255  | 168,316,050   | 貸付株式数 | 2,050株              |
| ジャフコ          | 27,900     | 2,128  | 59,371,200    | 貸付株式数 | 11,300株<br>(1,700株) |
| トモニホールディングス   | 156,800    | 310    | 48,608,000    |       |                     |
| 大和証券G本社       | 2,019,000  | 357    | 720,783,000   | 貸付株式数 | 358,000株            |
| 野村ホールディングス    | 4,292,900  | 404    | 1,734,331,600 | 貸付株式数 | 347,200株            |
| みずほ証券         | 522,000    | 199    | 103,878,000   | 貸付株式数 | 96,000株             |
| みずほインベストアズ証   | 474,000    | 75     | 35,550,000    |       |                     |
| 岡三証券グループ      | 172,000    | 302    | 51,944,000    |       |                     |
| 丸三証券          | 64,100     | 340    | 21,794,000    | 貸付株式数 | 1,000株              |
| 東洋証券          | 76,000     | 130    | 9,880,000     |       |                     |
| 東海東京HD        | 234,000    | 247    | 57,798,000    | 貸付株式数 | 42,000株             |
| 光世証券          | 47,000     | 73     | 3,431,000     | 貸付株式数 | 11,000株             |
| 水戸証券          | 52,000     | 118    | 6,136,000     |       |                     |
| いちよし証券        | 45,600     | 501    | 22,845,600    |       |                     |
| 松井証券          | 120,900    | 413    | 49,931,700    | 貸付株式数 | 71,200株             |

|                 |           |         |               |       |                    |
|-----------------|-----------|---------|---------------|-------|--------------------|
| NK S Jホールディングス  | 1,705,000 | 538     | 917,290,000   | 貸付株式数 | 85,000株            |
| だいこう証券ビジ        | 11,500    | 291     | 3,346,500     |       |                    |
| マネックスG          | 1,205     | 18,270  | 22,015,350    | 貸付株式数 | 473株               |
| カブドットコム証券       | 83,100    | 259     | 21,522,900    |       |                    |
| 極東証券            | 27,300    | 594     | 16,216,200    | 貸付株式数 | 100株               |
| 岩井コスモホールディング    | 19,100    | 371     | 7,086,100     |       |                    |
| フィデアホール         | 117,300   | 196     | 22,990,800    |       |                    |
| 池田泉州HD          | 596,700   | 125     | 74,587,500    | 貸付株式数 | 132,700株           |
| MS & AD         | 609,200   | 1,984   | 1,208,652,800 | 貸付株式数 | 28,500株            |
| SONY FH         | 195,300   | 1,518   | 296,465,400   | 貸付株式数 | 29,700株            |
| 小林洋行            | 5,600     | 202     | 1,131,200     | 貸付株式数 | 1,800株             |
| 第一生命            | 10,902    | 122,000 | 1,330,044,000 | 貸付株式数 | 650株               |
| 東京海上HD          | 773,900   | 2,380   | 1,841,882,000 | 貸付株式数 | 127,700株           |
| アサックス           | 27        | 117,800 | 3,180,600     |       |                    |
| NECキャピタルソリューション | 5,300     | 1,110   | 5,883,000     |       |                    |
| T & Dホールディングス   | 371,500   | 2,035   | 756,002,500   | 貸付株式数 | 56,550株            |
| 三井不動産           | 961,000   | 1,462   | 1,404,982,000 | 貸付株式数 | 167,000株           |
| 三菱地所            | 1,427,000 | 1,488   | 2,123,376,000 | 貸付株式数 | 11,000株            |
| 平和不動産           | 160,000   | 190     | 30,400,000    |       |                    |
| 東京建物            | 389,000   | 313     | 121,757,000   |       |                    |
| ダイビル            | 59,900    | 616     | 36,898,400    |       |                    |
| サンケイビル          | 39,400    | 486     | 19,148,400    | 貸付株式数 | 300株               |
| 東急不動産           | 410,000   | 358     | 146,780,000   | 貸付株式数 | 11,000株            |
| 京阪神不動産          | 24,300    | 376     | 9,136,800     |       |                    |
| 住友不動産           | 489,000   | 1,907   | 932,523,000   | 貸付株式数 | 90,000株            |
| 東宝不動産           | 21,400    | 442     | 9,458,800     |       |                    |
| 太平洋興発           | 70,000    | 77      | 5,390,000     | 貸付株式数 | 23,000株            |
| 大京              | 343,000   | 147     | 50,421,000    | 貸付株式数 | 42,000株            |
| テーオーシー          | 79,000    | 383     | 30,257,000    | 貸付株式数 | 7,200株             |
| 東京楽天地           | 32,000    | 287     | 9,184,000     |       |                    |
| レオパレス21         | 122,800   | 123     | 15,104,400    | 貸付株式数 | 74,700株            |
| フジ住宅            | 21,300    | 376     | 8,008,800     |       |                    |
| 空港施設            | 21,100    | 320     | 6,752,000     | 貸付株式数 | 1,000株             |
| 明和地所            | 11,700    | 477     | 5,580,900     | 貸付株式数 | 2,300株             |
| 住友不動産販売         | 7,340     | 3,760   | 27,598,400    | 貸付株式数 | 60株                |
| ゴールドクレスト        | 18,360    | 1,754   | 32,203,440    | 貸付株式数 | 9,660株             |
| 東栄住宅            | 15,600    | 1,018   | 15,880,800    | 貸付株式数 | 700株               |
| 日本エスリード         | 8,900     | 750     | 6,675,000     |       |                    |
| 東急リバブル          | 21,500    | 769     | 16,533,500    | 貸付株式数 | 8,200株             |
| 飯田産業            | 23,100    | 740     | 17,094,000    | 貸付株式数 | 6,700株<br>(3,500株) |
| 日神不動産           | 12,000    | 533     | 6,396,000     | 貸付株式数 | 1,700株             |
| アーネストワン         | 37,900    | 873     | 33,086,700    | 貸付株式数 | 6,600株             |
| タカラレーベン         | 19,100    | 543     | 10,371,300    |       |                    |
| サンヨーハウジ 名古屋     | 86        | 82,500  | 7,095,000     | 貸付株式数 | 2株                 |
| イオンモール          | 92,900    | 1,983   | 184,220,700   | 貸付株式数 | 3,400株             |
| フージャースコーポレーション  | 313       | 33,800  | 10,579,400    | 貸付株式数 | 125株               |
| サンシティ           | 481       | 1,915   | 921,115       | 貸付株式数 | 121株               |
| タクトホーム          | 108       | 77,600  | 8,380,800     |       |                    |
| ランド             | 22,800    | 19      | 433,200       | 貸付株式数 | 2,000株             |
| エヌ・ティ・ティ都市開発    | 1,477     | 71,100  | 105,014,700   | 貸付株式数 | 29株                |
| サンフロンティア不動産     | 189       | 9,100   | 1,719,900     |       |                    |
| ランドビジネス         | 138       | 16,240  | 2,241,120     |       |                    |
| 東武鉄道            | 912,000   | 345     | 314,640,000   | 貸付株式数 | 410,000株           |
| 相鉄ホールディングス      | 324,000   | 228     | 73,872,000    |       |                    |

