

【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27年2月6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27年 2月 7日から平成28年 2月 9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。

(1 0) 【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。

(1 1) 【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。

(1 2) 【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			
債券	年4回	北米	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	
()			
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ
	その他	アフリカ	
()			
その他資産		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。

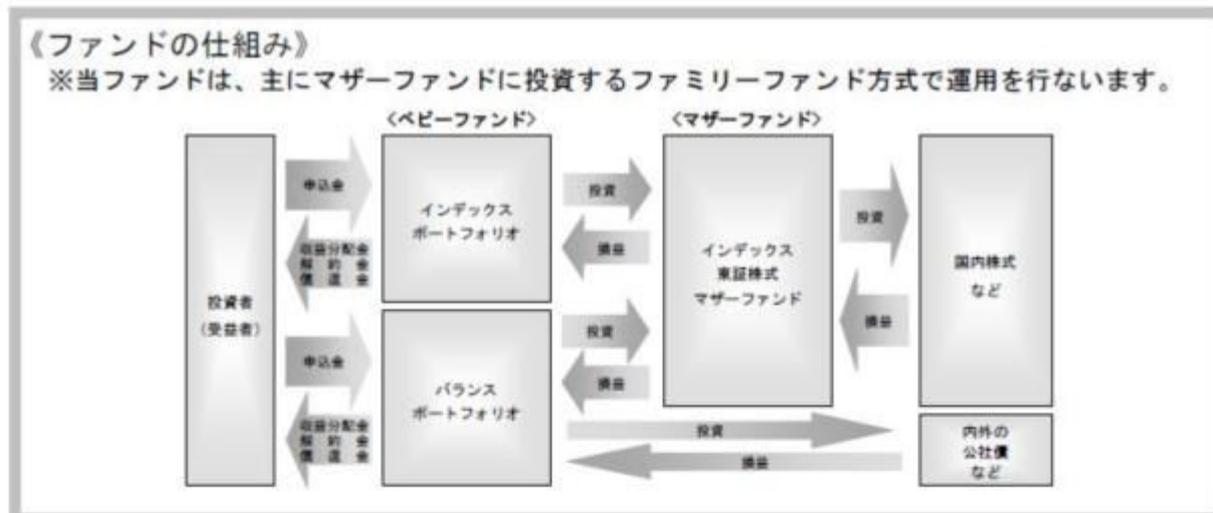
TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

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付けすることによって、一定量（口数）ずつ買付けした場合に比べて、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。

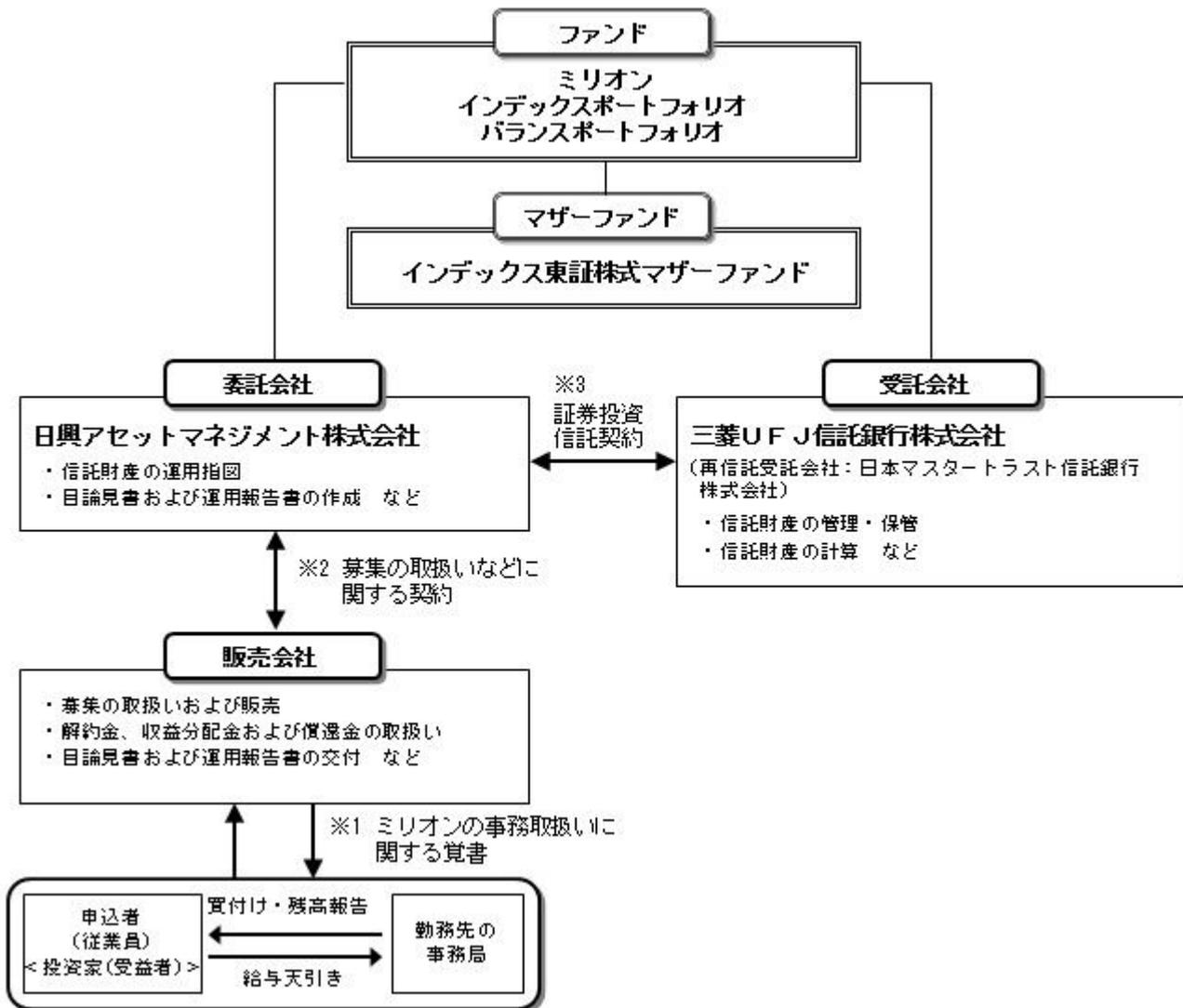
(2) 【ファンドの沿革】

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、ミリオンのお申込み・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26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です。)

- 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。)に限りです。)
- 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です。)
- 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です。)
- 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

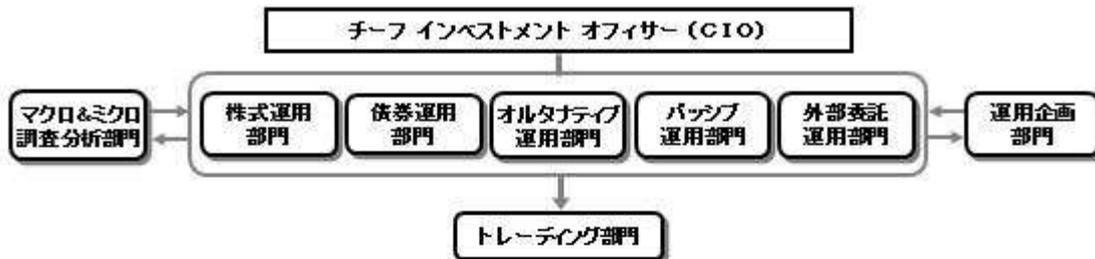
<インデックス東証株式マザーファンド>

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、バラ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ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

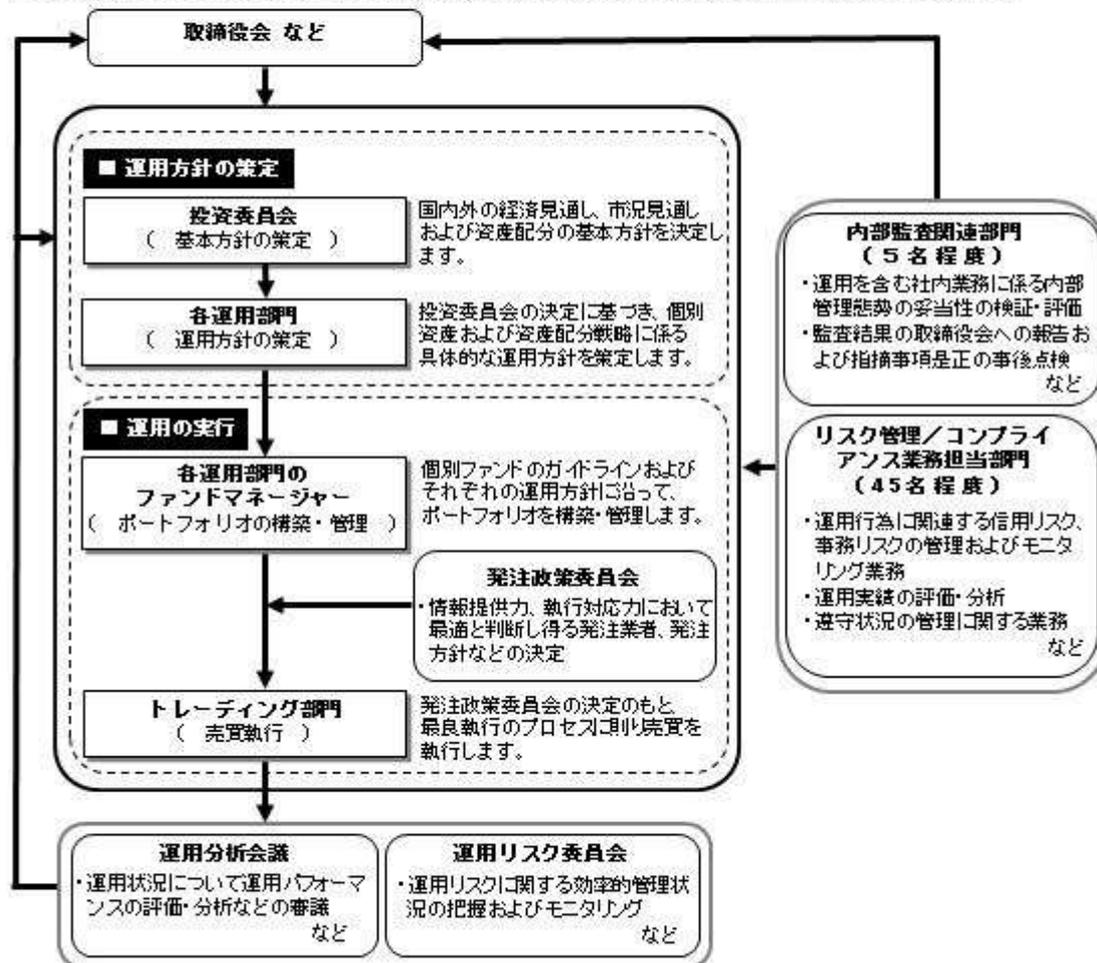
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
信託期間	無期限（昭和61年10月22日設定）
決算日	毎年10月21日（休業日の場合は翌営業日）

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は平成26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弁済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

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

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

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

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

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っていただく必要があります。

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

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）と基準価額の主なカイ離要因 >

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せん。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。

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

・解約によるファンドの資金流出に伴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・換金の取り扱いを停止する場合があります。

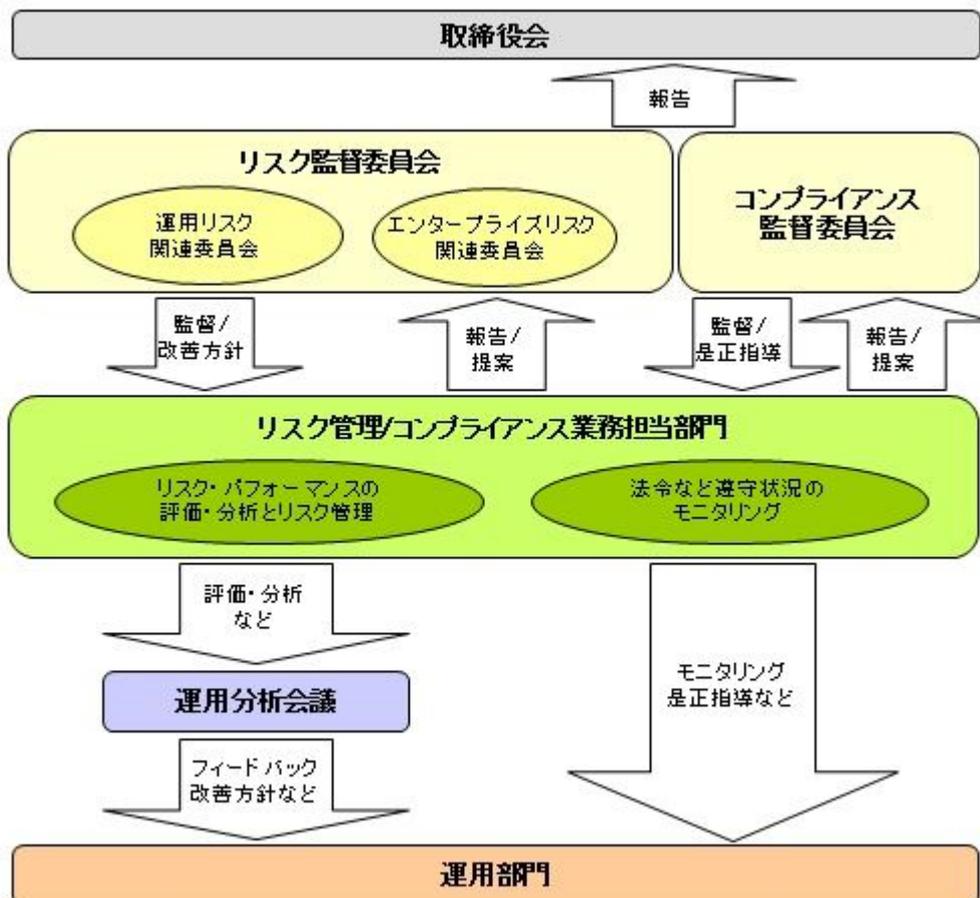
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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



全社リスク管理

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

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

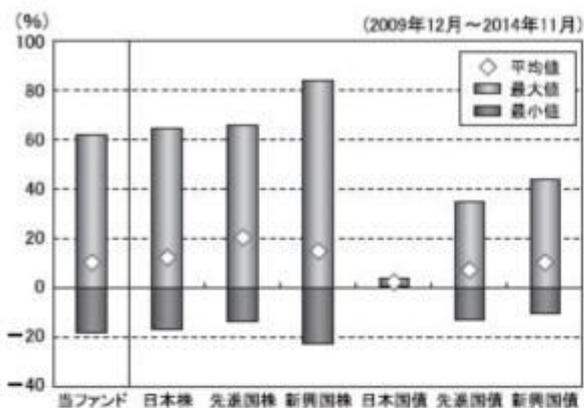
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行いません。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行いません。

上記体制は平成26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。

「インデックスポートフォリオ」

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	10.4%	12.3%	20.4%	14.9%	2.3%	7.3%	10.3%
最大値	62.2%	65.0%	65.7%	83.9%	4.1%	34.9%	43.7%
最小値	-18.2%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-12.7%	-10.1%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2009年12月から2014年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数（TOPIX、配当込）

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）

新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

日本国債……NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債

先進国債……シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。

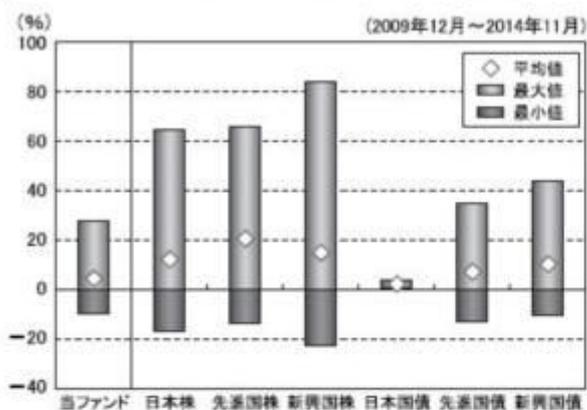
※分配金再投資基準価額は、2009年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）は、分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

「バランスポートフォリオ」

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	4.5%	12.3%	20.4%	14.9%	2.3%	7.3%	10.3%
最大値	27.8%	65.0%	65.7%	83.9%	4.1%	34.9%	43.7%
最小値	-9.5%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-12.7%	-10.1%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2009年12月から2014年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数（TOPIX、配当込）

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）

新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

日本国債……NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債

先進国債……シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数（TOPIX、配当込）

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

MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）

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

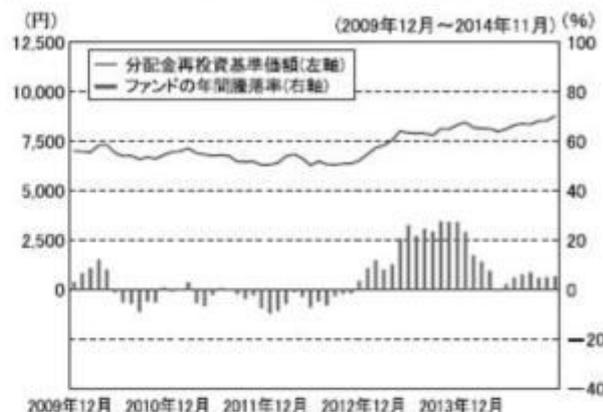
MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債

当指数は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2009年12月 2010年12月 2011年12月 2012年12月 2013年12月

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2009年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）は、分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLC に帰属します。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLC に帰属します。

4【手数料等及び税金】**（１）【申込手数料】**

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1.6416%（税抜1.52%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬（有価証券届出書提出日現在）の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.52%	0.34%	1.10%	0.08%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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>

- ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
- ・信託事務の処理に要する諸費用
- ・信託財産に関する租税 など

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

- * 監査費用、売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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せん。)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。

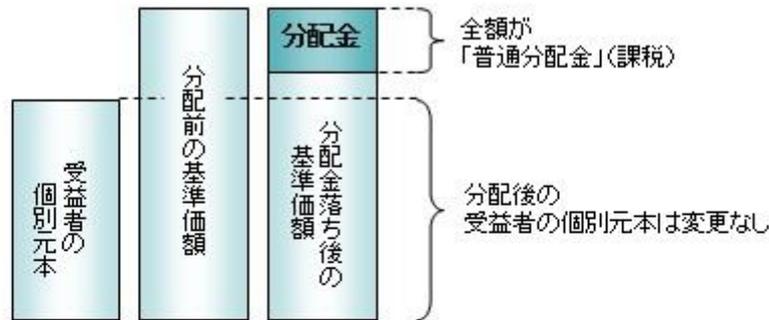
普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

