

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年2月5日
【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】	取締役社長 ビリー・ウェード・ワイルダー
【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】	犬伏 貴民
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	ミリオン インデックスポートフォリオ バランスポートフォリオ
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	継続募集額 各ポートフォリオ毎に上限1兆円
【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】

ミリオン

インデックスポートフォリオ

バランスポートフォリオ

・以下、上記を総称して、また各々を称して「ミリオン」、「ファンド」または「ポートフォリオ」ということがあります。

(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証券です。(以下「受益権」といいます。)

・格付は取得しておりません。

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】

各ポートフォリオ毎に、1兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。

勤務先の事務局を通じて販売会社に入金された日を取得申込受付日とします。

・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】

ありません。

(6) 【申込単位】

勤務先の事務局、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。

(7) 【申込期間】

平成22年2月6日から平成23年2月7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

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、原則として勤務先の事務局を通じて給与天引きにより申込金額を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、原則として勤務先の事務局を通じて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】

ファンドの目的

インデックスポートフォリオ	信託財産の長期的成長をめざして運用を行ないます。
バランスポートフォリオ	信託財産の長期的成長と安定した収益の確保をはかることをめざして運用を行ないます。

ファンドの基本的性格

<インデックスポートフォリオ>

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		日経225
	年2回	日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米	ファミリーファンド	
	年6回 (隔月)	欧州		
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア		TOPIX
	年12回 (毎月)	オセアニア		
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	その他 ()
	その他 ()	アフリカ		
その他資産 (投資信託証券(株式一般))		中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		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、株式に投資を行いません。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。

< バランスポートフォリオ >

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)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	内外	不動産投信
		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。

資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする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
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル	ファミリーファンド
	年2回	日本	
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米	ファンド・オブ・ファンズ
	年6回 (隔月)	欧州	
	年12回 (毎月)	アジア	
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ
	その他 ()	アフリカ	
その他資産 (投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))		中近東 (中東)	
		エマージング	
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券を対象を行いません。よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「資産複合」に分類されます。

「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

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、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、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。

ファンドの特色

- 1) ミリオンには2つのポートフォリオがあり、皆様のニーズにあったポートフォリオをお選びいただけます。
- ・「インデックスポートフォリオ」は、主として「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資を通じて、わが国の株式に投資を行ない(ファミリーファンド方式)、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。
 - ・「バランスポートフォリオ」は、主として「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資を通じて、わが国の株式に50%程度投資を行ない(ファミリーファンド方式)。また残りの50%程度は内外の公社債を中心に組み入れます。
 - ・市況の急激な変化が生じたときなど、やむを得ない事情が発生した場合ならびに信託財産の規模によっては上記のような運用ができない場合があります。

後述の「ファミリーファンド方式について」をご参照ください。

	インデックスポートフォリオ	バランスポートフォリオ	
主な投資対象	インデックス東証株式マザーファンド	インデックス東証株式マザーファンド	内外の公社債(国債・地方債など)
運用方針	TOPIX(東証株価指数)の動きに連動した運用成果を目標とします。	TOPIX(東証株価指数)の動きに連動した運用成果に、内外公社債の運用により安定性を加味します。	
	「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券を信託財産の90%以上組み入れます。	「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券を信託財産の50%程度組み入れ、残りの50%程度は内外の公社債を中心に組み入れます。	

組入比率は、株式・債券市況および運用期間などにより変更になることがあります。

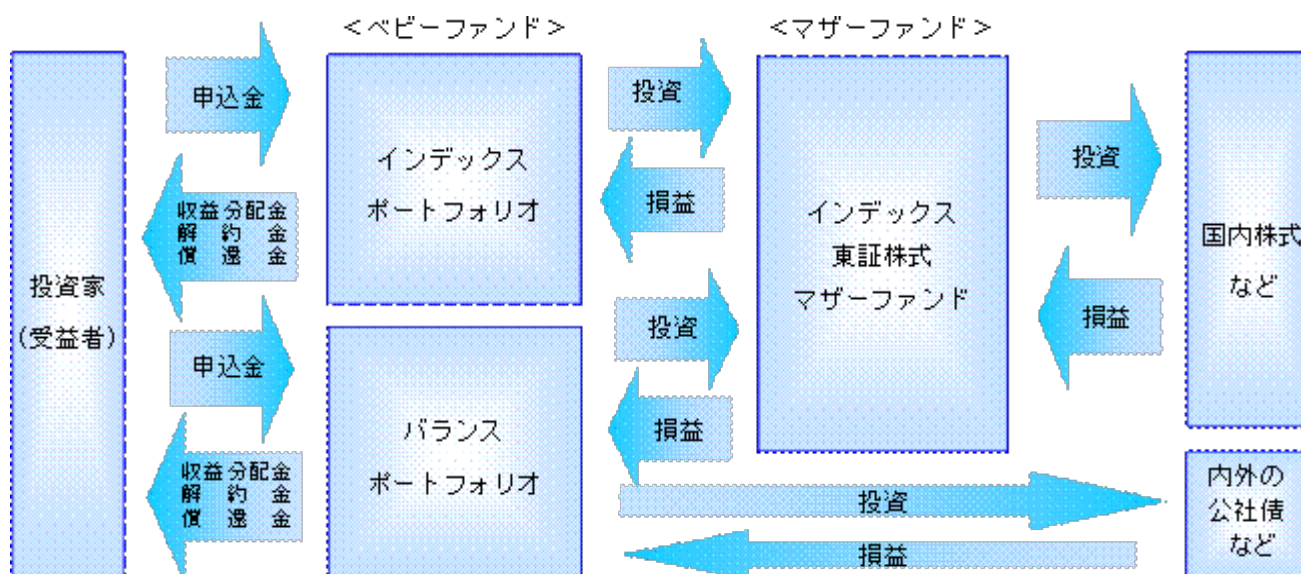
* TOPIX（東証株価指数）

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。

- 2) お買付けは、原則として給与天引きです。
- 3) お買付けは、無手数料です。
- 4) ドル・コスト平均法の妙味を發揮します。
ドル・コスト平均法とは、一定の金額を継続して投資する方法で、価格が安いときは多くの口数を、高いときは少ない口数を買い付けることによって、一定量（口数）ずつ買い付けた場合に比べて、平均買付コストを低く抑えることが期待できます。長期にわたり定期的に継続して積み立てることにより、ドル・コスト平均法が活かされます。

ファミリーファンド方式について

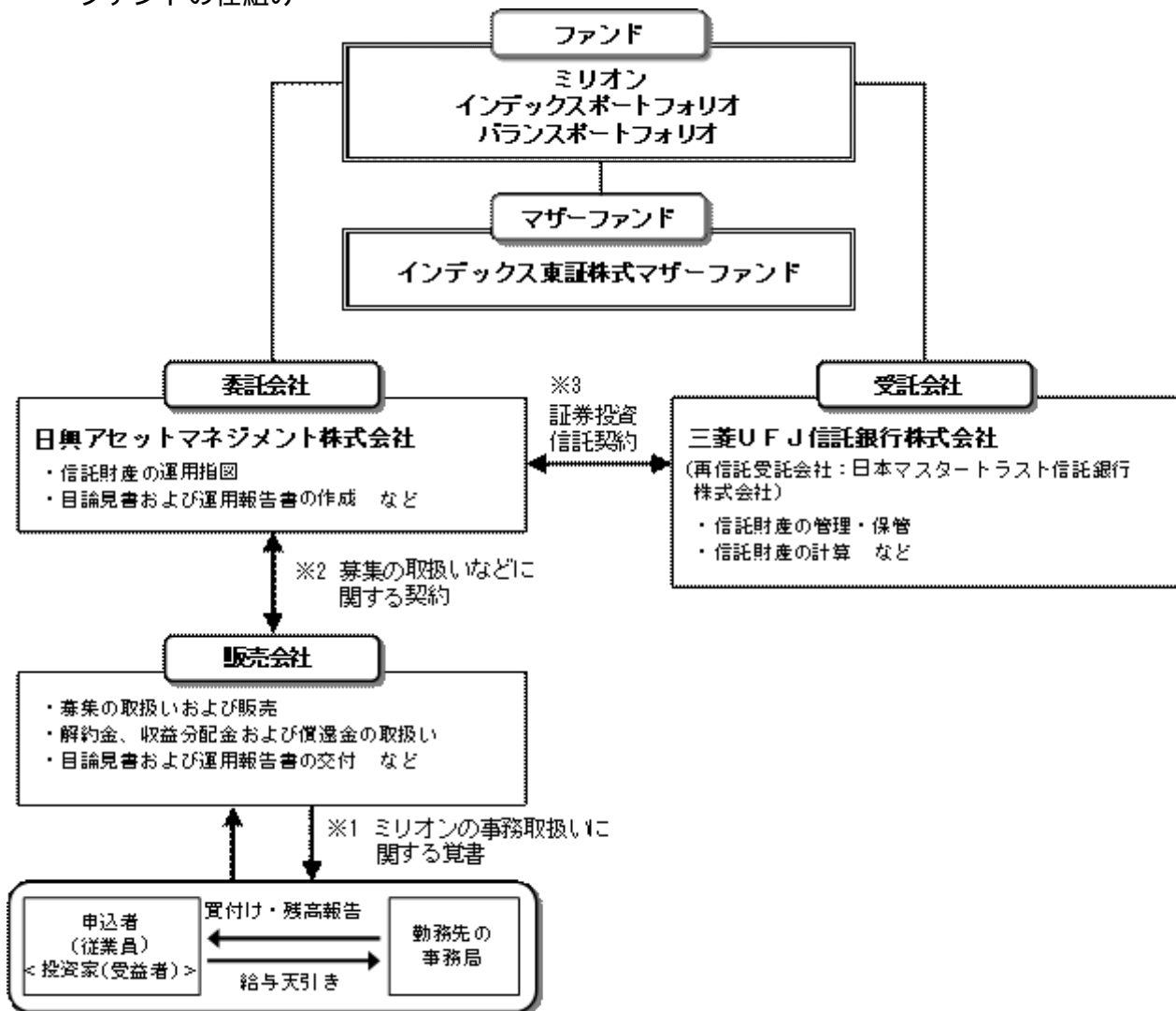
ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンドとし、その資金を主としてマザーファンド受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



信託金限度額

- ・各ポートフォリオ毎に、2,000億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) 【ファンドの仕組み】
ファンドの仕組み



- 1 ミリオンの事務局と販売会社の間における、ミリオンの申込み・入金・換金などに関する手続きを規定しています。
- 2 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を、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。
- 3 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を、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。

委託会社の概況（平成21年12月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
平成11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
住友信託銀行株式会社	大阪府大阪府中央区北浜四丁目5番33号	194,152,500株	98.54%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<インデックスポートフォリオ>

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
- ・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。

<バランスポートフォリオ>

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。
- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券に投資することにより売買益を追求し、内外の公社債に投資することにより利息等収益の確保につとめます。
- ・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75%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】

<インデックスポートフォリオ>

「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
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) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

主として「インデックス東証株式マザーファンド」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) 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
- 2) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 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。）
- 4) 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

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
- 次の取引ができます。
- 1) 資金の借入

<バランスポートフォリオ>

「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。

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17条の2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

主として「インデックス東証株式マザーファンド」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) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、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。)に限り、)
- 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 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。以下同じ。)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。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 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、)
- 12) 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
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
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
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 有価証券の貸付
 - 4) 外国為替予約取引
 - 5) 資金の借入

<インデックス東証株式マザーファンド>

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13条の2および第13条の4に定めるものに限り、)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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) 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、)
- 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

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。

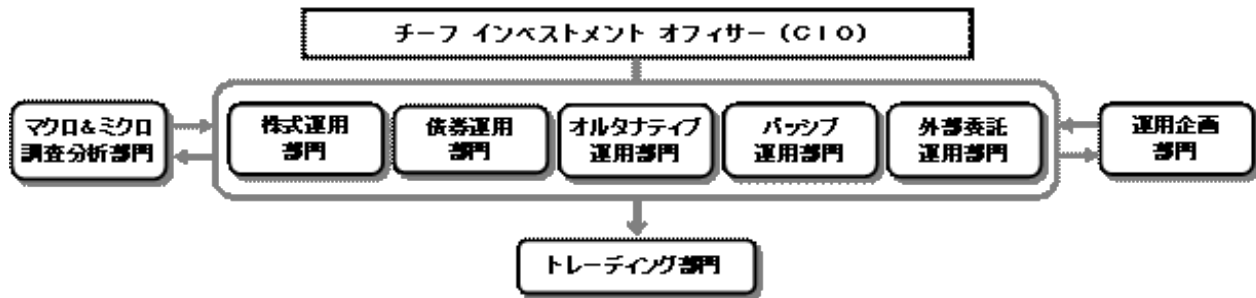
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 有価証券の貸付

投資対象とするマザーファンドの概要
 <インデックス東証株式マザーファンド>

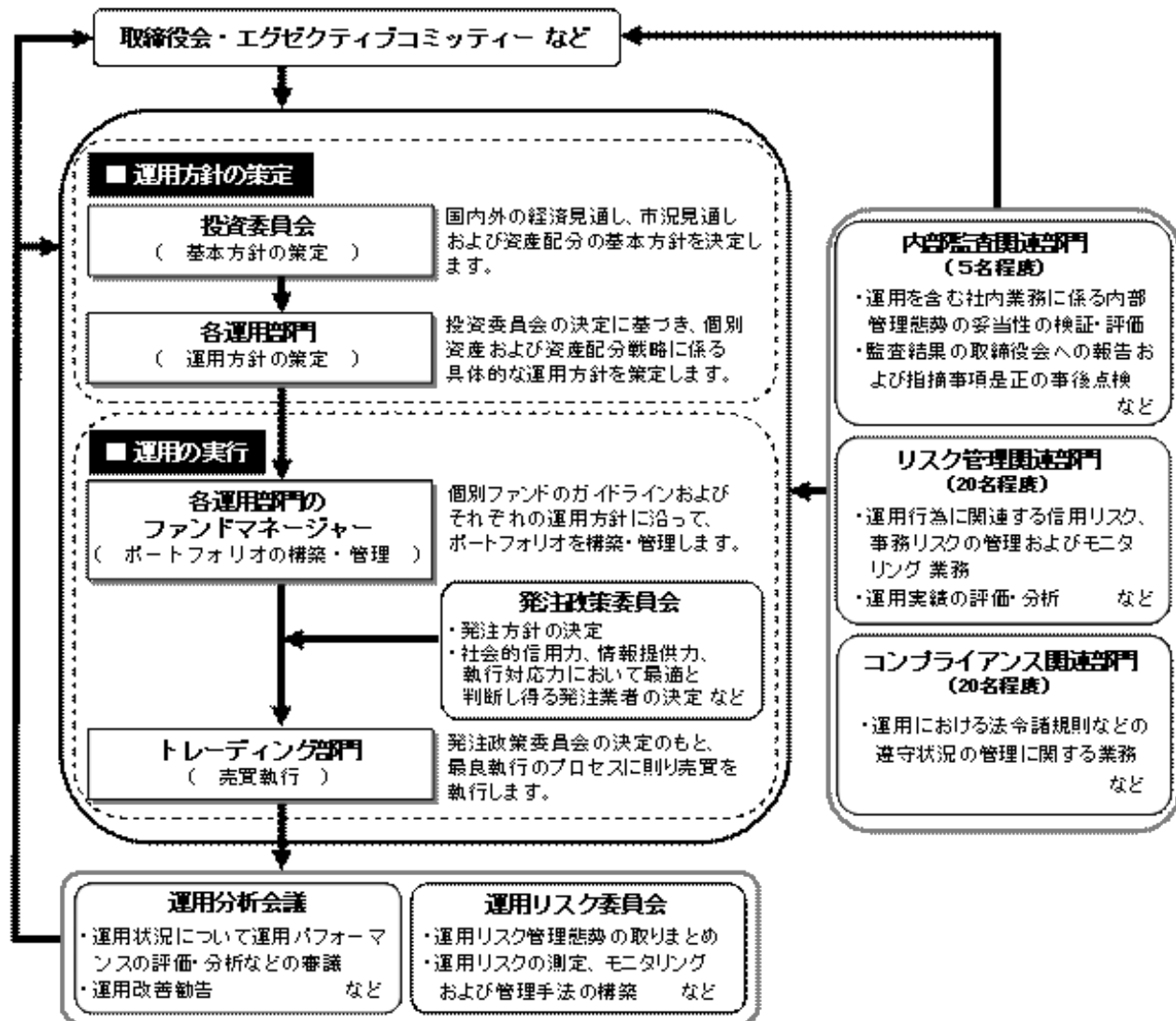
運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期的成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・投資成果をT O P I X（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、バール日本株式モデルに従い次のポートフォリオ管理を行いません。投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。資金の流入に伴う売買にあたっては、原則として買付の場合は時価比率の高い銘柄から順に、売却の場合は時価比率の低い銘柄から順番に行いません。 ・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	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への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いません。
収益分配	収益分配は行いません。
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	三菱UFJ信託銀行株式会社
信託期間	無期限（昭和61年10月22日設定）
決算日	毎年10月21日（休業日の場合は翌営業日）

(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。

上記体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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せんが、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。

収益分配金の支払い

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。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

<インデックスポートフォリオ>

- 1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合には制限を設けません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) 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、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴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) 借入れ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。

<バランスポートフォリオ>

- 1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- 2) 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第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。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 4) 信託財産が運用対象とする有価証券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。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - 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、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」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、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月ま

- 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14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。
- 八) 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、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。
- 5) 信託財産に属する資産の為替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通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション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、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産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、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- 八) 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保有外貨建資産の時価総額の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。
- 6) 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14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14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(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額、以下同じ。)に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- 八) 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。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、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。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 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、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴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
- 八) 借入れ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

- 二) 解約に伴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。

<インデックス東証株式マザーファンド>

- 1) 株式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) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産が運用対象とする有価証券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。以下同じ。)、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。以下同じ。)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。以下同じ。)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先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション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。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - 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、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」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、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受け取る組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ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10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、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。
- 5) 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10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10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。
- 6) 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。
- 7) 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。

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（マザーファンドを含みます。）は、主に株式および債券など値動きのある証券（外貨建証券は為替変動リスクもあります。）を投資対象としているため、基準価額は変動します。したがって、元金を割り込むことがあります。
- ・当ファンドは、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ありません。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りません。
- ・信託財産に生じた利益および損失はすべて受益者に帰属します。取得申込者は、ファンドの投資目的およびリスク要因を十分に認識することが求められます。

各ポートフォリオの主なリスクは以下の通りです。

<インデックスポートフォリオ>

価格変動リスク

一般に株式の価格は、国内および国外の経済・政治情勢などの影響を受け変動します。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。

流動性リスク

市場規模や取引量が少ない場合、組入銘柄を売却する際に市場実勢から期待される価格で売却できず、不測の損失を被るリスクがあります。

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。

TOPIXと基準価額の乖離リスク

当ファンドの基準価額とTOPIX（東証株価指数）との乖離の程度は、資金の流出入に伴う株式売買委託手数料（消費税等相当額を含みます。）負担、組入銘柄選定に伴う基準価額への影響などにより左右されます。

<バランスポートフォリオ>

価格変動リスク

・一般に株式の価格は、国内および国外の経済・政治情勢などの影響を受け変動します。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。

・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動は、残存期間・発行条件などによりばらつきがあります。

流動性リスク

市場規模や取引量が少ない場合、組入銘柄を売却する際に市場実勢から期待される価格で売却できず、不測の損失を被るリスクがあります。

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。

為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

<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閉鎖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。また、一時的に取得・換金ができなくなることもあります。

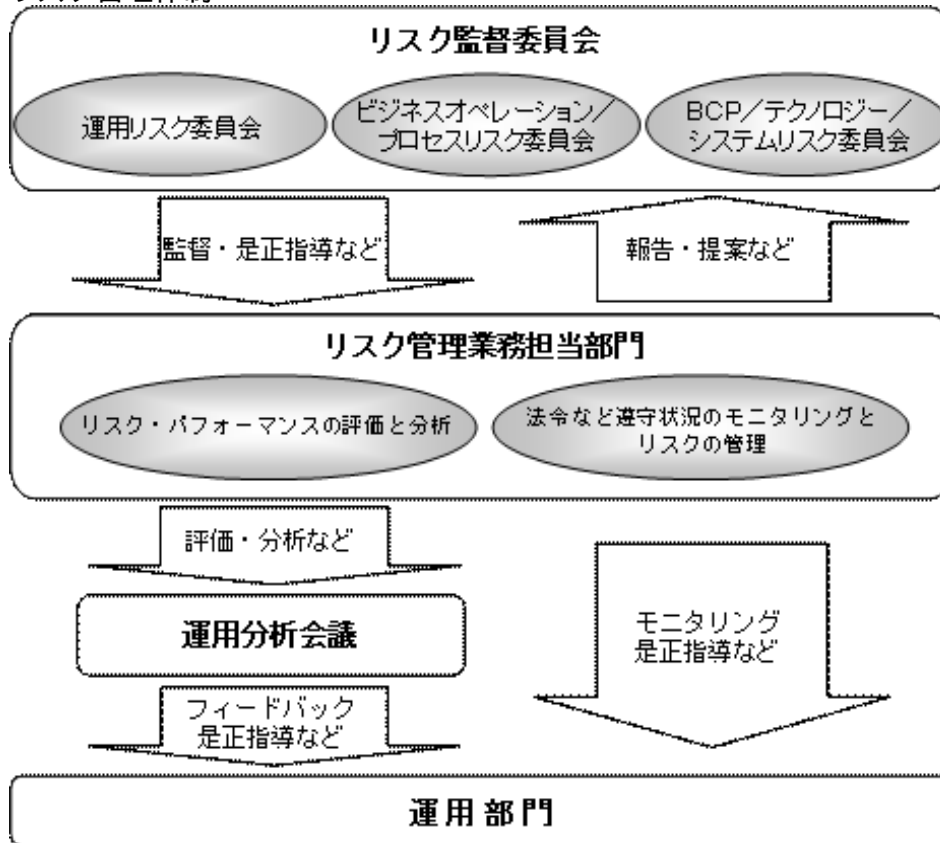
・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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証券を大量に売却することがあります。その際に基準価額が大きく変動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



全体的リスク管理

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マネジメント部を設置し、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およびリスク管理状況については、リスクマネジメント部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。本委員会およびその部門別委員会においては、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、重大なリスクの洗い出し、より予防的なリスクの軽減に繋がる施策、管理手法の構築などに努めております。

リスク・パフォーマンスの評価と分析

ファンド財産について運用状況の評価・分析と運用プロセスおよびリスク運営状況のモニタリングを行ないます。運用パフォーマンスおよびリスクに係る評価と分析の結果を運用分析会議に報告し、問題点については運用部門に原因の究明と是正指導を行ないます。

法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理

法令・諸規則、信託約款などの遵守状況とリスク管理状況のモニタリングを行ないます。その結果についてはリスク監督委員会、あるいはその部門別委員会へ報告され運用部門に是正指導を行なうなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

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1.596%（税抜1.52%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬（本書提出日現在）の配分は、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.596%	0.357%	1.155%	0.084%
（1.52%）	（0.34%）	（1.10%）	（0.08%）

括弧内は税抜です。

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、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。

組入る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。

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。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用（「バランスポートフォリオ」のみ）、解約に伴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>

- ・組入る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、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】

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、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、10%（所得税7%および地方税3%）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のいずれかを選択することもできます。
- ・なお、平成24年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

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、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、10%（所得税7%および地方税3%）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、10%（所得税7%および地方税3%）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

- ・なお、平成24年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

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および上場株式等の配当等（申告分離課税を選択したものに限り、）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）および普通分配金（申告分離課税を選択したものに限り、）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。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。

個別元本

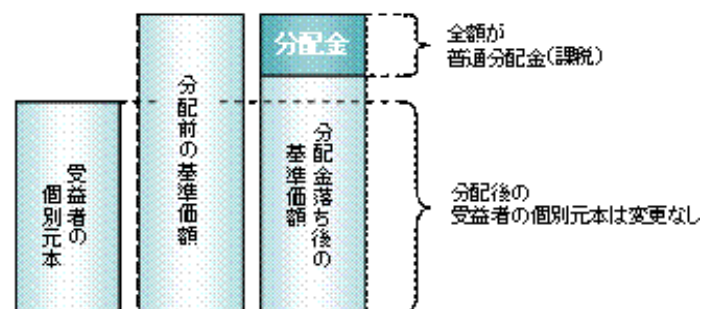
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と特別分配金