|              |           |         |               |       |                         |
|--------------|-----------|---------|---------------|-------|-------------------------|
| 東京急行         | 1,134,000 | 345     | 391,230,000   | 貸付株式数 | 34,000株                 |
| 京浜急行         | 531,000   | 591     | 313,821,000   | 貸付株式数 | 312,000株                |
| 小田急電鉄        | 662,000   | 655     | 433,610,000   | 貸付株式数 | 290,000株                |
| 京王電鉄         | 536,000   | 464     | 248,704,000   | 貸付株式数 | 35,000株                 |
| 京成電鉄         | 330,000   | 489     | 161,370,000   | 貸付株式数 | 18,000株                 |
| 富士急行         | 54,000    | 423     | 22,842,000    | 貸付株式数 | 15,000株                 |
| 新京成電鉄        | 26,000    | 352     | 9,152,000     |       |                         |
| 東日本旅客鉄道      | 359,100   | 4,815   | 1,729,066,500 | 貸付株式数 | 24,800株                 |
| 西日本旅客鉄道      | 192,400   | 3,260   | 627,224,000   |       |                         |
| 東海旅客鉄道       | 1,792     | 643,000 | 1,152,256,000 | 貸付株式数 | 98株                     |
| 西日本鉄道        | 267,000   | 348     | 92,916,000    |       |                         |
| ハマキョウレックス    | 5,600     | 2,542   | 14,235,200    | 貸付株式数 | 300株                    |
| サカイ引越センター    | 3,500     | 1,589   | 5,561,500     |       |                         |
| 近畿鉄道         | 1,865,000 | 261     | 486,765,000   | 貸付株式数 | 1,098,000株<br>(15,000株) |
| 阪急阪神HLDGS    | 1,386,000 | 326     | 451,836,000   | 貸付株式数 | 115,000株                |
| 南海電鉄         | 430,000   | 318     | 136,740,000   | 貸付株式数 | 173,000株                |
| 京阪電鉄         | 463,000   | 342     | 158,346,000   |       |                         |
| 名糖運輸         | 7,800     | 597     | 4,656,600     |       |                         |
| 名古屋鉄道        | 721,000   | 208     | 149,968,000   | 貸付株式数 | 1,000株                  |
| 日本通運         | 818,000   | 337     | 275,666,000   | 貸付株式数 | 109,000株                |
| ヤマトホールディングス  | 420,200   | 1,321   | 555,084,200   | 貸付株式数 | 28,600株                 |
| 山九           | 251,000   | 373     | 93,623,000    | 貸付株式数 | 26,000株                 |
| 日新           | 78,000    | 224     | 17,472,000    |       |                         |
| 丸運           | 11,100    | 200     | 2,220,000     |       |                         |
| 丸全昭和運輸       | 69,000    | 269     | 18,561,000    |       |                         |
| センコー         | 83,000    | 275     | 22,825,000    | 貸付株式数 | 2,000株                  |
| トナミホールディングス  | 41,000    | 170     | 6,970,000     |       |                         |
| 日本梱包運輸       | 60,500    | 906     | 54,813,000    |       |                         |
| 日石輸送         | 23,000    | 205     | 4,715,000     |       |                         |
| 福山通運         | 143,000   | 474     | 67,782,000    | 貸付株式数 | 39,000株                 |
| セイノーホールディングス | 160,000   | 621     | 99,360,000    | 貸付株式数 | 5,000株                  |
| 神奈川中央交通      | 24,000    | 417     | 10,008,000    |       |                         |
| 日立物流         | 35,800    | 1,378   | 49,332,400    | 貸付株式数 | 7,000株                  |
| 日本郵船         | 1,745,000 | 306     | 533,970,000   | 貸付株式数 | 40,000株                 |
| 商船三井         | 1,006,000 | 446     | 448,676,000   | 貸付株式数 | 120,000株                |
| 川崎汽船         | 638,000   | 289     | 184,382,000   | 貸付株式数 | 116,000株                |
| NSユニテッド海運    | 74,000    | 169     | 12,506,000    | 貸付株式数 | 23,000株                 |
| 乾汽船          | 24,500    | 406     | 9,947,000     |       |                         |
| 明治海運         | 18,400    | 283     | 5,207,200     |       |                         |
| 飯野海運         | 99,700    | 397     | 39,580,900    | 貸付株式数 | 37,700株                 |
| 共栄タンカー       | 17,000    | 167     | 2,839,000     |       |                         |
| 第一中央汽船       | 135,000   | 154     | 20,790,000    | 貸付株式数 | 48,000株<br>(38,000株)    |
| 全日本空輸        | 2,753,000 | 270     | 743,310,000   | 貸付株式数 | 188,000株                |
| パスコ          | 23,000    | 291     | 6,693,000     | 貸付株式数 | 7,000株                  |
| 国際航業HLDGS    | 11,000    | 383     | 4,213,000     | 貸付株式数 | 6,000株                  |
| 三菱倉庫         | 146,000   | 935     | 136,510,000   | 貸付株式数 | 9,000株                  |
| 三井倉庫         | 96,000    | 324     | 31,104,000    |       |                         |
| 住友倉庫         | 151,000   | 382     | 57,682,000    |       |                         |
| 渋沢倉庫         | 52,000    | 257     | 13,364,000    |       |                         |
| ヤマタネ         | 102,000   | 128     | 13,056,000    | 貸付株式数 | 34,000株                 |
| 東陽倉庫         | 31,000    | 178     | 5,518,000     |       |                         |
| 日本トランスシティ    | 42,000    | 252     | 10,584,000    |       |                         |
| ケイヒン         | 35,000    | 91      | 3,185,000     |       |                         |

|                 |           |         |               |       |                   |
|-----------------|-----------|---------|---------------|-------|-------------------|
| 安田倉庫            | 17,300    | 485     | 8,390,500     |       |                   |
| 東洋埠頭            | 57,000    | 132     | 7,524,000     |       |                   |
| 宇徳              | 14,800    | 212     | 3,137,600     | 貸付株式数 | 5,300株            |
| 上組              | 229,000   | 763     | 174,727,000   | 貸付株式数 | 11,000株           |
| サンリツ            | 5,200     | 605     | 3,146,000     |       |                   |
| キムラユニティー        | 4,500     | 706     | 3,177,000     |       |                   |
| キューソー流通システム     | 6,200     | 878     | 5,443,600     |       |                   |
| 郵船ロジスティクス       | 16,200    | 1,362   | 22,064,400    | 貸付株式数 | 4,200株            |
| 近鉄エクスプレス        | 18,400    | 2,757   | 50,728,800    | 貸付株式数 | 2,600株            |
| 東海運             | 11,100    | 197     | 2,186,700     |       |                   |
| バンテック           | 24        | 142,200 | 3,412,800     |       |                   |
| 東京放送HD          | 109,900   | 1,014   | 111,438,600   | 貸付株式数 | 35,700株           |
| 日本テレビ放送網        | 17,890    | 12,040  | 215,395,600   | 貸付株式数 | 6,500株            |
| テレビ朝日           | 516       | 124,200 | 64,087,200    | 貸付株式数 | 184株              |
| スカパーJ S A T H D | 1,547     | 34,400  | 53,216,800    | 貸付株式数 | 559株<br>(559株)    |
| テレビ東京HD         | 9,200     | 970     | 8,924,000     | 貸付株式数 | 500株              |
| アイ・ティー・シーネットワーク | 17,000    | 512     | 8,704,000     | 貸付株式数 | 5,600株            |
| イー・アクセス         | 1,111     | 39,250  | 43,606,750    | 貸付株式数 | 654株              |
| N E C モバイリング    | 7,500     | 2,758   | 20,685,000    |       |                   |
| 日本電信電話          | 765,500   | 3,885   | 2,973,967,500 | 貸付株式数 | 57,100株           |
| K D D I         | 3,164     | 573,000 | 1,812,972,000 | 貸付株式数 | 291株              |
| 光通信             | 26,200    | 1,987   | 52,059,400    |       |                   |
| エヌ・ティ・ティ・ドコモ    | 16,796    | 144,200 | 2,421,983,200 | 貸付株式数 | 2,129株            |
| G M O インターネット   | 57,800    | 376     | 21,732,800    |       |                   |
| 学研ホールディングス      | 61,000    | 149     | 9,089,000     | 貸付株式数 | 11,000株           |
| ゼンリン            | 29,400    | 857     | 25,195,800    | 貸付株式数 | 100株              |
| 昭文社             | 12,100    | 602     | 7,284,200     |       |                   |
| 角川グループH L D G S | 19,100    | 2,793   | 53,346,300    | 貸付株式数 | 10,400株<br>(700株) |
| インプレスホールディングス   | 16,700    | 122     | 2,037,400     |       |                   |
| 東京電力            | 1,520,300 | 411     | 624,843,300   | 貸付株式数 | 895,300株          |
| 中部電力            | 631,900   | 1,469   | 928,261,100   | 貸付株式数 | 125,000株          |
| 関西電力            | 842,800   | 1,475   | 1,243,130,000 | 貸付株式数 | 155,000株          |
| 中国電力            | 285,600   | 1,355   | 386,988,000   | 貸付株式数 | 117,700株          |
| 北陸電力            | 202,300   | 1,508   | 305,068,400   | 貸付株式数 | 23,700株           |
| 東北電力            | 516,000   | 1,114   | 574,824,000   | 貸付株式数 | 14,900株           |
| 四国電力            | 204,800   | 1,811   | 370,892,800   | 貸付株式数 | 51,200株           |
| 九州電力            | 456,100   | 1,367   | 623,488,700   | 貸付株式数 | 37,100株           |
| 北海道電力           | 193,300   | 1,273   | 246,070,900   | 貸付株式数 | 15,800株           |
| 沖縄電力            | 12,400    | 3,695   | 45,818,000    | 貸付株式数 | 2,600株            |
| 電源開発            | 128,200   | 2,229   | 285,757,800   | 貸付株式数 | 5,700株            |
| 東京瓦斯            | 2,582,000 | 376     | 970,832,000   | 貸付株式数 | 249,000株          |
| 大阪瓦斯            | 2,004,000 | 316     | 633,264,000   | 貸付株式数 | 285,000株          |
| 東邦瓦斯            | 525,000   | 441     | 231,525,000   | 貸付株式数 | 77,000株           |
| 北海道瓦斯           | 38,000    | 263     | 9,994,000     |       |                   |
| 西部瓦斯            | 233,000   | 208     | 48,464,000    | 貸付株式数 | 18,000株           |
| 静岡瓦斯            | 53,500    | 473     | 25,305,500    |       |                   |
| アイネット           | 9,800     | 488     | 4,782,400     |       |                   |
| 松竹              | 125,000   | 664     | 83,000,000    |       |                   |
| 東宝              | 133,300   | 1,365   | 181,954,500   | 貸付株式数 | 3,300株            |
| エイチ・アイ・エス       | 22,000    | 2,068   | 45,496,000    | 貸付株式数 | 10,800株           |
| 東映              | 85,000    | 374     | 31,790,000    |       |                   |
| 葵プロモーション        | 9,500     | 447     | 4,246,500     |       |                   |
| N T T データ       | 1,439     | 282,300 | 406,229,700   | 貸付株式数 | 10株               |

