

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年2月7日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 村上 雅彦
【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】	雄谷 敦史
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスポートフォリオ バランスポートフォリオ
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	インデックスポートフォリオ 1兆円を上限とします。 バランスポートフォリオ 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

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26年 2月 8日から平成27年 2月 6日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9) 【払込期日】

- ・取得申込者は、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經由して、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	TOPIX（東証株価指数）の動きに連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
バランスポートフォリオ	TOPIX（東証株価指数）の動きに連動した投資成果に、内外公社債への投資による安定性を加味した運用を行ない、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 不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 () 資産複合	特殊型

(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	年1回	グローバル		
大型株 中小型株	年2回	日本		
	年4回	北米		日経 225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)			
社債		アジア		
その他債券	年12回			TOPIX
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
不動産投信	日々	中南米		
	その他	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	その他 ()
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	()	中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
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(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
	内外	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	年1回	グローバル	
一般			
大型株	年2回	日本	
中小型株			
	年4回	北米	
債券			ファミリーファンド
一般	年6回	欧州	
公債	(隔月)		
社債		アジア	
その他債券	年12回		
クレジット属性	(毎月)	オセアニア	
()			
	日々	中南米	
不動産投信			ファンド・オブ・ファンズ
	その他	アフリカ	
()			
その他資産		中近東	
(投資信託証券(資産複合 資産配分		(中東)	
固定型(株式、債券))		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ないます。よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「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、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

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」

主として「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に投資を行ない、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」

主として「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に50%程度投資を行ないます。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。

*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。

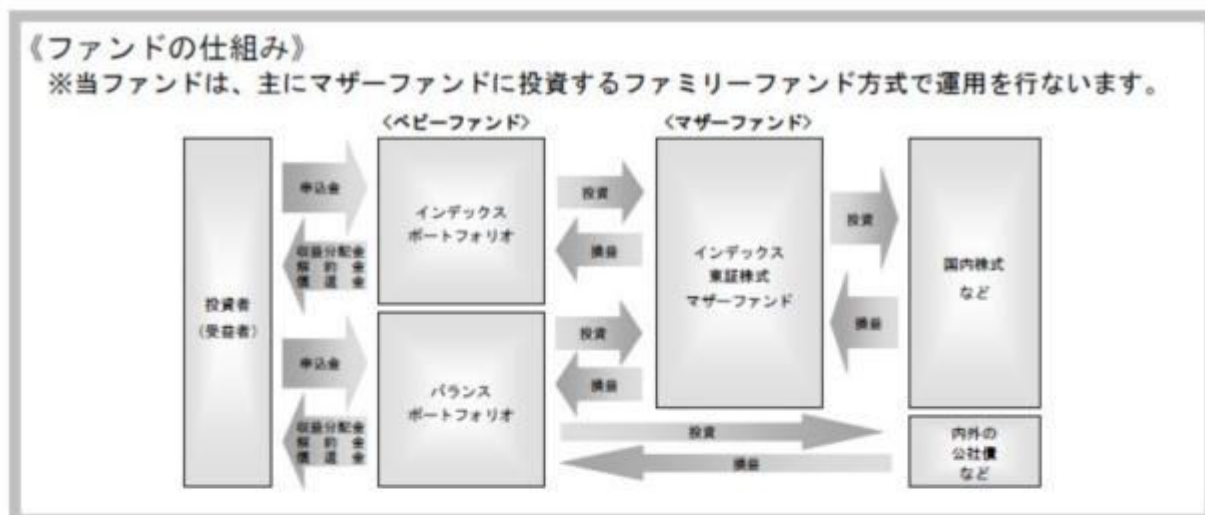
TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

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味わえます。

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。



主な投資制限

「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」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ないません。

「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」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。
- ・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。

分配方針

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」

- ・毎決算時に、利子・配当等収益を中心に安定的に分配を行いますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。

ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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。

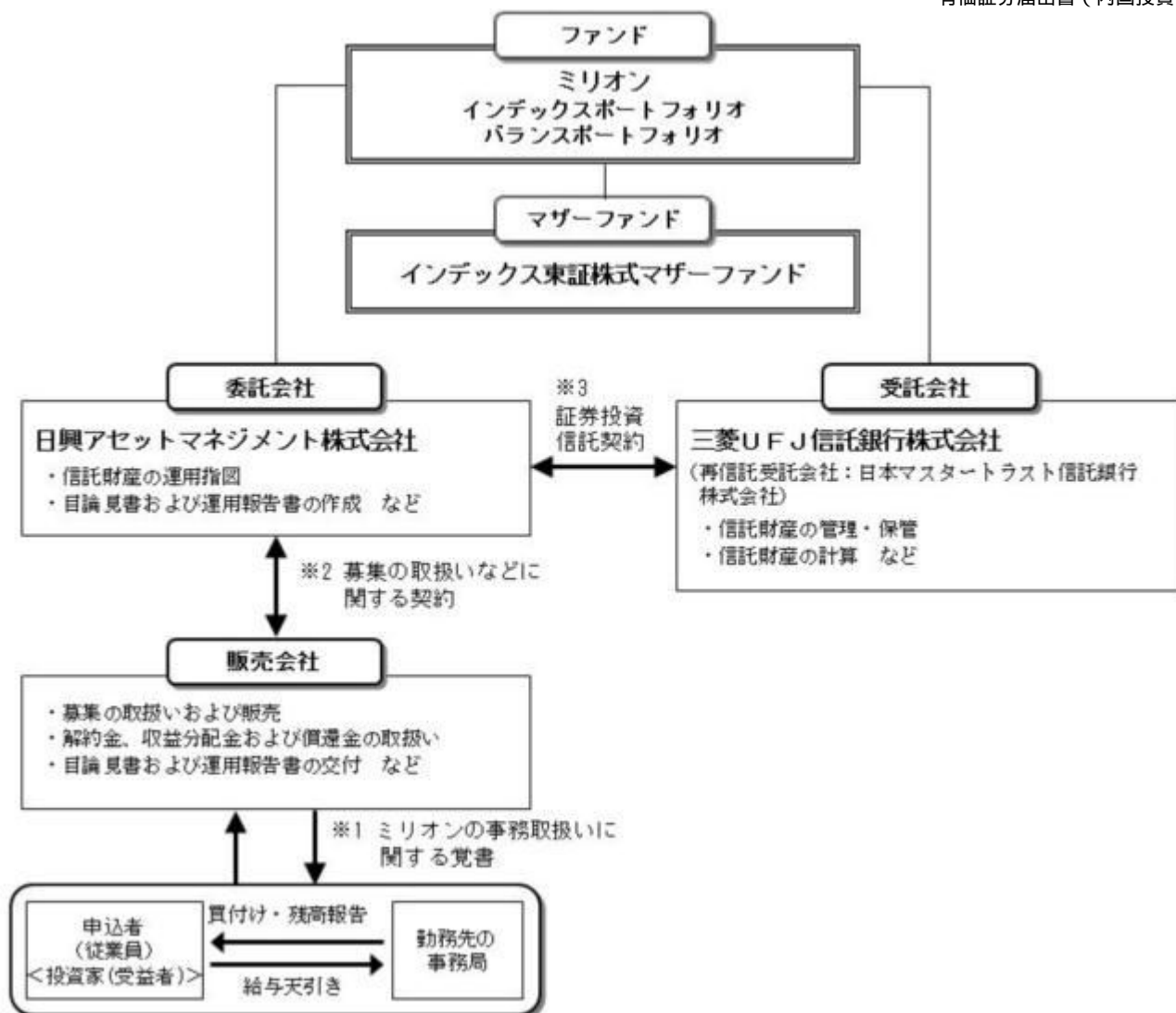
(2) 【ファンドの沿革】

昭和62年11月27日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【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です。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です。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25年11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
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<インデックスポートフォリオ>

- ・「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。) に限ります。)

- 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ます。)
- 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ます。)
 - 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

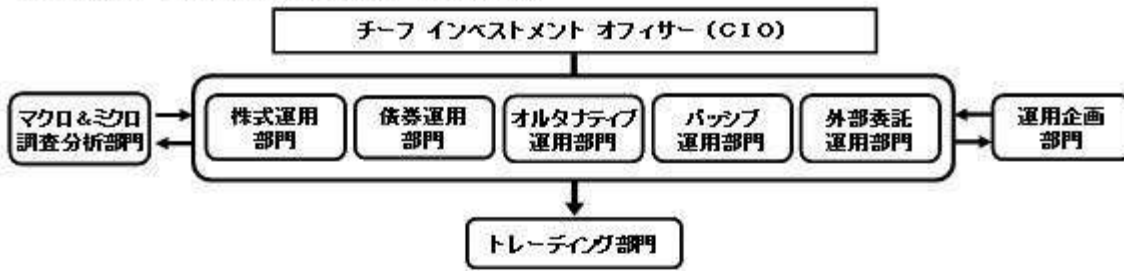
投資対象とするマザーファンドの概要

< インデックス東証株式マザーファンド >

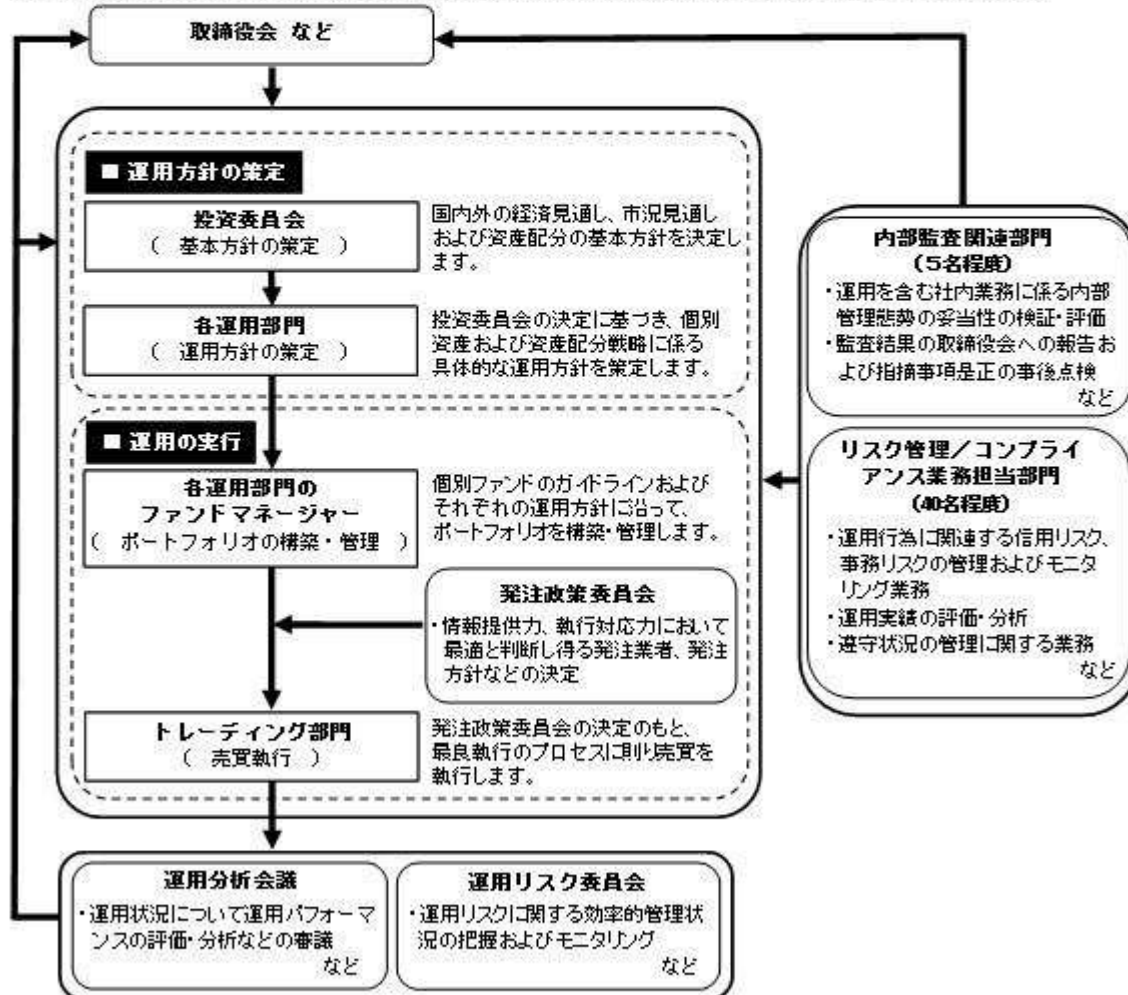
運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期的成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・投資成果をTOPIX（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、バール日本株式モデルに従い次のポートフォリオ管理を行いません。投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。 ・資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として買付の場合は時価比率の高い銘柄から順に、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	<p>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。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会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。

上記体制は平成25年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
 - 2) 分配対象額についての分配方針
利子・配当等収益を中心に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
 - 3) 留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
- 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。
 - 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。
 - 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。
- 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。
- 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。資金借入れ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。
- <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

<インデックスポートフォリオ>

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なう必要ががあります。

- ・ 投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・ 当ファンドは、主に株式を実質的な投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

- ・ 一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、

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

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

< T O P I X (東証株価指数) と基準価額の主な乖離要因 >

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

- ・ T O P I X (東証株価指数) の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。
- ・組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。
- ・先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きと T O P I X (東証株価指数) の採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

< バランスポートフォリオ >

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

- ・投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・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、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

流動性リスク

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

信用リスク

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

れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

- ・ 一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・ 格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

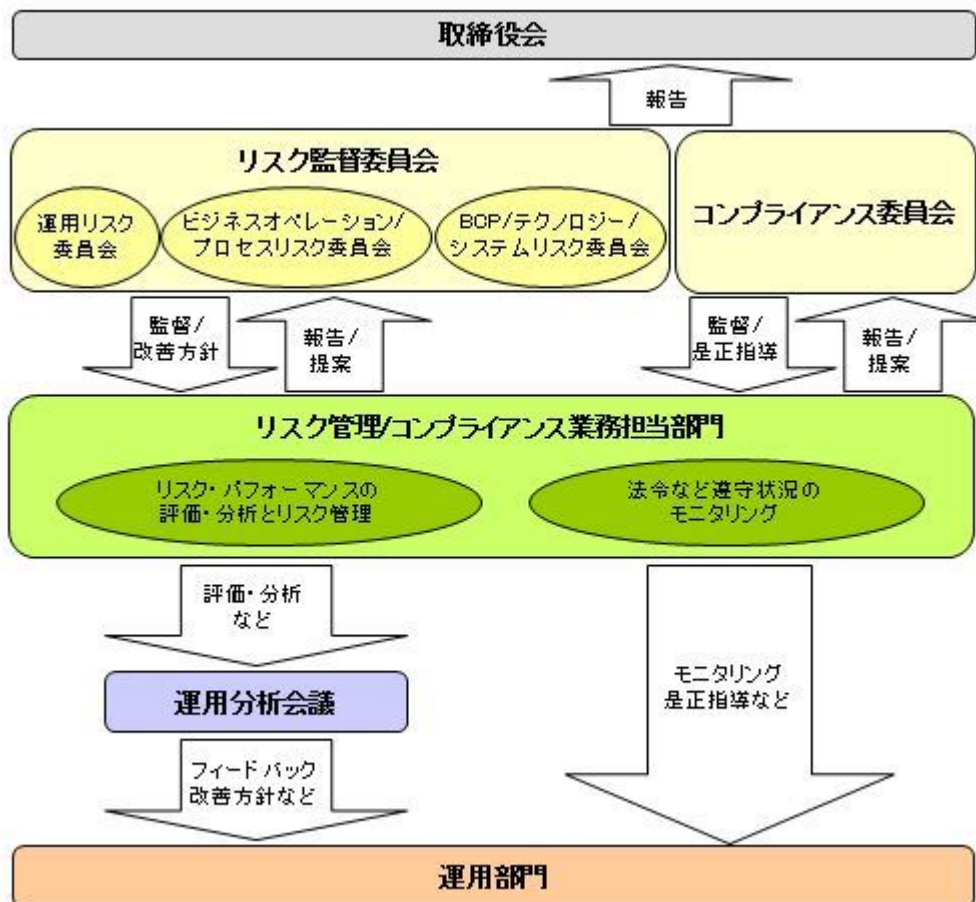
為替変動リスク

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有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。
- ・ 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している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・ 運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性やインデックスと基準価額が乖離する可能性があります。
- ・ 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



全社的なリスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況およびリスク管理状況については、リスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。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・分析とリスク管理

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いません。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については運用分析会議に報告し、リスク管理状況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、問題点の原因の究明や改善策策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成25年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【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。

*消費税率が8%になった場合は、1.6416%となります。

信託報酬の配分

信託報酬（有価証券届出書提出日現在）の配分は、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
1.52%	0.34%	1.10%	0.08%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益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。

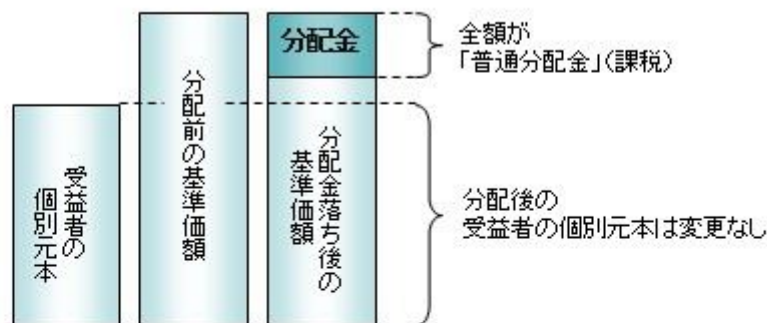
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

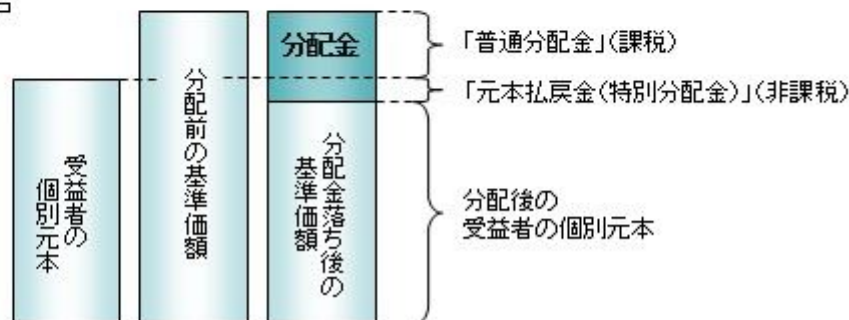
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 -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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

5【運用状況】

【インデックスポートフォリオ】

以下の運用状況は2013年11月29日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	12,511,458,872	100.02
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,858,533	0.02
合計(純資産総額)		12,508,600,339	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・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	10,994,252.085	1.0700	11,763,849,731	1.1380	12,511,458,872	100.02

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.02
合計	100.02

【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	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第17計算期間末 (2004年11月 8日)	15,068	15,085	0.4524	0.4529
第18計算期間末 (2005年11月 7日)	19,235	19,251	0.6130	0.6135
第19計算期間末 (2006年11月 7日)	18,844	18,858	0.6575	0.6580
第20計算期間末 (2007年11月 7日)	15,899	15,912	0.6318	0.6323
第21計算期間末 (2008年11月 7日)	9,110	9,123	0.3584	0.3589
第22計算期間末 (2009年11月 9日)	9,152	9,165	0.3557	0.3562
第23計算期間末 (2010年11月 8日)	8,949	8,962	0.3442	0.3447
第24計算期間末 (2011年11月 7日)	7,970	7,983	0.3088	0.3093
第25計算期間末 (2012年11月 7日)	7,945	7,958	0.3085	0.3090
第26計算期間末 (2013年11月 7日)	11,931	11,943	0.4906	0.4911
2012年11月末日	8,309		0.3231	
12月末日	9,104		0.3552	
2013年 1月末日	9,899		0.3881	
2月末日	10,223		0.4020	

3月末日	10,859		0.4297
4月末日	12,104		0.4832
5月末日	11,644		0.4706
6月末日	11,602		0.4696
7月末日	11,507		0.4680
8月末日	11,208		0.4568
9月末日	12,113		0.4961
10月末日	12,053		0.4954
11月末日	12,508		0.5208

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	0.0005
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	0.0005
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	0.0005
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	0.0005
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	0.0005
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.0005
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	0.0005
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0005
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	4.96
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	35.61
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	7.34
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	3.83
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	43.19
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.61
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	3.09
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	10.14
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.06
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	59.19

