

**【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28年10月3日提出
【計算期間】	第15計算期間 (自 平成27年7月11日 至 平成28年7月10日)
【ファンド名】	ダイワ上場投信 - トピックス
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 岩本 信之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山村 政
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3111
【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
追加型投信	海外	債券	MRF	
	内外	不動産投信	ETF	特殊型
		その他資産 ( )		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス <http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

## &lt; 信託の限度 &gt;

- ・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。

## &lt; ファンドの特色 &gt;

1

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

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

#### 東証株価指数（TOPIX）について

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

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

（注2）基準時の時価総額の修正方法：

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

- TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下（株）東京証券取引所という。）の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は（株）東京証券取引所が有する。
- （株）東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができる。
- （株）東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をしない。
- （株）東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また（株）東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負わない。
- 「ダイワ上場投信ートピックス」は、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用するが、「ダイワ上場投信ートピックス」の純資産価額とTOPIXの間に乖離が発生することがある。
- 「ダイワ上場投信ートピックス」は、（株）東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではない。
- （株）東京証券取引所は、「ダイワ上場投信ートピックス」の購入者または公衆に対し、「ダイワ上場投信ートピックス」の説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。
- 以上の項目に限らず、（株）東京証券取引所は「ダイワ上場投信ートピックス」の発行等または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しない。

## 2

当ファンドは、通常の証券投資信託とは異なる仕組みを有しています。

- 受益権は、東京証券取引所に上場され、株式と同様に売買することができます。
  - 売買単位は、10口単位です。
  - 取引方法は、原則として株式と同様です。
- 追加設定は、株式により行ないます。
  - 追加設定にかかる受益権の取得申込者は、取得時のバスケット（東証株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。
  - 原則として、所定の方法に定められる金銭の支払い以外に、金銭によって受益権の取得申込を行なうことはできません。

●受益権を株式と交換することができます。

- ・受益者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に対し、委託会社が定める一定口数の整数倍の受益権をもって、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式との交換を申込むことができます。
- ・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、名義登録受益者に対して支払われます。

- ・名義登録受益者とは、計算期間終了日において氏名または名称、住所および個人番号または法人番号（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所）が受託会社に登録されている者をいいます。

**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、運用管理費用（信託報酬）その他これらに類する費用の額の合計額を控除した額の全額について行ないます。決算日は毎年7月10日です。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

	名 称	関係業務の内容
--	-----	---------

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

- 1：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 2：受益権の募集の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務の内容等が規定されています。

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

< 委託会社の概況（平成28年7月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

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

・ 大株主の状況

名称	住所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

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

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

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

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

市況動向、資産規模等によっては、上記の運用を行なえないことがあります。

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

### (2) 【投資対象】

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 株券または新株引受権証券

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.の証券または証券を「株式」といいます。

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

1. 預金

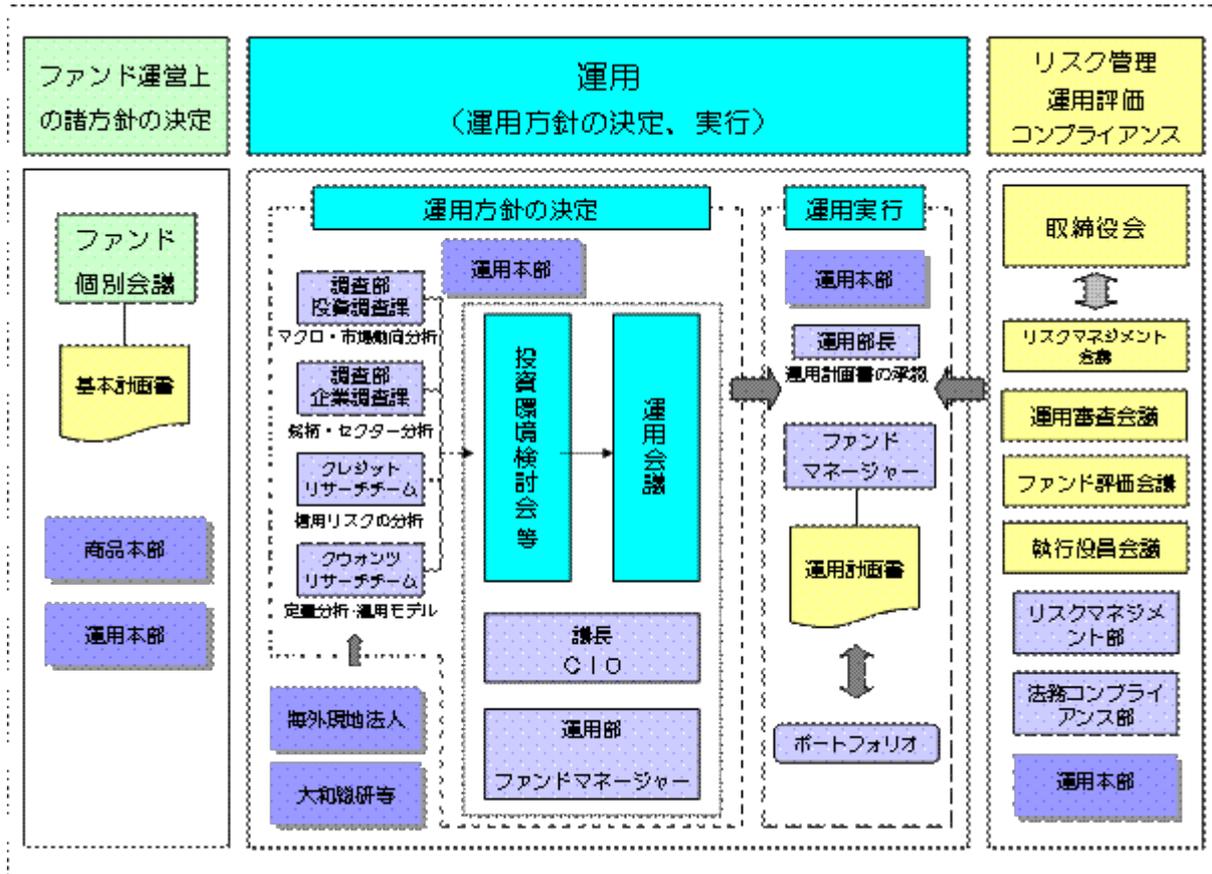
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

### (3) 【運用体制】

#### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



#### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．投資環境の検討

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

#### ハ．基本的な運用方針の決定

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

#### ニ．運用計画書の作成・承認

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

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

#### 職務権限

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

##### イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

##### ロ．Deputy-CIO（0～5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（0～5名程度）

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

##### ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

##### ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30～40名程度です。

##### イ．ファンド評価会議

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

##### ロ．運用審査会議

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

##### ハ．リスクマネジメント会議

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

##### ニ．執行役員会議

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

#### 受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成28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) 【配分方針】

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

## (5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資する株式の範囲（信託約款）

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

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

先物取引等（信託約款）

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

デリバティブ取引等（信託約款）

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

有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への投資は、行ないません。

### 3 【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

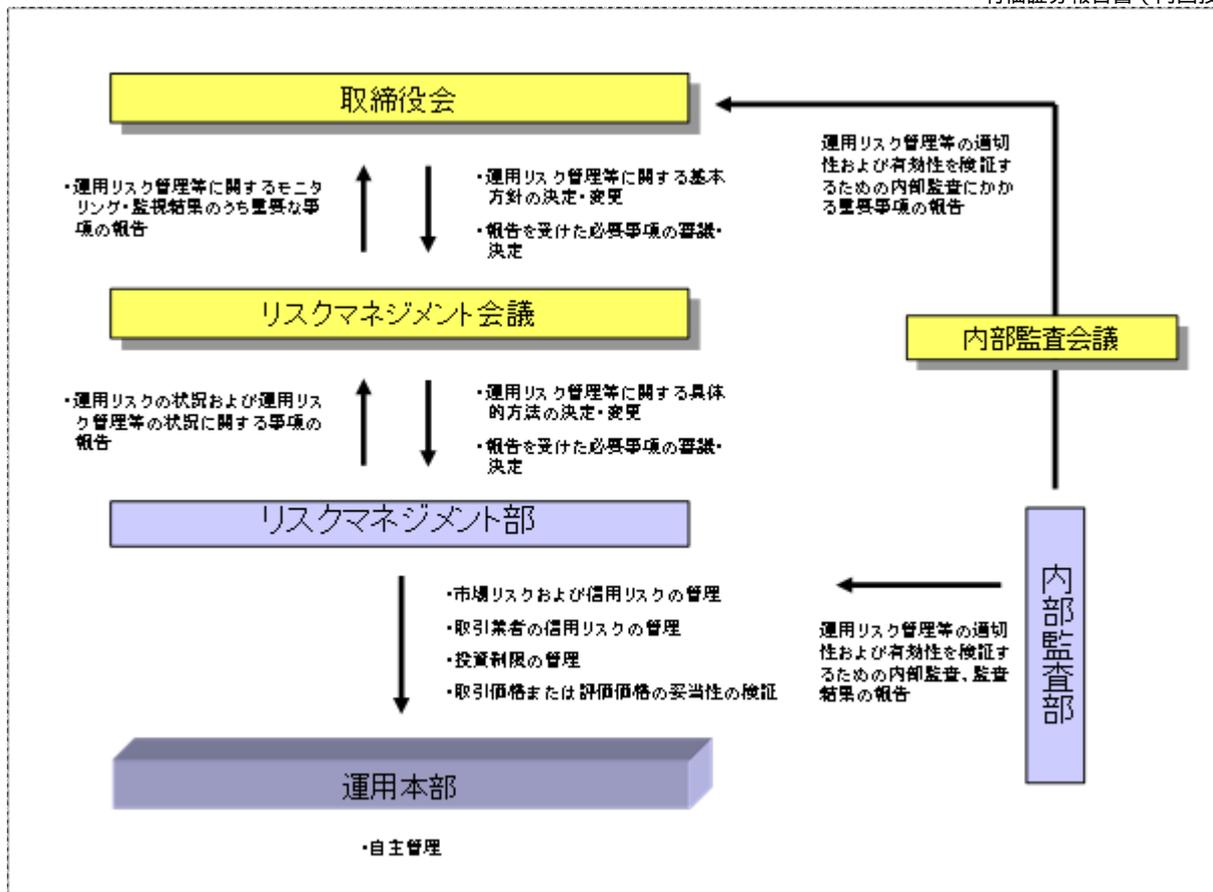
#### (2) その他の留意点

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

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

#### (3) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



### 流動性リスクに対する管理体制

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

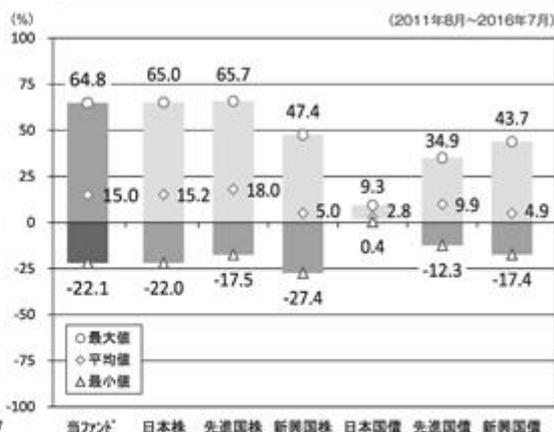
## 参考情報

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

## ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



## 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

## ※資産クラスについて

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

## ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）  
電話番号（コールセンター） 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

## (2) 【換金(解約)手数料】

### 換金手数料

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

販売会社については、前(1)をご参照下さい。

### 信託財産留保額

ありません。

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

## (3) 【信託報酬等】

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

イ. 信託財産の純資産総額に年率10,000分の11.88（税抜10,000分の11）以内を乗じて得た額

ロ. 信託財産に属する株式の貸付けにかかる品貸料（貸付株券から発生する配当金相当額等を含まないものとし、株式の貸付けにあたって担保として現金を受入れた場合には、当該現金の運用により生じたとみなし得る収益を加算し、貸付けの相手方に支払う当該現金に対する利息額を控除するものとします（控除した額が負数のときは零とします。）。）に100分の54（税抜100分の50）以内の率を乗じて得た額。

なお、提出日現在における上記イ.およびロ.に定める率は、次のとおりとなっております（今後、変更されることがあります。）。

イ. 年率10,000分の11.88（税抜10,000分の11）

ロ. 100分の54（税抜100分の50）

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

提出日現在における信託報酬にかかる委託会社、受託会社への配分については、次のとおりとなっております（今後、変更されることがあります。）。

### イ. 前 イ.の報酬

委託会社 年率10,000分の7.5（税抜）

受託会社 年率10,000分の3.5（税抜）

\* 上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

### ロ. 前 ロ.の報酬

委託会社 報酬の50%

受託会社 報酬の50%

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4) 【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、受益権の上場にかかる費用および東証株価指数の商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（以下「商標使用料」といいます。）ならびにこれらにかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。ただし、各計算期間において、信託財産中から支弁する受益権の上場にかかる費用および商標使用料の合計額は、信託財産の純資産総額に年率10,000分の6.48（税抜10,000分の6）を乗じて得た額を超えないものとしします。

\* 提出日現在、商標使用料は信託財産の純資産総額に、年率10,000分の3.24（税抜10,000分の3）以内を乗じて得た額（ただし、162万円(税抜150万円)を下回る場合は、162万円(税抜150万円)）となります。

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

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

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は特定株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

##### イ．受益権の売却時

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

ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

受益権を譲渡して生じた損失金額は上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益・償還差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・利子所得と通算できます。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。売却時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

##### ロ．収益分配金の受取時

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

ただし、平成49年12月31日まで、収益分配金の受取時に、収益分配金に対する所得税の源泉徴収額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

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

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

#### ハ．受益権と現物株式との交換時

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

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

法人の投資者に対する課税

#### イ．受益権の売却時

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

#### ロ．収益分配金の受取時

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

ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。益金不算入制度が適用されます。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

#### ハ．受益権と現物株式との交換時

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

( ) 上記は、平成28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28年7月29日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,296,569,145,950	99.82
内 日本	1,296,569,145,950	99.82
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,329,753,840	0.18
純資産総額	1,298,898,899,790	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)	2,378,015,000	0.18
内 日本	2,378,015,000	0.18

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

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

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

## (2) 【投資資産】（平成28年7月29日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	8,235,400	5,062.35 41,690,549,592	5,894.00 48,539,447,600	3.74
2	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	52,548,300	429.73 22,581,635,790	522.00 27,430,212,600	2.11
3	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	5,051,600	4,830.36 24,401,093,854	4,881.00 24,656,859,600	1.90
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	3,703,100	5,405.21 20,016,037,774	5,703.00 21,118,779,300	1.63
5	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	6,465,600	3,135.30 20,271,657,216	3,145.00 20,334,312,000	1.57

6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	5,233,500	2,779.14 14,544,663,850	3,308.00 17,312,418,000	1.33
7	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	5,959,200	2,479.63 14,776,644,050	2,841.50 16,933,066,800	1.30
8	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	4,112,600	4,289.73 17,641,970,523	4,025.00 16,553,215,000	1.27
9	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	92,957,400	142.28 13,226,458,887	167.10 15,533,181,540	1.20
10	ソニー	日本	株式	電気機 器	4,672,900	3,015.07 14,089,128,042	3,282.00 15,336,457,800	1.18
11	NTTドコモ	日本	株式	情報・通 信業	4,883,800	2,795.76 13,653,971,951	2,749.50 13,428,008,100	1.03
12	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	7,529,100	1,604.31 12,079,065,961	1,721.50 12,961,345,650	1.00
13	武田薬品	日本	株式	医薬品	2,762,700	4,255.59 11,756,945,646	4,588.00 12,675,267,600	0.98
14	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	2,734,300	4,083.41 11,165,292,138	4,303.00 11,765,692,900	0.91
15	ファナック	日本	株式	電気機 器	677,400	15,522.40 10,514,875,300	17,325.00 11,735,955,000	0.90
16	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	1,210,400	9,341.17 11,306,562,975	9,485.00 11,480,644,000	0.88
17	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	592,800	18,078.33 10,716,836,580	19,220.00 11,393,616,000	0.88
18	キーエンス	日本	株式	電気機 器	149,900	70,740.80 10,604,046,981	72,920.00 10,930,708,000	0.84
19	東京海上HD	日本	株式	保険業	2,648,300	3,258.05 8,628,299,192	4,040.00 10,699,132,000	0.82
20	キヤノン	日本	株式	電気機 器	3,565,400	2,804.97 10,000,848,550	2,935.00 10,464,449,000	0.81
21	花王	日本	株式	化学	1,761,800	5,829.35 10,270,153,031	5,553.00 9,783,275,400	0.75
22	三菱地所	日本	株式	不動産 業	4,860,000	1,729.90 8,407,340,700	1,929.00 9,374,940,000	0.72
23	日産自動車	日本	株式	輸送用 機器	9,242,700	920.17 8,504,873,042	1,012.00 9,353,612,400	0.72
24	村田製作所	日本	株式	電気機 器	698,600	10,497.15 7,333,309,135	12,825.00 8,959,545,000	0.69
25	信越化学	日本	株式	化学	1,243,900	5,906.02 7,346,507,628	7,064.00 8,786,909,600	0.68

26	任天堂	日本	株式	その他 製品	408,000	16,393.49 6,688,546,545	21,505.00 8,774,040,000	0.68
27	三菱商事	日本	株式	卸売業	4,904,600	1,750.01 8,583,134,362	1,778.50 8,722,831,100	0.67
28	ダイキン工業	日本	株式	機械	964,300	8,040.44 7,753,402,000	9,012.00 8,690,271,600	0.67
29	三菱電機	日本	株式	電気機 器	7,066,000	1,109.87 7,842,408,550	1,217.50 8,602,855,000	0.66
30	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	2,340,800	3,144.25 7,360,066,595	3,601.00 8,429,220,800	0.65

(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	99.82%
合計	99.82%

(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	0.11%
鉱業	0.29%
建設業	3.31%
食料品	5.07%
繊維製品	0.74%
パルプ・紙	0.26%
化学	6.23%
医薬品	5.75%
石油・石炭製品	0.46%
ゴム製品	0.86%
ガラス・土石製品	0.94%
鉄鋼	1.16%
非鉄金属	0.87%
金属製品	0.66%
機械	4.81%
電気機器	11.95%
輸送用機器	9.59%

精密機器	1.51%
その他製品	1.78%
電気・ガス業	1.88%
陸運業	4.58%
海運業	0.22%
空運業	0.59%
倉庫・運輸関連業	0.20%
情報・通信業	8.41%
卸売業	4.05%
小売業	4.88%
銀行業	7.52%
証券、商品先物取引業	1.00%
保険業	2.40%
その他金融業	1.27%
不動産業	2.61%
サービス業	3.86%
合計	99.82%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2016年9月	買建	179	2,182,173,100	2,378,015,000	0.18%

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

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

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額 (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6計算期間末 (平成19年7月10日)	377,975,712,627	381,927,367,525	1,813.5	1,832.5	1,812
第7計算期間末 (平成20年7月10日)	382,598,866,794	388,782,960,703	1,308.5	1,329.7	1,310
第8計算期間末 (平成21年7月10日)	169,610,147,395	174,789,556,053	875.7	902.4	877
第9計算期間末 (平成22年7月10日)	212,389,754,464	215,702,142,160	865.0	878.5	865
第10計算期間末 (平成23年7月10日)	242,981,056,419	247,200,364,545	881.1	896.4	883
第11計算期間末 (平成24年7月10日)	293,772,258,294	299,715,502,142	766.2	781.7	767
第12計算期間末 (平成25年7月10日)	935,579,160,460	943,078,552,355	1,222.6	1,232.4	1,222
第13計算期間末 (平成26年7月10日)	1,123,731,191,021	1,137,960,316,067	1,295.2	1,311.6	1,294
第14計算期間末 (平成27年7月10日)	1,279,925,104,350	1,298,892,337,720	1,633.0	1,657.2	1,632
平成27年7月末日	1,351,485,200,482	-	1,711.3	-	1,709
8月末日	1,305,486,757,696	-	1,585.1	-	1,583
9月末日	1,222,381,260,029	-	1,466.2	-	1,465
10月末日	1,336,944,955,025	-	1,618.9	-	1,619
11月末日	1,359,174,345,101	-	1,641.9	-	1,642
12月末日	1,377,242,206,635	-	1,609.5	-	1,609
平成28年1月末日	1,319,069,955,496	-	1,489.6	-	1,499
2月末日	1,222,577,077,233	-	1,350.3	-	1,350
3月末日	1,275,426,436,990	-	1,414.7	-	1,414
4月末日	1,257,819,582,706	-	1,407.4	-	1,408
5月末日	1,295,053,134,572	-	1,449.1	-	1,448
6月末日	1,215,062,223,950	-	1,310.1	-	1,314
第15計算期間末 (平成28年7月10日)	1,178,144,843,356	1,202,723,169,102	1,246.3	1,272.3	1,247
7月末日	1,298,898,899,790	-	1,362.6	-	1,359

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

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第6計算期間	18.96
第7計算期間	21.15
第8計算期間	26.74
第9計算期間	13.49
第10計算期間	15.30
第11計算期間	15.50
第12計算期間	9.80
第13計算期間	16.40
第14計算期間	24.20
第15計算期間	26.00

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第6計算期間	13.5
第7計算期間	26.7
第8計算期間	31.0
第9計算期間	0.3
第10計算期間	3.6
第11計算期間	11.3
第12計算期間	60.8
第13計算期間	7.3
第14計算期間	27.9
第15計算期間	22.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第6計算期間	69,645,100	81,100,716
第7計算期間	153,441,900	69,470,370
第8計算期間	33,969,100	132,666,084
第9計算期間	65,756,800	13,908,027
第10計算期間	61,810,890	31,583,053
第11計算期間	147,354,900	39,691,586
第12計算期間	425,333,390	43,524,406
第13計算期間	501,946,560	399,561,055

