

【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24年10月3日提出
【計算期間】 第11計算期間
(自 平成23年7月11日 至 平成24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 白川 真
【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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、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および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の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の停止またはT O P I Xの商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができる。
- （株）東京証券取引所は、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の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また（株）東京証券取引所は、T O P I Xの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負わない。
- 「ダイワ上場投信ートピックス」は、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、保証または販売されるものではない。
- （株）東京証券取引所は、「ダイワ上場投信ートピックス」の購入者または公衆に対し、「ダイワ上場投信ートピックス」の説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。
- 以上の項目に限らず、（株）東京証券取引所は「ダイワ上場投信ートピックス」の発行等または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。

2

当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

●受益権は、東京証券取引所に上場され、株式と同様に売買することができます。

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

●追加設定は、株式により行ないます。

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

●受益権を株式と交換することができます。

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

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

3

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

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

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

1：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項(運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等)が規定されています。

2：受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務の内容等が規定されています。

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

< 委託会社の概況(平成24年7月末日現在) >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

昭和34年12月12日	設立登記
昭和35年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
昭和35年 4月 1日	営業開始
昭和60年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
平成 7年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
平成 7年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
平成19年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長(金商)第352号)

・ 大株主の状況

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

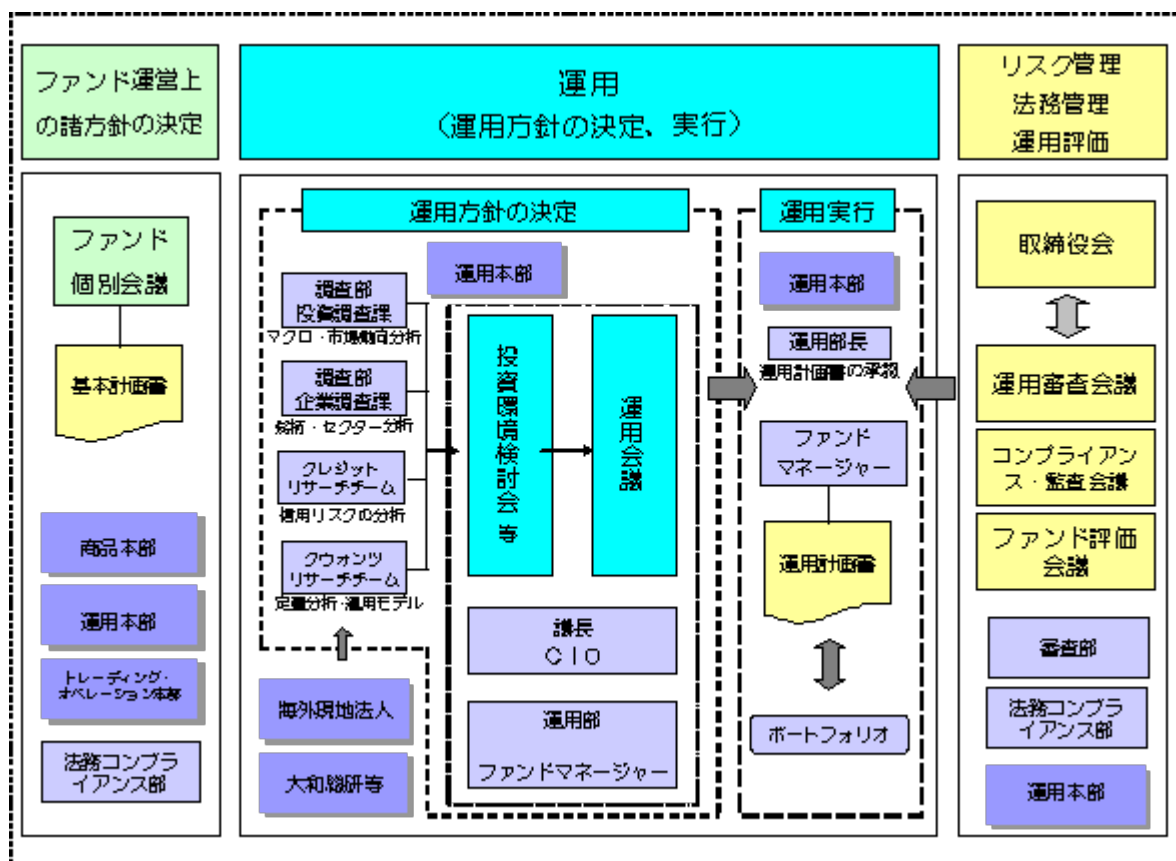
3. コール・ローン

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C I O（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ．基本的な運用方針の決定

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

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．C I O（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営

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

ロ．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

ＣＩＯを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．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25～35名程度です。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成24年7月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資する株式の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りでは

ありません。

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

先物取引等（信託約款）

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

有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への投資は、行ないません。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

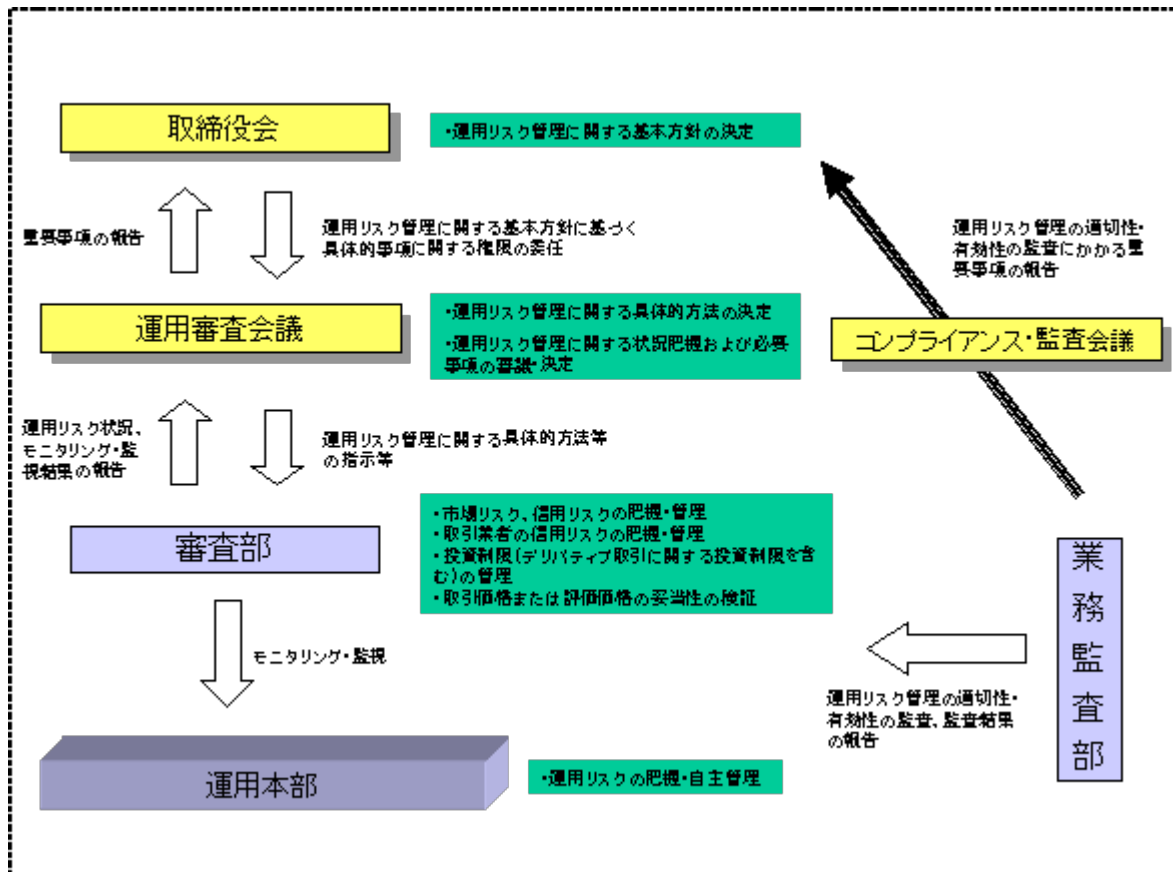
その他

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。

個人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

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

ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。

平成25年1月1日から平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

期間	税率
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%および地方税3%）
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%および地方税3%）
平成26年1月1日から	20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）

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

ロ．収益分配金の受取時

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

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

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

ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。平成25年1月1日から平成49年12月31日まで、収益分配金の受取時に、収益分配金に対する所得税の源泉徴収額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

申告不要制度を選択した場合、および確定申告を行ない申告分離課税を選択した場合の期間ごと

の税率は、上記イ．の表と同じです。

ハ．受益権と現物株式との交換時

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

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

法人の投資者に対する課税

イ．受益権の売却時

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

ロ．収益分配金の受取時

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

ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。

平成25年1月1日から平成49年12月31日までは基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

期間	税率
平成24年12月31日まで	7%（所得税7%）
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	7.147%（所得税7%および復興特別所得税0.147%）
平成26年1月1日から	15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）

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24年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成24年7月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	280,230,365,595	99.84
内 日本	280,230,365,595	99.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	438,777,684	0.16
純資産総額	280,669,143,279	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）	440,400,000	0.16
内 日本	440,400,000	0.16

(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24年7月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、 口数 または 額 面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3,613,400	3,092.03 11,172,765,366	3,020.00 10,912,468,000	3.89
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	20,824,100	382.73 7,970,035,830	381.00 7,933,982,100	2.83
3	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,351,300	2,574.71 6,053,935,405	2,551.00 5,998,166,300	2.14
4	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,088,600	2,574.78 5,377,691,280	2,488.00 5,196,436,800	1.85
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1,266,900	3,733.49 4,729,971,124	3,635.00 4,605,181,500	1.64
6	キヤノン	日本	株式	電気機器	1,731,500	3,041.10 5,265,677,180	2,650.00 4,588,475,000	1.63
7	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	35,385,700	128.90 4,561,367,080	129.00 4,564,755,300	1.63
8	武田薬品	日本	株式	医薬品	1,093,600	3,609.57 3,947,432,817	3,600.00 3,936,960,000	1.40

9	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,246,400	2,924.23 3,644,763,517	3,005.00 3,745,432,000	1.33
10	ファナック	日本	株式	電気機器	290,300	12,544.73 3,641,736,581	12,210.00 3,544,563,000	1.26
11	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	1,384,900	2,298.25 3,182,858,575	2,464.00 3,412,393,600	1.22
12	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,003,800	1,621.73 3,249,625,245	1,566.00 3,137,950,800	1.12
13	日立	日本	株式	電気機器	6,423,000	473.57 3,041,786,730	465.00 2,986,695,000	1.06
14	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	22,672	132,944.58 3,014,119,651	131,300.00 2,976,833,600	1.06
15	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	1,151,000	2,476.24 2,850,156,144	2,485.00 2,860,235,000	1.02
16	三井物産	日本	株式	卸売業	2,375,300	1,195.11 2,838,753,982	1,167.00 2,771,975,100	0.99
17	三菱地所	日本	株式	不動産業	1,925,000	1,381.60 2,659,591,200	1,416.00 2,725,800,000	0.97
18	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	3,547,500	718.78 2,549,897,688	744.00 2,639,340,000	0.94
19	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	484,800	5,048.66 2,447,590,938	5,020.00 2,433,696,000	0.87
20	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	648,300	3,600.86 2,334,439,140	3,730.00 2,418,159,000	0.86
21	小松製作所	日本	株式	機械	1,361,900	1,815.88 2,473,047,852	1,758.00 2,394,220,200	0.85
22	K D D I	日本	株式	情報・通信業	4,272	535,924.73 2,289,470,452	541,000.00 2,311,152,000	0.82
23	信越化学	日本	株式	化学	523,800	4,321.47 2,263,589,471	3,980.00 2,084,724,000	0.74
24	三井不動産	日本	株式	不動産業	1,221,000	1,472.34 1,797,736,980	1,526.00 1,863,246,000	0.66
25	東京海上HD	日本	株式	保険業	998,500	1,919.88 1,917,000,948	1,812.00 1,809,282,000	0.64
26	住友商事	日本	株式	卸売業	1,624,600	1,113.42 1,808,865,960	1,106.00 1,796,807,600	0.64
27	伊藤忠	日本	株式	卸売業	2,196,200	845.39 1,856,652,925	817.00 1,794,295,400	0.64
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	2,789,000	621.48 1,733,320,080	625.00 1,743,125,000	0.62
29	パナソニック	日本	株式	電気機器	3,186,900	608.63 1,939,661,932	546.00 1,740,047,400	0.62
30	デンソー	日本	株式	輸送用機器	689,100	2,589.45 1,784,395,440	2,519.00 1,735,842,900	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	99.84%

合計	99.84%
----	--------

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

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.67%
建設業	2.58%
食料品	4.19%
繊維製品	0.89%
パルプ・紙	0.30%
化学	5.72%
医薬品	5.45%
石油・石炭製品	0.74%
ゴム製品	0.81%
ガラス・土石製品	0.97%
鉄鋼	1.49%
非鉄金属	1.09%
金属製品	0.71%
機械	4.91%
電気機器	12.17%
輸送用機器	10.35%
精密機器	1.49%
その他製品	1.48%
電気・ガス業	2.35%
陸運業	4.36%
海運業	0.33%
空運業	0.33%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	6.99%
卸売業	5.69%
小売業	4.55%
銀行業	9.94%
証券、商品先物取引業	1.09%
保険業	2.17%
その他金融業	0.89%
不動産業	2.80%
サービス業	2.03%
合計	99.84%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
----	----	-----	-----------	----	----	----	----------

株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 2012年9月	買建	60	449,910,418	440,400,000	0.16%
----------	----	-----------------	----	----	-------------	-------------	-------

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)	東京証券取引 所 市場相場
第2計算期間末 (平成15年7月10日)	99,879,477,172	100,969,945,072	978.2	988.9	981
第3計算期間末 (平成16年7月10日)	326,229,828,165	327,183,172,345	1,160.0	1,163.4	1,162
第4計算期間末 (平成17年7月10日)	225,837,184,387	228,570,557,332	1,188.9	1,203.3	1,191
第5計算期間末 (平成18年7月10日)	354,879,041,066	358,181,582,085	1,614.0	1,629.0	1,613
第6計算期間末 (平成19年7月10日)	377,975,712,627	381,927,367,525	1,813.5	1,832.5	1,812
第7計算期間末 (平成20年7月10日)	382,598,866,794	388,782,960,703	1,308.5	1,329.7	1,310
第8計算期間末 (平成21年7月10日)	169,610,147,395	174,789,556,053	875.7	902.4	877
第9計算期間末 (平成22年7月10日)	212,389,754,464	215,702,142,160	865.0	878.5	865
第10計算期間末 (平成23年7月10日)	242,981,056,419	247,200,364,545	881.1	896.4	883
平成23年7月末日	228,735,413,697	-	847.8	-	850
8月末日	231,224,038,358	-	776.7	-	778
9月末日	249,084,958,517	-	774.6	-	773
10月末日	256,055,073,833	-	777.2	-	778
11月末日	247,142,946,567	-	741.2	-	741
12月末日	262,259,850,584	-	742.2	-	742
平成24年1月末日	271,842,436,835	-	769.3	-	768
2月末日	300,880,328,926	-	851.5	-	850
3月末日	296,810,630,322	-	879.4	-	879
4月末日	272,801,200,109	-	827.7	-	828
5月末日	264,862,334,607	-	740.9	-	738
6月末日	302,649,571,461	-	793.4	-	794
第11計算期間末 (平成24年7月10日)	293,772,258,294	299,715,502,142	766.2	781.7	767
7月末日	280,669,143,279	-	743.6	-	741

(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2計算期間	10.68
第3計算期間	3.39
第4計算期間	14.39
第5計算期間	15.02
第6計算期間	18.96
第7計算期間	21.15
第8計算期間	26.74
第9計算期間	13.49
第10計算期間	15.30
第11計算期間	15.50

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第11計算期間	11.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第11計算期間	147,354,900	39,691,586

[次へ](#)

(参考情報)

2012年7月31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	7,436円
純資産総額	2,806億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-4.4%
3カ月間	-8.3%
6カ月間	-1.4%
1年間	-10.5%
3年間	-17.8%
5年間	-52.5%
設定来	-31.2%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 155円 設定来分配金合計額: 1,552.4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	第11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	12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	155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。

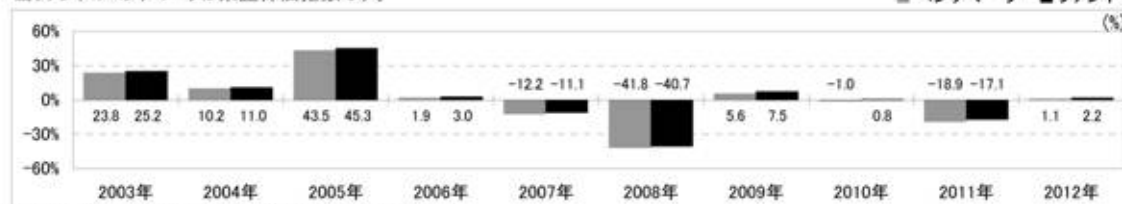
資産別構成			株式東証33業種別構成			組入上位10銘柄		業種名	
	銘柄数	比率		比率			比率		比率
国内株式	1,672	99.8%	電気機器	12.2%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.9%		
国内株式先物	1	0.2%	輸送用機器	10.3%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.8%		
不動産投資信託等	-	-	銀行業	9.9%	本田技研	輸送用機器	2.1%		
コール・ローン、その他	-	0.2%	情報・通信業	7.0%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.9%		
合計	1,673	-	化学	5.7%	日本電信電話	情報・通信業	1.6%		
株式市場・上場別構成			卸売業	5.7%	キャノン	電気機器	1.6%		
一部(東証・大証・名証)		99.8%	医薬品	5.4%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.6%		
二部(東証・大証・名証)		0.0%	機械	4.9%	武田薬品	医薬品	1.4%		
新興市場他		0.0%	小売業	4.6%	ソフトバンク	情報・通信業	1.3%		
その他		-	その他	34.1%	ファナック	電気機器	1.3%		
合計		99.8%	合計	99.8%	合計		19.6%		

