

**【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29年10月3日提出
【計算期間】	第16計算期間 (自 平成28年7月11日 至 平成29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】	高橋 慎
【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】	03-5555-3431
【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：

修正後の基準時価総額 = 修正前日の基準時価総額 × (修正前日の時価総額 ± 修正額)  
÷ 修正前日の時価総額

●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29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書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

なお、前1.の証券または証書を「株式」といいます。

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

1. 預金

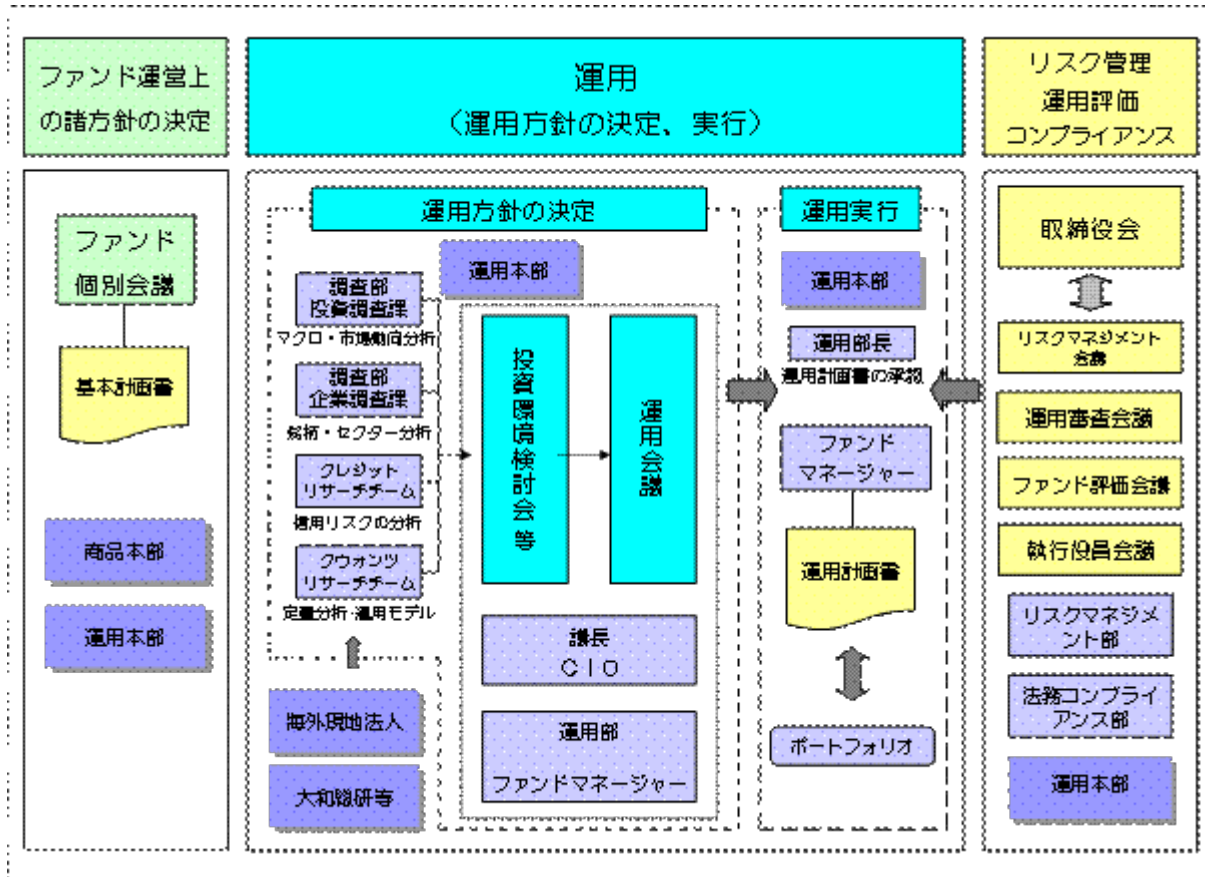
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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29年7月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

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

## (5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資する株式の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。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。

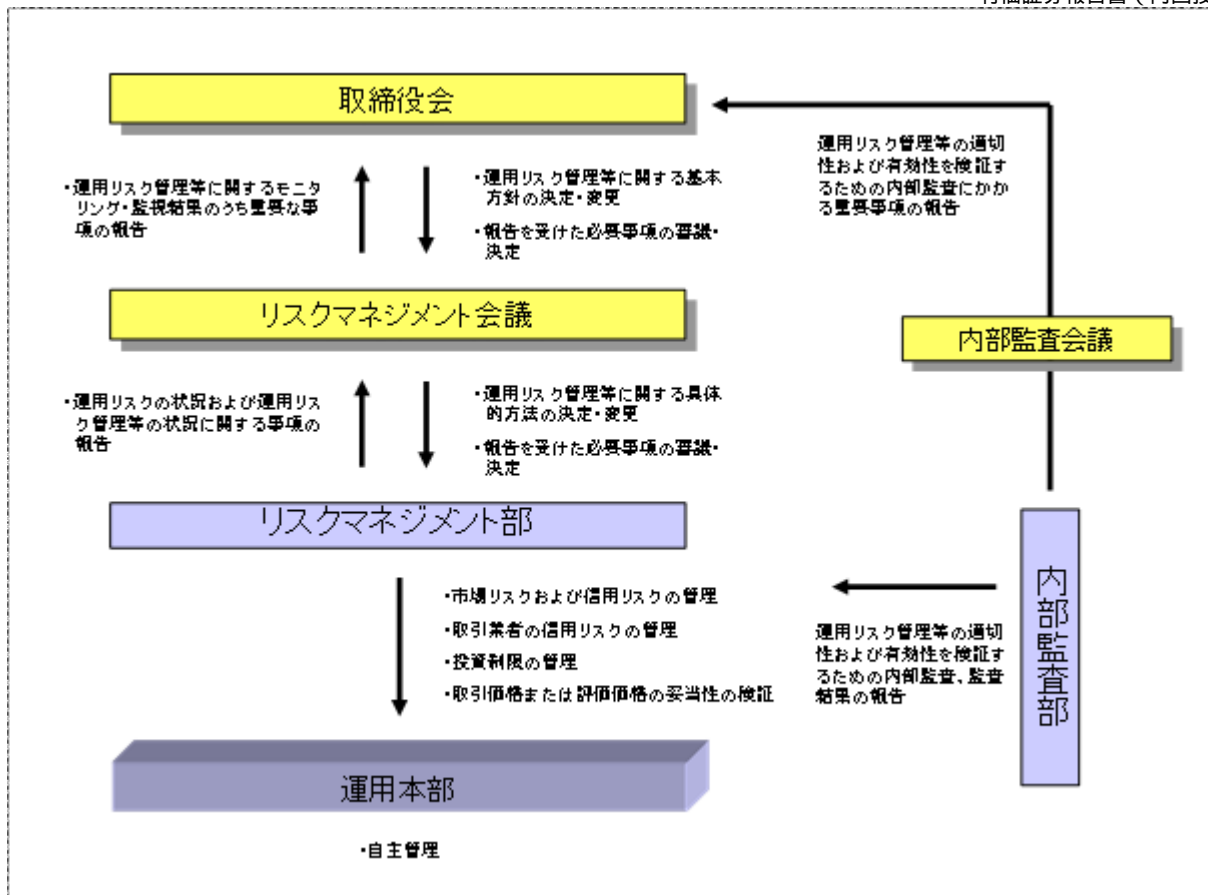
#### (2) その他の留意点

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。

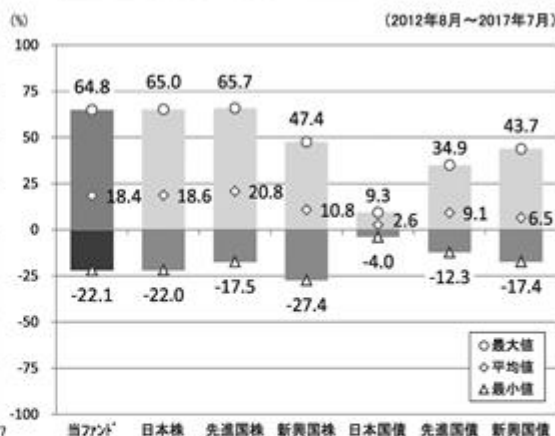
## 参考情報

- 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国債の知的財産権と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29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29年7月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	2,519,229,078,610	99.83
内 日本	2,519,229,078,610	99.83
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,304,687,681	0.17
純資産総額	2,523,533,766,291	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)	4,372,650,000	0.17
内 日本	4,372,650,000	0.17

(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29年7月31日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	13,016,200	6,186.95 80,530,664,541	6,234.00 81,142,990,800	3.22
2	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	80,070,300	748.73 59,951,338,189	700.00 56,049,210,000	2.22
3	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	8,482,300	5,232.89 44,386,967,848	5,390.00 45,719,597,000	1.81
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	4,756,400	8,933.30 42,490,359,767	8,958.00 42,607,831,200	1.69
5	三井住友フィナンシャ ルG	日本	株式	銀行業	8,461,100	4,370.75 36,981,379,252	4,195.00 35,494,314,500	1.41

6	ソニー	日本	株式	電気機器	7,564,600	4,322.40 32,697,277,890	4,540.00 34,343,284,000	1.36
7	KDDI	日本	株式	情報・通信業	10,320,500	2,909.42 30,026,724,023	2,920.00 30,135,860,000	1.19
8	本田技研	日本	株式	輸送用機器	9,634,500	3,103.90 29,904,586,395	3,108.00 29,944,026,000	1.19
9	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	143,480,600	204.49 29,341,594,209	196.40 28,179,589,840	1.12
10	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	6,648,400	3,856.47 25,639,400,209	3,834.00 25,489,965,600	1.01
11	キーエンス	日本	株式	電気機器	485,000	49,052.13 23,790,285,170	51,020.00 24,744,700,000	0.98
12	任天堂	日本	株式	その他製品	659,300	36,478.20 24,050,078,351	37,480.00 24,710,564,000	0.98
13	武田薬品	日本	株式	医薬品	4,205,900	5,695.07 23,952,929,098	5,832.00 24,528,808,800	0.97
14	ファナック	日本	株式	電気機器	1,085,300	22,063.61 23,945,644,307	22,565.00 24,489,794,500	0.97
15	キヤノン	日本	株式	電気機器	5,763,800	3,749.28 21,610,120,162	3,837.00 22,115,700,600	0.88
16	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	2,071,200	10,782.39 22,332,488,095	10,350.00 21,436,920,000	0.85
17	信越化学	日本	株式	化学	2,011,000	9,970.11 20,049,907,440	10,110.00 20,331,210,000	0.81
18	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	7,777,800	2,622.65 20,398,473,738	2,563.00 19,934,501,400	0.79
19	東京海上HD	日本	株式	保険業	4,255,500	4,773.90 20,315,372,910	4,645.00 19,766,797,500	0.78
20	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	4,422,400	4,533.83 20,050,416,637	4,445.00 19,657,568,000	0.78
21	三菱電機	日本	株式	電気機器	11,420,400	1,668.98 19,060,429,568	1,710.50 19,534,594,200	0.77
22	日立	日本	株式	電気機器	25,708,000	701.62 18,037,406,726	759.60 19,527,796,800	0.77
23	村田製作所	日本	株式	電気機器	1,123,200	16,919.44 19,003,917,829	17,180.00 19,296,576,000	0.76
24	三菱商事	日本	株式	卸売業	7,928,700	2,390.81 18,956,042,173	2,396.50 19,001,129,550	0.75
25	パナソニック	日本	株式	電気機器	12,295,300	1,492.02 18,344,885,030	1,521.00 18,701,151,300	0.74

26	花王	日本	株式	化学	2,634,200	6,706.11 17,665,245,267	6,714.00 17,686,018,800	0.70
27	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	3,784,000	4,858.75 18,385,517,845	4,657.00 17,622,088,000	0.70
28	ダイキン工業	日本	株式	機械	1,461,500	11,735.67 17,151,682,207	11,700.00 17,099,550,000	0.68
29	日本電産	日本	株式	電気機器	1,387,500	11,449.02 15,885,519,950	12,160.00 16,872,000,000	0.67
30	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	890,200	17,919.13 15,951,610,158	17,750.00 15,801,050,000	0.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	99.83%
合計	99.83%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.11%
鉱業	0.31%
建設業	3.21%
食料品	4.55%
繊維製品	0.70%
パルプ・紙	0.25%
化学	7.05%
医薬品	4.53%
石油・石炭製品	0.50%
ゴム製品	0.96%
ガラス・土石製品	0.99%
鉄鋼	1.29%
非鉄金属	0.98%
金属製品	0.70%
機械	5.23%
電気機器	13.38%
輸送用機器	8.68%

精密機器	1.62%
その他製品	2.12%
電気・ガス業	1.79%
陸運業	4.08%
海運業	0.22%
空運業	0.57%
倉庫・運輸関連業	0.20%
情報・通信業	7.98%
卸売業	4.43%
小売業	4.60%
銀行業	7.72%
証券、商品先物取引業	1.09%
保険業	2.47%
その他金融業	1.28%
不動産業	2.39%
サービス業	3.84%
合計	99.83%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 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 2017年9月	買建	270	4,366,216,860	4,372,650,000	0.17%

(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
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
平成28年7月末日	1,298,898,899,790	-	1,362.6	-	1,359
8月末日	1,354,905,273,074	-	1,369.9	-	1,369
9月末日	1,462,896,364,426	-	1,374.0	-	1,374
10月末日	1,523,565,799,009	-	1,446.9	-	1,448
11月末日	1,722,943,621,303	-	1,526.4	-	1,525
12月末日	1,811,059,297,965	-	1,579.3	-	1,578
平成29年1月末日	1,934,278,253,556	-	1,582.5	-	1,582
2月末日	2,057,502,526,451	-	1,597.4	-	1,596
3月末日	2,238,123,757,254	-	1,587.7	-	1,589
4月末日	2,305,238,354,080	-	1,608.0	-	1,608
5月末日	2,355,757,323,546	-	1,647.2	-	1,645
6月末日	2,487,883,192,187	-	1,694.7	-	1,694
第16計算期間末 (平成29年7月10日)	2,472,283,433,116	2,510,269,439,522	1,672.7	1,698.4	1,673
7月末日	2,523,533,766,291	-	1,675.7	-	1,675

(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
第16計算期間	25.70

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第16計算期間	36.3

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第16計算期間	786,531,040	253,796,537

## (参考情報) 運用実績

2017年7月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	16,757円
純資産総額	25,235億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	0.4%
3か月間	5.8%
6か月間	7.5%
1年間	24.9%
3年間	32.9%
5年間	142.0%
設定来	66.4%



※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: 257円 設定来分配金合計額: 2,573.4円

決算期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期
	06年7月	07年7月	08年7月	09年7月	10年7月	11年7月	12年7月	13年7月	14年7月	15年7月	16年7月	17年7月
分配金	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	257円

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,016	99.8%	電気機器	13.4%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.2%
国内株式先物	1	0.2%	輸送用機器	8.7%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.2%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	8.0%	日本電信電話	情報・通信業	1.8%
コール・ローン、その他	-	0.2%	銀行業	7.7%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.7%
合計	2,017	-	化学	7.1%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.4%
株式市場・上場別構成			機械	5.2%	ソニー	電気機器	1.4%
一部(東証・名証)		99.8%	小売業	4.6%	KDDI	情報・通信業	1.2%
二部(東証・名証)		-	食料品	4.5%	本田技研	輸送用機器	1.2%
新興市場他		-	医薬品	4.5%	みずほフィナンシャルG	銀行業	1.1%
その他		-	その他	36.1%	日本たばこ産業	食料品	1.0%
合計		99.8%	合計	99.8%	合計		16.2%

※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。

・2017年は7月31日までの騰落率を表しています。

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

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





## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

- イ．受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。
- ロ．受益権の取得申込者は、東証株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託会社が指定するもの（以下「取得時のバスケット」といいます。）を単位として、受益権を取得しなければならないものとします。また、当該取得時のバスケットの評価額（法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た額をいいます。以下同じ。）をもって、それに相当するものとして委託会社が定める一定口数の受益権を単位として取得するものとします。受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額とします。
- ハ．受益権の取得申込者が、委託会社が別に定める時限（営業日の午後3時）までに取得申込みをした場合には、その翌営業日を取得申込受付日として委託会社は当該取得申込みを受付けます。
- ニ．取得申込受付日に対応する取得時のバスケットを構成する各株式の銘柄名とその数量は、委託会社が取得申込受付日以前の別に定める期日に別に定める方法により提示するものとします。
- ホ．前ロ．にかかわらず、受益権の取得申込者は、取得時のバスケットの評価額が取得する一定口数の受益権の評価額に満たない場合には、その差額に相当する部分を金銭をもって支払うものとします。
- ヘ．前ロ．にかかわらず、取得時のバスケットに受益権の取得申込者が発行した株式またはその親会社（会社法第2条第1項第4号に規定する親会社をいいます。以下同じ。）が発行した株式（以下「自社株式等」といいます。）が含まれる場合には、当該取得申込者は当該自社株式等に代えて当該自社株式等に相当する金額（評価額により算出したものに限ります。）に、当該自社株式等を信託財産において取得するため必要な経費に相当するものとして当該金額に別に定める率を乗じて得た額を加算して得た金額の金銭をもって取得することができるものとします。
- ト．前ヘ．に該当する場合には、受益権の取得申込者は、販売会社を通じてその旨を委託会社に通知するものとします。この通知が取得申込みの際に行なわれなかった場合において、そのことによって当該取得申込者または信託財産その他に損害が生じた場合には、当該取得申込者がすべての責を負うものとします。
- チ．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 1. から7.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 1. の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 4. または前 3. の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金にかかる請求権

<支払方法>

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

ロ. 計算期間終了日において氏名または名称、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16期計算期間（平成28年7月11日から平成29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15期 平成28年7月10日現在	第16期 平成29年7月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	77,896,573,945	478,677,037,274
株式	3 4 1,176,133,662,940	3 4 2,468,165,203,854
新株予約権証券	-	5,712,600
派生商品評価勘定	-	38,923,920
未収入金	12,431,305,032	11,761,368,609
未収配当金	1,743,294,469	2,709,232,501
未収利息	1,744,165	11,548,693
前払金	1,235,666,000	-
その他未収収益	5 14,854,046	5 180,562,984
差入委託証拠金	254,130,000	-
流動資産合計	1,269,711,230,597	2,961,549,590,435
資産合計	1,269,711,230,597	2,961,549,590,435
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	215,092,560	-
前受金	-	51,230,000
未払金	1,201,406,720	3,636,320
未払収益分配金	24,578,325,746	37,986,006,406
未払受託者報酬	253,633,098	498,877,192
未払委託者報酬	522,306,583	975,391,091
未払利息	233,092	-
受入担保金	64,513,948,432	449,407,720,639
その他未払費用	281,441,010	343,295,671
流動負債合計	91,566,387,241	489,266,157,319
負債合計	91,566,387,241	489,266,157,319
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 1,181,650,276,250	1 1,847,568,405,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 3,505,432,894	2 624,715,028,116
（分配準備積立金）	1,795,560,838	2,956,400,148
元本等合計	1,178,144,843,356	2,472,283,433,116
純資産合計	1,178,144,843,356	2,472,283,433,116
負債純資産合計	1,269,711,230,597	2,961,549,590,435

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期		第16期	
	自	平成27年7月11日 至 平成28年7月10日	自	平成28年7月11日 至 平成29年7月10日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		26,402,590,169		40,084,875,898
受取利息		36,818,717		178,289,170
有価証券売買等損益		342,876,697,571		473,799,136,457
派生商品取引等損益		1,057,091,835		3,589,860,900
その他収益		1 612,466,125		1 1,810,978,757
<b>営業収益合計</b>		<b>316,881,914,395</b>		<b>519,463,141,182</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		18,084,755		94,397,282
受託者報酬		533,722,646		840,734,529
委託者報酬		1,090,615,798		1,646,150,779
その他費用		276,430,976		346,015,519
<b>営業費用合計</b>		<b>1,918,854,175</b>		<b>2,927,298,109</b>
営業利益又は営業損失( )		318,800,768,570		516,535,843,073
経常利益又は経常損失( )		318,800,768,570		516,535,843,073
当期純利益又は当期純損失( )		318,800,768,570		516,535,843,073
期首剰余金又は期首欠損金( )		300,212,636,850		3,505,432,894
剰余金増加額又は欠損金減少額		63,079,127,392		224,577,376,643
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		63,079,127,392		224,577,376,643
剰余金減少額又は欠損金増加額		23,418,102,820		74,906,752,300
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		23,418,102,820		74,906,752,300
分配金		2 24,578,325,746		2 37,986,006,406
期末剰余金又は期末欠損金( )		3,505,432,894		624,715,028,116

## (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16期 自 平成28年7月11日 至 平成29年7月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>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。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第15期	第16期
	平成28年7月10日現在	平成29年7月10日現在
1. 1 期首元本額	979,712,467,500円	1,181,650,276,250円
期中追加設定元本額	352,790,212,500円	983,163,800,000円
期中一部交換元本額	150,852,403,750円	317,245,671,250円
2. 計算期間末日における受益権の総数	945,320,221口	1,478,054,724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 60,234,566,570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 427,474,840,540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 589,455,000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 2,711,320,000円
6. 5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分9,548,470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162,310,521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15期	第16期
	自 平成27年7月11日 至 平成28年7月10日	自 平成28年7月11日 至 平成29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373,154,566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1,363,314,103円が含まれております。

2. 2 分配金の計算過程	<p>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。</p>	<p>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(41,979,746,543円)及び分配準備積立金(1,795,560,838円)の合計額から、経費(2,832,900,827円)を控除して計算される分配対象額は40,942,406,554円(10口当たり277円)であり、うち37,986,006,406円(10口当たり257円)を分配金額としております。</p>
---------------	--	--

## (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16期 自 平成28年7月11日 至 平成29年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

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16期 平成29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15期 平成28年7月10日現在	第16期 平成29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	315,374,031,400	413,713,208,446
新株予約権証券	-	5,712,600
合計	315,374,031,400	413,718,921,046

## (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

	第15期 平成28年7月10日 現在	第16期 平成29年7月10日 現在

種類	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	2,201,044,000	-	1,986,040,000	215,004,000	4,034,520,000	-	4,073,580,000	39,060,000
合計	2,201,044,000	-	1,986,040,000	215,004,000	4,034,520,000	-	4,073,580,000	39,060,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