- 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

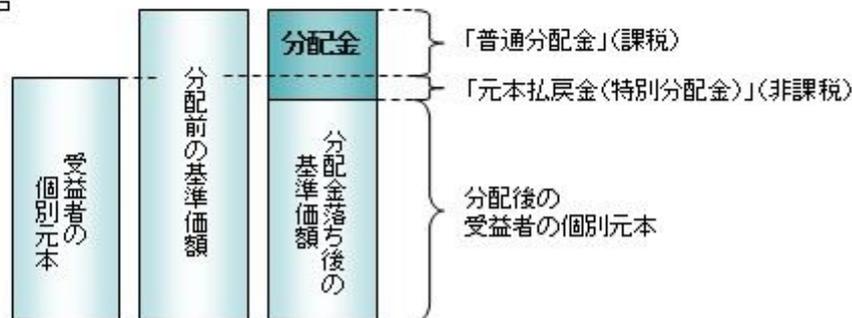
者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成27年 2月 6日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【インデックスポートフォリオ】

以下の運用状況は2014年11月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	12,879,957,461	99.97
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		4,481,372	0.03
合計(純資産総額)		12,884,438,833	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	9,907,659,586	1.2570	12,453,928,100	1.3000	12,879,957,461	99.97
----	-----------	-------------------	---------------	--------	----------------	--------	----------------	-------

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.97
合 計	99.97

【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
第27計算期間末 (2014年11月 7日)	12,764	12,776	0.5660	0.5665
2013年11月末日	12,508		0.5208	
12月末日	12,701		0.5384	
2014年 1月末日	11,852		0.5044	
2月末日	11,716		0.5001	
3月末日	11,695		0.5003	
4月末日	11,255		0.4828	
5月末日	11,603		0.4990	
6月末日	12,156		0.5237	
7月末日	12,343		0.5342	
8月末日	12,191		0.5290	

9月末日	12,568		0.5517
10月末日	12,575		0.5541
11月末日	12,884		0.5849

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	15.47

(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
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	540,447,887	2,308,575,579

【バランスポートフォリオ】

以下の運用状況は2014年11月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	95,317,727	24.91
親投資信託受益証券	日本	193,126,269	50.48
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		94,135,688	24.61
合計(純資産総額)		382,579,684	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	148,558,669	1.2570	186,738,247	1.3000	193,126,269			50.48
日本	国債証券	第9 6 回利付国債 (5年)	20,000,000	100.64	20,129,800	100.64	20,128,200	0.500	2016/3/20	5.26
日本	国債証券	第9 3 回利付国債 (5年)	20,000,000	100.53	20,107,200	100.51	20,103,800	0.500	2015/12/20	5.25
日本	国債証券	第9 2 回利付国債 (5年)	20,000,000	100.21	20,042,619	100.21	20,042,619	0.300	2015/9/20	5.24
日本	国債証券	第2 6 7 回利付国 債(10年)	20,000,000	100.08	20,016,049	100.08	20,016,049	1.300	2014/12/20	5.23
日本	国債証券	第8 9 回利付国債 (5年)	15,000,000	100.18	15,027,059	100.18	15,027,059	0.400	2015/6/20	3.93

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	24.91

親投資信託受益証券	50.48
合 計	75.39

【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
第27計算期間末 (2014年11月 7日)	382	382	0.8619	0.8624
2013年11月末日	403		0.8306	
12月末日	399		0.8445	
2014年 1月末日	384		0.8167	
2月末日	383		0.8128	
3月末日	383		0.8125	
4月末日	374		0.7976	
5月末日	380		0.8103	
6月末日	386		0.8300	
7月末日	377		0.8380	
8月末日	376		0.8334	
9月末日	380		0.8508	
10月末日	379		0.8524	
11月末日	382		0.8761	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	6.90

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第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
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	11,634,468	109,900,290

(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2014年11月28日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	12,863,979,370	98.39
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		210,335,771	1.61
合計(純資産総額)		13,074,315,141	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	169,260,000	1.29

(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	86,200	5,931.00	511,252,200	7,314.00	630,466,800	4.82
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	494,500	568.39	281,068,855	686.40	339,424,800	2.60
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	32,600	7,093.12	231,235,712	7,963.00	259,593,800	1.99
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	46,600	3,926.50	182,974,900	4,475.00	208,535,000	1.59
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	56,200	3,315.50	186,331,100	3,571.50	200,718,300	1.54
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	851,300	183.40	156,128,420	204.50	174,090,850	1.33
日本	株式	KDDI	情報・通信業	20,900	6,362.67	132,979,803	7,604.00	158,923,600	1.22
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	24,100	6,217.00	149,829,700	6,351.00	153,059,100	1.17
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	38,800	3,391.00	131,570,800	3,802.50	147,537,000	1.13
日本	株式	キヤノン	電気機器	36,200	3,224.00	116,708,800	3,801.50	137,614,300	1.05
日本	株式	日立製作所	電気機器	150,000	754.40	113,160,000	916.50	137,475,000	1.05

日本	株式	ファナック	電気機器	6,500	18,125.00	117,812,500	20,020.00	130,130,000	1.00
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	74,500	1,544.50	115,065,250	1,707.00	127,171,500	0.97
日本	株式	三菱地所	不動産業	46,000	2,247.22	103,372,120	2,671.50	122,889,000	0.94
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	24,500	4,423.50	108,375,750	4,972.00	121,814,000	0.93
日本	株式	パナソニック	電気機器	76,000	1,177.59	89,496,840	1,532.50	116,470,000	0.89
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	25,800	3,870.50	99,858,900	4,427.50	114,229,500	0.87
日本	株式	三井不動産	不動産業	33,000	2,933.50	96,805,500	3,430.50	113,206,500	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	47,200	1,983.00	93,597,600	2,245.00	105,964,000	0.81
日本	株式	ソニー	電気機器	40,100	1,865.85	74,820,585	2,600.00	104,260,000	0.80
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	11,400	7,798.00	88,897,200	8,897.00	101,425,800	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	25,300	3,170.82	80,221,746	3,880.50	98,176,650	0.75
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	87,600	935.10	81,914,760	1,108.50	97,104,600	0.74
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	5,600	13,900.00	77,840,000	17,275.00	96,740,000	0.74
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	50,700	1,675.00	84,922,500	1,851.50	93,871,050	0.72
日本	株式	信越化学工業	化学	11,700	6,585.00	77,044,500	7,990.00	93,483,000	0.72
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	21,200	3,159.00	66,970,800	4,318.00	91,541,600	0.70
日本	株式	小松製作所	機械	32,400	2,350.40	76,152,960	2,811.00	91,076,400	0.70
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	126,000	593.00	74,718,000	714.00	89,964,000	0.69
日本	株式	三菱電機	電気機器	62,000	1,264.00	78,368,000	1,426.50	88,443,000	0.68

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	0.08
		鉱業	0.41
		建設業	2.60
		食料品	4.02
		繊維製品	0.77
		パルプ・紙	0.22
		化学	5.81
		医薬品	4.39
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.88
		ガラス・土石製品	0.93
		鉄鋼	1.54
		非鉄金属	0.95
		金属製品	0.63
		機械	5.25
		電気機器	12.95
		輸送用機器	11.69
		精密機器	1.44
その他製品	1.38		

	電気・ガス業	2.03
	陸運業	3.91
	海運業	0.32
	空運業	0.60
	倉庫・運輸関連業	0.22
	情報・通信業	6.84
	卸売業	4.12
	小売業	3.99
	銀行業	9.06
	証券、商品先物取引業	1.43
	保険業	2.33
	その他金融業	1.25
	不動産業	3.10
	サービス業	2.81
合 計		98.39

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2014年12月	買建	12	日本円	161,985,959	169,260,000	1.29

(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。

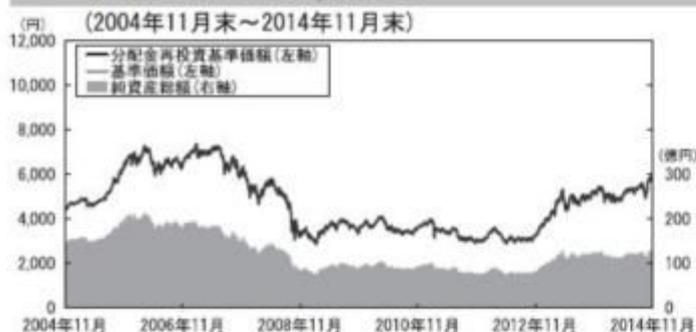
参考情報

運用実績

2014年11月28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……………5,849円
純資産総額……………128.84億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2004年11月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金（税引前）を再投資したものと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）

2010年11月	2011年11月	2012年11月	2013年11月	2014年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	135円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産	比率
株式	98.37%
株式先物	1.29%
債券	—
債券先物	—
現金その他	1.63%

※当ファンドの実質組入比率です。

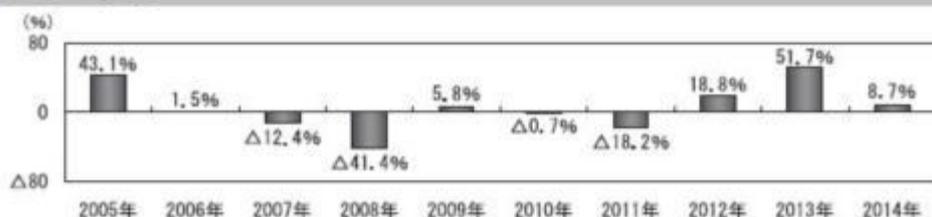
＜組入上位10銘柄＞

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	4.82%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.60%
3 ソフトバンク	情報・通信業	1.99%
4 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.59%
5 本田技研工業	輸送用機器	1.54%
6 みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.33%
7 KDDI	情報・通信業	1.22%
8 日本電信電話	情報・通信業	1.17%
9 日本たばこ産業	食料品	1.13%
10 キヤノン	電気機器	1.05%

※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



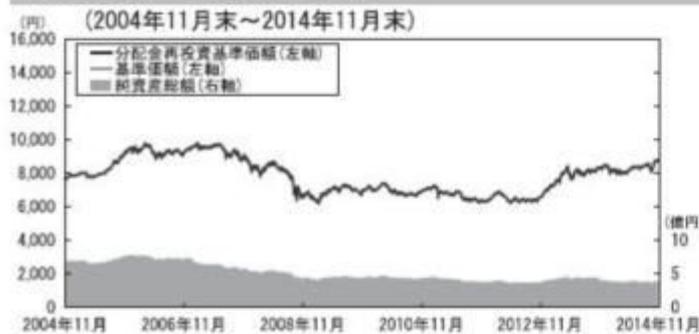
※ファンドの年間収益率は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。

※2014年は、2014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……………8,761円

純資産総額……………3.82億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2004年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金（税引前）を再投資したもとして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）

2010年11月	2011年11月	2012年11月	2013年11月	2014年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	135円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産	比率
株式	49.67%
株式先物	0.65%
債券	24.91%
債券先物	0.00%
現金その他	25.41%

※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	—	—	50.48%
2 第96回利付国債（5年）	国債証券	0.5%	2016年3月20日	5.26%
3 第93回利付国債（5年）	国債証券	0.5%	2015年12月20日	5.25%
4 第92回利付国債（5年）	国債証券	0.3%	2015年9月20日	5.24%
5 第267回利付国債（10年）	国債証券	1.3%	2014年12月20日	5.23%
6 第89回利付国債（5年）	国債証券	0.4%	2015年6月20日	3.93%

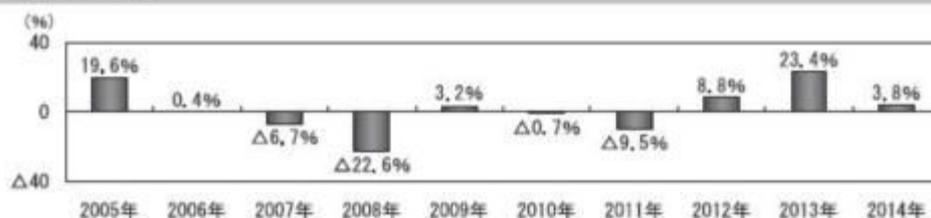
※当ファンドの対純資産総額比です。

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	4.82%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.60%
3 ソフトバンク	情報・通信業	1.99%
4 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.59%
5 本田技研工業	輸送用機器	1.54%

※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）を再投資したもとして計算しております。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2014年は、2014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。

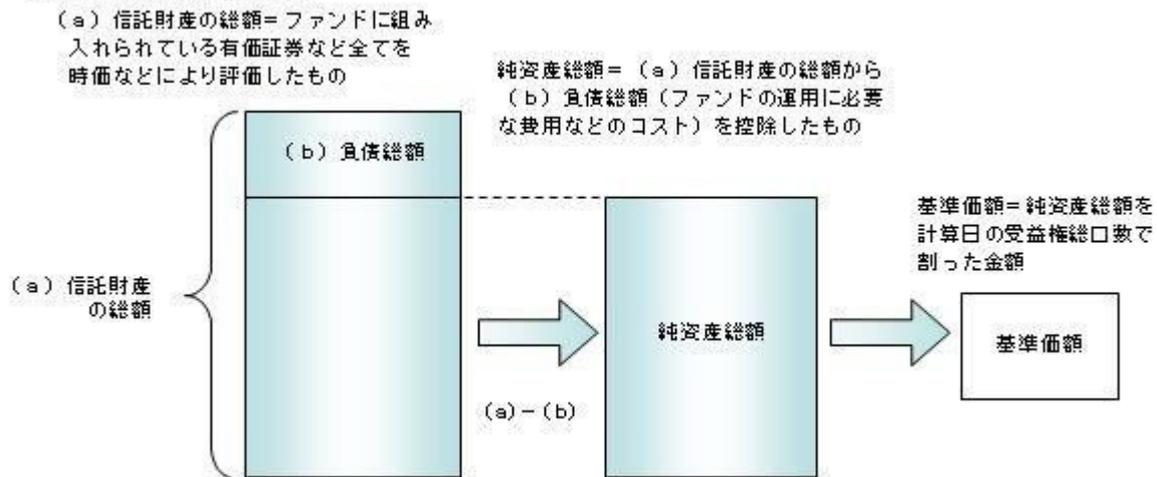
3【資産管理等の概要】

(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1万口当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	<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。</p> <p>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>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。</p> <p>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> <p>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。</p> <p>a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）</p> <p>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。）</p> <p>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。</p> <p>* 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

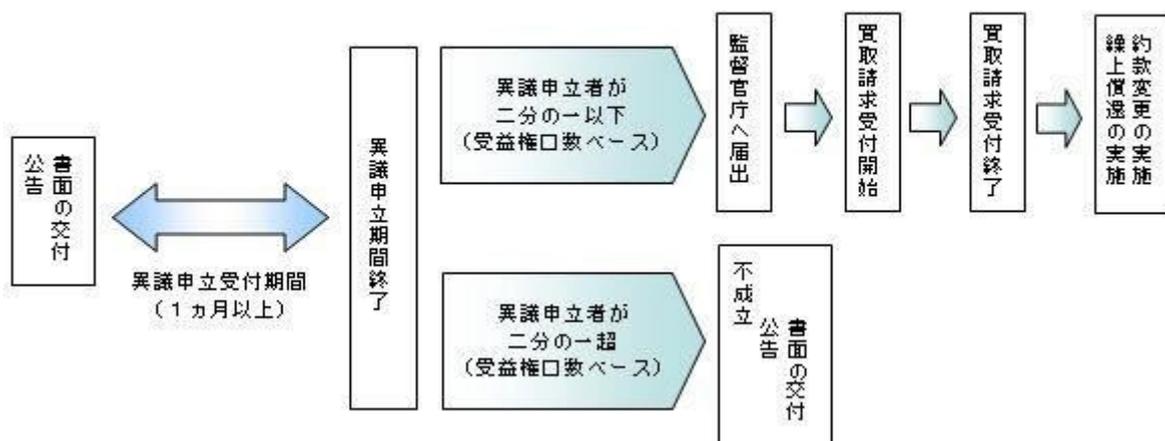
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

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

異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。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。
- ・交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

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27期計算期間(平成25年11月 8日から平成26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26期 平成25年11月 7日現在	第27期 平成26年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	105,134,719	67,181,997
親投資信託受益証券	11,932,416,914	12,773,459,412
未収入金	4,298,869	76,245,598
未収利息	139	93
流動資産合計	12,041,850,641	12,916,887,100
資産合計	12,041,850,641	12,916,887,100
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	12,159,646	11,275,582
未払解約金	1,999,215	40,895,982
未払受託者報酬	5,035,881	5,244,376
未払委託者報酬	90,646,989	94,399,950
その他未払費用	308,389	321,155
流動負債合計	110,150,120	152,137,045
負債合計	110,150,120	152,137,045
純資産の部		
元本等		
元本	24,319,293,344	22,551,165,652
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	12,387,592,823	9,786,415,597
(分配準備積立金)	453,900,962	400,021,243
元本等合計	11,931,700,521	12,764,750,055
純資産合計	11,931,700,521	12,764,750,055
負債純資産合計	12,041,850,641	12,916,887,100

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第26期		第27期	
	自	平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日	自	平成25年11月 8日 至 平成26年11月 7日
営業収益				
受取利息		26,663		29,296
有価証券売買等損益		4,819,279,412		1,964,940,157
営業収益合計		4,819,306,075		1,964,969,453
営業費用				
受託者報酬		9,156,746		10,236,738
委託者報酬		164,823,678		184,263,523
その他費用		560,739		625,137
営業費用合計		174,541,163		195,125,398
営業利益又は営業損失（ ）		4,644,764,912		1,769,844,055
経常利益又は経常損失（ ）		4,644,764,912		1,769,844,055
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,644,764,912		1,769,844,055
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（ ）		282,761,013		70,485,638
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		17,807,028,936		12,387,592,823
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,491,276,602		1,175,432,726
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,491,276,602		1,175,432,726
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		421,684,742		262,338,335
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		421,684,742		262,338,335
分配金		12,159,646		11,275,582
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,387,592,823		9,786,415,597

(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26期 平成25年11月 7日現在	第27期 平成26年11月 7日現在
1.	期首元本額	25,752,702,608円	24,319,293,344円
	期中追加設定元本額	726,814,196円	540,447,887円
	期中一部解約元本額	2,160,223,460円	2,308,575,579円
2.	受益権の総数	24,319,293,344口	22,551,165,652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	12,387,592,823円	9,786,415,597円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第26期 自 平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日		第27期 自 平成25年11月 8日 至 平成26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	26,494円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 29,296円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	2,847,093,064円	C 信託約款に定める収益調整金 2,649,729,981円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	466,034,114円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 411,267,529円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	3,313,153,672円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 3,061,026,806円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,362円	F 分配対象収益(1万口当たり) 1,357円
G	分配金額	12,159,646円	G 分配金額 11,275,582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26期 自 平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日	第27期 自 平成25年11月 8日 至 平成26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26期 平成25年11月 7日現在	第27期 平成26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