※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。

・2012年は7月31日までの騰落率を表しています。

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

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込（販売）手続等】

- イ．受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。
- ロ．受益権の取得申込者は、東証株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの（以下「取得時のバスケット」といいます。）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。また、当該取得時のバスケットの評価額（法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た額をいいます。以下同じ。）をもって、それに相当するものとして委託会社が定める一定口数の受益権を単位として取得するものとします。受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額とします。
- ハ．受益権の取得申込者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後3時）までに取得申込みをした場合には、その翌営業日を取得申込受付日として委託会社は当該取得申込みを受付けます。
- ニ．取得申込受付日に対応する取得時のバスケットを構成する各株式の銘柄名とその数量は、委託会社が取得申込受付日以前の別に定める期日に別に定める方法により提示するものとします。
- ホ．前ロ．にかかわらず、受益権の取得申込者は、取得時のバスケットの評価額が取得する一定口数の受益権の評価額に満たない場合には、その差額に相当する部分を金銭をもって支払うものとします。
- ヘ．前ロ．にかかわらず、取得時のバスケットに受益権の取得申込者が発行した株式またはその親会社（会社法第2条第1項第4号に規定する親会社をいいます。以下同じ。）が発行した株式（以下「自社株式等」といいます。）が含まれる場合には、当該取得申込者は当該自社株式等に代えて当該自社株式等に相当する金額（評価額により算出したものに限りまゝ。）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11期計算期間（平成23年7月11日から平成24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10期 平成23年7月10日現在	第11期 平成24年7月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	36,421,487,076	30,636,040,637
株式	3, 4 242,543,435,766	3, 4 293,178,366,298
派生商品評価勘定	33,571,790	49,012,327
未収入金	1,645,976,271	2,807,960,786
未収配当金	195,176,725	292,084,700
未収利息	188,154	-
その他未収収益	5 11,098,563	5 7,359,591
流動資産合計	280,850,934,345	326,970,824,339
資産合計		
280,850,934,345		
326,970,824,339		
負債の部		
流動負債		
前受金	226,315,000	344,416,000
未払金	-	493,146
未払収益分配金	4,219,308,126	5,943,243,848
未払受託者報酬	51,630,588	66,197,089
未払委託者報酬	98,099,465	124,890,683
未払利息	386,507	316,200
受入担保金	33,206,382,110	26,637,950,811
その他未払費用	67,756,130	81,058,268
流動負債合計	37,869,877,926	33,198,566,045
負債合計		
37,869,877,926		
33,198,566,045		
純資産の部		
元本等		
元本	1 344,714,716,250	1 479,293,858,750
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 101,733,659,831	2 185,521,600,456
（分配準備積立金）	204,632,559	334,799,396
元本等合計	242,981,056,419	293,772,258,294
純資産合計		
242,981,056,419		
293,772,258,294		
負債純資産合計		
280,850,934,345		
326,970,824,339		

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期		第11期	
	自 平成22年7月11日 至 平成23年7月10日		自 平成23年7月11日 至 平成24年7月10日	
営業収益				
受取配当金	4,311,570,529		6,144,825,716	
受取利息	17,767,345		36,323,784	
有価証券売買等損益	4,550,705,754		26,581,052,447	
派生商品取引等損益	242,214,191		398,966,796	
その他収益	¹ 308,071,815		¹ 352,636,944	
営業収益合計	9,430,329,634		20,446,232,799	
営業費用				
支払利息	10,439,182		18,493,722	
受託者報酬	100,915,210		125,198,976	
委託者報酬	191,493,747		235,122,644	
その他費用	68,440,496		81,560,417	
営業費用合計	371,288,635		460,375,759	
営業利益又は営業損失()	9,059,040,999		20,906,608,558	
経常利益又は経常損失()	9,059,040,999		20,906,608,558	
当期純利益又は当期純損失()	9,059,040,999		20,906,608,558	
期首剰余金又は期首欠損金()	94,540,165,536		101,733,659,831	
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,298,695,558		15,859,241,811	
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,298,695,558		15,859,241,811	
剰余金減少額又は欠損金増加額	23,331,922,726		72,797,330,030	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	23,331,922,726		72,797,330,030	
分配金	² 4,219,308,126		² 5,943,243,848	
期末剰余金又は期末欠損金()	101,733,659,831		185,521,600,456	

(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11期 自 平成23年7月11日 至 平成24年7月10日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金	原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(追加情報)

第11期 自 平成23年7月11日 至 平成24年7月10日	
第11期計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第10期 平成23年7月10日現在	第11期 平成24年7月10日現在
	1. 1 期首元本額	306,929,920,000円
期中追加設定元本額	77,263,612,500円	184,193,625,000円
期中一部交換元本額	39,478,816,250円	49,614,482,500円
2. 計算期間末日における受益権の総数	275,771,773口	383,435,087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101,733,659,831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185,521,600,456円であります。
4. 3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 31,643,678,069円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 24,842,134,227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。	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。

	株式	435,410,000円	株式	370,320,000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8,802,850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6,194,300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10期 自平成22年7月11日 至平成23年7月10日	第11期 自平成23年7月11日 至平成24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227,197,840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252,994,970円が含まれております。
2. 2 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（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。	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（6,515,292,722円）及び分配準備積立金(204,632,559円)の合計額から、経費(441,882,037円)を控除して計算される分配対象額は6,278,043,244円（10口当たり163.7円）であり、うち5,943,243,848円（10口当たり155.0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11期 自平成23年7月11日 至平成24年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第11期 平成24年7月10日現在	
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第10期 平成23年7月10日現在	第11期 平成24年7月10日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	4,479,566,384	25,062,627,929
合計	4,479,566,384	25,062,627,929

（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10期 平成23年7月10日 現在				第11期 平成24年7月10日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
株値指数 先物取引								
買 建	395,626,000	-	429,240,000	33,614,000	512,598,000	-	561,660,000	49,062,000
合計	395,626,000	-	429,240,000	33,614,000	512,598,000	-	561,660,000	49,062,000

（注） 1. 時価の算定方法

株値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。

- 株値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。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

第11期 自 平成23年7月11日 至 平成24年7月10日

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

(1口当たり情報)

	第10期 平成23年7月10日現在	第11期 平成24年7月10日現在
1口当たり純資産額 (10口当たり純資産額)	881.1円 (8,811円)	766.2円 (7,662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	125,000	189	23,625,000	貸付株式数 48,000株
日本水産	366,200	207	75,803,400	
マルハニチロホールディングス	629,000	126	79,254,000	
ハウスイ	22,000	105	2,310,000	
サカタのタネ	46,900	1,077	50,511,300	
ホクト	32,300	1,578	50,969,400	
ショーボンドHD	28,200	2,337	65,903,400	
ミライト・ホールディングス	90,200	560	50,512,000	
住石ホールディングス	93,300	78	7,277,400	貸付株式数 35,700株
日鉄鉱業	79,000	316	24,964,000	
三井松島	208,000	127	26,416,000	貸付株式数 79,000株
国際石油開発帝石	3,864	447,000	1,727,208,000	
日本海洋掘削	7,600	2,375	18,050,000	貸付株式数 3,100株 (2,100株)
関東天然瓦斯	32,000	402	12,864,000	
石油資源開発	45,300	3,070	139,071,000	
ダイセキ環境ソリューション	26	146,100	3,798,600	貸付株式数 9株
間組	114,300	206	23,545,800	貸付株式数 52,500株
東急建設	112,840	162	18,280,080	
コムシスホールディングス	154,300	952	146,893,600	
ミサワホーム	30,700	1,283	39,388,100	
高松コンストラクションGP	23,800	1,412	33,605,600	
東建コーポレーション	11,850	3,455	40,941,750	貸付株式数 4,590株
ヤマウラ	12,500	244	3,050,000	
大成建設	1,607,000	222	356,754,000	
大林組	953,000	360	343,080,000	
清水建設	972,000	271	263,412,000	
飛鳥建設	194,200	89	17,283,800	貸付株式数 89,300株
長谷工コーポレーション	1,987,000	56	111,272,000	
松井建設	34,000	330	11,220,000	
鹿島建設	1,490,000	232	345,680,000	貸付株式数 655,000株
不動テトラ	224,500	127	28,511,500	貸付株式数 103,400株
大末建設	122,000	53	6,466,000	貸付株式数 56,000株
鉄建建設	179,000	118	21,122,000	貸付株式数 73,000株
安藤建設	105,000	104	10,920,000	貸付株式数 20,000株
太平工業	53,000	382	20,246,000	
西松建設	416,000	146	60,736,000	
三井住友建設	201,600	59	11,894,400	
大豊建設	80,000	97	7,760,000	貸付株式数 31,000株
前田建設	195,000	374	72,930,000	貸付株式数 73,000株

佐田建設	109,000	67	7,303,000	貸付株式数	29,000株
ナカノフドー建設	22,500	146	3,285,000		
奥村組	302,000	272	82,144,000		
大和小田急建設	14,500	189	2,740,500		
東鉄工業	40,000	976	39,040,000		
イチケン	33,000	167	5,511,000	貸付株式数	8,000株
浅沼組	95,000	61	5,795,000	貸付株式数	36,000株
戸田建設	341,000	245	83,545,000		
熊谷組	225,000	78	17,550,000		
青木あすなろ建設	20,500	416	8,528,000		
北野建設	60,000	179	10,740,000		
植木組	37,000	171	6,327,000	貸付株式数	5,000株
三井ホーム	40,000	428	17,120,000		
矢作建設	39,100	351	13,724,100		
ピーエス三菱	19,900	391	7,780,900	貸付株式数	8,700株
大東建託	120,700	7,620	919,734,000		
新日本建設	37,800	192	7,257,600	貸付株式数	9,200株
NIPPO	72,000	911	65,592,000		
東亜道路	58,000	227	13,166,000		
前田道路	89,000	1,051	93,539,000		
日本道路	95,000	316	30,020,000		
東亜建設	275,000	142	39,050,000		
若築建設	171,000	88	15,048,000	貸付株式数	63,000株
東洋建設	484,000	67	32,428,000	貸付株式数	208,000株
五洋建設	403,000	204	82,212,000	貸付株式数	186,000株
大林道路	35,000	218	7,630,000		
世紀東急	77,000	56	4,312,000	貸付株式数	17,000株
福田組	45,000	270	12,150,000	貸付株式数	16,000株
住友林業	218,800	713	156,004,400		
日本基礎技術	35,300	299	10,554,700	貸付株式数	13,500株
日成ビルド工業	94,000	137	12,878,000	貸付株式数	43,000株
エス・バイ・エル	162,000	156	25,272,000	貸付株式数	70,000株
巴コーポレーション	39,200	280	10,976,000	貸付株式数	14,000株
パナホーム	119,000	501	59,619,000		
大和ハウス	793,000	1,109	879,437,000		
ライト工業	66,200	355	23,501,000	貸付株式数	30,600株
積水ハウス	894,000	762	681,228,000		
日特建設	75,000	83	6,225,000		
北陸電気工事	14,000	235	3,290,000		
ユアテック	42,000	318	13,356,000		
西部電気工業	26,000	354	9,204,000		
四電工	27,000	325	8,775,000		
中電工	45,700	804	36,742,800		
関電工	145,000	369	53,505,000		
きんでん	211,000	535	112,885,000		
東京エネシス	32,000	361	11,552,000		
トーエネック	43,000	453	19,479,000		
住友電設	21,800	523	11,401,400		
日本電設工業	57,000	776	44,232,000		
協和エクシオ	103,800	817	84,804,600		
新日本空調	24,200	477	11,543,400		
日本工営	99,000	286	28,314,000	貸付株式数	6,000株
日本電話施設	49,000	254	12,446,000		
九電工	58,000	487	28,246,000		
三機工業	71,000	433	30,743,000		

日 揮	297,000	2,372	704,484,000	貸付株式数	3,000株 (3,000株)
中外炉工業	102,000	232	23,664,000		
ヤマト	28,000	308	8,624,000		
太平電業	39,000	556	21,684,000		
高砂熱学	90,700	613	55,599,100		
三晃金属	33,000	236	7,788,000	貸付株式数	13,000株
N E C ネットエスアイ	26,200	1,269	33,247,800		
朝日工業社	33,000	301	9,933,000		
アタカ大機	19,000	408	7,752,000	貸付株式数	8,000株
大 氣 社	48,600	1,708	83,008,800		
ダイダン	41,000	499	20,459,000		
日比谷総合設	38,900	873	33,959,700		
東芝プラントシステム	50,000	936	46,800,000		
日本製粉	195,000	360	70,200,000		
日清製粉G本社	288,000	941	271,008,000		
日東富士製粉	24,000	300	7,200,000		
昭和産業	131,000	257	33,667,000		
鳥越製粉	25,200	610	15,372,000	貸付株式数	6,600株
協同飼料	110,000	87	9,570,000		
中部飼料	27,600	526	14,517,600		
日本配合飼料	97,000	102	9,894,000		
東洋精糖	45,000	89	4,005,000		
日本甜菜糖	175,000	168	29,400,000		
三井製糖	112,000	259	29,008,000		
ネクスト	11,600	383	4,442,800	貸付株式数	4,300株
日本M & A センター	11,700	2,409	28,185,300		
ノバレーゼ	54	50,800	2,743,200		
アコーディア・ゴルフ	1,206	50,900	61,385,400	貸付株式数	530株
パソナグループ	294	57,200	16,816,800		
リンクアンドモチベーション	115	30,050	3,455,750	貸付株式数	42株
エス・エム・エス	39	173,100	6,750,900	貸付株式数	16株
テンプホールディングス	40,400	958	38,703,200	貸付株式数	18,600株 (17,400株)
クックパッド	4,300	2,082	8,952,600	貸付株式数	1,800株
森永製菓	310,000	188	58,280,000		
中 村 屋	72,000	395	28,440,000		
江崎グリコ	115,000	911	104,765,000	貸付株式数	45,000株
名糖産業	14,000	1,054	14,756,000	貸付株式数	3,400株
不 二 家	182,000	213	38,766,000	貸付株式数	84,000株
山崎製パン	233,000	1,021	237,893,000	貸付株式数	96,000株
第一屋製パン	40,000	77	3,080,000	貸付株式数	16,000株
モロゾフ	46,000	277	12,742,000		
亀田製菓	17,700	1,972	34,904,400	貸付株式数	8,100株
カルビー	17,500	5,430	95,025,000	貸付株式数	7,500株
森永乳業	267,000	311	83,037,000		
ヤクルト	170,400	3,115	530,796,000	貸付株式数	72,500株 (3,800株)
明治ホールディングス	94,100	3,605	339,230,500		
雪印メグミルク	68,500	1,385	94,872,500		
プリマハム	178,000	145	25,810,000		
日本ハム	241,000	1,082	260,762,000		
伊藤ハム	174,000	334	58,116,000	貸付株式数	62,000株
林兼産業	102,000	69	7,038,000	貸付株式数	45,000株
丸大食品	152,000	304	46,208,000		

米 久	27,600	810	22,356,000		
S Foods	19,500	703	13,708,500		
学情	9,600	311	2,985,600		
スタジオアリス	13,600	1,348	18,332,800		
シミックホールディングス	10,400	1,264	13,145,600		
システナ	298	63,700	18,982,600		
N E Cフィールドディング	23,800	1,014	24,133,200		
新日鉄ソリューションズ	18,700	1,346	25,170,200		
総合警備保障	107,900	1,111	119,876,900		
日本駐車場開発	3,034	4,525	13,728,850		
コア	10,500	692	7,266,000		
カカクコム	45,900	2,459	112,868,100	貸付株式数	21,100株
アイロムホールディングス	659	2,241	1,476,819		
ルネサンス	13,200	484	6,388,800	貸付株式数	5,300株
新日本科学	18,100	214	3,873,400	貸付株式数	8,400株
ツクイ	8,100	1,269	10,278,900		
エムスリー	233	379,500	88,423,500	貸付株式数	102株
ベストプライダル	62	88,200	5,468,400		
ディー・エヌ・エー	132,800	2,271	301,588,800		
博報堂D Y H L D G S	37,650	5,360	201,804,000		
ぐるなび	20,400	901	18,380,400		
一休	210	33,500	7,035,000		
ジャパンベストレスキューS	36	79,200	2,851,200		
ジェイコムホールディングス	4,800	761	3,652,800	貸付株式数	1,900株
P G Mホールディングス	415	59,600	24,734,000	貸付株式数	182株
サッポロホールディングス	521,000	254	132,334,000		
アサヒグループホールディン	600,500	1,736	1,042,468,000		
キリンHD	1,284,000	932	1,196,688,000		
宝ホールディングス	268,000	512	137,216,000	貸付株式数	32,000株 (32,000株)
オエノンホールディングス	78,000	196	15,288,000		
養命酒	24,000	721	17,304,000		
三国コカ・コ・ラ	33,000	695	22,935,000		
コカ・コーラウエスト	107,700	1,407	151,533,900		
コカコーラセントラルジャパン	35,700	1,056	37,699,200		
ダイトードリンコ	14,600	3,540	51,684,000		
伊藤園	88,400	1,496	132,246,400		
キーコーヒー	27,500	1,455	40,012,500	貸付株式数	11,600株 (2,700株)
ユニカフェ	6,900	380	2,622,000		
ジャパンフーズ	3,800	854	3,245,200		
日清オイリオグループ	122,000	332	40,504,000		
不二製油	77,100	1,045	80,569,500		
J・オイルミルズ	118,000	242	28,556,000		
ローソン	88,300	5,520	487,416,000	貸付株式数	40,800株
インターニックス	11,300	614	6,938,200	貸付株式数	5,200株
サンエー	9,500	3,090	29,355,000		
キリン堂	12,000	541	6,492,000		
ダイユーエイト	3,900	577	2,250,300		
カワチ薬品	19,500	1,801	35,119,500		
エービーシー・マート	39,800	3,075	122,385,000	貸付株式数	17,500株
ハードオフコーポレーション	13,500	549	7,411,500		
高千穂交易	11,600	868	10,068,800		
アスクル	19,200	1,080	20,736,000		
ゲオホールディングス	431	89,500	38,574,500	貸付株式数	159株