第14計算期間	258,772,110	342,631,712
第15計算期間	282,232,170	120,681,923

## (参考情報) 運用実績

2016年7月29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	13,626円
純資産総額	12,988億円



## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	6.2%
3カ月間	-1.2%
6カ月間	-6.6%
1年間	-18.7%
3年間	23.5%
5年間	73.4%
設定来	33.3%

※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運用管理費用(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: 260円

設定来分配金合計額: 2,316.4円

決算期	第4期 05年7月	第5期 06年7月	第6期 07年7月	第7期 08年7月	第8期 09年7月	第9期 10年7月	第10期 11年7月	第11期 12年7月	第12期 13年7月	第13期 14年7月	第14期 15年7月	第15期 16年7月
分配金	143.9円	150.2円	189.6円	211.5円	267.4円	134.9円	153円	155円	98円	164円	242円	260円

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

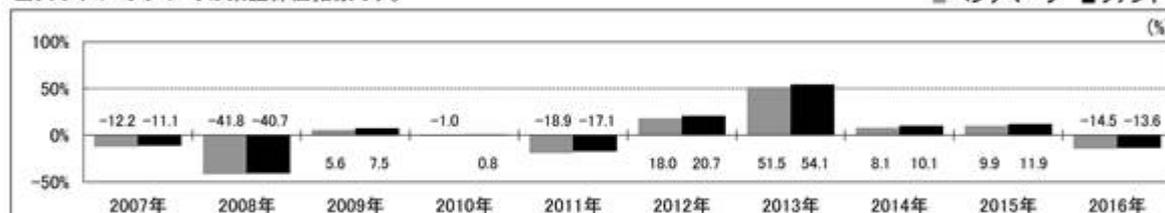
資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	租入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,965	99.8%	電気機器	12.0%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.7%
国内株式先物	1	0.2%	輸送用機器	9.6%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.1%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	8.4%	日本電信電話	情報・通信業	1.9%
コール・ローン、その他	-	0.2%	銀行業	7.5%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.6%
合計	1,966	-	化学	6.2%	KDDI	情報・通信業	1.6%
株式市場・上場別構成			医薬品	5.8%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.3%
一部(東証・名証)		99.8%	食料品	5.1%	本田技研	輸送用機器	1.3%
二部(東証・名証)		-	小売業	4.9%	日本たばこ産業	食料品	1.3%
新興市場他		-	機械	4.8%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.2%
その他		-	その他	35.6%	ソニー	電気機器	1.2%
合計		99.8%	合計	99.8%	合計		17.2%

※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。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

\*2016年は7月29日までの騰落率を表しています。

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

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



## 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．前ロ．にかかわらず、取得時のバスケットに、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは当該権利を取得することができる者が確定する日またはその前営業日に取得の申込みに応じて受益権の受渡しが行なわれることとなる株式（以下本チ．において「配当落ち株式等」といいます。）が含まれる場合には、当該取得申込者は当該配当落ち株式等に代えて当該配当落ち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、当該配当落ち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。
- リ．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。
- ヌ．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。

- ル．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、前リ．に定める株式（前ホ．、前ヘ．および前チ．に該当する場合の金銭を含みます。）または前ヌ．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。
- ヲ．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け付けを停止します。なお、次の1.から3.までに該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の取得申込みを受け付けることがあります。
- 1．東証株価指数構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内
  - 2．東証株価指数構成銘柄の変更および増減資等に伴う株数の変更日の2営業日前から起算して6営業日以内
  - 3．計算期間終了日の4営業日前から起算して5営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して6営業日以内）
  - 4．前1.から前3.までのほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき
- ワ．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。
- カ．委託会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときおよび委託会社が必要と認めるときは、取得申込みの受け付けの中止、取得申込みの受け付けの取消しまたはその両方を行なうことができます。
- コ．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（受託会社が「3 資産管理等の概要(5) 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からの「3 資産管理等の概要(5)」の規定による請求により買取った受益権を除きます。）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け付けを停止します。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け付けることがあります。
- 1．東証株価指数構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日
  - 2．東証株価指数構成銘柄の変更および増減資等に伴う株数の変更日の4営業日前から起算して8営業日以内
  - 3．計算期間終了日の4営業日前から起算して5営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して6営業日以内）
  - 4．前1.から前3.までのほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障を来すおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき
- ヘ．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ヨ．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．委託会社は、後ル．または後ヲ．の委託会社の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび後タ．に定める抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ、抹消したものとして取扱います。
- チ．販売会社は、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を交換請求者から徴収することができるものとします。当該手数料は、販売会社ならびに委託会社が収受するものとします。
- リ．委託会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときおよび委託会社が必要と認めるときは、交換請求の受け付けの中止、交換請求の受け付けの取消またはその両方を行なうことができます。
- ヌ．前リ．により、交換請求の受け付けを中止したときは、受益者は、当該受付中止以前に行なった当日の交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に交換の請求を受け付けたものとして計算されるものとします。
- ル．委託会社は、交換の請求を受け付けた場合には、当該請求にかかる振替受益権と、当該振替受益権の信託財産に対する持分に相当する株式として委託会社が指定するものとの交換を行なうよう委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。）を交換するよう委託会社に指図するものとします。

- ワ．前フ．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．前ル．にかかわらず、前ル．の委託会社が指定する株式に、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは当該権利を取得することができる者が確定する日に交換の申込みに応じて受益権の受渡しが行なわれることとなる株式（以下本カ．において「配当落ち株式等」といいます。）が含まれる場合には、委託会社は、当該配当落ち株式等に代えて当該配当落ち株式等の評価額（当該評価額から、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額とします。）に相当する金銭の交付をもって交換するよう受託会社に指図することができるものとします。
- ヨ．受託会社は、前ヘ．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および金銭の交付を行なうものとします。別に定める期日から、受益者への交換株式の交付に際しては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、受益者への金銭の交付については販売会社において行なわれます。
- タ．委託会社は、交換請求受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したのものとして取扱うこととし、受託会社は、当該受益権にかかる振替受益権が交換株式の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

#### < 買取り >

- イ．販売会社は、次に該当する場合で、受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。
1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権
  2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき
- ロ．前イ．の買取価額は、買取申込みを受付けた日の基準価額から、販売会社が定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を控除した価額とすることができます。
- ハ．販売会社は、金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することができます。
- ニ．前ハ．により受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取停止以前に行なった当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受付けたものとして、前ロ．に準じて計算されたものとします。

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

(注) 主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東証株価指数に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式：  
原則として金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）  
電話番号（コールセンター） 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ  
アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が200万口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となったときまたは東証株価指数が廃止された場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
3. 委託会社は、前1.および前2.の各事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
4. 前3.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
5. 前4.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。

6. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
7. 前4.から前6.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約する場合には適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前4.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合も同じとします。
8. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
9. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、前4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
10. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

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

#### 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

<支払方法>

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

ロ. 計算期間終了日において氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。）が受託会社に登録されている者（以下「名義登録受益者」といいます。）を当該計算期間終了日における収益分配金受領権者とし、受託会社は収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。この場合、名義登録受益者が当該計算期間終了日における振替制度移行後も受益証券を保有している所有者と異なる場合であっても、委託会社および受託会社は当該所有者に対して収益分配金の支払いおよびその他損害についてその責を負わないものとします。

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

ただし、証券金融会社等は前ロ. に規定する登録を受託会社に対して直接行なうことができます。

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

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

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

(c) 前八. の取引参加者は、計算期間終了日現在の当該取引参加者にかかる前(a)の受益権の受益者の振替機関の定める事項を(当該取引参加者が直接口座管理機関でない場合はその上位機関を通じて)振替機関に報告するとともに、振替機関は業務規程等に基づき、これを受託会社に通知するものとします。

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

ヘ. 前口. に規定する収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定した預金口座等に当該収益分配金を振込む方式により行なうものとします。なお、名義登録受益者が前八. に規定する取引参加者と別途収益分配金の取扱いにかかる契約を締結している場合は、当該契約にし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、前口. の名義登録受益者にかかる収益分配金の未払い残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとします。

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

#### 信託終了時の交換等

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

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

ハ. 信託終了に際して、委託会社が信託終了に関して指定する販売会社は、その所有にかかるすべての受益権を交換請求するものとします。交換により引渡される株式に当該販売会社の自社株式等が含まれる場合には、委託会社は、受託会社に対しこれを売却する指図をするとともに、当該自社株式等の評価額に相当する口数の受益権を、受託会社は信託財産をもって買取るものとします。

ニ. 受益者が、前イ. の交換について、交換開始日から10年間その交換の請求をしないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

#### 交換請求権および買取請求権

受益者は、保有する受益権について、交換または買取りを請求する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

### 第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（平成27年7月11日から平成28年7月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワ上場投信 - トピックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 平成27年7月10日現在	第15期 平成28年7月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	67,250,832,430	77,896,573,945
株式	3 4 1,278,250,047,993	3 4 1,176,133,662,940
未収入金	10,541,275,861	12,431,305,032
未収配当金	1,185,541,120	1,743,294,469
未収利息	-	1,744,165
前払金	502,430,000	1,235,666,000
その他未収収益	5 38,567,121	5 14,854,046
差入委託証拠金	-	254,130,000
流動資産合計	1,357,768,694,525	1,269,711,230,597
資産合計	1,357,768,694,525	1,269,711,230,597
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	74,381,034	215,092,560
未払金	423,837,367	1,201,406,720
未払収益分配金	18,967,233,370	24,578,325,746
未払受託者報酬	235,333,371	253,633,098
未払委託者報酬	483,955,565	522,306,583
未払利息	456,957	233,092
受入担保金	57,397,637,955	64,513,948,432
その他未払費用	260,754,556	281,441,010
流動負債合計	77,843,590,175	91,566,387,241
負債合計	77,843,590,175	91,566,387,241
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 979,712,467,500	1 1,181,650,276,250
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 300,212,636,850	2 3,505,432,894
（分配準備積立金）	1,240,865,748	1,795,560,838
元本等合計	1,279,925,104,350	1,178,144,843,356
純資産合計	1,279,925,104,350	1,178,144,843,356
負債純資産合計	1,357,768,694,525	1,269,711,230,597

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期 自 平成26年7月11日 至 平成27年7月10日	第15期 自 平成27年7月11日 至 平成28年7月10日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	20,134,374,139	26,402,590,169
受取利息	33,370,018	36,818,717
有価証券売買等損益	237,708,985,252	342,876,697,571
派生商品取引等損益	1,125,587,248	1,057,091,835
その他収益	1,753,969,989	1,612,466,125
<b>営業収益合計</b>	<b>259,756,286,646</b>	<b>316,881,914,395</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	16,404,328	18,084,755
受託者報酬	452,093,161	533,722,646
委託者報酬	926,818,688	1,090,615,798
その他費用	258,684,604	276,430,976
<b>営業費用合計</b>	<b>1,654,000,781</b>	<b>1,918,854,175</b>
営業利益又は営業損失（ ）	258,102,285,865	318,800,768,570
経常利益又は経常損失（ ）	258,102,285,865	318,800,768,570
当期純利益又は当期純損失（ ）	258,102,285,865	318,800,768,570
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	39,194,221,021	300,212,636,850
剰余金増加額又は欠損金減少額	68,554,144,614	63,079,127,392
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	68,554,144,614	63,079,127,392
剰余金減少額又は欠損金増加額	46,670,781,280	23,418,102,820
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	46,670,781,280	23,418,102,820
分配金	2,18,967,233,370	2,24,578,325,746
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	300,212,636,850	3,505,432,894

## (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15期	
	自 平成27年7月11日	至 平成28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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
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14期	第15期
	平成27年7月10日現在	平成28年7月10日現在
1. 1 期首元本額	1,084,536,970,000円	979,712,467,500円
期中追加設定元本額	323,465,137,500円	352,790,212,500円
期中一部交換元本額	428,289,640,000円	150,852,403,750円
2. 計算期間末日における受益権の総数	783,769,974口	945,320,221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3,505,432,894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 54,263,050,450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 60,234,566,570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 890,730,000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 589,455,000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35,033,508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9,548,470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14期		第15期	
	自 平成26年7月11日	至 平成27年7月10日	自 平成27年7月11日	至 平成28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620,842,824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373,154,566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(20,905,309,818円)及び分配準備積立金(940,385,753円)の合計額から、経費(1,637,596,453円)を控除して計算される分配対象額は20,208,099,118円(10口当たり257円)であり、うち18,967,233,370円(10口当たり242円)を分配金額としております。	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(27,033,790,256円)及び分配準備積立金(1,240,865,748円)の合計額から、経費(1,900,769,420円)を控除して計算される分配対象額は26,373,886,584円(10口当たり278円)であり、うち24,578,325,746円(10口当たり260円)を分配金額としております。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期
	自 平成27年7月11日 至 平成28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等であり、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（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期
	平成28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等  
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14期 平成27年7月10日現在	第15期 平成28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	206,990,913,449	315,374,031,400
合計	206,990,913,449	315,374,031,400

（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14期 平成27年7月10日 現在				第15期 平成28年7月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,711,448,000	-	1,637,185,000	74,263,000	2,201,044,000	-	1,986,040,000	215,004,000
合計	1,711,448,000	-	1,637,185,000	74,263,000	2,201,044,000	-	1,986,040,000	215,004,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

## 第15期

自 平成27年7月11日

至 平成28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14期 平成27年7月10日現在	第15期 平成28年7月10日現在
1口当たり純資産額 (10口当たり純資産額)	1,633.0円 (16,330円)	1,246.3円 (12,463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	320,000	257.00	82,240,000	
日本水産	851,500	500.00	425,750,000	
マルハニチロ	151,000	2,698.00	407,398,000	
ハウスイ	47,000	106.00	4,982,000	
カネコ種苗	25,700	1,318.00	33,872,600	
サカタのタネ	109,500	2,142.00	234,549,000	
ホクト	75,800	1,845.00	139,851,000	
ホクリヨウ	7,400	844.00	6,245,600	貸付株式数 2,600株
ショーボンドHD	74,600	4,480.00	334,208,000	貸付株式数 28,000株 (28,000株)
ミライト・ホールディングス	228,200	1,072.00	244,630,400	
タマホーム	54,900	423.00	23,222,700	貸付株式数 20,800株 (10,800株)
サンヨーホームズ	14,000	473.00	6,622,000	
住石ホールディングス	220,000	79.00	17,380,000	貸付株式数 7,500株
日鉄鉱業	186,000	312.00	58,032,000	
三井松島	485,000	95.00	46,075,000	
国際石油開発帝石	3,878,000	741.50	2,875,537,000	
日本海洋掘削	21,100	2,108.00	44,478,800	貸付株式数 10,200株 (4,300株)
石油資源開発	117,500	1,948.00	228,890,000	
K&Oエナジーグループ	49,700	1,252.00	62,224,400	

ダイセキ環境ソリューション	15,500	987.00	15,298,500	貸付株式数	5,900株
安藤・間	494,500	547.00	270,491,500	貸付株式数	188,100株
東急建設	241,500	929.00	224,353,500		
コムシスホールディングス	317,400	1,636.00	519,266,400		
ミサワホーム	88,500	672.00	59,472,000		
ビーアールホールディングス	26,800	393.00	10,532,400		
高松コンストラクションG P	55,200	2,361.00	130,327,200		
東建コーポレーション	30,200	8,000.00	241,600,000		
ソネック	7,700	581.00	4,473,700		
ヤマウラ	36,000	520.00	18,720,000	貸付株式数	12,100株
大成建設	3,822,000	811.00	3,099,642,000	貸付株式数	640,000株
大林組	2,208,100	1,045.00	2,307,464,500		
清水建設	2,252,000	931.00	2,096,612,000		
飛鳥建設	539,400	160.00	86,304,000	貸付株式数	179,400株
長谷工コーポレーション	860,600	928.00	798,636,800		
松井建設	82,800	1,067.00	88,347,600		
銭高組	99,000	296.00	29,304,000	貸付株式数	38,000株 (6,000株)
鹿島建設	3,452,000	694.00	2,395,688,000		
不動テトラ	525,100	154.00	80,865,400	貸付株式数	48,400株
大末建設	29,900	880.00	26,312,000	貸付株式数	6,000株
鉄建建設	454,000	275.00	124,850,000	貸付株式数	171,000株 (20,000株)
西松建設	854,000	480.00	409,920,000	貸付株式数	170,000株
三井住友建設	2,842,300	84.00	238,753,200		
大豊建設	288,000	462.00	133,056,000		
前田建設	456,000	785.00	357,960,000	貸付株式数	56,000株
佐田建設	50,700	351.00	17,795,700		
ナカノフドー建設	55,900	382.00	21,353,800		
奥村組	702,000	546.00	383,292,000		
東鉄工業	89,000	2,857.00	254,273,000		
イチケン	74,000	245.00	18,130,000	貸付株式数	16,000株
浅沼組	247,000	198.00	48,906,000	貸付株式数	81,000株
戸田建設	859,000	436.00	374,524,000		
熊谷組	1,075,000	280.00	301,000,000		
青木あすなろ建設	48,500	617.00	29,924,500		
北野建設	146,000	239.00	34,894,000		

植木組	83,000	205.00	17,015,000	
三井ホーム	90,000	419.00	37,710,000	
矢作建設	100,500	800.00	80,400,000	
ピーエス三菱	88,700	353.00	31,311,100	貸付株式数 5,400株
日本ハウスHLDGS	150,600	307.00	46,234,200	貸付株式数 36,100株
大東建託	270,700	16,255.00	4,400,228,500	
新日本建設	89,100	764.00	68,072,400	
NIPPO	155,000	1,694.00	262,570,000	貸付株式数 22,000株
東亜道路	130,000	251.00	32,630,000	
前田道路	213,000	1,748.00	372,324,000	
日本道路	199,000	371.00	73,829,000	
東亜建設	631,000	153.00	96,543,000	
若築建設	434,000	136.00	59,024,000	貸付株式数 136,000株 (70,000株)
東洋建設	233,900	417.00	97,536,300	
五洋建設	820,000	518.00	424,760,000	
大林道路	84,100	609.00	51,216,900	
世紀東急	114,300	473.00	54,063,900	
福田組	108,000	968.00	104,544,000	
日本ドライケミカル	8,000	2,075.00	16,600,000	
住友林業	507,700	1,420.00	720,934,000	
日本基礎技術	83,800	318.00	26,648,400	
日成ビルド工業	185,000	570.00	105,450,000	貸付株式数 67,000株 (5,000株)
ヤマダ・エスバイエルホーム	388,000	67.00	25,996,000	貸付株式数 147,000株
巴コーポレーション	92,700	322.00	29,849,400	
パナホーム	277,000	796.00	220,492,000	
大和ハウス	2,173,800	2,757.50	5,994,253,500	
ライト工業	142,900	1,049.00	149,902,100	
積水ハウス	2,460,600	1,653.00	4,067,371,800	
日特建設	82,700	383.00	31,674,100	
北陸電気工事	33,300	675.00	22,477,500	
ユアテック	105,000	661.00	69,405,000	
西部電気工業	57,000	407.00	23,199,000	
四電工	51,000	378.00	19,278,000	
中電工	106,100	1,968.00	208,804,800	
関電工	295,000	855.00	252,225,000	
きんでん	446,500	1,094.00	488,471,000	
東京エネシス	76,000	985.00	74,860,000	

トーエネック	99,000	533.00	52,767,000	
住友電設	57,500	1,130.00	64,975,000	
日本電設工業	121,100	1,676.00	202,963,600	
協和エクシオ	289,800	1,284.00	372,103,200	
新日本空調	61,000	1,019.00	62,159,000	
日本工営	209,000	299.00	62,491,000	
N D S	107,000	249.00	26,643,000	
九電工	130,100	3,050.00	396,805,000	貸付株式数 49,100株 (7,100株)
三機工業	165,000	783.00	129,195,000	
日 揮	740,700	1,439.00	1,065,867,300	貸付株式数 282,000株
中外炉工業	212,000	210.00	44,520,000	
ヤマト	64,600	522.00	33,721,200	
太平電業	98,000	1,055.00	103,390,000	
高砂熱学	221,000	1,180.00	260,780,000	
三晃金属	66,000	283.00	18,678,000	
N E C ネットズエスアイ	82,300	1,828.00	150,444,400	
朝日工業社	79,000	491.00	38,789,000	
明星工業	135,400	460.00	62,284,000	
大 気 社	90,800	2,436.00	221,188,800	
ダイダン	89,000	738.00	65,682,000	
日比谷総合設備	89,800	1,526.00	137,034,800	
東芝プラントシステム	120,600	1,648.00	198,748,800	貸付株式数 45,700株 (45,700株)
日本製粉	473,000	796.00	376,508,000	
日清製粉G本社	807,800	1,645.00	1,328,831,000	
日東富士製粉	52,000	332.00	17,264,000	
昭和産業	306,000	448.00	137,088,000	
鳥越製粉	57,800	663.00	38,321,400	
中部飼料	66,600	675.00	44,955,000	
フィード・ワン	448,000	113.00	50,624,000	
東洋精糖	101,000	100.00	10,100,000	
日本甜菜糖	386,000	182.00	70,252,000	
三井製糖	293,000	480.00	140,640,000	
塩水港精糖	80,700	219.00	17,673,300	
日新製糖	31,000	1,379.00	42,749,000	
ネクスト	195,300	862.00	168,348,600	貸付株式数 74,200株 (74,200株)
ジェイエイシーリクルート メント	39,000	1,479.00	57,681,000	貸付株式数 12,300株