第16期	
自 平成28年7月11日	
至 平成29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15期	第16期
	平成28年7月10日現在	平成29年7月10日現在
1口当たり純資産額	1,246.3円	1,672.7円
(10口当たり純資産額)	(12,463円)	(16,727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	46,300	3,110.00	143,993,000	貸付株式数	9,600株 (7,600株)
日本水産	1,526,100	638.00	973,651,800		
マルハニチロ	222,900	2,915.00	649,753,500	貸付株式数	110,100株
ハウスイ	82,000	126.00	10,332,000		
カネコ種苗	40,300	1,451.00	58,475,300		
サカタのタネ	173,400	3,495.00	606,033,000	貸付株式数	4,300株
ホクト	119,500	1,969.00	235,295,500	貸付株式数	3,500株
ホクリヨウ	16,400	1,044.00	17,121,600	貸付株式数	3,600株
ショーボンドHD	113,700	5,660.00	643,542,000	貸付株式数	20,600株
ミライト・ホールディングス	361,500	1,312.00	474,288,000	貸付株式数	17,800株
タマホーム	88,100	638.00	56,207,800	貸付株式数	25,400株 (10,800株)
サンヨーホームズ	24,700	637.00	15,733,900		
ファーストコーポレーション	26,000	1,123.00	29,198,000	貸付株式数	8,900株 (8,000株)
インベスターズクラウド	14,800	5,790.00	85,692,000	貸付株式数	800株
住石ホールディングス	326,000	100.00	32,600,000	貸付株式数	7,500株
日鉄鉱業	32,600	6,060.00	197,556,000		
三井松島	68,100	1,408.00	95,884,800		
国際石油開発帝石	6,190,700	1,067.50	6,608,572,250	貸付株式数	403,100株
日本海洋掘削	41,000	2,204.00	90,364,000	貸付株式数	20,900株 (9,900株)
石油資源開発	186,100	2,279.00	424,121,900	貸付株式数	88,600株
K & Oエナジーグループ	69,200	1,778.00	123,037,600	貸付株式数	14,600株
ダイセキ環境ソリューション	32,700	1,346.00	44,014,200	貸付株式数	15,600株
安藤・間	844,400	724.00	611,345,600	貸付株式数	430,500株
東急建設	417,200	903.00	376,731,600	貸付株式数	46,900株
コムシスホールディングス	459,200	2,315.00	1,063,048,000		
ミサワホーム	138,800	1,018.00	141,298,400		
ピーアールホールディングス	116,400	395.00	45,978,000	貸付株式数	4,000株 (4,000株)
高松コンストラクションG P	88,600	2,812.00	249,143,200		
東建コーポレーション	43,900	13,860.00	608,454,000		
ソネック	14,500	823.00	11,933,500	貸付株式数	3,600株

ヤマウラ	55,000	962.00	52,910,000	貸付株式数 27,100株 (20,000株)
大成建設	5,975,000	1,038.00	6,202,050,000	
大林組	3,524,400	1,322.00	4,659,256,800	貸付株式数 35,000株
清水建設	3,594,900	1,198.00	4,306,690,200	
飛鳥建設	1,131,900	171.00	193,554,900	貸付株式数 131,700株
長谷工コーポレーション	1,371,400	1,384.00	1,898,017,600	貸付株式数 288,300株
松井建設	129,500	877.00	113,571,500	
銭高組	166,000	448.00	74,368,000	貸付株式数 69,000株
鹿島建設	5,165,000	967.00	4,994,555,000	
不動テトラ	948,400	188.00	178,299,200	
大末建設	41,500	1,030.00	42,745,000	
鉄建建設	714,000	341.00	243,474,000	貸付株式数 61,000株 (20,000株)
西松建設	1,358,000	624.00	847,392,000	
三井住友建設	4,502,800	123.00	553,844,400	
大豊建設	426,000	550.00	234,300,000	
前田建設	774,000	1,333.00	1,031,742,000	貸付株式数 92,000株
佐田建設	80,900	440.00	35,596,000	
ナカノフドー建設	89,900	642.00	57,715,800	貸付株式数 600株
奥村組	967,000	754.00	729,118,000	
東鉄工業	141,100	3,365.00	474,801,500	貸付株式数 12,100株
イチケン	107,000	416.00	44,512,000	
浅沼組	410,000	341.00	139,810,000	貸付株式数 6,000株
戸田建設	1,366,000	711.00	971,226,000	貸付株式数 480,000株
熊谷組	1,844,000	363.00	669,372,000	
青木あすなろ建設	77,000	900.00	69,300,000	
北野建設	245,000	327.00	80,115,000	
植木組	144,000	273.00	39,312,000	
三井ホーム	150,000	732.00	109,800,000	
矢作建設	159,800	925.00	147,815,000	
ピーエス三菱	123,700	486.00	60,118,200	
日本ハウスHLDGS	224,500	522.00	117,189,000	貸付株式数 27,600株
大東建託	425,600	18,110.00	7,707,616,000	貸付株式数 20,800株
新日本建設	139,900	945.00	132,205,500	
NIPPO	272,000	2,257.00	613,904,000	貸付株式数 38,000株
東亜道路	221,000	470.00	103,870,000	
前田道路	368,000	2,310.00	850,080,000	
日本道路	349,000	609.00	212,541,000	
東亜建設	95,200	1,755.00	167,076,000	貸付株式数 48,500株

若築建設	676,000	177.00	119,652,000	
東洋建設	338,100	450.00	152,145,000	貸付株式数 1,000株
五洋建設	1,304,000	639.00	833,256,000	
大林道路	121,300	940.00	114,022,000	
世紀東急	171,100	595.00	101,804,500	
福田組	37,900	5,150.00	195,185,000	
日本ドライケミカル	13,900	2,355.00	32,734,500	
住友林業	808,800	1,732.00	1,400,841,600	貸付株式数 190,200株
日本基礎技術	130,600	370.00	48,322,000	
日成ビルド工業	347,000	630.00	218,610,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	598,000	90.00	53,820,000	
巴コーポレーション	146,000	364.00	53,144,000	
パナホーム	219,000	1,199.00	262,581,000	
大和ハウス	3,471,400	3,850.00	13,364,890,000	貸付株式数 1,682,600株 (360,000株)
ライト工業	225,900	1,174.00	265,206,600	
積水ハウス	3,598,700	1,977.00	7,114,629,900	
日特建設	100,100	602.00	60,260,200	
北陸電気工事	56,900	946.00	53,827,400	
ユアテック	184,000	772.00	142,048,000	
西部電気工業	19,500	2,380.00	46,410,000	
四電工	89,000	560.00	49,840,000	
中電工	132,500	2,959.00	392,067,500	貸付株式数 5,500株
関電工	468,000	1,121.00	524,628,000	貸付株式数 230,000株
きんでん	781,400	1,833.00	1,432,306,200	貸付株式数 41,600株
東京エネシス	121,300	1,045.00	126,758,500	
トーエネック	164,000	731.00	119,884,000	
住友電設	81,200	1,626.00	132,031,200	
日本電設工業	180,400	2,227.00	401,750,800	貸付株式数 2,000株
協和エクシオ	460,400	1,856.00	854,502,400	貸付株式数 4,300株
新日本空調	90,600	1,562.00	141,517,200	
日本工営	73,400	3,115.00	228,641,000	貸付株式数 1,000株
NDS	18,300	3,130.00	57,279,000	
九電工	230,800	4,245.00	979,746,000	貸付株式数 38,400株
三機工業	248,800	1,239.00	308,263,200	
日揮	1,096,700	1,849.00	2,027,798,300	
中外炉工業	355,000	226.00	80,230,000	
ヤマト	105,200	665.00	69,958,000	貸付株式数 6,800株
太平電業	158,000	1,369.00	216,302,000	

高砂熱学	323,400	1,820.00	588,588,000		
三晃金属	10,300	3,330.00	34,299,000		
NEC ネットエスアイ	113,500	2,500.00	283,750,000		
朝日工業社	26,600	3,220.00	85,652,000		
明星工業	212,700	684.00	145,486,800	貸付株式数	40,900株
大気社	155,700	2,928.00	455,889,600	貸付株式数	60,400株
ダイダン	156,000	1,495.00	233,220,000		
日比谷総合設備	131,200	1,929.00	253,084,800		
東芝プラントシステム	190,800	1,831.00	349,354,800	貸付株式数	6,600株
日本製粉	349,400	1,765.00	616,691,000	貸付株式数	19,000株
日清製粉G本社	1,288,500	1,797.00	2,315,434,500		
日東富士製粉	7,600	3,920.00	29,792,000		
昭和産業	483,000	598.00	288,834,000		
鳥越製粉	93,300	798.00	74,453,400		
中部飼料	128,600	1,435.00	184,541,000		
フィード・ワン	707,100	222.00	156,976,200	貸付株式数	8,400株
東洋精糖	176,000	116.00	20,416,000		
日本甜菜糖	59,900	2,136.00	127,946,400		
三井製糖	83,000	3,190.00	264,770,000	貸付株式数	1,000株
塩水港精糖	125,400	244.00	30,597,600		
日新製糖	49,800	1,871.00	93,175,800		
L i f u l l	270,800	940.00	254,552,000	貸付株式数	133,800株 (74,200株)
ジェイエイシーリクルート メント	67,700	1,850.00	125,245,000	貸付株式数	8,200株
日本M&Aセンター	316,200	4,065.00	1,285,353,000	貸付株式数	156,300株
メンバーズ	27,300	691.00	18,864,300	貸付株式数	13,500株
中広	10,300	748.00	7,704,400		
タケエイ	95,900	1,075.00	103,092,500	貸付株式数	29,300株
トラスト・テック	44,300	2,279.00	100,959,700	貸付株式数	1,200株
コシダカホールディングス	52,600	3,055.00	160,693,000	貸付株式数	20,000株 (20,000株)
パソナグループ	81,500	1,036.00	84,434,000	貸付株式数	14,000株 (7,900株)
C D S	24,800	1,307.00	32,413,600	貸付株式数	1,400株
リンクアンドモチベーショ ン	184,100	742.00	136,602,200	貸付株式数	127,700株 (99,000株)
G C A	97,300	1,050.00	102,165,000	貸付株式数	35,200株
エス・エム・エス	155,400	3,360.00	522,144,000	貸付株式数	79,200株
パーソルホールディングス	847,800	2,090.00	1,771,902,000	貸付株式数	364,500株

リニカル	64,400	1,766.00	113,730,400	貸付株式数 23,700株 (14,300株)
クックパッド	245,100	918.00	225,001,800	貸付株式数 124,500株
エスクリ	38,900	729.00	28,358,100	貸付株式数 8,500株
アイ・ケイ・ケイ	48,800	793.00	38,698,400	貸付株式数 20,900株 (4,100株)
森永製菓	229,400	6,380.00	1,463,572,000	
中村屋	27,200	5,070.00	137,904,000	
江崎グリコ	293,900	6,050.00	1,778,095,000	貸付株式数 13,700株
名糖産業	50,500	1,438.00	72,619,000	
不二家	67,200	2,464.00	165,580,800	
山崎製パン	860,800	2,206.00	1,898,924,800	貸付株式数 438,900株
第一屋製パン	17,900	1,217.00	21,784,300	
モロゾフ	178,000	650.00	115,700,000	
亀田製菓	65,400	5,440.00	355,776,000	貸付株式数 10,100株
寿スピリッツ	111,500	3,570.00	398,055,000	
カルビー	479,400	4,295.00	2,059,023,000	貸付株式数 237,600株
森永乳業	1,054,000	842.00	887,468,000	
六甲バター	52,400	2,566.00	134,458,400	貸付株式数 500株
ヤクルト	630,100	7,580.00	4,776,158,000	貸付株式数 215,800株
明治ホールディングス	696,100	8,940.00	6,223,134,000	貸付株式数 50,900株
雪印メグミルク	253,400	3,170.00	803,278,000	貸付株式数 3,600株
プリマハム	740,000	656.00	485,440,000	
日本ハム	825,000	3,365.00	2,776,125,000	
林兼産業	37,700	841.00	31,705,700	
丸大食品	561,000	513.00	287,793,000	
S Foods	63,000	4,100.00	258,300,000	貸付株式数 29,100株 (27,500株)
伊藤ハム米久HLDGS	677,800	1,007.00	682,544,600	貸付株式数 66,800株
学情	45,600	1,283.00	58,504,800	貸付株式数 22,300株 (18,700株)
スタジオアリス	44,900	2,394.00	107,490,600	貸付株式数 22,700株
シミックホールディングス	55,500	1,502.00	83,361,000	
システナ	82,600	2,186.00	180,563,600	貸付株式数 42,100株
NJS	24,500	1,364.00	33,418,000	
デジタルアーツ	46,000	3,945.00	181,470,000	貸付株式数 23,400株
新日鉄住金SOL	162,000	2,587.00	419,094,000	
総合警備保障	398,800	4,930.00	1,966,084,000	貸付株式数 136,700株
キューブシステム	59,700	856.00	51,103,200	

いちご	984,300	339.00	333,677,700	貸付株式数 501,900株 (258,200株)
日本駐車場開発	1,248,000	164.00	204,672,000	貸付株式数 303,800株 (271,900株)
コア	43,500	1,499.00	65,206,500	貸付株式数 9,600株
カカクコム	770,200	1,670.00	1,286,234,000	貸付株式数 391,900株 (41,900株)
アイロムグループ	33,400	1,700.00	56,780,000	貸付株式数 10,500株 (4,100株)
セントケア・ホールディング	14,000	1,674.00	23,436,000	
サイネックス	10,500	1,003.00	10,531,500	
ルネサンス	55,700	1,984.00	110,508,800	
ディップ	141,300	2,283.00	322,587,900	貸付株式数 69,900株
SBSホールディングス	103,500	869.00	89,941,500	
オプトホールディング	69,800	1,429.00	99,744,200	貸付株式数 17,100株 (5,000株)
新日本科学	122,000	666.00	81,252,000	貸付株式数 37,100株 (7,000株)
ツクイ	259,600	674.00	174,970,400	貸付株式数 105,200株
キャリアデザインセンター	23,000	1,455.00	33,465,000	
エムスリー	949,000	3,040.00	2,884,960,000	貸付株式数 237,200株
ツカダ・グローバルHOLD	79,700	608.00	48,457,600	貸付株式数 38,900株 (2,100株)
プラス	5,400	1,130.00	6,102,000	貸付株式数 2,700株
アウトソーシング	58,000	5,190.00	301,020,000	貸付株式数 34,800株 (8,200株)
ウェルネット	82,100	1,334.00	109,521,400	貸付株式数 40,600株 (16,100株)
ワールドホールディングス	32,900	2,691.00	88,533,900	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ディー・エヌ・エー	491,100	2,643.00	1,297,977,300	貸付株式数 76,300株
博報堂DYHLDGS	1,518,400	1,452.00	2,204,716,800	貸付株式数 231,500株
ぐるなび	158,500	1,848.00	292,908,000	貸付株式数 24,600株
エスアールジータカミヤ	118,000	552.00	65,136,000	貸付株式数 18,100株
ジャパンベストレスキュー	124,200	280.00	34,776,000	貸付株式数 29,200株 (26,600株)
ファンコミュニケーションズ	278,300	990.00	275,517,000	貸付株式数 111,500株 (84,600株)
ライク	19,600	3,150.00	61,740,000	貸付株式数 9,500株
ビジネス・ブレークスルー	46,300	388.00	17,964,400	

WDBホールディングス	39,200	2,227.00	87,298,400	貸付株式数 4,000株 (4,000株)
ティア	52,500	782.00	41,055,000	
CDG	7,600	1,800.00	13,680,000	
バリューコマース	89,800	684.00	61,423,200	
インフォマート	466,100	801.00	373,346,100	貸付株式数 61,300株 (51,200株)
サッポロホールディングス	384,900	3,105.00	1,195,114,500	
アサヒグループホールディングン	2,204,700	4,378.00	9,652,176,600	貸付株式数 71,800株
麒麟HD	5,059,900	2,344.00	11,860,405,600	貸付株式数 311,900株
宝ホールディングス	850,700	1,168.00	993,617,600	
オエノンホールディングス	298,000	284.00	84,632,000	
養命酒	36,200	2,093.00	75,766,600	貸付株式数 1,000株
コカ・コーラボトラーズJ	738,900	3,335.00	2,464,231,500	貸付株式数 35,000株 (35,000株)
サントリー食品インター	805,000	5,170.00	4,161,850,000	貸付株式数 4,800株
ダイドーグループHD	54,000	5,690.00	307,260,000	貸付株式数 26,900株
伊藤園	348,600	4,130.00	1,439,718,000	貸付株式数 172,300株
キーコーヒー	103,400	2,188.00	226,239,200	貸付株式数 8,000株
ユニカフェ	31,600	980.00	30,968,000	
ジャパンフーズ	14,800	1,382.00	20,453,600	
日清オイリオグループ	677,000	641.00	433,957,000	
不二製油グループ	313,700	2,552.00	800,562,400	貸付株式数 155,000株
かどや製油	11,500	5,070.00	58,305,000	貸付株式数 4,400株
J-オイルミルズ	54,600	3,895.00	212,667,000	
ローソン	326,600	7,330.00	2,393,978,000	貸付株式数 161,600株
サンエー	78,100	4,695.00	366,679,500	
カワチ薬品	80,100	2,673.00	214,107,300	
エービーシー・マート	188,100	6,330.00	1,190,673,000	
ハードオフコーポレーション	45,400	1,112.00	50,484,800	
高千穂交易	39,700	1,064.00	42,240,800	
アスクル	108,000	3,600.00	388,800,000	貸付株式数 53,500株 (1,500株)
ゲオホールディングス	173,000	1,183.00	204,659,000	貸付株式数 85,300株
アダストリア	158,900	2,784.00	442,377,600	貸付株式数 27,000株
ジーフット	62,300	796.00	49,590,800	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	13,100	773.00	10,126,300	

伊藤忠食品	25,500	4,630.00	118,065,000	
くらコーポレーション	60,700	5,210.00	316,247,000	貸付株式数 100株
キャンドウ	49,200	1,681.00	82,705,200	貸付株式数 9,900株
エレマテック	41,300	1,844.00	76,157,200	
パルグループHLDGS	52,700	2,841.00	149,720,700	
JALUX	33,200	2,696.00	89,507,200	貸付株式数 13,800株 (9,700株)
エディオン	401,200	993.00	398,391,600	貸付株式数 197,900株 (163,400株)
あらた	47,000	3,925.00	184,475,000	貸付株式数 23,200株 (23,200株)
サーラコーポレーション	129,500	780.00	101,010,000	
ワッツ	40,900	1,269.00	51,902,100	貸付株式数 9,000株
トーメンデバイス	15,400	2,211.00	34,049,400	貸付株式数 1,300株
ハローズ	33,900	2,306.00	78,173,400	
J Pホールディングス	314,700	293.00	92,207,100	貸付株式数 155,600株 (94,800株)
あみやき亭	19,900	4,175.00	83,082,500	
東京エレクトロンデバイス	37,400	1,683.00	62,944,200	貸付株式数 400株
ひらまつ	142,500	646.00	92,055,000	貸付株式数 70,400株 (37,000株)
フィールズ	79,100	1,201.00	94,999,100	貸付株式数 37,800株
双日	6,113,300	280.00	1,711,724,000	
ゲンキー	41,300	3,125.00	129,062,500	貸付株式数 15,000株
アルフレッサホールディングス	1,224,500	2,126.00	2,603,287,000	
大黒天物産	24,700	5,650.00	139,555,000	貸付株式数 11,800株 (11,800株)
ハニーズホールディングス	99,900	1,181.00	117,981,900	貸付株式数 28,100株 (22,400株)
ファーマライズHD	23,500	527.00	12,384,500	
キッコーマン	822,100	3,565.00	2,930,786,500	貸付株式数 396,400株
味の素	2,421,000	2,368.50	5,734,138,500	貸付株式数 550,000株 (550,000株)
キューピー	597,900	2,810.00	1,680,099,000	貸付株式数 304,800株
ハウス食品G本社	435,000	2,790.00	1,213,650,000	貸付株式数 21,700株
カゴメ	421,700	3,340.00	1,408,478,000	貸付株式数 208,500株
焼津水産化工	55,300	1,192.00	65,917,600	
アリアケジャパン	96,200	7,710.00	741,702,000	貸付株式数 48,200株
ピエトロ	13,600	1,633.00	22,208,800	貸付株式数 5,600株



エバラ食品工業	28,100	2,058.00	57,829,800	
ニチレイ	546,800	3,230.00	1,766,164,000	
横浜冷凍	243,600	1,060.00	258,216,000	貸付株式数 123,900株 (19,600株)
東洋水産	577,700	4,195.00	2,423,451,500	貸付株式数 67,800株
イトアンド	12,900	2,297.00	29,631,300	貸付株式数 5,100株 (2,300株)
大冷	11,600	1,826.00	21,181,600	
ヨシムラ・フード・HLD GS	2,100	2,885.00	6,058,500	貸付株式数 1,000株
日清食品HD	459,000	6,950.00	3,190,050,000	貸付株式数 226,800株
永谷園ホールディングス	112,000	1,391.00	155,792,000	
一正蒲鉾	40,900	1,284.00	52,515,600	貸付株式数 20,200株 (9,500株)
フジッコ	113,900	2,527.00	287,825,300	貸付株式数 800株
ロックフィールド	113,400	1,857.00	210,583,800	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
日本たばこ産業	6,513,000	3,857.00	25,120,641,000	
ケンコーマヨネーズ	63,300	3,145.00	199,078,500	貸付株式数 16,900株
わらべや日洋HD	68,900	2,937.00	202,359,300	
なとり	58,700	2,067.00	121,332,900	
イフジ産業	18,300	747.00	13,670,100	貸付株式数 9,000株
北の達人コーポ	50,400	859.00	43,293,600	貸付株式数 20,800株
ユーグレナ	406,200	1,172.00	476,066,400	貸付株式数 207,100株 (65,000株)
片倉工業	126,100	1,259.00	158,759,900	
グ ン ゼ	820,000	405.00	332,100,000	
ヒューリック	2,159,300	1,131.00	2,442,168,300	貸付株式数 493,500株
神 栄	141,000	168.00	23,688,000	貸付株式数 65,000株
山下医科器械	8,300	1,789.00	14,848,700	貸付株式数 4,000株 (1,200株)
ラサ商事	44,400	967.00	42,934,800	
アルペン	79,100	1,970.00	155,827,000	貸付株式数 9,300株
ラクーン	65,800	652.00	42,901,600	貸付株式数 32,200株 (16,200株)
クオール	116,700	1,706.00	199,090,200	
アルコニックス	58,900	1,998.00	117,682,200	
神戸物産	56,000	5,290.00	296,240,000	
ジンス	70,300	6,010.00	422,503,000	貸付株式数 34,700株 (7,500株)