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	1,619,588,910	2,482,316,326
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	1,358,186,333	3,284,725,185
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	907,747,499	3,628,251,250
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	793,043,556	4,287,293,625
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	981,834,490	730,018,204
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	1,338,588,106	1,023,299,271
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	1,177,644,536	908,226,822
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	1,083,821,347	1,275,668,411
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	1,098,402,396	1,156,956,048
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	726,814,196	2,160,223,460

【バランスポートフォリオ】

以下の運用状況は2013年11月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	105,876,690	26.24
親投資信託受益証券	日本	202,537,194	50.20
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		95,033,025	23.56
合計（純資産総額）		403,446,909	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・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
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	177,976,445	1.0710	190,612,773	1.1380	202,537,194			50.20
日本	国債証券	第267回利付国債 （10年）	20,000,000	101.34	20,268,600	101.27	20,255,000	1.300	2014/12/20	5.02
日本	国債証券	第96回利付国債 （5年）	20,000,000	100.93	20,187,800	100.93	20,187,600	0.500	2016/3/20	5.00
日本	国債証券	第93回利付国債 （5年）	20,000,000	100.85	20,170,200	100.84	20,169,400	0.500	2015/12/20	5.00
日本	国債証券	第92回利付国債 （5年）	20,000,000	100.38	20,077,800	100.39	20,078,800	0.300	2015/9/20	4.98

日本	国債証券	第89回利付国債 (5年)	15,000,000	100.50	15,075,750	100.49	15,073,950	0.400	2015/6/20	3.74
日本	国債証券	第264回利付国債 (10年)	10,000,000	101.11	10,111,940	101.11	10,111,940	1.500	2014/9/20	2.51

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	26.24
親投資信託受益証券	50.20
合計	76.44

【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	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第17計算期間末 (2004年11月 8日)	701	701	0.7722	0.7727
第18計算期間末 (2005年11月 7日)	744	745	0.8973	0.8978
第19計算期間末 (2006年11月 7日)	725	725	0.9269	0.9274
第20計算期間末 (2007年11月 7日)	579	580	0.9053	0.9058
第21計算期間末 (2008年11月 7日)	443	443	0.6881	0.6886
第22計算期間末 (2009年11月 9日)	438	438	0.6884	0.6889
第23計算期間末 (2010年11月 8日)	424	424	0.6749	0.6754
第24計算期間末 (2011年11月 7日)	381	381	0.6403	0.6408
第25計算期間末 (2012年11月 7日)	366	366	0.6377	0.6382
第26計算期間末 (2013年11月 7日)	436	437	0.8067	0.8072
2012年11月末日	375		0.6526	
12月末日	391		0.6850	
2013年 1月末日	407		0.7167	
2月末日	413		0.7295	
3月末日	426		0.7545	
4月末日	440		0.8010	
5月末日	432		0.7912	
6月末日	430		0.7904	

7月末日	429		0.7891	
8月末日	425		0.7792	
9月末日	438		0.8118	
10月末日	439		0.8107	
11月末日	403		0.8306	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	0.0005
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	0.0005
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	0.0005
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	0.0005
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	0.0005
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.0005
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	0.0005
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0005
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	2.21
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	16.27
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	3.35
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	2.28
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	23.94
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.12
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	1.89
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	5.05
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.33
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	26.58

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
---	----	---------	---------

第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	43,737,134	94,670,811
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	36,080,277	114,073,407
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	28,971,601	76,263,650
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	26,280,695	168,533,817
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	26,940,763	23,007,376
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	29,474,951	37,415,222
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	26,059,079	33,889,327
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	24,624,836	57,559,266
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	21,493,518	42,290,225
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	14,701,201	47,759,106

(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2013年11月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	12,525,018,860	98.51
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		189,362,186	1.49
合計(純資産総額)		12,714,381,046	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	138,875,000	1.09

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	98,000	6,304.37	617,828,260	6,380.00	625,240,000	4.92
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	526,400	635.00	334,264,000	659.00	346,897,600	2.73
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	34,100	7,480.00	255,068,000	8,290.00	282,689,000	2.22
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	63,400	3,950.72	250,475,648	4,330.00	274,522,000	2.16
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	52,500	4,890.00	256,725,000	5,070.00	266,175,000	2.09

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	899,400	209.00	187,974,600	215.00	193,371,000	1.52
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	43,700	3,480.00	152,076,000	3,460.00	151,202,000	1.19
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	27,300	5,270.00	143,871,000	5,140.00	140,322,000	1.10
日本	株式	三菱地所	不動産業	49,000	2,927.00	143,423,000	2,844.00	139,356,000	1.10
日本	株式	キヤノン	電気機器	40,800	3,185.00	129,948,000	3,410.00	139,128,000	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	21,600	5,302.20	114,527,520	6,430.00	138,888,000	1.09
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	27,600	4,695.00	129,582,000	4,975.00	137,310,000	1.08
日本	株式	ファナック	電気機器	7,800	16,736.25	130,542,750	17,240.00	134,472,000	1.06
日本	株式	日立製作所	電気機器	169,000	620.00	104,780,000	755.00	127,595,000	1.00
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	142,100	754.00	107,143,400	811.00	115,243,100	0.91
日本	株式	三井不動産	不動産業	33,000	3,425.00	113,025,000	3,475.00	114,675,000	0.90
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	29,100	3,720.00	108,252,000	3,770.00	109,707,000	0.86
日本	株式	三菱商事	卸売業	54,200	2,000.00	108,400,000	2,015.00	109,213,000	0.86
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	12,900	8,650.00	111,585,000	8,390.00	108,231,000	0.85
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	312,000	340.00	106,080,000	332.00	103,584,000	0.81
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	17,000	5,260.23	89,423,910	6,070.00	103,190,000	0.81
日本	株式	パナソニック	電気機器	80,400	949.00	76,299,600	1,175.00	94,470,000	0.74
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	57,200	1,557.00	89,060,400	1,650.00	94,380,000	0.74
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	98,800	1,015.00	100,282,000	936.00	92,476,800	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	26,900	3,180.00	85,542,000	3,400.00	91,460,000	0.72
日本	株式	三井物産	卸売業	63,900	1,426.61	91,160,379	1,419.00	90,674,100	0.71
日本	株式	デンソー	輸送用機器	17,400	4,820.00	83,868,000	5,130.00	89,262,000	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	23,100	3,485.00	80,503,500	3,750.00	86,625,000	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	70,000	1,041.00	72,870,000	1,183.00	82,810,000	0.65
日本	株式	住友不動産	不動産業	17,000	4,905.00	83,385,000	4,855.00	82,535,000	0.65

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.07
		鉱業	0.43
		建設業	2.47
		食料品	3.79
		繊維製品	0.71
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.30
		医薬品	4.35
		石油・石炭製品	0.61
		ゴム製品	0.90
		ガラス・土石製品	1.00
		鉄鋼	1.73
		非鉄金属	1.03

	金属製品	0.68
	機械	5.17
	電気機器	11.67
	輸送用機器	11.96
	精密機器	1.37
	その他製品	1.38
	電気・ガス業	2.21
	陸運業	3.72
	海運業	0.38
	空運業	0.47
	倉庫・運輸関連業	0.23
	情報・通信業	7.06
	卸売業	4.41
	小売業	4.10
	銀行業	9.68
	証券、商品先物取引業	1.82
	保険業	2.31
	その他金融業	1.48
	不動産業	3.63
	サービス業	2.12
合 計		98.51

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資 比率 （%）
株価指数先物 取引	東京証券取引所	東証株価指数先物 2013年 12月	買建	11	日本円	133,486,671	138,875,000	1.09

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

参考情報

運用実績

2013年11月29日現在

「インデックスポートフォリオ」

基準価額・純資産の推移



基準価額.....5,208円

純資産総額.....125.08億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金込基準価額は、2003年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金込基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2009年11月	2010年11月	2011年11月	2012年11月	2013年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	130円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	98.54%
株式先物	1.09%
債券	—
債券先物	—
現金その他	1.46%

※当ファンドの実質組入比率です。

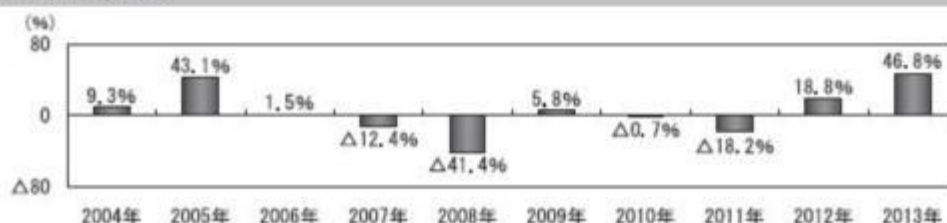
<組入上位10銘柄>

インデックス東証株式マザーファンド

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	4.92%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.73%
3 ソフトバンク	情報・通信業	2.22%
4 本田技研工業	輸送用機器	2.16%
5 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.09%
6 みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.52%
7 日本たばこ産業	食料品	1.19%
8 日本電信電話	情報・通信業	1.10%
9 三菱地所	不動産業	1.10%
10 キヤノン	電気機器	1.09%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



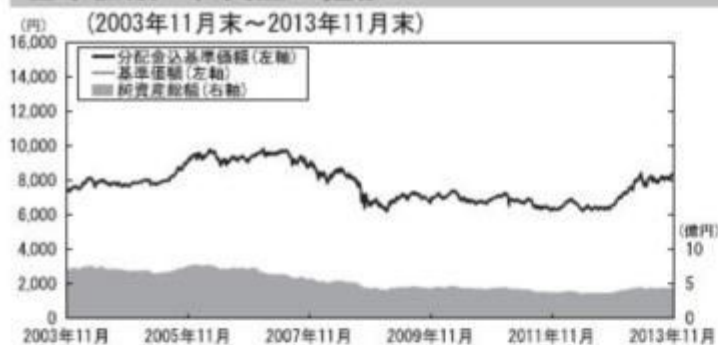
※ファンドの年間収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※2013年は、2013年11月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

「バランスポートフォリオ」

基準価額・純資産の推移



基準価額……………8,306 円

純資産総額……………4.03 億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。

※分配金込基準価額は、2003年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金込基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移（税引前、1万口当たり）

2009年11月	2010年11月	2011年11月	2012年11月	2013年11月	設定来累計
5 円	5 円	5 円	5 円	5 円	130 円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産	比率
株式	49.46%
株式先物	0.55%
債券	26.24%
債券先物	0.00%
現金その他	24.30%

※当ファンドの実質組入比率です。

＜組入上位銘柄＞

当ファンド

	銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1	インデックス東証株式マザーファンド	親投資信託受益証券	—	—	50.20%
2	第267回利付国債（10年）	国債証券	1.3%	2014年12月20日	5.02%
3	第96回利付国債（5年）	国債証券	0.5%	2016年3月20日	5.00%
4	第93回利付国債（5年）	国債証券	0.5%	2015年12月20日	5.00%
5	第92回利付国債（5年）	国債証券	0.3%	2015年9月20日	4.98%
6	第89回利付国債（5年）	国債証券	0.4%	2015年6月20日	3.74%

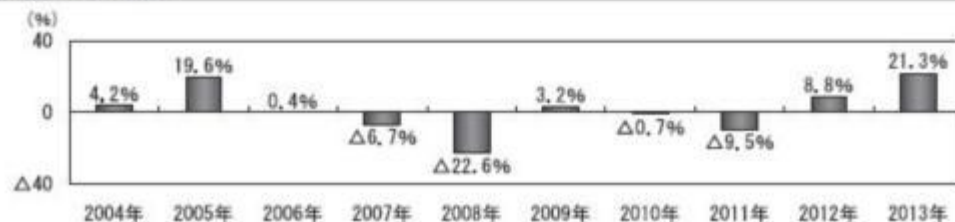
※当ファンドの対純資産総額比です。

インデックス東証株式マザーファンド

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	4.92%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.73%
3	ソフトバンク	情報・通信業	2.22%
4	本田技研工業	輸送用機器	2.16%
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2.09%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2013年は、2013年11月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

第2【管理及び運営】

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

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(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、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。

(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

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(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。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(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、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。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(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、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて買取りを中止すること、および既に受け付けた買取りを取り消すことができます。
- 買取請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとして取り扱います。

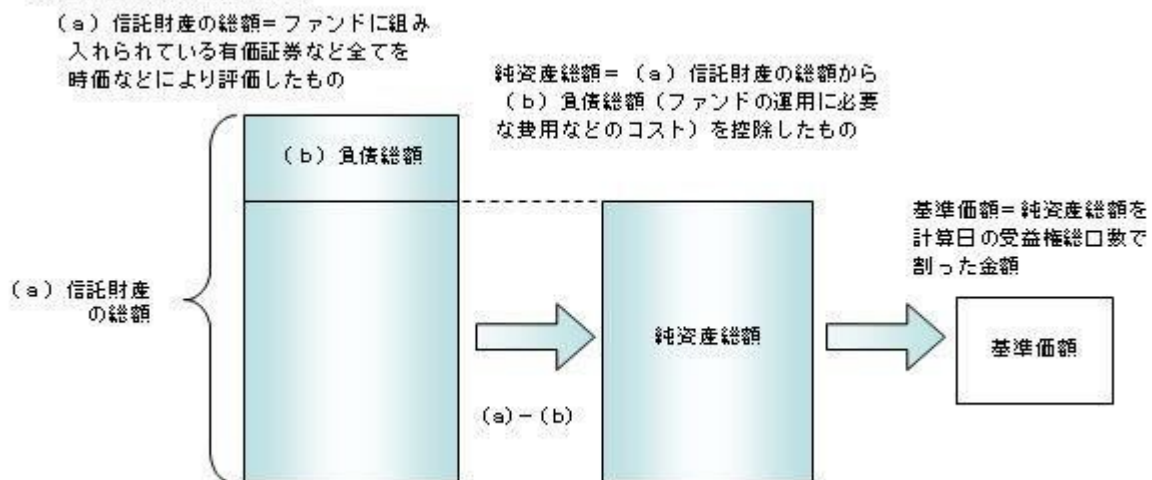
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

<主な資産の評価方法>

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

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（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。

<インデックスポートフォリオ>

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

<バランスポートフォリオ>

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) 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。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
- イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
 - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

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。

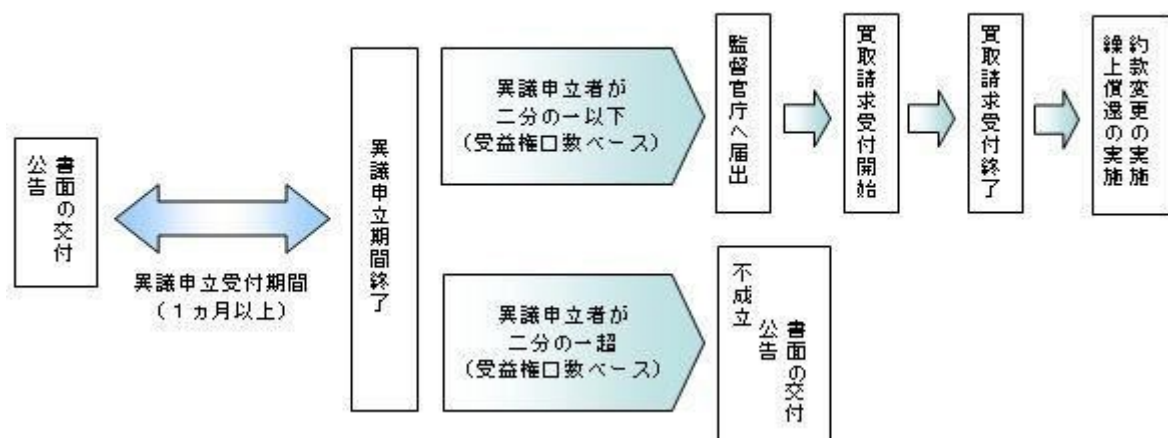
信託約款の変更

- 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ことができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



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。運用報告書は原則として知れている受益者に対して交付されます。

関係法人との契約について

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

延長されるものとし、以後も同様とします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

<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）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期計算期間（平成24年11月8日から平成25年11月7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25期 平成24年11月 7日現在	第26期 平成25年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	70,081,253	105,134,719
親投資信託受益証券	7,951,637,469	11,932,416,914
未収入金	2,395,918	4,298,869
未収利息	118	139
流動資産合計	8,024,114,758	12,041,850,641
資産合計	8,024,114,758	12,041,850,641
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	12,876,351	12,159,646
未払解約金	2,083,332	1,999,215
未払受託者報酬	3,330,326	5,035,881
未払委託者報酬	59,947,155	90,646,989
その他未払費用	203,922	308,389
流動負債合計	78,441,086	110,150,120
負債合計	78,441,086	110,150,120
純資産の部		
元本等		
元本	25,752,702,608	24,319,293,344
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,807,028,936	12,387,592,823
（分配準備積立金）	507,997,532	453,900,962
元本等合計	7,945,673,672	11,931,700,521
純資産合計	7,945,673,672	11,931,700,521
負債純資産合計	8,024,114,758	12,041,850,641

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第25期		第26期	
	自	平成23年11月 8日 至 平成24年11月 7日	自	平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日
営業収益				
受取利息		23,288		26,663
有価証券売買等損益		136,008,051		4,819,279,412
営業収益合計		136,031,339		4,819,306,075
営業費用				
受託者報酬		6,773,925		9,156,746
委託者報酬		121,933,019		164,823,678
その他費用		414,786		560,739
営業費用合計		129,121,730		174,541,163
営業利益又は営業損失（ ）		6,909,609		4,644,764,912
経常利益又は経常損失（ ）		6,909,609		4,644,764,912
当期純利益又は当期純損失（ ）		6,909,609		4,644,764,912
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		4,800,071		282,761,013
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		17,840,419,471		17,807,028,936
剰余金増加額又は欠損金減少額		799,614,381		1,491,276,602
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		799,614,381		1,491,276,602
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		755,457,033		421,684,742
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		755,457,033		421,684,742
分配金		12,876,351		12,159,646
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		17,807,028,936		12,387,592,823

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

有価証券の評価基準及び評価方法	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。
-----------------	--

（ 貸借対照表に関する注記 ）

	第25期 平成24年11月 7日現在	第26期 平成25年11月 7日現在
1. 期首元本額	25,811,256,260円	25,752,702,608円
期中追加設定元本額	1,098,402,396円	726,814,196円
期中一部解約元本額	1,156,956,048円	2,160,223,460円
2. 受益権の総数	25,752,702,608口	24,319,293,344口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	17,807,028,936円	12,387,592,823円

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

	第25期 自 平成23年11月 8日 至 平成24年11月 7日	第26期 自 平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日
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 26,494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	3,000,411,669円	C 信託約款に定める収益調整金 2,847,093,064円
D 信託約款に定める分配準備積立金	520,873,883円	D 信託約款に定める分配準備積立金 466,034,114円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	3,521,285,552円	E 分配対象収益（A+B+C+D） 3,313,153,672円
F 分配対象収益(1万口当たり)	1,367円	F 分配対象収益(1万口当たり) 1,362円
G 分配金額	12,876,351円	G 分配金額 12,159,646円
H 分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり) 5円

（ 金融商品に関する注記 ）

金融商品の状況に関する事項

	第25期 自 平成23年11月 8日 至 平成24年11月 7日	第26期 自 平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	第25期 平成24年11月 7日現在	第26期 平成25年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第25期（平成24年11月 7日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	264,253,812
合計	264,253,812

第26期（平成25年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	4,579,106,770
合計	4,579,106,770

（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25期 平成24年11月 7日現在		第26期 平成25年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.3085円	1口当たり純資産額	0.4906円
(1万口当たり純資産額)	(3,085円)	(1万口当たり純資産額)	(4,906円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	11,141,379,005	11,932,416,914	
合計		11,141,379,005	11,932,416,914	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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25期 平成24年11月 7日現在	第26期 平成25年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	87,832,382	118,430,659
国債証券	96,128,436	105,900,406
親投資信託受益証券	185,525,077	216,248,411
未収利息	254,569	201,672
前払費用	15,780	-
流動資産合計	369,756,244	440,781,148
資産合計	369,756,244	440,781,148
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	287,393	270,864
未払受託者報酬	154,398	184,844
未払委託者報酬	2,780,289	3,328,337
その他未払費用	9,395	11,259
流動負債合計	3,231,475	3,795,304
負債合計	3,231,475	3,795,304
純資産の部		
元本等		
元本	574,786,183	541,728,278
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	208,261,414	104,742,434
（分配準備積立金）	11,272,934	10,919,076
元本等合計	366,524,769	436,985,844
純資産合計	366,524,769	436,985,844
負債純資産合計	369,756,244	440,781,148

