

通貨選択型  
ダイワ・トップ・オブ・ジャパン  
(米ドル投資型)

運用報告書（全体版）  
第 4 期  
(決算日 2015年9月17日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|              |                                                                                                                                                             |                                  |
|--------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|
| 商品分類         | 追加型投信／国内／株式                                                                                                                                                 |                                  |
| 信託期間         | 約5年間（2013年9月18日～2018年9月14日）                                                                                                                                 |                                  |
| 運用方針         | 信託財産の成長をめざして運用を行ないます。                                                                                                                                       |                                  |
| 主要投資対象       | ベビーファンド                                                                                                                                                     | ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンドの受益証券      |
|              | ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド                                                                                                                                      | わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。以下同じ。） |
| ベビーファンドの運用方法 | ①主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式に投資するとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。<br>②原則として円売り／米ドル買いの為替取引を行なうことで、米ドルへの投資効果の享受をめざします。この為替取引を行なうにあたっては、外国為替予約取引等を活用します。 |                                  |
| マザーファンドの運用方法 | ①主として、わが国の金融商品取引所上場株式に投資し、信託財産の成長をめざします。<br>②株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80％程度以上に維持することを基本とします。                                                              |                                  |
| 組入制限         | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                                                       | 無制限                              |
|              | マザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                                            | 無制限                              |
| 分配方針         | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。                                                        |                                  |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「通貨選択型ダイワ・トップ・オブ・ジャパン（米ドル投資型）」は、このたび、第4期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
（営業日の9：00～17：00）  
<http://www.daiwa-am.co.jp/>

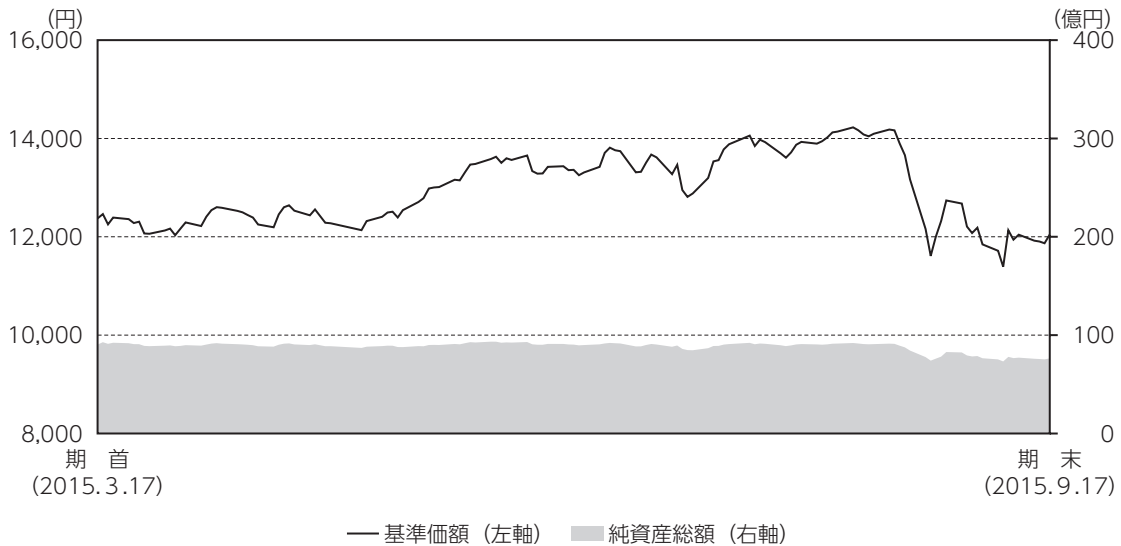
設定以来の運用実績

| 決 算 期                | 基 準 価 額 |           |         | T O P I X |         | 米ドル為替レート |         | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|----------------------|---------|-----------|---------|-----------|---------|----------|---------|-------------|-------------|--------------|
|                      | (分配落)   | 税 込 分 配 金 | 期 騰 落 率 | (参考指数)    | 期 騰 落 率 | (参考指数)   | 期 騰 落 率 |             |             |              |
| 1 期末(2014年 3 月 17 日) | 円 9,737 | 円 0       | % △ 2.6 | 1,154.93  | % △ 2.3 | 円 101.42 | % 2.3   | % 94.2      | % 0.9       | 百万円 11,194   |
| 2 期末(2014年 9 月 17 日) | 10,834  | 600       | 17.4    | 1,304.96  | 13.0    | 107.25   | 5.7     | 98.7        | 0.8         | 10,955       |
| 3 期末(2015年 3 月 17 日) | 12,374  | 1,100     | 24.4    | 1,570.50  | 20.3    | 121.43   | 13.2    | 100.1       | 0.6         | 9,043        |
| 4 期末(2015年 9 月 17 日) | 12,045  | 0         | △ 2.7   | 1,491.91  | △ 5.0   | 120.60   | △ 0.7   | 92.8        | 1.7         | 7,633        |

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。  
(注 2) 為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。  
(注 3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。  
(注 4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

## 《運用経過》

## 基準価額等の推移について



## ■基準価額・騰落率

期 首：12,374円

期 末：12,045円

騰落率：△2.7%

## ■基準価額の主な変動要因

「ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド」の受益証券を通じてわが国の株式に投資するとともに、純資産総額とほぼ同額の米ドルに投資した結果、国内株式市況の下落と米ドルが対円で下落したことを反映し、基準価額は値下がりました。