ビックカメラ	594,200	1,175.00	698,185,000	貸付株式数 293,700株 (55,200株)
DCMホールディングス	628,100	952.00	597,951,200	貸付株式数 310,400株 (2,900株)
MonotaRO	366,900	3,555.00	1,304,329,500	貸付株式数 137,400株
東京一番フーズ	25,700	583.00	14,983,100	貸付株式数 10,600株
ダイヤモンドダイニング	22,800	2,210.00	50,388,000	
あいホールディングス	147,400	2,931.00	432,029,400	貸付株式数 72,900株 (26,400株)
ディーブイエックス	36,700	1,276.00	46,829,200	貸付株式数 14,500株
きちり	27,500	667.00	18,342,500	
アークランドサービスHD	86,000	1,869.00	160,734,000	貸付株式数 16,000株
J. フロントリテイリング	1,309,700	1,642.00	2,150,527,400	貸付株式数 257,100株
ドトール・日レスHD	181,300	2,388.00	432,944,400	
マツモトキヨシHLDGS	195,700	6,310.00	1,234,867,000	
ブロンコビリー	54,000	2,611.00	140,994,000	貸付株式数 26,400株 (4,500株)
スタートトゥデイ	913,400	2,725.00	2,489,015,000	
トレジャー・ファクトリー	29,400	799.00	23,490,600	貸付株式数 11,000株 (2,600株)
物語コーポレーション	29,300	5,600.00	164,080,000	貸付株式数 6,700株
ココカラファイン	107,800	5,390.00	581,042,000	
三越伊勢丹HD	2,059,500	1,116.00	2,298,402,000	貸付株式数 1,014,400株
東洋紡	4,350,000	212.00	922,200,000	
ユニチカ	3,009,000	83.00	249,747,000	
富士紡ホールディングス	53,400	3,265.00	174,351,000	
日清紡ホールディングス	582,300	1,148.00	668,480,400	
倉敷紡績	1,108,000	264.00	292,512,000	
ダイワボウHD	879,000	411.00	361,269,000	
シキボウ	592,000	150.00	88,800,000	
日東紡績	887,000	590.00	523,330,000	
トヨタ紡織	366,700	2,292.00	840,476,400	貸付株式数 29,000株
マクニカ・富士エレHLDGS	191,500	1,632.00	312,528,000	
Hamee	31,000	1,644.00	50,964,000	貸付株式数 15,300株 (3,200株)
ウエルシアHD	273,100	4,015.00	1,096,496,500	
クリエイトSDH	152,300	2,514.00	382,882,200	貸付株式数 3,700株
バイタルKSKHD	194,400	882.00	171,460,800	

八洲電機	79,800	812.00	64,797,600	
メディアスホールディングス	15,800	3,010.00	47,558,000	貸付株式数 7,800株 (1,000株)
U K Cホールディングス	66,500	1,899.00	126,283,500	
丸善C H I H D	120,600	364.00	43,898,400	貸付株式数 59,500株 (57,800株)
大光	23,500	1,101.00	25,873,500	
O C H Iホールディングス	29,900	1,333.00	39,856,700	貸付株式数 3,000株
T O K A Iホールディングス	454,900	831.00	378,021,900	貸付株式数 224,900株
ミサワ	18,400	451.00	8,298,400	貸付株式数 5,900株 (100株)
ティーライフ	13,700	1,705.00	23,358,500	貸付株式数 6,700株
大阪工機	15,500	813.00	12,601,500	
エー・ピーカンパニー	16,800	890.00	14,952,000	貸付株式数 7,300株 (600株)
三洋貿易	56,700	2,614.00	148,213,800	
チムニー	31,400	2,803.00	88,014,200	貸付株式数 14,800株 (5,700株)
シュッピン	39,000	2,120.00	82,680,000	貸付株式数 10,600株 (10,000株)
ビューティガレージ	13,500	1,545.00	20,857,500	
ウイン・パートナーズ	74,500	1,286.00	95,807,000	
ネクステージ	33,700	1,982.00	66,793,400	貸付株式数 18,200株 (2,800株)
ジョイフル本田	168,100	3,160.00	531,196,000	貸付株式数 10,600株
鳥貴族	37,800	2,549.00	96,352,200	貸付株式数 18,300株 (10,700株)
キリン堂ホールディングス	33,100	1,057.00	34,986,700	
ホットランド	47,900	1,391.00	66,628,900	貸付株式数 23,400株 (1,800株)
すかいらーく	448,500	1,672.00	749,892,000	貸付株式数 98,000株
綿半ホールディングス	41,700	2,411.00	100,538,700	
日本毛織	309,800	916.00	283,776,800	
ダイトウボウ	145,000	76.00	11,020,000	
トーア紡コーポレーション	46,600	553.00	25,769,800	
ダイドーリミテッド	122,800	440.00	54,032,000	
ヨシックス	13,300	1,635.00	21,745,500	
ユナイテッド・スーパー マーケ	343,100	1,095.00	375,694,500	貸付株式数 88,500株
三栄建築設計	41,500	1,810.00	75,115,000	

野村不動産HLDGS	687,400	2,199.00	1,511,592,600	貸付株式数	11,000株
三重交通グループHD	183,400	388.00	71,159,200	貸付株式数	44,600株
サムティ	83,200	1,281.00	106,579,200	貸付株式数	31,300株 (7,200株)
ディア・ライフ	93,900	429.00	40,283,100	貸付株式数	45,100株
エー・ディー・ワークス	949,000	45.00	42,705,000		
日本商業開発	58,200	1,667.00	97,019,400	貸付株式数	28,800株
プレサンスコーポレーション	160,500	1,541.00	247,330,500	貸付株式数	12,700株
ユニゾホールディングス	85,200	2,557.00	217,856,400	貸付株式数	42,000株 (42,000株)
THEグローバル社	48,100	554.00	26,647,400	貸付株式数	24,500株 (24,500株)
日本管理センター	68,200	1,419.00	96,775,800	貸付株式数	14,000株 (4,600株)
サンセイランディック	21,100	777.00	16,394,700		
エストラスト	17,900	714.00	12,780,600	貸付株式数	400株
フージャースHD	133,600	1,004.00	134,134,400		
オープンハウス	168,400	3,465.00	583,506,000	貸付株式数	83,200株
東急不動産HD	2,504,200	662.00	1,657,780,400	貸付株式数	59,700株
飯田GHD	862,900	1,849.00	1,595,502,100	貸付株式数	435,300株
ムゲンエステート	47,500	946.00	44,935,000	貸付株式数	23,200株
帝国繊維	115,000	1,943.00	223,445,000	貸付株式数	17,300株
ブックオフコーポレーション	58,800	788.00	46,334,400	貸付株式数	28,700株
日本コークス工業	886,100	98.00	86,837,800	貸付株式数	152,900株
ゴルフダイジェスト・オン	41,700	796.00	33,193,200	貸付株式数	15,700株
ミタチ産業	23,900	754.00	18,020,600		
B E E N O S	15,900	1,422.00	22,609,800	貸付株式数	1,200株
あさひ	76,900	1,323.00	101,738,700	貸付株式数	1,800株
日本調剤	36,500	3,530.00	128,845,000	貸付株式数	17,100株 (12,200株)
コスモス薬品	52,100	22,000.00	1,146,200,000		
シップヘルスケアHD	198,700	3,380.00	671,606,000		
トーエル	49,800	900.00	44,820,000		
一六堂	21,600	393.00	8,488,800		
ソフトクリエイイトHD	49,300	1,455.00	71,731,500		
オンリー	15,400	825.00	12,705,000		
セブン&アイ・HLDGS	4,332,400	4,535.00	19,647,434,000	貸付株式数	2,000株
薬王堂	51,400	2,933.00	150,756,200	貸付株式数	8,900株

クリエイト・レストランツ・ホール	277,600	1,017.00	282,319,200	貸付株式数 20,000株 (20,000株)
明治電機工業	35,300	1,347.00	47,549,100	貸付株式数 1,600株
ツルハホールディングス	207,200	11,570.00	2,397,304,000	
デリカフーズ	21,700	1,685.00	36,564,500	貸付株式数 10,700株
スターティア	23,300	650.00	15,145,000	貸付株式数 11,500株
サンマルクホールディングス	66,800	3,380.00	225,784,000	
フェリシモ	29,400	1,174.00	34,515,600	貸付株式数 7,000株
トリドールホールディングス	127,100	2,867.00	364,395,700	
帝人	897,900	2,199.00	1,974,482,100	貸付株式数 107,000株
東レ	7,969,400	956.10	7,619,543,340	貸付株式数 3,961,100株
クラレ	1,849,000	2,135.00	3,947,615,000	貸付株式数 430,100株
旭化成	6,851,000	1,210.50	8,293,135,500	
サカイ オーベックス	25,900	1,796.00	46,516,400	
TOKYO BASE	13,200	4,625.00	61,050,000	
稲葉製作所	58,400	1,445.00	84,388,000	貸付株式数 10,700株
宮地エンジニアリングG	315,000	263.00	82,845,000	貸付株式数 27,000株
トーカロ	72,000	3,785.00	272,520,000	
アルファCO	36,500	2,455.00	89,607,500	貸付株式数 17,700株
SUMCO	955,100	1,748.00	1,669,514,800	貸付株式数 138,700株
川田テクノロジーズ	20,800	7,600.00	158,080,000	貸付株式数 10,300株 (9,700株)
RS TECHNOLOGIES	10,700	4,235.00	45,314,500	貸付株式数 5,000株
ファーストブラザーズ	14,000	1,687.00	23,618,000	
ハウスドゥ	16,500	1,675.00	27,637,500	貸付株式数 8,100株
シーアールイー	16,400	1,510.00	24,764,000	貸付株式数 2,900株
ケイアイスター不動産	27,800	2,081.00	57,851,800	
住江織物	300,000	275.00	82,500,000	貸付株式数 19,000株
日本フェルト	63,000	507.00	31,941,000	
イチカワ	71,000	316.00	22,436,000	貸付株式数 13,000株
エコナックホールディングス	390,000	71.00	27,690,000	
日東製網	11,800	1,852.00	21,853,600	
芦森工業	237,000	361.00	85,557,000	
アツギ	902,000	126.00	113,652,000	
コメダホールディングス	187,200	1,816.00	339,955,200	

サツドラホールディングス	13,500	1,971.00	26,608,500	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
ダイユー・リックHLDGS	33,300	805.00	26,806,500	
バロックジャパン	81,600	1,201.00	98,001,600	貸付株式数 40,100株
クスリのアオキHLDGS	82,000	5,630.00	461,660,000	貸付株式数 600株
ダイニック	206,000	187.00	38,522,000	
共和レザー	63,800	940.00	59,972,000	
スシローグローバルHLDGS	93,900	3,345.00	314,095,500	貸付株式数 46,400株
LIXILピバ	98,300	2,003.00	196,894,900	
セーレン	273,600	1,771.00	484,545,600	
ソトー	40,800	1,158.00	47,246,400	
東海染工	152,000	136.00	20,672,000	
小松精練	154,500	711.00	109,849,500	
ワコールホールディングス	653,000	1,515.00	989,295,000	貸付株式数 26,000株
ホギメディカル	69,200	7,370.00	510,004,000	貸付株式数 34,200株 (3,000株)
レナウン	296,900	160.00	47,504,000	貸付株式数 144,800株
クラウドディア	25,200	648.00	16,329,600	貸付株式数 2,400株
T S Iホールディングス	452,500	795.00	359,737,500	
T I S	343,100	3,055.00	1,048,170,500	
ネオス	30,600	496.00	15,177,600	貸付株式数 8,100株 (600株)
電算システム	35,900	1,767.00	63,435,300	貸付株式数 6,700株
グリー	630,200	934.00	588,606,800	貸付株式数 314,900株
コーエーテクモHD	245,600	2,175.00	534,180,000	貸付株式数 121,400株
三菱総合研究所	44,000	3,270.00	143,880,000	貸付株式数 100株
ボルテージ	18,500	1,593.00	29,470,500	貸付株式数 8,900株
電算	11,400	2,219.00	25,296,600	貸付株式数 3,300株
A G S	26,000	1,601.00	41,626,000	貸付株式数 7,100株 (5,300株)
ファインデックス	76,700	924.00	70,870,800	貸付株式数 24,100株 (2,700株)
ヒト・コミュニケーションズ	23,300	2,130.00	49,629,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
ブレインパッド	22,000	1,308.00	28,776,000	貸付株式数 10,800株 (4,600株)
K L a b	197,900	2,129.00	421,329,100	貸付株式数 96,700株 (54,700株)

ポルトゥウィン・ピット クル	74,500	1,513.00	112,718,500		
イーブックイニシアティブ	16,100	1,123.00	18,080,300	貸付株式数	7,300株
ネクソン	1,143,100	2,161.00	2,470,239,100	貸付株式数	107,000株
アイスタイル	233,000	839.00	195,487,000	貸付株式数	107,500株 (33,700株)
エムアップ	29,100	1,865.00	54,271,500	貸付株式数	14,400株 (12,500株)
エイチーム	69,700	2,925.00	203,872,500	貸付株式数	34,200株 (22,200株)
テクノスジャパン	79,700	1,136.00	90,539,200	貸付株式数	39,200株 (3,800株)
e n i s h	30,400	2,785.00	84,664,000	貸付株式数	15,000株 (900株)
コロプラ	332,000	1,143.00	379,476,000	貸付株式数	169,200株 (113,100株)
モバイルクリエイト	75,500	420.00	31,710,000	貸付株式数	34,400株 (21,800株)
オルトプラス	46,100	1,215.00	56,011,500	貸付株式数	19,800株
ブロードリーフ	255,000	700.00	178,500,000	貸付株式数	87,000株
ハーツユナイテッドグルー プ	54,500	1,732.00	94,394,000	貸付株式数	27,700株 (5,400株)
メディアドゥ	29,400	2,764.00	81,261,600	貸付株式数	14,500株 (900株)
ブイキューブ	57,100	603.00	34,431,300	貸付株式数	28,900株 (13,200株)
サイバーリンクス	15,600	1,259.00	19,640,400	貸付株式数	7,200株
ディー・エル・イー	46,000	585.00	26,910,000	貸付株式数	23,400株 (4,400株)
フィックスターズ	17,200	4,500.00	77,400,000	貸付株式数	8,500株
VOYAGE GROUP	51,400	2,466.00	126,752,400	貸付株式数	26,200株 (18,100株)
オブティム	21,600	3,120.00	67,392,000	貸付株式数	10,400株 (8,000株)
セレス	24,600	1,539.00	37,859,400	貸付株式数	12,100株
特種東海製紙	63,800	4,075.00	259,985,000		
ベリサーブ	11,800	3,400.00	40,120,000	貸付株式数	5,800株 (2,700株)
ティーガイア	103,000	2,105.00	216,815,000		
日本アジアグループ	117,100	434.00	50,821,400		
豆蔵ホールディングス	75,900	1,005.00	76,279,500		

テクマトリックス	64,500	1,805.00	116,422,500	貸付株式数	32,800株
ガンホー・オンライン・エンター	2,177,700	294.00	640,243,800	貸付株式数	1,106,800株
GMOペイメントゲートウェイ	72,600	6,190.00	449,394,000	貸付株式数	38,100株 (19,000株)
ザッパラス	53,300	516.00	27,502,800		
システムリサーチ	10,200	2,191.00	22,348,200		
インターネットイニシアティブ	152,100	2,033.00	309,219,300	貸付株式数	20,300株
さくらインターネット	84,100	915.00	76,951,500	貸付株式数	23,900株 (2,300株)
GMOクラウド	22,800	3,790.00	86,412,000	貸付株式数	11,200株 (100株)
SRAホールディングス	54,600	3,120.00	170,352,000	貸付株式数	1,200株
MINORISソリューションズ	22,900	1,302.00	29,815,800	貸付株式数	4,800株
システムインテグレータ	14,300	775.00	11,082,500		
朝日ネット	93,800	524.00	49,151,200		
アドソル日進	27,200	1,217.00	33,102,400	貸付株式数	7,900株
フリービット	76,200	918.00	69,951,600	貸付株式数	37,500株 (27,900株)
コムチュア	17,300	4,830.00	83,559,000	貸付株式数	8,500株
サイバーコム	18,100	1,084.00	19,620,400	貸付株式数	8,900株 (2,800株)
王子ホールディングス	4,294,000	579.00	2,486,226,000	貸付株式数	5,000株
日本製紙	492,200	2,220.00	1,092,684,000	貸付株式数	243,300株
三菱製紙	156,200	784.00	122,460,800		
北越紀州製紙	613,300	854.00	523,758,200	貸付株式数	137,400株
中越パルプ	435,000	233.00	101,355,000	貸付株式数	101,000株 (101,000株)
巴川製紙	168,000	239.00	40,152,000		
大王製紙	437,700	1,475.00	645,607,500	貸付株式数	223,200株 (53,400株)
阿波製紙	26,500	638.00	16,907,000		
メディカル・データ・ビジ	39,100	2,701.00	105,609,100	貸付株式数	19,200株
gumi	117,400	1,453.00	170,582,200	貸付株式数	57,700株
ショーケース・ティービー	15,300	1,195.00	18,283,500	貸付株式数	7,500株 (1,000株)
デジタル・インフォメーション	15,100	1,965.00	29,671,500		
PCIホールディングス	17,000	2,564.00	43,588,000	貸付株式数	4,500株



パイプドHD	18,300	1,220.00	22,326,000		
アイビーシー	10,700	1,127.00	12,058,900	貸付株式数	5,200株
オープンドア	13,400	3,200.00	42,880,000	貸付株式数	5,000株 (5,000株)
LINE	232,900	3,855.00	897,829,500	貸付株式数	114,500株
レンゴー	1,059,200	648.00	686,361,600	貸付株式数	422,500株
トーモク	346,000	397.00	137,362,000		
ザ・パック	77,800	3,610.00	280,858,000		
オークネット	32,100	1,414.00	45,389,400		
AOI TYO HOLDINGS	84,300	1,138.00	95,933,400	貸付株式数	41,600株
マクロミル	132,700	2,718.00	360,678,600		
昭和電工	731,300	2,688.00	1,965,734,400	貸付株式数	19,000株
住友化学	8,086,000	647.00	5,231,642,000		
住友精化	45,500	5,420.00	246,610,000		
日産化学	594,000	3,840.00	2,280,960,000		
ラサ工業	414,000	144.00	59,616,000	貸付株式数	48,000株
クレハ	82,800	5,570.00	461,196,000	貸付株式数	41,000株
多木化学	15,000	4,475.00	67,125,000		
テイカ	166,000	978.00	162,348,000		
石原産業	197,300	1,156.00	228,078,800		
片倉コープアグリ	148,000	263.00	38,924,000		
日東エフシー	64,200	952.00	61,118,400	貸付株式数	12,300株
日本曹達	659,000	626.00	412,534,000		
東ソー	3,176,000	1,219.00	3,871,544,000		
トクヤマ	1,708,000	554.00	946,232,000		
セントラル硝子	1,120,000	482.00	539,840,000		
東亜合成	644,800	1,432.00	923,353,600		
大阪ソーダ	473,000	544.00	257,312,000		
関東電化	224,900	1,029.00	231,422,100	貸付株式数	32,800株 (5,000株)
デンカ	2,163,000	594.00	1,284,822,000		
イビデン	733,900	1,966.00	1,442,847,400	貸付株式数	366,900株
信越化学	1,970,000	9,965.00	19,631,050,000		
日本カ-バイド	374,000	185.00	69,190,000		
堺化学	410,000	430.00	176,300,000		
エア・ウォーター	905,900	2,053.00	1,859,812,700	貸付株式数	354,700株
大陽日酸	846,200	1,245.00	1,053,519,000	貸付株式数	6,300株
日本化学工業	407,000	235.00	95,645,000		
日本パ-カラijing	561,400	1,614.00	906,099,600	貸付株式数	47,800株

高圧ガス	162,900	820.00	133,578,000	貸付株式数	18,400株
チタン工業	127,000	196.00	24,892,000	貸付株式数	24,000株
四国化成	157,000	1,343.00	210,851,000		
戸田工業	217,000	280.00	60,760,000		
ステラ ケミファ	53,400	2,971.00	158,651,400	貸付株式数	27,200株 (6,400株)
保土谷化学	38,400	4,410.00	169,344,000	貸付株式数	19,500株 (8,000株)
日本触媒	172,700	7,230.00	1,248,621,000	貸付株式数	85,400株
大日精化	455,000	903.00	410,865,000		
カネカ	1,482,000	871.00	1,290,822,000	貸付株式数	732,000株
協和発酵キリン	1,314,100	1,980.00	2,601,918,000	貸付株式数	531,800株
三菱瓦斯化学	1,023,400	2,457.00	2,514,493,800		
三井化学	4,992,000	605.00	3,020,160,000		
J S R	1,104,300	1,956.00	2,160,010,800	貸付株式数	431,100株
東京応化工業	205,600	3,730.00	766,888,000	貸付株式数	101,600株
大阪有機化学	71,200	1,309.00	93,200,800	貸付株式数	34,400株
三菱ケミカルH L D G S	7,401,000	954.90	7,067,214,900	貸付株式数	94,200株
K H ネオケム	167,500	2,128.00	356,440,000		
ダイセル	1,481,500	1,422.00	2,106,693,000		
住友ベークライト	969,000	811.00	785,859,000	貸付株式数	65,000株
積水化学	2,444,900	2,000.00	4,889,800,000	貸付株式数	116,900株
日本ゼオン	926,000	1,239.00	1,147,314,000	貸付株式数	459,000株 (287,000株)
アイカ工業	352,200	3,355.00	1,181,631,000		
宇部興産	5,533,000	293.00	1,621,169,000		
積水樹脂	169,500	2,020.00	342,390,000	貸付株式数	1,000株
タキロンシーアイ	231,000	583.00	134,673,000		
旭有機材	354,000	256.00	90,624,000		
日立化成	610,700	3,310.00	2,021,417,000		
ニチバン	108,000	962.00	103,896,000		
リケンテクノス	236,800	624.00	147,763,200	貸付株式数	116,900株
大倉工業	263,000	605.00	159,115,000		
積水化成品	153,000	968.00	148,104,000		
群栄化学	26,400	3,585.00	94,644,000		
タイガース ポリマー	54,000	739.00	39,906,000		
ミライアル	39,500	1,055.00	41,672,500		
ダイキアクシス	36,000	1,022.00	36,792,000		
ダイキョーニシカワ	192,500	1,587.00	305,497,500	貸付株式数	95,400株 (95,400株)

