

【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25年10月3日提出
【計算期間】	第12計算期間 （自 平成24年7月11日 至 平成25年7月10日）
【ファンド名】	ダイワ上場投信ートピックス
【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】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山部 努
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3111
【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。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	対象インデックス
株式	年1回	グローバル	
一般		日本	
大型株	年2回	北米	日経225
中小型株		欧州	
債券	年4回	アジア	TOPIX
一般	年6回 (隔月)	オセアニア	
公債	年12回 (毎月)	中南米	
社債		アフリカ	その他 ()
その他債券	日々	中近東 (中東)	
クレジット属性 ()	その他 ()	エマージング	
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、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス <http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

<信託の限度>

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

<ファンドの特色>

1

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

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

東証株価指数（TOPIX）について

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

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

（注2）基準時の時価総額の修正方法：

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

- ・ 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。

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

(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25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。

- ① 当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を東証株価指数の変動率に一致させることを目的として、東証株価指数に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式に対する投資として運用を行ないます。
- ② 東証株価指数を構成する全銘柄の株式の時価総額構成比率の95%以上を構成する銘柄の株式を組入れることを原則とします。

- ③ 前①および前②の基本方針に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行なうこと（有価証券指数等先物取引等を利用することを含みます。）があります。
- ④ 市況動向、資産規模等によっては、上記の運用を行なえないことがあります。

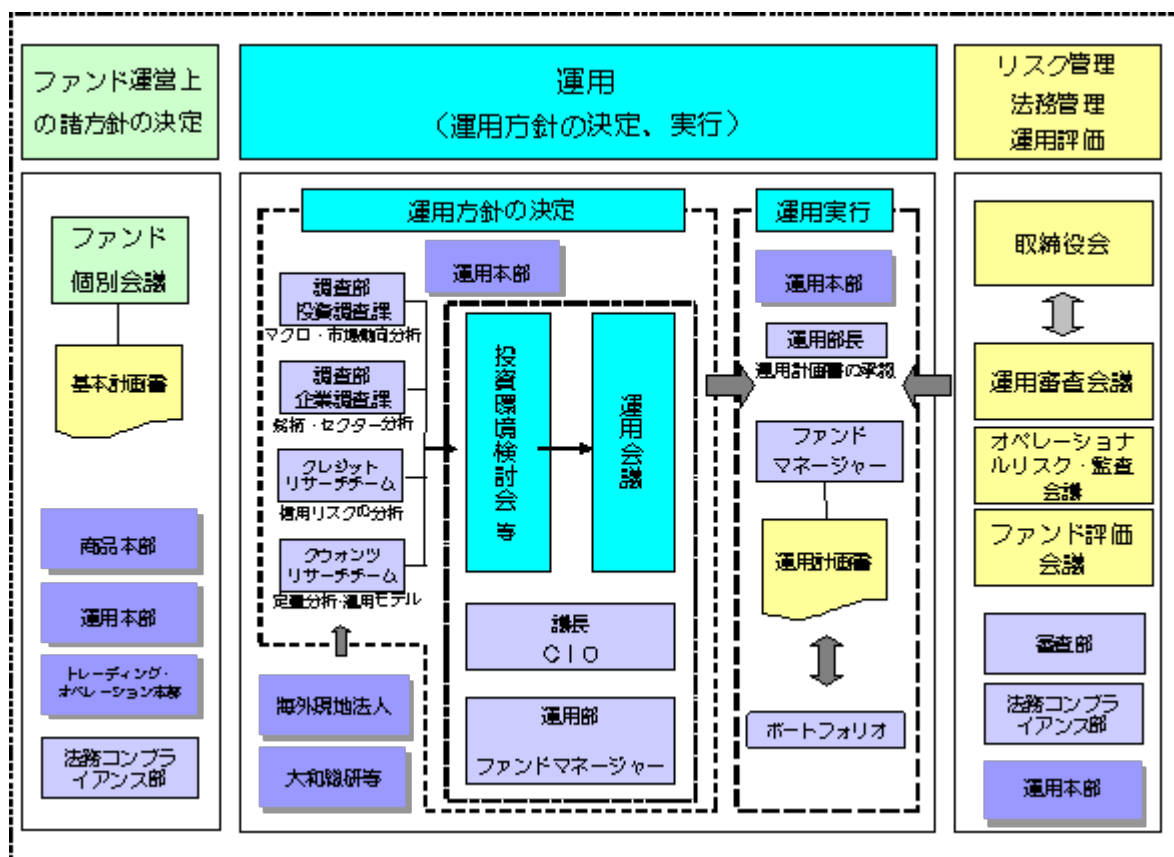
(2) 【投資対象】

- ① 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)③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
- ② 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。
- ③ 委託会社は、信託金を、前②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】

- ① 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。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ. 基本計画書の策定

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

ロ. 投資環境の検討

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

ハ. 基本的な運用方針の決定

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

ニ. 運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ. CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営

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

ロ. Deputy-CIO（1～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ. インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

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

ニ. 運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ. ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④ ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・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オペレーショナルリスク・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。

⑤ 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25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】

① 株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

② 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。

③ 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。

④ 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たときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

⑤ 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。

① 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。

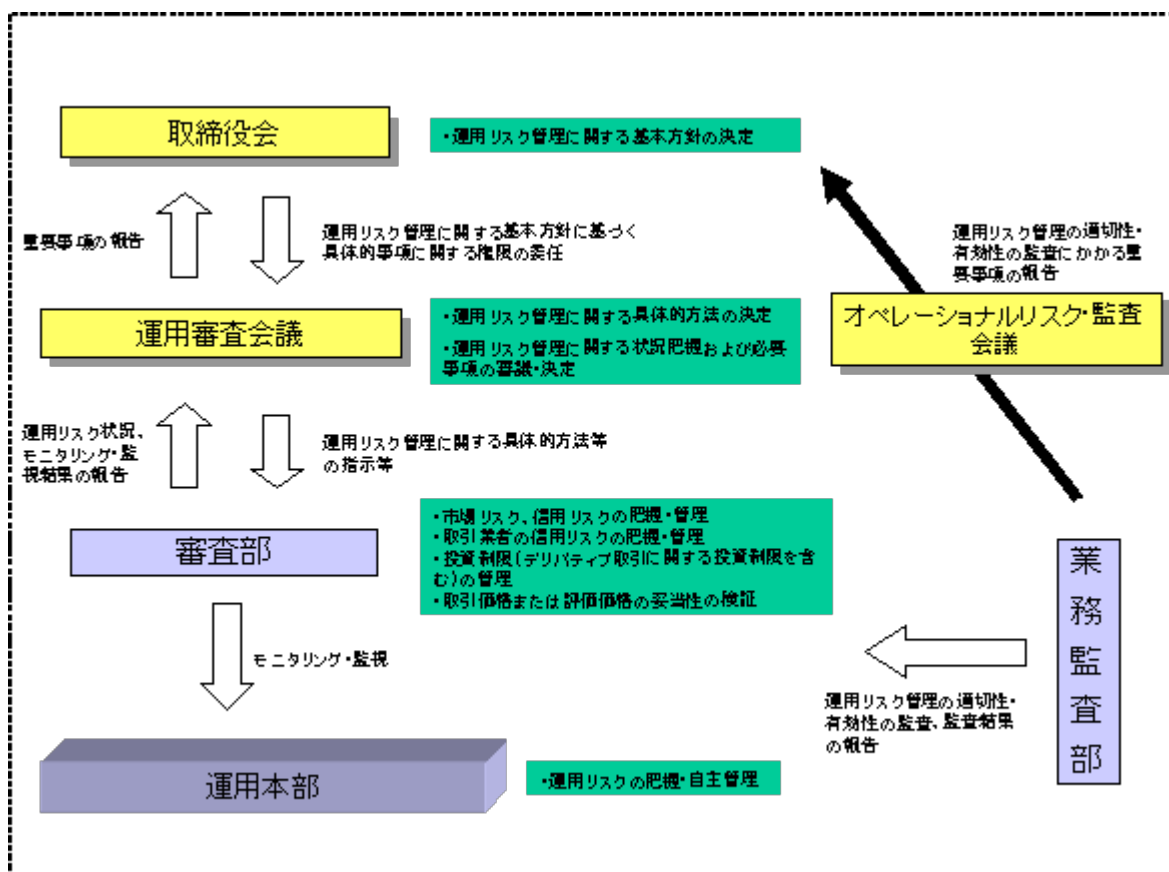
② その他

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】

① 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。

② 信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

① 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

※消費税率に応じて変更となることがあります。（消費税率が8%になった場合は、年率10,000分の11.88となります。）。

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、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。

※消費税率に応じて変更となることがあります（消費税率が8%になった場合は、年率100分の54となります。）。

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）

※消費税率に応じて変更となることがあります（消費税率が8%になった場合は、それぞれ年率10,000分の11.88、100分の54となります。）。

② 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。

③ 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①イ.の報酬

委託会社 年率10,000分の7.5（税抜）

受託会社 年率10,000分の3.5（税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

ロ. 前①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】

- ① 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。

※消費税率に応じて変更となることがあります（消費税率が8%になった場合は、年率10,000分の6.48となります。）。

※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。

※消費税率に応じて変更となることがあります（消費税率が8%になった場合は、それぞれ年率10,000分の3.24、162万円、162万円となります。）。

- ② 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。

① 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。

② 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25年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（平成25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		857,194,468,422	99.88
	内 日本	857,194,468,422	99.88
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,066,389,376	0.12
純資産総額		858,260,857,798	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		1,069,225,000	0.12
	内 日本	1,069,225,000	0.12

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

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

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

(2) 【投資資産】（平成25年7月31日現在）

① 【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	数 業種 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	7,040,400	6,390.26 44,990,021,404	5,970.00 42,031,188,000	4.90
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	40,928,600	653.05 26,728,442,085	601.00 24,598,088,600	2.87
3	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,088,300	4,745.34 19,400,394,800	4,485.00 18,336,025,500	2.14
4	本田技研	日本	株式	輸送用機器	4,624,200	3,810.29 17,619,547,991	3,630.00 16,785,846,000	1.96
5	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	2,600,700	5,761.93 14,985,074,064	6,240.00 16,228,368,000	1.89
6	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	69,821,100	215.01 15,012,845,200	203.00 14,173,683,300	1.65
7	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	3,411,100	3,734.82 12,739,868,744	3,425.00 11,683,017,500	1.36
8	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	2,277,100	5,260.05 11,977,666,470	4,935.00 11,237,488,500	1.31
9	キャノン	日本	株式	電気機器	3,168,300	3,380.00 10,708,854,000	3,025.00 9,584,107,500	1.12
10	武田薬品	日本	株式	医薬品	2,150,100	4,700.01 10,105,498,711	4,375.00 9,406,687,500	1.10

11	三菱地所	日本	株式	不動産業	3,775,000	2,716.27 10,253,956,230	2,491.00 9,403,525,000	1.10
12	日立	日本	株式	電気機器	13,000,000	664.03 8,632,519,690	658.00 8,554,000,000	1.00
13	ファナック	日本	株式	電気機器	569,800	14,760.54 8,410,558,842	14,860.00 8,467,228,000	0.99
14	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	2,262,400	3,945.09 8,925,378,764	3,700.00 8,370,880,000	0.98
15	KDDI	日本	株式	情報・通信業	1,527,200	5,250.00 8,017,800,000	5,410.00 8,262,152,000	0.96
16	野村ホールディングス	日本	株式	証券、商品 先物取引業	11,052,200	813.00 8,985,468,400	747.00 8,255,993,400	0.96
17	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	1,011,300	8,349.81 8,444,168,584	7,890.00 7,979,157,000	0.93
18	三井不動産	日本	株式	不動産業	2,551,000	3,185.12 8,125,245,920	2,963.00 7,558,613,000	0.88
19	三菱商事	日本	株式	卸売業	4,220,400	1,816.09 7,664,628,897	1,789.00 7,550,295,600	0.88
20	ソニー	日本	株式	電気機器	3,445,100	2,187.08 7,534,727,596	2,068.00 7,124,466,800	0.83
21	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	6,925,700	1,088.06 7,535,621,020	1,027.00 7,112,693,900	0.83
22	新日鐵住金	日本	株式	鉄鋼	24,258,000	291.02 7,059,591,480	285.00 6,913,530,000	0.81
23	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	44,585	158,685.92 7,075,011,934	149,500.00 6,665,457,500	0.78
24	東京海上HD	日本	株式	保険業	2,094,400	3,479.84 7,288,180,496	3,135.00 6,565,944,000	0.77
25	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	1,245,000	5,620.54 6,997,583,982	5,250.00 6,536,250,000	0.76
26	信越化学	日本	株式	化学	1,028,800	6,899.97 7,098,692,414	6,120.00 6,296,256,000	0.73
27	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	1,798,100	3,755.09 6,752,031,322	3,480.00 6,257,388,000	0.73
28	三井物産	日本	株式	卸売業	4,670,500	1,309.04 6,113,908,792	1,315.00 6,141,707,500	0.72
29	デンソー	日本	株式	輸送用機器	1,354,100	4,865.26 6,588,051,768	4,460.00 6,039,286,000	0.70
30	小松製作所	日本	株式	機械	2,676,800	2,338.13 6,258,706,520	2,188.00 5,856,838,400	0.68

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.88%
合計	99.88%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%

鉱業	0.45%
建設業	2.46%
食料品	3.99%
繊維製品	0.74%
パルプ・紙	0.26%
化学	5.40%
医薬品	4.43%
石油・石炭製品	0.66%
ゴム製品	0.97%
ガラス・土石製品	0.91%
鉄鋼	1.75%
非鉄金属	1.00%
金属製品	0.66%
機械	5.01%
電気機器	11.37%
輸送用機器	12.00%
精密機器	1.34%
その他製品	1.37%
電気・ガス業	2.60%
陸運業	4.03%
海運業	0.34%
空運業	0.63%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	6.91%
卸売業	4.53%
小売業	4.39%
銀行業	10.25%
証券、商品先物取引業	1.85%
保険業	2.41%
その他金融業	1.27%
不動産業	3.49%
サービス業	2.11%
合計	99.88%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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 2013年9月	買建	95	1,124,616,948	1,069,225,000	0.12%

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

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

(3) 【運用実績】

① 【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
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
平成24年7月末日	280,669,143,279	—	743.6	—	741
8月末日	280,430,428,538	—	739.1	—	737
9月末日	288,480,049,627	—	752.4	—	750
10月末日	296,385,175,138	—	757.3	—	756
11月末日	315,159,823,549	—	797.1	—	794
12月末日	348,885,675,251	—	878.0	—	877
平成25年1月末日	381,469,851,982	—	960.0	—	960
2月末日	395,909,989,808	—	996.3	—	993
3月末日	434,254,773,639	—	1,066.1	—	1,065
4月末日	505,992,634,043	—	1,200.6	—	1,200
5月末日	890,787,403,713	—	1,170.2	—	1,170
6月末日	892,389,344,487	—	1,169.2	—	1,166
第12計算期間末 (平成25年7月10日)	935,579,160,460	943,078,552,355	1,222.6	1,232.4	1,222
7月末日	858,260,857,798	—	1,157.6	—	1,156

(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。

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第12計算期間	9.80

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第12計算期間	60.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
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
第12計算期間	425,333,390	43,524,406

[次へ](#)

(参考情報)

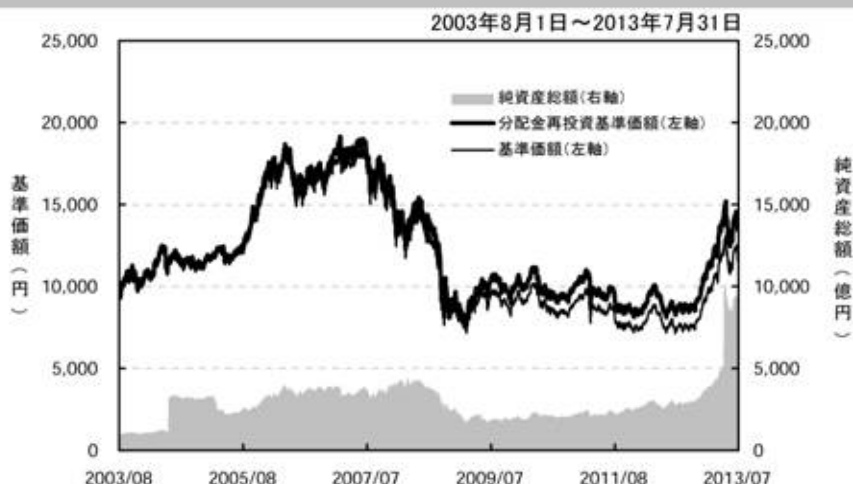
2013年7月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,576円
純資産総額	8,582億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.2%
3カ月間	-2.8%
6カ月間	21.5%
1年間	56.9%
3年間	42.0%
5年間	-4.1%
設定来	7.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、
「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移 (10口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 98円

設定来分配金合計額: 1,650.4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	第12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	13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	98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お約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

