【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年5月10日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 安倍　秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目７番１号
【事務連絡者氏名】	新屋敷　昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスファンドＴＳＰ
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

インデックスファンドＴＳＰ（以下「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
※ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社債、株式等の振替に関する法律第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情などがある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。

・販売会社における申込手数料率は2.16%＊（税抜２％）が上限となっております。
＊消費税率が10%になった場合は、2.2%となります。

（６）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2019年5月11日から2020年5月12日までとします。
・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（９）【払込期日】

- **取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。**
- **申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。**

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①　ファンドの目的

わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

②　ファンドの基本的性格

１）商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国　内	株　式	インデックス型
	海　外	債　券	
追加型投信	内　外	不動産投信	特殊型
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

◇追加型投信

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

◇国内

目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

◇株式

目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

◇インデックス型

目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

２）属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

◇その他資産（投資信託証券（株式　一般））

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式に投資を行ないます。よって、商品分類の「投資対象資産（収益の源泉）」においては、「株式」に分類されます。

◇年１回

目論見書または投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。

◇日本

目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

◇ファミリーファンド

目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。
上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（http://www.toushin.or.jp/）をご参照ください。

③　ファンドの特色

1 TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

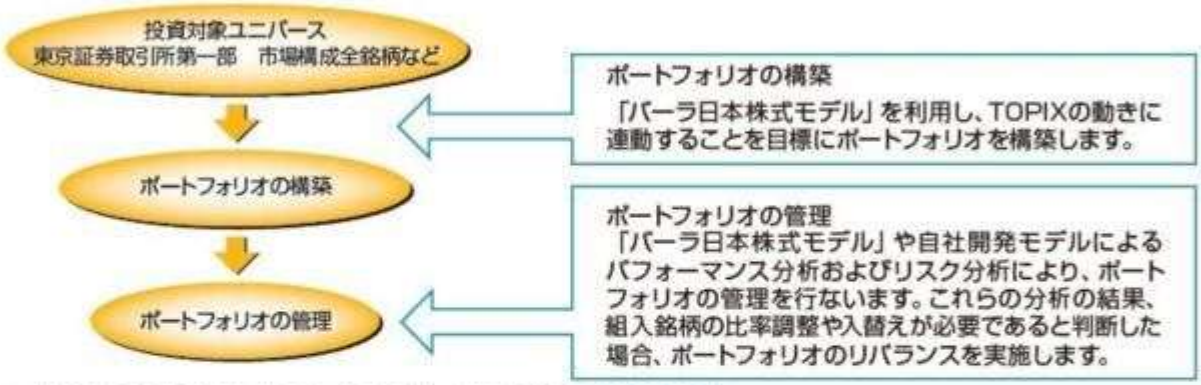
・主として、「インデックス マザーファンド TOPIX」への投資を通じて、東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資を行ない、日本株式市場全体の動きをとらえ、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
・中長期にわたって保有することで、日本経済の成長を享受することが期待できます。

TOPIX（東証株価指数）とは
・東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。
・TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

2 株式の実質組入比率は高位を保ちます。

株式組入比率（マザーファンドにおいて保有する株式を含みます。）は、原則として高位を維持します。したがって、基準価額は大きく変動することがあります。

<「インデックス マザーファンド TOPIX」の運用プロセス>



※上記は、2019年2月末現在のプロセスであり、将来変更となる場合があります。

なお、当ファンドの基準価額とTOPIX（東証株価指数）の動きのカイ離は、主として株式の配当金、信託報酬の費用負担、組入銘柄の選定に伴なう影響などにより生じます。

バーラ日本株式モデル

日本株式への投資から期待される収益（必然的にリスクを伴ないます。）の発生源を、①市場全体の動き、②財務・株式関連データから開発された個別銘柄の株価変動指標、③業種指標、④ポートフォリオ（または個別銘柄）固有の特性などからもたらされる部分に分解・分析し、数値化します。これらのデータをもとに、常に市場全体の株価変動の性格分析を行なうと同時に、検証を重ねつつ最適のポートフォリオを求めます。

ファンドの仕組み

当ファンドは、主にマザーファンドに投資するファミリーファンド方式で運用を行ないます。

（主な投資制限）・株式への実質投資割合には制限を設けません。
・外貨建資産への投資は行ないません。

（分配方針）毎決算時に、利子・配当等収益を中心に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

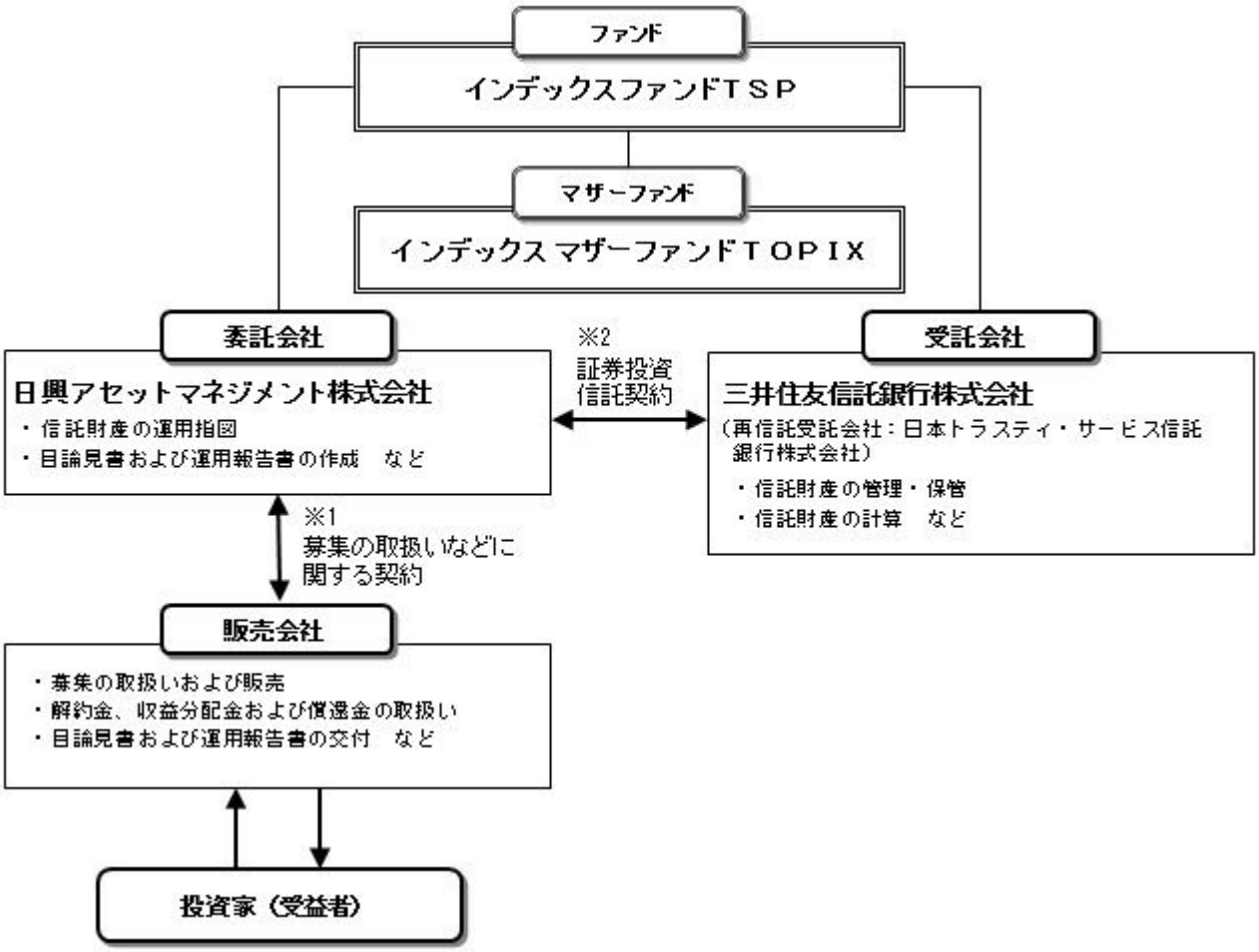
④　信託金限度額
・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（２）【ファンドの沿革】

1986年２月13日
・ファンドの信託契約締結、運用開始
2001年10月26日
・ファミリーファンド方式の導入
2002年11月13日
・信託期間を無期限に変更

（３）【ファンドの仕組み】

①　ファンドの仕組み



※1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。

※2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

②　委託会社の概況（2019年2月末現在）

１）資本金

17,363百万円

２）沿革

1959年：日興證券投資信託委託株式会社として設立

1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

３）大株主の状況

名　　称	住　　所	所有株数	所有比率
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番１号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

２【投資方針】

（１）【投資方針】

・「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券に投資を行なうとともに、わが国の金融商品取

引所上場株式に投資を行ない、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動した投資成果をめざします。

・投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、株式（マザーファンドにおいて保有する株式を含みます。）への投資にあたっては、「バーラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行ないます。

①東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行ないます。

②資金の流出入に伴なう売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。

③株式の組入比率は、高位を保ちます。

・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。

・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

＜インデックスファンドＴＳＰ＞

「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券ならびに東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１）有価証券

２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第20条の2および第20条の6に定めるものに限ります。）

３）金銭債権

４）約束手形

５）為替手形

② 主として「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

１）株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券

２）短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー

３）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、２）の証券の性質を有するもの

４）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）

５）投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの

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

７）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

１）預金

２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

３）コール・ローン

４）手形割引市場において売買される手形

５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

④ 次の取引ができます。

１）信用取引

２）先物取引等
３）スワップ取引
４）有価証券の貸付
５）資金の借入

＜インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ＞

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第18条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

② 主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
２）短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
３）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、２）の証券の性質を有するもの
４）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
５）投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
６）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
７）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

④ 次の取引ができます。
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）有価証券の貸付

◆投資対象とするマザーファンドの概要

＜インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ＞

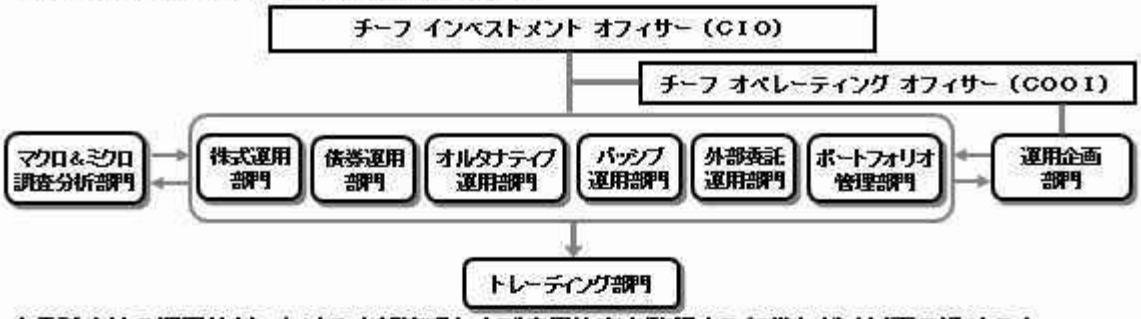
運用の基本方針		
	基本方針	わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）*の動きに連動する投資成果をめざします。
	主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

	投資方針	・投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、「バーラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行ないます。 ①東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行ないます。 ②資金の流出入に伴なう売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。 ③株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
	決算日	毎年２月12日（休業日の場合は翌営業日）

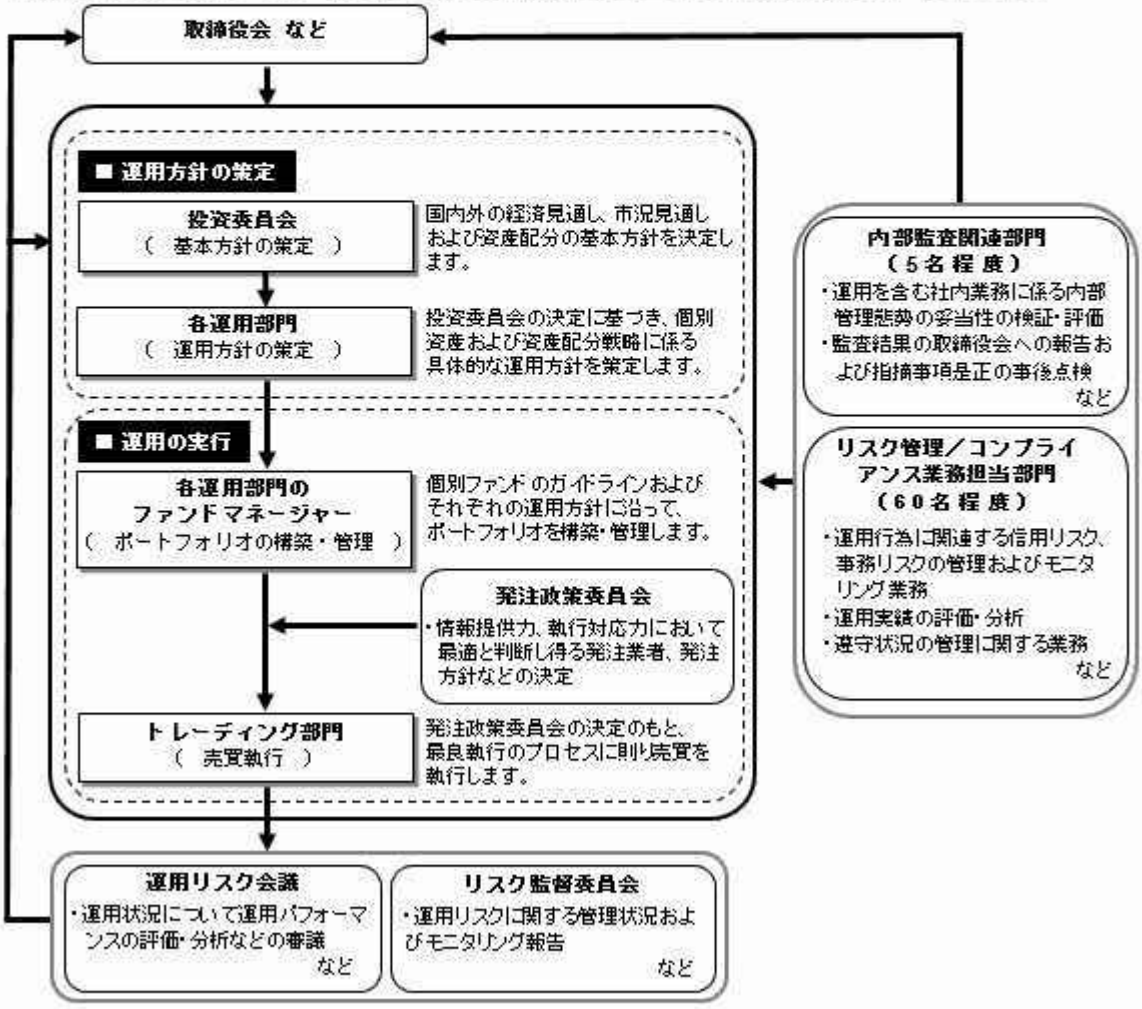
＊ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。
ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



◆委託会社の運用体制における内部管理および意思決定を監督する組織などは以下の通りです。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行なっており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

※上記体制は2019年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

① 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

１）分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。

２）分配対象額についての分配方針

利子・配当等収益を中心に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。

３）留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

② 収益分配金の支払い

＜分配金再投資コース＞

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

＜分配金受取りコース＞

毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限

＜インデックスファンドＴＳＰ＞

１）株式への実質投資割合には制限を設けません。

２）投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

３）投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

４）外貨建資産への投資は行ないません。

５）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ）株式分割により取得する株券

ハ）有償増資により取得する株券

ニ）売り出しにより取得する株券

ホ）信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

ヘ）信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使ならびに信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

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

７）信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が１年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第17条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第17条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の５％を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の５％を上回らない範囲内とします。

８）信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利また

は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

９）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50％を超えないものとします。

10）信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴なう支払資金の手当て（解約に伴なう支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。

イ）解約に伴なう支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内

ロ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内

ハ）借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10％以内

ニ）解約に伴なう支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とします。

ホ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

11）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

12）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

＜インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ＞

１）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

２）投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

３）投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

４）外貨建資産への投資は行ないません。

５）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ）株式分割により取得する株券

ハ）有償増資により取得する株券

ニ）売り出しにより取得する株券

６）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるもの

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

７）信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が１年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第13条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第13条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の５％を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の５％を上回らない範囲内とします。

８）信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

９）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50％を超えないものとします。

10）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

11）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

②　法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

３【投資リスク】

（１）ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴ないます。お申込みの際は、当ファンドのリスクを充分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

・当ファンドは、主に株式を実質的な投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①　価格変動リスク

一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

② 流動性リスク

市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

③ 信用リスク

・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

＜ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）と基準価額の主なカイ離要因＞

当ファンドは、基準価額の変動率をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の変動率に一致させることをめざしますが、次のような要因があるため、同指数と一致した推移をすることをお約束できるものではありません。

・ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。

・組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。

・先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きとＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

＜その他の留意事項＞

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴なう資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

・解約によるファンドの資金流出に伴なう基準価額変動に関する事項

一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

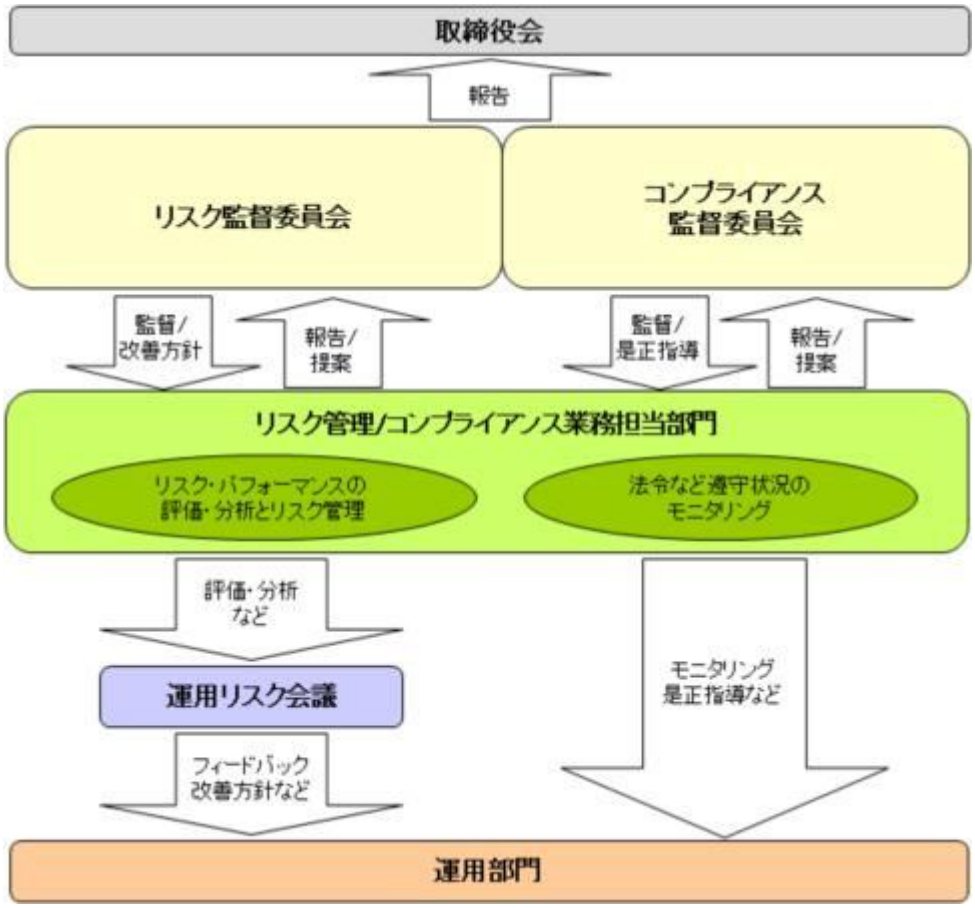
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。

・運用制限や規制上の制限に関する事項

関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性やインデックスと基準価額がカイ離する可能性があります。

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

（２）リスク管理体制



■全社的リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理／コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

■運用状況の評価・分析および運用リスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスクの管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスクの管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

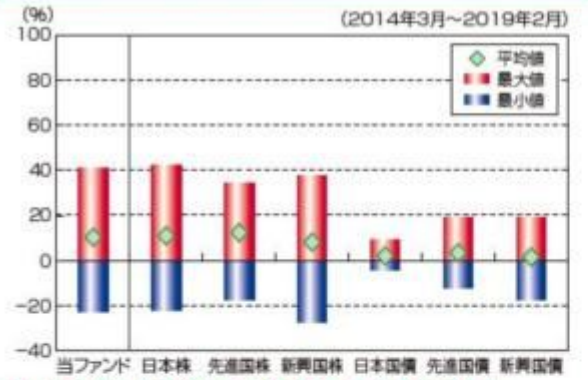
■法令など遵守状況のモニタリング

運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

※上記体制は2019年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



（当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率（%））

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	10.2%	10.9%	12.3%	8.1%	2.0%	3.4%	1.5%
最大値	41.1%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	19.3%	19.3%
最小値	-22.4%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
※上記は2014年3月から2019年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大･最小･平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>
日本株……東証株価指数（TOPIX、配当込）
先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）
新興国株……MSCIエマージング･マーケット･インデックス（配当込、円ベース）
日本国債……NOMURA-BPI国債
先進国債……FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル･ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）
※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2014年3月末の基準価額を起点として指数化しています。
※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数（TOPIX、配当込）
当指数は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）
当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc．に帰属します。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）
当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc．に帰属します。

NOMURA-BPI国債
当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）
当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。

・販売会社における申込手数料率は2.16%＊（税抜２％）が上限となっております。
　＊消費税率が10%になった場合は、2.2%となります。
・申込手数料の額（１口当たり）は、取得申込受付日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
※申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

（２）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.5616%＊（税抜0.52%）以内の率を乗じて得た額とします。
＊消費税率が10%になった場合は、0.572%となります。

② 信託報酬の配分
信託報酬（有価証券届出書提出日現在）の配分（年率）は、以下の通りとします。

販売会社毎の純資産総額	信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率			
	合　計	委託会社	販売会社	受託会社
1,000億円以下の部分	0.52%	0.22%	0.20%	0.10%
1,000億円超の部分		0.17%	0.25%	

委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

③　支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。

①　組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
②　信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。
③　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、解約に伴なう支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

＜投資対象とするマザーファンドに係る費用＞
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
・信託事務の処理に要する諸費用
・信託財産に関する租税　など

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。
＊監査費用、売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

①　個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）のいずれかを選択することもできます。

２）解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）＊については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

＊解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益

※確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が５年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、20歳未満

の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が５年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

② 法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

１）各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。

２）受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、１口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

１）収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

２）受益者が収益分配金を受け取る際

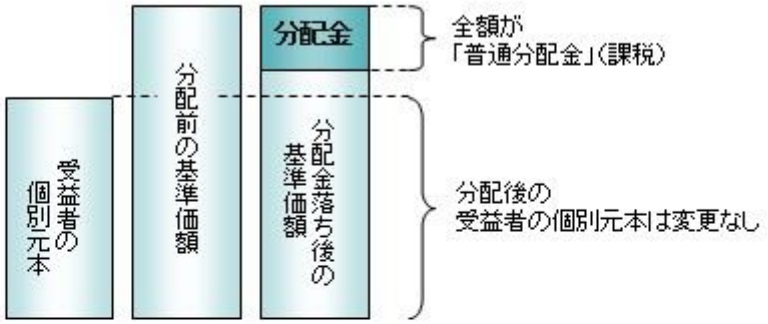
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

ロ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

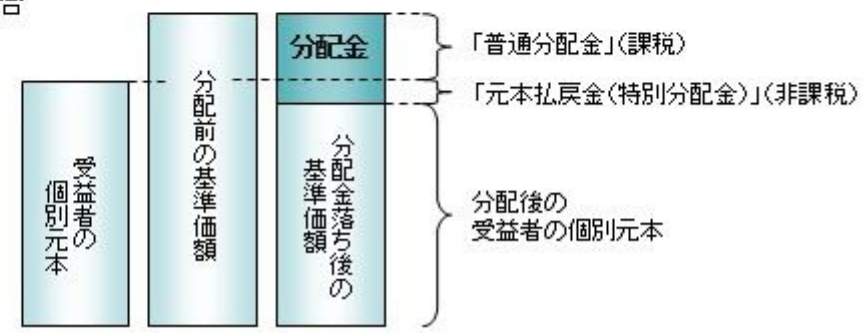
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



※上記は2019年5月10日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

【インデックスファンドＴＳＰ】

以下の運用状況は2019年 2月28日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	21,925,833,339	97.95
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	459,542,106	2.05
合計（純資産総額）		22,385,375,445	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	465,740,000	2.08

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	11,083,169,054	1.9346	21,441,498,852	1.9783	21,925,833,339	97.95

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.95
合　　計	97.95

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物　２０１９年０３月	買建	29	日本円	461,260,940	465,740,000	2.08