日本化薬	713,000	1,601.00	1,141,513,000	貸付株式数	9,000株
カーリットホールディングス	101,800	612.00	62,301,600		
E P Sホールディングス	150,800	1,758.00	265,106,400	貸付株式数	7,700株
ソルクシーズ	39,200	789.00	30,928,800	貸付株式数	19,100株
レグス	24,700	783.00	19,340,100		
プレステージ・インター	207,200	1,181.00	244,703,200		
フェイス	27,200	1,171.00	31,851,200	貸付株式数	12,700株
ハイマックス	13,500	1,624.00	21,924,000		
アミューズ	60,600	2,932.00	177,679,200	貸付株式数	25,200株
野村総合研究所	773,700	4,295.00	3,323,041,500	貸付株式数	117,300株
ドリームインキュベータ	33,300	2,166.00	72,127,800	貸付株式数	1,900株
サイバネットシステム	84,400	727.00	61,358,800	貸付株式数	31,500株
クイック	56,000	1,471.00	82,376,000	貸付株式数	13,900株 (13,900株)
T A C	60,300	250.00	15,075,000	貸付株式数	11,400株
C Eホールディングス	14,500	1,110.00	16,095,000	貸付株式数	3,400株
ケネディクス	1,389,300	529.00	734,939,700	貸付株式数	633,800株
電通	1,221,000	5,130.00	6,263,730,000	貸付株式数	608,500株 (281,200株)
インテージホールディングス	59,000	2,252.00	132,868,000		
テイクアンドギヴニーズ	51,000	814.00	41,514,000		
東邦システムサイエンス	33,800	730.00	24,674,000		
ぴあ	33,100	3,655.00	120,980,500	貸付株式数	11,200株 (700株)
イオンファンタジー	32,000	3,315.00	106,080,000	貸付株式数	12,000株 (12,000株)
ソースネクスト	62,000	613.00	38,006,000	貸付株式数	3,600株
シーティーエス	58,300	1,436.00	83,718,800	貸付株式数	16,200株 (8,000株)
ネクシィーズグループ	39,300	1,807.00	71,015,100	貸付株式数	19,200株 (11,600株)
メディカルシステムネットワーク	116,800	501.00	58,516,800		
日本精化	90,900	1,018.00	92,536,200		
扶桑化学工業	78,100	3,505.00	273,740,500		
A D E K A	472,600	1,678.00	793,022,800		
日油	848,000	1,477.00	1,252,496,000		
ミヨシ油脂	40,300	1,415.00	57,024,500		
新日本理化	173,300	158.00	27,381,400	貸付株式数	66,300株

ハリマ化成グループ	93,400	1,035.00	96,669,000		
花王	2,740,300	6,702.00	18,365,490,600	貸付株式数	91,300株
第一工業製薬	244,000	526.00	128,344,000		
日華化学	34,500	1,191.00	41,089,500		
ニイタカ	15,800	1,740.00	27,492,000		
三洋化成	69,000	5,260.00	362,940,000		
武田薬品	4,119,400	5,694.00	23,455,863,600	貸付株式数	1,996,800株
アステラス製薬	10,779,400	1,385.50	14,934,858,700	貸付株式数	4,365,300株
大日本住友製薬	777,500	1,519.00	1,181,022,500	貸付株式数	384,300株
塩野義製薬	1,393,400	6,004.00	8,365,973,600	貸付株式数	13,300株
田辺三菱製薬	1,279,800	2,610.00	3,340,278,000	貸付株式数	93,500株
わかもと製薬	124,000	279.00	34,596,000		
あすか製薬	119,400	1,657.00	197,845,800		
日本新薬	251,700	7,040.00	1,771,968,000		
ビオフェルミン製薬	17,700	3,025.00	53,542,500		
中外製薬	1,093,600	4,085.00	4,467,356,000		
科研製薬	205,100	5,990.00	1,228,549,000		
エーザイ	1,352,100	6,088.00	8,231,584,800	貸付株式数	62,800株
理研ビタミン	34,700	4,330.00	150,251,000		
ロート製薬	537,700	2,318.00	1,246,388,600		
小野薬品	2,494,500	2,468.50	6,157,673,250	貸付株式数	368,500株
久光製薬	309,900	5,230.00	1,620,777,000	貸付株式数	153,100株
有機合成薬品	71,600	284.00	20,334,400	貸付株式数	24,300株
持田製薬	73,500	7,840.00	576,240,000	貸付株式数	600株
参天製薬	1,984,100	1,563.00	3,101,148,300	貸付株式数	824,800株
扶桑薬品	36,900	2,710.00	99,999,000		
日本ケミファ	15,100	5,230.00	78,973,000		
ツムラ	368,700	4,420.00	1,629,654,000		
日医工	256,800	1,738.00	446,318,400	貸付株式数	130,900株 (4,300株)
テルモ	1,607,700	4,345.00	6,985,456,500	貸付株式数	3,400株
みらかホールディングス	279,900	4,930.00	1,379,907,000		
キッセイ薬品工業	194,600	2,947.00	573,486,200		
生化学工業	203,500	1,829.00	372,201,500	貸付株式数	6,900株
栄研化学	92,200	3,465.00	319,473,000	貸付株式数	9,300株
日水製薬	44,100	1,388.00	61,210,800		
鳥居薬品	65,700	2,676.00	175,813,200	貸付株式数	100株
JCRファーマ	84,500	2,801.00	236,684,500	貸付株式数	38,400株 (8,600株)

東和薬品	50,300	5,160.00	259,548,000	貸付株式数 25,600株 (600株)
富士製薬工業	35,600	3,810.00	135,636,000	
沢井製薬	186,400	6,140.00	1,144,496,000	貸付株式数 79,400株
ゼリア新薬工業	224,900	2,105.00	473,414,500	
第一三共	3,232,500	2,512.00	8,120,040,000	
キョーリン製薬HD	268,500	2,448.00	657,288,000	貸付株式数 4,600株
大幸薬品	55,200	2,382.00	131,486,400	貸付株式数 7,300株
ダイト	65,200	2,425.00	158,110,000	
大塚ホールディングス	2,361,600	4,745.00	11,205,792,000	
大正製薬HD	234,800	8,450.00	1,984,060,000	貸付株式数 78,900株
ペプチドリーム	410,600	3,350.00	1,375,510,000	貸付株式数 200,400株
大日本塗料	629,000	306.00	192,474,000	
日本ペイントHOLD	847,700	4,160.00	3,526,432,000	貸付株式数 432,300株 (10,000株)
関西ペイント	1,154,100	2,531.00	2,921,027,100	貸付株式数 585,100株 (43,500株)
神東塗料	81,000	203.00	16,443,000	
中国塗料	314,900	855.00	269,239,500	貸付株式数 155,700株
日本特殊塗料	76,900	1,879.00	144,495,100	貸付株式数 25,900株
藤倉化成	149,200	631.00	94,145,200	
太陽ホールディングス	89,400	4,990.00	446,106,000	貸付株式数 12,600株
D I C	433,800	4,235.00	1,837,143,000	貸付株式数 111,200株
サカタインクス	224,200	1,806.00	404,905,200	貸付株式数 23,100株
東洋インキSCホールディングン	1,086,000	581.00	630,966,000	
T & K TOKA	79,500	1,143.00	90,868,500	
アルプス技研	44,000	3,680.00	161,920,000	
サニックス	175,200	285.00	49,932,000	貸付株式数 86,100株 (7,000株)
ダイオーズ	19,600	1,255.00	24,598,000	貸付株式数 4,300株
日本空調サービス	104,900	692.00	72,590,800	貸付株式数 1,500株
オリエンタルランド	1,184,400	7,511.00	8,896,028,400	貸付株式数 573,600株
フォーカスシステムズ	53,100	1,333.00	70,782,300	貸付株式数 26,000株 (4,900株)
ダスキン	269,600	2,809.00	757,306,400	貸付株式数 12,400株
パーク24	527,000	2,909.00	1,533,043,000	貸付株式数 267,900株
明光ネットワークジャパン	126,800	1,469.00	186,269,200	
ファルコホールディングス	51,400	1,529.00	78,590,600	貸付株式数 8,800株
クレスコ	23,400	3,460.00	80,964,000	貸付株式数 1,300株

フジ・メディア・HD	1,077,900	1,510.00	1,627,629,000	貸付株式数	532,900株
秀英予備校	21,700	453.00	9,830,100	貸付株式数	8,500株
田谷	18,100	671.00	12,145,100		
ラウンドワン	341,900	1,099.00	375,748,100		
リゾートトラスト	424,100	2,056.00	871,949,600	貸付株式数	188,100株
オービック	356,800	6,860.00	2,447,648,000	貸付株式数	110,100株
ジャストシステム	167,300	1,615.00	270,189,500		
TDCソフトウェアエンジニア	45,000	1,239.00	55,755,000		
ヤフー	7,419,200	491.00	3,642,827,200	貸付株式数	3,783,400株
ビー・エム・エル	143,300	2,189.00	313,683,700		
ワタベウェディング	16,000	544.00	8,704,000	貸付株式数	6,800株
トレンドマイクロ	502,600	5,770.00	2,900,002,000		
りらいあコミュニケーション	181,100	1,208.00	218,768,800	貸付株式数	89,500株
インフォメーションディベロ	29,400	1,450.00	42,630,000		
リソー教育	186,500	903.00	168,409,500	貸付株式数	20,700株
日本オラクル	166,400	7,300.00	1,214,720,000	貸付株式数	30,700株
早稲田アカデミー	14,100	1,446.00	20,388,600		
アルファシステムズ	33,800	2,098.00	70,912,400		
フューチャー	139,700	982.00	137,185,400		
CAC HOLDINGS	77,200	1,029.00	79,438,800	貸付株式数	37,900株
ソフトバンク・テクノ	49,700	2,013.00	100,046,100	貸付株式数	24,500株 (9,400株)
トーセ	27,800	2,622.00	72,891,600	貸付株式数	13,700株
ユー・エス・エス	1,326,100	2,205.00	2,924,050,500	貸付株式数	58,100株
オービックビジネスC	52,600	5,800.00	305,080,000	貸付株式数	26,800株
伊藤忠テクノソリュー	234,500	3,935.00	922,757,500	貸付株式数	2,000株
アイティフォー	134,200	628.00	84,277,600	貸付株式数	200株
東京個別指導学院	35,300	1,506.00	53,161,800	貸付株式数	15,700株 (3,100株)
東計電算	18,100	2,777.00	50,263,700		
サイバーエージェント	658,700	3,565.00	2,348,265,500	貸付株式数	319,100株
楽天	5,601,600	1,317.50	7,380,108,000	貸付株式数	2,811,400株
エックスネット	18,800	894.00	16,807,200		
クリーク・アンド・リバー社	51,500	1,400.00	72,100,000		
テー・オー・ダブリュー	87,700	872.00	76,474,400		
大塚商会	279,200	6,920.00	1,932,064,000	貸付株式数	1,800株
総合メディカル	49,900	4,745.00	236,775,500	貸付株式数	6,300株

サイボウズ	137,400	508.00	69,799,200		
ソフトブレーン	80,600	504.00	40,622,400	貸付株式数	69,800株
セントラルスポーツ	37,300	4,535.00	169,155,500		
パラカ	32,900	2,059.00	67,741,100	貸付株式数	9,800株
電通国際情報S	63,700	2,536.00	161,543,200	貸付株式数	2,400株
デジタルガレージ	200,200	2,107.00	421,821,400	貸付株式数	98,700株
イーエムシステムズ	35,300	2,512.00	88,673,600	貸付株式数	2,300株
ウェザーニューズ	34,600	3,455.00	119,543,000	貸付株式数	8,600株
C I J	87,000	562.00	48,894,000	貸付株式数	7,300株
東洋ビジネスエンジ	10,300	1,743.00	17,952,900		
日本エンタープライズ	105,700	275.00	29,067,500	貸付株式数	52,200株 (35,800株)
WOWOW	49,300	3,060.00	150,858,000	貸付株式数	24,400株
スカラ	71,300	878.00	62,601,400	貸付株式数	35,000株
フルキャストホールディングス	87,700	1,302.00	114,185,400	貸付株式数	13,300株 (10,100株)
富士フイルムHLDGS	2,178,600	4,086.00	8,901,759,600	貸付株式数	12,700株
コニカミノルタ	2,455,400	946.00	2,322,808,400	貸付株式数	653,600株
資生堂	2,084,200	3,887.00	8,101,285,400	貸付株式数	850,400株
ライオン	1,368,200	2,289.00	3,131,809,800	貸付株式数	674,100株
高砂香料	72,200	4,225.00	305,045,000	貸付株式数	200株
マンダム	110,000	6,040.00	664,400,000	貸付株式数	700株
ミルボン	59,300	6,200.00	367,660,000	貸付株式数	19,800株
ファンケル	233,500	2,059.00	480,776,500		
コーセー	177,600	12,020.00	2,134,752,000		
コタ	45,400	1,220.00	55,388,000		
シーズ・ホールディングス	142,500	4,105.00	584,962,500	貸付株式数	31,600株 (31,600株)
シーボン	12,400	2,464.00	30,553,600	貸付株式数	1,100株
ポーラ・オルビスHD	447,700	2,961.00	1,325,639,700	貸付株式数	28,500株
ノエビアホールディングス	69,300	5,580.00	386,694,000	貸付株式数	18,400株
アジュバンコスメジャパン	20,600	955.00	19,673,000	貸付株式数	8,100株
エステー	74,900	2,540.00	190,246,000	貸付株式数	10,000株
アグロカネショウ	42,600	1,541.00	65,646,600		
コニシ	172,300	1,604.00	276,369,200	貸付株式数	9,000株
長谷川香料	139,100	2,295.00	319,234,500	貸付株式数	10,900株
星光PMC	60,100	1,313.00	78,911,300	貸付株式数	29,300株 (4,700株)
小林製薬	293,900	6,660.00	1,957,374,000	貸付株式数	114,000株
荒川化学工業	94,200	1,894.00	178,414,800	貸付株式数	9,300株

メック	85,000	1,331.00	113,135,000	貸付株式数 42,000株 (31,200株)
日本高純度化学	30,800	2,405.00	74,074,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
タカラバイオ	313,700	1,549.00	485,921,300	貸付株式数 155,000株 (34,800株)
J C U	68,900	4,040.00	278,356,000	
新田ゼラチン	65,800	766.00	50,402,800	貸付株式数 4,200株
O A T アグリオ	12,500	1,655.00	20,687,500	
デクセリアルズ	288,600	1,095.00	316,017,000	
アース製薬	78,900	6,370.00	502,593,000	貸付株式数 40,200株 (4,800株)
北興化学	107,400	507.00	54,451,800	
大成ラミック	33,900	2,890.00	97,971,000	貸付株式数 3,300株
クミアイ化学	466,700	622.00	290,287,400	貸付株式数 230,000株 (54,400株)
日本農薬	273,700	648.00	177,357,600	貸付株式数 89,500株 (25,100株)
昭和シエル石油	981,800	1,108.00	1,087,834,400	
富士興産	37,000	511.00	18,907,000	
ニチレキ	134,100	1,405.00	188,410,500	貸付株式数 2,000株
ユシロ化学	58,800	1,502.00	88,317,600	
ビーピー・カストロール	44,900	1,860.00	83,514,000	貸付株式数 21,900株 (2,600株)
富士石油	254,600	332.00	84,527,200	貸付株式数 125,900株
M O R E S C O	37,800	2,177.00	82,290,600	
出光興産	522,700	2,829.00	1,478,718,300	
J X T G ホールディングス	16,748,500	486.50	8,148,145,250	
コスモエネルギーH L D G S	331,300	1,765.00	584,744,500	貸付株式数 163,400株
横浜ゴム	607,300	2,314.00	1,405,292,200	
東洋ゴム	581,700	2,376.00	1,382,119,200	
ブリヂストン	3,707,000	4,858.00	18,008,606,000	
住友ゴム	1,027,900	2,012.00	2,068,134,800	
藤倉ゴム	91,600	711.00	65,127,600	貸付株式数 16,300株
オカモト	331,000	1,318.00	436,258,000	貸付株式数 6,000株
アキレス	89,700	1,933.00	173,390,100	
フ コ ク	45,900	1,026.00	47,093,400	
ニッタ	98,600	3,590.00	353,974,000	貸付株式数 15,600株
クリエートメディック	34,500	986.00	34,017,000	



住友理工	203,300	1,163.00	236,437,900	
三ツ星ベルト	255,000	1,214.00	309,570,000	
バンドー化学	199,900	1,084.00	216,691,600	
旭硝子	1,072,200	4,845.00	5,194,809,000	貸付株式数 30,000株
日本板硝子	500,400	978.00	489,391,200	
石塚硝子	152,000	219.00	33,288,000	
有沢製作所	186,300	913.00	170,091,900	
日本山村硝子	436,000	184.00	80,224,000	
日本電気硝子	453,700	4,040.00	1,832,948,000	
オハラ	41,400	1,250.00	51,750,000	貸付株式数 20,200株 (2,800株)
住友大阪セメント	2,039,000	544.00	1,109,216,000	貸付株式数 608,000株
太平洋セメント	6,625,000	419.00	2,775,875,000	
リソルホールディングス	109,000	366.00	39,894,000	
日本ヒューム	105,100	701.00	73,675,100	
日本コンクリート	244,600	431.00	105,422,600	貸付株式数 71,100株 (20,100株)
三谷セキサン	54,900	2,771.00	152,127,900	貸付株式数 9,900株
アジアパイルHD	135,000	756.00	102,060,000	
東海カーボン	952,300	659.00	627,565,700	
日本カーボン	53,900	3,385.00	182,451,500	貸付株式数 27,400株 (10,000株)
東洋炭素	61,000	1,923.00	117,303,000	
ノリタケ	61,900	3,885.00	240,481,500	
TOTO	806,900	4,210.00	3,397,049,000	
日本碍子	1,386,700	2,252.00	3,122,848,400	貸付株式数 148,700株
日本特殊陶業	946,400	2,361.00	2,234,450,400	貸付株式数 469,200株
ダントーホールディングス	78,000	148.00	11,544,000	
MARUWA	40,300	4,500.00	181,350,000	貸付株式数 19,800株
品川リフラクトリーズ	276,000	274.00	75,624,000	
黒崎播磨	237,000	434.00	102,858,000	
ヨータイ	60,000	377.00	22,620,000	
イソライト	53,800	377.00	20,282,600	貸付株式数 16,400株
東京窯業	133,300	212.00	28,259,600	
ニッカトー	35,500	603.00	21,406,500	
フジミインコーポレーテッド	93,500	2,374.00	221,969,000	貸付株式数 46,100株 (31,100株)
エーアンドエーマテリアル	228,000	126.00	28,728,000	
ニチアス	574,000	1,348.00	773,752,000	貸付株式数 22,000株
新日鐵住金	4,951,500	2,649.00	13,116,523,500	貸付株式数 899,000株

神戸製鋼所	1,898,500	1,232.00	2,338,952,000	貸付株式数	922,800株
中山製鋼所	123,300	679.00	83,720,700		
合同製鐵	61,400	2,382.00	146,254,800	貸付株式数	12,700株
J F Eホールディングス	3,001,400	2,034.00	6,104,847,600	貸付株式数	1,510,800株
日新製鋼	357,700	1,257.00	449,628,900		
東京製鐵	555,500	974.00	541,057,000	貸付株式数	300株
共英製鋼	117,000	1,935.00	226,395,000	貸付株式数	58,200株 (20,000株)
大和工業	220,400	2,987.00	658,334,800	貸付株式数	2,400株
東京鐵鋼	229,000	445.00	101,905,000		
大阪製鐵	68,800	2,229.00	153,355,200		
淀川製鋼所	151,700	3,055.00	463,443,500		
東洋鋼鈑	262,600	420.00	110,292,000		
丸一鋼管	367,300	3,400.00	1,248,820,000	貸付株式数	181,700株
モリ工業	34,100	2,265.00	77,236,500		
大同特殊鋼	1,839,000	673.00	1,237,647,000		
日本高周波	383,000	85.00	32,555,000		
日本冶金工	908,400	241.00	218,924,400	貸付株式数	135,000株
山陽特殊製鋼	653,000	663.00	432,939,000		
愛知製鋼	64,700	4,625.00	299,237,500		
日立金属	1,117,400	1,630.00	1,821,362,000	貸付株式数	533,400株
日本金属	26,200	1,670.00	43,754,000	貸付株式数	9,100株 (8,100株)
大平洋金属	701,000	297.00	208,197,000	貸付株式数	317,000株
新日本電工	621,200	414.00	257,176,800	貸付株式数	29,100株
栗本鉄工所	52,400	2,060.00	107,944,000		
虹 技	152,000	239.00	36,328,000	貸付株式数	29,000株
日本鑄鉄管	107,000	182.00	19,474,000	貸付株式数	37,000株
日本製鋼所	362,900	1,861.00	675,356,900	貸付株式数	179,500株
三菱製鋼	765,000	282.00	215,730,000		
日亜鋼業	151,700	280.00	42,476,000		
日本精線	74,000	699.00	51,726,000	貸付株式数	16,000株
大紀アルミニウム	183,000	611.00	111,813,000		
日本軽金属HD	2,826,400	277.00	782,912,800		
三井金属	2,985,000	475.00	1,417,875,000		
東邦亜鉛	619,000	474.00	293,406,000		
三菱マテリアル	685,100	3,425.00	2,346,467,500		
住友鋳山	2,841,000	1,507.00	4,281,387,000	貸付株式数	1,388,000株
DOWAホールディングス	1,211,000	876.00	1,060,836,000		

古河機金	1,712,000	204.00	349,248,000	貸付株式数 23,000株 (23,000株)
エス・サイエンス	491,400	214.00	105,159,600	貸付株式数 250,500株
大阪チタニウム	119,800	1,770.00	212,046,000	貸付株式数 58,400株 (17,000株)
東邦チタニウム	185,700	812.00	150,788,400	貸付株式数 92,000株
U A C J	1,551,000	319.00	494,769,000	
古河電工	368,200	4,980.00	1,833,636,000	
住友電工	4,136,700	1,793.50	7,419,171,450	貸付株式数 147,700株
フジクラ	1,445,200	976.00	1,410,515,200	
昭和電線H L D G S	1,305,000	92.00	120,060,000	
東京特殊電線	15,400	2,047.00	31,523,800	貸付株式数 7,000株
タツタ電線	205,600	675.00	138,780,000	
沖 電 線	114,000	271.00	30,894,000	貸付株式数 7,000株
カナレ電気	15,300	2,486.00	38,035,800	貸付株式数 7,500株
平河ヒューテック	51,700	1,497.00	77,394,900	貸付株式数 10,300株
リョービ	638,000	475.00	303,050,000	
アーステイ	127,100	1,148.00	145,910,800	
アサヒHD	165,300	1,866.00	308,449,800	
東洋製罐グループHD	780,100	1,867.00	1,456,446,700	貸付株式数 16,000株
ホッカンホールディングス	285,000	428.00	121,980,000	
コロナ	57,300	1,159.00	66,410,700	
横河ブリッジH L D G S	192,900	1,602.00	309,025,800	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
O S J B H D	359,100	291.00	104,498,100	貸付株式数 97,800株
駒井ハルテック	20,900	2,213.00	46,251,700	
高田機工	95,000	280.00	26,600,000	
三和ホールディングス	1,089,600	1,175.00	1,280,280,000	貸付株式数 525,100株
文化シャッタ -	305,600	879.00	268,622,400	
三協立山	143,900	1,747.00	251,393,300	貸付株式数 71,100株 (1,600株)
アルインコ	75,400	1,114.00	83,995,600	
東洋シャッタ -	27,000	635.00	17,145,000	
L I X I Lグループ	1,529,200	2,808.00	4,293,993,600	貸付株式数 307,000株 (60,000株)
日本ファイルコン	79,400	597.00	47,401,800	
ノーリツ	215,800	2,203.00	475,407,400	貸付株式数 106,300株
長府製作所	117,200	2,591.00	303,665,200	貸付株式数 15,000株
リンナイ	187,000	10,200.00	1,907,400,000	貸付株式数 75,300株
ユニプレス	202,500	2,659.00	538,447,500	貸付株式数 1,900株