|                |         |       |             |       |                      |
|----------------|---------|-------|-------------|-------|----------------------|
| 共立メンテナンス       | 9,700   | 1,281 | 12,425,700  |       |                      |
| イチネンホールディングス   | 22,600  | 416   | 9,401,600   |       |                      |
| 建設技術研究所        | 11,800  | 520   | 6,136,000   |       |                      |
| アインファーマシーズ     | 8,900   | 3,250 | 28,925,000  | 貸付株式数 | 3,900株               |
| 燦ホールディングス      | 4,200   | 1,245 | 5,229,000   |       |                      |
| スバル興業          | 15,000  | 248   | 3,720,000   |       |                      |
| 東京テアトル         | 82,000  | 105   | 8,610,000   | 貸付株式数 | 15,000株              |
| ホリプロ           | 7,300   | 733   | 5,350,900   |       |                      |
| よみうりランド        | 47,000  | 286   | 13,442,000  |       |                      |
| 東京都競馬          | 147,000 | 106   | 15,582,000  |       |                      |
| 常磐興産           | 63,000  | 85    | 5,355,000   |       |                      |
| カナモト           | 26,000  | 601   | 15,626,000  |       |                      |
| 東京ドーム          | 160,000 | 164   | 26,240,000  | 貸付株式数 | 11,000株              |
| D T S          | 19,200  | 860   | 16,512,000  |       |                      |
| スクウェア・エニックス・HD | 66,600  | 1,490 | 99,234,000  | 貸付株式数 | 10,200株              |
| シーイーシー         | 13,300  | 439   | 5,838,700   |       |                      |
| カプコン           | 43,400  | 1,827 | 79,291,800  | 貸付株式数 | 25,500株              |
| 東海観光           | 84,000  | 22    | 1,848,000   |       |                      |
| 日本空港ビルデング      | 65,000  | 967   | 62,855,000  | 貸付株式数 | 22,800株              |
| トランス・コスモス      | 28,200  | 881   | 24,844,200  | 貸付株式数 | 100株                 |
| 乃村工藝社          | 42,000  | 247   | 10,374,000  |       |                      |
| ジャステック         | 11,800  | 493   | 5,817,400   | 貸付株式数 | 1,000株               |
| 住商情報システム       | 20,900  | 1,390 | 29,051,000  | 貸付株式数 | 12,300株<br>(1,000株)  |
| 藤田観光           | 53,000  | 284   | 15,052,000  |       |                      |
| 近畿日本ツーリスト      | 68,000  | 99    | 6,732,000   | 貸付株式数 | 24,000株<br>(2,000株)  |
| 日本管財           | 7,900   | 1,411 | 11,146,900  |       |                      |
| トーカイ           | 9,500   | 1,704 | 16,188,000  | 貸付株式数 | 1,400株               |
| 白洋舎            | 22,000  | 201   | 4,422,000   |       |                      |
| セコム            | 224,400 | 3,900 | 875,160,000 | 貸付株式数 | 4,000株               |
| C S K          | 75,300  | 328   | 24,698,400  | 貸付株式数 | 24,400株              |
| 日本システムウエア      | 7,600   | 318   | 2,416,800   |       |                      |
| セントラル警備保障      | 9,500   | 818   | 7,771,000   |       |                      |
| アイネス           | 27,700  | 550   | 15,235,000  | 貸付株式数 | 1,600株               |
| 丹青社            | 20,000  | 282   | 5,640,000   | 貸付株式数 | 2,000株               |
| メイテック          | 31,500  | 1,692 | 53,298,000  | 貸付株式数 | 3,900株               |
| T K C          | 15,500  | 1,817 | 28,163,500  |       |                      |
| アサツー ディ・ケイ     | 35,200  | 2,246 | 79,059,200  |       |                      |
| 富士ソフト          | 27,500  | 1,225 | 33,687,500  | 貸付株式数 | 9,500株               |
| 応用地質           | 21,100  | 845   | 17,829,500  |       |                      |
| 船井総合研究所        | 22,000  | 519   | 11,418,000  |       |                      |
| N S D          | 39,400  | 710   | 27,974,000  | 貸付株式数 | 12,300株<br>(12,300株) |
| 進学会            | 11,600  | 301   | 3,491,600   |       |                      |
| 丸紅建材リース        | 20,000  | 153   | 3,060,000   | 貸付株式数 | 7,000株               |
| コナミ            | 93,900  | 1,989 | 186,767,100 | 貸付株式数 | 16,600株              |
| ベネッセホールディングス   | 66,800  | 3,400 | 227,120,000 |       |                      |
| イオンディライト       | 24,300  | 1,669 | 40,556,700  | 貸付株式数 | 4,300株               |
| ナック            | 4,700   | 1,533 | 7,205,100   |       |                      |
| 福井コンピュータ       | 3,900   | 398   | 1,552,200   |       |                      |
| ニチイ学館          | 37,500  | 703   | 26,362,500  |       |                      |
| ダイセキ           | 31,800  | 1,631 | 51,865,800  | 貸付株式数 | 6,800株               |
| 日鐵商事           | 44,000  | 228   | 10,032,000  |       |                      |
| 元気寿司           | 6,000   | 927   | 5,562,000   | 貸付株式数 | 2,200株               |

|             |             |         |                 |       |          |
|-------------|-------------|---------|-----------------|-------|----------|
| トラスコ中山      | 25,400      | 1,592   | 40,436,800      | 貸付株式数 | 100株     |
| ヤマダ電機       | 92,970      | 6,830   | 634,985,100     | 貸付株式数 | 1,710株   |
| オートバックスセブン  | 24,200      | 3,435   | 83,127,000      |       |          |
| アークランドサカモト  | 11,900      | 1,276   | 15,184,400      |       |          |
| ニトリホールディングス | 40,350      | 7,660   | 309,081,000     | 貸付株式数 | 4,700株   |
| グルメ杵屋       | 15,000      | 442     | 6,630,000       |       |          |
| 愛眼          | 16,200      | 406     | 6,577,200       |       |          |
| 吉野家ホールディングス | 552         | 100,200 | 55,310,400      |       |          |
| 加藤産業        | 29,400      | 1,503   | 44,188,200      |       |          |
| イノテック       | 12,300      | 565     | 6,949,500       |       |          |
| イエローハット     | 19,000      | 860     | 16,340,000      |       |          |
| 富士エレクトロニクス  | 11,500      | 1,263   | 14,524,500      |       |          |
| 松屋フーズ       | 9,800       | 1,505   | 14,749,000      |       |          |
| JBCホールディングス | 15,900      | 532     | 8,458,800       |       |          |
| JKホールディングス  | 18,800      | 395     | 7,426,000       |       |          |
| サガミチェーン     | 23,000      | 490     | 11,270,000      | 貸付株式数 | 6,000株   |
| 日伝          | 8,400       | 2,636   | 22,142,400      | 貸付株式数 | 100株     |
| 北沢産業        | 16,000      | 173     | 2,768,000       |       |          |
| 杉本商事        | 11,000      | 781     | 8,591,000       |       |          |
| 因幡電機産業      | 24,000      | 2,205   | 52,920,000      |       |          |
| 住金物産        | 95,000      | 203     | 19,285,000      |       |          |
| プレナス        | 25,600      | 1,338   | 34,252,800      |       |          |
| ミニストップ      | 15,100      | 1,443   | 21,789,300      |       |          |
| アークス        | 26,100      | 1,273   | 33,225,300      | 貸付株式数 | 10,600株  |
| バロー         | 40,500      | 1,121   | 45,400,500      |       |          |
| ミスミグループ本社   | 69,000      | 2,132   | 147,108,000     | 貸付株式数 | 7,000株   |
| 江守商事        | 3,800       | 893     | 3,393,400       |       |          |
| アルテック       | 8,900       | 296     | 2,634,400       | 貸付株式数 | 2,800株   |
| ベルク         | 10,000      | 1,043   | 10,430,000      |       |          |
| 大庄          | 9,500       | 995     | 9,452,500       |       |          |
| タキヒヨー       | 30,000      | 427     | 12,810,000      |       |          |
| ファーストリテイリング | 47,600      | 13,290  | 632,604,000     | 貸付株式数 | 7,500株   |
| ソフトバンク      | 905,800     | 3,110   | 2,817,038,000   | 貸付株式数 | 113,100株 |
| スズケン        | 84,300      | 1,991   | 167,841,300     | 貸付株式数 | 3,400株   |
| サンドラッグ      | 38,800      | 2,535   | 98,358,000      | 貸付株式数 | 21,700株  |
| ジェコス        | 14,000      | 353     | 4,942,000       |       |          |
| ヤマザワ        | 5,100       | 1,200   | 6,120,000       |       |          |
| やまや         | 3,000       | 903     | 2,709,000       | 貸付株式数 | 700株     |
| ベルーナ        | 25,400      | 532     | 13,512,800      |       |          |
| 合計          | 315,451,917 |         | 242,543,435,766 |       |          |