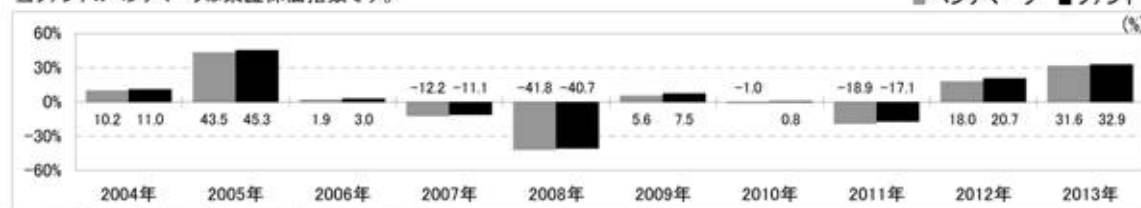
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,711	99.9%	輸送用機器	12.0%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.9%
国内株式先物	1	0.1%	電気機器	11.4%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.9%
不動産投資信託等	-	-	銀行業	10.3%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	2.1%
コール・ローン、その他		0.1%	情報・通信業	6.9%	本田技研	輸送用機器	2.0%
合計	1,712	-	化学	5.4%	ソフトバンク	情報・通信業	1.9%
株式 市場・上場別構成		比率	機械	5.0%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.7%
一部(東証・名証)		99.9%	卸売業	4.5%	日本たばこ産業	食料品	1.4%
二部(東証・名証)		-	医薬品	4.4%	日本電信電話	情報・通信業	1.3%
新興市場他		-	小売業	4.4%	キャノン	電気機器	1.1%
その他		-	その他	35.6%	武田薬品	医薬品	1.1%
合計		99.9%	合計	99.9%	合計		20.3%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄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。

・2013年は7月31日までの騰落率を表しています。

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

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込（販売）手続等】

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

1. 東証株価指数構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内

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

へ. 販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続きを行なうものとし、当該抹消にかかる手続きおよび後カ. 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。

ヨ. 委託会社は、交換請求受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したのものとして扱うこととし、受託会社は、当該受益権にかかる振替受益権が交換株式の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

<買取り>

イ. 販売会社は、次に該当する場合で、受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権

2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

（注）主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東証株価指数に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式：

原則として金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問い合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・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)①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】

① 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、②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。

② 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、公告を行ないません。
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。

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から7.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②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①の4.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

④ 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。

⑤ 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で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。

① 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。）を持分にに応じて請求する権利を有します。
- ロ. 計算期間終了日において氏名もしくは名称および住所が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、受託会社は収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。この場合、名義登録受益者が当該計算期間終了日における振替制度移行後も受益証券を保有している所有者と異なる場合であっても、委託会社および受託

会社は当該所有者に対して収益分配金の支払いおよびその他損害についてその責を負わないものとします。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

② 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。

③ 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12期計算期間（平成24年7月11日から平成25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】

ダイワ上場投信ートピックス

ダイワ上場投信ートピックス
(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 平成24年7月10日現在	第12期 平成25年7月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	30,636,040,637	30,566,239,359
株式	※3, ※4 293,178,366,298	※3, ※4 934,650,293,976
派生商品評価勘定	49,012,327	91,866,558
未収入金	2,807,960,786	3,460,646,545
未収配当金	292,084,700	713,952,870
その他未収収益	※5 7,359,591	※5 22,881,015
流動資産合計	326,970,824,339	969,505,880,323
資産合計	326,970,824,339	969,505,880,323
負債の部		
流動負債		
前受金	344,416,000	556,629,000
未払金	493,146	—
未払収益分配金	5,943,243,848	7,499,391,895
未払受託者報酬	66,197,089	116,621,694
未払委託者報酬	124,890,683	238,834,310
未払利息	316,200	269,706
受入担保金	26,637,950,811	25,392,615,053
その他未払費用	81,058,268	122,358,205
流動負債合計	33,198,566,045	33,926,719,863
負債合計	33,198,566,045	33,926,719,863
純資産の部		
元本等		
元本	※1 479,293,858,750	※1 956,555,088,750
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △185,521,600,456	※2 △20,975,928,290
（分配準備積立金）	334,799,396	743,918,552
元本等合計	293,772,258,294	935,579,160,460
純資産合計	293,772,258,294	935,579,160,460
負債純資産合計	326,970,824,339	969,505,880,323

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 自 平成23年7月11日 至 平成24年7月10日	第12期 自 平成24年7月11日 至 平成25年7月10日
営業収益		
受取配当金	6,144,825,716	8,232,140,255
受取利息	36,323,784	22,267,920
有価証券売買等損益	△26,581,052,447	185,169,889,627
派生商品取引等損益	△398,966,796	1,231,137,500
その他収益	※1 352,636,944	※1 336,147,232
営業収益合計	△20,446,232,799	194,991,582,534
営業費用		
支払利息	18,493,722	11,087,645
受託者報酬	125,198,976	181,375,780
委託者報酬	235,122,644	367,102,888
その他費用	81,560,417	122,478,043
営業費用合計	460,375,759	682,044,356
営業利益又は営業損失（△）	△20,906,608,558	194,309,538,178
経常利益又は経常損失（△）	△20,906,608,558	194,309,538,178
当期純利益又は当期純損失（△）	△20,906,608,558	194,309,538,178
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△101,733,659,831	△185,521,600,456
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,859,241,811	8,186,053,294
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	15,859,241,811	8,186,053,294
剰余金減少額又は欠損金増加額	72,797,330,030	30,450,527,411
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	72,797,330,030	30,450,527,411
分配金	※2 5,943,243,848	※2 7,499,391,895
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△185,521,600,456	△20,975,928,290

(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12期	
	自 平成24年7月11日 至 平成25年7月10日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第11期	第12期
	平成24年7月10日現在	平成25年7月10日現在
1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	344,714,716,250円 184,193,625,000円 49,614,482,500円	479,293,858,750円 531,666,737,500円 54,405,507,500円
2. 計算期間末日における受益権の総数	383,435,087口	765,244,071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185,521,600,456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20,975,928,290円であります。
4. ※3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 24,842,134,227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 24,623,111,170円
5. ※4 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 370,320,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 624,590,000円
6. ※5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分6,194,300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20,711,600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11期	第12期
	自 平成23年7月11日 至 平成24年7月10日	自 平成24年7月11日 至 平成25年7月10日

1. ※1 その他収益	貸付有価証券に係る配当金相当額252,994,970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267,128,821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（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。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当等収益額（8,579,467,762円）及び分配準備積立金(334,799,396円)の合計額から、経費(670,956,711円)を控除して計算される分配対象額は8,243,310,447円（10口当たり107.7円）であり、うち7,499,391,895円（10口当たり98.0円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

区 分	第12期 自 平成24年7月11日 至 平成25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。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第12期 平成25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11期 平成24年7月10日現在	第12期 平成25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	△25,062,627,929	176,354,232,646
合計	△25,062,627,929	176,354,232,646

(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11期 平成24年7月10日 現在				第12期 平成25年7月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	512,598,000	—	561,660,000	49,062,000	829,752,000	—	921,690,000	91,938,000
合計	512,598,000	—	561,660,000	49,062,000	829,752,000	—	921,690,000	91,938,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第12期 自 平成24年7月11日 至 平成25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11期 平成24年7月10日現在	第12期 平成25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)	766.2円 (7,662円)	1,222.6円 (12,226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	269,000	290	78,010,000	貸付株式数 106,000株
日本水産	681,300	206	140,347,800	
マルハニチロホールディングス	1,217,000	202	245,834,000	
ハウスイ	44,000	121	5,324,000	貸付株式数 12,000株
サカタのタネ	92,100	1,395	128,479,500	
ホクト	63,500	1,778	112,903,000	貸付株式数 25,200株
ショーボンドHD	54,300	4,180	226,974,000	貸付株式数 21,600株
ミライト・ホールディングス	180,100	935	168,393,500	
タマホーム	24,800	1,319	32,711,200	貸付株式数 11,100株
住石ホールディングス	184,400	127	23,418,800	貸付株式数 73,300株
日鉄鉱業	151,000	394	59,494,000	
三井松島	399,000	146	58,254,000	貸付株式数 58,000株
国際石油開発帝石	7,708	456,000	3,514,848,000	
日本海洋掘削	15,000	8,020	120,300,000	貸付株式数 4,500株 (4,500株)
関東天然瓦斯	64,000	822	52,608,000	
石油資源開発	90,400	4,370	395,048,000	
ダイセキ環境ソリューション	53	167,100	8,856,300	貸付株式数 9株
安藤・間	341,900	236	80,688,400	
東急建設	225,160	249	56,064,840	
コムシスホールディングス	306,800	1,310	401,908,000	
ミサワホーム	74,900	1,950	146,055,000	
高松コンストラクションGP	46,600	1,608	74,932,800	
東建コーポレーション	23,650	5,770	136,460,500	
ヤマウラ	29,500	281	8,289,500	
大成建設	3,202,000	407	1,303,214,000	
大 林 組	1,902,000	580	1,103,160,000	
清水建設	1,926,000	436	839,736,000	貸付株式数 204,000株
飛島建設	390,500	114	44,517,000	貸付株式数 92,500株
長谷工コーポレーション	3,965,000	133	527,345,000	
松井建設	70,000	357	24,990,000	
鹿島建設	2,787,000	375	1,045,125,000	
不動テトラ	447,900	164	73,455,600	
大末建設	242,000	72	17,424,000	
鉄建建設	384,000	117	44,928,000	貸付株式数 90,000株
太平工業	90,000	366	32,940,000	
西松建設	773,000	248	191,704,000	
三井住友建設	977,400	87	85,033,800	貸付株式数 113,000株
大豊建設	159,000	138	21,942,000	貸付株式数 30,000株
前田建設	386,000	520	200,720,000	
佐田建設	218,000	80	17,440,000	貸付株式数 86,000株
ナカノフドー建設	41,500	229	9,503,500	貸付株式数 11,500株
奥 村 組	543,000	405	219,915,000	
大和小田急建設	30,500	205	6,252,500	
東鉄工業	82,500	1,944	160,380,000	
イチケン	63,000	176	11,088,000	
浅沼組	172,000	77	13,244,000	貸付株式数 63,000株
戸田建設	737,000	295	217,415,000	
熊 谷 組	456,000	104	47,424,000	貸付株式数 181,000株
青木あすなろ建設	34,500	568	19,596,000	
北野建設	142,000	217	30,814,000	
植 木 組	74,000	181	13,394,000	
三井ホーム	76,000	507	38,532,000	
矢作建設	77,400	454	35,139,600	

ピーエス三菱	46,000	433	19,918,000	貸付株式数	13,900株
大東建託	240,800	8,790	2,116,632,000		
新日本建設	75,500	329	24,839,500		
N I P P O	144,000	1,872	269,568,000		
東亜道路	119,000	483	57,477,000		
前田道路	162,000	1,749	283,338,000		
日本道路	165,000	615	101,475,000		
東亜建設	539,000	143	77,077,000		
若築建設	327,000	94	30,738,000	貸付株式数	23,000株
東洋建設	197,000	259	51,023,000		
五洋建設	754,000	261	196,794,000	貸付株式数	64,500株
大林道路	72,000	447	32,184,000		
世紀東急	230,000	83	19,090,000	貸付株式数	66,000株
福 田 組	82,000	346	28,372,000		
住友林業	435,900	1,218	530,926,200		
日本基礎技術	75,900	325	24,667,500		
日成ビルド工業	165,000	191	31,515,000	貸付株式数	43,000株
ヤマダ・エスバイエルホーム	317,000	157	49,769,000	貸付株式数	126,000株
巴コーポレーション	84,700	347	29,390,900	貸付株式数	33,700株
パナホーム	237,000	666	157,842,000		
大和ハウス	1,586,000	1,789	2,837,354,000		
ライト工業	142,200	790	112,338,000		
積水ハウス	1,903,000	1,402	2,668,006,000	貸付株式数	5,000株
日特建設	53,200	357	18,992,400		
北陸電気工事	17,000	333	5,661,000		
ユアテック	85,000	319	27,115,000		
西部電気工業	53,000	428	22,684,000		
四電工	54,000	360	19,440,000		
中電工	91,000	1,015	92,365,000		
関 電 工	289,000	459	132,651,000		
きんでん	345,000	937	323,265,000		
東京エネシス	65,000	456	29,640,000		
トーエネック	80,000	511	40,880,000		
住友電設	43,800	1,436	62,896,800		
日本電設工業	115,000	1,075	123,625,000		
協和エクシオ	227,800	1,151	262,197,800		
新日本空調	44,400	595	26,418,000		
日本工営	198,000	381	75,438,000		
N D S	83,000	287	23,821,000		
九電工	86,000	425	36,550,000		
三機工業	135,000	629	84,915,000		
日 揮	631,000	3,780	2,385,180,000	貸付株式数	47,000株 (47,000株)
中外炉工業	204,000	256	52,224,000	貸付株式数	81,000株
ヤマト	57,000	360	20,520,000		
太平電業	74,000	749	55,426,000		
高砂熱学	180,900	852	154,126,800	貸付株式数	300株
三晃金属	69,000	240	16,560,000	貸付株式数	5,000株
N E C ネットスアイ	52,400	2,310	121,044,000		
朝日工業社	66,000	356	23,496,000		
アタカ大機	18,000	385	6,930,000	貸付株式数	8,000株
大 気 社	90,500	2,502	226,431,000		
ダイダン	77,000	540	41,580,000		
日比谷総合設備	77,100	1,025	79,027,500		
東芝プラントシステム	87,000	1,617	140,679,000	貸付株式数	12,000株

日本製粉	386,000	510	196,860,000	
日清製粉G本社	574,000	1,181	677,894,000	
日東富士製粉	49,000	309	15,141,000	
昭和産業	251,000	307	77,057,000	
鳥越製粉	50,300	633	31,839,900	
協同飼料	219,000	114	24,966,000	
中部飼料	54,200	537	29,105,400	
日本配合飼料	158,000	126	19,908,000	貸付株式数 20,000株
東洋精糖	83,000	100	8,300,000	
日本甜菜糖	317,000	178	56,426,000	
三井製糖	245,000	316	77,420,000	
ネクスト	25,300	1,304	32,991,200	
日本M&Aセンター	30,500	5,770	175,985,000	
ノバレーゼ	14,400	669	9,633,600	
アコーディア・ゴルフ	2,593	108,900	282,377,700	
タケエイ	19,600	1,500	29,400,000	貸付株式数 8,800株
パソナグループ	586	63,800	37,386,800	
リンクアンドモチベーション	380	34,550	13,129,000	貸付株式数 213株
G C Aサヴィアン	32,300	893	28,843,900	
エス・エム・エス	31,500	1,359	42,808,500	貸付株式数 12,500株
テンプホールディングス	80,600	2,229	179,657,400	
リニカル	13,000	1,410	18,330,000	貸付株式数 5,200株
クックパッド	28,600	2,684	76,762,400	貸付株式数 12,800株
エスクリ	13,100	1,029	13,479,900	
アイ・ケイ・ケイ	11,900	734	8,734,600	貸付株式数 2,600株
森永製菓	619,000	207	128,133,000	
中 村 屋	144,000	405	58,320,000	
江崎グリコ	229,000	975	223,275,000	
名糖産業	28,000	1,011	28,308,000	
不 二 家	363,000	195	70,785,000	貸付株式数 162,000株
山崎製パン	459,000	1,106	507,654,000	貸付株式数 96,000株
第一屋製パン	77,000	124	9,548,000	貸付株式数 13,000株
モロゾフ	83,000	321	26,643,000	貸付株式数 37,000株 (37,000株)
亀田製菓	35,300	3,005	106,076,500	貸付株式数 14,000株
カルビー	57,900	9,860	570,894,000	
森永乳業	529,000	301	159,229,000	
ヤクルト	371,000	4,195	1,556,345,000	貸付株式数 32,200株
明治ホールディングス	187,800	4,875	915,525,000	
雪印メグミルク	123,000	1,486	182,778,000	
プリマハム	355,000	203	72,065,000	
日本ハム	468,000	1,586	742,248,000	
伊藤ハム	348,000	435	151,380,000	
林兼産業	204,000	87	17,748,000	貸付株式数 91,000株
丸大食品	303,000	324	98,172,000	
米 久	25,300	800	20,240,000	
S F o o d s	37,000	894	33,078,000	
学情	19,100	700	13,370,000	
スタジオアリス	24,200	1,382	33,444,400	貸付株式数 9,900株
シミックホールディングス	22,400	1,906	42,694,400	貸付株式数 6,800株
システナ	59,400	747	44,371,800	
N E Cフィールドディング	46,600	1,205	56,153,000	
デジタルアーツ	20,500	1,084	22,222,000	
新日鉄住金S O L	37,300	1,976	73,704,800	
総合警備保障	215,200	1,828	393,385,600	