ダイニチ工業	55,900	788.00	44,049,200	
日東精工	143,200	477.00	68,306,400	
三洋工業	136,000	220.00	29,920,000	
岡 部	210,200	1,015.00	213,353,000	貸付株式数 7,600株
ジーテクト	114,400	2,233.00	255,455,200	貸付株式数 1,100株
中国工業	15,500	754.00	11,687,000	
東 プ レ	211,100	3,000.00	633,300,000	貸付株式数 66,900株
高周波熱錬	199,600	1,023.00	204,190,800	
東京製綱	74,200	1,713.00	127,104,600	貸付株式数 27,100株
サンコール	58,200	639.00	37,189,800	
モリテックスチル	55,100	294.00	16,199,400	
パイオラックス	166,200	3,105.00	516,051,000	貸付株式数 7,900株
エイチワン	83,200	1,223.00	101,753,600	
日本発条	1,033,200	1,230.00	1,270,836,000	貸付株式数 142,700株
中央発條	124,000	348.00	43,152,000	
アドバネクス	18,800	1,665.00	31,302,000	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
三浦工業	448,800	2,161.00	969,856,800	貸付株式数 127,700株
タ ク マ	351,400	1,138.00	399,893,200	貸付株式数 21,700株
テクノプロ・ホールディング グ	178,300	4,390.00	782,737,000	
アトラ	16,800	676.00	11,356,800	貸付株式数 5,800株
インターワークス	22,300	1,123.00	25,042,900	
K e e P e r 技研	31,800	1,332.00	42,357,600	貸付株式数 7,800株 (7,800株)
ファーストロジック	7,700	2,615.00	20,135,500	
三機サービス	10,900	1,346.00	14,671,400	
デザインワン・ジャパン	19,500	1,492.00	29,094,000	貸付株式数 5,500株 (5,500株)
イー・ガーディアン	50,500	2,291.00	115,695,500	貸付株式数 13,000株
リブセンス	64,100	620.00	39,742,000	貸付株式数 18,000株 (6,800株)
ジャパンマテリアル	79,900	1,978.00	158,042,200	貸付株式数 39,300株 (8,800株)
ベクトル	89,000	1,789.00	159,221,000	貸付株式数 13,200株
ウチヤマホールディングス	49,300	465.00	22,924,500	
サクセスホールディングス	10,200	1,627.00	16,595,400	
キャリアリンク	24,500	647.00	15,851,500	貸付株式数 12,100株 (2,100株)
I B J	73,100	731.00	53,436,100	貸付株式数 42,100株

アサンテ	40,200	2,008.00	80,721,600		
N・フィールド	52,000	1,480.00	76,960,000	貸付株式数	17,500株 (2,200株)
バリューHR	11,000	3,030.00	33,330,000		
M&Aキャピタルパートナー	19,500	4,965.00	96,817,500	貸付株式数	9,900株 (7,900株)
ライドオン・エクスプレス	27,200	1,215.00	33,048,000	貸付株式数	13,400株 (7,600株)
E R Iホールディングス	28,000	816.00	22,848,000	貸付株式数	5,500株
アビスト	14,300	4,300.00	61,490,000		
ウィルグループ	44,900	989.00	44,406,100	貸付株式数	6,200株
エスクローAJ	24,400	2,867.00	69,954,800	貸付株式数	900株
日本ビューホテル	22,100	1,455.00	32,155,500	貸付株式数	5,900株
リクルートホールディングス	7,179,800	1,904.00	13,670,339,200	貸付株式数	45,000株
エラン	12,100	2,665.00	32,246,500		
ツガミ	295,000	854.00	251,930,000	貸付株式数	146,000株 (11,000株)
オークマ	715,000	1,052.00	752,180,000		
東芝機械	586,000	510.00	298,860,000		
アマダホールディングス	1,477,600	1,292.00	1,909,059,200		
アイダエンジニア	311,800	1,089.00	339,550,200		
滝澤鉄工所	321,000	182.00	58,422,000		
富士機械製造	334,500	1,750.00	585,375,000	貸付株式数	18,600株
牧野フライス	547,000	929.00	508,163,000	貸付株式数	195,000株 (195,000株)
オーエスジー	468,700	2,349.00	1,100,976,300	貸付株式数	217,500株 (102,000株)
ダイジェット	125,000	176.00	22,000,000		
旭ダイヤモンド	308,400	856.00	263,990,400	貸付株式数	140,800株
D M G森精機	574,200	1,834.00	1,053,082,800	貸付株式数	249,400株
ソディック	278,400	1,346.00	374,726,400	貸付株式数	99,100株
ディスコ	128,500	18,700.00	2,402,950,000	貸付株式数	37,200株
日東工器	63,900	2,609.00	166,715,100		
パンチ工業	39,600	1,313.00	51,994,800		
富士ダイス	39,100	729.00	28,503,900		
土木管理総合試験	14,400	1,704.00	24,537,600	貸付株式数	7,100株
日本郵政	2,858,900	1,406.00	4,019,613,400		
ベルシステム24HLDGS	166,900	1,117.00	186,427,300	貸付株式数	60,000株

一蔵	10,600	1,113.00	11,797,800	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
LITALICO	12,800	1,511.00	19,340,800	貸付株式数 6,300株
エポラブルアジア	20,400	2,833.00	57,793,200	貸付株式数 10,000株
ソラスト	69,300	1,462.00	101,316,600	貸付株式数 2,500株
豊田自動織機	955,000	6,230.00	5,949,650,000	貸付株式数 375,600株
豊和工業	61,300	798.00	48,917,400	貸付株式数 29,900株 (20,500株)
OKK	398,000	130.00	51,740,000	貸付株式数 8,000株
石川製作所	27,000	1,193.00	32,211,000	貸付株式数 13,700株 (3,400株)
東洋機械金属	74,200	794.00	58,914,800	貸付株式数 34,400株
津田駒工業	244,000	180.00	43,920,000	貸付株式数 116,000株 (106,000株)
エンシュウ	269,000	116.00	31,204,000	貸付株式数 133,000株
島精機製作所	143,000	5,320.00	760,760,000	貸付株式数 70,700株
NCホールディングス	35,500	867.00	30,778,500	
フリュー	64,500	1,305.00	84,172,500	
ヤマシンフィルタ	28,300	2,178.00	61,637,400	貸付株式数 14,000株 (700株)
日阪製作所	149,200	969.00	144,574,800	
やまびこ	201,100	1,300.00	261,430,000	貸付株式数 99,400株
ペガサスミシン製造	105,100	737.00	77,458,700	貸付株式数 5,600株
ナプテスコ	570,500	3,275.00	1,868,387,500	貸付株式数 8,800株
三井海洋開発	110,200	2,592.00	285,638,400	貸付株式数 4,400株
レオン自動機	92,500	1,226.00	113,405,000	
SMC	329,100	35,070.00	11,541,537,000	貸付株式数 141,700株
新川	91,400	745.00	68,093,000	貸付株式数 13,100株
ホソカワミクロン	39,200	5,320.00	208,544,000	貸付株式数 1,000株
ユニオンツール	47,400	3,145.00	149,073,000	貸付株式数 7,100株 (6,300株)
オイレス工業	134,000	2,007.00	268,938,000	貸付株式数 400株
日精エーエスビー	34,900	3,890.00	135,761,000	貸付株式数 8,700株 (6,000株)
サト - ホールディングス	136,500	2,642.00	360,633,000	貸付株式数 67,400株
日本エアテック	35,300	838.00	29,581,400	貸付株式数 15,800株
日精樹脂工業	87,000	1,117.00	97,179,000	
オカダアイヨン	30,500	1,395.00	42,547,500	貸付株式数 1,300株
ワイエイシイホールディングス	41,000	1,330.00	54,530,000	貸付株式数 20,000株 (12,300株)

小松製作所	5,064,300	2,894.00	14,656,084,200	貸付株式数	94,500株
住友重機械	3,202,000	776.00	2,484,752,000		
日立建機	490,400	2,872.00	1,408,428,800	貸付株式数	116,700株
日工	32,900	2,217.00	72,939,300		
巴工業	44,600	1,805.00	80,503,000		
井関農機	104,800	2,225.00	233,180,000		
TOWA	89,600	1,734.00	155,366,400	貸付株式数	44,200株
丸山製作所	22,900	1,781.00	40,784,900		
北川鉄工所	50,200	2,516.00	126,303,200		
シンニッタン	89,600	702.00	62,899,200		
ローツェ	51,700	2,796.00	144,553,200	貸付株式数	26,300株 (7,400株)
タカキタ	36,400	522.00	19,000,800		
クボタ	5,254,400	1,939.00	10,188,281,600	貸付株式数	743,100株 (509,100株)
荏原実業	30,600	1,497.00	45,808,200		
東洋エンジニア	691,000	273.00	188,643,000	貸付株式数	158,000株
三菱化工機	360,000	258.00	92,880,000		
月島機械	208,000	1,265.00	263,120,000	貸付株式数	3,700株
帝国電機製作所	79,700	1,136.00	90,539,200		
東京機械	412,000	75.00	30,900,000	貸付株式数	138,000株
新東工業	248,800	1,154.00	287,115,200		
渋谷工業	91,700	3,265.00	299,400,500	貸付株式数	42,300株
アイチ コーポレーション	155,200	791.00	122,763,200	貸付株式数	50,600株
小森コーポレーション	263,700	1,403.00	369,971,100		
鶴見製作所	81,600	1,861.00	151,857,600		
住友精密	172,000	347.00	59,684,000		
酒井重工業	207,000	339.00	70,173,000		
荏原製作所	497,000	3,260.00	1,620,220,000	貸付株式数	64,500株
石井鉄工所	15,900	1,646.00	26,171,400		
西島製作所	107,100	1,140.00	122,094,000		
北越工業	117,900	1,073.00	126,506,700		
千代田化工建	848,000	652.00	552,896,000	貸付株式数	432,000株
ダイキン工業	1,431,800	11,735.00	16,802,173,000	貸付株式数	355,600株
オルガノ	206,000	561.00	115,566,000		
ト - ヨ - カネツ	474,000	323.00	153,102,000		
栗田工業	605,500	3,015.00	1,825,582,500	貸付株式数	32,300株
椿本チエイン	623,000	1,004.00	625,492,000	貸付株式数	308,000株
大同工業	214,000	310.00	66,340,000		
日機装	362,900	1,095.00	397,375,500	貸付株式数	8,600株

木村化工機	93,900	371.00	34,836,900	
新興プランテック	241,300	913.00	220,306,900	
アネスト岩田	190,300	1,029.00	195,818,700	貸付株式数 16,800株
ダイフク	523,300	3,310.00	1,732,123,000	
サムコ	28,800	930.00	26,784,000	貸付株式数 3,800株
加藤製作所	57,400	3,360.00	192,864,000	
油研工業	204,000	228.00	46,512,000	
タダノ	548,200	1,364.00	747,744,800	貸付株式数 270,700株
フジテック	305,400	1,489.00	454,740,600	貸付株式数 116,200株
C K D	314,200	1,885.00	592,267,000	貸付株式数 1,400株
キトー	132,100	1,249.00	164,992,900	貸付株式数 4,800株
平和	325,000	2,499.00	812,175,000	貸付株式数 160,700株
理想科学工業	104,200	2,174.00	226,530,800	貸付株式数 1,400株
S A N K Y O	291,800	3,750.00	1,094,250,000	貸付株式数 42,400株
日本金銭機械	96,600	1,189.00	114,857,400	貸付株式数 47,600株 (12,200株)
マースエンジニアリング	59,200	2,377.00	140,718,400	
福島工業	64,600	4,735.00	305,881,000	
オーイズミ	44,000	609.00	26,796,000	貸付株式数 21,400株 (9,300株)
ダイコク電機	43,300	1,716.00	74,302,800	
竹内製作所	191,500	2,070.00	396,405,000	貸付株式数 55,200株
ア マ ノ	324,500	2,364.00	767,118,000	貸付株式数 146,100株
J U K I	155,700	1,656.00	257,839,200	
サンデンホールディングス	639,000	327.00	208,953,000	貸付株式数 168,000株
蛇の目マシン	101,700	879.00	89,394,300	貸付株式数 9,000株 (9,000株)
ブラザー工業	1,280,900	2,691.00	3,446,901,900	貸付株式数 18,400株
マックス	160,000	1,580.00	252,800,000	
モリタホールディングス	183,300	1,697.00	311,060,100	貸付株式数 60,000株
グローリー	335,300	3,795.00	1,272,463,500	貸付株式数 800株
新晃工業	97,500	1,770.00	172,575,000	貸付株式数 1,300株
大和冷機工業	168,400	1,259.00	212,015,600	貸付株式数 8,500株
セガサミーホールディングス	1,040,400	1,516.00	1,577,246,400	貸付株式数 515,800株
日本ピストンリング	40,900	2,284.00	93,415,600	
リ ケ ン	48,500	5,250.00	254,625,000	
T P R	117,400	3,655.00	429,097,000	貸付株式数 47,100株
ツバキ・ナカシマ	104,600	2,137.00	223,530,200	貸付株式数 58,200株 (1,000株)



ホシザキ	307,500	10,120.00	3,111,900,000	貸付株式数	151,500株
大豊工業	85,200	1,466.00	124,903,200		
日本精工	2,154,200	1,472.00	3,170,982,400	貸付株式数	1,064,900株 (799,800株)
N T N	2,428,000	530.00	1,286,840,000	貸付株式数	1,026,000株
ジェイテクト	1,117,900	1,703.00	1,903,783,700		
不二越	974,000	624.00	607,776,000	貸付株式数	226,000株 (40,000株)
ミネベアミツミ	1,908,400	1,789.00	3,414,127,600	貸付株式数	403,900株
日本トムソン	335,100	602.00	201,730,200	貸付株式数	14,000株
T H K	741,000	3,245.00	2,404,545,000		
ユーシン精機	46,400	2,677.00	124,212,800	貸付株式数	22,700株 (20,800株)
前澤給装工業	38,100	1,539.00	58,635,900		
イーグル工業	113,400	1,914.00	217,047,600		
前澤工業	69,800	322.00	22,475,600	貸付株式数	15,800株
日本ピラ - 工業	106,000	1,725.00	182,850,000	貸付株式数	5,400株
キッツ	503,300	995.00	500,783,500	貸付株式数	1,700株
日立	25,184,000	701.00	17,653,984,000		
東芝	23,460,000	255.60	5,996,376,000	貸付株式数	9,617,000株 (905,000株)
三菱電機	11,187,800	1,669.50	18,678,032,100		
富士電機	3,160,000	608.00	1,921,280,000	貸付株式数	780,000株
東洋電機製造	44,300	1,663.00	73,670,900	貸付株式数	8,400株
安川電機	1,215,900	2,415.00	2,936,398,500	貸付株式数	607,000株
シンフォニア テクノロ ジー	679,000	469.00	318,451,000	貸付株式数	4,000株
明電舎	964,000	397.00	382,708,000	貸付株式数	90,000株
オリジン電気	151,000	312.00	47,112,000		
山洋電気	274,000	1,133.00	310,442,000		
デンヨー	96,800	1,950.00	188,760,000		
三桜工業	132,900	815.00	108,313,500		
マキタ	1,367,800	4,200.00	5,744,760,000	貸付株式数	2,500株
東芝テック	657,000	615.00	404,055,000		
芝浦メカトロニクス	168,000	335.00	56,280,000		
マブチモーター	292,600	5,730.00	1,676,598,000		
日本電産	1,359,300	11,445.00	15,557,188,500	貸付株式数	682,800株 (493,400株)
ユーエムシーエレクトロニ クス	32,600	1,720.00	56,072,000	貸付株式数	10,200株

東光高岳	53,000	1,715.00	90,895,000	貸付株式数	18,900株
ダブル・スコープ	101,600	2,000.00	203,200,000	貸付株式数	50,000株 (11,200株)
宮越ホールディングス	35,400	464.00	16,425,600	貸付株式数	10,100株
ダイヘン	574,000	880.00	505,120,000	貸付株式数	159,000株 (80,000株)
田淵電機	158,300	346.00	54,771,800	貸付株式数	78,400株
ヤーマン	13,200	8,360.00	110,352,000	貸付株式数	5,500株 (2,300株)
JVCケンウッド	769,500	331.00	254,704,500	貸付株式数	350,700株
ミマキエンジニアリング	93,900	828.00	77,749,200	貸付株式数	20,200株
第一精工	49,000	2,141.00	104,909,000	貸付株式数	5,200株 (4,200株)
日新電機	210,700	1,230.00	259,161,000	貸付株式数	28,600株
大崎電気	207,000	881.00	182,367,000		
オムロン	1,114,800	5,020.00	5,596,296,000	貸付株式数	117,000株
日東工業	154,000	1,776.00	273,504,000		
I D E C	136,900	1,457.00	199,463,300	貸付株式数	3,700株
不二電機工業	11,400	1,396.00	15,914,400	貸付株式数	5,600株 (3,500株)
ジーエス・ユアサ コーポ	2,020,000	493.00	995,860,000	貸付株式数	999,000株
サクサホールディングス	264,000	225.00	59,400,000	貸付株式数	61,000株
メルコホールディングス	57,900	3,250.00	188,175,000	貸付株式数	19,400株
テクノメディカ	23,500	1,934.00	45,449,000		
日本電気	14,420,000	295.00	4,253,900,000		
富士通	10,112,000	820.90	8,300,940,800	貸付株式数	1,180,000株 (1,140,000株)
沖電気	454,400	1,648.00	748,851,200		
岩崎通信機	460,000	86.00	39,560,000		
電気興業	298,000	562.00	167,476,000		
サンケン電気	613,000	537.00	329,181,000	貸付株式数	240,000株
ナカヨ	109,000	382.00	41,638,000	貸付株式数	16,000株
アイホン	59,300	1,979.00	117,354,700	貸付株式数	8,900株 (8,900株)
ルネサスエレクトロニクス	542,900	993.00	539,099,700	貸付株式数	228,200株 (228,200株)
セイコーエプソン	1,561,700	2,565.00	4,005,760,500		
ワコム	813,500	364.00	296,114,000	貸付株式数	403,300株 (84,900株)
アルバック	176,800	5,470.00	967,096,000		

アクセル	43,700	806.00	35,222,200	貸付株式数	21,500株
E I Z O	103,600	4,375.00	453,250,000	貸付株式数	31,200株
ジャパンディスプレイ	1,958,500	204.00	399,534,000	貸付株式数	971,000株 (273,000株)
日本信号	289,300	1,074.00	310,708,200	貸付株式数	143,100株
京三製作所	246,000	618.00	152,028,000	貸付株式数	9,000株
能美防災	118,900	1,657.00	197,017,300	貸付株式数	100株
ホーチキ	76,000	1,853.00	140,828,000	貸付株式数	1,200株
エレコム	90,700	2,221.00	201,444,700	貸付株式数	46,200株
日本無線	64,100	1,451.00	93,009,100		
パナソニック	12,044,800	1,491.50	17,964,819,200		
アンリツ	764,600	1,000.00	764,600,000		
富士通ゼネラル	355,900	2,642.00	940,287,800		
日立国際電気	274,100	2,659.00	728,831,900	貸付株式数	2,700株 (2,700株)
ソニー	7,409,300	4,318.00	31,993,357,400	貸付株式数	3,292,700株
T D K	590,800	7,520.00	4,442,816,000		
帝国通信工業	231,000	210.00	48,510,000		
タムラ製作所	404,000	533.00	215,332,000		
アルプス電気	968,200	3,240.00	3,136,968,000		
池上通信機	331,000	160.00	52,960,000	貸付株式数	164,000株
パイオニア	1,575,800	220.00	346,676,000	貸付株式数	240,000株
日本電波工業	101,400	890.00	90,246,000	貸付株式数	50,100株 (50,100株)
鈴木	40,300	726.00	29,257,800	貸付株式数	5,900株
日本トリム	25,400	4,350.00	110,490,000	貸付株式数	10,900株 (7,300株)
ローランド ディー・ ジー	53,600	2,736.00	146,649,600	貸付株式数	26,400株
日本コロムビア	30,700	688.00	21,121,600	貸付株式数	1,100株
フオスタ - 電機	122,800	2,009.00	246,705,200	貸付株式数	60,300株
クラリオン	552,000	433.00	239,016,000		
S M K	269,000	446.00	119,974,000		
ヨコオ	74,700	1,427.00	106,596,900	貸付株式数	36,900株
ティアック	754,000	50.00	37,700,000	貸付株式数	316,000株 (6,000株)
ホシデン	308,700	1,226.00	378,466,200		
ヒロセ電機	169,400	15,840.00	2,683,296,000	貸付株式数	49,100株
日本航空電子	300,000	1,647.00	494,100,000	貸付株式数	5,000株
T O A	123,700	1,067.00	131,987,900		

日立マクセル	156,300	2,370.00	370,431,000	
古野電気	135,000	656.00	88,560,000	
ユニデンホールディングス	308,000	288.00	88,704,000	
アルパイン	250,000	1,713.00	428,250,000	
スミダコーポレーション	95,200	2,099.00	199,824,800	貸付株式数 17,400株
アイコム	58,000	2,521.00	146,218,000	貸付株式数 24,500株 (24,500株)
リオン	40,000	1,781.00	71,240,000	
本多通信工業	44,700	1,726.00	77,152,200	
船井電機	117,700	1,028.00	120,995,600	貸付株式数 58,200株 (5,700株)
横河電機	1,137,200	1,796.00	2,042,411,200	
新電元工業	404,000	627.00	253,308,000	
アズビル	314,300	4,225.00	1,327,917,500	貸付株式数 85,000株
東亜ディーケーケー	51,800	725.00	37,555,000	
日本光電工業	438,300	2,566.00	1,124,677,800	貸付株式数 216,800株
チノール	37,400	1,269.00	47,460,600	
共和電業	118,800	458.00	54,410,400	
日本電子材料	41,400	713.00	29,518,200	貸付株式数 8,500株
堀場製作所	207,800	6,820.00	1,417,196,000	貸付株式数 102,700株
アドバンテスト	714,900	1,966.00	1,405,493,400	貸付株式数 354,400株
小野測器	44,800	756.00	33,868,800	
エスペック	92,900	1,729.00	160,624,100	
キーエンス	475,200	49,020.00	23,294,304,000	貸付株式数 3,700株
日置電機	54,800	2,195.00	120,286,000	
シスメックス	815,400	6,360.00	5,185,944,000	貸付株式数 383,900株
日本マイクロニクス	182,500	1,152.00	210,240,000	貸付株式数 93,000株
メガチップス	97,500	2,845.00	277,387,500	貸付株式数 48,200株 (47,000株)
OBARA GROUP	61,200	5,980.00	365,976,000	貸付株式数 30,400株
イマジカ・ロボットHD	87,000	723.00	62,901,000	貸付株式数 21,500株
澤藤電機	61,000	562.00	34,282,000	貸付株式数 23,000株
デンソー	2,585,900	4,817.00	12,456,280,300	貸付株式数 530,800株
コーセル	145,400	1,345.00	195,563,000	貸付株式数 8,400株
イリソ電子工業	43,900	8,910.00	391,149,000	貸付株式数 20,700株
新日本無線	89,200	717.00	63,956,400	貸付株式数 44,000株
オプテックスグループ	79,700	3,590.00	286,123,000	貸付株式数 39,200株
千代田インテグレ	50,600	2,239.00	113,293,400	貸付株式数 600株
アイ・オー・データ	43,400	1,200.00	52,080,000	貸付株式数 9,600株
レーザーテック	230,300	1,543.00	355,352,900	貸付株式数 113,900株