ポイント	23,640	2,855	67,492,200		
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	33,000	118	3,894,000	貸付株式数	15,000株
伊藤忠食品	6,700	3,005	20,133,500		
くらコーポレーション	14,900	1,149	17,120,100		
キャンドウ	148	100,500	14,874,000		
エレマテック	16,600	1,092	18,127,200	貸付株式数	1,800株
パル	8,150	3,885	31,662,750		
JALUX	7,500	854	6,405,000		
エディオン	111,700	382	42,669,400	貸付株式数	45,900株
あらた	58,000	421	24,418,000	貸付株式数	27,000株
サーラコーポレーション	22,500	514	11,565,000		
トーメンデバイス	4,000	2,029	8,116,000		
J Pホールディングス	8,000	809	6,472,000	貸付株式数	2,600株
あみやき亭	40	193,400	7,736,000	貸付株式数	14株
東京エレクトロンデバイス	53	144,600	7,663,800		
ひらまつ	96	81,300	7,804,800		
双日	1,873,900	130	243,607,000	貸付株式数	867,300株
ゲンキー	2,000	2,010	4,020,000		
アルフレッサホールディングス	73,200	4,345	318,054,000		
ハニーズ	24,570	1,564	38,427,480	貸付株式数	10,080株
キッコーマン	259,000	1,000	259,000,000	貸付株式数	119,000株
味の素	837,000	1,086	908,982,000		
キューピー	161,700	1,183	191,291,100		
ハウス食品	112,800	1,350	152,280,000		
カゴメ	122,800	1,634	200,655,200	貸付株式数	10,800株
焼津水産化工	14,900	759	11,309,100		
アリアケジャパン	28,900	1,730	49,997,000	貸付株式数	2,000株
ニチレイ	356,000	397	141,332,000		
横浜冷凍	66,500	613	40,764,500		
東洋水産	137,000	2,084	285,508,000		
日清食品HD	124,200	3,060	380,052,000	貸付株式数	38,600株
永谷園	30,000	771	23,130,000		
フジッコ	33,000	973	32,109,000		
ロックフィールド	16,500	1,487	24,535,500	貸付株式数	6,400株
日本たばこ産業	1,409,300	2,297	3,237,162,100		
ケンコーマヨネーズ	9,400	637	5,987,800		
わらべや日洋	17,600	1,310	23,056,000		
なとり	14,600	868	12,672,800	貸付株式数	5,900株
片倉工業	37,200	688	25,593,600		
グンゼ	222,000	211	46,842,000		
ヒューリック	323,200	364	117,644,800	貸付株式数	23,500株 (23,500株)
神栄	33,000	127	4,191,000	貸付株式数	13,000株
山下医科器械	2,200	972	2,138,400	貸付株式数	800株
ラサ商事	12,000	391	4,692,000		
アルペン	21,400	1,607	34,389,800		
アルコニックス	7,000	1,544	10,808,000	貸付株式数	3,300株
ビックカメラ	1,063	40,150	42,679,450	貸付株式数	490株
DCMホールディングス	144,900	549	79,550,100	貸付株式数	47,500株
MonotaRO	16,000	1,623	25,968,000	貸付株式数	7,200株
あいホールディングス	44,900	479	21,507,100		
J. フロント リテイリング	661,000	417	275,637,000		
ドトール・日レスHD	44,600	1,033	46,071,800		
マツモトキヨシHLDGS	51,900	1,791	92,952,900	貸付株式数	19,800株
スタートトゥデイ	50,800	1,032	52,425,600	貸付株式数	22,400株

物語コーポレーション	3,400	1,438	4,889,200	貸付株式数	1,500株
ココカラファイン	29,200	2,661	77,701,200		
三越伊勢丹HD	556,300	841	467,848,300	貸付株式数	225,600株
東洋紡績	1,255,000	105	131,775,000		
ユニチカ	661,000	42	27,762,000		
富士紡ホールディングス	124,000	180	22,320,000	貸付株式数	20,000株
日清紡ホールディングス	189,000	592	111,888,000		
倉敷紡績	305,000	139	42,395,000		
ダイワボウHD	270,000	157	42,390,000		
シキボウ	192,000	93	17,856,000		
日東紡績	218,000	249	54,282,000	貸付株式数	31,000株
トヨタ紡織	99,200	946	93,843,200	貸付株式数	42,300株
グローウェルHD	9,800	2,816	27,596,800	貸付株式数	4,500株
クリエイトSDH	11,800	2,273	26,821,400		
バイタルKSKHD	52,600	720	37,872,000		
八洲電機	18,400	346	6,366,400	貸付株式数	8,500株
UKCホールディングス	16,600	1,032	17,131,200		
丸善CHI HD	7,600	208	1,580,800	貸付株式数	2,400株
TOKAIホールディングス	136,700	394	53,859,800		
日本毛織	94,000	550	51,700,000		
大東紡織	42,000	64	2,688,000		
トーア紡コーポレーション	131,000	55	7,205,000	貸付株式数	24,000株
ダイドーリミテッド	36,500	570	20,805,000		
東京建物不動産販	11,400	259	2,952,600		
野村不動産HL DGS	134,200	1,363	182,914,600		
常和ホールディングス	4,700	1,420	6,674,000	貸付株式数	1,200株
帝国繊維	31,000	617	19,127,000		
ブックオフコーポレーション	15,400	692	10,656,800		
日本コークス工業	239,500	105	25,147,500		
ミタチ産業	6,100	388	2,366,800		
あさひ	16,200	1,280	20,736,000	貸付株式数	7,000株 (900株)
日本調剤	3,530	3,010	10,625,300	貸付株式数	1,540株
コスモス薬品	12,300	5,330	65,559,000		
シップヘルスケアHD	36,300	2,000	72,600,000		
ソフトクリエイト	2,900	1,173	3,401,700	貸付株式数	1,300株
セブン&アイ・HL DGS	1,171,200	2,476	2,899,891,200		
ツルハホールディングス	23,000	5,050	116,150,000		
サンマルクホールディングス	7,700	3,035	23,369,500		
フェリシモ	7,700	1,095	8,431,500		
トリドール	23,900	1,198	28,632,200		
クスリのアオキ	3,900	2,583	10,073,700	貸付株式数	1,800株
帝人	1,214,000	229	278,006,000		
東レ	2,155,000	530	1,142,150,000		
クラレ	472,100	986	465,490,600		
旭化成	1,730,000	428	740,440,000		
サカイオーベックス	81,000	109	8,829,000		
稲葉製作所	12,600	1,099	13,847,400		
宮地エンジニアリングG	88,000	160	14,080,000	貸付株式数	24,000株
三協・立山HL DGS	400,000	128	51,200,000		
トーカロ	16,700	1,197	19,989,900		
アルファCO	9,900	883	8,741,700		
SUMCO	181,600	671	121,853,600	貸付株式数	79,800株
川田テクノロジーズ	6,400	1,215	7,776,000		
住江織物	74,000	142	10,508,000	貸付株式数	21,000株

日本フェルト	16,500	400	6,600,000		
イチカワ	20,000	150	3,000,000		
日本バイリン	36,000	347	12,492,000		
エコナックホールディングス	81,000	37	2,997,000		
日東製網	34,000	136	4,624,000	貸付株式数	4,000株
芦森工業	67,000	105	7,035,000	貸付株式数	27,000株
アツギ	230,000	102	23,460,000		
ダイニック	53,000	152	8,056,000		
共和レザー	17,300	267	4,619,100		
セーレン	74,000	573	42,402,000		
東海染工	38,000	89	3,382,000		
小松精練	44,000	369	16,236,000		
ワコールホールディングス	177,000	924	163,548,000		
ホギメディカル	18,700	3,640	68,068,000		
レナウン	63,700	126	8,026,200	貸付株式数	29,300株
クラウドシア	3,000	1,071	3,213,000		
T S Iホールディングス	132,600	383	50,785,800		
デジタルハーツ	2,300	1,610	3,703,000	貸付株式数	1,000株
I Tホールディングス	85,100	893	75,994,300		
ネオス	46	57,900	2,663,400	貸付株式数	19株
グリー	143,800	1,461	210,091,800	貸付株式数	80,800株
コーエーテクモHD	55,300	669	36,995,700		
三菱総合研究所	10,800	1,815	19,602,000		
ボルテージ	3,000	871	2,613,000		
K L a b	8,400	558	4,687,200		
ネクソン	191,700	1,646	315,538,200		
特種東海製紙	187,000	211	39,457,000		
ドワンゴ	144	125,200	18,028,800	貸付株式数	62株
ベリサーブ	14	130,000	1,820,000		
マクロミル	27,200	867	23,582,400	貸付株式数	12,500株
ティーガイア	139	158,600	22,045,400		
GMOペイメントゲートウェイ	9,100	1,520	13,832,000	貸付株式数	4,200株
ザッパラス	154	74,700	11,503,800	貸付株式数	63株
インターネットイニシアティブ	164	322,500	52,890,000		
ソネットエンタテインメント	158	318,500	50,323,000		
S R Aホールディングス	14,800	900	13,320,000		
朝日ネット	23,000	379	8,717,000		
王子製紙	1,312,000	296	388,352,000	貸付株式数	522,000株
三菱製紙	421,000	77	32,417,000		
北越紀州製紙	184,500	421	77,674,500	貸付株式数	81,000株
中越パルプ	113,000	150	16,950,000		
巴川製紙	48,000	160	7,680,000	貸付株式数	19,000株
大王製紙	125,000	487	60,875,000		
日本製紙G本社	143,400	1,180	169,212,000	貸付株式数	66,300株
レンゴー	238,000	477	113,526,000	貸付株式数	109,000株
トーモク	94,000	225	21,150,000		
ザ・パック	17,700	1,400	24,780,000		
コ・プケミカル	42,000	102	4,284,000	貸付株式数	18,000株
昭和電工	1,846,000	158	291,668,000	貸付株式数	761,000株
住友化学	2,041,000	233	475,553,000	貸付株式数	944,000株
日本化成	52,000	121	6,292,000		
住友精化	53,000	303	16,059,000		
日産化学	225,900	792	178,912,800		
ラサ工業	119,000	86	10,234,000	貸付株式数	43,000株
クレハ	192,000	334	64,128,000		

テイカ	47,000	253	11,891,000		
石原産業	498,000	69	34,362,000		
片倉チツカリン	21,000	206	4,326,000		
日本曹達	177,000	307	54,339,000		
東ソー	794,000	206	163,564,000		
トクヤマ	461,000	185	85,285,000	貸付株式数	212,000株
セントラル硝子	284,000	309	87,756,000		
東亜合成	349,000	299	104,351,000		
ダイソー	118,000	240	28,320,000		
関東電化	64,000	251	16,064,000	貸付株式数	30,000株
電気化学	594,000	271	160,974,000		
イビデン	186,000	1,394	259,284,000		
信越化学	532,800	4,325	2,304,360,000		
日本カ - バイド	94,000	114	10,716,000		
堺 化 学	89,000	254	22,606,000		
エア・ウォーター	243,000	961	233,523,000		
大陽日酸	391,000	460	179,860,000		
日本化学工業	118,000	120	14,160,000		
日本パ - カライジング	69,000	1,180	81,420,000		
高压ガス	43,000	502	21,586,000		
チタン工業	32,000	264	8,448,000	貸付株式数	8,000株
四国化成	42,000	457	19,194,000		
戸田工業	38,000	381	14,478,000		
ステラ ケミファ	14,100	1,444	20,360,400	貸付株式数	6,200株
保土谷化学	58,000	238	13,804,000		
日本触媒	216,000	967	208,872,000		
大日精化	107,000	334	35,738,000		
カネカ	370,000	432	159,840,000		
協和発酵キリン	355,000	839	297,845,000		
三菱瓦斯化学	511,000	456	233,016,000		
三井化学	1,260,000	201	253,260,000		
J S R	270,500	1,348	364,634,000		
東京応化工業	53,400	1,722	91,954,800		
大阪有機化学	18,300	421	7,704,300		
三菱ケミカルH L D G S	1,857,500	364	676,130,000		
日本合成化学	60,000	484	29,040,000		
ダイセル	386,000	498	192,228,000		
住友ベ - クライト	255,000	356	90,780,000		
積水化学	610,000	716	436,760,000		
日本ゼオン	276,000	611	168,636,000		
アイカ工業	77,400	1,198	92,725,200		
宇部興産	1,244,000	181	225,164,000		
積水樹脂	41,000	853	34,973,000		
タキロン	67,000	256	17,152,000		
旭有機材	105,000	198	20,790,000		
日立化成	128,500	1,232	158,312,000		
ニチバン	28,000	261	7,308,000		
リケンテクノス	46,000	233	10,718,000		
大倉工業	69,000	194	13,386,000		
積水化成品	73,000	265	19,345,000		
群栄化学	76,000	208	15,808,000		
タイガース ポリマー	14,600	319	4,657,400		
日本カ - リット	23,200	391	9,071,200		
日本化薬	209,000	759	158,631,000		
イーピーエス	162	212,300	34,392,600	貸付株式数	42株

パナソニック インフォシス	6,400	2,021	12,934,400	
フェイス	947	8,580	8,125,260	
アミューズ	7,800	1,030	8,034,000	
野村総合研究所	158,500	1,744	276,424,000	
ドリームインキュベータ	87	66,600	5,794,200	
サイバネットシステム	226	22,200	5,017,200	
T A C	16,300	141	2,298,300	貸付株式数 6,900株 (3,000株)
ケネディクス	2,825	10,910	30,820,750	貸付株式数 1,232株
電通	269,500	2,342	631,169,000	貸付株式数 105,000株
インテージ	7,900	1,645	12,995,500	
テイクアンドギヴニーズ	1,265	7,070	8,943,550	貸付株式数 84株
ぴあ	8,300	964	8,001,200	貸付株式数 3,800株
シンプレクスホールディング	462	29,570	13,661,340	貸付株式数 212株
イオンファンタジー	9,600	1,129	10,838,400	
ソースネクスト	66	15,400	1,016,400	
ネクシィーズ	1,063	1,873	1,990,999	貸付株式数 469株
メディカルシステムネットワーク	17,200	510	8,772,000	貸付株式数 7,900株
日本精化	24,400	549	13,395,600	
A D E K A	127,800	683	87,287,400	
日油	230,000	404	92,920,000	
ミヨシ油脂	100,000	99	9,900,000	
ハリマ化成	25,100	408	10,240,800	
花 王	787,900	2,200	1,733,380,000	
第一工業製薬	51,000	233	11,883,000	
三洋化成	90,000	498	44,820,000	
武田薬品	1,112,900	3,610	4,017,569,000	
アステラス製薬	659,500	3,600	2,374,200,000	
大日本住友製薬	210,300	823	173,076,900	貸付株式数 32,000株 (32,000株)
塩野義製薬	463,900	1,108	514,001,200	
田辺三菱製薬	296,700	1,182	350,699,400	
わかもと製薬	32,000	201	6,432,000	
あすか製薬	34,000	456	15,504,000	
日本新薬	61,000	952	58,072,000	
中外製薬	345,100	1,508	520,410,800	
科研製薬	117,000	1,129	132,093,000	
エーザイ	365,700	3,475	1,270,807,500	貸付株式数 145,500株
ロート製薬	125,000	1,057	132,125,000	
小野薬品	145,300	5,060	735,218,000	
久光製薬	92,200	3,920	361,424,000	貸付株式数 10,400株
有機合成薬品	21,000	217	4,557,000	
持田製薬	102,000	931	94,962,000	
参天製薬	99,800	3,255	324,849,000	
扶桑薬品	100,000	236	23,600,000	
日本ケミファ	43,000	435	18,705,000	貸付株式数 17,000株
ツムラ	81,000	2,148	173,988,000	
日医工	46,600	1,791	83,460,600	
テ ル モ	200,700	3,320	666,324,000	
みらかホールディングス	77,300	3,250	251,225,000	
キッセイ薬品工業	55,100	1,454	80,115,400	
生化学工業	56,800	796	45,212,800	
栄研化学	22,900	1,134	25,968,600	
日水製薬	11,900	785	9,341,500	
鳥居薬品	20,200	1,665	33,633,000	