日本M&Aセンター	105,800	6,610.00	699,338,000		
ノバレーゼ	15,900	807.00	12,831,300	貸付株式数	6,000株
アコーディア・ゴルフ	191,900	1,048.00	201,111,200		
中広	6,000	603.00	3,618,000		
タケエイ	58,400	835.00	48,764,000	貸付株式数	22,900株
トラスト・テック	26,500	1,317.00	34,900,500		
パソナグループ	57,000	750.00	42,750,000	貸付株式数	19,400株 (15,900株)
CDS	14,100	745.00	10,504,500	貸付株式数	5,400株
リンクアンドモチベーション	140,100	209.00	29,280,900	貸付株式数	18,000株
GCAサヴィアン	60,900	796.00	48,476,400	貸付株式数	16,200株 (8,100株)
エス・エム・エス	86,300	2,149.00	185,458,700		
テンプホールディングス	481,900	1,701.00	819,711,900		
リニカル	40,900	1,489.00	60,900,100	貸付株式数	14,000株
クックパッド	153,000	1,371.00	209,763,000	貸付株式数	58,200株
エスクリ	30,700	568.00	17,437,600	貸付株式数	8,500株
アイ・ケイ・ケイ	38,100	538.00	20,497,800	貸付株式数	12,900株 (1,200株)
森永製菓	650,000	690.00	448,500,000		
中村屋	155,000	460.00	71,300,000		
江崎グリコ	170,100	6,200.00	1,054,620,000		
名糖産業	34,000	1,293.00	43,962,000		
不二家	431,000	193.00	83,183,000		
山崎製パン	538,000	2,927.00	1,574,726,000		
第一屋製パン	103,000	107.00	11,021,000	貸付株式数	39,000株
モロゾフ	107,000	421.00	45,047,000	貸付株式数	40,000株
亀田製菓	41,200	5,860.00	241,432,000		
寿スピリッツ	49,500	3,360.00	166,320,000	貸付株式数	18,800株 (18,800株)
カルビー	273,200	4,300.00	1,174,760,000	貸付株式数	15,200株
森永乳業	647,000	759.00	491,073,000		
六甲バター	33,700	2,313.00	77,948,100		
ヤクルト	394,900	4,875.00	1,925,137,500	貸付株式数	151,000株
明治ホールディングス	436,000	10,560.00	4,604,160,000		
雪印メグミルク	173,600	3,660.00	635,376,000		
プリマハム	469,000	310.00	145,390,000		
日本ハム	539,000	2,517.00	1,356,663,000		
林兼産業	255,000	83.00	21,165,000	貸付株式数	83,000株

丸大食品	382,000	473.00	180,686,000	
S Foods	46,700	2,822.00	131,787,400	貸付株式数 17,600株 (1,800株)
伊藤ハム米久HLDGS	441,200	1,052.00	464,142,400	
学情	27,200	1,346.00	36,611,200	貸付株式数 10,100株 (6,500株)
スタジオアリス	32,300	2,392.00	77,261,600	
シミックホールディングス	33,900	1,570.00	53,223,000	貸付株式数 8,900株 (6,400株)
システナ	62,200	1,450.00	90,190,000	
NJS	12,600	1,101.00	13,872,600	
デジタルアーツ	32,400	2,836.00	91,886,400	
新日鉄住金SOL	107,800	1,487.00	160,298,600	
総合警備保障	229,200	4,730.00	1,084,116,000	
キューブシステム	29,800	696.00	20,740,800	
いちごグループHD	680,200	362.00	246,232,400	貸付株式数 196,100株 (196,100株)
日本駐車場開発	720,500	129.00	92,944,500	貸付株式数 271,900株 (271,900株)
コア	29,000	897.00	26,013,000	貸付株式数 9,600株
カカクコム	493,400	2,007.00	990,253,800	貸付株式数 188,700株
アイロムグループ	17,700	954.00	16,885,800	貸付株式数 6,800株 (3,000株)
ルネサンス	36,400	1,103.00	40,149,200	
ディップ	76,500	2,854.00	218,331,000	
SBSホールディングス	63,600	693.00	44,074,800	貸付株式数 1,900株
オプトホールディング	43,700	787.00	34,391,900	貸付株式数 12,100株
新日本科学	63,700	650.00	41,405,000	貸付株式数 24,400株 (5,800株)
ツクイ	82,300	1,677.00	138,017,100	
キャリアデザインセンター	16,500	927.00	15,295,500	
エムスリー	594,400	3,645.00	2,166,588,000	
ツカダ・グローバルHOLD	50,100	700.00	35,070,000	貸付株式数 19,000株 (3,400株)
アウトソーシング	33,600	4,140.00	139,104,000	貸付株式数 10,600株
ウェルネット	52,300	2,078.00	108,679,400	
ディー・エヌ・エー	308,200	2,442.00	752,624,400	
博報堂DYHLDGS	952,200	1,136.00	1,081,699,200	
ぐるなび	80,100	2,885.00	231,088,500	

エスアールジータカミヤ	70,000	396.00	27,720,000	貸付株式数 21,100株 (1,800株)
ジャパンベストレスキュー S	80,000	210.00	16,800,000	貸付株式数 26,600株 (26,600株)
ファンコミュニケーションズ	158,100	836.00	132,171,600	貸付株式数 63,000株 (29,200株)
ジェイコムホールディングス	14,100	2,426.00	34,206,600	貸付株式数 5,800株
WDBホールディングス	26,400	846.00	22,334,400	
ティア	30,500	621.00	18,940,500	
バリューコマース	62,200	324.00	20,152,800	
インフォマート	121,400	961.00	116,665,400	貸付株式数 42,800株 (6,600株)
サッポロホールディングス	223,800	2,964.00	663,343,200	
アサヒグループホールディング ン	1,380,800	3,366.00	4,647,772,800	
麒麟HD	3,016,200	1,778.50	5,364,311,700	貸付株式数 637,800株
宝ホールディングス	534,700	929.00	496,736,300	
オエノンホールディングス	190,000	195.00	37,050,000	
養命酒	21,400	1,702.00	36,422,800	
コカ・コーラウエスト	249,900	2,902.00	725,209,800	
コカ・コーライーストジャ パン	264,800	1,957.00	518,213,600	
サントリー食品インター	504,300	4,620.00	2,329,866,000	貸付株式数 193,000株
ダイドードリンコ	37,600	5,530.00	207,928,000	
伊藤園	218,700	3,930.00	859,491,000	
キーコーヒー	63,600	1,864.00	118,550,400	
ユニカフェ	18,000	867.00	15,606,000	
ジャパンフーズ	8,500	1,158.00	9,843,000	貸付株式数 3,200株
日清オイリオグループ	393,000	484.00	190,212,000	
不二製油グループ	197,400	2,046.00	403,880,400	
かどや製油	6,500	2,942.00	19,123,000	貸付株式数 2,400株
J-オイルミルズ	313,000	342.00	107,046,000	
ローソン	245,600	8,040.00	1,974,624,000	
サンエー	44,400	4,990.00	221,556,000	
ダイユーエイト	15,400	633.00	9,748,200	
カワチ薬品	50,300	2,256.00	113,476,800	
エービーシー・マート	84,400	6,610.00	557,884,000	貸付株式数 33,500株
ハードオフコーポレーショ ン	32,900	1,154.00	37,966,600	

高千穂交易	26,700	865.00	23,095,500	貸付株式数	5,700株
アスクル	75,300	3,405.00	256,396,500	貸付株式数	4,200株
ゲオホールディングス	109,300	1,329.00	145,259,700		
アダストリア	120,000	3,285.00	394,200,000		
ジーフット	40,100	705.00	28,270,500		
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	84,000	70.00	5,880,000	貸付株式数	23,000株
伊藤忠食品	14,500	4,070.00	59,015,000		
くらコーポレーション	39,400	6,000.00	236,400,000		
キャンドウ	35,400	1,630.00	57,702,000	貸付株式数	16,800株
エレマテック	31,200	1,922.00	59,966,400		
パル	38,600	2,316.00	89,397,600		
JALUX	19,600	1,579.00	30,948,400	貸付株式数	7,200株
エディオン	276,300	869.00	240,104,700	貸付株式数	106,000株 (85,100株)
あらた	30,000	2,122.00	63,660,000		
サーラコーポレーション	57,000	549.00	31,293,000		
ワッツ	27,500	1,096.00	30,140,000	貸付株式数	9,000株
トーメンデバイス	8,800	1,790.00	15,752,000	貸付株式数	3,300株
ハローズ	20,000	2,002.00	40,040,000		
J Pホールディングス	173,400	276.00	47,858,400	貸付株式数	64,700株 (12,400株)
あみやき亭	12,000	4,085.00	49,020,000		
東京エレクトロンデバイス	24,700	1,482.00	36,605,400	貸付株式数	1,200株
ひらまつ	90,700	630.00	57,141,000	貸付株式数	22,100株 (1,700株)
フィールズ	52,400	1,176.00	61,622,400		
双日	4,090,300	238.00	973,491,400		
ゲンキー	12,300	3,745.00	46,063,500	貸付株式数	4,500株
アルフレッサホールディングス	815,400	2,119.00	1,727,832,600		
サッポロドラッグストアー	7,800	1,990.00	15,522,000	貸付株式数	600株
大黒天物産	14,000	4,800.00	67,200,000		
ハニーズ	56,400	1,364.00	76,929,600	貸付株式数	22,400株 (22,400株)
ファーマライズHD	13,400	502.00	6,726,800		
キッコーマン	554,000	3,800.00	2,105,200,000	貸付株式数	15,000株
味の素	1,547,900	2,479.50	3,838,018,050		
キューピー	374,900	3,350.00	1,255,915,000		
ハウス食品G本社	252,200	2,416.00	609,315,200		

カゴメ	264,700	2,707.00	716,542,900	貸付株式数 101,200株 (43,600株)
焼津水産化工	36,100	982.00	35,450,200	
アリアケジャパン	59,400	6,010.00	356,994,000	
ピエトロ	6,900	1,677.00	11,571,300	
エバラ食品工業	16,500	1,855.00	30,607,500	
ニチレイ	786,000	952.00	748,272,000	
横浜冷凍	160,100	1,076.00	172,267,600	
東洋水産	362,200	4,165.00	1,508,563,000	
イトアンド	7,400	1,976.00	14,622,400	貸付株式数 2,800株
日清食品HD	311,600	5,520.00	1,720,032,000	
永谷園ホールディングス	64,000	1,198.00	76,672,000	
一正蒲鉾	27,400	1,054.00	28,879,600	貸付株式数 6,200株
フジッコ	71,900	2,978.00	214,118,200	
ロックフィールド	77,800	1,536.00	119,500,800	
日本たばこ産業	4,349,500	4,289.00	18,655,005,500	
ケンコーマヨネーズ	24,500	3,305.00	80,972,500	
わらべや日洋	40,400	2,181.00	88,112,400	
なとり	38,100	1,514.00	57,683,400	貸付株式数 7,700株
北の達人コーポ	12,600	476.00	5,997,600	
ユーグレナ	237,100	1,364.00	323,404,400	貸付株式数 90,600株 (43,500株)
片倉工業	87,900	1,080.00	94,932,000	
グンゼ	553,000	272.00	150,416,000	
ヒューリック	1,352,800	978.00	1,323,038,400	
神栄	81,000	108.00	8,748,000	貸付株式数 30,000株
山下医科器械	4,700	1,623.00	7,628,100	貸付株式数 1,500株
ラサ商事	32,000	469.00	15,008,000	
アルペン	57,200	1,630.00	93,236,000	貸付株式数 21,800株 (2,800株)
ラクーン	29,100	493.00	14,346,300	
クオール	64,500	1,288.00	83,076,000	
アルコニックス	38,200	1,435.00	54,817,000	
神戸物産	42,700	1,959.00	83,649,300	貸付株式数 14,600株 (6,600株)
ジェイアイエヌ	44,500	4,075.00	181,337,500	貸付株式数 16,700株 (7,000株)
ビックカメラ	355,700	924.00	328,666,800	
DCMホールディングス	320,800	922.00	295,777,600	貸付株式数 122,100株
MonotaRO	229,700	3,135.00	720,109,500	貸付株式数 87,700株

東京一番フーズ	14,800	548.00	8,110,400	貸付株式数	3,500株
ダイヤモンドダイニング	12,400	983.00	12,189,200	貸付株式数	100株 (100株)
あい ホールディングス	108,000	2,232.00	241,056,000		
ディーブイエックス	21,000	1,225.00	25,725,000		
きちり	15,600	593.00	9,250,800		
アークランドサービスHD	19,500	2,923.00	56,998,500	貸付株式数	7,200株
J. フロント リテイリング	821,800	1,010.00	830,018,000		
ドトール・日レスHD	112,700	1,795.00	202,296,500		
マツモトキヨシHLDGS	134,100	4,595.00	616,189,500		
ブロンコビリー	31,200	3,445.00	107,484,000	貸付株式数	600株
スタートトゥデイ	197,500	5,220.00	1,030,950,000		
トレジャー・ファクトリー	16,600	962.00	15,969,200	貸付株式数	700株
物語コーポレーション	16,600	5,280.00	87,648,000		
ココカラファイン	66,100	4,800.00	317,280,000		
三越伊勢丹HD	1,291,000	891.00	1,150,281,000	貸付株式数	172,600株
東洋紡	2,733,000	196.00	535,668,000		
ユニチカ	2,010,000	57.00	114,570,000		
富士紡ホールディングス	342,000	238.00	81,396,000		
日清紡ホールディングス	366,700	893.00	327,463,100		
倉敷紡績	704,000	167.00	117,568,000		
ダイワボウHD	583,000	216.00	125,928,000		
シキボウ	430,000	100.00	43,000,000		
日東紡績	460,000	342.00	157,320,000		
トヨタ紡織	230,500	1,941.00	447,400,500		
マクニカ・富士エレHLDGS	117,900	1,012.00	119,314,800		
ウエルシアHD	55,700	6,930.00	386,001,000		
クリエイトSDH	96,100	2,615.00	251,301,500		
バイタルKSKHD	111,600	993.00	110,818,800		
八洲電機	50,100	515.00	25,801,500	貸付株式数	7,000株
UKCホールディングス	42,700	1,488.00	63,537,600		
丸善CHI HD	77,700	379.00	29,448,300	貸付株式数	28,800株
OCHIホールディングス	17,000	981.00	16,677,000	貸付株式数	5,900株
TOKAIホールディングス	287,800	670.00	192,826,000	貸付株式数	109,200株
ミサワ	9,400	502.00	4,718,800	貸付株式数	900株 (900株)
エー・ピーカンパニー	9,600	812.00	7,795,200	貸付株式数	2,500株

三洋貿易	37,000	1,123.00	41,551,000	
チムニー	15,100	2,720.00	41,072,000	貸付株式数 5,600株 (5,600株)
シュッピン	23,200	1,082.00	25,102,400	貸付株式数 6,900株
ウイン・パートナーズ	23,800	1,394.00	33,177,200	
ネクステージ	9,500	820.00	7,790,000	貸付株式数 3,600株
ジョイフル本田	97,700	2,283.00	223,049,100	貸付株式数 16,000株
鳥貴族	15,400	2,083.00	32,078,200	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
キリン堂ホールディングス	18,900	897.00	16,953,300	
ホットランド	20,400	907.00	18,502,800	貸付株式数 8,100株
すかいらーく	199,100	1,310.00	260,821,000	
綿半ホールディングス	23,300	1,484.00	34,577,200	貸付株式数 6,800株 (6,800株)
日本毛織	206,500	682.00	140,833,000	
大東紡織	89,000	62.00	5,518,000	
トーア紡コーポレーション	30,900	454.00	14,028,600	
ダイドーリミテッド	79,100	419.00	33,142,900	
ユナイテッド・スーパー マーケ	216,700	990.00	214,533,000	
三栄建築設計	27,800	1,030.00	28,634,000	
野村不動産HLDGS	431,100	1,656.00	713,901,600	
三重交通グループHD	113,900	347.00	39,523,300	
サムティ	45,100	938.00	42,303,800	貸付株式数 12,000株
ディア・ライフ	40,200	312.00	12,542,400	貸付株式数 12,700株 (12,700株)
エー・ディー・ワークス	545,200	36.00	19,627,200	
日本商業開発	27,600	1,393.00	38,446,800	貸付株式数 7,800株
プレサンスコーポレーショ ン	20,000	3,860.00	77,200,000	
ユニゾホールディングス	41,500	3,495.00	145,042,500	貸付株式数 15,400株
日本管理センター	42,900	1,258.00	53,968,200	貸付株式数 14,700株 (4,600株)
サンセイランディック	13,600	734.00	9,982,400	貸付株式数 5,300株 (700株)
エストラスト	10,300	515.00	5,304,500	
フージャースHD	91,500	521.00	47,671,500	貸付株式数 30,600株
オープンハウス	94,300	2,540.00	239,522,000	
東急不動産HD	1,571,000	570.00	895,470,000	
飯田GHD	601,200	2,019.00	1,213,822,800	

ムゲンエステート	18,000	856.00	15,408,000	
帝国繊維	73,400	1,283.00	94,172,200	
ブックオフコーポレーション	38,300	818.00	31,329,400	貸付株式数 14,000株
日本コークス工業	561,900	59.00	33,152,100	
ゴルフダイジェスト・オン	16,600	986.00	16,367,600	
ミタチ産業	15,100	534.00	8,063,400	
あさひ	48,500	1,526.00	74,011,000	貸付株式数 19,200株 (19,200株)
日本調剤	14,800	4,495.00	66,526,000	貸付株式数 5,700株 (800株)
コスモス薬品	32,700	19,690.00	643,863,000	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
シップヘルスケアHD	132,100	3,105.00	410,170,500	
トーエル	32,900	789.00	25,958,100	
一六堂	14,200	316.00	4,487,200	
ソフトクリエイイトHD	29,100	973.00	28,314,300	
セブン&アイ・HLDGS	2,711,100	4,078.00	11,055,865,800	貸付株式数 100,000株
薬王堂	11,500	5,100.00	58,650,000	
クリエイイト・レストランツ・ホール	174,600	955.00	166,743,000	
明治電機工業	18,500	958.00	17,723,000	貸付株式数 1,600株
ツルハホールディングス	148,100	11,770.00	1,743,137,000	
デリカフーズ	12,400	959.00	11,891,600	貸付株式数 4,700株
スターティア	11,400	463.00	5,278,200	
サンマルクホールディングス	51,100	3,015.00	154,066,500	
フェリシモ	16,700	1,023.00	17,084,100	
トリドール	80,100	3,055.00	244,705,500	
クスリのアオキ	54,600	4,925.00	268,905,000	
帝人	2,817,000	355.00	1,000,035,000	
東レ	4,991,000	882.00	4,402,062,000	
クラレ	1,096,900	1,201.00	1,317,376,900	貸付株式数 200,000株
旭化成	4,292,000	698.50	2,997,962,000	
サカイオーベックス	167,000	132.00	22,044,000	
稲葉製作所	38,000	1,364.00	51,832,000	貸付株式数 9,800株
宮地エンジニアリングG	195,000	127.00	24,765,000	貸付株式数 27,000株
トーカロ	48,700	1,691.00	82,351,700	
アルファCO	20,800	910.00	18,928,000	
SUMCO	545,900	597.00	325,902,300	貸付株式数 206,200株

川田テクノロジーズ	12,300	3,105.00	38,191,500	貸付株式数 4,600株 (4,600株)
シーアールイー	4,400	2,549.00	11,215,600	
住江織物	163,000	179.00	29,177,000	
日本フェルト	37,900	451.00	17,092,900	
イチカワ	42,000	260.00	10,920,000	
エコナックホールディングス	190,000	38.00	7,220,000	貸付株式数 73,000株
日東製網	72,000	162.00	11,664,000	
芦森工業	136,000	153.00	20,808,000	貸付株式数 24,000株
アツギ	539,000	105.00	56,595,000	
ダイニック	118,000	149.00	17,582,000	
共和レザー	45,800	751.00	34,395,800	
セーレン	173,400	906.00	157,100,400	
東海染工	87,000	112.00	9,744,000	
小松精練	105,400	666.00	70,196,400	
ワコールホールディングス	411,000	1,010.00	415,110,000	
ホギメディカル	43,600	7,060.00	307,816,000	
レナウン	188,200	104.00	19,572,800	貸付株式数 59,000株
クラウドディア	16,100	492.00	7,921,200	貸付株式数 6,200株
T S Iホールディングス	310,500	529.00	164,254,500	
T I S	215,600	2,230.00	480,788,000	
ネオス	17,400	554.00	9,639,600	貸付株式数 6,700株
電算システム	21,000	1,403.00	29,463,000	貸付株式数 8,100株 (600株)
グリー	395,300	576.00	227,692,800	
コーエーテクモHD	154,000	1,811.00	278,894,000	
三菱総合研究所	25,700	3,025.00	77,742,500	
ボルテージ	11,600	1,128.00	13,084,800	貸付株式数 4,500株
電算	6,500	1,884.00	12,246,000	貸付株式数 2,400株
A G S	13,200	972.00	12,830,400	貸付株式数 1,800株
ファインデックス	43,300	1,260.00	54,558,000	貸付株式数 13,300株
ヒト・コミュニケーションズ	13,600	1,797.00	24,439,200	貸付株式数 5,200株 (4,200株)
ブレインパッド	8,700	1,061.00	9,230,700	貸付株式数 2,000株
K L a b	100,600	767.00	77,160,200	貸付株式数 38,200株 (3,200株)
ポルトゥウィン・ピットクル	43,800	738.00	32,324,400	貸付株式数 15,100株
イーブックイニシアティブ	12,900	832.00	10,732,800	貸付株式数 5,100株