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第25期		第26期	
	自	平成23年11月 8日 至 平成24年11月 7日	自	平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日
営業収益				
受取利息		1,193,731		930,638
有価証券売買等損益		3,759,209		101,921,904
営業収益合計		4,952,940		102,852,542
営業費用				
受託者報酬		313,922		353,860
委託者報酬		5,652,764		6,371,728
その他費用		19,109		21,552
営業費用合計		5,985,795		6,747,140
営業利益又は営業損失（ ）		1,032,855		96,105,402
経常利益又は経常損失（ ）		1,032,855		96,105,402
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,032,855		96,105,402
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		263,253		5,864,720
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		214,221,568		208,261,414
剰余金増加額又は欠損金減少額		15,210,286		17,263,791
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		15,210,286		17,263,791
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		7,666,631		3,714,629
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		7,666,631		3,714,629
分配金		287,393		270,864
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		208,261,414		104,742,434

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<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 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>
-----------------	--

（貸借対照表に関する注記）

		第25期 平成24年11月 7日現在	第26期 平成25年11月 7日現在
1.	期首元本額	595,582,890円	574,786,183円
	期中追加設定元本額	21,493,518円	14,701,201円
	期中一部解約元本額	42,290,225円	47,759,106円
2.	受益権の総数	574,786,183口	541,728,278口
3.	元本の欠損		
	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	208,261,414円	104,742,434円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第25期 自 平成23年11月 8日 至 平成24年11月 7日		第26期 自 平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7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 841,894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	78,543,082円	C 信託約款に定める収益調整金 74,310,483円
D	信託約款に定める分配準備積立金	11,560,327円	D 信託約款に定める分配準備積立金 10,348,046円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	90,103,409円	E 分配対象収益（A+B+C+D） 85,500,423円

F 分配対象収益(1万口当たり)	1,567円	F 分配対象収益(1万口当たり)	1,578円
G 分配金額	287,393円	G 分配金額	270,864円
H 分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)	5円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第25期 自 平成23年11月 8日 至 平成24年11月 7日	第26期 自 平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第25期 平成24年11月 7日現在	第26期 平成25年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
-------------------------	---	----

（有価証券に関する注記）

第25期（平成24年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	533,664
親投資信託受益証券	3,107,396
合計	2,573,732

第26期（平成25年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	561,294
親投資信託受益証券	77,534,443
合計	76,973,149

（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25期 平成24年11月 7日現在		第26期 平成25年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.6377円	1口当たり純資産額	0.8067円
(1万口当たり純資産額)	(6,377円)	(1万口当たり純資産額)	(8,067円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第89回利付国債(5年)	15,000,000	15,075,750	
	第92回利付国債(5年)	20,000,000	20,077,800	
	第93回利付国債(5年)	20,000,000	20,170,200	
	第96回利付国債(5年)	20,000,000	20,187,800	
	第264回利付国債(10年)	10,000,000	10,120,256	
	第267回利付国債(10年)	20,000,000	20,268,600	
国債証券 合計		105,000,000	105,900,406	
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	201,912,616	216,248,411	
親投資信託受益証券 合計		201,912,616	216,248,411	
合計		306,912,616	322,148,817	

(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。

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」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。ただし、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(参考)

インデックス東証株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成24年11月 7日現在	平成25年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	999,225	434,746
コール・ローン	179,586,289	133,338,114
株式	7,882,174,640	11,933,040,118
派生商品評価勘定	3,291,292	344,189
未収入金	410,688	-
未収配当金	80,836,941	90,238,656
未収利息	304	176
前払金	-	1,530,000
流動資産合計	8,147,299,379	12,158,925,999
資産合計	8,147,299,379	12,158,925,999
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	215,039	3,364,930
前受金	4,315,000	-
未払金	-	2,974
未払解約金	2,395,918	4,298,869
流動負債合計	6,925,957	7,666,773
負債合計	6,925,957	7,666,773
純資産の部		
元本等		
元本	12,291,786,325	11,343,291,621
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,151,412,903	807,967,605
元本等合計	8,140,373,422	12,151,259,226
純資産合計	8,140,373,422	12,151,259,226
負債純資産合計	8,147,299,379	12,158,925,999

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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）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</p>
--------------------	--

	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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年11月 7日現在	平成25年11月 7日現在
1. 期首	平成23年11月 8日	平成24年11月 8日
期首元本額	12,551,054,432円	12,291,786,325円
期首からの追加設定元本額	285,013,172円	140,905,972円
期首からの一部解約元本額	544,281,279円	1,089,400,676円
元本の内訳		
インデックスポートフォリオ	12,011,536,963円	11,141,379,005円
バランスポートフォリオ	280,249,362円	201,912,616円
計	12,291,786,325円	11,343,291,621円
2. 受益権の総数	12,291,786,325口	11,343,291,621口
3. 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	4,151,412,903円	- 円
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とおりであります。		
株式	97,200,000円	188,100,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成23年11月 8日 至 平成24年11月 7日	自 平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
----------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年11月 7日現在	平成25年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成24年11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	82,655,165
合計	82,655,165

(平成25年11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	277,586,542
合計	277,586,542

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成24年11月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	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	219,905,000	-	223,050,000	3,145,000
合計		219,905,000	-	223,050,000	3,145,000

(平成25年11月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	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	180,785,000	-	177,825,000	2,960,000
合計		180,785,000	-	177,825,000	2,960,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成24年11月 7日現在		平成25年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.662円	1口当たり純資産額	1.071円
(1000口当たり純資産額)	(662円)	(1000口当たり純資産額)	(1,071円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,000	265.00	795,000	
日本水産	9,800	209.00	2,048,200	
マルハニチロホールディングス	15,000	180.00	2,700,000	
サカタのタネ	1,200	1,329.00	1,594,800	
ホクト	900	1,892.00	1,702,800	
住石ホールディングス	2,700	140.00	378,000	
日鉄鉱業	2,000	507.00	1,014,000	
三井松島産業	5,000	152.00	760,000	
国際石油開発帝石	38,900	1,153.00	44,851,700	
日本海洋掘削	200	6,750.00	1,350,000	
関東天然瓦斯開発	1,000	701.00	701,000	
石油資源開発	1,100	4,020.00	4,422,000	
ショーボンドホールディングス	700	4,520.00	3,164,000	
ミライト・ホールディングス	2,300	865.00	1,989,500	
タマホーム	400	1,053.00	421,200	
安藤・間	5,200	360.00	1,872,000	
東急建設	2,900	548.00	1,589,200	
コムシスホールディングス	3,900	1,346.00	5,249,400	
ミサワホーム	800	1,704.00	1,363,200	
高松コンストラクショングループ	600	1,814.00	1,088,400	
東建コーポレーション	300	5,290.00	1,587,000	
ヤマウラ	500	287.00	143,500	
大成建設	40,000	492.00	19,680,000	
大林組	24,000	612.00	14,688,000	

清水建設	24,000	492.00	11,808,000	
長谷工コーポレーション	10,500	724.00	7,602,000	
松井建設	1,000	415.00	415,000	
銭高組	1,000	272.00	272,000	
鹿島建設	35,000	413.00	14,455,000	
不動テトラ	5,800	198.00	1,148,400	
大末建設	4,000	141.00	564,000	
鉄建建設	5,000	322.00	1,610,000	
日鉄住金テックスエンジ	1,000	401.00	401,000	
西松建設	10,000	341.00	3,410,000	
三井住友建設	21,300	127.00	2,705,100	
大豊建設	2,000	385.00	770,000	
前田建設工業	5,000	698.00	3,490,000	
ナカノフドー建設	500	245.00	122,500	
奥村組	7,000	434.00	3,038,000	
大和小田急建設	500	273.00	136,500	
東鉄工業	1,000	2,211.00	2,211,000	
イチケン	1,000	184.00	184,000	
浅沼組	2,000	186.00	372,000	
戸田建設	9,000	350.00	3,150,000	
熊谷組	6,000	293.00	1,758,000	
青木あすなる建設	500	567.00	283,500	
北野建設	2,000	225.00	450,000	
植木組	1,000	211.00	211,000	
三井ホーム	1,000	485.00	485,000	
矢作建設工業	1,200	761.00	913,200	
ピーエス三菱	600	507.00	304,200	
大東建託	3,000	9,880.00	29,640,000	
新日本建設	1,000	324.00	324,000	
N I P P O	2,000	1,766.00	3,532,000	
東亜道路工業	2,000	559.00	1,118,000	
前田道路	2,000	1,645.00	3,290,000	
日本道路	2,000	587.00	1,174,000	
東亜建設工業	7,000	235.00	1,645,000	
若築建設	4,000	139.00	556,000	

東洋建設	2,600	366.00	951,600	
五洋建設	9,500	298.00	2,831,000	
大林道路	1,000	582.00	582,000	
世紀東急工業	4,000	141.00	564,000	
福田組	1,000	401.00	401,000	
住友林業	5,500	1,124.00	6,182,000	
日本基礎技術	1,100	409.00	449,900	
日成ビルド工業	2,000	220.00	440,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	4,000	140.00	560,000	
巴コーポレーション	1,100	512.00	563,200	
パナホーム	3,000	664.00	1,992,000	
大和ハウス工業	22,000	1,891.00	41,602,000	
ライト工業	1,700	782.00	1,329,400	
積水ハウス	21,000	1,356.00	28,476,000	
日特建設	500	428.00	214,000	
ユアテック	1,000	315.00	315,000	
西部電気工業	1,000	444.00	444,000	
四電工	1,000	349.00	349,000	
中電工	1,200	1,508.00	1,809,600	
関電工	4,000	600.00	2,400,000	
きんでん	5,000	1,050.00	5,250,000	
東京エネシス	1,000	511.00	511,000	
トーエネック	1,000	609.00	609,000	
住友電設	600	1,411.00	846,600	
日本電設工業	1,000	1,269.00	1,269,000	
協和エクシオ	3,100	1,128.00	3,496,800	
新日本空調	600	607.00	364,200	
N D S	1,000	283.00	283,000	
九電工	1,000	590.00	590,000	
三機工業	2,000	583.00	1,166,000	
日揮	8,000	3,700.00	29,600,000	
中外炉工業	2,000	251.00	502,000	
ヤマト	1,000	347.00	347,000	
太平電業	1,000	689.00	689,000	
高砂熱学工業	2,300	792.00	1,821,600	

三晃金属工業	1,000	276.00	276,000	
朝日工業社	1,000	349.00	349,000	
明星工業	1,000	409.00	409,000	
大気社	1,100	2,149.00	2,363,900	
ダイダン	1,000	538.00	538,000	
日比谷総合設備	1,000	1,127.00	1,127,000	
東芝プラントシステム	1,000	1,577.00	1,577,000	
東洋エンジニアリング	4,000	400.00	1,600,000	
千代田化工建設	6,000	1,213.00	7,278,000	
新興プランテック	1,600	778.00	1,244,800	
日本製粉	5,000	470.00	2,350,000	
日清製粉グループ本社	8,000	1,030.00	8,240,000	
日東富士製粉	1,000	302.00	302,000	
昭和産業	3,000	300.00	900,000	
鳥越製粉	600	660.00	396,000	
協同飼料	3,000	109.00	327,000	
中部飼料	700	557.00	389,900	
日本配合飼料	3,000	122.00	366,000	
東洋精糖	2,000	103.00	206,000	
日本甜菜製糖	4,000	181.00	724,000	
三井製糖	3,000	336.00	1,008,000	
森永製菓	8,000	206.00	1,648,000	
中村屋	2,000	398.00	796,000	
江崎グリコ	3,000	1,041.00	3,123,000	
名糖産業	400	1,013.00	405,200	
不二家	4,000	191.00	764,000	
山崎製パン	6,000	1,003.00	6,018,000	
第一屋製パン	1,000	152.00	152,000	
モロゾフ	1,000	310.00	310,000	
亀田製菓	400	2,833.00	1,133,200	
カルビー	2,900	2,561.00	7,426,900	
森永乳業	7,000	299.00	2,093,000	
六甲バター	200	818.00	163,600	
ヤクルト本社	4,700	4,940.00	23,218,000	
明治ホールディングス	2,400	5,420.00	13,008,000	

雪印メグミルク	1,700	1,324.00	2,250,800
プリマハム	4,000	209.00	836,000
日本ハム	6,000	1,482.00	8,892,000
伊藤ハム	4,000	413.00	1,652,000
林兼産業	3,000	90.00	270,000
丸大食品	4,000	305.00	1,220,000
米久	300	778.00	233,400
S Foods	500	988.00	494,000
サッポロホールディングス	13,000	432.00	5,616,000
アサヒグループホールディングス	16,100	2,726.00	43,888,600
キリンホールディングス	34,000	1,448.00	49,232,000
宝ホールディングス	6,000	924.00	5,544,000
オエノンホールディングス	2,000	250.00	500,000
養命酒製造	1,000	805.00	805,000
コカ・コーラウエスト	2,500	2,213.00	5,532,500
コカ・コーライーストジャパン	1,600	1,726.00	2,761,600
サントリー食品インターナショナル	4,100	3,245.00	13,304,500
ダイトードリンコ	400	4,200.00	1,680,000
伊藤園	2,200	2,183.00	4,802,600
キーコーヒー	700	1,527.00	1,068,900
ユニカフェ	200	546.00	109,200
ジャパンフーズ	100	1,227.00	122,700
日清オイリオグループ	3,000	321.00	963,000
不二製油	1,900	1,673.00	3,178,700
かどや製油	100	2,677.00	267,700
J - オイルミルズ	3,000	286.00	858,000
キッコーマン	7,000	1,830.00	12,810,000
味の素	19,000	1,374.00	26,106,000
キューピー	4,100	1,461.00	5,990,100
ハウス食品グループ本社	2,800	1,549.00	4,337,200
カゴメ	3,100	1,673.00	5,186,300
焼津水産化学工業	400	856.00	342,400
アリアケジャパン	700	2,337.00	1,635,900
ニチレイ	9,000	503.00	4,527,000
東洋水産	4,000	2,960.00	11,840,000

日清食品ホールディングス	3,100	4,085.00	12,663,500	
永谷園	1,000	884.00	884,000	
フジッコ	1,000	1,201.00	1,201,000	
ロック・フィールド	400	1,871.00	748,400	
日本たばこ産業	44,300	3,480.00	154,164,000	
ケンコーマヨネーズ	200	890.00	178,000	
わらべや日洋	500	1,804.00	902,000	
なとり	400	970.00	388,000	
ミヨシ油脂	2,000	157.00	314,000	
片倉工業	800	1,128.00	902,400	
ゲンゼ	6,000	262.00	1,572,000	
東洋紡	32,000	185.00	5,920,000	
ユニチカ	22,000	61.00	1,342,000	
富士紡ホールディングス	4,000	197.00	788,000	
日清紡ホールディングス	5,000	794.00	3,970,000	
倉敷紡績	8,000	169.00	1,352,000	
シキボウ	4,000	133.00	532,000	
日本毛織	2,000	768.00	1,536,000	
大東紡織	2,000	81.00	162,000	
トーア紡コーポレーション	4,000	81.00	324,000	
ガイドーリミテッド	900	639.00	575,100	
帝国繊維	1,000	873.00	873,000	
帝人	30,000	211.00	6,330,000	
東レ	54,000	647.00	34,938,000	
サカイオーベックス	3,000	155.00	465,000	
住江織物	2,000	287.00	574,000	
日本フェルト	500	440.00	220,000	
イチカワ	1,000	289.00	289,000	
日本バイリーン	1,000	556.00	556,000	
日東製網	1,000	127.00	127,000	
芦森工業	2,000	131.00	262,000	
アツギ	7,000	115.00	805,000	
ダイニック	2,000	172.00	344,000	
セーレン	2,000	639.00	1,278,000	
東海染工	1,000	124.00	124,000	

小松精練	1,000	478.00	478,000	
ワコールホールディングス	4,000	1,087.00	4,348,000	
ホギメディカル	500	5,450.00	2,725,000	
レナウン	1,500	130.00	195,000	
T S Iホールディングス	3,600	667.00	2,401,200	
三陽商会	4,000	272.00	1,088,000	
ナイガイ	3,000	86.00	258,000	
オンワードホールディングス	5,000	785.00	3,925,000	
ルック	1,000	291.00	291,000	
キムラタン	17,000	15.00	255,000	
ゴールドウイン	2,000	441.00	882,000	
デサント	2,000	701.00	1,402,000	
キング	300	410.00	123,000	
特種東海製紙	4,000	201.00	804,000	
王子ホールディングス	33,000	438.00	14,454,000	
日本製紙	3,800	1,699.00	6,456,200	
三菱製紙	10,000	87.00	870,000	
北越紀州製紙	5,000	436.00	2,180,000	
中越パルプ工業	3,000	155.00	465,000	
巴川製紙所	1,000	180.00	180,000	
大王製紙	3,000	769.00	2,307,000	
レンゴー	6,000	490.00	2,940,000	
トーモク	2,000	319.00	638,000	
ザ・パック	500	1,893.00	946,500	
クラレ	12,000	1,158.00	13,896,000	
旭化成	47,000	750.00	35,250,000	
共和レザー	500	469.00	234,500	
コープケミカル	1,000	142.00	142,000	
昭和電工	50,000	136.00	6,800,000	
住友化学	55,000	364.00	20,020,000	
日本化成	2,000	140.00	280,000	
住友精化	2,000	656.00	1,312,000	
日産化学工業	5,100	1,527.00	7,787,700	
ラサ工業	3,000	207.00	621,000	
クレハ	5,000	381.00	1,905,000	

テイカ	1,000	291.00	291,000	
石原産業	13,000	93.00	1,209,000	
片倉チッカリン	1,000	270.00	270,000	
日本曹達	5,000	604.00	3,020,000	
東ソー	20,000	406.00	8,120,000	
トクヤマ	12,000	387.00	4,644,000	
セントラル硝子	7,000	330.00	2,310,000	
東亜合成	9,000	439.00	3,951,000	
ダイソー	3,000	292.00	876,000	
関東電化工業	2,000	203.00	406,000	
電気化学工業	15,000	408.00	6,120,000	
信越化学工業	13,400	5,610.00	75,174,000	
日本カーバイド工業	2,000	313.00	626,000	
堺化学工業	3,000	325.00	975,000	
エア・ウォーター	6,000	1,362.00	8,172,000	
大陽日酸	10,000	637.00	6,370,000	
日本化学工業	3,000	167.00	501,000	
日本パーカライズン	2,000	2,006.00	4,012,000	
高圧ガス工業	1,000	544.00	544,000	
四国化成工業	1,000	740.00	740,000	
戸田工業	1,000	294.00	294,000	
ステラ ケミファ	400	1,762.00	704,800	
保土谷化学工業	2,000	196.00	392,000	
日本触媒	6,000	1,220.00	7,320,000	
大日精化工業	3,000	409.00	1,227,000	
カネカ	9,000	609.00	5,481,000	
三菱瓦斯化学	12,000	781.00	9,372,000	
三井化学	34,000	228.00	7,752,000	
J S R	6,900	1,839.00	12,689,100	
東京応化工業	1,400	2,061.00	2,885,400	
大阪有機化学工業	500	441.00	220,500	
三菱ケミカルホールディングス	46,500	445.00	20,692,500	
日本合成化学工業	2,000	931.00	1,862,000	
ダイセル	10,000	790.00	7,900,000	
住友ベークライト	6,000	349.00	2,094,000	