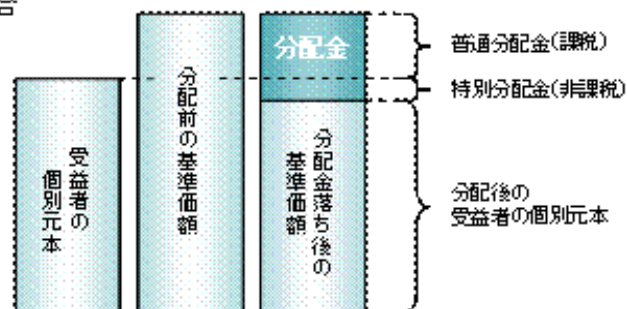
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「特別分配金」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が特別分配金となり、収益分配金から特別分配金を控除した金額が普通分配金となります。
 - ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本か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



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。

5【運用状況】

<インデックスポートフォリオ>

以下の運用状況は平成21年11月30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】

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	8,826,786	99.90
日本	8,826,786	99.90
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	8,531	0.10
純資産総額	8,835,318	100.00

(2)【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

<親投資信託受益証券>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	12,645,826,426	0.7239 0.6980	9,154,923,031 8,826,786,845	99.90

ロ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

【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】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】
【純資産の推移】

期別	1口当たりの純資産額(円)		純資産総額(百万円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第13計算期間末(2000年11月7日)	0.6072	0.6077	19,780	19,796
第14計算期間末(2001年11月7日)	0.4319	0.4324	14,388	14,404
第15計算期間末(2002年11月7日)	0.3649	0.3654	12,417	12,434
第16計算期間末(2003年11月7日)	0.4315	0.4320	14,743	14,760
第17計算期間末(2004年11月8日)	0.4524	0.4529	15,068	15,085
第18計算期間末(2005年11月7日)	0.6130	0.6135	19,235	19,251
第19計算期間末(2006年11月7日)	0.6575	0.6580	18,844	18,858
第20計算期間末(2007年11月7日)	0.6318	0.6323	15,899	15,912
第21計算期間末(2008年11月7日)	0.3584	0.3589	9,110	9,123
第22計算期間末(2009年11月9日)	0.3557	0.3562	9,152	9,165

	1口当たりの純資産額(円)	純資産総額(百万円)
2008年11月末日	0.3401	8,673
2008年12月末日	0.3501	8,903
2009年1月末日	0.3228	8,228
2009年2月末日	0.3080	7,863
2009年3月末日	0.3175	8,131
2009年4月末日	0.3433	8,768
2009年5月末日	0.3666	9,376
2009年6月末日	0.3795	9,751
2009年7月末日	0.3874	9,969
2009年8月末日	0.3932	10,112
2009年9月末日	0.3725	9,583
2009年10月末日	0.3661	9,431
2009年11月末日	0.3426	8,835

【分配の推移】

	1口当たり税込み分配金(円)
第13計算期間(1999年11月9日~2000年11月7日)	0.0005
第14計算期間(2000年11月8日~2001年11月7日)	0.0005
第15計算期間(2001年11月8日~2002年11月7日)	0.0005
第16計算期間(2002年11月8日~2003年11月7日)	0.0005
第17計算期間(2003年11月8日~2004年11月8日)	0.0005
第18計算期間(2004年11月9日~2005年11月7日)	0.0005
第19計算期間(2005年11月8日~2006年11月7日)	0.0005
第20計算期間(2006年11月8日~2007年11月7日)	0.0005
第21計算期間(2007年11月8日~2008年11月7日)	0.0005
第22計算期間(2008年11月8日~2009年11月9日)	0.0005

【収益率の推移】

	収益率(%)
第13計算期間(1999年11月9日~2000年11月7日)	8.34
第14計算期間(2000年11月8日~2001年11月7日)	28.79
第15計算期間(2001年11月8日~2002年11月7日)	15.40
第16計算期間(2002年11月8日~2003年11月7日)	18.39
第17計算期間(2003年11月8日~2004年11月8日)	4.96
第18計算期間(2004年11月9日~2005年11月7日)	35.61
第19計算期間(2005年11月8日~2006年11月7日)	7.34
第20計算期間(2006年11月8日~2007年11月7日)	3.83
第21計算期間(2007年11月8日~2008年11月7日)	43.19
第22計算期間(2008年11月8日~2009年11月9日)	0.61

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落ちの額、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。

< バランスポートフォリオ >

以下の運用状況は平成21年11月30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

投資資産の種類	時価（千円）	投資比率（％）
国債証券	115,678	26.91
日本	115,678	26.91
親投資信託受益証券	218,341	50.78
日本	218,341	50.78
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	95,921	22.31
純資産総額	429,941	100.00

(2) 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

< 国債証券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	利率(%) 償還期限	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券（5年）第49回	0.60000 2010-09-20	40,000,000	100.35 100.35	40,139,442 40,139,442	9.34
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券（5年）第48回	0.70000 2010-06-20	30,000,000	100.27 100.27	30,079,666 30,079,666	7.00
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券（5年）第63回	1.20000 2012-03-20	20,000,000	102.07 102.18	20,413,000 20,435,400	4.75
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券（5年）第42回	0.60000 2009-12-20	20,000,000	100.02 100.02	20,003,038 20,003,038	4.65
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券（2年）第272回	0.70000 2010-09-15	5,000,000	100.42 100.42	5,021,152 5,021,152	1.17

< 親投資信託受益証券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	親投資信託受益証券 -	インデックス東証株式マザーファンド	312,809,598	0.7228 0.6980	226,101,655 218,341,099	50.78

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率（％）
国債証券	26.91
親投資信託受益証券	50.78
合計	77.69

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

該当事項はありません。

(3) 運用実績
純資産の推移

期別	1口当たりの純資産額(円)		純資産総額(百万円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第13計算期間末(2000年11月7日)	0.9021	0.9026	883	884
第14計算期間末(2001年11月7日)	0.7602	0.7607	756	756
第15計算期間末(2002年11月7日)	0.6969	0.6974	682	683
第16計算期間末(2003年11月7日)	0.7560	0.7565	724	725
第17計算期間末(2004年11月8日)	0.7722	0.7727	701	701
第18計算期間末(2005年11月7日)	0.8973	0.8978	744	745
第19計算期間末(2006年11月7日)	0.9269	0.9274	725	725
第20計算期間末(2007年11月7日)	0.9053	0.9058	579	580
第21計算期間末(2008年11月7日)	0.6881	0.6886	443	443
第22計算期間末(2009年11月9日)	0.6884	0.6889	438	438

	1口当たりの純資産額(円)	純資産総額(百万円)
2008年11月末日	0.6712	433
2008年12月末日	0.6816	439
2009年1月末日	0.6554	422
2009年2月末日	0.6398	414
2009年3月末日	0.6515	422
2009年4月末日	0.6775	433
2009年5月末日	0.7008	444
2009年6月末日	0.7129	453
2009年7月末日	0.7201	460
2009年8月末日	0.7254	458
2009年9月末日	0.7051	447
2009年10月末日	0.6986	443
2009年11月末日	0.6757	429

分配の推移

	1口当たり税込み分配金(円)
第13計算期間(1999年11月9日~2000年11月7日)	0.0005
第14計算期間(2000年11月8日~2001年11月7日)	0.0005
第15計算期間(2001年11月8日~2002年11月7日)	0.0005
第16計算期間(2002年11月8日~2003年11月7日)	0.0005
第17計算期間(2003年11月8日~2004年11月8日)	0.0005
第18計算期間(2004年11月9日~2005年11月7日)	0.0005
第19計算期間(2005年11月8日~2006年11月7日)	0.0005
第20計算期間(2006年11月8日~2007年11月7日)	0.0005
第21計算期間(2007年11月8日~2008年11月7日)	0.0005
第22計算期間(2008年11月8日~2009年11月9日)	0.0005

収益率の推移

	収益率(%)
第13計算期間(1999年11月9日~2000年11月7日)	4.79
第14計算期間(2000年11月8日~2001年11月7日)	15.67
第15計算期間(2001年11月8日~2002年11月7日)	8.26
第16計算期間(2002年11月8日~2003年11月7日)	8.55
第17計算期間(2003年11月8日~2004年11月8日)	2.21
第18計算期間(2004年11月9日~2005年11月7日)	16.27
第19計算期間(2005年11月8日~2006年11月7日)	3.35
第20計算期間(2006年11月8日~2007年11月7日)	2.28
第21計算期間(2007年11月8日~2008年11月7日)	23.94
第22計算期間(2008年11月8日~2009年11月9日)	0.12

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額、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。

(参考) インデックス東証株式マザーファンド

以下の運用状況は平成21年11月30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。
- ・有価証券指数等先物取引の金額は、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。

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
株式	8,850,780	97.85
日本	8,850,780	97.85
新株予約権証券	230	0.00
日本	230	0.00
有価証券指数等先物取引(買建)	(176,400)	(1.95)
日本	(176,400)	(1.95)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	194,485	2.15
純資産総額	9,045,495	100.00

(2) 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

<株式>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	株式 輸送用機器	トヨタ自動車	110,300	3,608 3,440	397,937,900 379,432,000	4.19
日本円 日本	株式 銀行業	三菱UFJフィナンシャル・グループ	496,700	487 482	241,892,900 239,409,400	2.65
日本円 日本	株式 輸送用機器	ホンダ	68,500	2,780 2,700	190,430,000 184,950,000	2.04
日本円 日本	株式 電気機器	キヤノン	49,800	3,593 3,330	178,936,800 165,834,000	1.83
日本円 日本	株式 情報・通信業	日本電信電話	33,400	3,840 3,750	128,256,000 125,250,000	1.38
日本円 日本	株式 銀行業	三井住友フィナンシャルグループ	43,400	3,310 2,850	143,654,000 123,690,000	1.37
日本円 日本	株式 卸売業	三菱商事	63,300	2,047 1,950	129,593,100 123,435,000	1.36
日本円 日本	株式 電気・ガス業	東京電力	50,500	2,265 2,330	114,382,500 117,665,000	1.30
日本円 日本	株式 医薬品	武田薬品工業	31,600	3,662 3,600	115,730,600 113,760,000	1.26
日本円 日本	株式 銀行業	みずほフィナンシャルグループ	690,100	181 162	124,608,508 111,796,200	1.24
日本円 日本	株式 電気機器	ソニー	42,900	2,670 2,325	114,543,000 99,742,500	1.10
日本円 日本	株式 証券、商品先物取引業	野村ホールディングス	157,600	682 622	107,457,390 98,027,200	1.08
日本円 日本	株式 その他製品	任天堂	4,500	24,326 21,210	109,469,200 95,445,000	1.06
日本円 日本	株式 情報・通信業	NTTドコモ	703	133,700 131,000	93,991,100 92,093,000	1.02
日本円 日本	株式 陸運業	東日本旅客鉄道	14,900	6,230 6,100	92,827,000 90,890,000	1.00
日本円 日本	株式 電気機器	パナソニック	78,500	1,295 1,111	101,657,500 87,213,500	0.96
日本円 日本	株式 電気機器	東芝	181,000	542 458	98,106,000 82,898,000	0.92
日本円 日本	株式 保険業	東京海上ホールディングス	32,100	2,480 2,485	79,608,000 79,768,500	0.88
日本円 日本	株式 卸売業	三井物産	68,300	1,298 1,144	88,653,400 78,135,200	0.86
日本円 日本	株式 鉄鋼	新日本製鐵	236,000	363 321	85,580,000 75,756,000	0.84
日本円 日本	株式 不動産業	三菱地所	56,000	1,457 1,345	81,592,000 75,320,000	0.83
日本円 日本	株式 情報・通信業	ソフトバンク	34,600	2,166 2,070	74,952,400 71,622,000	0.79
日本円 日本	株式 電気・ガス業	関西電力	33,100	2,025 2,150	67,027,500 71,165,000	0.79
日本円 日本	株式 小売業	セブン&アイ・ホールディングス	33,800	2,099 1,933	70,948,400 65,335,400	0.72
日本円 日本	株式 化学	信越化学工業	13,800	5,340 4,690	73,692,000 64,722,000	0.72
日本円 日本	株式 機械	コマツ	37,300	1,832 1,698	68,333,600 63,335,400	0.70

日本円 日本	株式 情報・通信業	KDDI	131	502,888 467,000	65,878,386 61,177,000	0.68
日本円 日本	株式 輸送用機器	日産自動車	96,400	666 626	64,202,400 60,346,400	0.67
日本円 日本	株式 電気・ガス業	中部電力	27,000	2,095 2,210	56,565,000 59,670,000	0.66
日本円 日本	株式 電気機器	ファナック	8,300	7,899 7,140	65,563,000 59,262,000	0.66

<新株予約権証券>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	新株予約権証券 -	DOWAホールディングス(新株予約権)	10,000	29 23	290,000 230,000	0.00

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
株式	97.85
電気機器	13.49
輸送用機器	9.86
銀行業	9.42
化学	5.68
情報・通信業	5.63
電気・ガス業	5.39
卸売業	4.83
機械	4.42
医薬品	4.31
陸運業	4.08
小売業	3.56
食料品	3.44
鉄鋼	2.49
不動産業	2.29
保険業	2.20
その他製品	2.14
建設業	1.91
証券、商品先物取引業	1.88
サービス業	1.60
精密機器	1.56
非鉄金属	1.20
ガラス・土石製品	1.14
繊維製品	0.87
金属製品	0.65
その他金融業	0.63
石油・石炭製品	0.62
ゴム製品	0.54
海運業	0.44
鉱業	0.42
空運業	0.41
パルプ・紙	0.40
倉庫・運輸関連業	0.24
水産・農林業	0.11
新株予約権証券	0.00
合計	97.85

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

<有価証券指数等先物取引>

国・地域	銘柄名	種類	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
日本	東証株価指数先物 2009-12	買建	21	190,823,532	176,400,000	1.95

合計	-	190,823,532	176,400,000	1.95
----	---	-------------	-------------	------

6【手続等の概要】

(1) 申込（販売）手続等

申込方法

- ・原則として、勤務先の事務局を通じて、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・原則として、勤務先の事務局を通じて給与天引きで行なわれるため、販売会社に入金された日を
取得申込受付日とします。

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です。

申込単位

勤務先の事務局、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。

申込代金の支払い

原則として、勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

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、外国為替取引の停止、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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

(2) 換金（解約）手続等

< 解約請求による換金 >

解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

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。

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。

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。

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、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

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。

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、外国為替取引の停止、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。

< 買取請求による換金 >

買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

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。

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。

手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

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、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

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、外国為替取引の停止、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。

7【管理及び運営の概要】

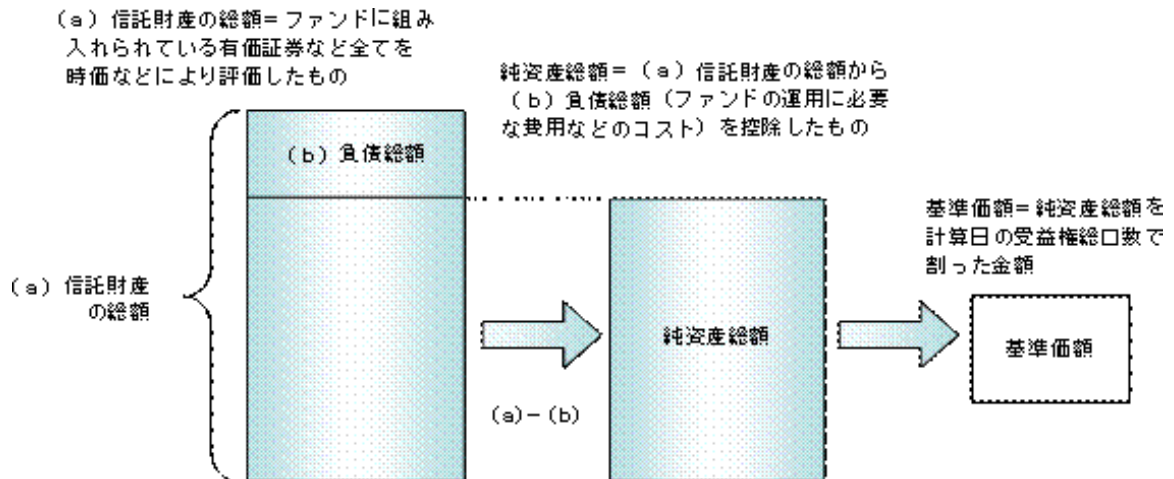
(1) 資産管理等の概要

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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額算出の流れ >



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 >

インデックスポートフォリオ	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。
バランスポートフォリオ	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。 公社債（国内・外国） 原則として、基準価額計算日 [*] における以下のいずれかの価額で評価します。 a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） b) 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。） c) 価格情報会社の提供する価額 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。 [*] 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

信託期間

無期限とします（昭和62年11月27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。

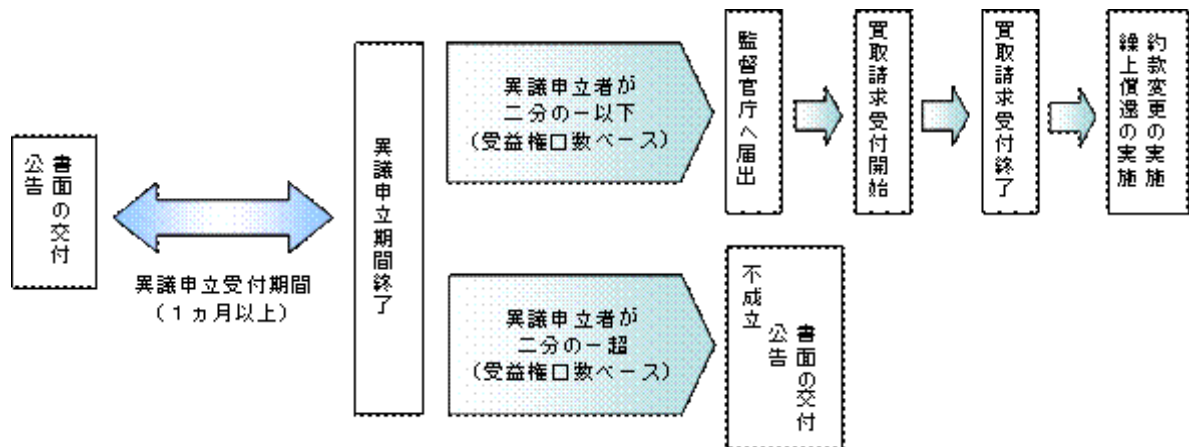
計算期間

毎年11月8日から翌年11月7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。

その他

- 1) 信託の終了(繰上償還)
 - イ) 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。
 - a) 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
 - b) 対象インデックスが改廃の場合
 - c) やむを得ない事情が発生したとき
 - ロ) 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いません。
 - ハ) 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。)
- 二) 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときなどには、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。
- ホ) 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
 - イ) 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。
 - ロ) 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いません。
 - ハ) この信託約款の変更に関する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。)
- 二) 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
 - イ) 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することができます。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ときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
 - ロ) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、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いません。
 - ハ) 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、每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。

(2) 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。

- ・ 収益分配金・償還金受領権
- ・ 解約請求権
- ・ 帳簿閲覧権

第2【財務ハイライト情報】

- (1) 以下の情報は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」に記載されている「財務諸表」から抜粋して記載したものです。
- (2) 「財務諸表」については、あらた監査法人による監査を受けております。また、当該監査法人による監査報告書は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」に記載されている「財務諸表」に添付されています。

インデックスポートフォリオ

1【貸借対照表】

(単位：円)

科目	期別	第21期 平成20年11月7日現在	第22期 平成21年11月9日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		108,465,392	75,949,556
親投資信託受益証券		9,113,734,849	9,158,180,242
未収入金		1,568,063	11,093,842
流動資産合計		9,223,768,304	9,245,223,640
資産合計		9,223,768,304	9,245,223,640
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		12,709,198	12,866,842
未払解約金		49,110	1,461,178
未払受託者報酬		5,256,067	4,111,821
未払委託者報酬		94,610,446	74,013,871
その他未払費用		448,665	410,712
流動負債合計		113,073,486	92,864,424
負債合計		113,073,486	92,864,424
純資産の部			
元本等			
元本		25,418,396,775	25,733,685,610
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		16,307,701,957	16,581,326,394
（分配準備積立金）		659,118,574	620,412,558
元本等合計		9,110,694,818	9,152,359,216
純資産合計		9,110,694,818	9,152,359,216
負債純資産合計		9,223,768,304	9,245,223,640

2【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

科目	期別	第21期 自平成19年11月8日 至平成20年11月7日	第22期 自平成20年11月8日 至平成21年11月9日
		金額	金額
営業収益			
受取利息		334,860	45,851
有価証券売買等損益		6,688,211,517	90,843,785
営業収益合計		6,687,876,657	90,889,636
営業費用			
受託者報酬		11,066,009	7,613,543
委託者報酬		199,190,456	137,045,976
その他費用		915,303	760,831
営業費用合計		211,171,768	145,420,350
営業損失()		6,899,048,425	54,530,714
経常損失()		6,899,048,425	54,530,714
当期純損失()		6,899,048,425	54,530,714
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		68,819,298	4,642,260
期首剰余金又は期首欠損金()		9,266,713,665	16,307,701,957
剰余金増加額又は欠損金減少額		269,608,564	656,975,695
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		269,608,564	656,975,695
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		467,658,531	867,844,836
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		467,658,531	867,844,836
分配金		12,709,198	12,866,842
期末剰余金又は期末欠損金()		16,307,701,957	16,581,326,394

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	期別	第21期 自平成19年11月8日 至平成20年11月7日	第22期 自平成20年11月8日 至平成21年11月9日
	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. 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11月8日から翌年11月7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いたしますので、当計算期間は平成20年11月8日から平成21年11月9日までとなっております。

バランスポートフォリオ

1 貸借対照表

（単位：円）

科目	期別	第21期 平成20年11月7日現在	第22期 平成21年11月9日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		102,792,569	110,080,752
国債証券		125,175,908	115,678,873
親投資信託受益証券		219,481,730	216,101,655
未収利息		281,656	199,151
前払費用		383	-
流動資産合計		447,732,246	442,060,431
資産合計		447,732,246	442,060,431
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		322,143	318,173
未払受託者報酬		214,999	192,271
未払委託者報酬		3,871,036	3,462,097
その他未払費用		21,442	19,172
流動負債合計		4,429,620	3,991,713
負債合計		4,429,620	3,991,713
純資産の部			
元本等			
元本		644,287,839	636,347,568
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		200,985,213	198,278,850
（分配準備積立金）		16,229,947	15,076,250
元本等合計		443,302,626	438,068,718
純資産合計		443,302,626	438,068,718
負債純資産合計		447,732,246	442,060,431

2 損益及び剰余金計算書

(単位:円)

科目	期別	第21期 自平成19年11月8日 至平成20年11月7日	第22期 自平成20年11月8日 至平成21年11月9日
		金額	金額
営業収益			
受取利息		1,587,995	989,082
有価証券売買等損益		131,730,726	6,734,490
営業収益合計		130,142,731	7,723,572
営業費用			
受託者報酬		441,071	370,221
委託者報酬		7,941,356	6,666,224
その他費用		43,991	36,909
営業費用合計		8,426,418	7,073,354
営業利益又は営業損失()		138,569,149	650,218
経常利益又は経常損失()		138,569,149	650,218
当期純利益又は当期純損失()		138,569,149	650,218
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		1,120,998	17,589
期首剰余金又は期首欠損金()		60,625,971	200,985,213
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,194,125	11,688,358
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,194,125	11,688,358
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		4,783,073	9,331,629
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		4,783,073	9,331,629
分配金		322,143	318,173
期末剰余金又は期末欠損金()		200,985,213	198,278,850

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

期別 項目	第21期 自平成19年11月8日 至平成20年11月7日	第22期 自平成20年11月8日 至平成21年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(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）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(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。</p> <p>(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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>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。</p>	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(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。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	-	<p>当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月8日から翌年11月7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したしますので、当計算期間は平成20年11月8日から平成21年11月9日までとなっております。</p>

第3【内国投資信託受益証券事務の概要】**(1) 名義書換**

該当事項はありません。

(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

譲渡制限はありません。

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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

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4【ファンドの詳細情報の項目】

有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」（投資信託説明書（請求目論見書））の記載項目は以下の通りです。

第1 ファンドの沿革**第2 手続等**

1 申込（販売）手続等

2 換金（解約）手続等

第3 管理及び運営

1 資産管理等の概要

(1) 資産の評価

(2) 保管

(3) 信託期間

(4) 計算期間

(5) その他

2 受益者の権利等

第4 ファンドの経理状況

1 財務諸表

(1) 貸借対照表

(2) 損益及び剰余金計算書

(3) 注記表

(4) 附属明細表

2 ファンドの現況

純資産額計算書

第5 設定及び解約の実績

第三部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

昭和62年11月27日 ファンドの信託契約締結、運用開始

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

- ・原則として、勤務先の事務局を通じて、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・原則として、勤務先の事務局を通じて給与天引きで行なわれるため、販売会社に入金された日を取得申込受付日とします。