ネクソン	624,400	1,477.00	922,238,800		
アイスタイル	100,100	745.00	74,574,500	貸付株式数	14,300株 (4,000株)
エムアップ	15,200	579.00	8,800,800		
エイチーム	34,700	1,832.00	63,570,400	貸付株式数	9,300株 (9,300株)
テクノスジャパン	18,100	1,930.00	34,933,000	貸付株式数	4,800株
e n i s h	19,000	566.00	10,754,000	貸付株式数	1,600株 (900株)
コロプラ	181,200	1,988.00	360,225,600	貸付株式数	68,600株 (68,600株)
モバイルクリエイト	39,200	335.00	13,132,000	貸付株式数	14,000株 (6,900株)
オルトプラス	25,700	333.00	8,558,100	貸付株式数	9,000株 (500株)
ブロードリーフ	65,400	948.00	61,999,200		
ハーツユナイテッドグループ	18,800	3,240.00	60,912,000	貸付株式数	6,900株
メディアドゥ	13,200	1,811.00	23,905,200		
ブイキューブ	40,900	792.00	32,392,800	貸付株式数	16,200株 (4,000株)
サイバーリンクス	9,000	982.00	8,838,000		
ディー・エル・イー	17,300	889.00	15,379,700	貸付株式数	3,200株 (3,200株)
VOYAGE GROUP	20,000	1,044.00	20,880,000	貸付株式数	5,000株
オプティム	5,000	4,740.00	23,700,000		
特種東海製紙	405,000	356.00	144,180,000		
ベリサーブ	6,900	3,315.00	22,873,500	貸付株式数	2,600株 (2,600株)
ティーガイア	63,300	1,439.00	91,088,700		
日本アジアグループ	69,500	387.00	26,896,500		
豆蔵ホールディングス	50,800	918.00	46,634,400		
テクマトリックス	28,700	2,310.00	66,297,000	貸付株式数	10,100株
ガンホー・オンライン・エンター	1,461,400	283.00	413,576,200	貸付株式数	581,900株 (138,300株)
GMOペイメントゲートウェイ	53,300	5,540.00	295,282,000	貸付株式数	10,000株 (10,000株)
ザッパラス	37,700	359.00	13,534,300		
インターネットイニシアティブ	104,700	2,054.00	215,053,800		

さくらインターネット	41,000	812.00	33,292,000	貸付株式数 12,100株 (2,300株)
GMOクラウド	13,000	1,015.00	13,195,000	
SRAホールディングス	38,200	2,068.00	78,997,600	
MINORIソリューションズ	11,500	843.00	9,694,500	
システムインテグレータ	8,200	634.00	5,198,800	
朝日ネット	58,100	411.00	23,879,100	
コムチュア	10,300	3,495.00	35,998,500	
サイバーコム	7,100	791.00	5,616,100	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
王子ホールディングス	2,693,000	384.00	1,034,112,000	
日本製紙	356,600	1,801.00	642,236,600	貸付株式数 136,200株
三菱製紙	1,047,000	66.00	69,102,000	
北越紀州製紙	429,300	738.00	316,823,400	
中越パルプ	282,000	200.00	56,400,000	貸付株式数 99,000株 (92,000株)
巴川製紙	96,000	168.00	16,128,000	
大王製紙	306,200	1,120.00	342,944,000	貸付株式数 116,600株
gumi	65,000	810.00	52,650,000	貸付株式数 24,900株 (700株)
パイプドHD	7,500	946.00	7,095,000	
レンゴー	600,000	693.00	415,800,000	
トーモク	197,000	287.00	56,539,000	
ザ・パック	49,000	2,631.00	128,919,000	
昭和電工	460,000	909.00	418,140,000	
住友化学	5,067,000	396.00	2,006,532,000	
日本化成	117,000	101.00	11,817,000	
住友精化	129,000	590.00	76,110,000	
日産化学	411,400	3,070.00	1,262,998,000	
ラサ工業	277,000	91.00	25,207,000	貸付株式数 48,000株
クレハ	519,000	359.00	186,321,000	
多木化学	40,000	640.00	25,600,000	
テイカ	111,000	444.00	49,284,000	
石原産業	1,263,000	59.00	74,517,000	
片倉コープアグリ	75,000	193.00	14,475,000	貸付株式数 16,000株
日東エフシー	41,300	814.00	33,618,200	
日本曹達	449,000	385.00	172,865,000	
東ソー	1,861,000	438.00	815,118,000	

トクヤマ	1,132,000	286.00	323,752,000	貸付株式数 221,000株 (36,000株)
セントラル硝子	750,000	419.00	314,250,000	
東亜合成	432,600	941.00	407,076,600	
大阪ソーダ	301,000	418.00	125,818,000	
関東電化	149,000	1,033.00	153,917,000	貸付株式数 27,000株 (26,000株)
デンカ	1,430,000	400.00	572,000,000	
イビデン	403,900	1,082.00	437,019,800	
信越化学	1,233,500	5,901.00	7,278,883,500	
日本カ - バイド	249,000	130.00	32,370,000	
堺 化 学	285,000	263.00	74,955,000	
エア・ウォーター	563,000	1,460.00	821,980,000	
大陽日酸	531,900	863.00	459,029,700	
日本化学工業	265,000	193.00	51,145,000	
日本パ - カライジング	353,200	1,093.00	386,047,600	
高压ガス	99,000	627.00	62,073,000	
チタン工業	73,000	160.00	11,680,000	貸付株式数 28,000株
四国化成	90,000	765.00	68,850,000	
戸田工業	129,000	265.00	34,185,000	貸付株式数 33,000株 (24,000株)
ステラ ケミファ	35,600	3,425.00	121,930,000	貸付株式数 13,400株
保土谷化学	197,000	258.00	50,826,000	
日本触媒	100,200	5,740.00	575,148,000	
大日精化	271,000	403.00	109,213,000	
カネカ	931,000	654.00	608,874,000	
協和発酵キリン	823,800	1,769.00	1,457,302,200	
三菱瓦斯化学	1,187,000	506.00	600,622,000	
三井化学	2,922,000	351.00	1,025,622,000	
J S R	646,700	1,328.00	858,817,600	
東京応化工業	138,700	2,464.00	341,756,800	貸付株式数 5,800株
大阪有機化学	49,400	537.00	26,527,800	
三菱ケミカルH L D G S	4,610,600	445.70	2,054,944,420	
日本合成化学	146,000	499.00	72,854,000	
ダイセル	929,400	983.00	913,600,200	
住友ベ - クライト	611,000	447.00	273,117,000	
積水化学	1,562,600	1,274.00	1,990,752,400	
日本ゼオン	583,000	625.00	364,375,000	貸付株式数 36,000株 (36,000株)
アイカ工業	207,000	2,273.00	470,511,000	

宇部興産	3,692,000	163.00	601,796,000	
積水樹脂	106,000	1,437.00	152,322,000	
タキロン	146,000	439.00	64,094,000	
旭有機材	210,000	188.00	39,480,000	
日立化成	340,900	1,812.00	617,710,800	
ニチバン	66,000	745.00	49,170,000	
リケンテクノス	144,700	404.00	58,458,800	貸付株式数 33,400株
大倉工業	158,000	268.00	42,344,000	
積水化成品	170,000	297.00	50,490,000	
群栄化学	176,000	281.00	49,456,000	
タイガース ポリマー	35,400	477.00	16,885,800	
ミライアル	26,600	724.00	19,258,400	貸付株式数 5,400株
ダイキアクシス	11,500	802.00	9,223,000	
ダイキョーニシカワ	89,000	1,126.00	100,214,000	
日本化薬	448,000	916.00	410,368,000	
カーリットホールディングス	62,700	452.00	28,340,400	
E P Sホールディングス	78,600	1,241.00	97,542,600	
レグス	12,200	680.00	8,296,000	
プレステージ・インター	57,000	1,529.00	87,153,000	
フェイス	15,500	1,034.00	16,027,000	貸付株式数 6,000株
ハイマックス	7,800	1,074.00	8,377,200	
アミューズ	36,500	1,757.00	64,130,500	貸付株式数 13,600株
野村総合研究所	454,700	3,475.00	1,580,082,500	
ドリームインキュベータ	21,800	1,852.00	40,373,600	貸付株式数 1,500株 (600株)
サイバネットシステム	52,800	662.00	34,953,600	貸付株式数 20,000株
クイック	36,600	788.00	28,840,800	
T A C	39,100	184.00	7,194,400	貸付株式数 11,400株
C Eホールディングス	8,900	905.00	8,054,500	貸付株式数 3,400株
ケネディクス	925,800	379.00	350,878,200	
電通	764,700	4,435.00	3,391,444,500	
インテージホールディングス	35,000	1,563.00	54,705,000	
テイクアンドギヴニーズ	33,600	388.00	13,036,800	
東邦システムサイエンス	17,300	600.00	10,380,000	
びあ	19,700	2,112.00	41,606,400	貸付株式数 7,200株
イオンファンタジー	24,800	2,669.00	66,191,200	貸付株式数 9,100株 (9,100株)
ソースネクスト	34,000	496.00	16,864,000	貸付株式数 11,000株

シーティーエス	18,800	758.00	14,250,400	
ネクシィーズグループ	26,100	1,239.00	32,337,900	貸付株式数 9,300株 (2,200株)
メディカルシステムネット ワーク	75,500	456.00	34,428,000	
ティー・ワイ・オー	116,200	164.00	19,056,800	
日本精化	56,400	736.00	41,510,400	
扶桑化学工業	44,100	1,517.00	66,899,700	
A D E K A	339,800	1,161.00	394,507,800	
日油	518,000	803.00	415,954,000	
ミヨシ油脂	269,000	115.00	30,935,000	貸付株式数 92,000株
新日本理化	108,200	131.00	14,174,200	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
ハリマ化成グループ	57,900	477.00	27,618,300	
花 王	1,849,700	5,827.00	10,778,201,900	
第一工業製薬	147,000	313.00	46,011,000	
ニイタカ	9,100	1,312.00	11,939,200	
三洋化成	196,000	755.00	147,980,000	
武田薬品	2,739,500	4,253.00	11,651,093,500	貸付株式数 101,600株
アステラス製薬	7,701,300	1,603.50	12,349,034,550	貸付株式数 32,800株
大日本住友製薬	487,800	1,874.00	914,137,200	貸付株式数 186,500株
塩野義製薬	1,002,600	5,539.00	5,553,401,400	
田辺三菱製薬	802,300	1,834.00	1,471,418,200	
わかもと製薬	71,000	220.00	15,620,000	
あすか製薬	88,300	1,717.00	151,611,100	
日本新薬	154,900	5,320.00	824,068,000	
ビオフェルミン製薬	10,300	2,708.00	27,892,400	貸付株式数 3,000株
中外製薬	685,100	3,680.00	2,521,168,000	貸付株式数 262,500株
科研製薬	118,800	6,900.00	819,720,000	
エーザイ	846,800	5,509.00	4,665,021,200	貸付株式数 47,500株
理研ビタミン	19,700	4,905.00	96,628,500	
ロート製薬	337,900	1,506.00	508,877,400	
小野薬品	1,562,100	3,952.00	6,173,419,200	
久光製薬	213,700	6,020.00	1,286,474,000	
有機合成薬品	41,000	220.00	9,020,000	
持田製薬	47,200	8,560.00	404,032,000	
参天製薬	1,267,900	1,635.00	2,073,016,500	
扶桑薬品	211,000	274.00	57,814,000	
日本ケミファ	91,000	439.00	39,949,000	
ツムラ	217,100	2,779.00	603,320,900	

日医工	160,500	1,995.00	320,197,500	
テ ル モ	1,006,800	4,495.00	4,525,566,000	貸付株式数 181,400株
みらかホールディングス	175,500	4,470.00	784,485,000	
キッセイ薬品工業	122,800	2,003.00	245,968,400	
生化学工業	128,600	1,601.00	205,888,600	
栄研化学	57,200	2,305.00	131,846,000	
日水製薬	29,400	1,111.00	32,663,400	
鳥居薬品	47,500	2,307.00	109,582,500	
J C Rファーマ	52,800	2,970.00	156,816,000	貸付株式数 18,600株 (14,600株)
東和薬品	31,900	4,820.00	153,758,000	
富士製薬工業	21,300	2,331.00	49,650,300	
沢井製薬	116,900	7,920.00	925,848,000	
ゼリア新薬工業	142,100	1,544.00	219,402,400	
第一三共	2,313,400	2,547.50	5,893,386,500	
キョーリン製薬HD	184,300	2,050.00	377,815,000	
大幸薬品	35,000	1,591.00	55,685,000	貸付株式数 10,000株 (9,300株)
ダイト	35,300	2,873.00	101,416,900	
大塚ホールディングス	1,478,800	4,835.00	7,149,998,000	
大正製薬HD	165,600	10,730.00	1,776,888,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
ペプチドリーム	111,600	5,550.00	619,380,000	貸付株式数 42,600株
大日本塗料	405,000	181.00	73,305,000	
日本ペイントHOLD	531,600	2,320.00	1,233,312,000	
関西ペイント	779,100	1,927.00	1,501,325,700	貸付株式数 142,700株 (101,000株)
神東塗料	46,000	160.00	7,360,000	
中国塗料	179,000	598.00	107,042,000	
日本特殊塗料	48,600	988.00	48,016,800	
藤倉化成	94,400	535.00	50,504,000	
太陽ホールディングス	50,500	2,956.00	149,278,000	
D I C	272,600	2,078.00	566,462,800	
サカティンクス	142,000	1,130.00	160,460,000	
東洋インキSCホールディ ン	665,000	413.00	274,645,000	
T & K T O K A	50,700	797.00	40,407,900	
アルプス技研	27,100	1,908.00	51,706,800	
サニックス	109,300	144.00	15,739,200	貸付株式数 45,600株 (7,000株)

ダイオーズ	11,200	940.00	10,528,000	貸付株式数	4,300株
日本空調サービス	61,500	516.00	31,734,000		
オリエンタルランド	741,700	6,359.00	4,716,470,300		
フォーカスシステムズ	23,100	440.00	10,164,000		
ダスキン	177,000	1,692.00	299,484,000		
パーク24	327,800	3,355.00	1,099,769,000	貸付株式数	59,100株
明光ネットワークジャパン	81,500	1,261.00	102,771,500	貸付株式数	7,300株 (7,300株)
ファルコホールディングス	31,400	1,317.00	41,353,800		
クレスコ	13,700	2,333.00	31,962,100		
フジ・メディア・HD	676,500	1,110.00	750,915,000		
秀英予備校	11,200	367.00	4,110,400	貸付株式数	4,200株
田谷	10,400	672.00	6,988,800	貸付株式数	3,700株 (2,500株)
ラウンドワン	216,500	831.00	179,911,500		
リゾートトラスト	288,500	2,095.00	604,407,500	貸付株式数	6,300株
オービック	223,700	5,550.00	1,241,535,000		
ジャストシステム	120,100	843.00	101,244,300		
TDCソフトウェアエンジニア	27,700	583.00	16,149,100		
ヤフー	4,648,700	452.00	2,101,212,400	貸付株式数	36,100株 (36,100株)
ビー・エム・エル	40,800	4,785.00	195,228,000		
ワタベウェディング	18,400	411.00	7,562,400	貸付株式数	6,800株
トレンドマイクロ	319,400	3,630.00	1,159,422,000		
りらいあコミュニケーション	112,600	1,012.00	113,951,200		
インフォメーションディベロ	11,200	942.00	10,550,400		
リソー教育	130,000	407.00	52,910,000	貸付株式数	20,700株
日本オラクル	103,900	5,580.00	579,762,000		
早稲田アカデミー	8,100	851.00	6,893,100		
アルファシステムズ	19,900	1,656.00	32,954,400		
フューチャー	79,900	750.00	59,925,000		
CAC HOLDINGS	48,600	778.00	37,810,800		
ソフトバンク・テクノ	16,500	1,814.00	29,931,000		
トーセ	15,800	631.00	9,969,800	貸付株式数	6,000株
ユー・エス・エス	831,500	1,589.00	1,321,253,500		
オービックビジネスC	33,300	4,700.00	156,510,000	貸付株式数	12,500株 (12,500株)
伊藤忠テクノソリューションズ	147,700	2,188.00	323,167,600		

アイティフォー	85,900	501.00	43,035,900	
東京個別指導学院	34,800	633.00	22,028,400	貸付株式数 12,100株
東計電算	10,400	1,748.00	18,179,200	
サイバーエージェント	178,500	6,200.00	1,106,700,000	
楽天	3,246,600	1,050.00	3,408,930,000	貸付株式数 82,500株
エクスネット	5,400	1,492.00	8,056,800	
テー・オー・ダブリュー	52,200	575.00	30,015,000	貸付株式数 14,600株
大塚商会	174,700	4,765.00	832,445,500	
総合メディカル	31,800	3,695.00	117,501,000	
サイボウズ	87,800	366.00	32,134,800	
ソフトブレーン	95,600	482.00	46,079,200	貸付株式数 36,300株
セントラルスポーツ	24,300	2,305.00	56,011,500	
パラカ	19,900	1,447.00	28,795,300	貸付株式数 4,600株
電通国際情報S	41,100	1,692.00	69,541,200	
デジタルガレージ	102,000	2,147.00	218,994,000	
イーエムシステムズ	20,100	1,245.00	25,024,500	貸付株式数 2,200株
ウェザーニューズ	20,000	3,150.00	63,000,000	貸付株式数 6,900株
C I J	58,000	447.00	25,926,000	貸付株式数 7,300株
東洋ビジネスエンジ	5,800	1,371.00	7,951,800	
日本エンタープライズ	60,300	294.00	17,728,200	貸付株式数 21,600株 (6,900株)
WOWOW	31,800	2,287.00	72,726,600	
フュージョンパートナー	38,100	538.00	20,497,800	貸付株式数 12,800株
フルキャストホールディングス	61,800	821.00	50,737,800	
富士フイルムHLDGS	1,574,200	3,724.00	5,862,320,800	
コニカミノルタ	1,642,400	715.00	1,174,316,000	
資生堂	1,305,400	2,885.50	3,766,731,700	
ライオン	814,000	1,689.00	1,374,846,000	
高砂香料	45,900	2,695.00	123,700,500	
マンダム	62,900	4,710.00	296,259,000	
ミルボン	40,900	4,705.00	192,434,500	
ファンケル	159,300	1,404.00	223,657,200	貸付株式数 21,100株 (21,100株)
コーセー	110,600	8,590.00	950,054,000	
コタ	23,300	1,109.00	25,839,700	
シーズ・ホールディングス	87,400	2,281.00	199,359,400	貸付株式数 21,400株 (21,400株)
シーボン	7,100	2,060.00	14,626,000	貸付株式数 2,300株
ポーラ・オルビスHD	70,300	9,700.00	681,910,000	

ノエビアホールディングス	44,000	3,160.00	139,040,000	
アジュバンコスメジャパン	11,800	887.00	10,466,600	貸付株式数 1,500株
エステー	47,500	1,121.00	53,247,500	
アグロカネショウ	28,500	1,029.00	29,326,500	
コニシ	107,600	1,268.00	136,436,800	
長谷川香料	88,200	1,785.00	157,437,000	
星光PMC	39,000	999.00	38,961,000	貸付株式数 15,900株
小林製薬	208,200	4,430.00	922,326,000	
荒川化学工業	57,900	899.00	52,052,100	
メック	53,100	856.00	45,453,600	貸付株式数 20,200株 (20,200株)
日本高純度化学	18,300	2,013.00	36,837,900	
タカラバイオ	134,500	1,351.00	181,709,500	
JCU	18,300	3,005.00	54,991,500	
新田ゼラチン	45,600	760.00	34,656,000	貸付株式数 15,800株
OATアグリオ	7,300	1,236.00	9,022,800	貸付株式数 2,100株
デクセリアルズ	187,800	699.00	131,272,200	貸付株式数 56,400株
アース製薬	49,600	4,960.00	246,016,000	
イハラケミカル	105,600	916.00	96,729,600	
北興化学	67,000	273.00	18,291,000	
大成ラミック	18,500	2,783.00	51,485,500	貸付株式数 2,900株
クミアイ化学	143,300	563.00	80,677,900	貸付株式数 54,400株 (54,400株)
日本農薬	157,100	455.00	71,480,500	貸付株式数 59,800株 (11,100株)
昭和シエル石油	693,600	889.00	616,610,400	
富士興産	26,800	405.00	10,854,000	
ニチレキ	81,600	632.00	51,571,200	
東燃ゼネラル石油	1,038,000	917.00	951,846,000	
ユシロ化学	38,300	1,323.00	50,670,900	
ピーピー・カストロール	29,800	1,167.00	34,776,600	貸付株式数 9,900株
富士石油	159,200	311.00	49,511,200	
MORESCO	19,800	1,105.00	21,879,000	
出光興産	359,800	1,954.00	703,049,200	
JXホールディングス	8,144,900	381.00	3,103,206,900	
コスモエネルギーHLDGS	207,600	1,172.00	243,307,200	
横浜ゴム	416,400	1,237.00	515,086,800	貸付株式数 3,200株
東洋ゴム	316,000	1,048.00	331,168,000	
ブリヂストン	2,321,200	3,140.00	7,288,568,000	

住友ゴム	645,000	1,300.00	838,500,000	
藤倉ゴム	56,900	464.00	26,401,600	貸付株式数 20,900株
オカモト	193,000	1,116.00	215,388,000	
アキレス	570,000	124.00	70,680,000	
フコク	27,000	708.00	19,116,000	
ニッタ	75,000	2,257.00	169,275,000	
クリエートメディック	19,700	798.00	15,720,600	
住友理工	149,300	802.00	119,738,600	
三ツ星ベルト	152,000	788.00	119,776,000	
バンドー化学	254,000	467.00	118,618,000	
鬼怒川ゴム	137,000	776.00	106,312,000	
旭硝子	3,633,000	490.00	1,780,170,000	貸付株式数 1,194,000株
日本板硝子	3,348,000	60.00	200,880,000	
石塚硝子	87,000	148.00	12,876,000	
有沢製作所	101,800	491.00	49,983,800	
日本山村硝子	286,000	153.00	43,758,000	
日本電気硝子	1,425,000	418.00	595,650,000	
オハラ	27,800	486.00	13,510,800	貸付株式数 9,800株
住友大阪セメント	1,366,000	448.00	611,968,000	
太平洋セメント	4,298,000	248.00	1,065,904,000	
デイ・シイ	62,400	339.00	21,153,600	
リゾートソリューション	62,000	292.00	18,104,000	
日本ヒユ-ム	64,500	524.00	33,798,000	
日本コンクリ-ト	142,800	280.00	39,984,000	貸付株式数 49,700株 (35,600株)
三谷セキサン	35,400	2,036.00	72,074,400	貸付株式数 12,100株
アジアパイルHD	86,400	359.00	31,017,600	
東海カーボン	589,000	251.00	147,839,000	
日本カーボン	349,000	181.00	63,169,000	貸付株式数 128,000株 (51,000株)
東洋炭素	39,500	1,252.00	49,454,000	貸付株式数 2,400株
ノリタケ	397,000	228.00	90,516,000	
TOTO	505,600	3,900.00	1,971,840,000	貸付株式数 24,700株
日本碍子	869,100	1,918.00	1,666,933,800	貸付株式数 63,000株
日本特殊陶業	593,800	1,393.00	827,163,400	
ダントーホールディングス	72,000	182.00	13,104,000	貸付株式数 26,000株
MARUWA	25,900	3,060.00	79,254,000	
品川リフラクトリーズ	163,000	176.00	28,688,000	
黒崎播磨	140,000	231.00	32,340,000	
ヨータイ	36,000	273.00	9,828,000	貸付株式数 12,000株