第27期（平成26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	1,951,077,331
合計	1,951,077,331

(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26期 平成25年11月 7日現在		第27期 平成26年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.4906円	1口当たり純資産額	0.5660円
(1万口当たり純資産額)	(4,906円)	(1万口当たり純資産額)	(5,660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	10,161,861,108	12,773,459,412	
合計		10,161,861,108	12,773,459,412	

(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26期 平成25年11月 7日現在	第27期 平成26年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	118,430,659	86,512,862
国債証券	105,900,406	95,342,278
親投資信託受益証券	216,248,411	192,557,691
未収入金	-	11,000,000
未収利息	201,672	181,956
流動資産合計	440,781,148	385,594,787
資産合計	440,781,148	385,594,787
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	270,864	221,731
未払受託者報酬	184,844	164,868
未払委託者報酬	3,328,337	2,968,858
その他未払費用	11,259	10,038
流動負債合計	3,795,304	3,365,495
負債合計	3,795,304	3,365,495
純資産の部		
元本等		
元本	541,728,278	443,462,456
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	104,742,434	61,233,164
(分配準備積立金)	10,919,076	9,099,575
元本等合計	436,985,844	382,229,292
純資産合計	436,985,844	382,229,292
負債純資産合計	440,781,148	385,594,787

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第26期		第27期	
	自	平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日	自	平成25年11月 8日 至 平成26年11月 7日
営業収益				
受取利息		930,638		756,406
有価証券売買等損益		101,921,904		32,751,152
営業収益合計		102,852,542		33,507,558
営業費用				
受託者報酬		353,860		329,598
委託者報酬		6,371,728		5,935,010
その他費用		21,552		20,011
営業費用合計		6,747,140		6,284,619
営業利益又は営業損失（ ）		96,105,402		27,222,939
経常利益又は経常損失（ ）		96,105,402		27,222,939
当期純利益又は当期純損失（ ）		96,105,402		27,222,939
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（ ）		5,864,720		2,664,044
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		208,261,414		104,742,434
剰余金増加額又は欠損金減少額		17,263,791		21,239,299
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		17,263,791		21,239,299
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		3,714,629		2,067,193
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		3,714,629		2,067,193
分配金		270,864		221,731
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		104,742,434		61,233,164

（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26期 平成25年11月 7日現在	第27期 平成26年11月 7日現在
1.	期首元本額	574,786,183円	541,728,278円
	期中追加設定元本額	14,701,201円	11,634,468円
	期中一部解約元本額	47,759,106円	109,900,290円
2.	受益権の総数	541,728,278口	443,462,456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	104,742,434円	61,233,164円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第26期 自 平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日		第27期 自 平成25年11月 8日 至 平成26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	841,894円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 600,873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	74,310,483円	C 信託約款に定める収益調整金 61,049,093円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	10,348,046円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 8,720,433円

E 分配対象収益 (A+B+C+D)	85,500,423円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	70,370,399円
F 分配対象収益(1万口当たり)	1,578円	F 分配対象収益(1万口当たり)	1,586円
G 分配金額	270,864円	G 分配金額	221,731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26期 自 平成24年11月 8日 至 平成25年11月 7日	第27期 自 平成25年11月 8日 至 平成26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26期 平成25年11月 7日現在	第27期 平成26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	(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

	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。	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

第27期（平成26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	437,872
親投資信託受益証券	28,493,022
合計	28,055,150

（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26期 平成25年11月 7日現在		第27期 平成26年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.8067円	1口当たり純資産額	0.8619円
(1万口当たり純資産額)	(8,067円)	(1万口当たり純資産額)	(8,619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	15,029,810	
	第92回利付国債(5年)	20,000,000	20,045,622	
	第93回利付国債(5年)	20,000,000	20,107,200	
	第96回利付国債(5年)	20,000,000	20,129,800	
	第267回利付国債(10年)	20,000,000	20,029,846	
国債証券 合計		95,000,000	95,342,278	
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	153,188,299	192,557,691	
親投資信託受益証券 合計		153,188,299	192,557,691	
合計		248,188,299	287,899,969	

(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、当該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25年11月 7日現在	平成26年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	434,746	850,979
コール・ローン	133,338,114	199,780,583
株式	11,933,040,118	12,650,979,530
派生商品評価勘定	344,189	13,104,668
未収入金	-	108,265,377
未収配当金	90,238,656	94,013,280
未収利息	176	277
前払金	1,530,000	-
流動資産合計	12,158,925,999	13,066,994,694
資産合計	12,158,925,999	13,066,994,694
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,364,930	-
前受金	-	12,505,000
未払金	2,974	-
未払解約金	4,298,869	87,245,598
流動負債合計	7,666,773	99,750,598
負債合計	7,666,773	99,750,598
純資産の部		
元本等		
元本	11,343,291,621	10,315,049,407
剰余金		
剰余金又は欠損金()	807,967,605	2,652,194,689
元本等合計	12,151,259,226	12,967,244,096
純資産合計	12,151,259,226	12,967,244,096
負債純資産合計	12,158,925,999	13,066,994,694

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25年11月 7日現在	平成26年11月 7日現在
1.	期首	平成24年11月 8日	平成25年11月 8日
	期首元本額	12,291,786,325円	11,343,291,621円
	期首からの追加設定元本額	140,905,972円	84,087,897円
	期首からの一部解約元本額	1,089,400,676円	1,112,330,111円
	元本の内訳		
	インデックスポートフォリオ	11,141,379,005円	10,161,861,108円
	バランスポートフォリオ	201,912,616円	153,188,299円
	計	11,343,291,621円	10,315,049,407円
2.	受益権の総数	11,343,291,621口	10,315,049,407口
3.	担保資産		
	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
	株式	188,100,000円	204,510,000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24年11月 8日 至 平成25年11月 7日	自 平成25年11月 8日 至 平成26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25年11月 7日現在	平成26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

(平成26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	1,454,935,663
合計	1,454,935,663

(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

(平成26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	246,920,000	-	260,110,000	13,190,000
合計		246,920,000	-	260,110,000	13,190,000

(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25年11月 7日現在		平成26年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.071円	1口当たり純資産額	1.257円
(1千口当たり純資産額)	(1,071円)	(1千口当たり純資産額)	(1,257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	261.00	783,000	
日本水産	8,800	368.00	3,238,400	
マルハニチロ	1,400	1,589.00	2,224,600	
サカタのタネ	1,100	1,633.00	1,796,300	
ホクト	800	2,002.00	1,601,600	
住石ホールディングス	2,700	121.00	326,700	
日鉄鉱業	2,000	407.00	814,000	
三井松島産業	5,000	132.00	660,000	
国際石油開発帝石	37,600	1,345.00	50,572,000	
日本海洋掘削	200	4,160.00	832,000	
石油資源開発	1,000	3,690.00	3,690,000	
K&Oエナジーグループ	500	1,430.00	715,000	
ショーボンドホールディングス	600	4,220.00	2,532,000	
ミライト・ホールディングス	2,200	1,248.00	2,745,600	
タマホーム	300	604.00	181,200	
安藤・間	4,700	715.00	3,360,500	
東急建設	2,600	528.00	1,372,800	
コムシスホールディングス	3,200	1,915.00	6,128,000	
ミサワホーム	800	1,032.00	825,600	
高松コンストラクショングループ	500	2,083.00	1,041,500	
東建コーポレーション	300	5,060.00	1,518,000	
ヤマウラ	300	402.00	120,600	
大成建設	36,000	608.00	21,888,000	
大林組	21,000	753.00	15,813,000	
清水建設	22,000	803.00	17,666,000	
飛鳥建設	4,600	295.00	1,357,000	
長谷工コーポレーション	8,900	825.00	7,342,500	
松井建設	1,000	530.00	530,000	
銭高組	1,000	367.00	367,000	

鹿島建設	31,000	484.00	15,004,000	
不動テトラ	5,300	268.00	1,420,400	
大末建設	400	928.00	371,200	
鉄建建設	4,000	476.00	1,904,000	
日鉄住金テックスエンジ	1,000	550.00	550,000	
西松建設	8,000	524.00	4,192,000	
三井住友建設	28,800	130.00	3,744,000	
大豊建設	2,000	509.00	1,018,000	
前田建設工業	5,000	917.00	4,585,000	
ナカノフドー建設	500	362.00	181,000	
奥村組	7,000	595.00	4,165,000	
大和小田急建設	400	806.00	322,400	
東鉄工業	900	2,493.00	2,243,700	
イチケン	1,000	321.00	321,000	
浅沼組	3,000	171.00	513,000	
戸田建設	9,000	495.00	4,455,000	
熊谷組	9,000	397.00	3,573,000	
青木あすなろ建設	500	810.00	405,000	
北野建設	2,000	331.00	662,000	
植木組	1,000	287.00	287,000	
三井ホーム	1,000	489.00	489,000	
矢作建設工業	900	895.00	805,500	
ピーエス三菱	600	500.00	300,000	
東日本ハウス	800	464.00	371,200	
大東建託	2,700	13,855.00	37,408,500	
新日本建設	1,000	384.00	384,000	
N I P P O	2,000	1,950.00	3,900,000	
東亜道路工業	1,000	433.00	433,000	
前田道路	2,000	1,720.00	3,440,000	
日本道路	2,000	608.00	1,216,000	
東亜建設工業	5,000	190.00	950,000	
若築建設	4,000	212.00	848,000	
東洋建設	1,900	498.00	946,200	
五洋建設	7,900	357.00	2,820,300	
大林道路	1,000	778.00	778,000	
世紀東急工業	1,000	604.00	604,000	
福田組	1,000	1,148.00	1,148,000	
住友林業	5,400	1,206.00	6,512,400	
日本基礎技術	1,000	395.00	395,000	
日成ビルド工業	2,000	279.00	558,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	3,000	103.00	309,000	
巴コーポレーション	800	437.00	349,600	

パナホーム	3,000	735.00	2,205,000
大和ハウス工業	20,900	2,187.00	45,708,300
ライト工業	1,100	1,005.00	1,105,500
積水ハウス	22,000	1,431.00	31,482,000
日特建設	1,000	564.00	564,000
ユアテック	1,000	596.00	596,000
西部電気工業	1,000	482.00	482,000
四電工	1,000	401.00	401,000
中電工	1,000	1,855.00	1,855,000
関電工	3,000	584.00	1,752,000
きんでん	5,000	1,161.00	5,805,000
東京エネシス	1,000	735.00	735,000
トーエネック	1,000	598.00	598,000
住友電設	600	1,378.00	826,800
日本電設工業	1,200	1,513.00	1,815,600
協和エクシオ	3,000	1,362.00	4,086,000
新日本空調	600	898.00	538,800
N D S	1,000	310.00	310,000
九電工	1,000	1,213.00	1,213,000
三機工業	1,400	773.00	1,082,200
日揮	7,000	2,861.00	20,027,000
中外炉工業	2,000	216.00	432,000
ヤマト	1,000	399.00	399,000
太平電業	1,000	909.00	909,000
高砂熱学工業	2,000	1,394.00	2,788,000
三晃金属工業	1,000	259.00	259,000
朝日工業社	1,000	399.00	399,000
明星工業	1,000	780.00	780,000
大気社	1,000	2,445.00	2,445,000
ダイダン	1,000	646.00	646,000
日比谷総合設備	900	1,609.00	1,448,100
東芝プラントシステム	1,100	1,827.00	2,009,700
東洋エンジニアリング	3,000	548.00	1,644,000
千代田化工建設	5,000	1,083.00	5,415,000
新興プランテック	1,500	814.00	1,221,000
日本製粉	4,000	551.00	2,204,000
日清製粉グループ本社	7,800	1,135.00	8,853,000
日東富士製粉	1,000	317.00	317,000
昭和産業	3,000	434.00	1,302,000
鳥越製粉	600	766.00	459,600
中部飼料	700	666.00	466,200
フィード・ワンホールディングス	4,100	108.00	442,800

東洋精糖	2,000	101.00	202,000
日本甜菜製糖	4,000	189.00	756,000
三井製糖	3,000	380.00	1,140,000
塩水港精糖	400	281.00	112,400
森永製菓	6,000	260.00	1,560,000
中村屋	2,000	427.00	854,000
江崎グリコ	1,700	3,680.00	6,256,000
名糖産業	400	1,142.00	456,800
不二家	4,000	200.00	800,000
山崎製パン	5,000	1,395.00	6,975,000
第一屋製パン	1,000	133.00	133,000
モロゾフ	1,000	357.00	357,000
亀田製菓	400	3,560.00	1,424,000
寿スピリッツ	100	2,214.00	221,400
カルビー	2,600	3,955.00	10,283,000
森永乳業	6,000	367.00	2,202,000
六甲バター	200	1,195.00	239,000
ヤクルト本社	3,800	6,100.00	23,180,000
明治ホールディングス	2,100	9,380.00	19,698,000
雪印メグミルク	1,700	1,443.00	2,453,100
プリマハム	4,000	252.00	1,008,000
日本ハム	5,000	2,413.00	12,065,000
伊藤ハム	4,000	568.00	2,272,000
林兼産業	3,000	77.00	231,000
丸大食品	4,000	425.00	1,700,000
米久	300	1,495.00	448,500
S Foods	400	2,178.00	871,200
サッポロホールディングス	12,000	478.00	5,736,000
アサヒグループホールディングス	14,400	3,474.50	50,032,800
キリンホールディングス	30,500	1,443.50	44,026,750
宝ホールディングス	5,500	839.00	4,614,500
オエノンホールディングス	2,000	232.00	464,000
養命酒製造	1,000	870.00	870,000
コカ・コーラウエスト	2,400	1,608.00	3,859,200
コカ・コーライーストジャパン	2,100	2,203.00	4,626,300
サントリー食品インターナショナル	4,300	4,165.00	17,909,500
ダイトードリンク	400	4,625.00	1,850,000
伊藤園	1,900	2,197.00	4,174,300
キーコーヒー	600	1,612.00	967,200
ユニカフェ	200	670.00	134,000
ジャパンフーズ	100	1,085.00	108,500
日清オイリオグループ	3,000	402.00	1,206,000

不二製油	1,900	1,742.00	3,309,800
かどや製油	100	2,620.00	262,000
J - オイルミルズ	3,000	372.00	1,116,000
キッコーマン	6,000	2,751.00	16,506,000
味の素	16,000	2,164.00	34,624,000
キュービー	3,700	1,939.00	7,174,300
ハウス食品グループ本社	2,700	1,939.00	5,235,300
カゴメ	2,700	1,767.00	4,770,900
焼津水産化学工業	400	988.00	395,200
アリアケジャパン	600	2,552.00	1,531,200
ニチレイ	8,000	473.00	3,784,000
東洋水産	3,700	3,890.00	14,393,000
日清食品ホールディングス	3,000	5,920.00	17,760,000
永谷園	1,000	1,073.00	1,073,000
フジッコ	1,000	1,666.00	1,666,000
ロック・フィールド	400	1,900.00	760,000
日本たばこ産業	39,600	3,932.50	155,727,000
ケンコーマヨネーズ	200	1,200.00	240,000
わらべや日洋	400	1,979.00	791,600
なとり	300	1,136.00	340,800
ミヨシ油脂	2,000	138.00	276,000
片倉工業	800	1,352.00	1,081,600
ゲンゼ	5,000	312.00	1,560,000
東洋紡	26,000	161.00	4,186,000
ユニチカ	19,000	49.00	931,000
富士紡ホールディングス	3,000	283.00	849,000
日清紡ホールディングス	4,000	1,056.00	4,224,000
倉敷紡績	7,000	182.00	1,274,000
シキボウ	4,000	121.00	484,000
日本毛織	2,000	744.00	1,488,000
大東紡織	2,000	73.00	146,000
トーア紡コーポレーション	4,000	78.00	312,000
ガイドーリミテッド	600	496.00	297,600
帝国繊維	700	2,652.00	1,856,400
帝人	27,000	299.00	8,073,000
東レ	52,000	774.00	40,248,000
サカイオーベックス	3,000	158.00	474,000
住江織物	2,000	298.00	596,000
日本フェルト	500	482.00	241,000
イチカワ	1,000	277.00	277,000
日本バイリーン	1,000	620.00	620,000
日東製網	1,000	166.00	166,000

芦森工業	2,000	183.00	366,000
アツギ	6,000	115.00	690,000
ダイニック	2,000	174.00	348,000
セーレン	1,600	953.00	1,524,800
東海染工	1,000	122.00	122,000
小松精練	1,100	537.00	590,700
ワコールホールディングス	4,000	1,155.00	4,620,000
ホギメディカル	400	5,800.00	2,320,000
レナウン	1,400	112.00	156,800
T S Iホールディングス	2,900	686.00	1,989,400
三陽商会	3,000	292.00	876,000
ナイガイ	3,000	62.00	186,000
オンワードホールディングス	5,000	689.00	3,445,000
ルック	1,000	238.00	238,000
キムラタン	15,000	10.00	150,000
ゴールドウイン	2,000	625.00	1,250,000
デサント	2,000	1,074.00	2,148,000
キング	200	436.00	87,200
特種東海製紙	4,000	263.00	1,052,000
王子ホールディングス	27,000	397.00	10,719,000
日本製紙	3,200	1,604.00	5,132,800
三菱製紙	10,000	85.00	850,000
北越紀州製紙	4,000	460.00	1,840,000
中越パルプ工業	3,000	183.00	549,000
巴川製紙所	1,000	187.00	187,000
大王製紙	3,000	953.00	2,859,000
レンゴー	6,000	469.00	2,814,000
トーモク	2,000	280.00	560,000
ザ・パック	500	2,305.00	1,152,500
クラレ	11,400	1,317.00	15,013,800
旭化成	42,000	940.00	39,480,000
共和レザー	500	766.00	383,000
コープケミカル	1,000	104.00	104,000
昭和電工	45,000	152.00	6,840,000
住友化学	49,000	391.00	19,159,000
日本化成	2,000	142.00	284,000
住友精化	1,000	707.00	707,000
日産化学工業	4,500	2,101.00	9,454,500
ラサ工業	3,000	138.00	414,000
クレハ	5,000	508.00	2,540,000
テイカ	1,000	465.00	465,000
石原産業	11,000	89.00	979,000