(2) 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です。

(3) 申込単位

勤務先の事務局、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

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。

(4) 申込代金の支払い

原則として、勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

(5) 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、外国為替取引の停止、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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

(2) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基つき、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。

(3) 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

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。

(4) 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。

(5) 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、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

(6) 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。

(7) 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、外国為替取引の停止、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) 買取りの請求
勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。
- (2) 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。
- (3) 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。
- (4) 手取額
1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。
- (5) 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、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。
- (6) 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、外国為替取引の停止、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。

第3【管理及び運営】

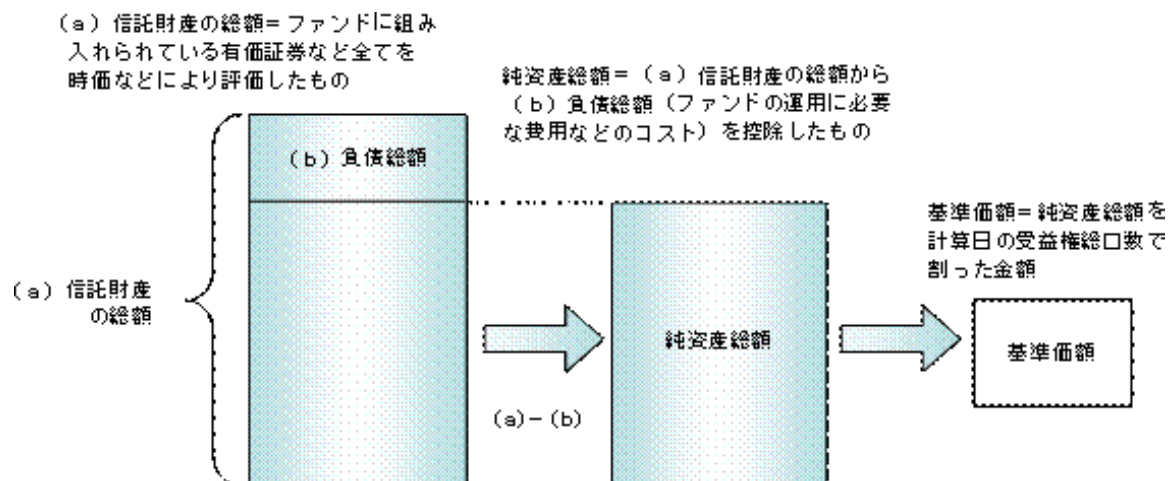
1【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額算出の流れ >



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 >

インデックスポートフォリオ	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。
---------------	--

<p>バランスポートフォリオ</p>	<p>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。 公社債（国内・外国） 原則として、基準価額計算日[*]における以下のいずれかの価額で評価します。 a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） b) 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。） c) 価格情報会社の提供する価額 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。 [*] 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。</p>
--------------------	---

- ・ 外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

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

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（昭和62年11月27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11月8日から翌年11月7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】

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) 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
 - ロ) 対象インデックスが改廃の場合
 - ハ) 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。）に異議を述べるすることができます。（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。）
 - 二) 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。
- 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。

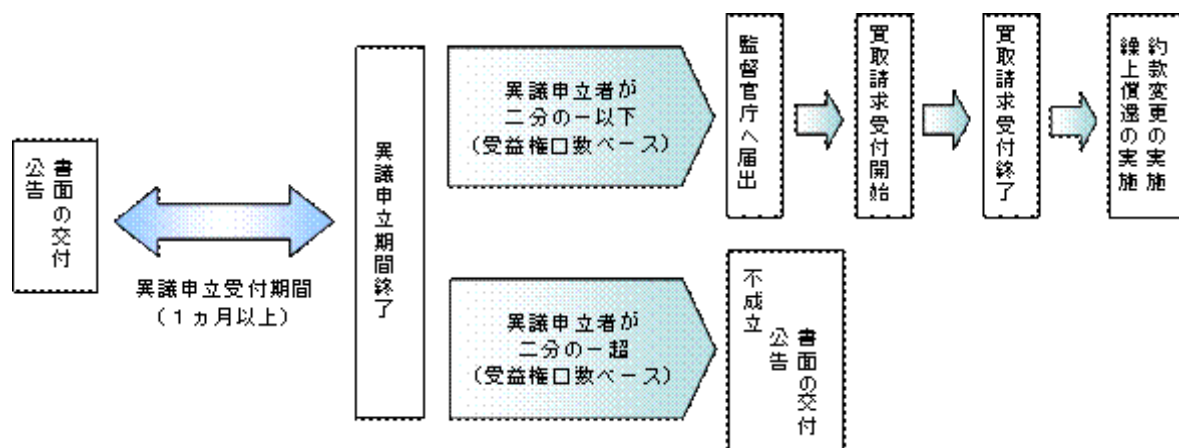
信託約款の変更

- 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することができます。（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。

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することができます。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 >



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

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。

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。

2【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4【ファンドの経理状況】

<インデックスポートフォリオ>

<バランスポートフォリオ>

- (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。その後の改正を含みます。）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。その後の改正を含みます。）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21期計算期間（平成19年11月8日から平成20年11月7日まで）及び第22期計算期間（平成20年11月8日から平成21年11月9日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【インデックスポートフォリオ】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 平成20年11月7日現在	第22期 平成21年11月9日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	108,465,392	75,949,556
親投資信託受益証券	9,113,734,849	9,158,180,242
未収入金	1,568,063	11,093,842
流動資産合計	9,223,768,304	9,245,223,640
資産合計		
	9,223,768,304	9,245,223,640
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	12,709,198	12,866,842
未払解約金	49,110	1,461,178
未払受託者報酬	5,256,067	4,111,821
未払委託者報酬	94,610,446	74,013,871
その他未払費用	448,665	410,712
流動負債合計	113,073,486	92,864,424
負債合計		
	113,073,486	92,864,424
純資産の部		
元本等		
元本	25,418,396,775	25,733,685,610
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	16,307,701,957	16,581,326,394
(分配準備積立金)	659,118,574	620,412,558
元本等合計	9,110,694,818	9,152,359,216
純資産合計		
	9,110,694,818	9,152,359,216
負債純資産合計		
	9,223,768,304	9,245,223,640

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第21期	第22期
	自 平成19年11月8日 至 平成20年11月7日	自 平成20年11月8日 至 平成21年11月9日
営業収益		
受取利息	334,860	45,851
有価証券売買等損益	6,688,211,517	90,843,785
営業収益合計	6,687,876,657	90,889,636
営業費用		
受託者報酬	11,066,009	7,613,543
委託者報酬	199,190,456	137,045,976
その他費用	915,303	760,831
営業費用合計	211,171,768	145,420,350
営業損失()	6,899,048,425	54,530,714
経常損失()	6,899,048,425	54,530,714
当期純損失()	6,899,048,425	54,530,714
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	68,819,298	4,642,260
期首剰余金又は期首欠損金()	9,266,713,665	16,307,701,957
剰余金増加額又は欠損金減少額	269,608,564	656,975,695
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	269,608,564	656,975,695
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	467,658,531	867,844,836
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	467,658,531	867,844,836
分配金	12,709,198	12,866,842
期末剰余金又は期末欠損金()	16,307,701,957	16,581,326,394

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第21期		第22期	
	自平成19年11月8日 至平成20年11月7日		自平成20年11月8日 至平成21年11月9日	
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。		親投資信託受益証券 同左	
2. 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11月8日から翌年11月7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いたしますので、当計算期間は平成20年11月8日から平成21年11月9日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

第21期 平成20年11月7日現在			第22期 平成21年11月9日現在		
1.	期首元本額	25,166,580,489 円	1.	期首元本額	25,418,396,775 円
	期中追加設定元本額	981,834,490 円		期中追加設定元本額	1,338,588,106 円
	期中解約元本額	730,018,204 円		期中解約元本額	1,023,299,271 円
2.	計算期間末日における 受益権の総数	25,418,396,775 口	2.	計算期間末日における 受益権の総数	25,733,685,610 口
3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は16,307,701,957円であります。		3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は16,581,326,394円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第21期 自平成19年11月8日 至平成20年11月7日			第22期 自平成20年11月8日 至平成21年11月9日		
A	分配金の計算過程 計算期末における費用控除後の 配当等収益	0 円	A	分配金の計算過程 計算期末における費用控除後の 配当等収益	0 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	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	2,854,587,998 円	C	信託約款に定める収益調整金	2,924,009,072 円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	671,827,772 円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	633,279,400 円
E	分配対象収益 (A + B + C + D)	3,526,415,770 円	E	分配対象収益 (A + B + C + D)	3,557,288,472 円
F	分配対象収益 (1口当たり) (1万口当たり)	0.1387 円 1,387 円	F	分配対象収益 (1口当たり) (1万口当たり)	0.1382 円 1,382 円
G	分配金額	12,709,198 円	G	分配金額	12,866,842 円
H	分配金額 (1口当たり) (1万口当たり)	0.0005 円 5 円	H	分配金額 (1口当たり) (1万口当たり)	0.0005 円 5 円

(有価証券に関する注記)

第21期（自平成19年11月8日 至 平成20年11月7日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	貸借対照表計上額	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	9,113,734,849	6,630,878,926
合計	9,113,734,849	6,630,878,926

第22期（自平成20年11月8日 至 平成21年11月9日）

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	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	9,158,180,242	92,419,877
合計	9,158,180,242	92,419,877

(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21期 平成20年11月7日現在		第22期 平成21年11月9日現在	
1口当たり純資産額	0.3584 円	1口当たり純資産額	0.3557 円
(1万口当たり純資産額)	(3,584 円)	(1万口当たり純資産額)	(3,557 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

(親投資信託受益証券)

(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	インデックス東証株式マザーファンド	12,649,420,225	9,158,180,242	
合計		12,649,420,225	9,158,180,242	

(注) 親投資信託受益証券における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

該当事項はありません。

【バランスポートフォリオ】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 平成20年11月7日現在	第22期 平成21年11月9日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	102,792,569	110,080,752
国債証券	125,175,908	115,678,873
親投資信託受益証券	219,481,730	216,101,655
未収利息	281,656	199,151
前払費用	383	-
流動資産合計	447,732,246	442,060,431
資産合計	447,732,246	442,060,431
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	322,143	318,173
未払受託者報酬	214,999	192,271
未払委託者報酬	3,871,036	3,462,097
その他未払費用	21,442	19,172
流動負債合計	4,429,620	3,991,713
負債合計	4,429,620	3,991,713
純資産の部		
元本等		
元本	644,287,839	636,347,568
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	200,985,213	198,278,850
（分配準備積立金）	16,229,947	15,076,250
元本等合計	443,302,626	438,068,718
純資産合計	443,302,626	438,068,718
負債純資産合計	447,732,246	442,060,431

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第21期	第22期
	自 平成19年11月8日 至 平成20年11月7日	自 平成20年11月8日 至 平成21年11月9日
営業収益		
受取利息	1,587,995	989,082
有価証券売買等損益	131,730,726	6,734,490
営業収益合計	130,142,731	7,723,572
営業費用		
受託者報酬	441,071	370,221
委託者報酬	7,941,356	6,666,224
その他費用	43,991	36,909
営業費用合計	8,426,418	7,073,354
営業利益又は営業損失()	138,569,149	650,218
経常利益又は経常損失()	138,569,149	650,218
当期純利益又は当期純損失()	138,569,149	650,218
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	1,120,998	17,589
期首剰余金又は期首欠損金()	60,625,971	200,985,213
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,194,125	11,688,358
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,194,125	11,688,358
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	4,783,073	9,331,629
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	4,783,073	9,331,629
分配金	322,143	318,173
期末剰余金又は期末欠損金()	200,985,213	198,278,850

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

期 別 項 目	第21期 自 平成19年11月8日 至 平成20年11月7日	第22期 自 平成20年11月8日 至 平成21年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(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）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(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。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月8日から翌年11月7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いたしますので、当計算期間は平成20年11月8日から平成21年11月9日までとなっております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		

（貸借対照表に関する注記）

第21期 平成20年11月7日現在		第22期 平成21年11月9日現在	
1.	期首元本額 640,354,452 円 期中追加設定元本額 26,940,763 円 期中解約元本額 23,007,376 円	1.	期首元本額 644,287,839 円 期中追加設定元本額 29,474,951 円 期中解約元本額 37,415,222 円
2.	計算期間末日における 受益権の総数 644,287,839 口	2.	計算期間末日における 受益権の総数 636,347,568 口
3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は200,985,213円であります。	3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は198,278,850円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第21期 自平成19年11月8日 至平成20年11月7日		第22期 自平成20年11月8日 至平成21年11月9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 0 円	A	計算期末における費用控除後の配 当等収益 85,107 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	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 85,648,799 円	C	信託約款に定める収益調整金 85,313,797 円
D	信託約款に定める分配準備積立金 16,552,090 円	D	信託約款に定める分配準備積立金 15,309,316 円
E	分配対象収益（A + B + C + D） 102,200,889 円	E	分配対象収益（A + B + C + D） 100,708,220 円
F	分配対象収益（1口当たり） （1万口当たり） 0.1586 円 1,586 円	F	分配対象収益（1口当たり） （1万口当たり） 0.1582 円 1,582 円
G	分配金額 322,143 円	G	分配金額 318,173 円
H	分配金額（1口当たり） （1万口当たり） 0.0005 円 5 円	H	分配金額（1口当たり） （1万口当たり） 0.0005 円 5 円

（有価証券に関する注記）

第21期（自平成19年11月8日至平成20年11月7日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	125,175,908	238,708
親投資信託受益証券	219,481,730	121,711,670
合計	344,657,638	121,472,962

第22期（自平成20年11月8日至平成21年11月9日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	115,678,873	99,527
親投資信託受益証券	216,101,655	6,457,765
合計	331,780,528	6,358,238

（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21期 平成20年11月7日現在		第22期 平成21年11月9日現在	
1口当たり純資産額	0.6881 円	1口当たり純資産額	0.6884 円
（1万口当たり純資産額）	（6,881 円）	（1万口当たり純資産額）	（6,884 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

(邦貨建債券)

(単位：円)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	0042 0272	利付国庫債券（2年）第272回	5,000,000	5,022,685	
	0045 0042	利付国庫債券（5年）第42回	20,000,000	20,005,852	
	0045 0048	利付国庫債券（5年）第48回	30,000,000	30,087,940	
	0045 0049	利付国庫債券（5年）第49回	40,000,000	40,149,396	
	0045 0063	利付国庫債券（5年）第63回	20,000,000	20,413,000	
国債証券計			115,000,000	115,678,873	
合計			115,000,000	115,678,873	

(親投資信託受益証券)

(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	インデックス東証株式マザーファンド	298,482,950	216,101,655	
合計		298,482,950	216,101,655	

(注) 親投資信託受益証券における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

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「インデックス東証株式マザーファンド」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。

「インデックス東証株式マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

インデックス東証株式マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成20年11月7日現在	平成21年11月9日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		370,016	903,263
コール・ローン		302,626,672	150,507,992
株式		8,945,606,965	9,164,785,950
新株予約権証券		-	260,000
派生商品評価勘定		4,204,497	-
未収配当金		95,843,601	64,533,146
前払金		97,168,000	10,739,000
流動資産合計		9,445,819,751	9,391,729,351
資産合計		9,445,819,751	9,391,729,351
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		103,518,645	9,551,816
未払金		3,402,161	2,370,518
未払解約金		1,568,063	11,093,842
流動負債合計		108,488,869	23,016,176
負債合計		108,488,869	23,016,176
純資産の部			
元本等			
元本		13,017,038,466	12,947,903,175
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,679,707,584	3,579,190,000
元本等合計		9,337,330,882	9,368,713,175
純資産合計		9,337,330,882	9,368,713,175
負債純資産合計		9,445,819,751	9,391,729,351

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間 自 平成19年11月8日 至 平成20年11月7日	自 平成20年11月8日 至 平成21年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>(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）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(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。</p> <p>(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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>株式及び新株予約権証券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。</p> <p>(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。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p style="text-align: center;">同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p style="text-align: center;">同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引</p> <p>個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>	<p>デリバティブ取引</p> <p style="text-align: center;">同左</p>

（貸借対照表に関する注記）

平成20年11月7日現在			平成21年11月9日現在		
1.	期首	平成19年11月8日	1.	期首	平成20年11月8日
	期首元本額	13,010,864,880 円		期首元本額	13,017,038,466 円
	期首からの追加設定元本額	362,203,056 円		期首からの追加設定元本額	443,702,731 円
	期首からの解約元本額	356,029,470 円		期首からの解約元本額	512,838,022 円
	平成20年11月7日現在の元本の内訳			平成21年11月9日現在の元本の内訳	
	インデックスポートフォリオ	12,710,927,266 円		インデックスポートフォリオ	12,649,420,225 円
	バランスポートフォリオ	306,111,200 円		バランスポートフォリオ	298,482,950 円
	（合計）	13,017,038,466 円		（合計）	12,947,903,175 円
2.	本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	13,017,038,466 口	2.	本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	12,947,903,175 口
3.	元本の欠損		3.	元本の欠損	
	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,679,707,584円であります。			貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,579,190,000円であります。	
4.	担保資産		4.	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通りであります。			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通りであります。	
	株式	108,240,000 円		株式	105,000,000 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

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成19年11月8日 至 平成20年11月7日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	8,945,606,965	762,695,230
合計	8,945,606,965	762,695,230

対象期間（自 平成20年11月8日 至 平成21年11月9日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	9,164,785,950	443,643,831
新株予約権証券	260,000	30,000
合計	9,165,045,950	443,673,831

（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報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間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）

取引の状況に関する事項

	自 平成19年11月8日 至 平成20年11月7日	自 平成20年11月8日 至 平成21年11月9日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、およびスワップ取引であります。	同左
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また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。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。	同左

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(単位:円)

区分	種類	平成20年11月7日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	462,847,000	-	363,670,000	99,177,000
		合計	462,847,000	-	363,670,000

(単位:円)

区分	種類	平成21年11月9日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	174,701,000	-	165,205,000	9,496,000
		合計	174,701,000	-	165,205,000

(注)時価の算定方法

1. 計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定します。
2. 先物取引の残高表示は契約額ベースです。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(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20年11月7日現在		平成21年11月9日現在	
1口当たり純資産額	0.717円	1口当たり純資産額	0.724円
(1千口当たり純資産額)	(717円)	(1千口当たり純資産額)	(724円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:株,円)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
1301	極洋	4,000	181	724,000	
1332	日本水産	9,700	248	2,405,600	
1334	マルハニチロホールディングス	19,000	131	2,489,000	
1352	ハウスイ	1,000	125	125,000	
1377	サカタのタネ	1,800	1,390	2,502,000	
1379	ホクト	1,000	1,981	1,981,000	
1414	ショーボンドホールディングス	900	1,625	1,462,500	
1514	住石ホールディングス	2,100	98	205,800	
1515	日鉄鉱業	2,000	408	816,000	
1518	三井松島産業	4,000	165	660,000	
1605	国際石油開発帝石	44	784,000	34,496,000	
1661	関東天然瓦斯開発	1,000	533	533,000	
1662	石油資源開発	1,500	4,590	6,885,000	
1712	ダイセキ環境ソリューション	1	143,300	143,300	
1719	ハザマ	3,800	97	368,600	
1720	東急建設	3,240	243	787,320	
1721	コムシスホールディングス	3,900	868	3,385,200	
1722	ミサワホーム	1,100	311	342,100	
1762	高松コンストラクショングループ	700	1,260	882,000	
1766	東建コーポレーション	340	2,880	979,200	
1780	ヤマウラ	500	201	100,500	
1801	大成建設	41,000	171	7,011,000	
1802	大林組	25,000	336	8,400,000	
1803	清水建設	26,000	348	9,048,000	
1808	長谷工コーポレーション	45,500	67	3,048,500	
1810	松井建設	1,000	330	330,000	
1812	鹿島	39,000	211	8,229,000	
1813	不動テトラ	6,500	61	396,500	
1814	大末建設	4,000	39	156,000	
1815	鉄建	6,000	77	462,000	
1816	安藤建設	3,000	120	360,000	
1819	太平工業	2,000	306	612,000	
1820	西松建設	12,000	129	1,548,000	
1821	三井住友建設	4,900	78	382,200	
1822	大豊建設	2,000	63	126,000	
1824	前田建設工業	7,000	250	1,750,000	
1827	ナカノフドー建設	1,000	170	170,000	
1833	奥村組	9,000	285	2,565,000	
1834	大和小田急建設	500	228	114,000	
1835	東鉄工業	1,000	516	516,000	
1847	イチケン	1,000	124	124,000	
1852	浅沼組	3,000	69	207,000	
1860	戸田建設	10,000	295	2,950,000	
1861	熊谷組	7,000	65	455,000	
1865	青木あすなる建設	500	544	272,000	
1866	北野建設	2,000	226	452,000	
1867	植木組	1,000	120	120,000	
1868	三井ホーム	1,000	496	496,000	
1870	矢作建設工業	1,000	598	598,000	
1871	ピーエス三菱	600	330	198,000	
1878	大東建託	3,800	3,860	14,668,000	
1879	新日本建設	1,200	159	190,800	
1881	N I P P O	2,000	678	1,356,000	
1882	東亜道路工業	2,000	128	256,000	

1883	前田道路	3,000	745	2,235,000	
1884	日本道路	3,000	221	663,000	
1885	東亜建設工業	8,000	91	728,000	
1888	若築建設	5,000	51	255,000	
1890	東洋建設	13,000	44	572,000	
1893	五洋建設	10,500	104	1,092,000	
1896	大林道路	1,000	150	150,000	
1898	世紀東急工業	2,000	59	118,000	
1899	福田組	1,000	178	178,000	
1911	住友林業	6,300	652	4,107,600	
1914	日本基礎技術	1,400	197	275,800	
1916	日成ビルド工業	3,000	54	162,000	
1919	エス・バイ・エル	4,000	49	196,000	
1921	巴コーポレーション	1,400	216	302,400	
1924	パナホーム	3,000	580	1,740,000	
1925	大和ハウス工業	22,000	938	20,636,000	
1926	ライト工業	1,900	190	361,000	
1928	積水ハウス	27,000	779	21,033,000	
1929	日特建設	2,000	41	82,000	
1930	北陸電気工事	1,000	285	285,000	
1932	コミュニチュア	1,000	542	542,000	
1934	ユアテック	1,000	541	541,000	
1937	西部電気工業	1,000	374	374,000	
1939	四電工	1,000	487	487,000	
1941	中電工	1,300	1,311	1,704,300	
1942	関電工	4,000	569	2,276,000	
1943	大明	1,100	749	823,900	
1944	きんでん	6,000	734	4,404,000	
1945	東京エネシス	1,000	714	714,000	
1946	トーエネック	1,000	527	527,000	
1949	住友電設	700	468	327,600	
1950	日本電設工業	2,000	750	1,500,000	
1951	協和エクシオ	3,200	783	2,505,600	
1952	新日本空調	600	618	370,800	
1954	日本工営	3,000	284	852,000	
1955	東電通	1,000	159	159,000	
1956	日本電話施設	2,000	257	514,000	
1959	九電工	2,000	522	1,044,000	
1961	三機工業	2,000	668	1,336,000	
1963	日揮	9,000	1,748	15,732,000	
1964	中外炉工業	3,000	258	774,000	
1967	ヤマト	1,000	303	303,000	
1968	太平電業	1,000	1,105	1,105,000	
1969	高砂熱学工業	2,000	723	1,446,000	
1972	三晃金属工業	1,000	241	241,000	
1973	NEC ネットエスアイ	700	1,172	820,400	
1975	朝日工業社	1,000	365	365,000	
1978	アタカ大機	1,000	208	208,000	
1979	大気社	1,300	1,240	1,612,000	
1980	ダイダン	1,000	458	458,000	
1982	日比谷総合設備	1,300	771	1,002,300	
1983	東芝プラントシステム	1,000	1,193	1,193,000	
2001	日本製粉	6,000	453	2,718,000	
2002	日清製粉グループ本社	8,500	1,220	10,370,000	
2003	日東富士製粉	1,000	332	332,000	
2004	昭和産業	4,000	297	1,188,000	
2009	鳥越製粉	800	800	640,000	
2052	協同飼料	3,000	117	351,000	
2053	中部飼料	1,000	866	866,000	
2056	日本配合飼料	3,000	111	333,000	
2059	ユニ・チャーム ペットケア	600	3,280	1,968,000	

[次へ](#)