東和薬品	15,100	4,565	68,931,500		
沢井製薬	19,500	8,590	167,505,000	貸付株式数	3,100株
ゼリア新薬工業	41,000	1,395	57,195,000	貸付株式数	11,000株
第一三共	999,200	1,382	1,380,894,400		
キョーリン製薬HD	71,000	1,747	124,037,000		
大幸薬品	13,800	739	10,198,200		
ダイト	8,000	1,079	8,632,000		
大塚ホールディングス	589,600	2,492	1,469,283,200		
大正製薬HD	71,500	6,430	459,745,000	貸付株式数	31,300株
大日本塗料	170,000	89	15,130,000		
日本ペイント	279,000	653	182,187,000		
関西ペイント	336,000	835	280,560,000	貸付株式数	73,000株 (73,000株)
トウペ	24,000	80	1,920,000	貸付株式数	3,000株
中国塗料	89,000	409	36,401,000		
日本特殊塗料	22,600	343	7,751,800		
藤倉化成	37,500	378	14,175,000		
太陽ホールディングス	24,000	1,996	47,904,000	貸付株式数	4,300株 (4,300株)
D I C	1,134,000	141	159,894,000		
サカタインクス	53,000	383	20,299,000		
東洋インキSCホールディング	265,000	287	76,055,000		
アルプス技研	11,900	599	7,128,100		
サニックス	42,600	295	12,567,000	貸付株式数	19,600株
ダイオーズ	4,900	517	2,533,300		
日本空調サービス	6,900	727	5,016,300		
オリエンタルランド	80,100	9,090	728,109,000		
ダスキン	87,600	1,569	137,444,400		
パーク24	145,500	1,179	171,544,500		
明光ネットワークジャパン	26,600	808	21,492,800	貸付株式数	12,300株
ファルコSDホールディングス	16,000	971	15,536,000		
クレスコ	6,300	653	4,113,900		
フジ・メディア・HD	2,915	136,800	398,772,000		
秀英予備校	4,900	304	1,489,600		
田谷	4,200	702	2,948,400		
ラウンドワン	92,500	421	38,942,500	貸付株式数	35,400株
リゾートトラスト	45,500	1,365	62,107,500		
オービック	8,770	15,590	136,724,300		
TDCソフトウェアエンジニア	5,100	787	4,013,700		
ヤフー	20,503	26,720	547,840,160	貸付株式数	7,953株
ビー・エム・エル	19,400	2,172	42,136,800		
ワタベウェディング	8,300	735	6,100,500		
トレンドマイクロ	111,200	2,267	252,090,400		
もしもしホットライン	49,000	829	40,621,000		
東急コミュニティー	7,400	2,618	19,373,200		
リソー教育	3,006	5,500	16,533,000	貸付株式数	497株
日本オラクル	56,000	3,370	188,720,000		
アルファシステムズ	8,800	1,073	9,442,400		
フューチャーアーキテクト	336	31,100	10,449,600		
ウェアハウス	4,300	228	980,400		
シーエーシー	17,100	642	10,978,200		
ソフトバンク・テクノ	6,200	810	5,022,000	貸付株式数	2,500株
トーセ	6,500	551	3,581,500	貸付株式数	200株 (200株)
ユー・エス・エス	38,630	8,410	324,878,300		

オービックビジネスC	7,100	4,130	29,323,000	貸付株式数	200株 (200株)
伊藤忠テクノソリューションズ	33,000	3,960	130,680,000		
アイティフォー	31,100	286	8,894,600		
東京個別指導学院	14,300	151	2,159,300	貸付株式数	5,500株
東計電算	4,700	1,045	4,911,500		
エクスネット	25	116,000	2,900,000		
テー・オー・ダブリュー	9,700	519	5,034,300	貸付株式数	4,400株
大塚商会	22,400	6,820	152,768,000		
総合メディカル	6,600	2,910	19,206,000		
サイボウズ	511	24,340	12,437,740	貸付株式数	224株
ソフトブレイン	407	7,250	2,950,750		
アグレックス	7,100	744	5,282,400	貸付株式数	2,900株
セントラルスポーツ	8,700	1,127	9,804,900		
電通国際情報S	17,200	659	11,334,800		
ウェザーニューズ	7,300	2,649	19,337,700	貸付株式数	3,400株
C I J	27,200	320	8,704,000		
WOWOW	82	172,400	14,136,800		
フルキャストホールディングス	241	15,410	3,713,810	貸付株式数	106株
富士フイルムHLDGS	634,600	1,442	915,093,200		
コニカミノルタHLDGS	749,500	601	450,449,500	貸付株式数	51,000株
資生堂	493,200	1,234	608,608,800		
ライオン	342,000	437	149,454,000		
高砂香料	98,000	404	39,592,000		
マンダム	29,800	1,996	59,480,800		
ミルボン	14,600	2,384	34,806,400	貸付株式数	6,900株
ファンケル	74,600	984	73,406,400	貸付株式数	31,200株
コーセー	48,000	1,876	90,048,000		
ドクターシーラボ	181	282,100	51,060,100	貸付株式数	83株
ポーラ・オルビスHD	30,700	2,551	78,315,700		
エステー	18,200	910	16,562,000		
コニシ	21,500	1,166	25,069,000		
長谷川香料	37,600	993	37,336,800	貸付株式数	9,000株
星光PMC	12,200	309	3,769,800	貸付株式数	4,500株
小林製薬	41,200	4,360	179,632,000		
荒川化学工業	22,900	679	15,549,100	貸付株式数	9,400株
メック	21,200	248	5,257,600		
日本高純度化学	80	183,500	14,680,000		
荏原ユージライト	3,800	2,266	8,610,800	貸付株式数	1,600株
アース製薬	21,400	2,923	62,552,200		
イハラケミカル	49,000	351	17,199,000		
北興化学	28,000	215	6,020,000		
大成ラミック	8,000	2,382	19,056,000	貸付株式数	3,400株
クミアイ化学	61,000	342	20,862,000	貸付株式数	27,000株
日本農薬	67,000	352	23,584,000		
昭和シェル石油	265,500	462	122,661,000		
コスモ石油	821,000	189	155,169,000		
富士興産	100,000	62	6,200,000		
ニチレキ	38,000	412	15,656,000		
東燃ゼネラル石油	448,000	699	313,152,000		
ユシロ化学	16,100	851	13,701,100		
ビービー・カストロール	12,100	335	4,053,500		
AOCホールディングス	68,900	309	21,290,100		
MORESCO	5,900	865	5,103,500	貸付株式数	2,600株
出光興産	35,200	6,910	243,232,000		

J Xホールディングス	3,297,000	395	1,302,315,000		
横浜ゴム	332,000	567	188,244,000	貸付株式数	160,000株
東洋ゴム	224,000	243	54,432,000		
ブリヂストン	931,000	1,818	1,692,558,000		
住友ゴム	231,700	1,000	231,700,000		
藤倉ゴム	18,600	284	5,282,400		
オカモト	106,000	320	33,920,000		
アキレス	239,000	112	26,768,000		
フコク	12,400	761	9,436,400		
ニッタ	29,300	1,242	36,390,600		
クリエートメディック	8,100	800	6,480,000		
東海ゴム工業	55,000	841	46,255,000		
三ツ星ベルト	75,000	411	30,825,000		
バンドー化学	102,000	305	31,110,000		
鬼怒川ゴム	64,000	487	31,168,000	貸付株式数	28,000株
旭硝子	1,463,000	519	759,297,000		
日本板硝子	1,273,000	78	99,294,000	貸付株式数	622,000株
石塚硝子	37,000	135	4,995,000		
有沢製作所	49,300	227	11,191,100		
日本山村硝子	118,000	177	20,886,000		
日本電気硝子	570,000	447	254,790,000	貸付株式数	250,000株
オハラ	11,200	737	8,254,400		
住友大阪セメント	602,000	259	155,918,000		
太平洋セメント	1,744,000	175	305,200,000	貸付株式数	335,000株
デイ・シイ	26,800	267	7,155,600		
リゾートソリューション	24,000	157	3,768,000	貸付株式数	8,000株 (8,000株)
日本ヒュム	28,000	336	9,408,000		
日本コンクリート	43,000	263	11,309,000	貸付株式数	17,000株
東海カーボン	258,000	335	86,430,000		
日本カーボン	140,000	192	26,880,000		
東洋炭素	14,600	2,454	35,828,400		
ノリタケ	153,000	216	33,048,000	貸付株式数	59,000株
TOTO	458,000	592	271,136,000		
日本碍子	387,000	876	339,012,000		
日本特殊陶業	256,000	999	255,744,000	貸付株式数	27,000株
ダントーホールディングス	39,000	88	3,432,000	貸付株式数	17,000株
MARUWA	8,500	2,342	19,907,000	貸付株式数	3,800株 (500株)
品川リフラクトリーズ	72,000	175	12,600,000		
黒崎播磨	63,000	176	11,088,000		
東京窯業	34,000	175	5,950,000		
ニッカトー	10,400	451	4,690,400		
フジインコーポレーテッド	26,800	1,211	32,454,800		
エーアンドエーマテリアル	59,000	75	4,425,000	貸付株式数	14,000株
ニチアス	132,000	435	57,420,000		
新日本製鐵	7,794,000	169	1,317,186,000	貸付株式数	3,436,000株
住友金属工業	5,503,000	123	676,869,000		
神戸製鋼所	4,116,000	88	362,208,000	貸付株式数	1,904,000株
日新製鋼	1,051,000	100	105,100,000		
中山製鋼所	150,000	49	7,350,000		
合同製鐵	166,000	163	27,058,000		
JFEホールディングス	703,600	1,187	835,173,200	貸付株式数	326,100株
東京製鐵	150,200	440	66,088,000		
共英製鋼	31,600	1,447	45,725,200		

大和工業	67,600	2,247	151,897,200	貸付株式数	31,300株
東京鐵鋼	57,000	257	14,649,000		
大阪製鐵	18,600	1,526	28,383,600		
淀川製鋼所	211,000	301	63,511,000		
東洋鋼鈹	69,000	289	19,941,000		
住友鋼管	17,300	701	12,127,300		
丸一鋼管	91,100	1,649	150,223,900		
モリ工業	42,000	230	9,660,000		
大同特殊鋼	498,000	492	245,016,000		
日本高周波	116,000	86	9,976,000		
日本金属工業	227,000	55	12,485,000	貸付株式数	88,000株
日本冶金工	218,000	106	23,108,000	貸付株式数	38,500株
山陽特殊製鋼	147,000	331	48,657,000		
愛知製鋼	158,000	309	48,822,000		
日立金属	194,000	912	176,928,000	貸付株式数	85,000株
日本金属	69,000	125	8,625,000		
大平洋金属	207,000	310	64,170,000		
日本電工	113,000	286	32,318,000		
栗本鉄工所	142,000	213	30,246,000	貸付株式数	65,000株
日本鑄鉄管	31,000	163	5,053,000		
日本製鋼所	458,000	436	199,688,000	貸付株式数	195,000株 (195,000株)
三菱製鋼	179,000	190	34,010,000		
日亜鋼業	43,000	210	9,030,000		
日本精線	20,000	363	7,260,000		
日本軽金属	672,000	96	64,512,000		
大紀アルミニウム	45,000	240	10,800,000		
三井金属	807,000	169	136,383,000		
東邦亜鉛	168,000	296	49,728,000		
三菱マテリアル	1,853,000	221	409,513,000		
住友鋳山	768,000	891	684,288,000		
DOWAホールディングス	355,000	499	177,145,000		
古河機金	499,000	71	35,429,000		
大阪チタニウム	29,200	2,338	68,269,600	貸付株式数	13,500株
東邦チタニウム	48,200	852	41,066,400	貸付株式数	22,300株 (1,200株)
住友軽金属	717,000	82	58,794,000	貸付株式数	102,000株
古河スカイ	120,000	228	27,360,000		
古河電工	934,000	179	167,186,000	貸付株式数	431,000株
住友電工	1,048,900	959	1,005,895,100		
フジクラ	445,000	224	99,680,000	貸付株式数	205,000株
昭和電線HLDGS	380,000	68	25,840,000		
東京特殊電線	36,000	79	2,844,000	貸付株式数	16,000株
タツタ電線	54,000	506	27,324,000	貸付株式数	25,000株
日立電線	230,000	165	37,950,000		
沖電線	30,000	146	4,380,000		
カナレ電気	3,500	1,256	4,396,000	貸付株式数	1,500株
平河ヒューテック	5,500	687	3,778,500		
リョービ	166,000	224	37,184,000		
アサヒHD	41,500	1,640	68,060,000		
東洋製罐	209,800	969	203,296,200		
ホッカンホールディングス	69,000	237	16,353,000		
コロナ	13,600	1,076	14,633,600		
横河ブリッジHLDGS	60,000	531	31,860,000		
日本橋梁	10,350	326	3,374,100	貸付株式数	4,750株

駒井ハルテック	56,000	265	14,840,000	
サクラダ	255,000	14	3,570,000	貸付株式数 117,000株
高田機工	25,000	177	4,425,000	
三和ホールディングス	295,000	329	97,055,000	
文化シヤツタ -	74,000	347	25,678,000	
東洋シヤツタ -	7,800	420	3,276,000	
LI X ILグループ	386,000	1,717	662,762,000	
日本ファイルコン	21,400	388	8,303,200	
ノーリツ	58,200	1,474	85,786,800	
長府製作所	28,500	1,869	53,266,500	
リンナイ	47,800	5,210	249,038,000	
ユニプレス	45,200	2,038	92,117,600	
ダイニチ工業	15,100	659	9,950,900	
日東精工	37,000	225	8,325,000	
三洋工業	35,000	149	5,215,000	
岡 部	58,400	468	27,331,200	
日立ツール	17,000	766	13,022,000	
中国工業	42,000	86	3,612,000	
東 プ レ	57,100	719	41,054,900	
高周波熱錬	39,300	615	24,169,500	
東京製綱	186,000	137	25,482,000	貸付株式数 86,000株 (17,000株)
パイオラックス	12,700	1,790	22,733,000	
日本発条	215,000	828	178,020,000	貸付株式数 75,000株
中央発條	36,000	293	10,548,000	
アドバネクス	56,000	84	4,704,000	
三浦工業	44,100	2,060	90,846,000	
タ ク マ	101,000	360	36,360,000	
ツ ガ ミ	71,000	500	35,500,000	貸付株式数 33,000株 (5,000株)
オークマ	178,000	491	87,398,000	
東芝機械	162,000	367	59,454,000	
ア マ ダ	419,000	443	185,617,000	
アイダエンジニア	76,600	478	36,614,800	
牧野フライス	148,000	443	65,564,000	貸付株式数 49,000株
オーエスジー	122,000	1,136	138,592,000	
ダイジェット	33,000	167	5,511,000	
旭ダイヤモンド	73,000	893	65,189,000	
森精機製作所	156,500	655	102,507,500	貸付株式数 72,300株
ディスコ	30,000	4,230	126,900,000	貸付株式数 13,800株
日東工器	17,300	1,752	30,309,600	貸付株式数 5,000株
豊田自動織機	258,300	2,208	570,326,400	
豊和工業	155,000	75	11,625,000	貸付株式数 41,000株
大阪機工	115,000	107	12,305,000	貸付株式数 48,000株
石川製作所	60,000	63	3,780,000	
東洋機械金属	21,700	207	4,491,900	貸付株式数 6,200株
津田駒工業	70,000	148	10,360,000	貸付株式数 27,000株
エンシュウ	69,000	77	5,313,000	貸付株式数 17,000株
島精機製作所	38,700	1,190	46,053,000	貸付株式数 4,100株
日阪製作所	37,000	732	27,084,000	
やまびこ	11,700	1,015	11,875,500	
ペガサスミシン製造	26,500	183	4,849,500	貸付株式数 10,800株
ナプテスコ	123,300	1,656	204,184,800	貸付株式数 57,100株 (4,700株)