片倉チッカリン	1,000	264.00	264,000
日本曹達	4,000	630.00	2,520,000
東ソー	17,000	496.00	8,432,000
トクヤマ	10,000	238.00	2,380,000
セントラル硝子	7,000	363.00	2,541,000
東亜合成	8,000	488.00	3,904,000
ダイソー	3,000	361.00	1,083,000
関東電化工業	2,000	430.00	860,000
電気化学工業	14,000	363.00	5,082,000
信越化学工業	12,000	7,405.00	88,860,000
日本カーバイド工業	2,000	229.00	458,000
堺化学工業	3,000	341.00	1,023,000
エア・ウォーター	6,000	1,817.00	10,902,000
大陽日酸	9,000	1,068.00	9,612,000
日本化学工業	3,000	167.00	501,000
日本パーカライズン	1,600	2,653.00	4,244,800
高圧ガス工業	1,000	587.00	587,000
四国化成工業	1,000	791.00	791,000
戸田工業	1,000	450.00	450,000
ステラ ケミファ	300	1,329.00	398,700
保土谷化学工業	2,000	191.00	382,000
日本触媒	5,000	1,341.00	6,705,000
大日精化工業	3,000	592.00	1,776,000
カネカ	9,000	639.00	5,751,000
三菱瓦斯化学	11,000	689.00	7,579,000
三井化学	30,000	321.00	9,630,000
J S R	6,600	2,008.00	13,252,800
東京応化工業	1,400	3,320.00	4,648,000
大阪有機化学工業	500	484.00	242,000
三菱ケミカルホールディングス	41,800	566.10	23,662,980
日本合成化学工業	2,000	712.00	1,424,000
ダイセル	9,000	1,294.00	11,646,000
住友ベークライト	6,000	445.00	2,670,000
積水化学工業	16,000	1,409.00	22,544,000
日本ゼオン	6,000	1,048.00	6,288,000
アイカ工業	2,000	2,263.00	4,526,000
宇部興産	34,000	172.00	5,848,000
積水樹脂	1,000	1,513.00	1,513,000
タキロン	1,000	523.00	523,000
旭有機材工業	2,000	278.00	556,000
日立化成	3,400	2,074.00	7,051,600
ニチバン	1,000	387.00	387,000

リケンテクノス	1,100	491.00	540,100
大倉工業	2,000	392.00	784,000
積水化成成品工業	2,000	330.00	660,000
群栄化学工業	2,000	340.00	680,000
タイガースポリマー	400	687.00	274,800
ミライアル	200	1,723.00	344,600
ダイキョーニシカワ	200	3,090.00	618,000
日本化薬	4,000	1,446.00	5,784,000
カーリットホールディングス	500	582.00	291,000
日本精化	600	849.00	509,400
A D E K A	3,000	1,421.00	4,263,000
日油	5,000	725.00	3,625,000
新日本理化	500	220.00	110,000
ハリマ化成グループ	600	451.00	270,600
花王	18,400	4,415.00	81,236,000
第一工業製薬	1,000	413.00	413,000
三洋化成工業	2,000	707.00	1,414,000
大日本塗料	4,000	157.00	628,000
日本ペイントホールディングス	6,000	2,532.00	15,192,000
関西ペイント	8,000	1,698.00	13,584,000
中国塗料	2,000	845.00	1,690,000
日本特殊塗料	600	738.00	442,800
藤倉化成	800	584.00	467,200
太陽ホールディングス	500	3,820.00	1,910,000
D I C	27,000	235.00	6,345,000
サカタインクス	1,400	1,111.00	1,555,400
東洋インキＳＣホールディングス	7,000	517.00	3,619,000
T & K T O K A	200	2,448.00	489,600
富士フイルムホールディングス	15,300	3,771.50	57,703,950
資生堂	11,900	1,714.00	20,396,600
ライオン	8,000	640.00	5,120,000
高砂香料工業	2,000	536.00	1,072,000
マンダム	700	3,810.00	2,667,000
ミルボン	400	3,515.00	1,406,000
ファンケル	1,500	1,458.00	2,187,000
コーセー	1,100	4,165.00	4,581,500
コタ	200	1,300.00	260,000
ドクターシーラボ	500	3,505.00	1,752,500
シーボン	100	2,323.00	232,300
ポーラ・オルビスホールディングス	800	4,100.00	3,280,000
ノエビアホールディングス	500	1,987.00	993,500
アジュバンコスメジャパン	100	927.00	92,700

エステー	400	1,014.00	405,600
コニシ	500	1,848.00	924,000
長谷川香料	800	1,691.00	1,352,800
星光PMC	300	950.00	285,000
小林製薬	1,100	6,710.00	7,381,000
荒川化学工業	600	1,117.00	670,200
メック	500	1,151.00	575,500
日本高純度化学	200	2,365.00	473,000
新田ゼラチン	400	815.00	326,000
アース製薬	500	4,075.00	2,037,500
イハラケミカル工業	1,000	1,159.00	1,159,000
北興化学工業	1,000	377.00	377,000
大成ラミック	200	2,711.00	542,200
クミアイ化学工業	1,000	666.00	666,000
日本農薬	1,600	1,112.00	1,779,200
アキレス	6,000	153.00	918,000
有沢製作所	1,200	795.00	954,000
日東電工	5,200	6,046.00	31,439,200
レック	200	1,194.00	238,800
きもと	900	290.00	261,000
藤森工業	600	3,355.00	2,013,000
前澤化成工業	500	1,132.00	566,000
JSP	500	1,768.00	884,000
エフピコ	600	3,260.00	1,956,000
天馬	600	1,604.00	962,400
信越ポリマー	1,300	513.00	666,900
東リ	2,000	243.00	486,000
ニフコ	1,500	3,470.00	5,205,000
日本バルカー工業	3,000	315.00	945,000
ユニ・チャーム	13,500	2,487.00	33,574,500
協和発酵キリン	8,000	1,280.00	10,240,000
武田薬品工業	25,000	4,907.00	122,675,000
アステラス製薬	76,000	1,779.00	135,204,000
大日本住友製薬	4,800	1,272.00	6,105,600
塩野義製薬	10,400	2,882.00	29,972,800
田辺三菱製薬	7,800	1,758.00	13,712,400
わかもと製薬	1,000	263.00	263,000
あすか製薬	800	1,221.00	976,800
日本新薬	2,000	3,175.00	6,350,000
ピオフェルミン製薬	100	2,897.00	289,700
中外製薬	6,700	3,420.00	22,914,000
科研製薬	2,000	2,719.00	5,438,000

エーザイ	8,800	4,370.00	38,456,000
ロート製薬	3,000	1,568.00	4,704,000
小野薬品工業	3,000	11,000.00	33,000,000
久光製薬	1,900	3,785.00	7,191,500
有機合成薬品工業	1,000	259.00	259,000
持田製薬	500	6,800.00	3,400,000
参天製薬	2,500	6,630.00	16,575,000
扶桑薬品工業	2,000	308.00	616,000
日本ケミファ	1,000	556.00	556,000
ツムラ	2,100	2,575.00	5,407,500
日医工	1,500	1,781.00	2,671,500
キッセイ薬品工業	1,200	3,005.00	3,606,000
生化学工業	1,300	1,755.00	2,281,500
栄研化学	500	1,921.00	960,500
鳥居薬品	500	3,185.00	1,592,500
JCRファーマ	500	2,381.00	1,190,500
東和薬品	300	4,985.00	1,495,500
富士製薬工業	200	2,169.00	433,800
沢井製薬	1,100	6,630.00	7,293,000
ゼリア新薬工業	1,400	2,011.00	2,815,400
第一三共	22,400	1,718.50	38,494,400
キョーリン製薬ホールディングス	1,800	2,336.00	4,204,800
大幸薬品	300	1,921.00	576,300
ダイト	300	1,986.00	595,800
大塚ホールディングス	13,200	3,949.50	52,133,400
大正製薬ホールディングス	1,600	7,770.00	12,432,000
日本コークス工業	6,000	110.00	660,000
昭和シェル石油	6,000	942.00	5,652,000
コスモ石油	18,000	163.00	2,934,000
ニチレキ	1,000	852.00	852,000
東燃ゼネラル石油	10,000	974.00	9,740,000
ユシロ化学工業	400	1,495.00	598,000
ピーピー・カストロール	400	1,120.00	448,000
富士石油	1,500	317.00	475,500
MORESCO	100	1,756.00	175,600
出光興産	3,200	2,068.00	6,617,600
JXホールディングス	74,100	453.90	33,633,990
横浜ゴム	7,000	1,037.00	7,259,000
東洋ゴム工業	3,000	1,911.00	5,733,000
ブリヂストン	20,900	3,829.00	80,026,100
住友ゴム工業	5,100	1,619.00	8,256,900
藤倉ゴム工業	500	815.00	407,500

オカモト	2,000	418.00	836,000	
フコク	400	1,255.00	502,000	
ニッタ	600	2,538.00	1,522,800	
住友理工	1,200	973.00	1,167,600	
三ツ星ベルト	2,000	802.00	1,604,000	
バンドー化学	2,000	433.00	866,000	
日東紡績	5,000	419.00	2,095,000	
旭硝子	33,000	583.00	19,239,000	
日本板硝子	32,000	104.00	3,328,000	
石塚硝子	1,000	160.00	160,000	
日本山村硝子	3,000	167.00	501,000	
日本電気硝子	13,000	520.00	6,760,000	
オハラ	300	576.00	172,800	
住友大阪セメント	12,000	366.00	4,392,000	
太平洋セメント	42,000	399.00	16,758,000	
デイ・シイ	700	491.00	343,700	
日本ヒューム	700	878.00	614,600	
日本コンクリート工業	1,100	648.00	712,800	
三谷セキサン	300	1,943.00	582,900	
ジャパンパイル	900	848.00	763,200	
東海カーボン	6,000	295.00	1,770,000	
日本カーボン	4,000	192.00	768,000	
東洋炭素	400	2,083.00	833,200	
ノリタケカンパニーリミテド	4,000	264.00	1,056,000	
TOTO	10,000	1,286.00	12,860,000	
日本碍子	8,000	2,585.00	20,680,000	
日本特殊陶業	5,800	3,230.00	18,734,000	
ダントーホールディングス	2,000	150.00	300,000	
MARUWA	200	3,160.00	632,000	
品川リフラクトリーズ	2,000	262.00	524,000	
黒崎播磨	2,000	238.00	476,000	
イソライト工業	100	209.00	20,900	
東京窯業	1,000	205.00	205,000	
ニッカトー	300	405.00	121,500	
フジインコーポレーテッド	700	1,528.00	1,069,600	
エーアンドエーマテリアル	2,000	107.00	214,000	
ニチアス	3,000	681.00	2,043,000	
ニチハ	900	1,004.00	903,600	
新日鐵住金	282,000	294.40	83,020,800	
神戸製鋼所	116,000	175.00	20,300,000	
合同製鐵	4,000	156.00	624,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	17,000	2,287.50	38,887,500	

日新製鋼	2,800	1,010.00	2,828,000
東京製鐵	3,300	581.00	1,917,300
共英製鋼	700	1,837.00	1,285,900
大和工業	1,500	3,475.00	5,212,500
東京鐵鋼	1,000	494.00	494,000
大阪製鐵	400	2,009.00	803,600
淀川製鋼所	5,000	408.00	2,040,000
東洋鋼鈹	2,000	640.00	1,280,000
丸一鋼管	2,000	2,697.00	5,394,000
モリ工業	1,000	426.00	426,000
大同特殊鋼	11,000	431.00	4,741,000
日本高周波鋼業	3,000	112.00	336,000
日本冶金工業	5,200	273.00	1,419,600
山陽特殊製鋼	4,000	379.00	1,516,000
愛知製鋼	4,000	400.00	1,600,000
日立金属	7,000	1,953.00	13,671,000
日本金属	2,000	146.00	292,000
大太平洋金属	4,000	339.00	1,356,000
新日本電工	4,000	279.00	1,116,000
栗本鐵工所	3,000	225.00	675,000
日本鑄鉄管	1,000	242.00	242,000
三菱製鋼	4,000	247.00	988,000
日亜鋼業	1,000	326.00	326,000
日本精線	1,000	686.00	686,000
シンニッタン	900	580.00	522,000
新家工業	2,000	178.00	356,000
大紀アルミニウム工業所	1,000	303.00	303,000
日本軽金属ホールディングス	15,900	165.00	2,623,500
三井金属鉱業	18,000	287.00	5,166,000
東邦亜鉛	4,000	366.00	1,464,000
三菱マテリアル	41,000	337.00	13,817,000
住友金属鉱山	18,000	1,495.00	26,910,000
D O W A ホールディングス	8,000	925.00	7,400,000
古河機械金属	10,000	220.00	2,200,000
エス・サイエンス	1,600	50.00	80,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	600	2,022.00	1,213,200
東邦チタニウム	1,200	676.00	811,200
U A C J	7,000	357.00	2,499,000
古河電気工業	20,000	191.00	3,820,000
住友電気工業	25,000	1,517.50	37,937,500
フジクラ	9,000	462.00	4,158,000
昭和電線ホールディングス	7,000	100.00	700,000

タツタ電線	1,300	543.00	705,900
沖電線	1,000	287.00	287,000
カナレ電気	100	1,753.00	175,300
リョービ	4,000	311.00	1,244,000
アーレスティ	500	639.00	319,500
アサヒホールディングス	1,000	1,815.00	1,815,000
稲葉製作所	300	1,386.00	415,800
宮地エンジニアリンググループ	2,000	217.00	434,000
トーカロ	400	1,919.00	767,600
アルファC o	300	1,086.00	325,800
SUMCO	4,600	1,535.00	7,061,000
川田テクノロジーズ	100	4,940.00	494,000
東洋製罐グループホールディングス	4,800	1,363.00	6,542,400
ホッカホールディングス	2,000	282.00	564,000
コロナ	300	1,185.00	355,500
横河ブリッジホールディングス	1,300	1,354.00	1,760,200
駒井ハルテック	1,000	269.00	269,000
高田機工	1,000	215.00	215,000
三和ホールディングス	6,300	830.00	5,229,000
文化シャッター	2,000	983.00	1,966,000
三協立山	800	1,968.00	1,574,400
東洋シャッター	200	773.00	154,600
LIXILグループ	9,900	2,339.00	23,156,100
日本フィルコン	500	513.00	256,500
ノーリツ	1,300	2,006.00	2,607,800
長府製作所	700	3,220.00	2,254,000
リンナイ	1,200	8,820.00	10,584,000
ダイニチ工業	400	774.00	309,600
日東精工	1,000	372.00	372,000
三洋工業	1,000	200.00	200,000
岡部	1,300	993.00	1,290,900
中国工業	100	770.00	77,000
東プレ	1,300	1,548.00	2,012,400
高周波熱錬	1,200	780.00	936,000
東京製綱	5,000	167.00	835,000
モリテック スチール	200	329.00	65,800
パイオラックス	300	4,935.00	1,480,500
日本発條	5,800	1,011.00	5,863,800
中央発條	1,000	320.00	320,000
アドバネクス	2,000	172.00	344,000
三益半導体工業	600	994.00	596,400
日本ドライケミカル	100	2,296.00	229,600

日本製鋼所	9,000	415.00	3,735,000
三浦工業	3,000	1,323.00	3,969,000
タクマ	2,000	703.00	1,406,000
ツガミ	2,000	588.00	1,176,000
オークマ	4,000	856.00	3,424,000
東芝機械	4,000	479.00	1,916,000
アマダ	10,000	1,006.00	10,060,000
アイダエンジニアリング	1,500	1,076.00	1,614,000
滝澤鉄工所	2,000	212.00	424,000
富士機械製造	2,200	1,040.00	2,288,000
牧野フライス製作所	3,000	807.00	2,421,000
オーエスジー	3,000	1,879.00	5,637,000
ダイジェット工業	1,000	244.00	244,000
旭ダイヤモンド工業	1,800	1,284.00	2,311,200
D M G 森精機	4,200	1,346.00	5,653,200
ディスコ	700	8,450.00	5,915,000
日東工器	400	2,105.00	842,000
パンチ工業	100	1,506.00	150,600
豊和工業	400	746.00	298,400
大阪機工	3,000	158.00	474,000
東洋機械金属	700	456.00	319,200
津田駒工業	2,000	148.00	296,000
島精機製作所	1,000	1,940.00	1,940,000
日阪製作所	900	1,015.00	913,500
やまびこ	300	4,405.00	1,321,500
ペガサスミシン製造	700	690.00	483,000
ナブテスコ	4,100	2,833.00	11,615,300
三井海洋開発	700	2,408.00	1,685,600
レオン自動機	1,000	502.00	502,000
S M C	2,000	30,845.00	61,690,000
新川	500	566.00	283,000
ホソカワミクロン	1,000	621.00	621,000
ユニオンツール	300	2,854.00	856,200
オイレス工業	800	2,051.00	1,640,800
日精エー・エス・ビー機械	200	2,408.00	481,600
サトーホールディングス	800	2,801.00	2,240,800
日本エアテック	300	1,089.00	326,700
日精樹脂工業	500	896.00	448,000
ワイエイシイ	300	586.00	175,800
小松製作所	33,100	2,757.50	91,273,250
住友重機械工業	18,000	660.00	11,880,000
日立建機	3,000	2,358.00	7,074,000

日工	1,000	430.00	430,000
巴工業	300	1,716.00	514,800
井関農機	7,000	260.00	1,820,000
T O W A	700	648.00	453,600
丸山製作所	2,000	249.00	498,000
北川鉄工所	3,000	202.00	606,000
クボタ	32,000	1,780.50	56,976,000
荏原実業	200	1,423.00	284,600
三菱化工機	2,000	404.00	808,000
月島機械	1,200	1,234.00	1,480,800
帝国電機製作所	400	1,227.00	490,800
新東工業	1,500	783.00	1,174,500
澁谷工業	600	2,681.00	1,608,600
アイチ コーポレーション	900	550.00	495,000
小森コーポレーション	1,600	1,075.00	1,720,000
鶴見製作所	500	1,990.00	995,000
住友精密工業	1,000	433.00	433,000
酒井重工業	1,000	283.00	283,000
荏原製作所	14,000	574.00	8,036,000
石井鐵工所	1,000	239.00	239,000
西島製作所	600	885.00	531,000
ダイキン工業	9,300	7,139.00	66,392,700
オルガノ	1,000	488.00	488,000
トーヨーカネツ	4,000	259.00	1,036,000
栗田工業	3,800	2,456.00	9,332,800
椿本チエイン	3,000	904.00	2,712,000
大同工業	1,000	267.00	267,000
日本コンベヤ	2,000	249.00	498,000
木村化工機	700	492.00	344,400
アネスト岩田	1,000	795.00	795,000
ダイフク	3,100	1,282.00	3,974,200
サムコ	100	984.00	98,400
加藤製作所	1,000	821.00	821,000
油研工業	2,000	249.00	498,000
タダノ	3,000	1,650.00	4,950,000
フジテック	1,800	1,110.00	1,998,000
C K D	1,800	966.00	1,738,800
キトー	700	1,311.00	917,700
平和	1,400	2,311.00	3,235,400
理想科学工業	400	3,550.00	1,420,000
S A N K Y O	1,900	3,940.00	7,486,000
日本金銭機械	600	1,686.00	1,011,600