積水化学工業	15,000	1,081.00	16,215,000	
日本ゼオン	6,000	1,187.00	7,122,000	
アイカ工業	2,100	2,053.00	4,311,300	
宇部興産	38,000	195.00	7,410,000	
積水樹脂	1,000	1,403.00	1,403,000	
タキロン	2,000	411.00	822,000	
旭有機材工業	3,000	217.00	651,000	
日立化成	3,200	1,488.00	4,761,600	
ニチバン	1,000	380.00	380,000	
リケンテクノス	1,000	446.00	446,000	
大倉工業	2,000	336.00	672,000	
積水化成成品工業	2,000	269.00	538,000	
群栄化学工業	2,000	464.00	928,000	
タイガースポリマー	400	441.00	176,400	
ミライアル	200	1,556.00	311,200	
日本化薬	5,000	1,355.00	6,775,000	
カーリットホールディングス	600	489.00	293,400	
日本精化	600	651.00	390,600	
A D E K A	3,200	1,121.00	3,587,200	
日油	6,000	709.00	4,254,000	
新日本理化	600	285.00	171,000	
ハリマ化成グループ	700	464.00	324,800	
花王	19,400	3,195.00	61,983,000	
第一工業製薬	1,000	242.00	242,000	
三洋化成工業	2,000	643.00	1,286,000	
大日本塗料	4,000	166.00	664,000	
日本ペイント	6,000	1,700.00	10,200,000	
関西ペイント	9,000	1,306.00	11,754,000	
中国塗料	2,000	561.00	1,122,000	
日本特殊塗料	600	548.00	328,800	
藤倉化成	1,000	540.00	540,000	
太陽ホールディングス	600	2,900.00	1,740,000	
D I C	26,000	284.00	7,384,000	
サカタインクス	1,000	929.00	929,000	
東洋インキ S C ホールディングス	7,000	496.00	3,472,000	

T & K T O K A	300	2,017.00	605,100	
富士フィルムホールディングス	17,100	2,431.00	41,570,100	
資生堂	13,300	1,678.00	22,317,400	
ライオン	9,000	595.00	5,355,000	
高砂香料工業	3,000	580.00	1,740,000	
マンダム	700	3,290.00	2,303,000	
ミルボン	400	4,000.00	1,600,000	
ファンケル	1,700	1,151.00	1,956,700	
コーセー	1,200	3,045.00	3,654,000	
ドクターシーラボ	5	327,000.00	1,635,000	
シーボン	100	1,999.00	199,900	
ポーラ・オルビスホールディングス	800	3,395.00	2,716,000	
ノエビアホールディングス	500	1,598.00	799,000	
エステー	500	1,003.00	501,500	
コニシ	500	1,951.00	975,500	
長谷川香料	1,000	1,390.00	1,390,000	
星光P M C	300	480.00	144,000	
小林製薬	1,200	5,370.00	6,444,000	
荒川化学工業	700	921.00	644,700	
メック	600	475.00	285,000	
日本高純度化学	2	215,800.00	431,600	
新田ゼラチン	500	1,041.00	520,500	
アース製薬	500	3,620.00	1,810,000	
イハラケミカル工業	1,000	727.00	727,000	
北興化学工業	1,000	295.00	295,000	
大成ラミック	200	2,508.00	501,600	
クミアイ化学工業	2,000	699.00	1,398,000	
日本農薬	2,000	1,180.00	2,360,000	
アキレス	6,000	158.00	948,000	
有沢製作所	1,300	543.00	705,900	
日東電工	6,200	5,110.00	31,682,000	
レック	200	1,219.00	243,800	
きもと	500	936.00	468,000	
藤森工業	600	2,872.00	1,723,200	
前澤化成工業	600	1,025.00	615,000	

J S P	500	1,520.00	760,000	
エフピコ	400	7,450.00	2,980,000	
天馬	600	1,269.00	761,400	
信越ポリマー	1,500	357.00	535,500	
東リ	2,000	207.00	414,000	
ニフコ	1,700	2,580.00	4,386,000	
日本バルカー工業	3,000	274.00	822,000	
ユニ・チャーム	4,600	5,970.00	27,462,000	
協和発酵キリン	9,000	1,060.00	9,540,000	
武田薬品工業	28,000	4,705.00	131,740,000	
アステラス製薬	17,200	5,620.00	96,664,000	
大日本住友製薬	5,300	1,344.00	7,123,200	
塩野義製薬	11,700	2,185.00	25,564,500	
田辺三菱製薬	6,200	1,369.00	8,487,800	
わかもと製薬	1,000	263.00	263,000	
あすか製薬	1,000	692.00	692,000	
日本新薬	2,000	1,654.00	3,308,000	
バイオフェルミン製薬	100	2,421.00	242,100	
中外製薬	7,500	2,246.00	16,845,000	
科研製薬	3,000	1,549.00	4,647,000	
エーザイ	9,200	3,915.00	36,018,000	
ロート製薬	3,000	1,460.00	4,380,000	
小野薬品工業	3,400	7,770.00	26,418,000	
久光製薬	2,300	5,220.00	12,006,000	
有機合成薬品工業	1,000	268.00	268,000	
持田製薬	500	6,190.00	3,095,000	
参天製薬	2,800	4,740.00	13,272,000	
扶桑薬品工業	3,000	316.00	948,000	
日本ケミファ	1,000	455.00	455,000	
ツムラ	2,200	3,010.00	6,622,000	
日医工	1,100	2,240.00	2,464,000	
キッセイ薬品工業	1,400	2,213.00	3,098,200	
生化学工業	1,600	1,283.00	2,052,800	
栄研化学	600	1,944.00	1,166,400	
鳥居薬品	500	2,565.00	1,282,500	

東和薬品	400	4,705.00	1,882,000	
富士製薬工業	200	1,717.00	343,400	
沢井製薬	1,100	6,970.00	7,667,000	
ゼリア新薬工業	1,200	2,280.00	2,736,000	
第一三共	23,500	1,872.00	43,992,000	
キョーリン製薬ホールディングス	2,000	2,009.00	4,018,000	
大幸薬品	400	1,642.00	656,800	
ダイト	200	1,391.00	278,200	
大塚ホールディングス	14,800	2,731.00	40,418,800	
大正製薬ホールディングス	1,800	7,050.00	12,690,000	
日本コークス工業	6,500	120.00	780,000	
昭和シェル石油	6,700	1,030.00	6,901,000	
コスモ石油	21,000	172.00	3,612,000	
ニチレキ	1,000	1,121.00	1,121,000	
東燃ゼネラル石油	11,000	925.00	10,175,000	
ユシロ化学工業	400	906.00	362,400	
ピーピー・カストロール	400	466.00	186,400	
富士石油	1,900	349.00	663,100	
MORESCO	100	1,610.00	161,000	
出光興産	900	8,580.00	7,722,000	
JXホールディングス	82,900	508.00	42,113,200	
横浜ゴム	8,000	946.00	7,568,000	
東洋ゴム工業	6,000	577.00	3,462,000	
ブリヂストン	23,400	3,365.00	78,741,000	
住友ゴム工業	5,800	1,330.00	7,714,000	
藤倉ゴム工業	500	429.00	214,500	
オカモト	3,000	318.00	954,000	
フコク	400	853.00	341,200	
ニッタ	800	2,124.00	1,699,200	
東海ゴム工業	1,400	892.00	1,248,800	
三ツ星ベルト	2,000	510.00	1,020,000	
バンドー化学	3,000	387.00	1,161,000	
日東紡績	5,000	459.00	2,295,000	
旭硝子	37,000	601.00	22,237,000	
日本板硝子	36,000	124.00	4,464,000	

石塚硝子	1,000	383.00	383,000	
日本山村硝子	3,000	177.00	531,000	
日本電気硝子	16,000	512.00	8,192,000	
オハラ	300	601.00	180,300	
住友大阪セメント	14,000	394.00	5,516,000	
太平洋セメント	44,000	415.00	18,260,000	
デイ・シイ	800	720.00	576,000	
日本ヒューム	1,000	874.00	874,000	
日本コンクリート工業	1,000	563.00	563,000	
三谷セキサン	400	1,450.00	580,000	
ジャパンパイル	600	1,000.00	600,000	
東海カーボン	7,000	322.00	2,254,000	
日本カーボン	4,000	187.00	748,000	
東洋炭素	400	1,778.00	711,200	
ノリタケカンパニーリミテド	4,000	262.00	1,048,000	
TOTO	11,000	1,391.00	15,301,000	
日本碍子	9,000	1,633.00	14,697,000	
日本特殊陶業	6,000	2,258.00	13,548,000	
ダントーホールディングス	2,000	118.00	236,000	
MARUWA	200	3,585.00	717,000	
品川リフラクトリーズ	2,000	208.00	416,000	
黒崎播磨	2,000	233.00	466,000	
イソライト工業	200	187.00	37,400	
東京窯業	1,000	236.00	236,000	
ニッカトー	300	420.00	126,000	
フジインコーポレーテッド	700	1,300.00	910,000	
エーアンドエーマテリアル	2,000	145.00	290,000	
ニチアス	4,000	656.00	2,624,000	
ニチハ	900	1,378.00	1,240,200	
新日鐵住金	316,000	317.00	100,172,000	
神戸製鋼所	103,000	168.00	17,304,000	
合同製鐵	4,000	178.00	712,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	19,100	2,200.00	42,020,000	
日新製鋼ホールディングス	3,200	1,312.00	4,198,400	
東京製鐵	4,100	511.00	2,095,100	

共英製鋼	700	2,018.00	1,412,600	
大和工業	1,600	3,420.00	5,472,000	
東京鐵鋼	2,000	408.00	816,000	
大阪製鐵	400	1,946.00	778,400	
淀川製鋼所	5,000	439.00	2,195,000	
東洋鋼板	2,000	447.00	894,000	
丸一鋼管	2,500	2,355.00	5,887,500	
モリ工業	1,000	416.00	416,000	
大同特殊鋼	13,000	523.00	6,799,000	
日本高周波鋼業	3,000	105.00	315,000	
日本冶金工業	5,500	311.00	1,710,500	
山陽特殊製鋼	4,000	478.00	1,912,000	
愛知製鋼	4,000	465.00	1,860,000	
日立金属	7,000	1,319.00	9,233,000	
日本金属	2,000	130.00	260,000	
大平洋金属	5,000	360.00	1,800,000	
日本電工	3,000	284.00	852,000	
栗本鐵工所	4,000	257.00	1,028,000	
虹技	1,000	198.00	198,000	
日本鑄鉄管	1,000	244.00	244,000	
三菱製鋼	4,000	280.00	1,120,000	
日垂鋼業	1,000	357.00	357,000	
日本精線	1,000	431.00	431,000	
シンニッタン	900	367.00	330,300	
新家工業	2,000	171.00	342,000	
大紀アルミニウム工業所	1,000	274.00	274,000	
日本輕金属ホールディングス	16,800	139.00	2,335,200	
三井金属鉱業	19,000	255.00	4,845,000	
東邦亜鉛	4,000	290.00	1,160,000	
三菱マテリアル	47,000	381.00	17,907,000	
住友金属鉱山	19,000	1,350.00	25,650,000	
DOWAホールディングス	8,000	913.00	7,304,000	
古河機械金属	12,000	199.00	2,388,000	
エス・サイエンス	1,700	63.00	107,100	
大阪チタニウムテクノロジーズ	800	2,117.00	1,693,600	

東邦チタニウム	1,300	768.00	998,400	
U A C J	9,000	311.00	2,799,000	
古河電気工業	24,000	240.00	5,760,000	
住友電気工業	28,100	1,452.00	40,801,200	
フジクラ	12,000	440.00	5,280,000	
昭和電線ホールディングス	9,000	110.00	990,000	
タツタ電線	1,100	563.00	619,300	
沖電線	1,000	161.00	161,000	
カナレ電気	100	1,521.00	152,100	
リョービ	4,000	443.00	1,772,000	
アサヒホールディングス	1,100	1,632.00	1,795,200	
稲葉製作所	300	1,262.00	378,600	
宮地エンジニアリンググループ	3,000	222.00	666,000	
トーカロ	500	1,617.00	808,500	
アルファC o	300	1,043.00	312,900	
S U M C O	4,600	837.00	3,850,200	
川田テクノロジーズ	200	2,820.00	564,000	
東洋製罐グループホールディングス	5,300	1,950.00	10,335,000	
ホッカンホールディングス	2,000	307.00	614,000	
コロナ	400	1,110.00	444,000	
横河ブリッジホールディングス	1,000	1,395.00	1,395,000	
駒井ハルテック	2,000	315.00	630,000	
高田機工	1,000	215.00	215,000	
三和ホールディングス	6,000	626.00	3,756,000	
文化シャッター	2,000	553.00	1,106,000	
三協立山	1,000	2,022.00	2,022,000	
東洋シャッター	200	603.00	120,600	
L I X I Lグループ	10,400	2,277.00	23,680,800	
日本フィルコン	500	445.00	222,500	
ノーリツ	1,400	2,273.00	3,182,200	
長府製作所	800	2,214.00	1,771,200	
リンナイ	1,200	7,570.00	9,084,000	
ダイニチ工業	400	814.00	325,600	
日東精工	1,000	361.00	361,000	
三洋工業	1,000	184.00	184,000	

岡部	1,500	1,292.00	1,938,000	
中国工業	100	760.00	76,000	
東プレ	1,500	1,354.00	2,031,000	
高周波熱錬	1,100	915.00	1,006,500	
東京製綱	5,000	168.00	840,000	
モリテック スチール	300	271.00	81,300	
パイオラックス	300	3,155.00	946,500	
日本発條	5,900	1,027.00	6,059,300	
中央発條	1,000	305.00	305,000	
アドバネクス	2,000	124.00	248,000	
三益半導体工業	700	857.00	599,900	
アタカ大機	1,000	443.00	443,000	
日本製鋼所	11,000	515.00	5,665,000	
三浦工業	1,100	2,660.00	2,926,000	
タクマ	2,000	834.00	1,668,000	
ツガミ	2,000	498.00	996,000	
オークマ	5,000	851.00	4,255,000	
東芝機械	4,000	536.00	2,144,000	
アマダ	11,000	845.00	9,295,000	
アイダエンジニアリング	1,800	948.00	1,706,400	
滝澤鉄工所	2,000	143.00	286,000	
富士機械製造	2,300	892.00	2,051,600	
牧野フライス製作所	4,000	707.00	2,828,000	
オーエスジー	3,000	1,573.00	4,719,000	
ダイジェット工業	1,000	154.00	154,000	
旭ダイヤモンド工業	1,900	866.00	1,645,400	
D M G 森精機	3,900	1,579.00	6,158,100	
ディスコ	800	5,890.00	4,712,000	
日東工器	500	1,850.00	925,000	
豊和工業	400	873.00	349,200	
大阪機工	3,000	139.00	417,000	
東洋機械金属	700	396.00	277,200	
津田駒工業	2,000	158.00	316,000	
島精機製作所	1,000	2,010.00	2,010,000	
日阪製作所	1,000	906.00	906,000	

やまびこ	300	2,903.00	870,900	
ペガサスミシン製造	800	372.00	297,600	
ナブテスコ	3,400	2,233.00	7,592,200	
三井海洋開発	600	2,948.00	1,768,800	
レオン自動機	1,000	570.00	570,000	
S M C	2,100	22,440.00	47,124,000	
新川	500	629.00	314,500	
ホソカワミクロン	1,000	662.00	662,000	
ユニオンツール	400	2,255.00	902,000	
オイレス工業	700	2,114.00	1,479,800	
サトーホールディングス	800	2,025.00	1,620,000	
日本エアージェット	300	497.00	149,100	
日精樹脂工業	600	614.00	368,400	
ワイエイシイ	300	609.00	182,700	
小松製作所	34,800	2,093.00	72,836,400	
住友重機械工業	20,000	453.00	9,060,000	
日立建機	3,800	2,019.00	7,672,200	
日工	1,000	531.00	531,000	
巴工業	300	1,540.00	462,000	
井関農機	8,000	316.00	2,528,000	
T O W A	700	472.00	330,400	
丸山製作所	2,000	264.00	528,000	
北川鉄工所	3,000	199.00	597,000	
クボタ	39,000	1,529.00	59,631,000	
荏原実業	200	1,341.00	268,200	
三菱化工機	2,000	172.00	344,000	
月島機械	1,000	1,072.00	1,072,000	
帝国電機製作所	300	2,228.00	668,400	
新東工業	1,800	723.00	1,301,400	
澁谷工業	400	1,852.00	740,800	
アイチ コーポレーション	1,100	495.00	544,500	
小森コーポレーション	1,800	1,544.00	2,779,200	
鶴見製作所	1,000	1,028.00	1,028,000	
住友精密工業	1,000	407.00	407,000	
酒井重工業	1,000	420.00	420,000	

荏原製作所	16,000	517.00	8,272,000	
石井鐵工所	1,000	287.00	287,000	
西島製作所	800	858.00	686,400	
ダイキン工業	9,800	5,830.00	57,134,000	
オルガノ	1,000	468.00	468,000	
トーヨーカネツ	4,000	293.00	1,172,000	
栗田工業	4,500	2,102.00	9,459,000	
橋本チエイン	4,000	660.00	2,640,000	
大同工業	1,000	283.00	283,000	
日本コンベヤ	3,000	143.00	429,000	
木村化工機	700	522.00	365,400	
アネスト岩田	1,000	496.00	496,000	
ダイフク	3,000	1,257.00	3,771,000	
加藤製作所	2,000	676.00	1,352,000	
油研工業	2,000	215.00	430,000	
タダノ	3,000	1,281.00	3,843,000	
フジテック	2,000	1,185.00	2,370,000	
C K D	2,000	952.00	1,904,000	
キトー	400	1,555.00	622,000	
平和	1,500	1,624.00	2,436,000	
理想科学工業	500	2,169.00	1,084,500	
S A N K Y O	2,100	4,600.00	9,660,000	
日本金銭機械	600	2,111.00	1,266,600	
マースエンジニアリング	400	1,931.00	772,400	
福島工業	400	1,537.00	614,800	
オーイズミ	400	1,251.00	500,400	
ダイコク電機	300	2,114.00	634,200	
アマノ	2,000	933.00	1,866,000	
J U K I	5,000	192.00	960,000	
サンデン	4,000	388.00	1,552,000	
蛇の目マシン工業	7,000	81.00	567,000	
マックス	1,000	1,078.00	1,078,000	
グローリー	2,100	2,409.00	5,058,900	
新晃工業	300	831.00	249,300	
大和冷機工業	1,000	615.00	615,000	

セガサミーホールディングス	7,700	2,587.00	19,919,900	
日本ピストンリング	3,000	176.00	528,000	
リケン	3,000	422.00	1,266,000	
T P R	800	1,790.00	1,432,000	
ホシザキ電機	1,600	3,550.00	5,680,000	
大豊工業	500	1,158.00	579,000	
日本精工	16,000	1,009.00	16,144,000	
N T N	17,000	419.00	7,123,000	
ジェイテクト	7,500	1,234.00	9,255,000	
不二越	7,000	478.00	3,346,000	
日本トムソン	2,000	518.00	1,036,000	
T H K	4,400	2,052.00	9,028,800	
ユーシン精機	300	1,944.00	583,200	
前澤給装工業	300	1,268.00	380,400	
イーグル工業	1,000	1,594.00	1,594,000	
前澤工業	800	361.00	288,800	
日本ピラー工業	1,000	650.00	650,000	
キッツ	3,300	417.00	1,376,100	
日立工機	1,800	701.00	1,261,800	
マキタ	4,600	4,950.00	22,770,000	
日立造船	5,200	773.00	4,019,600	
三菱重工業	127,000	625.00	79,375,000	
I H I	49,000	399.00	19,551,000	
イビデン	4,300	1,619.00	6,961,700	
コニカミノルタ	19,000	854.00	16,226,000	
ブラザー工業	9,100	1,055.00	9,600,500	
ミネベア	10,000	626.00	6,260,000	
日立製作所	171,000	682.00	116,622,000	
東芝	141,000	411.00	57,951,000	
三菱電機	71,000	1,092.00	77,532,000	
富士電機	20,000	437.00	8,740,000	
東洋電機製造	1,000	318.00	318,000	
安川電機	8,000	1,251.00	10,008,000	
シンフォニアテクノロジー	4,000	172.00	688,000	
明電舎	6,000	357.00	2,142,000	