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第24計算期間末　(2010年 2月12日)	22,199	22,491	0.4558	0.4618
第25計算期間末　(2011年 2月14日)	24,740	25,043	0.4909	0.4969
第26計算期間末　(2012年 2月13日)	20,778	21,089	0.4011	0.4071
第27計算期間末　(2013年 2月12日)	25,203	25,608	0.4980	0.5060
第28計算期間末　(2014年 2月12日)	26,006	26,338	0.6275	0.6355
第29計算期間末　(2015年 2月12日)	27,404	27,771	0.7464	0.7564
第30計算期間末　(2016年 2月12日)	20,550	20,885	0.6143	0.6243
第31計算期間末　(2017年 2月13日)	24,644	24,951	0.8013	0.8113
第32計算期間末　(2018年 2月13日)	23,554	23,873	0.8864	0.8984
第33計算期間末　(2019年 2月12日)	21,725	22,046	0.8132	0.8252
2018年 2月末日	24,533	—	0.9131	—
3月末日	24,098	—	0.8941	—
4月末日	24,909	—	0.9256	—
5月末日	24,366	—	0.9100	—
6月末日	24,136	—	0.9021	—
7月末日	24,444	—	0.9133	—
8月末日	24,253	—	0.9038	—
9月末日	25,463	—	0.9537	—
10月末日	22,983	—	0.8634	—
11月末日	23,298	—	0.8744	—
12月末日	20,932	—	0.7845	—
2019年 1月末日	21,979	—	0.8227	—
2月末日	22,385	—	0.8314	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第24期	2009年 2月13日～2010年 2月12日	0.0060
第25期	2010年 2月13日～2011年 2月14日	0.0060
第26期	2011年 2月15日～2012年 2月13日	0.0060
第27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	0.0080
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	0.0080
第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	0.0100

第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	0.0100
第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	0.0100
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	0.0120
第33期	2018年 2月14日～2019年 2月12日	0.0120

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第24期	2009年 2月13日～2010年 2月12日	18.99
第25期	2010年 2月13日～2011年 2月14日	9.02
第26期	2011年 2月15日～2012年 2月13日	△17.07
第27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	26.15
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	27.61
第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	20.54
第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	△16.36
第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	32.07
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	12.12
第33期	2018年 2月14日～2019年 2月12日	△6.90

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第24期	2009年 2月13日～2010年 2月12日	10,539,361,357	7,372,791,814
第25期	2010年 2月13日～2011年 2月14日	8,326,706,473	6,627,979,535
第26期	2011年 2月15日～2012年 2月13日	8,796,604,597	7,398,051,340
第27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	9,449,720,873	10,636,174,809
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	13,799,258,867	22,968,753,955
第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	6,408,687,971	11,137,684,985
第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	6,211,940,096	9,472,751,226
第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	3,331,269,772	6,027,353,049
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	6,031,038,498	10,213,544,441
第33期	2018年 2月14日～2019年 2月12日	3,915,213,807	3,773,318,387

（参考）

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

以下の運用状況は2019年 2月28日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	39,386,278,060	99.60
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	157,864,763	0.40
合計（純資産総額）		39,544,142,823	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	160,600,000	0.41

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	190,200	6,605.00	1,256,271,000	6,697.00	1,273,769,400	3.22
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	70,000	10,260.00	718,200,000	10,280.00	719,600,000	1.82
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,158,800	580.90	673,146,920	576.70	668,279,960	1.69
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	149,400	4,390.88	655,997,500	4,469.00	667,668,600	1.69
日本	株式	ソニー	電気機器	114,500	4,854.00	555,783,000	5,341.00	611,544,500	1.55
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	114,600	4,600.00	527,160,000	4,801.00	550,194,600	1.39
日本	株式	キーエンス	電気機器	8,400	61,940.00	520,296,000	64,930.00	545,412,000	1.38
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	118,600	3,931.00	466,216,600	3,942.00	467,521,200	1.18
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	144,000	2,950.00	424,800,000	3,153.00	454,032,000	1.15
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,287,500	173.40	396,652,500	175.20	400,770,000	1.01
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	147,700	2,671.00	394,506,700	2,688.50	397,091,450	1.00
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	15,300	23,995.00	367,123,500	24,975.00	382,117,500	0.97
日本	株式	三菱商事	卸売業	118,000	3,120.00	368,160,000	3,139.00	370,402,000	0.94
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	116,800	2,959.00	345,611,200	3,114.00	363,715,200	0.92
日本	株式	花王	化学	41,400	8,038.00	332,773,200	8,424.00	348,753,600	0.88
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	70,400	4,843.00	340,947,200	4,894.00	344,537,600	0.87
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	61,000	5,349.00	326,289,000	5,426.00	330,986,000	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	30,300	10,165.00	307,999,500	10,660.00	322,998,000	0.82

日本	株式	任天堂	その他製品	10,500	29,235.00	306,967,500	30,440.00	319,620,000	0.81
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	120,400	2,563.00	308,585,200	2,591.50	312,016,600	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	17,900	17,730.00	317,367,000	17,325.00	310,117,500	0.78
日本	株式	ファナック	電気機器	16,200	18,835.00	305,127,000	18,440.00	298,728,000	0.76
日本	株式	キヤノン	電気機器	91,900	3,170.00	291,323,000	3,201.00	294,171,900	0.74
日本	株式	ダイキン工業	機械	23,300	11,810.00	275,173,000	12,090.00	281,697,000	0.71
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	98,900	2,752.50	272,222,250	2,833.00	280,183,700	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	20,500	13,305.00	272,752,500	13,475.00	276,237,500	0.70
日本	株式	信越化学工業	化学	29,500	9,262.00	273,229,000	9,271.00	273,494,500	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	157,400	1,672.00	263,172,800	1,718.50	270,491,900	0.68
日本	株式	日立製作所	電気機器	76,900	3,424.00	263,305,600	3,335.00	256,461,500	0.65
日本	株式	資生堂	化学	33,900	6,912.00	234,316,800	7,348.00	249,097,200	0.63

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.12
		鉱業	0.29
		建設業	2.96
		食料品	4.24
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.29
		化学	7.26
		医薬品	5.94
		石油・石炭製品	0.63
		ゴム製品	0.80
		ガラス・土石製品	0.91
		鉄鋼	0.98
		非鉄金属	0.79
		金属製品	0.58
		機械	4.80
		電気機器	12.80
		輸送用機器	8.08
		精密機器	1.98
		その他製品	1.98
		電気・ガス業	1.96
		陸運業	4.82
		海運業	0.16
		空運業	0.61
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	8.35
		卸売業	4.95
		小売業	4.84

		銀行業	6.22
		証券、商品先物取引業	0.83
		保険業	2.23
		その他金融業	1.14
		不動産業	2.37
		サービス業	4.86
合　　計			99.60

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物　２０１９年０３月	買建	10	日本円	161,655,400	160,600,000	0.41

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

≪参考情報≫

運用実績

2019年2月28日現在

基準価額･純資産の推移

基準価額……8,314円
純資産総額……223.85億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2009年2月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものとして計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2015年2月	2016年2月	2017年2月	2018年2月	2019年2月	設定来累計
100円	100円	100円	120円	120円	4,420円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	100.0%
うち先物	2.5%
CB	0.0%
公社債	0.0%
現金その他	2.4%
外貨建資産	0.0%

※当ファンドの実質組入比率です。

<株式組入上位5業種>

	業種	比率
1	電気機器	12.9%
2	情報･通信業	8.4%
3	輸送用機器	8.1%
4	化学	7.3%
5	銀行業	6.2%

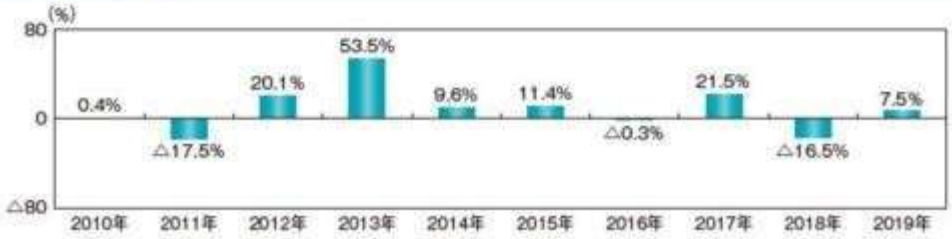
※マザーファンドの対組入株式時価総額比です。

<株式組入上位10銘柄>（銘柄数:2,091銘柄）

	銘　柄	業　種	比　率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.22%
2	ソフトバンクグループ	情報･通信業	1.82%
3	三菱UFJフィナンシャル･グループ	銀行業	1.69%
4	武田薬品工業	医薬品	1.69%
5	ソニー	電気機器	1.55%
6	日本電信電話	情報･通信業	1.39%
7	キーエンス	電気機器	1.38%
8	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.18%
9	本田技研工業	輸送用機器	1.15%
10	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.01%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※2019年は、2019年2月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

（２）コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の２通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

（３）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（４）取扱時間

原則として、午後３時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

（５）申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

（６）申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（７）申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

（８）受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所※における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

※金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

（９）償還乗換

・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

（10）乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の１年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができる場合があります。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

２【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

（１）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（２）取扱時間

原則として、午後３時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

（３）解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（４）解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（５）手取額
１口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。
※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（６）解約単位
１口単位
※販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（７）解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して４営業日目からお支払いします。

（８）受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

＜買取請求による換金＞

（１）買取りの受付
販売会社の営業日に受け付けます。

（２）取扱時間
原則として、午後３時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

（３）買取制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の買取りには受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（４）買取価額
買取請求受付日の基準価額から、当該買取りを行なう販売会社に係る源泉徴収税額に相当する金額を控除した価額となります。なお、一定の要件の下では、買取請求受付日の基準価額となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（５）手取額
１口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

（６）買取単位
１口単位
※販売会社によっては、買取単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（７）受付の中止および取消
・販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて買取りを中止すること、および既に受け付けた買取りを取り消すことができます。
・買取請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算

日に買取請求を受け付けたものとして取り扱います。

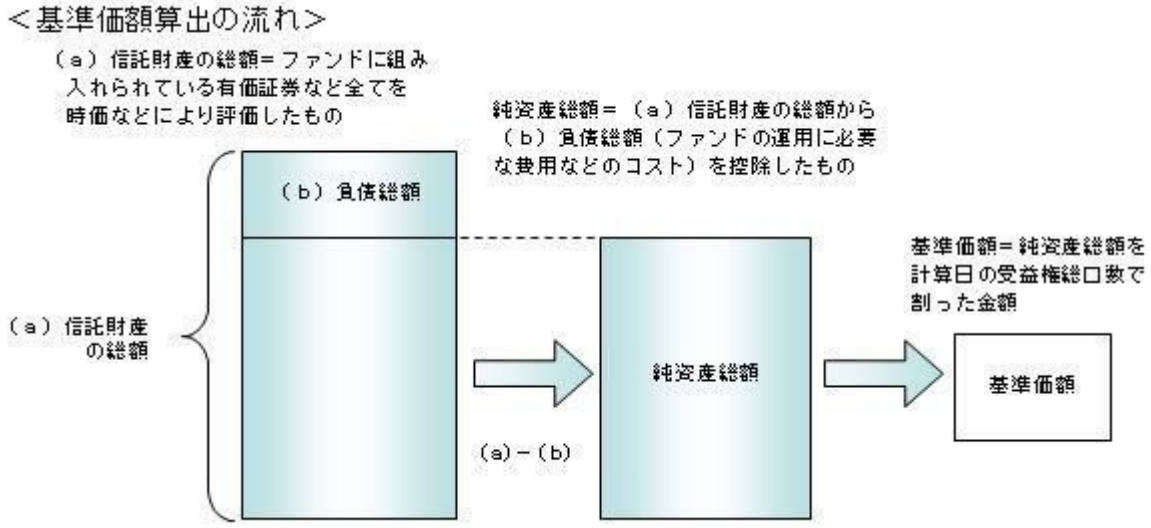
3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

① 基準価額の算出

・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは１万口当たりに換算した価額で表示することがあります。



② 有価証券などの評価基準

・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします（1986年２月13日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（4）【計算期間】

毎年２月13日から翌年２月12日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ）受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ）対象インデックスが改廃の場合

ニ）やむを得ない事情が発生したとき

２）この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

３）この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（１ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

４）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

イ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合

ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）

ニ）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

５）繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

② 償還金について

・償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して５営業日まで）から受益者に支払います。

・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

③ 信託約款の変更

１）委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

２）この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

３）この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

４）委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

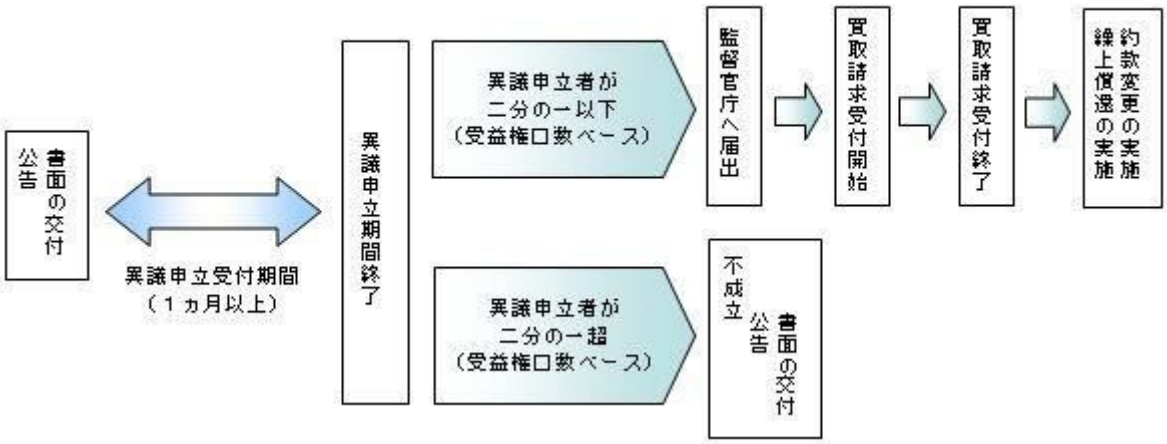
④ 異議の申立て

１）繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

２）委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

３）なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

＜繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ＞



⑤　公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥　運用報告書の作成

・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス　　www.nikkoam.com/

⑦　関係法人との契約について

販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より１年間とします。ただし、期間満了の３ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に１年間延長されるものとし、以後も同様とします。

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（１）収益分配金・償還金受領権

・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。

・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から５年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

（２）解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき販売会社を通じて、委託会社に解約の請求をすることができます。

（３）帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

第３【ファンドの経理状況】

（１）　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期計算期間（平成30年 2月14日から平成31年 2月12日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【インデックスファンドＴＳＰ】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第32期 平成30年 2月13日現在	第33期 平成31年 2月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	581,432,186	558,294,282
親投資信託受益証券	23,247,963,661	21,517,823,979
派生商品評価勘定	-	9,152,440
未収入金	117,000,000	21,481,760
前払金	34,010,000	130,000
差入委託証拠金	20,520,000	15,345,000
流動資産合計	24,000,925,847	22,122,227,461
資産合計	24,000,925,847	22,122,227,461
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	38,488,360	908,100
未払金	1,939,320	146,080
未払収益分配金	318,886,069	320,588,814
未払解約金	15,664,445	9,855,090
未払受託者報酬	13,538,501	12,421,734
未払委託者報酬	56,861,970	52,171,552
未払利息	494	552
その他未払費用	663,329	496,811
流動負債合計	446,042,488	396,588,733
負債合計	446,042,488	396,588,733
純資産の部		
元本等		
元本	26,573,839,124	26,715,734,544
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△3,018,955,765	△4,990,095,816
（分配準備積立金）	5,855,288,014	5,146,501,585
元本等合計	23,554,883,359	21,725,638,728
純資産合計	23,554,883,359	21,725,638,728
負債純資産合計	24,000,925,847	22,122,227,461

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第32期 自　平成29年 2月14日 至　平成30年 2月13日	第33期 自　平成30年 2月14日 至　平成31年 2月12日
営業収益		
受取利息	1,745	1,501
有価証券売買等損益	2,961,562,648	△1,470,139,682
派生商品取引等損益	32,886,160	△2,222,100
営業収益合計	2,994,450,553	△1,472,360,281
営業費用		
支払利息	244,699	262,821
受託者報酬	26,702,020	25,479,754
委託者報酬	112,149,014	107,015,510
その他費用	1,309,092	1,064,064
営業費用合計	140,404,825	133,822,149
営業利益又は営業損失（△）	2,854,045,728	△1,606,182,430
経常利益又は経常損失（△）	2,854,045,728	△1,606,182,430
当期純利益又は当期純損失（△）	2,854,045,728	△1,606,182,430
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	507,787,084	41,864,439
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△6,112,193,264	△3,018,955,765
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,014,240,836	424,434,528
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,014,240,836	424,434,528
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	948,375,912	426,938,896
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	948,375,912	426,938,896
分配金	318,886,069	320,588,814
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△3,018,955,765	△4,990,095,816

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月13日から翌年2月12日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は平成30年 2月14日から平成31年 2月12日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

		第32期 平成30年 2月13日現在	第33期 平成31年 2月12日現在
１．	期首元本額	30,756,345,067円	26,573,839,124円
	期中追加設定元本額	6,031,038,498円	3,915,213,807円
	期中一部解約元本額	10,213,544,441円	3,773,318,387円
２．	受益権の総数	26,573,839,124口	26,715,734,544口
３．	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	3,018,955,765円	4,990,095,816円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第32期 自 平成29年 2月14日 至 平成30年 2月13日			第33期 自 平成30年 2月14日 至 平成31年 2月12日		
	分配金の計算過程			分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	438,871,779円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	380,183,788円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	1,907,386,865円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	12,474,080,283円	C	信託約款に定める収益調整金	13,346,211,879円
D	信託約款に定める分配準備積立金	3,827,915,439円	D	信託約款に定める分配準備積立金	5,086,906,611円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	18,648,254,366円	E	分配対象収益（A+B+C+D）	18,813,302,278円
F	分配対象収益(1万口当たり)	7,017円	F	分配対象収益(1万口当たり)	7,042円
G	分配金額	318,886,069円	G	分配金額	320,588,814円
H	分配金額(1万口当たり)	120円	H	分配金額(1万口当たり)	120円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第32期 自 平成29年 2月14日 至 平成30年 2月13日	第33期 自 平成30年 2月14日 至 平成31年 2月12日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第32期 平成30年 2月13日現在	第33期 平成31年 2月12日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

第32期（平成30年 2月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,495,715,763
合計	2,495,715,763

第33期（平成31年 2月12日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	△1,415,982,938
合計	△1,415,982,938

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

第32期（平成30年 2月13日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	619,190,000	－	580,720,000	△38,470,000
合計		619,190,000	－	580,720,000	△38,470,000

第33期（平成31年 2月12日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	448,635,000	－	456,895,000	8,260,000

合計	448,635,000	―	456,895,000	8,260,000

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

第32期 平成30年 2月13日現在		第33期 平成31年 2月12日現在	
1口当たり純資産額	0.8864円	1口当たり純資産額	0.8132円
(1万口当たり純資産額)	(8,864円)	(1万口当たり純資産額)	(8,132円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	11,123,196,681	21,517,823,979	
合計		11,123,196,681	21,517,823,979	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

当ファンドは、「インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

貸借対照表

（単位：円）

	平成30年 2月13日現在	平成31年 2月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	171,760,788	105,801,622
株式	40,156,024,100	38,645,266,100
派生商品評価勘定	-	1,944,600
未収配当金	56,464,087	63,631,347
前払金	4,675,000	1,950,000
流動資産合計	40,388,923,975	38,818,593,669
資産合計	40,388,923,975	38,818,593,669
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,938,780	-
未払解約金	117,000,000	28,420,692
未払利息	146	104
流動負債合計	122,938,926	28,420,796
負債合計	122,938,926	28,420,796
純資産の部		
元本等		
元本	19,489,325,256	20,051,564,010
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	20,776,659,793	18,738,608,863
元本等合計	40,265,985,049	38,790,172,873
純資産合計	40,265,985,049	38,790,172,873
負債純資産合計	40,388,923,975	38,818,593,669

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券

	当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 （3）時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		平成30年 2月13日現在	平成31年 2月12日現在
１．	期首	平成29年 2月14日	平成30年 2月14日
	期首元本額	21,754,017,768円	19,489,325,256円
	期首からの追加設定元本額	2,186,701,894円	3,188,930,338円
	期首からの一部解約元本額	4,451,394,406円	2,626,691,584円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンドＴＳＰ	11,252,099,928円	11,123,196,681円
	財形株投（一般財形３０）	－円	14,199,854円
	財形株投（一般財形５０）	－円	57,283,497円
	財形株投（年金・住宅財形３０）	－円	31,107,299円
	インデックスファンドＴＯＰＩＸ（日本株式）	7,606,555,954円	8,210,517,711円
	ＴＯＰＩＸインデックスファンド（個人型年金向け）	434,528,550円	466,864,771円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－０８	40,301,147円	34,137,961円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－０８	29,471,220円	26,299,760円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－１１	37,606,958円	17,168,805円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１	41,976,298円	31,065,212円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１７－０２	18,587,439円	16,027,870円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１７－０２	28,197,762円	23,694,589円
	計	19,489,325,256円	20,051,564,010円
２．	受益権の総数	19,489,325,256口	20,051,564,010口
３．	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	304,980,000円	261,108,000円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 平成29年 2月14日 至 平成30年 2月13日	自 平成30年 2月14日 至 平成31年 2月12日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	平成30年 2月13日現在	平成31年 2月12日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成30年 2月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,686,550,888
合計	3,686,550,888

（平成31年 2月12日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△3,436,676,618
合計	△3,436,676,618

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（平成30年 2月13日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	125,495,000	－	119,560,000	△5,935,000
合計		125,495,000	－	119,560,000	△5,935,000

（平成31年 2月12日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益

市場取引	株価指数先物取引 買建	155,600,000	－	157,550,000	1,950,000
合計		155,600,000	－	157,550,000	1,950,000

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

平成30年 2月13日現在		平成31年 2月12日現在	
1口当たり純資産額	2.0661円	1口当たり純資産額	1.9345円
(1万口当たり純資産額)	(20,661円)	(1万口当たり純資産額)	(19,345円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	2,907.00	2,325,600	
日本水産	23,400	724.00	16,941,600	
マルハニチロ	3,400	3,555.00	12,087,000	
カネコ種苗	700	1,317.00	921,900	
サカタのタネ	2,800	3,590.00	10,052,000	
ホクト	2,000	1,958.00	3,916,000	
ホクリヨウ	300	610.00	183,000	
住石ホールディングス	5,400	100.00	540,000	
日鉄鉱業	500	4,605.00	2,302,500	
三井松島ホールディングス	1,000	1,423.00	1,423,000	
国際石油開発帝石	93,700	1,003.50	94,027,950	
石油資源開発	3,400	2,072.00	7,044,800	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	1,100	1,472.00	1,619,200	

ヒノキヤグループ	500	2,281.00	1,140,500	
ショーボンドホールディングス	1,700	8,080.00	13,736,000	
ミライト・ホールディングス	6,600	1,641.00	10,830,600	
サンヨーホームズ	400	830.00	332,000	
日本アクア	600	499.00	299,400	
ファーストコーポレーション	700	745.00	521,500	
ベステラ	500	1,338.00	669,000	
ＴＡＴＥＲＵ	2,900	288.00	835,200	
スペースバリューホールディングス	2,800	944.00	2,643,200	
ダイセキ環境ソリューション	500	645.00	322,500	
第一カッター興業	300	1,818.00	545,400	
安藤・間	15,000	741.00	11,115,000	
東急建設	6,800	968.00	6,582,400	
コムシスホールディングス	8,300	2,806.00	23,289,800	
ミサワホーム	1,900	712.00	1,352,800	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,822.00	4,233,000	
東建コーポレーション	700	6,380.00	4,466,000	
ソネック	300	711.00	213,300	
ヤマウラ	1,000	969.00	969,000	
大成建設	19,200	4,880.00	93,696,000	
大林組	57,800	1,005.00	58,089,000	
清水建設	59,000	895.00	52,805,000	
飛島建設	1,700	1,433.00	2,436,100	
長谷工コーポレーション	24,100	1,359.00	32,751,900	
松井建設	2,100	737.00	1,547,700	
錢高組	300	5,310.00	1,593,000	
鹿島建設	45,200	1,527.00	69,020,400	
不動テトラ	1,400	1,549.00	2,168,600	
大末建設	700	940.00	658,000	
鉄建建設	1,200	2,750.00	3,300,000	
西松建設	4,200	2,483.00	10,428,600	
三井住友建設	14,000	690.00	9,660,000	
大豊建設	1,300	3,510.00	4,563,000	
前田建設工業	13,800	1,088.00	15,014,400	
ナカノフドー建設	1,500	494.00	741,000	
奥村組	3,200	3,300.00	10,560,000	
東鉄工業	2,300	2,942.00	6,766,600	
イチケン	400	1,943.00	777,200	
富士ピー・エス	600	522.00	313,200	
淺沼組	700	2,553.00	1,787,100	
戸田建設	22,400	681.00	15,254,400	
熊谷組	2,700	3,275.00	8,842,500	