マースエンジニアリング	400	1,998.00	799,200
福島工業	300	2,096.00	628,800
オーイズミ	400	889.00	355,600
ダイコク電機	300	1,800.00	540,000
アマノ	2,100	1,229.00	2,580,900
J U K I	5,000	379.00	1,895,000
サンデン	4,000	655.00	2,620,000
蛇の目ミシン工業	6,000	183.00	1,098,000
マックス	1,000	1,249.00	1,249,000
グローリー	2,100	2,848.00	5,980,800
新晃工業	500	999.00	499,500
大和冷機工業	1,000	827.00	827,000
セガサミーホールディングス	6,900	1,658.00	11,440,200
日本ピストンリング	2,000	245.00	490,000
リケン	3,000	448.00	1,344,000
T P R	700	2,701.00	1,890,700
ホシザキ電機	1,400	5,510.00	7,714,000
大豊工業	500	1,206.00	603,000
日本精工	13,000	1,474.00	19,162,000
N T N	15,000	491.00	7,365,000
ジェイテクト	6,800	1,793.00	12,192,400
不二越	6,000	699.00	4,194,000
日本トムソン	2,000	495.00	990,000
T H K	4,300	2,781.00	11,958,300
ユーシン精機	300	2,308.00	692,400
前澤給装工業	300	1,378.00	413,400
イーグル工業	900	2,150.00	1,935,000
前澤工業	800	334.00	267,200
日本ピラー工業	700	895.00	626,500
キッツ	2,900	466.00	1,351,400
日立工機	1,700	980.00	1,666,000
マキタ	4,200	6,340.00	26,628,000
日立造船	4,900	612.00	2,998,800
三菱重工業	107,000	690.70	73,904,900
I H I	46,000	564.00	25,944,000
イビデン	4,200	1,704.00	7,156,800
コニカミノルタ	15,300	1,264.00	19,339,200
ブラザー工業	8,200	2,037.00	16,703,400
ミネベア	9,000	1,484.00	13,356,000
日立製作所	153,000	873.50	133,645,500
東芝	134,000	498.70	66,825,800
三菱電機	64,000	1,435.00	91,840,000

富士電機	18,000	488.00	8,784,000
東洋電機製造	2,000	390.00	780,000
安川電機	7,500	1,447.00	10,852,500
シンフォニアテクノロジー	4,000	160.00	640,000
明電舎	6,000	401.00	2,406,000
オリジン電気	1,000	437.00	437,000
山洋電気	1,000	773.00	773,000
デンヨー	600	1,485.00	891,000
東芝テック	5,000	775.00	3,875,000
芝浦メカトロニクス	1,000	342.00	342,000
マブチモーター	1,000	9,520.00	9,520,000
日本電産	6,900	7,329.00	50,570,100
東光高岳	300	1,603.00	480,900
宮越ホールディングス	200	563.00	112,600
ダイヘン	4,000	414.00	1,656,000
ヤーマン	100	1,339.00	133,900
JVCケンウッド	4,600	215.00	989,000
第一精工	200	2,061.00	412,200
日新電機	2,000	591.00	1,182,000
大崎電気工業	1,000	707.00	707,000
オムロン	7,200	5,310.00	38,232,000
日東工業	1,000	1,993.00	1,993,000
I D E C	700	927.00	648,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	12,000	548.00	6,576,000
サクサホールディングス	2,000	153.00	306,000
メルコホールディングス	400	1,582.00	632,800
テクノメディカ	300	2,282.00	684,600
日本電気	83,000	387.00	32,121,000
富士通	61,000	678.00	41,358,000
沖電気工業	22,000	250.00	5,500,000
岩崎通信機	4,000	90.00	360,000
電気興業	2,000	562.00	1,124,000
サンケン電気	3,000	958.00	2,874,000
ナカヨ	1,000	367.00	367,000
アイホン	400	1,988.00	795,200
ルネサスエレクトロニクス	3,300	842.00	2,778,600
セイコーエプソン	4,400	5,350.00	23,540,000
ワコム	5,000	435.00	2,175,000
アルバック	1,200	1,381.00	1,657,200
アクセル	300	1,486.00	445,800
E I Z O	600	2,277.00	1,366,200
ジャパンディスプレイ	9,700	326.00	3,162,200

日本信号	1,800	1,075.00	1,935,000
京三製作所	1,000	357.00	357,000
能美防災	800	1,607.00	1,285,600
ホーチキ	1,000	900.00	900,000
エレコム	200	2,558.00	511,600
日本無線	1,000	396.00	396,000
パナソニック	77,700	1,417.50	110,139,750
シャープ	54,000	287.00	15,498,000
アンリツ	3,900	838.00	3,268,200
富士通ゼネラル	2,000	1,364.00	2,728,000
日立国際電気	2,000	1,713.00	3,426,000
ソニー	41,000	2,258.00	92,578,000
T D K	3,800	6,480.00	24,624,000
帝国通信工業	2,000	180.00	360,000
ミツミ電機	2,300	782.00	1,798,600
タムラ製作所	3,000	395.00	1,185,000
アルプス電気	5,000	2,086.00	10,430,000
池上通信機	2,000	121.00	242,000
パイオニア	9,500	279.00	2,650,500
日本電波工業	600	890.00	534,000
鈴木	100	884.00	88,400
日本トリム	100	2,453.00	245,300
ローランド ディー . ジー .	300	4,295.00	1,288,500
フォスター電機	700	1,789.00	1,252,300
クラリオン	3,000	401.00	1,203,000
S M K	2,000	436.00	872,000
ヨコオ	600	575.00	345,000
東光	1,000	316.00	316,000
ティアック	5,000	58.00	290,000
ホシデン	2,000	596.00	1,192,000
ヒロセ電機	1,000	14,220.00	14,220,000
日本航空電子工業	2,000	2,353.00	4,706,000
T O A	700	1,184.00	828,800
日立マクセル	900	1,736.00	1,562,400
古野電気	700	932.00	652,400
ユニデン	2,000	236.00	472,000
アルパイン	1,500	1,950.00	2,925,000
スミダコーポレーション	400	789.00	315,600
アイコム	300	2,771.00	831,300
リオン	100	1,406.00	140,600
船井電機	600	1,249.00	749,400
横河電機	6,400	1,517.00	9,708,800

新電元工業	2,000	693.00	1,386,000
アズビル	2,100	2,641.00	5,546,100
東亜ディーケーケー	200	582.00	116,400
日本光電工業	1,400	5,720.00	8,008,000
チノー	200	1,210.00	242,000
共和電業	800	456.00	364,800
日本電子材料	200	616.00	123,200
堀場製作所	1,200	4,055.00	4,866,000
アドバンテスト	4,400	1,339.00	5,891,600
小野測器	400	967.00	386,800
エスベック	700	1,023.00	716,100
パナソニック デバイスSUNX	600	599.00	359,400
キーエンス	1,400	53,700.00	75,180,000
日置電機	300	1,694.00	508,200
シスメックス	4,900	4,780.00	23,422,000
メガチップス	700	1,471.00	1,029,700
OBARA GROUP	400	4,210.00	1,684,000
澤藤電機	1,000	233.00	233,000
コーセル	900	1,294.00	1,164,600
新日本無線	1,000	486.00	486,000
オブテックス	500	1,971.00	985,500
千代田インテグレ	300	1,975.00	592,500
レーザーテック	700	1,271.00	889,700
スタンレー電気	4,600	2,250.00	10,350,000
岩崎電気	2,000	246.00	492,000
ウシオ電機	3,800	1,113.00	4,229,400
ヘリオス テクノ ホールディング	700	342.00	239,400
日本セラミック	400	1,666.00	666,400
遠藤照明	300	1,304.00	391,200
日本デジタル研究所	500	1,785.00	892,500
双信電機	300	398.00	119,400
山一電機	700	862.00	603,400
図研	500	1,052.00	526,000
日本電子	3,000	535.00	1,605,000
カシオ計算機	6,400	1,690.00	10,816,000
ファナック	6,600	19,965.00	131,769,000
日本シイエムケイ	1,600	275.00	440,000
エンブラス	300	3,905.00	1,171,500
大真空	1,000	340.00	340,000
ローム	3,100	6,970.00	21,607,000
浜松ホトニクス	2,700	5,160.00	13,932,000
三井ハイテック	800	680.00	544,000

新光電気工業	2,400	696.00	1,670,400	
京セラ	10,500	5,212.00	54,726,000	
太陽誘電	3,400	1,140.00	3,876,000	
村田製作所	6,700	12,590.00	84,353,000	
ユーシン	900	718.00	646,200	
双葉電子工業	1,100	1,578.00	1,735,800	
北陸電気工業	3,000	168.00	504,000	
ニチコン	2,000	809.00	1,618,000	
日本ケミコン	5,000	305.00	1,525,000	
K O A	900	1,015.00	913,500	
市光工業	2,000	254.00	508,000	
小糸製作所	3,800	3,410.00	12,958,000	
ミツバ	1,200	1,815.00	2,178,000	
スター精密	1,200	1,687.00	2,024,400	
S C R E E Nホールディングス	6,000	654.00	3,924,000	
キヤノン電子	600	2,033.00	1,219,800	
キヤノン	36,900	3,554.00	131,142,600	
リコー	19,200	1,196.50	22,972,800	
M U T O Hホールディングス	1,000	550.00	550,000	
東京エレクトロン	5,400	7,528.00	40,651,200	
トヨタ紡織	2,200	1,255.00	2,761,000	
鬼怒川ゴム工業	1,000	491.00	491,000	
ユニプレス	1,200	2,023.00	2,427,600	
豊田自動織機	5,800	5,570.00	32,306,000	
モリタホールディングス	1,100	1,115.00	1,226,500	
三櫻工業	800	733.00	586,400	
デンソー	15,700	5,299.00	83,194,300	
東海理化電機製作所	1,700	2,275.00	3,867,500	
三井造船	25,000	244.00	6,100,000	
川崎重工業	47,000	455.00	21,385,000	
名村造船所	1,800	1,156.00	2,080,800	
サノヤホールディングス	400	281.00	112,400	
日本車輛製造	2,000	346.00	692,000	
ニチュ三菱フォークリフト	700	757.00	529,900	
近畿車輛	1,000	292.00	292,000	
日産自動車	89,500	1,045.50	93,572,250	
いすゞ自動車	20,100	1,478.00	29,707,800	
トヨタ自動車	87,900	6,817.00	599,214,300	代用有価証券 30,000株
日野自動車	9,100	1,615.00	14,696,500	
三菱自動車工業	23,400	1,191.00	27,869,400	
エフテック	200	1,129.00	225,800	

レシップホールディングス	200	875.00	175,000
武蔵精密工業	700	2,255.00	1,578,500
日産車体	2,800	1,510.00	4,228,000
新明和工業	3,000	993.00	2,979,000
極東開発工業	1,200	1,559.00	1,870,800
日信工業	1,200	1,760.00	2,112,000
トビー工業	5,000	210.00	1,050,000
ティラド	2,000	267.00	534,000
曙ブレーキ工業	2,600	448.00	1,164,800
タチエス	1,000	1,469.00	1,469,000
NOK	3,100	2,894.00	8,971,400
フタバ産業	1,900	604.00	1,147,600
カヤバ工業	7,000	483.00	3,381,000
シロキ工業	2,000	221.00	442,000
大同メタル工業	1,000	1,320.00	1,320,000
プレス工業	3,000	420.00	1,260,000
カルソニックカンセイ	5,000	600.00	3,000,000
太平洋工業	1,300	825.00	1,072,500
ケーヒン	1,400	1,431.00	2,003,400
河西工業	800	993.00	794,400
アイシン精機	5,800	3,885.00	22,533,000
富士機工	1,000	533.00	533,000
マツダ	19,000	2,737.00	52,003,000
ダイハツ工業	7,600	1,603.00	12,182,800
今仙電機製作所	500	1,859.00	929,500
本田技研工業	57,300	3,644.50	208,829,850
スズキ	13,300	3,510.50	46,689,650
富士重工業	21,700	4,091.00	88,774,700
安永	200	591.00	118,200
ヤマハ発動機	9,800	2,319.00	22,726,200
ショーワ	1,500	1,190.00	1,785,000
T B K	800	651.00	520,800
エクセディ	900	2,892.00	2,602,800
豊田合成	2,000	2,182.00	4,364,000
愛三工業	1,000	875.00	875,000
ヨロズ	600	1,979.00	1,187,400
エフ・シー・シー	900	1,955.00	1,759,500
シマノ	2,800	15,200.00	42,560,000
タカタ	1,100	1,416.00	1,557,600
テイ・エス テック	1,400	2,765.00	3,871,000
テルモ	9,800	2,805.00	27,489,000
クリエートメディック	200	1,044.00	208,800

日機装	2,000	1,157.00	2,314,000
島津製作所	8,000	971.00	7,768,000
JMS	1,000	291.00	291,000
ショットモリテックス	200	278.00	55,600
長野計器	500	659.00	329,500
ブイ・テクノロジー	100	2,581.00	258,100
東京計器	2,000	276.00	552,000
愛知時計電機	1,000	322.00	322,000
オーバル	500	294.00	147,000
東京精密	1,100	1,805.00	1,985,500
マニー	200	6,880.00	1,376,000
ニコン	12,000	1,546.00	18,552,000
トプコン	1,900	2,674.00	5,080,600
オリンパス	9,500	4,265.00	40,517,500
理研計器	600	1,100.00	660,000
タムロン	500	2,166.00	1,083,000
HOYA	15,200	4,037.00	61,362,400
ノーリツ鋼機	600	611.00	366,600
エー・アンド・デイ	600	532.00	319,200
シチズンホールディングス	7,900	760.00	6,004,000
リズム時計工業	3,000	157.00	471,000
大研医器	200	2,290.00	458,000
松風	300	1,366.00	409,800
セイコーホールディングス	4,000	563.00	2,252,000
ニプロ	4,100	917.00	3,759,700
パラマウントベッドホールディングス	700	3,215.00	2,250,500
SHO-BI	100	411.00	41,100
前田工織	700	1,212.00	848,400
永大産業	1,000	445.00	445,000
アートネイチャー	400	1,424.00	569,600
ダンロップスポーツ	400	1,350.00	540,000
パンダイナムコホールディングス	7,100	2,566.00	18,218,600
共立印刷	900	285.00	256,500
フランスベッドホールディングス	4,000	184.00	736,000
パイロットコーポレーション	600	6,340.00	3,804,000
萩原工業	100	1,731.00	173,100
トッパン・フォームズ	1,200	1,110.00	1,332,000
フジシールインターナショナル	800	3,500.00	2,800,000
タカラトミー	2,300	610.00	1,403,000
廣済堂	800	460.00	368,000
タカノ	400	599.00	239,600
プロネクサス	600	719.00	431,400

ホクシン	400	130.00	52,000
ウッドワン	1,000	276.00	276,000
大建工業	3,000	251.00	753,000
凸版印刷	18,000	743.00	13,374,000
大日本印刷	20,000	1,057.00	21,140,000
図書印刷	1,000	353.00	353,000
共同印刷	2,000	386.00	772,000
日本写真印刷	1,000	1,650.00	1,650,000
光村印刷	1,000	261.00	261,000
宝印刷	400	780.00	312,000
アシックス	6,400	2,790.00	17,856,000
ツツミ	300	2,595.00	778,500
小松ウオール工業	200	2,613.00	522,600
ヤマハ	4,700	1,541.00	7,242,700
河合楽器製作所	200	2,057.00	411,400
クリナップ	700	906.00	634,200
ピジョン	1,200	6,960.00	8,352,000
兼松日産農林	2,000	166.00	332,000
キングジム	600	748.00	448,800
リンテック	1,500	2,371.00	3,556,500
T A S A K I	100	1,176.00	117,600
イトーキ	1,400	587.00	821,800
任天堂	3,900	12,165.00	47,443,500
三菱鉛筆	500	3,610.00	1,805,000
タカラスタANDARD	3,000	850.00	2,550,000
コクヨ	3,300	893.00	2,946,900
ナカバヤシ	2,000	203.00	406,000
岡村製作所	2,400	771.00	1,850,400
美津濃	3,000	552.00	1,656,000
アデランス	800	1,277.00	1,021,600
東京電力	54,100	436.00	23,587,600
中部電力	19,600	1,424.50	27,920,200
関西電力	26,000	1,156.50	30,069,000
中国電力	8,800	1,522.00	13,393,600
北陸電力	6,200	1,546.00	9,585,200
東北電力	15,900	1,445.00	22,975,500
四国電力	5,700	1,571.00	8,954,700
九州電力	14,100	1,289.00	18,174,900
北海道電力	5,900	963.00	5,681,700
沖縄電力	400	3,490.00	1,396,000
電源開発	4,300	3,940.00	16,942,000
東京瓦斯	78,000	648.00	50,544,000

大阪瓦斯	66,000	454.30	29,983,800
東邦瓦斯	16,000	621.00	9,936,000
北海道瓦斯	1,000	290.00	290,000
西部瓦斯	7,000	271.00	1,897,000
静岡瓦斯	1,800	731.00	1,315,800
SBSホールディングス	500	953.00	476,500
東武鉄道	34,000	559.00	19,006,000
相鉄ホールディングス	11,000	431.00	4,741,000
東京急行電鉄	35,000	725.00	25,375,000
京浜急行電鉄	17,000	911.00	15,487,000
小田急電鉄	20,000	1,062.00	21,240,000
京王電鉄	18,000	857.00	15,426,000
京成電鉄	10,000	1,288.00	12,880,000
富士急行	2,000	1,097.00	2,194,000
新京成電鉄	1,000	385.00	385,000
東日本旅客鉄道	11,700	8,654.00	101,251,800
西日本旅客鉄道	6,100	5,374.00	32,781,400
東海旅客鉄道	5,700	16,740.00	95,418,000
西武ホールディングス	5,100	2,177.00	11,102,700
鴻池運輸	400	2,213.00	885,200
西日本鉄道	8,000	480.00	3,840,000
ハマキョウレックス	200	3,595.00	719,000
サカイ引越センター	100	3,430.00	343,000
近畿日本鉄道	64,000	393.00	25,152,000
阪急阪神ホールディングス	43,000	650.00	27,950,000
南海電気鉄道	13,000	548.00	7,124,000
京阪電気鉄道	14,000	578.00	8,092,000
神戸電鉄	2,000	371.00	742,000
名糖運輸	200	681.00	136,200
名古屋鉄道	23,000	475.00	10,925,000
山陽電気鉄道	2,000	453.00	906,000
日本通運	25,000	508.00	12,700,000
ヤマトホールディングス	11,700	2,437.50	28,518,750
山九	8,000	476.00	3,808,000
丸運	300	248.00	74,400
丸全昭和運輸	2,000	350.00	700,000
センコー	3,000	495.00	1,485,000
トナミホールディングス	2,000	254.00	508,000
日本梱包運輸倉庫	2,100	1,799.00	3,777,900
日本石油輸送	1,000	232.00	232,000
福山通運	4,000	560.00	2,240,000
セイノーホールディングス	5,000	903.00	4,515,000