通貨選択型ダイワ・トップ・オブ・ジャパン（米ドル投資型）

| 年 月 日           | 基 準 価 額     |        | T O P I X |        | 米ドル為替レート    |        | 株 式<br>組 入 比 率 | 株 式<br>先 物 比 率 |
|-----------------|-------------|--------|-----------|--------|-------------|--------|----------------|----------------|
|                 |             | 騰 落 率  | (参考指数)    | 騰 落 率  | (参考指数)      | 騰 落 率  |                |                |
| (期首) 2015年3月17日 | 円<br>12,374 | %<br>－ | 1,570.50  | %<br>－ | 円<br>121.43 | %<br>－ | %<br>100.1     | %<br>0.6       |
| 3月末             | 12,166      | △ 1.7  | 1,543.11  | △1.7   | 120.17      | △1.0   | 98.2           | 0.4            |
| 4月末             | 12,286      | △ 0.7  | 1,592.79  | 1.4    | 119.00      | △2.0   | 97.9           | 0.8            |
| 5月末             | 13,482      | 9.0    | 1,673.65  | 6.6    | 123.73      | 1.9    | 95.9           | －              |
| 6月末             | 13,322      | 7.7    | 1,630.40  | 3.8    | 122.45      | 0.8    | 95.7           | －              |
| 7月末             | 13,929      | 12.6   | 1,659.52  | 5.7    | 124.04      | 2.1    | 94.5           | －              |
| 8月末             | 12,675      | 2.4    | 1,537.05  | △2.1   | 121.18      | △0.2   | 93.1           | －              |
| (期末) 2015年9月17日 | 12,045      | △ 2.7  | 1,491.91  | △5.0   | 120.60      | △0.7   | 92.8           | 1.7            |

(注) 騰落率は期首比。

**投資環境について****○国内株式市況**

国内株式市況は、期首より、ＥＣＢ（欧州中央銀行）による量的金融緩和の導入や国内景気の持ち直し、良好な株式需給関係、円安の進行などを受けて、株価は大きく上昇しました。2015年6月からは、ギリシャ支援協議の難航によりギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念が一時高まったことや、中国株の急落を受け中国経済への不安が高まったこと、さらには世界経済減速懸念も台頭したことから日本株も一時急落するなど、不安定な推移となりました。

**○為替相場**

米ドルの対円相場の期首比の騰落率は△0.7%となりました。

当期は、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）による利上げ期待から円安米ドル高方向に振れる時期もありましたが、期末にかけては利上げ期待も後退し、期首比で若干の円高米ドル安となりました。

**前期における「今後の運用方針」****○当ファンド**

「ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド」の受益証券へ投資を行なうとともに、純資産総額とほぼ同額の米ドルに投資することで、信託財産の成長をめざします。

**○ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド**

株式組入比率については、基本的には現状の高位組入れを維持する方針です。ただし、リスクシナリオの顕在化などで株式市況が大きく変動する局面では、一時的に組入比率を引下げるなど機動的に対応していく方針です。引続き、内外企業と比較した競争力や業績動向、バリュエーションを主な基準にした銘柄選別姿勢をもって運用していきますが、株価変動や外部環境の変化などにより各業種の魅力度が大きく変化したときには、大胆かつ積極的に業種構成を変更していきたいと考えております。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

マザーファンドの受益証券をほぼ100%組入れるとともに、純資産総額とほぼ同額の米ドルに投資しました。

### ○ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド

株式組入比率はおおむね93～98%程度の高位を維持しました。

業種構成は、インバウンド需要の拡大により恩恵を受けている小売業や陸運業などの比率を上げました。一方、円安効果の一服や世界的な景気減速懸念を受けて市場の期待成長率が鈍化した機械や電気機器などの比率を下げました。

個別銘柄では、業績見通しや株価指標などを総合的に勘案して東日本旅客鉄道、西日本旅客鉄道、デクセリアルズ、日本航空、大林組などの組入比率の引上げ、または新規買付けをしました。一方、三井住友フィナンシャルG、村田製作所、オリエンタルランド、楽天、ソニーなどの組入比率の引下げ、または全部売却をしました。

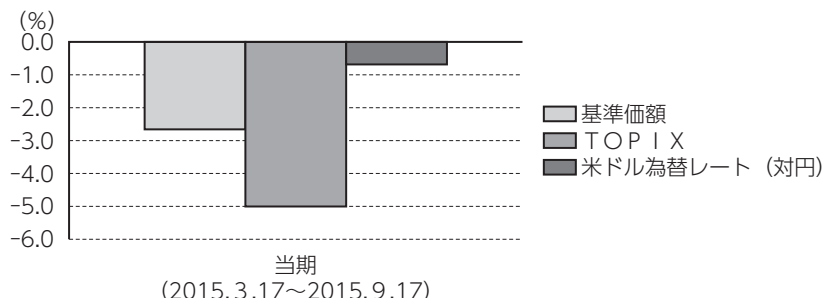
## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。

当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比では、T O P I Xの騰落率は△5.0%、米ドル為替レート△0.7%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△2.7%となりました。T O P I Xの騰落率を上回った建設業、空運業、保険業などをオーバーウエートとしていたことなどがプラス要因となりました。個別銘柄では、K D D I、オリエンタルランド、リンクバルなどがマイナス要因となりましたが、福島工業、象印マホービン、森永製菓などがプラス要因となりました。

また、米ドルが対円で下落したことがマイナス要因となりました。



## 分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が少額であったため、収益分配を見送らせていただきました。  
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（１万口当たり）

| 項 目        |     | 当 期                       |
|------------|-----|---------------------------|
|            |     | 2015年3月18日<br>～2015年9月17日 |
| 当期分配金（税込み） | (円) | —                         |
| 対基準価額比率    | (%) | —                         |
| 当期の収益      | (円) | —                         |
| 当期の収益以外    | (円) | —                         |
| 翌期繰越分配対象額  | (円) | 2,044                     |

（注１）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注２）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注３）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

「ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド」の受益証券へ投資を行なうとともに、純資産総額とほぼ同額の米ドルに投資することで、信託財産の成長をめざします。