オリジン電気	1,000	323.00	323,000	
山洋電気	1,000	641.00	641,000	
デンヨー	700	1,213.00	849,100	
東芝テック	4,000	595.00	2,380,000	
芝浦メカトロニクス	1,000	238.00	238,000	
マブチモーター	1,000	5,370.00	5,370,000	
日本電産	3,900	9,230.00	35,997,000	
東光高岳ホールディングス	400	2,040.00	816,000	
宮越ホールディングス	200	288.00	57,600	
ダイヘン	4,000	418.00	1,672,000	
ヤーマン	100	1,251.00	125,100	
JVCケンウッド	5,100	171.00	872,100	
第一精工	200	1,486.00	297,200	
日新電機	1,000	594.00	594,000	
大崎電気工業	1,000	544.00	544,000	
オムロン	8,000	3,730.00	29,840,000	
日東工業	1,100	1,596.00	1,755,600	
I D E C	1,000	843.00	843,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	14,000	576.00	8,064,000	
サクサホールディングス	2,000	152.00	304,000	
メルコホールディングス	500	1,270.00	635,000	
テクノメディカ	300	2,112.00	633,600	
日本電気	98,000	217.00	21,266,000	
富士通	69,000	428.00	29,532,000	
沖電気工業	28,000	221.00	6,188,000	
岩崎通信機	4,000	98.00	392,000	
電気興業	2,000	625.00	1,250,000	
サンケン電気	4,000	531.00	2,124,000	
ナカヨ通信機	1,000	321.00	321,000	
アイホン	400	1,644.00	657,600	
ルネサスエレクトロニクス	3,700	532.00	1,968,400	
セイコーエプソン	4,900	2,136.00	10,466,400	
ワコム	5,600	735.00	4,116,000	
アルバック	1,200	1,001.00	1,201,200	
アクセル	300	1,823.00	546,900	

E I Z O	700	2,691.00	1,883,700	
日本信号	1,800	727.00	1,308,600	
京三製作所	2,000	310.00	620,000	
能美防災	1,000	1,019.00	1,019,000	
ホーチキ	1,000	525.00	525,000	
エレコム	200	1,391.00	278,200	
日本無線	2,000	357.00	714,000	
パナソニック	81,300	1,020.00	82,926,000	
シャープ	51,000	288.00	14,688,000	
アンリツ	4,200	1,231.00	5,170,200	
富士通ゼネラル	2,000	1,169.00	2,338,000	
日立国際電気	1,000	1,244.00	1,244,000	
ソニー	39,100	1,694.00	66,235,400	
T D K	4,300	4,225.00	18,167,500	
帝国通信工業	2,000	170.00	340,000	
ミツミ電機	2,700	678.00	1,830,600	
タムラ製作所	3,000	256.00	768,000	
アルプス電気	5,200	896.00	4,659,200	
池上通信機	3,000	101.00	303,000	
パイオニア	9,600	172.00	1,651,200	
日本電波工業	700	892.00	624,400	
日本トリム	200	8,910.00	1,782,000	
ローランド ディー . ジー .	300	3,005.00	901,500	
フォスター電機	700	1,964.00	1,374,800	
クラリオン	4,000	122.00	488,000	
S M K	2,000	464.00	928,000	
ヨコオ	600	538.00	322,800	
東光	3,000	342.00	1,026,000	
ティアック	5,000	62.00	310,000	
ホシデン	2,100	531.00	1,115,100	
ヒロセ電機	1,200	14,890.00	17,868,000	
日本航空電子工業	2,000	1,123.00	2,246,000	
T O A	800	842.00	673,600	
古野電気	500	630.00	315,000	
ユニデン	2,000	238.00	476,000	

アルパイン	1,600	1,278.00	2,044,800	
スミダコーポレーション	500	462.00	231,000	
アイコム	400	2,225.00	890,000	
リオン	100	1,492.00	149,200	
船井電機	700	1,031.00	721,700	
横河電機	7,700	1,278.00	9,840,600	
新電元工業	2,000	640.00	1,280,000	
アズビル	2,200	2,273.00	5,000,600	
日本光電工業	1,500	3,885.00	5,827,500	
チノー	1,000	230.00	230,000	
共和電業	1,000	423.00	423,000	
日本電子材料	300	359.00	107,700	
堀場製作所	1,300	3,405.00	4,426,500	
アドバンテスト	4,800	1,106.00	5,308,800	
小野測器	1,000	427.00	427,000	
エスベック	700	788.00	551,600	
パナソニック デバイスSUNX	700	453.00	317,100	
キーエンス	1,600	39,250.00	62,800,000	
日置電機	400	1,369.00	547,600	
シスメックス	3,000	6,250.00	18,750,000	
メガチップス	600	1,505.00	903,000	
OBARA GROUP	500	2,451.00	1,225,500	
日本電産コバル電子	700	598.00	418,600	
澤藤電機	1,000	240.00	240,000	
コーセル	1,000	1,213.00	1,213,000	
日立メディコ	1,000	1,328.00	1,328,000	
新日本無線	1,000	392.00	392,000	
オブテックス	400	1,603.00	641,200	
千代田インテグレ	300	1,835.00	550,500	
レーザーテック	500	934.00	467,000	
スタンレー電気	5,200	2,248.00	11,689,600	
岩崎電気	3,000	216.00	648,000	
ウシオ電機	4,300	1,208.00	5,194,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	700	274.00	191,800	
日本セラミック	400	1,395.00	558,000	

遠藤照明	300	2,276.00	682,800	
日本デジタル研究所	600	1,240.00	744,000	
古河電池	1,000	545.00	545,000	
双信電機	300	364.00	109,200	
山一電機	900	238.00	214,200	
図研	500	804.00	402,000	
日本電子	2,000	436.00	872,000	
カシオ計算機	7,400	925.00	6,845,000	
ファナック	8,000	15,310.00	122,480,000	
日本シイエムケイ	1,600	278.00	444,800	
エンプラス	300	6,000.00	1,800,000	
大真空	1,000	369.00	369,000	
ローム	3,800	3,795.00	14,421,000	
浜松ホトニクス	2,800	3,680.00	10,304,000	
三井ハイテック	900	680.00	612,000	
新光電気工業	2,400	800.00	1,920,000	
京セラ	12,700	4,920.00	62,484,000	
太陽誘電	3,500	1,216.00	4,256,000	
村田製作所	7,500	7,840.00	58,800,000	
ユーシン	1,100	733.00	806,300	
双葉電子工業	1,400	1,331.00	1,863,400	
北陸電気工業	3,000	136.00	408,000	
ニチコン	2,300	912.00	2,097,600	
日本ケミコン	4,000	370.00	1,480,000	
K O A	900	920.00	828,000	
市光工業	2,000	187.00	374,000	
小糸製作所	4,000	1,825.00	7,300,000	
ミツバ	1,300	1,628.00	2,116,400	
スター精密	1,400	1,086.00	1,520,400	
大日本スクリーン製造	7,000	497.00	3,479,000	
キヤノン電子	600	1,848.00	1,108,800	
キヤノン	41,300	3,095.00	127,823,500	
リコー	21,000	1,009.00	21,189,000	
M U T O Hホールディングス	1,000	431.00	431,000	
東京エレクトロン	6,400	5,400.00	34,560,000	

トヨタ紡織	2,500	1,230.00	3,075,000	
鬼怒川ゴム工業	1,000	510.00	510,000	
ユニプレス	1,100	1,755.00	1,930,500	
豊田自動織機	6,500	4,280.00	27,820,000	
モリタホールディングス	1,000	861.00	861,000	
三櫻工業	900	698.00	628,200	
デンソー	17,600	4,675.00	82,280,000	
東海理化電機製作所	1,900	1,986.00	3,773,400	
三井造船	28,000	187.00	5,236,000	
佐世保重工業	5,000	96.00	480,000	
川崎重工業	56,000	394.00	22,064,000	
名村造船所	1,100	1,221.00	1,343,100	
サノヤスホールディングス	400	177.00	70,800	
日本車輛製造	3,000	508.00	1,524,000	
ニチュ三菱フォークリフト	1,000	464.00	464,000	
近畿車輛	1,000	300.00	300,000	
日産自動車	100,100	887.00	88,788,700	
いすゞ自動車	41,000	604.00	24,764,000	
トヨタ自動車	99,200	6,270.00	621,984,000	代用有価証券 30,000株
日野自動車	9,000	1,318.00	11,862,000	
三菱自動車工業	16,600	1,099.00	18,243,400	
エフテック	300	1,553.00	465,900	
武蔵精密工業	800	2,155.00	1,724,000	
日産車体	3,000	1,584.00	4,752,000	
新明和工業	3,000	745.00	2,235,000	
極東開発工業	1,200	1,262.00	1,514,400	
日信工業	1,500	1,787.00	2,680,500	
トピー工業	6,000	195.00	1,170,000	
ティラド	3,000	310.00	930,000	
曙ブレーキ工業	3,300	482.00	1,590,600	
タチエス	1,100	1,501.00	1,651,100	
N O K	3,400	1,545.00	5,253,000	
フタバ産業	2,100	349.00	732,900	
カヤバ工業	6,000	561.00	3,366,000	
シロキ工業	2,000	213.00	426,000	

大同メタル工業	1,000	971.00	971,000	
プレス工業	3,000	414.00	1,242,000	
カルソニックカンセイ	5,000	539.00	2,695,000	
太平洋工業	1,400	683.00	956,200	
ケーヒン	1,600	1,557.00	2,491,200	
河西工業	1,000	586.00	586,000	
アイシン精機	6,500	3,845.00	24,992,500	
富士機工	1,000	337.00	337,000	
マツダ	106,000	428.00	45,368,000	
ダイハツ工業	7,600	1,808.00	13,740,800	
今仙電機製作所	600	1,394.00	836,400	
本田技研工業	64,200	3,900.00	250,380,000	
スズキ	14,900	2,468.00	36,773,200	
富士重工業	24,200	2,660.00	64,372,000	
ヤマハ発動機	10,900	1,408.00	15,347,200	
ショーワ	1,700	1,443.00	2,453,100	
T B K	1,000	561.00	561,000	
エクセディ	900	2,897.00	2,607,300	
豊田合成	2,300	2,344.00	5,391,200	
愛三工業	900	975.00	877,500	
ヨロズ	500	1,921.00	960,500	
エフ・シー・シー	1,200	2,165.00	2,598,000	
シマノ	3,100	8,310.00	25,761,000	
タカタ	1,300	2,540.00	3,302,000	
テイ・エス テック	1,500	3,600.00	5,400,000	
テルモ	5,500	4,810.00	26,455,000	
クリエートメディック	200	935.00	187,000	
日機装	2,000	1,278.00	2,556,000	
島津製作所	9,000	926.00	8,334,000	
J M S	1,000	294.00	294,000	
ショットモリテックス	200	279.00	55,800	
長野計器	500	694.00	347,000	
ブイ・テクノロジー	1	265,200.00	265,200	
東京計器	2,000	314.00	628,000	
愛知時計電機	1,000	285.00	285,000	

東京精密	1,300	1,793.00	2,330,900	
マニー	200	3,755.00	751,000	
ニコン	13,300	1,790.00	23,807,000	
トプコン	1,900	1,513.00	2,874,700	
オリンパス	10,600	3,110.00	32,966,000	
理研計器	600	742.00	445,200	
タムロン	500	1,944.00	972,000	
HOYA	17,300	2,545.00	44,028,500	
ノーリツ鋼機	600	610.00	366,000	
エー・アンド・デイ	700	608.00	425,600	
シチズンホールディングス	8,700	687.00	5,976,900	
リズム時計工業	3,000	144.00	432,000	
大研医器	200	1,802.00	360,400	
松風	400	874.00	349,600	
セイコーホールディングス	5,000	446.00	2,230,000	
ニプロ	3,800	899.00	3,416,200	
パラマウントベッドホールディングス	700	3,120.00	2,184,000	
S H O - B I	100	423.00	42,300	
前田工織	500	1,115.00	557,500	
永大産業	1,000	489.00	489,000	
ダンロップスポーツ	400	1,229.00	491,600	
バンダイナムコホールディングス	7,900	1,996.00	15,768,400	
共立印刷	900	265.00	238,500	
フランスベッドホールディングス	4,000	193.00	772,000	
パイロットコーポレーション	600	3,610.00	2,166,000	
トッパン・フォームズ	1,300	905.00	1,176,500	
フジシールインターナショナル	900	2,905.00	2,614,500	
タカラトミー	2,400	502.00	1,204,800	
廣濟堂	800	561.00	448,800	
タカノ	400	487.00	194,800	
プロネクサス	800	639.00	511,200	
ホクシン	500	178.00	89,000	
ウッドワン	1,000	270.00	270,000	
大建工業	3,000	253.00	759,000	
凸版印刷	20,000	765.00	15,300,000	

大日本印刷	22,000	1,015.00	22,330,000	
図書印刷	1,000	274.00	274,000	
共同印刷	2,000	267.00	534,000	
日本写真印刷	1,200	1,481.00	1,777,200	
光村印刷	1,000	262.00	262,000	
宝印刷	400	680.00	272,000	
アシックス	7,100	1,718.00	12,197,800	
ツツミ	400	2,342.00	936,800	
ローランド	700	1,244.00	870,800	
小松ウオール工業	200	1,982.00	396,400	
ヤマハ	5,300	1,425.00	7,552,500	
河合楽器製作所	2,000	189.00	378,000	
クリナップ	700	848.00	593,600	
ピジョン	1,200	4,915.00	5,898,000	
兼松日産農林	2,000	160.00	320,000	
キングジム	600	694.00	416,400	
リンテック	1,700	1,988.00	3,379,600	
T A S A K I	100	605.00	60,500	
イトーキ	1,600	494.00	790,400	
任天堂	4,400	11,920.00	52,448,000	
三菱鉛筆	600	2,450.00	1,470,000	
タカスタンダード	3,000	803.00	2,409,000	
コクヨ	3,600	742.00	2,671,200	
ナカバヤシ	2,000	205.00	410,000	
岡村製作所	3,000	734.00	2,202,000	
美津濃	4,000	544.00	2,176,000	
アデランス	900	1,170.00	1,053,000	
東京電力	60,400	526.00	31,770,400	
中部電力	23,400	1,403.00	32,830,200	
関西電力	29,100	1,186.00	34,512,600	
中国電力	9,900	1,462.00	14,473,800	
北陸電力	7,000	1,365.00	9,555,000	
東北電力	17,800	1,109.00	19,740,200	
四国電力	6,400	1,656.00	10,598,400	
九州電力	15,700	1,316.00	20,661,200	

北海道電力	6,700	1,220.00	8,174,000	
沖縄電力	500	3,275.00	1,637,500	
電源開発	4,400	3,085.00	13,574,000	
東京瓦斯	84,000	507.00	42,588,000	
大阪瓦斯	74,000	401.00	29,674,000	
東邦瓦斯	18,000	497.00	8,946,000	
北海道瓦斯	1,000	266.00	266,000	
西部瓦斯	8,000	241.00	1,928,000	
静岡瓦斯	1,800	624.00	1,123,200	
東武鉄道	40,000	497.00	19,880,000	
相鉄ホールディングス	12,000	365.00	4,380,000	
東京急行電鉄	42,000	651.00	27,342,000	
京浜急行電鉄	18,000	898.00	16,164,000	
小田急電鉄	23,000	927.00	21,321,000	
京王電鉄	20,000	668.00	13,360,000	
京成電鉄	11,000	998.00	10,978,000	
富士急行	2,000	817.00	1,634,000	
新京成電鉄	1,000	367.00	367,000	
東日本旅客鉄道	13,100	8,410.00	110,171,000	
西日本旅客鉄道	6,600	4,395.00	29,007,000	
東海旅客鉄道	6,400	12,330.00	78,912,000	
鴻池運輸	400	1,573.00	629,200	
西日本鉄道	9,000	380.00	3,420,000	
ハマキョウレックス	200	2,741.00	548,200	
サカイ引越センター	100	3,225.00	322,500	
近畿日本鉄道	72,000	361.00	25,992,000	
阪急阪神ホールディングス	48,000	548.00	26,304,000	
南海電気鉄道	15,000	364.00	5,460,000	
京阪電気鉄道	15,000	395.00	5,925,000	
神戸電鉄	2,000	341.00	682,000	
名糖運輸	300	642.00	192,600	
名古屋鉄道	25,000	290.00	7,250,000	
山陽電気鉄道	3,000	418.00	1,254,000	
日本通運	28,000	486.00	13,608,000	
ヤマトホールディングス	13,300	2,066.00	27,477,800	

山九	9,000	345.00	3,105,000	
丸運	300	247.00	74,100	
丸全昭和運輸	2,000	351.00	702,000	
センコー	3,000	525.00	1,575,000	
トナミホールディングス	2,000	213.00	426,000	
日本梱包運輸倉庫	2,200	1,745.00	3,839,000	
日本石油輸送	1,000	226.00	226,000	
福山通運	4,000	578.00	2,312,000	
セイノーホールディングス	5,000	933.00	4,665,000	
神奈川中央交通	1,000	504.00	504,000	
日立物流	1,500	1,583.00	2,374,500	
日本郵船	60,000	299.00	17,940,000	
商船三井	40,000	412.00	16,480,000	
川崎汽船	31,000	224.00	6,944,000	
N S ユナイテッド海運	3,000	283.00	849,000	
乾汽船	800	357.00	285,600	
明治海運	700	429.00	300,300	
飯野海運	3,000	614.00	1,842,000	
共栄タンカー	1,000	234.00	234,000	
日本航空	6,000	5,510.00	33,060,000	
A N A ホールディングス	140,000	211.00	29,540,000	
パスコ	1,000	480.00	480,000	
ランコム	200	2,904.00	580,800	
日新	3,000	273.00	819,000	
三菱倉庫	5,000	1,277.00	6,385,000	
三井倉庫	3,000	475.00	1,425,000	
住友倉庫	5,000	545.00	2,725,000	
澁澤倉庫	2,000	405.00	810,000	
東陽倉庫	1,000	261.00	261,000	
日本トランスシティ	2,000	331.00	662,000	
ケイヒン	1,000	182.00	182,000	
中央倉庫	300	939.00	281,700	
安田倉庫	600	1,185.00	711,000	
東洋埠頭	2,000	260.00	520,000	
宇徳	400	323.00	129,200	

上組	9,000	857.00	7,713,000	
サンリツ	200	530.00	106,000	
キューソー流通システム	200	1,052.00	210,400	
郵船ロジスティクス	700	1,117.00	781,900	
近鉄エクスプレス	600	3,675.00	2,205,000	
エーアイティー	200	759.00	151,800	
N E C ネットズエスアイ	800	2,561.00	2,048,800	
システナ	800	709.00	567,200	
デジタルアーツ	300	876.00	262,800	
新日鉄住金ソリューションズ	600	2,223.00	1,333,800	
コア	300	750.00	225,000	
ソフトクリエイトホールディングス	300	919.00	275,700	
I T ホールディングス	2,500	1,375.00	3,437,500	
ネオス	100	1,530.00	153,000	
電算システム	200	1,428.00	285,600	
グリー	3,700	813.00	3,008,100	
コーエーテクモホールディングス	1,400	1,203.00	1,684,200	
三菱総合研究所	300	2,060.00	618,000	
ボルテージ	100	1,040.00	104,000	
ヒト・コミュニケーションズ	100	1,422.00	142,200	
ブレインパッド	100	1,219.00	121,900	
K L a b	200	735.00	147,000	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	200	2,945.00	589,000	
ネクソン	5,800	1,131.00	6,559,800	
アイスタイル	100	684.00	68,400	
ブロードリーフ	700	1,894.00	1,325,800	
ハーツユナイテッドグループ	100	2,156.00	215,600	
ドワンゴ	600	1,778.00	1,066,800	
マクロミル	1,100	619.00	680,900	
ティーガイア	700	1,029.00	720,300	
テクマトリックス	200	570.00	114,000	
G M O ペイメントゲートウェイ	300	3,580.00	1,074,000	
ザッパラス	400	770.00	308,000	
インターネットイニシアティブ	1,000	2,783.00	2,783,000	
ビットアイル	500	856.00	428,000	