2107	東洋精糖	2,000	125	250,000	
2108	日本甜菜製糖	5,000	224	1,120,000	
2109	三井製糖	3,000	309	927,000	
2127	日本M&Aセンター	2	383,000	766,000	
2131	アコーディア・ゴルフ	21	82,600	1,734,600	
2168	パソナグループ	9	69,100	621,900	
2170	リンクアンドモチベーション	1	43,800	43,800	
2181	テンプホールディングス	1,200	809	970,800	
2201	森永製菓	9,000	195	1,755,000	
2204	中村屋	2,000	465	930,000	
2206	江崎グリコ	3,000	991	2,973,000	
2207	名糖産業	400	1,268	507,200	
2211	不二家	6,000	153	918,000	
2212	山崎製パン	7,000	1,072	7,504,000	
2215	第一屋製パン	2,000	106	212,000	
2217	モロゾフ	2,000	299	598,000	
2264	森永乳業	8,000	420	3,360,000	
2267	ヤクルト本社	4,900	2,365	11,588,500	
2269	明治ホールディングス	2,800	3,590	10,052,000	
2270	雪印メグミルク	1,900	1,740	3,306,000	
2281	プリマハム	5,000	103	515,000	
2282	日本ハム	7,000	1,015	7,105,000	
2284	伊藤ハム	7,000	335	2,345,000	
2286	林兼産業	4,000	125	500,000	
2288	丸大食品	4,000	279	1,116,000	
2290	米久	1,000	915	915,000	
2292	S FOODS	500	816	408,000	
2301	学情	300	294	88,200	
2305	スタジオアリス	400	912	364,800	
2309	シミック	20	21,240	424,800	
2317	システムプロ	6	40,400	242,400	
2322	NECフィールドینگ	700	1,311	917,700	
2327	新日鉄ソリューションズ	700	1,630	1,141,000	
2331	総合警備保障	3,000	1,003	3,009,000	
2353	日本駐車場開発	104	4,350	452,400	
2359	コア	300	626	187,800	
2371	カカクコム	5	322,000	1,610,000	
2372	アイロムホールディングス	21	4,670	98,070	
2378	ルネサンス	200	308	61,600	
2392	セキュアード・キャピタル・ジャパン	2	82,500	165,000	
2395	新日本科学	400	608	243,200	
2413	ソネット・エムスリー	4	311,000	1,244,000	
2432	ディー・エヌ・エー	10	349,000	3,490,000	
2433	博報堂DYホールディングス	1,120	4,450	4,984,000	
2440	ぐるなび	5	225,100	1,125,500	
2450	一休	6	40,700	244,200	
2466	パシフィックゴルフグループインターナショナルホールディングス	19	60,200	1,143,800	
2501	サッポロホールディングス	14,000	471	6,594,000	
2502	アサヒビール	16,700	1,630	27,221,000	
2503	麒麟ホールディングス	39,000	1,453	56,667,000	
2531	宝ホールディングス	8,000	551	4,408,000	
2533	オエノンホールディングス	2,000	191	382,000	
2536	メルシャン	3,000	205	615,000	
2540	養命酒製造	1,000	863	863,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	1,200	750	900,000	
2579	コカ・コーラウエスト	2,400	1,638	3,931,200	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	1,100	1,184	1,302,400	
2590	ダイトードリンコ	400	2,715	1,086,000	
2593	伊藤園	2,700	1,452	3,920,400	
2594	キーコーヒー	800	1,591	1,272,800	
2597	ユニカフェ	200	996	199,200	

2599	ジャパンフーズ	100	825	82,500	
2602	日清オイリオグループ	4,000	470	1,880,000	
2607	不二製油	2,400	1,372	3,292,800	
2613	J - オイルミルズ	4,000	304	1,216,000	
2651	ローソン	2,500	3,900	9,750,000	
2657	インターニックス	400	348	139,200	
2659	サンエー	300	3,280	984,000	
2660	キリン堂	300	466	139,800	
2662	ダイユーエイト	100	647	64,700	
2664	カワチ薬品	500	1,814	907,000	
2670	エービーシー・マート	900	2,515	2,263,500	
2674	ハードオフコーポレーション	300	463	138,900	
2676	高千穂交易	400	942	376,800	
2678	アスクル	700	1,780	1,246,000	
2681	ゲオ	14	97,500	1,365,000	
2685	ポイント	770	5,330	4,104,100	
2692	伊藤忠食品	200	3,000	600,000	
2695	くらコーポレーション	2	298,000	596,000	
2698	キャンドゥ	4	99,800	399,200	
2715	エレマテック	600	982	589,200	
2726	パル	200	1,828	365,600	
2729	J A L U X	200	1,301	260,200	
2730	エディオン	3,400	756	2,570,400	
2734	サーラコーポレーション	1,000	550	550,000	
2737	トーメンデバイス	100	1,701	170,100	
2738	パルス	4	69,700	278,800	
2753	あみやき亭	1	194,900	194,900	
2768	双日	55,500	167	9,268,500	
2784	アルフレッサ ホールディングス	2,000	3,780	7,560,000	
2792	ハニーズ	670	577	386,590	
2801	キッコーマン	7,000	1,029	7,203,000	
2802	味の素	24,000	839	20,136,000	
2809	キューピー	5,000	1,020	5,100,000	
2810	ハウス食品	3,400	1,397	4,749,800	
2811	カゴメ	3,500	1,681	5,883,500	
2812	焼津水産化学工業	500	1,130	565,000	
2815	アリアケジャパン	800	1,391	1,112,800	
2871	ニチレイ	10,000	337	3,370,000	
2874	ヨコレイ	2,000	589	1,178,000	
2875	東洋水産	4,000	2,330	9,320,000	
2897	日清食品ホールディングス	3,400	3,360	11,424,000	
2899	永谷園	1,000	870	870,000	
2908	フジッコ	1,000	1,007	1,007,000	
2910	ロック・フィールド	500	1,206	603,000	
2914	J T	200	242,100	48,420,000	
2918	わらべや日洋	500	1,090	545,000	
2922	なとり	400	797	318,800	
3001	片倉工業	1,000	959	959,000	
3002	グンゼ	6,000	348	2,088,000	
3003	昭栄	1,400	757	1,059,800	
3004	神栄	2,000	126	252,000	
3009	川島織物セルコン	4,000	75	300,000	
3023	ラサ商事	300	332	99,600	
3028	アルペン	700	1,571	1,099,700	
3048	ビックカメラ	20	33,600	672,000	
3050	D C M Japanホールディングス	4,300	569	2,446,700	
3076	あい ホールディングス	2,000	305	610,000	
3078	ユニバース	100	1,341	134,100	
3086	J . フロント リテイリング	20,000	404	8,080,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	1,300	1,288	1,674,400	
3088	マツモトキヨシホールディングス	1,400	2,100	2,940,000	
3098	ココカラファイン ホールディングス	700	1,899	1,329,300	

3099	三越伊勢丹ホールディングス	14,700	830	12,201,000	
3101	東洋紡	30,000	142	4,260,000	
3103	ユニチカ	19,000	69	1,311,000	
3104	富士紡ホールディングス	4,000	164	656,000	
3105	日清紡ホールディングス	6,000	818	4,908,000	
3106	クラボウ	9,000	153	1,377,000	
3107	ダイワボウホールディングス	6,000	315	1,890,000	
3109	シキボウ	5,000	199	995,000	
3110	日東紡	7,000	158	1,106,000	
3116	トヨタ紡織	2,500	1,869	4,672,500	
3148	クリエイティブSDホールディングス	300	1,890	567,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,100	543	597,300	
3156	UKCホールディングス	500	1,164	582,000	
3201	ニッケ	3,000	570	1,710,000	
3202	大東紡織	1,000	77	77,000	
3204	トーア紡コーポレーション	3,000	67	201,000	
3205	グイドーリミテッド	1,100	631	694,100	
3225	東京建物不動産販売	200	298	59,600	
3231	野村不動産ホールディングス	4,000	1,421	5,684,000	
3265	ヒューリック	2,400	577	1,384,800	
3302	帝国繊維	1,000	528	528,000	
3313	ブックオフコーポレーション	400	1,336	534,400	
3315	日本コークス工業	7,500	110	825,000	
3321	ミタチ産業	200	451	90,200	
3332	JFE商事ホールディングス	6,000	328	1,968,000	
3337	サークルKサンクス	1,600	1,215	1,944,000	
3341	日本調剤	110	1,902	209,220	
3349	コスモス薬品	300	2,220	666,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	11	54,000	594,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	33,800	1,956	66,112,800	
3391	ツルハホールディングス	700	3,560	2,492,000	
3395	サンマルクホールディングス	300	2,660	798,000	
3396	フェリシモ	200	1,490	298,000	
3397	トリドール	3	189,900	569,700	
3401	帝人	31,000	277	8,587,000	
3402	東レ	56,000	487	27,272,000	
3404	三菱レイヨン	21,000	289	6,069,000	
3405	クラレ	12,000	1,016	12,192,000	
3407	旭化成	49,000	450	22,050,000	
3408	サカイオーバックス	3,000	86	258,000	
3421	稲葉製作所	400	918	367,200	
3431	宮地エンジニアリンググループ	3,000	90	270,000	
3432	三協・立山ホールディングス	11,000	86	946,000	
3433	トーカロ	400	1,381	552,400	
3434	アルファCo	300	576	172,800	
3436	SUMCO	4,600	1,660	7,636,000	
3443	川田テクノロジーズ	200	1,692	338,400	
3501	住江織物	2,000	121	242,000	
3512	日本フェルト	400	401	160,400	
3513	イチカワ	1,000	192	192,000	
3514	日本バイリーン	1,000	464	464,000	
3524	日東製網	1,000	115	115,000	
3526	芦森工業	2,000	123	246,000	
3529	アツギ	8,000	114	912,000	
3551	ダイニック	2,000	148	296,000	
3553	共和レザー	600	352	211,200	
3569	セーレン	2,100	603	1,266,300	
3577	東海染工	1,000	107	107,000	
3580	小松精練	1,000	357	357,000	
3591	ワコールホールディングス	5,000	1,017	5,085,000	
3593	ホギメディカル	400	4,820	1,928,000	
3605	サンエー・インターナショナル	400	926	370,400	

3606	レナウン	1,500	147	220,500	
3626	I Tホールディングス	2,600	1,118	2,906,800	
3635	コーエーテクモホールディングス	1,700	770	1,309,000	
3708	特種東海ホールディングス	6,000	230	1,380,000	
3715	ドワンゴ	5	184,200	921,000	
3730	マクロミル	5	140,200	701,000	
3738	ティーガイア	7	164,500	1,151,500	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	1	115,000	115,000	
3770	ザッパラス	3	137,000	411,000	
3774	インターネットイニシアティブ	5	204,500	1,022,500	
3789	ソネットエンタテインメント	4	191,400	765,600	
3817	S R Aホールディングス	300	820	246,000	
3820	J B I Sホールディングス	900	292	262,800	
3861	王子製紙	37,000	383	14,171,000	
3864	三菱製紙	12,000	113	1,356,000	
3865	北越紀州製紙	6,000	455	2,730,000	
3877	中越パルプ工業	4,000	158	632,000	
3878	巴川製紙所	1,000	211	211,000	
3880	大王製紙	4,000	726	2,904,000	
3893	日本製紙グループ本社	3,700	2,325	8,602,500	
3941	レンゴー	6,000	547	3,282,000	
3946	トモク	3,000	209	627,000	
3950	ザ・パック	600	1,343	805,800	
4003	コープケミカル	1,000	160	160,000	
4004	昭和電工	54,000	172	9,288,000	
4005	住友化学	57,000	355	20,235,000	
4007	日本化成	2,000	187	374,000	
4008	住友精化	2,000	329	658,000	
4021	日産化学工業	6,000	1,190	7,140,000	
4022	ラサ工業	3,000	99	297,000	
4023	クレハ	6,000	493	2,958,000	
4027	テイカ	2,000	253	506,000	
4028	石原産業	15,000	70	1,050,000	
4031	片倉チッカリン	1,000	275	275,000	
4041	日本曹達	6,000	352	2,112,000	
4042	東ソー	21,000	252	5,292,000	
4043	トクヤマ	14,000	530	7,420,000	
4044	セントラル硝子	9,000	360	3,240,000	
4045	東亜合成	10,000	315	3,150,000	
4046	ダイソー	4,000	240	960,000	
4047	関東電化工業	2,000	777	1,554,000	
4061	電気化学工業	18,000	364	6,552,000	
4062	イビデン	5,700	3,270	18,639,000	
4063	信越化学工業	13,800	4,760	65,688,000	
4064	日本カーバイド工業	2,000	107	214,000	
4078	堺化学工業	3,000	375	1,125,000	
4088	エア・ウォーター	6,000	1,104	6,624,000	
4091	大陽日酸	12,000	946	11,352,000	
4092	日本化学工業	3,000	195	585,000	
4095	日本パーカライズン	2,000	1,092	2,184,000	
4097	高圧ガス工業	1,000	520	520,000	
4099	四国化成工業	1,000	544	544,000	
4100	戸田工業	1,000	857	857,000	
4109	ステラ ケミファ	400	5,100	2,040,000	
4112	保土谷化学工業	2,000	236	472,000	
4114	日本触媒	5,000	771	3,855,000	
4116	大日精化工業	3,000	333	999,000	
4118	カネカ	11,000	618	6,798,000	
4151	協和発酵キリン	11,000	1,024	11,264,000	
4182	三菱ガス化学	14,000	412	5,768,000	
4183	三井化学	26,000	303	7,878,000	
4185	J S R	8,100	1,679	13,599,900	

4186	東京応化工業	1,600	1,721	2,753,600	
4188	三菱ケミカルホールディングス	48,000	323	15,504,000	
4201	日本合成化学工業	2,000	636	1,272,000	
4202	ダイセル化学工業	11,000	535	5,885,000	
4203	住友ベークライト	8,000	426	3,408,000	
4204	積水化学工業	17,000	538	9,146,000	
4205	日本ゼオン	8,000	407	3,256,000	
4206	アイカ工業	2,200	860	1,892,000	
4208	宇部興産	38,000	238	9,044,000	
4212	積水樹脂	1,000	721	721,000	
4215	タキロン	2,000	247	494,000	
4216	旭有機材工業	3,000	216	648,000	
4217	日立化成工業	3,900	1,735	6,766,500	
4218	ニチバン	1,000	303	303,000	
4220	リケンテクノス	2,000	213	426,000	
4221	大倉工業	2,000	263	526,000	
4228	積水化成成品工業	2,000	376	752,000	
4229	群栄化学工業	2,000	209	418,000	
4231	タイガースポリマー	500	373	186,500	
4271	日本カーリット	700	428	299,600	
4272	日本化薬	6,000	801	4,806,000	
4282	イーピーエス	2	361,000	722,000	
4283	パナソニック電工インフォメーションシステムズ	200	2,465	493,000	
4295	フェイス	33	11,340	374,220	
4301	アミューズ	100	1,011	101,100	
4307	野村総合研究所	4,800	1,915	9,192,000	
4310	ドリームインキュベータ	3	64,500	193,500	
4312	サイバネットシステム	6	37,250	223,500	
4319	T A C	600	368	220,800	
4321	ケネディクス	43	34,650	1,489,950	
4324	電通	8,100	1,885	15,268,500	
4326	インテージ	200	1,561	312,200	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	23	11,710	269,330	
4337	びあ	200	1,165	233,000	
4340	シンプレクス・テクノロジー	11	42,300	465,300	
4343	イオンファンタジー	200	1,194	238,800	
4362	日本精化	700	787	550,900	
4401	A D E K A	3,500	814	2,849,000	
4403	日油	7,000	396	2,772,000	
4404	ミヨシ油脂	3,000	142	426,000	
4410	ハリマ化成	1,000	532	532,000	
4452	花王	23,100	2,015	46,546,500	
4461	第一工業製薬	1,000	268	268,000	
4471	三洋化成工業	2,000	488	976,000	
4502	武田薬品工業	31,600	3,580	113,128,000	
4503	アステラス製薬	17,800	3,260	58,028,000	
4506	大日本住友製薬	6,400	912	5,836,800	
4507	塩野義製薬	12,000	1,927	23,124,000	
4508	田辺三菱製薬	7,000	1,144	8,008,000	
4512	わかもと製薬	1,000	317	317,000	
4514	あすか製薬	1,000	772	772,000	
4516	日本新薬	2,000	1,238	2,476,000	
4519	中外製薬	8,900	1,721	15,316,900	
4521	科研製薬	4,000	806	3,224,000	
4523	エーザイ	10,300	3,300	33,990,000	
4527	ロート製薬	4,000	1,117	4,468,000	
4528	小野薬品工業	4,300	4,170	17,931,000	
4530	久光製薬	2,600	3,090	8,034,000	
4531	有機合成薬品工業	1,000	254	254,000	
4534	持田製薬	3,000	928	2,784,000	
4535	大正製薬	7,000	1,652	11,564,000	
4536	参天製薬	2,600	3,120	8,112,000	

4537	エスエス製薬	2,000	490	980,000	
4538	扶桑薬品工業	3,000	271	813,000	
4539	日本ケミファ	1,000	281	281,000	
4540	ツムラ	2,500	3,050	7,625,000	
4543	テルモ	6,200	4,900	30,380,000	
4544	みらかホールディングス	1,700	3,040	5,168,000	
4547	キッセイ薬品工業	2,000	1,978	3,956,000	
4548	生化学工業	1,600	1,100	1,760,000	
4549	栄研化学	700	998	698,600	
4551	鳥居薬品	500	1,721	860,500	
4553	東和薬品	400	4,500	1,800,000	
4555	沢井製薬	500	5,270	2,635,000	
4559	ゼリア新薬工業	1,000	965	965,000	
4568	第一三共	26,500	1,724	45,686,000	
4569	キョーリン	2,000	1,478	2,956,000	
4611	大日本塗料	6,000	100	600,000	
4612	日本ペイント	8,000	529	4,232,000	
4613	関西ペイント	10,000	755	7,550,000	
4617	中国塗料	2,000	641	1,282,000	
4619	日本特殊塗料	1,000	340	340,000	
4620	藤倉化成	1,100	456	501,600	
4626	太陽インキ製造	700	2,185	1,529,500	
4631	D I C	28,000	137	3,836,000	
4633	サカタインクス	2,000	359	718,000	
4634	東洋インキ製造	9,000	341	3,069,000	
4641	アルプス技研	300	562	168,600	
4651	サニックス	1,100	158	173,800	
4653	ダイオーズ	100	478	47,800	
4661	オリエンタルランド	2,200	6,100	13,420,000	
4665	ダスキン	2,500	1,635	4,087,500	
4666	パーク24	4,900	976	4,782,400	
4668	明光ネットワークジャパン	700	584	408,800	
4671	ファルコバイオシステムズ	500	870	435,000	
4674	クレスコ	400	412	164,800	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	88	127,500	11,220,000	
4678	秀英予備校	200	495	99,000	
4679	田谷	100	668	66,800	
4680	ラウンドワン	1,100	665	731,500	
4681	リゾートトラスト	1,200	1,046	1,255,200	
4684	オービック	250	14,750	3,687,500	
4687	ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	200	704	140,800	
4689	ヤフー	463	27,000	12,501,000	
4694	ビー・エム・エル	500	2,360	1,180,000	
4696	ワタベウェディング	300	1,009	302,700	
4704	トレンドマイクロ	3,400	3,250	11,050,000	
4708	もしもしホットライン	600	1,719	1,031,400	
4711	東急コミュニティー	200	1,913	382,600	
4714	リソー教育	97	5,090	493,730	
4716	日本オラクル	1,300	4,110	5,343,000	
4719	アルファシステムズ	200	1,764	352,800	
4722	フューチャーアーキテクト	10	36,800	368,000	
4724	ウェアハウス	200	459	91,800	
4725	シーエーシー	500	627	313,500	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	200	632	126,400	
4728	トーセ	200	606	121,200	
4732	ユー・エス・エス	1,160	5,710	6,623,600	
4733	オービックビジネスコンサルタント	200	4,060	812,000	
4738	日立ビジネスソリューション	300	657	197,100	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	1,200	2,470	2,964,000	

4743	アイティフォー	700	326	228,200	
4745	東京個別指導学院	700	157	109,900	
4746	東計電算	200	1,201	240,200	
4756	カルチュア・コンビニエンス・クラブ	3,100	616	1,909,600	
4762	エックスネット	1	133,600	133,600	
4768	大塚商会	700	4,570	3,199,000	
4775	総合メディカル	200	2,215	443,000	
4776	サイボウズ	12	33,500	402,000	
4779	ソフトブレーン	8	6,080	48,640	
4801	セントラルスポーツ	200	844	168,800	
4812	I S I D	600	567	340,200	
4825	ウェザーニューズ	400	1,102	440,800	
4826	C I J	700	308	215,600	
4901	富士フイルムホールディングス	17,800	2,535	45,123,000	
4902	コニカミノルタホールディングス	18,500	871	16,113,500	
4911	資生堂	15,000	1,632	24,480,000	
4912	ライオン	10,000	449	4,490,000	
4914	高砂香料工業	3,000	461	1,383,000	
4917	マンダム	800	2,315	1,852,000	
4919	ミルボン	400	2,135	854,000	
4921	ファンケル	1,700	1,575	2,677,500	
4922	コーセー	1,300	1,933	2,512,900	
4924	ドクターシーラボ	6	186,100	1,116,600	
4951	エステー	600	1,011	606,600	
4956	コニシ	700	845	591,500	
4958	長谷川香料	1,200	1,371	1,645,200	
4967	小林製薬	1,200	3,790	4,548,000	
4968	荒川化学工業	700	1,078	754,600	
4971	メック	600	564	338,400	
4973	日本高純度化学	2	304,000	608,000	
4985	アース製薬	600	2,910	1,746,000	
4989	イハラケミカル工業	2,000	310	620,000	
4992	北興化学工業	1,000	301	301,000	
4994	大成ラミック	200	2,180	436,000	
4996	クミアイ化学工業	2,000	294	588,000	
4997	日本農薬	2,000	558	1,116,000	
5001	新日本石油	51,000	416	21,216,000	
5002	昭和シェル石油	8,000	830	6,640,000	
5007	コスモ石油	24,000	226	5,424,000	
5009	富士興産	4,000	70	280,000	
5011	ニチレキ	1,000	368	368,000	
5012	東燃ゼネラル石油	12,000	813	9,756,000	
5013	ユシロ化学工業	500	1,337	668,500	
5015	ビービー・カストロール	400	343	137,200	
5016	新日鉱ホールディングス	32,000	376	12,032,000	
5017	A O C ホールディングス	2,100	642	1,348,200	
5019	出光興産	1,000	6,300	6,300,000	
5101	横浜ゴム	9,000	369	3,321,000	
5105	東洋ゴム工業	8,000	159	1,272,000	
5108	ブリヂストン	26,000	1,419	36,894,000	
5110	住友ゴム工業	6,000	772	4,632,000	
5121	藤倉ゴム工業	600	363	217,800	
5122	オカモト	3,000	339	1,017,000	
5142	アキレス	7,000	131	917,000	
5185	フコク	300	648	194,400	
5186	ニッタ	800	1,297	1,037,600	
5187	クリエートメディック	200	895	179,000	
5191	東海ゴム工業	1,400	1,034	1,447,600	
5192	三ツ星ベルト	2,000	332	664,000	
5195	バンドー化学	3,000	250	750,000	
5196	鬼怒川ゴム工業	2,000	195	390,000	
5201	旭硝子	41,000	837	34,317,000	