神奈川中央交通	1,000	552.00	552,000
日立物流	1,300	1,541.00	2,003,300
日本郵船	54,000	301.00	16,254,000
商船三井	33,000	346.00	11,418,000
川崎汽船	28,000	276.00	7,728,000
N S ユナイテッド海運	3,000	293.00	879,000
明治海運	700	377.00	263,900
飯野海運	3,300	663.00	2,187,900
共栄タンカー	1,000	211.00	211,000
日本航空	12,200	3,075.00	37,515,000
A N A ホールディングス	125,000	260.80	32,600,000
スカイマーク	1,800	195.00	351,000
パスコ	1,000	351.00	351,000
トランコム	200	4,480.00	896,000
日新	2,000	282.00	564,000
三菱倉庫	4,000	1,733.00	6,932,000
三井倉庫ホールディングス	4,000	432.00	1,728,000
住友倉庫	5,000	621.00	3,105,000
澁澤倉庫	2,000	370.00	740,000
東陽倉庫	1,000	273.00	273,000
乾汽船	400	1,030.00	412,000
日本トランスシティ	1,000	370.00	370,000
ケイヒン	1,000	166.00	166,000
中央倉庫	300	914.00	274,200
安田倉庫	500	1,025.00	512,500
東洋埠頭	2,000	208.00	416,000
宇徳	400	611.00	244,400
上組	8,000	1,082.00	8,656,000
サンリツ	200	520.00	104,000
キューソー流通システム	200	1,284.00	256,800
郵船ロジスティクス	600	1,207.00	724,200
近鉄エクスプレス	600	4,045.00	2,427,000
エーアイティー	200	791.00	158,200
N E C ネットズエスアイ	800	2,466.00	1,972,800
システナ	600	831.00	498,600
デジタルアーツ	200	1,151.00	230,200
新日鉄住金ソリューションズ	500	3,360.00	1,680,000
キューブシステム	200	529.00	105,800
コア	300	812.00	243,600
ソフトクリエイイトホールディングス	200	933.00	186,600
I T ホールディングス	2,100	1,844.00	3,872,400
電算システム	200	1,568.00	313,600

グリー	3,800	774.00	2,941,200
コーエーテクモホールディングス	1,400	1,769.00	2,476,600
三菱総合研究所	200	2,703.00	540,600
ポルテージ	100	1,284.00	128,400
A G S	100	907.00	90,700
ヒト・コミュニケーションズ	100	1,748.00	174,800
K L a b	700	1,653.00	1,157,100
ポルトウウィン・ビットクルーホールディングス	300	851.00	255,300
イーブックイニシアティブジャパン	100	1,244.00	124,400
ネクソン	6,000	1,006.00	6,036,000
アイスタイル	100	494.00	49,400
エイチーム	100	5,230.00	523,000
e n i s h	100	2,329.00	232,900
コロプラ	1,100	3,810.00	4,191,000
モバイルクリエイト	200	813.00	162,600
オルトプラス	100	811.00	81,100
ブロードリーフ	500	1,736.00	868,000
ハーツユナイテッドグループ	100	1,911.00	191,100
ティーガイア	600	1,092.00	655,200
豆蔵ホールディングス	300	670.00	201,000
テクマトリックス	200	643.00	128,600
G M O ペイメントゲートウェイ	600	2,252.00	1,351,200
ザッパラス	400	595.00	238,000
インターネットイニシアティブ	1,000	2,033.00	2,033,000
ビットアイル	400	463.00	185,200
S R A ホールディングス	300	1,433.00	429,900
コムチュア	100	1,890.00	189,000
パナソニック インフォメーションシステムズ	200	3,050.00	610,000
フェイス	200	1,044.00	208,800
野村総合研究所	3,600	3,680.00	13,248,000
サイバネットシステム	700	483.00	338,100
インテージホールディングス	300	1,462.00	438,600
東邦システムサイエンス	100	1,219.00	121,900
ティー・ワイ・オー	500	175.00	87,500
クレスコ	300	1,452.00	435,600
フジ・メディア・ホールディングス	6,600	1,469.00	9,695,400
オービック	2,200	3,895.00	8,569,000
ジャストシステム	800	808.00	646,400
T D C ソフトウェアエンジニアリング	200	944.00	188,800
ヤフー	45,300	411.00	18,618,300
トレンドマイクロ	3,300	3,715.00	12,259,500

日本オラクル	1,000	4,240.00	4,240,000
アルファシステムズ	200	1,522.00	304,400
フューチャーアーキテクト	700	635.00	444,500
C A C Holdings	400	1,221.00	488,400
ソフトバンク・テクノロジー	200	1,370.00	274,000
トーセ	300	725.00	217,500
オービックビジネスコンサルタント	400	3,310.00	1,324,000
伊藤忠テクノソリューションズ	700	4,765.00	3,335,500
アイティフォー	900	425.00	382,500
東計電算	100	1,618.00	161,800
エクスネット	100	1,406.00	140,600
大塚商会	1,700	4,010.00	6,817,000
サイボウズ	1,300	360.00	468,000
ソフトブレーン	1,200	201.00	241,200
電通国際情報サービス	400	1,281.00	512,400
E Mシステムズ	100	1,729.00	172,900
ウェザーニューズ	200	3,035.00	607,000
C I J	900	493.00	443,700
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,372.00	137,200
日本エンタープライズ	400	452.00	180,800
WOWOW	200	5,120.00	1,024,000
日本コロムビア	300	448.00	134,400
イマジカ・ロボットホールディングス	300	470.00	141,000
ネットワンシステムズ	2,500	678.00	1,695,000
アルゴグラフィックス	300	1,955.00	586,500
マーベラス	1,100	1,141.00	1,255,100
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,200	1,635.00	1,962,000
日本ユニシス	1,800	1,082.00	1,947,600
兼松エレクトロニクス	400	1,511.00	604,400
東京放送ホールディングス	3,700	1,348.00	4,987,600
日本テレビホールディングス	5,700	1,698.00	9,678,600
テレビ朝日ホールディングス	1,700	1,841.00	3,129,700
スカパーJ S A Tホールディングス	4,700	683.00	3,210,100
テレビ東京ホールディングス	500	2,239.00	1,119,500
コネクシオ	500	1,160.00	580,000
日本電信電話	24,600	6,819.00	167,747,400
K D D I	21,300	7,312.00	155,745,600
光通信	600	7,200.00	4,320,000
N T T ドコモ	51,900	1,832.50	95,106,750
G M O インターネット	2,100	1,031.00	2,165,100
K A D O K A W A ・ D W A N G O	1,600	2,006.00	3,209,600
学研ホールディングス	2,000	261.00	522,000

ゼンリン	800	1,364.00	1,091,200
昭文社	400	779.00	311,600
インプレスホールディングス	700	127.00	88,900
アイネット	400	849.00	339,600
松竹	4,000	1,030.00	4,120,000
東宝	4,500	2,613.00	11,758,500
東映	2,000	580.00	1,160,000
AOI Pro.	400	715.00	286,000
エヌ・ティ・ティ・データ	3,900	4,355.00	16,984,500
DTS	600	2,300.00	1,380,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,300	2,178.00	5,009,400
シーイーシー	500	1,036.00	518,000
カプコン	1,600	1,765.00	2,824,000
ジャステック	600	896.00	537,600
SCSK	1,500	3,075.00	4,612,500
日本システムウエア	400	648.00	259,200
アイネス	900	831.00	747,900
TKC	500	2,175.00	1,087,500
富士ソフト	900	2,554.00	2,298,600
NSD	1,300	1,637.00	2,128,100
コナミ	2,600	2,142.00	5,569,200
福井コンピュータホールディングス	200	785.00	157,000
JBCCHホールディングス	500	766.00	383,000
ミロク情報サービス	500	592.00	296,000
ソフトバンク	33,200	7,780.00	258,296,000
ハウスイ	1,000	130.00	130,000
高千穂交易	300	1,038.00	311,400
伊藤忠食品	200	3,680.00	736,000
エレマテック	300	2,492.00	747,600
JALUX	200	1,317.00	263,400
あらた	1,000	319.00	319,000
トーメンデバイス	100	1,771.00	177,100
東京エレクトロン デバイス	100	1,490.00	149,000
双日	42,200	171.00	7,216,200
アルフレッサ ホールディングス	7,400	1,397.00	10,337,800
横浜冷凍	1,600	808.00	1,292,800
神栄	1,000	202.00	202,000
ラサ商事	300	527.00	158,100
アルコニックス	400	1,680.00	672,000
神戸物産	100	4,770.00	477,000
あい ホールディングス	1,000	2,111.00	2,111,000
ダイワボウホールディングス	6,000	203.00	1,218,000

バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,100	863.00	949,300
八洲電機	500	560.00	280,000
U K Cホールディングス	400	1,854.00	741,600
T O K A Iホールディングス	3,100	568.00	1,760,800
三洋貿易	400	1,288.00	515,200
ミタチ産業	100	748.00	74,800
シップヘルスケアホールディングス	1,100	2,749.00	3,023,900
スターティア	100	1,770.00	177,000
富士興産	300	634.00	190,200
協栄産業	1,000	220.00	220,000
小野建	500	1,010.00	505,000
佐鳥電機	500	722.00	361,000
エコートレーディング	100	665.00	66,500
伯東	400	1,155.00	462,000
コンドーテック	200	726.00	145,200
中山福	400	813.00	325,200
ナガイレーベン	900	2,049.00	1,844,100
三菱食品	700	2,603.00	1,822,100
松田産業	500	1,258.00	629,000
メディバルホールディングス	6,300	1,281.00	8,070,300
アドヴァン	400	1,147.00	458,800
S P K	100	1,943.00	194,300
アズワン	400	3,135.00	1,254,000
尾家産業	200	834.00	166,800
シモジマ	400	1,009.00	403,600
ドウシシャ	800	1,819.00	1,455,200
小津産業	100	1,773.00	177,300
高速	400	929.00	371,600
黒田電気	1,100	1,569.00	1,725,900
丸文	600	743.00	445,800
ハビネット	400	1,795.00	718,000
トーメンエレクトロニクス	300	1,650.00	495,000
エクセル	300	1,416.00	424,800
マルカキカイ	200	1,369.00	273,800
ガリバーインターナショナル	1,900	954.00	1,812,600
日本エム・ディ・エム	900	568.00	511,200
進和	400	1,301.00	520,400
エスケイジャパン	200	262.00	52,400
ダイトエレクトロン	300	508.00	152,400
シークス	400	1,935.00	774,000
田中商事	200	675.00	135,000
オーハシテクニカ	400	1,295.00	518,000

マクニカ	300	3,150.00	945,000
白銅	300	1,041.00	312,300
伊藤忠商事	52,700	1,367.00	72,040,900
丸紅	54,900	728.00	39,967,200
高島	1,000	233.00	233,000
長瀬産業	3,800	1,368.00	5,198,400
蝶理	400	1,668.00	667,200
豊田通商	7,100	2,762.00	19,610,200
三共生興	1,200	413.00	495,600
兼松	12,000	178.00	2,136,000
ツカモトコーポレーション	1,000	130.00	130,000
三井物産	53,300	1,679.00	89,490,700
日本紙パルプ商事	3,000	330.00	990,000
日立ハイテクノロジーズ	2,200	3,395.00	7,469,000
カメイ	800	811.00	648,800
東都水産	1,000	195.00	195,000
OUGホールディングス	1,000	231.00	231,000
スターゼン	3,000	340.00	1,020,000
山善	2,400	862.00	2,068,800
椿本興業	1,000	306.00	306,000
住友商事	37,100	1,220.00	45,262,000
内田洋行	1,000	353.00	353,000
三菱商事	48,200	2,236.00	107,775,200
第一実業	2,000	540.00	1,080,000
キャノンマーケティングジャパン	1,800	2,206.00	3,970,800
西華産業	2,000	275.00	550,000
佐藤商事	500	743.00	371,500
菱洋エレクトロ	700	1,101.00	770,700
東京産業	500	441.00	220,500
ユアサ商事	500	2,210.00	1,105,000
神鋼商事	2,000	281.00	562,000
小林産業	300	274.00	82,200
阪和興業	6,000	404.00	2,424,000
カナデン	1,000	790.00	790,000
菱電商事	1,000	821.00	821,000
フルサト工業	300	1,683.00	504,900
岩谷産業	7,000	718.00	5,026,000
すてきナイスグループ	3,000	198.00	594,000
昭光通商	2,000	167.00	334,000
ニチモウ	1,000	194.00	194,000
極東貿易	1,000	251.00	251,000
イワキ	1,000	236.00	236,000

三愛石油	2,000	780.00	1,560,000
稲畑産業	1,500	1,034.00	1,551,000
G S Iクレオス	3,000	137.00	411,000
明和産業	500	414.00	207,000
ワキタ	1,400	1,152.00	1,612,800
東邦ホールディングス	2,100	1,432.00	3,007,200
サンゲツ	1,200	2,703.00	3,243,600
ミツウロコグループホールディングス	1,100	543.00	597,300
シナネン	1,000	440.00	440,000
伊藤忠エネクス	1,400	725.00	1,015,000
サンリオ	1,800	3,045.00	5,481,000
サンワテクノス	400	1,150.00	460,000
リョーサン	1,100	2,418.00	2,659,800
新光商事	800	1,102.00	881,600
トーホー	1,000	423.00	423,000
三信電気	800	818.00	654,400
東陽テクニカ	900	989.00	890,100
モスフードサービス	800	2,105.00	1,684,000
加賀電子	500	1,375.00	687,500
ソーダニッカ	1,000	474.00	474,000
立花エレテック	400	1,466.00	586,400
P a l t a c	1,000	1,362.00	1,362,000
太平洋興発	3,000	94.00	282,000
ヤマタネ	3,000	173.00	519,000
日鉄住金物産	4,000	402.00	1,608,000
トラスコ中山	800	3,170.00	2,536,000
オートバックスセブン	2,300	1,650.00	3,795,000
加藤産業	900	2,381.00	2,142,900
イノテック	400	544.00	217,600
イエローハット	600	2,279.00	1,367,400
富士エレクトロニクス	300	1,313.00	393,900
J Kホールディングス	700	558.00	390,600
日伝	300	2,468.00	740,400
北沢産業	500	181.00	90,500
杉本商事	400	1,111.00	444,400
因幡電機産業	900	3,860.00	3,474,000
バイテック	200	823.00	164,600
ミスミグループ本社	2,300	3,635.00	8,360,500
江守グループホールディングス	300	1,119.00	335,700
アルテック	400	224.00	89,600
タキヒヨー	1,000	409.00	409,000
スズケン	2,600	3,040.00	7,904,000

ジェコス	400	1,888.00	755,200
ローソン	2,400	7,560.00	18,144,000
サンエー	500	3,725.00	1,862,500
ダイユーエイト	100	699.00	69,900
カワチ薬品	500	1,764.00	882,000
エービーシー・マート	900	6,120.00	5,508,000
ハードオフコーポレーション	300	895.00	268,500
アスクル	700	2,055.00	1,438,500
ゲオホールディングス	1,200	977.00	1,172,400
アダストリアホールディングス	500	2,223.00	1,111,500
くらコーポレーション	400	2,941.00	1,176,400
キャンドウ	300	1,649.00	494,700
パル	400	2,895.00	1,158,000
エディオン	2,900	794.00	2,302,600
サーラコーポレーション	600	608.00	364,800
ワッツ	200	865.00	173,000
あみやき亭	200	4,005.00	801,000
ひらまつ	900	607.00	546,300
大黒天物産	200	3,265.00	653,000
ハニーズ	500	1,011.00	505,500
アルペン	600	1,679.00	1,007,400
クオール	200	717.00	143,400
ジェイアイエヌ	400	2,407.00	962,800
ビックカメラ	2,700	943.00	2,546,100
D C Mホールディングス	3,000	720.00	2,160,000
MonotaRO	1,200	2,946.00	3,535,200
きちり	100	690.00	69,000
アークランドサービス	100	3,330.00	333,000
J.フロント リテイリング	8,000	1,441.00	11,528,000
ドトール・日レスホールディングス	1,100	1,591.00	1,750,100
マツモトキヨシホールディングス	1,400	3,250.00	4,550,000
スタートトゥデイ	1,900	2,306.00	4,381,400
物語コーポレーション	200	3,580.00	716,000
ココカラファイン	700	2,733.00	1,913,100
三越伊勢丹ホールディングス	12,600	1,447.00	18,232,200
ウエルシアホールディングス	600	3,605.00	2,163,000
クリエイイトSDホールディングス	300	3,955.00	1,186,500
丸善C H Iホールディングス	300	374.00	112,200
チムニー	200	2,261.00	452,200
ジョイフル本田	300	4,115.00	1,234,500
キリン堂ホールディングス	300	685.00	205,500
ブックオフコーポレーション	300	828.00	248,400