三井海洋開発	24,500	1,482	36,309,000	貸付株式数	11,300株 (2,100株)
レオン自動機	27,000	193	5,211,000		
S M C	88,600	13,260	1,174,836,000		
新川	22,700	385	8,739,500		
ホソカワミクロン	44,000	419	18,436,000		
ユニオンツール	16,300	1,209	19,706,700		
オイレス工業	30,900	1,622	50,119,800		
サト - ホールディングス	31,000	1,184	36,704,000	貸付株式数	12,800株
日本エアーテック	8,100	353	2,859,300		
日精樹脂工業	23,200	321	7,447,200		
ワイエイシイ	11,900	610	7,259,000		
小松製作所	1,385,500	1,818	2,518,839,000	貸付株式数	421,000株
住友重機械	758,000	339	256,962,000		
日立建機	151,600	1,371	207,843,600	貸付株式数	70,000株
日 工	39,000	300	11,700,000	貸付株式数	2,000株
巴工業	11,100	1,660	18,426,000	貸付株式数	3,900株
井関農機	304,000	197	59,888,000		
T O W A	26,100	548	14,302,800		
丸山製作所	65,000	160	10,400,000		
北川鉄工所	136,000	167	22,712,000	貸付株式数	62,000株
シンニッタン	25,200	369	9,298,800		
クボタ	1,359,000	730	992,070,000		
荏原実業	6,800	1,198	8,146,400	貸付株式数	2,700株
東洋エンジニア	170,000	347	58,990,000		
三菱化工機	87,000	149	12,963,000		
月島機械	43,000	688	29,584,000		
帝国電機製作所	10,000	1,486	14,860,000		
東京機械	95,000	46	4,370,000		
新東工業	64,700	765	49,495,500		
渋谷工業	18,500	850	15,725,000		
アイチ コーポレーション	49,000	334	16,366,000		
小森コーポレーション	84,200	563	47,404,600		
鶴見製作所	22,000	635	13,970,000		
住友精密	41,000	434	17,794,000		
酒井重工業	53,000	285	15,105,000	貸付株式数	24,000株 (7,000株)
荏原製作所	484,000	305	147,620,000		
石井鉄工所	41,000	146	5,986,000		
西島製作所	34,200	799	27,325,800	貸付株式数	13,400株
千代田化工建	252,000	988	248,976,000		
ダイキン工業	361,400	2,173	785,322,200		
オルガノ	54,000	532	28,728,000		
ト - ヨ - カネツ	159,000	173	27,507,000		
栗田工業	163,800	1,860	304,668,000		
椿本チエイン	152,000	453	68,856,000		
大同工業	57,000	142	8,094,000		
日本コンベヤ	87,000	72	6,264,000		
日 機 装	89,000	871	77,519,000		
木村化工機	26,600	298	7,926,800	貸付株式数	11,700株
新興プランテック	65,200	696	45,379,200		
アネスト岩田	44,000	365	16,060,000		
ダイフク	129,500	474	61,383,000		
加藤製作所	65,000	387	25,155,000		
油研工業	49,000	166	8,134,000		

タダノ	137,000	581	79,597,000		
フジテック	81,000	495	40,095,000		
C K D	79,500	547	43,486,500		
キトー	119	63,100	7,508,900		
平和	61,500	1,515	93,172,500		
理想科学工業	20,300	1,362	27,648,600		
S A N K Y O	86,000	3,860	331,960,000		
日本金銭機械	25,800	623	16,073,400		
マースエンジニアリング	16,000	1,707	27,312,000		
福島工業	7,400	1,164	8,613,600		
オーイズミ	9,900	247	2,445,300	貸付株式数	3,800株
ダイコク電機	13,000	1,415	18,395,000		
ア マ ノ	85,900	670	57,553,000		
J U K I	172,000	129	22,188,000	貸付株式数	74,000株
サンデン	148,000	263	38,924,000	貸付株式数	22,000株
蛇の目マシン	271,000	65	17,615,000		
ブラザー工業	366,700	862	316,095,400		
マックス	43,000	936	40,248,000		
モリタホールディングス	44,000	596	26,224,000		
グローリー	84,600	1,620	137,052,000		
大和冷機工業	40,000	366	14,640,000		
セガサミーホールディングス	304,800	1,659	505,663,200		
日本ピストンリング	103,000	148	15,244,000		
リ ケ ン	103,000	316	32,548,000		
T P R	31,400	1,258	39,501,200		
ホシザキ電機	57,300	2,018	115,631,400		
大豊工業	19,700	986	19,424,200		
日本精工	631,000	496	312,976,000		
N T N	657,000	233	153,081,000		
ジェイテクト	271,300	767	208,087,100		
不 二 越	263,000	290	76,270,000		
ミネベア	422,000	297	125,334,000	貸付株式数	66,000株
日本トムソン	88,000	362	31,856,000		
T H K	188,600	1,358	256,118,800	貸付株式数	72,300株
ユーシン精機	14,100	1,584	22,334,400	貸付株式数	3,300株
前澤給装工業	10,700	1,103	11,802,100		
イーグル工業	34,000	659	22,406,000		
前澤工業	20,700	214	4,429,800		
日本ピラ - 工業	29,000	659	19,111,000		
キッツ	116,600	323	37,661,800		
日 立	6,536,000	474	3,098,064,000	貸付株式数	907,000株 (724,000株)
東 芝	5,972,000	290	1,731,880,000	貸付株式数	2,257,000株
三菱電機	2,837,000	622	1,764,614,000		
富士電機	855,000	179	153,045,000		
東洋電機製造	54,000	269	14,526,000	貸付株式数	6,000株
安川電機	333,000	560	186,480,000	貸付株式数	127,000株
シンフォニア テクノロジー	171,000	172	29,412,000	貸付株式数	49,000株
明 電 舎	279,000	288	80,352,000	貸付株式数	4,000株
オリジン電気	39,000	275	10,725,000		
デンヨー	25,700	996	25,597,200	貸付株式数	7,300株
日立工機	75,900	636	48,272,400		
三桜工業	36,000	659	23,724,000		
マキタ	185,000	2,600	481,000,000	貸付株式数	85,500株
東芝テック	178,000	278	49,484,000		

芝浦メカトロニクス	48,000	175	8,400,000	貸付株式数	13,000株
マブチモーター	38,800	3,190	123,772,000	貸付株式数	17,800株
日本電産	153,300	6,170	945,861,000	貸付株式数	71,000株
宮越ホールディングス	9,600	312	2,995,200	貸付株式数	4,400株
高岳製作所	112,000	162	18,144,000	貸付株式数	45,000株 (6,000株)
ダイヘン	167,000	267	44,589,000		
ヤーマン	2,300	1,191	2,739,300		
JVCケンウッド	171,400	261	44,735,400	貸付株式数	79,000株 (25,300株)
第一精工	6,400	1,534	9,817,600	貸付株式数	2,200株
日新電機	57,000	509	29,013,000	貸付株式数	26,000株
大崎電気	40,000	667	26,680,000	貸付株式数	13,000株
オムロン	315,900	1,638	517,444,200		
日東工業	41,700	1,370	57,129,000		
I D E C	37,000	723	26,751,000	貸付株式数	8,900株
ジーエス・ユアサ コーポ	546,000	335	182,910,000	貸付株式数	251,000株 (5,000株)
サクサホールディングス	69,000	178	12,282,000	貸付株式数	22,000株
メルコホールディングス	15,700	1,699	26,674,300		
テクノメディカ	21	313,500	6,583,500	貸付株式数	3株 (3株)
日本電気	3,900,000	112	436,800,000	貸付株式数	1,716,000株
富士通	2,735,000	361	987,335,000	貸付株式数	687,000株
沖電気	1,095,000	123	134,685,000		
岩崎通信機	124,000	65	8,060,000		
電気興業	84,000	387	32,508,000		
サンケン電気	144,000	314	45,216,000	貸付株式数	63,000株
ナカヨ通信機	27,000	305	8,235,000		
アイホン	16,400	1,593	26,125,200		
ルネサスエレクトロニクス	73,500	316	23,226,000	貸付株式数	33,900株 (14,400株)
セイコーエプソン	193,600	737	142,683,200	貸付株式数	89,400株
ワコム	558	163,000	90,954,000		
アルバック	56,500	702	39,663,000	貸付株式数	26,000株
アクセル	13,100	1,440	18,864,000	貸付株式数	4,800株
ピクセラ	11,700	159	1,860,300	貸付株式数	4,700株
ナナオ	23,900	1,589	37,977,100		
日本信号	66,000	509	33,594,000		
京三製作所	60,000	343	20,580,000		
能美防災	37,000	510	18,870,000		
ホーチキ	26,000	428	11,128,000		
日本無線	59,000	176	10,384,000	貸付株式数	22,000株
パナソニック	3,240,900	610	1,976,949,000	貸付株式数	1,165,000株
シャープ	1,370,000	362	495,940,000	貸付株式数	633,000株
アンリツ	140,000	953	133,420,000	貸付株式数	34,000株
富士通ゼネラル	66,000	600	39,600,000	貸付株式数	31,000株
日立国際電気	64,000	585	37,440,000		
ソニー	1,769,800	1,046	1,851,210,800	貸付株式数	176,300株
T D K	148,400	3,195	474,138,000	貸付株式数	68,600株
帝国通信工業	65,000	135	8,775,000		
ミツミ電機	100,200	516	51,703,200	貸付株式数	26,700株 (26,700株)
タムラ製作所	95,000	198	18,810,000	貸付株式数	8,000株
アルプス電気	223,900	528	118,219,200		

池上通信機	84,000	57	4,788,000	貸付株式数	34,000株
パイオニア	402,100	269	108,164,900	貸付株式数	185,800株
日本電波工業	21,800	922	20,099,600	貸付株式数	3,000株
日本トリム	3,100	2,017	6,252,700		
ローランド ディー . ジー .	12,500	910	11,375,000		
日本コロムビア	271,000	26	7,046,000		
フオスタ - 電機	26,700	1,184	31,612,800		
クラリオン	174,000	180	31,320,000	貸付株式数	70,000株
S M K	87,000	246	21,402,000		
ヨコオ	21,900	445	9,745,500		
東 光	131,000	235	30,785,000	貸付株式数	59,000株
ティアック	153,000	30	4,590,000	貸付株式数	30,000株 (30,000株)
ホシデン	76,900	496	38,142,400		
ヒロセ電機	49,300	7,950	391,935,000	貸付株式数	18,900株
日本航空電子	64,000	684	43,776,000	貸付株式数	14,000株
T O A	31,000	623	19,313,000		
ユニデン	80,000	211	16,880,000		
アルパイン	55,300	878	48,553,400		
スミダコーポレーション	17,600	385	6,776,000		
アイコム	15,700	1,920	30,144,000		
リオン	6,100	546	3,330,600	貸付株式数	1,000株
船井電機	25,400	1,121	28,473,400		
横河電機	307,600	791	243,311,600		
新電元工業	100,000	257	25,700,000		
アズビル	72,800	1,591	115,824,800		
日本光電工業	56,400	2,493	140,605,200		
チ ノ ー	48,000	233	11,184,000		
共和電業	28,000	252	7,056,000		
日本電子材料	11,200	392	4,390,400		
堀場製作所	52,800	2,816	148,684,800		
アドバンテスト	210,900	1,137	239,793,300	貸付株式数	86,200株 (4,500株)
小野測器	29,000	324	9,396,000		
エスベック	29,300	771	22,590,300		
パナソニックデバイス	24,600	371	9,126,600		
キーエンス	69,600	19,000	1,322,400,000		
日置電機	14,000	1,385	19,390,000		
シスメックス	99,900	3,130	312,687,000		
メガチップス	23,200	1,527	35,426,400		
O B A R A G R O U P	20,000	968	19,360,000		
日本電産コパル電子	29,300	462	13,536,600		
ミヤチテクノス	12,700	529	6,718,300	貸付株式数	5,800株
東京電波	7,700	317	2,440,900	貸付株式数	1,900株
澤藤電機	13,000	224	2,912,000		
デンソー	700,800	2,592	1,816,473,600		
コーセル	41,200	1,042	42,930,400	貸付株式数	19,000株 (8,100株)
日立メディコ	21,000	1,075	22,575,000		
新日本無線	15,000	222	3,330,000	貸付株式数	6,000株
オブテックス	18,000	966	17,388,000		
千代田インテグレ	13,700	918	12,576,600		
東光電気	16,000	311	4,976,000		
スタンレー電気	189,200	1,186	224,391,200		
岩崎電気	103,000	156	16,068,000		

ウシオ電機	172,200	967	166,517,400	貸付株式数	10,000株 (10,000株)
岡谷電機	15,400	304	4,681,600		
ヘリオステクノH	23,700	147	3,483,900		
日本セラミック	18,500	1,160	21,460,000	貸付株式数	6,900株
日本デジタル研究所	23,700	870	20,619,000		
古河電池	20,000	464	9,280,000	貸付株式数	7,000株
双信電機	13,700	316	4,329,200		
山一電機	28,700	155	4,448,500		
函 研	18,400	586	10,782,400		
日本電子	105,000	191	20,055,000	貸付株式数	23,000株 (23,000株)
カ シ オ	270,300	502	135,690,600	貸付株式数	125,000株
ファナック	295,300	12,550	3,706,015,000		
日本シイエムケイ	60,800	302	18,361,600		
エンプラス	14,300	2,084	29,801,200	貸付株式数	6,200株
ロ ー ム	139,800	2,990	418,002,000		
浜松ホトニクス	110,700	2,717	300,771,900		
三井ハイテック	37,400	425	15,895,000		
新光電気工業	95,200	591	56,263,200	貸付株式数	41,400株 (14,300株)
京 セ ラ	235,900	6,670	1,573,453,000		
協栄産業	32,000	148	4,736,000		
太陽誘電	127,300	720	91,656,000	貸付株式数	58,800株
村田製作所	297,600	4,055	1,206,768,000		
ユーシン	39,300	528	20,750,400		
双葉電子工業	48,500	1,247	60,479,500		
日東電工	244,900	3,480	852,252,000	貸付株式数	89,600株
北陸電気工業	114,000	93	10,602,000	貸付株式数	33,000株
東海理化電機	66,400	1,269	84,261,600		
ニチコン	89,300	740	66,082,000		
日本ケミコン	163,000	217	35,371,000	貸付株式数	75,000株
K O A	35,700	773	27,596,100		
三井造船	1,098,000	114	125,172,000	貸付株式数	401,000株
日立造船	1,122,000	100	112,200,000		
佐世保重工業	185,000	91	16,835,000	貸付株式数	81,000株 (81,000株)
三菱重工業	4,754,000	316	1,502,264,000		
川崎重工業	2,062,000	206	424,772,000		
I H I	1,938,000	168	325,584,000	貸付株式数	25,000株
日本車輛	103,000	276	28,428,000		
日本輸送機	36,000	222	7,992,000	貸付株式数	7,000株
近畿車輛	40,000	302	12,080,000		
島根銀行	5,800	1,139	6,606,200	貸付株式数	2,300株
日産自動車	3,609,100	719	2,594,942,900	貸付株式数	1,590,700株
いすゞ自動車	1,793,000	410	735,130,000		
トヨタ自動車	3,678,400	3,095	11,384,648,000		
日野自動車	405,000	574	232,470,000	貸付株式数	178,000株
三菱自動車工業	6,341,000	79	500,939,000	貸付株式数	2,625,000株
エフテック	9,800	1,343	13,161,400		
武蔵精密工業	27,300	1,421	38,793,300		
日産車体	81,000	846	68,526,000	貸付株式数	17,000株 (17,000株)
新明和工業	127,000	383	48,641,000		
極東開発工業	48,900	710	34,719,000		

日信工業	51,900	1,038	53,872,200	貸付株式数	19,800株
トピー工業	212,000	221	46,852,000		
ティラド	103,000	265	27,295,000	貸付株式数	41,000株 (41,000株)
曙ブレーキ	143,700	351	50,438,700	貸付株式数	66,300株
タチエス	37,000	1,434	53,058,000		
N O K	137,200	1,604	220,068,800		
フタバ産業	80,100	405	32,440,500		
カヤバ工業	196,000	331	64,876,000	貸付株式数	90,000株
シロキ工業	61,000	216	13,176,000		
市光工業	66,000	142	9,372,000		
大同メタル工業	42,000	761	31,962,000		
プレス工業	131,000	369	48,339,000		
カルソニックカンセイ	168,000	420	70,560,000	貸付株式数	77,000株 (65,000株)
太平洋工業	57,800	493	28,495,400		
ケーヒン	58,600	1,100	64,460,000	貸付株式数	23,500株
河西工業	34,000	459	15,606,000		
アイシン精機	233,600	2,562	598,483,200	貸付株式数	87,600株
富士機工	31,000	270	8,370,000	貸付株式数	7,000株
マ ッ ダ	3,805,000	99	376,695,000	貸付株式数	832,000株
ダイハツ	263,000	1,364	358,732,000	貸付株式数	121,000株
今仙電機製作所	20,800	1,084	22,547,200		
本田技研	2,393,200	2,577	6,167,276,400		
スズキ	593,000	1,571	931,603,000		
富士重工業	896,000	627	561,792,000		
ヤマハ発動機	431,300	726	313,123,800		
ショーワ	60,200	637	38,347,400		
小糸製作所	142,000	1,088	154,496,000		
T B K	28,000	439	12,292,000		
エクセディ	38,500	1,706	65,681,000		
ミツバ	50,000	551	27,550,000		
豊田合成	80,200	1,750	140,350,000	貸付株式数	35,200株
愛三工業	29,300	714	20,920,200		
ヨロズ	17,000	1,258	21,386,000		
エフ・シー・シー	46,300	1,255	58,106,500		
新家工業	62,000	110	6,820,000		
シマノ	108,100	5,070	548,067,000	貸付株式数	4,000株 (4,000株)
タカタ	51,300	1,570	80,541,000	貸付株式数	23,700株
テイ・エス テック	59,900	1,360	81,464,000		
小野建	24,000	678	16,272,000		
はるやま商事	11,600	476	5,521,600		
佐鳥電機	20,300	413	8,383,900		
カップクリエイト	20,550	1,713	35,202,150	貸付株式数	8,700株 (3,800株)
エコトレーディング	6,600	719	4,745,400		
伯東	17,000	794	13,498,000		
コンドーテック	19,700	483	9,515,100		
中山福	16,000	625	10,000,000		
ライトオン	20,800	688	14,310,400		
ナガイレーベン	37,000	1,172	43,364,000		
ジーンズメイト	8,200	170	1,394,000		
三菱食品	25,500	2,020	51,510,000		
良品計画	29,700	4,465	132,610,500		