イソライト	35,300	183.00	6,459,900	貸付株式数	10,700株
東京窯業	79,200	148.00	11,721,600		
ニッカトー	26,000	355.00	9,230,000		
フジインコーポレーテッド	59,700	1,435.00	85,669,500	貸付株式数	22,400株 (22,400株)
エーアンドエーマテリアル	130,000	77.00	10,010,000		
ニチアス	356,000	800.00	284,800,000		
新日鐵住金	3,100,800	1,864.00	5,779,891,200		
神戸製鋼所	12,651,000	82.00	1,037,382,000		
中山製鋼所	794,000	48.00	38,112,000		
合同製鐵	397,000	148.00	58,756,000		
J F Eホールディングス	1,880,500	1,242.50	2,336,521,250		
日新製鋼	315,100	1,242.00	391,354,200		
東京製鐵	382,900	558.00	213,658,200		
共英製鋼	74,500	1,556.00	115,922,000		
大和工業	152,600	2,194.00	334,804,400		
東京鐵鋼	138,000	350.00	48,300,000		
大阪製鐵	44,100	1,639.00	72,279,900		
淀川製鋼所	102,500	2,433.00	249,382,500		
東洋鋼鈹	167,900	231.00	38,784,900		
丸一鋼管	230,600	3,510.00	809,406,000		
モリ工業	102,000	278.00	28,356,000		
大同特殊鋼	1,142,000	349.00	398,558,000		
日本高周波	287,000	64.00	18,368,000		
日本冶金工	512,400	111.00	56,876,400	貸付株式数	193,800株 (117,800株)
山陽特殊製鋼	413,000	484.00	199,892,000		
愛知製鋼	409,000	432.00	176,688,000		
日立金属	789,000	954.00	752,706,000		
日本金属	161,000	88.00	14,168,000	貸付株式数	54,000株
大平洋金属	483,000	278.00	134,274,000	貸付株式数	7,000株
新日本電工	391,900	150.00	58,785,000		
栗本鉄工所	341,000	151.00	51,491,000		
虹 技	87,000	144.00	12,528,000	貸付株式数	26,000株
日本鑄鉄管	67,000	127.00	8,509,000		
日本製鋼所	1,128,000	436.00	491,808,000		
三菱製鋼	483,000	146.00	70,518,000		
日亜鋼業	95,900	207.00	19,851,300		
日本精線	42,000	382.00	16,044,000	貸付株式数	16,000株
大紀アルミニウム	99,000	282.00	27,918,000		

日本軽金属HD	1,565,100	216.00	338,061,600	貸付株式数	596,600株
三井金属	1,764,000	173.00	305,172,000		
東邦亜鉛	366,000	333.00	121,878,000	貸付株式数	137,000株
三菱マテリアル	4,297,000	241.00	1,035,577,000		
住友鉱山	1,899,000	1,031.00	1,957,869,000		
DOWAホールディングス	889,000	526.00	467,614,000		
古河機金	1,069,000	123.00	131,487,000		
エス・サイエンス	317,000	31.00	9,827,000		
大阪チタニウム	66,100	1,197.00	79,121,700	貸付株式数	25,400株 (6,600株)
東邦チタニウム	117,300	629.00	73,781,700	貸付株式数	44,100株 (6,500株)
UACJ	968,000	247.00	239,096,000		
古河電工	2,169,000	243.00	527,067,000		
住友電工	2,753,100	1,244.00	3,424,856,400		
フジクラ	960,000	435.00	417,600,000		
昭和電線HLDGS	838,000	53.00	44,414,000		
東京特殊電線	8,800	702.00	6,177,600		
タツタ電線	144,300	280.00	40,404,000		
沖電線	72,000	169.00	12,168,000	貸付株式数	27,000株
カナレ電気	9,800	1,823.00	17,865,400	貸付株式数	3,700株
平河ビューテック	31,800	800.00	25,440,000	貸付株式数	6,400株
リョービ	424,000	394.00	167,056,000		
アーレステイ	81,700	667.00	54,493,900		
アサヒHD	103,600	1,541.00	159,647,600		
東洋製罐グループHD	489,400	1,921.00	940,137,400		
ホッカンホールディングス	172,000	292.00	50,224,000		
コロナ	37,400	1,027.00	38,409,800		
横河ブリッジHLDGS	132,000	982.00	129,624,000		
OSJBHD	150,600	181.00	27,258,600	貸付株式数	19,100株
駒井ハルテック	111,000	185.00	20,535,000		
高田機工	54,000	179.00	9,666,000		
三和ホールディングス	684,200	908.00	621,253,600		
文化シャツタ-	193,100	768.00	148,300,800		
三協立山	91,400	1,450.00	132,530,000		
アルインコ	49,900	949.00	47,355,100		
東洋シャツタ-	15,400	492.00	7,576,800		
LIXILグループ	958,500	1,640.00	1,571,940,000		
日本ファイルコン	49,900	418.00	20,858,200		
ノーリツ	135,700	1,775.00	240,867,500		

長府製作所	74,100	2,424.00	179,618,400	
リンナイ	127,900	8,990.00	1,149,821,000	
ユニプレス	137,500	1,478.00	203,225,000	
ダイニチ工業	36,500	591.00	21,571,500	
日東精工	91,000	266.00	24,206,000	
三洋工業	78,000	158.00	12,324,000	
岡 部	143,900	708.00	101,881,200	
ジーテクト	73,200	1,242.00	90,914,400	
中国工業	9,500	651.00	6,184,500	
東 プ レ	133,100	2,117.00	281,772,700	
高周波熱錬	130,200	677.00	88,145,400	
東京製綱	471,000	148.00	69,708,000	
サンコール	37,900	430.00	16,297,000	
モリテックスチル	36,000	238.00	8,568,000	貸付株式数 8,000株
パイオラックス	35,100	4,215.00	147,946,500	
日本発条	649,400	780.00	506,532,000	
中央発條	81,000	272.00	22,032,000	
アドバネクス	11,600	1,111.00	12,887,600	
三浦工業	307,400	2,216.00	681,198,400	
タ ク マ	256,000	803.00	205,568,000	
テクノプロ・ホールディング グ	105,200	3,315.00	348,738,000	
インターワークス	10,900	1,196.00	13,036,400	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
K e e P e r 技研	7,100	1,501.00	10,657,100	貸付株式数 900株
ファーストロジック	3,300	1,746.00	5,761,800	
リブセンス	46,400	407.00	18,884,800	貸付株式数 17,400株 (800株)
ジャパンマテリアル	29,100	3,900.00	113,490,000	貸付株式数 10,800株 (4,800株)
ベクトル	19,400	2,996.00	58,122,400	貸付株式数 7,400株
ウチヤマホールディングス	36,800	422.00	15,529,600	貸付株式数 12,400株
サクセスホールディングス	5,800	1,167.00	6,768,600	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
キャリアリンク	16,300	927.00	15,110,100	貸付株式数 5,000株
I B J	50,000	602.00	30,100,000	
アサンテ	26,600	1,464.00	38,942,400	
N・フィールド	31,600	1,812.00	57,259,200	貸付株式数 9,500株 (1,000株)

M & Aキャピタルパートナー	7,900	2,292.00	18,106,800	貸付株式数	1,800株
ライドオン・エクスプレス	13,400	1,412.00	18,920,800	貸付株式数	3,800株
E R Iホールディングス	16,000	751.00	12,016,000	貸付株式数	6,100株
アビスト	9,600	2,029.00	19,478,400		
ウィルグループ	14,100	921.00	12,986,100	貸付株式数	3,200株
日本ビューホテル	9,000	1,249.00	11,241,000	貸付株式数	2,600株
リクルートホールディングス	1,383,500	3,760.00	5,201,960,000		
エラン	6,900	1,329.00	9,170,100		
ツガミ	181,000	400.00	72,400,000		
オークマ	450,000	640.00	288,000,000		
東芝機械	381,000	292.00	111,252,000		
アマダホールディングス	1,004,100	967.00	970,964,700		
アイダエンジニア	182,700	801.00	146,342,700		
滝澤鉄工所	197,000	117.00	23,049,000		
富士機械製造	226,600	918.00	208,018,800	貸付株式数	8,400株
牧野フライス	346,000	497.00	171,962,000		
オーエスジー	314,300	1,552.00	487,793,600	貸付株式数	116,900株 (72,400株)
ダイジェット	72,000	122.00	8,784,000		
旭ダイヤモンド	187,700	735.00	137,959,500		
D M G森精機	383,300	927.00	355,319,100		
ソディック	159,500	749.00	119,465,500		
ディスコ	87,800	8,750.00	768,250,000		
日東工器	40,900	2,086.00	85,317,400		
パンチ工業	28,900	715.00	20,663,500		
日本郵政	2,018,200	1,188.00	2,397,621,600		
ベルシステム24HLDGS	123,300	767.00	94,571,100	貸付株式数	42,700株 (6,000株)
豊田自動織機	598,300	3,750.00	2,243,625,000	貸付株式数	28,900株
豊和工業	39,800	517.00	20,576,600		
OKK	284,000	93.00	26,412,000		
石川製作所	154,000	68.00	10,472,000	貸付株式数	83,000株
東洋機械金属	50,700	345.00	17,491,500	貸付株式数	5,200株
津田駒工業	151,000	113.00	17,063,000	貸付株式数	46,000株
エンシュウ	153,000	54.00	8,262,000	貸付株式数	33,000株
島精機製作所	97,700	1,818.00	177,618,600		
N Cホールディングス	20,500	834.00	17,097,000		
フリー	12,600	2,640.00	33,264,000		

ヤマシンフィルタ	12,400	440.00	5,456,000	
日阪製作所	88,400	805.00	71,162,000	
やまびこ	128,600	706.00	90,791,600	
ペガサスミシン製造	73,300	440.00	32,252,000	貸付株式数 5,600株
ナブテスコ	357,900	2,419.00	865,760,100	
三井海洋開発	81,800	1,474.00	120,573,200	
レオン自動機	57,300	540.00	30,942,000	
S M C	206,100	23,200.00	4,781,520,000	
新川	60,500	474.00	28,677,000	
ホソカワミクロン	110,000	518.00	56,980,000	
ユニオンツール	30,400	2,681.00	81,502,400	貸付株式数 11,300株 (11,300株)
オイレス工業	90,000	1,606.00	144,540,000	
日精エーエスビー	23,100	1,650.00	38,115,000	貸付株式数 9,100株 (500株)
サト - ホールディングス	93,500	1,918.00	179,333,000	
日本エアテック	25,900	605.00	15,669,500	貸付株式数 8,400株
日精樹脂工業	50,100	583.00	29,208,300	
オカダアイヨン	12,100	721.00	8,724,100	
ワイエイシイ	28,900	1,443.00	41,702,700	貸付株式数 10,500株 (10,500株)
小松製作所	3,369,700	1,759.00	5,927,302,300	貸付株式数 187,600株 (187,600株)
住友重機械	2,009,000	426.00	855,834,000	
日立建機	308,400	1,378.00	424,975,200	
日 工	96,000	291.00	27,936,000	
巴工業	29,200	1,465.00	42,778,000	貸付株式数 5,000株
井関農機	712,000	214.00	152,368,000	貸付株式数 268,000株 (268,000株)
T O W A	65,000	999.00	64,935,000	
丸山製作所	132,000	155.00	20,460,000	貸付株式数 46,000株
北川鉄工所	327,000	160.00	52,320,000	
シンニッタン	60,800	507.00	30,825,600	
タカキタ	21,000	489.00	10,269,000	
クボタ	3,300,800	1,276.00	4,211,820,800	貸付株式数 500,000株
荏原実業	18,900	1,153.00	21,791,700	
東洋エンジニア	399,000	324.00	129,276,000	
三菱化工機	214,000	179.00	38,306,000	
月島機械	132,300	914.00	120,922,200	
帝国電機製作所	50,100	760.00	38,076,000	

東京機械	276,000	36.00	9,936,000	
新東工業	156,000	692.00	107,952,000	
渋谷工業	56,900	1,625.00	92,462,500	
アイチ コーポレーション	97,900	704.00	68,921,600	
小森コーポレーション	168,800	1,140.00	192,432,000	
鶴見製作所	51,100	1,208.00	61,728,800	
住友精密	101,000	298.00	30,098,000	
酒井重工業	118,000	159.00	18,762,000	
荏原製作所	1,524,000	559.00	851,916,000	
石井鉄工所	91,000	144.00	13,104,000	
西島製作所	75,000	1,022.00	76,650,000	
北越工業	76,100	557.00	42,387,700	
千代田化工建	530,000	665.00	352,450,000	
ダイキン工業	956,300	8,029.00	7,678,132,700	
オルガノ	113,000	377.00	42,601,000	
ト - ヨ - カネツ	339,000	196.00	66,444,000	
栗田工業	413,900	2,148.00	889,057,200	
椿本チエイン	393,000	601.00	236,193,000	
大同工業	124,000	185.00	22,940,000	
日 機 装	239,300	629.00	150,519,700	
木村化工機	58,100	285.00	16,558,500	
新興プランテック	151,600	720.00	109,152,000	
アネスト岩田	110,400	861.00	95,054,400	
ダイフク	346,500	1,782.00	617,463,000	
サムコ	15,000	825.00	12,375,000	貸付株式数 3,800株
加藤製作所	141,000	375.00	52,875,000	
油研工業	117,000	161.00	18,837,000	
タダノ	319,300	787.00	251,289,100	
フジテック	192,900	886.00	170,909,400	
C K D	185,100	770.00	142,527,000	
キトー	84,700	751.00	63,609,700	貸付株式数 6,700株
平和	204,100	2,017.00	411,669,700	
理想科学工業	74,000	1,260.00	93,240,000	
S A N K Y O	183,200	3,850.00	705,320,000	
日本金銭機械	59,700	737.00	43,998,900	貸付株式数 22,800株
マースエンジニアリング	38,000	2,107.00	80,066,000	
福島工業	41,100	3,170.00	130,287,000	
オーイズミ	29,300	357.00	10,460,100	貸付株式数 7,100株 (6,900株)

ダイコク電機	28,500	1,458.00	41,553,000	貸付株式数 10,300株 (10,300株)
竹内製作所	120,800	1,031.00	124,544,800	
ア マ ノ	203,800	1,708.00	348,090,400	
J U K I	98,100	780.00	76,518,000	貸付株式数 1,400株
サンデンホールディングス	408,000	262.00	106,896,000	
蛇の目マシン	62,600	511.00	31,988,600	
ブラザー工業	850,700	1,000.00	850,700,000	貸付株式数 30,500株
マックス	92,000	1,163.00	106,996,000	
モリタホールディングス	113,800	1,321.00	150,329,800	
グローリー	224,600	2,704.00	607,318,400	
新晃工業	46,500	1,064.00	49,476,000	
大和冷機工業	105,400	862.00	90,854,800	
セガサミーホールディングス	707,400	1,105.00	781,677,000	
日本ピストンリング	28,800	1,325.00	38,160,000	
リ ケ ン	310,000	300.00	93,000,000	
T P R	81,900	1,800.00	147,420,000	
ツバキ・ナカシマ	74,600	1,089.00	81,239,400	貸付株式数 25,800株
ホシザキ	144,100	9,160.00	1,319,956,000	
大豊工業	52,900	996.00	52,688,400	
日本精工	1,351,400	702.00	948,682,800	
N T N	1,636,000	243.00	397,548,000	
ジェイテクト	701,700	1,041.00	730,469,700	貸付株式数 17,700株
不 二 越	602,000	259.00	155,918,000	貸付株式数 130,000株 (35,000株)
ミネベア	1,058,600	617.00	653,156,200	
日本トムソン	214,000	287.00	61,418,000	
T H K	437,800	1,691.00	740,319,800	
ユーシン精機	26,600	1,594.00	42,400,400	貸付株式数 9,600株 (9,600株)
前澤給装工業	28,300	1,337.00	37,837,100	
イーグル工業	82,900	1,110.00	92,019,000	
前澤工業	48,500	266.00	12,901,000	貸付株式数 15,800株
日本ピラ - 工業	65,000	980.00	63,700,000	
キッツ	296,000	487.00	144,152,000	
日 立	16,756,000	403.30	6,757,694,800	
東 芝	13,829,000	269.50	3,726,915,500	
三菱電機	7,006,000	1,108.00	7,762,648,000	
富士電機	1,983,000	398.00	789,234,000	

東洋電機製造	121,000	238.00	28,798,000	
安川電機	817,100	1,204.00	983,788,400	
シンフォニア テクノロジー	436,000	156.00	68,016,000	
明電舎	595,000	313.00	186,235,000	
オリジン電気	87,000	248.00	21,576,000	
山洋電気	156,000	435.00	67,860,000	
デンヨー	59,800	990.00	59,202,000	
日立工機	178,800	568.00	101,558,400	
三桜工業	85,200	510.00	43,452,000	
マキタ	428,400	6,260.00	2,681,784,000	
東芝テック	475,000	345.00	163,875,000	
芝浦メカトロニクス	96,000	196.00	18,816,000	
マブチモーター	185,800	3,820.00	709,756,000	
日本電産	790,400	7,131.00	5,636,342,400	貸付株式数 30,200株
ユーエムシーエレクトロニクス	7,200	2,485.00	17,892,000	
東光高岳	37,700	1,542.00	58,133,400	貸付株式数 4,500株 (4,500株)
ダブル・スコープ	52,800	1,712.00	90,393,600	貸付株式数 14,200株 (4,000株)
宮越ホールディングス	20,200	496.00	10,019,200	貸付株式数 7,900株
ダイヘン	392,000	437.00	171,304,000	
田淵電機	76,600	321.00	24,588,600	貸付株式数 16,700株
ヤーマン	7,600	1,974.00	15,002,400	
JVCケンウッド	485,800	205.00	99,589,000	
ミマキエンジニアリング	55,400	413.00	22,880,200	貸付株式数 5,600株
第一精工	29,100	923.00	26,859,300	
日新電機	154,300	1,468.00	226,512,400	
大崎電気	111,000	810.00	89,910,000	貸付株式数 19,000株
オムロン	742,100	3,060.00	2,270,826,000	
日東工業	105,100	1,219.00	128,116,900	
I D E C	87,500	886.00	77,525,000	
不二電機工業	5,600	1,395.00	7,812,000	貸付株式数 2,100株
ジーエス・ユアサ コーポ	1,270,000	386.00	490,220,000	
サクサホールディングス	155,000	180.00	27,900,000	貸付株式数 38,000株
メルコホールディングス	37,200	2,127.00	79,124,400	貸付株式数 13,800株
テクノメディカ	13,700	1,442.00	19,755,400	
日本電気	9,035,000	247.00	2,231,645,000	
富士通	6,336,000	343.70	2,177,683,200	

沖 電 気	2,860,000	126.00	360,360,000	
岩崎通信機	325,000	61.00	19,825,000	
電気興業	157,000	443.00	69,551,000	
サンケン電気	365,000	298.00	108,770,000	貸付株式数 136,000株 (136,000株)
ナカヨ	58,000	305.00	17,690,000	貸付株式数 16,000株
アイホン	38,300	1,671.00	63,999,300	
ルネサスエレクトロニクス	342,500	520.00	178,100,000	貸付株式数 35,100株
セイコーエプソン	978,900	1,549.00	1,516,316,100	
ワコム	514,500	380.00	195,510,000	貸付株式数 195,300株 (84,900株)
アルバック	117,300	2,834.00	332,428,200	
アクセル	31,400	653.00	20,504,200	
E I Z O	63,700	2,604.00	165,874,800	
ジャパンディスプレイ	1,237,100	179.00	221,440,900	貸付株式数 470,300株
日本信号	183,600	834.00	153,122,400	
京三製作所	148,000	343.00	50,764,000	
能美防災	75,800	1,429.00	108,318,200	
ホーチキ	48,000	1,163.00	55,824,000	
エレコム	56,400	2,206.00	124,418,400	
日本無線	184,000	250.00	46,000,000	
パナソニック	7,503,500	863.00	6,475,520,500	貸付株式数 627,600株
シャープ	5,569,000	103.00	573,607,000	貸付株式数 781,000株 (37,000株)
アンリツ	397,700	564.00	224,302,800	貸付株式数 151,000株
富士通ゼネラル	184,000	2,231.00	410,504,000	
日立国際電気	142,300	1,584.00	225,403,200	貸付株式数 34,000株
ソ ニ ー	4,633,700	3,013.00	13,961,338,100	貸付株式数 209,000株
T D K	396,700	5,250.00	2,082,675,000	貸付株式数 104,400株
帝国通信工業	141,000	138.00	19,458,000	
ミツミ電機	251,000	381.00	95,631,000	
タムラ製作所	260,000	277.00	72,020,000	
アルプス電気	562,300	1,664.00	935,667,200	貸付株式数 213,300株
池上通信機	191,000	117.00	22,347,000	貸付株式数 73,000株
パイオニア	1,073,900	164.00	176,119,600	貸付株式数 407,400株
日本電波工業	58,600	836.00	48,989,600	
鈴木	23,200	485.00	11,252,000	貸付株式数 5,900株
日本トリム	16,000	7,690.00	123,040,000	貸付株式数 6,400株 (6,400株)

