

【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28年2月9日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【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】	森川 晃
【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28年 2月10日から平成29年 2月 7日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

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経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(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	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

インデックス型

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

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	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
		債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

ンドをいいます。

国内

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

資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. ミリオンには2つのポートフォリオがあり、皆様のニーズにあったポートフォリオをお選びいただけます。

「インデックスポートフォリオ」

主として「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に投資を行ない、TOPIX（東証株価指数）*の動きに連動する投資成果をめざします。

「バランスポートフォリオ」

主として「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に50%程度投資を行ないます。また残りの50%程度は内外の公社債を中心に組み入れます。

市況の急激な変化が生じたときなど、やむを得ない事情が発生した場合ならびに信託財産の規模によっては上記のような運用ができない場合があります。

* TOPIX（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。

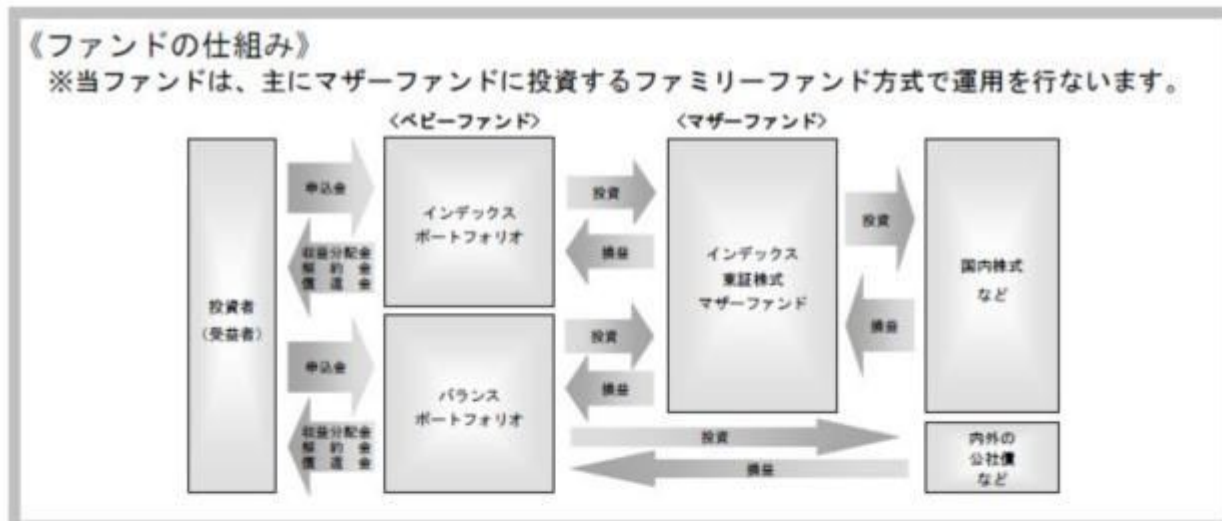
TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

2. お買付けは、原則として給与天引きです。

3. お買付けは、無手数料です。

4. ドル・コスト平均法の妙味を味わえます。

ドル・コスト平均法とは、一定の金額を継続して投資する方法で、価格が安いときは多くの口数を、高いときは少ない口数を買い付けることによって、一定量（口数）ずつ買い付けた場合に比べて、平均買付コストを低く抑えることが期待できます。長期にわたり定期的に継続して積み立てることにより、ドル・コスト平均法が活かされます。



主な投資制限

「インデックスポートフォリオ」

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」への投資割合には制限を設けません。
- ・外貨建資産への投資は行ないません。

「バランスポートフォリオ」

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」への投資割合は、信託財産の純資産総額の 70%未満とします。
- ・外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の 30%以下とします。