日本駐車場開発	6,049	8,340	50,448,660	
コア	20,900	746	15,591,400	
カカクコム	159,400	3,075	490,155,000	貸付株式数 22,300株
アイロムホールディングス	1,143	9,620	10,995,660	
ルネサンス	25,200	743	18,723,600	
新日本科学	36,200	1,803	65,268,600	貸付株式数 14,400株
ツクイ	59,600	1,090	64,964,000	貸付株式数 15,000株
エムスリー	1,392	229,000	318,768,000	
ベストブライダル	31,500	768	24,192,000	
日本E R I	11,300	1,379	15,582,700	
アウトソーシング	18,500	713	13,190,500	貸付株式数 8,100株
ディー・エヌ・エー	291,500	1,946	567,259,000	貸付株式数 131,100株
博報堂DYHLDGS	81,870	7,350	601,744,500	
ぐるなび	39,700	1,089	43,233,300	
一休	366	151,000	55,266,000	貸付株式数 145株
ジャパンベストレスキューS	71	167,000	11,857,000	貸付株式数 7株
ジェイコムホールディングス	8,600	745	6,407,000	貸付株式数 2,400株
PGMホールディングス	83,300	926	77,135,800	
バリューコマース	19,200	1,178	22,617,600	貸付株式数 1,000株
サッポロホールディングス	1,039,000	396	411,444,000	
アサヒグループホールディン	1,274,800	2,682	3,419,013,600	
麒麟HD	2,714,000	1,585	4,301,690,000	
宝ホールディングス	497,000	911	452,767,000	
オエノンホールディングス	150,000	241	36,150,000	
養 命 酒	48,000	817	39,216,000	
コカ・コーラウエスト	195,300	1,822	355,836,600	
コカ・コーライーストジャパン	131,146	1,461	191,604,306	貸付株式数 19,500株
ダイドードリンコ	31,600	4,170	131,772,000	
伊 藤 園	172,500	2,392	412,620,000	貸付株式数 52,200株
キーコーヒー	53,800	1,541	82,905,800	
ユニカフェ	15,400	516	7,946,400	
ジャパンフーズ	7,500	1,420	10,650,000	
日清オイリオグループ	274,000	366	100,284,000	
不二製油	153,400	1,678	257,405,200	
かどや製油	4,900	2,720	13,328,000	貸付株式数 1,900株
J-オイルミルズ	253,000	300	75,900,000	
ローソン	211,500	8,080	1,708,920,000	貸付株式数 71,700株
サンエー	21,100	4,965	104,761,500	
麒麟堂	19,900	690	13,731,000	
ダイユーエイト	9,100	636	5,787,600	
カワチ薬品	38,600	2,163	83,491,800	
エービーシー・マート	66,200	4,230	280,026,000	
ハードオフコーポレーション	27,000	725	19,575,000	
高千穂交易	23,200	902	20,926,400	
アスクル	41,700	1,866	77,812,200	貸付株式数 3,800株 (2,100株)
ゲオホールディングス	956	91,600	87,569,600	貸付株式数 118株
ポイント	51,340	5,240	269,021,600	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	70,000	107	7,490,000	
伊藤忠食品	13,700	3,465	47,470,500	
くらコーポレーション	31,900	1,741	55,537,900	
キャンドゥ	26,500	1,546	40,969,000	貸付株式数 13,200株
エレマテック	25,100	1,289	32,353,900	
パル	31,800	2,980	94,764,000	
JALUX	14,800	1,011	14,962,800	

エディオン	241,400	637	153,771,800	貸付株式数	108,500株
あらた	125,000	374	46,750,000	貸付株式数	30,000株
サーラコーポレーション	46,600	500	23,300,000		
トーメンデバイス	7,700	1,690	13,013,000		
J Pホールディングス	79,700	634	50,529,800	貸付株式数	20,700株
あみやき亭	83	298,300	24,758,900	貸付株式数	14株
東京エレクトロンデバイス	91	156,000	14,196,000		
ひらまつ	57,700	819	47,256,300		
双日	3,519,200	178	626,417,600		
ゲンキー	4,800	2,000	9,600,000	貸付株式数	1,900株
アルフレッサホールディングス	144,600	5,130	741,798,000		
大黒天物産	8,200	2,766	22,681,200	貸付株式数	2,200株
ハニーズ	44,130	1,069	47,174,970	貸付株式数	13,370株
キッコーマン	518,000	1,703	882,154,000		
味の素	1,545,000	1,349	2,084,205,000		
キュービー	321,600	1,493	480,148,800		
ハウス食品	222,700	1,675	373,022,500		
カゴメ	227,600	1,726	392,837,600	貸付株式数	22,600株
焼津水産化工	29,600	854	25,278,400		
アリアケジャパン	57,700	2,279	131,498,300		
ニチレイ	676,000	524	354,224,000		
横浜冷凍	138,300	825	114,097,500	貸付株式数	36,800株 (9,100株)
東洋水産	292,000	3,315	967,980,000	貸付株式数	3,000株
日清食品HD	246,300	4,195	1,033,228,500	貸付株式数	97,900株
永谷園	61,000	881	53,741,000		
フジッコ	68,000	1,137	77,316,000		
ロックフィールド	32,100	1,919	61,599,900	貸付株式数	12,700株
日本たばこ産業	3,521,100	3,735	13,151,308,500	貸付株式数	172,400株 (172,400株)
ケンコーマヨネーズ	16,500	849	14,008,500		
わらべや日洋	38,000	1,544	58,672,000		
なとり	29,100	941	27,383,100		
片倉工業	68,100	1,300	88,530,000		
グンゼ	443,000	247	109,421,000		
ヒューリック	724,500	1,149	832,450,500		
神栄	69,000	350	24,150,000	貸付株式数	27,000株 (7,000株)
山下医科器械	4,500	1,991	8,959,500		
ラサ商事	24,000	440	10,560,000		
アルペン	42,700	2,032	86,766,400		
クオール	19,000	571	10,849,000	貸付株式数	5,800株
アルコニックス	14,900	1,960	29,204,000		
ジェイアイエヌ	28,400	5,200	147,680,000	貸付株式数	12,700株
ビックカメラ	2,120	43,900	93,068,000	貸付株式数	843株
DCMホールディングス	275,600	741	204,219,600		
Monotaro	75,100	2,777	208,552,700	貸付株式数	14,000株
あいホールディングス	94,800	958	90,818,400		
J. フロントリテイリング	1,304,000	847	1,104,488,000		
ドトール・日レスHD	97,800	1,466	143,374,800		
マツモトキヨシHLDS	92,400	3,210	296,604,000	貸付株式数	17,200株
ブロンコビリー	3,600	1,886	6,789,600	貸付株式数	1,600株
スタートトゥデイ	132,500	2,047	271,227,500		
物語コーポレーション	7,100	4,085	29,003,500	貸付株式数	1,700株
ココカラファイン	58,200	3,260	189,732,000		

三越伊勢丹HD	1,109,000	1,483	1,644,647,000	
東洋紡	2,504,000	158	395,632,000	
ユニチカ	1,612,000	53	85,436,000	
富士紡ホールディングス	284,000	253	71,852,000	貸付株式数 127,000株
日清紡ホールディングス	377,000	774	291,798,000	貸付株式数 21,000株
倉敷紡績	608,000	171	103,968,000	
ダイワボウHD	508,000	164	83,312,000	
シキボウ	362,000	118	42,716,000	貸付株式数 144,000株
日東紡績	435,000	343	149,205,000	
トヨタ紡織	197,900	1,504	297,641,600	貸付株式数 42,300株
ウエルシアHD	19,600	5,140	100,744,000	
クリエイトSDH	23,500	3,895	91,532,500	貸付株式数 7,100株 (7,100株)
バイタルKSKHD	104,900	783	82,136,700	
八洲電機	39,000	414	16,146,000	貸付株式数 7,900株
UKCホールディングス	32,100	1,749	56,142,900	
丸善CHI HD	31,800	309	9,826,200	貸付株式数 12,600株
TOKAIホールディングス	218,200	333	72,660,600	
日本毛織	164,000	737	120,868,000	
大東紡織	79,000	69	5,451,000	
トーア紡コーポレーション	251,000	70	17,570,000	
ダイドーリミテッド	66,300	693	45,945,900	
東京建物不動産販	28,900	491	14,189,900	貸付株式数 11,400株 (11,400株)
三栄建築設計	13,800	844	11,647,200	
野村不動産HLDS	267,700	2,400	642,480,000	
常和ホールディングス	12,100	2,711	32,803,100	
フージャースHD	74,500	864	64,368,000	
帝国繊維	62,000	782	48,484,000	
ブックオフコーポレーション	30,800	700	21,560,000	
日本コークス工業	478,000	109	52,102,000	
ミタチ産業	12,900	435	5,611,500	
あさひ	31,800	1,500	47,700,000	貸付株式数 7,400株 (900株)
日本調剤	6,960	2,898	20,170,080	貸付株式数 3,130株
コスモス薬品	27,800	11,200	311,360,000	
シップヘルスケアHD	78,200	3,680	287,776,000	
一六堂	6,900	531	3,663,900	
ソフトクリエイトHD	18,000	712	12,816,000	
セブン&アイ・HLDS	2,335,400	3,945	9,213,153,000	
ツルハホールディングス	49,200	9,950	489,540,000	
サンマルクホールディングス	16,100	4,845	78,004,500	
フェリシモ	15,000	1,173	17,595,000	
トリドール	46,800	1,048	49,046,400	
クスリのアオキ	7,600	7,390	56,164,000	貸付株式数 3,000株
帝 人	2,236,000	221	494,156,000	
東 レ	4,586,000	666	3,054,276,000	貸付株式数 348,000株 (348,000株)
ク ラ レ	1,008,900	1,412	1,424,566,800	貸付株式数 300株
旭 化 成	3,688,000	679	2,504,152,000	
サカイ オーベックス	149,000	150	22,350,000	貸付株式数 59,000株
稲葉製作所	24,700	1,624	40,112,800	
宮地エンジニアリングG	195,000	160	31,200,000	貸付株式数 54,000株
トーカロ	32,200	1,337	43,051,400	
アルファCO	19,700	1,016	20,015,200	

SUMCO	361,200	1,119	404,182,800	貸付株式数	90,400株
川田テクノロジーズ	13,200	2,908	38,385,600		
住江織物	145,000	254	36,830,000	貸付株式数	18,000株
日本フェルト	32,000	442	14,144,000		
イチカワ	39,000	286	11,154,000		
日本バイリーン	72,000	508	36,576,000		
エコナックホールディングス	157,000	54	8,478,000	貸付株式数	25,000株
日東製網	69,000	131	9,039,000	貸付株式数	16,000株
芦森工業	138,000	152	20,976,000	貸付株式数	62,000株
アツギ	474,000	111	52,614,000		
ダイニック	91,000	177	16,107,000		
共和レザー	34,400	300	10,320,000		
セーレン	159,000	662	105,258,000		
東海染工	76,000	116	8,816,000	貸付株式数	12,000株
小松精練	84,000	494	41,496,000		
ワコールホールディングス	353,000	1,007	355,471,000		
ホギメディカル	37,300	5,840	217,832,000		
レナウン	127,700	130	16,601,000	貸付株式数	31,500株
クラウドシア	6,400	1,155	7,392,000		
T S Iホールディングス	305,200	650	198,380,000		
デジタルハーツ	8,600	2,422	20,829,200	貸付株式数	2,400株
I Tホールディングス	184,600	1,174	216,720,400		
ネオス	89	60,100	5,348,900	貸付株式数	19株
電算システム	12,400	1,158	14,359,200		
グリー	289,100	816	235,905,600	貸付株式数	130,000株
コーエーテクモHD	109,100	949	103,535,900		
三菱総合研究所	21,600	2,111	45,597,600		
ボルテージ	7,900	951	7,512,900		
電算	1,600	1,755	2,808,000		
K L a b	22,000	1,694	37,268,000	貸付株式数	9,900株
ポルトゥウィン・ピットクル	11,500	2,637	30,325,500	貸付株式数	2,100株
ネクソン	458,300	1,163	533,002,900		
アイスタイル	11,600	692	8,027,200	貸付株式数	4,600株
エイチーム	5,100	3,110	15,861,000	貸付株式数	2,000株
ブロードリーフ	52,300	1,590	83,157,000		
特種東海製紙	344,000	203	69,832,000		
ドワンゴ	251	512,000	128,512,000	貸付株式数	100株
ベリサーブ	16	208,000	3,328,000		
マクロミル	88,700	606	53,752,200	貸付株式数	35,200株 (6,800株)
ティーガイア	69,400	937	65,027,800	貸付株式数	27,600株
テクマトリックス	15,500	551	8,540,500	貸付株式数	4,700株
GMOペイメントゲートウェイ	19,300	2,029	39,159,700	貸付株式数	7,600株
ザッパラス	309	70,200	21,691,800	貸付株式数	122株
インターネットイニシアティブ	65,300	3,450	225,285,000	貸付株式数	4,300株
S R Aホールディングス	26,800	1,098	29,426,400		
朝日ネット	46,000	431	19,826,000	貸付株式数	13,000株
王子ホールディングス	2,612,000	427	1,115,324,000	貸付株式数	522,000株
日本製紙	282,500	1,452	410,190,000	貸付株式数	127,100株 (26,600株)
三菱製紙	839,000	96	80,544,000		
北越紀州製紙	368,000	436	160,448,000		
中越パルプ	226,000	148	33,448,000		
巴川製紙	81,000	180	14,580,000	貸付株式数	19,000株
大王製紙	245,000	617	151,165,000		

レンゴー	465,000	500	232,500,000	
トーモク	164,000	315	51,660,000	
ザ・パックス	40,000	1,692	67,680,000	
コープケミカル	79,000	136	10,744,000	貸付株式数 31,000株
昭和電工	3,682,000	138	508,116,000	貸付株式数 1,656,000株
住友化学	4,068,000	329	1,338,372,000	
日本化成	91,000	136	12,376,000	
住友精化	91,000	398	36,218,000	貸付株式数 10,000株
日産化学	406,000	1,458	591,948,000	
ラサ工業	209,000	117	24,453,000	貸付株式数 94,000株
クレハ	399,000	332	132,468,000	
ティカ	85,000	284	24,140,000	
石原産業	1,065,000	75	79,875,000	貸付株式数 364,000株
片倉チツカリン	19,000	274	5,206,000	
日本曹達	353,000	530	187,090,000	貸付株式数 17,000株
東ソー	1,585,000	371	588,035,000	
トクヤマ	848,000	330	279,840,000	貸付株式数 173,000株
セントラル硝子	526,000	310	163,060,000	
東亜合成	695,000	424	294,680,000	
ダイソー	236,000	294	69,384,000	
関東電化	141,000	260	36,660,000	貸付株式数 60,000株
電気化学	1,186,000	355	421,030,000	
イビデン	344,300	1,601	551,224,300	
信越化学	1,062,000	6,900	7,327,800,000	
日本カーバイド	157,000	689	108,173,000	貸付株式数 62,000株
堺 化 学	221,000	281	62,101,000	
エア・ウォーター	471,000	1,470	692,370,000	
大陽日酸	772,000	728	562,016,000	貸付株式数 307,000株
日本化学工業	220,000	142	31,240,000	貸付株式数 98,000株
日本パーカライジング	140,000	2,047	286,580,000	
高压ガス	79,000	577	45,583,000	
チタン工業	69,000	220	15,180,000	貸付株式数 20,000株
四国化成	78,000	695	54,210,000	
戸田工業	77,000	269	20,713,000	貸付株式数 30,000株
ステラ ケミファ	25,000	1,540	38,500,000	貸付株式数 11,200株
保土谷化学	133,000	188	25,004,000	
日本触媒	430,000	1,049	451,070,000	
大日精化	213,000	433	92,229,000	
カネカ	738,000	687	507,006,000	
協和発酵キリン	702,000	1,118	784,836,000	
三菱瓦斯化学	920,000	775	713,000,000	
三井化学	2,515,000	237	596,055,000	貸付株式数 1,000,000株
J S R	543,700	1,995	1,084,681,500	
東京応化工業	114,600	2,271	260,256,600	
大阪有機化学	38,600	471	18,180,600	
三菱ケミカルHLDGS	3,706,000	491	1,819,646,000	
日本合成化学	121,000	1,124	136,004,000	
ダイセル	700,000	886	620,200,000	
住友ベークライト	457,000	385	175,945,000	
積水化学	1,217,000	1,091	1,327,747,000	
日本ゼオン	511,000	1,159	592,249,000	
アイカ工業	166,300	2,017	335,427,100	
宇部興産	2,836,000	191	541,676,000	
積水樹脂	76,000	1,378	104,728,000	
タキロン	138,000	423	58,374,000	

旭有機材	209,000	220	45,980,000	
日立化成	256,300	1,647	422,126,100	
ニチバン	58,000	400	23,200,000	
リケンテクノス	83,000	314	26,062,000	
大倉工業	141,000	353	49,773,000	
積水化成品	146,000	265	38,690,000	
群栄化学	150,000	634	95,100,000	貸付株式数 67,000株
タイガース ポリマー	29,200	407	11,884,400	
ミライアル	14,400	1,620	23,328,000	貸付株式数 5,400株
日本カーリット	46,200	583	26,934,600	
日本化薬	400,000	1,299	519,600,000	
イーピーエス	636	117,800	74,920,800	貸付株式数 252株
パナソニック インフォシス	13,100	2,275	29,802,500	
フェイス	1,892	10,810	20,452,520	
アミューズ	16,100	2,433	39,171,300	
野村総合研究所	314,500	3,370	1,059,865,000	
ドリームインキュベータ	164	162,900	26,715,600	
サイバネットシステム	452	33,900	15,322,800	
T A C	35,800	210	7,518,000	貸付株式数 3,000株 (3,000株)
ケネディクス	564,900	544	307,305,600	
電通	536,300	3,200	1,716,160,000	貸付株式数 143,400株
インテージ	15,300	2,399	36,704,700	
テイクアンドギヴニーズ	2,283	23,920	54,609,360	貸付株式数 220株
ぴあ	15,700	1,676	26,313,200	貸付株式数 700株
シンプレクスホールディング	1,037	44,850	46,509,450	貸付株式数 86株
イオンファンタジー	19,200	1,684	32,332,800	
ソースネクスト	13,900	1,358	18,876,200	貸付株式数 5,500株
ネクシィーズ	21,200	305	6,466,000	貸付株式数 2,200株 (1,200株)
メディカルシステムネットワーク	34,400	458	15,755,200	貸付株式数 7,500株
日本精化	47,200	662	31,246,400	
A D E K A	254,300	1,081	274,898,300	
日油	456,000	591	269,496,000	
ミヨシ油脂	217,000	165	35,805,000	貸付株式数 28,000株
ハリマ化成グループ	50,400	489	24,645,600	
花 王	1,541,700	3,360	5,180,112,000	
第一工業製薬	89,000	243	21,627,000	
三洋化成	164,000	631	103,484,000	
武田薬品	2,219,500	4,700	10,431,650,000	
アステラス製薬	1,285,000	5,620	7,221,700,000	
大日本住友製薬	419,600	1,366	573,173,600	貸付株式数 22,700株
塩野義製薬	864,000	2,155	1,861,920,000	
田辺三菱製薬	493,300	1,381	681,247,300	
わかもと製薬	67,000	296	19,832,000	
あすか製薬	70,000	688	48,160,000	
日本新薬	123,000	1,734	213,282,000	
中外製薬	688,200	2,079	1,430,767,800	
科研製薬	233,000	1,533	357,189,000	
エーザイ	729,700	4,185	3,053,794,500	
ロート製薬	245,000	1,425	349,125,000	
小野薬品	290,000	6,860	1,989,400,000	
久光製薬	184,000	5,850	1,076,400,000	貸付株式数 10,400株
有機合成薬品	42,000	278	11,676,000	
持田製薬	218,000	1,385	301,930,000	