青木あすなろ建設	1,000	967.00	967,000	
北野建設	400	3,180.00	1,272,000	
植木組	300	2,268.00	680,400	
矢作建設工業	2,700	709.00	1,914,300	
ピーエス三菱	2,100	650.00	1,365,000	
日本ハウスホールディングス	3,800	430.00	1,634,000	
大東建託	6,900	15,475.00	106,777,500	
新日本建設	2,300	1,003.00	2,306,900	
ＮＩＰＰＯ	5,100	2,179.00	11,112,900	
東亜道路工業	400	3,125.00	1,250,000	
前田道路	6,100	2,117.00	12,913,700	
日本道路	500	6,560.00	3,280,000	
東亜建設工業	1,700	1,402.00	2,383,400	
若築建設	1,000	1,499.00	1,499,000	
東洋建設	7,100	415.00	2,946,500	
五洋建設	23,000	536.00	12,328,000	
世紀東急工業	3,000	617.00	1,851,000	
福田組	600	4,305.00	2,583,000	
住友林業	13,700	1,406.00	19,262,200	
日本基礎技術	2,100	340.00	714,000	
巴コーポレーション	2,500	367.00	917,500	
大和ハウス工業	53,400	3,332.00	177,928,800	
ライト工業	3,700	1,462.00	5,409,400	
積水ハウス	59,000	1,608.50	94,901,500	
日特建設	1,800	624.00	1,123,200	
北陸電気工事	1,000	893.00	893,000	
ユアテック	3,100	884.00	2,740,400	
四電工	300	2,668.00	800,400	
中電工	2,500	2,324.00	5,810,000	
関電工	8,800	994.00	8,747,200	
きんでん	12,800	1,766.00	22,604,800	
東京エネシス	2,000	976.00	1,952,000	
トーエネック	600	3,215.00	1,929,000	
住友電設	1,400	1,872.00	2,620,800	
日本電設工業	3,300	2,289.00	7,553,700	
協和エクシオ	7,600	2,802.00	21,295,200	
新日本空調	1,600	1,820.00	2,912,000	
九電工	3,800	3,895.00	14,801,000	
三機工業	4,400	1,182.00	5,200,800	
日揮	16,600	1,567.00	26,012,200	
中外炉工業	600	1,732.00	1,039,200	
ヤマト	1,800	460.00	828,000	

太平電業	1,300	2,305.00	2,996,500	
高砂熱学工業	4,900	1,800.00	8,820,000	
三晃金属工業	300	2,927.00	878,100	
朝日工業社	400	2,955.00	1,182,000	
明星工業	3,600	699.00	2,516,400	
大氣社	2,600	2,802.00	7,285,200	
ダイダン	1,300	2,487.00	3,233,100	
日比谷総合設備	1,800	1,838.00	3,308,400	
東芝プラントシステム	4,100	2,000.00	8,200,000	
東洋エンジニアリング	2,300	713.00	1,639,900	
千代田化工建設	14,000	328.00	4,592,000	
新興プランテック	3,500	1,245.00	4,357,500	
日本製粉	5,700	1,830.00	10,431,000	
日清製粉グループ本社	19,500	2,249.00	43,855,500	
日東富士製粉	100	6,150.00	615,000	
昭和産業	1,600	2,979.00	4,766,400	
鳥越製粉	1,600	769.00	1,230,400	
中部飼料	2,100	1,098.00	2,305,800	
フィード・ワン	11,600	178.00	2,064,800	
東洋精糖	300	1,016.00	304,800	
日本甜菜製糖	1,000	1,750.00	1,750,000	
三井製糖	1,300	2,931.00	3,810,300	
塩水港精糖	2,100	221.00	464,100	
日新製糖	800	2,032.00	1,625,600	
森永製菓	4,400	4,855.00	21,362,000	
中村屋	500	4,225.00	2,112,500	
江崎グリコ	5,200	5,780.00	30,056,000	
名糖産業	900	1,425.00	1,282,500	
井村屋グループ	700	2,443.00	1,710,100	
不二家	1,000	2,290.00	2,290,000	
山崎製パン	14,100	2,188.00	30,850,800	
第一屋製パン	400	1,000.00	400,000	
モロゾフ	300	4,840.00	1,452,000	
亀田製菓	1,100	5,080.00	5,588,000	
寿スピリッツ	1,800	4,080.00	7,344,000	
カルビー	7,900	3,130.00	24,727,000	
森永乳業	3,500	3,450.00	12,075,000	
六甲バター	1,300	1,952.00	2,537,600	
ヤクルト本社	12,800	7,160.00	91,648,000	
明治ホールディングス	12,200	8,720.00	106,384,000	
雪印メグミルク	4,200	2,671.00	11,218,200	
プリマハム	2,400	2,089.00	5,013,600	

日本ハム	7,500	4,315.00	32,362,500	
林兼産業	600	569.00	341,400	
丸大食品	1,900	1,852.00	3,518,800	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,600	4,005.00	6,408,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,000	637.00	7,007,000	
サッポロホールディングス	6,300	2,431.00	15,315,300	
アサヒグループホールディングス	36,200	4,676.00	169,271,200	
キリンホールディングス	78,100	2,677.00	209,073,700	
宝ホールディングス	12,900	1,227.00	15,828,300	
オエノンホールディングス	5,100	379.00	1,932,900	
養命酒製造	500	2,041.00	1,020,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	13,200	3,420.00	45,144,000	
サントリー食品インターナショナル	11,600	4,850.00	56,260,000	
ダイドーグループホールディングス	1,000	5,350.00	5,350,000	
伊藤園	5,200	5,070.00	26,364,000	
キーコーヒー	1,700	2,051.00	3,486,700	
ユニカフェ	600	1,004.00	602,400	
ジャパンフーズ	300	1,206.00	361,800	
日清オイリオグループ	2,200	3,400.00	7,480,000	
不二製油グループ本社	4,200	3,595.00	15,099,000	
かどや製油	200	4,920.00	984,000	
Ｊ－オイルミルズ	900	4,005.00	3,604,500	
キッコーマン	11,400	5,210.00	59,394,000	
味の素	38,100	1,664.50	63,417,450	
キユーピー	9,600	2,495.00	23,952,000	
ハウス食品グループ本社	6,600	4,035.00	26,631,000	
カゴメ	6,900	2,883.00	19,892,700	
焼津水産化学工業	900	1,101.00	990,900	
アリアケジャパン	1,600	5,910.00	9,456,000	
ピエトロ	300	1,640.00	492,000	
エバラ食品工業	400	2,120.00	848,000	
ニチレイ	9,000	2,684.00	24,156,000	
東洋水産	8,900	4,085.00	36,356,500	
イートアンド	600	1,642.00	985,200	
大冷	200	1,734.00	346,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	500	616.00	308,000	
日清食品ホールディングス	7,300	7,460.00	54,458,000	
永谷園ホールディングス	900	2,370.00	2,133,000	
一正蒲鉾	700	1,043.00	730,100	
フジッコ	1,900	2,299.00	4,368,100	
ロック・フィールド	1,900	1,581.00	3,003,900	
日本たばこ産業	99,600	2,752.50	274,149,000	

ケンコーマヨネーズ	1,000	2,271.00	2,271,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,938.00	2,131,800	
なとり	1,000	1,670.00	1,670,000	
イフジ産業	300	678.00	203,400	
ピックルスコーポレーション	400	1,943.00	777,200	
北の達人コーポレーション	6,800	409.00	2,781,200	
ユーグレナ	7,400	600.00	4,440,000	
ミヨシ油脂	700	1,008.00	705,600	
理研ビタミン	800	3,555.00	2,844,000	
片倉工業	2,100	1,146.00	2,406,600	
グンゼ	1,100	5,100.00	5,610,000	
東洋紡	7,100	1,571.00	11,154,100	
ユニチカ	5,000	485.00	2,425,000	
富士紡ホールディングス	900	2,791.00	2,511,900	
倉敷紡績	1,600	2,267.00	3,627,200	
シキボウ	900	1,039.00	935,100	
日本毛織	5,500	859.00	4,724,500	
ダイトウボウ	3,400	83.00	282,200	
トーア紡コーポレーション	700	445.00	311,500	
ダイドーリミテッド	2,100	335.00	703,500	
帝国繊維	1,900	2,597.00	4,934,300	
帝人	13,700	1,789.00	24,509,300	
東レ	130,600	769.00	100,431,400	
サカイオーベックス	400	1,884.00	753,600	
住江織物	500	2,472.00	1,236,000	
日本フエルト	1,000	448.00	448,000	
日東製網	200	1,317.00	263,400	
アツギ	1,400	947.00	1,325,800	
ダイニック	700	742.00	519,400	
セーレン	4,100	1,877.00	7,695,700	
ソトー	600	937.00	562,200	
東海染工	200	995.00	199,000	
小松マテーレ	2,800	775.00	2,170,000	
ワコールホールディングス	4,900	2,780.00	13,622,000	
ホギメディカル	2,100	3,785.00	7,948,500	
レナウン	5,000	99.00	495,000	
クラウディアホールディングス	400	468.00	187,200	
ＴＳＩホールディングス	6,200	689.00	4,271,800	
マツオカコーポレーション	500	2,572.00	1,286,000	
ワールド	1,700	1,978.00	3,362,600	
三陽商会	1,000	1,675.00	1,675,000	
ナイガイ	600	531.00	318,600	

オンワードホールディングス	10,100	649.00	6,554,900	
ルックホールディングス	600	1,081.00	648,600	
キムラタン	9,100	22.00	200,200	
ゴールドウイン	1,500	12,710.00	19,065,000	
デサント	4,100	2,552.00	10,463,200	
キング	900	573.00	515,700	
ヤマトインターナショナル	1,100	405.00	445,500	
特種東海製紙	1,100	4,085.00	4,493,500	
王子ホールディングス	75,900	654.00	49,638,600	
日本製紙	8,100	2,036.00	16,491,600	
三菱製紙	2,800	531.00	1,486,800	
北越コーポレーション	11,200	591.00	6,619,200	
中越パルプ工業	700	1,322.00	925,400	
巴川製紙所	600	1,000.00	600,000	
大王製紙	8,200	1,245.00	10,209,000	
阿波製紙	500	443.00	221,500	
レンゴー	17,400	906.00	15,764,400	
トーモク	1,000	1,579.00	1,579,000	
ザ・パック	1,300	3,320.00	4,316,000	
クラレ	28,400	1,646.00	46,746,400	
旭化成	119,800	1,107.00	132,618,600	
共和レザー	1,100	744.00	818,400	
昭和電工	11,200	3,760.00	42,112,000	
住友化学	132,600	539.00	71,471,400	
住友精化	800	4,305.00	3,444,000	
日産化学	10,400	5,400.00	56,160,000	
ラサ工業	600	1,417.00	850,200	
クレハ	1,500	7,000.00	10,500,000	
多木化学	500	5,270.00	2,635,000	
テイカ	1,400	2,059.00	2,882,600	
石原産業	3,200	1,119.00	3,580,800	
片倉コープアグリ	500	1,176.00	588,000	
日東エフシー	1,100	769.00	845,900	
日本曹達	2,700	2,905.00	7,843,500	
東ソー	26,000	1,577.00	41,002,000	
トクヤマ	4,900	2,840.00	13,916,000	
セントラル硝子	3,700	2,510.00	9,287,000	
東亜合成	10,600	1,247.00	13,218,200	
大阪ソーダ	1,800	2,732.00	4,917,600	
関東電化工業	4,000	907.00	3,628,000	
デンカ	6,600	3,270.00	21,582,000	
信越化学工業	29,700	9,262.00	275,081,400	

日本カーバイド工業	600	1,550.00	930,000	
堺化学工業	1,100	2,230.00	2,453,000	
第一稀元素化学工業	1,400	899.00	1,258,600	
エア・ウォーター	13,800	1,822.00	25,143,600	
大陽日酸	13,900	1,579.00	21,948,100	
日本化学工業	600	2,270.00	1,362,000	
東邦アセチレン	300	1,364.00	409,200	
日本パーカライジング	9,200	1,383.00	12,723,600	
高圧ガス工業	2,700	785.00	2,119,500	
四国化成工業	2,800	1,260.00	3,528,000	
戸田工業	400	2,120.00	848,000	
ステラ　ケミファ	1,000	2,911.00	2,911,000	
保土谷化学工業	600	2,784.00	1,670,400	
日本触媒	2,800	7,370.00	20,636,000	
大日精化工業	1,400	2,978.00	4,169,200	
カネカ	4,500	4,150.00	18,675,000	
三菱瓦斯化学	17,300	1,751.00	30,292,300	
三井化学	15,300	2,759.00	42,212,700	
ＪＳＲ	16,900	1,821.00	30,774,900	
東京応化工業	2,900	3,140.00	9,106,000	
大阪有機化学工業	1,600	1,135.00	1,816,000	
三菱ケミカルホールディングス	112,600	813.00	91,543,800	
ＫＨネオケム	2,600	2,615.00	6,799,000	
ダイセル	26,200	1,085.00	28,427,000	
住友ベークライト	2,900	4,190.00	12,151,000	
積水化学工業	36,800	1,720.00	63,296,000	
日本ゼオン	15,200	1,146.00	17,419,200	
アイカ工業	5,100	3,740.00	19,074,000	
宇部興産	8,500	2,446.00	20,791,000	
積水樹脂	2,800	2,099.00	5,877,200	
タキロンシーアイ	3,600	600.00	2,160,000	
旭有機材	1,200	1,623.00	1,947,600	
日立化成	7,800	1,983.00	15,467,400	
ニチバン	900	2,197.00	1,977,300	
リケンテクノス	4,600	450.00	2,070,000	
大倉工業	900	1,864.00	1,677,600	
積水化成品工業	2,500	950.00	2,375,000	
群栄化学工業	400	2,740.00	1,096,000	
タイガースポリマー	900	570.00	513,000	
ミライアル	500	1,134.00	567,000	
ダイキアクシス	600	950.00	570,000	
ダイキョーニシカワ	3,500	1,129.00	3,951,500	

竹本容器	600	1,365.00	819,000	
森六ホールディングス	900	2,609.00	2,348,100	
日本化薬	10,700	1,272.00	13,610,400	
カーリットホールディングス	1,800	799.00	1,438,200	
日本精化	1,400	1,174.00	1,643,600	
扶桑化学工業	1,700	2,107.00	3,581,900	
トリケミカル研究所	400	4,960.00	1,984,000	
ＡＤＥＫＡ	8,300	1,693.00	14,051,900	
日油	6,500	3,565.00	23,172,500	
新日本理化	3,300	181.00	597,300	
ハリマ化成グループ	1,400	1,074.00	1,503,600	
花王	41,800	8,038.00	335,988,400	
第一工業製薬	600	2,787.00	1,672,200	
石原ケミカル	400	1,766.00	706,400	
日華化学	600	952.00	571,200	
三洋化成工業	1,100	5,150.00	5,665,000	
有機合成薬品工業	1,400	210.00	294,000	
大日本塗料	1,900	1,090.00	2,071,000	
日本ペイントホールディングス	13,900	3,800.00	52,820,000	
関西ペイント	18,900	1,951.00	36,873,900	
神東塗料	1,400	172.00	240,800	
中国塗料	5,500	962.00	5,291,000	
日本特殊塗料	1,300	1,266.00	1,645,800	
藤倉化成	2,300	585.00	1,345,500	
太陽ホールディングス	1,400	3,550.00	4,970,000	
ＤＩＣ	7,600	3,380.00	25,688,000	
サカタインクス	3,700	1,262.00	4,669,400	
東洋インキＳＣホールディングス	3,600	2,519.00	9,068,400	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,300	990.00	1,287,000	
富士フイルムホールディングス	35,700	4,906.00	175,144,200	
資生堂	34,200	6,912.00	236,390,400	
ライオン	24,000	2,376.00	57,024,000	
高砂香料工業	1,200	3,620.00	4,344,000	
マンダム	3,900	2,600.00	10,140,000	
ミルボン	2,100	4,715.00	9,901,500	
ファンケル	7,700	2,368.00	18,233,600	
コーセー	2,900	17,050.00	49,445,000	
コタ	800	1,459.00	1,167,200	
シーボン	200	2,664.00	532,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,300	3,270.00	23,871,000	
ノエビアホールディングス	1,100	5,030.00	5,533,000	
アジュバンコスメジャパン	400	960.00	384,000	

エステー	1,300	1,909.00	2,481,700	
アグロ　カネショウ	700	2,091.00	1,463,700	
コニシ	3,100	1,711.00	5,304,100	
長谷川香料	2,100	1,680.00	3,528,000	
星光ＰＭＣ	1,200	761.00	913,200	
小林製薬	4,800	8,370.00	40,176,000	
荒川化学工業	1,600	1,302.00	2,083,200	
メック	1,200	1,144.00	1,372,800	
日本高純度化学	500	2,234.00	1,117,000	
タカラバイオ	4,500	2,313.00	10,408,500	
ＪＣＵ	2,200	1,793.00	3,944,600	
新田ゼラチン	1,100	666.00	732,600	
ＯＡＴアグリオ	300	2,061.00	618,300	
デクセリアルズ	4,500	781.00	3,514,500	
アース製薬	1,300	5,340.00	6,942,000	
北興化学工業	1,800	521.00	937,800	
大成ラミック	600	2,803.00	1,681,800	
クミアイ化学工業	7,100	678.00	4,813,800	
日本農薬	4,200	477.00	2,003,400	
アキレス	1,300	2,020.00	2,626,000	
有沢製作所	2,700	778.00	2,100,600	
日東電工	13,000	5,964.00	77,532,000	
レック	1,800	1,604.00	2,887,200	
三光合成	1,400	359.00	502,600	
きもと	3,100	186.00	576,600	
藤森工業	1,600	2,895.00	4,632,000	
前澤化成工業	1,200	1,077.00	1,292,400	
未来工業	900	2,309.00	2,078,100	
ウェーブロックホールディングス	400	802.00	320,800	
ＪＳＰ	1,000	2,486.00	2,486,000	
エフピコ	1,400	6,250.00	8,750,000	
天馬	1,200	2,053.00	2,463,600	
信越ポリマー	3,100	826.00	2,560,600	
東リ	4,300	251.00	1,079,300	
ニフコ	6,900	2,697.00	18,609,300	
バルカー	1,400	2,256.00	3,158,400	
ユニ・チャーム	36,500	3,466.00	126,509,000	
協和発酵キリン	21,500	2,144.00	46,096,000	
武田薬品工業	109,000	4,342.00	473,278,000	
アステラス製薬	158,600	1,672.00	265,179,200	
大日本住友製薬	12,700	2,590.00	32,893,000	
塩野義製薬	22,500	6,756.00	152,010,000	

田辺三菱製薬	18,000	1,613.00	29,034,000	
わかもと製薬	2,200	274.00	602,800	
あすか製薬	2,100	1,217.00	2,555,700	
日本新薬	4,500	7,170.00	32,265,000	
ビオフェルミン製薬	300	2,384.00	715,200	
中外製薬	17,900	6,950.00	124,405,000	
科研製薬	3,100	5,460.00	16,926,000	
エーザイ	20,600	8,697.00	179,158,200	
ロート製薬	8,800	3,025.00	26,620,000	
小野薬品工業	40,600	2,241.00	90,984,600	
久光製薬	5,100	5,640.00	28,764,000	
持田製薬	1,300	10,600.00	13,780,000	
参天製薬	32,600	1,523.00	49,649,800	
扶桑薬品工業	600	2,463.00	1,477,800	
日本ケミファ	200	2,981.00	596,200	
ツムラ	5,300	3,490.00	18,497,000	
日医工	4,400	1,613.00	7,097,200	
キッセイ薬品工業	3,000	2,959.00	8,877,000	
生化学工業	3,300	1,303.00	4,299,900	
栄研化学	3,000	2,538.00	7,614,000	
日水製薬	700	1,187.00	830,900	
鳥居薬品	900	2,208.00	1,987,200	
ＪＣＲファーマ	1,200	5,820.00	6,984,000	
東和薬品	800	8,110.00	6,488,000	
富士製薬工業	1,200	1,783.00	2,139,600	
沢井製薬	3,500	5,560.00	19,460,000	
ゼリア新薬工業	3,400	1,925.00	6,545,000	
第一三共	49,200	3,743.00	184,155,600	
キョーリン製薬ホールディングス	3,800	2,263.00	8,599,400	
大幸薬品	800	1,771.00	1,416,800	
ダイト	1,000	2,804.00	2,804,000	
大塚ホールディングス	32,800	4,500.00	147,600,000	
大正製薬ホールディングス	3,900	11,050.00	43,095,000	
ペプチドリーム	8,600	4,700.00	40,420,000	
日本コークス工業	14,600	98.00	1,430,800	
昭和シェル石油	15,900	1,527.00	24,279,300	
ニチレキ	2,300	1,120.00	2,576,000	
ユシロ化学工業	900	1,262.00	1,135,800	
ビーピー・カストロール	600	1,347.00	808,200	
富士石油	4,300	265.00	1,139,500	
ＭＯＲＥＳＣＯ	600	1,623.00	973,800	
出光興産	13,300	3,575.00	47,547,500	

ＪＸＴＧホールディングス	289,300	530.00	153,329,000	
コスモエネルギーホールディングス	5,000	2,276.00	11,380,000	
横浜ゴム	9,900	2,327.00	23,037,300	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	8,800	1,479.00	13,015,200	
ブリヂストン	52,800	4,147.00	218,961,600	
住友ゴム工業	15,500	1,482.00	22,971,000	
藤倉ゴム工業	1,500	453.00	679,500	
オカモト	1,200	5,230.00	6,276,000	
フコク	800	849.00	679,200	
ニッタ	1,900	3,735.00	7,096,500	
住友理工	3,300	993.00	3,276,900	
三ツ星ベルト	2,300	2,153.00	4,951,900	
バンドー化学	3,300	1,157.00	3,818,100	
日東紡績	2,600	1,969.00	5,119,400	
ＡＧＣ	17,000	3,860.00	65,620,000	
日本板硝子	8,300	924.00	7,669,200	
石塚硝子	300	1,786.00	535,800	
日本山村硝子	700	1,467.00	1,026,900	
日本電気硝子	7,400	2,891.00	21,393,400	
オハラ	700	1,683.00	1,178,100	
住友大阪セメント	3,500	4,490.00	15,715,000	
太平洋セメント	10,900	3,655.00	39,839,500	
日本ヒューム	1,800	767.00	1,380,600	
日本コンクリート工業	3,900	282.00	1,099,800	
三谷セキサン	800	2,825.00	2,260,000	
アジアパイルホールディングス	2,500	624.00	1,560,000	
東海カーボン	15,600	1,618.00	25,240,800	
日本カーボン	800	4,710.00	3,768,000	
東洋炭素	1,000	2,438.00	2,438,000	
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	5,200.00	5,200,000	
ＴＯＴＯ	13,200	4,255.00	56,166,000	
日本碍子	21,000	1,601.00	33,621,000	
日本特殊陶業	14,500	2,273.00	32,958,500	
ダントーホールディングス	2,100	117.00	245,700	
ＭＡＲＵＷＡ	600	5,910.00	3,546,000	
品川リフラクトリーズ	500	3,320.00	1,660,000	
黒崎播磨	400	5,470.00	2,188,000	
ヨータイ	1,500	602.00	903,000	
イソライト工業	900	601.00	540,900	
東京窯業	2,200	372.00	818,400	
ニッカトー	800	990.00	792,000	
フジミインコーポレーテッド	1,500	2,270.00	3,405,000	

クニミネ工業	600	827.00	496,200	
エーアンドエーマテリアル	300	1,043.00	312,900	
ニチアス	4,700	1,991.00	9,357,700	
ニチハ	2,400	3,050.00	7,320,000	
新日鐵住金	79,000	2,036.00	160,844,000	
神戸製鋼所	31,200	852.00	26,582,400	
合同製鐵	900	1,720.00	1,548,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	45,900	1,909.00	87,623,100	
東京製鐵	9,200	893.00	8,215,600	
共英製鋼	1,900	1,624.00	3,085,600	
大和工業	3,600	2,894.00	10,418,400	
東京鐵鋼	700	1,153.00	807,100	
大阪製鐵	1,100	1,885.00	2,073,500	
淀川製鋼所	2,300	2,191.00	5,039,300	
丸一鋼管	6,000	3,355.00	20,130,000	
モリ工業	500	2,514.00	1,257,000	
大同特殊鋼	2,800	4,330.00	12,124,000	
日本高周波鋼業	700	537.00	375,900	
日本冶金工業	14,300	235.00	3,360,500	
山陽特殊製鋼	2,100	2,288.00	4,804,800	
愛知製鋼	1,000	3,410.00	3,410,000	
日立金属	18,300	1,075.00	19,672,500	
日本金属	400	1,190.00	476,000	
大平洋金属	1,200	2,879.00	3,454,800	
新日本電工	10,300	236.00	2,430,800	
栗本鐵工所	900	1,490.00	1,341,000	
虹技	300	1,328.00	398,400	
日本鋳鉄管	200	901.00	180,200	
三菱製鋼	1,300	1,600.00	2,080,000	
日亜鋼業	2,600	305.00	793,000	
日本精線	200	3,370.00	674,000	
エンビプロ・ホールディングス	400	498.00	199,200	
シンニッタン	2,700	328.00	885,600	
新家工業	400	1,588.00	635,200	
大紀アルミニウム工業所	2,900	604.00	1,751,600	
日本軽金属ホールディングス	46,500	238.00	11,067,000	
三井金属鉱業	4,600	2,539.00	11,679,400	
東邦亜鉛	900	3,305.00	2,974,500	
三菱マテリアル	11,200	2,958.00	33,129,600	
住友金属鉱山	23,300	2,955.50	68,863,150	
ＤＯＷＡホールディングス	4,000	3,325.00	13,300,000	
古河機械金属	2,800	1,363.00	3,816,400	