分配方針

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

- ・各ポートフォリオ毎に、2,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

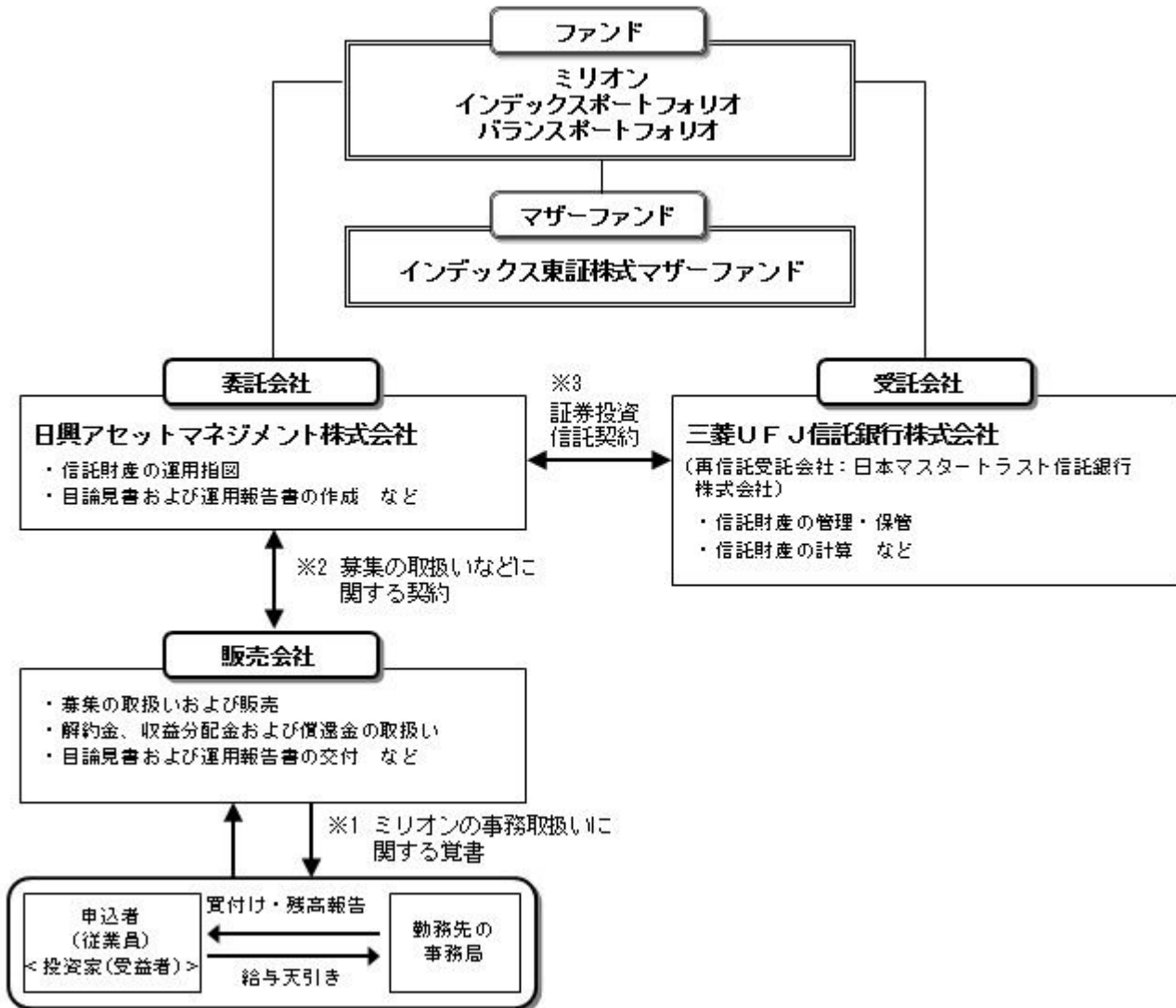
(2) 【ファンドの沿革】

昭和62年11月27日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 ミリオンの事務局と販売会社の間における、ミリオンの申込み・入金・換金などに関する手続きを規定しています。
- 2 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 3 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（平成27年11月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
平成11年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<インデックスポートフォリオ>

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

<バランスポートフォリオ>

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。
- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券に投資することにより売買益を追求し、内外の公社債に投資することにより利息等収益の確保につとめます。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の75%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

<インデックスポートフォリオ>

「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

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

- 1) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 4) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

- 1) 資金の借入

<バランスポートフォリオ>

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条お

よび第17条の2に定めるものに限ります。)

- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限ります。)
- 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 有価証券の貸付
- 4) 外国為替予約取引
- 5) 資金の借入

<インデックス東証株式マザーファンド>

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第13条の2および第13条の4に定めるものに限ります。)
- 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