5202	日本板硝子	25,000	267	6,675,000	
5204	石塚硝子	1,000	183	183,000	
5208	有沢製作所	1,200	512	614,400	
5210	日本山村硝子	4,000	291	1,164,000	
5214	日本電気硝子	15,000	998	14,970,000	
5218	オハラ	400	1,362	544,800	
5232	住友大阪セメント	15,000	162	2,430,000	
5233	太平洋セメント	34,000	106	3,604,000	
5234	デイ・シイ	900	252	226,800	
5261	リゾートソリューション	1,000	149	149,000	
5262	日本ヒューム	1,000	254	254,000	
5269	日本コンクリート工業	1,000	147	147,000	
5301	東海カーボン	8,000	422	3,376,000	
5302	日本カーボン	4,000	313	1,252,000	
5310	東洋炭素	400	4,350	1,740,000	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	5,000	260	1,300,000	
5332	TOTO	13,000	506	6,578,000	
5333	日本ガイシ	10,000	2,030	20,300,000	
5334	日本特殊陶業	7,000	1,058	7,406,000	
5337	ダントーホールディングス	1,000	102	102,000	
5344	MARUWA	200	1,864	372,800	
5351	品川リフラクトリーズ	2,000	169	338,000	
5352	黒崎播磨	2,000	161	322,000	
5363	TYK	1,000	206	206,000	
5367	ニッカトー	300	375	112,500	
5384	フジミインコーポレーテッド	800	1,317	1,053,600	
5391	エーアンドエーマテリアル	2,000	68	136,000	
5393	ニチアス	4,000	349	1,396,000	
5401	新日本製鐵	236,000	338	79,768,000	
5405	住友金属工業	153,000	234	35,802,000	
5406	神戸製鋼所	118,000	163	19,234,000	
5407	日新製鋼	33,000	151	4,983,000	
5408	中山製鋼所	4,000	140	560,000	
5410	合同製鐵	5,000	217	1,085,000	
5411	JFEホールディングス	18,000	3,030	54,540,000	
5423	東京製鐵	4,100	1,136	4,657,600	
5440	共英製鋼	900	1,934	1,740,600	
5444	大和工業	2,100	2,870	6,027,000	
5445	東京鐵鋼	2,000	282	564,000	
5449	大阪製鐵	500	1,654	827,000	
5451	淀川製鋼所	6,000	382	2,292,000	
5453	東洋鋼鈹	2,000	402	804,000	
5457	住友鋼管	600	488	292,800	
5463	丸一鋼管	2,400	1,629	3,909,600	
5464	モリ工業	1,000	203	203,000	
5471	大同特殊鋼	14,000	303	4,242,000	
5476	日本高周波鋼業	3,000	90	270,000	
5479	日本金属工業	6,000	158	948,000	
5480	日本冶金工業	5,000	417	2,085,000	
5481	山陽特殊製鋼	5,000	356	1,780,000	
5482	愛知製鋼	5,000	404	2,020,000	
5486	日立金属	5,000	871	4,355,000	
5491	日本金属	2,000	153	306,000	
5541	大平洋金属	6,000	681	4,086,000	
5563	日本電工	4,000	629	2,516,000	
5602	栗本鐵工所	5,000	83	415,000	
5612	日本鑄鉄管	1,000	140	140,000	
5631	日本製鋼所	13,000	1,125	14,625,000	
5632	三菱製鋼	6,000	176	1,056,000	
5658	日亜鋼業	1,000	283	283,000	
5659	日本精線	1,000	247	247,000	
5701	日本軽金属	21,000	84	1,764,000	

5702	大紀アルミニウム工業所	2,000	218	436,000	
5706	三井金属	25,000	240	6,000,000	
5707	東邦亜鉛	4,000	473	1,892,000	
5711	三菱マテリアル	48,000	235	11,280,000	
5713	住友金属鉱山	22,000	1,519	33,418,000	
5714	DOWAホールディングス	10,000	530	5,300,000	
5715	古河機械金属	15,000	123	1,845,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	900	2,280	2,052,000	
5727	東邦チタニウム	1,500	1,117	1,675,500	
5738	住友軽金属工業	13,000	78	1,014,000	
5741	古河スカイ	4,000	132	528,000	
5801	古河電気工業	27,000	388	10,476,000	
5802	住友電気工業	27,400	1,057	28,961,800	
5803	フジクラ	13,000	442	5,746,000	
5804	三菱電線工業	6,000	82	492,000	
5805	昭和電線ホールディングス	11,000	84	924,000	
5807	東京特殊電線	1,000	94	94,000	
5809	タツタ電線	2,000	225	450,000	
5812	日立電線	7,000	260	1,820,000	
5815	沖電線	1,000	131	131,000	
5819	カナレ電気	100	974	97,400	
5851	リョービ	5,000	231	1,155,000	
5857	アサヒホールディングス	1,200	1,569	1,882,800	
5901	東洋製罐	6,600	1,454	9,596,400	
5902	ホッカンホールディングス	2,000	223	446,000	
5909	コロナ	400	1,158	463,200	
5911	横河ブリッジホールディングス	2,000	728	1,456,000	
5915	駒井鉄工	1,000	192	192,000	
5916	ハルテック	1,000	95	95,000	
5923	高田機工	1,000	174	174,000	
5929	三和ホールディングス	8,000	247	1,976,000	
5930	文化シャッター	2,000	287	574,000	
5936	東洋シャッター	200	562	112,400	
5938	住生活グループ	10,800	1,435	15,498,000	
5942	日本フィルコン	600	492	295,200	
5943	ノーリツ	1,400	1,144	1,601,600	
5946	長府製作所	1,000	1,825	1,825,000	
5947	リンナイ	1,400	4,040	5,656,000	
5949	ユニプレス	1,200	1,235	1,482,000	
5951	ダイニチ工業	500	567	283,500	
5957	日東精工	1,000	222	222,000	
5958	三洋工業	1,000	147	147,000	
5959	岡部	1,900	322	611,800	
5963	日立ツール	500	825	412,500	
5974	中国工業	1,000	94	94,000	
5975	東プレ	1,700	765	1,300,500	
5976	ネツレン	1,400	627	877,800	
5981	東京製綱	6,000	226	1,356,000	
5988	パイオラックス	400	1,537	614,800	
5991	ニッパツ	6,000	691	4,146,000	
5992	中央発條	1,000	259	259,000	
5998	アドバネクス	2,000	69	138,000	
6005	三浦工業	1,200	2,340	2,808,000	
6013	タクマ	3,000	247	741,000	
6101	ツガミ	3,000	169	507,000	
6103	オークマ	6,000	426	2,556,000	
6104	東芝機械	4,000	301	1,204,000	
6113	アマダ	14,000	556	7,784,000	
6118	アイダエンジニアリング	2,200	267	587,400	
6135	牧野フライス製作所	4,000	335	1,340,000	
6136	O S G	3,700	886	3,278,200	
6138	ダイジェット工業	1,000	136	136,000	

6140	旭ダイヤモンド工業	2,000	612	1,224,000	
6141	森精機製作所	3,300	892	2,943,600	
6146	ディスコ	800	4,780	3,824,000	
6151	日東工器	500	1,827	913,500	
6201	豊田自動織機	6,900	2,410	16,629,000	
6203	豊和工業	5,000	51	255,000	
6205	OKK	3,000	71	213,000	
6210	東洋機械金属	600	132	79,200	
6213	オーエム製作所	1,000	287	287,000	
6217	津田駒工業	2,000	113	226,000	
6222	島精機製作所	1,100	1,799	1,978,900	
6242	日本スピンドル製造	1,000	129	129,000	
6247	日阪製作所	1,000	964	964,000	
6250	やまびこ	300	1,083	324,900	
6262	ペガサスミシン製造	500	160	80,000	
6268	ナプテスコ	3,000	1,032	3,096,000	
6269	三井海洋開発	600	1,724	1,034,400	
6272	レオン自動機	1,000	248	248,000	
6273	S M C	2,700	10,150	27,405,000	
6274	新川	700	1,420	994,000	
6277	ホソカワミクロン	1,000	345	345,000	
6278	ユニオンツール	600	2,450	1,470,000	
6282	オイレス工業	1,000	1,371	1,371,000	
6287	サトー	900	1,047	942,300	
6291	日本エアテック	300	576	172,800	
6293	日精樹脂工業	700	267	186,900	
6298	ワイエイシイ	300	750	225,000	
6301	コマツ	37,300	1,854	69,154,200	
6302	住友重機械工業	18,000	422	7,596,000	
6305	日立建機	3,400	2,300	7,820,000	
6306	日工	1,000	247	247,000	
6309	巴工業	400	1,323	529,200	
6310	井関農機	9,000	342	3,078,000	
6315	T O W A	1,000	588	588,000	
6316	丸山製作所	2,000	179	358,000	
6317	北川鉄工所	4,000	98	392,000	
6319	シンニッタン	900	225	202,500	
6326	クボタ	34,000	766	26,044,000	
6328	荏原実業	200	1,268	253,600	
6330	東洋エンジニアリング	6,000	306	1,836,000	
6331	三菱化工機	3,000	234	702,000	
6332	月島機械	1,000	534	534,000	
6333	帝国電機製作所	300	1,861	558,300	
6339	新東工業	1,700	619	1,052,300	
6340	澁谷工業	500	770	385,000	
6345	アイチコーポレーション	1,700	379	644,300	
6349	小森コーポレーション	2,400	1,042	2,500,800	
6351	鶴見製作所	1,000	591	591,000	
6355	住友精密工業	1,000	256	256,000	
6358	酒井重工業	2,000	127	254,000	
6361	荏原	17,000	383	6,511,000	
6362	石井鐵工所	2,000	156	312,000	
6363	西島製作所	800	1,630	1,304,000	
6366	千代田化工建設	7,000	693	4,851,000	
6367	ダイキン工業	9,400	3,130	29,422,000	
6368	オルガノ	2,000	615	1,230,000	
6369	トーヨーカネツ	4,000	156	624,000	
6370	栗田工業	4,700	2,845	13,371,500	
6371	椿本チエイン	5,000	390	1,950,000	
6373	大同工業	2,000	147	294,000	
6374	T C M	2,000	226	452,000	
6375	日本コンベヤ	3,000	76	228,000	

[次へ](#)

6376	日機装	2,000	644	1,288,000
6378	木村化工機	800	936	748,800
6379	新興プランテック	1,600	863	1,380,800
6381	アネスト岩田	2,000	292	584,000
6383	ダイフク	3,500	544	1,904,000
6390	加藤製作所	2,000	157	314,000
6393	油研工業	2,000	125	250,000
6395	タダノ	4,000	447	1,788,000
6406	フジテック	2,000	488	976,000
6407	C K D	2,300	653	1,501,900
6409	キトー	2	89,400	178,800
6412	平和	1,600	871	1,393,600
6413	理想科学工業	700	857	599,900
6417	S A N K Y O	2,300	4,960	11,408,000
6418	日本金銭機械	800	747	597,600
6419	マースエンジニアリング	400	2,480	992,000
6420	福島工業	200	834	166,800
6421	キヤノンファインテック	700	1,149	804,300
6428	オーイズミ	300	201	60,300
6430	ダイコク電機	300	1,582	474,600
6436	アマノ	2,500	784	1,960,000
6440	J U K I	5,000	94	470,000
6444	サンデン	5,000	230	1,150,000
6445	蛇の目ミシン工業	8,000	62	496,000
6448	ブラザー工業	11,100	991	11,000,100
6454	マックス	2,000	905	1,810,000
6455	モリタホールディングス	1,000	425	425,000
6457	グローリー	2,500	2,030	5,075,000
6459	大和冷機工業	1,000	447	447,000
6460	セガサミーホールディングス	9,300	1,161	10,797,300
6461	日本ピストンリング	3,000	96	288,000
6462	リケン	3,000	315	945,000
6463	T P R	1,000	363	363,000
6465	ホシザキ電機	1,800	1,277	2,298,600
6470	大豊工業	600	679	407,400
6471	日本精工	16,000	567	9,072,000
6472	N T N	18,000	343	6,174,000
6473	ジェイテクト	8,100	963	7,800,300
6474	不二越	9,000	195	1,755,000
6479	ミネベア	12,000	400	4,800,000
6480	日本トムソン	3,000	427	1,281,000
6481	T H K	5,100	1,480	7,548,000
6482	ユーシン精機	400	1,370	548,000
6485	前澤給装工業	300	1,315	394,500
6486	イーグル工業	1,000	412	412,000
6489	前澤工業	800	159	127,200
6490	日本ピラー工業	1,000	375	375,000
6498	キッツ	4,000	449	1,796,000
6501	日立製作所	136,000	297	40,392,000
6502	東芝	181,000	516	93,396,000
6503	三菱電機	75,000	661	49,575,000
6504	富士電機ホールディングス	22,000	159	3,498,000
6505	東洋電機製造	2,000	760	1,520,000
6506	安川電機	9,000	727	6,543,000
6507	シンフォニアテクノロジー	5,000	206	1,030,000
6508	明電舎	8,000	454	3,632,000
6513	オリジン電気	1,000	223	223,000
6517	デンヨー	800	642	513,600
6581	日立工機	2,400	1,008	2,419,200
6584	三桜工業	1,100	549	603,900
6586	マキタ	5,200	3,050	15,860,000
6588	東芝テック	6,000	352	2,112,000

6590	芝浦メカトロニクス	1,000	323	323,000	
6592	マブチモーター	1,200	4,480	5,376,000	
6594	日本電産	3,900	7,700	30,030,000	
6621	高岳製作所	3,000	282	846,000	
6622	ダイヘン	4,000	318	1,272,000	
6632	JVC・ケンウッド・ホールディングス	32,500	45	1,462,500	
6641	日新電機	1,000	488	488,000	
6644	大崎電気工業	1,000	835	835,000	
6645	オムロン	9,700	1,462	14,181,400	
6651	日東工業	1,300	839	1,090,700	
6652	I D E C	1,100	626	688,600	
6665	エルピーダメモリ	8,400	1,251	10,508,400	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	15,000	763	11,445,000	
6675	サクサホールディングス	3,000	172	516,000	
6676	メルコホールディングス	400	1,781	712,400	
6678	テクノメディカ	1	283,000	283,000	
6701	N E C	82,000	267	21,894,000	
6702	富士通	83,000	545	45,235,000	
6703	O K I	31,000	81	2,511,000	
6704	岩崎通信機	4,000	80	320,000	
6706	電気興業	2,000	396	792,000	
6707	サンケン電気	5,000	301	1,505,000	
6715	ナカヨ通信機	1,000	171	171,000	
6718	アイホン	600	1,586	951,600	
6723	N E C エレクトロニクス	2,000	650	1,300,000	
6724	セイコーエプソン	6,200	1,376	8,531,200	
6727	ワコム	16	194,000	3,104,000	
6728	アルバック	1,400	2,130	2,982,000	
6737	ナナオ	700	2,195	1,536,500	
6741	日本信号	2,100	790	1,659,000	
6742	京三製作所	2,000	406	812,000	
6744	能美防災	1,000	595	595,000	
6745	ホーチキ	1,000	472	472,000	
6749	マスプロ電工	600	844	506,400	
6751	日本無線	3,000	167	501,000	
6752	パナソニック	78,500	1,228	96,398,000	
6753	シャープ	38,000	968	36,784,000	
6754	アンリツ	4,000	322	1,288,000	
6755	富士通ゼネラル	2,000	312	624,000	
6756	日立国際電気	2,000	672	1,344,000	
6758	ソニー	42,900	2,615	112,183,500	
6762	T D K	4,100	5,110	20,951,000	
6763	帝国通信工業	2,000	201	402,000	
6764	三洋電機	85,000	172	14,620,000	
6766	宮越商事	200	506	101,200	
6767	ミツミ電機	2,600	1,636	4,253,600	
6768	タムラ製作所	2,000	268	536,000	
6770	アルプス電気	6,900	548	3,781,200	
6771	池上通信機	3,000	78	234,000	
6773	パイオニア	6,800	256	1,740,800	
6779	日本電波工業	600	1,760	1,056,000	
6788	日本トリム	150	1,863	279,450	
6789	ローランド ディー・ジー	300	1,087	326,100	
6791	コロムビアミュージックエンタテインメント	7,000	34	238,000	
6794	フォスター電機	700	2,830	1,981,000	
6796	クラリオン	4,000	88	352,000	
6798	S M K	3,000	535	1,605,000	
6800	ヨコオ	700	552	386,400	
6801	東光	4,000	110	440,000	
6803	ティアック	3,000	37	111,000	
6804	ホシデン	2,200	1,034	2,274,800	

6806	ヒロセ電機	1,400	9,270	12,978,000	
6807	日本航空電子工業	2,000	577	1,154,000	
6809	T O A	1,000	525	525,000	
6815	ユニデン	3,000	202	606,000	
6816	アルパイン	1,700	891	1,514,700	
6817	スミダ コーポレーション	600	612	367,200	
6820	アイコム	400	2,170	868,000	
6839	船井電機	700	4,630	3,241,000	
6841	横河電機	8,800	687	6,045,600	
6844	新電元工業	3,000	259	777,000	
6845	山武	2,100	1,917	4,025,700	
6849	日本光電	1,500	1,681	2,521,500	
6850	チノー	2,000	223	446,000	
6853	共和電業	1,000	266	266,000	
6855	日本電子材料	400	557	222,800	
6856	堀場製作所	1,300	2,260	2,938,000	
6857	アドバンテスト	5,800	1,981	11,489,800	
6858	小野測器	1,000	415	415,000	
6859	エスペック	900	568	511,200	
6860	S U N X	700	305	213,500	
6861	キーエンス	1,600	18,210	29,136,000	
6866	H I O K I	400	1,650	660,000	
6869	シスメックス	1,500	4,600	6,900,000	
6875	メガチップス	700	1,442	1,009,400	
6877	O B A R A	600	875	525,000	
6883	日本電産コパル電子	900	569	512,100	
6885	ミヤチテクノス	400	575	230,000	
6900	東京電波	300	560	168,000	
6901	澤藤電機	1,000	152	152,000	
6902	デンソー	18,900	2,475	46,777,500	
6905	コーセル	1,100	997	1,096,700	
6910	日立メディコ	1,000	848	848,000	
6911	新日本無線	1,000	198	198,000	
6914	オブテックス	600	918	550,800	
6915	千代田インテグレ	500	1,007	503,500	
6921	東光電気	1,000	474	474,000	
6923	スタンレー電気	5,700	1,780	10,146,000	
6924	岩崎電気	3,000	151	453,000	
6925	ウシオ電機	4,900	1,446	7,085,400	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	600	289	173,400	
6929	日本セラミック	600	1,162	697,200	
6934	新神戸電機	1,000	1,090	1,090,000	
6935	日本デジタル研究所	700	1,093	765,100	
6937	古河電池	1,000	772	772,000	
6938	双信電機	400	369	147,600	
6941	山一電機	700	170	119,000	
6947	図研	600	715	429,000	
6951	日本電子	3,000	342	1,026,000	
6952	カシオ計算機	8,900	676	6,016,400	
6954	ファナック	8,300	7,610	63,163,000	
6958	日本C M K	1,700	626	1,064,200	
6961	エンプラス	500	1,414	707,000	
6963	ローム	4,000	5,950	23,800,000	
6965	浜松ホトニクス	3,000	2,260	6,780,000	
6966	三井ハイテック	1,100	859	944,900	
6967	新光電気工業	2,100	1,356	2,847,600	
6971	京セラ	6,600	7,520	49,632,000	
6973	協栄産業	1,000	185	185,000	
6974	日本インター	800	288	230,400	
6976	太陽誘電	3,000	942	2,826,000	
6981	村田製作所	9,100	4,260	38,766,000	
6985	ユーシン	1,000	474	474,000	

6986	双葉電子工業	1,500	1,425	2,137,500	
6988	日東電工	6,900	2,865	19,768,500	
6989	北陸電気工業	3,000	160	480,000	
6991	パナソニック電工	14,000	1,024	14,336,000	
6995	東海理化	2,100	1,780	3,738,000	
6996	ニチコン	2,800	828	2,318,400	
6997	日本ケミコン	4,000	300	1,200,000	
6999	K O A	1,100	706	776,600	
7003	三井造船	33,000	237	7,821,000	
7004	日立造船	36,000	126	4,536,000	
7007	佐世保重工業	6,000	198	1,188,000	
7011	三菱重工業	135,000	315	42,525,000	
7012	川崎重工業	62,000	219	13,578,000	
7013	I H I	59,000	168	9,912,000	
7102	日本車輛製造	3,000	564	1,692,000	
7105	ニチユ	1,000	198	198,000	
7122	近畿車輛	1,000	761	761,000	
7201	日産自動車	96,400	642	61,888,800	
7202	いすゞ自動車	54,000	193	10,422,000	
7203	トヨタ自動車	110,300	3,500	386,050,000	代用有価証券 30,000株
7205	日野自動車	11,000	318	3,498,000	
7211	三菱自動車	177,000	132	23,364,000	
7212	エフテック	300	802	240,600	
7220	武蔵精密工業	900	1,953	1,757,700	
7221	トヨタ車体	1,600	1,667	2,667,200	
7222	日産車体	4,000	743	2,972,000	
7223	関東自動車工業	1,300	836	1,086,800	
7224	新明和工業	4,000	309	1,236,000	
7226	極東開発工業	1,400	345	483,000	
7230	日信工業	1,400	1,383	1,936,200	
7231	トビー工業	7,000	174	1,218,000	
7236	ティラド	3,000	234	702,000	
7238	曙ブレーキ工業	2,900	690	2,001,000	
7239	タチエス	1,200	764	916,800	
7240	N O K	4,100	1,057	4,333,700	
7241	フタバ産業	2,700	471	1,271,700	
7242	K Y B	5,000	271	1,355,000	
7243	シロキ工業	1,000	150	150,000	
7244	市光工業	2,000	169	338,000	
7245	大同メタル工業	1,000	246	246,000	
7246	プレス工業	4,000	179	716,000	
7248	カルソニックカンセイ	6,000	216	1,296,000	
7250	太平洋工業	2,000	413	826,000	
7251	ケーヒン	1,600	1,346	2,153,600	
7256	河西工業	1,000	247	247,000	
7259	アイシン精機	7,000	2,190	15,330,000	
7260	富士機工	1,000	109	109,000	
7261	マツダ	51,000	212	10,812,000	
7262	ダイハツ工業	8,000	888	7,104,000	
7263	愛知機械工業	2,000	302	604,000	
7266	今仙電機製作所	600	1,231	738,600	
7267	ホンダ	68,500	2,830	193,855,000	
7269	スズキ	15,900	2,245	35,695,500	
7270	富士重工業	28,000	349	9,772,000	
7272	ヤマハ発動機	10,000	1,085	10,850,000	
7274	ショーワ	1,800	471	847,800	
7276	小糸製作所	4,000	1,347	5,388,000	
7277	T B K	1,000	155	155,000	
7278	エクセディ	1,100	1,915	2,106,500	
7280	ミツバ	1,000	349	349,000	
7282	豊田合成	2,300	2,420	5,566,000	
7283	愛三工業	900	723	650,700	

7294	ヨロズ	600	1,036	621,600	
7296	エフ・シー・シー	1,100	1,579	1,736,900	
7305	新家工業	2,000	134	268,000	
7309	シマノ	3,200	3,650	11,680,000	
7312	タカタ	1,300	1,691	2,198,300	
7313	テイ・エス テック	1,600	1,715	2,744,000	
7414	小野建	700	695	486,500	
7416	はるやま商事	300	362	108,600	
7420	佐鳥電機	600	576	345,600	
7421	カッパ・クリエイト	550	1,974	1,085,700	
7427	エコートレーディング	200	931	186,200	
7433	伯東	500	762	381,000	
7442	中山福	500	547	273,500	
7445	ライトオン	700	702	491,400	
7447	ナガイレーベン	500	1,947	973,500	
7448	ジーンズメイト	300	525	157,500	
7451	菱食	800	2,275	1,820,000	
7453	良品計画	900	3,910	3,519,000	
7455	三城ホールディングス	1,000	719	719,000	
7456	松田産業	600	1,590	954,000	
7459	メディバルホールディングス	8,700	1,219	10,605,300	
7463	アドヴァン	600	548	328,800	
7466	S P K	200	1,139	227,800	
7476	アズワン	500	1,651	825,500	
7481	尾家産業	300	799	239,700	
7482	シモジマ	600	1,273	763,800	
7483	ドウシシャ	400	1,798	719,200	
7494	コナカ	1,000	238	238,000	
7504	高速	500	692	346,000	
7506	ハウス オブ ローゼ	100	1,279	127,900	
7508	G - 7ホールディングス	300	496	148,800	
7512	イオン北海道	600	292	175,200	
7513	コジマ	1,200	452	542,400	
7516	コーナン商事	700	1,102	771,400	
7517	黒田電気	1,100	1,196	1,315,600	
7518	ネットワンシステムズ	16	112,400	1,798,400	
7520	エコス	200	656	131,200	
7522	ワタミ	900	1,734	1,560,600	
7532	ドン・キホーテ	1,500	2,260	3,390,000	
7537	丸文	700	466	326,200	
7541	メガネトップ	700	1,262	883,400	
7545	西松屋チェーン	2,100	901	1,892,100	
7550	ゼンショー	3,200	634	2,028,800	
7552	ハビネット	300	1,223	366,900	
7554	幸楽苑	500	1,171	585,500	
7558	トーマンエレクトロニクス	400	948	379,200	
7560	ユニマットライフ	400	916	366,400	
7561	ハークスレイ	300	785	235,500	
7581	サイゼリヤ	1,400	1,666	2,332,400	
7591	エクセル	400	1,044	417,600	
7594	マルカキカイ	300	751	225,300	
7595	アルゴグラフィックス	300	988	296,400	
7599	ガリバーインターナショナル	200	6,750	1,350,000	
7600	日本エム・ディ・エム	600	239	143,400	
7601	ポブラ	300	615	184,500	
7606	ユナイテッドアローズ	1,000	877	877,000	
7607	進和	500	1,243	621,500	
7608	エスケイジャパン	200	318	63,600	
7609	ダイトエレクトロン	300	472	141,600	
7611	ハイデイ日高	300	1,062	318,600	
7613	シークス	600	925	555,000	
7615	京都きもの友禅	600	888	532,800	