参天製薬	203,000	4,425	898,275,000	
扶桑薬品	199,000	335	66,665,000	
日本ケミファ	76,000	563	42,788,000	
ツムラ	160,800	2,861	460,048,800	貸付株式数 48,700株
日医工	84,700	2,221	188,118,700	
テ ル モ	433,800	5,010	2,173,338,000	
みらかホールディングス	153,700	4,820	740,834,000	
キッセイ薬品工業	108,900	2,025	220,522,500	
生化学工業	113,300	1,295	146,723,500	
栄研化学	42,100	1,860	78,306,000	貸付株式数 10,900株
日水製薬	23,800	1,156	27,512,800	
鳥居薬品	35,400	2,335	82,659,000	
東和薬品	30,200	4,065	122,763,000	貸付株式数 5,100株
富士製薬工業	14,500	1,956	28,362,000	
沢井製薬	38,600	12,090	466,674,000	貸付株式数 11,700株
ゼリア新薬工業	77,000	1,516	116,732,000	
第一三共	1,869,100	1,734	3,241,019,400	
キョーリン製薬HD	158,100	2,226	351,930,600	
大幸薬品	27,700	1,345	37,256,500	貸付株式数 10,900株
ダイト	19,300	1,405	27,116,500	
大塚ホールディングス	1,176,300	3,470	4,081,761,000	
大正製薬HD	142,600	7,250	1,033,850,000	
大日本塗料	326,000	157	51,182,000	貸付株式数 92,000株
日本ペイント	513,000	1,224	627,912,000	
関西ペイント	671,000	1,312	880,352,000	
トウペ	16,000	140	2,240,000	
中国塗料	162,000	517	83,754,000	
日本特殊塗料	45,200	408	18,441,600	
藤倉化成	68,900	446	30,729,400	
太陽ホールディングス	46,800	3,150	147,420,000	
D I C	2,101,000	255	535,755,000	
サカタインクス	121,000	928	112,288,000	
東洋インキ S Cホールディン	528,000	506	267,168,000	
T & K T O K A	19,800	2,030	40,194,000	
アルプス技研	23,700	990	23,463,000	
サニックス	84,700	1,486	125,864,200	貸付株式数 27,900株 (8,100株)
ダイオーズ	8,800	693	6,098,400	
日本空調サービス	14,200	885	12,567,000	
オリエンタルランド	175,800	15,980	2,809,284,000	
ダスキン	159,900	1,884	301,251,600	貸付株式数 1,000株
パーク 2 4	291,100	1,817	528,928,700	
明光ネットワークジャパン	56,200	1,355	76,151,000	
ファルコ S Dホールディングス	30,200	1,405	42,431,000	
クレスコ	12,700	744	9,448,800	
フジ・メディア・HD	5,402	194,000	1,047,988,000	
秀英予備校	8,800	354	3,115,200	
田谷	7,900	761	6,011,900	
ラウンドワン	184,300	622	114,634,600	
リゾートトラスト	100,000	3,200	320,000,000	
オービック	19,180	27,470	526,874,600	
T D Cソフトウェアエンジニア	9,000	799	7,191,000	
ヤフー	40,432	50,700	2,049,902,400	
ビー・エム・エル	34,800	2,582	89,853,600	
ワタベウェディング	15,800	732	11,565,600	貸付株式数 4,200株

トレンドマイクロ	222,100	3,260	724,046,000	
もしもしホットライン	97,700	1,291	126,130,700	貸付株式数 5,300株
東急コミュニティー	14,600	4,820	70,372,000	
リソー教育	6,020	8,400	50,568,000	貸付株式数 1,371株
日本オラクル	111,700	3,910	436,747,000	
早稲田アカデミー	6,400	767	4,908,800	
アルファシステムズ	16,200	1,235	20,007,000	
フューチャーアーキテクト	67,000	509	34,103,000	
シーエーシー	32,700	863	28,220,100	
ソフトバンク・テクノ	13,100	1,305	17,095,500	
トーセ	13,600	647	8,799,200	
ユー・エス・エス	66,060	12,670	836,980,200	
オービックビジネスC	17,750	6,240	110,760,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	65,900	4,170	274,803,000	
アイティフォー	62,000	415	25,730,000	
東京個別指導学院	28,600	218	6,234,800	貸付株式数 11,400株
東計電算	8,400	1,369	11,499,600	
エクスネット	51	136,200	6,946,200	
テー・オー・ダブリュー	19,400	597	11,581,800	
大塚商会	50,100	11,680	585,168,000	
総合メディカル	13,500	3,895	52,582,500	
サイボウズ	834	27,670	23,076,780	貸付株式数 364株
ソフトブレイン	76,200	140	10,668,000	
アグレックス	14,300	863	12,340,900	
セントラルスポーツ	16,200	1,586	25,693,200	
電通国際情報S	34,400	1,138	39,147,200	
イーエムシステムズ	7,800	1,980	15,444,000	貸付株式数 300株
ウェザーニューズ	14,300	2,280	32,604,000	貸付株式数 5,700株
C I J	51,500	401	20,651,500	
WOWOW	156	355,000	55,380,000	
フルキャストホールディングス	53,700	242	12,995,400	貸付株式数 24,100株
富士フイルムHLDGS	1,266,200	2,318	2,935,051,600	
コニカミノルタ	1,494,000	778	1,162,332,000	
資 生 堂	1,054,500	1,466	1,545,897,000	
ライオン	683,000	567	387,261,000	
高砂香料	195,000	479	93,405,000	
マンダム	63,000	3,380	212,940,000	
ミルボン	30,100	3,545	106,704,500	
ファンケル	148,900	1,193	177,637,700	
コーセー	106,500	2,723	289,999,500	
ドクターシーラボ	392	277,100	108,623,200	貸付株式数 176株 (66株)
シーボン	4,500	2,083	9,373,500	貸付株式数 400株
ポーラ・オルビスHD	60,400	3,340	201,736,000	
ノエビアホールディングス	36,300	1,591	57,753,300	貸付株式数 8,400株
エステー	36,400	1,012	36,836,800	
コ ニ シ	42,900	1,871	80,265,900	
長谷川香料	75,100	1,445	108,519,500	
星光PMC	24,200	402	9,728,400	
小林製薬	89,700	5,220	468,234,000	
荒川化学工業	45,600	859	39,170,400	
メック	42,300	497	21,023,100	
日本高純度化学	148	199,900	29,585,200	
J C U	7,800	4,865	37,947,000	
新田ゼラチン	26,900	1,347	36,234,300	貸付株式数 12,100株

アース製薬	42,600	3,395	144,627,000	貸付株式数	17,100株
イハラケミカル	85,000	654	55,590,000		
北興化学	58,000	321	18,618,000		
大成ラミック	15,400	2,448	37,699,200	貸付株式数	2,200株
クミアイ化学	122,000	625	76,250,000	貸付株式数	48,000株
日本農薬	135,000	1,001	135,135,000		
昭和シエル石油	528,800	872	461,113,600		
コスモ石油	1,618,000	185	299,330,000		
富士興産	20,000	598	11,960,000		
ニチレキ	71,000	712	50,552,000		
東燃ゼネラル石油	894,000	971	868,074,000		
ユシロ化学	31,600	968	30,588,800		
ビーピー・カストロール	24,200	417	10,091,400		
AOCホールディングス	137,400	345	47,403,000		
MORESCO	9,100	1,175	10,692,500	貸付株式数	2,100株
出光興産	69,900	8,060	563,394,000		
JXホールディングス	6,578,600	497	3,269,564,200		
横浜ゴム	662,000	1,056	699,072,000		
東洋ゴム	473,000	627	296,571,000		
ブリヂストン	1,856,100	3,755	6,969,655,500	貸付株式数	168,000株 (168,000株)
住友ゴム	462,300	1,737	803,015,100		
藤倉ゴム	32,000	361	11,552,000		
オカモト	207,000	307	63,549,000		
アキレス	467,000	134	62,578,000		
フコク	24,400	819	19,983,600		
ニッタ	58,500	2,030	118,755,000		
クリエートメディック	15,600	873	13,618,800		
東海ゴム工業	108,700	930	101,091,000		
三ツ星ベルト	145,000	495	71,775,000		
バンドー化学	199,000	378	75,222,000		
鬼怒川ゴム	88,000	531	46,728,000	貸付株式数	35,000株
旭硝子	2,918,000	656	1,914,208,000		
日本板硝子	2,688,000	101	271,488,000	貸付株式数	1,209,000株
石塚硝子	73,000	222	16,206,000		
有沢製作所	91,400	435	39,759,000		
日本山村硝子	235,000	176	41,360,000		
日本電気硝子	1,049,000	492	516,108,000		
オハラ	22,400	703	15,747,200	貸付株式数	6,700株
住友大阪セメント	1,052,000	325	341,900,000		
太平洋セメント	3,263,000	341	1,112,683,000	貸付株式数	50,000株
デイ・シイ	60,800	305	18,544,000		
リゾートソリューション	49,000	213	10,437,000		
日本ヒューム	57,000	590	33,630,000		
日本コンクリート	85,000	278	23,630,000		
ジャパンパイル	42,300	646	27,325,800		
東海カーボン	518,000	276	142,968,000		
日本カーボン	311,000	192	59,712,000	貸付株式数	123,000株
東洋炭素	30,100	1,838	55,323,800	貸付株式数	13,500株 (6,600株)
ノリタケ	306,000	279	85,374,000		
TOTO	910,000	1,023	930,930,000		
日本碍子	768,000	1,335	1,025,280,000		
日本特殊陶業	511,000	1,973	1,008,203,000		
ダントーホールディングス	77,000	109	8,393,000		

MARUWA	13,000	3,385	44,005,000	貸付株式数 5,200株 (2,000株)
品川リフラクトリーズ	145,000	192	27,840,000	
黒崎播磨	128,000	205	26,240,000	
東京窯業	71,000	176	12,496,000	
ニッカトー	19,200	473	9,081,600	
フジミインコーポレーテッド	53,100	1,119	59,418,900	
エーアンドエーマテリアル	123,000	92	11,316,000	貸付株式数 1,000株
ニチアス	253,000	642	162,426,000	貸付株式数 77,000株 (13,000株)
新日鐵住金	25,040,000	291	7,286,640,000	
神戸製鋼所	8,212,000	139	1,141,468,000	貸付株式数 1,998,000株
中山製鋼所	300,000	66	19,800,000	貸付株式数 16,000株
合同製鐵	321,000	164	52,644,000	
JFEホールディングス	1,511,800	2,392	3,616,225,600	
日新製鋼HD	251,000	826	207,326,000	
東京製鐵	327,000	413	135,051,000	
共英製鋼	53,800	1,573	84,627,400	貸付株式数 24,200株
大和工業	122,100	3,160	385,836,000	貸付株式数 30,500株
東京鐵鋼	115,000	378	43,470,000	
大阪製鐵	29,700	1,744	51,796,800	
淀川製鋼所	421,000	414	174,294,000	
東洋鋼鋳	124,000	360	44,640,000	
住友鋼管	39,100	1,087	42,501,700	貸付株式数 9,500株
丸一鋼管	198,200	2,454	486,382,800	
モリ工業	80,000	320	25,600,000	
大同特殊鋼	911,000	551	501,961,000	
日本高周波	232,000	90	20,880,000	貸付株式数 92,000株
日本冶金工	427,000	121	51,667,000	貸付株式数 192,000株
山陽特殊製鋼	294,000	491	144,354,000	貸付株式数 70,000株
愛知製鋼	313,000	458	143,354,000	
日立金属	498,350	1,091	543,699,850	
日本金属	147,000	122	17,934,000	
大平洋金属	378,000	446	168,588,000	貸付株式数 67,000株
日本電工	237,000	284	67,308,000	
栗本鉄工所	250,000	265	66,250,000	貸付株式数 99,000株
日本鑄鉄管	64,000	224	14,336,000	
日本製鋼所	909,000	589	535,401,000	
三菱製鋼	358,000	207	74,106,000	
日亜鋼業	76,000	332	25,232,000	
日本精線	40,000	450	18,000,000	
大紀アルミニウム	85,000	314	26,690,000	
日本軽金属HD	1,245,500	133	165,651,500	
三井金属	1,510,000	229	345,790,000	
東邦亜鉛	323,000	282	91,086,000	
三菱マテリアル	3,452,000	337	1,163,324,000	
住友鋁山	1,531,000	1,186	1,815,766,000	
DOWAホールディングス	654,000	972	635,688,000	
古河機金	995,000	190	189,050,000	貸付株式数 245,000株
大阪チタニウム	58,200	1,780	103,596,000	貸付株式数 26,100株 (9,000株)
東邦チタニウム	100,200	763	76,452,600	貸付株式数 45,000株 (8,100株)
住友軽金属	1,431,000	92	131,652,000	

古河スカイ	200,000	275	55,000,000	貸付株式数 89,000株 (19,000株)
古河電工	1,852,000	226	418,552,000	
住友電工	2,093,000	1,318	2,758,574,000	
フジクラ	934,000	365	340,910,000	
昭和電線HLDGS	758,000	86	65,188,000	
東京特殊電線	77,000	120	9,240,000	貸付株式数 11,000株
タツタ電線	111,000	982	109,002,000	貸付株式数 33,600株 (10,500株)
沖 電 線	62,000	143	8,866,000	
カナレ電気	7,700	1,439	11,080,300	貸付株式数 1,500株
平河ヒューテック	13,900	766	10,647,400	
リョービ	321,000	305	97,905,000	
アサヒHD	89,200	1,573	140,311,600	
東洋製罐グループHD	420,600	1,624	683,054,400	
ホッカンホールディングス	141,000	316	44,556,000	
コロナ	27,100	1,069	28,969,900	
横河ブリッジHLDGS	91,000	1,229	111,839,000	
日本橋梁	84,400	180	15,192,000	貸付株式数 37,900株
駒井ハルテック	122,000	216	26,352,000	
高田機工	47,000	214	10,058,000	
三和ホールディングス	534,000	583	311,322,000	
文化シャッター	147,000	586	86,142,000	
三協立山	77,600	2,448	189,964,800	
東洋シャッター	14,800	604	8,939,200	
LIXILグループ	825,300	2,290	1,889,937,000	
日本ファイルコン	39,000	420	16,380,000	
ノーリツ	115,400	1,766	203,796,400	
長府製作所	55,100	2,176	119,897,600	
リンナイ	93,700	7,190	673,703,000	
ユニプレス	99,700	1,895	188,931,500	
ダイニチ工業	30,100	761	22,906,100	
日東精工	73,000	328	23,944,000	
三洋工業	72,000	195	14,040,000	
岡 部	115,700	985	113,964,500	
中国工業	80,000	86	6,880,000	
東 プ レ	113,900	900	102,510,000	
高周波熱錬	77,500	764	59,210,000	
東京製綱	391,000	137	53,567,000	貸付株式数 155,000株 (17,000株)
パイオラックス	25,200	2,670	67,284,000	
日本発条	428,200	1,176	503,563,200	
中央発條	73,000	318	23,214,000	
アドバネクス	117,000	108	12,636,000	貸付株式数 25,000株
三浦工業	88,100	2,500	220,250,000	
タ ク マ	201,000	760	152,760,000	
リブセンス	11,400	5,360	61,104,000	貸付株式数 4,600株
ツ ガ ミ	150,000	549	82,350,000	貸付株式数 67,000株
オークマ	384,000	753	289,152,000	
東芝機械	293,000	495	145,035,000	
ア マ ダ	905,000	729	659,745,000	
アイダエンジニア	139,000	767	106,613,000	
滝澤鉄工所	147,000	160	23,520,000	
牧野フライス	274,000	609	166,866,000	
オーエスジー	243,400	1,640	399,176,000	貸付株式数 18,500株