S R Aホールディングス	400	1,106.00	442,400	
パナソニック インフォメーションシステムズ	200	2,708.00	541,600	
フェイス	200	1,043.00	208,600	
野村総合研究所	4,000	3,190.00	12,760,000	
サイバネットシステム	800	350.00	280,000	
インテージホールディングス	400	1,280.00	512,000	
クレスコ	300	744.00	223,200	
フジ・メディア・ホールディングス	6,800	1,938.00	13,178,400	
オービック	2,400	3,005.00	7,212,000	
T D Cソフトウェアエンジニアリング	200	788.00	157,600	
ヤフー	51,000	464.00	23,664,000	
トレンドマイクロ	3,100	3,560.00	11,036,000	
日本オラクル	1,400	3,880.00	5,432,000	
アルファシステムズ	200	1,294.00	258,800	
フューチャーアーキテクト	900	558.00	502,200	
シーエーシー	600	883.00	529,800	
ソフトバンク・テクノロジー	200	1,715.00	343,000	
トーセ	300	672.00	201,600	
オービックビジネスコンサルタント	400	3,390.00	1,356,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	800	3,885.00	3,108,000	
アイティフォー	900	405.00	364,500	
東計電算	200	1,424.00	284,800	
エクスネット	100	1,333.00	133,300	
大塚商会	600	12,340.00	7,404,000	
サイボウズ	13	28,560.00	371,280	
ソフトブレーン	1,300	129.00	167,700	
電通国際情報サービス	500	1,158.00	579,000	
E Mシステムズ	100	1,989.00	198,900	
ウェザーニューズ	200	2,110.00	422,000	
C I J	900	401.00	360,900	
WOWOW	200	3,570.00	714,000	
日本コロムビア	300	641.00	192,300	
ネットワンシステムズ	2,800	654.00	1,831,200	
アルゴグラフィックス	300	1,588.00	476,400	
マーベラスA Q L	1,100	535.00	588,500	

エイベックス・グループ・ホールディングス	1,300	2,479.00	3,222,700
日本ユニシス	1,700	809.00	1,375,300
兼松エレクトロニクス	400	1,277.00	510,800
東京放送ホールディングス	3,800	1,298.00	4,932,400
日本テレビホールディングス	7,100	1,804.00	12,808,400
テレビ朝日	1,700	2,327.00	3,955,900
スカパーJ S A Tホールディングス	5,200	556.00	2,891,200
テレビ東京ホールディングス	600	1,691.00	1,014,600
コネクシオ	600	823.00	493,800
日本電信電話	27,600	5,090.00	140,484,000
K D D I	21,800	5,490.00	119,682,000
光通信	700	7,410.00	5,187,000
N T T ドコモ	58,000	1,552.00	90,016,000
G M O インターネット	2,300	1,157.00	2,661,100
学研ホールディングス	2,000	298.00	596,000
ゼンリン	900	1,026.00	923,400
昭文社	400	616.00	246,400
K A D O K A W A	700	3,580.00	2,506,000
インプレスホールディングス	700	131.00	91,700
アイネット	500	706.00	353,000
松竹	5,000	957.00	4,785,000
東宝	5,000	2,103.00	10,515,000
東映	3,000	577.00	1,731,000
A O I P r o .	400	640.00	256,000
エヌ・ティ・ティ・データ	5,000	3,285.00	16,425,000
D T S	700	1,707.00	1,194,900
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,500	1,673.00	4,182,500
シーイーシー	500	623.00	311,500
カプコン	1,800	1,814.00	3,265,200
ジャステック	600	835.00	501,000
S C S K	1,700	2,393.00	4,068,100
日本システムウエア	400	421.00	168,400
アイネス	1,000	633.00	633,000
T K C	600	1,616.00	969,600
富士ソフト	900	2,088.00	1,879,200

NSD	1,500	1,172.00	1,758,000
コナミ	3,200	2,434.00	7,788,800
福井コンピュータホールディングス	100	799.00	79,900
JBCCHホールディングス	600	796.00	477,600
ミロク情報サービス	500	380.00	190,000
ソフトバンク	34,500	7,480.00	258,060,000
ハウスイ	1,000	132.00	132,000
高千穂交易	300	951.00	285,300
伊藤忠食品	200	3,180.00	636,000
エレマテック	300	1,494.00	448,200
JALUX	200	1,135.00	227,000
あらた	2,000	345.00	690,000
トーメンデバイス	100	1,661.00	166,100
東京エレクトロン デバイス	100	1,567.00	156,700
双日	47,000	189.00	8,883,000
アルフレッサ ホールディングス	2,100	5,250.00	11,025,000
横浜冷凍	1,800	772.00	1,389,600
神栄	1,000	291.00	291,000
ラサ商事	300	453.00	135,900
アルコニックス	200	2,041.00	408,200
神戸物産	100	2,205.00	220,500
あい ホールディングス	1,200	1,234.00	1,480,800
ダイワボウホールディングス	6,000	193.00	1,158,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,300	671.00	872,300
八洲電機	500	421.00	210,500
UKCホールディングス	500	1,625.00	812,500
TOKAIホールディングス	3,400	354.00	1,203,600
ミタチ産業	100	417.00	41,700
シップヘルスケアホールディングス	1,000	3,910.00	3,910,000
富士興産	300	637.00	191,100
協栄産業	1,000	193.00	193,000
小野建	600	1,204.00	722,400
佐鳥電機	500	583.00	291,500
エコートレーディング	100	724.00	72,400
伯東	400	935.00	374,000

コンドーテック	300	719.00	215,700	
中山福	400	760.00	304,000	
ナガイレーベン	900	1,588.00	1,429,200	
三菱食品	800	2,533.00	2,026,400	
松田産業	500	1,364.00	682,000	
メディバルホールディングス	7,000	1,266.00	8,862,000	
アドヴァン	400	1,200.00	480,000	
S P K	100	1,771.00	177,100	
アズワン	500	2,205.00	1,102,500	
尾家産業	300	811.00	243,300	
シモジマ	400	937.00	374,800	
ドウシシャ	800	1,442.00	1,153,600	
高速	400	903.00	361,200	
黒田電気	1,000	1,403.00	1,403,000	
丸文	600	479.00	287,400	
ハピネット	200	739.00	147,800	
トーメンエレクトロニクス	400	1,110.00	444,000	
エクセル	300	1,115.00	334,500	
マルカキカイ	200	1,454.00	290,800	
ガリバーインターナショナル	2,300	580.00	1,334,000	
日本エム・ディ・エム	900	277.00	249,300	
進和	400	1,128.00	451,200	
エスケイジャパン	200	277.00	55,400	
ダイトエレクトロン	300	377.00	113,100	
シークス	500	1,198.00	599,000	
田中商事	200	589.00	117,800	
オーハシテクニカ	500	856.00	428,000	
マクニカ	400	2,680.00	1,072,000	
白銅	300	796.00	238,800	
伊藤忠商事	56,100	1,223.00	68,610,300	
丸紅	62,000	763.00	47,306,000	
高島	1,000	273.00	273,000	
長瀬産業	4,000	1,134.00	4,536,000	
蝶理	400	1,158.00	463,200	
豊田通商	7,800	2,436.00	19,000,800	

三共生興	1,200	330.00	396,000	
兼松	15,000	134.00	2,010,000	
ツカモトコーポレーション	2,000	153.00	306,000	
三井物産	64,800	1,364.00	88,387,200	
日本紙パルプ商事	3,000	311.00	933,000	
日立ハイテクノロジーズ	2,100	2,129.00	4,470,900	
カメイ	900	741.00	666,900	
東都水産	1,000	213.00	213,000	
OUGホールディングス	1,000	181.00	181,000	
スターゼン	3,000	266.00	798,000	
山善	2,700	647.00	1,746,900	
樺本興業	1,000	266.00	266,000	
住友商事	41,600	1,241.00	51,625,600	
内田洋行	2,000	287.00	574,000	
三菱商事	54,900	1,968.00	108,043,200	
第一実業	2,000	423.00	846,000	
キヤノンマーケティングジャパン	2,000	1,396.00	2,792,000	
西華産業	2,000	239.00	478,000	
佐藤商事	700	609.00	426,300	
菱洋エレクトロ	900	919.00	827,100	
東京産業	500	328.00	164,000	
ユアサ商事	7,000	197.00	1,379,000	
神鋼商事	2,000	199.00	398,000	
小林産業	300	337.00	101,100	
阪和興業	7,000	464.00	3,248,000	
カナデン	1,000	650.00	650,000	
菱電商事	1,000	673.00	673,000	
フルサト工業	400	1,049.00	419,600	
岩谷産業	8,000	441.00	3,528,000	
すてきナイスグループ	3,000	231.00	693,000	
昭光通商	3,000	155.00	465,000	
二チモウ	1,000	199.00	199,000	
極東貿易	1,000	214.00	214,000	
イワキ	1,000	210.00	210,000	
三愛石油	2,000	424.00	848,000	

稲畑産業	1,800	970.00	1,746,000	
G S I クレオス	3,000	150.00	450,000	
明和産業	600	319.00	191,400	
ワキタ	1,000	1,255.00	1,255,000	
東邦ホールディングス	2,300	1,855.00	4,266,500	
サンゲツ	1,200	2,550.00	3,060,000	
ミツウロコグループホールディングス	1,100	515.00	566,500	
シナネン	2,000	376.00	752,000	
伊藤忠エネクス	1,700	528.00	897,600	
サンリオ	1,800	4,835.00	8,703,000	
サンワテクノス	500	887.00	443,500	
リョーサン	1,100	1,954.00	2,149,400	
新光商事	800	839.00	671,200	
トーヨー	1,000	353.00	353,000	
三信電気	900	659.00	593,100	
東陽テクニカ	1,000	1,105.00	1,105,000	
モスフードサービス	900	1,903.00	1,712,700	
加賀電子	600	1,025.00	615,000	
ソーダニッカ	1,000	412.00	412,000	
立花エレテック	400	1,172.00	468,800	
P a l t a c	1,000	1,288.00	1,288,000	
太平洋興発	3,000	106.00	318,000	
ヤマタネ	4,000	182.00	728,000	
日鉄住金物産	5,000	292.00	1,460,000	
トラスコ中山	800	2,087.00	1,669,600	
オートバックスセブン	2,500	1,463.00	3,657,500	
加藤産業	1,000	1,960.00	1,960,000	
イノテック	400	440.00	176,000	
イエローハット	600	1,825.00	1,095,000	
富士エレクトロニクス	400	1,331.00	532,400	
J Kホールディングス	700	602.00	421,400	
日伝	300	2,278.00	683,400	
北沢産業	500	178.00	89,000	
杉本商事	400	897.00	358,800	
因幡電機産業	900	2,976.00	2,678,400	

バイテック	200	855.00	171,000	
ミスミグループ本社	2,800	2,790.00	7,812,000	
江守商事	100	1,795.00	179,500	
アルテック	400	275.00	110,000	
タキヒヨー	1,000	399.00	399,000	
スズケン	2,900	3,405.00	9,874,500	
ジェコス	600	727.00	436,200	
ローソン	2,900	7,600.00	22,040,000	
サンエー	500	2,812.00	1,406,000	
キリン堂	300	644.00	193,200	
ダイユーエイト	100	658.00	65,800	
カワチ薬品	500	1,824.00	912,000	
エーピーシー・マート	1,000	4,790.00	4,790,000	
ハードオフコーポレーション	300	746.00	223,800	
アスクル	600	2,989.00	1,793,400	
ゲオホールディングス	1,200	921.00	1,105,200	
アダストリアホールディングス	500	4,345.00	2,172,500	
くらコーポレーション	400	1,583.00	633,200	
キャンドウ	300	1,607.00	482,100	
パル	400	2,616.00	1,046,400	
エディオン	3,200	528.00	1,689,600	
サーラコーポレーション	600	514.00	308,400	
あみやき亭	200	3,320.00	664,000	
ひらまつ	300	627.00	188,100	
ゲンキー	100	2,104.00	210,400	
大黒天物産	100	2,887.00	288,700	
ハニーズ	590	1,094.00	645,460	
アルペン	500	1,863.00	931,500	
クオール	200	615.00	123,000	
ジェイアイエヌ	400	3,760.00	1,504,000	
ビックカメラ	26	50,600.00	1,315,600	
DCMホールディングス	3,500	688.00	2,408,000	
Monotaro	1,100	2,280.00	2,508,000	
J．フロント リテイリング	17,000	735.00	12,495,000	
ドトール・日レスホールディングス	1,200	1,780.00	2,136,000	

マツモトキヨシホールディングス	1,400	3,230.00	4,522,000	
スタートトゥデイ	2,200	2,893.00	6,364,600	
物語コーポレーション	100	3,965.00	396,500	
ココカラファイン	700	2,632.00	1,842,400	
三越伊勢丹ホールディングス	14,000	1,470.00	20,580,000	
ウエルシアホールディングス	200	5,640.00	1,128,000	
クリエイティブSDホールディングス	300	3,535.00	1,060,500	
丸善CHIホールディングス	300	286.00	85,800	
ブックオフコーポレーション	300	663.00	198,900	
あさひ	400	1,619.00	647,600	
日本調剤	90	2,653.00	238,770	
コスモス薬品	400	11,390.00	4,556,000	
一六堂	100	476.00	47,600	
セブン&アイ・ホールディングス	29,500	3,575.00	105,462,500	
ツルハホールディングス	700	8,850.00	6,195,000	
サンマルクホールディングス	200	5,050.00	1,010,000	
フェリシモ	200	994.00	198,800	
トリドール	600	789.00	473,400	
クスリのアオキ	100	5,860.00	586,000	
メディカルシステムネットワーク	200	440.00	88,000	
総合メディカル	200	3,745.00	749,000	
はるやま商事	500	670.00	335,000	
カッパ・クリエイティブホールディングス	500	1,819.00	909,500	
ライトオン	500	804.00	402,000	
ジーンズメイト	300	251.00	75,300	
良品計画	700	9,800.00	6,860,000	
三城ホールディングス	900	456.00	410,400	
コナカ	900	888.00	799,200	
ハウス オブ ローゼ	100	1,334.00	133,400	
G-7ホールディングス	300	754.00	226,200	
イオン北海道	500	646.00	323,000	
コジマ	900	272.00	244,800	
ヒマラヤ	200	1,339.00	267,800	
コーナン商事	900	1,033.00	929,700	
エコス	300	605.00	181,500	

ワタミ	800	1,491.00	1,192,800	
ドン・キホーテ	2,100	6,310.00	13,251,000	
西松屋チェーン	1,400	719.00	1,006,600	
ゼンショーホールディングス	2,700	1,070.00	2,889,000	
幸楽苑	500	1,229.00	614,500	
ハークスレイ	200	758.00	151,600	
サイゼリヤ	1,100	1,198.00	1,317,800	
ポプラ	200	544.00	108,800	
ユナイテッドアローズ	900	4,015.00	3,613,500	
ハイデイ日高	400	2,064.00	825,600	
京都きもの友禅	500	1,029.00	514,500	
コロワイド	2,500	999.00	2,497,500	
壱番屋	300	4,070.00	1,221,000	
トップカルチャー	300	442.00	132,600	
P L A N T	100	919.00	91,900	
スギホールディングス	1,300	4,065.00	5,284,500	
スクロール	1,000	275.00	275,000	
ヨンドシーホールディングス	500	1,303.00	651,500	
ファミリーマート	2,400	4,280.00	10,272,000	
木曽路	800	1,792.00	1,433,600	
サトレストランシステムズ	400	668.00	267,200	
千趣会	1,200	840.00	1,008,000	
タカキュー	500	323.00	161,500	
ケーヨー	1,200	461.00	553,200	
上新電機	2,000	781.00	1,562,000	
日本瓦斯	1,000	1,038.00	1,038,000	
ベスト電器	2,000	149.00	298,000	
マルエツ	1,000	320.00	320,000	
ロイヤルホールディングス	1,200	1,570.00	1,884,000	
東天紅	1,000	194.00	194,000	
いなげや	800	995.00	796,000	
島忠	1,600	2,302.00	3,683,200	
チヨダ	900	2,088.00	1,879,200	
ライフコーポレーション	500	1,606.00	803,000	
カスミ	1,500	605.00	907,500	

リンガーハット	700	1,434.00	1,003,800	
さが美	1,000	107.00	107,000	
MrMax	800	325.00	260,000	
テンアライド	500	322.00	161,000	
AOKIホールディングス	600	3,270.00	1,962,000	
オークワ	1,000	870.00	870,000	
コメリ	1,100	2,422.00	2,664,200	
青山商事	1,900	2,508.00	4,765,200	
しまむら	800	10,630.00	8,504,000	
CFSコーポレーション	700	385.00	269,500	
はせがわ	200	678.00	135,600	
高島屋	10,000	927.00	9,270,000	
松屋	1,400	1,145.00	1,603,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	4,000	812.00	3,248,000	
近鉄百貨店	3,000	349.00	1,047,000	
丸栄	1,000	232.00	232,000	
ニッセンホールディングス	1,300	311.00	404,300	
パルコ	700	1,009.00	706,300	
丸井グループ	9,200	905.00	8,326,000	
アクシアル リテイリング	400	1,560.00	624,000	
ダイエー	4,350	336.00	1,461,600	
イズミヤ	3,000	456.00	1,368,000	
イオン	27,700	1,317.00	36,480,900	
ユニグループ・ホールディングス	6,600	611.00	4,032,600	
イズミ	1,600	3,145.00	5,032,000	
東武ストア	1,000	257.00	257,000	
平和堂	1,500	1,482.00	2,223,000	
フジ	800	1,762.00	1,409,600	
ヤオコー	400	3,880.00	1,552,000	
ゼビオ	800	2,070.00	1,656,000	
ケーズホールディングス	1,500	3,025.00	4,537,500	
Olympicグループ	500	699.00	349,500	
日産東京販売ホールディングス	1,000	379.00	379,000	
アインファーマシーズ	400	4,335.00	1,734,000	
元気寿司	200	1,252.00	250,400	

ヤマダ電機	27,900	293.00	8,174,700
アークランドサカモト	400	1,524.00	609,600
ニトリホールディングス	1,400	8,930.00	12,502,000
グルメ杵屋	1,000	684.00	684,000
愛眼	600	277.00	166,200
吉野家ホールディングス	1,900	1,135.00	2,156,500
松屋フーズ	400	1,596.00	638,400
サガミチェーン	1,000	878.00	878,000
関西スーパーマーケット	400	881.00	352,400
王将フードサービス	300	3,265.00	979,500
プレナス	800	2,259.00	1,807,200
ミニストップ	500	1,547.00	773,500
アークス	1,200	1,816.00	2,179,200
バロー	1,500	1,272.00	1,908,000
藤久	100	1,655.00	165,500
ベルク	300	1,750.00	525,000
大庄	300	1,261.00	378,300
ファーストリテイリング	1,600	31,750.00	50,800,000
サンドラッグ	1,500	4,720.00	7,080,000
東京デリカ	400	1,499.00	599,600
ヤマザワ	200	1,505.00	301,000
やまや	100	1,436.00	143,600
ペルーナ	1,700	481.00	817,700
島根銀行	200	1,298.00	259,600
じもとホールディングス	5,000	200.00	1,000,000
新生銀行	61,000	221.00	13,481,000
あおぞら銀行	37,000	282.00	10,434,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	532,900	616.00	328,266,400
りそなホールディングス	66,800	501.00	33,466,800
三井住友トラスト・ホールディングス	138,000	467.00	64,446,000
三井住友フィナンシャルグループ	53,200	4,700.00	250,040,000
第四銀行	9,000	344.00	3,096,000
北越銀行	8,000	201.00	1,608,000
西日本シティ銀行	25,000	264.00	6,600,000
千葉銀行	27,000	696.00	18,792,000

横浜銀行	46,000	547.00	25,162,000	
常陽銀行	26,000	496.00	12,896,000	
群馬銀行	16,000	566.00	9,056,000	
武蔵野銀行	1,100	3,370.00	3,707,000	
千葉興業銀行	1,400	731.00	1,023,400	
筑波銀行	2,900	329.00	954,100	
東京都民銀行	1,200	1,027.00	1,232,400	
七十七銀行	11,000	478.00	5,258,000	
青森銀行	5,000	256.00	1,280,000	
秋田銀行	5,000	242.00	1,210,000	
山形銀行	4,000	402.00	1,608,000	
岩手銀行	500	4,460.00	2,230,000	
東邦銀行	6,000	305.00	1,830,000	
東北銀行	4,000	143.00	572,000	
みちのく銀行	4,000	200.00	800,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	29,000	441.00	12,789,000	
静岡銀行	21,000	1,094.00	22,974,000	
十六銀行	9,000	392.00	3,528,000	
スルガ銀行	7,000	1,564.00	10,948,000	
八十二銀行	13,000	603.00	7,839,000	
山梨中央銀行	5,000	413.00	2,065,000	
大垣共立銀行	9,000	275.00	2,475,000	
福井銀行	6,000	209.00	1,254,000	
北國銀行	8,000	347.00	2,776,000	
清水銀行	200	2,707.00	541,400	
滋賀銀行	7,000	522.00	3,654,000	
南都銀行	7,000	382.00	2,674,000	
百五銀行	6,000	392.00	2,352,000	
京都銀行	13,000	841.00	10,933,000	
紀陽銀行	2,800	1,287.00	3,603,600	
三重銀行	3,000	200.00	600,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	48,000	201.00	9,648,000	
広島銀行	21,000	416.00	8,736,000	
山陰合同銀行	4,000	710.00	2,840,000	
中国銀行	5,300	1,374.00	7,282,200	