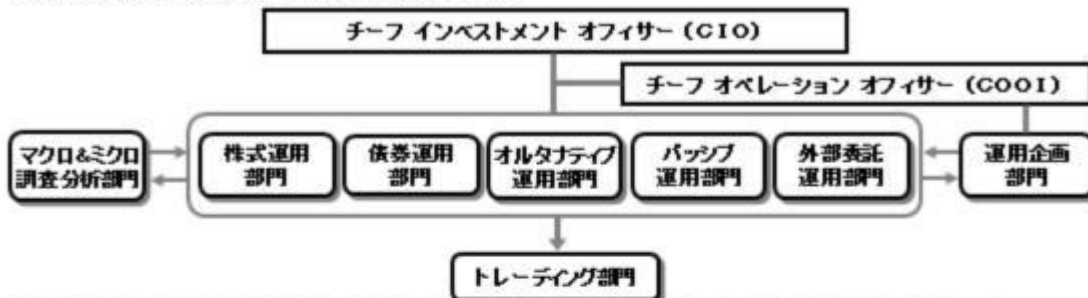
<インデックス東証株式マザーファンド>

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。

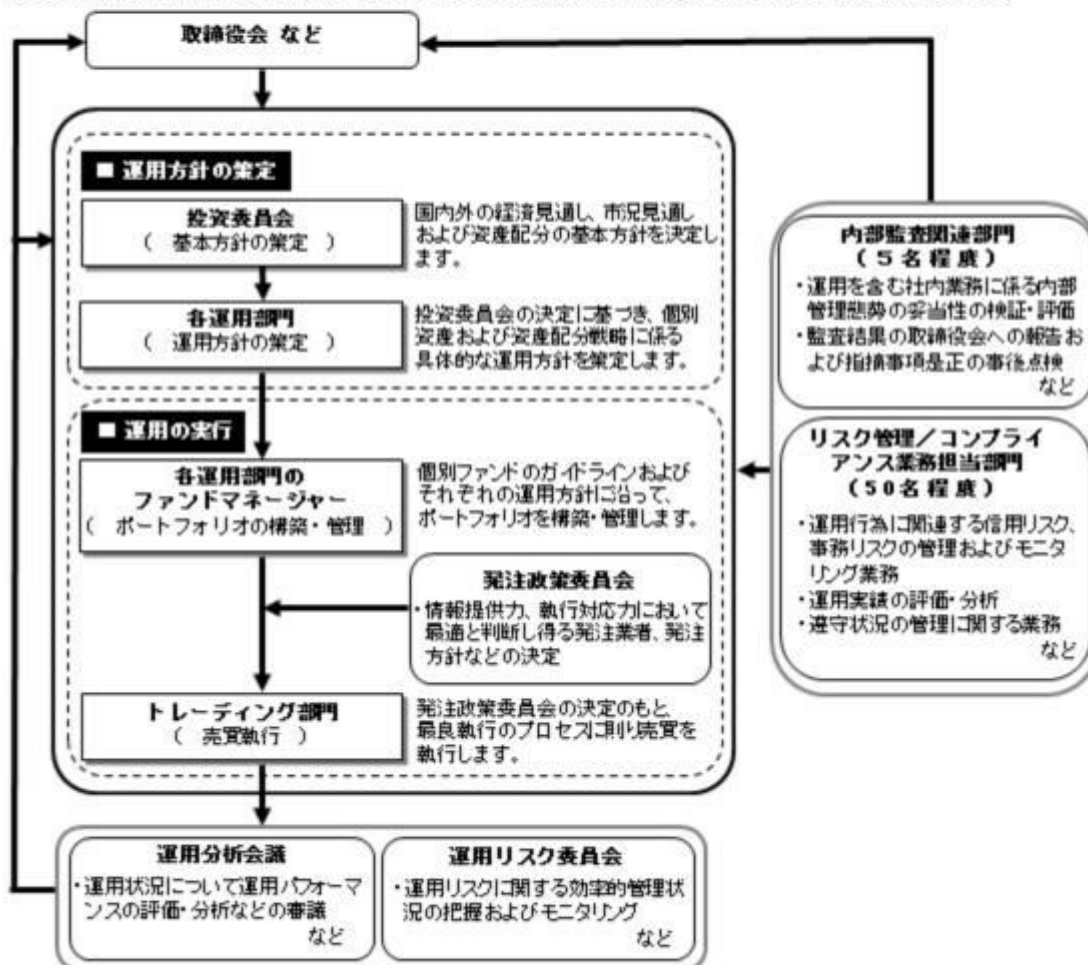
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
信託期間	無期限（昭和61年10月22日設定）
決算日	毎年10月21日（休業日の場合は翌営業日）

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

上記体制は平成27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支弁される日からその翌営業日までとします。

<バランスポートフォリオ>

- 1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- 2) 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 4) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とす

- る有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 5)信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 6)信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 7)信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 8)信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9)信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約

に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入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。

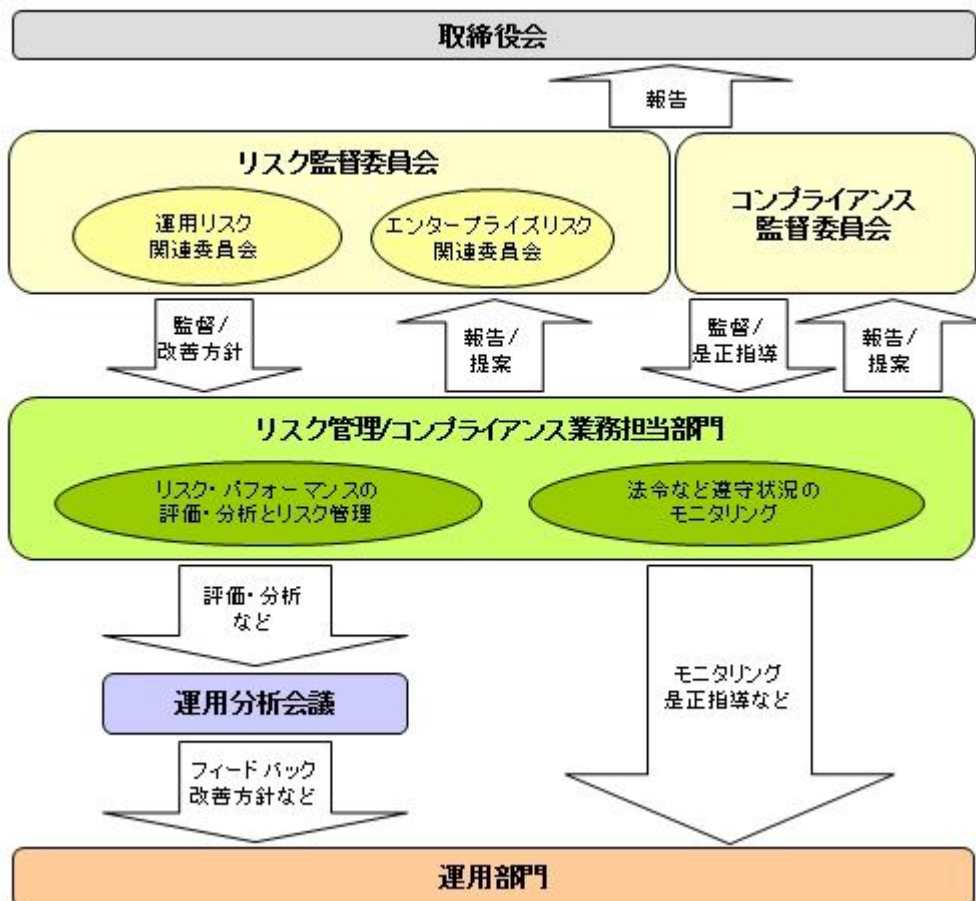
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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。