ダイジェット	68,000	162	11,016,000	
旭ダイヤモンド	142,000	963	136,746,000	
森精機製作所	312,300	1,239	386,939,700	
ディスコ	65,700	6,620	434,934,000	貸付株式数 18,500株
日東工器	34,500	1,850	63,825,000	
豊田自動織機	515,400	4,395	2,265,183,000	
豊和工業	322,000	101	32,522,000	
大阪機工	229,000	157	35,953,000	
石川製作所	135,000	124	16,740,000	貸付株式数 8,000株
東洋機械金属	43,700	247	10,793,900	
津田駒工業	142,000	171	24,282,000	貸付株式数 56,000株
エンシュウ	143,000	160	22,880,000	貸付株式数 57,000株
島精機製作所	76,800	1,803	138,470,400	
日阪製作所	72,000	889	64,008,000	
やまびこ	23,300	3,110	72,463,000	
ペガサスミシン製造	52,900	399	21,107,100	貸付株式数 12,200株
ナブテスコ	292,400	2,015	589,186,000	貸付株式数 26,100株
三井海洋開発	47,100	3,190	150,249,000	
レオン自動機	55,000	240	13,200,000	
SMC	169,500	21,180	3,590,010,000	
新川	47,100	740	34,854,000	
ホソカワミクロン	84,000	727	61,068,000	
ユニオンツール	25,600	1,956	50,073,600	貸付株式数 12,600株 (12,600株)
オイレス工業	61,700	2,142	132,161,400	
サトーホールディングス	61,900	1,904	117,857,600	貸付株式数 27,800株 (27,800株)
日本エアーテック	15,600	522	8,143,200	
日精樹脂工業	43,100	783	33,747,300	
ワイエイシイ	22,100	570	12,597,000	
小松製作所	2,763,200	2,338	6,460,361,600	
住友重機械	1,610,000	451	726,110,000	
日立建機	302,400	2,117	640,180,800	貸付株式数 91,600株
日 工	76,000	360	27,360,000	貸付株式数 9,000株
巴工業	20,400	1,635	33,354,000	貸付株式数 9,900株
井関農機	545,000	333	181,485,000	貸付株式数 245,000株
TOWA	52,500	717	37,642,500	
丸山製作所	124,000	306	37,944,000	貸付株式数 49,000株
北川鉄工所	248,000	168	41,664,000	
シンニッタン	45,300	392	17,757,600	
クボタ	3,091,000	1,589	4,911,599,000	
荏原実業	14,000	1,324	18,536,000	貸付株式数 5,500株
東洋エンジニア	326,000	489	159,414,000	
三菱化工機	161,000	185	29,785,000	貸付株式数 38,000株
月島機械	83,000	1,080	89,640,000	
帝国電機製作所	16,200	2,442	39,560,400	
東京機械	206,000	142	29,252,000	貸付株式数 92,000株
新東工業	119,300	815	97,229,500	
渋谷工業	37,100	885	32,833,500	
アイチ コーポレーション	97,700	528	51,585,600	
小森コーポレーション	144,000	1,279	184,176,000	
鶴見製作所	44,000	865	38,060,000	
住友精密	82,000	402	32,964,000	
酒井重工業	91,000	275	25,025,000	貸付株式数 19,000株

荏原製作所	1,164,000	556	647,184,000	貸付株式数 523,000株 (523,000株)
石井鉄工所	78,000	255	19,890,000	貸付株式数 20,000株
西島製作所	68,300	874	59,694,200	
千代田化工建	455,000	1,239	563,745,000	
ダイキン工業	771,800	4,415	3,407,497,000	
オルガノ	86,000	518	44,548,000	
トーヨーカネツ	315,000	279	87,885,000	
栗田工業	326,800	2,122	693,469,600	貸付株式数 16,700株
椿本チエイン	303,000	587	177,861,000	
大同工業	116,000	269	31,204,000	
日本コンベヤ	162,000	80	12,960,000	
日 機 装	198,000	1,262	249,876,000	
木村化工機	53,000	692	36,676,000	貸付株式数 21,100株
新興プランテック	129,500	775	100,362,500	
アネスト岩田	81,000	481	38,961,000	
ダイフク	259,500	947	245,746,500	
加藤製作所	134,000	503	67,402,000	貸付株式数 2,000株
油研工業	91,000	226	20,566,000	
タダノ	273,000	1,490	406,770,000	
フジテック	153,000	960	146,880,000	
CKD	158,600	825	130,845,000	
キトー	35,700	1,627	58,083,900	
平和	122,200	1,794	219,226,800	
理想科学工業	37,500	2,270	85,125,000	
SANKYO	170,000	4,665	793,050,000	
日本金銭機械	52,100	1,288	67,104,800	
マースエンジニアリング	31,500	1,908	60,102,000	
福島工業	29,700	1,536	45,619,200	
オーイズミ	19,800	987	19,542,600	
ダイコク電機	23,400	1,813	42,424,200	
ア マ ノ	161,700	1,119	180,942,300	
JUKI	364,000	155	56,420,000	貸付株式数 144,000株 (25,000株)
サンデン	316,000	374	118,184,000	貸付株式数 142,000株
蛇の目ミシン	536,000	83	44,488,000	貸付株式数 87,000株
ブラザー工業	731,600	1,185	866,946,000	
マックス	79,000	1,120	88,480,000	
モリタホールディングス	85,000	806	68,510,000	
グローリー	167,900	2,399	402,792,100	
大和冷機工業	80,000	580	46,400,000	
セガサミーホールディングス	608,300	2,572	1,564,547,600	
日本ピストンリング	206,000	170	35,020,000	貸付株式数 82,000株
リ ケ ン	206,000	425	87,550,000	
T P R	62,600	1,704	106,670,400	
ホシザキ電機	122,700	3,420	419,634,000	
大豊工業	39,100	1,431	55,952,100	
日本精工	1,259,000	999	1,257,741,000	
N T N	1,217,000	336	408,912,000	
ジェイテクト	601,400	1,194	718,071,600	
不 二 越	524,000	461	241,564,000	貸付株式数 28,000株
ミネベア	768,000	382	293,376,000	貸付株式数 190,000株
日本トムソン	194,000	490	95,060,000	
T H K	375,800	2,181	819,619,800	
ユーシン精機	28,200	1,807	50,957,400	貸付株式数 2,100株

前澤給装工業	21,400	1,296	27,734,400	貸付株式数	1,200株
イーグル工業	70,000	1,315	92,050,000		
前澤工業	39,700	437	17,348,900		
日本ピラー工業	57,000	708	40,356,000		
キッツ	231,000	486	112,266,000		
日立	13,424,000	664	8,913,536,000		
東芝	11,162,000	479	5,346,598,000		
三菱電機	5,657,000	1,046	5,917,222,000		
富士電機	1,697,000	376	638,072,000		
東洋電機製造	91,000	316	28,756,000	貸付株式数	36,000株
安川電機	621,000	1,264	784,944,000	貸付株式数	133,000株
シンフォニアテクノロジー	327,000	165	53,955,000		
明電舎	542,000	337	182,654,000		
オリジン電気	76,000	323	24,548,000	貸付株式数	30,000株
山洋電気	82,000	838	68,716,000	貸付株式数	2,000株
デンヨー	54,000	1,497	80,838,000		
日立工機	151,400	830	125,662,000		
三桜工業	70,600	739	52,173,400		
マキタ	344,200	5,690	1,958,498,000		
東芝テック	354,000	576	203,904,000		
芝浦メカトロニクス	85,000	253	21,505,000		
マブチモーター	78,900	5,430	428,427,000		
日本電産	305,800	7,060	2,158,948,000	貸付株式数	137,600株
東光高岳HD	28,600	1,653	47,275,800	貸付株式数	11,300株
宮越ホールディングス	19,100	319	6,092,900	貸付株式数	3,300株
ダイヘン	310,000	481	149,110,000		
ヤーマン	5,700	1,277	7,278,900	貸付株式数	1,000株
JVCケンウッド	342,000	241	82,422,000	貸付株式数	50,000株
第一精工	15,900	1,365	21,703,500	貸付株式数	6,300株
日新電機	92,000	646	59,432,000	貸付株式数	23,000株
大崎電気	72,000	535	38,520,000		
オムロン	598,700	3,145	1,882,911,500		
日東工業	83,100	1,836	152,571,600		
I D E C	73,900	969	71,609,100	貸付株式数	2,600株
ジーエス・ユアサコーポ	1,083,000	429	464,607,000	貸付株式数	230,000株
サクサホールディングス	142,000	169	23,998,000	貸付株式数	4,000株
メルコホールディングス	35,200	1,356	47,731,200	貸付株式数	14,000株
テクノメディカ	42	614,000	25,788,000		
日本電気	7,324,000	227	1,662,548,000		
富士通	5,438,000	411	2,235,018,000		
沖電気	2,054,000	207	425,178,000		
岩崎通信機	245,000	95	23,275,000	貸付株式数	50,000株
電気興業	145,000	557	80,765,000		
サンケン電気	287,000	474	136,038,000		
ナカヨ通信機	55,000	317	17,435,000		
アイホン	32,000	1,649	52,768,000		
ルネサスエレクトロニクス	146,200	450	65,790,000	貸付株式数	58,100株 (14,400株)
セイコーエプソン	386,300	1,342	518,414,600	貸付株式数	89,400株
ワコム	415,900	1,118	464,976,200		
アルバック	95,400	832	79,372,800	貸付株式数	3,400株
アクセル	28,300	1,852	52,411,600		
ピクセラ	21,300	155	3,301,500	貸付株式数	6,300株
E I Z O	46,600	2,284	106,434,400		
日本信号	142,700	754	107,595,800		

京三製作所	121,000	352	42,592,000	
能美防災	72,000	837	60,264,000	
ホーチキ	51,000	470	23,970,000	
エレコム	16,700	1,211	20,223,700	
日本無線	121,000	340	41,140,000	貸付株式数 48,000株
パナソニック	6,466,400	839	5,425,309,600	
シャープ	2,922,000	424	1,238,928,000	貸付株式数 633,000株
アンリツ	303,600	1,232	374,035,200	
富士通ゼネラル	134,000	1,034	138,556,000	
日立国際電気	129,000	1,105	142,545,000	
ソ ニ ー	3,556,300	2,187	7,777,628,100	貸付株式数 1,078,200株
T D K	318,900	3,705	1,181,524,500	貸付株式数 27,500株
帝国通信工業	134,000	172	23,048,000	
ミツミ電機	215,300	714	153,724,200	貸付株式数 2,400株
タムラ製作所	218,000	221	48,178,000	
アルプス電気	414,100	791	327,553,100	
池上通信機	159,000	106	16,854,000	貸付株式数 47,000株
パイオニア	687,700	205	140,978,500	貸付株式数 273,400株
日本電波工業	46,400	929	43,105,600	
日本トリム	7,200	7,670	55,224,000	
ローランド ディー. ジー.	24,600	3,385	83,271,000	貸付株式数 9,700株
日本コロムビア	535,000	43	23,005,000	
フオスター電機	57,800	1,721	99,473,800	貸付株式数 26,000株
クラリオン	298,000	128	38,144,000	貸付株式数 134,000株
S M K	154,000	310	47,740,000	
ヨコオ	44,000	525	23,100,000	
東 光	266,000	306	81,396,000	貸付株式数 32,000株
ティアック	305,000	59	17,995,000	貸付株式数 72,000株 (29,000株)
ホシデン	152,400	557	84,886,800	
ヒロセ電機	98,500	14,060	1,384,910,000	
日本航空電子	130,000	1,024	133,120,000	
T O A	61,000	821	50,081,000	
ユニデン	154,000	233	35,882,000	貸付株式数 61,000株
アルパイン	109,000	1,006	109,654,000	
スミダコーポレーション	36,400	496	18,054,400	貸付株式数 2,800株
アイコム	31,300	2,448	76,622,400	
リオン	12,700	1,010	12,827,000	貸付株式数 5,700株
船井電機	55,400	1,056	58,502,400	貸付株式数 16,800株
横河電機	566,300	1,297	734,491,100	
新電元工業	162,000	514	83,268,000	
アズビル	158,400	2,180	345,312,000	
日本光電工業	112,600	4,090	460,534,000	
チ ノ ー	86,000	227	19,522,000	
共和電業	63,000	319	20,097,000	
日本電子材料	24,200	405	9,801,000	
堀場製作所	104,700	3,770	394,719,000	
アドバンテスト	385,800	1,640	632,712,000	
小野測器	59,000	452	26,668,000	
エスベック	58,500	760	44,460,000	
パナソニックデバイス	47,100	412	19,405,200	
キーエンス	138,700	33,500	4,646,450,000	
日置電機	29,600	1,428	42,268,800	貸付株式数 11,700株
シスメックス	198,800	6,380	1,268,344,000	
メガチップス	45,900	1,398	64,168,200	

OBARA GROUP	36,700	3,045	111,751,500	
日本電産コパル電子	58,400	455	26,572,000	
東京電波	15,200	790	12,008,000	貸付株式数 2,500株
澤藤電機	17,000	263	4,471,000	
デンソー	1,397,700	4,865	6,799,810,500	
コーセル	82,300	1,236	101,722,800	貸付株式数 10,900株
日立メディコ	42,000	1,301	54,642,000	
新日本無線	41,000	589	24,149,000	貸付株式数 16,000株
オプテックス	35,800	1,599	57,244,200	貸付株式数 100株
千代田インテグレ	24,800	1,411	34,992,800	
レーザーテック	40,400	1,340	54,136,000	
スタンレー電気	440,400	2,019	889,167,600	
岩崎電気	206,000	194	39,964,000	貸付株式数 62,000株
ウシオ電機	343,600	1,326	455,613,600	
岡谷電機	30,200	338	10,207,600	
ヘリオステクノH	46,400	225	10,440,000	
日本セラミック	32,400	1,390	45,036,000	貸付株式数 14,700株 (3,000株)
日本デジタル研究所	46,500	1,050	48,825,000	
古河電池	40,000	558	22,320,000	
双信電機	27,400	353	9,672,200	
山一電機	61,400	182	11,174,800	貸付株式数 15,700株
図 研	31,900	871	27,784,900	
日本電子	209,000	530	110,770,000	
カ シ オ	539,400	916	494,090,400	貸付株式数 42,700株
ファナック	588,200	14,760	8,681,832,000	
日本シイエムケイ	121,800	335	40,803,000	
エンプラス	24,500	7,840	192,080,000	
ロ ー ム	298,800	4,175	1,247,490,000	
浜松ホトニクス	220,800	3,700	816,960,000	
三井ハイテック	82,100	665	54,596,500	
新光電気工業	190,000	1,198	227,620,000	
京 セ ラ	470,700	10,810	5,088,267,000	
協栄産業	67,000	202	13,534,000	
太陽誘電	274,900	1,551	426,369,900	
村田製作所	593,800	7,960	4,726,648,000	
ユーシン	77,600	819	63,554,400	
双葉電子工業	104,800	1,247	130,685,600	
日東電工	488,600	6,250	3,053,750,000	
北陸電気工業	228,000	152	34,656,000	
東海理化電機	131,500	2,060	270,890,000	
ニチコン	177,600	1,077	191,275,200	
日本ケミコン	318,000	417	132,606,000	貸付株式数 82,000株
K O A	70,300	972	68,331,600	
三井造船	2,191,000	165	361,515,000	貸付株式数 546,000株
日立造船	2,238,500	153	342,490,500	
佐世保重工業	370,000	100	37,000,000	
三菱重工業	9,476,000	626	5,931,976,000	
川崎重工業	4,407,000	335	1,476,345,000	
I H I	3,867,000	425	1,643,475,000	
日本車輛	206,000	534	110,004,000	
ニチュ三菱フォークリフト	72,000	500	36,000,000	
近畿車輛	84,000	319	26,796,000	貸付株式数 14,000株
F P G	31,100	1,453	45,188,300	
島根銀行	12,500	1,292	16,150,000	貸付株式数 100株

じもとホールディングス	400,800	239	95,791,200	貸付株式数	34,200株
全国保証	51,000	3,535	180,285,000		
日産自動車	7,148,900	1,088	7,778,003,200		
いすゞ自動車	3,280,000	802	2,630,560,000		
トヨタ自動車 ※	7,267,400	6,390	46,438,686,000		
日野自動車	701,000	1,641	1,150,341,000		
三菱自動車工業	13,545,000	146	1,977,570,000	貸付株式数	4,107,000株
エフテック	19,600	1,650	32,340,000		
武蔵精密工業	60,300	2,454	147,976,200	貸付株式数	27,100株 (12,000株)
日産車体	193,000	1,176	226,968,000		
新明和工業	228,000	844	192,432,000		
極東開発工業	105,200	1,142	120,138,400		
日信工業	114,800	1,872	214,905,600		
トピー工業	423,000	204	86,292,000		
ティラド	176,000	388	68,288,000		
曙ブレーキ	261,600	510	133,416,000	貸付株式数	102,000株
タチエス	75,100	1,366	102,586,600		
N O K	273,900	1,610	440,979,000	貸付株式数	6,400株
フタバ産業	172,400	494	85,165,600		
カヤバ工業	431,000	526	226,706,000		
シロキ工業	125,000	215	26,875,000	貸付株式数	49,000株
市光工業	135,000	148	19,980,000		
大同メタル工業	74,000	651	48,174,000		
プレス工業	240,000	457	109,680,000		
カルソニックカンセイ	383,000	448	171,584,000		
太平洋工業	115,000	807	92,805,000		
ケーヒン	115,900	1,532	177,558,800	貸付株式数	9,500株
河西工業	69,000	548	37,812,000		
アイシン精機	517,900	3,940	2,040,526,000		
富士機工	65,000	309	20,085,000		
マ ツ ダ	8,954,000	435	3,894,990,000		
ダイハツ	601,000	2,051	1,232,651,000	貸付株式数	74,000株
今仙電機製作所	39,900	1,516	60,488,400	貸付株式数	12,000株
本田技研	4,773,200	3,810	18,185,892,000		
スズキ	1,183,200	2,447	2,895,290,400		
富士重工業	1,779,000	2,673	4,755,267,000		
ヤマハ発動機	860,600	1,422	1,223,773,200		
ショーワ	133,600	1,306	174,481,600		
小糸製作所	283,000	1,993	564,019,000		
T B K	57,000	487	27,759,000		
エクセディ	76,600	2,652	203,143,200		
ミツバ	87,000	1,798	156,426,000		
豊田合成	159,900	2,648	423,415,200		
愛三工業	58,700	1,117	65,567,900		
ヨ ロ ズ	39,900	1,671	66,672,900		
エフ・シー・シー	91,500	2,509	229,573,500		
新家工業	127,000	156	19,812,000	貸付株式数	50,000株
シマノ	228,700	8,830	2,019,421,000		
タカタ	101,500	2,190	222,285,000		
テイ・エス テック	119,500	3,475	415,262,500		
小 野 建	46,900	970	45,493,000		
はるやま商事	23,200	711	16,495,200		
佐鳥電機	39,500	531	20,974,500		