### ○ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド

国内株式市況は、米国や中国などの経済や金融政策に不透明感があるものの、国内企業への業績回復期待、政府の成長戦略などが引続き株価の押し上げ要因になると考えており、株式組入比率は高位を維持する方針です。業種構成比については、特定の業種に偏ることなく幅広く分散させていく予定です。銘柄選別においては、活発なIPO（株式の新規公開）銘柄を含めて新しいビジネスモデルで高い成長が見込まれる銘柄や、中長期で業績拡大が続く銘柄などに積極的に投資していく方針です。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目     | 当期                    |         | 項 目 の 概 要                                                          |
|---------|-----------------------|---------|--------------------------------------------------------------------|
|         | (2015.3.18～2015.9.17) |         |                                                                    |
|         | 金 額                   | 比 率     |                                                                    |
| 信託報酬    | 102円                  | 0.783%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は12,971円です。                       |
| （投信会社）  | (48)                  | (0.367) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価             |
| （販売会社）  | (51)                  | (0.390) | 販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価                    |
| （受託銀行）  | (4)                   | (0.027) | 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価                                     |
| 売買委託手数料 | 18                    | 0.137   | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式）    | (18)                  | (0.136) |                                                                    |
| （先物）    | (0)                   | (0.001) |                                                                    |
| 有価証券取引税 | —                     | —       | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金   |
| その他費用   | 0                     | 0.003   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                          |
| （監査費用）  | (0)                   | (0.003) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                        |
| （その他）   | (0)                   | (0.000) | 信託事務の処理等に関するその他の費用                                                 |
| 合 計     | 120                   | 0.923   |                                                                    |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年3月18日から2015年9月17日まで)

|                            | 設 定       |           | 解 約       |           |
|----------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
|                            | 口 数       | 金 額       | 口 数       | 金 額       |
|                            | 千口        | 千円        | 千口        | 千円        |
| ダイワ・ニッポン・<br>エクイティ・マザーファンド | 1,094,269 | 1,378,100 | 2,793,257 | 3,427,500 |

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2015年3月18日から2015年9月17日まで)

| 項 目               | 当 期                    |
|-------------------|------------------------|
|                   | ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 81,992,397千円           |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 48,284,457千円           |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 1.69                   |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2015年3月18日から2015年9月17日まで)

| 決 算 期   | 当 期           |                        |           |               |                        |           |
|---------|---------------|------------------------|-----------|---------------|------------------------|-----------|
|         | 買付額等          |                        |           | 売付額等          |                        |           |
| 区 分     | A             | うち利害<br>関係人との<br>取引状況B | B／A       | C             | うち利害<br>関係人との<br>取引状況D | D／C       |
| 株式      | 百万円<br>35,586 | 百万円<br>14,565          | %<br>40.9 | 百万円<br>46,405 | 百万円<br>20,115          | %<br>43.3 |
| 株式先物取引  | 1,227         | 735                    | 59.9      | 775           | —                      | —         |
| コール・ローン | 219,816       | —                      | —         | —             | —                      | —         |

(注) 平均保有割合17.6%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2015年3月18日から2015年9月17日まで)

| 種 類 | 当 期                    |
|-----|------------------------|
|     | ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド |
|     | 買 付 額                  |
| 株式  | 百万円<br>824             |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2015年3月18日から2015年9月17日まで)

| 項 目              | 当 期      |
|------------------|----------|
| 売買委託手数料総額 (A)    | 12,218千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 7,822千円  |
| (B)／(A)          | 64.0%    |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

| 種 類                    | 期 首       | 当 期 末               |
|------------------------|-----------|---------------------|
|                        | 口 数       | 口 数 評 価 額           |
|                        | 千口        | 千口 千円               |
| ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド | 8,030,822 | 6,331,834 7,538,048 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年9月17日現在

| 項 目                    | 当 期 末           |
|------------------------|-----------------|
|                        | 評 価 額 比 率       |
|                        | 千円 %            |
| ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド | 7,538,048 97.5  |
| コール・ローン等、その他           | 196,586 2.5     |
| 投資信託財産総額               | 7,734,635 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年9月17日現在

| 項 目                             | 当 期 末           |
|---------------------------------|-----------------|
| (A) 資産                          | 15,262,031,857円 |
| コール・ローン等                        | 94,699,140      |
| ダイワ・ニッポン・<br>エクイティ・マザーファンド(評価額) | 7,538,048,717   |
| 未収入金                            | 7,629,284,000   |
| (B) 負債                          | 7,628,793,447   |
| 未払金                             | 7,529,133,400   |
| 未払解約金                           | 29,756,403      |
| 未払信託報酬                          | 69,663,505      |
| その他未払費用                         | 240,139         |
| (C) 純資産総額(A－B)                  | 7,633,238,410   |
| 元本                              | 6,337,528,817   |
| 次期繰越損益金                         | 1,295,709,593   |
| (D) 受益権総口数                      | 6,337,528,817口  |
| 1万口当り基準価額(C／D)                  | 12,045円         |

\* 期首における元本額は7,308,470,750円、当期中における追加設定元本額は660,062,297円、同解約元本額は1,631,004,230円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,045円です。

■損益の状況

当期 自2015年3月18日 至2015年9月17日

| 項 目                  | 当 期            |
|----------------------|----------------|
| (A) 配当等収益            | 33,218円        |
| 受取利息                 | 33,218         |
| (B) 有価証券売買損益         | △ 157,213,898  |
| 売買益                  | 673,885,981    |
| 売買損                  | △ 831,099,879  |
| (C) 信託報酬等            | △ 69,914,444   |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | △ 227,095,124  |
| (E) 前期繰越損益金          | 1,090,645,415  |
| (F) 追加信託差損益金         | 432,159,302    |
| (配当等相当額)             | ( 132,017,409) |
| (売買損益相当額)            | ( 300,141,893) |
| (G) 合計(D + E + F)    | 1,295,709,593  |
| 次期繰越損益金(G)           | 1,295,709,593  |
| 追加信託差損益金             | 432,159,302    |
| (配当等相当額)             | ( 132,017,409) |
| (売買損益相当額)            | ( 300,141,893) |
| 分配準備積立金              | 1,092,366,933  |
| 繰越損益金                | △ 228,816,642  |

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。  
(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。  
(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表を参照。

■収益分配金の計算過程（総額）

| 項 目                        | 当 期            |
|----------------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益            | 1,721,518円     |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益        | 0              |
| (c) 収益調整金                  | 203,342,660    |
| (d) 分配準備積立金                | 1,090,645,415  |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 1,295,709,593  |
| (f) 分配金                    | 0              |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e－f)         | 1,295,709,593  |
| (h) 受益権総口数                 | 6,337,528,817口 |

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2015年3月17日の交付運用報告書および運用報告書（全体版）につきまして、「1万口当りの費用の明細」の表の「項目の概要」における次の記載にて下線部が不要でした。お詫び申し上げますとともに、下線部を除いてお読み替えくださいますようお願い申し上げます。