7616	コロワイド	2,000	581	1,162,000	
7619	田中商事	300	405	121,500	
7628	オーハシテクニカ	600	506	303,600	
7630	壱番屋	300	2,275	682,500	
7631	マクニカ	400	1,447	578,800	
7637	白銅	300	593	177,900	
7640	トップカルチャー	300	385	115,500	
7649	スギホールディングス	1,200	1,988	2,385,600	
7701	島津製作所	9,000	585	5,265,000	
7702	JMS	1,000	395	395,000	
7704	アロカ	500	731	365,500	
7714	モリテックス	300	281	84,300	
7715	長野計器	500	525	262,500	
7718	スター精密	1,600	712	1,139,200	
7721	東京計器	3,000	112	336,000	
7723	愛知時計電機	1,000	278	278,000	
7728	日本電産トーソク	300	795	238,500	
7729	東京精密	1,600	1,065	1,704,000	
7731	ニコン	14,900	1,672	24,912,800	
7732	トプコン	1,800	499	898,200	
7733	オリンパス	9,400	2,800	26,320,000	
7734	理研計器	700	599	419,300	
7735	大日本スクリーン製造	9,000	357	3,213,000	
7739	キヤノン電子	800	1,801	1,440,800	
7740	タムロン	800	945	756,000	
7741	H O Y A	18,700	2,145	40,111,500	
7744	ノーリツ鋼機	700	677	473,900	
7745	エー・アンド・デイ	600	359	215,400	
7751	キヤノン	49,800	3,380	168,324,000	
7752	リコー	24,000	1,222	29,328,000	
7756	日本電産コパル	800	1,336	1,068,800	
7757	日本電産サンキョー	2,000	660	1,320,000	
7762	シチズンホールディングス	10,500	526	5,523,000	
7769	リズム時計工業	4,000	134	536,000	
7825	S R I スポーツ	5	85,500	427,500	
7832	バンダイナムコホールディングス	9,300	938	8,723,400	
7838	共立印刷	700	143	100,100	
7840	フランスベッドホールディングス	6,000	140	840,000	
7846	パイロットコーポレーション	7	100,100	700,700	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	1,200	805	966,000	
7862	トッパン・フォームズ	1,500	997	1,495,500	
7864	フジシールインターナショナル	800	1,919	1,535,200	
7867	タカラトミー	2,700	782	2,111,400	
7868	廣濟堂	400	200	80,000	
7874	レック	300	2,025	607,500	
7882	アロン化成	1,000	388	388,000	
7885	タカノ	300	506	151,800	
7893	プロネクス	1,100	615	676,500	
7897	ホクシン	800	153	122,400	
7898	ウッドワン	2,000	236	472,000	
7905	大建工業	4,000	192	768,000	
7908	K I M O T O	700	743	520,100	
7911	凸版印刷	24,000	769	18,456,000	
7912	大日本印刷	24,000	1,094	26,256,000	
7913	図書印刷	2,000	180	360,000	
7914	共同印刷	3,000	241	723,000	
7915	日本写真印刷	1,300	4,460	5,798,000	
7916	光村印刷	1,000	302	302,000	
7917	藤森工業	600	1,312	787,200	
7921	宝印刷	500	750	375,000	
7925	前澤化成工業	600	942	565,200	
7935	コンビ	500	640	320,000	

7936	アシックス	7,000	786	5,502,000	
7937	ツツミ	400	2,150	860,000	
7942	J S P	600	890	534,000	
7943	ニチハ	1,000	527	527,000	
7944	ローランド	600	903	541,800	
7947	エフピコ	400	4,270	1,708,000	
7949	小松ウオール工業	300	1,089	326,700	
7951	ヤマハ	5,700	936	5,335,200	
7952	河合楽器製作所	3,000	114	342,000	
7955	クリナップ	1,000	659	659,000	
7956	ピジョン	500	3,360	1,680,000	
7958	天馬	600	1,049	629,400	
7960	パラマウントベッド	900	1,976	1,778,400	
7961	兼松日産農林	1,000	117	117,000	
7962	キングジム	700	677	473,900	
7966	リンテック	1,800	1,552	2,793,600	
7968	田崎真珠	1,000	101	101,000	
7970	信越ポリマー	1,700	578	982,600	
7971	東リ	2,000	164	328,000	
7972	イトーキ	1,700	213	362,100	
7974	任天堂	4,500	23,690	106,605,000	
7976	三菱鉛筆	800	1,074	859,200	
7981	タカラスタANDARD	4,000	521	2,084,000	
7984	コクヨ	4,500	770	3,465,000	
7987	ナカバヤシ	2,000	185	370,000	
7988	ニフコ	1,800	1,700	3,060,000	
7993	サンウエーブ工業	1,000	233	233,000	
7994	岡村製作所	3,000	445	1,335,000	
7995	日本バルカー工業	4,000	168	672,000	
7999	M U T O Hホールディングス	1,000	140	140,000	
8001	伊藤忠商事	55,000	581	31,955,000	
8002	丸紅	65,000	456	29,640,000	
8005	スクロール	1,000	365	365,000	
8007	高島	2,000	140	280,000	
8008	F & A アクアホールディングス	700	989	692,300	
8011	三陽商会	4,000	291	1,164,000	
8012	長瀬産業	4,000	1,070	4,280,000	
8013	ナイガイ	3,000	44	132,000	
8014	蝶理	6,000	99	594,000	
8015	豊田通商	7,500	1,268	9,510,000	
8016	オンワードホールディングス	6,000	529	3,174,000	
8018	三共生興	1,300	241	313,300	
8020	兼松	18,000	75	1,350,000	
8022	ミズノ	4,000	410	1,640,000	
8025	ツカモトコーポレーション	1,000	81	81,000	
8028	ファミリーマート	2,500	2,540	6,350,000	
8029	ルック	2,000	92	184,000	
8031	三井物産	68,300	1,168	79,774,400	
8032	日本紙パルプ商事	4,000	344	1,376,000	
8035	東京エレクトロン	6,700	4,860	32,562,000	
8036	日立ハイテクノロジー	2,600	1,497	3,892,200	
8037	カメイ	1,000	450	450,000	
8038	東都水産	1,000	158	158,000	
8042	日本マタイ	2,000	104	208,000	
8043	スターゼン	3,000	229	687,000	
8050	セイコーホールディングス	3,000	182	546,000	
8051	山善	3,100	290	899,000	
8052	椿本興業	1,000	195	195,000	
8053	住友商事	43,300	865	37,454,500	
8056	日本ユニシス	2,100	748	1,570,800	

8057	内田洋行	2,000	259	518,000	
8058	三菱商事	63,300	1,989	125,903,700	
8059	第一実業	2,000	248	496,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	2,800	1,412	3,953,600	
8061	西華産業	3,000	202	606,000	
8065	佐藤商事	700	488	341,600	
8068	菱洋エレクトロ	1,000	714	714,000	
8070	東京産業	1,000	255	255,000	
8074	ユアサ商事	9,000	87	783,000	
8075	神鋼商事	2,000	150	300,000	
8078	阪和興業	8,000	306	2,448,000	
8081	カナデン	1,000	480	480,000	
8084	菱電商事	1,000	511	511,000	
8086	ニプロ	1,700	2,020	3,434,000	
8087	フルサト工業	500	537	268,500	
8088	岩谷産業	9,000	264	2,376,000	
8089	すてきナイスグループ	4,000	185	740,000	
8090	昭光通商	3,000	110	330,000	
8091	ニチモウ	1,000	138	138,000	
8093	極東貿易	1,000	121	121,000	
8095	イワキ	1,000	246	246,000	
8096	兼松エレクトロニクス	500	802	401,000	
8097	三愛石油	2,000	434	868,000	
8098	稲畑産業	2,100	317	665,700	
8101	G S イクレオス	2,000	104	208,000	
8103	明和産業	900	157	141,300	
8111	ゴールドウイン	2,000	167	334,000	
8112	東京スタイル	3,000	744	2,232,000	
8113	ユニ・チャーム	1,600	8,430	13,488,000	
8114	デサント	2,000	439	878,000	
8129	東邦ホールディングス	2,200	1,243	2,734,600	
8130	サンゲツ	1,500	1,965	2,947,500	
8131	ミツウロコ	1,400	600	840,000	
8132	シナネン	2,000	450	900,000	
8133	伊藤忠エネクス	1,800	447	804,600	
8134	T O K A I	2,000	481	962,000	
8136	サンリオ	2,400	721	1,730,400	
8137	サンワテクノス	400	398	159,200	
8140	リョーサン	1,300	2,120	2,756,000	
8141	新光商事	800	698	558,400	
8142	トーホー	2,000	333	666,000	
8150	三信電気	900	700	630,000	
8151	東陽テクニカ	1,300	762	990,600	
8153	モスフードサービス	1,100	1,460	1,606,000	
8154	加賀電子	900	897	807,300	
8155	三益半導体工業	700	1,151	805,700	
8158	ソーダニッカ	1,000	313	313,000	
8159	立花エレテック	500	601	300,500	
8160	木曽路	900	1,985	1,786,500	
8165	千趣会	1,500	596	894,000	
8166	タカキュー	1,000	157	157,000	
8168	ケーヨー	1,600	455	728,000	
8170	アデランスホールディングス	1,000	1,121	1,121,000	
8173	上新電機	2,000	658	1,316,000	
8174	日本瓦斯	900	1,514	1,362,600	
8175	ベスト電器	2,500	360	900,000	
8178	マルエツ	2,000	414	828,000	
8179	ロイヤルホールディングス	1,300	1,004	1,305,200	
8181	東天紅	1,000	159	159,000	
8182	いなげや	1,000	945	945,000	
8184	島忠	1,900	2,090	3,971,000	
8185	チヨダ	1,100	1,030	1,133,000	

8193	鈴丹	200	251	50,200	
8194	ライフコーポレーション	600	1,603	961,800	
8196	カスミ	1,700	433	736,100	
8200	リンガーハット	600	1,143	685,800	
8201	さが美	1,000	174	174,000	
8203	MrMax	1,000	448	448,000	
8207	テナアライド	600	308	184,800	
8214	AOKIホールディングス	800	861	688,800	
8217	オークワ	1,000	919	919,000	
8218	コメリ	1,000	2,410	2,410,000	
8219	青山商事	2,000	1,390	2,780,000	
8227	しまむら	900	8,920	8,028,000	
8229	CFSコーポレーション	1,000	507	507,000	
8233	高島屋	11,000	591	6,501,000	
8236	丸善	4,000	94	376,000	
8237	松屋	1,500	797	1,195,500	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	4,000	542	2,168,000	
8245	丸栄	2,000	120	240,000	
8248	ニッセンホールディングス	1,700	297	504,900	
8251	パルコ	2,300	767	1,764,100	
8252	丸井グループ	9,300	536	4,984,800	
8253	クレディセゾン	5,900	1,106	6,525,400	
8255	原信ナルスホールディングス	500	1,047	523,500	
8258	セディナ	6,400	183	1,171,200	
8263	ダイエー	3,700	338	1,250,600	
8266	イズミヤ	3,000	444	1,332,000	
8267	イオン	27,700	773	21,412,100	
8270	ユニー	6,400	662	4,236,800	
8273	イズミ	2,200	1,074	2,362,800	
8274	東武ストア	1,000	300	300,000	
8276	平和堂	1,500	1,141	1,711,500	
8278	フジ	1,000	1,779	1,779,000	
8279	ヤオコー	400	2,915	1,166,000	
8281	ゼビオ	900	1,957	1,761,300	
8282	ケーズホールディングス	1,300	2,880	3,744,000	
8289	オリンピック	600	636	381,600	
8291	東日カーライフグループ	1,000	90	90,000	
8303	新生銀行	38,000	116	4,408,000	
8304	あおぞら銀行	26,000	110	2,860,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	496,700	490	243,383,000	
8308	りそなホールディングス	22,700	1,027	23,312,900	
8309	中央三井トラスト・ホールディングス	44,000	316	13,904,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	43,400	3,060	132,804,000	
8324	第四銀行	11,000	331	3,641,000	
8325	北越銀行	9,000	147	1,323,000	
8327	西日本シティ銀行	26,000	226	5,876,000	
8328	札幌北洋ホールディングス	12,100	309	3,738,900	
8331	千葉銀行	31,000	539	16,709,000	
8332	横浜銀行	55,000	431	23,705,000	
8333	常陽銀行	31,000	396	12,276,000	
8334	群馬銀行	20,000	476	9,520,000	
8336	武蔵野銀行	1,300	2,620	3,406,000	
8337	千葉興業銀行	1,700	757	1,286,900	
8338	関東つくば銀行	2,500	304	760,000	
8339	東京都民銀行	1,500	1,273	1,909,500	
8341	七十七銀行	13,000	532	6,916,000	
8342	青森銀行	6,000	240	1,440,000	
8343	秋田銀行	6,000	363	2,178,000	
8344	山形銀行	5,000	423	2,115,000	
8345	岩手銀行	600	5,530	3,318,000	
8346	東邦銀行	8,000	299	2,392,000	
8349	東北銀行	4,000	134	536,000	

8350	みちのく銀行	4,000	180	720,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	32,000	335	10,720,000	
8355	静岡銀行	25,000	890	22,250,000	
8356	十六銀行	10,000	320	3,200,000	
8358	スルガ銀行	8,000	836	6,688,000	
8359	八十二銀行	16,000	539	8,624,000	
8360	山梨中央銀行	5,000	404	2,020,000	
8361	大垣共立銀行	11,000	297	3,267,000	
8362	福井銀行	8,000	304	2,432,000	
8363	北國銀行	9,000	349	3,141,000	
8364	清水銀行	300	3,820	1,146,000	
8366	滋賀銀行	8,000	552	4,416,000	
8367	南都銀行	8,000	498	3,984,000	
8368	百五銀行	8,000	429	3,432,000	
8369	京都銀行	14,000	814	11,396,000	
8374	三重銀行	4,000	273	1,092,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	56,000	197	11,032,000	
8379	広島銀行	24,000	345	8,280,000	
8381	山陰合同銀行	5,000	804	4,020,000	
8382	中国銀行	7,000	1,206	8,442,000	
8383	鳥取銀行	3,000	248	744,000	
8385	伊予銀行	10,000	810	8,100,000	
8386	百十四銀行	9,000	374	3,366,000	
8387	四国銀行	6,000	300	1,800,000	
8388	阿波銀行	7,000	461	3,227,000	
8390	鹿児島銀行	6,000	663	3,978,000	
8392	大分銀行	5,000	361	1,805,000	
8393	宮崎銀行	4,000	423	1,692,000	
8394	肥後銀行	7,000	539	3,773,000	
8395	佐賀銀行	5,000	298	1,490,000	
8396	十八銀行	5,000	242	1,210,000	
8397	沖縄銀行	700	3,090	2,163,000	
8399	琉球銀行	1,700	965	1,640,500	
8403	住友信託銀行	71,000	482	34,222,000	
8404	みずほ信託銀行	67,000	84	5,628,000	
8409	八千代銀行	500	2,405	1,202,500	
8411	みずほフィナンシャルグループ	687,700	176	121,035,200	
8415	紀陽ホールディングス	32,000	110	3,520,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	8,000	865	6,920,000	
8424	芙蓉総合リース	700	2,060	1,442,000	
8425	興銀リース	1,200	1,534	1,840,800	
8439	東京センチュリーリース	2,100	1,074	2,255,400	
8473	SBIホールディングス	755	15,570	11,755,350	
8511	日本証券金融	3,500	668	2,338,000	
8512	大証金	1,100	205	225,500	
8519	ポケットカード	700	238	166,600	
8521	長野銀行	3,000	180	540,000	
8522	名古屋銀行	8,000	347	2,776,000	
8527	愛知銀行	300	7,550	2,265,000	
8529	第三銀行	5,000	211	1,055,000	
8530	中京銀行	4,000	247	988,000	
8536	東日本銀行	5,000	183	915,000	
8541	愛媛銀行	5,000	246	1,230,000	
8542	トマト銀行	3,000	184	552,000	
8543	みなと銀行	9,000	116	1,044,000	
8544	京葉銀行	7,000	443	3,101,000	
8545	関西アーバン銀行	9,000	126	1,134,000	
8550	栃木銀行	4,000	420	1,680,000	
8551	北日本銀行	300	2,620	786,000	
8556	香川銀行	3,000	316	948,000	
8558	東和銀行	8,000	62	496,000	
8561	徳島銀行	2,000	320	640,000	

8562	福島銀行	12,000	52	624,000	
8563	大東銀行	5,000	66	330,000	
8566	リコーリース	600	1,875	1,125,000	
8570	イオンクレジットサービス	3,600	926	3,333,600	
8584	ジャックス	5,000	231	1,155,000	
8586	日立キャピタル	2,000	1,181	2,362,000	
8591	オリックス	4,100	6,540	26,814,000	
8593	三菱UFJリース	2,160	2,870	6,199,200	
8595	ジャフコ	1,100	2,300	2,530,000	
8601	大和証券グループ本社	75,000	455	34,125,000	
8604	野村ホールディングス	154,900	620	96,038,000	
8606	みずほ証券	21,000	308	6,468,000	
8607	みずほインベスターズ証券	20,000	90	1,800,000	
8609	岡三証券グループ	7,000	422	2,954,000	
8613	丸三証券	2,700	533	1,439,100	
8614	東洋証券	3,000	169	507,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	9,000	287	2,583,000	
8617	光世証券	2,000	97	194,000	
8622	水戸証券	2,000	192	384,000	
8624	いちよし証券	1,800	621	1,117,800	
8628	松井証券	5,000	621	3,105,000	
8692	だいこう証券ビジネス	300	477	143,100	
8698	マネックスグループ	50	34,750	1,737,500	
8703	カブドットコム証券	13	94,100	1,223,300	
8706	極東証券	1,000	668	668,000	
8707	岩井証券	800	661	528,800	
8713	フィデアホールディングス	4,000	160	640,000	
8714	池田泉州ホールディングス	27,100	322	8,726,200	
8725	三井住友海上グループホールディングス	17,900	2,275	40,722,500	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	27	260,300	7,028,100	
8742	小林洋行	300	310	93,000	
8754	日本興亜損害保険	28,000	507	14,196,000	
8755	損保ジャパン	37,000	555	20,535,000	
8759	ニッセイ同和損害保険	9,000	428	3,852,000	
8761	あいおい損害保険	21,000	427	8,967,000	
8763	富士火災海上保険	10,000	109	1,090,000	
8766	東京海上ホールディングス	32,100	2,445	78,484,500	
8772	アサックス	1	74,200	74,200	
8793	NECキャピタルソリューション	300	1,229	368,700	
8795	T&Dホールディングス	11,600	2,200	25,520,000	
8801	三井不動産	35,000	1,402	49,070,000	
8802	三菱地所	56,000	1,319	73,864,000	
8803	平和不動産	6,000	285	1,710,000	
8804	東京建物	12,000	426	5,112,000	
8806	ダイビル	2,100	710	1,491,000	
8809	サンケイビル	1,400	649	908,600	
8815	東急不動産	16,000	347	5,552,000	
8818	京阪神不動産	900	400	360,000	
8830	住友不動産	19,000	1,605	30,495,000	
8833	東宝不動産	900	524	471,600	
8835	太平洋興発	3,000	69	207,000	
8838	有楽土地	1,000	309	309,000	
8840	大京	9,000	216	1,944,000	
8841	テーオーシー	3,300	398	1,313,400	
8842	東京楽天地	1,000	365	365,000	
8848	レオパレス21	5,600	447	2,503,200	
8860	フジ住宅	700	343	240,100	
8864	空港施設	1,000	506	506,000	
8869	明和地所	400	547	218,800	
8870	住友不動産販売	300	3,030	909,000	

8871	ゴールドクレスト	590	2,615	1,542,850
8875	東栄住宅	600	1,030	618,000
8877	日本エスリード	400	752	300,800
8879	東急リパブル	800	880	704,000
8880	飯田産業	400	1,524	609,600
8881	日神不動産	600	435	261,000
8895	アーネストワン	1,400	1,078	1,509,200
8897	タカラレーベン	400	571	228,400
8904	サンヨーハウジング名古屋	3	83,000	249,000
8905	イオンモール	3,700	1,738	6,430,600
8907	フージャースコーポレーション	8	10,330	82,640
8915	タクトホーム	4	94,100	376,400
8918	ランド	300	40	12,000
8924	リサ・パートナーズ	11	73,400	807,400
8933	N T T都市開発	50	65,800	3,290,000
8934	サンフロンティア不動産	7	22,290	156,030
8939	大和システム	300	234	70,200
8944	ランドビジネス	6	23,910	143,460
9001	東武鉄道	34,000	473	16,082,000
9003	相鉄ホールディングス	12,000	388	4,656,000
9005	東京急行電鉄	45,000	374	16,830,000
9006	京浜急行電鉄	22,000	686	15,092,000
9007	小田急電鉄	25,000	695	17,375,000
9008	京王電鉄	22,000	535	11,770,000
9009	京成電鉄	12,000	497	5,964,000
9010	富士急行	2,000	451	902,000
9014	新京成電鉄	1,000	344	344,000
9020	東日本旅客鉄道	14,900	5,620	83,738,000
9021	西日本旅客鉄道	69	309,000	21,321,000
9022	東海旅客鉄道	69	573,000	39,537,000
9030	アートコーポレーション	200	1,461	292,200
9031	西日本鉄道	11,000	331	3,641,000
9037	ハマキョウレックス	200	2,120	424,000
9039	サカイ引越センター	100	1,935	193,500
9041	近畿日本鉄道	74,000	308	22,792,000
9042	阪急阪神ホールディングス	55,000	390	21,450,000
9044	南海電気鉄道	17,000	382	6,494,000
9045	京阪電気鉄道	18,000	371	6,678,000
9047	名糖運輸	300	770	231,000
9048	名古屋鉄道	28,000	271	7,588,000
9062	日本通運	35,000	388	13,580,000
9064	ヤマトホールディングス	16,000	1,296	20,736,000
9065	山九	10,000	425	4,250,000
9066	日新	3,000	196	588,000
9067	丸運	800	228	182,400
9068	丸全昭和運輸	3,000	294	882,000
9069	センコー	3,000	330	990,000
9070	トナミホールディングス	2,000	237	474,000
9072	日本梱包運輸倉庫	2,000	947	1,894,000
9074	日本石油輸送	1,000	195	195,000
9075	福山通運	6,000	458	2,748,000
9076	セイノーホールディングス	6,000	660	3,960,000
9081	神奈川中央交通	1,000	516	516,000
9086	日立物流	1,500	1,178	1,767,000
9101	日本郵船	43,000	327	14,061,000
9104	商船三井	39,000	535	20,865,000
9107	川崎汽船	20,000	328	6,560,000
9110	新和海運	3,000	262	786,000
9113	乾汽船	1,000	703	703,000
9115	明治海運	800	432	345,600
9119	飯野海運	3,900	436	1,700,400
9123	太平洋海運	2,000	79	158,000