エス・サイエンス	8,000	60.00	480,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,000	1,804.00	3,608,000	
東邦チタニウム	3,100	947.00	2,935,700	
ＵＡＣＪ	2,600	2,197.00	5,712,200	
ＣＫサンエツ	300	2,437.00	731,100	
古河電気工業	4,900	3,355.00	16,439,500	
住友電気工業	63,600	1,511.50	96,131,400	
フジクラ	20,600	480.00	9,888,000	
昭和電線ホールディングス	2,100	681.00	1,430,100	
タツタ電線	3,400	499.00	1,696,600	
カナレ電気	300	1,796.00	538,800	
平河ヒューテック	700	1,520.00	1,064,000	
リョービ	2,100	2,932.00	6,157,200	
アーレスティ	2,100	638.00	1,339,800	
アサヒホールディングス	3,200	2,114.00	6,764,800	
稲葉製作所	1,000	1,244.00	1,244,000	
宮地エンジニアリンググループ	500	2,050.00	1,025,000	
トーカロ	4,400	920.00	4,048,000	
アルファＣｏ	600	1,295.00	777,000	
ＳＵＭＣＯ	18,800	1,565.00	29,422,000	
川田テクノロジーズ	400	7,210.00	2,884,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	300	3,035.00	910,500	
東洋製罐グループホールディングス	10,800	2,154.00	23,263,200	
ホッカンホールディングス	900	1,760.00	1,584,000	
コロナ	900	1,033.00	929,700	
横河ブリッジホールディングス	3,200	1,917.00	6,134,400	
駒井ハルテック	400	1,884.00	753,600	
高田機工	200	2,678.00	535,600	
三和ホールディングス	17,600	1,285.00	22,616,000	
文化シヤッター	5,000	788.00	3,940,000	
三協立山	2,400	1,381.00	3,314,400	
アルインコ	1,400	968.00	1,355,200	
東洋シヤッター	500	705.00	352,500	
ＬＩＸＩＬグループ	25,100	1,530.00	38,403,000	
日本フイルコン	1,300	528.00	686,400	
ノーリツ	3,800	1,572.00	5,973,600	
長府製作所	1,700	2,198.00	3,736,600	
リンナイ	3,000	7,380.00	22,140,000	
ダイニチ工業	1,000	722.00	722,000	
日東精工	2,400	535.00	1,284,000	
三洋工業	300	1,891.00	567,300	
岡部	3,500	869.00	3,041,500	

ジーテクト	1,900	1,699.00	3,228,100	
中国工業	300	564.00	169,200	
東プレ	3,200	2,385.00	7,632,000	
高周波熱錬	3,300	870.00	2,871,000	
東京製綱	1,100	1,044.00	1,148,400	
サンコール	1,000	643.00	643,000	
モリテック　スチール	1,400	422.00	590,800	
パイオラックス	2,700	2,287.00	6,174,900	
エイチワン	1,700	1,115.00	1,895,500	
日本発條	16,900	1,030.00	17,407,000	
中央発條	200	2,887.00	577,400	
アドバネクス	200	1,582.00	316,400	
立川ブラインド工業	800	1,120.00	896,000	
三益半導体工業	1,500	1,472.00	2,208,000	
日本ドライケミカル	500	1,173.00	586,500	
日本製鋼所	5,200	2,044.00	10,628,800	
三浦工業	7,400	2,480.00	18,352,000	
タクマ	6,200	1,358.00	8,419,600	
ツガミ	3,900	703.00	2,741,700	
オークマ	2,200	5,890.00	12,958,000	
東芝機械	1,900	2,182.00	4,145,800	
アマダホールディングス	26,200	1,065.00	27,903,000	
アイダエンジニアリング	4,700	795.00	3,736,500	
滝澤鉄工所	500	1,680.00	840,000	
ＦＵＪＩ	5,100	1,485.00	7,573,500	
牧野フライス製作所	2,000	4,305.00	8,610,000	
オーエスジー	8,400	2,228.00	18,715,200	
ダイジェット工業	200	1,600.00	320,000	
旭ダイヤモンド工業	4,500	777.00	3,496,500	
ＤＭＧ森精機	10,800	1,497.00	16,167,600	
ソディック	3,700	807.00	2,985,900	
ディスコ	2,300	16,720.00	38,456,000	
日東工器	900	2,254.00	2,028,600	
日進工具	500	2,430.00	1,215,000	
パンチ工業	1,200	518.00	621,600	
冨士ダイス	800	643.00	514,400	
豊和工業	1,000	834.00	834,000	
ＯＫＫ	700	849.00	594,300	
東洋機械金属	1,200	587.00	704,400	
津田駒工業	400	1,920.00	768,000	
島精機製作所	2,300	3,585.00	8,245,500	
オプトラン	1,700	1,936.00	3,291,200	

ＮＣホールディングス	600	477.00	286,200	
フリュー	1,400	1,035.00	1,449,000	
ヤマシンフィルタ	3,000	658.00	1,974,000	
日阪製作所	2,100	863.00	1,812,300	
やまびこ	3,300	1,095.00	3,613,500	
平田機工	800	6,440.00	5,152,000	
ペガサスミシン製造	1,600	639.00	1,022,400	
マルマエ	500	714.00	357,000	
タツモ	500	845.00	422,500	
ナブテスコ	9,300	3,015.00	28,039,500	
三井海洋開発	1,800	3,025.00	5,445,000	
レオン自動機	1,700	1,583.00	2,691,100	
ＳＭＣ	5,000	40,000.00	200,000,000	
新川	1,300	373.00	484,900	
ホソカワミクロン	600	4,615.00	2,769,000	
ユニオンツール	800	3,130.00	2,504,000	
オイレス工業	2,400	1,873.00	4,495,200	
日精エー・エス・ビー機械	500	3,310.00	1,655,000	
サトーホールディングス	2,000	2,519.00	5,038,000	
技研製作所	1,200	3,225.00	3,870,000	
日本エアーテック	600	567.00	340,200	
カワタ	400	1,276.00	510,400	
日精樹脂工業	1,400	948.00	1,327,200	
オカダアイヨン	600	1,466.00	879,600	
ワイエイシイホールディングス	700	645.00	451,500	
小松製作所	77,900	2,667.50	207,798,250	
住友重機械工業	9,900	3,625.00	35,887,500	
日立建機	6,900	2,734.00	18,864,600	
日工	500	2,228.00	1,114,000	
巴工業	700	2,396.00	1,677,200	
井関農機	1,700	1,643.00	2,793,100	
ＴＯＷＡ	1,500	644.00	966,000	
丸山製作所	400	1,281.00	512,400	
北川鉄工所	800	2,263.00	1,810,400	
ローツェ	800	1,683.00	1,346,400	
タカキタ	600	601.00	360,600	
クボタ	92,100	1,666.50	153,484,650	
荏原実業	500	2,049.00	1,024,500	
三菱化工機	600	1,542.00	925,200	
月島機械	3,400	1,432.00	4,868,800	
帝国電機製作所	1,200	1,214.00	1,456,800	
新東工業	4,100	991.00	4,063,100	

澁谷工業	1,500	3,400.00	5,100,000	
アイチ　コーポレーション	3,000	715.00	2,145,000	
小森コーポレーション	4,700	1,139.00	5,353,300	
鶴見製作所	1,400	1,789.00	2,504,600	
住友精密工業	300	2,830.00	849,000	
酒井重工業	300	2,396.00	718,800	
荏原製作所	7,600	3,050.00	23,180,000	
石井鐵工所	300	1,753.00	525,900	
西島製作所	1,800	927.00	1,668,600	
北越工業	1,800	1,165.00	2,097,000	
ダイキン工業	23,500	11,810.00	277,535,000	
オルガノ	600	2,832.00	1,699,200	
トーヨーカネツ	700	2,340.00	1,638,000	
栗田工業	9,300	2,902.00	26,988,600	
椿本チエイン	2,200	3,970.00	8,734,000	
大同工業	800	886.00	708,800	
木村化工機	1,400	378.00	529,200	
アネスト岩田	2,700	951.00	2,567,700	
ダイフク	9,500	5,600.00	53,200,000	
サムコ	500	979.00	489,500	
加藤製作所	900	2,699.00	2,429,100	
油研工業	300	1,820.00	546,000	
タダノ	8,300	1,150.00	9,545,000	
フジテック	6,200	1,222.00	7,576,400	
ＣＫＤ	4,800	1,072.00	5,145,600	
キトー	1,300	1,744.00	2,267,200	
平和	4,800	2,221.00	10,660,800	
理想科学工業	1,500	1,761.00	2,641,500	
ＳＡＮＫＹＯ	4,300	4,015.00	17,264,500	
日本金銭機械	1,900	1,015.00	1,928,500	
マースグループホールディングス	1,100	2,125.00	2,337,500	
福島工業	1,100	3,845.00	4,229,500	
オーイズミ	800	350.00	280,000	
ダイコク電機	800	1,437.00	1,149,600	
竹内製作所	2,900	1,968.00	5,707,200	
アマノ	4,900	2,376.00	11,642,400	
ＪＵＫＩ	2,400	1,159.00	2,781,600	
サンデンホールディングス	2,200	780.00	1,716,000	
蛇の目ミシン工業	1,600	465.00	744,000	
マックス	2,600	1,480.00	3,848,000	
グローリー	4,800	2,568.00	12,326,400	
新晃工業	1,600	1,500.00	2,400,000	

大和冷機工業	2,500	1,181.00	2,952,500	
セガサミーホールディングス	17,100	1,211.00	20,708,100	
日本ピストンリング	600	1,797.00	1,078,200	
リケン	800	5,250.00	4,200,000	
ＴＰＲ	2,300	2,314.00	5,322,200	
ツバキ・ナカシマ	2,600	1,698.00	4,414,800	
ホシザキ	5,000	7,940.00	39,700,000	
大豊工業	1,400	1,009.00	1,412,600	
日本精工	35,300	1,030.00	36,359,000	
ＮＴＮ	37,100	338.00	12,539,800	
ジェイテクト	16,500	1,352.00	22,308,000	
不二越	1,600	4,320.00	6,912,000	
日本トムソン	5,200	551.00	2,865,200	
ＴＨＫ	10,700	2,675.00	28,622,500	
ユーシン精機	1,400	936.00	1,310,400	
前澤給装工業	700	1,823.00	1,276,100	
イーグル工業	2,100	1,292.00	2,713,200	
前澤工業	1,200	349.00	418,800	
日本ピラー工業	1,800	1,381.00	2,485,800	
キッツ	7,000	876.00	6,132,000	
マキタ	20,900	3,970.00	82,973,000	
日立造船	13,700	367.00	5,027,900	
三菱重工業	28,800	4,274.00	123,091,200	
ＩＨＩ	13,200	3,145.00	41,514,000	
スター精密	2,900	1,575.00	4,567,500	
日清紡ホールディングス	9,600	925.00	8,880,000	
イビデン	10,500	1,501.00	15,760,500	
コニカミノルタ	37,600	1,047.00	39,367,200	
ブラザー工業	22,400	2,067.00	46,300,800	
ミネベアミツミ	31,900	1,788.00	57,037,200	
日立製作所	77,400	3,424.00	265,017,600	
三菱電機	172,000	1,400.50	240,886,000	
富士電機	11,200	3,315.00	37,128,000	
東洋電機製造	700	1,256.00	879,200	
安川電機	20,000	3,140.00	62,800,000	
シンフォニアテクノロジー	2,400	1,365.00	3,276,000	
明電舎	3,400	1,608.00	5,467,200	
オリジン電気	500	1,968.00	984,000	
山洋電気	800	4,005.00	3,204,000	
デンヨー	1,600	1,404.00	2,246,400	
東芝テック	2,200	2,883.00	6,342,600	
芝浦メカトロニクス	300	3,330.00	999,000	

マブチモーター	4,800	3,910.00	18,768,000	
日本電産	20,700	13,305.00	275,413,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	1,616.00	1,454,400	
トレックス・セミコンダクター	600	1,305.00	783,000	
東光高岳	900	1,428.00	1,285,200	
ダブル・スコープ	2,500	1,137.00	2,842,500	
ダイヘン	1,900	2,741.00	5,207,900	
ヤーマン	2,500	1,305.00	3,262,500	
ＪＶＣケンウッド	13,300	270.00	3,591,000	
ミマキエンジニアリング	1,600	756.00	1,209,600	
第一精工	700	1,096.00	767,200	
日新電機	4,000	979.00	3,916,000	
大崎電気工業	3,500	699.00	2,446,500	
オムロン	18,300	4,760.00	87,108,000	
日東工業	2,800	2,218.00	6,210,400	
ＩＤＥＣ	2,300	2,077.00	4,777,100	
正興電機製作所	300	869.00	260,700	
不二電機工業	200	1,297.00	259,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	6,200	2,219.00	13,757,800	
サクサホールディングス	400	1,784.00	713,600	
メルコホールディングス	700	3,980.00	2,786,000	
テクノメディカ	400	2,099.00	839,600	
日本電気	22,300	3,725.00	83,067,500	
富士通	16,600	7,614.00	126,392,400	
沖電気工業	7,500	1,246.00	9,345,000	
岩崎通信機	800	785.00	628,000	
電気興業	900	2,829.00	2,546,100	
サンケン電気	2,000	2,080.00	4,160,000	
ナカヨ	300	1,375.00	412,500	
アイホン	1,000	1,709.00	1,709,000	
ルネサスエレクトロニクス	17,800	715.00	12,727,000	
セイコーエプソン	21,300	1,617.00	34,442,100	
ワコム	12,500	462.00	5,775,000	
アルバック	3,400	3,630.00	12,342,000	
アクセル	800	489.00	391,200	
ＥＩＺＯ	1,600	4,720.00	7,552,000	
ジャパンディスプレイ	41,000	73.00	2,993,000	
日本信号	4,400	982.00	4,320,800	
京三製作所	3,700	394.00	1,457,800	
能美防災	2,300	1,981.00	4,556,300	
ホーチキ	1,100	1,080.00	1,188,000	
星和電機	700	459.00	321,300	

エレコム	1,600	3,300.00	5,280,000	
パナソニック	196,500	1,034.50	203,279,250	
シャープ	17,100	1,227.00	20,981,700	
アンリツ	11,100	2,225.00	24,697,500	
富士通ゼネラル	5,300	1,498.00	7,939,400	
ソニー	115,400	4,854.00	560,151,600	
ＴＤＫ	9,000	8,770.00	78,930,000	
帝国通信工業	800	1,218.00	974,400	
タムラ製作所	6,600	627.00	4,138,200	
アルプスアルパイン	17,900	2,321.00	41,545,900	
池上通信機	500	1,237.00	618,500	
パイオニア	29,300	65.00	1,904,500	
日本電波工業	1,600	372.00	595,200	
鈴木	900	651.00	585,900	
日本トリム	300	5,450.00	1,635,000	
ローランド　ディー．ジー．	900	2,234.00	2,010,600	
フォスター電機	2,000	1,590.00	3,180,000	
クラリオン	1,500	2,499.00	3,748,500	
ＳＭＫ	500	2,661.00	1,330,500	
ヨコオ	1,200	1,602.00	1,922,400	
ホシデン	5,100	834.00	4,253,400	
ヒロセ電機	2,500	11,780.00	29,450,000	
日本航空電子工業	3,900	1,476.00	5,756,400	
ＴＯＡ	1,900	1,032.00	1,960,800	
マクセルホールディングス	3,700	1,625.00	6,012,500	
古野電気	2,300	912.00	2,097,600	
ユニデンホールディングス	500	2,146.00	1,073,000	
スミダコーポレーション	1,500	1,349.00	2,023,500	
アイコム	1,000	2,140.00	2,140,000	
リオン	800	1,799.00	1,439,200	
本多通信工業	1,500	557.00	835,500	
船井電機	1,800	588.00	1,058,400	
横河電機	17,200	2,054.00	35,328,800	
新電元工業	600	4,460.00	2,676,000	
アズビル	11,100	2,399.00	26,628,900	
東亜ディーケーケー	900	780.00	702,000	
日本光電工業	7,600	3,340.00	25,384,000	
チノー	600	1,259.00	755,400	
共和電業	1,800	369.00	664,200	
日本電子材料	700	721.00	504,700	
堀場製作所	3,400	5,500.00	18,700,000	
アドバンテスト	11,700	2,551.00	29,846,700	

小野測器	800	594.00	475,200	
エスペック	1,500	1,956.00	2,934,000	
キーエンス	8,400	61,940.00	520,296,000	
日置電機	900	4,585.00	4,126,500	
シスメックス	13,400	6,482.00	86,858,800	
日本マイクロニクス	2,800	852.00	2,385,600	
メガチップス	1,400	2,020.00	2,828,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,000	3,540.00	3,540,000	
澤藤電機	200	1,619.00	323,800	
原田工業	600	951.00	570,600	
コーセル	2,200	1,152.00	2,534,400	
イリソ電子工業	1,600	4,805.00	7,688,000	
オプテックスグループ	3,000	1,995.00	5,985,000	
千代田インテグレ	700	1,879.00	1,315,300	
アイ・オー・データ機器	600	1,298.00	778,800	
レーザーテック	3,500	4,265.00	14,927,500	
スタンレー電気	12,200	3,265.00	39,833,000	
岩崎電気	700	1,337.00	935,900	
ウシオ電機	10,400	1,261.00	13,114,400	
岡谷電機産業	1,200	388.00	465,600	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,600	687.00	1,099,200	
エノモト	300	874.00	262,200	
日本セラミック	1,700	2,613.00	4,442,100	
遠藤照明	900	720.00	648,000	
古河電池	1,300	738.00	959,400	
双信電機	800	349.00	279,200	
山一電機	1,300	1,252.00	1,627,600	
図研	1,100	1,623.00	1,785,300	
日本電子	3,400	1,895.00	6,443,000	
カシオ計算機	15,200	1,467.00	22,298,400	
ファナック	16,400	18,835.00	308,894,000	
日本シイエムケイ	4,400	678.00	2,983,200	
エンプラス	800	3,030.00	2,424,000	
大真空	600	946.00	567,600	
ローム	8,300	8,010.00	66,483,000	
浜松ホトニクス	12,300	3,915.00	48,154,500	
三井ハイテック	1,900	1,006.00	1,911,400	
新光電気工業	5,800	784.00	4,547,200	
京セラ	26,200	5,969.00	156,387,800	
太陽誘電	7,700	2,380.00	18,326,000	
村田製作所	18,100	17,730.00	320,913,000	
ユーシン	2,800	983.00	2,752,400	

双葉電子工業	2,800	1,731.00	4,846,800	
北陸電気工業	700	1,045.00	731,500	
ニチコン	5,400	976.00	5,270,400	
日本ケミコン	1,200	2,175.00	2,610,000	
ＫＯＡ	2,600	1,630.00	4,238,000	
市光工業	2,600	609.00	1,583,400	
小糸製作所	10,300	6,440.00	66,332,000	
ミツバ	3,200	662.00	2,118,400	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	3,000	4,795.00	14,385,000	
キヤノン電子	1,600	1,831.00	2,929,600	
キヤノン	92,500	3,170.00	293,225,000	
リコー	51,800	1,097.00	56,824,600	
象印マホービン	3,200	1,193.00	3,817,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	300	1,865.00	559,500	
東京エレクトロン	11,500	15,680.00	180,320,000	
トヨタ紡織	6,000	1,797.00	10,782,000	
芦森工業	400	1,632.00	652,800	
ユニプレス	3,300	2,069.00	6,827,700	
豊田自動織機	13,900	5,530.00	76,867,000	
モリタホールディングス	3,000	1,771.00	5,313,000	
三櫻工業	2,200	574.00	1,262,800	
デンソー	37,900	4,728.00	179,191,200	
東海理化電機製作所	4,500	1,903.00	8,563,500	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	6,300	1,236.00	7,786,800	
川崎重工業	13,400	2,751.00	36,863,400	
名村造船所	5,200	433.00	2,251,600	
サノヤスホールディングス	2,400	176.00	422,400	
日本車輌製造	600	2,481.00	1,488,600	
三菱ロジスネクスト	2,100	1,312.00	2,755,200	
近畿車輛	300	2,070.00	621,000	
日産自動車	202,700	931.40	188,794,780	
いすゞ自動車	54,400	1,609.50	87,556,800	
トヨタ自動車	191,700	6,605.00	1,266,178,500	代用有価証券 23,000株
日野自動車	21,400	1,013.00	21,678,200	
三菱自動車工業	63,700	642.00	40,895,400	
エフテック	1,200	972.00	1,166,400	
レシップホールディングス	700	733.00	513,100	
ＧＭＢ	400	915.00	366,000	
ファルテック	300	819.00	245,700	
武蔵精密工業	4,200	1,442.00	6,056,400	
日産車体	3,400	1,003.00	3,410,200	
新明和工業	7,700	1,470.00	11,319,000	

極東開発工業	3,400	1,520.00	5,168,000	
日信工業	3,200	1,538.00	4,921,600	
トピー工業	1,400	2,368.00	3,315,200	
ティラド	600	2,281.00	1,368,600	
曙ブレーキ工業	9,800	166.00	1,626,800	
タチエス	2,900	1,667.00	4,834,300	
ＮＯＫ	9,200	1,771.00	16,293,200	
フタバ産業	4,800	592.00	2,841,600	
ＫＹＢ	1,800	2,975.00	5,355,000	
大同メタル工業	2,800	788.00	2,206,400	
プレス工業	8,500	609.00	5,176,500	
ミクニ	2,200	461.00	1,014,200	
太平洋工業	3,600	1,693.00	6,094,800	
ケーヒン	4,000	1,909.00	7,636,000	
河西工業	2,100	871.00	1,829,100	
アイシン精機	14,100	4,250.00	59,925,000	
マツダ	54,000	1,294.00	69,876,000	
今仙電機製作所	1,600	1,034.00	1,654,400	
本田技研工業	145,100	2,950.00	428,045,000	
スズキ	31,500	5,617.00	176,935,500	
ＳＵＢＡＲＵ	53,400	2,809.50	150,027,300	
安永	900	1,369.00	1,232,100	
ヤマハ発動機	24,300	2,350.00	57,105,000	
ショーワ	4,100	1,565.00	6,416,500	
ＴＢＫ	2,100	405.00	850,500	
エクセディ	2,300	2,647.00	6,088,100	
豊田合成	5,500	2,351.00	12,930,500	
愛三工業	2,700	725.00	1,957,500	
盟和産業	300	1,039.00	311,700	
日本プラスト	1,400	824.00	1,153,600	
ヨロズ	1,600	1,517.00	2,427,200	
エフ・シー・シー	3,100	2,516.00	7,799,600	
シマノ	6,900	15,500.00	106,950,000	
テイ・エス　テック	4,000	3,280.00	13,120,000	
ジャムコ	900	2,512.00	2,260,800	
テルモ	24,300	6,563.00	159,480,900	
クリエートメディック	600	958.00	574,800	
日機装	5,600	999.00	5,594,400	
島津製作所	22,100	2,757.00	60,929,700	
ＪＭＳ	1,600	667.00	1,067,200	
長野計器	1,400	852.00	1,192,800	
ブイ・テクノロジー	400	16,190.00	6,476,000	

東京計器	1,100	933.00	1,026,300	
愛知時計電機	200	3,795.00	759,000	
インターアクション	800	2,167.00	1,733,600	
オーバル	1,800	247.00	444,600	
東京精密	3,100	3,120.00	9,672,000	
マニー	2,100	4,810.00	10,101,000	
ニコン	30,000	1,645.00	49,350,000	
トプコン	9,200	1,479.00	13,606,800	
オリンパス	25,600	4,650.00	119,040,000	
理研計器	1,500	2,104.00	3,156,000	
タムロン	1,600	1,770.00	2,832,000	
ＨＯＹＡ	34,600	6,749.00	233,515,400	
シード	700	1,192.00	834,400	
ノーリツ鋼機	1,400	2,140.00	2,996,000	
エー・アンド・デイ	1,600	719.00	1,150,400	
朝日インテック	7,300	4,995.00	36,463,500	
シチズン時計	18,900	589.00	11,132,100	
リズム時計工業	600	1,672.00	1,003,200	
大研医器	1,400	585.00	819,000	
メニコン	2,400	2,687.00	6,448,800	
シンシア	300	492.00	147,600	
松風	900	1,234.00	1,110,600	
セイコーホールディングス	2,700	2,322.00	6,269,400	
ニプロ	11,900	1,488.00	17,707,200	
中本パックス	500	1,640.00	820,000	
スノーピーク	700	1,330.00	931,000	
パラマウントベッドホールディングス	2,000	4,845.00	9,690,000	
トランザクション	900	712.00	640,800	
ＳＨＯ－ＢＩ	500	347.00	173,500	
ニホンフラッシュ	800	1,958.00	1,566,400	
前田工繊	1,900	2,823.00	5,363,700	
永大産業	2,300	432.00	993,600	
アートネイチャー	1,800	618.00	1,112,400	
バンダイナムコホールディングス	17,800	4,760.00	84,728,000	
アイフィスジャパン	400	573.00	229,200	
共立印刷	2,800	230.00	644,000	
ＳＨＯＥＩ	800	4,050.00	3,240,000	
フランスベッドホールディングス	2,500	865.00	2,162,500	
パイロットコーポレーション	3,000	5,480.00	16,440,000	
萩原工業	1,000	1,666.00	1,666,000	
トッパン・フォームズ	3,700	903.00	3,341,100	
フジシールインターナショナル	3,900	4,070.00	15,873,000	