「期中の平均基準価額（月末値の平均値）」は11,944円です。」

# ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンド

## 運用報告書 第4期（決算日 2015年9月17日）

（計算期間 2015年3月18日～2015年9月17日）

ダイワ・ニッポン・エクイティ・マザーファンドの第4期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|             |                                                                                                |
|-------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運 用 方 針     | 信託財産の成長をめざして運用を行ないます。                                                                          |
| 主 要 投 資 対 象 | わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。以下同じ。）                                                               |
| 運 用 方 法     | ①主として、わが国の金融商品取引所上場株式に投資し、信託財産の成長をめざします。<br>②株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80％程度以上に維持することを基本とします。 |
| 株 式 組 入 制 限 | 無制限                                                                                            |

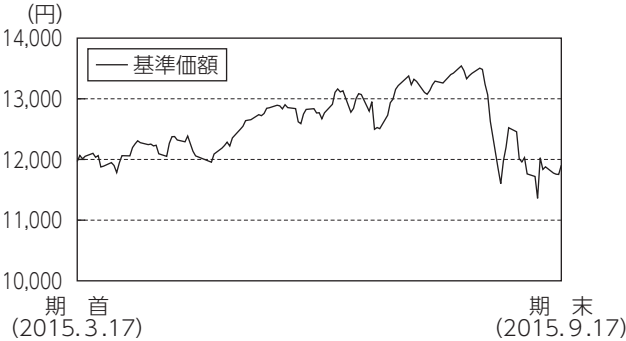
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日          | 基 準 価 額 |       | T O P I X |       | 株 組 入 率 | 株 先 比 | 式 物 率 |
|----------------|---------|-------|-----------|-------|---------|-------|-------|
|                | 円       | 騰 落 率 | (参考指数)    | 騰 落 率 |         |       |       |
| (期首)2015年3月17日 | 11,967  | %     | 1,570.50  | %     | 94.2    | 0.5   |       |
| 3月末            | 11,901  | △ 0.6 | 1,543.11  | △1.7  | 97.6    | 0.4   |       |
| 4月末            | 12,136  | 1.4   | 1,592.79  | 1.4   | 97.8    | 0.8   |       |
| 5月末            | 12,851  | 7.4   | 1,673.65  | 6.6   | 96.8    | —     |       |
| 6月末            | 12,842  | 7.3   | 1,630.40  | 3.8   | 96.0    | —     |       |
| 7月末            | 13,291  | 11.1  | 1,659.52  | 5.7   | 95.6    | —     |       |
| 8月末            | 12,456  | 4.1   | 1,537.05  | △2.1  | 93.7    | —     |       |
| (期末)2015年9月17日 | 11,905  | △ 0.5 | 1,491.91  | △5.0  | 93.9    | 1.7   |       |

(注1) 騰落率は期首比。  
(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：11,967円 期末：11,905円 騰落率：△0.5%

【基準価額の主な変動要因】

国内株式市況の下落を反映し、当ファンドのポートフォリオも下落したことから、基準価額は値下がりしました。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、ＥＣＢ（欧州中央銀行）による量的金融緩和の導入や国内景気の持ち直し、良好な株式需給関係、円安の進行などを受けて、株価は大きく上昇しました。2015年6月からは、ギリシャ支援協議の難航によりギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念が一時高まったことや、中国株の急落を受け中国経済への不安が高まったこと、さらには世界経済減速懸念も台頭したことから日本株も一時急落するなど、不安定な推移となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

株式組入比率については、基本的には現状の高位組入れを維持する方針です。ただし、リスクシナリオの顕在化などで株式市況が大きく変動する局面では、一時的に組入比率を引下げるなど機動的に対応していく方針です。引続き、内外企業と比較した競争力や業績動向、バリュエーションを主な基準にした銘柄選別姿勢をもって運用していきますが、株価変動や外部環境の変化などにより各業種の魅力度が大きく変化したときには、大胆かつ積極的に業種構成を変更していきたいと考えております。

◆ポートフォリオについて

当ファンドの運用方針に従い、株式組入比率はおおむね93～98%程度の高位を維持しました。

業種構成は、インバウンド需要の拡大により恩恵を受けている小売業や陸運業などの比率を上げました。一方、円安効果の一服や世界的な景気減速懸念を受けて市場の期待成長率が鈍化した機械や電気機器などの比率を下げました。

個別銘柄では、業績見通しや株価指標などを総合的に勘案して東日本旅客鉄道、西日本旅客鉄道、デクセリアルズ、日本航空、大林組などの組入比率の引上げ、または新規買付けをしました。一方、三井住友フィナンシャルＧ、村田製作所、オリエンタルランド、楽天、ソニーなどの組入比率の引下げ、または全部売却をしました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比では、参考指数（ＴＯＰＩＸ）の騰落率は△5.0%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△0.5%となりました。ＴＯＰＩＸの騰落率を上回った建設業、空運業、保険業などをオーバーウエートとしていたことなどがプラス要因となりました。個別銘柄では、ＫＤＤＩ、オリエンタルランド、リンクパルなどがマイナス要因となりましたが、福島工業、象印マホービン、森永製菓などがプラス要因となりました。

《今後の運用方針》

国内株式市況は、米国や中国などの経済や金融政策に不透明感があるものの、国内企業への業績回復期待、政府の成長戦略などが引続き株価の押し上げ要因になると考えており、株式組入比率は高位を維持する方針です。業種構成比については、特定の業種に偏ることなく幅広く分散させていく予定です。銘柄選別においては、活発なＩＰＯ（株式の新規公開）銘柄を含めて新しいビジネスモデルで高い成長が見込まれる銘柄や、中長期で業績拡大が続く銘柄などに積極的に投資していく方針です。

■ 1 万口当りの費用の明細

| 項 目     | 当 期  |
|---------|------|
| 売買委託手数料 | 17円  |
| (株式)    | (17) |
| (先物)    | ( 0) |
| 有価証券取引税 | －    |
| その他費用   | －    |
| 合 計     | 17   |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって  
受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。費用の項  
目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の項目の概  
要をご参照ください。  
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2015年3月18日から2015年9月17日まで)

|    | 買 付                  |                    | 売 付      |            |
|----|----------------------|--------------------|----------|------------|
|    | 株 数                  | 金 額                | 株 数      | 金 額        |
| 国内 | 千株                   | 千円                 | 千株       | 千円         |
|    | 21,026.1<br>( 339.4) | 35,586,838<br>( -) | 28,073.9 | 46,405,558 |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) ( )内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれており  
ません。  
(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2015年3月18日から2015年9月17日まで)

| 種 類 別 |        | 買 建   |       | 売 建   |       |
|-------|--------|-------|-------|-------|-------|
|       |        | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国 内   | 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   | 百万円   |
|       | 株式先物取引 | 1,227 | 775   | －     | －     |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄  
株 式