9130	共栄タンカー	1,000	198	198,000	
9132	第一中央汽船	6,000	223	1,338,000	
9202	全日本空輸	114,000	228	25,992,000	
9205	日本航空	117,000	106	12,402,000	
9232	パスコ	1,000	177	177,000	
9234	国際航業ホールディングス	1,000	295	295,000	
9301	三菱倉庫	6,000	945	5,670,000	
9302	三井倉庫	3,000	309	927,000	
9303	住友倉庫	6,000	405	2,430,000	
9304	滋澤倉庫	2,000	284	568,000	
9305	ヤマタネ	4,000	125	500,000	
9306	東陽倉庫	1,000	183	183,000	
9310	日本トランスシティ	2,000	259	518,000	
9312	ケイヒン	2,000	124	248,000	
9324	安田倉庫	600	621	372,600	
9351	東洋埠頭	2,000	169	338,000	
9358	宇徳	900	244	219,600	
9364	上組	10,000	669	6,690,000	
9366	サンリツ	200	578	115,600	
9369	キューソー流通システム	200	1,020	204,000	
9370	郵船航空サービス	700	1,209	846,300	
9375	近鉄エクスプレス	700	2,120	1,484,000	
9382	バンテック	4	122,900	491,600	
9401	東京放送ホールディングス	4,800	1,324	6,355,200	
9404	日本テレビ放送網	770	12,280	9,455,600	
9409	テレビ朝日	21	133,400	2,801,400	
9411	テレビ東京	300	2,170	651,000	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	68	40,750	2,771,000	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	1	202,800	202,800	
9427	イー・アクセス	46	68,100	3,132,600	
9430	N E C モバイリング	300	2,320	696,000	
9432	日本電信電話	33,400	3,680	122,912,000	
9433	K D D I	131	458,000	59,998,000	
9435	光通信	1,100	1,630	1,793,000	
9437	N T T ドコモ	703	130,800	91,952,400	
9449	G M O インターネット	2,400	402	964,800	
9470	学研ホールディングス	4,000	239	956,000	
9474	ゼンリン	1,100	1,217	1,338,700	
9475	昭文社	500	602	301,000	
9477	角川グループホールディングス	700	2,200	1,540,000	
9479	インプレスホールディングス	700	209	146,300	
9501	東京電力	50,500	2,115	106,807,500	
9502	中部電力	27,000	2,025	54,675,000	
9503	関西電力	33,100	1,953	64,644,300	
9504	中国電力	11,800	1,720	20,296,000	
9505	北陸電力	8,400	1,950	16,380,000	
9506	東北電力	20,300	1,757	35,667,100	
9507	四国電力	8,900	2,460	21,894,000	
9508	九州電力	17,700	1,783	31,559,100	
9509	北海道電力	7,600	1,688	12,828,800	
9511	沖縄電力	600	4,780	2,868,000	
9513	J - P O W E R	5,300	2,660	14,098,000	
9531	東京ガス	101,000	340	34,340,000	
9532	大阪ガス	87,000	296	25,752,000	
9533	東邦ガス	21,000	443	9,303,000	
9534	北海道ガス	2,000	247	494,000	
9536	西部ガス	10,000	248	2,480,000	
9543	静岡ガス	2,500	625	1,562,500	
9600	アイネット	300	491	147,300	
9601	松竹	5,000	803	4,015,000	
9602	東宝	6,100	1,347	8,216,700	
9603	エイチ・アイ・エス	800	1,842	1,473,600	

9605	東映	3,000	472	1,416,000	
9607	葵プロモーション	500	443	221,500	
9613	NTTデータ	52	259,400	13,488,800	
9616	共立メンテナンス	400	1,433	573,200	
9619	イチネンホールディングス	800	350	280,000	
9621	建設技術研究所	500	488	244,000	
9628	燦ホールディングス	200	1,581	316,200	
9632	スバル興業	1,000	275	275,000	
9633	東京テアトル	3,000	148	444,000	
9665	吉本興業	1,300	1,304	1,695,200	
9667	ホリプロ	400	780	312,000	
9671	よみうりランド	2,000	303	606,000	
9672	東京都競馬	7,000	137	959,000	
9675	常磐興産	3,000	146	438,000	
9678	カナモト	1,000	370	370,000	
9681	東京ドーム	6,000	273	1,638,000	
9682	D T S	800	741	592,800	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,100	2,210	4,641,000	
9692	シーイーシー	500	552	276,000	
9697	カブコン	1,800	1,524	2,743,200	
9706	日本空港ビルデング	2,100	1,240	2,604,000	
9715	トランスコスモス	1,000	783	783,000	
9716	乃村工芸社	2,000	253	506,000	
9717	ジャステック	400	570	228,000	
9719	住商情報システム	900	1,384	1,245,600	
9722	藤田観光	2,000	360	720,000	
9726	K N T	3,000	81	243,000	
9728	日本管財	300	1,591	477,300	
9731	白洋舎	1,000	272	272,000	
9735	セコム	8,100	4,300	34,830,000	
9737	C S Kホールディングス	3,200	342	1,094,400	
9739	N S W	300	302	90,600	
9740	C S P	500	876	438,000	
9742	アイネス	1,100	654	719,400	
9743	丹青社	1,000	215	215,000	
9744	メイテック	1,200	1,494	1,792,800	
9746	T K C	800	1,798	1,438,400	
9747	アサツー ディ・ケイ	1,600	1,781	2,849,600	
9749	富士ソフト	1,100	1,656	1,821,600	
9750	ソラン	800	455	364,000	
9755	応用地質	900	736	662,400	
9757	船井総合研究所	900	528	475,200	
9759	日本システムディベロップメント	1,900	961	1,825,900	
9760	進学会	400	303	121,200	
9766	コナミ	3,400	1,562	5,310,800	
9783	ベネッセホールディングス	2,800	3,800	10,640,000	
9787	イオンディライト	700	1,288	901,600	
9788	ナック	200	882	176,400	
9790	福井コンピュータ	200	305	61,000	
9792	ニチイ学館	1,800	802	1,443,600	
9793	ダイセキ	1,500	1,797	2,695,500	
9828	元気寿司	200	1,204	240,800	
9830	トラスコ中山	1,000	1,394	1,394,000	
9831	ヤマダ電機	3,900	5,470	21,333,000	
9832	オートバックスセブン	1,000	2,890	2,890,000	
9842	アークランドサカモト	500	1,071	535,500	
9843	ニトリ	1,550	7,350	11,392,500	
9850	グルメ杵屋	1,000	609	609,000	
9854	愛眼	600	538	322,800	
9861	吉野家ホールディングス	23	104,800	2,410,400	
9869	加藤産業	1,200	1,503	1,803,600	
9882	イエローハット	800	810	648,000	

9883	富士エレクトロニクス	500	756	378,000	
9887	松屋フーズ	400	1,286	514,400	
9889	JBCホールディングス	700	601	420,700	
9896	JKホールディングス	700	366	256,200	
9897	ユニダックス	500	404	202,000	
9900	サガミチェーン	1,000	791	791,000	
9902	日伝	400	2,585	1,034,000	
9930	北沢産業	1,000	216	216,000	
9932	杉本商事	400	851	340,400	
9934	因幡電機産業	900	2,135	1,921,500	
9937	セシール	500	166	83,000	
9938	住金物産	4,000	190	760,000	
9945	プレナス	900	1,211	1,089,900	
9946	ミニストップ	600	1,205	723,000	
9948	アークス	1,000	1,294	1,294,000	
9956	パロー	1,500	741	1,111,500	
9962	ミスミグループ本社	2,900	1,449	4,202,100	
9963	江守商事	200	725	145,000	
9972	アルテック	500	182	91,000	
9974	ベルク	400	820	328,000	
9979	大庄	500	1,211	605,500	
9982	タキヒヨー	1,000	456	456,000	
9983	ファーストリテイリング	1,700	15,910	27,047,000	
9984	ソフトバンク	34,600	2,145	74,217,000	
9987	スズケン	3,000	3,150	9,450,000	
9989	サンドラッグ	1,600	2,235	3,576,000	
9991	ジェコス	500	386	193,000	
9993	ヤマザワ	200	1,344	268,800	
9994	やまや	200	801	160,200	
9997	ペルーナ	1,050	380	399,000	
	合計	11,926,026		9,164,785,950	

(2) 株式以外の有価証券

(新株予約権証券)

(単位：円)

銘柄	券面総額	評価額	備考
5714-4 DOWAホールディングス	10,000	260,000	
合計	10,000	260,000	

(注) 新株予約権証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」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平成21年11月30日現在です。

<インデックスポートフォリオ>

【純資産額計算書】

資産総額	8,846,410,678	円
負債総額	11,091,916	円
純資産総額（ - ）	8,835,318,762	円
発行済数量	25,790,570,812	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.3426	円

<バランスポートフォリオ>

純資産額計算書

資産総額	430,511,264	円
負債総額	570,182	円
純資産総額（ - ）	429,941,082	円
発行済数量	636,294,025	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6757	円

（参考）インデックス東証株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	9,068,616,562	円
負債総額	23,120,647	円
純資産総額（ - ）	9,045,495,915	円
発行済数量	12,958,636,024	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.698	円

第5【設定及び解約の実績】

<インデックスポートフォリオ>

	設定数量（口）	解約数量（口）
第13計算期間（1999年11月9日～2000年11月7日）	2,117,402,183	5,343,756,637
第14計算期間（2000年11月8日～2001年11月7日）	2,409,937,140	1,674,415,732
第15計算期間（2001年11月8日～2002年11月7日）	2,527,633,631	1,808,811,918
第16計算期間（2002年11月8日～2003年11月7日）	2,350,914,067	2,209,700,994
第17計算期間（2003年11月8日～2004年11月8日）	1,619,588,910	2,482,316,326
第18計算期間（2004年11月9日～2005年11月7日）	1,358,186,333	3,284,725,185
第19計算期間（2005年11月8日～2006年11月7日）	907,747,499	3,628,251,250
第20計算期間（2006年11月8日～2007年11月7日）	793,043,556	4,287,293,625
第21計算期間（2007年11月8日～2008年11月7日）	981,834,490	730,018,204
第22計算期間（2008年11月8日～2009年11月9日）	1,338,588,106	1,023,299,271

<バランスポートフォリオ>

	設定数量（口）	解約数量（口）
第13計算期間（1999年11月9日～2000年11月7日）	68,637,545	199,015,330
第14計算期間（2000年11月8日～2001年11月7日）	67,071,501	52,160,165
第15計算期間（2001年11月8日～2002年11月7日）	66,100,980	81,548,255
第16計算期間（2002年11月8日～2003年11月7日）	54,445,112	75,027,275
第17計算期間（2003年11月8日～2004年11月8日）	43,737,134	94,670,811
第18計算期間（2004年11月9日～2005年11月7日）	36,080,277	114,073,407
第19計算期間（2005年11月8日～2006年11月7日）	28,971,601	76,263,650
第20計算期間（2006年11月8日～2007年11月7日）	26,280,695	168,533,817
第21計算期間（2007年11月8日～2008年11月7日）	26,940,763	23,007,376
第22計算期間（2008年11月8日～2009年11月9日）	29,474,951	37,415,222

第四部【特別情報】

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

平成21年12月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	220,000,000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

年月日	変更後（変更前）
平成18年7月6日	16,223,228,400円（16,174,272,500円）
平成19年4月13日	16,287,728,400円（16,223,228,400円）
平成20年6月23日	16,403,045,900円（16,287,728,400円）
平成21年10月1日	17,363,045,900円（16,403,045,900円）

(2) 会社の意思決定機構

・株主総会

取締役・監査役などの選任、定款変更などに係る決議などを行いません。

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4月1日から3ヵ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

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

10名以内の取締役で構成され、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を任期とします。

取締役会はその決議をもって、代表取締役若干名を選任します。また、取締役中より取締役会長および取締役社長各1名、取締役副社長、専務取締役および常務取締役各若干名を選任することができます。

・監査役会

5名以内の監査役で構成され、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。

（平成21年12月末現在）

(3) 運用の意思決定プロセス

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. 運用に関するリスク・パフォーマンスの評価と分析および法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理については、運用部門から独立したリスク管理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、精度の高い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、平成21年12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	368	65,894
株式投資信託	291	53,184
単位型	41	986
追加型	250	52,198
公社債投資信託	77	12,709
単位型	60	948
追加型	17	11,760
投資法人合計	1	39

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）については、改正前の「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条の規定により、改正前の「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、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則並びに同規則第2条の規定により、改正後の「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49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第49期 (平成20年3月31日)		第50期 (平成21年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		35,432		27,759
有価証券		337		
前払費用		407		393
未収入金		7		3,869
未収委託者報酬		10,138		5,506
未収収益	3	712	3	582
立替金		190		222
繰延税金資産		1,901		862
その他	2	30	2	30
流動資産合計		49,158		39,226
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	843	1	313
器具備品	1	548	1	346
有形固定資産合計		1,391		660
無形固定資産				
ソフトウェア		109		73
電話加入権等		21		21
無形固定資産合計		131		94
投資その他の資産				
投資有価証券		4,274		1,243
関係会社株式		8,154		7,719
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		1,062		1,037
繰延税金資産		661		1,218
その他		2		0
子会社投資損失引当金		576		576
投資その他の資産合計		13,639		10,702
固定資産合計		15,162		11,458
資産合計		64,321		50,684

(単位:百万円)

	第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	150	181
未払金	5,073	2,811
未払収益分配金	7	7
未払償還金	353	187
未払手数料	4,378	2,391
その他未払金	333	225
未払費用	3 6,697	3 3,701
未払法人税等	5,651	
未払消費税等	424	
賞与引当金	2,855	1,821
役員賞与引当金	320	191
その他	212	16
流動負債合計	21,384	8,723
固定負債		
退職給付引当金	624	612
その他	102	102
固定負債合計	727	714
負債合計	22,112	9,438
純資産の部		
株主資本		
資本金	16,287	16,403
資本剰余金		
資本準備金	4,157	4,272
その他資本剰余金	4	4
資本剰余金合計	4,161	4,277
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	21,660	20,593
利益剰余金合計	21,660	20,593
株主資本合計	42,109	41,273
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	99	26
評価・換算差額等合計	99	26
純資産合計	42,208	41,246
負債純資産合計	64,321	50,684

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	87,292	56,567
その他営業収益	3,894	2,962
営業収益計	91,186	59,529
営業費用		
支払手数料	36,598	27,877
広告宣伝費	4,770	1,298
公告費	42	17
受益証券発行費	13	
調査費	17,679	12,861
調査費	868	854
委託調査費	16,792	11,990
図書費	19	15
委託計算費	554	491
営業雑経費	1,002	714
通信費	237	190
印刷費	430	340
協会費	44	49
諸会費	9	7
その他	280	126
営業費用計	60,661	43,260
一般管理費		
給料	8,005	7,124
役員報酬	220	228
役員賞与引当金繰入額	320	191
給料・手当	4,578	4,879
賞与	31	4
賞与引当金繰入額	2,855	1,821
交際費	100	79
寄付金	19	33
旅費交通費	446	264
租税公課	341	255
不動産賃借料	1,164	921
退職給付費用	327	336
退職金	231	14
固定資産減価償却費	446	801
諸経費	3,806	2,992
一般管理費計	14,890	12,824
営業利益	15,634	3,444

(単位：百万円)

	第49期 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月31日)		第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	
営業外収益				
受取利息		1		2
受取配当金		63	1	710
有価証券売却益				160
有価証券償還益				73
時効成立分配金・償還金		689		106
その他		71		122
営業外収益計		826		1,176
営業外費用				
支払利息		16		15
有価証券売却損				51
有価証券償還損				200
時効成立後支払分配金・償還金		90		129
弁護士報酬等		31		37
その他		12		2
営業外費用計		150		438
経常利益		16,310		4,182
特別利益				
投資有価証券売却益		560		38
特別利益計		560		38
特別損失				
投資有価証券売却損		390		226
投資有価証券評価損				569
関係会社株式評価損		2,618		454
固定資産処分損		46		0
移転費用		110		
割増退職金				433
その他		7		
特別損失計		3,172		1,685
税引前当期純利益		13,697		2,535
法人税、住民税及び事業税		7,266		273
法人税等調整額		1,581		568
法人税等合計		5,685		842
当期純利益		8,012		1,693

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	16,223	16,287
当期変動額		
新株の発行	64	115
当期変動額合計	64	115
当期末残高	16,287	16,403
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	4,092	4,157
当期変動額		
新株の発行	64	115
当期変動額合計	64	115
当期末残高	4,157	4,272
その他資本剰余金		
前期末残高	4	4
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	4	4
資本剰余金合計		
前期末残高	4,097	4,161
当期変動額		
新株の発行	64	115
当期変動額合計	64	115
当期末残高	4,161	4,277
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
前期末残高	20,616	21,660
当期変動額		
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
当期変動額合計	1,043	1,067
当期末残高	21,660	20,593
利益剰余金合計		
前期末残高	20,616	21,660
当期変動額		
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
当期変動額合計	1,043	1,067
当期末残高	21,660	20,593

(単位：百万円)

	第49期 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月31日)	第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)
株主資本合計		
前期末残高	40,937	42,109
当期変動額		
新株の発行	129	230
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
当期変動額合計	1,172	836
当期末残高	42,109	41,273
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	682	99
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	582	126
当期変動額合計	582	126
当期末残高	99	26
評価・換算差額等合計		
前期末残高	682	99
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	582	126
当期変動額合計	582	126
当期末残高	99	26
純資産合計		
前期末残高	41,619	42,208
当期変動額		
新株の発行	129	230
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	582	126
当期変動額合計	589	962
当期末残高	42,208	41,246

重要な会計方針

	第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 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	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
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。 なお、主な耐用年数は以下の通りで あります。 建物 4年 器具備品 4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、ソフトウェア(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。	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りで あります。 建物 4年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 同左
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。 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)按分 した額をそれぞれ発生の翌事業年度 から費用処理することとしておりま す。	(1) 賞与引当金 同左 (2) 役員賞与引当金 同左 (3) 退職給付引当金 同左

	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
4 リース取引の処理方法	(4) 子会社投資損失引当金 子会社株式の実質価額の低下による損失に備えて、純資産価額等を勘案して必要と認められる額を計上しております。 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。	(4) 子会社投資損失引当金 同左
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。	消費税等の会計処理 同左

会計方針の変更

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
(固定資産の減価償却の方法) 法人税法の改正((所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日 法律第6号)及び(法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号))に伴い、当事業年度より、平成19年4月1日以降に取得したものについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。これにより、従来の方法によった場合に比べて、営業利益、経常利益、税引前当期純利益が63百万円、当期純利益が37百万円それぞれ減少しております。	

表示方法の変更

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
「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)の別紙様式に基づき、前事業年度において「現金」及び「預金」として掲記されていたものは、当事業年度より「現金・預金」と表示しております。	

注記事項

（貸借対照表関係）

第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p style="padding-left: 20px;">建物 166百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">器具備品 210百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、日興シティ信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次の通りであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p style="padding-left: 20px;">未収収益 77百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p style="padding-left: 20px;">未払費用 693百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Limited 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138百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p style="padding-left: 20px;">建物 704百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">器具備品 424百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、日興シティ信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次の通りであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p style="padding-left: 20px;">未収収益 28百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p style="padding-left: 20px;">未払費用 272百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Limited 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64百万円に対して保証を行っております。</p>

（損益計算書関係）

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次の通りであります。</p> <p style="padding-left: 40px;">受取配当金 703百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第49期（自平成19年4月1日至平成20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	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	183,402,500	645,000		184,047,500

(注) 普通株式の発行済株式総数の増加645,000株は、第三者割当による新株の発行による増加であります。

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

区分	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)
			前事業 年度末	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
提出 会社	平成16年度 ストックオプション(1)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(2)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(3)	普通株式	6,520,000	-	520,000	6,000,000	-
	平成17年度 ストックオプション	普通株式	3,450,000	-	310,000	3,140,000	-
	平成18年度 ストックオプション	普通株式	1,550,000	-	80,000	1,470,000	-
	平成19年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,250,000	110,000	4,140,000	-
	平成19年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	30,000	-	30,000	-
合計			23,520,000	4,280,000	1,020,000	26,780,000	-

- (注) 1 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16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す。
- 2 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19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。
- 3 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション及び平成19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。
- 4 平成19年度ストックオプション(1)及び平成19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。

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19年5月23日 取締役会	普通株式	6,969	38	平成19年3月31日	平成19年6月21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当事業年度後となるもの

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20年5月23日 取締役会	普通株式	利益剰余金	2,760	15	平成20年3月31日	平成20年6月10日

第50期（自平成20年4月1日至平成21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	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	184,047,500	965,000		185,012,500

(注) 普通株式の発行済株式総数の増加965,000株は、第三者割当による新株の発行による増加であります。

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

区分	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)
			前事業 年度末	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
提出 会社	平成16年度 ストックオプション(1)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(2)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(3)	普通株式	6,000,000	-	670,000	5,330,000	-
	平成17年度 ストックオプション	普通株式	3,140,000	-	300,000	2,840,000	-
	平成18年度 ストックオプション	普通株式	1,470,000	-	150,000	1,320,000	-
	平成19年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,140,000	-	530,000	3,610,000	-
	平成19年度 ストックオプション(2)	普通株式	30,000	-	-	30,000	-
合計			26,780,000	-	1,650,000	25,130,000	-

- (注) 1 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16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す。
- 2 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19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。
- 3 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション及び平成19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。

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20年5月23日 取締役会	普通株式	2,760	15	平成20年3月31日	平成20年6月10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当事業年度後となるもの現時点で未定であります。

(リース取引関係)

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
1 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 当事業年度中にリース契約が終了し、金額が僅少であるため、注記を省略しております。	1 ファイナンス・リース取引
2 オペレーティング・リース取引 未経過リース料	2 オペレーティング・リース取引 未経過リース料
1年内 906百万円	1年内 906百万円
1年超 1,849百万円	1年超 942百万円
合計 2,755百万円	合計 1,849百万円

(有価証券関係)

第49期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

1 その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

	種 類	取 得 原 価	貸借対照表計上額	差 額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株 式	7	27	19
	そ の 他	2,667	3,071	403
	小 計	2,675	3,098	423
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	そ の 他	1,545	1,289	255
	小 計	1,545	1,289	255
合 計		4,220	4,388	167

(注) 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 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

売 却 額	売 却 益 の 合 計 額	売 却 損 の 合 計 額
8,079	560	390

3 時価評価されていない有価証券

その他有価証券

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
非上場株式	124
その他 投資証券	100
合 計	224

(注) 当事業年度において、その他有価証券で時価評価されていない株式7百万円につき、株式の実質価額の低下を考慮し、減損処理を行っております。

4 その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

(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
その他有価証券 その他 投資信託	337	1,078	792	1,112
合計	337	1,078	792	1,112

5 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
子会社株式	905	787	117
合計	905	787	117

第50期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

1 その他有価証券で時価のあるもの

(単位:百万円)

	種類	取得原価	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	7	12	5
	その他	273	299	25
	小計	280	312	31
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	836	759	76
	小計	836	759	76
合計		1,117	1,072	45

(注) 表中の「取得原価」は減損処理後の帳簿価額であります。当事業年度については、269百万円の減損処理を行っております。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。

2 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
3,196	199	278

3 時価評価されていない有価証券

その他有価証券

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
非上場株式	121
その他 投資証券	50
合計	171

(注) 当事業年度において、その他有価証券で時価評価されていない投資証券につき、投資証券の実質価額の低下を考慮し、50百万円の減損処理を行っております。

4 その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

(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
その他有価証券 その他 投資信託	-	-	504	442
合計	-	-	504	442

5 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
子会社株式	500	499	1
合計	500	499	1

(注) 当事業年度において、時価のある子会社株式につき、時価が著しく下落し回復する見込があると認められないため、404百万円の減損処理を行っております。

(持分法損益等)

第49期 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月 31日)	第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21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)	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 2,892	(1) 関連会社に対する投資の金額 2,892
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,201	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,495
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,519	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,019

(退職給付関係)

第49期 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月 31日)	第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21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、キャッシュバランスプラン型退職金制度、適格退職年金制度及び退職一時金制度を設けております。	1 採用している退職給付制度の概要 同左
2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)	2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)
イ 退職給付債務 1,502	イ 退職給付債務 1,429
ロ 年金資産 688	ロ 年金資産 676
ハ 未積立退職給付債務 813	ハ 未積立退職給付債務 753
ニ 未認識数理計算上の差異 188	ニ 未認識数理計算上の差異 141
ホ 退職給付引当金残高 624	ホ 退職給付引当金残高 612
3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)	3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)
イ 勤務費用 96	イ 勤務費用 107
ロ 利息費用 29	ロ 利息費用 30
ハ 期待運用収益 5	ハ 期待運用収益 5
ニ 数理計算上の差異の費用処理額 32	ニ 数理計算上の差異の費用処理額 34
ホ 確定拠出型企業年金への掛金 174	ホ 確定拠出型企業年金への掛金 169
ヘ 退職給付費用合計 327	ヘ 退職給付費用合計 336

4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項	4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項
イ 退職給付見込額の期間配分方法 勤続期間比例	イ 退職給付見込額の期間配分方法 勤続期間比例
ロ 割引率 2.0%	ロ 割引率 2.0%
ハ 期待運用収益率 0.7%	ハ 期待運用収益率 0.7%
ニ 数理計算上の差異の処理年数 10年	ニ 数理計算上の差異の処理年数 10年
	5 割増退職金に関する事項 (単位：百万円)
	イ 流動負債 16
	ロ 割増退職金 433

(ストックオプション等関係)