スタンレー電気	746,400	3,630.00	2,709,432,000	貸付株式数	378,700株
岩崎電気	382,000	209.00	79,838,000		
ウシオ電機	636,600	1,429.00	909,701,400	貸付株式数	238,600株
岡谷電機	56,000	400.00	22,400,000		
ヘリオステクノH	96,600	773.00	74,671,800	貸付株式数	14,000株
日本セラミック	87,000	2,637.00	229,419,000	貸付株式数	42,200株 (9,500株)
遠藤照明	52,900	1,207.00	63,850,300		
古河電池	75,000	775.00	58,125,000	貸付株式数	6,000株
双信電機	50,700	302.00	15,311,400		
山一電機	98,600	1,758.00	173,338,800	貸付株式数	44,300株 (27,900株)
図研	68,200	1,501.00	102,368,200	貸付株式数	1,800株
日本電子	382,000	596.00	227,672,000	貸付株式数	34,000株
カシオ	843,500	1,749.00	1,475,281,500	貸付株式数	4,700株
ファナック	1,063,200	22,060.00	23,454,192,000	貸付株式数	344,000株
日本シイエムケイ	225,900	984.00	222,285,600	貸付株式数	111,500株 (41,300株)
エンプラス	47,500	3,555.00	168,862,500	貸付株式数	23,400株
大真空	38,300	1,781.00	68,212,300	貸付株式数	19,500株
ローム	507,000	8,910.00	4,517,370,000		
浜松ホトニクス	763,800	3,470.00	2,650,386,000	貸付株式数	333,700株
三井ハイテック	138,300	1,693.00	234,141,900	貸付株式数	70,500株 (59,300株)
新光電気工業	396,200	980.00	388,276,000		
京セラ	1,721,600	6,508.00	11,204,172,800	貸付株式数	10,900株
協栄産業	124,000	184.00	22,816,000	貸付株式数	29,000株
太陽誘電	510,100	1,827.00	931,952,700	貸付株式数	151,100株
村田製作所	1,100,400	16,915.00	18,613,266,000	貸付株式数	22,100株 (5,000株)
ユーシン	146,300	780.00	114,114,000	貸付株式数	71,800株 (40,600株)
双葉電子工業	171,500	2,026.00	347,459,000	貸付株式数	36,500株
日東電工	792,200	9,712.00	7,693,846,400		
北陸電気工業	422,000	139.00	58,658,000		
東海理化電機	276,200	2,149.00	593,553,800	貸付株式数	80,100株
ニチコン	330,200	1,217.00	401,853,400		
日本ケミコン	903,000	468.00	422,604,000		
K O A	145,000	2,258.00	327,410,000		
三井造船	3,789,000	161.00	610,029,000		

日立造船	831,500	561.00	466,471,500		
三菱重工業	17,578,000	460.00	8,085,880,000		
川崎重工業	8,161,000	339.00	2,766,579,000	貸付株式数	576,000株
I H I	8,059,000	381.00	3,070,479,000	貸付株式数	44,000株
名村造船所	314,800	678.00	213,434,400	貸付株式数	128,600株
サノヤスホールディングス	127,400	261.00	33,251,400	貸付株式数	37,000株
日本車輛	382,000	285.00	108,870,000	貸付株式数	39,000株
ニチユ三菱フォークリフト	124,700	797.00	99,385,900	貸付株式数	60,600株 (60,600株)
近畿車輛	15,600	2,552.00	39,811,200		
F P G	369,600	1,182.00	436,867,200	貸付株式数	182,500株 (9,300株)
島根銀行	21,600	1,321.00	28,533,600		
じもとホールディングス	742,700	202.00	150,025,400		
全国保証	291,500	4,750.00	1,384,625,000	貸付株式数	77,100株
めぶきフィナンシャルG	4,991,500	434.00	2,166,311,000		
東京T YフィナンシャルG	149,700	3,115.00	466,315,500		
九州フィナンシャルG	1,697,600	729.00	1,237,550,400	貸付株式数	791,500株
かんぼ生命保険	390,800	2,515.00	982,862,000		
ゆうちょ銀行	2,930,800	1,457.00	4,270,175,600	貸付株式数	1,300,800株
富山第一銀行	263,000	520.00	136,760,000		
コンコルディア・フィナンシャル	6,709,000	575.50	3,861,029,500		
西日本フィナンシャルHD	701,800	1,202.00	843,563,600		
日産自動車	12,370,300	1,152.00	14,250,585,600	貸付株式数	5,933,800株
いすゞ自動車	3,039,200	1,411.50	4,289,830,800	貸付株式数	509,700株
トヨタ自動車	12,751,100	6,187.00	78,891,055,700	貸付株式数	5,754,600株
日野自動車	1,496,900	1,272.00	1,904,056,800	貸付株式数	131,500株
三菱自動車工業	3,843,700	748.00	2,875,087,600	貸付株式数	1,905,700株
エフテック	60,000	1,462.00	87,720,000	貸付株式数	12,900株
レシップホールディングス	34,300	897.00	30,767,100	貸付株式数	7,100株 (700株)
G M B	16,800	1,191.00	20,008,800		
ファルテック	18,100	1,413.00	25,575,300		
武蔵精密工業	121,900	3,190.00	388,861,000	貸付株式数	34,600株
日産車体	460,800	1,086.00	500,428,800		
新明和工業	423,300	951.00	402,558,300		
極東開発工業	208,800	1,817.00	379,389,600	貸付株式数	101,500株
日信工業	234,500	1,845.00	432,652,500	貸付株式数	115,800株 (114,200株)

トピー工業	86,200	3,375.00	290,925,000	
ティラド	408,000	355.00	144,840,000	
曙ブレーキ	487,100	373.00	181,688,300	
タチエス	178,000	2,097.00	373,266,000	
N O K	507,400	2,423.00	1,229,430,200	貸付株式数 39,100株
フタバ産業	319,400	1,053.00	336,328,200	
K Y B	1,174,000	607.00	712,618,000	
市光工業	219,000	877.00	192,063,000	貸付株式数 100,000株 (49,000株)
大同メタル工業	131,800	1,013.00	133,513,400	貸付株式数 65,100株
プレス工業	556,900	539.00	300,169,100	貸付株式数 29,500株
ミクニ	133,100	497.00	66,150,700	
太平洋工業	237,000	1,518.00	359,766,000	
ケーヒン	240,900	1,622.00	390,739,800	貸付株式数 49,900株
河西工業	141,500	1,469.00	207,863,500	
アイシン精機	959,600	5,960.00	5,719,216,000	貸付株式数 55,400株
富士機工	103,900	738.00	76,678,200	
マ ッ ダ	3,320,900	1,620.00	5,379,858,000	貸付株式数 1,471,800株
今仙電機製作所	96,000	1,286.00	123,456,000	貸付株式数 21,600株
本田技研	9,438,300	3,104.00	29,296,483,200	貸付株式数 400,000株 (400,000株)
スズキ	2,078,600	5,353.00	11,126,745,800	貸付株式数 283,300株 (120,000株)
S U B A R U	3,256,300	4,118.00	13,409,443,400	
安永	50,500	1,236.00	62,418,000	貸付株式数 24,600株 (4,200株)
ヤマハ発動機	1,481,300	2,944.00	4,360,947,200	貸付株式数 732,600株
ショーワ	272,300	1,114.00	303,342,200	貸付株式数 76,100株
小糸製作所	628,300	5,810.00	3,650,423,000	貸付株式数 215,100株
T B K	134,100	517.00	69,329,700	
エクセディ	142,400	3,215.00	457,816,000	貸付株式数 58,300株
ミツバ	193,000	2,103.00	405,879,000	貸付株式数 29,700株
豊田合成	338,700	2,757.00	933,795,900	貸付株式数 166,300株
愛三工業	183,800	929.00	170,750,200	貸付株式数 9,800株
盟和産業	15,800	1,222.00	19,307,600	
ヨ ロ ズ	97,900	1,835.00	179,646,500	
エフ・シー・シー	171,400	2,277.00	390,277,800	貸付株式数 2,300株
新家工業	236,000	193.00	45,548,000	
シマノ	422,700	17,910.00	7,570,557,000	貸付株式数 130,500株
テイ・エス テック	243,600	3,350.00	816,060,000	

ジャムコ	61,200	2,611.00	159,793,200	貸付株式数 29,900株 (24,800株)
小野建	89,900	1,744.00	156,785,600	貸付株式数 1,400株
はるやまHLDGS	48,300	993.00	47,961,900	
ノジマ	161,300	1,722.00	277,758,600	
佐鳥電機	76,000	850.00	64,600,000	
カップ・クリエイト	144,800	1,258.00	182,158,400	貸付株式数 44,000株 (32,900株)
エコートレーディング	23,600	688.00	16,236,800	貸付株式数 1,700株
伯東	70,700	1,460.00	103,222,000	
コンドーテック	81,900	1,010.00	82,719,000	貸付株式数 5,200株
中山福	59,200	801.00	47,419,200	貸付株式数 1,900株
ライトオン	86,800	970.00	84,196,000	貸付株式数 30,400株 (20,300株)
ナガイレーベン	137,000	2,543.00	348,391,000	貸付株式数 500株
ジーンズメイト	32,900	677.00	22,273,300	貸付株式数 6,700株
三菱食品	113,600	3,170.00	360,112,000	
良品計画	137,200	27,350.00	3,752,420,000	貸付株式数 67,700株
三城ホールディングス	127,800	463.00	59,171,400	
松田産業	75,300	1,483.00	111,669,900	
第一興商	168,300	5,220.00	878,526,000	
メディパルHD	1,035,200	2,049.00	2,121,124,800	貸付株式数 7,300株
アドヴァン	105,100	1,122.00	117,922,200	
SPK	22,100	2,655.00	58,675,500	
萩原電気	35,100	2,241.00	78,659,100	
アルビス	27,000	4,760.00	128,520,000	
アズワン	80,800	5,340.00	431,472,000	
スズデン	37,000	1,294.00	47,878,000	貸付株式数 6,200株
尾家産業	33,100	1,221.00	40,415,100	貸付株式数 2,700株
シモジマ	63,200	1,114.00	70,404,800	
ドウシシャ	121,700	2,164.00	263,358,800	
小津産業	22,700	2,153.00	48,873,100	貸付株式数 11,000株 (10,500株)
コナカ	131,900	593.00	78,216,700	
高速	61,500	1,064.00	65,436,000	貸付株式数 9,300株
ハウスローゼ	12,500	1,555.00	19,437,500	貸付株式数 4,700株
G-7ホールディングス	30,300	2,161.00	65,478,300	
たけびし	36,100	1,436.00	51,839,600	貸付株式数 14,700株
イオン北海道	103,800	607.00	63,006,600	貸付株式数 15,300株
コジマ	177,600	311.00	55,233,600	



ヒマラヤ	28,100	862.00	24,222,200	貸付株式数	7,000株
コーナン商事	146,800	2,038.00	299,178,400	貸付株式数	72,600株
黒田電気	141,300	2,150.00	303,795,000		
ネットワンシステムズ	448,100	1,111.00	497,839,100	貸付株式数	6,600株
エコス	41,600	1,211.00	50,377,600	貸付株式数	6,800株
ワタミ	122,200	1,326.00	162,037,200	貸付株式数	17,200株 (5,600株)
マルシェ	23,000	825.00	18,975,000	貸付株式数	11,200株 (3,500株)
リックス	23,200	1,800.00	41,760,000	貸付株式数	5,500株
システムソフト	243,500	163.00	39,690,500	貸付株式数	120,400株 (28,600株)
ドンキホーテホールディング	669,600	4,090.00	2,738,664,000	貸付株式数	280,300株
丸文	91,300	796.00	72,674,800		
西松屋チェーン	181,300	1,164.00	211,033,200	貸付株式数	89,600株
ゼンショーホールディングス	536,000	2,035.00	1,090,760,000	貸付株式数	272,900株
ハピネット	86,200	1,967.00	169,555,400		
幸楽苑ホールディングス	65,500	1,799.00	117,834,500	貸付株式数	16,800株 (5,800株)
ハークスレイ	25,100	1,113.00	27,936,300		
橋本総業HLDGS	21,100	1,671.00	35,258,100		
日本ライフライン	117,800	4,575.00	538,935,000	貸付株式数	57,900株 (5,800株)
サイゼリヤ	153,200	3,260.00	499,432,000	貸付株式数	1,200株
エクセル	44,400	1,434.00	63,669,600	貸付株式数	8,900株
V Tホールディングス	349,900	572.00	200,142,800	貸付株式数	172,900株
マルカキカイ	33,300	1,885.00	62,770,500		
アルゴグラフィックス	47,300	2,552.00	120,709,600		
魚力	32,100	1,236.00	39,675,600		
I D O M	278,500	768.00	213,888,000	貸付株式数	136,100株 (83,600株)
日本エム・ディ・エム	77,600	949.00	73,642,400	貸付株式数	39,500株 (30,100株)
ポプラ	25,800	579.00	14,938,200	貸付株式数	6,200株
フジ・コーポレーション	15,200	1,993.00	30,293,600	貸付株式数	7,400株
ユナイテッドアローズ	137,700	3,445.00	474,376,500	貸付株式数	68,000株
進和	61,000	2,152.00	131,272,000	貸付株式数	3,200株
エスケイジャパン	19,200	293.00	5,625,600	貸付株式数	2,200株
ダイトロン	47,200	1,466.00	69,195,200	貸付株式数	11,200株

ハイデイ日高	112,900	2,975.00	335,877,500		
シークス	65,700	4,450.00	292,365,000	貸付株式数	36,400株 (30,000株)
京都きもの友禅	65,600	930.00	61,008,000	貸付株式数	32,300株 (3,300株)
コロワイド	343,200	1,874.00	643,156,800	貸付株式数	169,600株 (12,900株)
ピーシーデポコーポ	137,100	578.00	79,243,800	貸付株式数	57,100株 (10,000株)
田中商事	31,600	730.00	23,068,000		
オーハシテクニカ	58,200	1,410.00	82,062,000		
壱番屋	72,800	3,805.00	277,004,000	貸付株式数	36,100株
白銅	25,900	1,748.00	45,273,200		
トップカルチャー	37,200	495.00	18,414,000	貸付株式数	10,900株 (9,700株)
P L A N T	23,700	1,220.00	28,914,000	貸付株式数	6,800株
スギホールディングス	226,900	5,400.00	1,225,260,000	貸付株式数	112,000株
島津製作所	1,349,800	2,209.00	2,981,708,200	貸付株式数	128,000株
J M S	192,000	327.00	62,784,000		
クボテック	22,500	593.00	13,342,500	貸付株式数	11,100株
長野計器	82,300	770.00	63,371,000	貸付株式数	3,200株
ブイ・テクノロジー	21,100	19,150.00	404,065,000	貸付株式数	10,400株 (3,400株)
スター精密	183,800	1,926.00	353,998,800	貸付株式数	41,200株
東京計器	361,000	299.00	107,939,000	貸付株式数	156,000株
愛知時計	13,700	3,710.00	50,827,000		
インターアクション	39,300	793.00	31,164,900	貸付株式数	19,400株
オーバル	102,300	267.00	27,314,100	貸付株式数	9,300株
東京精密	202,800	3,735.00	757,458,000	貸付株式数	42,800株
マニー	127,700	2,708.00	345,811,600		
ニコン	1,827,600	1,876.00	3,428,577,600	貸付株式数	903,700株
トプコン	528,000	2,012.00	1,062,336,000	貸付株式数	5,300株
オリンパス	1,673,900	4,140.00	6,929,946,000	貸付株式数	748,300株 (220,900株)
理研計器	92,500	2,098.00	194,065,000		
S C R E E Nホールディングス	215,000	7,860.00	1,689,900,000	貸付株式数	37,800株
キヤノン電子	96,200	2,250.00	216,450,000	貸付株式数	2,400株
タムロン	84,500	1,986.00	167,817,000	貸付株式数	45,900株
H O Y A	2,157,800	5,708.00	12,316,722,400		

シード	13,400	2,439.00	32,682,600		
ノーリツ鋼機	106,100	964.00	102,280,400	貸付株式数	16,500株
エー・アンド・デイ	95,600	463.00	44,262,800		
キヤノン	5,646,400	3,748.00	21,162,707,200	貸付株式数	3,100株
リコー	3,153,500	969.00	3,055,741,500		
シチズン時計	1,147,600	826.00	947,917,600	貸付株式数	17,000株
リズム時計	420,000	236.00	99,120,000		
大研医器	93,300	785.00	73,240,500	貸付株式数	13,600株
メニコン	71,900	3,540.00	254,526,000		
スノーピーク	15,900	3,190.00	50,721,000	貸付株式数	8,100株 (5,500株)
パラマウントベッドHD	100,600	4,975.00	500,485,000	貸付株式数	49,400株 (46,600株)
トランザクション	47,000	1,248.00	58,656,000	貸付株式数	22,900株
SHOBI	34,900	450.00	15,705,000		
ニホンフラッシュ	49,000	1,505.00	73,745,000		
前田工織	105,000	1,641.00	172,305,000		
永大産業	136,000	507.00	68,952,000		
アートネイチャー	112,000	714.00	79,968,000		
ダンロップスポーツ	66,100	1,134.00	74,957,400	貸付株式数	3,000株 (3,000株)
バンダイナムコHLDGS	1,156,700	4,080.00	4,719,336,000	貸付株式数	2,600株
アイフィスジャパン	23,300	716.00	16,682,800		
共立印刷	174,200	339.00	59,053,800		
SHOEI	47,100	3,045.00	143,419,500	貸付株式数	23,000株
フランスベッドHLDGS	131,600	989.00	130,152,400		
マーベラス	174,500	1,101.00	192,124,500	貸付株式数	66,600株 (25,100株)
パイロットコーポレーション	182,900	4,735.00	866,031,500	貸付株式数	88,000株
萩原工業	29,000	2,944.00	85,376,000		
エイベックス・グループHD	190,500	1,469.00	279,844,500		
トッパン・フォームズ	187,200	1,219.00	228,196,800		
フジシールインターナショナル	235,100	3,015.00	708,826,500	貸付株式数	116,300株
タカラトミー	407,600	1,348.00	549,444,800	貸付株式数	29,400株
廣濟堂	105,500	360.00	37,980,000		
AS-MEエステール	27,900	703.00	19,613,700	貸付株式数	11,500株

アーク	441,100	112.00	49,403,200	貸付株式数 218,700株 (112,400株)
レック	68,400	2,641.00	180,644,400	貸付株式数 32,600株
タカノ	46,100	1,116.00	51,447,600	
プロネクサス	98,000	1,241.00	121,618,000	貸付株式数 10,200株
ホクシン	73,900	193.00	14,262,700	貸付株式数 36,500株
ウッドワン	175,000	288.00	50,400,000	
大建工業	73,800	2,501.00	184,573,800	
きもと	196,200	260.00	51,012,000	
凸版印刷	2,961,000	1,209.00	3,579,849,000	
大日本印刷	2,956,000	1,253.00	3,703,868,000	
図書印刷	139,000	505.00	70,195,000	貸付株式数 40,000株 (8,000株)
共同印刷	322,000	381.00	122,682,000	
日本写真印刷	183,000	2,980.00	545,340,000	貸付株式数 90,100株 (59,100株)
光村印刷	93,000	245.00	22,785,000	
藤森工業	81,600	3,310.00	270,096,000	貸付株式数 40,300株
ヴィア・ホールディングス	78,400	966.00	75,734,400	貸付株式数 32,900株
宝印刷	54,800	1,639.00	89,817,200	貸付株式数 26,300株
前澤化成工業	71,700	1,220.00	87,474,000	
アシックス	1,041,900	2,017.00	2,101,512,300	貸付株式数 511,800株 (55,000株)
ツツミ	39,200	2,111.00	82,751,200	
ジェイエスピー	51,100	3,290.00	168,119,000	貸付株式数 4,300株
ニチハ	145,900	4,035.00	588,706,500	貸付株式数 3,900株
エフピコ	97,300	6,070.00	590,611,000	貸付株式数 48,000株
小松ウオール工業	35,400	2,071.00	73,313,400	
ヤマハ	706,600	3,985.00	2,815,801,000	
河合楽器	41,100	2,291.00	94,160,100	
クリナップ	109,700	893.00	97,962,100	
ビジョン	633,900	4,075.00	2,583,142,500	貸付株式数 225,700株 (70,800株)
天馬	72,500	2,105.00	152,612,500	
兼松サステック	108,000	234.00	25,272,000	
キングジム	87,200	1,009.00	87,984,800	貸付株式数 2,800株
リンテック	249,300	2,722.00	678,594,600	
信越ポリマー	215,300	904.00	194,631,200	貸付株式数 7,400株
東リ	261,200	364.00	95,076,800	
イトーキ	220,700	919.00	202,823,300	

任 天 堂	645,900	36,470.00	23,555,973,000	
三菱鉛筆	172,700	3,070.00	530,189,000	貸付株式数 64,000株
松 風	55,100	1,328.00	73,172,800	
タカラスタンダ - ド	216,700	1,833.00	397,211,100	
コ ク ヨ	503,100	1,496.00	752,637,600	
ナカバヤシ	186,000	319.00	59,334,000	
ニ フ コ	192,600	6,260.00	1,205,676,000	貸付株式数 95,100株
立川ブラインド	45,600	1,293.00	58,960,800	貸付株式数 10,000株
グローブライド	50,700	1,917.00	97,191,900	
岡村製作所	366,000	1,027.00	375,882,000	貸付株式数 82,500株
日本バルカー	85,200	2,379.00	202,690,800	
M U T O Hホールディング ス	142,000	250.00	35,500,000	
伊 藤 忠	7,581,300	1,726.50	13,089,114,450	
丸 紅	10,187,300	739.70	7,535,545,810	
スクロール	156,500	374.00	58,531,000	
高 島	177,000	206.00	36,462,000	
ヨンドシーホールディング ス	105,100	2,618.00	275,151,800	貸付株式数 47,100株
三陽商会	57,500	1,769.00	101,717,500	
長瀬産業	622,400	1,729.00	1,076,129,600	
ナイガイ	401,000	67.00	26,867,000	
蝶 理	65,900	2,065.00	136,083,500	
豊田通商	1,153,000	3,390.00	3,908,670,000	
オンワ - ドホールディング ス	711,000	785.00	558,135,000	貸付株式数 351,000株
三共生興	156,300	390.00	60,957,000	
兼 松	2,201,000	238.00	523,838,000	
美 津 濃	563,000	652.00	367,076,000	
ツカモトコーポレーション	184,000	129.00	23,736,000	貸付株式数 35,000株
ユニー・ファミリーマート H D	453,900	6,300.00	2,859,570,000	貸付株式数 226,700株
ルック	187,000	272.00	50,864,000	
三井物産	9,360,500	1,603.00	15,004,881,500	貸付株式数 4,537,500株
日本紙パルプ	538,000	430.00	231,340,000	
東京エレクトロン	699,400	15,580.00	10,896,652,000	貸付株式数 1,400株
日立ハイテクノロジーズ	358,800	4,425.00	1,587,690,000	貸付株式数 7,600株
カメイ	134,700	1,535.00	206,764,500	
東都水産	15,600	1,867.00	29,125,200	貸付株式数 500株
O U Gホールディングス	162,000	265.00	42,930,000	