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

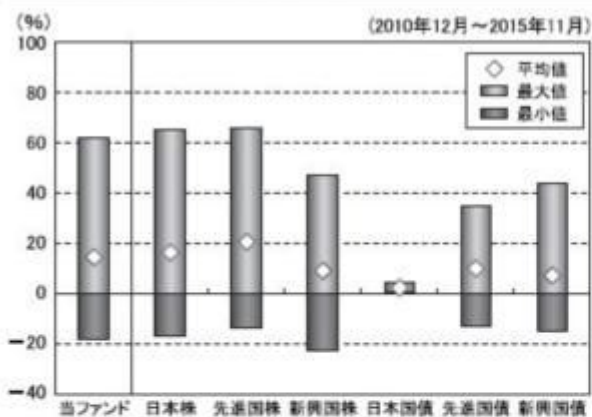
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成27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。

(参考情報)

「インデックスポートフォリオ」

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	14.5%	16.4%	20.6%	9.1%	2.3%	10.0%	7.2%
最大値	62.2%	65.0%	65.7%	47.4%	4.5%	34.9%	43.7%
最小値	-18.2%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-12.7%	-15.0%

※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2010年12月から2015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）を再投資したもとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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



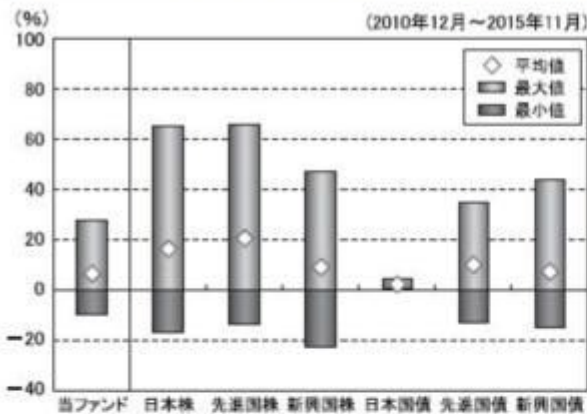
※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2010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）を再投資したもとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

「バランスポートフォリオ」

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	6.4%	16.4%	20.6%	9.1%	2.3%	10.0%	7.2%
最大値	27.8%	65.0%	65.7%	47.4%	4.5%	34.9%	43.7%
最小値	-9.5%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-12.7%	-15.0%

※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2010年12月から2015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。

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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



2010年12月 2011年12月 2012年12月 2013年12月 2014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、2010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。

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す。)を控除した利益

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

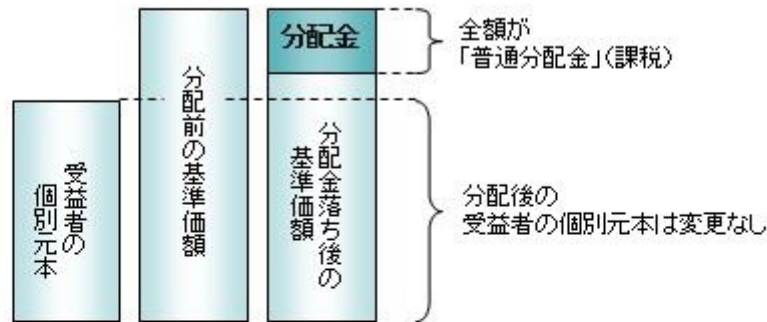
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