(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せん。

|        |         |               |          |
|--------|---------|---------------|----------|
| トヨタ自動車 | 30,000株 | 本田技研          | 30,000株  |
| キヤノン   | 28,000株 | 三菱UFJフィナンシャルG | 300,000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キャピタル・マーケット株式会社に対する貸付であります。

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成23年7月29日

|                 |                  |        |
|-----------------|------------------|--------|
| 資産総額            | 268,119,372,290円 |        |
| 負債総額            | 39,383,958,593円  |        |
| 純資産総額（ - ）      | 228,735,413,697円 |        |
| 発行済数量           | 269,783,349口     |        |
| 1単位当たり純資産額（ / ） |                  | 847.8円 |

## 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

## (2) 名義登録と収益分配金の支払い

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

## (3) 受益者に対する特典

ありません。

## (4) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

## (5) 受益証券の再発行

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

## (6) 受益権の譲渡

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

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

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

## (7) 受益権の譲渡の対抗要件

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

## (8) 受益権の再分割

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

## (9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成23年7月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者である運用本部長（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なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

平成23年7月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

| 基本的性格      | 本数（本） | 純資産額の合計額（百万円） |
|------------|-------|---------------|
| 単位型株式投資信託  | 6     | 20,084        |
| 追加型株式投資信託  | 379   | 7,194,881     |
| 株式投資信託 合計  | 385   | 7,214,965     |
| 単位型公社債投資信託 | -     | -             |
| 追加型公社債投資信託 | 17    | 2,693,745     |
| 公社債投資信託 合計 | 17    | 2,693,745     |
| 総合計        | 402   | 9,908,710     |

## 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21年4月1日から平成22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22年4月1日から平成23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21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、また、当事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）の財務諸表については、有限責任あずさ監査法人により監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任あずさ監査法人となっております。

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<br>(平成22年3月31日現在) | 当事業年度<br>(平成23年3月31日現在) |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部      |                         |                         |
| 流動資産      |                         |                         |
| 現金・預金     | 4,783,803               | 1,820,358               |
| 有価証券      | 26,970,072              | 18,987,155              |
| 前払金       | 136                     | 579                     |
| 前払費用      | 77,248                  | 24,840                  |
| 未収入金      | 3,858                   | 6,925                   |
| 未収委託者報酬   | 7,030,430               | 6,933,076               |
| 未収収益      | 90,787                  | 41,963                  |
| 貯蔵品       | 30,324                  | 23,337                  |
| 繰延税金資産    | 566,334                 | 286,080                 |
| その他       | 256,955                 | 501,484                 |
| 流動資産計     | 39,809,953              | 28,625,803              |
| 固定資産      |                         |                         |
| 有形固定資産    | 1                       | 1                       |
| 建物（純額）    | 1,186,818               | 967,190                 |
| 器具備品（純額）  | 318,162                 | 332,407                 |
| 建設仮勘定     | 757,333                 | 634,782                 |
| 無形固定資産    | 111,322                 | -                       |
| ソフトウェア    | 1,751,209               | 2,414,530               |
| ソフトウェア仮勘定 | 1,558,342               | 1,364,617               |
| 電話加入権     | 179,630                 | 1,037,069               |
| 電話加入権     | 11,850                  | 11,850                  |
| 商標権       | 660                     | 396                     |

|              |   |            |   |            |
|--------------|---|------------|---|------------|
| その他          |   | 725        |   | 596        |
| 投資その他の資産     |   | 10,657,920 |   | 18,825,476 |
| 投資有価証券       |   | 10,018,677 |   | 12,339,547 |
| 関係会社株式       |   | 737,012    |   | 5,141,069  |
| 出資金          |   | 178,806    |   | 142,215    |
| 従業員に対する長期貸付金 |   | 104,419    |   | 99,889     |
| 差入保証金        |   | 617,615    |   | 609,781    |
| 長期前払費用       |   | 8,402      |   | 7,607      |
| 投資不動産（純額）    | 1 | 489,861    | 1 | 490,114    |
| 貸倒引当金        | 3 | 1,496,873  |   | 4,750      |
| 固定資産計        |   | 13,595,948 |   | 22,207,196 |
| 資産合計         |   | 53,405,901 |   | 50,833,000 |

(単位:千円)

|              | 前事業年度<br>(平成22年3月31日現在) | 当事業年度<br>(平成23年3月31日現在) |
|--------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>負債の部</b>  |                         |                         |
| <b>流動負債</b>  |                         |                         |
| 預り金          | 46,289                  | 46,454                  |
| 未払金          | 7,304,929               | 6,501,119               |
| 未払収益分配金      | 31,110                  | 27,599                  |
| 未払償還金        | 261,645                 | 119,838                 |
| 未払手数料        | 3,847,895               | 3,725,807               |
| その他未払金       | 2 3,164,277             | 2 2,627,872             |
| 未払費用         | 2,212,051               | 2,395,029               |
| 未払法人税等       | 692,446                 | 895,379                 |
| 未払消費税等       | 104,897                 | 383,973                 |
| 賞与引当金        | 838,400                 | 263,000                 |
| その他          | 168,621                 | -                       |
| 流動負債計        | 11,367,635              | 10,484,955              |
| <b>固定負債</b>  |                         |                         |
| 退職給付引当金      | 1,179,482               | 1,410,635               |
| 役員退職慰労引当金    | 39,300                  | 59,160                  |
| 繰延税金負債       | 1,963,856               | 1,977,913               |
| 固定負債計        | 3,182,638               | 3,447,708               |
| 負債合計         | 14,550,274              | 13,932,663              |
| <b>純資産の部</b> |                         |                         |
| <b>株主資本</b>  |                         |                         |
| 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              |
| <b>利益剰余金</b> |                         |                         |
| 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               | -                       |
| 繰越利益剰余金      | 9,085,103               | 9,874,176               |

|             |            |            |
|-------------|------------|------------|
| 利益剰余金合計     | 12,259,401 | 10,248,473 |
| 株主資本合計      | 38,929,401 | 36,918,473 |
| 評価・換算差額等    |            |            |
| 其他有価証券評価差額金 | 18,061     | 104,040    |
| 繰延ヘッジ損益     | 55,712     | 85,902     |
| 評価・換算差額等合計  | 73,774     | 18,137     |
| 純資産合計       | 38,855,627 | 36,900,336 |
| 負債・純資産合計    | 53,405,901 | 50,833,000 |

## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

|              | 前事業年度<br>(自 平成21年 4月 1日<br>至 平成22年 3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成22年 4月 1日<br>至 平成23年 3月31日) |
|--------------|---|---|
| 営業収益         |   |   |
| 委託者報酬        | 63,362,142                                | 72,303,483                                |
| その他営業収益      | 432,889                                   | 345,390                                   |
| 営業収益計        | 63,795,032                                | 72,648,873                                |
| 営業費用         |   |   |
| 支払手数料        | 37,293,022                                | 41,437,322                                |
| 広告宣伝費        | 917,652                                   | 967,991                                   |
| 公告費          | 257                                       | 1,256                                     |
| 受益証券発行費      | 131                                       | 3   |
| 調査費          | 4,336,342                                 | 6,192,360                                 |
| 調査費          | 771,298                                   | 831,159                                   |
| 委託調査費        | 3,565,043                                 | 5,361,200                                 |
| 委託計算費        | 601,778                                   | 718,414                                   |
| 営業雑経費        | 1,793,369                                 | 1,806,147                                 |
| 通信費          | 284,273                                   | 287,454                                   |
| 印刷費          | 837,408                                   | 674,758                                   |
| 協会費          | 45,168                                    | 47,465                                    |
| 諸会費          | 11,118                                    | 10,778                                    |
| その他営業雑経費     | 615,400                                   | 785,691                                   |
| 営業費用計        | 44,942,552                                | 51,123,496                                |
| 一般管理費        |   |   |
| 給料           | 4,847,709                                 | 4,192,794                                 |
| 役員報酬         | 217,200                                   | 157,200                                   |
| 給料・手当        | 3,478,553                                 | 3,545,655                                 |
| 賞与           | 313,555                                   | 226,939                                   |
| 賞与引当金繰入額     | 838,400                                   | 263,000                                   |
| 福利厚生費        | 680,311                                   | 619,459                                   |
| 交際費          | 80,019                                    | 68,476                                    |
| 寄付金          | -   | 638                                       |
| 旅費交通費        | 178,718                                   | 266,082                                   |
| 租税公課         | 166,974                                   | 169,305                                   |
| 不動産賃借料       | 731,728                                   | 680,147                                   |
| 退職給付費用       | 303,972                                   | 334,864                                   |
| 役員退職慰労引当金繰入額 | 37,500                                    | 28,500                                    |
| 固定資産減価償却費    | 941,172                                   | 897,352                                   |
| 諸経費          | 990,534                                   | 1,170,318                                 |
| 一般管理費計       | 8,958,640                                 | 8,427,939                                 |
| 営業利益         | 9,893,838                                 | 13,097,437                                |