三城ホールディングス	34,600	496	17,161,600	貸付株式数	10,300株 (2,000株)
松田産業	20,300	1,207	24,502,100		
メディバルHD	301,500	1,163	350,644,500		
アドヴァン	16,600	830	13,778,000		
S P K	6,400	1,405	8,992,000		
アズワン	18,200	1,669	30,375,800		
スズデン	8,400	458	3,847,200		
尾家産業	8,500	840	7,140,000		
シモジマ	17,100	994	16,997,400	貸付株式数	5,400株
ドウシシャ	13,200	2,244	29,620,800	貸付株式数	4,800株
コナカ	32,900	984	32,373,600	貸付株式数	15,200株
高速	16,600	665	11,039,000		
ハウス ローゼ	3,000	1,263	3,789,000		
G - 7ホールディングス	7,600	401	3,047,600		
イオン北海道	17,500	358	6,265,000		
コジマ	37,700	296	11,159,200	貸付株式数	14,100株
ヒマラヤ	8,100	656	5,313,600		
コーナン商事	30,500	1,015	30,957,500	貸付株式数	11,900株
黒田電気	34,500	937	32,326,500		
ネットワンシステムズ	126,400	1,113	140,683,200	貸付株式数	55,700株
エコス	9,400	510	4,794,000		
ワタミ	33,000	1,704	56,232,000	貸付株式数	12,700株 (1,400株)
マルシェ	6,500	730	4,745,000		
ドン・キホーテ	74,700	2,695	201,316,500		
丸文	22,100	356	7,867,600		
メガネトップ	40,100	945	37,894,500	貸付株式数	17,500株
西松屋チェーン	61,200	660	40,392,000	貸付株式数	7,800株
ゼンショーホールディングス	106,700	1,003	107,020,100	貸付株式数	46,800株
ハピネット	14,800	774	11,455,200		
幸楽苑	17,200	1,222	21,018,400		
トーメンエレクトロニクス	12,800	1,166	14,924,800		
ハークスレイ	6,400	592	3,788,800		
サイゼリヤ	41,400	1,238	51,253,200	貸付株式数	18,200株 (2,900株)
エクセル	12,800	726	9,292,800		
マルカキカイ	8,600	924	7,946,400		
アルゴグラフィックス	10,100	1,050	10,605,000		
ガリバーインターナショナル	8,470	2,507	21,234,290	貸付株式数	3,560株
日本エム・ディ・エム	23,000	242	5,566,000	貸付株式数	9,000株
ポプラ	6,700	526	3,524,200		
ユナイテッドアローズ	30,200	2,002	60,460,400		
進和	16,500	945	15,592,500		
エスケイジャパン	6,300	266	1,675,800		
ダイトエレクトロン	12,800	361	4,620,800		
ハイデイ日高	14,700	1,230	18,081,000	貸付株式数	200株
シークス	17,800	1,012	18,013,600		
京都きもの友禅	18,500	976	18,056,000	貸付株式数	5,300株
コロナイド	93,000	635	59,055,000	貸付株式数	37,500株
田中商事	8,000	481	3,848,000	貸付株式数	2,100株
オーハシテクニカ	15,600	588	9,172,800		
壱番屋	11,200	2,337	26,174,400	貸付株式数	5,200株
マクニカ	14,400	1,834	26,409,600		
白銅	8,600	741	6,372,600		

トップカルチャー	10,100	370	3,737,000		
スギホールディングス	50,200	2,627	131,875,400		
島津製作所	339,000	647	219,333,000	貸付株式数	29,000株
J M S	40,000	265	10,600,000		
クボテック	58	16,750	971,500		
モリテックス	5,900	243	1,433,700		
長野計器	19,800	694	13,741,200		
ブイ・テクノロジー	37	200,800	7,429,600	貸付株式数	16株
スター精密	45,600	764	34,838,400		
東京計器	98,000	129	12,642,000		
愛知時計	30,000	303	9,090,000		
日本電産トーソク	13,600	653	8,880,800	貸付株式数	5,100株 (900株)
東京精密	50,900	1,341	68,256,900		
ニコン	494,300	2,336	1,154,684,800	貸付株式数	217,700株
トプコン	65,000	550	35,750,000	貸付株式数	29,900株 (4,700株)
オリンパス	334,500	1,283	429,163,500	貸付株式数	154,800株 (7,600株)
理研計器	22,600	531	12,000,600	貸付株式数	9,200株
大日本スクリーン	268,000	536	143,648,000	貸付株式数	100,000株
キヤノン電子	25,900	1,658	42,942,200		
タムロン	21,800	2,579	56,222,200	貸付株式数	11,200株
HOYA	689,700	1,750	1,206,975,000		
ノーリツ鋼機	25,200	378	9,525,600		
エー・アンド・デイ	27,000	289	7,803,000		
キヤノン	1,762,200	3,045	5,365,899,000		
リコー	853,000	615	524,595,000	貸付株式数	395,000株
日本電産コパル	22,000	775	17,050,000		
日本電産サンキョー	66,000	418	27,588,000		
シチズンホールディングス	339,400	452	153,408,800		
リズム時計	128,000	124	15,872,000		
大研医器	3,300	987	3,257,100	貸付株式数	1,400株
パラマウントベッドHD	24,100	2,392	57,647,200		
SHOBI	4,300	481	2,068,300	貸付株式数	1,600株
永大産業	36,000	360	12,960,000		
ダンロップスポーツ	15,300	977	14,948,100		
バンダイナムコHLDGS	293,300	1,095	321,163,500		
共立印刷	33,000	261	8,613,000	貸付株式数	14,800株
フランスベッドHLDGS	178,000	179	31,862,000		
パイロットコーポレーション	247	144,400	35,666,800		
エイベックス・グループHD	52,900	1,202	63,585,800		
トッパン・フォームズ	60,700	686	41,640,200		
フジシールインターナショナル	31,800	1,497	47,604,600		
タカラトミー	93,300	513	47,862,900		
廣済堂	23,700	342	8,105,400	貸付株式数	9,200株
アーク	95,700	225	21,532,500	貸付株式数	10,000株
レック	8,500	1,062	9,027,000		
タカノ	11,100	422	4,684,200		
プロネクサス	29,600	480	14,208,000	貸付株式数	13,600株
ホクシン	19,800	222	4,395,600	貸付株式数	9,100株
ウッドワン	45,000	258	11,610,000		
大建工業	115,000	215	24,725,000		
きもと	23,700	430	10,191,000		
凸版印刷	862,000	531	457,722,000	貸付株式数	379,000株

大日本印刷	864,000	638	551,232,000	貸付株式数	87,000株
図書印刷	43,000	153	6,579,000		
共同印刷	95,000	206	19,570,000		
日本写真印刷	47,600	894	42,554,400	貸付株式数	20,900株 (7,200株)
光村印刷	26,000	249	6,474,000		
藤森工業	21,300	1,540	32,802,000		
宝印刷	16,000	596	9,536,000	貸付株式数	6,100株 (5,200株)
前澤化成工業	20,800	841	17,492,800		
アシックス	264,200	937	247,555,400		
ツ ツ ミ	14,100	1,851	26,099,100		
ジェイ エス ピー	19,300	1,176	22,696,800		
ニ チ ハ	32,900	898	29,544,200		
ローランド	29,300	662	19,396,600		
エフピコ	13,200	5,330	70,356,000		
小松ウオール工業	10,600	963	10,207,800	貸付株式数	2,000株
ヤマハ	208,500	769	160,336,500		
河合楽器	106,000	183	19,398,000		
クリナップ	33,100	525	17,377,500		
ピジヨン	25,000	3,465	86,625,000	貸付株式数	11,300株
天馬	23,400	822	19,234,800		
兼松日産農林	42,000	145	6,090,000	貸付株式数	1,000株
キングジム	23,300	638	14,865,400		
リンテック	53,900	1,355	73,034,500		
T A S A K I	5,400	308	1,663,200	貸付株式数	2,300株
信越ポリマー	58,000	366	21,228,000		
東 リ	74,000	149	11,026,000		
イトーキ	59,600	388	23,124,800	貸付株式数	26,100株
任 天 堂	162,200	9,250	1,500,350,000		
三菱鉛筆	23,400	1,357	31,753,800		
松 風	13,800	839	11,578,200	貸付株式数	1,000株
タカラスタンダ - ド	130,000	618	80,340,000		
コ ク ヨ	147,400	602	88,734,800		
ナカバヤシ	58,000	184	10,672,000	貸付株式数	22,000株
ニ フ コ	66,300	1,900	125,970,000	貸付株式数	27,900株
グローブライド	137,000	95	13,015,000		
岡村製作所	99,000	577	57,123,000		
日本バルカー	115,000	220	25,300,000		
M U T O Hホールディングス	28,000	251	7,028,000	貸付株式数	13,000株
伊 藤 忠	2,233,500	846	1,889,541,000		
丸 紅	2,449,000	531	1,300,419,000	貸付株式数	111,000株
スクロール	36,300	297	10,781,100		
高 島	46,000	336	15,456,000	貸付株式数	21,000株
F & A アクアホールディングス	21,300	877	18,680,100		
三陽商会	148,000	257	38,036,000	貸付株式数	67,000株 (6,000株)
長瀬産業	158,500	958	151,843,000		
ナイガイ	78,000	48	3,744,000		
蝶 理	170,000	102	17,340,000		
豊田通商	311,900	1,529	476,895,100		
オンワ - ドホールディングス	183,000	607	111,081,000		
三共生興	47,600	268	12,756,800		
兼 松	595,000	92	54,740,000		
美 津 濃	140,000	421	58,940,000		

ツカモトコーポレーション	46,000	137	6,302,000	貸付株式数	12,000株
ファミリーマート	86,000	3,655	314,330,000	貸付株式数	37,800株
ルック	46,000	587	27,002,000	貸付株式数	18,000株
三井物産	2,416,700	1,196	2,890,373,200		
日本紙パルプ	146,000	282	41,172,000		
東京エレクトロン	238,600	3,490	832,714,000		
日立ハイテクノロジーズ	84,900	1,877	159,357,300		
カメイ	36,000	801	28,836,000		
東都水産	44,000	129	5,676,000	貸付株式数	5,000株
スターゼン	89,000	228	20,292,000		
セイコーHD	164,000	228	37,392,000	貸付株式数	24,000株
山 善	107,400	595	63,903,000		
椿本興業	28,000	231	6,468,000		
住友商事	1,652,300	1,114	1,840,662,200		
日本ユニシス	67,600	560	37,856,000		
内田洋行	60,000	269	16,140,000		
三菱商事	2,039,000	1,623	3,309,297,000		
第一実業	58,000	393	22,794,000		
キャノンマーケティングJPN	93,100	1,005	93,565,500		
西華産業	101,000	222	22,422,000		
佐藤商事	24,700	563	13,906,100		
菱洋エレクトロ	30,400	815	24,776,000		
東京産業	26,000	263	6,838,000		
ユアサ商事	286,000	145	41,470,000		
神鋼商事	68,000	178	12,104,000		
阪和興業	278,000	300	83,400,000		
カナデン	28,000	506	14,168,000		
菱電商事	39,000	477	18,603,000		
ニプロ	117,400	482	56,586,800		
フルサト工業	16,500	801	13,216,500		
岩谷産業	310,000	318	98,580,000		
すてきなイスグループ	122,000	207	25,254,000	貸付株式数	22,000株
昭光通商	99,000	121	11,979,000		
ニチモウ	38,000	182	6,916,000		
極東貿易	31,000	146	4,526,000	貸付株式数	11,000株
イ ワ キ	40,000	181	7,240,000		
兼松エレクトロニクス	17,700	894	15,823,800		
三愛石油	66,000	370	24,420,000		
稲畑産業	74,600	508	37,896,800		
G S Iクレオス	66,000	108	7,128,000	貸付株式数	14,000株
明和産業	21,900	567	12,417,300	貸付株式数	10,100株
J F E 商事	187,700	318	59,688,600		
ゴ - ルドウイン	66,000	475	31,350,000	貸付株式数	31,000株
ユニ・チャ - ム	164,000	4,465	732,260,000	貸付株式数	30,400株
デサント	73,000	490	35,770,000		
ヤマトインタ - ナショナル	17,800	383	6,817,400		
東邦ホールディングス	89,600	1,613	144,524,800		
サンゲツ	49,600	1,974	97,910,400		
ミツウロコグループ	44,800	541	24,236,800		
シナネン	60,000	337	20,220,000		
伊藤忠エネクス	61,600	469	28,890,400		
サンリオ	70,600	2,734	193,020,400	貸付株式数	32,700株
サンワ テクノス	13,600	717	9,751,200		
リョーサン	45,500	1,549	70,479,500		
新光商事	30,600	660	20,196,000		

トーヨー	58,000	316	18,328,000		
三信電気	40,000	582	23,280,000		
東陽テクニカ	40,500	892	36,126,000		
モスフード サービス	36,700	1,575	57,802,500		
加賀電子	30,300	806	24,421,800		
三益半導体	24,900	700	17,430,000		
ソーダニツカ	29,000	345	10,005,000		
立花エレテック	16,900	714	12,066,600		
木曽路	32,000	1,618	51,776,000	貸付株式数	14,700株
千趣会	50,300	516	25,954,800		
タカキユー	20,000	220	4,400,000	貸付株式数	9,000株
ケーヨー	52,400	497	26,042,800	貸付株式数	22,900株 (2,400株)
アデランス	35,400	980	34,692,000		
上新電機	60,000	809	48,540,000		
日本瓦斯	26,600	1,065	28,329,000		
ベスト電器	87,500	159	13,912,500		
マルエツ	56,000	292	16,352,000		
ロイヤルホールディングス	46,500	922	42,873,000	貸付株式数	17,100株
東天紅	20,000	170	3,400,000	貸付株式数	7,000株
いなげや	31,100	931	28,954,100		
島忠	63,400	1,710	108,414,000		
チヨダ	36,600	1,836	67,197,600		
ライフコーポレーション	17,700	2,194	38,833,800		
カスミ	57,300	564	32,317,200		
リンガーハット	25,200	1,064	26,812,800	貸付株式数	11,600株
さが美	21,000	119	2,499,000	貸付株式数	8,000株
MR MAX	27,300	327	8,927,100		
テナライド	21,100	272	5,739,200	貸付株式数	8,200株
AOKIホールディングス	24,600	1,676	41,229,600		
オークワ	39,000	1,057	41,223,000		
コメリ	38,300	2,033	77,863,900		
青山商事	77,200	1,609	124,214,800		
しまむら	32,500	9,260	300,950,000		
CFSコーポレーション	18,100	371	6,715,100		
高島屋	379,000	605	229,295,000		
松屋	56,300	692	38,959,600	貸付株式数	25,900株 (8,300株)
エイチ・ツー・オーリテイリング	146,000	766	111,836,000	貸付株式数	22,000株
丸栄	42,000	88	3,696,000	貸付株式数	18,000株
ニッセンHD	50,300	375	18,862,500	貸付株式数	23,400株
パルコ	50,900	987	50,238,300	貸付株式数	23,400株
丸井グループ	364,900	606	221,129,400		
クレディセゾン	228,700	1,697	388,103,900		
原信ナルスHLDGS	15,500	1,438	22,289,000		
井筒屋	152,000	51	7,752,000	貸付株式数	10,000株
ダイエー	172,750	212	36,623,000	貸付株式数	79,700株
イズミヤ	98,000	406	39,788,000		
イオン	987,000	978	965,286,000	貸付株式数	457,400株 (315,800株)
ユニー	209,900	905	189,959,500		
イズミ	71,200	1,643	116,981,600		
東武ストア	35,000	267	9,345,000	貸付株式数	16,000株
平和堂	51,600	1,115	57,534,000		
フジ	31,100	1,793	55,762,300	貸付株式数	7,500株

ヤオコー	12,300	2,817	34,649,100	
ゼビオ	33,800	1,888	63,814,400	
ケーズホールディングス	69,900	2,256	157,694,400	貸付株式数 32,300株 (1,700株)
P a l t a c	29,500	1,111	32,774,500	
O L Y M P I C	18,500	848	15,688,000	
日産東京販売HD	39,000	370	14,430,000	貸付株式数 15,000株
新生銀行	2,180,000	97	211,460,000	
あおぞら銀行	872,000	186	162,192,000	貸付株式数 383,000株
三菱UFJフィナンシャルG	21,195,500	383	8,117,876,500	
りそなホールディングス	2,436,700	323	787,054,100	
三井住友トラストHD	5,488,000	237	1,300,656,000	
三井住友フィナンシャルG	2,125,800	2,577	5,478,186,600	
第四銀行	360,000	241	86,760,000	
北越銀行	287,000	156	44,772,000	
西日本シティ銀行	982,000	190	186,580,000	
札幌北洋ホール	422,200	235	99,217,000	
千葉銀行	1,104,000	475	524,400,000	
横浜銀行	1,781,000	372	662,532,000	
常陽銀行	1,070,000	357	381,990,000	貸付株式数 472,000株
群馬銀行	633,000	386	244,338,000	
武蔵野銀行	45,100	2,351	106,030,100	
千葉興業銀行	53,600	445	23,852,000	
筑波銀行	116,300	277	32,215,100	
東京都民銀行	52,900	745	39,410,500	
七十七銀行	439,000	322	141,358,000	
青森銀行	209,000	247	51,623,000	
秋田銀行	192,000	220	42,240,000	
山形銀行	170,000	336	57,120,000	
岩手銀行	18,900	3,290	62,181,000	
東邦銀行	235,000	239	56,165,000	
東北銀行	151,000	121	18,271,000	
みちのく銀行	140,000	156	21,840,000	
ふくおかフィナンシャルG	1,136,000	296	336,256,000	
静岡銀行	820,000	836	685,520,000	
十六銀行	351,000	260	91,260,000	
スルガ銀行	272,000	805	218,960,000	
八十二銀行	516,000	417	215,172,000	
山梨中央銀行	171,000	320	54,720,000	
大垣共立銀行	373,000	274	102,202,000	
福井銀行	239,000	186	44,454,000	
北國銀行	324,000	309	100,116,000	
清水銀行	9,500	2,191	20,814,500	
滋賀銀行	263,000	431	113,353,000	
南都銀行	260,000	341	88,660,000	
百五銀行	253,000	334	84,502,000	
京都銀行	501,000	595	298,095,000	貸付株式数 7,000株 (7,000株)
三重銀行	116,000	176	20,416,000	
ほくほくフィナンシャルG	1,961,000	126	247,086,000	
広島銀行	826,000	277	228,802,000	貸付株式数 198,000株
山陰合同銀行	164,000	552	90,528,000	
中国銀行	216,000	1,041	224,856,000	
鳥取銀行	85,000	144	12,240,000	
伊予銀行	299,000	635	189,865,000	