タカラトミー	7,200	1,208.00	8,697,600	
廣済堂	1,700	711.00	1,208,700	
エステールホールディングス	600	667.00	400,200	
アーク	6,900	94.00	648,600	
タカノ	700	839.00	587,300	
プロネクサス	1,500	1,170.00	1,755,000	
ホクシン	1,300	135.00	175,500	
ウッドワン	600	1,056.00	633,600	
大建工業	1,300	1,873.00	2,434,900	
凸版印刷	24,300	1,741.00	42,306,300	
大日本印刷	24,200	2,530.00	61,226,000	
図書印刷	1,600	930.00	1,488,000	
共同印刷	500	2,456.00	1,228,000	
ＮＩＳＳＨＡ	3,500	1,490.00	5,215,000	
光村印刷	200	1,973.00	394,600	
宝印刷	800	1,601.00	1,280,800	
アシックス	17,100	1,621.00	27,719,100	
ツツミ	600	1,929.00	1,157,400	
小松ウオール工業	600	1,866.00	1,119,600	
ヤマハ	10,200	5,220.00	53,244,000	
河合楽器製作所	600	3,090.00	1,854,000	
クリナップ	1,600	603.00	964,800	
ピジョン	10,400	4,440.00	46,176,000	
兼松サステック	100	1,577.00	157,700	
キングジム	1,500	790.00	1,185,000	
リンテック	4,100	2,468.00	10,118,800	
イトーキ	3,200	591.00	1,891,200	
任天堂	10,600	29,235.00	309,891,000	
三菱鉛筆	2,900	2,323.00	6,736,700	
タカラスタンダード	3,600	1,703.00	6,130,800	
コクヨ	8,300	1,701.00	14,118,300	
ナカバヤシ	1,700	536.00	911,200	
オカムラ	6,000	1,300.00	7,800,000	
美津濃	1,700	2,436.00	4,141,200	
東京電力ホールディングス	137,400	668.00	91,783,200	
中部電力	52,600	1,692.50	89,025,500	
関西電力	70,200	1,573.00	110,424,600	
中国電力	23,800	1,462.00	34,795,600	
北陸電力	16,900	879.00	14,855,100	
東北電力	40,300	1,424.00	57,387,200	
四国電力	15,500	1,404.00	21,762,000	
九州電力	35,500	1,336.00	47,428,000	

北海道電力	16,100	798.00	12,847,800	
沖縄電力	3,200	2,090.00	6,688,000	
電源開発	13,700	2,761.00	37,825,700	
エフオン	800	887.00	709,600	
イーレックス	3,000	703.00	2,109,000	
レノバ	2,100	1,049.00	2,202,900	
東京瓦斯	33,800	2,945.00	99,541,000	
大阪瓦斯	33,400	2,182.00	72,878,800	
東邦瓦斯	8,500	4,765.00	40,502,500	
北海道瓦斯	900	1,445.00	1,300,500	
広島ガス	3,600	340.00	1,224,000	
西部瓦斯	1,900	2,516.00	4,780,400	
静岡ガス	5,300	941.00	4,987,300	
メタウォーター	800	3,115.00	2,492,000	
ＳＢＳホールディングス	1,700	1,641.00	2,789,700	
東武鉄道	18,200	3,050.00	55,510,000	
相鉄ホールディングス	5,900	3,235.00	19,086,500	
東京急行電鉄	46,700	1,834.00	85,647,800	
京浜急行電鉄	23,600	1,769.00	41,748,400	
小田急電鉄	27,600	2,419.00	66,764,400	
京王電鉄	9,600	6,170.00	59,232,000	
京成電鉄	12,900	3,645.00	47,020,500	
富士急行	2,300	3,800.00	8,740,000	
東日本旅客鉄道	30,600	10,165.00	311,049,000	
西日本旅客鉄道	15,400	7,907.00	121,767,800	
東海旅客鉄道	15,400	23,995.00	369,523,000	
西武ホールディングス	21,900	1,926.00	42,179,400	
鴻池運輸	2,700	1,677.00	4,527,900	
西日本鉄道	4,800	2,690.00	12,912,000	
ハマキョウレックス	1,300	3,950.00	5,135,000	
サカイ引越センター	900	6,440.00	5,796,000	
近鉄グループホールディングス	16,300	4,850.00	79,055,000	
阪急阪神ホールディングス	21,700	3,915.00	84,955,500	
南海電気鉄道	7,300	2,915.00	21,279,500	
京阪ホールディングス	7,300	4,515.00	32,959,500	
神戸電鉄	500	3,880.00	1,940,000	
名古屋鉄道	13,100	2,951.00	38,658,100	
山陽電気鉄道	1,300	2,111.00	2,744,300	
日本通運	6,400	6,550.00	41,920,000	
ヤマトホールディングス	28,600	2,902.00	82,997,200	
山九	4,500	5,110.00	22,995,000	
丸運	900	307.00	276,300	

丸全昭和運輸	1,300	2,795.00	3,633,500	
センコーグループホールディングス	9,000	891.00	8,019,000	
トナミホールディングス	400	6,350.00	2,540,000	
ニッコンホールディングス	6,200	2,748.00	17,037,600	
日本石油輸送	200	2,889.00	577,800	
福山通運	2,100	4,365.00	9,166,500	
セイノーホールディングス	12,200	1,509.00	18,409,800	
エスライン	500	1,128.00	564,000	
神奈川中央交通	400	3,690.00	1,476,000	
日立物流	3,600	3,160.00	11,376,000	
丸和運輸機関	900	3,370.00	3,033,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,600	1,194.00	1,910,400	
九州旅客鉄道	13,700	3,585.00	49,114,500	
ＳＧホールディングス	15,400	3,010.00	46,354,000	
日本郵船	13,700	1,768.00	24,221,600	
商船三井	9,700	2,572.00	24,948,400	
川崎汽船	5,000	1,546.00	7,730,000	
ＮＳユナイテッド海運	900	2,615.00	2,353,500	
明治海運	1,800	349.00	628,200	
飯野海運	7,800	395.00	3,081,000	
共栄タンカー	200	1,505.00	301,000	
乾汽船	1,500	692.00	1,038,000	
日本航空	29,900	4,023.00	120,287,700	
ＡＮＡホールディングス	29,800	4,061.00	121,017,800	
パスコ	300	885.00	265,500	
トランコム	400	6,660.00	2,664,000	
日新	1,400	1,930.00	2,702,000	
三菱倉庫	5,700	2,629.00	14,985,300	
三井倉庫ホールディングス	2,000	1,989.00	3,978,000	
住友倉庫	6,100	1,424.00	8,686,400	
澁澤倉庫	900	1,572.00	1,414,800	
東陽倉庫	3,000	304.00	912,000	
日本トランスシティ	3,600	438.00	1,576,800	
ケイヒン	300	1,358.00	407,400	
中央倉庫	1,000	1,015.00	1,015,000	
川西倉庫	300	1,194.00	358,200	
安田倉庫	1,400	908.00	1,271,200	
ファイズ	200	839.00	167,800	
東洋埠頭	500	1,423.00	711,500	
宇徳	1,400	534.00	747,600	
上組	10,000	2,472.00	24,720,000	
サンリツ	400	686.00	274,400	

キムラユニティー	500	1,110.00	555,000	
キユーソー流通システム	400	2,003.00	801,200	
近鉄エクスプレス	3,100	1,790.00	5,549,000	
東海運	1,000	280.00	280,000	
エーアイテイー	1,100	1,015.00	1,116,500	
内外トランスライン	500	1,414.00	707,000	
日本コンセプト	500	989.00	494,500	
ＮＥＣネッツエスアイ	1,900	2,486.00	4,723,400	
クロスキャット	300	995.00	298,500	
システナ	6,000	1,115.00	6,690,000	
デジタルアーツ	900	8,340.00	7,506,000	
新日鉄住金ソリューションズ	2,500	2,973.00	7,432,500	
キューブシステム	900	876.00	788,400	
エイジア	400	1,173.00	469,200	
コア	700	1,345.00	941,500	
ソリトンシステムズ	1,000	862.00	862,000	
ソフトクリエイトホールディングス	700	1,469.00	1,028,300	
ＴＩＳ	5,600	5,160.00	28,896,000	
ネオス	600	1,016.00	609,600	
電算システム	700	2,398.00	1,678,600	
グリー	11,700	449.00	5,253,300	
コーエーテクモホールディングス	3,400	1,815.00	6,171,000	
三菱総合研究所	700	3,205.00	2,243,500	
ボルテージ	400	580.00	232,000	
電算	200	2,159.00	431,800	
ＡＧＳ	900	679.00	611,100	
ファインデックス	1,400	665.00	931,000	
ヒト・コミュニケーションズ	400	1,656.00	662,400	
ブレインパッド	300	4,915.00	1,474,500	
ＫＬａｂ	3,000	822.00	2,466,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,300	869.00	1,998,700	
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,513.00	453,900	
ネクソン	43,000	1,670.00	71,810,000	
アイスタイル	4,300	630.00	2,709,000	
エムアップ	600	1,832.00	1,099,200	
エイチーム	1,100	1,848.00	2,032,800	
テクノスジャパン	1,500	760.00	1,140,000	
コロプラ	4,800	707.00	3,393,600	
オルトプラス	1,100	321.00	353,100	
ブロードリーフ	8,400	568.00	4,771,200	
クロス・マーケティンググループ	500	361.00	180,500	
デジタルハーツホールディングス	800	1,289.00	1,031,200	

メディアドゥホールディングス	500	2,350.00	1,175,000	
じげん	1,800	562.00	1,011,600	
ブイキューブ	900	379.00	341,100	
サイバーリンクス	200	1,037.00	207,400	
フィックスターズ	1,600	1,281.00	2,049,600	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	900	1,063.00	956,700	
オプティム	400	4,500.00	1,800,000	
セレス	500	1,450.00	725,000	
ベリサーブ	200	6,680.00	1,336,000	
ティーガイア	1,700	2,005.00	3,408,500	
セック	300	3,570.00	1,071,000	
日本アジアグループ	1,900	360.00	684,000	
豆蔵ホールディングス	1,100	982.00	1,080,200	
テクマトリックス	1,200	1,892.00	2,270,400	
プロシップ	400	1,364.00	545,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	40,800	293.00	11,954,400	
GMOペイメントゲートウェイ	2,800	5,660.00	15,848,000	
ザッパラス	900	379.00	341,100	
システムリサーチ	200	3,015.00	603,000	
インターネットイニシアティブ	2,700	2,600.00	7,020,000	
さくらインターネット	2,100	477.00	1,001,700	
ヴィンクス	600	1,263.00	757,800	
GMOクラウド	400	3,500.00	1,400,000	
ＳＲＡホールディングス	900	2,684.00	2,415,600	
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	300	1,617.00	485,100	
システムインテグレータ	500	786.00	393,000	
朝日ネット	1,400	502.00	702,800	
ｅＢＡＳＥ	500	1,744.00	872,000	
アバント	600	1,433.00	859,800	
アドソル日進	600	1,537.00	922,200	
フリービット	1,000	992.00	992,000	
コムチュア	1,000	3,015.00	3,015,000	
サイバーコム	300	2,296.00	688,800	
アステリア	800	852.00	681,600	
マークラインズ	600	1,475.00	885,000	
メディカル・データ・ビジョン	1,500	1,055.00	1,582,500	
ｇｕｍｉ	2,200	613.00	1,348,600	
ショーケース・ティービー	400	685.00	274,000	
モバイルファクトリー	500	1,557.00	778,500	
テラスカイ	100	3,580.00	358,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,333.00	933,100	
ＰＣＩホールディングス	300	2,289.00	686,700	

パイプドＨＤ	300	822.00	246,600	
アイビーシー	300	1,290.00	387,000	
ネオジャパン	300	983.00	294,900	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	100	2,317.00	231,700	
ランドコンピュータ	200	1,043.00	208,600	
ダブルスタンダード	100	3,680.00	368,000	
オープンドア	800	3,085.00	2,468,000	
マイネット	600	1,780.00	1,068,000	
アカツキ	600	5,550.00	3,330,000	
ベネフィットジャパン	100	838.00	83,800	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	300	1,350.00	405,000	
ＬＩＮＥ	5,100	3,970.00	20,247,000	
カナミックネットワーク	300	1,776.00	532,800	
ノムラシステムコーポレーション	100	756.00	75,600	
チェンジ	200	4,125.00	825,000	
シンクロ・フード	700	689.00	482,300	
オークネット	900	940.00	846,000	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,900	822.00	1,561,800	
マクロミル	3,000	1,598.00	4,794,000	
ビーグリー	400	900.00	360,000	
オロ	200	4,735.00	947,000	
ソルクシーズ	700	650.00	455,000	
フェイス	700	820.00	574,000	
ハイマックス	200	1,834.00	366,800	
野村総合研究所	10,700	4,250.00	45,475,000	
サイバネットシステム	1,400	619.00	866,600	
ＣＥホールディングス	400	707.00	282,800	
日本システム技術	300	1,504.00	451,200	
インテージホールディングス	2,200	870.00	1,914,000	
東邦システムサイエンス	500	912.00	456,000	
ソースネクスト	6,600	553.00	3,649,800	
インフォコム	700	3,970.00	2,779,000	
ＦＩＧ	1,600	327.00	523,200	
アルテリア・ネットワークス	1,400	1,225.00	1,715,000	
フォーカスシステムズ	1,100	1,002.00	1,102,200	
クレスコ	500	3,480.00	1,740,000	
フジ・メディア・ホールディングス	17,500	1,564.00	27,370,000	
オービック	5,900	10,320.00	60,888,000	
ジャストシステム	2,400	2,365.00	5,676,000	
ＴＤＣソフト	1,500	865.00	1,297,500	
ヤフー	109,900	314.00	34,508,600	
トレンドマイクロ	9,000	5,590.00	50,310,000	

インフォメーション・ディベロプメント	500	1,384.00	692,000	
日本オラクル	3,400	8,190.00	27,846,000	
アルファシステムズ	500	2,622.00	1,311,000	
フューチャー	2,300	1,756.00	4,038,800	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,200	950.00	1,140,000	
ソフトバンク・テクノロジー	700	2,069.00	1,448,300	
トーセ	500	808.00	404,000	
オービックビジネスコンサルタント	1,700	4,140.00	7,038,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,700	2,549.00	19,627,300	
アイティフォー	2,100	809.00	1,698,900	
東計電算	200	3,020.00	604,000	
エックスネット	300	854.00	256,200	
大塚商会	9,100	3,980.00	36,218,000	
サイボウズ	2,000	638.00	1,276,000	
ソフトブレーン	1,400	506.00	708,400	
電通国際情報サービス	1,000	3,600.00	3,600,000	
デジタルガレージ	3,300	2,806.00	9,259,800	
ＥＭシステムズ	1,400	1,154.00	1,615,600	
ウェザーニューズ	600	2,916.00	1,749,600	
ＣＩＪ	1,300	802.00	1,042,600	
東洋ビジネスエンジニアリング	200	1,910.00	382,000	
日本エンタープライズ	1,900	177.00	336,300	
WOWOW	800	2,876.00	2,300,800	
スカラ	1,200	747.00	896,400	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,400	516.00	722,400	
ネットワンシステムズ	6,000	2,537.00	15,222,000	
システムソフト	4,200	99.00	415,800	
アルゴグラフィックス	700	4,840.00	3,388,000	
マーベラス	2,600	931.00	2,420,600	
エイベックス	2,900	1,467.00	4,254,300	
日本ユニシス	5,300	2,891.00	15,322,300	
兼松エレクトロニクス	900	3,285.00	2,956,500	
東京放送ホールディングス	11,200	1,929.00	21,604,800	
日本テレビホールディングス	15,500	1,729.00	26,799,500	
朝日放送グループホールディングス	1,700	749.00	1,273,300	
テレビ朝日ホールディングス	4,600	1,938.00	8,914,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	12,800	492.00	6,297,600	
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,562.00	3,586,800	
日本ＢＳ放送	600	1,061.00	636,600	
ビジョン	500	4,700.00	2,350,000	
スマートバリュー	400	822.00	328,800	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	700	948.00	663,600	

ワイヤレスゲート	800	470.00	376,000	
コネクシオ	1,300	1,416.00	1,840,800	
クロップス	400	685.00	274,000	
日本電信電話	115,500	4,600.00	531,300,000	
ＫＤＤＩ	148,900	2,671.00	397,711,900	
ソフトバンク	134,300	1,291.00	173,381,300	
光通信	2,000	18,050.00	36,100,000	
ＮＴＴドコモ	121,300	2,563.00	310,891,900	
エムティーアイ	2,000	612.00	1,224,000	
GMOインターネット	6,200	1,587.00	9,839,400	
アイドママーケティングコミュニケーション	400	499.00	199,600	
カドカワ	4,900	1,200.00	5,880,000	
学研ホールディングス	600	4,225.00	2,535,000	
ゼンリン	3,400	2,808.00	9,547,200	
昭文社	800	455.00	364,000	
インプレスホールディングス	1,600	147.00	235,200	
アイネット	1,000	1,339.00	1,339,000	
松竹	1,100	11,110.00	12,221,000	
東宝	11,100	3,920.00	43,512,000	
東映	700	14,050.00	9,835,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	44,900	1,190.00	53,431,000	
ピー・シー・エー	200	2,035.00	407,000	
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,001.00	600,300	
ＤＴＳ	1,900	4,170.00	7,923,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,800	3,345.00	26,091,000	
シーイーシー	1,800	2,121.00	3,817,800	
カプコン	7,200	2,297.00	16,538,400	
アイ・エス・ビー	300	2,049.00	614,700	
ジャステック	1,000	943.00	943,000	
ＳＣＳＫ	4,500	4,685.00	21,082,500	
日本システムウエア	600	2,035.00	1,221,000	
アイネス	2,200	1,304.00	2,868,800	
ＴＫＣ	1,400	3,930.00	5,502,000	
富士ソフト	2,500	4,370.00	10,925,000	
ＮＳＤ	2,800	2,456.00	6,876,800	
コナミホールディングス	6,900	4,385.00	30,256,500	
福井コンピュータホールディングス	600	1,939.00	1,163,400	
ＪＢＣＣホールディングス	1,400	1,714.00	2,399,600	
ミロク情報サービス	1,700	2,585.00	4,394,500	
ソフトバンクグループ	70,500	10,260.00	723,330,000	
ホウスイ	100	897.00	89,700	
高千穂交易	700	997.00	697,900	

伊藤忠食品	400	4,830.00	1,932,000	
エレマテック	800	1,827.00	1,461,600	
ＪＡＬＵＸ	500	2,501.00	1,250,500	
あらた	900	4,395.00	3,955,500	
トーメンデバイス	300	2,397.00	719,100	
東京エレクトロン　デバイス	600	1,809.00	1,085,400	
フィールズ	1,500	734.00	1,101,000	
双日	93,700	413.00	38,698,100	
アルフレッサ　ホールディングス	18,800	3,025.00	56,870,000	
横浜冷凍	4,400	938.00	4,127,200	
神栄	200	759.00	151,800	
ラサ商事	900	842.00	757,800	
ラクーンホールディングス	800	672.00	537,600	
アルコニックス	1,800	1,092.00	1,965,600	
神戸物産	2,600	3,505.00	9,113,000	
あい　ホールディングス	2,400	1,995.00	4,788,000	
ディーブイエックス	600	1,102.00	661,200	
ダイワボウホールディングス	1,600	6,050.00	9,680,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	4,700	1,521.00	7,148,700	
ラクト・ジャパン	400	8,300.00	3,320,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,200	1,102.00	3,526,400	
八洲電機	1,300	818.00	1,063,400	
メディアスホールディングス	900	695.00	625,500	
ＵＫＣホールディングス	1,100	1,987.00	2,185,700	
ジューテックホールディングス	400	1,016.00	406,400	
大光	400	608.00	243,200	
ＯＣＨＩホールディングス	500	1,161.00	580,500	
ＴＯＫＡＩホールディングス	9,000	886.00	7,974,000	
黒谷	300	474.00	142,200	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	300	818.00	245,400	
三洋貿易	900	1,992.00	1,792,800	
ビューティガレージ	300	1,507.00	452,100	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,128.00	1,240,800	
ミタチ産業	400	739.00	295,600	
シップヘルスケアホールディングス	3,500	4,195.00	14,682,500	
明治電機工業	600	1,749.00	1,049,400	
デリカフーズホールディングス	300	1,353.00	405,900	
スターティアホールディングス	300	604.00	181,200	
コメダホールディングス	3,900	2,101.00	8,193,900	
富士興産	700	631.00	441,700	
協栄産業	200	1,494.00	298,800	
小野建	1,500	1,613.00	2,419,500	

南陽	300	2,270.00	681,000	
佐鳥電機	1,300	949.00	1,233,700	
エコートレーディング	400	599.00	239,600	
伯東	1,100	1,186.00	1,304,600	
コンドーテック	1,300	1,000.00	1,300,000	
中山福	1,000	529.00	529,000	
ナガイレーベン	2,400	2,278.00	5,467,200	
三菱食品	1,800	2,881.00	5,185,800	
松田産業	1,200	1,426.00	1,711,200	
第一興商	2,500	5,340.00	13,350,000	
メディパルホールディングス	18,300	2,546.00	46,591,800	
ＳＰＫ	400	2,270.00	908,000	
萩原電気ホールディングス	600	2,986.00	1,791,600	
アズワン	1,200	8,120.00	9,744,000	
スズデン	600	1,587.00	952,200	
シモジマ	1,000	1,116.00	1,116,000	
ドウシシャ	1,600	1,624.00	2,598,400	
小津産業	400	1,861.00	744,400	
高速	1,000	1,073.00	1,073,000	
たけびし	600	1,411.00	846,600	
リックス	400	1,627.00	650,800	
丸文	1,500	710.00	1,065,000	
ハピネット	1,400	1,576.00	2,206,400	
橋本総業ホールディングス	300	1,420.00	426,000	
日本ライフライン	5,300	1,633.00	8,654,900	
タカショー	1,000	429.00	429,000	
エクセル	600	2,164.00	1,298,400	
マルカキカイ	600	2,029.00	1,217,400	
ＩＤＯＭ	5,800	382.00	2,215,600	
日本エム・ディ・エム	1,000	1,078.00	1,078,000	
進和	1,000	2,107.00	2,107,000	
エスケイジャパン	400	644.00	257,600	
ダイトロン	800	1,575.00	1,260,000	
シークス	2,100	1,521.00	3,194,100	
田中商事	600	601.00	360,600	
オーハシテクニカ	1,000	1,391.00	1,391,000	
白銅	500	1,580.00	790,000	
伊藤忠商事	118,400	1,999.50	236,740,800	
丸紅	167,100	782.60	130,772,460	
高島	300	1,773.00	531,900	
長瀬産業	9,500	1,628.00	15,466,000	
蝶理	1,100	1,544.00	1,698,400	