(2015年3月18日から2015年9月17日まで)

| 当           |   |       |           |        | 期         |   |     |           |        |
|-------------|---|-------|-----------|--------|-----------|---|-----|-----------|--------|
| 買           |   | 付     |           |        | 売         |   | 付   |           |        |
| 銘           | 柄 | 株 数   | 金 額       | 平均単価   | 銘         | 柄 | 株 数 | 金 額       | 平均単価   |
|             |   | 千株    | 千円        | 円      |           |   | 千株  | 千円        | 円      |
| 任天堂         |   | 77.3  | 1,675,253 | 21,672 | KDDI      |   | 579 | 1,533,509 | 2,648  |
| トヨタ自動車      |   | 205   | 1,511,250 | 7,371  | 村田製作所     |   | 78  | 1,441,136 | 18,476 |
| デクセリアルズ     |   | 746.5 | 1,220,895 | 1,635  | オリエンタルランド |   | 177 | 1,349,203 | 7,622  |
| 東日本旅客鉄道     |   | 92    | 1,060,238 | 11,524 | ソニー       |   | 300 | 1,008,790 | 3,362  |
| KDDI        |   | 324   | 986,300   | 3,044  | 楽天        |   | 480 | 963,734   | 2,007  |
| みずほフィナンシャルG |   | 3,500 | 935,504   | 267    | 第一生命      |   | 460 | 957,951   | 2,082  |
| 西日本旅客鉄道     |   | 120   | 903,311   | 7,527  | ファナック     |   | 35  | 894,130   | 25,546 |
| 第一生命        |   | 460   | 894,491   | 1,944  | 三菱商事      |   | 312 | 801,448   | 2,568  |
| 名村造船所       |   | 883   | 858,339   | 972    | 任天堂       |   | 38  | 768,470   | 20,222 |
| オリエンタルランド   |   | 107   | 814,948   | 7,616  | 三井物産      |   | 470 | 752,392   | 1,600  |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表  
(1) 国内株式

| 銘柄              | 期首株数 | 当期末株数 | 期末評価額     | 銘柄              | 期首株数  | 当期末株数 | 期末評価額   | 銘柄            | 期首株数  | 当期末株数 | 期末評価額     |
|-----------------|------|-------|-----------|-----------------|-------|-------|---------|---------------|-------|-------|-----------|
|                 | 千株   | 千株    | 千円        |                 | 千株    | 千株    | 千円      |               | 千株    | 千株    | 千円        |
| 建設業 (6.2%)      |      |       |           | 信越ポリマー          | 140   | —     | —       | フジテック         | 120   | —     | —         |
| 安藤・間            | 400  | —     | —         | ユニ・チャーム         | 80    | —     | —       | 福島工業          | 335   | 325   | 801,775   |
| 大林組             | 160  | 1,000 | 994,000   | 医薬品 (2.2%)      |       |       |         | J U K I       | 710   | —     | —         |
| 長谷工コーポレーション     | 420  | 915   | 1,221,525 | アステラス製薬         | 150   | —     | —       | 日本精工          | 100   | —     | —         |
| 不動テトラ           | 800  | —     | —         | 塩野義製薬           | 70    | 68    | 315,860 | 電気機器 (4.3%)   |       |       |           |
| 大未建設            | 65   | —     | —         | あすか製薬           | 140   | —     | —       | ミネベア          | 270   | —     | —         |
| 大豊建設            | 130  | —     | —         | 日本新薬            | 60    | —     | —       | 三菱電機          | 150   | —     | —         |
| 大和小田急建設         | 130  | —     | —         | 小野薬品            | —     | 38    | 576,460 | 富士電機          | 350   | —     | —         |
| 東鉄工業            | 30   | —     | —         | 沢井製薬            | 15    | —     | —       | 日本電産          | 30    | —     | —         |
| 若築建設            | 500  | —     | —         | ゴム製品 (0.5%)     |       |       |         | ダイヘン          | 450   | —     | —         |
| 大和ハウス           | 165  | 48    | 147,720   | ブリヂストン          | 70    | —     | —       | J V Cケンウッド    | 270   | —     | —         |
| ライト工業           | 190  | 120   | 140,760   | オカモト            | —     | 171   | 185,877 | 富士通           | 1,050 | —     | —         |
| 積水ハウス           | 160  | —     | —         | ガラス・土石製品 (1.1%) |       |       |         | ジャパンディスプレイ    | 350   | —     | —         |
| 食料品 (3.4%)      |      |       |           | 日本板硝子           | 1,050 | 1,000 | 110,000 | ソニー           | 255   | —     | —         |
| 森永製菓            | —    | 738   | 387,450   | 日本碍子            | 120   | 120   | 317,760 | T D K         | 50    | —     | —         |
| 明治ホールディングス      | 15   | —     | —         | 鉄鋼 (0.8%)       |       |       |         | アルプス電気        | 170   | 80    | 300,000   |
| 日本ハム            | —    | 160   | 403,040   | 日立金属            | 220   | 210   | 315,000 | 日本航空電子        | 41    | —     | —         |
| キッコーマン          | 55   | —     | —         | 日本金属            | 500   | —     | —       | 共和電業          | 40    | —     | —         |
| 味の素             | 40   | —     | —         | 非鉄金属 (1.0%)     |       |       |         | キーエンス         | 12.5  | 6.4   | 362,560   |
| 日本たばこ産業         | 55   | 135   | 563,085   | 古河機金            | 400   | 400   | 104,000 | シスメックス        | 70    | 75    | 496,500   |
| 繊維製品 (—)        |      |       |           | 住友電工            | 80    | 180   | 304,920 | オプテックス        | 150   | —     | —         |
| 東レ              | 370  | —     | —         | 金属製品 (0.5%)     |       |       |         | カシオ           | 220   | —     | —         |
| 化学 (8.1%)       |      |       |           | サンコーテクノ         | 169.3 | 169.3 | 196,388 | ファナック         | 30    | —     | —         |
| クラレ             | 140  | —     | —         | 三和ホールディングス      | 300   | —     | —       | 浜松ホトニクス       | 40    | —     | —         |
| 旭化成             | 300  | —     | —         | 機械 (4.0%)       |       |       |         | 村田製作所         | 66    | —     | —         |
| 住友化学            | —    | 747   | 485,550   | タクマ             | 280   | —     | —       | 象印マホービン       | 310   | 320   | 575,680   |
| 東ソー             | 530  | —     | —         | オークマ            | 100   | 150   | 132,150 | 輸送用機器 (13.4%) |       |       |           |
| 電気化学            | 500  | —     | —         | アイダエンジニア        | 230   | —     | —       | デンソー          | 30    | —     | —         |
| 信越化学            | 40   | —     | —         | 牧野フライス          | 250   | —     | —       | 名村造船所         | —     | 883   | 784,987   |
| ダイセル            | 300  | —     | —         | D M G森精機        | 100   | —     | —       | トヨタ自動車        | 285   | 490   | 3,595,620 |
| 積水化学            | 250  | —     | —         | ディスコ            | 25    | —     | —       | 日野自動車         | 150   | —     | —         |
| 花王              | 120  | 90    | 471,960   | 中村超硬            | —     | 133.3 | 296,192 | マツダ           | 110   | —     | —         |
| D I C           | 500  | —     | —         | S M C           | 10    | —     | —       | スズキ           | 30    | —     | —         |
| 富士フィルムH L D G S | 90   | 90    | 436,455   | 日精樹脂工業          | 140   | —     | —       | 富士重工          | 150   | 115   | 508,875   |
| コーセー            | —    | 41    | 436,650   | クボタ             | 200   | —     | —       | ヤマハ発動機        | 160   | 210   | 518,070   |
| ドクターシーラボ        | 40   | —     | —         | ダイワフク           | 260   | 130   | 223,990 | 精密機器 (2.0%)   |       |       |           |
| デクセリアルズ         | —    | 746.5 | 1,222,767 | 加藤製作所           | 240   | —     | —       | トプコン          | 180   | 57.1  | 96,213    |
| 日東電工            | 55   | 25    | 195,000   | タダノ             | 105   | 90    | 136,620 | オリンパス         | 110   | —     | —         |