カップ・クリエイトHD	41,000	1,821	74,661,000	貸付株式数	18,400株 (4,100株)
エコートレーディング	13,800	802	11,067,600		
伯東	32,500	943	30,647,500		
コンドーテック	45,000	600	27,000,000	貸付株式数	400株
中山福	31,500	769	24,223,500		
ライトオン	40,000	976	39,040,000		
ナガイレーベン	73,900	1,583	116,983,700		
ジーンズメイト	15,800	274	4,329,200	貸付株式数	4,200株
三菱食品	61,300	2,465	151,104,500	貸付株式数	4,000株
良品計画	59,200	8,570	507,344,000		
三城ホールディングス	69,000	495	34,155,000		
松田産業	39,500	1,328	52,456,000		
メディパルHD	558,700	1,319	736,925,300		
アドヴァン	29,700	1,200	35,640,000		
S P K	12,900	1,736	22,394,400		
アズワン	36,400	2,464	89,689,600		
スズデン	15,900	521	8,283,900		
尾家産業	16,000	804	12,864,000		
シモジマ	32,600	984	32,078,400	貸付株式数	5,400株
ドウシシャ	59,100	1,447	85,517,700		
コナカ	67,500	1,160	78,300,000		
高速	32,100	950	30,495,000		
ハウス ローゼ	6,200	1,327	8,227,400		
G－7ホールディングス	15,100	739	11,158,900		
イオン北海道	35,000	516	18,060,000		
コ ジ マ	82,200	318	26,139,600	貸付株式数	32,600株
ヒマラヤ	13,000	1,189	15,457,000		
コーナン商事	73,100	1,181	86,331,100	貸付株式数	17,800株
黒田電気	74,600	1,373	102,425,800	貸付株式数	17,700株 (17,700株)
ネットワンシステムズ	203,300	770	156,541,000		
エコス	16,500	613	10,114,500		
ワタミ	65,900	1,729	113,941,100	貸付株式数	26,200株
マルシェ	13,500	832	11,232,000	貸付株式数	2,900株
ドン・キホーテ	154,300	5,310	819,333,000		
丸文	47,300	456	21,568,800		
メガネトップ	48,000	1,398	67,104,000		
西松屋チェーン	108,900	974	106,068,600	貸付株式数	29,300株
ゼンショーホールディングス	212,800	1,179	250,891,200	貸付株式数	84,600株 (600株)
ハピネット	32,400	746	24,170,400		
幸楽苑	32,600	1,228	40,032,800	貸付株式数	14,600株
トーメンエレクトロニクス	28,400	1,251	35,528,400		
ハークスレイ	14,800	765	11,322,000		
サイゼリヤ	82,700	1,293	106,931,100		
エクセル	24,000	1,183	28,392,000		
マルカキカイ	16,100	1,257	20,237,700		
アルゴグラフィックス	20,400	1,658	33,823,200		
ガリバーインターナショナル	187,900	657	123,450,300		
日本エム・ディ・エム	51,200	260	13,312,000		
ポプラ	13,900	625	8,687,500		
ユナイテッドアローズ	59,800	4,860	290,628,000		
進和	32,000	1,230	39,360,000		
エスケイジャパン	13,200	305	4,026,000	貸付株式数	3,100株

ダイトエレクトロン	24,800	399	9,895,200	
ハイデイ日高	29,400	2,152	63,268,800	
シークス	35,400	1,224	43,329,600	
京都きもの友禅	36,900	1,090	40,221,000	
コロワイド	185,000	980	181,300,000	貸付株式数 36,000株 (1,000株)
田中商事	16,200	571	9,250,200	
オーハシテクニカ	29,900	866	25,893,400	
壺番屋	22,400	3,820	85,568,000	
マクニカ	28,600	2,260	64,636,000	
白銅	16,100	798	12,847,800	
トップカルチャー	20,100	432	8,683,200	
スギホールディングス	89,000	4,110	365,790,000	
島津製作所	676,000	799	540,124,000	
J M S	77,000	342	26,334,000	
クボテック	122	30,950	3,775,900	貸付株式数 29株
ショットモリテックス	12,200	307	3,745,400	貸付株式数 4,800株
長野計器	39,000	745	29,055,000	
ブイ・テクノロジー	117	260,500	30,478,500	貸付株式数 46株 (10株)
スター精密	99,200	1,042	103,366,400	
東京計器	161,000	243	39,123,000	貸付株式数 64,000株
愛知時計	65,000	287	18,655,000	
日本電産トーソク	27,100	861	23,333,100	
東京精密	101,100	2,283	230,811,300	
マニー	15,700	3,655	57,383,500	貸付株式数 7,000株
ニコン	1,056,200	2,314	2,444,046,800	
トプコン	121,100	1,055	127,760,500	貸付株式数 44,500株
オリンパス	666,600	2,969	1,979,135,400	
理研計器	45,500	740	33,670,000	
大日本スクリーン	580,000	562	325,960,000	
キャノン電子	51,900	1,849	95,963,100	
タムロン	43,500	2,135	92,872,500	貸付株式数 6,300株
HOYA	1,375,800	2,193	3,017,129,400	
ノーリツ銅機	50,900	684	34,815,600	
エー・アンド・デイ	51,300	780	40,014,000	
キャノン ※	3,515,100	3,380	11,881,038,000	
リ コ ー	1,695,000	1,197	2,028,915,000	
日本電産コパル	44,300	853	37,787,900	
シチズンホールディングス	638,600	604	385,714,400	
リズム時計	248,000	150	37,200,000	
大研医器	14,000	2,132	29,848,000	貸付株式数 5,600株
パラマウントベッドHD	47,000	3,480	163,560,000	
SHO - B I	12,800	424	5,427,200	貸付株式数 5,100株
前田工織	28,500	923	26,305,500	貸付株式数 12,800株
永大産業	72,000	409	29,448,000	
ダンロップスポーツ	30,600	1,154	35,312,400	
バンダイナムコHLDGS	585,200	1,671	977,869,200	
共立印刷	74,400	257	19,120,800	貸付株式数 32,800株
フランスベッドHLDGS	355,000	197	69,935,000	
マーベラスAQL	735	49,750	36,566,250	
パイロットコーポレーション	47,400	3,565	168,981,000	
エイベックス・グループHD	102,800	3,200	328,960,000	
トッパン・フォームズ	100,800	854	86,083,200	
フジシールインターナショナル	68,700	2,859	196,413,300	

タカラトミー	185,100	488	90,328,800	
廣済堂	46,500	485	22,552,500	貸付株式数 17,000株
アーク	191,300	270	51,651,000	貸付株式数 86,000株
レック	16,300	1,140	18,582,000	
タカノ	24,500	469	11,490,500	
プロネクス	63,800	628	40,066,400	
ホクシン	38,900	171	6,651,900	
ウッドワン	83,000	325	26,975,000	
大建工業	230,000	290	66,700,000	
き も と	52,600	821	43,184,600	
凸版印刷	1,598,000	710	1,134,580,000	貸付株式数 110,000株
大日本印刷	1,724,000	934	1,610,216,000	貸付株式数 685,000株
図書印刷	80,000	300	24,000,000	貸付株式数 21,000株
共同印刷	158,000	294	46,452,000	
日本写真印刷	85,300	1,905	162,496,500	貸付株式数 38,300株 (10,800株)
光村印刷	53,000	264	13,992,000	
藤森工業	48,800	3,135	152,988,000	
宝印刷	31,400	715	22,451,000	
前澤化成工業	39,900	1,007	40,179,300	
アシックス	527,100	1,592	839,143,200	
ツ ツ ミ	28,200	2,551	71,938,200	
ジェイ エス ピー	38,400	1,510	57,984,000	貸付株式数 6,200株
ニ チ ハ	65,600	1,530	100,368,000	
ローランド	50,300	1,017	51,155,100	
エフピコ	29,200	6,470	188,924,000	
小松ウオール工業	21,100	2,051	43,276,100	
ヤマハ	416,000	1,209	502,944,000	
河合楽器	196,000	174	34,104,000	貸付株式数 77,000株
クリナップ	57,800	802	46,355,600	
ビジョン	42,800	8,660	370,648,000	
天馬	46,200	1,258	58,119,600	
兼松日産農林	79,000	158	12,482,000	貸付株式数 31,000株
キングジム	46,200	719	33,217,800	貸付株式数 18,400株
リンテック	121,100	1,842	223,066,200	
T A S A K I	9,100	502	4,568,200	
信越ポリマー	115,400	330	38,082,000	
東 リ	147,000	203	29,841,000	
イトーキ	119,100	532	63,361,200	貸付株式数 7,400株
任 天 堂	322,200	12,250	3,946,950,000	
三菱鉛筆	45,900	2,011	92,304,900	
松 風	27,600	895	24,702,000	
タカラスタANDARD	251,000	719	180,469,000	
コ ク ヨ	294,100	721	212,046,100	
ナカバヤシ	119,000	206	24,514,000	
ニ フ コ	130,500	2,210	288,405,000	
グローブライド	274,000	117	32,058,000	
岡村製作所	217,000	633	137,361,000	
日本バルカー	244,000	257	62,708,000	
MUTOHホールディングス	73,000	481	35,113,000	貸付株式数 29,000株
伊 藤 忠	4,456,700	1,208	5,383,693,600	
丸 紅	4,581,000	707	3,238,767,000	
スクロール	70,500	263	18,541,500	
高 島	87,000	310	26,970,000	貸付株式数 24,000株
F & A アクアホールディングス	42,500	1,689	71,782,500	

三陽商会	311,000	245	76,195,000	
長瀬産業	314,400	1,346	423,182,400	
ナイガイ	220,000	59	12,980,000	貸付株式数 46,000株
蝶 理	35,600	1,037	36,917,200	
豊田通商	622,200	2,815	1,751,493,000	
オンワードホールディングス	389,000	863	335,707,000	
三共生興	93,200	360	33,552,000	
兼 松	1,188,000	119	141,372,000	
美 津 濃	280,000	574	160,720,000	
ツカモトコーポレーション	81,000	149	12,069,000	貸付株式数 32,000株
フアミリーマート	170,400	4,505	767,652,000	貸付株式数 64,600株
ルック	85,000	336	28,560,000	貸付株式数 19,000株
三井物産	4,821,100	1,309	6,310,819,900	
日本紙パルプ	290,000	322	93,380,000	
東京エレクトロン	474,900	4,955	2,353,129,500	
日立ハイテクノロジーズ	168,200	2,310	388,542,000	貸付株式数 8,400株 (8,400株)
カメイ	66,100	820	54,202,000	
東都水産	85,000	152	12,920,000	貸付株式数 34,000株
スターゼン	163,000	270	44,010,000	
セイコーHD	361,000	484	174,724,000	貸付株式数 89,000株
山 善	214,400	645	138,288,000	
椿本興業	63,000	269	16,947,000	
住友商事	3,296,900	1,328	4,378,283,200	
日本ユニシス	153,500	720	110,520,000	
内田洋行	128,000	295	37,760,000	貸付株式数 28,000株
三菱商事	4,356,600	1,816	7,911,585,600	
第一実業	127,000	428	54,356,000	
キヤノンマーケティングJPN	159,300	1,365	217,444,500	
西華産業	193,000	258	49,794,000	
佐藤商事	49,800	577	28,734,600	
菱洋エレクトロ	65,800	828	54,482,400	
東京産業	45,500	320	14,560,000	
ユアサ商事	551,000	187	103,037,000	
神鋼商事	140,000	196	27,440,000	
阪和興業	541,000	406	219,646,000	
カナデン	55,000	623	34,265,000	
菱電商事	75,000	668	50,100,000	
ニプロ	299,900	1,035	310,396,500	貸付株式数 134,900株
フルサト工業	28,200	893	25,182,600	
岩谷産業	618,000	383	236,694,000	
すてきナイスグループ	221,000	213	47,073,000	
昭光通商	178,000	142	25,276,000	
ニチモウ	75,000	187	14,025,000	
極東貿易	64,000	219	14,016,000	貸付株式数 11,000株
イ ワ キ	77,000	199	15,323,000	
兼松エレクトロニクス	35,200	1,313	46,217,600	
三愛石油	130,000	391	50,830,000	
稲畑産業	137,400	853	117,202,200	
G S Iクレオス	144,000	173	24,912,000	貸付株式数 64,000株
明和産業	44,100	331	14,597,100	貸付株式数 5,600株
ゴールドウイン	136,000	473	64,328,000	貸付株式数 54,000株
ユニ・チャーム	327,300	5,430	1,777,239,000	貸付株式数 23,500株
デサント	145,000	703	101,935,000	
ヤマトインターナショナル	35,600	450	16,020,000	

東邦ホールディングス	177,900	1,807	321,465,300	
サンゲツ	98,900	2,588	255,953,200	
ミツウロコグループ	89,800	498	44,720,400	
シナネン	120,000	384	46,080,000	
伊藤忠エネクス	122,500	508	62,230,000	
サンリオ	139,900	5,050	706,495,000	貸付株式数 55,600株
サンワ テクノス	27,200	1,010	27,472,000	
リョーサン	90,700	1,727	156,638,900	
新光商事	61,200	892	54,590,400	
トーヨー	116,000	365	42,340,000	
三信電気	78,200	611	47,780,200	
東陽テクニカ	76,700	1,273	97,639,100	
モスフード サービス	73,100	1,895	138,524,500	貸付株式数 16,900株 (16,900株)
加賀電子	53,900	804	43,335,600	
三益半導体	49,900	894	44,610,600	
ソーダニツカ	58,000	410	23,780,000	
立花エレテック	32,500	998	32,435,000	
木曽路	68,300	1,892	129,223,600	
千 趣 会	100,500	862	86,631,000	
タカキュー	39,000	396	15,444,000	
ケーヨー	92,300	486	44,857,800	貸付株式数 36,700株 (16,200株)
アデランス	70,100	1,380	96,738,000	
上新電機	121,000	855	103,455,000	
日本瓦斯	76,600	1,181	90,464,600	
ベスト電器	174,600	180	31,428,000	
マルエツ	92,000	312	28,704,000	
ロイヤルホールディングス	91,900	1,548	142,261,200	貸付株式数 20,300株
東 天 紅	41,000	190	7,790,000	貸付株式数 9,000株
いなげや	62,100	986	61,230,600	
島 忠	126,400	2,470	312,208,000	
チヨダ	65,800	2,624	172,659,200	
ライフコーポレーション	35,200	1,252	44,070,400	
カ ス ミ	114,300	627	71,666,100	
リンガーハット	50,400	1,475	74,340,000	貸付株式数 10,000株
さ が 美	43,000	107	4,601,000	
MR MAX	54,000	326	17,604,000	
テンアライド	42,000	307	12,894,000	貸付株式数 3,300株
AOKIホールディングス	47,000	3,150	148,050,000	
オークワ	79,000	972	76,788,000	
コメリ	84,800	2,485	210,728,000	
青山商事	153,400	2,704	414,793,600	
しまむら	63,600	12,220	777,192,000	
CFSコーポレーション	36,600	388	14,200,800	
はせがわ	16,100	795	12,799,500	
高 島 屋	756,000	1,096	828,576,000	
松 屋	112,400	1,418	159,383,200	貸付株式数 44,600株
エイチ・ツー・オーリテイリング	363,000	949	344,487,000	
丸 栄	81,000	315	25,515,000	貸付株式数 36,000株
ニッセンHD	100,500	312	31,356,000	
パ ル コ	107,000	1,108	118,556,000	貸付株式数 19,100株
丸井グループ	727,000	1,061	771,347,000	
クレディセゾン	488,900	2,492	1,218,338,800	
原信ナルスHLDGS	30,900	1,755	54,229,500	

井 筒 屋	303,000	92	27,876,000	貸付株式数	106,000株
ダイエー	323,200	334	107,948,800	貸付株式数	128,500株
イズミヤ	210,000	476	99,960,000		
イオン	1,971,000	1,398	2,755,458,000		
ユニーグループ・HD	534,900	643	343,940,700		
イ ズ ミ	138,600	3,000	415,800,000		
東武ストア	71,000	269	19,099,000	貸付株式数	6,000株
平 和 堂	113,200	1,708	193,345,600		
フ ジ	62,000	1,792	111,104,000	貸付株式数	15,000株
ヤオコー	28,100	3,655	102,705,500		
ゼビオ	75,800	2,189	165,926,200		
ケーズホールディングス	139,100	3,635	505,628,500	貸付株式数	30,900株
P a l t a c	66,000	1,332	87,912,000		
OLYMPICグループ	32,000	688	22,016,000		
日産東京販売HD	76,000	329	25,004,000	貸付株式数	9,000株
新生銀行	4,830,000	245	1,183,350,000		
あおぞら銀行	2,030,000	316	641,480,000		
三菱UFJフィナンシャルG ※	42,249,600	653	27,588,988,800		
りそなホールディングス	5,746,000	503	2,890,238,000		
三井住友トラストHD	10,959,000	493	5,402,787,000		
三井住友フィナンシャルG ※	4,220,300	4,745	20,025,323,500		
第四銀行	707,000	346	244,622,000		
北越銀行	556,000	212	117,872,000		
西日本シティ銀行	1,960,000	279	546,840,000		
千葉銀行	2,153,000	735	1,582,455,000		
横浜銀行	3,447,000	555	1,913,085,000		
常陽銀行	2,107,000	569	1,198,883,000		
群馬銀行	1,240,000	592	734,080,000		
武蔵野銀行	89,100	3,580	318,978,000		
千葉興業銀行	107,000	825	88,275,000		
筑波銀行	230,700	375	86,512,500		
東京都民銀行	105,600	1,192	125,875,200		
七十七銀行	856,000	501	428,856,000		
青森銀行	400,000	261	104,400,000		
秋田銀行	383,000	267	102,261,000		
山形銀行	326,000	434	141,484,000		
岩手銀行	39,300	3,985	156,610,500		
東邦銀行	462,000	307	141,834,000		
東北銀行	284,000	151	42,884,000		
みちのく銀行	278,000	197	54,766,000		
ふくおかフィナンシャルG	2,267,000	447	1,013,349,000		
静岡銀行	1,618,000	1,126	1,821,868,000		
十六銀行	697,000	378	263,466,000		
スルガ銀行	534,000	1,836	980,424,000		
八十二銀行	1,017,000	615	625,455,000		
山梨中央銀行	327,000	442	144,534,000		
大垣共立銀行	745,000	309	230,205,000		
福井銀行	467,000	222	103,674,000		
北國銀行	628,000	356	223,568,000		
清水銀行	17,000	2,860	48,620,000		
滋賀銀行	524,000	528	276,672,000		
南都銀行	540,000	392	211,680,000		
百五銀行	502,000	430	215,860,000		
京都銀行	1,000,000	875	875,000,000	貸付株式数	9,000株
三重銀行	231,000	213	49,203,000		