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

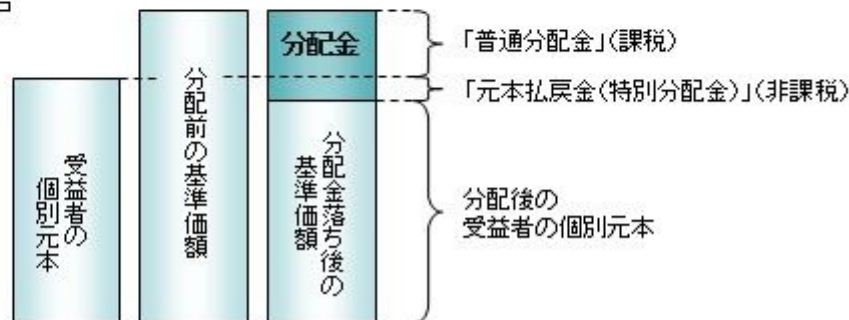
者の個別元本となります。

<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28年 2月 9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2015年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

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	12,478,965,538	99.99
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		779,292	0.01
合計(純資産総額)		12,479,744,830	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	8,403,343,797	1.4930	12,546,192,289	1.4850	12,478,965,538	99.99
----	-----------	-------------------	---------------	--------	----------------	--------	----------------	-------

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合 計	99.99

【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
第28計算期間末 (2015年11月 9日)	12,726	12,735	0.6615	0.6620
2014年11月末日	12,884		0.5849	
12月末日	12,560		0.5836	
2015年 1月末日	12,531		0.5859	
2月末日	13,312		0.6304	
3月末日	13,247		0.6425	
4月末日	13,440		0.6621	
5月末日	13,917		0.6952	
6月末日	13,307		0.6768	
7月末日	13,441		0.6878	
8月末日	12,306		0.6366	

9月末日	11,350		0.5883
10月末日	12,491		0.6486
11月末日	12,479		0.6564

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
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
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
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
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	16.96

(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
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	397,656,514	3,710,414,810

【バランスポートフォリオ】

以下の運用状況は2015年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	70,792,567	22.35
親投資信託受益証券	日本	161,912,695	51.12
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		84,040,540	26.53
合計（純資産総額）		316,745,802	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	109,032,118	1.4950	163,003,017	1.4850	161,912,695			51.12
日本	国債証券	第9 6 回利付国債 （5年）	20,000,000	100.15	20,030,915	100.15	20,030,915	0.500	2016/3/20	6.32
日本	国債証券	第9 3 回利付国債 （5年）	20,000,000	100.03	20,007,302	100.03	20,007,302	0.500	2015/12/20	6.32
日本	国債証券	第2 9 3 回利付国 債（10年）	15,000,000	104.67	15,701,400	104.59	15,689,850	1.800	2018/6/20	4.95
日本	国債証券	第1 0 1 回利付国 債（5年）	15,000,000	100.44	15,067,200	100.43	15,064,500	0.400	2016/12/20	4.76

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	22.35
親投資信託受益証券	51.12
合計	73.47

【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
第28計算期間末 (2015年11月 9日)	322	322	0.9300	0.9305
2014年11月末日	382		0.8761	
12月末日	359		0.8742	
2015年 1月末日	361		0.8753	
2月末日	367		0.9084	
3月末日	353		0.9168	
4月末日	353		0.9308	
5月末日	356		0.9537	
6月末日	350		0.9402	
7月末日	333		0.9473	
8月末日	316		0.9132	
9月末日	304		0.8771	
10月末日	319		0.9208	
11月末日	316		0.9260	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	7.96

(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

第28期	2014年11月 8日 ~ 2015年11月 9日	9,591,772	106,409,569
------	---------------------------	-----------	-------------

(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2015年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

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	12,414,862,300	98.23
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		224,176,886	1.77
合計(純資産総額)		12,639,039,186	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	189,840,000	1.50

(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	67,900	7,467.00	507,009,300	7,657.00	519,910,300	4.11
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	422,400	769.50	325,036,800	790.00	333,696,000	2.64
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	42,200	4,803.37	202,702,214	4,697.00	198,213,400	1.57
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	29,800	6,495.73	193,572,754	6,537.00	194,802,600	1.54
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	48,000	3,954.00	189,792,000	4,002.00	192,096,000	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	40,700	4,549.00	185,144,300	4,565.00	185,795,500	1.47
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	741,500	243.70	180,703,550	248.50	184,262,750	1.46
日本	株式	KDDI	情報・通信業	53,500	2,852.00	152,582,000	3,058.00	163,603,000	1.29
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	35,300	4,053.00	143,070,900	4,410.00	155,673,000	1.23
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	22,200	5,703.36	126,614,592	5,983.00	132,822,600	1.05
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	22,000	5,457.00	120,054,000	5,520.00	121,440,000	0.96