| 銘柄             | 期首             | 当期      | 期末        | 銘柄                | 期首            | 当期       | 期末            | 銘柄                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 期首                              | 当期             | 期末             |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
|----------------|----------------|---------|-----------|-------------------|---------------|----------|---------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|----------------|----------------|------------------|------|--|-----|--|-------|-------|----------------|----|---|---|------------|--|--|--|----|-------|------------|----------|------|---|-------|---------|------------|-----|---|---|---------------|--|--|--|-------|------|---|---|--------|-----|-----|---------|--|--|--|--|---------------|-----|---|---|------------|--|--|--|--|--|--|--|--------|-----|---|---|-------------|----|---|---|--|--|--|--|--------|-----|-----|-----------|---------|----|---|---|--|--|--|--|------|----|---|---|-------|-----|---|---|--|--|--|--|--------|-----|---|---|----------|-----|---|---|--|--|--|--|--------|----|----|---------|-----------|-----|---|---|--|--|--|--|----------------|----|----|---------|-------------|--|--|--|--|--|--|--|------|----|---|---|-------------|---|----|---------|--|--|--|--|-----------|-----|-----|---------|---------|-----|---|---|--|--|--|--|-----|----|---|---|-------|-----|-----|---------|--|--|--|--|------------|----|---|---|------|-----|-----|---------|--|--|--|--|------------|--|--|--|------|-----|-----|---------|--|--|--|--|---------|----|---|---|-------|-----|---|---|--|--|--|--|
|                | 株数             | 株数      | 評価額       |                   | 株数            | 株数       | 評価額           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 株数                              | 株数             | 評価額            |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| HOYA           | 千株<br>100      | 千株<br>— | 千円<br>—   | クリヤマホールディングス      | 千株<br>143     | 千株<br>73 | 千円<br>108,478 | エヌ・ティ・ティ都市開発                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 千株<br>—                         | 千株<br>509      | 千円<br>569,571  |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 朝日インテック        | 80             | 160     | 714,400   | ハビネット             | 70            | —        | —             | サービス業 (9.4%)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| その他製品 (2.9%)   |                |         |           | 三井物産              | 370           | —        | —             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 日本M&Aセンター                       | 75             | 80             | 414,400          |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| ブロッコリー         | 260            | —       | —         | 三菱商事              | 272           | —        | —             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | テンプホールディングス                     | 40             | 70             | 348,250          |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| パンダイナムコHLDGS   | 70             | —       | —         | サンリオ              | 40            | —        | —             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 総合警備保障                          | —              | 80             | 422,400          |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| ビジョン           | 35             | 126     | 328,986   | 日鉄住金物産            | 200           | —        | —             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | カカココム                           | 75             | —              | —                |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| イトーキ           | 90             | —       | —         | ジェコス              | 95            | —        | —             | ディップ                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | —                               | 100            | 213,300        |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 任天堂            | —              | 39.3    | 836,893   | 小売業 (5.3%)        |               |          |               | エムスリー                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 130                             | 125            | 302,000        |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 電気・ガス業 (2.9%)  |                |         |           |                   | クスリのアオキ       | —        | 55            | 294,800                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | ディー・エヌ・エー                       | —              | 280            | 647,640          |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 中部電力           | —              | 150     | 267,450   |                   | ノジマ           | —        | 208.6         | 265,965                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | ケネディクス                          | 450            | —              | —                |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 関西電力           | —              | 523     | 699,774   | 良品計画              | —             | 13       | 306,670       | オリエンタルランド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 27                              | 44             | 284,108        |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 東京瓦斯           | 500            | 300     | 187,140   | 大塚家具              | —             | 233.3    | 365,581       | サイバーエージェント                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 80                              | —              | —              |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 陸運業 (5.8%)     |                |         |           | ラオックス             | —             | 650      | 263,900       | 楽天                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 420                             | —              | —              |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| SBSホールディングス    | 150            | —       | —         | ファーストリテイリング       | 11            | 13.5     | 639,967       | エン・ジャパン                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | —                               | 158.6          | 475,800        |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 東日本旅客鉄道        | —              | 92      | 959,100   | 銀行業 (8.8%)        |               |          |               | テクノプロ・ホールディング                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | —                               | 173            | 573,495        |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 西日本旅客鉄道        | —              | 120     | 922,800   |                   | 三菱UFJフィナンシャルG | 1,850    | 2,500         | 1,920,750                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | リンクバル                           | —              | 82.6           | 101,185          |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 阪急阪神HLDGS      | —              | 590     | 446,630   |                   | 三井住友トラストHD    | 650      | —             | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | カナモト                            | 40             | —              | —                |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 空運業 (2.1%)     |                |         |           | 三井住友フィナンシャルG      | 255           | 160      | 776,640       | 合 計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 株数、金額<br>銘柄数<比率>                | 千株<br>30,163.9 | 千株<br>23,455.5 | 千円<br>40,215,683 |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 日本航空           | —              | 194     | 849,720   | みずほフィナンシャルG       | —             | 3,500    | 832,300       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 | 151銘柄          | 81銘柄           | <93.9%>          |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 情報・通信業 (7.4%)  |                |         |           | 証券・商品先物取引業 (1.0%) |               |          |               | (注1) 銘柄欄の( )内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
|                | KLab           | —       | 123       | 163,467           | ジャフコ          | 50       | 50            | 257,000                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | (注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