豊田通商	18,900	3,405.00	64,354,500	
三共生興	2,900	415.00	1,203,500	
兼松	6,800	1,271.00	8,642,800	
ツカモトコーポレーション	300	1,012.00	303,600	
三井物産	139,500	1,717.00	239,521,500	
日本紙パルプ商事	1,000	4,145.00	4,145,000	
日立ハイテクノロジーズ	5,200	4,170.00	21,684,000	
カメイ	2,200	1,157.00	2,545,400	
東都水産	300	2,500.00	750,000	
ＯＵＧホールディングス	300	2,438.00	731,400	
スターゼン	600	4,055.00	2,433,000	
山善	6,600	1,161.00	7,662,600	
椿本興業	400	3,530.00	1,412,000	
住友商事	100,200	1,574.00	157,714,800	
内田洋行	800	2,242.00	1,793,600	
三菱商事	118,900	3,120.00	370,968,000	
第一実業	800	3,365.00	2,692,000	
キヤノンマーケティングジャパン	4,800	2,039.00	9,787,200	
西華産業	1,000	1,421.00	1,421,000	
佐藤商事	1,500	879.00	1,318,500	
菱洋エレクトロ	1,700	1,507.00	2,561,900	
東京産業	1,700	529.00	899,300	
ユアサ商事	1,700	3,370.00	5,729,000	
神鋼商事	400	2,465.00	986,000	
小林産業	1,100	275.00	302,500	
阪和興業	2,900	2,870.00	8,323,000	
正栄食品工業	900	2,874.00	2,586,600	
カナデン	1,600	1,260.00	2,016,000	
菱電商事	1,400	1,378.00	1,929,200	
フルサト工業	900	1,630.00	1,467,000	
岩谷産業	3,800	3,695.00	14,041,000	
すてきナイスグループ	700	869.00	608,300	
昭光通商	700	623.00	436,100	
ニチモウ	300	1,715.00	514,500	
極東貿易	500	1,685.00	842,500	
イワキ	2,100	405.00	850,500	
三愛石油	4,500	956.00	4,302,000	
稲畑産業	4,100	1,503.00	6,162,300	
ＧＳＩクレオス	500	1,169.00	584,500	
明和産業	1,600	448.00	716,800	
ワキタ	3,600	1,182.00	4,255,200	
東邦ホールディングス	5,000	2,650.00	13,250,000	

サンゲツ	5,100	2,072.00	10,567,200	
ミツウロコグループホールディングス	2,500	806.00	2,015,000	
シナネンホールディングス	700	2,206.00	1,544,200	
伊藤忠エネクス	3,700	915.00	3,385,500	
サンリオ	5,200	2,235.00	11,622,000	
サンワテクノス	1,000	938.00	938,000	
リョーサン	1,900	3,105.00	5,899,500	
新光商事	1,600	1,854.00	2,966,400	
トーホー	800	2,046.00	1,636,800	
三信電気	1,400	1,841.00	2,577,400	
東陽テクニカ	2,000	857.00	1,714,000	
モスフードサービス	2,200	2,703.00	5,946,600	
加賀電子	1,700	2,132.00	3,624,400	
ソーダニッカ	1,800	534.00	961,200	
立花エレテック	1,300	1,610.00	2,093,000	
フォーバル	800	867.00	693,600	
ＰＡＬＴＡＣ	3,100	5,360.00	16,616,000	
三谷産業	2,000	272.00	544,000	
太平洋興発	700	735.00	514,500	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	400	4,630.00	1,852,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,201.00	120,100	
国際紙パルプ商事	3,100	268.00	830,800	
ヤマタネ	900	1,654.00	1,488,600	
丸紅建材リース	200	1,927.00	385,400	
日鉄住金物産	1,200	4,620.00	5,544,000	
泉州電業	600	2,589.00	1,553,400	
トラスコ中山	3,500	3,165.00	11,077,500	
オートバックスセブン	6,700	1,871.00	12,535,700	
モリト	1,200	715.00	858,000	
加藤産業	2,700	3,275.00	8,842,500	
北恵	400	923.00	369,200	
イノテック	1,000	991.00	991,000	
イエローハット	1,600	2,736.00	4,377,600	
ＪＫホールディングス	1,500	562.00	843,000	
日伝	1,400	1,560.00	2,184,000	
北沢産業	1,400	265.00	371,000	
杉本商事	900	1,718.00	1,546,200	
因幡電機産業	2,400	4,605.00	11,052,000	
バイテックホールディングス	800	1,964.00	1,571,200	
東テク	600	2,208.00	1,324,800	
ミスミグループ本社	21,200	2,591.00	54,929,200	
アルテック	1,400	222.00	310,800	

タキヒヨー	500	1,787.00	893,500	
蔵王産業	300	1,272.00	381,600	
スズケン	7,700	5,830.00	44,891,000	
ジェコス	1,200	1,033.00	1,239,600	
ルネサスイーストン	1,500	433.00	649,500	
ローソン	4,300	6,610.00	28,423,000	
サンエー	1,300	4,445.00	5,778,500	
カワチ薬品	1,300	2,039.00	2,650,700	
エービーシー・マート	2,600	6,160.00	16,016,000	
ハードオフコーポレーション	700	818.00	572,600	
アスクル	1,800	2,132.00	3,837,600	
ゲオホールディングス	2,600	1,534.00	3,988,400	
アダストリア	2,400	1,892.00	4,540,800	
ジーフット	1,000	675.00	675,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	300	760.00	228,000	
くらコーポレーション	1,000	5,220.00	5,220,000	
キャンドゥ	800	1,533.00	1,226,400	
パルグループホールディングス	900	3,050.00	2,745,000	
エディオン	7,200	950.00	6,840,000	
サーラコーポレーション	3,400	568.00	1,931,200	
ワッツ	600	726.00	435,600	
ハローズ	600	2,260.00	1,356,000	
あみやき亭	400	3,620.00	1,448,000	
ひらまつ	3,400	342.00	1,162,800	
大黒天物産	400	4,010.00	1,604,000	
ハニーズホールディングス	1,500	946.00	1,419,000	
ファーマライズホールディングス	400	538.00	215,200	
アルペン	1,300	1,641.00	2,133,300	
ハブ	600	940.00	564,000	
クオールホールディングス	2,500	1,408.00	3,520,000	
ジンズ	1,100	5,270.00	5,797,000	
ビックカメラ	9,000	1,232.00	11,088,000	
ＤＣＭホールディングス	9,100	1,110.00	10,101,000	
ペッパーフードサービス	1,300	2,676.00	3,478,800	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	10,700	2,330.00	24,931,000	
東京一番フーズ	500	594.00	297,000	
ＤＤホールディングス	400	2,096.00	838,400	
きちりホールディングス	500	700.00	350,000	
アークランドサービスホールディングス	1,300	2,170.00	2,821,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	21,700	1,215.00	26,365,500	
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,143.00	6,429,000	
マツモトキヨシホールディングス	7,000	3,265.00	22,855,000	

ブロンコビリー	900	2,603.00	2,342,700	
ＺＯＺＯ	18,300	1,848.00	33,818,400	
トレジャー・ファクトリー	500	812.00	406,000	
物語コーポレーション	400	9,520.00	3,808,000	
ココカラファイン	1,900	4,950.00	9,405,000	
三越伊勢丹ホールディングス	31,700	1,060.00	33,602,000	
Ｈａｍｅｅ	500	812.00	406,000	
ウエルシアホールディングス	4,500	4,150.00	18,675,000	
クリエイトＳＤホールディングス	2,500	2,819.00	7,047,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	2,000	326.00	652,000	
ミサワ	400	407.00	162,800	
ティーライフ	200	885.00	177,000	
エー・ピーカンパニー	400	456.00	182,400	
チムニー	500	2,635.00	1,317,500	
シュッピン	1,200	724.00	868,800	
ネクステージ	2,600	925.00	2,405,000	
ジョイフル本田	5,000	1,389.00	6,945,000	
鳥貴族	600	1,749.00	1,049,400	
キリン堂ホールディングス	700	1,463.00	1,024,100	
ホットランド	900	1,267.00	1,140,300	
すかいらーくホールディングス	15,800	1,824.00	28,819,200	
綿半ホールディングス	600	2,084.00	1,250,400	
ヨシックス	300	3,295.00	988,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,900	1,195.00	5,855,500	
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	641.00	448,700	
ＢＥＥＮＯＳ	400	1,118.00	447,200	
あさひ	1,400	1,476.00	2,066,400	
日本調剤	600	3,880.00	2,328,000	
コスモス薬品	700	21,130.00	14,791,000	
トーエル	800	700.00	560,000	
オンリー	300	975.00	292,500	
セブン＆アイ・ホールディングス	71,000	4,843.00	343,853,000	
薬王堂	700	2,562.00	1,793,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,500	1,239.00	5,575,500	
ツルハホールディングス	3,700	9,840.00	36,408,000	
サンマルクホールディングス	1,300	2,546.00	3,309,800	
フェリシモ	400	1,098.00	439,200	
トリドールホールディングス	2,100	1,983.00	4,164,300	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,500	881.00	1,321,500	
ウイルプラスホールディングス	100	732.00	73,200	
ジャパンミート	700	1,700.00	1,190,000	

サツドラホールディングス	300	1,820.00	546,000	
デファクトスタンダード	100	400.00	40,000	
ダイユー・リックホールディングス	900	968.00	871,200	
バロックジャパンリミテッド	1,400	910.00	1,274,000	
クスリのアオキホールディングス	1,600	7,260.00	11,616,000	
力の源ホールディングス	500	787.00	393,500	
スシローグローバルホールディングス	1,900	7,170.00	13,623,000	
ＬＩＸＩＬビバ	1,400	1,457.00	2,039,800	
メディカルシステムネットワーク	1,800	443.00	797,400	
はるやまホールディングス	800	815.00	652,000	
ノジマ	3,000	1,993.00	5,979,000	
カッパ・クリエイト	2,400	1,373.00	3,295,200	
ライトオン	1,500	798.00	1,197,000	
ジーンズメイト	600	389.00	233,400	
良品計画	2,400	26,470.00	63,528,000	
三城ホールディングス	2,100	400.00	840,000	
アドヴァン	2,600	984.00	2,558,400	
アルビス	700	2,369.00	1,658,300	
コナカ	2,200	431.00	948,200	
ハウス　オブ　ローゼ	200	1,832.00	366,400	
Ｇ－７ホールディングス	500	2,250.00	1,125,000	
イオン北海道	1,700	790.00	1,343,000	
コジマ	2,600	583.00	1,515,800	
ヒマラヤ	600	1,002.00	601,200	
コーナン商事	2,200	2,722.00	5,988,400	
エコス	600	1,670.00	1,002,000	
ワタミ	2,200	1,399.00	3,077,800	
マルシェ	500	770.00	385,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	10,200	6,670.00	68,034,000	
西松屋チェーン	3,700	898.00	3,322,600	
ゼンショーホールディングス	8,000	2,453.00	19,624,000	
幸楽苑ホールディングス	1,100	2,253.00	2,478,300	
ハークスレイ	400	1,118.00	447,200	
サイゼリヤ	2,800	2,050.00	5,740,000	
ＶＴホールディングス	5,700	410.00	2,337,000	
魚力	500	1,425.00	712,500	
ポプラ	500	582.00	291,000	
フジ・コーポレーション	300	2,044.00	613,200	
ユナイテッドアローズ	1,900	3,720.00	7,068,000	
ハイデイ日高	2,200	2,202.00	4,844,400	
京都きもの友禅	1,100	431.00	474,100	
コロワイド	5,600	2,304.00	12,902,400	

ピーシーデポコーポレーション	2,200	426.00	937,200	
壱番屋	1,200	4,655.00	5,586,000	
ＰＬＡＮＴ	400	993.00	397,200	
スギホールディングス	3,700	4,540.00	16,798,000	
ヴィア・ホールディングス	2,100	646.00	1,356,600	
スクロール	2,600	391.00	1,016,600	
ヨンドシーホールディングス	1,900	2,173.00	4,128,700	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	4,700	12,410.00	58,327,000	
木曽路	2,100	2,485.00	5,218,500	
ＳＲＳホールディングス	2,000	994.00	1,988,000	
千趣会	3,100	233.00	722,300	
タカキュー	1,500	187.00	280,500	
ケーヨー	3,200	530.00	1,696,000	
上新電機	2,000	2,300.00	4,600,000	
日本瓦斯	2,700	4,100.00	11,070,000	
ロイヤルホールディングス	3,000	2,663.00	7,989,000	
東天紅	100	1,329.00	132,900	
いなげや	1,900	1,355.00	2,574,500	
島忠	3,800	3,030.00	11,514,000	
チヨダ	1,800	1,857.00	3,342,600	
ライフコーポレーション	1,300	2,457.00	3,194,100	
リンガーハット	2,100	2,369.00	4,974,900	
ＭｒＭａｘＨＤ	2,300	504.00	1,159,200	
テンアライド	1,700	397.00	674,900	
ＡＯＫＩホールディングス	3,400	1,246.00	4,236,400	
オークワ	2,400	1,036.00	2,486,400	
コメリ	2,600	2,750.00	7,150,000	
青山商事	3,000	2,589.00	7,767,000	
しまむら	2,000	9,380.00	18,760,000	
はせがわ	1,000	396.00	396,000	
高島屋	13,300	1,437.00	19,112,100	
松屋	3,400	1,079.00	3,668,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	8,700	1,508.00	13,119,600	
近鉄百貨店	600	3,370.00	2,022,000	
パルコ	1,600	1,083.00	1,732,800	
丸井グループ	14,300	1,982.00	28,342,600	
アクシアル　リテイリング	1,400	3,495.00	4,893,000	
イオン	65,200	2,257.50	147,189,000	
イズミ	3,400	5,330.00	18,122,000	
平和堂	3,500	2,511.00	8,788,500	
フジ	2,000	1,848.00	3,696,000	
ヤオコー	1,900	5,760.00	10,944,000	

ゼビオホールディングス	2,000	1,286.00	2,572,000	
ケーズホールディングス	17,600	961.00	16,913,600	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	1,000	666.00	666,000	
日産東京販売ホールディングス	2,500	319.00	797,500	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	800	2,591.00	2,072,800	
総合メディカルホールディングス	1,500	1,919.00	2,878,500	
ブックオフグループホールディングス	900	771.00	693,900	
アインホールディングス	2,300	7,560.00	17,388,000	
元気寿司	500	3,940.00	1,970,000	
ヤマダ電機	51,600	538.00	27,760,800	
アークランドサカモト	2,900	1,390.00	4,031,000	
ニトリホールディングス	7,300	13,875.00	101,287,500	
愛眼	1,400	297.00	415,800	
ケーユーホールディングス	800	788.00	630,400	
吉野家ホールディングス	6,000	1,798.00	10,788,000	
松屋フーズホールディングス	800	3,590.00	2,872,000	
サガミホールディングス	2,300	1,324.00	3,045,200	
関西スーパーマーケット	1,300	999.00	1,298,700	
王将フードサービス	1,200	7,220.00	8,664,000	
プレナス	1,900	1,843.00	3,501,700	
ミニストップ	1,300	1,941.00	2,523,300	
アークス	3,200	2,512.00	8,038,400	
バローホールディングス	3,700	2,748.00	10,167,600	
藤久	100	743.00	74,300	
ベルク	800	4,880.00	3,904,000	
大庄	900	1,538.00	1,384,200	
ファーストリテイリング	2,300	49,220.00	113,206,000	
サンドラッグ	6,400	3,235.00	20,704,000	
サックスバー　ホールディングス	1,500	1,091.00	1,636,500	
ヤマザワ	300	1,779.00	533,700	
やまや	300	2,264.00	679,200	
ベルーナ	4,100	853.00	3,497,300	
島根銀行	400	703.00	281,200	
じもとホールディングス	11,500	118.00	1,357,000	
めぶきフィナンシャルグループ	87,800	297.00	26,076,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,561.00	3,590,300	
九州フィナンシャルグループ	27,800	451.00	12,537,800	
ゆうちょ銀行	47,900	1,265.00	60,593,500	
富山第一銀行	4,000	377.00	1,508,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	108,000	440.00	47,520,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,900	966.00	10,529,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,900	838.00	6,620,200	

三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,589.00	2,383,500	
第四北越フィナンシャルグループ	2,900	3,190.00	9,251,000	
新生銀行	12,500	1,462.00	18,275,000	
あおぞら銀行	9,500	3,150.00	29,925,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,181,400	580.90	686,275,260	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	186,300	516.50	96,223,950	
三井住友トラスト・ホールディングス	33,400	4,059.00	135,570,600	
三井住友フィナンシャルグループ	119,600	3,931.00	470,147,600	代用有価証券 13,000株
千葉銀行	60,100	672.00	40,387,200	
群馬銀行	33,900	467.00	15,831,300	
武蔵野銀行	2,500	2,422.00	6,055,000	
千葉興業銀行	4,700	338.00	1,588,600	
筑波銀行	7,100	207.00	1,469,700	
七十七銀行	5,300	1,813.00	9,608,900	
青森銀行	1,300	2,666.00	3,465,800	
秋田銀行	1,100	2,133.00	2,346,300	
山形銀行	1,900	1,890.00	3,591,000	
岩手銀行	1,200	3,300.00	3,960,000	
東邦銀行	15,200	306.00	4,651,200	
東北銀行	900	1,059.00	953,100	
みちのく銀行	1,100	1,619.00	1,780,900	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,800	2,369.00	32,692,200	
静岡銀行	42,700	866.00	36,978,200	
十六銀行	2,300	2,267.00	5,214,100	
スルガ銀行	17,500	457.00	7,997,500	
八十二銀行	30,700	453.00	13,907,100	
山梨中央銀行	2,100	1,338.00	2,809,800	
大垣共立銀行	2,700	2,261.00	6,104,700	
福井銀行	1,500	1,600.00	2,400,000	
北國銀行	1,800	3,335.00	6,003,000	
清水銀行	700	1,651.00	1,155,700	
富山銀行	300	3,145.00	943,500	
滋賀銀行	3,400	2,461.00	8,367,400	
南都銀行	2,000	2,174.00	4,348,000	
百五銀行	15,200	376.00	5,715,200	
京都銀行	6,100	4,550.00	27,755,000	
紀陽銀行	6,000	1,527.00	9,162,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,300	1,193.00	13,480,900	
広島銀行	25,100	614.00	15,411,400	
山陰合同銀行	10,000	779.00	7,790,000	
中国銀行	10,900	1,021.00	11,128,900	

鳥取銀行	600	1,356.00	813,600	
伊予銀行	22,500	606.00	13,635,000	
百十四銀行	1,800	2,432.00	4,377,600	
四国銀行	2,400	1,025.00	2,460,000	
阿波銀行	2,700	3,085.00	8,329,500	
大分銀行	1,000	3,340.00	3,340,000	
宮崎銀行	1,100	2,607.00	2,867,700	
佐賀銀行	1,000	1,734.00	1,734,000	
十八銀行	1,000	2,622.00	2,622,000	
沖縄銀行	1,500	3,260.00	4,890,000	
琉球銀行	3,900	1,078.00	4,204,200	
セブン銀行	57,400	338.00	19,401,200	
みずほフィナンシャルグループ	2,305,000	173.40	399,687,000	
高知銀行	600	732.00	439,200	
山口フィナンシャルグループ	21,200	1,051.00	22,281,200	
長野銀行	600	1,519.00	911,400	
名古屋銀行	1,400	3,275.00	4,585,000	
北洋銀行	25,600	289.00	7,398,400	
愛知銀行	600	3,425.00	2,055,000	
中京銀行	700	2,142.00	1,499,400	
大光銀行	600	1,660.00	996,000	
愛媛銀行	2,400	1,051.00	2,522,400	
トマト銀行	600	1,055.00	633,000	
京葉銀行	7,500	658.00	4,935,000	
栃木銀行	8,800	230.00	2,024,000	
北日本銀行	500	2,042.00	1,021,000	
東和銀行	3,000	684.00	2,052,000	
福島銀行	1,500	376.00	564,000	
大東銀行	800	613.00	490,400	
トモニホールディングス	13,100	398.00	5,213,800	
フィデアホールディングス	16,500	134.00	2,211,000	
池田泉州ホールディングス	17,900	302.00	5,405,800	
ＦＰＧ	5,300	1,028.00	5,448,400	
マーキュリアインベストメント	700	734.00	513,800	
ＳＢＩホールディングス	20,200	2,203.00	44,500,600	
ジャフコ	2,800	3,745.00	10,486,000	
大和証券グループ本社	136,000	546.10	74,269,600	
野村ホールディングス	298,500	436.70	130,354,950	
岡三証券グループ	14,500	479.00	6,945,500	
丸三証券	5,100	801.00	4,085,100	
東洋証券	6,400	160.00	1,024,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20,200	482.00	9,736,400	

光世証券	500	729.00	364,500	
水戸証券	5,100	257.00	1,310,700	
いちよし証券	3,600	849.00	3,056,400	
松井証券	8,400	1,162.00	9,760,800	
だいこう証券ビジネス	800	405.00	324,000	
マネックスグループ	16,000	383.00	6,128,000	
カブドットコム証券	12,700	529.00	6,718,300	
極東証券	2,300	1,155.00	2,656,500	
岩井コスモホールディングス	1,800	1,197.00	2,154,600	
藍澤證券	3,200	667.00	2,134,400	
マネーパートナーズグループ	2,100	289.00	606,900	
かんぽ生命保険	6,400	2,478.00	15,859,200	
ＳＯＭＰＯホールディングス	29,900	4,009.00	119,869,100	
アニコム　ホールディングス	1,400	2,806.00	3,928,400	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	44,300	3,237.00	143,399,100	
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,900	2,110.00	29,329,000	
第一生命ホールディングス	96,000	1,761.50	169,104,000	
東京海上ホールディングス	61,500	5,349.00	328,963,500	
Ｔ＆Ｄホールディングス	52,500	1,385.00	72,712,500	
アドバンスクリエイト	400	1,784.00	713,600	
全国保証	4,800	4,030.00	19,344,000	
ジェイリース	400	371.00	148,400	
イントラスト	500	428.00	214,000	
日本モーゲージサービス	300	1,307.00	392,100	
Ｃａｓａ	600	1,134.00	680,400	
アルヒ	1,500	2,080.00	3,120,000	
プレミアグループ	300	3,195.00	958,500	
クレディセゾン	11,900	1,524.00	18,135,600	
芙蓉総合リース	1,900	5,440.00	10,336,000	
興銀リース	3,200	2,582.00	8,262,400	
東京センチュリー	3,400	5,030.00	17,102,000	
日本証券金融	7,500	605.00	4,537,500	
アイフル	26,100	281.00	7,334,100	
リコーリース	1,300	3,485.00	4,530,500	
イオンフィナンシャルサービス	10,800	2,121.00	22,906,800	
アコム	34,100	369.00	12,582,900	
ジャックス	1,900	1,854.00	3,522,600	
オリエントコーポレーション	45,900	118.00	5,416,200	
日立キャピタル	4,000	2,438.00	9,752,000	
アプラスフィナンシャル	8,200	83.00	680,600	
オリックス	113,100	1,623.00	183,561,300	
三菱ＵＦＪリース	38,200	567.00	21,659,400	

九州リースサービス	900	689.00	620,100	
日本取引所グループ	45,800	1,895.00	86,791,000	
イー・ギャランティ	1,600	1,103.00	1,764,800	
アサックス	700	513.00	359,100	
ＮＥＣキャピタルソリューション	700	1,644.00	1,150,800	
いちご	21,600	376.00	8,121,600	
日本駐車場開発	20,600	160.00	3,296,000	
ヒューリック	35,400	983.00	34,798,200	
三栄建築設計	700	1,673.00	1,171,100	
スター・マイカ	800	1,496.00	1,196,800	
野村不動産ホールディングス	11,300	2,077.00	23,470,100	
三重交通グループホールディングス	3,500	612.00	2,142,000	
サムティ	2,400	1,513.00	3,631,200	
ディア・ライフ	2,200	408.00	897,600	
コーセーアールイー	500	740.00	370,000	
エー・ディー・ワークス	27,500	34.00	935,000	
日本商業開発	1,100	1,505.00	1,655,500	
プレサンスコーポレーション	2,700	1,393.00	3,761,100	
ユニゾホールディングス	2,600	2,183.00	5,675,800	
ＴＨＥグローバル社	900	486.00	437,400	
日本管理センター	1,100	845.00	929,500	
サンセイランディック	500	777.00	388,500	
エストラスト	300	772.00	231,600	
フージャースホールディングス	3,700	661.00	2,445,700	
オープンハウス	2,800	4,460.00	12,488,000	
東急不動産ホールディングス	45,700	610.00	27,877,000	
飯田グループホールディングス	14,100	1,990.00	28,059,000	
イーグランド	300	673.00	201,900	
ムゲンエステート	1,200	601.00	721,200	
ビーロット	300	1,272.00	381,600	
ファーストブラザーズ	500	1,073.00	536,500	
ハウスドゥ	900	1,512.00	1,360,800	
シーアールイー	600	895.00	537,000	
プロパティエージェント	200	1,127.00	225,400	
ケイアイスター不動産	500	1,933.00	966,500	
アグレ都市デザイン	200	619.00	123,800	
グッドコムアセット	300	1,514.00	454,200	
ジェイ・エス・ビー	100	4,280.00	428,000	
テンポイノベーション	100	1,680.00	168,000	
パーク２４	9,900	2,613.00	25,868,700	
パラカ	400	1,700.00	680,000	
三井不動産	90,000	2,610.50	234,945,000	