(単位:千円)

|                | 前事業年度<br>(自 平成21年 4月 1日<br>至 平成22年 3月31日) |           | 当事業年度<br>(自 平成22年 4月 1日<br>至 平成23年 3月31日) |            |
|----------------|---|-----------|---|------------|
| <b>営業外収益</b>   |   |           |   |            |
| 受取配当金          |   | 61,884    | 1   | 573,514    |
| 有価証券利息         |   | 87,447    |   | 23,029     |
| 受取利息           |   | 3,425     |   | 2,673      |
| 時効成立分配金・償還金    |   | 40,507    |   | 149,120    |
| 投資有価証券売却益      |   | 213,196   |   | 38,591     |
| 有価証券償還益        |   | 33,090    |   | -          |
| その他            |   | 82,595    |   | 45,094     |
| 営業外収益計         |   | 522,147   |   | 832,022    |
| <b>営業外費用</b>   |   |           |   |            |
| 時効成立後支払分配金・償還金 |   | 101,945   |   | 98,613     |
| 貯蔵品廃棄損         |   | 44,214    |   | 25,533     |
| 投資有価証券売却損      |   | 263,840   |   | 7,515      |
| 為替差損           |   | 7,870     |   | -          |
| 投資不動産管理費用      |   | -         |   | 20,028     |
| その他            |   | 68,406    |   | 36,603     |
| 営業外費用計         |   | 486,276   |   | 188,294    |
| 経常利益           |   | 9,929,709 |   | 13,741,165 |
| <b>特別利益</b>    |   |           |   |            |
| 貸倒引当金戻入額       |   | 159,959   |   | 614,232    |
| 特別利益計          |   | 159,959   |   | 614,232    |
| <b>特別損失</b>    |   |           |   |            |
| 固定資産除却損        | 2   | 16,233    | 2   | 1,067      |
| ゴルフ会員権評価損      |   | -         |   | 21,290     |
| 減損損失           | 3   | 76,450    | 3   | 35,468     |
| その他            |   | -         |   | 768        |
| 特別損失計          |   | 92,683    |   | 58,595     |
| 税引前当期純利益       |   | 9,996,985 |   | 14,296,802 |
| 法人税、住民税及び事業税   |   | 4,592,433 |   | 4,834,931  |
| 法人税等調整額        |   | 516,225   |   | 256,140    |
| 法人税等合計         |   | 4,076,208 |   | 5,091,072  |
| 当期純利益          |   | 5,920,777 |   | 9,205,730  |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

|          | 前事業年度<br>(自 平成21年 4月 1日<br>至 平成22年 3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成22年 4月 1日<br>至 平成23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 |   |   |
| 別途積立金    |   |   |
| 前期末残高    | 2,800,000                                 | 2,800,000                                 |
| 当期変動額    |   |   |
| 別途積立金の取崩 | -   | 2,800,000                                 |
| 当期変動額合計  | -   | 2,800,000                                 |
| 当期末残高    | 2,800,000                                 | -   |
| 繰越利益剰余金  |   |   |
| 前期末残高    | 9,659,553                                 | 9,085,103                                 |
| 当期変動額    |   |   |
| 別途積立金の取崩 | -   | 2,800,000                                 |
| 剰余金の配当   | 6,495,227                                 | 11,216,657                                |
| 当期純利益    | 5,920,777                                 | 9,205,730                                 |
| 当期変動額合計  | 574,450                                   | 789,072                                   |
| 当期末残高    | 9,085,103                                 | 9,874,176                                 |
| 利益剰余金合計  |   |   |
| 前期末残高    | 12,833,851                                | 12,259,401                                |
| 当期変動額    |   |   |
| 剰余金の配当   | 6,495,227                                 | 11,216,657                                |

|         |            |            |
|---------|------------|------------|
| 当期純利益   | 5,920,777  | 9,205,730  |
| 当期変動額合計 | 574,450    | 2,010,927  |
| 当期末残高   | 12,259,401 | 10,248,473 |

(単位:千円)

|                         | 前事業年度<br>(自平成21年4月1日<br>至平成22年3月31日) | 当事業年度<br>(自平成22年4月1日<br>至平成23年3月31日) |
|-------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| <b>株主資本合計</b>           |                                      |                                      |
| 前期末残高                   | 39,503,851                           | 38,929,401                           |
| 当期変動額                   |                                      |                                      |
| 剰余金の配当                  | 6,495,227                            | 11,216,657                           |
| 当期純利益                   | 5,920,777                            | 9,205,730                            |
| 当期変動額合計                 | 574,450                              | 2,010,927                            |
| 当期末残高                   | 38,929,401                           | 36,918,473                           |
| <b>評価・換算差額等</b>         |                                      |                                      |
| <b>その他有価証券評価差額金</b>     |                                      |                                      |
| 前期末残高                   | 618,549                              | 18,061                               |
| 当期変動額                   |                                      |                                      |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | 600,487                              | 85,978                               |
| 当期変動額合計                 | 600,487                              | 85,978                               |
| 当期末残高                   | 18,061                               | 104,040                              |
| <b>繰延ヘッジ損益</b>          |                                      |                                      |
| 前期末残高                   | -                                    | 55,712                               |
| 当期変動額                   |                                      |                                      |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | 55,712                               | 141,615                              |
| 当期変動額合計                 | 55,712                               | 141,615                              |
| 当期末残高                   | 55,712                               | 85,902                               |
| <b>評価・換算差額等合計</b>       |                                      |                                      |
| 前期末残高                   | 618,549                              | 73,774                               |
| 当期変動額                   |                                      |                                      |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | 544,775                              | 55,636                               |
| 当期変動額合計                 | 544,775                              | 55,636                               |
| 当期末残高                   | 73,774                               | 18,137                               |
| <b>純資産合計</b>            |                                      |                                      |
| 前期末残高                   | 38,885,301                           | 38,855,627                           |
| 当期変動額                   |                                      |                                      |
| 剰余金の配当                  | 6,495,227                            | 11,216,657                           |
| 当期純利益                   | 5,920,777                            | 9,205,730                            |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額(純額) | 544,775                              | 55,636                               |
| 当期変動額合計                 | 29,674                               | 1,955,290                            |
| 当期末残高                   | 38,855,627                           | 36,900,336                           |

## 重要な会計方針

|                          | 前事業年度<br>(自 平成21年 4月 1日<br>至 平成22年 3月31日)  | 当事業年度<br>(自 平成22年 4月 1日<br>至 平成23年 3月31日)  |
|--------------------------|--|--|
| 1. 有価証券の評価基準<br>及び評価方法   | (1) 子会社及び関連会社株式<br>移動平均法による原価法によ<br>り計上しております。<br>(2) その他有価証券<br>時価のあるもの<br>決算日の市場価格等に基づく<br>時価法（評価差額は全部純資産<br>直入法により処理し、売却原価<br>は移動平均法により算定）を採<br>用しております。<br>時価のないもの<br>移動平均法による原価法を採<br>用しております。              | (1) 子会社及び関連会社株式<br>同左<br>(2) その他有価証券<br>同左   |
| 2. デリバティブの評価<br>基準及び評価方法 | 時価法により計上しておりま<br>す。  | 同左   |
| 3. 固定資産の減価償却<br>の方法      | (1) 有形固定資産及び投資不動産<br>（リース資産を除く）<br>定率法によっております。<br>なお、主な耐用年数は以下の通<br>りであります。<br>建物 6～47年<br>器具備品 3～20年<br>(2) 無形固定資産<br>（リース資産を除く）<br>定額法によっております。<br>なお、自社利用のソフトウェア<br>については、社内における利用可<br>能期間（5年）に基づいておりま<br>す。 | (1) 有形固定資産及び投資不動産<br>同左<br>(2) 無形固定資産<br>同左  |
| 4. 引当金の計上基準              | (3) 長期前払費用<br>定額法によっております。<br>(1) 貸倒引当金<br>債権等の貸倒損失に備えるた<br>め、一般債権については貸倒実績<br>率法により、貸倒懸念債権及び破<br>産更生債権等については財務内容<br>評価法により計上しております。<br>(2) 賞与引当金<br>役員および従業員に対する賞与<br>の支給に備えるため、支給見込額<br>を計上しております。             | (3) 長期前払費用<br>同左<br>(1) 貸倒引当金<br>債権の貸倒損失に備えるため、<br>一般債権については貸倒実績率法<br>により、貸倒懸念債権及び破産更<br>生債権等については財務内容評価<br>法により計上しております。<br>(2) 賞与引当金<br>従業員に対する賞与の支給に備<br>えるため、支給見込額を計上して<br>おります。 |

|                             |  |  |
|-----------------------------|--|--|
| 5 . ヘッジ会計の方法                | <p>(3) 退職給付引当金<br/>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。<br/>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<br/>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) ヘッジ会計の方法<br/>繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象<br/>ヘッジ手段・・・株価指数先物<br/>ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針<br/>価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法<br/>原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。</p> | <p>(3) 退職給付引当金<br/>同左</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金<br/>同左</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法<br/>同左</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象<br/>同左</p> <p>(3) ヘッジ方針<br/>同左</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法<br/>同左</p> |
| 6 . リース取引の処理方法              | <p>リース取引開始日が平成20年3月31日以前の、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>   |  |
| 7 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>(1) 消費税等の会計処理<br/>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<br/>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<br/>同左</p> <p>(2) 連結納税制度の適用<br/>同左</p>  |