日本	株式	ファナック	電気機器	5,500	19,910.00	109,505,000	21,920.00	120,560,000	0.95
日本	株式	ソニー	電気機器	37,600	3,414.00	128,366,400	3,177.00	119,455,200	0.95
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	9,700	11,215.00	108,785,500	11,620.00	112,714,000	0.89
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	62,600	1,648.00	103,164,800	1,733.50	108,517,100	0.86
日本	株式	村田製作所	電気機器	5,600	15,890.00	88,984,000	19,100.00	106,960,000	0.85
日本	株式	キャノン	電気機器	28,700	3,829.00	109,892,300	3,716.00	106,649,200	0.84
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	4,800	21,025.00	100,920,000	21,985.00	105,528,000	0.83
日本	株式	三菱地所	不動産業	39,000	2,552.00	99,528,000	2,589.50	100,990,500	0.80
日本	株式	日立製作所	電気機器	136,000	682.48	92,817,280	726.60	98,817,600	0.78
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	74,900	1,216.00	91,078,400	1,314.50	98,456,050	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	21,300	4,644.00	98,917,200	4,540.00	96,702,000	0.77
日本	株式	花王	化学	15,000	5,782.00	86,730,000	6,311.00	94,665,000	0.75
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	40,600	2,273.00	92,283,800	2,328.00	94,516,800	0.75
日本	株式	三井不動産	不動産業	28,000	3,272.00	91,616,000	3,104.00	86,912,000	0.69
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	16,900	4,563.00	77,114,700	5,088.00	85,987,200	0.68
日本	株式	パナソニック	電気機器	60,900	1,351.50	82,306,350	1,397.50	85,107,750	0.67
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	18,900	4,322.00	81,685,800	4,380.00	82,782,000	0.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	39,500	2,230.50	88,104,750	2,072.00	81,844,000	0.65
日本	株式	キーエンス	電気機器	1,200	58,270.00	69,924,000	66,720.00	80,064,000	0.63

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.35
		建設業	2.82
		食料品	4.33
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.24
		化学	5.99
		医薬品	5.11
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.90
		ガラス・土石製品	0.94
		鉄鋼	1.22
		非鉄金属	0.88
		金属製品	0.67
		機械	4.67
		電気機器	11.95
		輸送用機器	10.68
		精密機器	1.54
		その他製品	1.53
		電気・ガス業	2.03
陸運業	4.22		

	海運業	0.26
	空運業	0.61
	倉庫・運輸関連業	0.20
	情報・通信業	7.14
	卸売業	3.97
	小売業	4.81
	銀行業	8.89
	証券、商品先物取引業	1.19
	保険業	2.47
	その他金融業	1.32
	不動産業	2.73
	サービス業	3.26
合 計		98.23

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 2015年12月	買建	12	日本円	185,853,780	189,840,000	1.50

(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。

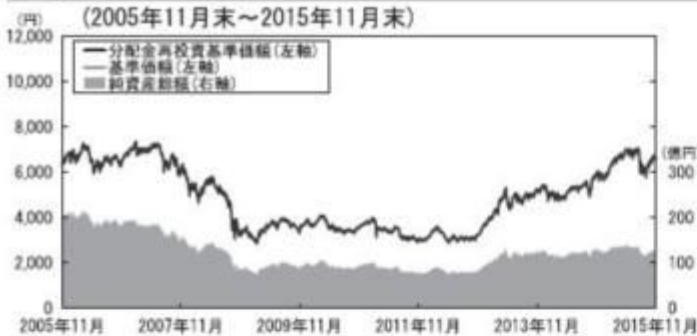
参考情報

運用実績

2015年11月30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……………6,564円

純資産総額……………124.79億円

※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、2005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）

2011年11月	2012年11月	2013年11月	2014年11月	2015年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	140円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産	比率
株式	98.21%
株式先物	1.50%
債券	—
債券先物	—
現金その他	1.79%

※当ファンドの実質組入比率です。

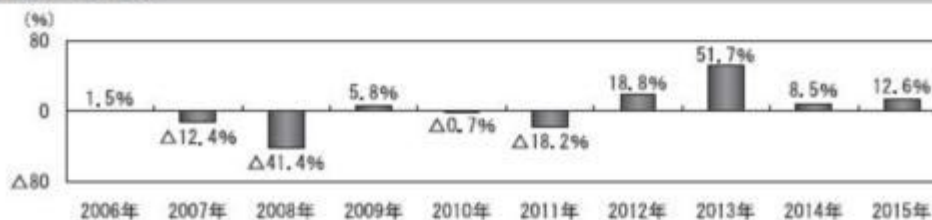
＜組入上位10銘柄＞

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	4.11%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.64%
3 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.57%
4 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.54%
5 本田技研工業	輸送用機器	1.52%
6 日本電信電話	情報・通信業	1.47%
7 みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.46%
8 KDDI	情報・通信業	1.29%
9 日本たばこ産業	食料品	1.23%
10 武田薬品工業	医薬品	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