ローランド ディー . ジー .	33,900	1,777.00	60,240,300	
日本コロムビア	20,000	445.00	8,900,000	貸付株式数 1,100株
フオスタ - 電機	84,500	1,552.00	131,144,000	
クラリオン	355,000	222.00	78,810,000	貸付株式数 117,000株 (5,000株)
S M K	176,000	321.00	56,496,000	
ヨコオ	47,300	499.00	23,602,700	
ティアック	476,000	33.00	15,708,000	貸付株式数 6,000株 (6,000株)
ホシデン	200,000	575.00	115,000,000	
ヒロセ電機	105,900	11,870.00	1,257,033,000	
日本航空電子	171,000	1,303.00	222,813,000	
T O A	79,600	912.00	72,595,200	
日立マクセル	108,400	1,323.00	143,413,200	
古野電気	80,200	513.00	41,142,600	
ユニデンホールディングス	188,000	111.00	20,868,000	貸付株式数 72,000株
アルパイン	156,600	943.00	147,673,800	
スミダコーポレーション	53,600	647.00	34,679,200	
アイコム	37,300	1,892.00	70,571,600	
リオン	26,600	1,356.00	36,069,600	
本多通信工業	15,700	705.00	11,068,500	貸付株式数 4,900株
船井電機	65,000	856.00	55,640,000	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
横河電機	658,800	1,151.00	758,278,800	
新電元工業	231,000	305.00	70,455,000	
アズビル	215,100	2,982.00	641,428,200	
東亜ディーケーケー	33,400	441.00	14,729,400	
日本光電工業	275,100	2,881.00	792,563,100	
チ ノ ー	25,300	1,037.00	26,236,100	
共和電業	82,200	310.00	25,482,000	
日本電子材料	27,800	381.00	10,591,800	貸付株式数 4,600株
堀場製作所	124,200	4,295.00	533,439,000	
アドバンテスト	449,400	1,029.00	462,432,600	貸付株式数 171,500株
小野測器	33,400	840.00	28,056,000	
エスベック	66,400	1,178.00	78,219,200	
パナソニックデバイス	57,000	590.00	33,630,000	
キーエンス	148,700	70,710.00	10,514,577,000	
日置電機	35,400	1,818.00	64,357,200	貸付株式数 13,100株
シスメックス	510,200	6,880.00	3,510,176,000	

日本マイクロニクス	112,600	853.00	96,047,800	
メガチップス	66,300	1,069.00	70,874,700	貸付株式数 25,300株 (25,300株)
O B A R A G R O U P	38,800	3,730.00	144,724,000	貸付株式数 14,600株 (14,600株)
イマジカ・ロボットHD	54,300	460.00	24,978,000	貸付株式数 11,700株
澤藤電機	32,000	169.00	5,408,000	貸付株式数 12,000株
デンソー	1,622,600	3,399.00	5,515,217,400	
コーセル	92,300	974.00	89,900,200	
新日本無線	48,400	344.00	16,649,600	
オプテックス	48,800	2,559.00	124,879,200	
千代田インテグレ	35,700	1,782.00	63,617,400	
アイ・オー・データ	19,700	616.00	12,135,200	
レーザーテック	70,400	1,310.00	92,224,000	
スタンレー電気	470,300	2,096.00	985,748,800	
岩崎電気	209,000	125.00	26,125,000	
ウシオ電機	400,200	1,135.00	454,227,000	
岡谷電機	36,600	352.00	12,883,200	
ヘリオステクノH	55,500	331.00	18,370,500	貸付株式数 19,400株
日本セラミック	39,000	1,949.00	76,011,000	貸付株式数 14,300株 (7,500株)
遠藤照明	34,700	914.00	31,715,800	貸付株式数 11,600株
日本デジタル研究所	55,100	1,371.00	75,542,100	
古河電池	44,000	593.00	26,092,000	貸付株式数 11,000株
双信電機	33,400	260.00	8,684,000	
山一電機	56,500	606.00	34,239,000	貸付株式数 21,600株
図 研	47,900	841.00	40,283,900	
日本電子	265,000	352.00	93,280,000	
カ シ オ	659,500	1,422.00	937,809,000	貸付株式数 252,400株 (4,300株)
ファナック	671,800	15,500.00	10,412,900,000	貸付株式数 50,000株
日本シイエムケイ	142,900	389.00	55,588,100	貸付株式数 54,200株 (4,400株)
エンプラス	34,300	2,512.00	86,161,600	
大真空	112,000	255.00	28,560,000	貸付株式数 5,000株
ロ - ム	317,900	3,640.00	1,157,156,000	
浜松ホトニクス	513,000	2,800.00	1,436,400,000	
三井ハイテック	96,100	586.00	56,314,600	
新光電気工業	249,400	468.00	116,719,200	
京 セ ラ	1,078,100	4,613.00	4,973,275,300	貸付株式数 19,800株

協栄産業	77,000	123.00	9,471,000	貸付株式数	29,000株
太陽誘電	321,800	781.00	251,325,800	貸付株式数	8,400株
村田製作所	692,600	10,475.00	7,254,985,000		
ユーシン	87,300	614.00	53,602,200	貸付株式数	33,000株 (33,000株)
双葉電子工業	108,500	1,819.00	197,361,500		
日東電工	531,600	6,173.00	3,281,566,800	貸付株式数	17,700株
北陸電気工業	282,000	102.00	28,764,000		
東海理化電機	193,500	1,360.00	263,160,000		
ニチコン	207,000	626.00	129,582,000		
日本ケミコン	531,000	117.00	62,127,000		
K O A	92,100	699.00	64,377,900		
三井造船	2,549,000	133.00	339,017,000	貸付株式数	21,000株
日立造船	519,300	464.00	240,955,200		
三菱重工業	11,697,000	413.60	4,837,879,200	貸付株式数	1,171,000株
川崎重工業	5,116,000	260.00	1,330,160,000		
I H I	5,052,000	274.00	1,384,248,000	貸付株式数	1,934,000株
名村造船所	198,200	497.00	98,505,400		
サノヤスホールディングス	81,900	161.00	13,185,900	貸付株式数	6,500株
日本車輛	276,000	270.00	74,520,000	貸付株式数	102,000株 (102,000株)
ニチュ三菱フォークリフト	77,900	609.00	47,441,100		
近畿車輛	91,000	254.00	23,114,000	貸付株式数	5,000株
F P G	216,400	993.00	214,885,200	貸付株式数	33,200株
島根銀行	12,400	1,140.00	14,136,000		
じもとホールディングス	470,700	136.00	64,015,200		
全国保証	169,000	3,845.00	649,805,000		
足利ホールディングス	480,300	301.00	144,570,300		
東京T YフィナンシャルG	90,400	2,017.00	182,336,800		
九州フィナンシャルG	996,000	487.00	485,052,000		
かんぼ生命保険	258,700	1,927.00	498,514,900	貸付株式数	97,800株
ゆうちょ銀行	1,662,100	1,111.00	1,846,593,100		
富山第一銀行	167,600	450.00	75,420,000		
コンコルディア・フィナンシャル	4,519,500	379.00	1,712,890,500		
日産自動車	9,165,100	918.90	8,421,810,390	貸付株式数	677,200株
いすゞ自動車	1,904,100	1,232.00	2,345,851,200		
トヨタ自動車	8,166,200	5,055.00	41,280,141,000	貸付株式数	3,000,000株
日野自動車	939,200	916.00	860,307,200		
三菱自動車工業	2,611,400	442.00	1,154,238,800		

エフテック	36,100	865.00	31,226,500	貸付株式数	12,900株
レシップホールディングス	19,600	790.00	15,484,000	貸付株式数	7,200株
GMB	9,700	914.00	8,865,800	貸付株式数	1,900株
ファルテック	10,400	1,143.00	11,887,200		
武蔵精密工業	70,900	1,823.00	129,250,700		
日産車体	322,600	946.00	305,179,600		
新明和工業	288,000	584.00	168,192,000		
極東開発工業	132,800	892.00	118,457,600		
日信工業	147,800	1,235.00	182,533,000	貸付株式数	9,400株 (9,400株)
トピー工業	538,000	200.00	107,600,000		
ティラド	266,000	175.00	46,550,000		
曙ブレーキ	336,000	181.00	60,816,000	貸付株式数	127,600株 (9,600株)
タチエス	104,100	1,384.00	144,074,400		
N O K	318,900	1,581.00	504,180,900	貸付株式数	6,600株
フタバ産業	200,800	429.00	86,143,200		
K Y B	741,000	319.00	236,379,000		
市光工業	150,000	245.00	36,750,000	貸付株式数	1,000株
大同メタル工業	92,900	980.00	91,042,000		
プレス工業	352,600	314.00	110,716,400		
ミクニ	77,100	285.00	21,973,500		
カルソニックカンセイ	503,000	742.00	373,226,000		
太平洋工業	146,100	885.00	129,298,500		
ケーヒン	151,400	1,424.00	215,593,600		
河西工業	82,700	862.00	71,287,400		
アイシン精機	673,400	3,760.00	2,531,984,000		
富士機工	78,100	286.00	22,336,600		
マ ッ ダ	2,080,500	1,211.50	2,520,525,750		
ダイハツ	785,200	1,314.00	1,031,752,800		
今仙電機製作所	59,300	820.00	48,626,000	貸付株式数	21,600株
本田技研	5,909,200	2,476.50	14,634,133,800		
スズキ	1,201,900	2,691.00	3,234,312,900		
富士重工業	2,075,300	3,288.00	6,823,586,400		
安永	19,800	470.00	9,306,000	貸付株式数	7,600株
ヤマハ発動機	928,700	1,426.00	1,324,326,200	貸付株式数	250,000株
ショーワ	173,800	550.00	95,590,000		
小糸製作所	393,700	4,340.00	1,708,658,000		
T B K	80,200	344.00	27,588,800		
エクセディ	90,100	2,024.00	182,362,400		

ミツバ	110,900	973.00	107,905,700	
豊田合成	239,700	1,708.00	409,407,600	貸付株式数 33,000株
愛三工業	113,900	628.00	71,529,200	
盟和産業	9,800	991.00	9,711,800	
ヨロズ	60,500	1,368.00	82,764,000	
エフ・シー・シー	107,100	1,608.00	172,216,800	
新家工業	123,000	125.00	15,375,000	
シマノ	264,700	13,740.00	3,636,978,000	
タカタ	121,600	347.00	42,195,200	貸付株式数 10,900株 (800株)
テイ・エス テック	152,900	2,371.00	362,525,900	
ジャムコ	35,500	1,819.00	64,574,500	貸付株式数 11,200株 (10,700株)
小野建	55,900	1,170.00	65,403,000	
はるやま商事	28,700	726.00	20,836,200	貸付株式数 2,400株
佐島電機	51,300	658.00	33,755,400	
カップ・クリエイト	92,000	1,293.00	118,956,000	
エコートレーディング	13,400	570.00	7,638,000	貸付株式数 5,100株
伯東	49,500	850.00	42,075,000	
コンドーテック	51,400	707.00	36,339,800	
中山福	41,300	762.00	31,470,600	貸付株式数 1,900株
ライトオン	48,700	1,300.00	63,310,000	貸付株式数 19,200株 (19,200株)
ナガイレーベン	94,300	2,359.00	222,453,700	
ジーンズメイト	18,800	165.00	3,102,000	貸付株式数 7,200株
三菱食品	71,800	2,694.00	193,429,200	
良品計画	74,500	22,070.00	1,644,215,000	
三城ホールディングス	82,100	403.00	33,086,300	
松田産業	47,700	1,258.00	60,006,600	
第一興商	114,200	4,295.00	490,489,000	
メディパルHD	649,300	1,543.00	1,001,869,900	
アドヴァン	64,500	830.00	53,535,000	
S P K	13,800	1,968.00	27,158,400	
萩原電気	20,900	1,868.00	39,041,200	
アルビス	15,900	2,115.00	33,628,500	
アズワン	50,700	4,160.00	210,912,000	
スズデン	19,000	891.00	16,929,000	貸付株式数 6,200株
尾家産業	18,900	864.00	16,329,600	
シモジマ	45,200	1,064.00	48,092,800	
ドウシシャ	77,200	1,978.00	152,701,600	

小津産業	13,200	1,995.00	26,334,000	貸付株式数	4,500株
コナカ	79,300	490.00	38,857,000		
高速	39,900	844.00	33,675,600		
ハウス ローゼ	7,200	1,395.00	10,044,000	貸付株式数	2,700株
G - 7ホールディングス	17,300	1,175.00	20,327,500		
たけびし	20,600	994.00	20,476,400	貸付株式数	8,000株
イオン北海道	44,200	508.00	22,453,600	貸付株式数	15,300株
コジマ	96,200	238.00	22,895,600		
ヒマラヤ	18,300	910.00	16,653,000	貸付株式数	7,000株
コーナン商事	92,900	1,935.00	179,761,500		
黒田電気	121,700	1,773.00	215,774,100		
ネットワンシステムズ	283,700	609.00	172,773,300		
エコス	26,000	1,217.00	31,642,000	貸付株式数	6,800株
ワタミ	78,400	1,062.00	83,260,800	貸付株式数	41,200株
マルシェ	14,300	817.00	11,683,100	貸付株式数	5,900株
リックス	14,600	1,617.00	23,608,200		
ドンキホーテホールディング グ	419,500	3,565.00	1,495,517,500		
丸文	56,700	560.00	31,752,000		
西松屋チェーン	129,000	1,522.00	196,338,000		
ゼンショーホールディング ス	334,500	1,543.00	516,133,500		
ハピネット	58,200	822.00	47,840,400		
幸楽苑ホールディングス	42,000	1,526.00	64,092,000	貸付株式数	15,600株 (3,400株)
ハークスレイ	16,300	958.00	15,615,400		
橋本総業HLDGS	12,100	1,453.00	17,581,300		
日本ライフライン	31,500	3,870.00	121,905,000		
サイゼリヤ	106,400	1,830.00	194,712,000		
エクセル	33,000	1,283.00	42,339,000	貸付株式数	11,100株
V Tホールディングス	222,800	442.00	98,477,600		
マルカキカイ	19,100	993.00	18,966,300		
アルゴグラフィックス	30,900	1,548.00	47,833,200		
魚力	18,700	1,320.00	24,684,000	貸付株式数	7,000株
ガリバーインターナシヨナ ル	176,800	783.00	138,434,400	貸付株式数	66,800株 (66,800株)
日本エム・ディ・エム	53,800	669.00	35,992,200	貸付株式数	19,700株
ポプラ	14,700	480.00	7,056,000	貸付株式数	6,200株
ユナイテッドアローズ	93,100	3,070.00	285,817,000		
進和	39,600	1,355.00	53,658,000		

エスケイジャパン	14,200	245.00	3,479,000	貸付株式数	5,300株
ダイトエレクトロン	31,300	552.00	17,277,600	貸付株式数	11,200株
ハイデイ日高	58,800	2,502.00	147,117,600		
シークス	42,300	3,290.00	139,167,000		
京都きもの友禅	45,000	805.00	36,225,000	貸付株式数	3,300株 (3,300株)
コロワイド	216,000	1,852.00	400,032,000	貸付株式数	82,300株 (21,900株)
ピーシーデポコーポ	65,900	1,420.00	93,578,000	貸付株式数	7,200株
田中商事	18,000	625.00	11,250,000		
オーハシテクニカ	37,900	1,131.00	42,864,900		
壺番屋	59,100	3,550.00	209,805,000		
白銅	16,800	1,056.00	17,740,800		
トップカルチャー	23,700	455.00	10,783,500	貸付株式数	4,000株
P L A N T	13,300	1,120.00	14,896,000		
スギホールディングス	116,600	4,930.00	574,838,000		
島津製作所	846,000	1,348.00	1,140,408,000		
J M S	114,000	270.00	30,780,000		
クボテック	12,800	427.00	5,465,600	貸付株式数	4,000株
長野計器	41,000	552.00	22,632,000	貸付株式数	3,200株
ブイ・テクノロジー	14,200	12,100.00	171,820,000	貸付株式数	5,600株 (4,000株)
スター精密	126,500	1,059.00	133,963,500	貸付株式数	47,700株 (47,700株)
東京計器	195,000	150.00	29,250,000		
愛知時計	79,000	299.00	23,621,000		
オーバル	63,000	228.00	14,364,000	貸付株式数	22,500株
東京精密	127,600	2,219.00	283,144,400		
マニー	79,900	1,637.00	130,796,300	貸付株式数	28,800株 (7,000株)
ニコン	1,227,300	1,366.00	1,676,491,800	貸付株式数	470,200株
トプコン	222,400	922.00	205,052,800	貸付株式数	20,000株
オリンパス	978,500	3,425.00	3,351,362,500	貸付株式数	64,300株
理研計器	53,000	1,066.00	56,498,000		
S C R E E Nホールディングス	659,000	1,045.00	688,655,000		
キヤノン電子	59,400	1,369.00	81,318,600		
タムロン	52,900	1,272.00	67,288,800	貸付株式数	20,100株
H O Y A	1,485,300	3,527.00	5,238,653,100		
ノーリツ鋼機	58,400	675.00	39,420,000	貸付株式数	22,300株

エー・アンド・デイ	58,800	353.00	20,756,400		
キヤノン	3,535,400	2,802.50	9,907,958,500	貸付株式数	400,000株
リコー	2,128,400	823.00	1,751,673,200	貸付株式数	374,900株
シチズンホールディングス	812,200	482.00	391,480,400		
リズム時計	298,000	178.00	53,044,000		
大研医器	52,000	785.00	40,820,000	貸付株式数	19,700株 (3,700株)
メニコン	40,400	3,145.00	127,058,000		
スノーピーク	6,700	4,330.00	29,011,000		
パラマウントベッドHD	67,600	4,835.00	326,846,000	貸付株式数	26,000株 (26,000株)
トランザクション	12,100	1,037.00	12,547,700	貸付株式数	2,400株
SHOBI	19,900	397.00	7,900,300		
ニホンフラッシュ	24,200	1,161.00	28,096,200	貸付株式数	6,400株
前田工織	67,700	990.00	67,023,000	貸付株式数	9,700株 (9,700株)
永大産業	88,000	381.00	33,528,000		
アートネイチャー	68,500	782.00	53,567,000	貸付株式数	12,000株
ダンロップスポーツ	42,500	901.00	38,292,500	貸付株式数	3,000株 (3,000株)
バンダイナムコHLDGS	679,600	2,639.00	1,793,464,400		
アイフィスジャパン	13,600	356.00	4,841,600		
共立印刷	108,700	292.00	31,740,400		
SHOEI	30,800	1,473.00	45,368,400		
フランスベッドHLDGS	92,800	905.00	83,984,000		
マーベラス	108,900	815.00	88,753,500	貸付株式数	41,400株 (6,100株)
パイロットコーポレーション	113,600	4,135.00	469,736,000		
萩原工業	17,400	2,518.00	43,813,200		
エイベックス・グループHD	121,100	1,115.00	135,026,500		
トッパン・フォームズ	119,100	1,042.00	124,102,200		
フジシールインターナショナル	80,200	3,700.00	296,740,000		
タカラトミー	218,100	879.00	191,709,900		
廣濟堂	60,200	291.00	17,518,200		
AS-MEエステール	15,900	580.00	9,222,000		
アーク	279,900	68.00	19,033,200	貸付株式数	57,100株
レック	20,100	1,790.00	35,979,000		

タカノ	30,600	596.00	18,237,600	
プロネクサス	60,600	978.00	59,266,800	
ホクシン	52,100	106.00	5,522,600	貸付株式数 16,400株
ウッドワン	111,000	223.00	24,753,000	
大建工業	263,000	316.00	83,108,000	
きもと	111,000	147.00	16,317,000	
凸版印刷	1,856,000	854.00	1,585,024,000	
大日本印刷	1,896,000	1,165.00	2,208,840,000	
図書印刷	119,000	462.00	54,978,000	貸付株式数 42,000株 (10,000株)
共同印刷	201,000	315.00	63,315,000	
日本写真印刷	109,700	1,781.00	195,375,700	貸付株式数 41,800株 (41,800株)
光村印刷	59,000	179.00	10,561,000	貸付株式数 4,000株
藤森工業	58,300	1,873.00	109,195,900	
宝印刷	33,000	1,363.00	44,979,000	
前澤化成工業	48,500	991.00	48,063,500	
アシックス	618,300	1,584.00	979,387,200	貸付株式数 103,200株 (90,100株)
ツツミ	33,700	1,965.00	66,220,500	
ジェイエスピー	45,600	1,930.00	88,008,000	
ニチハ	92,600	1,549.00	143,437,400	
エフピコ	60,200	5,050.00	304,010,000	
小松ウオール工業	20,900	1,534.00	32,060,600	
ヤマハ	483,300	2,589.00	1,251,263,700	
河合楽器	25,400	1,850.00	46,990,000	
クリナップ	79,200	750.00	59,400,000	
ピジョン	372,700	2,816.00	1,049,523,200	貸付株式数 66,500株 (50,000株)
天馬	52,300	1,494.00	78,136,200	
兼松日産農林	63,000	135.00	8,505,000	
キングジム	54,400	814.00	44,281,600	貸付株式数 20,700株 (17,900株)
リンテック	156,300	1,956.00	305,722,800	
TASAKI	11,200	1,121.00	12,555,200	貸付株式数 4,500株
信越ポリマー	136,800	578.00	79,070,400	
東リ	170,000	281.00	47,770,000	
イトーキ	140,000	520.00	72,800,000	
任天堂	404,400	16,270.00	6,579,588,000	
三菱鉛筆	49,400	4,565.00	225,511,000	