## 会計方針の変更

|   |   |
|---|---|
| <p>前事業年度<br/>(自 平成21年4月1日<br/>至 平成22年3月31日)</p> | <p>当事業年度<br/>(自 平成22年4月1日<br/>至 平成23年3月31日)</p> |
|---|---|

|  |  |
|--|--|
|  | <p>(資産除去債務に関する会計基準の適用)</p> <p>当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。</p> <p>なお、当該変更に伴う損益に与える影響はありません。</p> |
|--|--|

## 表示方法の変更

| 前事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日)  |
|--|---|
|  | <p>(損益計算書)</p> <p>1. 「有価証券償還益」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外収益に区分掲記しておりましたが、重要性が低いため「その他」に含めて表示しております。</p> <p>なお、当事業年度の、営業外収益の「その他」に含まれている「有価証券償還益」の金額は、3,185千円であります。</p> <p>2. 「投資不動産管理費用」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外費用の「その他」に含めて表示しておりましたが、重要性が増したため、当事業年度より、営業外費用の「投資不動産管理費用」として区分掲記しております。</p> <p>なお、前事業年度の営業外費用の「その他」に含まれている「投資不動産管理費用」の金額は、17,078千円であります。</p> <p>3. 「為替差損」の表示方法は、従来、損益計算書上、営業外費用に区分掲記しておりましたが、重要性が低いため「その他」に含めて表示しております。なお、当事業年度の、営業外費用の「その他」に含まれている「為替差損」の金額は、8,906千円であります。</p> |

## 追加情報

| 前事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日)   | 当事業年度<br>(自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日) |
|--|--|
| <p>(投資有価証券売却損益の計上区分の変更)</p> <p>従来、投資有価証券売却損益は、特別利益又は特別損失の区分において処理しておりましたが、投資有価証券の保有方針等を勘案し、今後、経常的に発生すると見込まれるものについては、実態をより適切に表示するため、当事業年度より営業外収益又は営業外費用の区分において処理しております。</p> <p>この結果、従来の方法と同一の方法によった場合と比べ、経常利益は50,644千円少なく計上されておりますが、税引前当期純利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<br>（平成22年3月31日現在）  | 当事業年度<br>（平成23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> <p>建物 815,365千円<br/>器具備品 1,938,369千円<br/>投資建物 688,305千円<br/>投資器具備品 27,339千円</p> <p>2 関係会社項目<br/>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。<br/>未払金 3,002,391千円</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<br/>子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務598,500千円に対して保証を行っております。</p> | <p>1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額</p> <p>建物 854,118千円<br/>器具備品 2,129,756千円<br/>投資建物 700,991千円<br/>投資器具備品 28,141千円</p> <p>2 関係会社項目<br/>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。<br/>未払金 2,591,913千円</p> <p>4 保証債務<br/>子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,384,110千円に対して保証を行っております。</p> |

## （損益計算書関係）

| 前事業年度<br>（自平成21年4月1日<br>至平成22年3月31日）                                    | 当事業年度<br>（自平成22年4月1日<br>至平成23年3月31日）  |
|---|---|
| <p>2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>器具備品 1,439千円<br/>ソフトウェア 14,793千円</p> | <p>1 関係会社項目<br/>関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。<br/>受取配当金 460,584千円</p> <p>2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。</p> <p>器具備品 1,067千円</p> |

## 3 減損損失に関する注記

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。  
場所 千葉県浦安市  
用途 賃貸等不動産(浦安寮)  
種類 建物及び土地

当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグルーピングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失(76,450千円)として特別損失に計上しております。その内訳は、建物7,750千円及び土地68,700千円であります。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により評価しております。

## 3 減損損失に関する注記

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。  
場所 千葉県浦安市  
用途 賃貸等不動産(浦安寮)  
種類 建物及び土地

当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグルーピングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失(35,468千円)として特別損失に計上しております。その内訳は、建物26,868千円及び土地8,600千円であります。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により評価しております。

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成21年4月1日至平成22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<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>の総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|------------------------|---------------------|----------------|----------------|
| 平成21年6月19日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 6,495                  | 2,490               | 平成21年<br>3月31日 | 平成21年<br>6月22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22年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

剰余金の配当の総額 11,216百万円  
配当の原資 利益剰余金  
1株当たり配当額 4,300円  
基準日 平成22年3月31日  
効力発生日 平成22年6月28日

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>の総額<br>(百万円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|------------------------|---------------------|----------------|----------------|
| 平成22年6月25日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 11,216                 | 4,300               | 平成22年<br>3月31日 | 平成22年<br>6月28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23年6月24日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

剰余金の配当の総額 9,182百万円  
 配当の原資 利益剰余金  
 1株当たり配当額 3,520円  
 基準日 平成23年3月31日  
 効力発生日 平成23年6月27日

## (リース取引関係)

| 前事業年度<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日)   | 当事業年度<br>(自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日) |
|--|--|
| (借主側)<br>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<br>(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<br>該当事項はありません。<br>(2) 未経過リース料期末残高相当額<br>該当事項はありません。<br>(3) 支払リース料及び減価償却費相当額 |  |

|                                    |       |
|------------------------------------|-------|
| 支払リース料                             | 985千円 |
| 減価償却費相当額                           | 985千円 |
| (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。 |       |

## （金融商品関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

### 1．金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

デリバティブ取引は為替予約及び株式先物取引を行っております。当社ではこれらをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる為替変動リスク及び価格変動リスクをヘッジしております。このうち株式先物取引についてはヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

##### 市場リスクの管理

##### （ ）為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っており、外貨建資産担保債券について為替予約を利用してヘッジしております。

##### （ ）価格変動リスクの管理

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

有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

( ) デリバティブ取引

デリバティブ取引に関しては、ヘッジ手段に用いる場合にのみ限定しております。取引の執行・管理については財務リスク管理規程に従って行っており、取引の状況を財務会議において行っております。

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、デリバティブ取引は信用リスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2. 金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（<注2>参照のこと）。

（単位：千円）

|                            | 貸借対照表<br>計上額 | 時価         | 差額 |
|----------------------------|--------------|------------|----|
| (1) 現金・預金                  | 4,783,803    | 4,783,803  | -  |
| (2) 未収委託者報酬                | 7,030,430    | 7,030,430  | -  |
| (3) 有価証券及び投資有価証券<br>其他有価証券 | 34,012,542   | 34,012,542 | -  |
| 資産計                        | 45,826,776   | 45,826,776 | -  |
| (1) 未払手数料                  | 3,847,895    | 3,847,895  | -  |
| (2) その他未払金                 | 3,164,277    | 3,164,277  | -  |
| (3) 未払費用（*1）               | 1,696,832    | 1,696,832  | -  |
| 負債計                        | 8,709,004    | 8,709,004  | -  |
| デリバティブ取引（*2）               |              |            |    |
| ヘッジ会計が適用されていないもの           | (7,985)      | (7,985)    | -  |
| ヘッジ会計が適用されているもの            | (159,516)    | (159,516)  | -  |
| デリバティブ取引計                  | (167,501)    | (167,501)  | -  |

（\*1）未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（\*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

<注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資産

## (1) 現金・預金、及び(2) 未収委託者報酬

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

## (3) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

## (1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

| 区分                | 貸借対照表計上額  |
|-------------------|-----------|
| (1) その他有価証券       |           |
| 外貨建資産担保債券(*1)     | 311,905   |
| 非上場株式             | 1,172,137 |
| (2) 子会社株式及び関連会社株式 |           |
| 子会社株式             | 737,012   |
| (3) 長期差入保証金       | 617,615   |

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

(\*1) 外貨建資産担保債券に対する貸倒引当金を控除しております。

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

|                       | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|-----------------------|------------|-------------|--------------|------|
| 現金・預金                 | 4,783,803  | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬               | 7,030,430  | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券          |            |             |              |      |
| その他有価証券のうち満期<br>があるもの | -          | 746,330     | 1,547,596    | -    |
| 合計                    | 11,814,233 | 746,330     | 1,547,596    | -    |

外貨建資産担保債券311,905千円は清算事象が生じており、償還予定額を見込めないため上記表には含めておりません。

（追加情報）

当事業年度より、平成20年3月31日公表の「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準委員会 企業会計基準第10号）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第19号）を適用しております。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社では、これをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、ヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

（ ）デリバティブ取引

デリバティブ取引に関しては、ヘッジ手段に用いる場合にのみ限定しております。取引の執行・管理については財務リスク管理規程に従って行っており、取引の状況を財務会議において行っております。