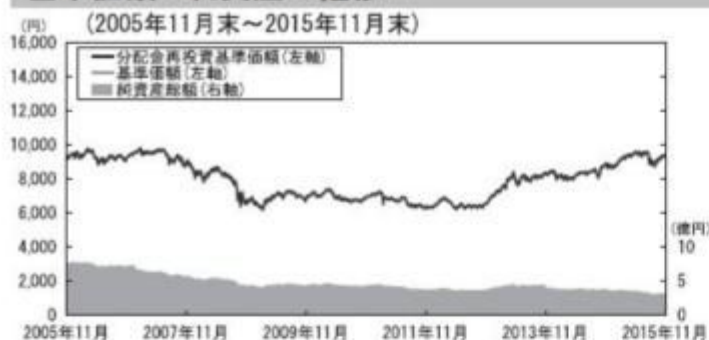
※ファンドの年間収益率は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。

※2015年は、2015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……………9,260円

純資産総額……………3.16億円

※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、2005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）

2011年11月	2012年11月	2013年11月	2014年11月	2015年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	140円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産	比率
株式	50.20%
株式先物	0.77%
債券	22.35%
債券先物	0.00%
現金その他	27.45%

※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	—	—	51.12%
2	第96回利付国債（5年）	国債証券	0.5%	2016年3月20日	6.32%
3	第93回利付国債（5年）	国債証券	0.5%	2015年12月20日	6.32%
4	第293回利付国債（10年）	国債証券	1.8%	2018年6月20日	4.95%
5	第101回利付国債（5年）	国債証券	0.4%	2016年12月20日	4.76%

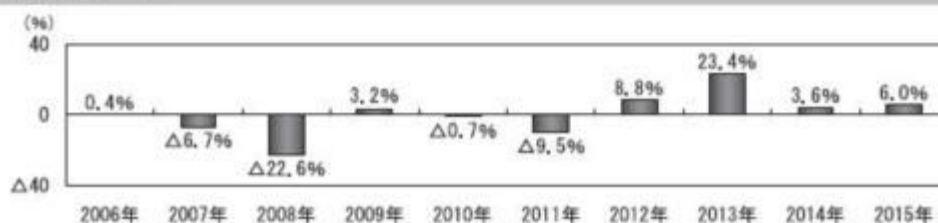
※当ファンドの対純資産総額比です。

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	4.11%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.64%
3	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.57%
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.54%
5	本田技研工業	輸送用機器	1.52%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2015年は、2015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。