|                | インターネットイニシアティブ | 100     | —         | —                 | 野村ホールディングス    | 600      | —             | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | (注3) 評価額の単位未満は切捨て。              |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| CAC HOLDINGS   | 50             | —       | —         | マネックスG            | 550           | —        | —             | (2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| オービックビジネスC     | —              | 39.5    | 233,445   | マネースクウェアHD        | 90            | 90       | 152,730       | <table><tr><th colspan="2" rowspan="2">銘柄 別</th><th colspan="2">当 期</th></tr><tr><th>買 建 額</th><th>売 建 額</th></tr><tr><td>伊藤忠テクノソリューションズ</td><td>30</td><td>—</td><td>—</td><td>保険業 (1.4%)</td><td></td><td></td><td></td><td>国内</td><td>TOPIX</td><td>百万円<br/>740</td><td>百万円<br/>—</td></tr><tr><td>大塚商会</td><td>—</td><td>115.5</td><td>675,675</td><td>損保ジャパン興亜HD</td><td>140</td><td>—</td><td>—</td><td colspan="4">(注) 単位未満は切捨て。</td></tr><tr><td>WOWOW</td><td>10.1</td><td>—</td><td>—</td><td>東京海上HD</td><td>110</td><td>120</td><td>550,860</td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>エイベックス・グループHD</td><td>150</td><td>—</td><td>—</td><td>その他金融業 (—)</td><td></td><td></td><td></td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>日本BS放送</td><td>180</td><td>—</td><td>—</td><td>東京センチュリーリース</td><td>65</td><td>—</td><td>—</td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>日本電信電話</td><td>100</td><td>260</td><td>1,141,530</td><td>日立キャピタル</td><td>57</td><td>—</td><td>—</td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>KDDI</td><td>85</td><td>—</td><td>—</td><td>オリックス</td><td>340</td><td>—</td><td>—</td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>NTTドコモ</td><td>310</td><td>—</td><td>—</td><td>三菱UFJリース</td><td>250</td><td>—</td><td>—</td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>NTTデータ</td><td>55</td><td>75</td><td>455,250</td><td>日本取引所グループ</td><td>100</td><td>—</td><td>—</td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>スクウェア・エニックス・HD</td><td>45</td><td>50</td><td>151,750</td><td>不動産業 (5.3%)</td><td></td><td></td><td></td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>SCSK</td><td>50</td><td>—</td><td>—</td><td>ユニゾホールディングス</td><td>—</td><td>44</td><td>213,620</td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>日本システムウエア</td><td>175</td><td>175</td><td>164,850</td><td>東急不動産HD</td><td>220</td><td>—</td><td>—</td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>コナミ</td><td>70</td><td>—</td><td>—</td><td>三井不動産</td><td>140</td><td>140</td><td>454,720</td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>ソフトバンクグループ</td><td>45</td><td>—</td><td>—</td><td>三菱地所</td><td>180</td><td>180</td><td>446,130</td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>卸売業 (0.3%)</td><td></td><td></td><td></td><td>東京建物</td><td>200</td><td>314</td><td>453,102</td><td colspan="4"></td></tr><tr><td>アルコニックス</td><td>40</td><td>—</td><td>—</td><td>住友不動産</td><td>100</td><td>—</td><td>—</td><td colspan="4"></td></tr></table> |                                 |                |                |                  | 銘柄 別 |  | 当 期 |  | 買 建 額 | 売 建 額 | 伊藤忠テクノソリューションズ | 30 | — | — | 保険業 (1.4%) |  |  |  | 国内 | TOPIX | 百万円<br>740 | 百万円<br>— | 大塚商会 | — | 115.5 | 675,675 | 損保ジャパン興亜HD | 140 | — | — | (注) 単位未満は切捨て。 |  |  |  | WOWOW | 10.1 | — | — | 東京海上HD | 110 | 120 | 550,860 |  |  |  |  | エイベックス・グループHD | 150 | — | — | その他金融業 (—) |  |  |  |  |  |  |  | 日本BS放送 | 180 | — | — | 東京センチュリーリース | 65 | — | — |  |  |  |  | 日本電信電話 | 100 | 260 | 1,141,530 | 日立キャピタル | 57 | — | — |  |  |  |  | KDDI | 85 | — | — | オリックス | 340 | — | — |  |  |  |  | NTTドコモ | 310 | — | — | 三菱UFJリース | 250 | — | — |  |  |  |  | NTTデータ | 55 | 75 | 455,250 | 日本取引所グループ | 100 | — | — |  |  |  |  | スクウェア・エニックス・HD | 45 | 50 | 151,750 | 不動産業 (5.3%) |  |  |  |  |  |  |  | SCSK | 50 | — | — | ユニゾホールディングス | — | 44 | 213,620 |  |  |  |  | 日本システムウエア | 175 | 175 | 164,850 | 東急不動産HD | 220 | — | — |  |  |  |  | コナミ | 70 | — | — | 三井不動産 | 140 | 140 | 454,720 |  |  |  |  | ソフトバンクグループ | 45 | — | — | 三菱地所 | 180 | 180 | 446,130 |  |  |  |  | 卸売業 (0.3%) |  |  |  | 東京建物 | 200 | 314 | 453,102 |  |  |  |  | アルコニックス | 40 | — | — | 住友不動産 | 100 | — | — |  |  |  |  |
| 銘柄 別           |                | 当 期     |           |                   |               |          |               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
|                |                | 買 建 額   | 売 建 額     |                   |               |          |               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 30             | —       | —         | 保険業 (1.4%)        |               |          |               | 国内                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | TOPIX                           | 百万円<br>740     | 百万円<br>—       |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 大塚商会           | —              | 115.5   | 675,675   | 損保ジャパン興亜HD        | 140           | —        | —             | (注) 単位未満は切捨て。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| WOWOW          | 10.1           | —       | —         | 東京海上HD            | 110           | 120      | 550,860       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| エイベックス・グループHD  | 150            | —       | —         | その他金融業 (—)        |               |          |               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 日本BS放送         | 180            | —       | —         | 東京センチュリーリース       | 65            | —        | —             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 日本電信電話         | 100            | 260     | 1,141,530 | 日立キャピタル           | 57            | —        | —             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| KDDI           | 85             | —       | —         | オリックス             | 340           | —        | —             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| NTTドコモ         | 310            | —       | —         | 三菱UFJリース          | 250           | —        | —             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| NTTデータ         | 55             | 75      | 455,250   | 日本取引所グループ         | 100           | —        | —             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| スクウェア・エニックス・HD | 45             | 50      | 151,750   | 不動産業 (5.3%)       |               |          |               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| SCSK           | 50             | —       | —         | ユニゾホールディングス       | —             | 44       | 213,620       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 日本システムウエア      | 175            | 175     | 164,850   | 東急不動産HD           | 220           | —        | —             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| コナミ            | 70             | —       | —         | 三井不動産             | 140           | 140      | 454,720       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| ソフトバンクグループ     | 45             | —       | —         | 三菱地所              | 180           | 180      | 446,130       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| 卸売業 (0.3%)     |                |         |           | 東京建物              | 200           | 314      | 453,102       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |
| アルコニックス        | 40             | —       | —         | 住友不動産             | 100           | —        | —             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                 |                |                |                  |      |  |     |  |       |       |                |    |   |   |            |  |  |  |    |       |            |          |      |   |       |         |            |     |   |   |               |  |  |  |       |      |   |   |        |     |     |         |  |  |  |  |               |     |   |   |            |  |  |  |  |  |  |  |        |     |   |   |             |    |   |   |  |  |  |  |        |     |     |           |         |    |   |   |  |  |  |  |      |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |        |     |   |   |          |     |   |   |  |  |  |  |        |    |    |         |           |     |   |   |  |  |  |  |                |    |    |         |             |  |  |  |  |  |  |  |      |    |   |   |             |   |    |         |  |  |  |  |           |     |     |         |         |     |   |   |  |  |  |  |     |    |   |   |       |     |     |         |  |  |  |  |            |    |   |   |      |     |     |         |  |  |  |  |            |  |  |  |      |     |     |         |  |  |  |  |         |    |   |   |       |     |   |   |  |  |  |  |