#### 信用リスクの管理

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

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2. 金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（<注2>参照のこと）。

（単位：千円）

|                             | 貸借対照表<br>計上額 | 時価         | 差額 |
|-----------------------------|--------------|------------|----|
| (1) 現金・預金                   | 1,820,358    | 1,820,358  | -  |
| (2) 未収委託者報酬                 | 6,933,076    | 6,933,076  | -  |
| (3) 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券 | 30,154,565   | 30,154,565 | -  |
| 資産計                         | 38,908,001   | 38,908,001 | -  |
| (1) 未払手数料                   | 3,725,807    | 3,725,807  | -  |
| (2) その他未払金                  | 2,627,872    | 2,627,872  | -  |
| (3) 未払費用（*1）                | 1,951,710    | 1,951,710  | -  |
| 負債計                         | 8,305,391    | 8,305,391  | -  |
| デリバティブ取引（*2）                | 183,430      | 183,430    | -  |

（\*1）未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（\*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

#### <注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

#### 資産

##### （1）現金・預金、及び（2）未収委託者報酬

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

##### （3）有価証券及び投資有価証券

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

関係」をご参照下さい。

## 負債

### （１）未払手数料、（２）その他未払金、並びに（３）未払費用

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

## デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注 2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

| 区分                         | 貸借対照表計上額  |
|----------------------------|-----------|
| (1) その他有価証券<br>非上場株式       | 1,172,137 |
| (2) 子会社株式及び関連会社株式<br>子会社株式 | 5,141,069 |
| (3) 長期差入保証金                | 609,781   |

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

<注 3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

|                                       | 1年以内      | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|---------------------------------------|-----------|-------------|--------------|------|
| 現金・預金                                 | 1,820,358 | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬                               | 6,933,076 | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券のうち満期<br>があるもの | -         | 1,588,634   | 4,868,529    | -    |
| 合計                                    | 8,753,434 | 1,588,634   | 4,868,529    | -    |

（有価証券関係）

前事業年度（平成22年3月31日現在）

### 1．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（貸借対照表計上額 737,012千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

### 2．その他有価証券

|                          | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|--------------------------|------------------|--------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えるもの  |                  |              |            |
| (1)株式                    | 76,077           | 55,101       | 20,975     |
| (2)その他                   |                  |              |            |
| 証券投資信託の受益証券              | 4,728,727        | 4,379,317    | 349,410    |
| 小計                       | 4,804,805        | 4,434,419    | 370,385    |
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えないもの |                  |              |            |
| その他                      |                  |              |            |
| 証券投資信託の受益証券              | 29,207,737       | 29,608,576   | 400,839    |
| 小計                       | 29,207,737       | 29,608,576   | 400,839    |
| 合計                       | 34,012,542       | 34,042,996   | 30,453     |

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 1,172,137千円)、外貨建資産担保債券(貸借対照表計上額(貸倒引当金控除前) 1,804,069千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

| 種類          | 売却額<br>(千円) | 売却益の合計額<br>(千円) | 売却損の合計額<br>(千円) |
|-------------|-------------|-----------------|-----------------|
| その他         |             |                 |                 |
| 証券投資信託の受益証券 | 13,871,201  | 213,196         | 263,840         |
| 合計          | 13,871,201  | 213,196         | 263,840         |

当事業年度(平成23年3月31日現在)

#### 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

#### 2. その他有価証券

|                          | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|--------------------------|------------------|--------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えるもの  |                  |              |            |
| その他                      |                  |              |            |
| 証券投資信託の受益証券              | 4,822,299        | 4,383,992    | 438,306    |
| 小計                       | 4,822,299        | 4,383,992    | 438,306    |
| 貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えないもの |                  |              |            |
| (1)株式                    | 54,283           | 55,101       | 818        |
| (2)その他                   |                  |              |            |
| 証券投資信託の受益証券              | 25,277,982       | 25,890,888   | 612,906    |
| 小計                       | 25,332,266       | 25,945,990   | 613,724    |

|    |            |            |         |
|----|------------|------------|---------|
| 合計 | 30,154,565 | 30,329,983 | 175,417 |
|----|------------|------------|---------|

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,172,137千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

| 種類                 | 売却額<br>(千円) | 売却益の合計額<br>(千円) | 売却損の合計額<br>(千円) |
|--------------------|-------------|-----------------|-----------------|
| その他<br>証券投資信託の受益証券 | 21,607,835  | 38,591          | 7,515           |
| 合計                 | 21,607,835  | 38,591          | 7,515           |

#### (デリバティブ取引関係)

前事業年度(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

##### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。

##### 通貨関連

(単位：千円)

| 区分            | デリバティブ<br>取引の種類等    | 契約額等    |       | 時価    | 評価損益  |
|---------------|---------------------|---------|-------|-------|-------|
|               |                     |         | うち1年超 |       |       |
| 市場取引<br>以外の取引 | 為替予約取引<br>売建<br>米ドル | 280,388 | -     | 7,985 | 7,985 |
|               | 合計                  | 280,388 | -     | 7,985 | 7,985 |

(注) 時価の算定方法は、取引先の金融機関から提示された価格により評価しております。

##### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

##### 株式関連

(単位：千円)

| ヘッジ<br>会計の<br>方法 | デリバティブ<br>取引の種類等          | 主な<br>ヘッジ<br>対象 | 契約額等      |       | 時価      | 当該時価の<br>算定方法               |
|------------------|---------------------------|-----------------|-----------|-------|---------|-----------------------------|
|                  |                           |                 |           | うち1年超 |         |                             |
| 原則的<br>処理方法      | 株価指数先物取引<br>売建<br>TOPIX先物 | 投資<br>有価証券      | 2,303,784 | -     | 159,516 | 東京証券取引所から公表された価格<br>によっている。 |
|                  | 合計                        |                 | 2,303,784 | -     | 159,516 |                             |

当事業年度(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

## ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

## 株式関連

(単位：千円)

| ヘッジ<br>会計の<br>方法 | デリバティブ<br>取引の種類等          | 主な<br>ヘッジ<br>対象 | 契約額等      |       | 時価      | 当該時価の<br>算定方法               |
|------------------|---------------------------|-----------------|-----------|-------|---------|-----------------------------|
|                  |                           |                 |           | うち1年超 |         |                             |
| 原則的<br>処理方法      | 株価指数先物取引<br>売建<br>TOPIX先物 | 投資<br>有価証券      | 2,435,030 | -     | 183,430 | 東京証券取引所から公表された価格<br>によっている。 |
|                  | 合計                        |                 | 2,435,030 | -     | 183,430 |                             |

## (退職給付関係)

| 前事業年度<br>(平成22年3月31日現在)   | 当事業年度<br>(平成23年3月31日現在)   |
|---|---|
| 1. 採用している退職給付制度の概要<br>当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠<br>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<br>同左  |
| 2. 退職給付債務に関する事項<br>退職給付債務 1,179,482千円<br>退職給付引当金 1,179,482千円    | 2. 退職給付債務に関する事項<br>退職給付債務 1,410,635千円<br>退職給付引当金 1,410,635千円    |
| 3. 退職給付費用に関する事項<br>勤務費用 175,249千円<br>その他 128,723千円              | 3. 退職給付費用に関する事項<br>勤務費用 191,300千円<br>その他 143,564千円              |
| 退職給付費用 303,972千円<br>なお、「その他」の128,723千円は、確定<br>拠出年金への掛金支払額であります。 | 退職給付費用 334,864千円<br>なお、「その他」の143,564千円は、確定<br>拠出年金への掛金支払額であります。 |

## (税効果会計関係)

| 前事業年度<br>(平成22年3月31日現在)          | 当事業年度<br>(平成23年3月31日現在)          |
|----------------------------------|----------------------------------|
| 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生<br>の主な原因別内訳 | 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生<br>の主な原因別内訳 |
| 繰延税金資産 千円                        | 繰延税金資産 千円                        |
| 減損損失 915,392                     | 減損損失 928,499                     |
| 貸倒引当金 609,077                    | 退職給付引当金 573,987                  |
| 退職給付引当金 479,931                  | 連結法人間取引(譲渡損) 294,850             |
| 賞与引当金 302,163                    | 投資有価証券評価損 216,468                |
| 株式譲渡損繰延 287,965                  | 未払事業税 212,062                    |
| 投資有価証券評価損 225,062                | 出資金評価損 128,238                   |
| 外貨建有価証券換算差額 176,654              | その他有価証券評価差額金 125,395             |
| 未払事業税 163,956                    | 賞与引当金 107,014                    |
| 出資金評価損 126,163                   | 器具備品 38,093                      |
| その他有価証券評価差額金 65,652              | 役員退職慰労引当金 24,072                 |
| 未払社会保険料 44,836                   | 未払社会保険料 11,722                   |

|   |           |   |           |
|---|-----------|---|-----------|
| 繰延ヘッジ損益   | 38,221    | その他   | 28,763    |
| 器具備品  | 38,093    | 繰延税金資産小計  | 2,689,169 |
| 役員退職慰労引当金   | 15,991    | 評価性引当額  | 1,547,609 |
| その他   | 27,316    | 繰延税金資産合計  | 1,141,560 |
| 繰延税金資産小計  | 3,516,480 | 繰延税金負債  |           |
| 評価性引当額  | 2,139,543 | 連結法人間取引（譲渡益）  | 2,772,301 |
| 繰延税金資産合計  | 1,376,937 | 繰延ヘッジ損益   | 58,934    |
| 繰延税金負債  |           | その他   | 2,156     |
| 株式譲渡益繰延   | 2,772,301 | 繰延税金負債合計  | 2,833,392 |
| その他   | 2,156     | 繰延税金負債の純額   | 1,691,832 |
| 繰延税金負債合計  | 2,774,458 |   |           |
| 繰延税金負債の純額   | 1,397,521 |   |           |
| 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 |           | 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 |           |
| 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。 |           | 法定実効税率<br>（調整）  | 40.69%    |
|   |           | 交際費等永久に損金に算入されない項目  | 0.21      |
|   |           | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目  | 1.25      |
|   |           | 住民税均等割  | 0.02      |
|   |           | 評価性引当額  | 4.14      |
|   |           | その他   | 0.07      |
|   |           | 税効果会計適用後の法人税等の負担率   | 35.60     |