百十四銀行	307,000	311	95,477,000		
四国銀行	201,000	204	41,004,000		
阿波銀行	246,000	508	124,968,000		
鹿児島銀行	181,000	488	88,328,000		
大分銀行	181,000	250	45,250,000		
宮崎銀行	186,000	203	37,758,000		
肥後銀行	215,000	416	89,440,000		
佐賀銀行	170,000	197	33,490,000		
十八銀行	179,000	208	37,232,000		
沖縄銀行	21,200	3,490	73,988,000		
琉球銀行	58,900	1,031	60,725,900		
八千代銀行	14,400	1,555	22,392,000		
セブン銀行	829,000	196	162,484,000		
みずほフィナンシャルG	36,012,700	129	4,645,638,300		
紀陽ホールディングス	1,116,000	115	128,340,000		
山口フィナンシャルG	278,000	706	196,268,000		
アクリティブ	153	9,300	1,422,900	貸付株式数	45株
芙蓉総合リース	26,500	2,467	65,375,500		
興銀リース	38,900	1,941	75,504,900		
東京センチュリーリース	75,100	1,413	106,116,300		
SBIホールディングス	29,662	5,400	160,174,800		
日本証券金融	115,500	384	44,352,000		
大阪証券金融	32,600	171	5,574,600		
アイフル	254,650	155	39,470,750	貸付株式数	117,200株
日本アジア投資	199,000	55	10,945,000	貸付株式数	63,000株
ポケットカード	27,200	364	9,900,800	貸付株式数	11,300株
長野銀行	88,000	152	13,376,000		
名古屋銀行	252,000	247	62,244,000		
愛知銀行	10,100	3,865	39,036,500		
第三銀行	158,000	151	23,858,000		
中京銀行	115,000	179	20,585,000		
東日本銀行	134,000	172	23,048,000		
大光銀行	99,000	214	21,186,000		
愛媛銀行	176,000	219	38,544,000		
トマト銀行	108,000	135	14,580,000		
みなと銀行	253,000	143	36,179,000		
京葉銀行	231,000	363	83,853,000		
関西アーバン銀行	390,000	101	39,390,000		
栃木銀行	141,000	246	34,686,000		
北日本銀行	8,400	2,120	17,808,000		
東和銀行	281,000	78	21,918,000		
福島銀行	324,000	58	18,792,000	貸付株式数	117,000株
大東銀行	178,000	66	11,748,000		
リコーリース	19,200	1,789	34,348,800		
イオン クレジットサービス	114,700	1,394	159,891,800	貸付株式数	50,500株
アコム	56,240	1,569	88,240,560		
ジャックス	170,000	256	43,520,000		
オリコ	429,500	102	43,809,000		
日立キャピタル	55,000	1,285	70,675,000		
オリックス	145,670	7,250	1,056,107,500	貸付株式数	64,180株
三菱UFJリース	71,010	3,200	227,232,000		
ジャフコ	34,000	1,459	49,606,000	貸付株式数	9,100株
トモニホールディングス	214,800	331	71,098,800		
大和証券G本社	2,774,000	274	760,076,000		
野村ホールディングス	6,060,400	272	1,648,428,800	貸付株式数	1,308,900株

岡三証券グループ	237,000	291	68,967,000		
丸三証券	94,300	272	25,649,600		
東洋証券	105,000	142	14,910,000		
東海東京HD	321,000	267	85,707,000		
光世証券	63,000	76	4,788,000	貸付株式数	24,000株
水戸証券	78,000	163	12,714,000	貸付株式数	32,000株
いちよし証券	62,500	416	26,000,000		
松井証券	166,000	443	73,538,000	貸付株式数	72,800株
NK S Jホールディングス	585,300	1,610	942,333,000		
だいこう証券ビジ	15,700	292	4,584,400		
マネックスG	2,112	12,490	26,378,880		
カブドットコム証券	114,100	230	26,243,000		
極東証券	37,500	592	22,200,000		
岩井コスモホールディング	26,000	315	8,190,000		
フィデアホール	161,100	159	25,614,900		
池田泉州HD	1,155,200	106	122,451,200		
M S & A D	836,700	1,378	1,152,972,600		
SONY F H	268,200	1,251	335,518,200		
小林洋行	6,700	177	1,185,900	貸付株式数	1,800株
第一生命	14,974	84,900	1,271,292,600		
東京海上HD	1,062,900	1,922	2,042,893,800		
アサックス	36	83,400	3,002,400	貸付株式数	13株
NECキャピタルソリューション	9,500	995	9,452,500		
T & Dホールディングス	1,020,400	826	842,850,400		
三井不動産	1,242,000	1,473	1,829,466,000		
三菱地所	1,959,000	1,382	2,707,338,000		
平和不動産	264,500	180	47,610,000		
東京建物	534,000	278	148,452,000		
ダイビル	82,300	600	49,380,000		
東急不動産	564,000	378	213,192,000		
京阪神ビルディング	33,400	360	12,024,000		
住友不動産	671,000	1,858	1,246,718,000		
東宝不動産	29,400	434	12,759,600		
太平洋興発	96,000	79	7,584,000	貸付株式数	35,000株
大京	431,000	197	84,907,000		
テーオーシー	108,500	444	48,174,000	貸付株式数	21,400株
東京楽天地	44,000	308	13,552,000		
レオパレス21	216,300	260	56,238,000	貸付株式数	100,200株 (4,500株)
フジ住宅	35,700	421	15,029,700		
空港施設	29,000	364	10,556,000		
明和地所	13,700	419	5,740,300	貸付株式数	4,700株
住友不動産販売	10,080	3,910	39,412,800		
ゴールドクレスト	25,210	1,276	32,167,960		
東栄住宅	19,000	841	15,979,000		
リロ・ホールディング	8,700	2,676	23,281,200		
日本エスリード	10,900	671	7,313,900		
東急リバブル	25,100	835	20,958,500		
飯田産業	26,400	714	18,849,600		
日神不動産	16,500	466	7,689,000		
アーネストワン	46,100	1,038	47,851,800		
タカラレーベン	32,300	686	22,157,800		
サンヨーハウジ 名古屋	124	82,100	10,180,400		
イオンモール	127,600	1,775	226,490,000		
フージャースコーポレーション	427	58,300	24,894,100	貸付株式数	184株

タクトホーム	148	71,600	10,596,800	貸付株式数	56株
ランド	37,100	12	445,200		
トーセイ	289	30,900	8,930,100		
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,739	62,600	108,861,400		
サンフロンティア不動産	226	17,710	4,002,460		
ランドビジネス	189	15,360	2,903,040		
グランディハウス	6,000	616	3,696,000		
東武鉄道	1,610,000	419	674,590,000	貸付株式数	746,000株
相鉄ホールディングス	453,000	267	120,951,000		
東京急行	1,669,000	377	629,213,000		
京浜急行	729,000	734	535,086,000	貸付株式数	320,000株
小田急電鉄	909,000	795	722,655,000	貸付株式数	420,000株
京王電鉄	793,000	576	456,768,000	貸付株式数	199,000株
京成電鉄	456,000	695	316,920,000		
富士急行	76,000	477	36,252,000	貸付株式数	35,000株 (7,000株)
新京成電鉄	36,000	356	12,816,000		
東日本旅客鉄道	493,200	5,050	2,490,660,000		
西日本旅客鉄道	246,600	3,415	842,139,000		
東海旅客鉄道	2,359	639,000	1,507,401,000		
西日本鉄道	367,000	351	128,817,000		
ハマキョウレックス	7,800	2,743	21,395,400		
サカイ引越センター	4,900	1,595	7,815,500		
近畿日本鉄道	2,562,000	312	799,344,000	貸付株式数	1,187,000株 (120,000株)
阪急阪神HLDGS	1,904,000	410	780,640,000	貸付株式数	128,000株
南海電鉄	591,000	353	208,623,000	貸付株式数	241,000株
京阪電鉄	636,000	381	242,316,000	貸付株式数	266,000株
名糖運輸	11,600	601	6,971,600		
名古屋鉄道	990,000	220	217,800,000	貸付株式数	407,000株
日本通運	1,123,000	327	367,221,000		
ヤマトホールディングス	577,200	1,279	738,238,800		
山九	345,000	300	103,500,000		
日新	107,000	213	22,791,000		
丸運	15,300	190	2,907,000		
丸全昭和運輸	95,000	247	23,465,000		
センコー	114,000	341	38,874,000	貸付株式数	52,000株
トナミホールディングス	57,000	178	10,146,000		
日本梱包運輸	85,000	997	84,745,000		
日石輸送	31,000	190	5,890,000		
福山通運	172,000	444	76,368,000	貸付株式数	79,000株 (39,000株)
セイノーホールディングス	220,000	532	117,040,000		
神奈川中央交通	33,000	445	14,685,000		
日立物流	59,100	1,450	85,695,000		
日本郵船	2,247,000	203	456,141,000		
商船三井	1,487,000	267	397,029,000	貸付株式数	578,000株
川崎汽船	882,000	129	113,778,000	貸付株式数	405,000株
NSユニテッド海運	122,000	118	14,396,000	貸付株式数	23,000株
乾汽船	31,100	261	8,117,100	貸付株式数	12,800株
明治海運	25,000	321	8,025,000	貸付株式数	11,500株 (1,300株)
飯野海運	137,000	361	49,457,000		
共栄タンカー	23,000	211	4,853,000	貸付株式数	9,000株
第一中央汽船	186,000	99	18,414,000	貸付株式数	85,000株

全日本空輸	3,802,000	197	748,994,000	貸付株式数	2,749,000株 (200,000株)
パスコ	25,000	247	6,175,000	貸付株式数	7,000株
三菱倉庫	201,000	823	165,423,000	貸付株式数	40,000株 (40,000株)
三井倉庫	132,000	286	37,752,000		
住友倉庫	207,000	378	78,246,000		
渋沢倉庫	65,000	235	15,275,000		
ヤマタネ	140,000	111	15,540,000		
東陽倉庫	43,000	179	7,697,000		
日本トランスシティ	58,000	275	15,950,000		
ケイヒン	48,000	103	4,944,000		
安田倉庫	21,900	512	11,212,800		
東洋埠頭	79,000	129	10,191,000		
宇徳	19,100	244	4,660,400		
上組	314,000	643	201,902,000		
サンリツ	7,000	515	3,605,000		
キムラユニティー	6,100	746	4,550,600		
キューソー流通システム	7,800	861	6,715,800		
郵船ロジスティクス	22,200	1,067	23,687,400		
近鉄エクスプレス	25,300	2,546	64,413,800		
東海運	17,800	230	4,094,000		
エーアイティー	2,300	1,193	2,743,900		
東京放送HD	167,700	964	161,662,800	貸付株式数	33,700株
日本テレビ放送網	24,570	11,990	294,594,300	貸付株式数	7,610株
テレビ朝日	709	124,600	88,341,400		
スカパーJ S A T H D	2,125	34,800	73,950,000	貸付株式数	874株
テレビ東京HD	17,700	915	16,195,500		
アイ・ティー・シーネットワーク	23,300	647	15,075,100	貸付株式数	5,600株
イー・アクセス	2,136	16,020	34,218,720	貸付株式数	984株
N E C モバイリング	10,200	3,150	32,130,000		
日本電信電話	1,289,300	3,735	4,815,535,500		
K D D I	4,345	536,000	2,328,920,000		
光通信	25,600	3,425	87,680,000	貸付株式数	11,800株
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	23,068	133,000	3,068,044,000		
G M O インターネット	82,800	417	34,527,600		
学研ホールディングス	81,000	172	13,932,000		
ゼンリン	40,400	780	31,512,000		
昭文社	15,200	555	8,436,000		
角川グループH L D G S	26,300	2,199	57,833,700	貸付株式数	12,100株 (4,400株)
インプレスホールディングス	22,700	121	2,746,700	貸付株式数	9,200株
東京電力	2,264,700	152	344,234,400	貸付株式数	997,700株
中部電力	934,700	1,272	1,188,938,400		
関西電力	1,157,600	914	1,058,046,400		
中国電力	392,200	1,302	510,644,400	貸付株式数	172,600株
北陸電力	277,900	1,255	348,764,500		
東北電力	708,700	764	541,446,800		
四国電力	255,400	1,681	429,327,400		
九州電力	626,500	913	571,994,500		
北海道電力	265,500	1,006	267,093,000		
沖縄電力	17,000	2,625	44,625,000		
電源開発	176,100	2,111	371,747,100	貸付株式数	77,500株
東京瓦斯	3,406,000	408	1,389,648,000		
大阪瓦斯	2,753,000	338	930,514,000		

東邦瓦斯	721,000	501	361,221,000	貸付株式数	317,000株
北海道瓦斯	48,000	253	12,144,000		
西部瓦斯	319,000	218	69,542,000		
静岡瓦斯	74,000	549	40,626,000		
アイネット	12,100	575	6,957,500		
松竹	184,000	775	142,600,000	貸付株式数	81,000株 (24,000株)
東宝	199,800	1,352	270,129,600		
エイチ・アイ・エス	24,100	2,730	65,793,000		
東映	117,000	379	44,343,000		
AOI Pro.	12,500	527	6,587,500		
NTTデータ	1,729	240,500	415,824,500	貸付株式数	505株
共立メンテナンス	14,700	1,701	25,004,700		
イチネンホールディングス	31,000	420	13,020,000		
建設技術研究所	16,200	470	7,614,000		
アインファーマシーズ	15,400	4,945	76,153,000	貸付株式数	6,700株
燦ホールディングス	6,300	1,394	8,782,200		
スバル興業	21,000	261	5,481,000		
東京テアトル	113,000	108	12,204,000	貸付株式数	41,000株
よみうりランド	58,000	255	14,790,000		
東京都競馬	227,000	110	24,970,000		
常磐興産	86,000	90	7,740,000	貸付株式数	35,000株
カナモト	35,000	894	31,290,000		
東京ドーム	235,000	233	54,755,000		
DTS	28,900	1,011	29,217,900		
スクウェア・エニックス・HD	91,500	1,280	117,120,000	貸付株式数	40,100株 (4,800株)
シーイーシー	16,600	461	7,652,600		
カプコン	53,700	1,624	87,208,800	貸付株式数	23,500株
アゴーラ・ホスピタリティーG	120,000	21	2,520,000		
日本空港ビルデング	89,300	954	85,192,200		
トランス・コスモス	38,600	1,038	40,066,800		
乃村工藝社	57,000	248	14,136,000		
ジャステック	16,100	497	8,001,700		
SCSK	57,100	1,107	63,209,700		
藤田観光	73,000	252	18,396,000	貸付株式数	24,000株 (24,000株)
近畿日本ツーリスト	88,000	123	10,824,000	貸付株式数	40,000株
日本管財	10,900	1,459	15,903,100		
トーカイ	11,900	1,948	23,181,200		
白洋舎	30,000	205	6,150,000		
セコム	287,700	3,735	1,074,559,500		
日本システムウエア	8,500	314	2,669,000		
セントラル警備保障	13,100	798	10,453,800		
アイネス	33,800	515	17,407,000		
丹青社	27,000	240	6,480,000		
メイテック	45,800	1,688	77,310,400		
TKC	23,600	1,620	38,232,000		
アサツー ディ・ケイ	48,800	2,217	108,189,600	貸付株式数	20,500株
富士ソフト	36,700	1,312	48,150,400		
応用地質	31,100	875	27,212,500		
船井総合研究所	30,300	534	16,180,200		
NSD	50,900	690	35,121,000		
進学会	14,100	292	4,117,200		
丸紅建材リース	26,000	146	3,796,000	貸付株式数	12,000株