鳥取銀行	2,000	186.00	372,000	
伊予銀行	7,000	1,004.00	7,028,000	
百十四銀行	8,000	356.00	2,848,000	
四国銀行	5,000	224.00	1,120,000	
阿波銀行	6,000	507.00	3,042,000	
鹿児島銀行	5,000	651.00	3,255,000	
大分銀行	4,000	364.00	1,456,000	
宮崎銀行	5,000	282.00	1,410,000	
肥後銀行	6,000	548.00	3,288,000	
佐賀銀行	4,000	204.00	816,000	
十八銀行	4,000	225.00	900,000	
沖縄銀行	500	3,620.00	1,810,000	
琉球銀行	1,300	1,068.00	1,388,400	
八千代銀行	300	2,617.00	785,100	
セブン銀行	26,300	356.00	9,362,800	
みずほフィナンシャルグループ	910,500	205.00	186,652,500	
山口フィナンシャルグループ	7,000	939.00	6,573,000	
長野銀行	3,000	174.00	522,000	
名古屋銀行	6,000	335.00	2,010,000	
北洋銀行	10,500	394.00	4,137,000	
愛知銀行	200	4,325.00	865,000	
第三銀行	4,000	157.00	628,000	
中京銀行	3,000	176.00	528,000	
東日本銀行	3,000	216.00	648,000	
大光銀行	2,000	215.00	430,000	
愛媛銀行	4,000	236.00	944,000	
トマト銀行	3,000	172.00	516,000	
みなと銀行	6,000	169.00	1,014,000	
京葉銀行	6,000	493.00	2,958,000	
関西アーバン銀行	10,000	113.00	1,130,000	
栃木銀行	4,000	389.00	1,556,000	
北日本銀行	200	2,410.00	482,000	
東和銀行	9,000	91.00	819,000	
福島銀行	9,000	84.00	756,000	
大東銀行	5,000	101.00	505,000	

トモニホールディングス	5,400	382.00	2,062,800
フィデアホールディングス	4,200	191.00	802,200
池田泉州ホールディングス	5,200	476.00	2,475,200
F P G	500	1,027.00	513,500
S B Iホールディングス	8,500	1,221.00	10,378,500
ジャフコ	1,000	4,930.00	4,930,000
大和証券グループ本社	70,000	897.00	62,790,000
野村ホールディングス	143,900	724.00	104,183,600
岡三証券グループ	5,000	818.00	4,090,000
丸三証券	2,100	799.00	1,677,900
東洋証券	3,000	335.00	1,005,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	7,400	793.00	5,868,200
光世証券	2,000	256.00	512,000
水戸証券	2,000	458.00	916,000
いちよし証券	1,400	1,364.00	1,909,600
松井証券	3,600	1,039.00	3,740,400
だいこう証券ビジネス	500	664.00	332,000
マネックスグループ	7,400	343.00	2,538,200
カブドットコム証券	2,800	493.00	1,380,400
極東証券	900	1,686.00	1,517,400
岩井コスモホールディングス	700	1,215.00	850,500
マネーパートナーズグループ	600	275.00	165,000
小林洋行	300	265.00	79,500
N K S Jホールディングス	15,600	2,503.00	39,046,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	21,100	2,514.00	53,045,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	6,700	1,760.00	11,792,000
第一生命保険	35,500	1,390.00	49,345,000
東京海上ホールディングス	27,300	3,140.00	85,722,000
T & Dホールディングス	24,100	1,187.00	28,606,700
全国保証	800	4,080.00	3,264,000
クレディセゾン	5,800	2,575.00	14,935,000
芙蓉総合リース	700	4,065.00	2,845,500
興銀リース	1,200	2,845.00	3,414,000
東京センチュリーリース	1,700	3,340.00	5,678,000
日本証券金融	3,100	690.00	2,139,000

アイフル	12,800	440.00	5,632,000	
ポケットカード	700	845.00	591,500	
リコーリース	500	2,843.00	1,421,500	
イオンフィナンシャルサービス	4,100	2,800.00	11,480,000	
アコム	14,200	357.00	5,069,400	
ジャックス	4,000	446.00	1,784,000	
オリエントコーポレーション	15,600	243.00	3,790,800	
日立キャピタル	1,400	2,632.00	3,684,800	
アプラスフィナンシャル	1,700	148.00	251,600	
オリックス	42,700	1,679.00	71,693,300	
三菱UFJリース	17,800	564.00	10,039,200	
日本取引所グループ	10,300	2,250.00	23,175,000	
イー・ギャランティ	200	2,208.00	441,600	
アサックス	200	1,327.00	265,400	
NECキャピタルソリューション	200	2,398.00	479,600	
日本駐車場開発	78	7,230.00	563,940	
ヒューリック	11,800	1,576.00	18,596,800	
東京建物不動産販売	300	453.00	135,900	
三栄建築設計	200	825.00	165,000	
野村不動産ホールディングス	4,600	2,443.00	11,237,800	
常和ホールディングス	300	2,933.00	879,900	
フージャースホールディングス	1,000	766.00	766,000	
東急不動産ホールディングス	17,100	943.00	16,125,300	
飯田グループホールディングス	3,104	2,017.00	6,260,768	
パーク24	3,700	1,896.00	7,015,200	
三井不動産	33,000	3,210.00	105,930,000	
三菱地所	49,000	2,768.00	135,632,000	
平和不動産	1,400	1,680.00	2,352,000	
東京建物	14,000	918.00	12,852,000	
ダイビル	2,100	1,260.00	2,646,000	
京阪神ビルディング	1,200	540.00	648,000	
住友不動産	17,000	4,580.00	77,860,000	
大京	12,000	276.00	3,312,000	
テーオーシー	2,400	778.00	1,867,200	
東京楽天地	1,000	486.00	486,000	

レオパレス21	6,700	648.00	4,341,600	
フジ住宅	1,000	647.00	647,000	
空港施設	900	825.00	742,500	
明和地所	500	454.00	227,000	
住友不動産販売	500	3,110.00	1,555,000	
ゴールドクレスト	600	2,720.00	1,632,000	
日本エスリード	400	1,047.00	418,800	
日神不動産	500	785.00	392,500	
タカラレーベン	2,500	412.00	1,030,000	
サンヨーハウジング名古屋	400	1,194.00	477,600	
イオンモール	4,600	2,826.00	12,999,600	
ファースト住建	100	1,446.00	144,600	
トーセイ	1,000	743.00	743,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	4,400	1,224.00	5,385,600	
サンフロンティア不動産	700	1,103.00	772,100	
ランドビジネス	500	429.00	214,500	
グランディハウス	500	344.00	172,000	
日本空港ビルデング	2,400	2,103.00	5,047,200	
日本工営	3,000	454.00	1,362,000	
ネクスト	200	3,400.00	680,000	
日本M&Aセンター	400	7,610.00	3,044,000	
ノバレーゼ	100	706.00	70,600	
アコーディア・ゴルフ	3,000	1,139.00	3,417,000	
タケエイ	500	1,501.00	750,500	
パソナグループ	8	75,700.00	605,600	
リンクアンドモチベーション	8	30,250.00	242,000	
GCAサヴィアン	500	1,035.00	517,500	
エス・エム・エス	400	2,080.00	832,000	
テンプホールディングス	1,700	2,835.00	4,819,500	
リニカル	200	1,144.00	228,800	
クックパッド	400	3,345.00	1,338,000	
エスクリ	200	927.00	185,400	
アイ・ケイ・ケイ	100	758.00	75,800	
学情	400	850.00	340,000	
スタジオアリス	300	1,302.00	390,600	

シミックホールディングス	300	1,179.00	353,700	
NECフィールドینگ	600	1,097.00	658,200	
総合警備保障	2,700	1,917.00	5,175,900	
カカコム	4,500	1,982.00	8,919,000	
ルネサンス	400	742.00	296,800	
ツクイ	800	1,039.00	831,200	
総合臨床ホールディングス	200	575.00	115,000	
キャリアデザインセンター	2	108,000.00	216,000	
エムスリー	24	251,700.00	6,040,800	
ベストプライダル	200	681.00	136,200	
日本E R I	100	1,225.00	122,500	
アウトソーシング	300	905.00	271,500	
ディー・エヌ・エー	4,000	2,070.00	8,280,000	
博報堂D Yホールディングス	10,200	749.00	7,639,800	
ぐるなび	500	2,203.00	1,101,500	
一休	6	144,700.00	868,200	
P G Mホールディングス	1,100	959.00	1,054,900	
バリューコマース	400	1,621.00	648,400	
J Pホールディングス	1,300	423.00	549,900	
イーピーエス	8	104,400.00	835,200	
アミューズ	200	1,852.00	370,400	
ドリームインキュベータ	4	181,000.00	724,000	
T A C	300	335.00	100,500	
ケネディクス	8,700	505.00	4,393,500	
電通	7,000	3,655.00	25,585,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	300	1,828.00	548,400	
ぴあ	200	1,687.00	337,400	
イオンファンタジー	200	1,533.00	306,600	
みらかホールディングス	1,900	4,475.00	8,502,500	
アルプス技研	500	1,056.00	528,000	
サニックス	1,100	1,053.00	1,158,300	
ダイオーズ	200	717.00	143,400	
オリエンタルランド	2,000	15,430.00	30,860,000	
ダスキン	2,000	1,966.00	3,932,000	
明光ネットワークジャパン	700	1,089.00	762,300	

ファルコSDホールディングス	400	1,284.00	513,600	
秀英予備校	200	327.00	65,400	
田谷	100	766.00	76,600	
ラウンドワン	2,100	520.00	1,092,000	
リゾートトラスト	1,300	3,570.00	4,641,000	
ピー・エム・エル	500	3,290.00	1,645,000	
ワタベウェディング	200	663.00	132,600	
もしもしホットライン	1,400	1,166.00	1,632,400	
リソー教育	900	637.00	573,300	
早稲田アカデミー	100	748.00	74,800	
ユー・エス・エス	9,100	1,442.00	13,122,200	
東京個別指導学院	600	237.00	142,200	
セントラルスポーツ	200	1,514.00	302,800	
リゾートソリューション	1,000	223.00	223,000	
リブセンス	200	4,805.00	961,000	
リロ・ホールディング	300	4,585.00	1,375,500	
エイチ・アイ・エス	600	5,120.00	3,072,000	
共立メンテナンス	400	3,840.00	1,536,000	
イチネンホールディングス	700	683.00	478,100	
建設技術研究所	500	883.00	441,500	
スペース	400	876.00	350,400	
燦ホールディングス	100	1,380.00	138,000	
スバル興業	1,000	374.00	374,000	
東京テアトル	3,000	160.00	480,000	
よみうりランド	2,000	731.00	1,462,000	
東京都競馬	6,000	400.00	2,400,000	
常磐興産	2,000	167.00	334,000	
カナモト	1,000	2,554.00	2,554,000	
東京ドーム	5,000	676.00	3,380,000	
西尾レントオール	400	2,634.00	1,053,600	
トランス・コスモス	1,000	1,722.00	1,722,000	
乃村工藝社	1,000	832.00	832,000	
藤田観光	2,000	418.00	836,000	
KNT-CTホールディングス	3,000	155.00	465,000	
日本管財	300	1,825.00	547,500	

トーカイ	300	2,527.00	758,100	
白洋舎	1,000	239.00	239,000	
セコム	7,800	5,900.00	46,020,000	
セントラル警備保障	400	924.00	369,600	
丹青社	1,000	660.00	660,000	
メイテック	1,000	2,800.00	2,800,000	
アサツー ディ・ケイ	1,300	2,636.00	3,426,800	
応用地質	700	1,588.00	1,111,600	
船井総合研究所	800	799.00	639,200	
進学会	500	394.00	197,000	
ベネッセホールディングス	2,500	3,705.00	9,262,500	
イオンディライト	700	1,906.00	1,334,200	
ナック	400	1,708.00	683,200	
ニチイ学館	1,600	947.00	1,515,200	
ダイセキ	1,100	1,904.00	2,094,400	
ステップ	200	829.00	165,800	
合 計	11,402,019		11,933,040,118	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2013年11月29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	12,548,945,569円
負債総額	40,345,230円
純資産総額（ - ）	12,508,600,339円
発行済口数	24,016,555,612口
1口当たり純資産額（ / ）	0.5208円

【バランスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	403,871,921円
負債総額	425,012円
純資産総額（ - ）	403,446,909円
発行済口数	485,744,543口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8306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	12,767,849,839円
負債総額	53,468,793円
純資産総額（ - ）	12,714,381,046円
発行済口数	11,172,228,530口
1口当たり純資産額（ / ）	1.138円

第4【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、
- ・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。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

平成25年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減

年月日	変更後（変更前）
平成21年10月1日	17,363,045,900円（16,403,045,900円）

(2) 会社の意思決定機関（平成25年11月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（平成25年11月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成25年11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	464	95,929
株式投資信託	404	73,974
単体型	45	935
追加型	359	73,038
公社債投資信託	60	21,955
単体型	44	445
追加型	16	21,509
投資法人合計	1	84

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定により、「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54期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

なお、当社の監査法人は次のとおり、交代しております。

第53期事業年度 あらた監査法人

第54期事業年度 有限責任 あずさ監査法人

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第53期 (平成24年3月31日)		第54期 (平成25年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	17,352	3	15,820
前払費用		332	3	380
未収入金		1		4
未収委託者報酬		5,872		7,472
未収収益	3	543	3	342
関係会社短期貸付金		33		606
立替金		1,094		335
繰延税金資産		1,084		869
その他	2	30	2	30
流動資産合計		26,345		25,862
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	66	1	48
器具備品	1	137	1	124
有形固定資産合計		203		172
無形固定資産				
ソフトウェア		72		70
無形固定資産合計		72		70
投資その他の資産				

投資有価証券	3,002	7,170
関係会社株式	24,320	22,935
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	774	706
繰延税金資産	723	500
投資その他の資産合計	28,880	31,373
固定資産合計	29,156	31,616
資産合計	55,502	57,478

(単位：百万円)

	第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	194	305
未払金	3,086	3,862
未払収益分配金	7	6
未払償還金	129	115
未払手数料	3 2,486	3 3,195
その他未払金	462	545
未払費用	3 2,807	3 3,282
未払法人税等	1,295	589
未払消費税等	4 281	4 123
賞与引当金	2,039	1,770
役員賞与引当金	105	80
流動負債合計	9,809	10,012
固定負債		
退職給付引当金	907	1,001
その他	55	55
固定負債合計	963	1,057
負債合計	10,773	11,070
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	22,172	23,530
利益剰余金合計	22,172	23,530
自己株式	68	68
株主資本合計	44,687	46,045
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	42	362
評価・換算差額等合計	42	362

純資産合計	44,729	46,408
負債純資産合計	55,502	57,478

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	56,698	52,848
その他営業収益	2,025	1,922
営業収益合計	58,724	54,771
営業費用		
支払手数料	29,251	26,955
広告宣伝費	673	649
公告費	3	7
調査費	11,397	10,797
調査費	719	691
委託調査費	10,660	10,089
図書費	18	17
委託計算費	348	406
営業雑経費	577	530
通信費	206	188
印刷費	247	214
協会費	43	46
諸会費	9	16
その他	70	64
営業費用計	42,252	39,347
一般管理費		
給料	6,991	6,759
役員報酬	237	256
役員賞与引当金繰入額	105	80
給料・手当	4,508	4,565
賞与	101	87
賞与引当金繰入額	2,039	1,770
交際費	74	100
寄付金	111	66
旅費交通費	328	313
租税公課	145	188
不動産賃借料	749	753
退職給付費用	307	312
退職金	8	83
固定資産減価償却費	143	124
諸経費	3,110	3,061
一般管理費計	11,971	11,764
営業利益	4,500	3,659

(単位：百万円)

	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業外収益		

受取利息		15		12
受取配当金	1	757	1	601
有価証券償還益		19		-
時効成立分配金・償還金		35		4
為替差益		-		64
その他		18		16
営業外収益合計		846		699
営業外費用				
支払利息		10		19
有価証券償還損		-		1
時効成立後支払分配金・償還金		77		15
支払源泉所得税		74		55
為替差損		35		-
弁護士報酬等		180		-
その他		4		2
営業外費用合計		381		93
経常利益		4,965		4,265
特別利益				
投資有価証券売却益		1		226
関係会社株式売却益		-		239
特別利益合計		1		465
特別損失				
投資有価証券売却損		0		84
固定資産処分損		6		3
役員退職一時金		369		75
特別損失合計		376		163
税引前当期純利益		4,590		4,568
法人税、住民税及び事業税		1,795		1,480
法人税等調整額		224		260
法人税等合計		2,020		1,740
当期純利益		2,570		2,827

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	第53期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日)	第54期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月 31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	17,363	17,363
当期末残高	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	5,220	5,220
当期末残高	5,220	5,220
その他資本剰余金		
当期首残高	4	-
当期変動額		

自己株式の処分	4	-
当期変動額合計	4	-
当期末残高	-	-
資本剰余金合計		
当期首残高	5,225	5,220
当期変動額		
自己株式の処分	4	-
当期変動額合計	4	-
当期末残高	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	21,703	22,172
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
自己株式の処分	599	-
当期変動額合計	468	1,358
当期末残高	22,172	23,530
利益剰余金合計		
当期首残高	21,703	22,172
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
自己株式の処分	599	-
当期変動額合計	468	1,358
当期末残高	22,172	23,530

(単位：百万円)

	第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月 31日)	第54期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月 31日)
自己株式		
当期首残高	68	68
当期変動額		
自己株式の取得	8,700	-
自己株式の処分	8,700	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	68	68
株主資本合計		
当期首残高	44,224	44,687
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
自己株式の取得	8,700	-
自己株式の処分	8,095	-
当期変動額合計	463	1,358
当期末残高	44,687	46,045
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		

当期首残高	63	42
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	21	320
当期変動額合計	21	320
当期末残高	42	362
評価・換算差額等合計		
当期首残高	63	42
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	21	320
当期変動額合計	21	320
当期末残高	42	362
純資産合計		
当期首残高	44,287	44,729
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
自己株式の取得	8,700	-
自己株式の処分	8,095	-
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	21	320
当期変動額合計	441	1,678
当期末残高	44,729	46,408

重要な会計方針

項目	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25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
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とおりであります。 建物 4年～5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。
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。

4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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。</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、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。</p> <p>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。</p>
---------------------------	--

会計方針の変更

<p>第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)</p>
<p>(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。 この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。</p>

未適用の会計基準等

1. 「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）
- (1) 概要
当該会計基準等は、財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、主に 未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法を変更し、開示項目を拡充するほか、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を改正するものであります。
- (2) 適用予定日
当社は については、平成25年4月1日に開始する事業年度の年度末に係る財務諸表から適用し、については、平成26年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。
- (3) 当該会計基準等の適用による影響
当該会計基準等の適用による影響は、現在評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)								
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">1,012百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">590百万円</td> </tr> </table>	建物	1,012百万円	器具備品	590百万円	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">1,054百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">618百万円</td> </tr> </table>	建物	1,054百万円	器具備品	618百万円
建物	1,012百万円								
器具備品	590百万円								
建物	1,054百万円								
器具備品	618百万円								
<p>2 信託資産 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、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>2 信託資産 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、野村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とおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 5,802百万円</p> <p>未収収益 217百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 42百万円</p> <p>未払費用 259百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務110百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務138百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,818百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 58百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 143百万円</p> <p>未払費用 297百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務87百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務243百万円に対して保証を行っております。</p>
---	---

(損益計算書関係)

第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	第54期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25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、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 743百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 552百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第53期（自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	109,600	14,283,400	14,283,400	109,600

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であり、自己株式の減少は、自己株式の処分であります。

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	19,328,100	-	112,200	19,215,900	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,702,800	-	26,400	1,676,400	-

平成22年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	-	2,955,200	-	2,955,200	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	6,101,700	9,900	6,091,800	-
合計		23,340,900	9,056,900	148,500	32,249,300	-