第49期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

1 スtock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tockオプション(新株予約権)の内容

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役 1名	当社の取締役 1名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 6,070,000株	普通株式 6,070,000株
付与日	平成16年8月31日	平成16年8月31日
権利確定条件	平成17年3月24日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年4月24日から平成19年3月24日まで各24日にそれぞれ170,000株の権利が確定	平成17年7月8日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年8月8日から平成19年7月8日まで各8日にそれぞれ170,000株の権利が確定
対象勤務期間	平成16年8月31日から平成19年3月23日まで	平成16年8月31日から平成19年7月7日まで
権利行使期間	平成16年8月31日から平成26年3月24日まで	平成16年8月31日から平成26年7月8日まで

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
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 97名	当社の従業員及び関係会社の取締役・従業員 147名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 7,640,000株	普通株式 3,710,000株
付与日	平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日	平成18年2月14日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成18年6月24日のいずれか遅い日(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ずつ権利確定する。	上場がなされた日又は平成19年6月23日のいずれか遅い日(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ずつ権利確定する。
対象勤務期間	それぞれの付与日から、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18年6月24日から平成26年6月23日まで	平成19年6月23日から平成27年6月22日まで

	平成18年度ストックオプション	
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の従業員 115名	当社及び関係会社の従業員 11名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）1	普通株式 1,270,000株	普通株式 340,000株
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成21年4月28日のいずれか遅い日(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、当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から3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4分の1ずつ権利確定する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から3年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成21年4月28日から平成28年4月27日まで	同左

	平成19年度ストックオプション(1)	平成19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 124名	当社の従業員 1名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）1	普通株式 4,250,000株	普通株式 30,000株
付与日	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成21年7月19日のいずれか遅い日(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ずつ権利確定する。	上場がなされた日又は平成22年3月19日のいずれか遅い日(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ずつ権利確定する。
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	同左
権利行使期間	平成21年7月19日から平成29年7月18日まで	平成22年3月19日から平成30年3月18日まで

(注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の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

ストックオプション(新株予約権)の数

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年8月31日	平成16年8月31日
権利確定前(株)		
期首		680,000
付与		0
失効		0
権利確定		680,000
権利未確定残		0
権利確定後(株)		
期首	6,000,000	5,320,000
権利確定	0	680,000
権利行使	0	0
失効	0	0
権利未行使残	6,000,000	6,000,000

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日	平成18年2月14日
権利確定前(株)		
期首	6,520,000	3,450,000
付与	0	0
失効	520,000	310,000
権利確定	0	0
権利未確定残	6,000,000	3,140,000
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18年度ストックオプション	
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定前(株)		
期首	1,220,000	330,000
付与	0	0
失効	80,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	1,140,000	330,000
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19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与日	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利確定前(株)		
期首	0	0
付与	4,250,000	30,000
失効	110,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	4,140,000	30,000
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。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。

単価情報

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年 8 月31日	平成16年 8 月31日
権利行使価格(円) (注) 1	15,823(分割後159)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3		

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年 1 月11日、平成17年 1 月28日 平成17年 5 月24日、平成17年 6 月22日	平成18年 2 月14日
権利行使価格(円) (注) 1	15,823(分割後159)	17,666(分割後177)
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3		

	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年 4 月28日	平成18年 7 月18日
権利行使価格(円) (注) 1	19,981(分割後200)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3		0

	平成19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与日	平成19年 7 月27日	平成20年 3 月31日
権利行使価格(円) (注) 1	450	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3	0	0

- (注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。
- 2 平成16年度ストックオプション(1)(2)(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションのうち平成18年4月28日付与ストックオプションについては、会社法の施行日前に付与されたストックオプションであるため、記載しておりません。
- 3 平成18年度ストックオプションのうち平成18年7月18日付与ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)については、公正な評価単価に代え、本源的価値（DCF法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。

第50期(自 平成20年4月1日 至 平成21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16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役 1名	当社の取締役 1名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 6,070,000株	普通株式 6,070,000株
付与日	平成16年8月31日	平成16年8月31日
権利確定条件	平成17年3月24日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年4月24日から平成19年3月24日まで各24日にそれぞれ170,000株の権利が確定	平成17年7月8日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年8月8日から平成19年7月8日まで各8日にそれぞれ170,000株の権利が確定
対象勤務期間	平成16年8月31日から平成19年3月23日まで	平成16年8月31日から平成19年7月7日まで
権利行使期間	平成16年8月31日から平成26年3月24日まで	平成16年8月31日から平成26年7月8日まで

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
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 97名	当社の従業員及び関係会社の取締役・従業員 147名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 7,640,000株	普通株式 3,710,000株
付与日	平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日	平成18年2月14日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成18年6月24日のいずれか遅い日(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ずつ権利確定する。	上場がなされた日又は平成19年6月23日のいずれか遅い日(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ずつ権利確定する。
対象勤務期間	それぞれの付与日から、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18年6月24日から平成26年6月23日まで	平成19年6月23日から平成27年6月22日まで

	平成18年度ストックオプション	
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の従業員 115名	当社及び関係会社の従業員 11名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注) 1	普通株式 1,270,000株	普通株式 340,000株
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成21年4月28日のいずれか遅い日(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、当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から3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4分の1ずつ権利確定する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から3年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成21年4月28日から平成28年4月27日まで	同左

	平成19年度ストックオプション(1)	平成19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 124名	当社の従業員 1名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注) 1	普通株式 4,250,000株	普通株式 30,000株
付与日	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利確定条件	上場がなされた日又は平成21年7月19日のいずれか遅い日(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ずつ権利確定する。	上場がなされた日又は平成22年3月19日のいずれか遅い日(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ずつ権利確定する。
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	同左
権利行使期間	平成21年7月19日から平成29年7月18日まで	平成22年3月19日から平成30年3月18日まで

(注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の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

ストックオプション（新株予約権）の数

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年 8 月31日	平成16年 8 月31日
権利確定前(株)		
期首		
付与		
失効		
権利確定		
権利未確定残		
権利確定後(株)		
期首	6,000,000	6,000,000
権利確定	0	0
権利行使	0	0
失効	0	0
権利未行使残	6,000,000	6,000,000

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年 1 月11日、平成17年 1 月28日 平成17年 5 月24日、平成17年 6 月22日	平成18年 2 月14日
権利確定前(株)		
期首	6,000,000	3,140,000
付与	0	0
失効	670,000	300,000
権利確定	0	0
権利未確定残	5,330,000	2,840,000
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18年度ストックオプション	
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定前(株)		
期首	1,140,000	330,000
付与	0	0
失効	120,000	30,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,020,000	300,000
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19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与日	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利確定前(株)		
期首	4,140,000	30,000
付与	0	0
失効	530,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	3,610,000	30,000
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。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。

単価情報

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年 8 月31日	平成16年 8 月31日
権利行使価格(円) (注) 1	15,823(分割後159)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3		

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年 1 月11日、平成17年 1 月28日 平成17年 5 月24日、平成17年 6 月22日	平成18年 2 月14日
権利行使価格(円) (注) 1	15,823(分割後159)	17,666(分割後177)
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3		

	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年 4 月28日	平成18年 7 月18日
権利行使価格(円) (注) 1	19,981(分割後200)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3		0

	平成19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与日	平成19年 7 月27日	平成20年 3 月31日
権利行使価格(円) (注) 1	450	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3	0	0

(注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。

2 平成16年度ストックオプション(1)(2)(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションのうち平成18年4月28日付与ストックオプションについては、会社法の施行日前に付与されたストックオプションであるため、記載しておりません。

3 平成18年度ストックオプションのうち平成18年7月18日付与ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)については、公正な評価単価に代え、本源的価値（DCF法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。

4 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 169百万円

(税効果会計関係)

第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21年3月31日)																																								
<p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">1,161</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">551</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">188</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,901</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">254</td> </tr> <tr> <td>子会社投資損失引当金</td> <td style="text-align: right;">234</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">240</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">729</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産合計</p> <p style="text-align: right;">2,630</p> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">68</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債合計</p> <p style="text-align: right;">68</p> <p>繰延税金資産の純額</p> <p style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,562</p>	賞与引当金繰入超過額	1,161	未払事業税	551	その他	188		1,901	退職給付引当金超過額	254	子会社投資損失引当金	234	その他	240		729	その他有価証券評価差額金	68	<p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">895</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">182</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,078</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>投資有価証券等評価損</td> <td style="text-align: right;">171</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">185</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">249</td> </tr> <tr> <td>子会社投資損失引当金</td> <td style="text-align: right;">234</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">215</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">162</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,218</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産合計</p> <p style="text-align: right;">2,297</p> <p>繰延税金負債(流動)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>事業税中間納付還付予定額</td> <td style="text-align: right;">216</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債合計</p> <p style="text-align: right;">216</p> <p>繰延税金資産の純額</p> <p style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,080</p>	賞与引当金繰入超過額	895	その他	182		1,078	投資有価証券等評価損	171	関係会社株式評価損	185	退職給付引当金超過額	249	子会社投資損失引当金	234	固定資産減価償却超過額	215	その他	162		1,218	事業税中間納付還付予定額	216
賞与引当金繰入超過額	1,161																																								
未払事業税	551																																								
その他	188																																								
	1,901																																								
退職給付引当金超過額	254																																								
子会社投資損失引当金	234																																								
その他	240																																								
	729																																								
その他有価証券評価差額金	68																																								
賞与引当金繰入超過額	895																																								
その他	182																																								
	1,078																																								
投資有価証券等評価損	171																																								
関係会社株式評価損	185																																								
退職給付引当金超過額	249																																								
子会社投資損失引当金	234																																								
固定資産減価償却超過額	215																																								
その他	162																																								
	1,218																																								
事業税中間納付還付予定額	216																																								
<p>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</p> <p>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百分の五以下であるため注記を省略しております。</p>	<p>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</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">40.6%</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">3.6%</td> </tr> <tr> <td>外国税額控除の影響額等</td> <td style="text-align: right;">11.0%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">33.2%</td> </tr> </table>	法定実効税率	40.6%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	3.6%	外国税額控除の影響額等	11.0%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	33.2%																														
法定実効税率	40.6%																																								
(調整)																																									
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.6%																																								
外国税額控除の影響額等	11.0%																																								
税効果会計適用後の法人税等の負担率	33.2%																																								

(関連当事者情報)

第49期(自 平成19年 4 月 1 日 至 平成20年 3 月31日)

(追加情報)

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」(平成18年10月17日 企業会計基準委員会 企業会計基準第11号)及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」(平成18年10月17日 企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第13号)を早期に適用しております。

この結果、従来の開示対象範囲に加えて、親会社又は重要な関連会社に関する注記が開示対象に追加されております。

1 関連当事者との取引

(1) 関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	日興コーディアル証券株式会社	東京都千代田区	100,000	証券業	なし	投資信託受益証券の募集販売	信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払(注1)	19,162	未払手数料	2,977

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、未払手数料の期末残高には消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち委託者報酬分を、市場価格を勘案し両者協議の上配分を合理的に決定しております。

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

Citigroup Inc.(ニューヨーク証券取引所等に上場)

シティグループ・ジャパン・ホールディングス株式会社

株式会社日興コーディアルグループ

(注) 平成20年5月1日、シティグループ・ジャパン・ホールディングス株式会社と株式会社日興コーディアルグループは合併し、日興シティホールディングス株式会社に名称変更しております。

(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通りであります。なお、下記数値は平成19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	8,817百万円
負債合計	2,727百万円
純資産合計	6,090百万円
営業収益	13,173百万円
税引前当期純利益	5,719百万円
当期純利益	4,873百万円

第50期(自 平成20年4月1日 至 平成21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) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	日興コーディアル証券株式会社	東京都千代田区	100,000	証券業	なし	投資信託受益証券の募集販売	信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払(注1)	13,541	未払手数料	1,406

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、未払手数料の期末残高には消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち委託者報酬分を、市場価格を勘案し両者協議の上配分を合理的に決定しております。

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

Citigroup Inc.(ニューヨーク証券取引所等に上場)

日興シティホールディングス株式会社

(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

報は以下の通りであります。なお、下記数値は平成20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	6,747百万円
負債合計	1,977百万円
純資産合計	4,769百万円
営業収益	10,700百万円
税引前当期純利益	3,968百万円
当期純利益	3,255百万円

（1株当たり情報）

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)		第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	
1株当たり純資産額	229円33銭	1株当たり純資産額	222円93銭
1株当たり当期純利益	43円54銭	1株当たり当期純利益	9円16銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、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。</p>		<p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、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。</p>	

（注）算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

項目	第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21年3月31日)
貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	-	41,246
普通株式に係る純資産額（百万円）	-	41,246
差額の主な内訳（百万円）		
新株予約権	-	-
普通株式の発行済株式数（千株）	-	185,013
普通株式の自己株式数（千株）	-	-
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数（千株）	-	185,013

（注）当事業年度より、1株当たり純資産額の算定上の基礎を記載しております。

2 1株当たり当期純利益金額及び潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎

項目	第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
当期純利益(百万円)	8,012	1,693
普通株式に係る当期純利益(百万円)	8,012	1,693
普通株主に帰属しない金額(百万円)		
普通株式の期中平均株式数(千株)	184,023	184,790
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の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成16年度ストックオプション(1) 6,000,000株、平成16年度ストックオプション(2) 6,000,000株、平成16年度ストックオプション(3) 6,000,000株、平成17年度ストックオプション3,140,000株、平成18年度ストックオプション1,470,000株、平成19年度ストックオプション(1) 4,140,000株、平成19年度ストックオプション(2) 30,000株。	平成16年度ストックオプション(1) 6,000,000株、平成16年度ストックオプション(2) 6,000,000株、平成16年度ストックオプション(3) 5,330,000株、平成17年度ストックオプション2,840,000株、平成18年度ストックオプション1,320,000株、平成19年度ストックオプション(1) 3,610,000株、平成19年度ストックオプション(2) 30,000株。

(重要な後発事象)

第49期(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

1 新株発行に対する払込

当社は、平成20年6月9日開催の定時株主総会及び同日開催の取締役会にて、965,000株の第三者割当による当社普通株式の発行を決議いたしました。決済金額は期日に払込まれております。

割当先	日興アセットマネジメント社員持株会
発行価額	1株につき金239円
資本組入額	1株につき金119円50銭
払込期日	平成20年6月23日

第50期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

1 投資有価証券の繰上償還

当社が投資有価証券として保有しているグローバルコレクション(隔月分配型)(121百万円 当事業年度末現在)が平成21年5月14日に繰上償還されることを、平成21年5月11日に金融庁に届出ております。

1. 当社の中間財務諸表は、改正後の「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、以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、改正後の「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. 金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第51期中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第51期中間会計期間末
(平成21年9月30日現在)

資産の部

流動資産

現金及び預金	21,422	
未収委託者報酬	6,134	
未収収益	900	
立替金	1,211	
繰延税金資産	973	
その他	2	450
流動資産合計	31,093	

固定資産

有形固定資産	1	497
無形固定資産	81	
投資その他の資産		
投資有価証券	11,054	
関係会社株式	7,719	
長期差入保証金	1,044	
繰延税金資産	1,080	
その他	60	
子会社投資損失引当金	576	
投資その他の資産合計	20,382	
固定資産合計	20,961	
資産合計	52,054	

(単位：百万円)

第51期中間会計期間末
(平成21年9月30日現在)

負債の部

流動負債

未払金	3,389
未払費用	4,148
未払法人税等	598
未払消費税等	123
賞与引当金	1,336
役員賞与引当金	110
その他	230
流動負債合計	9,937

固定負債

退職給付引当金	678
その他	102
固定負債合計	781

負債合計 10,718

純資産の部

株主資本

資本金	16,403
資本剰余金	
資本準備金	4,272
その他資本剰余金	4
資本剰余金合計	4,277

利益剰余金

その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	20,576
利益剰余金合計	20,576

株主資本合計 41,256

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	79
評価・換算差額等合計	79

純資産合計 41,335

負債純資産合計 52,054

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第51期中間会計期間
(自 平成21年 4月 1日
至 平成21年 9月30日)

営業収益		
委託者報酬		24,168
その他営業収益		1,347
営業収益合計		25,515
営業費用及び一般管理費	1	24,429
営業利益		1,085
営業外収益	2	855
営業外費用	3	307
経常利益		1,633
特別利益	4	1
特別損失	5	41
税引前中間純利益		1,593
法人税、住民税及び事業税		573
法人税等調整額		46
中間純利益		1,065

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

	第51期中間会計期間 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成21年 9 月30日)
株主資本	
資本金	
前期末残高	16,403
当中間期末残高	<u>16,403</u>
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	4,272
当中間期末残高	<u>4,272</u>
その他資本剰余金	
前期末残高	4
当中間期末残高	<u>4</u>
資本剰余金合計	
前期末残高	4,277
当中間期末残高	<u>4,277</u>
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	
前期末残高	20,593
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,082
中間純利益	<u>1,065</u>
当中間期変動額合計	<u>16</u>
当中間期末残高	<u>20,576</u>
利益剰余金合計	
前期末残高	20,593
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,082
中間純利益	<u>1,065</u>
当中間期変動額合計	<u>16</u>
当中間期末残高	<u>20,576</u>
株主資本合計	
前期末残高	41,273
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,082
中間純利益	<u>1,065</u>
当中間期変動額合計	<u>16</u>
当中間期末残高	<u>41,256</u>
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	26
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	<u>106</u>
当中間期変動額合計	<u>106</u>
当中間期末残高	<u>79</u>

評価・換算差額等合計	
前期末残高	26
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	<u>106</u>
当中間期変動額合計	<u>106</u>
当中間期末残高	<u>79</u>
純資産合計	
前期末残高	41,246
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,082
中間純利益	1,065
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	<u>106</u>
当中間期変動額合計	<u>89</u>
当中間期末残高	<u>41,335</u>

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

項目	第51期中間会計期間 (自 平成21年 4月 1日 至 平成21年 9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>其他有価証券 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)</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。但し、ソフトウェア (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。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(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 給見込額に基づき、当中間会計期間負担額を計上 しております。</p> <p>(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、支給 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。</p> <p>(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。 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)で按分した額をそれぞれ発生の翌事 業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 子会社投資損失引当金 子会社株式の実質価額の低下による損失に備 えて、純資産価額等を勘案して必要と認められる 額を計上しております。</p>
4 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	<p>消費税等の会計処理について 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。</p>

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更

第51期中間会計期間 (自 平成21年 4月 1日 至 平成21年 9月30日)
該当事項はありません。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第51期中間会計期間末 (平成21年 9月30日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 1,292百万円
2. 信託資産 その他流動資産のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、日興シティ信託銀行株式会社に信託しております。
3. 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Limited 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49百万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51期中間会計期間 (自 平成21年 4月 1日 至 平成21年 9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	163 百万円
無形固定資産	14 百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	0 百万円
受取配当金	713 百万円
時効成立分配金・償還金	15 百万円
有価証券償還益	13 百万円
中間納付法人税等還付加算金	110 百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	5 百万円
時効成立後支払分配金・償還金	46 百万円
弁護士報酬等	30 百万円
為替差損	60 百万円
支払源泉所得税	71 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	1 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	12 百万円
割増退職金	28 百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第51期中間会計期間（自 平成21年4月1日 至 平成21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	前事業年度末 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	185,012,500			185,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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)
		前事業年度末	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	
平成16年度ストックオプション (1)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
平成16年度ストックオプション (2)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
平成16年度ストックオプション (3)	普通株式	5,330,000	-	90,000	5,240,000	-
平成17年度ストックオプション	普通株式	2,840,000	-	160,000	2,680,000	-
平成18年度ストックオプション	普通株式	1,320,000	-	-	1,320,000	-
平成19年度ストックオプション (1)	普通株式	3,610,000	-	40,000	3,570,000	-
平成19年度ストックオプション (2)	普通株式	30,000	-	-	30,000	-
合計		25,130,000	-	290,000	24,840,000	-

(注) 1. 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16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す。

2. 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19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。

3. 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション及び平成19年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の消滅によるものであります。

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21年6月30日 取締役会	普通株式	1,082	5.85	平成21年3月31日	平成21年6月30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51期中間会計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)	
1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引	該当事項はありません。
2. オペレーティング・リース取引	
未経過リース料	
1年内	906 百万円
1年超	488 百万円
合計	1,395 百万円

(有価証券関係)

第51期中間会計期間末（平成21年9月30日現在）

1 その他有価証券で時価のあるもの

区分	取得原価 (百万円)	中間貸借対照表 計上額(百万円)	差額 (百万円)
株式	7	18	11
その他	10,765	10,888	122
合計	10,772	10,906	134

(注) 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。当中間会計期間末においては該当ございません。

2 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

区 分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
子会社株式	500	669	168
合 計	500	669	168

3 時価評価されていない主な有価証券の内容

区 分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
子会社株式	3,748
関連会社株式	2,892
その他有価証券	
非上場株式	97
その他	50

(持分法損益等)

第51期中間会計期間 (自 平成21年 4月 1日 至 平成21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	(単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額	2,892
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	4,307
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	683

(ストックオプション等関係)

第51期中間会計期間(自 平成21年 4月 1日 至 平成21年 9月30日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

第51期中間会計期間 (自 平成21年 4月 1日 至 平成21年 9月30日)	
1株当たり純資産額	223円42銭
1株当たり中間純利益	5円75銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、新株予約権の残高はありますが、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。</p>	

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

項目	第51期中間会計期間末 (平成21年9月30日現在)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額 (百万円)	41,335
普通株式に係る純資産額(百万円)	41,335
差額の主な内訳(百万円) 新株予約権	-
普通株式の発行済株式数(千株)	185,013
普通株式の自己株式数(千株)	-
1株当たり純資産額の算定に用いられた 普通株式の数(千株)	185,013

2 1株当たり中間純利益及び潜在株式調整後1株当たり中間純利益の算定上の基礎

	第51期中間会計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)
中間純利益(百万円)	1,065
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)	1,065
普通株式の期中平均株式数(千株)	185,013
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の算定に含まれな かった潜在株式の概要	平成16年度ストックオプション(1) 6,000,000株 平成16年度ストックオプション(2) 6,000,000株 平成16年度ストックオプション(3) 5,240,000株 平成17年度ストックオプション 2,680,000株 平成18年度ストックオプション 1,320,000株 平成19年度ストックオプション(1) 3,570,000株 平成19年度ストックオプション(2) 30,000株

(重要な後発事象)

第51期中間会計期間(自平成21年4月1日至平成21年9月30日)

住友信託銀行株式会社は、平成21年10月1日に当社取締役から取得した新株予約権を同日行使しました。行使価額は同日払込まれ、当社は12,000,000株の当社普通株式を発行いたしました。

割当先	住友信託銀行株式会社
発行価額	1株につき金159円
資本組入額	1株につき金80円

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 (平成21年9月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	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：日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額：10,000百万円（平成21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（日本マスタートラスト信託銀行株式会社）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 (平成21年9月末現在)	事業の内容
アーク証券株式会社	2,619百万円	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。
かざか証券株式会社	15,446百万円	
金十証券株式会社	1,045百万円	
日興コーディアル証券株式会社	10,000百万円 (平成21年10月1日現在)	

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・計算事務などを行いません。

(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いません。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(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) 目論見書の表紙または表紙裏に、委託会社の名称、ファンドの基本的性格などを記載し、委託会社およびファンドのロゴ・マークを表示し、図案などを採用することがあります。
- (3) 目論見書の表紙裏に、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。
投資信託は、金融機関の預金や保険契約とは商品性が異なり、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こと。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ならないこと。
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こと。
投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入されたお客様が負うこと。
- (4) 目論見書の裏表紙に、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を記載することがあります。
- (5) 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」を要約し、「ファンドの概要」などとして、目論見書の冒頭に記載することがあります。
- (6) 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。
- (7) 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。
- (8) 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。
- (9) 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。

独立監査人の監査報告書

平成20年12月17日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスポートフォリオの平成19年11月8日から平成20年11月7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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、インデックスポートフォリオの平成20年11月7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。

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. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年12月9日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 涉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスポートフォリオの平成20年11月8日から平成21年11月9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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、インデックスポートフォリオの平成21年11月9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。

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. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年12月17日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランスポートフォリオの平成19年11月8日から平成20年11月7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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、バランスポートフォリオの平成20年11月7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。

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. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年12月9日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 涉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランスポートフォリオの平成20年11月8日から平成21年11月9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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、バランスポートフォリオの平成21年11月9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。

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. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月23日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅
業務執行社員指定社員 公認会計士 鳥飼裕一
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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19年4月1日から平成20年3月31日までの第49期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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20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。

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

以上

(注) 上記は、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。

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅
業務執行社員指定社員 公認会計士 辻村和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21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。

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

以上

(注) 上記は、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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成21年11月16日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 辻 村 和 之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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21年4月1日から平成22年3月31日までの第51期事業年度の中間会計期間（平成21年4月1日から平成21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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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、我が国におけ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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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平成21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（平成21年4月1日から平成21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。

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

以 上

（注）上記は、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。