コナミ	126,400	1,730	218,672,000	貸付株式数	48,400株
ベネッセホールディングス	90,200	3,600	324,720,000		
イオンディライト	33,400	1,852	61,856,800		
ナック	7,200	1,927	13,874,400		
福井コンピュータHLD S	3,600	421	1,515,600		
ニチイ学館	57,900	812	47,014,800		
ダイセキ	47,700	1,407	67,113,900	貸付株式数	21,000株
日鐵商事	61,000	227	13,847,000		
元気寿司	8,200	998	8,183,600	貸付株式数	3,700株
トラスコ中山	34,900	1,618	56,468,200		
ヤマダ電機	136,200	3,600	490,320,000	貸付株式数	63,080株
オートバックスセブン	31,600	3,925	124,030,000		
アークランドサカモト	18,200	1,203	21,894,600		
ニトリホールディングス	55,450	7,480	414,766,000		
グルメ杵屋	20,000	509	10,180,000	貸付株式数	9,000株
愛眼	22,100	322	7,116,200		
吉野家ホールディングス	758	103,000	78,074,000	貸付株式数	350株
加藤産業	40,300	1,602	64,560,600		
イノテック	17,200	382	6,570,400		
イエローハット	26,200	1,375	36,025,000		
富士エレクトロニクス	14,400	1,096	15,782,400		
松屋フーズ	13,400	1,522	20,394,800		
J B C Cホールディングス	21,700	545	11,826,500		
J Kホールディングス	23,100	356	8,223,600		
サガミチェーン	33,000	681	22,473,000	貸付株式数	13,000株
日伝	11,600	2,035	23,606,000		
北沢産業	21,500	158	3,397,000		
杉本商事	15,100	759	11,460,900		
因幡電機産業	33,000	2,383	78,639,000		
住金物産	130,000	196	25,480,000		
プレナス	31,300	1,475	46,167,500		
ミニストップ	20,600	1,372	28,263,200		
アークス	38,500	1,795	69,107,500	貸付株式数	4,000株
バロ-	55,700	1,375	76,587,500	貸付株式数	23,600株 (23,600株)
ミスミグループ本社	103,800	1,894	196,597,200	貸付株式数	33,400株
江守商事	5,100	904	4,610,400		
アルテック	13,600	215	2,924,000	貸付株式数	5,600株
ベルク	13,800	1,104	15,235,200		
大庄	13,100	1,049	13,741,900		
タキヒヨー	41,000	427	17,507,000		
ファーストリテイリング	56,100	15,380	862,818,000		
ソフトバンク	1,268,400	2,924	3,708,801,600	貸付株式数	295,900株
スズケン	107,600	2,722	292,887,200		
サンドラッグ	53,200	2,696	143,427,200		
東京デリカ	8,300	908	7,536,400		
ジェコス	19,200	404	7,756,800		
ヤマザワ	7,000	1,435	10,045,000		
やまや	4,400	1,274	5,605,600	貸付株式数	2,000株
ベルーナ	34,900	651	22,719,900		
合計			293,178,366,298		

(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24年7月31日

資産総額	314,295,755,432円
負債総額	33,626,612,153円
純資産総額（ - ）	280,669,143,279円
発行済数量	377,447,086口
1 単位当たり純資産額（ / ）	743.6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24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C I O（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ. 運用会議

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

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24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	4	11,395
追加型株式投資信託	414	6,826,809
株式投資信託 合計	418	6,838,203
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,373,570
公社債投資信託 合計	17	2,373,570
総合計	435	9,211,774

3 【委託会社等の経理状況】

- 1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
- 3．財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,820,358	3,745,233
有価証券	18,987,155	19,655,070
前払金	579	314
前払費用	24,840	90,562
未収入金	6,925	11,931
未収委託者報酬	6,933,076	6,516,540
未収収益	41,963	55,102
貯蔵品	23,337	11,888
繰延税金資産	286,080	630,508
その他	501,484	190,450
流動資産計	28,625,803	30,907,602
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物（純額）	967,190	1,003,450
器具備品（純額）	332,407	513,162
建設仮勘定	634,782	484,571
	-	5,715
無形固定資産	2,414,530	2,870,849
ソフトウェア	1,364,617	2,173,517
ソフトウェア仮勘定	1,037,069	684,878
電話加入権	11,850	11,850
商標権	396	132
その他	596	471
投資その他の資産	18,825,476	16,375,520
投資有価証券	12,339,547	10,034,136
関係会社株式	5,141,069	5,141,069
出資金	142,215	136,315
従業員に対する長期貸付金	99,889	112,674
差入保証金	609,781	542,920

長期前払費用		7,607		8,478
投資不動産（純額）	1	490,114	1	409,876
貸倒引当金		4,750		9,950
固定資産計		22,207,196		20,249,820
資産合計		50,833,000		51,157,423

（単位：千円）

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	46,454	55,551
未払金	6,501,119	7,194,946
未払収益分配金	27,599	17,954
未払償還金	119,838	88,334
未払手数料	3,725,807	3,386,380
その他未払金	2,627,872	3,702,277
未払費用	2,395,029	3,313,011
未払法人税等	895,379	963,539
未払消費税等	383,973	229,365
賞与引当金	263,000	307,000
本社移転関連費用引当金	-	346,425
資産除去債務	-	292,000
その他	-	87,535
流動負債計	10,484,955	12,789,375
固定負債		
退職給付引当金	1,410,635	1,670,344
役員退職慰労引当金	59,160	68,068
繰延税金負債	1,977,913	1,782,558
固定負債計	3,447,708	3,520,970
負債合計	13,932,663	16,310,345
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計	10,248,473	8,089,414
株主資本合計	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益	85,902	53,783
評価・換算差額等合計	18,137	87,663

純資産合計	36,900,336	34,847,077
負債・純資産合計	50,833,000	51,157,423

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	72,303,483	72,931,048
その他営業収益	345,390	401,212
営業収益計	72,648,873	73,332,260
営業費用		
支払手数料	41,437,322	41,050,089
広告宣伝費	967,991	709,853
公告費	1,256	699
受益証券発行費	3	74
調査費	6,192,360	7,993,144
調査費	831,159	878,635
委託調査費	5,361,200	7,114,509
委託計算費	718,414	733,156
営業雑経費	1,806,147	1,651,996
通信費	287,454	205,421
印刷費	674,758	472,511
協会費	47,465	52,117
諸会費	10,778	11,971
その他営業雑経費	785,691	909,973
営業費用計	51,123,496	52,139,015
一般管理費		
給料	4,192,794	4,452,711
役員報酬	157,200	209,630
給料・手当	3,545,655	3,646,155
賞与	226,939	289,926
賞与引当金繰入額	263,000	307,000
福利厚生費	619,459	728,342
交際費	68,476	71,356
寄付金	638	591
旅費交通費	266,082	215,939
租税公課	169,305	171,533
不動産賃借料	680,147	727,939
退職給付費用	334,864	422,030
役員退職慰労引当金繰入額	28,500	27,988
固定資産減価償却費	897,352	1,107,222
諸経費	1,170,318	1,077,041
一般管理費計	8,427,939	9,002,696
営業利益	13,097,437	12,190,548

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)		当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	573,514		74,753
有価証券利息		23,029		13,537
受取利息		2,673		2,771
時効成立分配金・償還金		149,120		42,189
投資有価証券売却益		38,591		117,695
有価証券償還益		3,185		68,106
その他		41,908		54,685
営業外収益計		832,022		373,739
営業外費用				
投資有価証券売却損		7,515		95,389
有価証券償還損		277		67,873
その他		180,501		67,829
営業外費用計		188,294		231,091
経常利益		13,741,165		12,333,196
特別利益				
貸倒引当金戻入額		614,232		-
特別利益計		614,232		-
特別損失				
固定資産除却損	2	1,067	2	4,871
減損損失	3	35,468	3	76,217
有価証券評価損		-		211,376
本社移転関連費用		-		346,425
その他		22,059		19,547
特別損失計		58,595		658,438
税引前当期純利益		14,296,802		11,674,757
法人税、住民税及び事業税		4,834,931		5,254,642
法人税等調整額		256,140		602,832
法人税等合計		5,091,072		4,651,809
当期純利益		9,205,730		7,022,948

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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	-	-
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,085,103	9,874,176
当期変動額		
別途積立金の取崩	2,800,000	-
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	789,072	2,159,059
当期末残高	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計		
当期首残高	12,259,401	10,248,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008

当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	10,248,473	8,089,414

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
株主資本合計		
当期首残高	38,929,401	36,918,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	18,061	104,040
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	85,978	137,920
当期変動額合計	85,978	137,920
当期末残高	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	55,712	85,902
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	141,615	32,119
当期変動額合計	141,615	32,119
当期末残高	85,902	53,783
評価・換算差額等合計		
当期首残高	73,774	18,137
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,636	105,800
当期変動額合計	55,636	105,800
当期末残高	18,137	87,663
純資産合計		
当期首残高	38,855,627	36,900,336
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,636	105,800
当期変動額合計	1,955,290	2,053,258
当期末残高	36,900,336	34,847,077

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法により計上しております。

3．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

(リース資産を除く)

定率法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	6～47年
器具備品	3～20年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。

(3) 長期前払費用

定額法によっております。

4．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

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

（４）役員退職慰労引当金

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

（５）本社移転関連費用引当金

本社移転に伴い発生する損失に備えるため、発生が見込まれる固定資産除却損、移転費用について合理的な見積額を計上しております。

５．ヘッジ会計の方法

（１）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。

（２）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段・・・株価指数先物

ヘッジ対象・・・投資有価証券

（３）ヘッジ方針

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。

（４）ヘッジ有効性評価の方法

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。

６．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

表示方法の変更

（損益計算書）

１．前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めていた「有価証券償還益」は重要性が増し

たため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外収益」の「その他」に表示していた45,094千円は、「有価証券償還益」3,185千円、「その他」41,908千円として組替えております。

2. 前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「有価証券償還損」は重要性が増したため、当事業年度より区分掲記することとしました。また、前事業年度において区分掲記していた「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」、「貯蔵品廃棄損」及び「投資不動産管理費用」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」に表示していた98,613千円、「貯蔵品廃棄損」に表示していた25,533千円、「投資不動産管理費用」に表示していた20,028千円、及び「その他」に表示していた36,603千円は、「有価証券償還損」277千円、「その他」180,501千円として組替えております。

3. 前事業年度において区分掲記していた「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」に表示していた21,290千円は、「その他」として組替えております。

追加情報

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
建物	854,118千円	986,089千円
器具備品	2,129,756千円	2,234,738千円
投資建物	700,991千円	712,587千円
投資器具備品	28,141千円	22,398千円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
未払金	2,591,913千円	3,577,654千円

3 保証債務

前事業年度（平成23年3月31日現在）

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。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,372,770千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
受取配当金	460,584千円	-

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
器具備品	1,067千円	4,812千円
投資不動産	-	59千円
計	1,067千円	4,871千円

3 減損損失に関する注記

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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つのグループ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。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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つのグループピニ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（76,217千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物17,417千円及び土地58,800千円です。

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）

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成22年6月25日 定時株主総会	普通株式	11,216	4,300	平成22年 3月31日	平成22年 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

当事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年6月24日 定時株主総会	普通株式	9,182	3,520	平成23年 3月31日	平成23年 6月27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24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 7,022百万円
 配当の原資 利益剰余金
 1株当たり配当額 2,692円
 基準日 平成24年3月31日
 効力発生日 平成24年6月26日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。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、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。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価格変動リスクをヘッジしております。なお、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止し、中止時点までのヘッジ手段に係る損益は、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで繰り延べております。

（ ）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

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

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	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 其他有価証券	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。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	3,745,233	3,745,233	-
(2) 未収委託者報酬	6,516,540	6,516,540	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	28,525,516	28,525,516	-
資産計	38,787,291	38,787,291	-
(1) 未払手数料	3,386,380	3,386,380	-
(2) その他未払金	3,702,277	3,702,277	-
(3) 未払費用(*1)	2,764,494	2,764,494	-
負債計	9,853,152	9,853,152	-
デリバティブ取引(*2)	(87,535)	(87,535)	-

(*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	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
(1) その他有価証券 非上場株式	1,172,137	1,163,689
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069	5,141,069
(3) 差入保証金	609,781	542,920

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

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	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 その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,588,634	4,868,529	-
合計	8,753,434	1,588,634	4,868,529	-

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	3,745,233	-	-	-
未収委託者報酬	6,516,540	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	836,311	2,069,432	4,320,954	-
合計	11,098,084	2,069,432	4,320,954	-

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成23年3月31日現在）

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

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

2．その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの 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 原価を超えないもの （1）株式 （2）その他 証券投資信託の受益証券	54,283 25,277,982	55,101 25,890,888	818 612,906
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。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	6,864,572	6,497,516	367,056
小計	6,864,572	6,497,516	367,056
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの （1）株式	49,871	55,101	5,230

(2) その他 証券投資信託の受益証券	21,611,072	21,918,194	307,122
小計	21,660,944	21,973,296	312,352
合計	28,525,516	28,470,813	54,703

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,163,689千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他 証券投資信託の受益証券	16,215,351	117,695	95,389
合計	16,215,351	117,695	95,389

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、その他有価証券（その他）について211,376千円の減損処理を行っておりません。

(デリバティブ取引関係)

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。

前事業年度（平成23年3月31日現在）

該当事項はありません。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

株式関連

(単位：千円)

区分	デリバティブ 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 以外の 取引	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	1,669,315	-	87,535	87,535
合計		1,669,315	-	87,535	87,535

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表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。

前事業年度（平成23年3月31日現在）

株式関連

（単位：千円）

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価
				うち1年超	
原則的 処理 方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	2,435,030	-	183,430
合計			2,435,030	-	183,430

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表された価格により評価しております。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
退職給付債務	1,410,635千円	1,670,344千円
退職給付引当金	1,410,635千円	1,670,344千円

3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
勤務費用	191,300千円	261,341千円
その他	143,564千円	160,689千円
退職給付費用	334,864千円	422,030千円

（注）「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：千円）

	前事業年度（平成23年3月31日 現在）	当事業年度（平成24年3月31日 現在）
繰延税金資産		
減損損失	928,499	838,826
退職給付引当金	573,987	599,247
連結法人間取引（譲渡損）	294,850	258,256
未払事業税	212,062	212,753
投資有価証券評価損	216,468	191,138
本社移転関連費用引当金	-	131,676
賞与引当金	107,014	116,690
出資金評価損	128,238	114,425
資産除去債務	-	110,989
有価証券評価損	-	80,344
器具備品	38,093	33,365
その他有価証券評価差額金	125,395	27,099
役員退職慰労引当金	24,072	25,804
未払社会保険料	11,722	14,071
その他	28,763	27,487
繰延税金資産小計	2,689,169	2,782,177
評価性引当額	1,547,609	1,379,241
繰延税金資産合計	1,141,560	1,402,935
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	2,772,301	2,428,233
建物（資産除去債務）	-	76,837
繰延ヘッジ損益	58,934	29,783
その他有価証券評価差額金	-	18,241
その他	2,156	1,888
繰延税金負債合計	2,833,392	2,554,985
繰延税金負債の純額	1,691,832	1,152,049

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

（単位：%）

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
法定実効税率	40.69	-
（調整）		
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	-

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

3．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率の変更により繰延税金負債の純額（繰延税金資産の金額を控除した金額）が211,604千円減少し、法人税等調整額が205,949千円減少しております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を1年1ヶ月と見積り、過去の不動産賃貸借契約に係る原状回復費用の実績をもとに資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから割引前の見積り額を計上しております。

3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

変動の内容	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
期首残高	-	-
見積りの変更に伴う増加額	-	292,000
期末残高	-	292,000

4．当該資産除去債務の金額の見積りの変更

当事業年度において、平成24年度中に予定している本社移転計画により、合理的な見積りが可能となったため、当該資産除去債務292,000千円を貸借対照表に計上しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

前事業年度（自 平成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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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	76,217	76,217

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,372,770	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	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	大和証券キャピタル・マーケッツ㈱	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。

当事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	19,792,278	未払手数料	2,376,978
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	595,391	未払手数料	76,686
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,233,996	未払費用	245,735

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

(3) 大和証券株式会社及び大和証券キャピタル・マーケット株式会社は、平成24年4月1日をもって合併いたしました。

2. 親会社に関する注記

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

(1 株当たり情報)

前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
1株当たり純資産額 14,146.05円 1株当たり当期純利益 3,529.09円	1株当たり純資産額 13,358.92円 1株当たり当期純利益 2,692.30円

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

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

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
当期純利益(千円)	9,205,730	7,022,948
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(追加情報)

前事業年度(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) 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。

当事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼ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 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成24年4月1日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 (平成24年3月末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	() 100,000	金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	3,000	
クレディ・スイス証券株式会社	78,100	
ゴールドマン・サックス証券会社	83,616	
J . P . モルガン証券株式会社	50,275	
シティグループ証券株式会社	96,307	
ソシエテ ジェネラル証券会社 東京支店	31,703	
ドイツ証券株式会社	72,728	
野村証券株式会社	10,000	
パークレイズ証券株式会社	32,945	
B N P パリバ証券株式会社	102,025	
みずほ証券株式会社	125,167	
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	40,500	
メリルリンチ日本証券株式会社	119,440	
モルガン・スタンレーMUF G証券株式会社	62,149	
UBS証券株式会社	(1) 66,850	

() 資本金の額は、平成24年4月1日現在のものです。

(1) 資本金の額は、平成24年4月2日現在のものです。

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24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23年9月29日	有価証券届出書の訂正届出書
平成23年9月29日	有価証券届出書の訂正届出書
平成23年10月3日	有価証券届出書・同添付書類、有価証券報告書（第10期）・同添付書類
平成24年3月30日	有価証券届出書の訂正届出書
平成24年4月3日	半期報告書（第11期中）、有価証券届出書の訂正届出書・同添付書類
平成24年4月26日	有価証券届出書の訂正届出書
平成24年7月10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24年8月9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23年7月11日から平成24年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ上場投信 - トピックスの平成24年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）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）](#)△

独立監査人の監査報告書

平成24年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成24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。

利害関係

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

以上

(注)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。