三菱地所	118,900	1,840.00	218,776,000	
平和不動産	3,200	2,062.00	6,598,400	
東京建物	18,600	1,340.00	24,924,000	
ダイビル	5,000	1,060.00	5,300,000	
京阪神ビルディング	3,100	900.00	2,790,000	
住友不動産	38,100	4,069.00	155,028,900	
テーオーシー	3,900	814.00	3,174,600	
東京楽天地	200	4,645.00	929,000	
レオパレス２１	21,000	335.00	7,035,000	
スターツコーポレーション	2,300	2,456.00	5,648,800	
フジ住宅	2,200	835.00	1,837,000	
空港施設	2,000	540.00	1,080,000	
明和地所	1,000	594.00	594,000	
ゴールドクレスト	1,400	1,626.00	2,276,400	
日本エスリード	700	1,575.00	1,102,500	
日神不動産	2,500	454.00	1,135,000	
日本エスコン	3,100	809.00	2,507,900	
タカラレーベン	8,000	345.00	2,760,000	
サンヨーハウジング名古屋	1,000	924.00	924,000	
イオンモール	8,500	1,839.00	15,631,500	
毎日コムネット	300	756.00	226,800	
ファースト住建	700	1,163.00	814,100	
カチタス	1,900	3,425.00	6,507,500	
トーセイ	2,400	1,052.00	2,524,800	
穴吹興産	200	2,690.00	538,000	
サンフロンティア不動産	2,400	1,226.00	2,942,400	
エフ・ジェー・ネクスト	1,500	871.00	1,306,500	
インテリックス	500	641.00	320,500	
ランドビジネス	900	770.00	693,000	
グランディハウス	1,500	425.00	637,500	
日本空港ビルデング	5,400	4,300.00	23,220,000	
日本工営	1,100	2,520.00	2,772,000	
ＬＩＦＵＬＬ	6,400	708.00	4,531,200	
ジェイエイシーリクルートメント	1,300	2,393.00	3,110,900	
日本M＆Aセンター	12,200	2,830.00	34,526,000	
メンバーズ	600	1,374.00	824,400	
中広	200	552.00	110,400	
タケエイ	1,700	785.00	1,334,500	
Ｅ・Ｊホールディングス	200	1,040.00	208,000	
トラスト・テック	900	3,710.00	3,339,000	
コシダカホールディングス	4,400	1,523.00	6,701,200	
アルトナー	300	901.00	270,300	

パソナグループ	2,000	1,441.00	2,882,000	
ＣＤＳ	400	1,127.00	450,800	
リンクアンドモチベーション	3,000	919.00	2,757,000	
ＧＣＡ	1,700	792.00	1,346,400	
エス・エム・エス	6,100	1,886.00	11,504,600	
サニーサイドアップ	200	1,300.00	260,000	
パーソルホールディングス	16,400	1,947.00	31,930,800	
リニカル	900	1,400.00	1,260,000	
クックパッド	5,200	279.00	1,450,800	
エスクリ	400	645.00	258,000	
アイ・ケイ・ケイ	800	724.00	579,200	
学情	700	1,319.00	923,300	
スタジオアリス	800	2,415.00	1,932,000	
シミックホールディングス	900	1,536.00	1,382,400	
ＮＪＳ	400	1,568.00	627,200	
綜合警備保障	6,500	4,820.00	31,330,000	
カカクコム	12,400	2,031.00	25,184,400	
アイロムグループ	600	1,469.00	881,400	
セントケア・ホールディング	900	555.00	499,500	
サイネックス	300	674.00	202,200	
ルネサンス	900	1,951.00	1,755,900	
ディップ	2,700	1,995.00	5,386,500	
オプトホールディング	1,000	1,736.00	1,736,000	
新日本科学	2,300	786.00	1,807,800	
ツクイ	3,900	738.00	2,878,200	
キャリアデザインセンター	400	1,216.00	486,400	
ベネフィット・ワン	2,300	3,915.00	9,004,500	
エムスリー	34,600	1,590.00	55,014,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,000	619.00	619,000	
ブラス	100	559.00	55,900	
アウトソーシング	8,700	1,404.00	12,214,800	
ウェルネット	1,600	1,077.00	1,723,200	
ワールドホールディングス	400	2,787.00	1,114,800	
ディー・エヌ・エー	8,900	1,684.00	14,987,600	
博報堂ＤＹホールディングス	22,900	1,686.00	38,609,400	
ぐるなび	2,400	705.00	1,692,000	
エスアールジータカミヤ	1,700	671.00	1,140,700	
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	1,215.00	1,579,500	
ファンコミュニケーションズ	4,500	526.00	2,367,000	
ライク	600	930.00	558,000	
ビジネス・ブレークスルー	700	370.00	259,000	
ＷＤＢホールディングス	800	2,948.00	2,358,400	

ティア	800	671.00	536,800	
ＣＤＧ	100	1,344.00	134,400	
バリューコマース	1,100	1,917.00	2,108,700	
インフォマート	9,000	1,241.00	11,169,000	
ＪＰホールディングス	4,700	293.00	1,377,100	
エコナックホールディングス	3,300	122.00	402,600	
ＥＰＳホールディングス	2,400	1,737.00	4,168,800	
レッグス	400	998.00	399,200	
プレステージ・インターナショナル	3,100	1,265.00	3,921,500	
アミューズ	1,000	2,624.00	2,624,000	
ドリームインキュベータ	500	1,474.00	737,000	
クイック	1,000	1,602.00	1,602,000	
ＴＡＣ	900	232.00	208,800	
ケネディクス	14,500	543.00	7,873,500	
電通	20,000	4,955.00	99,100,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,961.00	1,372,700	
ぴあ	500	3,905.00	1,952,500	
イオンファンタジー	500	2,656.00	1,328,000	
シーティーエス	1,900	643.00	1,221,700	
みらかホールディングス	4,600	2,932.00	13,487,200	
アルプス技研	1,500	1,980.00	2,970,000	
日本空調サービス	1,900	653.00	1,240,700	
オリエンタルランド	19,400	11,970.00	232,218,000	
ダスキン	4,400	2,593.00	11,409,200	
明光ネットワークジャパン	2,100	930.00	1,953,000	
ファルコホールディングス	900	1,384.00	1,245,600	
秀英予備校	400	489.00	195,600	
田谷	300	634.00	190,200	
ラウンドワン	5,100	1,358.00	6,925,800	
リゾートトラスト	7,000	1,528.00	10,696,000	
ビー・エム・エル	2,100	3,320.00	6,972,000	
ワタベウェディング	300	655.00	196,500	
りらいあコミュニケーションズ	3,000	892.00	2,676,000	
リソー教育	8,400	480.00	4,032,000	
早稲田アカデミー	300	1,711.00	513,300	
ユー・エス・エス	20,000	1,923.00	38,460,000	
東京個別指導学院	600	1,327.00	796,200	
サイバーエージェント	10,100	3,270.00	33,027,000	
楽天	76,600	816.00	62,505,600	
クリーク・アンド・リバー社	1,000	1,139.00	1,139,000	
テー・オー・ダブリュー	1,500	736.00	1,104,000	
セントラルスポーツ	600	3,440.00	2,064,000	

フルキャストホールディングス	1,600	2,104.00	3,366,400	
エン・ジャパン	1,800	4,000.00	7,200,000	
リソルホールディングス	200	4,150.00	830,000	
テクノプロ・ホールディングス	3,300	6,090.00	20,097,000	
アトラ	300	413.00	123,900	
インターワークス	300	727.00	218,100	
アイ・アールジャパンホールディングス	500	1,278.00	639,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	600	1,086.00	651,600	
ファーストロジック	300	663.00	198,900	
三機サービス	300	1,437.00	431,100	
Ｇｕｎｏｓｙ	1,200	2,498.00	2,997,600	
デザインワン・ジャパン	300	311.00	93,300	
イー・ガーディアン	800	2,082.00	1,665,600	
リブセンス	900	284.00	255,600	
ジャパンマテリアル	4,500	1,267.00	5,701,500	
ベクトル	2,000	1,360.00	2,720,000	
ウチヤマホールディングス	800	466.00	372,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	400	1,533.00	613,200	
ライクキッズネクスト	400	861.00	344,400	
キャリアリンク	600	358.00	214,800	
ＩＢＪ	1,100	831.00	914,100	
アサンテ	700	2,223.00	1,556,100	
Ｎ・フィールド	1,100	1,000.00	1,100,000	
バリューＨＲ	300	1,833.00	549,900	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	400	5,420.00	2,168,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,324.00	926,800	
ＥＲＩホールディングス	500	751.00	375,500	
アビスト	200	3,145.00	629,000	
シグマクシス	800	865.00	692,000	
ウィルグループ	1,100	1,096.00	1,205,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,300	244.00	561,200	
日本ビューホテル	500	1,104.00	552,000	
リクルートホールディングス	117,700	2,959.00	348,274,300	
エラン	1,200	1,309.00	1,570,800	
土木管理総合試験所	800	534.00	427,200	
日本郵政	134,600	1,322.00	177,941,200	
ベルシステム２４ホールディングス	2,700	1,463.00	3,950,100	
鎌倉新書	1,200	1,650.00	1,980,000	
一蔵	200	623.00	124,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	400	2,094.00	837,600	
グローバルグループ	200	932.00	186,400	
エボラブルアジア	500	2,327.00	1,163,500	

アトラエ	300	2,230.00	669,000	
ストライク	400	2,044.00	817,600	
ソラスト	4,000	1,133.00	4,532,000	
セラク	400	591.00	236,400	
インソース	600	2,270.00	1,362,000	
ベイカレント・コンサルティング	900	3,085.00	2,776,500	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	200	917.00	183,400	
アイモバイル	400	726.00	290,400	
キャリアインデックス	600	1,309.00	785,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	700	1,787.00	1,250,900	
船場	300	846.00	253,800	
グレイステクノロジー	500	2,458.00	1,229,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,000	1,860.00	1,860,000	
フルテック	200	1,120.00	224,000	
グリーンズ	500	1,444.00	722,000	
ツナグ・ソリューションズ	100	663.00	66,300	
日総工産	400	2,500.00	1,000,000	
キュービーネットホールディングス	800	1,914.00	1,531,200	
スプリックス	500	2,327.00	1,163,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	700	978.00	684,600	
リログループ	9,000	2,911.00	26,199,000	
東祥	1,000	3,345.00	3,345,000	
エイチ・アイ・エス	2,900	4,280.00	12,412,000	
ラックランド	300	1,950.00	585,000	
共立メンテナンス	2,500	5,320.00	13,300,000	
イチネンホールディングス	1,700	1,265.00	2,150,500	
建設技術研究所	1,200	1,403.00	1,683,600	
スペース	1,100	1,289.00	1,417,900	
長大	700	805.00	563,500	
燦ホールディングス	400	2,482.00	992,800	
スバル興業	100	5,600.00	560,000	
東京テアトル	700	1,270.00	889,000	
タナベ経営	300	1,267.00	380,100	
ナガワ	500	5,460.00	2,730,000	
よみうりランド	400	4,180.00	1,672,000	
東京都競馬	1,100	3,095.00	3,404,500	
常磐興産	700	1,583.00	1,108,100	
カナモト	2,500	3,005.00	7,512,500	
東京ドーム	6,200	960.00	5,952,000	
西尾レントオール	1,700	3,450.00	5,865,000	
トランス・コスモス	1,800	2,050.00	3,690,000	
乃村工藝社	3,800	3,075.00	11,685,000	

藤田観光	700	2,676.00	1,873,200	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	900	1,324.00	1,191,600	
日本管財	1,800	1,900.00	3,420,000	
トーカイ	1,600	2,846.00	4,553,600	
白洋舎	200	2,768.00	553,600	
セコム	17,400	9,248.00	160,915,200	
セントラル警備保障	800	4,220.00	3,376,000	
丹青社	3,100	1,139.00	3,530,900	
メイテック	2,100	4,850.00	10,185,000	
応用地質	1,800	1,196.00	2,152,800	
船井総研ホールディングス	3,400	2,232.00	7,588,800	
進学会ホールディングス	800	567.00	453,600	
オオバ	1,300	612.00	795,600	
いであ	400	974.00	389,600	
学究社	500	1,340.00	670,000	
ベネッセホールディングス	6,000	2,913.00	17,478,000	
イオンディライト	2,000	4,075.00	8,150,000	
ナック	1,100	1,043.00	1,147,300	
ニチイ学館	2,300	1,243.00	2,858,900	
ダイセキ	2,800	2,624.00	7,347,200	
ステップ	600	1,418.00	850,800	
合　　計	19,896,700		38,645,266,100	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2019年 2月28日現在です。

【インデックスファンドＴＳＰ】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	22,405,429,690円
Ⅱ　負債総額	20,054,245円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,385,375,445円
Ⅳ　発行済口数	26,926,139,277口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8314円

（参考）

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	39,883,822,412円
Ⅱ　負債総額	339,679,589円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	39,544,142,823円
Ⅳ　発行済口数	19,988,599,755口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9783円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。

（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容
①　譲渡制限はありません。
②　受益権の譲渡
・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている

振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

③　受益権の譲渡の対抗要件

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

（４）受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

（５）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2019年2月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去５年間における主な資本金の増減　：　該当事項はありません。

（２）会社の意思決定機関（2019年2月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年３月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年３月31日（事業年度の終了）から３ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

当社の取締役会は10名以内の取締役で構成され、取締役の任期は選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、代表取締役若干名を選定します。

・監査役会

当社の監査役会は５名以内の監査役で構成され、監査役の任期は選任後４年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までを任期とします。監査役会は、その決議をもって常勤の監査役を選定します。

（３）運用の意思決定プロセス（2019年2月末現在）

１．投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
２．各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
３．各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
４．トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
５．運用状況の評価・分析および運用リスク管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理／コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

２【事業の内容及び営業の概況】

・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
・委託会社の運用する、2019年2月末現在の投資信託などは次の通りです。

種　類	ファンド本数	純資産額 （単位：億円）
投資信託総合計	816	174,711

	株式投資信託		772	148,744
		単位型	250	8,575
		追加型	522	140,169
	公社債投資信託		44	25,966
		単位型	30	562
		追加型	14	25,404

3【委託会社等の経理状況】

１．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第59期事業年度（平成29年４月１日から平成30年３月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第60期中間会計期間（2018年４月１日から2018年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第58期 (平成29年３月31日)		第59期 (平成30年３月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金	※3	16,761	※3	14,024
金銭の信託	※3	152		―
有価証券		10		19
前払費用		506		551
未収入金		136		73
未収委託者報酬		10,757		15,873
未収収益	※3	2,799	※3	3,174
関係会社短期貸付金		962		1,128
立替金		1,240		2,776
繰延税金資産		865		1,014
その他	※2,3	385	※2,3	4,179
流動資産合計		34,577		42,814
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	93	※1	68
器具備品	※1	190	※1	122
有形固定資産合計		283		191
無形固定資産				

ソフトウエア	138	99
無形固定資産合計	138	99
投資その他の資産		
投資有価証券	11,783	14,103
関係会社株式	23,203	25,769
関係会社長期貸付金	60	―
長期差入保証金	782	490
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	423	489
投資その他の資産合計	36,253	40,854
固定資産合計	36,674	41,144
資産合計	71,252	83,959

（単位：百万円）

		第58期 （平成29年３月31日）		第59期 （平成30年３月31日）
負債の部				
流動負債				
預り金	※3	589	※3	3,804
未払金		4,043		5,874
未払収益分配金		7		7
未払償還金		91		91
未払手数料	※3	3,499	※3	5,124
その他未払金		445		651
未払費用	※3	4,229	※3	4,634
未払法人税等		1,808		2,185
未払消費税等	※4	538	※4	788
賞与引当金		2,077		2,286
役員賞与引当金		168		198
その他	※3	62		41
流動負債合計		13,517		19,813
固定負債				
退職給付引当金		1,259		1,316
その他		―		318
固定負債合計		1,259		1,634
負債合計		14,777		21,448
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		34,015		39,959
利益剰余金合計		34,015		39,959

自己株式	△672	△786
株主資本合計	55,926	61,756
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	282	408
繰延ヘッジ損益	266	346
評価・換算差額等合計	548	754
純資産合計	56,475	62,511
負債純資産合計	71,252	83,959

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)	第59期 (自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日)
営業収益		
委託者報酬	64,680	70,609
その他営業収益	4,218	5,398
営業収益合計	68,898	76,008
営業費用		
支払手数料	28,675	30,448
広告宣伝費	969	973
公告費	2	2
調査費	17,322	18,132
調査費	841	862
委託調査費	16,456	17,241
図書費	24	28
委託計算費	498	520
営業雑経費	656	740
通信費	185	173
印刷費	276	348
協会費	66	68
諸会費	17	24
その他	111	125
営業費用計	48,124	50,817
一般管理費		
給料	8,243	9,096
役員報酬	360	507
役員賞与引当金繰入額	168	198
給料・手当	5,576	6,083
賞与	61	20
賞与引当金繰入額	2,077	2,286
交際費	99	99
寄付金	17	16
旅費交通費	412	455
租税公課	375	424
不動産賃借料	889	890
退職給付費用	390	355
退職金	20	24
固定資産減価償却費	192	152
福利費	959	974
諸経費	2,791	3,175

一般管理費計	14,394	15,664
営業利益	6,380	9,526

(単位：百万円)

		第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)		第59期 (自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日)
営業外収益				
受取利息		19		26
受取配当金	※１	1,644	※１	1,120
有価証券償還益		―		1
時効成立分配金・償還金		22		1
為替差益		177		79
その他		36		41
営業外収益合計		1,899		1,272
営業外費用				
支払利息	※１	223	※１	223
有価証券償還損		7		―
デリバティブ費用	※１	146	※１	295
時効成立後支払分配金・償還金		2		0
支払源泉所得税		155		―
長期差入保証金償却額		―		212
その他		73		34
営業外費用合計		608		767
経常利益		7,670		10,030
特別利益				
投資有価証券売却益		174		199
特別利益合計		174		199
特別損失				
投資有価証券売却損		120		133
固定資産処分損		13		7
役員退職一時金		―		117
損害賠償損失		―		81
特別損失合計		134		340
税引前当期純利益		7,710		9,890
法人税、住民税及び事業税		2,137		3,217
過年度法人税等	※２	115		―
法人税等調整額		△104		△307
法人税等合計		2,147		2,910
当期純利益		5,562		6,979

（３）【株主資本等変動計算書】

第58期（自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日）

(単位：百万円)

	株主資本				
		資本剰余金	利益剰余金		

	資本金	資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	自己株式	株主資本合計
当期首残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	△502	52,028
当期変動額							
剰余金の配当				△1,495	△1,495		△1,495
当期純利益				5,562	5,562		5,562
自己株式の取得						△170	△170
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	－	－	－	4,067	4,067	△170	3,897
当期末残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	△672	55,926

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	151	258	410	52,438
当期変動額				
剰余金の配当				△1,495
当期純利益				5,562
自己株式の取得				△170
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	130	7	138	138
当期変動額合計	130	7	138	4,036
当期末残高	282	266	548	56,475

第59期（自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	△672	55,926
当期変動額							
剰余金の配当				△1,036	△1,036		△1,036
当期純利益				6,979	6,979		6,979
自己株式の取得						△113	△113
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計				5,943	5,943	△113	5,830
当期末残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	△786	61,756

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券	繰延ヘッジ	評価・換算	

	評価差額金	損益	差額等合計	
当期首残高	282	266	548	56,475
当期変動額				
剰余金の配当				△1,036
当期純利益				6,979
自己株式の取得				△113
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	125	80	206	206
当期変動額合計	125	80	206	6,036
当期末残高	408	346	754	62,511

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第59期 (自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日)
1　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①　子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②　その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法 (2) 金銭の信託 時価法 (3) デリバティブ 時価法
2　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年４月１日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物　３年～15年 器具備品　５年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウエア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。
3　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 ①　退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

	②　数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。
4　ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。
5　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

（貸借対照表関係）

第58期 (平成29年３月31日)	第59期 (平成30年３月31日)
※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,222百万円 器具備品　603百万円	※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,260百万円 器具備品　612百万円
※２　信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。	※２　信託資産 流動資産のその他のうち3,030百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金　3,243百万円 金銭の信託　152百万円 未収収益　619百万円 その他　20百万円 (流動負債) 預り金　177百万円 未払手数料　144百万円 未払費用　251百万円 その他　61百万円	※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金　3,189百万円 未収収益　592百万円 その他　345百万円 (流動負債) 預り金　419百万円 未払手数料　376百万円 未払費用　677百万円
※４　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。	※４　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
※５　保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務587百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務546百万円に対して保証を行っております。	※５　保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務553百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc.がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務103百万円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)	第59期 (自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日)
※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　1,550百万円 デリバティブ収益　347百万円 支払利息　58百万円 ※２　過年度の取引に関する法人税等の追加費用計上額です。	※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　979百万円 デリバティブ収益　407百万円 支払利息　213百万円

（株主資本等変動計算書関係）

第58期（自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	197,012,500	－	－	197,012,500

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	814,100	305,000	－	1,119,100

３　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度ストックオプション（1）	普通株式	1,762,200	－	72,600	1,689,600	－
平成21年度ストックオプション（2）	普通株式	174,900	－	－	174,900	－
平成23年度ストックオプション（1）	普通株式	4,738,800	－	1,848,000	2,890,800	－
平成28年度ストックオプション（1）	普通株式	－	4,437,000	33,000	4,404,000	－
合計		6,675,900	4,437,000	1,953,600	9,159,300	－

(注) １　平成28年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
２　当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
３　平成21年度ストックオプション(1)1,689,600株、平成21年度ストックオプション(2)174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,890,800株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

４　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年５月30日取締役会	普通株式	1,495	7.62	平成28年３月31日	平成28年６月22日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(百万円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日

平成29年５月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,036	5.29	平成29年３月31日	平成29年６月22日

第59期（自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	197,012,500	－	－	197,012,500

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,119,100	182,600	－	1,301,700

３　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度 ストックオプション（１）	普通株式	1,689,600	－	194,700	1,494,900	－
平成21年度 ストックオプション（２）	普通株式	174,900	－	66,000	108,900	－
平成23年度 ストックオプション（１）	普通株式	2,890,800	－	204,600	2,686,200	－
平成28年度 ストックオプション（１）	普通株式	4,404,000	－	786,000	3,618,000	－
平成28年度 ストックオプション（２）	普通株式	－	4,409,000	532,000	3,877,000	－
合計		9,159,300	4,409,000	1,783,300	11,785,000	－

(注) １　平成28年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
２　当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
３　平成21年度ストックオプション(1)1,494,900株、平成21年度ストックオプション(2)108,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,686,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)及び平成28年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

４　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	１株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年５月25日 取締役会	普通株式	1,036	5.29	平成29年３月31日	平成29年６月22日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	１株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年５月31日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,640	8.38	平成30年３月31日	平成30年６月23日

(リース取引関係)

第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)	第59期 (自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日)
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料 １年内　865百万円 １年超　1,787百万円 合計　2,653百万円	オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料 １年内　866百万円 １年超　923百万円 合計　1,790百万円

（金融商品関係）

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日）

１　金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「４　ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが１年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

外貨建ての関係会社短期借入金に関しましては、為替変動リスクに晒されておりますが、為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益）を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

平成29年３月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(※1)	時価(※1)	差額
(1) 現金・預金	16,761	16,761	―
(2) 未収委託者報酬	10,757	10,757	―
(3) 未収収益	2,799	2,799	―
(4) 関係会社短期貸付金	962	962	―
(5) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	11,777	11,777	―
(6) 未払金	(4,043)	(4,043)	―
(7) 未払費用	(4,229)	(4,229)	―
(8) デリバティブ取引(※2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	35	35	―
ヘッジ会計が適用されているもの	(1)	(1)	―
デリバティブ取引計	34	34	―

(※1)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(※2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬 、(3) 未収収益並びに (4) 関係会社短期貸付金

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち75百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、39百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち20百万円は貸借対照表上流動資産のその他

に含まれ、22百万円は流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額20,310百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
現金・預金	16,761	－	－	－
未収委託者報酬	10,757	－	－	－
未収収益	2,799	－	－	－
有価証券及び投資有価証券 投資信託	10	616	907	735
合計	30,328	616	907	735

第59期(自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「４　ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが１年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクに

も晒されております。

外貨建ての関係会社短期借入金に関しましては、為替変動リスクに晒されておりますが、為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益）を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

平成30年３月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(※1)	時価(※1)	差額
(1) 現金・預金	14,024	14,024	―
(2) 未収委託者報酬	15,873	15,873	―
(3) 未収収益	3,174	3,174	―
(4) 関係会社短期貸付金	1,128	1,128	―
(5) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	14,106	14,106	―
(6) 未払金	(5,874)	(5,874)	―
(7) 未払費用	(4,634)	(4,634)	―
(8) デリバティブ取引(※2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(14)	(14)	―
ヘッジ会計が適用されているもの	336	336	―
デリバティブ取引計	321	321	―

(※1)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(※2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬 、(3) 未収収益並びに (4) 関係会社短期貸付金

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

ております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち８百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているものは貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額22,876百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,024	－	－	－
未収委託者報酬	15,873	－	－	－
未収収益	3,174	－	－	－
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	616	1,743	545
合計	33,090	616	1,743	545

（有価証券関係）

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日)

１　子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,310
関連会社株式	2,892

(注)　子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

２　その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額	投資信託	6,299	5,590	708

が取得原価を超えるもの	小計	6,299	5,590	708
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	5,478	5,780	△302
	小計	5,478	5,780	△302
合計		11,777	11,370	406

(注) 1　減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。

2　非上場株式等（貸借対照表計上額　16百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3　当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	3,198	174	120
合計	3,198	174	120