■投資信託財産の構成

2015年9月17日現在

| 項 目          | 当 期 末      |       |
|--------------|------------|-------|
|              | 評 価 額      | 比 率   |
|              | 千円         | %     |
| 株式           | 40,215,683 | 89.4  |
| コール・ローン等、その他 | 4,758,887  | 10.6  |
| 投資信託財産総額     | 44,974,570 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年9月17日現在

| 項 目            | 当 期 末           |
|----------------|-----------------|
| (A) 資産         | 44,974,570,836円 |
| コール・ローン等       | 2,882,120,894   |
| 株式(評価額)        | 40,215,683,200  |
| 未収入金           | 1,802,157,442   |
| 未収配当金          | 26,959,300      |
| 差入委託証拠金        | 47,650,000      |
| (B) 負債         | 2,160,351,338   |
| 未払金            | 1,910,351,338   |
| 未払解約金          | 250,000,000     |
| (C) 純資産総額(A－B) | 42,814,219,498  |
| 元本             | 35,964,444,463  |
| 次期繰越損益金        | 6,849,775,035   |
| (D) 受益権総口数     | 35,964,444,463口 |
| 1万口当り基準価額(C／D) | 11,905円         |

\* 期首における元本額は45,565,829,869円、当中における追加設定元本額は1,236,144,297円、同解約元本額は10,837,529,703円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ・トップ・オブ・ジャパン29,632,610,177円、通貨選択型ダイワ・トップ・オブ・ジャパン (米ドル投資型) 6,331,834,286円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,905円です。

■損益の状況

当期 自2015年3月18日 至2015年9月17日

| 項 目                   | 当 期            |
|-----------------------|----------------|
| (A) 配当等収益             | 436,203,825円   |
| 受取配当金                 | 435,731,920    |
| 受取利息                  | 470,193        |
| その他収益金                | 1,712          |
| (B) 有価証券売買損益          | △ 322,936,543  |
| 売買益                   | 3,571,992,355  |
| 売買損                   | △3,894,928,898 |
| (C) 先物取引等損益           | △ 2,741,237    |
| 取引益                   | 6,266,422      |
| 取引損                   | △ 9,007,659    |
| (D) 当期損益金(A + B + C)  | 110,526,045    |
| (E) 前期繰越損益金           | 8,962,763,584  |
| (F) 解約差損益金            | △2,536,970,297 |
| (G) 追加信託差損益金          | 313,455,703    |
| (H) 合計(D + E + F + G) | 6,849,775,035  |
| 次期繰越損益金(H)            | 6,849,775,035  |

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。