ほくほくフィナンシャルG	3,801,000	206	783,006,000	
広島銀行	1,648,000	446	735,008,000	
山陰合同銀行	320,000	778	248,960,000	
中国銀行	401,000	1,441	577,841,000	
鳥取銀行	160,000	195	31,200,000	
伊予銀行	597,000	1,000	597,000,000	
百十四銀行	613,000	332	203,516,000	
四国銀行	393,000	240	94,320,000	
阿波銀行	456,000	566	258,096,000	
鹿児島銀行	385,000	687	264,495,000	
大分銀行	320,000	331	105,920,000	
宮崎銀行	372,000	328	122,016,000	
肥後銀行	456,000	609	277,704,000	
佐賀銀行	326,000	215	70,090,000	
十八銀行	347,000	243	84,321,000	
沖縄銀行	39,900	4,330	172,767,000	
琉球銀行	115,300	1,294	149,198,200	
八千代銀行	28,600	2,986	85,399,600	
セブン銀行	1,883,800	376	708,308,800	
みずほフィナンシャルG	72,077,700	215	15,496,705,500	
紀陽ホールディングス	2,224,000	140	311,360,000	
山口フィナンシャルG	541,000	1,006	544,246,000	
アクリーティブ	305	20,460	6,240,300	貸付株式数 92株
芙蓉総合リース	52,800	3,890	205,392,000	
興銀リース	83,800	3,395	284,501,000	
東京センチュリーリース	130,000	2,883	374,790,000	
S B I ホールディングス	710,300	1,272	903,501,600	
日本証券金融	214,100	812	173,849,200	
大阪証券金融	70,200	316	22,183,200	
アイフル	465,800	1,081	503,529,800	貸付株式数 25,050株
日本アジア投資	380,000	119	45,220,000	貸付株式数 92,000株
ポケットカード	54,100	741	40,088,100	貸付株式数 16,300株
長野銀行	195,000	183	35,685,000	
名古屋銀行	505,000	391	197,455,000	
北洋銀行	841,100	399	335,598,900	
愛知銀行	20,200	4,705	95,041,000	
第三銀行	313,000	164	51,332,000	
中京銀行	229,000	187	42,823,000	
東日本銀行	242,000	219	52,998,000	
大光銀行	198,000	241	47,718,000	
愛媛銀行	320,000	247	79,040,000	
トマト銀行	216,000	179	38,664,000	
みなと銀行	506,000	176	89,056,000	
京葉銀行	456,000	529	241,224,000	
関西アーバン銀行	771,000	110	84,810,000	
栃木銀行	281,000	368	103,408,000	
北日本銀行	15,200	2,297	34,914,400	
東和銀行	612,000	94	57,528,000	
福島銀行	687,000	80	54,960,000	
大東銀行	357,000	86	30,702,000	
リコーリース	38,300	2,884	110,457,200	
イオンフィナンシャルサービス	204,200	3,005	613,621,000	貸付株式数 91,800株
ア コ ム	112,220	3,455	387,720,100	貸付株式数 22,990株
ジャックス	308,000	583	179,564,000	
オ リ コ	1,095,000	275	301,125,000	貸付株式数 332,000株

日立キャピタル	108,700	2,261	245,770,700	
オリックス	3,283,400	1,470	4,826,598,000	
三菱UFJリース	1,417,000	496	702,832,000	
ジャフコ	76,400	4,210	321,644,000	
トモニホールディングス	428,000	393	168,204,000	
大和証券G本社	5,532,000	900	4,978,800,000	
野村ホールディングス	11,409,000	813	9,275,517,000	
岡三証券グループ	464,000	944	438,016,000	
丸三証券	169,300	764	129,345,200	
東洋証券	209,000	352	73,568,000	貸付株式数 85,000株
東海東京HD	641,100	810	519,291,000	
光世証券	133,000	329	43,757,000	貸付株式数 59,000株
水戸証券	152,000	514	78,128,000	貸付株式数 45,000株
いちよし証券	123,300	1,416	174,592,800	
松井証券	330,600	991	327,624,600	貸付株式数 100,200株
NK S Jホールディングス	1,241,000	2,510	3,114,910,000	
だいこう証券ビジ	31,200	673	20,997,600	
日本取引所グループ	138,900	11,760	1,633,464,000	
マネックスG	6,067	43,150	261,791,050	貸付株式数 1,576株
カブドットコム証券	216,700	595	128,936,500	貸付株式数 36,400株
極東証券	74,900	1,906	142,759,400	
岩井コスモホールディング	52,500	1,359	71,347,500	貸付株式数 15,200株
フィデアホール	321,500	232	74,588,000	
池田泉州HD	459,700	530	243,641,000	
MS & A D	1,669,500	2,812	4,694,634,000	
SONY FH	535,100	1,683	900,573,300	
マネーパートナーズGP	423	28,300	11,970,900	
小林洋行	14,000	275	3,850,000	貸付株式数 3,300株
第一生命	29,863	155,100	4,631,751,300	
東京海上HD	2,161,800	3,480	7,523,064,000	
イー・ギャランティ	13,000	3,080	40,040,000	貸付株式数 2,900株
アサックス	83	159,300	13,221,900	
NECキャピタルソリューション	22,700	2,637	59,859,900	
T & Dホールディングス	1,916,300	1,395	2,673,238,500	
三井不動産	2,633,000	3,185	8,386,105,000	
三菱地所	3,897,000	2,716	10,584,252,000	
平和不動産	105,600	1,797	189,763,200	
東京建物	1,071,000	874	936,054,000	
ダイビル	143,800	1,149	165,226,200	
東急不動産	1,218,000	1,014	1,235,052,000	
京阪神ビルディング	74,500	568	42,316,000	貸付株式数 32,600株 (3,800株)
住友不動産	1,339,000	4,380	5,864,820,000	
太平洋興発	203,000	102	20,706,000	貸付株式数 72,000株
大京	848,000	316	267,968,000	
テーオーシー	191,800	735	140,973,000	
東京楽天地	81,000	512	41,472,000	
レオパレス21	488,600	439	214,495,400	
フジ住宅	70,300	690	48,507,000	
空港施設	67,500	645	43,537,500	
明和地所	27,400	447	12,247,800	貸付株式数 10,900株
住友不動産販売	19,960	5,750	114,770,000	
ゴールドクレスト	44,000	2,528	111,232,000	
東栄住宅	37,900	2,136	80,954,400	
リロ・ホールディング	20,200	5,190	104,838,000	

日本エスリード	24,300	1,147	27,872,100	
東急リバブル	59,100	2,122	125,410,200	
飯田産業	57,300	1,858	106,463,400	
日神不動産	32,000	691	22,112,000	貸付株式数 4,600株
アーネストワン	91,400	2,153	196,784,200	
タカラレーベン	232,000	415	96,280,000	
サンヨーハウジ 名古屋	28,800	1,341	38,620,800	
イオンモール	254,200	2,549	647,955,800	
タクトホーム	285	197,200	56,202,000	
ランド	102,400	21	2,150,400	
トーセイ	70,900	897	63,597,300	
エヌ・ティ・ティ都市開発	3,454	129,500	447,293,000	
サンフロンティア不動産	489	99,200	48,508,800	
ランドビジネス	37,700	615	23,185,500	貸付株式数 12,500株
グランディハウス	36,500	384	14,016,000	
東武鉄道	3,206,000	537	1,721,622,000	
相鉄ホールディングス	905,000	367	332,135,000	
東京急行	3,331,000	699	2,328,369,000	
京浜急行	1,454,000	893	1,298,422,000	貸付株式数 28,000株
小田急電鉄	1,813,000	1,003	1,818,439,000	
京王電鉄	1,581,000	709	1,120,929,000	
京成電鉄	842,000	979	824,318,000	
富士急行	148,000	1,090	161,320,000	貸付株式数 66,000株
新京成電鉄	71,000	384	27,264,000	
東日本旅客鉄道	1,043,900	8,350	8,716,565,000	
西日本旅客鉄道	487,800	4,420	2,156,076,000	
東海旅客鉄道	470,700	12,940	6,090,858,000	
鴻池運輸	22,500	1,339	30,127,500	
西日本鉄道	732,000	390	285,480,000	
ハマキョウレックス	15,100	3,575	53,982,500	
サカイ引越センター	8,700	2,651	23,063,700	
近畿日本鉄道	5,112,000	446	2,279,952,000	貸付株式数 2,033,000株
阪急阪神HLDGS	3,575,000	596	2,130,700,000	
南海電鉄	1,163,000	382	444,266,000	貸付株式数 69,000株
京阪電鉄	1,268,000	413	523,684,000	
名糖運輸	23,200	641	14,871,200	
名古屋鉄道	1,975,000	287	566,825,000	
トランコム	14,600	2,919	42,617,400	
日本通運	2,232,000	490	1,093,680,000	
ヤマトホールディングス	1,054,000	2,249	2,370,446,000	貸付株式数 34,300株
山 九	688,000	385	264,880,000	
日 新	214,000	287	61,418,000	
丸 運	30,500	246	7,503,000	貸付株式数 9,200株
丸全昭和運輸	170,000	348	59,160,000	
センコー	227,000	509	115,543,000	
トナミホールディングス	116,000	216	25,056,000	
日本梱包運輸	172,800	1,626	280,972,800	
日石輸送	64,000	219	14,016,000	
福山通運	326,000	606	197,556,000	貸付株式数 113,000株 (113,000株)
セイノーホールディングス	438,000	920	402,960,000	
神奈川中央交通	66,000	531	35,046,000	
日立物流	98,200	1,560	153,192,000	
日本郵船	4,483,000	283	1,268,689,000	
商船三井	2,751,000	407	1,119,657,000	貸付株式数 655,000株

川崎汽船	2,461,000	210	516,810,000	貸付株式数	960,000株
N Sユニテッド海運	242,000	153	37,026,000		
乾 汽 船	67,200	362	24,326,400	貸付株式数	16,700株
明治海運	50,600	419	21,201,400	貸付株式数	17,400株
飯野海運	235,200	549	129,124,800	貸付株式数	35,000株
共栄タンカー	47,000	232	10,904,000	貸付株式数	14,000株
第一中央汽船	400,000	110	44,000,000	貸付株式数	159,000株
日本航空	636,700	5,320	3,387,244,000		
A N Aホールディングス	11,124,000	220	2,447,280,000	貸付株式数	3,648,000株
パスコ	52,000	389	20,228,000	貸付株式数	12,000株
三菱倉庫	392,000	1,460	572,320,000		
三井倉庫	252,000	526	132,552,000	貸付株式数	13,000株
住友倉庫	379,000	599	227,021,000		
渋沢倉庫	144,000	451	64,944,000	貸付株式数	35,000株
ヤマタネ	250,000	188	47,000,000	貸付株式数	23,000株
東陽倉庫	80,000	266	21,280,000	貸付株式数	21,000株
日本トランスシティ	130,000	333	43,290,000		
ケイヒン	87,000	186	16,182,000		
安田倉庫	44,000	961	42,284,000		
東洋埠頭	152,000	201	30,552,000		
宇徳	45,300	352	15,945,600		
上 組	625,000	849	530,625,000		
サンリツ	14,300	526	7,521,800		
キムラユニティー	12,700	973	12,357,100		
キューソー流通システム	14,800	975	14,430,000		
郵船ロジスティクス	44,500	889	39,560,500		
近鉄エクスプレス	50,600	3,960	200,376,000	貸付株式数	8,600株
東海運	30,500	246	7,503,000		
エーアイティー	8,000	1,267	10,136,000	貸付株式数	300株
東京放送HD	299,900	1,367	409,963,300		
日本テレビH L D S	510,000	1,875	956,250,000		
テレビ朝日	141,400	2,202	311,362,800		
スカパーJ S A T H D	4,835	48,050	232,321,750		
テレビ東京HD	39,400	1,684	66,349,600		
アイ・ティー・シーネットワーク	47,200	911	42,999,200		
N E Cモバイリング	5,100	5,460	27,846,000		
日本電信電話	2,350,500	5,260	12,363,630,000		
K D D I	1,576,400	5,250	8,276,100,000	貸付株式数	54,200株
光通信	55,200	5,650	311,880,000		
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	46,023	158,700	7,303,850,100		
GMOインターネット	185,200	1,035	191,682,000		
学研ホールディングス	154,000	293	45,122,000	貸付株式数	61,000株
ゼンリン	73,900	1,127	83,285,300	貸付株式数	29,300株
昭文社	32,200	595	19,159,000		
K A D O K A W A	46,600	3,750	174,750,000	貸付株式数	20,900株 (4,400株)
インプレスホールディングス	45,400	138	6,265,200		
東京電力	4,801,300	662	3,178,460,600	貸付株式数	1,197,900株
中部電力	1,731,800	1,482	2,566,527,600		
関西電力	2,309,700	1,447	3,342,135,900		
中国電力	782,500	1,581	1,237,132,500		
北陸電力	554,500	1,575	873,337,500		
東北電力	1,413,900	1,295	1,831,000,500		
四国電力	509,700	1,944	990,856,800	貸付株式数	202,600株
九州電力	1,250,100	1,506	1,882,650,600		

北海道電力	528,800	1,416	748,780,800	
沖縄電力	32,600	3,980	129,748,000	
電源開発	351,100	3,255	1,142,830,500	貸付株式数 56,900株 (56,900株)
東京瓦斯	6,796,000	563	3,826,148,000	
大阪瓦斯	5,492,000	428	2,350,576,000	
東邦瓦斯	1,439,000	511	735,329,000	
北海道瓦斯	85,000	255	21,675,000	貸付株式数 38,000株
西部瓦斯	631,000	246	155,226,000	
静岡瓦斯	147,300	712	104,877,600	
アイネット	24,100	795	19,159,500	
松 竹	367,000	922	338,374,000	貸付株式数 17,000株
東 宝	397,800	2,172	864,021,600	
エイチ・アイ・エス	46,700	4,645	216,921,500	
東 映	234,000	659	154,206,000	
AOI Pro.	25,000	653	16,325,000	
NTTデータ	3,445	367,500	1,266,037,500	
共立メンテナンス	29,200	3,800	110,960,000	
イチネンホールディングス	61,900	710	43,949,000	
建設技術研究所	31,700	770	24,409,000	
スペース	28,700	936	26,863,200	
アインファーマシーズ	31,000	4,250	131,750,000	
燦ホールディングス	12,800	1,365	17,472,000	
スバル興業	42,000	334	14,028,000	
東京テアトル	225,000	167	37,575,000	貸付株式数 68,000株
よみうりランド	117,000	934	109,278,000	貸付株式数 28,000株
東京都競馬	454,000	432	196,128,000	貸付株式数 204,000株
常磐興産	162,000	196	31,752,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
カナモト	69,000	2,203	152,007,000	
東京ドーム	438,000	689	301,782,000	
D T S	52,700	1,455	76,678,500	
スクウェア・エニックス・HD	202,800	1,207	244,779,600	貸付株式数 22,300株
シーイーシー	36,300	665	24,139,500	
カプコン	107,100	1,698	181,855,800	貸付株式数 32,400株
アゴーラ・ホスピタリティーG	241,000	48	11,568,000	貸付株式数 10,000株
日本空港ビルデング	192,100	1,677	322,151,700	貸付株式数 23,200株
トランス・コスモス	76,800	1,663	127,718,400	
乃村工藝社	126,000	745	93,870,000	
ジャステック	31,600	705	22,278,000	
S C S K	131,200	1,934	253,740,800	
藤田観光	145,000	436	63,220,000	
KNT－CTホールディングス	188,000	135	25,380,000	貸付株式数 86,000株
日本管財	21,700	1,468	31,855,600	
トーカイ	25,100	2,823	70,857,300	
白 洋 舎	62,000	213	13,206,000	
セコム	615,000	5,510	3,388,650,000	
日本システムウエア	20,900	431	9,007,900	
セントラル警備保障	25,100	914	22,941,400	
アイネス	75,900	659	50,018,100	
丹青社	52,000	470	24,440,000	
メイテック	87,000	2,513	218,631,000	貸付株式数 3,300株
TKC	47,000	1,746	82,062,000	
アサツー ディ・ケイ	99,000	2,616	258,984,000	貸付株式数 20,500株
富士ソフト	77,000	2,077	159,929,000	