## ( 関連当事者情報 )

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

## 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       | 資本金または出資金（百万円） | 事業の内容   | 議決権等の所有（被所有）割合（%） | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-----|--|-----------|----------------|---------|-------------------|-----------|-------|----------|----|----------|
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd. | Singapore | 133            | 金融商品取引業 | (所有) 直接 100.0     | 経営管理      | 債務保証  | 598,500  | -  | -        |

## (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<br>または<br>出資金<br>(百万円) | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合<br>(%) | 関連当事者<br>との関係   | 取引の内容        | 取引金額<br>(千円) | 科目    | 期末残高<br>(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 | 22,043,473   | 未払手数料 | 2,870,857    |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券キャピタル・マーケット(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 | 676,687      | 未払手数料 | 64,597       |
|             |                    |         |                            |           |                                   |                 | 為替予約         | 3,946,508    | -     | -            |

(注) 1. 上記金額のうち、証券投資信託の代行手数料の取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として、代行手数料を支払っております。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. 大和証券エスエムピーシー(株)は、平成22年1月1日付で、大和証券キャピタル・マーケット(株)に商号変更しております。

2. 親会社に関する注記

(株)大和証券グループ本社(東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

当事業年度(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

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<br>または<br>出資金<br>(百万円) | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合<br>(%) | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(千円) | 科目 | 期末残高<br>(千円) |
|-----|---|-----------|----------------------------|-----------|-----------------------------------|---------------|-------|--------------|----|--------------|
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.        | Singapore | 133                        | 金融商品取引業   | (所有)直接100.0                       | 経営管理          | 債務保証  | 1,384,110    | -  | -            |
| 子会社 | Daiwa Asset Management (India)Private Limited | India     | 1,128                      | 金融商品取引業   | (所有)直接91.0                        | 経営管理          | 増資の引受 | 3,204,985    | -  | -            |

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関する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。

(2) インド共和国における外国資本規制上の最低払込金額を満たすため、当社がDaiwa Asset Management(India)Private Limited社の行った増資を1株につき72円86銭で引き受けております。

## (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<br>または<br>出資金<br>(百万円) | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合<br>(%) | 関連当事者<br>との関係   | 取引の内容        | 取引金額<br>(千円) | 科目    | 期末残高<br>(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 | 21,941,957   | 未払手数料 | 2,760,790    |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券<br>キャピタル<br>・<br>マーケット(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 | 666,862      | 未払手数料 | 70,947       |
|             |                                |         |                            |           |                                   |                 | 為替予約         | 1,160,187    | -     | -            |
| 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    | 1,085,626    | 未払費用  | 129,623      |

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を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。

## 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）

## (セグメント情報等)

## [ セグメント情報 ]

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

## [ 関連情報 ]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

## 1. サービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

（単位：千円）

|      | 資産運用に関する事業 | 合計     |
|------|------------|--------|
| 減損損失 | 35,468     | 35,468 |

## [ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

## (追加情報)

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等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20号 平成20年3月21日）を適用しております。

## (1株当たり情報)

| 前事業年度<br>（自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日）             | 当事業年度<br>（自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日）       |
|--|--|
| 1株当たり純資産額 14,895.63円<br>1株当たり当期純利益 2,269.77円       | 1株当たり純資産額 14,146.05円<br>1株当たり当期純利益 3,529.09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。 | 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<br>(自 平成21年 4月 1日<br>至 平成22年 3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成22年 4月 1日<br>至 平成23年 3月31日) |
|-----------------|---|---|
| 当期純利益(千円)       | 5,920,777                                 | 9,205,730                                 |
| 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<br>(自 平成21年 4月 1日<br>至 平成22年 3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成22年 4月 1日<br>至 平成23年 3月31日) |
|---|---|
| 該当事項はありません。                               | 同左  |

## (追加情報)

前事業年度(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

当社及び株式会社大和証券グループ本社(以下、総称して「大和証券グループ」)は、株式会社新生銀行傘下で、インド共和国においてアセットマネジメント事業を行っているShinsei Asset Management (India) Private Limited(以下、「SAMI」)及びShinsei Trustee Company (India) Private Limited(以下、「STC」)の全株式を株式会社新生銀行及びその他の株主から取得いたしました。

本件について、平成22年12月20日に買収手続きを完了した後、「SAMI」及び「STC」は、Daiwa Asset Management (India) Private Limited(以下、「DAMI」)及びDaiwa Trustee Company (India) Private Limited(以下、「DTC」)として商号を変更しました。その後、インドにおける外国資本規制上の最低払込金額を満たすために、平成23年 1月31日に増資を行っております。「DAMI」及び「DTC」は大和証券グループの100%子会社であり、当社の取得原価、増資の引受、貸借対照表計上額並びに出資比率は下記のとおりであります。

(単位：千円)

|                       | DAMI      | DTC    |
|-----------------------|-----------|--------|
| 取得原価                  | 1,059,552 | 2,717  |
| 増資の引受                 | 3,204,985 | 9,944  |
| 貸借対照表計上額(注)<br>関係会社株式 | 4,391,020 | 13,037 |
| 出資比率                  | 91.0%     | 99.9%  |

(注) 取得付随費用を算入した後の金額になります。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成22年12月20日付で、Shinsei Asset Management (India) Private Limited (現Daiwa Asset Management (India) Private Limited) およびShinsei Trustee Company (India) Private Limited (現Daiwa Trustee Company (India) Private Limited) への出資を行ない、当該2社を子会社といたしました。

##### 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 342,037百万円（平成23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<br>単位：百万円<br>(平成23年3月末日現在) | 事業の内容                                 |
|--------------------------|----------------------------------|---------------------------------------|
| 大和証券キャピタル・マーケット株式会社      | 255,700                          | (注1)                                  |
| S M B C 日興証券株式会社         | 10,000                           |                                       |
| クレディ・アグリコル証券会社 東京支店      | 38,500                           | (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<br>第一種金融商品取引業を<br>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            | 96,307                           |                                       |
| ソシエテ ジェネラル証券会社 東京支店      | 26,703                           | (注2)                                  |
| ドイツ証券株式会社                | 72,728                           | 金融商品取引法に定める<br>第一種金融商品取引業を<br>営んでいます。 |
| 野村証券株式会社                 | 10,000                           |                                       |
| パークレイズ・キャピタル証券株式会社       | 32,945                           |                                       |
| B N P パリバ証券株式会社          | ( 1 ) 102,025                    |                                       |
| みずほ証券株式会社                | 125,167                          |                                       |
| みずほインベスターズ証券株式会社         | 80,288                           |                                       |
| 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社    | ( 2 ) 18,000                     |                                       |
| メリルリンチ日本証券株式会社           | 119,440                          |                                       |
| モルガン・スタンレーM U F G 証券株式会社 | 126,149                          |                                       |
| U B S 証券会社 東京支店          | 60,000                           |                                       |

( 1 ) 資本金の額は、平成23年5月 1 日現在のものです。

( 2 ) 資本金の額は、平成23年4月22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いません。

### 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23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22年10月1日 | 有価証券届出書・同添付書類、有価証券報告書（第9期）・同添付書類 |
| 平成23年4月1日  | 半期報告書（第10期中）、有価証券届出書の訂正届出書       |
| 平成23年4月28日 | 有価証券届出書の訂正届出書                    |
| 平成23年5月23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23年8月5日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 茂 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ上場投信 - トピックスの平成22年7月11日から平成23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23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23年6月2日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

|                    |       |       |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 森 公 高 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 福 井 淳 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 梅 津 広 |

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22年4月1日から平成23年3月31日までの第52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23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22年8月13日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 山元 太志 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久野 佳樹 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ上場投信 - トピックスの平成21年7月11日から平成22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22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22年6月25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21年4月1日から平成22年3月31日までの第51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22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。