松 風	33,500	1,320.00	44,220,000	
タカラスタンダ - ド	273,000	935.00	255,255,000	
コ ク ヨ	342,600	1,387.00	475,186,200	
ナカバヤシ	125,000	231.00	28,875,000	
ニ フ コ	131,900	5,190.00	684,561,000	
立川プラインド	30,300	682.00	20,664,600	貸付株式数 10,000株
グロープライド	33,000	1,644.00	54,252,000	貸付株式数 9,300株
岡村製作所	231,100	962.00	222,318,200	
日本バルカー	275,000	255.00	70,125,000	
MUTOHホールディングス	71,000	222.00	15,762,000	貸付株式数 18,000株
伊 藤 忠	5,086,500	1,226.00	6,236,049,000	
丸 紅	6,381,600	459.00	2,929,154,400	貸付株式数 2,445,800株
スクロール	98,600	350.00	34,510,000	貸付株式数 30,200株
高 島	110,000	151.00	16,610,000	
ヨンドシーホールディングス	49,600	1,901.00	94,289,600	
三陽商会	397,000	187.00	74,239,000	貸付株式数 58,000株
長瀬産業	391,400	1,076.00	421,146,400	
ナイガイ	270,000	40.00	10,800,000	
蝶 理	42,400	1,290.00	54,696,000	
豊田通商	722,700	2,177.00	1,573,317,900	
オンワ - ドホールディングス	448,000	604.00	270,592,000	
三共生興	98,500	326.00	32,111,000	
兼 松	1,390,000	158.00	219,620,000	
美 津 濃	356,000	454.00	161,624,000	
ツカモトコーポレーション	106,000	98.00	10,388,000	貸付株式数 35,000株
ファミリーマート	199,400	6,200.00	1,236,280,000	貸付株式数 15,500株
ルック	113,000	126.00	14,238,000	貸付株式数 39,000株
三井物産	5,861,500	1,188.00	6,963,462,000	貸付株式数 1,199,600株
日本紙パルプ	343,000	334.00	114,562,000	
東京エレクトロン	539,100	8,490.00	4,576,959,000	貸付株式数 140,300株
日立ハイテクノロジーズ	225,300	2,700.00	608,310,000	
カメイ	86,300	756.00	65,242,800	
東都水産	97,000	153.00	14,841,000	
OUGホールディングス	85,000	234.00	19,890,000	
スターゼン	23,200	3,900.00	90,480,000	
セイコーHD	429,000	292.00	125,268,000	
山 善	250,100	797.00	199,329,700	

椿本興業	66,000	251.00	16,566,000	
住友商事	4,081,100	1,015.00	4,142,316,500	
日本ユニシス	180,300	1,291.00	232,767,300	
内田洋行	145,000	462.00	66,990,000	
三菱商事	4,863,400	1,748.00	8,501,223,200	
第一実業	134,000	427.00	57,218,000	
キヤノンマーケティングJ PN	185,800	1,870.00	347,446,000	
西華産業	198,000	232.00	45,936,000	
佐藤商事	57,200	590.00	33,748,000	
菱洋エレクトロ	74,600	1,285.00	95,861,000	
東京産業	63,200	333.00	21,045,600	貸付株式数 3,800株
ユアサ商事	60,600	2,100.00	127,260,000	
神鋼商事	133,000	160.00	21,280,000	
小林産業	43,900	254.00	11,150,600	
阪和興業	636,000	541.00	344,076,000	
カナデン	60,900	886.00	53,957,400	
菱電商事	93,000	606.00	56,358,000	
ニプロ	491,000	1,248.00	612,768,000	
フルサト工業	37,200	1,209.00	44,974,800	
岩谷産業	772,000	573.00	442,356,000	貸付株式数 291,000株
すてきナイスグループ	291,000	131.00	38,121,000	
昭光通商	209,000	71.00	14,839,000	貸付株式数 51,000株
ニチモウ	91,000	159.00	14,469,000	貸付株式数 34,000株
極東貿易	84,000	173.00	14,532,000	貸付株式数 6,000株
イワキ	89,000	183.00	16,287,000	貸付株式数 34,000株
兼松エレクトロニクス	42,000	1,812.00	76,104,000	
三愛石油	156,600	594.00	93,020,400	
稲畑産業	155,600	906.00	140,973,600	
G S Iクレオス	156,000	91.00	14,196,000	
明和産業	58,900	296.00	17,434,400	
キムラタン	2,923,000	6.00	17,538,000	
ゴ-ルドウイン	29,500	4,510.00	133,045,000	貸付株式数 11,100株
ユニ・チャ-ム	1,393,100	2,060.50	2,870,482,550	貸付株式数 533,900株
デサント	156,900	1,043.00	163,646,700	
キング	35,600	343.00	12,210,800	
ワキタ	139,700	645.00	90,106,500	
ヤマトインタ-ナショナル	43,600	385.00	16,786,000	貸付株式数 14,900株
東邦ホールディングス	207,700	2,328.00	483,525,600	
サンゲツ	226,600	1,924.00	435,978,400	

ミツウロコグループ	104,200	485.00	50,537,000	
シナネンホールディングス	133,000	391.00	52,003,000	
伊藤忠エネクス	168,900	949.00	160,286,100	
サンリオ	200,700	1,720.00	345,204,000	貸付株式数 76,300株
サンワ テクノス	42,400	718.00	30,443,200	
リョーサン	102,900	2,357.00	242,535,300	
新光商事	78,100	959.00	74,897,900	
トーホー	30,000	2,427.00	72,810,000	
三信電気	91,000	810.00	73,710,000	
東陽テクニカ	87,900	953.00	83,768,700	
モスフード サービス	85,500	2,908.00	248,634,000	
加賀電子	57,900	1,152.00	66,700,800	
三益半導体	50,800	863.00	43,840,400	
ソーダニツカ	65,300	444.00	28,993,200	
立花エレテック	48,200	1,042.00	50,224,400	
木曽路	80,100	2,241.00	179,504,100	貸付株式数 26,000株 (6,700株)
サトレストランシステムズ	78,400	808.00	63,347,200	貸付株式数 29,100株
千 趣 会	130,400	651.00	84,890,400	貸付株式数 48,900株 (48,900株)
タカキュー	50,100	173.00	8,667,300	貸付株式数 17,500株
ケーヨー	108,800	518.00	56,358,400	貸付株式数 41,600株 (7,400株)
アデランス	113,000	468.00	52,884,000	貸付株式数 43,200株 (43,200株)
上新電機	139,000	838.00	116,482,000	
日本瓦斯	91,700	2,244.00	205,774,800	
ベスト電器	211,000	100.00	21,100,000	
ロイヤルホールディングス	107,400	1,825.00	196,005,000	貸付株式数 40,900株 (40,900株)
東 天 紅	43,000	129.00	5,547,000	貸付株式数 13,000株
いなげや	73,600	1,372.00	100,979,200	
島 忠	168,500	2,208.00	372,048,000	
チヨダ	77,200	2,232.00	172,310,400	
ライフコーポレーション	41,700	2,561.00	106,793,700	貸付株式数 9,500株
リンガーハット	57,900	2,290.00	132,591,000	貸付株式数 9,100株 (9,100株)
さ が 美	45,000	75.00	3,375,000	貸付株式数 14,000株
MR MAX	56,100	271.00	15,203,100	

テナライド	58,900	364.00	21,439,600	貸付株式数 20,900株 (14,000株)
A O K Iホールディングス	148,800	1,045.00	155,496,000	
オークワ	92,000	1,032.00	94,944,000	
コメリ	100,300	2,546.00	255,363,800	
青山商事	124,700	3,675.00	458,272,500	
しまむら	75,400	15,140.00	1,141,556,000	
はせがわ	27,900	414.00	11,550,600	
高島屋	945,000	697.00	658,665,000	貸付株式数 25,000株
松屋	132,900	661.00	87,846,900	貸付株式数 47,700株 (2,700株)
エイチ・ツー・オーリテイ リング	333,300	1,287.00	428,957,100	
近鉄百貨店	253,000	316.00	79,948,000	
丸栄	121,000	78.00	9,438,000	貸付株式数 47,000株 (13,000株)
ニッセンHD	96,000	91.00	8,736,000	貸付株式数 41,800株
パルコ	61,200	816.00	49,939,200	
丸井グループ	796,700	1,399.00	1,114,583,300	貸付株式数 13,200株
クレディセゾン	492,700	1,598.00	787,334,600	
アクシアルリテイリング	50,200	3,345.00	167,919,000	
井筒屋	366,000	42.00	15,372,000	
イオン	2,667,500	1,444.50	3,853,203,750	貸付株式数 1,022,400株
ユニグループ・HD	622,600	856.00	532,945,600	
イズミ	129,100	3,810.00	491,871,000	
東武ストア	71,000	292.00	20,732,000	
フオーバル	31,500	715.00	22,522,500	
平和堂	132,300	1,872.00	247,665,600	
フジ	72,900	2,261.00	164,826,900	
ヤオコー	73,800	4,340.00	320,292,000	
ゼビオホールディングス	89,300	1,368.00	122,162,400	
ケーズホールディングス	272,500	2,026.00	552,085,000	貸付株式数 105,000株 (105,000株)
PALTAC	103,800	2,139.00	222,028,200	
三谷産業	67,100	310.00	20,801,000	貸付株式数 25,800株 (600株)
OLYMPICグループ	39,500	503.00	19,868,500	
日産東京販売HD	108,400	204.00	22,113,600	
新生銀行	5,622,000	134.00	753,348,000	
あおぞら銀行	4,105,000	339.00	1,391,595,000	貸付株式数 1,572,000株

三菱UFJフィナンシャルG	51,996,800	428.70	22,291,028,160	貸付株式数	1,054,200株
りそなホールディングス	7,586,200	358.00	2,715,859,600		
三井住友トラストHD	13,535,000	289.80	3,922,443,000		
三井住友フィナンシャルG	5,189,500	2,775.00	14,400,862,500	貸付株式数	552,600株
第四銀行	826,000	312.00	257,712,000		
北越銀行	709,000	165.00	116,985,000		
西日本シティ銀行	2,123,000	167.00	354,541,000		
千葉銀行	2,503,000	445.00	1,113,835,000	貸付株式数	608,000株
常陽銀行	2,348,000	353.00	828,844,000		
群馬銀行	1,446,000	346.00	500,316,000		
武蔵野銀行	103,500	2,166.00	224,181,000		
千葉興業銀行	180,600	342.00	61,765,200		
筑波銀行	273,500	254.00	69,469,000		
七十七銀行	1,019,000	321.00	327,099,000		
青森銀行	477,000	270.00	128,790,000	貸付株式数	28,000株 (28,000株)
秋田銀行	429,000	291.00	124,839,000		
山形銀行	369,000	378.00	139,482,000	貸付株式数	139,000株 (77,000株)
岩手銀行	45,800	3,850.00	176,330,000		
東邦銀行	574,000	307.00	176,218,000		
東北銀行	344,000	140.00	48,160,000		
みちのく銀行	334,000	176.00	58,784,000	貸付株式数	85,000株
ふくおかフィナンシャルG	2,810,000	319.00	896,390,000		
静岡銀行	1,901,000	657.00	1,248,957,000	貸付株式数	412,000株
十六銀行	820,000	251.00	205,820,000		
スルガ銀行	616,100	2,085.00	1,284,568,500	貸付株式数	236,000株
八十二銀行	1,176,900	419.00	493,121,100		
山梨中央銀行	407,000	348.00	141,636,000		
大垣共立銀行	871,000	269.00	234,299,000		
福井銀行	551,000	214.00	117,914,000		
北國銀行	695,000	266.00	184,870,000		
清水銀行	21,100	2,131.00	44,964,100		
富山銀行	11,800	3,300.00	38,940,000	貸付株式数	4,400株
滋賀銀行	601,000	427.00	256,627,000		
南都銀行	616,000	311.00	191,576,000		
百五銀行	577,000	332.00	191,564,000		
京都銀行	1,240,000	580.00	719,200,000		

紀陽銀行	254,900	1,218.00	310,468,200	
三重銀行	300,000	171.00	51,300,000	
ほくほくフィナンシャルG	4,427,000	111.00	491,397,000	
広島銀行	1,918,000	315.00	604,170,000	
山陰合同銀行	392,700	615.00	241,510,500	
中国銀行	461,300	973.00	448,844,900	
鳥取銀行	194,000	157.00	30,458,000	
伊予銀行	696,400	570.00	396,948,000	
百十四銀行	718,000	285.00	204,630,000	
四国銀行	503,000	193.00	97,079,000	
阿波銀行	523,000	509.00	266,207,000	
大分銀行	380,000	290.00	110,200,000	
宮崎銀行	439,000	231.00	101,409,000	
佐賀銀行	402,000	214.00	86,028,000	
十八銀行	407,000	228.00	92,796,000	
沖縄銀行	60,020	2,796.00	167,815,920	
琉球銀行	135,500	979.00	132,654,500	
セブン銀行	2,435,000	293.00	713,455,000	貸付株式数 931,200株
みずほフィナンシャルG	91,914,400	142.00	13,051,844,800	貸付株式数 4,114,800株
高知銀行	269,000	99.00	26,631,000	
山口フィナンシャルG	599,000	907.00	543,293,000	貸付株式数 72,000株
アクリーティブ	53,100	328.00	17,416,800	貸付株式数 10,000株 (800株)
芙蓉総合リース	74,600	4,025.00	300,265,000	
興銀リース	122,900	1,681.00	206,594,900	
東京センチュリーリース	152,600	3,175.00	484,505,000	
SBIホールディングス	780,300	952.00	742,845,600	
日本証券金融	288,200	363.00	104,616,600	
アイフル	1,091,600	297.00	324,205,200	
日本アジア投資	44,800	298.00	13,350,400	
ポケットカード	63,500	494.00	31,369,000	貸付株式数 22,700株
長野銀行	201,000	192.00	38,592,000	貸付株式数 74,000株
名古屋銀行	542,000	298.00	161,516,000	
北洋銀行	984,000	257.00	252,888,000	
愛知銀行	19,800	3,985.00	78,903,000	
第三銀行	379,000	150.00	56,850,000	
中京銀行	275,000	226.00	62,150,000	
大光銀行	218,000	172.00	37,496,000	
愛媛銀行	390,000	216.00	84,240,000	
トマト銀行	265,000	133.00	35,245,000	

みなと銀行	580,000	143.00	82,940,000	
京葉銀行	533,000	364.00	194,012,000	
関西アーバン銀行	91,700	863.00	79,137,100	
栃木銀行	341,000	319.00	108,779,000	
北日本銀行	19,300	2,370.00	45,741,000	
東和銀行	1,118,000	77.00	86,086,000	
福島銀行	818,000	86.00	70,348,000	
大東銀行	400,000	171.00	68,400,000	貸付株式数 148,000株
リコーリース	51,000	2,494.00	127,194,000	貸付株式数 100株
イオンフィナンシャルサービス	426,000	2,140.00	911,640,000	
アコム	1,305,800	467.00	609,808,600	貸付株式数 170,500株
ジャックス	362,000	472.00	170,864,000	
オリコ	2,813,000	176.00	495,088,000	
日立キャピタル	153,100	1,731.00	265,016,100	貸付株式数 60,800株
アプラスフィナンシャル	315,700	89.00	28,097,300	貸付株式数 118,200株
オリックス	4,590,300	1,251.00	5,742,465,300	
三菱UFJリース	1,649,100	351.00	578,834,100	
ジャフコ	108,000	2,369.00	255,852,000	
トモニホールディングス	503,600	305.00	153,598,000	
大和証券G本社	6,067,000	513.90	3,117,831,300	
野村ホールディングス	12,473,900	352.60	4,398,297,140	
岡三証券グループ	549,000	436.00	239,364,000	
丸三証券	194,100	814.00	157,997,400	
東洋証券	260,000	171.00	44,460,000	
東海東京HD	748,300	414.00	309,796,200	
光世証券	141,000	102.00	14,382,000	
水戸証券	201,500	207.00	41,710,500	
いちよし証券	146,200	698.00	102,047,600	
松井証券	319,500	829.00	264,865,500	
損保ジャパン興亜HD	1,440,200	2,600.00	3,744,520,000	
だいこう証券ビジ	33,000	542.00	17,886,000	
日本取引所グループ	1,904,700	1,155.00	2,199,928,500	
マネックスG	762,000	219.00	166,878,000	貸付株式数 288,800株 (161,000株)
カブドットコム証券	569,800	304.00	173,219,200	
極東証券	88,500	1,041.00	92,128,500	貸付株式数 33,200株 (33,200株)
岩井コスモホールディング	60,400	800.00	48,320,000	
藍澤証券	112,300	490.00	55,027,000	

フィデアホール	490,200	129.00	63,235,800	
池田泉州HD	692,800	364.00	252,179,200	
アニコムホールディングス	44,600	2,683.00	119,661,800	貸付株式数 16,800株 (3,800株)
MS&AD	1,937,300	2,429.00	4,705,701,700	
マネースクウェアHD	20,200	782.00	15,796,400	
SONY FH	622,600	1,050.00	653,730,000	
マネーパートナーズGP	59,300	510.00	30,243,000	貸付株式数 22,600株
小林洋行	16,800	278.00	4,670,400	貸付株式数 3,300株
第一生命	4,153,800	1,011.50	4,201,568,700	
東京海上HD	2,625,900	3,252.00	8,539,426,800	
イー・ギャランティ	19,200	3,050.00	58,560,000	
アサックス	10,200	1,336.00	13,627,200	
NECキャピタルソリューション	27,700	1,377.00	38,142,900	
T&Dホールディングス	2,364,100	813.00	1,922,013,300	
三井不動産	3,437,000	2,039.00	7,008,043,000	
三菱地所	4,820,000	1,727.50	8,326,550,000	
平和不動産	124,100	1,199.00	148,795,900	
東京建物	715,400	1,143.00	817,702,200	
ダイビル	169,000	802.00	135,538,000	
京阪神ビルディング	107,200	494.00	52,956,800	
住友不動産	1,554,000	2,453.50	3,812,739,000	
太平洋興発	288,000	66.00	19,008,000	
大京	1,218,000	142.00	172,956,000	
テーオーシー	252,300	770.00	194,271,000	
東京楽天地	102,000	471.00	48,042,000	
レオパレス21	766,000	688.00	527,008,000	
スターツコーポレーション	75,300	1,881.00	141,639,300	
フジ住宅	84,700	635.00	53,784,500	貸付株式数 29,500株
空港施設	80,500	471.00	37,915,500	
明和地所	37,000	540.00	19,980,000	
住友不動産販売	47,200	1,980.00	93,456,000	
ゴールドクレスト	51,100	1,442.00	73,686,200	
リログループ	25,800	16,780.00	432,924,000	
日本エスリード	27,100	987.00	26,747,700	
日神不動産	87,900	330.00	29,007,000	
タカラレーベン	285,000	779.00	222,015,000	貸付株式数 108,400株
サンヨーハウジング名古屋	35,600	879.00	31,292,400	
イオンモール	419,500	1,212.00	508,434,000	

ファースト住建	25,700	1,161.00	29,837,700	
ランド	275,300	19.00	5,230,700	
東祥	18,600	4,620.00	85,932,000	
トーセイ	99,100	760.00	75,316,000	
穴吹興産	64,000	242.00	15,488,000	貸付株式数 17,000株
エヌ・ティ・ティ都市開発	404,500	1,014.00	410,163,000	
サンフロンティア不動産	80,400	963.00	77,425,200	貸付株式数 24,200株
エフ・ジェー・ネクスト	56,100	491.00	27,545,100	
ランドビジネス	44,500	236.00	10,502,000	
グランディハウス	56,100	314.00	17,615,400	
東武鉄道	3,512,000	563.00	1,977,256,000	
相鉄ホールディングス	1,118,000	553.00	618,254,000	
東京急行	3,824,000	861.00	3,292,464,000	
京浜急行	1,801,000	1,028.00	1,851,428,000	
小田急電鉄	2,105,000	1,197.00	2,519,685,000	
京王電鉄	1,836,000	956.00	1,755,216,000	
京成電鉄	986,000	1,294.00	1,275,884,000	
富士急行	163,000	1,457.00	237,491,000	貸付株式数 62,000株 (62,000株)
新京成電鉄	79,000	375.00	29,625,000	
東日本旅客鉄道	1,200,400	9,339.00	11,210,535,600	
西日本旅客鉄道	632,200	6,486.00	4,100,449,200	
東海旅客鉄道	588,000	18,065.00	10,622,220,000	
西武ホールディングス	698,700	1,582.00	1,105,343,400	
鴻池運輸	93,900	1,023.00	96,059,700	
西日本鉄道	853,000	509.00	434,177,000	
ハマキョウレックス	50,500	1,890.00	95,445,000	
サカイ引越センター	26,600	2,897.00	77,060,200	貸付株式数 9,800株 (600株)
近鉄グループHLDGS	6,613,000	432.00	2,856,816,000	
阪急阪神HLDGS	4,409,000	756.00	3,333,204,000	
南海電鉄	1,477,000	574.00	847,798,000	
京阪ホールディングス	1,474,000	711.00	1,048,014,000	
神戸電鉄	154,000	361.00	55,594,000	
名古屋鉄道	2,394,000	588.00	1,407,672,000	貸付株式数 916,000株 (916,000株)
山陽電鉄	243,000	478.00	116,154,000	
トランコム	17,200	6,600.00	113,520,000	
日本通運	2,543,000	469.00	1,192,667,000	
ヤマトホールディングス	1,174,800	2,546.00	2,991,040,800	貸付株式数 11,500株