応用地質	56,400	1,695	95,598,000	
船井総合研究所	60,400	738	44,575,200	
N S D	108,900	1,095	119,245,500	
進学会	28,200	354	9,982,800	
丸紅建材リース	48,000	177	8,496,000	
コナミ	252,200	2,078	524,071,600	
ベネッセホールディングス	180,100	3,600	648,360,000	
イオンディライト	55,400	1,846	102,268,400	
ナック	24,500	1,915	46,917,500	
福井コンピュータH L D S	7,200	675	4,860,000	
ニチイ学館	115,100	862	99,216,200	貸付株式数 28,400株
ダイセキ	85,400	1,859	158,758,600	貸付株式数 19,700株
ステップ	15,900	875	13,912,500	
日鐵商事	124,000	273	33,852,000	貸付株式数 55,000株
元氣寿司	15,700	1,252	19,656,400	
トラスコ中山	63,100	2,056	129,733,600	
ヤマダ電機	254,790	4,485	1,142,733,150	貸付株式数 75,720株 (8,000株)
オートバックスセブン	196,000	1,495	293,020,000	
アークランドサカモト	36,400	1,808	65,811,200	
ニトリホールディングス	110,600	8,410	930,146,000	
グルメ杵屋	40,000	696	27,840,000	
愛 眼	44,400	292	12,964,800	
吉野家ホールディングス	1,513	114,800	173,692,400	貸付株式数 70株
加藤産業	80,500	2,102	169,211,000	
イノテック	46,400	465	21,576,000	
イエローハット	52,500	1,944	102,060,000	
富士エレクトロニクス	28,700	1,301	37,338,700	貸付株式数 11,400株
松屋フーズ	26,800	1,580	42,344,000	貸付株式数 3,300株
J B C Cホールディングス	46,000	1,319	60,674,000	貸付株式数 14,800株
J Kホールディングス	46,000	585	26,910,000	
サガミチェーン	66,000	804	53,064,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
日 伝	24,700	2,386	58,934,200	
ミロク情報サービス	35,500	357	12,673,500	
北沢産業	38,000	174	6,612,000	
杉本商事	30,100	862	25,946,200	
因幡電機産業	67,500	2,701	182,317,500	
住金物産	289,000	288	83,232,000	
プレナス	62,400	1,714	106,953,600	
ミニストップ	39,800	1,644	65,431,200	
アークス	93,500	1,908	178,398,000	
バ ロ ー	120,300	1,739	209,201,700	
バイテック	12,700	750	9,525,000	貸付株式数 3,100株
ミスミグループ本社	206,300	2,693	555,565,900	
江守商事	12,500	1,301	16,262,500	貸付株式数 5,500株
藤 久	4,300	1,711	7,357,300	
アルテック	27,200	384	10,444,800	貸付株式数 8,200株
ベ ル ク	27,500	1,838	50,545,000	
大 庄	25,100	1,302	32,680,200	
タキヒヨー	77,000	438	33,726,000	
ファーストリテイリング	130,000	38,000	4,940,000,000	
ソフトバンク	2,685,100	5,760	15,466,176,000	
スズケン	214,600	3,180	682,428,000	
サンドラッグ	106,200	4,445	472,059,000	

東京デリカ	19,500	1,653	32,233,500	貸付株式数	7,700株
ジェコス	38,300	623	23,860,900		
ヤマザワ	14,300	1,673	23,923,900		
やまや	9,200	1,432	13,174,400	貸付株式数	2,000株
ベルーナ	69,500	1,080	75,060,000		
合計			934,650,293,976		

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

トヨタ自動車	30,000株	キャノン	28,000株
三菱UFJフィナンシャルG	300,000株	三井住友フィナンシャルG	30,000株

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

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成25年7月31日

I	資産総額	891,163,542,261円
II	負債総額	32,902,684,463円
III	純資産総額（I－II）	858,260,857,798円
IV	発行済数量	741,443,980口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	1,157.6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わないものとします。

(6) 受益権の譲渡

- ① 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。
- ② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。
- ③ 上記①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た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25年7月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

① 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。

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・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オペレーショナルリスク・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25年7月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	6	98,947
追加型株式投資信託	453	8,789,791
株式投資信託 合計	459	8,888,738
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,881,680
公社債投資信託 合計	17	2,881,680
総合計	476	11,770,419

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24年4月1日から平成25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24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,745,233	14,380,327
有価証券	19,655,070	9,427,636
前払金	314	207
前払費用	90,562	142,919
未収入金	11,931	521,825
未収委託者報酬	6,516,540	7,183,011
未収収益	55,102	106,914
貯蔵品	11,888	9,551
繰延税金資産	630,508	491,727
その他	190,450	8,445
流動資産計	30,907,602	32,272,567
固定資産		
有形固定資産	※1 1,003,450	※1 254,258
建物（純額）	513,162	26,257
器具備品（純額）	484,571	222,274
リース資産（純額）	—	5,726
建設仮勘定	5,715	—
無形固定資産	2,870,849	3,194,512
ソフトウェア	2,173,517	3,132,238
ソフトウェア仮勘定	684,878	50,423
電話加入権	11,850	11,850
商標権	132	—
その他	471	—
投資その他の資産	16,375,520	15,113,434
投資有価証券	10,034,136	8,342,934
関係会社株式	5,141,069	5,141,069
出資金	136,315	136,315

従業員に対する長期貸付金	112,674	92,527
差入保証金	542,920	1,000,820
長期前払費用	8,478	7,376
投資不動産（純額）	※1 409,876	※1 402,340
貸倒引当金	△9,950	△9,950
固定資産計	20,249,820	18,562,205
資産合計	51,157,423	50,834,773

(単位:千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
リース債務	—	1,227
預り金	55,551	56,491
未払金	7,194,946	6,795,899
未払収益分配金	17,954	10,333
未払償還金	88,334	113,002
未払手数料	3,386,380	3,764,501
その他未払金	※2 3,702,277	※2 2,908,061
未払費用	3,313,011	3,383,551
未払法人税等	963,539	588,040
未払消費税等	229,365	189,139
賞与引当金	307,000	841,300
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	12,789,375	11,855,648
固定負債		
リース債務	—	4,494
退職給付引当金	1,670,344	1,935,442
役員退職慰労引当金	68,068	67,410
繰延税金負債	1,782,558	1,740,407
固定負債計	3,520,970	3,747,753
負債合計	16,310,345	15,603,402
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	7,715,116	7,722,723
利益剰余金合計	8,089,414	8,097,020
株主資本合計	34,759,414	34,767,020

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	33,879	464,350
繰延ヘッジ損益	53,783	—
評価・換算差額等合計	87,663	464,350
純資産合計	34,847,077	35,231,371
負債・純資産合計	51,157,423	50,834,773

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	72,931,048	73,498,726
その他営業収益	401,212	526,465
営業収益計	73,332,260	74,025,191
営業費用		
支払手数料	41,050,089	41,213,272
広告宣伝費	709,853	604,864
公告費	699	949
受益証券発行費	74	—
調査費	7,993,144	8,116,701
調査費	878,635	824,915
委託調査費	7,114,509	7,291,786
委託計算費	733,156	807,090
営業雑経費	1,651,996	1,280,599
通信費	205,421	206,564
印刷費	472,511	404,023
協会費	52,117	53,643
諸会費	11,971	11,281
その他営業雑経費	909,973	605,086
営業費用計	52,139,015	52,023,478
一般管理費		
給料	4,452,711	5,264,128
役員報酬	209,630	249,180
給料・手当	3,646,155	3,782,533
賞与	289,926	391,114
賞与引当金繰入額	307,000	841,300
福利厚生費	728,342	809,254
交際費	71,356	55,806
寄付金	591	636
旅費交通費	215,939	196,147
租税公課	171,533	206,178
不動産賃借料	727,939	887,968
退職給付費用	422,030	469,713
役員退職慰労引当金繰入額	27,988	38,970
固定資産減価償却費	1,107,222	1,181,438
諸経費	1,077,041	1,094,627
一般管理費計	9,002,696	10,204,869
営業利益	12,190,548	11,796,843

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	※ 1	74,753	※ 1	257,704
有価証券利息		13,537		11,102
受取利息		2,771		10,598
時効成立分配金・償還金		42,189		21,305
投資有価証券売却益		117,695		279,443
有価証券償還益		68,106		101,052
その他		54,685		44,912
営業外収益計		373,739		726,118
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		2,182		19,392
投資有価証券売却損		95,389		36,469
有価証券償還損		67,873		33,338
投資不動産管理費用		16,454		16,271
その他		49,191		23,111
営業外費用計		231,091		128,584
経常利益		12,333,196		12,394,377
特別利益				
投資有価証券売却益		—		39,827
固定資産売却益		—		31
その他		—		16,466
特別利益計		—		56,325
特別損失				
固定資産除却損	※2	4,871	※2	129,816
減損損失	※3	76,217	※3	—
有価証券評価損		211,376		—
本社移転関連費用		346,425		1,099,913
その他		19,547		14,428
特別損失計		658,438		1,244,158
税引前当期純利益		11,674,757		11,206,544
法人税、住民税及び事業税		5,254,642		4,286,691
法人税等調整額		△602,832		△109,902
法人税等合計		4,651,809		4,176,789
当期純利益		7,022,948		7,029,755

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25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		
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,874,176	7,715,116
当期変動額		
剰余金の配当	△9,182,008	△7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	△2,159,059	7,606
当期末残高	7,715,116	7,722,723
利益剰余金合計		
当期首残高	10,248,473	8,089,414
当期変動額		
剰余金の配当	△9,182,008	△7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	△2,159,059	7,606
当期末残高	8,089,414	8,097,020

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
株主資本合計		
当期首残高	36,918,473	34,759,414
当期変動額		
剰余金の配当	△9,182,008	△7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	△2,159,059	7,606
当期末残高	34,759,414	34,767,020
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	△104,040	33,879
当期変動額		
株主資本以外の項目 の	137,920	430,470
当期変動額(純額)		
当期変動額合計	137,920	430,470
当期末残高	33,879	464,350
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	85,902	53,783
当期変動額		
株主資本以外の項目 の	△32,119	△53,783
当期変動額(純額)		
当期変動額合計	△32,119	△53,783
当期末残高	53,783	—
評価・換算差額等合計		
当期首残高	△18,137	87,663
当期変動額		
株主資本以外の項目 の	105,800	376,686
当期変動額(純額)		
当期変動額合計	105,800	376,686
当期末残高	87,663	464,350
純資産合計		
当期首残高	36,900,336	34,847,077
当期変動額		
剰余金の配当	△9,182,008	△7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	105,800	376,686
当期変動額合計	△2,053,258	384,293

当期末残高

34,847,077

35,231,371

注記事項

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 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とおりであります。

建物 6～47年

器具備品 3～20年

（会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

（2）無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）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）リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

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

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

（３）退職給付引当金

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

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

（４）役員退職慰労引当金

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

（５）本社移転関連費用引当金

前事業年度において、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、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計を終了しております。

（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）

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「時効成立後支払分配金・償還金」及び「投資不動産管理費用」は重要性が増したため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた67,829千円は、「時効成立後支払分配金・償還金」2,182千円、「投資不動産管理費用」16,454千円、「その他」49,191千円として組替えております。

（貸借対照表関係）

※ 1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成24年 3月31日現在)	当事業年度 (平成25年 3月31日現在)
建物	986,089千円	15,528千円
器具備品	2,234,738千円	250,072千円
リース資産	—	409千円
投資建物	712,587千円	724,130千円
投資器具備品	22,398千円	23,691千円

※ 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24年 3月31日現在)	当事業年度 (平成25年 3月31日現在)
未払金	3,577,654千円	2,883,398千円

3 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（平成25年3月31日現在）

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

（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23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
受取配当金	—	185,280千円

※2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
建物	—	546千円
器具備品	4,812千円	128,892千円
無形固定資産（その他）	—	377千円
投資不動産	59千円	—
計	4,871千円	129,816千円

※3 減損損失に関する注記

前事業年度（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つのグルーピングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（76,217千円）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24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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
次のとおり提案しております。

- ① 剰余金の配当の総額 7,022百万円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 2,692円
- ④ 基準日 平成24年3月31日
- ⑤ 効力発生日 平成24年6月26日

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成24年6月25日 定時株主総会	普通株式	7,022	2,692	平成24年 3月31日	平成24年 6月26日

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

平成25年6月24日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- | | |
|-------------|------------|
| ① 剰余金の配当の総額 | 7,027百万円 |
| ② 配当の原資 | 利益剰余金 |
| ③ 1株当たり配当額 | 2,694円 |
| ④ 基準日 | 平成25年3月31日 |
| ⑤ 効力発生日 | 平成25年6月25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、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計の適用を終了しております。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

①市場リスクの管理

(i) 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。

(ii) 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、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計の適用を終了しております。

(iii) 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。

②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。

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

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

（*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。

<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、（2）未収委託者報酬並びに（3）未収入金

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

（4）有価証券及び投資有価証券

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

負 債

（1）未払手数料、（2）その他未払金、並びに（3）未払費用

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

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24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,163,689	1,059,169
(2) 子会社株式及び関連会社株式		

子会社株式	5,141,069	5,141,069
（３）差入保証金	542,920	1,000,820

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	-

当事業年度（平成25年３月31日現在）

（単位：千円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 １０年以内	１０年超
現金・預金	14,380,327	-	-	-
未収委託者報酬	7,183,011	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,434,397	4,840,276	-
合計	21,563,339	1,434,397	4,840,276	-

（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。

当事業年度（平成25年３月31日現在）

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

２．その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度（平成25年3月31日現在）

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

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,059,169千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

（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。

当事業年度（平成25年3月31日現在）

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
退職給付債務	1,670,344千円	1,935,442千円
退職給付引当金	1,670,344千円	1,935,442千円

3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
勤務費用	261,341千円	301,777千円
その他	160,689千円	167,935千円
退職給付費用	442,030千円	469,713千円

(注) 「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

(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24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	838,826	837,121
退職給付引当金	599,247	693,199
賞与引当金	116,690	280,855
連結法人間取引（譲渡損）	258,256	264,269
繰延資産	12	157,330
未払事業税	212,753	154,219
投資有価証券評価損	191,138	128,953
出資金評価損	114,425	114,425
未払社会保険料	14,071	43,411
器具備品	33,365	33,316
役員退職慰労引当金	25,804	24,920
本社移転関連費用引当金	131,676	—
資産除去債務	110,989	—
有価証券評価損	80,344	—
その他有価証券評価差額金	27,099	—
その他	27,474	29,627
繰延税金資産小計	2,782,177	2,761,651
評価性引当額	△ 1,379,241	△ 1,323,069
繰延税金資産合計	1,402,935	1,438,582
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△ 2,428,233	△ 2,428,233
建物（資産除去債務）	△ 76,837	—
繰延ヘッジ損益	△ 29,783	—
その他有価証券評価差額金	△ 18,241	△ 257,138

その他	△ 1,888	△ 1,888
繰延税金負債合計	△ 2,554,985	△ 2,687,261
繰延税金負債の純額	△ 1,152,049	△ 1,248,679

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

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

（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

旧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

前事業年度において、移転までの使用見込期間を1年1ヶ月と見積み、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み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23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
期首残高	—	292,000
見積りの変更に伴う増加額	292,000	—
資産除去債務の履行による減少額	—	△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

前事業年度において、本社移転計画に基づく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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

[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に応じて保証状にて定められております。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,591,590	—	—

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 または 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	—	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	20,510,864	未払手数料	2,758,584
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	—	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,205,721	未払費用	82,519
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ（株）	東京都中央区	100	不動産管理業	—	本社ビルの管理	不動産の賃借料	1,194,567	長期差入保証金	971,157
									未収入金	511,559

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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23年４月１日 至 平成24年３月31日)		当事業年度 (自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日)	
１株当たり純資産額	13,358.92円	１株当たり純資産額	13,506.24円
１株当たり当期純利益	2,692.30円	１株当たり当期純利益	2,694.91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23年４月１日 至 平成24年３月31日)	当事業年度 (自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日)
当期純利益（千円）	7,022,948	7,029,755
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

- ① 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。）。
- ② 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。）。
- ③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤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。
- ④ 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。
- ⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成24年12月3日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・本店の所在地の変更(東京都千代田区に変更)

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

- ① 名称 三井住友信託銀行株式会社
- ② 資本金の額 342,037百万円（平成25年3月末日現在）
- ③ 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

① 名 称	② 資本金の額 単位：百万円 (平成25年3月末日現在)	③ 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。
SMB 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	
バークレイズ証券株式会社	32,945	
BNPパリバ証券株式会社	102,025	
みずほ証券株式会社	125,167	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	
メリルリンチ日本証券株式会社	119,440	
モルガン・スタンレーMUF G証券株式会社	62,149	
UBS証券株式会社	74,450	

2 【関係業務の概要】

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

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

3 【資本関係】

該当ありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成25年3月末日現在）

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

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

第3 【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24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11期）・同添付書類
平成24年12月27日	有価証券届出書の訂正届出書
平成25年4月3日	半期報告書（第12期中）、有価証券届出書の訂正届出書・同添付書類

独立監査人の監査報告書

平成25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 貞廣 篤典 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ートピックスの平成24年7月11日から平成25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、ダイワ上場投信ートピックスの平成25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）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年 5月29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24年4月1日から平成25年3月31日までの第54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25年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(注)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。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年 5月29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24年4月1日から平成25年3月31日までの第54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25年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(注)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。