あさひ	400	1,170.00	468,000
コスモス薬品	400	15,950.00	6,380,000
トーエル	300	671.00	201,300
一六堂	100	446.00	44,600
セブン&アイ・ホールディングス	26,300	4,302.00	113,142,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	400	1,417.00	566,800
ツルハホールディングス	1,200	6,630.00	7,956,000
サンマルクホールディングス	200	5,860.00	1,172,000
フェリシモ	200	1,105.00	221,000
トリドール	600	1,418.00	850,800
クスリのアオキ	300	5,040.00	1,512,000
メディカルシステムネットワーク	200	350.00	70,000
総合メディカル	200	5,430.00	1,086,000
はるやま商事	500	707.00	353,500
カッパ・クリエイトホールディングス	1,000	1,027.00	1,027,000
ライトオン	500	715.00	357,500
ジーンズメイト	300	210.00	63,000
良品計画	800	14,080.00	11,264,000
三城ホールディングス	800	475.00	380,000
コナカ	800	634.00	507,200
ハウス オブ ローゼ	100	1,387.00	138,700
G - 7ホールディングス	300	922.00	276,600
イオン北海道	500	654.00	327,000
コジマ	900	295.00	265,500
ヒマラヤ	200	952.00	190,400
コーナン商事	1,000	1,277.00	1,277,000
エコス	300	840.00	252,000
ワタミ	700	1,262.00	883,400
ドンキホーテホールディングス	2,200	6,970.00	15,334,000
西松屋チェーン	1,200	964.00	1,156,800
ゼンショーホールディングス	3,200	992.00	3,174,400
幸楽苑	400	1,401.00	560,400
ハークスレイ	200	892.00	178,400
サイゼリヤ	900	1,641.00	1,476,900
ポプラ	200	539.00	107,800
ユニテッドアローズ	800	3,505.00	2,804,000
ハイデイ日高	400	3,330.00	1,332,000
京都きもの友禅	400	1,007.00	402,800
コロワイド	2,100	1,298.00	2,725,800
壱番屋	200	5,220.00	1,044,000
トップカルチャー	300	500.00	150,000

PLANT	100	1,161.00	116,100
スギホールディングス	1,100	4,850.00	5,335,000
スクロール	1,000	272.00	272,000
ヨンドシーホールディングス	500	1,967.00	983,500
ファミリーマート	2,100	4,425.00	9,292,500
木曽路	800	1,906.00	1,524,800
サトレストランシステムズ	600	863.00	517,800
千趣会	1,100	860.00	946,000
タカキュー	500	206.00	103,000
ケーヨー	1,100	526.00	578,600
上新電機	1,000	987.00	987,000
日本瓦斯	1,000	2,569.00	2,569,000
ベスト電器	2,000	135.00	270,000
マルエツ	1,000	541.00	541,000
ロイヤルホールディングス	1,000	1,661.00	1,661,000
東天紅	1,000	178.00	178,000
いなげや	700	1,165.00	815,500
島忠	1,500	2,864.00	4,296,000
チヨダ	700	2,184.00	1,528,800
ライフコーポレーション	400	1,775.00	710,000
カスミ	1,300	1,045.00	1,358,500
リンガーハット	600	1,730.00	1,038,000
さが美	1,000	94.00	94,000
MrMax	800	309.00	247,200
テナアライド	500	349.00	174,500
AOKIホールディングス	1,500	1,185.00	1,777,500
オークワ	1,000	956.00	956,000
コメリ	1,100	2,473.00	2,720,300
青山商事	1,500	2,619.00	3,928,500
しまむら	700	9,580.00	6,706,000
CFSコーポレーション	700	635.00	444,500
はせがわ	200	584.00	116,800
高島屋	9,000	943.00	8,487,000
松屋	1,300	1,506.00	1,957,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	3,000	1,791.00	5,373,000
近鉄百貨店	2,000	310.00	620,000
丸栄	1,000	143.00	143,000
ニッセンホールディングス	1,300	351.00	456,300
パルコ	600	917.00	550,200
丸井グループ	7,600	972.00	7,387,200
アクシアル リテイリング	500	2,370.00	1,185,000
ダイエー	7,100	129.00	915,900

イオン	25,100	1,117.00	28,036,700
ユニグループ・ホールディングス	6,100	584.00	3,562,400
イズミ	1,400	3,535.00	4,949,000
東武ストア	1,000	286.00	286,000
平和堂	1,300	2,100.00	2,730,000
フジ	700	2,169.00	1,518,300
ヤオコー	400	6,970.00	2,788,000
ゼビオ	900	1,764.00	1,587,600
ケーズホールディングス	1,400	2,854.00	3,995,600
Olympicグループ	500	997.00	498,500
日産東京販売ホールディングス	1,000	290.00	290,000
アインファーマシーズ	700	3,040.00	2,128,000
元気寿司	200	1,852.00	370,400
ヤマダ電機	24,800	364.00	9,027,200
アークランドサカモト	400	2,527.00	1,010,800
ニトリホールディングス	2,700	6,830.00	18,441,000
グルメ杵屋	1,000	866.00	866,000
愛眼	600	258.00	154,800
ケーユーホールディングス	200	590.00	118,000
吉野家ホールディングス	1,800	1,251.00	2,251,800
松屋フーズ	300	2,041.00	612,300
サガミチェーン	1,000	1,045.00	1,045,000
関西スーパーマーケット	300	790.00	237,000
王将フードサービス	500	4,005.00	2,002,500
プレナス	700	1,957.00	1,369,900
ミニストップ	500	1,542.00	771,000
アークス	1,100	2,439.00	2,682,900
パロー	1,300	1,733.00	2,252,900
藤久	100	1,689.00	168,900
ベルク	300	3,250.00	975,000
大庄	300	1,314.00	394,200
ファーストリテイリング	1,300	42,325.00	55,022,500
サンドラッグ	1,300	5,150.00	6,695,000
サクスパー ホールディングス	500	1,501.00	750,500
ヤマザワ	200	1,603.00	320,600
やまや	100	1,580.00	158,000
ベルーナ	1,500	473.00	709,500
島根銀行	100	1,366.00	136,600
じもとホールディングス	4,500	227.00	1,021,500
足利ホールディングス	4,000	427.00	1,708,000
東京TYフィナンシャルグループ	800	3,515.00	2,812,000
新生銀行	60,000	242.00	14,520,000

あおぞら銀行	42,000	392.00	16,464,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	504,500	628.50	317,078,250
りそなホールディングス	73,600	657.00	48,355,200
三井住友トラスト・ホールディングス	139,000	469.80	65,302,200
三井住友フィナンシャルグループ	47,600	4,427.00	210,725,200
第四銀行	8,000	398.00	3,184,000
北越銀行	7,000	222.00	1,554,000
西日本シティ銀行	22,000	312.00	6,864,000
千葉銀行	24,000	813.00	19,512,000
横浜銀行	43,000	661.30	28,435,900
常陽銀行	23,000	594.00	13,662,000
群馬銀行	15,000	714.00	10,710,000
武蔵野銀行	1,000	3,785.00	3,785,000
千葉興業銀行	1,300	810.00	1,053,000
筑波銀行	2,500	378.00	945,000
七十七銀行	11,000	633.00	6,963,000
青森銀行	5,000	343.00	1,715,000
秋田銀行	4,000	316.00	1,264,000
山形銀行	4,000	525.00	2,100,000
岩手銀行	400	5,090.00	2,036,000
東邦銀行	6,000	410.00	2,460,000
東北銀行	4,000	158.00	632,000
みちのく銀行	3,000	216.00	648,000
ふくおかフィナンシャルグループ	25,000	586.00	14,650,000
静岡銀行	18,000	1,163.00	20,934,000
十六銀行	8,000	447.00	3,576,000
スルガ銀行	6,700	2,301.00	15,416,700
八十二銀行	11,000	699.00	7,689,000
山梨中央銀行	4,000	502.00	2,008,000
大垣共立銀行	8,000	308.00	2,464,000
福井銀行	5,000	266.00	1,330,000
北國銀行	7,000	375.00	2,625,000
清水銀行	200	2,972.00	594,400
滋賀銀行	6,000	611.00	3,666,000
南都銀行	6,000	429.00	2,574,000
百五銀行	6,000	472.00	2,832,000
京都銀行	12,000	977.00	11,724,000
紀陽銀行	2,500	1,608.00	4,020,000
三重銀行	3,000	266.00	798,000
ほくほくフィナンシャルグループ	43,000	227.00	9,761,000
広島銀行	19,000	587.00	11,153,000
山陰合同銀行	4,000	858.00	3,432,000

中国銀行	4,500	1,659.00	7,465,500
鳥取銀行	2,000	224.00	448,000
伊予銀行	6,600	1,207.00	7,966,200
百十四銀行	7,000	357.00	2,499,000
四国銀行	5,000	243.00	1,215,000
阿波銀行	5,000	665.00	3,325,000
鹿児島銀行	4,000	731.00	2,924,000
大分銀行	4,000	444.00	1,776,000
宮崎銀行	4,000	349.00	1,396,000
肥後銀行	5,000	651.00	3,255,000
佐賀銀行	4,000	268.00	1,072,000
十八銀行	4,000	336.00	1,344,000
沖縄銀行	500	4,895.00	2,447,500
琉球銀行	1,300	1,809.00	2,351,700
セブン銀行	21,200	475.00	10,070,000
みずほフィナンシャルグループ	868,600	203.00	176,325,800
高知銀行	3,000	152.00	456,000
山口フィナンシャルグループ	6,000	1,098.00	6,588,000
長野銀行	2,000	192.00	384,000
名古屋銀行	6,000	448.00	2,688,000
北洋銀行	9,400	467.00	4,389,800
愛知銀行	200	5,470.00	1,094,000
第三銀行	4,000	180.00	720,000
中京銀行	3,000	209.00	627,000
東日本銀行	3,000	320.00	960,000
大光銀行	2,000	221.00	442,000
愛媛銀行	4,000	255.00	1,020,000
トマト銀行	3,000	180.00	540,000
みなと銀行	6,000	223.00	1,338,000
京葉銀行	5,000	606.00	3,030,000
関西アーバン銀行	900	1,230.00	1,107,000
栃木銀行	3,000	458.00	1,374,000
北日本銀行	200	2,601.00	520,200
東和銀行	9,000	102.00	918,000
福島銀行	8,000	87.00	696,000
大東銀行	4,000	144.00	576,000
トモニホールディングス	4,800	479.00	2,299,200
フィデアホールディングス	3,700	224.00	828,800
池田泉州ホールディングス	5,200	578.00	3,005,600
F P G	600	1,154.00	692,400
S B Iホールディングス	7,500	1,346.00	10,095,000
ジャフコ	900	4,425.00	3,982,500

大和証券グループ本社	59,000	951.00	56,109,000
野村ホールディングス	128,600	713.60	91,768,960
岡三証券グループ	5,000	922.00	4,610,000
丸三証券	2,000	836.00	1,672,000
東洋証券	2,000	342.00	684,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	7,300	799.00	5,832,700
光世証券	2,000	236.00	472,000
水戸証券	2,000	421.00	842,000
いちよし証券	1,300	1,393.00	1,810,900
松井証券	3,200	1,100.00	3,520,000
だいこう証券ビジネス	500	719.00	359,500
マネックスグループ	7,300	305.00	2,226,500
カブドットコム証券	2,800	572.00	1,601,600
極東証券	800	1,904.00	1,523,200
岩井コスモホールディングス	600	1,268.00	760,800
マネースクウェアHD	200	1,431.00	286,200
マネーパートナーズグループ	500	401.00	200,500
小林洋行	300	253.00	75,900
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	14,000	2,873.00	40,222,000
アニコムホールディングス	200	1,348.00	269,600
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	20,000	2,451.50	49,030,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	6,000	1,779.00	10,674,000
第一生命保険	40,400	1,688.50	68,215,400
東京海上ホールディングス	25,900	3,576.00	92,618,400
T & Dホールディングス	23,000	1,416.50	32,579,500
全国保証	1,600	3,595.00	5,752,000
クレディセゾン	5,100	2,203.00	11,235,300
芙蓉総合リース	700	4,275.00	2,992,500
興銀リース	1,200	2,574.00	3,088,800
東京センチュリーリース	1,500	3,120.00	4,680,000
日本証券金融	2,900	660.00	1,914,000
アイフル	10,500	472.00	4,956,000
ポケットカード	700	652.00	456,400
リコーリース	500	3,125.00	1,562,500
イオンフィナンシャルサービス	4,100	2,215.00	9,081,500
アコム	12,400	346.00	4,290,400
ジャックス	3,000	588.00	1,764,000
オリエントコーポレーション	14,400	221.00	3,182,400
日立キャピタル	1,200	2,742.00	3,290,400
アプラスフィナンシャル	2,900	153.00	443,700
オリックス	44,600	1,573.00	70,155,800

三菱UFJリース	16,000	575.00	9,200,000
日本取引所グループ	9,200	3,060.00	28,152,000
イー・ギャランティ	200	1,902.00	380,400
アサックス	200	1,420.00	284,000
NECキャピタルソリューション	200	2,101.00	420,200
日本駐車場開発	7,200	121.00	871,200
ヒューリック	10,600	1,154.00	12,232,400
東京建物不動産販売	300	410.00	123,000
三栄建築設計	200	921.00	184,200
野村不動産ホールディングス	3,800	1,895.00	7,201,000
プレサンスコーポレーション	200	3,200.00	640,000
常和ホールディングス	200	3,670.00	734,000
フージャースホールディングス	1,000	526.00	526,000
オープンハウス	400	2,159.00	863,600
東急不動産ホールディングス	16,500	792.00	13,068,000
飯田グループホールディングス	4,000	1,251.00	5,004,000
パーク24	3,200	1,668.00	5,337,600
三井不動産	33,000	3,386.00	111,738,000
三菱地所	47,000	2,615.00	122,905,000
平和不動産	1,200	1,856.00	2,227,200
東京建物	14,000	911.00	12,754,000
ダイビル	1,600	1,212.00	1,939,200
京阪神ビルディング	1,000	639.00	639,000
住友不動産	15,000	4,151.00	62,265,000
大京	10,000	196.00	1,960,000
テーオーシー	2,200	768.00	1,689,600
東京楽天地	1,000	504.00	504,000
レオパレス21	6,800	656.00	4,460,800
スターツコーポレーション	700	1,626.00	1,138,200
フジ住宅	800	623.00	498,400
空港施設	800	731.00	584,800
明和地所	500	529.00	264,500
住友不動産販売	400	2,553.00	1,021,200
ゴールドクレスト	600	2,023.00	1,213,800
日本エスリード	400	1,067.00	426,800
日神不動産	900	445.00	400,500
タカラレーベン	2,800	529.00	1,481,200
サンヨーハウジング名古屋	400	1,222.00	488,800
イオンモール	4,000	1,966.00	7,864,000
ファースト住建	100	1,232.00	123,200
トーセイ	900	744.00	669,600
穴吹興産	1,000	246.00	246,000

エヌ・ティ・ティ都市開発	3,900	1,201.00	4,683,900
サンフロンティア不動産	700	1,273.00	891,100
エフ・ジェー・ネクスト	300	500.00	150,000
ランドビジネス	500	429.00	214,500
グランディハウス	500	300.00	150,000
日本空港ビルディング	2,200	4,460.00	9,812,000
日本工営	2,000	471.00	942,000
ネクスト	600	641.00	384,600
日本M&Aセンター	1,000	3,380.00	3,380,000
ノバレーゼ	100	879.00	87,900
アコーディア・ゴルフ	2,500	1,128.00	2,820,000
タケエイ	700	1,009.00	706,300
トラスト・テック	100	1,921.00	192,100
パソナグループ	700	525.00	367,500
CDS	100	1,002.00	100,200
リンクアンドモチベーション	1,000	162.00	162,000
GCAサヴィアン	500	1,132.00	566,000
エス・エム・エス	400	2,656.00	1,062,400
テンプホールディングス	1,300	3,530.00	4,589,000
リニカル	200	852.00	170,400
クックパッド	300	3,885.00	1,165,500
エスクリ	100	1,006.00	100,600
アイ・ケイ・ケイ	100	890.00	89,000
学情	400	1,053.00	421,200
スタジオアリス	400	1,432.00	572,800
シミックホールディングス	200	1,562.00	312,400
総合警備保障	2,200	2,510.00	5,522,000
カカクコム	4,400	1,645.00	7,238,000
ルネサンス	400	971.00	388,400
ディップ	100	3,895.00	389,500
オプト	300	777.00	233,100
新日本科学	700	816.00	571,200
ツクイ	800	941.00	752,800
総合臨床ホールディングス	200	477.00	95,400
キャリアデザインセンター	100	1,085.00	108,500
エムスリー	5,700	1,893.00	10,790,100
ツカダ・グローバルホールディング	200	870.00	174,000
アウトソーシング	200	1,729.00	345,800
ディー・エヌ・エー	3,200	1,436.00	4,595,200
博報堂DYホールディングス	9,200	1,141.00	10,497,200
ぐるなび	800	1,529.00	1,223,200
一休	500	1,440.00	720,000

ファンコミュニケーションズ	1,100	1,057.00	1,162,700
PGMホールディングス	1,000	1,111.00	1,111,000
WDBホールディングス	100	1,783.00	178,300
ティア	200	690.00	138,000
パリュコマース	400	646.00	258,400
J Pホールディングス	1,600	371.00	593,600
イーピーエス	800	1,227.00	981,600
プレステージ・インターナショナル	400	970.00	388,000
アミューズ	200	3,425.00	685,000
ドリームインキュベータ	400	1,794.00	717,600
TAC	300	231.00	69,300
ケネディクス	9,400	554.00	5,207,600
電通	7,400	4,150.00	30,710,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	300	1,131.00	339,300
びあ	200	1,891.00	378,200
イオンファンタジー	200	1,446.00	289,200
みらかホールディングス	1,700	4,695.00	7,981,500
アルプス技研	500	1,288.00	644,000
サニックス	900	546.00	491,400
ダイオーズ	200	920.00	184,000
オリエンタルランド	1,800	23,695.00	42,651,000
ダスキン	1,900	1,859.00	3,532,100
明光ネットワークジャパン	700	1,213.00	849,100
ファルコホールディングス	300	1,254.00	376,200
秀英予備校	200	282.00	56,400
田谷	100	770.00	77,000
ラウンドワン	1,900	671.00	1,274,900
リゾートトラスト	2,500	2,569.00	6,422,500
ビー・エム・エル	400	3,415.00	1,366,000
ワタベウェディング	200	534.00	106,800
もしもしホットライン	1,200	1,094.00	1,312,800
リソー教育	700	230.00	161,000
早稲田アカデミー	100	790.00	79,000
ユー・エス・エス	8,100	1,742.00	14,110,200
東京個別指導学院	600	402.00	241,200
サイバーエージェント	1,200	4,555.00	5,466,000
楽天	28,800	1,427.00	41,097,600
セントラルスポーツ	200	1,780.00	356,000
リゾートソリューション	1,000	242.00	242,000
リブセンス	400	781.00	312,400
ジャパンマテリアル	100	4,755.00	475,500
アサンテ	100	1,279.00	127,900