スターゼン	43,200	4,650.00	200,880,000	貸付株式数 500株 (500株)
セイコーHD	742,000	480.00	356,160,000	
山 善	397,300	1,130.00	448,949,000	
椿本興業	116,000	435.00	50,460,000	
住友商事	6,516,100	1,489.00	9,702,472,900	貸付株式数 1,401,900株
日本ユニシス	285,700	1,857.00	530,544,900	貸付株式数 17,100株
内田洋行	47,500	2,825.00	134,187,500	
三菱商事	7,767,100	2,390.50	18,567,252,550	貸付株式数 76,400株
第一実業	235,000	624.00	146,640,000	
キャノンマーケティングJ PN	295,200	2,524.00	745,084,800	貸付株式数 10,800株
西華産業	320,000	405.00	129,600,000	
佐藤商事	92,300	906.00	83,623,800	
菱洋エレクトロ	96,000	1,830.00	175,680,000	貸付株式数 8,000株
東京産業	102,700	445.00	45,701,500	貸付株式数 3,800株
ユアサ商事	98,000	3,410.00	334,180,000	貸付株式数 1,300株
神鋼商事	26,000	2,626.00	68,276,000	
小林産業	68,400	317.00	21,682,800	
阪和興業	1,034,000	844.00	872,696,000	
カナデン	98,700	1,155.00	113,998,500	貸付株式数 23,100株
菱電商事	162,000	799.00	129,438,000	
ニプロ	725,900	1,512.00	1,097,560,800	貸付株式数 101,200株
フルサト工業	57,000	1,686.00	96,102,000	
岩谷産業	1,146,000	704.00	806,784,000	
すてきナイスグループ	440,000	158.00	69,520,000	
昭光通商	366,000	97.00	35,502,000	貸付株式数 144,000株
ニチモウ	147,000	177.00	26,019,000	貸付株式数 34,000株
極東貿易	157,000	276.00	43,332,000	
イ ワ キ	145,000	477.00	69,165,000	貸付株式数 34,000株
兼松エレクトロニクス	65,200	3,550.00	231,460,000	
三愛石油	277,500	1,141.00	316,627,500	
稲畑産業	248,100	1,488.00	369,172,800	
G S Iクレオス	253,000	143.00	36,179,000	
明和産業	95,200	440.00	41,888,000	
キムラタン	4,638,000	6.00	27,828,000	
ゴ - ルドウイン	46,500	6,780.00	315,270,000	貸付株式数 23,000株 (6,200株)
ユニ・チャ - ム	2,223,900	2,828.50	6,290,301,150	貸付株式数 797,200株
デザート	250,500	1,507.00	377,503,500	貸付株式数 123,800株

キング	54,500	418.00	22,781,000		
ワキタ	220,200	1,183.00	260,496,600		
ヤマトインタ-ナショナル	72,800	439.00	31,959,200	貸付株式数	14,900株
東邦ホールディングス	331,400	2,155.00	714,167,000	貸付株式数	115,900株
サンゲツ	351,200	1,957.00	687,298,400	貸付株式数	149,400株
ミツウロコグループ	166,400	720.00	119,808,000		
シナネンホールディングス	44,400	2,228.00	98,923,200		
伊藤忠エネクス	228,400	963.00	219,949,200		
サンリオ	319,000	2,181.00	695,739,000	貸付株式数	157,700株
サンワテクノス	61,100	1,532.00	93,605,200		
リョーサン	139,200	4,240.00	590,208,000	貸付株式数	55,600株
新光商事	113,300	1,386.00	157,033,800		
トーホー	46,600	3,000.00	139,800,000		
三信電気	114,400	1,450.00	165,880,000		
東陽テクニカ	118,900	1,089.00	129,482,100	貸付株式数	58,700株
モスフードサービス	135,500	3,355.00	454,602,500	貸付株式数	60,100株 (3,000株)
加賀電子	93,500	2,370.00	221,595,000		
三益半導体	92,500	1,733.00	160,302,500		
ソーダニツカ	106,500	522.00	55,593,000		
立花エレテック	69,900	1,524.00	106,527,600		
木曽路	126,600	2,680.00	339,288,000	貸付株式数	2,900株
サトレストランシステムズ	121,700	902.00	109,773,400	貸付株式数	39,900株 (10,800株)
千趣会	187,100	789.00	147,621,900		
タカキュー	79,700	197.00	15,700,900	貸付株式数	17,500株
ケーヨー	174,300	826.00	143,971,800	貸付株式数	18,800株 (7,400株)
上新電機	244,000	1,561.00	380,884,000		
日本瓦斯	189,800	3,550.00	673,790,000	貸付株式数	13,400株
ロイヤルホールディングス	170,700	2,537.00	433,065,900	貸付株式数	78,800株 (72,200株)
東天紅	84,000	202.00	16,968,000	貸付株式数	13,000株
いなげや	115,100	1,862.00	214,316,200	貸付株式数	48,000株
島忠	267,800	2,587.00	692,798,600	貸付株式数	129,700株
チヨダ	122,000	2,997.00	365,634,000		
ライフコーポレーション	78,300	3,005.00	235,291,500	貸付株式数	38,600株
リンガーハット	116,500	2,417.00	281,580,500	貸付株式数	49,000株 (43,200株)
さが美	93,000	121.00	11,253,000	貸付株式数	14,000株

MR MAX	129,000	554.00	71,466,000	貸付株式数 16,000株 (16,000株)
テンアライド	95,200	398.00	37,889,600	貸付株式数 13,300株 (6,400株)
AOKIホールディングス	206,600	1,441.00	297,710,600	貸付株式数 11,900株
オークワ	146,000	1,261.00	184,106,000	貸付株式数 31,000株
コメリ	159,500	2,845.00	453,777,500	貸付株式数 78,300株
青山商事	216,500	3,965.00	858,422,500	貸付株式数 107,100株
しまむら	120,200	13,650.00	1,640,730,000	貸付株式数 26,500株
はせがわ	54,600	476.00	25,989,600	
高島屋	1,737,000	1,029.00	1,787,373,000	
松屋	225,600	988.00	222,892,800	貸付株式数 86,600株 (86,600株)
エイチ・ツー・オーリテイ リング	530,000	1,933.00	1,024,490,000	貸付株式数 261,900株
近鉄百貨店	395,000	350.00	138,250,000	
パルコ	99,100	1,312.00	130,019,200	
丸井グループ	1,089,000	1,589.00	1,730,421,000	貸付株式数 550,200株
クレディセゾン	785,100	2,214.00	1,738,211,400	貸付株式数 53,200株
アクシアル リテイリング	80,000	4,140.00	331,200,000	貸付株式数 1,200株
井筒屋	56,100	425.00	23,842,500	
イオン	4,259,100	1,718.00	7,317,133,800	貸付株式数 2,111,700株
イズミ	186,700	6,130.00	1,144,471,000	
東武ストア	12,300	3,065.00	37,699,500	
フオーバル	45,200	766.00	34,623,200	
平和堂	209,700	2,297.00	481,680,900	貸付株式数 21,900株 (21,900株)
フジ	115,000	2,668.00	306,820,000	貸付株式数 200株
ヤオコー	117,300	4,675.00	548,377,500	貸付株式数 52,500株
ゼビオホールディングス	140,400	1,982.00	278,272,800	
ケースホールディングス	437,900	2,160.00	945,864,000	貸付株式数 217,100株 (52,900株)
PALTAC	165,600	3,825.00	633,420,000	貸付株式数 2,600株
三谷産業	109,800	421.00	46,225,800	貸付株式数 5,700株
OLYMPICグループ	60,800	596.00	36,236,800	貸付株式数 400株
日産東京販売HD	151,900	436.00	66,228,400	
新生銀行	9,852,000	193.00	1,901,436,000	
あおぞら銀行	6,549,000	436.00	2,855,364,000	
三菱UFJフィナンシャル G	78,439,400	749.30	58,774,642,420	貸付株式数 671,100株



りそなホールディングス	12,109,600	605.30	7,329,940,880	貸付株式数	968,900株
三井住友トラストHD	2,161,000	4,039.00	8,728,279,000	貸付株式数	98,700株
三井住友フィナンシャルG	8,288,800	4,373.00	36,246,922,400	貸付株式数	3,571,200株
第四銀行	1,269,000	514.00	652,266,000		
北越銀行	111,800	2,647.00	295,934,600		
千葉銀行	3,992,000	825.00	3,293,400,000	貸付株式数	2,000,000株
群馬銀行	2,300,200	669.00	1,538,833,800	貸付株式数	53,000株
武蔵野銀行	165,100	3,435.00	567,118,500		
千葉興業銀行	283,700	596.00	169,085,200		
筑波銀行	430,100	335.00	144,083,500		
七十七銀行	1,623,000	553.00	897,519,000		
青森銀行	802,000	391.00	313,582,000	貸付株式数	33,000株 (28,000株)
秋田銀行	663,000	320.00	212,160,000		
山形銀行	581,000	490.00	284,690,000	貸付株式数	245,000株
岩手銀行	67,800	4,490.00	304,422,000	貸付株式数	30,900株
東邦銀行	925,000	392.00	362,600,000	貸付株式数	24,000株
東北銀行	526,000	152.00	79,952,000		
みちのく銀行	620,000	184.00	114,080,000	貸付株式数	240,000株 (10,000株)
ふくおかフィナンシャルG	4,200,000	547.00	2,297,400,000	貸付株式数	1,509,000株
静岡銀行	2,731,000	1,031.00	2,815,661,000	貸付株式数	1,229,000株
十六銀行	1,389,000	367.00	509,763,000		
スルガ銀行	1,058,300	2,785.00	2,947,365,500	貸付株式数	523,100株
八十二銀行	1,997,300	730.00	1,458,029,000	貸付株式数	753,400株
山梨中央銀行	641,000	461.00	295,501,000		
大垣共立銀行	1,600,000	322.00	515,200,000		
福井銀行	885,000	272.00	240,720,000		
北國銀行	1,099,000	421.00	462,679,000		
清水銀行	35,100	3,630.00	127,413,000		
富山銀行	19,800	4,185.00	82,863,000	貸付株式数	7,800株 (7,800株)
滋賀銀行	972,000	589.00	572,508,000	貸付株式数	438,000株
南都銀行	118,200	3,180.00	375,876,000		
百五銀行	931,000	454.00	422,674,000		
京都銀行	1,852,000	1,061.00	1,964,972,000		
紀陽銀行	389,200	1,981.00	771,005,200	貸付株式数	24,600株
三重銀行	46,100	2,501.00	115,296,100		
ほくほくフィナンシャルG	688,600	1,835.00	1,263,581,000		

広島銀行	3,054,000	484.00	1,478,136,000	
山陰合同銀行	613,400	908.00	556,967,200	貸付株式数 38,900株
中国銀行	715,400	1,714.00	1,226,195,600	貸付株式数 339,000株
鳥取銀行	32,800	1,700.00	55,760,000	
伊予銀行	1,476,100	927.00	1,368,344,700	貸付株式数 729,700株
百十四銀行	1,099,000	369.00	405,531,000	
四国銀行	793,000	298.00	236,314,000	
阿波銀行	884,000	753.00	665,652,000	貸付株式数 431,000株
大分銀行	595,000	423.00	251,685,000	貸付株式数 259,000株
宮崎銀行	689,000	364.00	250,796,000	
佐賀銀行	628,000	260.00	163,280,000	
十八銀行	636,000	304.00	193,344,000	
沖縄銀行	100,600	4,505.00	453,203,000	貸付株式数 4,500株
琉球銀行	213,200	1,628.00	347,089,600	貸付株式数 4,900株
セブン銀行	3,880,200	415.00	1,610,283,000	貸付株式数 1,951,900株 (150,000株)
みずほフィナンシャルG	140,558,200	204.60	28,758,207,720	
高知銀行	375,000	125.00	46,875,000	
山口フィナンシャルG	968,000	1,352.00	1,308,736,000	貸付株式数 479,000株
アクリーティブ	84,900	403.00	34,214,700	貸付株式数 38,300株 (12,600株)
芙蓉総合リース	118,400	6,480.00	767,232,000	貸付株式数 1,600株
興銀リース	194,400	2,680.00	520,992,000	貸付株式数 37,100株
東京センチュリー	208,300	4,725.00	984,217,500	貸付株式数 1,000株
SBIホールディングス	1,170,100	1,547.00	1,810,144,700	貸付株式数 301,600株 (170,000株)
日本証券金融	455,900	570.00	259,863,000	
アイフル	1,736,000	392.00	680,512,000	貸付株式数 758,100株 (75,100株)
日本アジア投資	99,000	435.00	43,065,000	貸付株式数 41,200株 (3,500株)
ポケットカード	77,500	767.00	59,442,500	
長野銀行	33,900	1,984.00	67,257,600	貸付株式数 15,500株
名古屋銀行	83,600	4,130.00	345,268,000	貸付株式数 34,700株
北洋銀行	1,689,400	391.00	660,555,400	
愛知銀行	34,700	6,210.00	215,487,000	
第三銀行	58,500	1,708.00	99,918,000	
中京銀行	42,500	2,297.00	97,622,500	
大光銀行	354,000	235.00	83,190,000	

愛媛銀行	131,600	1,412.00	185,819,200	貸付株式数 52,000株 (39,600株)
トマト銀行	39,900	1,551.00	61,884,900	
みなと銀行	93,700	2,089.00	195,739,300	
京葉銀行	844,000	480.00	405,120,000	貸付株式数 84,000株
関西アーバン銀行	144,200	1,303.00	187,892,600	
栃木銀行	571,100	465.00	265,561,500	
北日本銀行	32,200	3,165.00	101,913,000	
東和銀行	1,937,000	126.00	244,062,000	
福島銀行	1,123,000	88.00	98,824,000	
大東銀行	538,000	163.00	87,694,000	
リコーリース	81,400	3,915.00	318,681,000	貸付株式数 2,800株
イオンフィナンシャルサー ビス	660,900	2,391.00	1,580,211,900	貸付株式数 326,800株 (14,900株)
アコム	2,079,300	508.00	1,056,284,400	貸付株式数 1,060,300株
ジャックス	571,000	545.00	311,195,000	
オリコ	2,238,100	193.00	431,953,300	貸付株式数 1,109,600株
日立キャピタル	243,900	2,761.00	673,407,900	貸付株式数 120,600株
アプラスフィナンシャル	496,400	109.00	54,107,600	貸付株式数 245,400株 (64,800株)
オリックス	7,330,300	1,784.00	13,077,255,200	
三菱UFJリース	2,625,600	622.00	1,633,123,200	貸付株式数 1,298,200株
ジャフコ	173,000	4,585.00	793,205,000	
トモニホールディングス	853,100	534.00	455,555,400	貸付株式数 2,500株
大和証券G本社	9,408,000	675.90	6,358,867,200	
野村ホールディングス	21,161,900	664.30	14,057,850,170	
岡三証券グループ	881,000	743.00	654,583,000	貸付株式数 3,000株
丸三証券	329,200	933.00	307,143,600	貸付株式数 162,400株 (21,900株)
東洋証券	370,000	256.00	94,720,000	貸付株式数 39,000株
東海東京HD	1,187,800	640.00	760,192,000	
光世証券	247,000	161.00	39,767,000	貸付株式数 65,000株 (15,000株)
水戸証券	320,400	309.00	99,003,600	
いちよし証券	231,500	937.00	216,915,500	
松井証券	591,000	935.00	552,585,000	
SOMPOホールディング ス	2,164,100	4,412.00	9,548,009,200	
だいこう証券ビジ	50,000	611.00	30,550,000	
日本取引所グループ	3,218,500	2,010.00	6,469,185,000	貸付株式数 1,328,800株

マネックスG	1,096,500	307.00	336,625,500	貸付株式数	542,200株
カブドットコム証券	772,200	383.00	295,752,600	貸付株式数	94,100株
極東証券	138,800	1,620.00	224,856,000	貸付株式数	68,500株 (30,000株)
岩井コスモホールディング	97,700	1,260.00	123,102,000		
藍澤證券	193,500	674.00	130,419,000	貸付株式数	13,000株
フィデアホール	1,004,400	182.00	182,800,800		
池田泉州HD	1,098,100	457.00	501,831,700		
アニコムホールディングス	70,100	2,635.00	184,713,500	貸付株式数	34,300株
MS&AD	3,093,500	3,859.00	11,937,816,500		
SONY FH	991,600	2,042.00	2,024,847,200	貸付株式数	505,600株
マネーパートナーズGP	132,000	512.00	67,584,000	貸付株式数	66,500株
小林洋行	29,500	271.00	7,994,500	貸付株式数	3,300株
第一生命HLDGS	6,242,200	2,075.00	12,952,565,000		
東京海上HD	4,168,800	4,774.00	19,901,851,200	貸付株式数	106,200株
イー・ギャランティ	30,800	2,598.00	80,018,400	貸付株式数	9,300株 (8,100株)
アサックス	17,800	1,664.00	29,619,200		
NECキャピタルソリューション	42,100	1,787.00	75,232,700		
T&Dホールディングス	3,772,700	1,755.00	6,621,088,500	貸付株式数	1,677,000株
アドバンスクリエイト	24,200	1,965.00	47,553,000	貸付株式数	7,100株 (7,100株)
三井不動産	5,488,600	2,608.50	14,317,013,100		
三菱地所	7,699,200	2,038.00	15,690,969,600		
平和不動産	195,700	1,779.00	348,150,300		
東京建物	1,130,500	1,457.00	1,647,138,500	貸付株式数	13,800株
ダイビル	266,400	1,138.00	303,163,200	貸付株式数	2,200株
京阪神ビルディング	171,500	682.00	116,963,000		
住友不動産	2,481,000	3,426.00	8,499,906,000	貸付株式数	26,000株
太平洋興発	431,000	104.00	44,824,000		
大京	1,923,000	234.00	449,982,000		
テーオーシー	401,200	1,022.00	410,026,400	貸付株式数	6,800株
東京楽天地	168,000	596.00	100,128,000		
レオパレス21	1,286,900	731.00	940,723,900		
スターツコーポレーション	140,700	2,647.00	372,432,900		
フジ住宅	132,000	743.00	98,076,000	貸付株式数	1,100株
空港施設	125,200	617.00	77,248,400		
明和地所	56,700	820.00	46,494,000		

ゴールドクレスト	93,200	2,395.00	223,214,000	貸付株式数	17,300株
リログループ	547,900	2,138.00	1,171,410,200	貸付株式数	251,500株
日本エスリード	40,300	1,778.00	71,653,400		
日神不動産	122,300	584.00	71,423,200		
日本エスコ	180,400	477.00	86,050,800	貸付株式数	89,000株 (35,100株)
タカラレーベン	444,200	494.00	219,434,800	貸付株式数	226,400株
サンヨーハウジ 名古屋	53,300	1,118.00	59,589,400		
イオンモール	666,500	2,088.00	1,391,652,000	貸付株式数	300,400株
ファースト住建	38,500	1,570.00	60,445,000	貸付株式数	14,700株
ランド	1,077,100	17.00	18,310,700		
東祥	31,100	5,140.00	159,854,000	貸付株式数	15,400株
トーセイ	125,800	792.00	99,633,600		
穴吹興産	11,300	2,912.00	32,905,600		
エヌ・ティ・ティ都市開発	643,100	1,078.00	693,261,800	貸付株式数	317,900株
サンフロンティア不動産	111,400	1,134.00	126,327,600	貸付株式数	54,900株
エフ・ジェー・ネクスト	90,300	844.00	76,213,200	貸付株式数	44,500株 (39,600株)
インテリックス	31,600	832.00	26,291,200	貸付株式数	3,100株
ランドビジネス	61,000	292.00	17,812,000		
グランディハウス	90,300	425.00	38,377,500		
東武鉄道	5,604,000	604.00	3,384,816,000	貸付株式数	521,000株
相鉄ホールディングス	1,678,000	551.00	924,578,000		
東京急行	5,698,000	844.00	4,809,112,000		
京浜急行	2,874,000	1,321.00	3,796,554,000		
小田急電鉄	1,680,000	2,210.00	3,712,800,000	貸付株式数	845,700株
京王電鉄	2,930,000	926.00	2,713,180,000	貸付株式数	1,172,000株
京成電鉄	786,000	2,957.00	2,324,202,000	貸付株式数	294,000株
富士急行	285,000	1,167.00	332,595,000	貸付株式数	131,000株 (87,000株)
新京成電鉄	133,000	417.00	55,461,000		
東日本旅客鉄道	2,029,000	10,785.00	21,882,765,000		
西日本旅客鉄道	1,009,400	7,960.00	8,034,824,000		
東海旅客鉄道	872,100	17,920.00	15,628,032,000		
西武ホールディングス	1,448,400	2,006.00	2,905,490,400	貸付株式数	718,100株
鴻池運輸	148,300	1,516.00	224,822,800	貸付株式数	5,600株
西日本鉄道	1,260,000	496.00	624,960,000		
ハマキョウレックス	68,100	2,757.00	187,751,700		
サカイ引越センター	48,100	4,370.00	210,197,000	貸付株式数	24,500株 (6,100株)