第59期(自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日)

1　子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

(注)　子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2　その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	8,544	7,535	1,008
	小計	8,544	7,535	1,008
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	5,561	5,982	△420
	小計	5,561	5,982	△420
合計		14,106	13,518	588

(注) 1　減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。

2　非上場株式等（貸借対照表計上額　16百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3　当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	2,792	199	133
合計	2,792	199	133

（デリバティブ取引関係）

第58期(平成29年３月31日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	1,729	－	35	35
	買建	－	－	－	－
合計		1,729	－	35	35

(注) １　上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
２　時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

２　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		2,993	－	11
	豪ドル		77	－	△2
	シンガポールドル		1,639	－	△20
	香港ドル		205	－	2
	人民元		1,946	－	6
	ユーロ		57	－	0
合計			6,920	－	△1

(注) １　時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第59期(平成30年３月31日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
	株価指数先物取引				

市場取引	売建	2,422	－	△14	△14
	買建	－	－	－	－
合計		2,422	－	△14	△14

(注) 1　上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
2　時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資有価証券	4,447	－	196
	豪ドル		109	－	10
	シンガポールドル		1,783	－	65
	香港ドル		541	－	25
	人民元		2,156	－	32
	ユーロ		154	－	6
合計			9,192	－	336

(注) 1　時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（持分法損益等）

第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)	第59期 (自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 （単位：百万円） (1)関連会社に対する投資の金額　3,030 (2)持分法を適用した場合の投資の金額　9,455 (3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　2,092	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 （単位：百万円） (1)　関連会社に対する投資の金額　3,008 (2)　持分法を適用した場合の投資の金額　10,409 (3)　持分法を適用した場合の投資利益の金額　1,827

（退職給付関係）

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日)

1　採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2　確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	（百万円）
退職給付債務の期首残高	1,299
勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	△190
退職給付の支払額	△72

退職給付債務の期末残高	1,190

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,190
未積立退職給付債務	1,190
未認識数理計算上の差異	69
貸借対照表に計上された負債の額	1,259

退職給付引当金	1,259
貸借対照表に計上された負債の額	1,259

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	23
確定給付制度に係る退職給付費用	177

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%

3　確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、213百万円でありました。

第59期(自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日)

1　採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2　確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	（百万円）
退職給付債務の期首残高	1,190
勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	66
退職給付の支払額	△76
退職給付債務の期末残高	1,313

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,313
未積立退職給付債務	1,313
未認識数理計算上の差異	2
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

退職給付引当金	1,316
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	△0
確定給付制度に係る退職給付費用	132

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率　0.2%

3　確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、222百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日)

1　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員　271名	当社及び関係会社の取締役・従業員　48名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　19,724,100株	普通株式　1,702,800株
付与日	平成22年２月８日	平成22年８月20日
権利確定条件	平成24年１月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の２分の１、４分の１、４分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年１月22日から平成32年１月21日まで	同左

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員　186名	当社及び関係会社の取締役・従業員　16名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　6,101,700株	普通株式　4,437,000株
付与日	平成23年10月7日	平成28年７月15日
権利確定条件	平成25年10月７日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の２分の１、４分の１、４分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成30年７月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。

対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	平成25年10月７日から 平成33年10月６日まで	平成30年7月15日から 平成38年7月31日まで

(注)　株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

①　ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年２月８日	平成22年８月20日
権利確定前(株)		
期首	1,762,200	174,900
付与	0	0
失効	72,600	0
権利確定	0	0
権利未確定残	1,689,600	174,900
権利確定後(株)		
期首	―	―
権利確定	―	―
権利行使	―	―
失効	―	―
権利未行使残	―	―

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月７日	平成28年７月15日
権利確定前(株)		
期首	4,738,800	―
付与	0	4,437,000
失効	1,848,000	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,890,800	4,404,000
権利確定後(株)		
期首	―	―
権利確定	―	―
権利行使	―	―
失効	―	―
権利未行使残	―	―

(注)　株式数に換算して記載しております。

②　単価情報

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年２月８日	平成22年８月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円)　(注)１	0	0

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年７月15日
権利行使価格(円)	737 (注)３	558
付与日における公正な評価単価(円) (注)１	0	0

(注)１　公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
２　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額　　－　百万円
３　株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第59期(自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日)

１　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員　271名	当社及び関係会社の取締役・従業員　48名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　19,724,100株	普通株式　1,702,800株
付与日	平成22年２月８日	平成22年８月20日
権利確定条件	平成24年１月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の２分の１、４分の１、４分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年１月22日から平成32年１月21日まで	同左

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員　186名	当社及び関係会社の取締役・従業員　16名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　6,101,700株	普通株式　4,437,000株
付与日	平成23年10月7日	平成28年７月15日
権利確定条件	平成25年10月７日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の２分の１、４分の１、４分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成30年７月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。

対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	平成25年10月７日から 平成33年10月６日まで	平成30年7月15日から 平成38年7月31日まで

	平成28年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員　31名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　4,409,000株
付与日	平成29年４月27日
権利確定条件	平成31年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	平成31年4月27日から 平成39年4月30日まで

(注)　株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

①　ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年２月８日	平成22年８月20日
権利確定前(株)		
期首	1,689,600	174,900
付与	0	0
失効	194,700	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,494,900	108,900
権利確定後(株)		
期首	―	―
権利確定	―	―
権利行使	―	―
失効	―	―
権利未行使残	―	―

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月７日	平成28年７月15日
権利確定前(株)		
期首	2,890,800	4,404,000
付与	0	0
失効	204,600	786,000

権利確定	0	0
権利未確定残	2,686,200	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	―	―
権利確定	―	―
権利行使	―	―
失効	―	―
権利未行使残	―	―

	平成28年度ストックオプション(2)
付与日	平成29年４月27日
権利確定前(株)	
期首	―
付与	4,409,000
失効	532,000
権利確定	0
権利未確定残	3,877,000
権利確定後(株)	
期首	―
権利確定	―
権利行使	―
失効	―
権利未行使残	―

（注）　株式数に換算して記載しております。

②　単価情報

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年２月８日	平成22年８月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円)　(注)１	0	0

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月７日	平成28年７月15日
権利行使価格(円)	737(注)３	558
付与日における公正な評価単価(円)　(注)１	0	0

	平成28年度ストックオプション(2)
付与日	平成29年４月27日
権利行使価格(円)	553
付与日における公正な評価単価(円)　(注)１	0

（注）　１　公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
２　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額　　1,149百万円

3　株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

（税効果会計関係）

第58期 (平成29年３月31日)	第59期 (平成30年３月31日)
1　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円) 繰延税金資産(流動) 賞与引当金　641 その他　224 小計　865 繰延税金資産(固定) 投資有価証券評価損　96 関係会社株式評価損　1,430 退職給付引当金　385 固定資産減価償却費　119 その他　63 小計　2,095 繰延税金資産小計　2,961 評価性引当金　△1,430 繰延税金資産合計　1,530 繰延税金負債(流動) その他有価証券評価差額金　0 小計　0 繰延税金負債(固定) その他有価証券評価差額金　123 繰延ヘッジ利益　117 小計　241 繰延税金負債合計　242 繰延税金資産の純額　1,288	1　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円) 繰延税金資産(流動) 賞与引当金　700 その他　314 小計　1,014 繰延税金資産(固定) 投資有価証券評価損　96 関係会社株式評価損　1,430 退職給付引当金　402 固定資産減価償却費　111 その他　211 小計　2,253 繰延税金資産小計　3,268 評価性引当金　△1,430 繰延税金資産合計　1,838 繰延税金負債(流動) その他有価証券評価差額金　- 小計　- 繰延税金負債(固定) その他有価証券評価差額金　180 繰延ヘッジ利益　152 小計　333 繰延税金負債合計　333 繰延税金資産の純額　1,504
2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 法定実効税率　30.9% （調整） 交際費等永久に損金に算入されない項目　0.6% 受取配当金等永久に益金に算入されない項目　△5.3% 過年度法人税等　1.5% 海外子会社の留保利益の影響額等　0.2% 税効果会計適用後の法人税等の負担率　27.9%	2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

（関連当事者情報）

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日)

1　関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

（イ）財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	312,000(SGD 千)	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貨建)(注1)	65(SGD 800 千)(注2)	関係会社短期貸付金	385(SGD 4,800千)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	13(SGD 177 千)	未収収益	8(SGD 105千)
							資金の貸付(円貨建)(注3)	△4,422(注4)	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貨建)(注3)	3	未収収益	3
						―	増資の引受(注5)	1,501(SGD 20,000 千)	―	―
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542(USD 千)(注6)	アセットマネジメント業	間接100.00	資金の借入	資金の借入(米ドル貨建)(注7)	△5,549(USD △50,000 千)(注8)	関係会社短期借入金	―
							借入金利息(米ドル貨建)(注7)	48(USD 453 千)	未払費用	―

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2 資金の貸付に係る取引金額65百万円（SGD800千）の内訳は、貸付505百万円（SGD6,600千）及び返済439百万円（SGD5,800千）であります。
3 融資枠5,000百万円、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
4 資金の貸付に係る取引金額△4,422百万円の内訳は、貸付577百万円及び返済5,000百万円であります。
5 Nikko Asset Management International Limitedの行った20,000,000株の新株発行増資を、１株につき１シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
6 Nikko Asset Management Americas, Inc.の「資本金」は、資本金と資本剰余金の合計額を記載しております。
7 融資枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
8 資金の借入に係る取引金額△5,549百万円（USD△50,000千）は、返済であります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

三井住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成28年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為

替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	25,221百万円
負債合計	5,428百万円
純資産合計	19,792百万円
営業収益	18,250百万円
税引前当期純利益	6,809百万円
当期純利益	4,680百万円

第59期(自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日)

１　関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

（イ）財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369(SGD 千)	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貨建)(注1)	159(SGD 2,000千)(注2)	関係会社短期貸付金	550(SGD 6,800千)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	13(SGD 162千)	未収収益	8(SGD 110千)
							資金の貸付(円貨建)(注3)	―	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貨建)(注3)	12	未収収益	3
						―	増資の引受(注4)	2,466(SGD 30,369千)	―	―
子会社	日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社	日本	100(百万円)	金融商品取引業者として登録を受けるための準備会社	直接100.00	―	増資の引受(注5)	100	―	―

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

1　融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

2　資金の貸付に係る取引金額159百万円（SGD2,000千）の内訳は、貸付159百万円（SGD2,000千）であります。

3　融資枠5,000百万円、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

4　Nikko Asset Management International Limitedの行った30,369,000株の新株発行増資を、１株につき１シンガポールドルで当社が引受けたものであります。

5　日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社の行った2,000株の新株発行を、１株につき50千円で当社が引受けたものであります。

2　親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

三井住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成29年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	27,012百万円
負債合計	5,141百万円
純資産合計	21,871百万円
営業収益	15,830百万円
税引前当期純利益	5,266百万円
当期純利益	3,594百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

第59期(自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

関連情報

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日)

1　製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2　地域ごとの情報

（１）営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第59期(自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日)

1　製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

（1）営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日)

該当事項はありません。

第59期(自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日)

該当事項はありません。

第59期(自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第58期(自　平成28年４月１日　至　平成29年３月31日)

該当事項はありません。

第59期(自　平成29年４月１日　至　平成30年３月31日)

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

項目	第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)	第59期 (自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日)
１株当たり純資産額	288円29銭	319円40銭
１株当たり当期純利益金額	28円38銭	35円64銭

(注)　1　潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。

2　１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期 (自　平成28年４月１日 至　平成29年３月31日)	第59期 (自　平成29年４月１日 至　平成30年３月31日)
当期純利益（百万円）	5,562	6,979
普通株主に帰属しない金額（百万円）	―	―
普通株式に係る当期純利益（百万円）	5,562	6,979
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,009	195,794
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1)　1,689,600株、平成21年度ストックオプション(2)　174,900株、平成23年度ストックオプション(1)　2,890,800株、平成28年度ストックオプション（1）　4,404,000株	平成21年度ストックオプション(1)　1,494,900株、平成21年度ストックオプション(2)　108,900株、平成23年度ストックオプション(1)　2,686,200株、平成28年度ストックオプション（1）　3,618,000株、平成28年度ストックオプション（2）　3,877,000株

３　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期 (平成29年３月31日)	第59期 (平成30年３月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	56,475	62,511
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	―	―
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	56,475	62,511
１株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	195,893	195,711

（重要な後発事象）

新株予約権（ストックオプション）の付与

当社は平成30年３月15日付の臨時株主総会及び平成30年３月20日開催の取締役会の決議に基づき、平成30年４月27日にストックオプションとして新株予約権を当社、当社子会社の取締役及び従業員36名に付与いたしました。

①　新株予約権の数　4,422個
②　新株予約権の目的となる株式の種類及び数　当社普通株式　4,422,000株
③　新株予約権の発行価額　無償
④　新株予約権の行使時の払込金額　１株当たり金694円
⑤　新株予約権の行使期間　平成32年４月27日から平成40年４月30日まで

中間財務諸表等

（１）中間貸借対照表

(単位：百万円)

	第60期中間会計期間 (2018年９月30日)
資産の部	
流動資産	
現金・預金	24,039
有価証券	19

未収委託者報酬		14,192
未収収益		920
関係会社短期貸付金		743
その他	※２	2,462
流動資産合計		42,379
固定資産		
有形固定資産	※１	160
無形固定資産		96
投資その他の資産		
投資有価証券		11,639
関係会社株式		25,769
長期差入保証金		463
繰延税金資産		1,450
長期前払費用		0
投資その他の資産合計		39,324
固定資産合計		39,580
資産合計		81,960

（単位：百万円）

		第60期中間会計期間 (2018年９月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		6,326
未払費用		3,919
未払法人税等		1,899
未払消費税等	※３	627
賞与引当金		1,452
役員賞与引当金		60
その他		548
流動負債合計		14,835
固定負債		
退職給付引当金		1,355
その他		450
固定負債合計		1,805
負債合計		16,640
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		42,692
利益剰余金合計		42,692
自己株式		△833

株主資本合計	64,442
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	729
繰延ヘッジ損益	147
評価・換算差額等合計	876
純資産合計	65,319
負債純資産合計	81,960

（２）中間損益計算書

（単位：百万円）

		第60期中間会計期間 (自　2018年４月１日 至　2018年９月30日)
営業収益		
委託者報酬		40,168
その他営業収益		1,608
営業収益合計		41,776
営業費用及び一般管理費	※１	36,000
営業利益		5,776
営業外収益	※２	842
営業外費用	※３	441
経常利益		6,177
特別利益	※４	98
特別損失	※５	144
税引前中間純利益		6,131
法人税等	※６	1,758
中間純利益		4,373

（３）中間株主資本等変動計算書

第60期中間会計期間（自　2018年４月１日　至　2018年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	△786	61,756
当中間期変動額							
剰余金の配当				△1,640	△1,640		△1,640
中間純利益				4,373	4,373		4,373
自己株式の取得						△47	△47
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計				2,733	2,733	△47	2,685
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	42,692	42,692	△833	64,442

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	408	346	754	62,511
当中間期変動額				
剰余金の配当				△1,640
中間純利益				4,373
自己株式の取得				△47
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	321	△198	122	122
当中間期変動額合計	321	△198	122	2,808
当中間期末残高	729	147	876	65,319

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第60期中間会計期間 (自　2018年４月１日 至　2018年９月30日)
１　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法 (2) デリバティブ 時価法
２　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウエア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。
３　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

	①　退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②　数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。
4　ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。
5　その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。 (2)税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。

（表示方法の変更）

第60期中間会計期間 (自　2018年４月１日 至　2018年９月30日)
(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用) 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号　平成30年２月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

（中間貸借対照表関係）

第60期中間会計期間 (2018年９月30日)
※１　有形固定資産の減価償却累計額 1,899百万円 ※２　信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。

※３　消費税等の取扱い
　仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

※４　保証債務
　当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務516百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務36百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

第60期中間会計期間
(自　2018年４月１日
至　2018年９月30日)

※１　減価償却実施額

有形固定資産	34百万円
無形固定資産	19百万円

※２　営業外収益のうち主要なもの

受取利息	13百万円
受取配当金	824百万円

※３　営業外費用のうち主要なもの

支払利息	181百万円
デリバティブ費用	165百万円

※４　特別利益のうち主要なもの

投資有価証券売却益	98百万円

※５　特別損失のうち主要なもの

投資有価証券売却損	144百万円

※６　中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。

（中間株主資本等変動計算書関係）

第60期中間会計期間（自　2018年４月１日　至　2018年９月30日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	197,012,500	－	－	197,012,500

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,301,700	64,000	－	1,365,700

(注)　自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

３　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高（百万円）
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	

2009年度 ストックオプション（1）	普通株式	1,494,900	―	108,900	1,386,000	―
2009年度 ストックオプション（2）	普通株式	108,900	―	―	108,900	―
2011年度 ストックオプション（1）	普通株式	2,686,200	―	287,100	2,399,100	―
2016年度 ストックオプション（1）	普通株式	3,618,000	―	―	3,618,000	―
2016年度 ストックオプション（2）	普通株式	3,877,000	―	―	3,877,000	―
2017年度 ストックオプション（1）	普通株式	―	4,422,000	―	4,422,000	―
合計		11,785,000	4,422,000	396,000	15,811,000	

(注) 1　2017年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
2　2009年度ストックオプション(1)及び2011年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
3　2009年度ストックオプション(1)1,386,000株、2009年度ストックオプション(2)108,900株及び2011年度ストックオプション(1)2,399,100株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)は権利行使期間の初日が到来しておりません。

4　配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	１株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年５月31日 取締役会	普通株式	1,640	8.38	2018年３月31日	2018年６月23日

(2)基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第60期中間会計期間 (自　2018年４月１日 至　2018年９月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
１年内	866百万円
１年超	7,125百万円
合計	7,991百万円

（金融商品関係）

第60期中間会計期間(2018年９月30日)

１　金融商品の時価等に関する事項

2018年９月30日（当中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表 計上額(※1)	時価(※1)	差額
(1) 現金・預金	24,039	24,039	―

(2) 未収委託者報酬	14,192	14,192	―
(3) 未収収益	920	920	―
(4) 関係会社短期貸付金	743	743	―
(5) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	11,642	11,642	―
(6) 未払金	(6,326)	(6,326)	―
(7) 未払費用	(3,919)	(3,919)	―
(8) デリバティブ取引(※2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(190)	(190)	―
ヘッジ会計が適用されているもの	29	29	―
デリバティブ取引計	(160)	(160)	―

(※1)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(※2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬 、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券
投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(8) デリバティブ取引
（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないものは、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。またヘッジ会計が適用されているもののうち37百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、8百万円は、流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等（中間貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（中間貸借対照表計上額22,876百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

（有価証券関係）

第60期中間会計期間(2018年９月30日)

1　子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

(注)　子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2　その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	8,029	6,865	1,163
	小計	8,029	6,865	1,163
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,612	3,725	△113
	小計	3,612	3,725	△113
合計		11,642	10,591	1,050

(注) 1　減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当中間会計期間については、該当ございません。

2　非上場株式等（中間貸借対照表計上額16百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第60期中間会計期間(2018年９月30日)

1　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引 売建	2,572	－	△190	△190
合計		2,572	－	△190	△190

(注) 1　上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2　時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		2,752	－	2
	豪ドル		62	－	1
	シンガポールドル		955	－	5
	ユーロ		79	－	△0
	香港ドル		586	－	△7
	人民元		2,020	－	28
合計			6,456	－	29

(注) 1　時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（持分法損益等）

第60期中間会計期間 (自　2018年４月１日 至　2018年９月30日)

関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
（1）関連会社に対する投資の金額	3,011百万円
（2）持分法を適用した場合の投資の金額	9,743百万円
（3）持分法を適用した場合の投資利益の金額	848百万円

（ストックオプション等関係）

第60期中間会計期間(自　2018年４月１日　至　2018年９月30日)

当中間会計期間において、ストックオプションを付与しておりますが、当該ストックオプションの付与による影響が当社の財政状態、経営成績等にとって重要でないと認められるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

第60期中間会計期間(自　2018年４月１日　至　2018年９月30日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

［関連情報］

第60期中間会計期間(自　2018年４月１日　至　2018年９月30日)

１　製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

２　地域ごとの情報

（１）営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第60期中間会計期間(自　2018年４月１日　至　2018年９月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第60期中間会計期間(自　2018年４月１日　至　2018年９月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第60期中間会計期間(自　2018年４月１日　至　2018年９月30日)

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

項目	第60期中間会計期間 (自　2018年４月１日 至　2018年９月30日)
１株当たり純資産額	333円86銭
１株当たり中間純利益金額	22円34銭

(注)　１　潜在株式調整後１株当たり中間純利益金額については、新株予約権等の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。

２　１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期中間会計期間 (自　2018年４月１日 至　2018年９月30日)
中間純利益（百万円）	4,373
普通株主に帰属しない金額（百万円）	―
普通株式に係る中間純利益（百万円）	4,373
普通株式の期中平均株式数（千株）	195,706
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2009年度ストックオプション(1)1,386,000株、 2009年度ストックオプション(2)108,900株、 2011年度ストックオプション(1)2,399,100株、 2016年度ストックオプション(1)3,618,000株、 2016年度ストックオプション(2)3,877,000株、 2017年度ストックオプション(1)4,422,000株

３　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期中間会計期間 (2018年９月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	65,319
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	―
普通株式に係る中間会計期間末の 純資産額（百万円）	65,319
１株当たり純資産額の算定に用いられた 中間会計期間末の普通株式の数（千株）	195,647

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

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

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

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

（３）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当

該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

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

（５）上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

（１）定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（２）訴訟事件その他の重要事項

委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名　　称	資本金の額 （2018年9月末現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

＜再信託受託会社の概要＞

名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額　：51,000百万円（2018年9月末現在）

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

再信託の目的：原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

（２）販売会社

名　　称	資本金の額 （2018年9月末現在）	事業の内容
藍澤證券株式会社	8,000百万円	
あかつき証券株式会社	3,067百万円	
池田泉州ＴＴ証券株式会社	1,250百万円	
エース証券株式会社	8,831百万円	
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
光世証券株式会社	12,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
髙木証券株式会社	11,069百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
東武証券株式会社	420百万円	

とうほう証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
東洋証券株式会社　※1	13,494百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	
西日本シティＴＴ証券株式会社	3,000百万円	
浜銀ＴＴ証券株式会社　※1	3,307百万円	
ばんせい証券株式会社	1,558百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
丸三証券株式会社	10,000百万円	
みずほ証券株式会社　※1	125,167百万円	
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
明和證券株式会社　※1	511百万円	
山和証券株式会社	585百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社沖縄銀行	22,725百万円	
株式会社神奈川銀行	5,191百万円	
株式会社京都銀行	42,103百万円	
株式会社きらぼし銀行	43,734百万円	
株式会社京葉銀行	49,759百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社四国銀行	25,000百万円	
株式会社ジャパンネット銀行	37,250百万円	
株式会社十六銀行	36,839百万円	
ソニー銀行株式会社	31,000百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社東北銀行	13,233百万円	
株式会社徳島銀行	11,036百万円	
株式会社栃木銀行	27,408百万円	
株式会社トマト銀行	17,810百万円	
株式会社富山銀行	6,730百万円	
株式会社富山第一銀行	10,182百万円	
株式会社三井住友銀行　※1	1,770,996百万円	
株式会社みなと銀行	27,484百万円	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
株式会社山梨中央銀行	15,400百万円	

株式会社ＳＭＢＣ信託銀行	87,550百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
全国信用協同組合連合会	67,275百万円 （出資の総額）	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

※1　募集の取扱いを行ないません。

２【関係業務の概要】

（１）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
（２）販売会社
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

３【資本関係】

（１）受託会社
三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。（2018年9月末現在）
（２）販売会社
該当事項はありません。

第３【その他】

（１）目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。
（２）目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。
①　委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
②　ファンドの基本的性格など
③　委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
④　委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
⑤　目論見書の使用開始日
（３）目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
①　投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
②　投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
③　投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
④　「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
⑤　「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
⑥　請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。
⑦　請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
⑧　「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
⑨　商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
⑩　投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
⑪　有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
⑫　委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
（４）有価証券届出書本文「第一部　証券情報」、「第二部　ファンド情報」に記載の内容について、投資者

の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

（５）目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部　ファンド情報」中「第１　ファンドの状況」「２　投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。

（６）投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。

（７）目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

（８）交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

① ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の６の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。

② 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

③ 分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

平成30年６月15日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　羽 太 典 明

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　竹 内 知 明

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成29年４月１日から平成30年３月31日までの第59期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成30年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

(注)1.上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

平成31年３月20日

日興アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　鶴　田　　光　夫

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　辻　村　　和　之

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスファンドＴＳＰの平成30年２月14日から平成31年２月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスファンドＴＳＰの平成31年２月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　　上

(注)1.上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2018年12月５日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　羽 太 典 明

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　竹 内 知 明

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2018年４月１日から2019年３月31日までの第60期事業年度の中間会計期間(2018年４月１日から2018年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2018年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2018年４月１日から2018年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

(注)1.上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。