ERIホールディングス	100	1,134.00	113,400	
リロ・ホールディング	200	7,680.00	1,536,000	
東祥	100	2,207.00	220,700	
エイチ・アイ・エス	1,100	2,642.00	2,906,200	
共立メンテナンス	300	4,770.00	1,431,000	
イチネンホールディングス	700	932.00	652,400	
建設技術研究所	400	1,690.00	676,000	
スペース	400	1,277.00	510,800	
燦ホールディングス	100	1,571.00	157,100	
スバル興業	1,000	438.00	438,000	
東京テアトル	3,000	146.00	438,000	
よみうりランド	1,000	503.00	503,000	
東京都競馬	5,000	321.00	1,605,000	
常磐興産	2,000	147.00	294,000	
カナモト	900	3,765.00	3,388,500	
東京ドーム	5,000	466.00	2,330,000	
西尾レントオール	500	3,940.00	1,970,000	
トランス・コスモス	900	2,020.00	1,818,000	
乃村工藝社	1,300	1,016.00	1,320,800	
藤田観光	2,000	384.00	768,000	
KNT-CTホールディングス	3,000	164.00	492,000	
日本管財	300	2,932.00	879,600	
トーカイ	300	3,445.00	1,033,500	
白洋舎	1,000	247.00	247,000	
セコム	6,500	7,004.00	45,526,000	
セントラル警備保障	400	1,193.00	477,200	
丹青社	800	990.00	792,000	
メイテック	900	3,300.00	2,970,000	
アサツー ディ・ケイ	1,300	2,808.00	3,650,400	
応用地質	700	1,891.00	1,323,700	
船井総研ホールディングス	800	1,001.00	800,800	
進学会	500	410.00	205,000	
ベネッセホールディングス	2,400	3,490.00	8,376,000	
イオンディライト	600	2,759.00	1,655,400	
ナック	400	1,227.00	490,800	
ニチイ学館	1,300	856.00	1,112,800	
ダイセキ	1,100	1,970.00	2,167,000	
ステップ	200	849.00	169,800	
合計	10,541,400		12,650,979,530	

(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2014年11月28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	12,912,483,774円
負債総額	28,044,941円
純資産総額（ - ）	12,884,438,833円
発行済口数	22,029,537,448口
1口当たり純資産額（ / ）	0.5849円

【バランスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	382,941,789円
負債総額	362,105円
純資産総額（ - ）	382,579,684円
発行済口数	436,684,070口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8761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	13,121,503,030円
負債総額	47,187,889円

純資産総額（ - ）	13,074,315,141円
発行済口数	10,056,218,255口
1口当たり純資産額（ / ）	1.300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ます。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

（4）受益証券の再発行

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

（5）受益権の再分割

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【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26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：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（平成26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26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26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	546	106,167

株式投資信託		490	81,061
単位型		80	2,285
追加型		410	78,776
公社債投資信託		56	25,105
単位型		40	393
追加型		16	24,712
投資法人合計		1	41

3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成していません。

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55期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第56期中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第54期 (平成25年3月31日)		第55期 (平成26年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	15,820	3	17,805
有価証券		-		234
前払費用	3	380	3	419
未収入金		4		37
未収委託者報酬		7,472		7,162
未収収益	3	342	3	608
関係会社短期貸付金		606		240
立替金		335		303
繰延税金資産		869		984
その他	2	30	2	30
流動資産合計		25,862		27,826
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	48	1	47
器具備品	1	124	1	134

有形固定資産合計	172	181
無形固定資産		
ソフトウェア	70	91
無形固定資産合計	70	91
投資その他の資産		
投資有価証券	7,170	7,290
関係会社株式	22,935	21,702
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	706	692
繰延税金資産	500	525
投資その他の資産合計	31,373	30,271
固定資産合計	31,616	30,544
資産合計	57,478	58,371

(単位：百万円)

	第54期 (平成25年3月31日)		第55期 (平成26年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		305		329
未払金		3,862		3,404
未払収益分配金		6		6
未払償還金		115		112
未払手数料	3	3,195	3	2,743
その他未払金		545		542
未払費用	3	3,282	3	3,239
未払法人税等		589		2,286
未払消費税等	4	123	4	356
賞与引当金		1,770		1,935
役員賞与引当金		80		150
流動負債合計		10,012		11,702
固定負債				
退職給付引当金		1,001		1,081
その他		55		55
固定負債合計		1,057		1,137
負債合計		11,070		12,840
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		23,530		22,694
利益剰余金合計		23,530		22,694

自己株式	68	68
株主資本合計	46,045	45,209
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	362	321
評価・換算差額等合計	362	321
純資産合計	46,408	45,531
負債純資産合計	57,478	58,371

(2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	52,848	63,120
その他営業収益	1,922	2,557
営業収益合計	54,771	65,678
営業費用		
支払手数料	26,955	31,207
広告宣伝費	649	1,081
公告費	7	2
調査費	10,797	13,405
調査費	691	712
委託調査費	10,089	12,669
図書費	17	23
委託計算費	406	465
営業雑経費	530	558
通信費	188	186
印刷費	214	252
協会費	46	43
諸会費	16	11
その他	64	65
営業費用計	39,347	46,721
一般管理費		
給料	6,759	7,171
役員報酬	256	316
役員賞与引当金繰入額	80	150
給料・手当	4,565	4,719
賞与	87	50
賞与引当金繰入額	1,770	1,935
交際費	100	108
寄付金	66	54
旅費交通費	313	448
租税公課	188	209
不動産賃借料	753	755
退職給付費用	312	313
退職金	83	32
固定資産減価償却費	124	109
諸経費	3,061	3,364
一般管理費計	11,764	12,568
営業利益	3,659	6,388

(単位：百万円)

	第54期		第55期	
	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		12		17
受取配当金	1	601	1	1,774
時効成立分配金・償還金		4		4
為替差益		64		26
その他		16		19
営業外収益合計		699		1,842
営業外費用				
支払利息		19		19
有価証券償還損		1		-
時効成立後支払分配金・償還金		15		22
支払源泉所得税		55		57
その他		2		13
営業外費用合計		93		114
経常利益		4,265		8,116
特別利益				
投資有価証券売却益		226		135
関係会社株式売却益		239		-
特別利益合計		465		135
特別損失				
投資有価証券売却損		84		12
関係会社株式評価損		-		4,500
固定資産処分損		3		0
割増退職金		-		59
役員退職一時金		75		235
特別損失合計		163		4,807
税引前当期純利益		4,568		3,445
法人税、住民税及び事業税		1,480		3,020
法人税等調整額		260		119
法人税等合計		1,740		2,900
当期純利益		2,827		544

(3) 【株主資本等変動計算書】

第54期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余 金合計		

当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,172	22,172	68	44,687
当期変動額							
剰余金の配当				1,468	1,468		1,468
当期純利益				2,827	2,827		2,827
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	1,358	1,358	-	1,358
当期末残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券評 価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	42	42	44,729
当期変動額			
剰余金の配当			1,468
当期純利益			2,827
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	320	320	320
当期変動額合計	320	320	1,678
当期末残高	362	362	46,408

第55期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余 金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045
当期変動額							
剰余金の配当				1,380	1,380		1,380
当期純利益				544	544		544
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	836	836	-	836
当期末残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券評 価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	362	362	46,408
当期変動額			
剰余金の配当			1,380
当期純利益			544
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	40	40	40
当期変動額合計	40	40	876

当期末残高	321	321	45,531
-------	-----	-----	--------

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(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</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。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～5年 器具備品 4年～20年</p> <p>(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。</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、当事業年度の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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>
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>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>

(表示方法の変更)

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

「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。以下「退職給付会計基準」という。)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。以下「退職給付適用指針」という。)を当事業年度より適用し(ただし、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めを除く。)、(退職給付関係)注記の表示方法を変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、(退職給付関係)の注記の組替えは行っていません。

(貸借対照表関係)

第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,054百万円</p> <p>器具備品 618百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,091百万円</p> <p>器具備品 625百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、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</p> <p>その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、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 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>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 6,249百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 74百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 98百万円</p> <p>未払費用 274百万円</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>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>	<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65百万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159百万円に対して保証を行っております。</p>

(損益計算書関係)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26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 552百万円</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 1,290百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

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翌事業年度となるもの

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

第55期（自 平成25年4月1日 至 平成26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	16,978,500	-	1,075,800	15,902,700	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,626,900	-	59,400	1,567,500	-
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	-	541,200	5,388,900	-
合計		29,800,700	-	1,676,400	28,124,300	-

- (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)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500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株及び平成23年度ストックオプション(1)2,887,500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。

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) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの該当事項はありません。

(リース取引関係)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26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	750百万円	1年内	751百万円
1年超	807百万円	1年超	77百万円
合計	1,558百万円	合計	828百万円

（金融商品関係）

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、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。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（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額

(1) 現金・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			
其他有価証券	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・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(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・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

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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ぬ。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ぬ。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、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。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26年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりませぬ。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金・預金	17,805	17,805	-
(2) 未収委託者報酬	7,162	7,162	-
(3) 未収収益	608	608	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,457	7,457	-
(5) 未払金	(3,404)	(3,404)	-
(6) 未払費用	(3,239)	(3,239)	-

()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・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) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(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（貸借対照表計上額66百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式（貸借対照表計上額18,809百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。
- 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	17,805	-	-	-
未収委託者報酬	7,162	-	-	-
未収収益	608	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	234	315	1,166	973
合計	25,811	315	1,166	973

（有価証券関係）

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

（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

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

2 その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	投資信託	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	投資信託	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、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	3,819	3,188	631
	小計	3,819	3,188	631
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,637	3,768	130
	小計	3,637	3,768	130
合計		7,457	6,957	500

(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 66百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	23	11	-
投資信託	1,734	124	12
合計	1,758	135	12

(持分法損益等)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26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 3,069	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,065
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,280	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 7,660
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,159	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,379

(退職給付関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 退職給付債務に関する事項

(単位：百万円)

イ 退職給付債務	1,101
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

3 退職給付費用に関する事項

(単位：百万円)

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

4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例
ロ 割引率	0.9%
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	1,101	百万円
勤務費用	110	"
利息費用	9	"
数理計算上の差異の発生額	9	"
退職給付の支払額	56	"
退職給付債務の期末残高	1,174	"

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,174	百万円
未積立退職給付債務	1,174	"
未認識数理計算上の差異	92	"
貸借対照表に計上された負債の額	1,081	"

退職給付引当金	1,081	百万円
貸借対照表に計上された負債の額	1,081	"

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	110	百万円
利息費用	9	"
数理計算上の差異の費用処理額	16	"
確定給付制度に係る退職給付費用	137	"

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.8%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、176百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

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	19,215,900	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55期(自 平成25年 4月 1日 至 平成26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	16,978,500	1,626,900
付与	0	0
失効	1,075,800	59,400
権利確定	0	0
権利未確定残	15,902,700	1,567,500
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	5,930,100
付与	0	0
失効	0	541,200
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,388,900
権利確定後(株)		

期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(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。

(税効果会計関係)

第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
----------------------	----------------------

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)
繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)	
賞与引当金繰入超過額	672	賞与引当金繰入超過額	689
その他	196	その他	294
小計	869	小計	984
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
投資有価証券評価損	149	投資有価証券評価損	148
退職給付引当金超過額	361	関係会社株式評価損	1,665
固定資産減価償却超過額	174	退職給付引当金超過額	385
その他	75	固定資産減価償却超過額	158
小計	760	その他	34
繰延税金資産小計	1,630	小計	2,391
評価性引当金	61	繰延税金資産小計	3,375
繰延税金資産合計	1,568	評価性引当金	1,665
		繰延税金資産合計	1,710
繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(固定)	
その他有価証券評価差額金	199	その他有価証券評価差額金	200
繰延税金負債合計	199	繰延税金負債合計	200
繰延税金資産の純額	1,369	繰延税金資産の純額	1,510
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		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。		法定実効税率	38.0%
		(調整)	
		評価性引当金の増減	46.6%
		交際費等永久に損金に算入されない項目	3.7%
		受取配当金等永久に益金に算入されない項目	12.9%
		税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.9%
		海外子会社の留保利益の影響額等	6.9%
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	84.2%

第54期
(平成25年3月31日)

第55期
(平成26年3月31日)

	<p>3 法人税等の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>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」(平成26年政令第151号)が平成26年3月31日に公布されたことにより、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、平成26年4月1日に開始する事業年度において解消が見込まれる一時差異について、当社が使用した法定実効税率は38.0%から35.6%に変更されております。この結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は65百万円減少し、その他有価証券評価差額金の金額が1百万円、法人税等調整額の金額が63百万円、それぞれ増加しております。</p>
--	--

(関連当事者情報)

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	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	525 (千SGD 8,000)	関係会社短期貸付金	606 (千SGD 8,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	5 (千SGD 76)	未収収益	5 (千SGD 76)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(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	292,000	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)	398 (千 SGD 5,059) (注2)	関係会社 短期貸付金	240 (千 SGD 2,940)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	15 (千 SGD 192)	未収収益	5 (千 SGD 64)
							増資の引受(注3)	3,266 (千 SGD 40,000)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。
- 資金の貸付に係る取引金額 398百万円(5,059千 SGD)の内訳は、貸付240百万円(2,940千 SGD)及び返済 638百万円(8,000千 SGD)であります。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った40,000,000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。

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(ロンドン)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25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	15,790百万円
負債合計	1,713百万円
純資産合計	14,076百万円

営業収益	11,350百万円
税引前当期純利益	4,212百万円
当期純利益	3,096百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

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。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	235円69銭	231円23銭
1株当たり当期純利益金額	14円35銭	2円76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54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益(百万円)	2,827	544
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)	2,827	544
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903	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) 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	平成21年度ストックオプション(1) 15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2) 1,567,500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) 5,388,900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54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	46,408	45,531

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）	46,408	45,531
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。

中間財務諸表等

（1）中間貸借対照表

（単位：百万円）

		第56期中間会計期間 (平成26年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		15,789
有価証券		226
未収委託者報酬		6,584
未収収益		938
関係会社短期貸付金		258
繰延税金資産		487
その他	2	2,365
流動資産合計		26,649
固定資産		
有形固定資産	1	235
無形固定資産		92
投資その他の資産		
投資有価証券		9,667
関係会社株式		21,702
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		683
繰延税金資産		357
投資その他の資産合計		32,471
固定資産合計		32,799
資産合計		59,448

（単位：百万円）

		第56期中間会計期間 (平成26年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		3,203

未払費用		3,470
未払法人税等		871
未払消費税等	3	550
賞与引当金		875
役員賞与引当金		120
その他		671
流動負債合計		9,763
固定負債		
退職給付引当金		1,071
固定負債合計		1,071
負債合計		10,834
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		25,511
利益剰余金合計		25,511
自己株式		68
株主資本合計		48,026
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		587
評価・換算差額等合計		587
純資産合計		48,614
負債純資産合計		59,448

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		30,757
その他営業収益		1,678
営業収益合計		32,435
営業費用及び一般管理費	1	29,279
営業利益		3,156
営業外収益	2	862
営業外費用	3	86
経常利益		3,931
特別利益	4	174
特別損失	5	3
税引前中間純利益		4,102

法人税、住民税及び事業税	831
法人税等調整額	495
中間純利益	2,775

(3) 中間株主資本等変動計算書

第56期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209
会計方針の変更による 累積的影響額				41	41		41
会計方針の変更を反映した 当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,735	22,735	68	45,250
当中間期変動額							
剰余金の配当							
中間純利益				2,775	2,775		2,775
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）							
当中間期変動額合計	-	-	-	2,775	2,775	-	2,775
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	25,511	25,511	68	48,026

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	321	321	45,531
会計方針の変更による 累積的影響額			41
会計方針の変更を反映した 当期首残高	321	321	45,572
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			2,775
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	265	265	265
当中間期変動額合計	265	265	3,041
当中間期末残高	587	587	48,614

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第56期中間会計期間 (自 平成26年 4月 1日 至 平成26年 9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の日から費用処理しております。</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>

（会計方針の変更）

<p>第56期中間会計期間 (自 平成26年 4月 1日 至 平成26年 9月30日)</p>

「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。以下「退職給付会計基準」という。)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。以下「退職給付適用指針」という。)を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更、割引率の決定方法を平均残存勤務年数に対応した高格付社債の流通利回りを基礎とする方法から退職給付の支払見込期間及び期間毎の金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当中間会計期間の期首の退職給付引当金が63百万円減少、繰延税金資産が22百万円減少、繰越利益剰余金が41百万円増加しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益への影響は軽微であります。なお、1株当たり純資産額及び1株当たり中間純利益金額に対する影響額は、軽微であります。

(中間貸借対照表関係)

第56期中間会計期間 (平成26年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,750百万円
2	信託資産 その他流動資産のうち180百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4	保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務47百万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113百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 50百万円 無形固定資産 16百万円
2	営業外収益のうち主要なもの 受取利息 3百万円 受取配当金 761百万円
3	営業外費用のうち主要なもの 支払利息 10百万円 時効成立後支払分配金・償還金 4百万円 支払源泉所得税 71百万円
4	特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益 174百万円
5	特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損 3百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第56期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26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	15,902,700	-	-	15,902,700	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,567,500	-	-	1,567,500	-
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	5,388,900	-	330,000	5,058,900	-
合計		28,124,300	-	330,000	27,794,300	-

(注) 1 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)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、平成23年度ストックオプション(1)2,887,500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。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

(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56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26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	766百万円
1年超	3,502百万円
合計	4,268百万円

（金融商品関係）

第56期中間会計期間(平成26年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成26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	15,789	15,789	-
(2) 未収委託者報酬	6,584	6,584	-
(3) 未収収益	938	938	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	9,864	9,864	-
(5) 未払金	(3,203)	(3,203)	-
(6) 未払費用	(3,470)	(3,470)	-

()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) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(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30百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」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18,809百万円）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56期中間会計期間(平成26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	18,809
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	8,573	7,543	1,029
	小計	8,573	7,543	1,029
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	1,291	1,407	116
	小計	1,291	1,407	116
合計		9,864	8,951	913

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

2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額 30百万円)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56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26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	3,075百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	7,780百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	762百万円

(ストックオプション等関係)

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26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56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

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

関連情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26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56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26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56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26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56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
1株当たり純資産額	246円89銭
1株当たり中間純利益金額	14円09銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
中間純利益(百万円)	2,775
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)	2,775
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)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500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)5,058,900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56期中間会計期間 (平成26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)	48,614

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）	48,614
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）通常の見積り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26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26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26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	
内藤証券株式会社	3,002百万円	

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・計算事務などを行ないます。

（２）販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

3【資本関係】

（１）受託会社

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26年6月13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26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成26年12月17日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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25年11月8日から平成26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26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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成26年12月17日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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25年11月8日から平成26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26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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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26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26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。