近鉄グループHLDGS	10,555,000	426.00	4,496,430,000	貸付株式数	198,000株
阪急阪神HLDGS	1,324,900	4,015.00	5,319,473,500		
南海電鉄	2,216,000	567.00	1,256,472,000		
京阪ホールディングス	2,350,000	702.00	1,649,700,000	貸付株式数	634,000株
神戸電鉄	256,000	392.00	100,352,000	貸付株式数	107,000株 (107,000株)
名古屋鉄道	3,819,000	515.00	1,966,785,000	貸付株式数	1,755,000株 (982,000株)
山陽電鉄	382,000	561.00	214,302,000		
トランコム	30,200	5,490.00	165,798,000	貸付株式数	11,100株
日本通運	3,900,000	711.00	2,772,900,000		
ヤマトホールディングス	1,875,300	2,265.50	4,248,492,150	貸付株式数	8,000株
山 九	1,380,000	753.00	1,039,140,000		
日 新	429,000	519.00	222,651,000		
丸 運	56,600	285.00	16,131,000		
丸全昭和運輸	351,000	455.00	159,705,000	貸付株式数	2,000株
センコーグループHLDGS	497,800	738.00	367,376,400	貸付株式数	30,000株
トナミホールディングス	213,000	439.00	93,507,000		
ニッコンホールディングス	355,600	2,540.00	903,224,000		
日石輸送	11,800	2,742.00	32,355,600		
福山通運	635,000	717.00	455,295,000		
セイノーホールディングス	743,900	1,502.00	1,117,337,800		
神奈川中央交通	122,000	732.00	89,304,000		
日立物流	218,400	2,601.00	568,058,400		
丸和運輸機関	26,100	3,930.00	102,573,000	貸付株式数	12,900株 (3,400株)
C & F ロジホールディングス	108,800	1,311.00	142,636,800	貸付株式数	22,000株
日本郵船	8,861,000	221.00	1,958,281,000	貸付株式数	4,307,000株
商船三井	5,500,000	356.00	1,958,000,000	貸付株式数	1,507,000株
川崎汽船	3,977,000	281.00	1,117,537,000	貸付株式数	1,457,000株 (1,457,000株)
NSユニテッド海運	468,000	234.00	109,512,000		
明治海運	93,800	414.00	38,833,200	貸付株式数	4,400株
飯野海運	542,600	502.00	272,385,200		
共栄タンカー	87,000	212.00	18,444,000	貸付株式数	20,000株
九州旅客鉄道	1,042,100	3,600.00	3,751,560,000		
日本航空	1,843,000	3,508.00	6,465,244,000		
ANAホールディングス	19,467,000	384.80	7,490,901,600		

パスコ	96,000	376.00	36,096,000	貸付株式数 47,000株 (9,000株)
三菱倉庫	687,000	1,468.00	1,008,516,000	
三井倉庫HOLD	608,000	309.00	187,872,000	貸付株式数 302,000株 (236,000株)
住友倉庫	706,000	710.00	501,260,000	貸付株式数 109,000株
渋沢倉庫	272,000	369.00	100,368,000	
ヤマタネ	51,700	1,630.00	84,271,000	
東陽倉庫	179,300	299.00	53,610,700	
乾汽船	76,400	841.00	64,252,400	
日本トランスシティ	241,000	448.00	107,968,000	
ケイヒン	190,000	159.00	30,210,000	
中央倉庫	60,500	1,071.00	64,795,500	貸付株式数 11,400株
安田倉庫	81,600	742.00	60,547,200	
東洋埠頭	302,000	185.00	55,870,000	
宇徳	84,900	465.00	39,478,500	
上組	1,251,000	1,182.00	1,478,682,000	
サンリツ	25,400	698.00	17,729,200	
キムラユニティー	26,500	1,165.00	30,872,500	
キューソー流通システム	28,900	2,800.00	80,920,000	貸付株式数 4,400株
郵船ロジスティクス	96,200	1,007.00	96,873,400	貸付株式数 47,500株
近鉄エクスプレス	187,600	1,841.00	345,371,600	貸付株式数 34,100株
東海運	56,500	431.00	24,351,500	貸付株式数 24,400株 (18,900株)
エーアイテイー	64,300	1,007.00	64,750,100	貸付株式数 10,100株
内外トランスライン	31,300	1,300.00	40,690,000	貸付株式数 4,300株
東京放送HD	682,200	1,871.00	1,276,396,200	
日本テレビHLD S	945,000	1,804.00	1,704,780,000	貸付株式数 481,900株
朝日放送	102,200	802.00	81,964,400	
テレビ朝日HD	282,700	1,894.00	535,433,800	貸付株式数 139,700株
スカパーJ S A T H D	673,300	472.00	317,797,600	貸付株式数 343,300株
テレビ東京HD	84,300	2,218.00	186,977,400	貸付株式数 41,800株 (36,100株)
日本BS放送	34,700	1,251.00	43,409,700	貸付株式数 10,900株 (2,900株)
ビジョン	26,500	2,513.00	66,594,500	貸付株式数 10,000株
U - N E X T	26,800	1,146.00	30,712,800	貸付株式数 13,200株 (6,800株)
ワイヤレスゲート	47,700	1,465.00	69,880,500	貸付株式数 24,300株 (22,400株)

コネクシオ	90,900	1,993.00	181,163,700	
日本通信	890,400	166.00	147,806,400	
クロップス	21,700	594.00	12,889,800	貸付株式数 4,000株
日本電信電話	8,309,500	5,230.00	43,458,685,000	貸付株式数 3,580,300株
KDDI	10,110,300	2,909.00	29,410,862,700	貸付株式数 3,209,500株
光通信	124,400	11,450.00	1,424,380,000	
NTTドコモ	7,619,300	2,622.50	19,981,614,250	
エムティーアイ	138,500	713.00	98,750,500	貸付株式数 32,500株
GMOインターネット	377,600	1,419.00	535,814,400	貸付株式数 163,000株
アイドママーケティング コミュ	13,200	712.00	9,398,400	
カドカワ	300,100	1,394.00	418,339,400	貸付株式数 65,000株
学研ホールディングス	34,400	3,325.00	114,380,000	
ゼンリン	136,800	3,245.00	443,916,000	貸付株式数 15,300株
昭文社	59,200	720.00	42,624,000	
インプレスホールディング ス	85,200	142.00	12,098,400	貸付株式数 39,000株
東京電力HD	8,896,500	460.00	4,092,390,000	貸付株式数 1,263,200株
中部電力	3,455,800	1,451.00	5,014,365,800	貸付株式数 111,900株
関西電力	4,279,800	1,487.50	6,366,202,500	貸付株式数 1,181,200株
中国電力	1,450,000	1,228.00	1,780,600,000	貸付株式数 739,400株
北陸電力	1,027,400	994.00	1,021,235,600	貸付株式数 354,900株 (70,000株)
東北電力	2,620,200	1,510.00	3,956,502,000	貸付株式数 352,600株
四国電力	944,400	1,306.00	1,233,386,400	貸付株式数 234,300株
九州電力	2,316,300	1,321.00	3,059,832,300	貸付株式数 1,151,700株
北海道電力	981,500	853.00	837,219,500	貸付株式数 95,300株
沖縄電力	169,500	2,638.00	447,141,000	貸付株式数 8,300株
電源開発	834,500	2,721.00	2,270,674,500	貸付株式数 420,400株
エフオン	51,800	1,002.00	51,903,600	
イーレックス	131,800	999.00	131,668,200	貸付株式数 64,800株 (1,200株)
東京瓦斯	11,249,000	576.30	6,482,798,700	
大阪瓦斯	10,177,000	444.10	4,519,605,700	
東邦瓦斯	2,616,000	786.00	2,056,176,000	
北海道瓦斯	270,000	273.00	73,710,000	貸付株式数 21,000株
広島ガス	215,900	351.00	75,780,900	
西部瓦斯	1,181,000	267.00	315,327,000	
静岡ガス	297,700	754.00	224,465,800	



メタウォーター	59,100	3,115.00	184,096,500	貸付株式数 7,700株 (7,000株)
アイネット	58,200	1,331.00	77,464,200	
松竹	681,000	1,392.00	947,952,000	
東宝	677,000	3,390.00	2,295,030,000	
エイチ・アイ・エス	156,200	3,455.00	539,671,000	貸付株式数 91,000株 (55,000株)
東映	385,000	1,078.00	415,030,000	
ラックランド	19,100	2,042.00	39,002,200	貸付株式数 6,900株
NTTデータ	3,197,100	1,239.00	3,961,206,900	貸付株式数 31,100株
共立メンテナンス	178,000	3,255.00	579,390,000	貸付株式数 52,600株
イチネンホールディングス	112,200	1,213.00	136,098,600	
建設技術研究所	69,200	1,140.00	78,888,000	
スペース	59,100	1,454.00	85,931,400	貸付株式数 800株
アインホールディングス	135,000	7,890.00	1,065,150,000	貸付株式数 34,300株
燦ホールディングス	21,600	2,135.00	46,116,000	
ピー・シー・エー	14,900	1,467.00	21,858,300	貸付株式数 2,400株
スバル興業	78,000	628.00	48,984,000	貸付株式数 16,000株
東京テアトル	418,000	143.00	59,774,000	貸付株式数 156,000株
タナベ経営	21,200	1,405.00	29,786,000	
ビジネスB太田昭和	17,400	1,053.00	18,322,200	
ナガワ	19,800	3,965.00	78,507,000	
よみうりランド	216,000	552.00	119,232,000	貸付株式数 49,000株
東京都競馬	74,900	2,970.00	222,453,000	貸付株式数 8,000株
常磐興産	40,200	1,795.00	72,159,000	
カナモト	152,800	3,765.00	575,292,000	
東京ドーム	437,000	1,032.00	450,984,000	貸付株式数 7,000株
DTS	106,800	3,440.00	367,392,000	貸付株式数 19,400株
スクウェア・エニックス・HD	398,500	3,595.00	1,432,607,500	
シーイーシー	61,200	2,109.00	129,070,800	
カプコン	242,600	2,583.00	626,635,800	貸付株式数 119,500株
西尾レントオール	88,200	3,565.00	314,433,000	
アイ・エス・ビー	19,800	1,615.00	31,977,000	貸付株式数 9,700株 (900株)
アゴーラ・ホスピタリティ ティーG	550,000	36.00	19,800,000	
日本空港ビルデング	330,100	4,235.00	1,397,973,500	貸付株式数 22,900株
トランス・コスモス	127,100	2,612.00	331,985,200	
乃村工藝社	234,300	2,356.00	552,010,800	

ジャステック	59,600	1,249.00	74,440,400	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
S C S K	281,300	4,850.00	1,364,305,000	貸付株式数 40,500株
藤田観光	35,700	3,720.00	132,804,000	
K N T - C Tホールディングス	623,000	203.00	126,469,000	
日本管財	93,900	1,952.00	183,292,800	
トーカイ	48,400	4,575.00	221,430,000	
白 洋 舎	10,800	3,020.00	32,616,000	貸付株式数 5,200株
セコム	1,139,600	8,580.00	9,777,768,000	
日本システムウエア	33,900	1,761.00	59,697,900	貸付株式数 3,100株
セントラル警備保障	48,300	1,952.00	94,281,600	貸付株式数 23,600株
アイネス	130,400	1,143.00	149,047,200	貸付株式数 500株
丹青社	189,200	1,117.00	211,336,400	貸付株式数 58,900株 (57,800株)
メイテック	127,000	4,680.00	594,360,000	貸付株式数 10,500株 (8,100株)
T K C	95,800	3,215.00	307,997,000	
アサツー ディ・ケイ	177,500	2,792.00	495,580,000	貸付株式数 5,700株
富士ソフト	142,700	3,165.00	451,645,500	貸付株式数 2,600株
応用地質	103,700	1,528.00	158,453,600	貸付株式数 3,100株
船井総研ホールディング	138,700	2,809.00	389,608,300	貸付株式数 15,000株
N S D	219,600	2,025.00	444,690,000	
進学会	45,700	580.00	26,506,000	貸付株式数 2,900株
丸紅建材リース	101,000	223.00	22,523,000	
オ オ バ	84,800	513.00	43,502,400	貸付株式数 39,300株
コナミホールディングス	467,300	6,160.00	2,878,568,000	
いであ	20,100	1,051.00	21,125,100	
学 究 社	28,700	1,579.00	45,317,300	
ベネッセホールディングス	367,000	4,375.00	1,605,625,000	貸付株式数 184,600株
イオンディライト	123,500	3,615.00	446,452,500	貸付株式数 10,100株 (10,000株)
ナック	67,100	1,000.00	67,100,000	貸付株式数 1,300株
福井コンピュータH L D S	29,900	3,635.00	108,686,500	貸付株式数 14,100株 (8,800株)
ニチイ学館	190,200	1,110.00	211,122,000	貸付株式数 21,200株
ダイセキ	191,000	2,792.00	533,272,000	貸付株式数 5,100株
ステップ	36,600	1,455.00	53,253,000	
日鉄住金物産	90,700	5,620.00	509,734,000	
元気寿司	26,000	2,230.00	57,980,000	貸付株式数 10,700株

トラスコ中山	215,000	2,760.00	593,400,000	貸付株式数 15,800株 (10,000株)
ヤマダ電機	3,555,272	562.00	1,998,062,864	貸付株式数 1,716,600株 (844,700株)
オートバックスセブン	383,200	1,846.00	707,387,200	貸付株式数 195,400株 (4,100株)
モリト	82,700	913.00	75,505,100	貸付株式数 20,100株
アークランドサカモト	175,200	1,500.00	262,800,000	
ニトリホールディングス	447,200	15,000.00	6,708,000,000	貸付株式数 115,700株
グルメ杵屋	74,000	1,105.00	81,770,000	貸付株式数 14,000株 (10,000株)
愛眼	75,500	212.00	16,006,000	貸付株式数 1,900株
ケーユーホールディングス	53,900	993.00	53,522,700	
吉野家ホールディングス	360,600	1,964.00	708,218,400	貸付株式数 164,400株
加藤産業	161,500	2,914.00	470,611,000	
イノテック	89,000	661.00	58,829,000	
イエローハット	97,500	2,785.00	271,537,500	貸付株式数 2,600株
松屋フーズ	49,600	4,155.00	206,088,000	貸付株式数 20,800株
JBCホールディングス	86,500	839.00	72,573,500	
JKホールディングス	103,700	677.00	70,204,900	
サガミチェーン	129,500	1,375.00	178,062,500	貸付株式数 8,600株 (8,600株)
日伝	42,800	3,855.00	164,994,000	
関西スーパーマーケット	84,200	1,506.00	126,805,200	貸付株式数 41,100株 (36,700株)
ミロク情報サービス	102,000	2,285.00	233,070,000	貸付株式数 4,600株
北沢産業	85,300	203.00	17,315,900	
杉本商事	59,400	1,545.00	91,773,000	
因幡電機産業	145,200	4,275.00	620,730,000	
王将フードサービス	75,800	4,320.00	327,456,000	
プレナス	115,700	2,338.00	270,506,600	貸付株式数 57,100株 (44,500株)
ミニストップ	76,500	2,371.00	181,381,500	貸付株式数 25,000株
アークス	193,700	2,383.00	461,587,100	貸付株式数 9,600株
バローホールディングス	222,900	2,481.00	553,014,900	貸付株式数 110,100株
バイテックホールディングス	42,100	1,419.00	59,739,900	貸付株式数 500株
ミスミグループ本社	1,179,700	2,598.00	3,064,860,600	貸付株式数 309,800株
藤久	8,200	1,720.00	14,104,000	貸付株式数 1,300株
アルテック	88,200	237.00	20,903,400	貸付株式数 42,700株

ベルク	45,900	4,895.00	224,680,500	
大庄	55,200	1,752.00	96,710,400	貸付株式数 21,200株 (4,000株)
タキヒヨー	155,000	466.00	72,230,000	
ファーストリテイリング	172,700	37,180.00	6,420,986,000	
ソフトバンクグループ	4,659,600	8,928.00	41,600,908,800	貸付株式数 2,303,800株
蔵王産業	16,700	1,455.00	24,298,500	
スズケン	471,200	3,670.00	1,729,304,000	貸付株式数 35,900株
サンドラッグ	393,700	4,045.00	1,592,516,500	
サクスパーホールディング グ	97,200	1,216.00	118,195,200	貸付株式数 5,600株
ジェコス	71,200	1,329.00	94,624,800	
ヤマザワ	21,300	1,773.00	37,764,900	
やまや	21,100	1,623.00	34,245,300	
ルネサスイーストン	94,700	593.00	56,157,100	貸付株式数 4,200株
ベルーナ	221,700	1,305.00	289,318,500	貸付株式数 100株
合計			2,468,165,203,854	

(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	160,000株	本田技研	30,000株
三菱UFJフィナンシャルG	1,300,000株	三井住友フィナンシャルG	30,000株
日本電信電話	100,000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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
新株予約権証券	ADワークス 新株予約権	952,100	5,712,600	
新株予約権証券 合計			5,712,600	
合計			5,712,600	

新株予約権証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 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29年7月31日

資産総額	2,853,761,037,264円
負債総額	330,227,270,973円
純資産総額（ - ）	2,523,533,766,291円
発行済数量	1,505,994,147口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1,675.7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29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29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	77	206,007
追加型株式投資信託	692	13,838,117
株式投資信託 合計	769	14,044,124
単位型公社債投資信託	23	126,932
追加型公社債投資信託	14	2,074,451
公社債投資信託 合計	37	2,201,383
総合計	806	16,245,506

## 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28年4月1日から平成29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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,715	31,260
有価証券	1,137	110
前払費用	159	190
未収委託者報酬	9,896	10,453
未収収益	87	72
繰延税金資産	468	439
その他	83	34
流動資産計	43,547	42,560
固定資産		
有形固定資産	1	229
建物	18	15
器具備品	224	214
無形固定資産	2,706	2,650
ソフトウェア	2,385	2,323
ソフトウェア仮勘定	321	327
投資その他の資産	14,223	12,353
投資有価証券	7,872	5,920
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	123	185
長期差入保証金	1,049	1,050
繰延税金資産	-	31
その他	47	37
固定資産計	17,173	15,234

資産合計

60,720

57,795

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	61	79
未払金	8,789	9,466
未払収益分配金	5	7
未払償還金	63	59
未払手数料	4,330	4,453
その他未払金	2	2
未払費用	4,215	4,077
未払法人税等	1,155	980
未払消費税等	538	223
賞与引当金	937	945
その他	22	3
流動負債計	15,720	15,776
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,209	2,318
役員退職慰労引当金	93	151
繰延税金負債	1,410	-
その他	-	7
固定負債計	3,714	2,477
負債合計	19,435	18,254
<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
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,960	12,231
利益剰余金合計	14,334	12,606

株主資本合計	41,004	39,276
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	280	264
評価・換算差額等合計	280	264
純資産合計	41,284	39,540
負債・純資産合計	60,720	57,795

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	88,850	79,747
その他営業収益	799	727
営業収益計	89,650	80,474
営業費用		
支払手数料	46,165	40,110
広告宣伝費	646	549
調査費	10,116	9,436
調査費	925	904
委託調査費	9,191	8,531
委託計算費	761	793
営業雑経費	1,346	1,375
通信費	249	251
印刷費	515	501
協会費	53	50
諸会費	14	13
その他営業雑経費	513	557
営業費用計	59,036	52,265
一般管理費		
給料	5,797	5,833
役員報酬	354	416
給料・手当	3,850	3,940
賞与	654	531
賞与引当金繰入額	937	945
福利厚生費	837	807
交際費	70	60
旅費交通費	211	178
租税公課	325	531

不動産賃借料	1,258	1,273
退職給付費用	394	463
役員退職慰労引当金繰入額	37	60
固定資産減価償却費	1,110	1,045
諸経費	1,486	1,400
一般管理費計	11,531	11,655
営業利益	19,082	16,554

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	109	92
受取利息	25	12
投資有価証券売却益	115	224
有価証券償還益	0	94
外国税関連費用引当金戻入益	171	-
その他	72	56
営業外収益計	496	481
営業外費用		
投資有価証券売却損	14	24
その他	94	75
営業外費用計	108	100
経常利益	19,471	16,935
特別損失		
MMF等償還関連費用	-	305
特別損失計	-	305
税引前当期純利益	19,471	16,629
法人税、住民税及び事業税	6,215	6,501
法人税等調整額	6	1,405
法人税等合計	6,209	5,096
当期純利益	13,262	11,533

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益	利益剰余金	
				剰余金 繰越利益 剰余金		
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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		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	13,960	14,334	41,004
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	13,261	13,261	13,261
当期純利益	-	-	-	11,533	11,533	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,728	1,728	1,728
当期末残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

	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	280	280	41,284
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	13,261
当期純利益	-	-	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	15	15	15
当期変動額合計	15	15	1,743
当期末残高	264	264	39,540

## 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「有価証券償還益」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73百万円は、「有価証券償還益」0百万円、「その他」72百万円として組替えております。

(追加情報)

「繰延税金資産の回収可能性に関する摘要指針(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)」  
を当期から適用しております。

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
建物	23百万円	26百万円
器具備品	232百万円	264百万円

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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
未払金	4,320百万円	4,877百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(平成29年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,685百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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28年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 3月31日	平成28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29年6月26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	11,532百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,421円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月27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 その他有価証券	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。

当事業年度（平成29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	31,260	31,260	-
(2) 未収委託者報酬	10,453	10,453	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	5,060	5,060	-
資産計	46,774	46,774	-
(1) 未払手数料	4,453	4,453	-
(2) その他未払金	4,946	4,946	-
(3) 未払費用(*)	3,409	3,409	-
負債計	12,809	12,809	-

(\*) 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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,021	970
(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	1,049	1,050

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

当事業年度（平成29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	31,260	-	-	-
未収委託者報酬	10,453	-	-	-
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	110	2,876	1,139	110
合計	41,824	2,876	1,139	110

## （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。

当事業年度（平成29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。

当事業年度(平成29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	122	55	67
(2) その他			
証券投資信託	3,107	2,697	410
小計	3,230	2,752	478
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	1,829	1,926	96
小計	1,829	1,926	96
合計	5,060	4,679	381

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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	50	-	1
(2) その他			
証券投資信託	4,371	224	23
合計	4,421	224	24

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。  
当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、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おります。

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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,072百万円	2,209百万円
勤務費用	222	202
退職給付の支払額	120	122
その他	35	29
退職給付債務の期末残高	2,209	2,318

(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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,209百万円	2,318百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,209	2,318
退職給付引当金	2,209	2,318
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,209	2,318

(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27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
勤務費用	222百万円	202百万円
その他	-	87
確定給付制度に係る退職給付費用	222	289

## 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172百万円、当事業年度173百万円であります。

## (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28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	676	709
賞与引当金	225	224
未払事業税	224	169
連結法人間取引(譲渡損)	121	5
出資金評価損	98	98
投資有価証券評価損	95	65
その他	173	185
繰延税金資産小計	1,615	1,458
評価性引当額	347	201
繰延税金資産合計	1,268	1,257
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,086	639
その他有価証券評価差額金	124	146
繰延税金負債合計	2,210	786
繰延税金資産の純額	941	470

## 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28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
--	------------------------	------------------------

法定実効税率 (調整)	33.06%	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.77%	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.02%	
評価性引当額の増減額	1.29%	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.19%	
その他	0.43%	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.89%	

(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、記載を省略していません。

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、記載を省略していません。

(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、記載を省略していません。

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。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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)	1,685	-	-

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。

## 当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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)	23,238	未払手数料	3,298
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)	768	未払費用	218
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)	1,036	長期差入保証金	1,028

## 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27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,826.85円	1株当たり純資産額	15,158.25円
1株当たり当期純利益	5,084.10円	1株当たり当期純利益	4,421.51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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,262	11,533
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29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29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	5,500	
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	36,765	
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U F J 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M U F G 証券株式会社	62,149	
U B S 証券株式会社	61,450	

## 2 【関係業務の概要】

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

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

### 3 【資本関係】

該当事項はありません。

#### <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29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28年10月3日	有価証券届出書、有価証券報告書
平成29年4月3日	半期報告書、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29年 5月26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28年4月1日から平成29年3月31日までの第58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29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29年8月4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28年7月11日から平成29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29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。