山 九	868,000	527.00	457,436,000	
日 新	276,000	281.00	77,556,000	
丸 運	36,900	239.00	8,819,100	
丸全昭和運輸	200,000	359.00	71,800,000	
センコー	298,500	617.00	184,174,500	
トナミホールディングス	126,000	264.00	33,264,000	
ニッコンホールディングス	209,800	1,812.00	380,157,600	
日石輸送	68,000	218.00	14,824,000	
福山通運	402,000	559.00	224,718,000	貸付株式数 152,000株 (146,000株)
セイノーホールディングス	467,800	973.00	455,169,400	
神奈川中央交通	74,000	589.00	43,586,000	
日立物流	137,900	1,645.00	226,845,500	
丸和運輸機関	18,900	3,010.00	56,889,000	
C & F ロジホールディングス	61,900	1,031.00	63,818,900	貸付株式数 22,000株
日本郵船	5,905,000	169.00	997,945,000	
商船三井	3,207,000	202.00	647,814,000	貸付株式数 1,226,000株
川崎汽船	2,881,000	244.00	702,964,000	貸付株式数 1,101,000株 (1,101,000株)
N S ユナイテッド海運	309,000	120.00	37,080,000	
明治海運	58,100	292.00	16,965,200	貸付株式数 4,400株
飯野海運	342,300	357.00	122,201,100	
共栄タンカー	50,000	147.00	7,350,000	貸付株式数 20,000株
日本航空	1,257,600	3,022.00	3,800,467,200	
A N A ホールディングス	12,194,000	276.70	3,374,079,800	
パスコ	55,000	295.00	16,225,000	貸付株式数 21,000株 (5,000株)
三菱倉庫	467,000	1,360.00	635,120,000	
三井倉庫H O L D	388,000	253.00	98,164,000	
住友倉庫	483,000	480.00	231,840,000	
渋沢倉庫	164,000	272.00	44,608,000	
ヤマタネ	316,000	131.00	41,396,000	
東陽倉庫	103,000	212.00	21,836,000	
乾汽船	51,900	860.00	44,634,000	
日本トランスシティ	145,000	346.00	50,170,000	
ケイヒン	109,000	128.00	13,952,000	
中央倉庫	39,300	892.00	35,055,600	貸付株式数 13,500株
安田倉庫	51,100	585.00	29,893,500	
東洋埠頭	175,000	135.00	23,625,000	

宇徳	53,100	287.00	15,239,700	貸付株式数	12,000株
上組	785,000	893.00	701,005,000		
サンリツ	14,500	485.00	7,032,500		
キムラユニティー	15,100	1,007.00	15,205,700		
キューソー流通システム	17,300	2,523.00	43,647,900	貸付株式数	6,900株 (6,900株)
郵船ロジスティクス	59,500	947.00	56,346,500		
近鉄エクスプレス	119,000	1,213.00	144,347,000		
東海運	36,900	251.00	9,261,900		
エーアイテイー	38,400	829.00	31,833,600	貸付株式数	10,800株
内外トランスライン	19,800	902.00	17,859,600		
東京放送HD	389,700	1,318.00	513,624,600		
日本テレビHLDS	592,800	1,654.00	980,491,200		
朝日放送	62,900	605.00	38,054,500		
テレビ朝日HD	178,200	1,603.00	285,654,600		
スカパーJSA THD	496,200	443.00	219,816,600		
テレビ東京HD	58,000	1,963.00	113,854,000	貸付株式数	14,200株
日本BS放送	13,300	992.00	13,193,600		
U-NEXT	18,300	732.00	13,395,600	貸付株式数	7,300株 (5,500株)
ワイヤレスゲート	18,200	1,591.00	28,956,200		
コネクシオ	56,500	1,370.00	77,405,000		
日本通信	422,700	209.00	88,344,300	貸付株式数	121,800株
クロップス	10,700	511.00	5,467,700	貸付株式数	4,000株
日本電信電話	5,009,200	4,829.00	24,189,426,800		
KDDI	6,411,200	3,134.00	20,092,700,800		
光通信	78,100	8,580.00	670,098,000		
NTTドコモ	4,842,600	2,795.00	13,535,067,000		
エムティーアイ	90,500	633.00	57,286,500		
GMOインターネット	238,300	1,025.00	244,257,500	貸付株式数	90,600株
カドカワ	203,100	1,390.00	282,309,000		
学研ホールディングス	207,000	254.00	52,578,000		
ゼンリン	86,700	1,916.00	166,117,200		
昭文社	36,800	536.00	19,724,800	貸付株式数	12,400株
インプレスホールディングス	53,300	131.00	6,982,300	貸付株式数	14,900株 (2,600株)
東京電力HD	5,574,200	403.00	2,246,402,600		
中部電力	2,010,200	1,422.00	2,858,504,400		
関西電力	2,681,300	956.70	2,565,199,710		
中国電力	909,200	1,291.00	1,173,777,200	貸付株式数	26,200株

北陸電力	644,800	1,249.00	805,355,200	
東北電力	1,641,900	1,266.00	2,078,645,400	
四国電力	592,900	1,142.00	677,091,800	
九州電力	1,452,000	994.00	1,443,288,000	
北海道電力	617,000	779.00	480,643,000	
沖縄電力	103,100	2,127.00	219,293,700	
電源開発	560,600	2,392.00	1,340,955,200	
ファーストエスコ	27,800	687.00	19,098,600	貸付株式数 10,100株
イーレックス	18,700	2,343.00	43,814,100	貸付株式数 4,600株
東京瓦斯	7,334,000	414.60	3,040,676,400	
大阪瓦斯	6,801,000	390.50	2,655,790,500	
東邦瓦斯	1,657,000	866.00	1,434,962,000	
北海道瓦斯	153,000	276.00	42,228,000	貸付株式数 29,000株
広島ガス	113,500	302.00	34,277,000	
西部瓦斯	747,000	242.00	180,774,000	
静岡ガス	188,600	713.00	134,471,800	
メタウォーター	43,000	2,903.00	124,829,000	貸付株式数 16,200株 (7,800株)
アイネット	37,600	1,077.00	40,495,200	
松竹	428,000	1,074.00	459,672,000	
東宝	463,000	2,696.00	1,248,248,000	
エイチ・アイ・エス	111,100	3,085.00	342,743,500	貸付株式数 42,400株
東映	243,000	908.00	220,644,000	
AOI Pro.	34,200	956.00	32,695,200	貸付株式数 5,200株
ラックランド	8,700	1,526.00	13,276,200	
NTTデータ	400,700	4,725.00	1,893,307,500	貸付株式数 29,700株
共立メンテナンス	51,300	6,310.00	323,703,000	貸付株式数 19,500株
イチネンホールディングス	73,900	907.00	67,027,300	
建設技術研究所	41,700	777.00	32,400,900	
スペース	38,400	1,119.00	42,969,600	
アインホールディングス	78,300	6,920.00	541,836,000	
燦ホールディングス	12,400	1,331.00	16,504,400	
ピー・シー・エー	7,500	1,172.00	8,790,000	貸付株式数 2,400株
スバル興業	44,000	382.00	16,808,000	貸付株式数 16,000株
東京テアトル	279,000	113.00	31,527,000	
ビジネスB太田昭和	8,900	907.00	8,072,300	
ナガワ	11,900	3,510.00	41,769,000	
よみうりランド	131,000	431.00	56,461,000	貸付株式数 42,000株 (42,000株)
東京都競馬	475,000	201.00	95,475,000	

常磐興産	265,000	148.00	39,220,000	
カナモト	96,500	1,841.00	177,656,500	
東京ドーム	545,000	453.00	246,885,000	
D T S	73,100	1,878.00	137,281,800	
スクウェア・エニックス・HD	274,900	3,290.00	904,421,000	
シーイーシー	43,300	1,286.00	55,683,800	
カプコン	166,600	2,169.00	361,355,400	
西尾レントオール	55,000	2,023.00	111,265,000	貸付株式数 6,500株
アイ・エス・ビー	9,600	824.00	7,910,400	貸付株式数 2,700株
アゴーラ・ホスピタリティーG	353,000	34.00	12,002,000	
日本空港ビルデング	207,000	3,540.00	732,780,000	貸付株式数 78,800株 (78,800株)
トランス・コスモス	80,300	2,877.00	231,023,100	
乃村工藝社	147,700	1,604.00	236,910,800	
ジャステック	42,000	960.00	40,320,000	
S C S K	154,500	3,675.00	567,787,500	
藤田観光	254,000	342.00	86,868,000	貸付株式数 94,000株 (12,000株)
K N T - C Tホールディングス	348,000	131.00	45,588,000	
日本管財	58,100	1,647.00	95,690,700	
トーカイ	30,900	3,005.00	92,854,500	
白 洋 舎	6,500	2,394.00	15,561,000	
セコム	713,700	7,443.00	5,312,069,100	貸付株式数 14,700株
日本システムウエア	26,100	1,021.00	26,648,100	
セントラル警備保障	31,200	1,945.00	60,684,000	
アイネス	92,900	982.00	91,227,800	
丹青社	130,900	712.00	93,200,800	貸付株式数 2,500株
メイテック	83,600	3,535.00	295,526,000	
T K C	59,200	2,651.00	156,939,200	
アサツー ディ・ケイ	121,100	2,219.00	268,720,900	
富士ソフト	97,000	2,258.00	219,026,000	
応用地質	65,300	1,006.00	65,691,800	
船井総研ホールディング	96,400	1,299.00	125,223,600	
N S D	138,700	1,623.00	225,110,100	
進学会	34,300	494.00	16,944,200	貸付株式数 2,900株
丸紅建材リース	51,000	166.00	8,466,000	
オ オ バ	45,400	390.00	17,706,000	

コナミホールディングス	293,000	4,050.00	1,186,650,000	
学 究 社	9,000	1,140.00	10,260,000	
ベネッセホールディングス	230,500	2,376.00	547,668,000	貸付株式数 88,100株
イオンディライト	64,900	2,828.00	183,537,200	
ナック	43,100	792.00	34,135,200	貸付株式数 11,800株
福井コンピュータH L D S	17,600	2,085.00	36,696,000	貸付株式数 5,300株
ニチイ学館	122,000	658.00	80,276,000	貸付株式数 45,600株 (23,100株)
ダイセキ	129,900	1,787.00	232,131,300	
ステップ	21,000	1,060.00	22,260,000	
日鉄住金物産	518,000	327.00	169,386,000	
元気寿司	17,100	2,047.00	35,003,700	
トラスコ中山	74,400	5,190.00	386,136,000	
ヤマダ電機	1,973,900	536.00	1,058,010,400	
オートバックスセブン	241,300	1,385.00	334,200,500	
アークランドサカモト	108,900	1,130.00	123,057,000	
ニトリホールディングス	280,100	13,120.00	3,674,912,000	
グルメ杵屋	44,000	964.00	42,416,000	貸付株式数 16,000株 (10,000株)
愛 眼	51,700	199.00	10,288,300	
ケーユーホールディングス	35,300	707.00	24,957,100	貸付株式数 5,200株
吉野家ホールディングス	240,400	1,393.00	334,877,200	貸付株式数 14,100株 (14,100株)
加藤産業	101,500	2,330.00	236,495,000	
イノテック	58,700	408.00	23,949,600	
イエローハット	60,300	2,267.00	136,700,100	
松屋フーズ	31,800	2,758.00	87,704,400	
J B C Cホールディングス	54,000	642.00	34,668,000	
J Kホールディングス	63,700	460.00	29,302,000	
サガミチェーン	88,100	1,192.00	105,015,200	貸付株式数 33,100株
日 伝	27,400	3,060.00	83,844,000	
関西スーパーマーケット	52,700	985.00	51,909,500	
ミロク情報サービス	48,300	1,449.00	69,986,700	
北沢産業	53,300	151.00	8,048,300	
杉本商事	38,600	1,120.00	43,232,000	
因幡電機産業	91,500	3,350.00	306,525,000	
王将フードサービス	48,000	3,790.00	181,920,000	貸付株式数 400株
プレナス	73,500	1,750.00	128,625,000	
ミニストップ	48,400	1,647.00	79,714,800	
アークス	122,000	2,586.00	315,492,000	

パローホールディングス	140,300	2,656.00	372,636,800	
バイテックホールディングス	24,900	1,014.00	25,248,600	貸付株式数 7,000株 (6,500株)
ミスミグループ本社	729,000	1,686.00	1,229,094,000	貸付株式数 279,000株
藤 久	4,700	1,674.00	7,867,800	貸付株式数 1,300株
アルテック	55,000	128.00	7,040,000	貸付株式数 14,200株
ベルク	32,300	4,280.00	138,244,000	
大 庄	33,800	1,527.00	51,612,600	貸付株式数 8,000株 (4,000株)
タキヒヨー	102,000	420.00	42,840,000	
ファーストリテイリング	108,200	25,445.00	2,753,149,000	貸付株式数 41,200株
ソフトバンクグループ	3,671,900	5,399.00	19,824,588,100	貸付株式数 26,700株
蔵王産業	9,600	1,271.00	12,201,600	
スズケン	295,500	3,095.00	914,572,500	
サンドラッグ	137,100	9,060.00	1,242,126,000	
サックスパーホールディング	60,100	904.00	54,330,400	貸付株式数 23,000株 (23,000株)
ジェコス	45,400	918.00	41,677,200	
ヤマザワ	12,200	1,680.00	20,496,000	
やまや	12,100	1,588.00	19,214,800	
ルネサスイーストン	49,300	393.00	19,374,900	貸付株式数 4,200株
ペルーナ	161,100	573.00	92,310,300	
合計			1,176,133,662,940	

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

トヨタ自動車	60,000株	本田技研	30,000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28年7月29日

資産総額	1,402,922,592,485円
負債総額	104,023,692,695円
純資産総額（ - ）	1,298,898,899,790円
発行済数量	953,281,977口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1,362.6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

受託会社は、計算期間終了日において氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。）または法人番号（同法同条に規定する法人番号をいいます。）（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。）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、収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。この場合、名義登録受益者が当該計算期間終了日における振替制度移行後も受益証券を保有している所有者と異なる場合であっても、委託会社および受託会社は当該所有者に対して収益分配金の支払いおよびその他損害についてその責を負わないものとします。

## (3) 受益者に対する特典

ありません。

## (4) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

## (5) 受益証券の再発行

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

## (6) 受益権の譲渡

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

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

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

## (7) 受益権の譲渡の対抗要件

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

## (8) 受益権の再分割

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部 【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28年7月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28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	51	191,367
追加型株式投資信託	640	11,528,035
株式投資信託 合計	691	11,719,403
単位型公社債投資信託	10	84,783
追加型公社債投資信託	15	2,172,804
公社債投資信託 合計	25	2,257,587
総合計	716	13,976,989

## 3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(平成27年4月1日から平成28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、百万円未満を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,438	31,715
有価証券	4,878	1,137
前払費用	139	159
未収委託者報酬	10,295	9,896
未収収益	110	87
繰延税金資産	585	468
その他	153	83
流動資産計	47,600	43,547
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	21	18
器具備品	234	224
無形固定資産	2,759	2,706
ソフトウェア	2,758	2,385
ソフトウェア仮勘定	1	321
投資その他の資産	12,979	14,223
投資有価証券	6,667	7,872
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	124	123
長期差入保証金	996	1,049
その他	60	47
固定資産計	15,995	17,173
資産合計	63,596	60,720

（単位:百万円）

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	64	61
未払金	9,172	8,789
未払収益分配金	5	5
未払償還金	72	63
未払手数料	4,965	4,330
その他未払金	2	2
未払費用	4,162	4,215
未払法人税等	1,133	1,155
未払消費税等	1,429	538
賞与引当金	1,092	937
その他	747	22
流動負債計	17,801	15,720
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,072	2,209
役員退職慰労引当金	101	93
繰延税金負債	1,745	1,410
その他	2	-
固定負債計	3,920	3,714
負債合計	21,722	19,435
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	14,126	13,960
利益剰余金合計	14,501	14,334
株主資本合計	41,171	41,004
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	702	280
評価・換算差額等合計	702	280
純資産合計	41,873	41,284
負債・純資産合計	63,596	60,720

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	90,924	88,850
その他営業収益	933	799
営業収益計	91,858	89,650
営業費用		
支払手数料	49,978	46,165
広告宣伝費	670	646
調査費	9,013	10,116
調査費	867	925
委託調査費	8,146	9,191
委託計算費	756	761
営業雑経費	1,289	1,346
通信費	252	249
印刷費	481	515
協会費	53	53
諸会費	13	14
その他営業雑経費	488	513
営業費用計	61,709	59,036
一般管理費		
給料	5,881	5,797
役員報酬	289	354
給料・手当	3,803	3,850
賞与	695	654
賞与引当金繰入額	1,092	937
福利厚生費	831	837
交際費	45	70
旅費交通費	176	211
租税公課	259	325
不動産賃借料	1,180	1,258
退職給付費用	383	394

役員退職慰労引当金繰入額	38	37
固定資産減価償却費	1,032	1,110
諸経費	1,372	1,486
一般管理費計	11,201	11,531
営業利益	18,948	19,082

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	1,226	1	109
受取利息		20		25
投資有価証券売却益		145		115
外国税関連費用引当金戻入益		-		171
その他		226		73
営業外収益計		1,620		496
営業外費用				
投資有価証券売却損		84		14
その他		67		94
営業外費用計		152		108
経常利益		20,416		19,471
特別利益				
固定資産売却益		7		-
特別利益計		7		-
特別損失				
外国税関連費用		746		-
その他		26		-
特別損失計		772		-
税引前当期純利益		19,651		19,471
法人税、住民税及び事業税		6,238		6,215
法人税等調整額		17		6
法人税等合計		6,220		6,209
当期純利益		13,431		13,262

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,428	△13,428	△13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△166	△166	△166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	702	702	41,873
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△13,428
当期純利益	-	-	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△422	△422	△422
当期変動額合計	△422	△422	△589
当期末残高	280	280	41,284

## 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) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 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。

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (表示方法の変更)

### (損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「投資有価証券売却益」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた372百万円は、「投資有価証券売却益」145百万円、「その他」226百万円として組替えております。

## (貸借対照表関係)

### 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	20百万円	23百万円
器具備品	275百万円	232百万円

## 2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払金	4,084百万円	4,320百万円

## 3 保証債務

前事業年度（平成27年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,834百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成28年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,749百万円に対して保証を行っております。

## (損益計算書関係)

## 1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
受取配当金	1,065百万円	-

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日

平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日
----------------------	------	--------	-------	----------------	----------------

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

平成27年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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27年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,428	5,148	平成27年 3月31日	平成27年 6月24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28年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	13,262百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,084円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

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

## ( ) 価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	31,715	31,715	-
(2) 未収委託者報酬	9,896	9,896	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,987	7,987	-
資産計	49,599	49,599	-
(1) 未払手数料	4,330	4,330	-
(2) その他未払金	4,390	4,390	-
(3) 未払費用(*)	3,420	3,420	-
負債計	12,141	12,141	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,025	1,021
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	996	1,049

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27年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,438	-	-	-
未収委託者報酬	10,295	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	6	1,591	3,790	84
合計	41,740	1,591	3,790	84

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,715	-	-	-
未収委託者報酬	9,896	-	-	-
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	1,115	4,570	1,712	141
合計	42,727	4,570	1,712	141

（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27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

## 2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	164	55	109
（2）その他 証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他 証券投資信託	5,779	5,793	14
小計	5,779	5,793	14
合計	10,520	9,482	1,038

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

当事業年度（平成28年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	141	55	86
（2）その他 証券投資信託	3,875	3,408	466
小計	4,016	3,463	553
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	3,970	4,119	148
小計	3,970	4,119	148
合計	7,987	7,583	404

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,021百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3．売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（1）株式	3	-	0
（2）その他 証券投資信託	19,069	115	13
合計	19,072	115	14

### 4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。  
当事業年度において、証券投資信託について4百万円の減損処理を行っております。

## (退職給付関係)

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

### 2. 確定給付制度

#### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,959百万円	2,072百万円
勤務費用	212	222
退職給付の支払額	118	120
その他	18	35
退職給付債務の期末残高	2,072	2,209

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

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,072百万円	2,209百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,072	2,209
退職給付引当金	2,072	2,209
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,072	2,209

#### (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用	212百万円	222百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	212	222

### 3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	670	676
賞与引当金	305	225
外国税関連費用	241	-
未払事業税	231	224
連結法人間取引(譲渡損)	128	121
投資有価証券評価損	105	95
出資金評価損	103	98
その他	206	173
繰延税金資産小計	1,992	1,615
評価性引当額	613	347
繰延税金資産合計	1,379	1,268
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,203	2,086
その他有価証券評価差額金	335	124
繰延税金負債合計	2,539	2,210
繰延税金負債の純額	1,159	941

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.64%	33.06%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.14%	0.77%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.02%	0.02%
評価性引当額の増減額	2.67%	1.29%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.51%	0.19%
その他	0.07%	0.43%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.65%	31.89%

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が24百万円、繰延税金負債（長期）が74百万円、法人税等調整額が50百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が6百万円増加しております。

（セグメント情報等）

#### [セグメント情報]

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

#### [関連情報]

##### 1. サービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報

###### （1）営業収益

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

###### （2）有形固定資産

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

##### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）  
該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,834	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,749	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## （イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	978	長期差入保証金	971

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	27,062	未払手数料	3,188
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(注3)	593	未払費用	252
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(注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,052.69円	1株当たり純資産額	15,826.85円
1株当たり当期純利益	5,148.94円	1株当たり当期純利益	5,084.10円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,431	13,262
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

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

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

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

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

## 第2 【その他の関係法人の概況】

## 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成28年3月末日現在）

事業の内容

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

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 (平成28年3月末日 現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式 会社	4,500	
クレディ・スイス証券株式会社	78,100	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616	
J . P . モルガン証券株式会社	73,272	
シティグループ証券株式会社	96,307	
ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	( 1 ) 30,765	
ドイツ証券株式会社	72,728	
野村證券株式会社	10,000	
B N P パリバ証券株式会社	102,025	
みずほ証券株式会社	125,167	
三菱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	
U B S 証券株式会社	46,450	

( 1 ) 資本金の額は、平成28年5月1日現在のものです。

## 2 【関係業務の概要】

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

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】

該当事項はありません。

#### <再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成28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27年10月2日	有価証券届出書、有価証券報告書(第14期)
平成28年4月1日	半期報告書(第15期中)、有価証券届出書の訂正届出書

**独立監査人の監査報告書**

平成28年 5月27日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57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28年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注)2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年8月5日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ上場投信 - トピックスの平成27年7月11日から平成28年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ上場投信 - トピックスの平成28年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。