- (注) 1 平成21年度ストックオプション(1)及び平成21年度ストックオプション(2)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
- 2 第1回新株予約権の増加は、新株予約権の発行によるものであります。第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。
- 3 平成23年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであり、減少は新株予約権の失効によるものであります。
- 4 平成21年度ストックオプション(1)9,837,300株、平成21年度ストックオプション(2)871,200株、平成22年度ストックオプション(1)1,155,000株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成23年5月23日 取締役会	普通株式	1,502	7.63	平成23年3月31日	平成23年6月22日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が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24年5月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,468	7.46	平成24年3月31日	平成24年6月19日

第54期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	109,600	-	-	109,600

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	19,215,900	-	2,237,400	16,978,500	-

平成21年度 ストックオプション（2）	普通株式	1,676,400	-	49,500	1,626,900	-
平成22年度 ストックオプション（1）	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度 ストックオプション（1）	普通株式	6,091,800	-	161,700	5,930,100	-
合計		32,249,300	-	2,448,600	29,800,700	-

- (注) 1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)及び平成23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。
- 2 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。
- 3 平成21年度ストックオプション(1)13,625,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,287,000株、平成22年度ストックオプション(1)1,732,500株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年5月28日 取締役会	普通株式	1,468	7.46	平成24年3月31日	平成24年6月19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25年5月27日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18日

(リース取引関係)

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	740百万円	1年内	750百万円
1年超	1,548百万円	1年超	807百万円
合計	2,288百万円	合計	1,558百万円

(金融商品関係)

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等によ

る信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬、未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻または債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されております。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金を預入れる金融機関の選定に関しては、短期間の取引が想定される金融機関の場合を除き、相手方の財政状態及び経営成績、または必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また投資有価証券に関しては、毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュエーション・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。これらの結果、当社の財政状態、経営成績に与える影響が著しいと判断される場合には、必要に応じて、ヘッジ取引規程に則り、それを回避する目的で、ヘッジ取引を行うことが可能であります。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金及び預金	17,352	17,352	-
(2) 未収委託者報酬	5,872	5,872	-
(3) 未収収益	543	543	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	2,854	2,854	-
(5) 関係会社株式 関連会社株式	1,404	1,615	210
(6) 未払金	(3,086)	(3,086)	-
(7) 未払費用	(2,807)	(2,807)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額147百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額20,023百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)関係会社株式」には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	17,352	-	-	-
未収委託者報酬	5,872	-	-	-
未収収益	543	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	362	479	439
合計	23,768	362	479	439

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬、未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻または債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されております。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金を預入れる金融機関の選定に関しては、短期間の取引が想定される金融機関の場合を除き、相手方の財政状態及び経営成績、または必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また投資有価証券に関しては、毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュエーション・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。これらの結果、当社の財政状態、経営成績に与える影響が著しいと判断される場合には、必要に応じて、ヘッジ取引規程に則り、それを回避する目的で、ヘッジ取引を行うことが可能であります。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成25年3月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金及び預金	15,820	15,820	-
(2) 未収委託者報酬	7,472	7,472	-
(3) 未収収益	342	342	-
(4) 投資有価証券			
その他有価証券	7,091	7,091	-
(5) 未払金	(3,862)	(3,862)	-
(6) 未払費用	(3,282)	(3,282)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額79百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額20,042百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	15,820	-	-	-
未収委託者報酬	7,472	-	-	-
未収収益	342	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	385	1,299	920
合計	23,635	385	1,299	920

（有価証券関係）

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
関連会社株式	1,404	1,615	210
合計	1,404	1,615	210

（注）

時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,023
関連会社株式	2,892

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

2 その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	株式	35	7	28
	その他	1,177	999	177
	小計	1,212	1,006	206
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	その他	1,642	1,784	141
	小計	1,642	1,784	141
	合計	2,854	2,790	64

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 147百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	112	1	0
合計	112	1	0

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく時価を把握することが極めて困難と認められるため、子会社株式及び関連会社株式の時価を記載しておりません。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額は次のとおりです。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,042
関連会社株式	2,892

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他	6,366	5,708	658
	小計	6,366	5,708	658
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	724	821	96
	小計	724	821	96
合計		7,091	6,529	561

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 79百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	43	35	67
投資信託	1,099	190	17
合計	1,143	226	84

(持分法損益等)

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25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 4,407	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,069
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,834	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,280
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 927	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,159

（退職給付関係）

第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	第54期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)																																																
<p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバ ランスプラン型退職金制度を設けております。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table> <tr><td>イ 退職給付債務</td><td>985</td></tr> <tr><td>ロ 未積立退職給付債務</td><td>985</td></tr> <tr><td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td>77</td></tr> <tr><td>ニ 退職給付引当金残高</td><td>907</td></tr> </table> <p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table> <tr><td>イ 勤務費用</td><td>97</td></tr> <tr><td>ロ 利息費用</td><td>14</td></tr> <tr><td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td>27</td></tr> <tr><td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td>168</td></tr> <tr><td>ホ 退職給付費用合計</td><td>307</td></tr> </table> <p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table> <tr><td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td>勤続期間比例</td></tr> <tr><td>ロ 割引率</td><td>1.4%</td></tr> <tr><td>ハ 数理計算上の差異の処理年数</td><td>10年</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	985	ロ 未積立退職給付債務	985	ハ 未認識数理計算上の差異	77	ニ 退職給付引当金残高	907	イ 勤務費用	97	ロ 利息費用	14	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168	ホ 退職給付費用合計	307	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	1.4%	ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年	<p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバ ランスプラン型退職金制度を設けております。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table> <tr><td>イ 退職給付債務</td><td>1,101</td></tr> <tr><td>ロ 未積立退職給付債務</td><td>1,101</td></tr> <tr><td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td>99</td></tr> <tr><td>ニ 退職給付引当金残高</td><td>1,001</td></tr> </table> <p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table> <tr><td>イ 勤務費用</td><td>102</td></tr> <tr><td>ロ 利息費用</td><td>13</td></tr> <tr><td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td>24</td></tr> <tr><td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td>171</td></tr> <tr><td>ホ 退職給付費用合計</td><td>312</td></tr> </table> <p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table> <tr><td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td>勤続期間比例</td></tr> <tr><td>ロ 割引率</td><td>0.9%</td></tr> <tr><td>ハ 数理計算上の差異の処理年数</td><td>10年</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	1,101	ロ 未積立退職給付債務	1,101	ハ 未認識数理計算上の差異	99	ニ 退職給付引当金残高	1,001	イ 勤務費用	102	ロ 利息費用	13	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	24	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	171	ホ 退職給付費用合計	312	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	0.9%	ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年
イ 退職給付債務	985																																																
ロ 未積立退職給付債務	985																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	77																																																
ニ 退職給付引当金残高	907																																																
イ 勤務費用	97																																																
ロ 利息費用	14																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168																																																
ホ 退職給付費用合計	307																																																
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	1.4%																																																
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																
イ 退職給付債務	1,101																																																
ロ 未積立退職給付債務	1,101																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	99																																																
ニ 退職給付引当金残高	1,001																																																
イ 勤務費用	102																																																
ロ 利息費用	13																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	24																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	171																																																
ホ 退職給付費用合計	312																																																
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	0.9%																																																
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																

（ストックオプション等関係）

第53期(自 平成23年 4月 1日 至 平成24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)ストックオプション(新株予約権)の内容

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

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)

付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年 8月20日	平成23年10月7日
権利確定条件	平成24年 1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月 7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年 1月22日から 平成32年 1月21日まで	平成25年10月 7日から 平成33年10月 6日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

（2）ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年 2月 8日	平成22年 8月20日
権利確定前(株)		
期首	19,328,100	1,702,800
付与	0	0
失効	112,200	26,400
権利確定	0	0
権利未確定残	19,215,900	1,676,400
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22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8月20日	平成23年10月 7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	-
付与	0	6,101,700
失効	0	9,900
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	6,091,800
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。

単価情報

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

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8 月20日	平成23年10月7日
権利行使価格(円)	625	737 (注) 3
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

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

第54期(自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25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21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年 2 月 8 日	平成22年 8 月20日
権利確定条件	平成24年 1 月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年 1 月22日から 平成32年 1 月21日まで	同左

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定条件	平成24年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から平成32年1月21日まで	平成25年10月7日から平成33年10月6日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) スtock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21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	19,215,900	1,676,400
付与	0	0
失効	2,237,400	49,500
権利確定	0	0
権利未確定残	16,978,500	1,626,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	6,091,800
付与	0	0
失効	0	161,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,930,100
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。

単価情報

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

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8 月20日	平成23年10月7日
権利行使価格(円)	625	737 (注) 3
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

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

(税効果会計関係)

第53期 (平成24年 3 月31日)	第54期 (平成25年 3 月31日)
------------------------	------------------------

第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25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%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">775</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">309</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,084</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">52</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">205</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">329</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">190</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">28</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">806</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right;">1,890</td> </tr> <tr> <td>評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">61</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,829</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">22</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">22</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,807</td> </tr> </table> <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%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">40.6%</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;">2.5%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">5.6%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">3.8%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">2.7%</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;">44.0%</td> </tr> </table>	賞与引当金繰入超過額	775	その他	309	小計	1,084	投資有価証券評価損	52	関係会社株式評価損	205	退職給付引当金超過額	329	固定資産減価償却超過額	190	その他	28	小計	806		1,890	評価性引当金	61	繰延税金資産合計	1,829	その他有価証券評価差額金	22	繰延税金負債合計	22		1,807	法定実効税率 (調整)	40.6%	交際費等永久に損金に算入されない項目	2.5%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.8%	海外子会社の留保利益の影響額等	2.7%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.0%	<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%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">672</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">196</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">869</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">149</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">361</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">174</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">75</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">760</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right;">1,630</td> </tr> <tr> <td>評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">61</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,568</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">199</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">199</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,369</td> </tr> </table> <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100分の5以下であるため注記を省略しております。</p>	賞与引当金繰入超過額	672	その他	196	小計	869	投資有価証券評価損	149	退職給付引当金超過額	361	固定資産減価償却超過額	174	その他	75	小計	760		1,630	評価性引当金	61	繰延税金資産合計	1,568	その他有価証券評価差額金	199	繰延税金負債合計	199		1,369
賞与引当金繰入超過額	775																																																																						
その他	309																																																																						
小計	1,084																																																																						
投資有価証券評価損	52																																																																						
関係会社株式評価損	205																																																																						
退職給付引当金超過額	329																																																																						
固定資産減価償却超過額	190																																																																						
その他	28																																																																						
小計	806																																																																						
	1,890																																																																						
評価性引当金	61																																																																						
繰延税金資産合計	1,829																																																																						
その他有価証券評価差額金	22																																																																						
繰延税金負債合計	22																																																																						
	1,807																																																																						
法定実効税率 (調整)	40.6%																																																																						
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.5%																																																																						
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%																																																																						
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.8%																																																																						
海外子会社の留保利益の影響額等	2.7%																																																																						
税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.0%																																																																						
賞与引当金繰入超過額	672																																																																						
その他	196																																																																						
小計	869																																																																						
投資有価証券評価損	149																																																																						
退職給付引当金超過額	361																																																																						
固定資産減価償却超過額	174																																																																						
その他	75																																																																						
小計	760																																																																						
	1,630																																																																						
評価性引当金	61																																																																						
繰延税金資産合計	1,568																																																																						
その他有価証券評価差額金	199																																																																						
繰延税金負債合計	199																																																																						
	1,369																																																																						

第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)
----------------------	----------------------

<p>3 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律及び東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法が平成23年12月2日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算（ただし、平成24年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の40.6%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成24年4月1日から平成27年3月31日までのものは38.0%、平成27年4月1日以降のものについては35.6%にそれぞれ変更されております。</p> <p>その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債を控除した金額）が170百万円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が174百万円、その他有価証券評価差額金額が4百万円、それぞれ増加しております。</p>	
---	--

（関連当事者情報）

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

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)
親会社	住友信託銀行株式会社(注)3	大阪市中央区	342,037	信託銀行業	(被所有) 直接 91.34 (注)2	投資信託受益証券の募集販売	自己株式の取得(注)1	8,700	-	-

上記の金額のうち、取引金額には消費税が含まれておりません。

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 当社株式14,283,400株を1株につき609.10円で取得したものであります。
- 2 議決権等の被所有割合は、自己株式(109,600株)を控除して計算しております。
- 3 住友信託銀行株式会社は、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社及び中央三井アセット信託銀行株式会社を吸収合併し、三井住友信託銀行株式会社に社名を変更しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千SGD)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	252,000	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	増資の引受(注)1	8,095	-	-
							株式売買代金相当額の引受(注)2	8,095	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 Nikko Asset Management Singapore Limitedの行った137,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。なお、Nikko Asset Management Singapore Limitedは、当事業年度中にNikko Asset Management International Limited に社名を変更しております。
- 2 DBS Asset Management Ltd（現社名Nikko Asset Management Asia Limited）株式の売買代金相当額をNikko Asset Management Singapore Limited（現社名Nikko Asset Management International Limited）から当社が受領したものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成23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	9,309百万円
負債合計	1,103百万円
純資産合計	8,206百万円

営業収益	7,961百万円
税引前当期純利益	2,868百万円
当期純利益	2,181百万円

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金は出資金(千SGD)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	252,000	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	525 (千SGD8,000)	関係会社短期貸付	606 (千SGD8,000)
							貸付利息(シンガポールドル貸建)(注1)	5 (千SGD76)	未収収益	5 (千SGD76)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11百万、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

三井住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成24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	10,930百万円
負債合計	1,103百万円
純資産合計	9,826百万円

営業収益	7,917百万円
税引前当期純利益	2,801百万円
当期純利益	2,091百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

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

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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

関連情報

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	227円16銭	235円69銭
1株当たり当期純利益金額	13円09銭	14円35銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(百万円)	2,570	2,827
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	2,570	2,827
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,278	196,903

希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 19,215,900株、平成21年度ストックオプション(2) 1,676,400株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 6,091,800株	平成21年度ストックオプション(1) 16,978,500株、平成21年度ストックオプション(2) 1,626,900株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 5,930,100株
--	---	---

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	44,729	46,408
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	44,729	46,408
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	196,903	196,903

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

- 1 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
- 2 金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第55期中間会計期間(平成25年4月1日から平成25年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第55期中間会計期間 (平成25年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		16,689
未収委託者報酬		6,483
未収収益		570
関係会社短期貸付金		850
繰延税金資産		526
その他	2	786
流動資産合計		25,905
固定資産		
有形固定資産	1	192
無形固定資産		81
投資その他の資産		
投資有価証券		7,723
関係会社株式		22,935

関係会社長期貸付金	60
長期差入保証金	686
繰延税金資産	552
投資その他の資産合計	31,958
固定資産合計	32,233
資産合計	58,138

(単位：百万円)

第55期中間会計期間
(平成25年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		3,260
未払費用		3,331
未払法人税等		1,288
未払消費税等	3	266
賞与引当金		881
役員賞与引当金		170
その他		303
流動負債合計		9,501

固定負債

退職給付引当金		1,032
その他		55
固定負債合計		1,088

負債合計

10,590

純資産の部

株主資本

資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220

利益剰余金

その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		24,690
利益剰余金合計		24,690

自己株式 68

株主資本合計 47,206

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金 342

評価・換算差額等合計 342

純資産合計 47,548

負債純資産合計 58,138

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第55期中間会計期間
(自 平成25年 4月 1日
至 平成25年 9月30日)

営業収益		
委託者報酬		32,440
その他営業収益		1,179
営業収益合計		33,620
営業費用及び一般管理費	1	30,198
営業利益		3,421
営業外収益	2	822
営業外費用	3	89
経常利益		4,155
特別利益	4	56
特別損失	5	35
税引前中間純利益		4,175
法人税、住民税及び事業税		1,333
法人税等調整額		302
中間純利益		2,540

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

第55期中間会計期間
(自 平成25年 4月 1日
至 平成25年 9月30日)

株主資本		
資本金		
当期首残高		17,363
当中間期末残高		17,363
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高		5,220
当中間期末残高		5,220
資本剰余金合計		
当期首残高		5,220
当中間期末残高		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高		23,530
当中間期変動額		
剰余金の配当		1,380
中間純利益		2,540
当中間期変動額合計		1,160
当中間期末残高		24,690
利益剰余金合計		
当期首残高		23,530
当中間期変動額		
剰余金の配当		1,380
中間純利益		2,540
当中間期変動額合計		1,160
当中間期末残高		24,690

(単位：百万円)

第55期中間会計期間
(自 平成25年 4月 1日
至 平成25年 9月30日)

自己株式	
当期首残高	68
当中間期末残高	68
株主資本合計	
当期首残高	46,045
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,380
中間純利益	2,540
当中間期変動額合計	1,160
当中間期末残高	47,206
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	362
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)	19
当中間期変動額合計	19
当中間期末残高	342
評価・換算差額等合計	
当期首残高	362
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)	19
当中間期変動額合計	19
当中間期末残高	342
純資産合計	
当期首残高	46,408
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,380
中間純利益	2,540
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	19
当中間期変動額合計	1,140
当中間期末残高	47,548

重要な会計方針

項目	第55期中間会計期間 (自 平成25年 4月 1日 至 平成25年 9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	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>その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)</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 定額法により償却しております。なお、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、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</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、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</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)按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理することとしております。</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 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>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第55期中間会計期間 (平成25年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,700百万円
2 信託資産	<p>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、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>
3 消費税等の取扱い	<p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>
4 保証債務	<p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務78百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務202百万円に対して保証を行っております。</p>

(中間損益計算書関係)

第55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	34百万円
無形固定資産	11百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	11百万円
受取配当金	804百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	9百万円
時効成立後支払分配金・償還金	21百万円
支払源泉所得税	57百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	56百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
割増退職金	34百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第55期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	109,600	-	-	109,600

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会 計期間末 残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	16,978,500	-	1,059,300	15,919,200	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,626,900	-	42,900	1,584,000	-
平成22年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	5,930,100	-	468,600	5,461,500	-
合計		29,800,700	-	1,570,800	28,229,900	-

(注) 1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)及び平成23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。

- 2 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当中間会計期間末の発行済株式に基づき算出しております。
- 3 平成21年度ストックオプション(1)13,830,300株、平成21年度ストックオプション(2)1,287,000株、平成22年度ストックオプション(1)1,732,500株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成25年5月27日 取締役会	普通株式	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18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55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	744百万円
1年超	437百万円
合計	1,182百万円

(金融商品関係)

第55期中間会計期間(平成25年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金及び預金	16,689	16,689	-
(2) 未収委託者報酬	6,483	6,483	-
(3) 未収収益	570	570	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	7,643	7,643	-
(5) 未払金	(3,260)	(3,260)	-
(6) 未払費用	(3,331)	(3,331)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

- 2 非上場株式等（中間貸借対照表計上額79百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式（中間貸借対照表計上額20,042百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

(有価証券関係)

第55期中間会計期間(平成25年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	20,042
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	6,524	5,871	652
	小計	6,524	5,871	652
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,119	1,241	122
	小計	1,119	1,241	122
合計		7,643	7,113	530

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

- 2 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 79百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(持分法損益等)

第55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,073百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	6,686百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	635百万円

(ストックオプション等関係)

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
該当事項はありません。

(セグメント情報等)

セグメント情報

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

関連情報

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
1株当たり純資産額	241円48銭
1株当たり中間純利益金額	12円90銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

中間純利益（百万円）	2,540
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）	2,540
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 15,919,200株、平成21年度ストックオプション(2) 1,584,000株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1)5,461,500株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第55期中間会計期間 (平成25年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	47,548
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	47,548
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	196,903

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成25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25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25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。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
かざか証券株式会社	1,000百万円	

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、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

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

目論見書の使用開始日

(3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。

請求目論見書の入手方法(ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど)についての記載。

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。

(4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

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

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

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

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成25年12月11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	鶴 田	光 夫
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24年11月8日から平成25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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスポートフォリオの平成25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。

利害関係

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

以 上

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

2.財務諸表の範囲にはX B R 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25年12月11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	鶴 田	光 夫
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24年11月8日から平成25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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランスポートフォリオの平成25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。

利害関係

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

以 上

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

2. 財務諸表の範囲にはX B R 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25年6月14日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦
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24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成25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。

その他の事項

会社の平成24年3月31日をもって終了した前事業年度の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成24年6月15日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以 上

(注) 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。

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月6日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽太典明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 秋宗勝彦
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25年4月1日から平成26年3月31日までの第55期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成25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25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

（注）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。