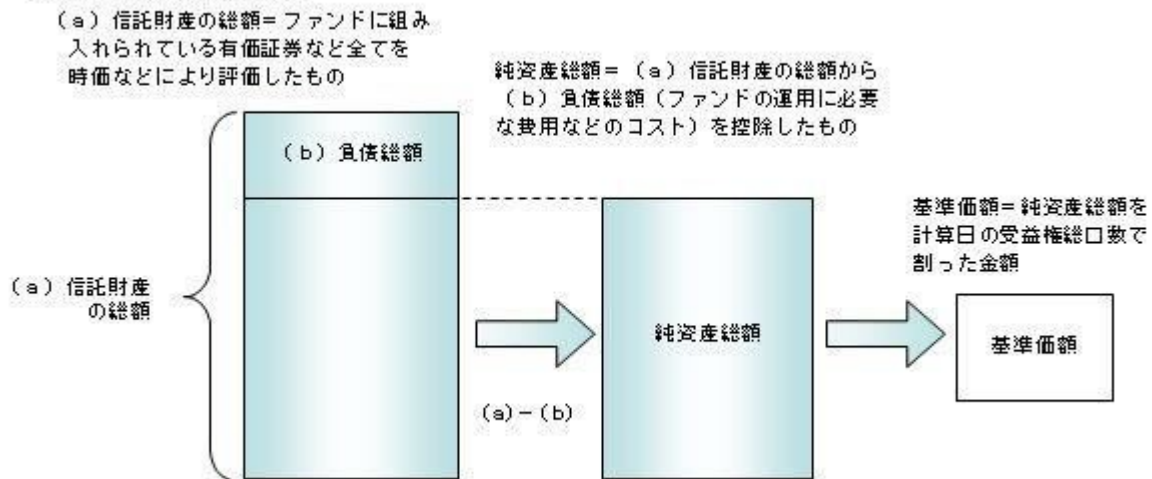
3【資産管理等の概要】

(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

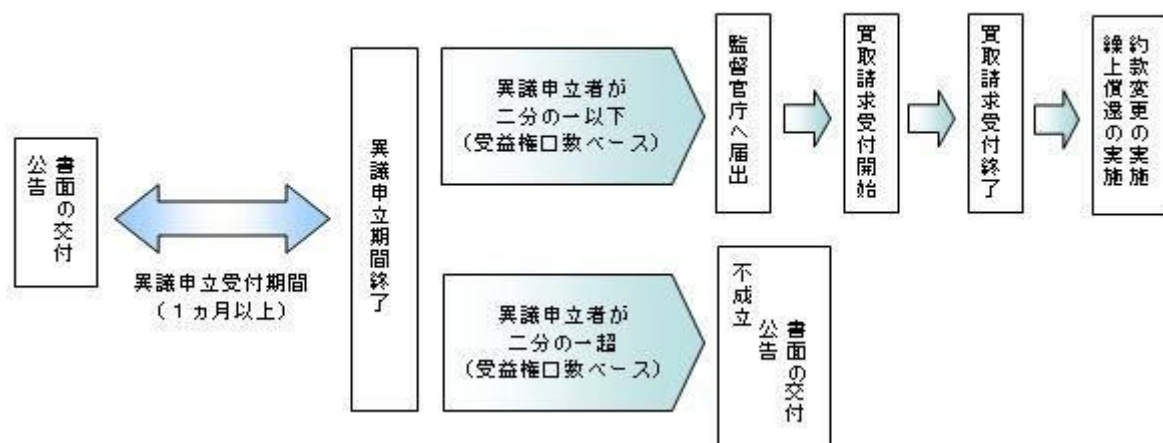
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

- 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28期計算期間(平成26年11月 8日から平成27年11月 9日まで)の財務諸表について、PwC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27期 平成26年11月 7日現在	第28期 平成27年11月 9日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	67,181,997	113,599,359
親投資信託受益証券	12,773,459,412	12,728,102,533
未収入金	76,245,598	7,686,583
未収利息	93	182
流動資産合計	12,916,887,100	12,849,388,657
資産合計	12,916,887,100	12,849,388,657
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	11,275,582	9,619,203
未払解約金	40,895,982	5,558,094
未払受託者報酬	5,244,376	5,658,502
未払委託者報酬	94,399,950	101,854,145
その他未払費用	321,155	346,520
流動負債合計	152,137,045	123,036,464
負債合計	152,137,045	123,036,464
純資産の部		
元本等		
元本	22,551,165,652	19,238,407,356
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	9,786,415,597	6,512,055,163
(分配準備積立金)	400,021,243	1,682,960,841
元本等合計	12,764,750,055	12,726,352,193
純資産合計	12,764,750,055	12,726,352,193
負債純資産合計	12,916,887,100	12,849,388,657

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第27期		第28期	
	自	平成25年11月 8日 至 平成26年11月 7日	自	平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9日
営業収益				
受取利息		29,296		33,985
有価証券売買等損益		1,964,940,157		2,279,288,359
営業収益合計		1,964,969,453		2,279,322,344
営業費用				
受託者報酬		10,236,738		11,216,203
委託者報酬		184,263,523		201,893,891
その他費用		625,137		686,872
営業費用合計		195,125,398		213,796,966
営業利益又は営業損失（ ）		1,769,844,055		2,065,525,378
経常利益又は経常損失（ ）		1,769,844,055		2,065,525,378
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,769,844,055		2,065,525,378
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（ ）		70,485,638		244,436,961
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		12,387,592,823		9,786,415,597
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,175,432,726		1,608,952,504
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,175,432,726		1,608,952,504
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		262,338,335		146,061,284
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		262,338,335		146,061,284
分配金		11,275,582		9,619,203
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,786,415,597		6,512,055,163

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月8日から翌年11月7日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は平成26年11月 8日から平成27年11月 9日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第27期 平成26年11月 7日現在	第28期 平成27年11月 9日現在
1.	期首元本額	24,319,293,344円	22,551,165,652円
	期中追加設定元本額	540,447,887円	397,656,514円
	期中一部解約元本額	2,308,575,579円	3,710,414,810円
2.	受益権の総数	22,551,165,652口	19,238,407,356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	9,786,415,597円	6,512,055,163円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第27期 自 平成25年11月 8日 至 平成26年11月 7日		第28期 自 平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	29,296円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 33,648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 1,357,862,451円
C	信託約款に定める収益調整金	2,649,729,981円	C 信託約款に定める収益調整金 2,267,062,904円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	411,267,529円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 334,683,945円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	3,061,026,806円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 3,959,642,948円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,357円	F 分配対象収益(1万口当たり) 2,058円
G	分配金額	11,275,582円	G 分配金額 9,619,203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27期 自 平成25年11月 8日 至 平成26年11月 7日	第28期 自 平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9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27期 平成26年11月 7日現在	第28期 平成27年11月 9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

第28期（平成27年11月 9日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,026,279,867
合計	2,026,279,867

（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27期 平成26年11月 7日現在		第28期 平成27年11月 9日現在	
1口当たり純資産額	0.5660円	1口当たり純資産額	0.6615円
(1万口当たり純資産額)	(5,660円)	(1万口当たり純資産額)	(6,615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	8,513,780,959	12,728,102,533	
合計		8,513,780,959	12,728,102,533	

(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27期 平成26年11月 7日現在	第28期 平成27年11月 9日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	86,512,862	85,326,425
国債証券	95,342,278	70,818,430
親投資信託受益証券	192,557,691	169,011,055
未収入金	11,000,000	-
未収利息	181,956	177,823
前払費用	-	2,958
流動資産合計	385,594,787	325,336,691
資産合計	385,594,787	325,336,691
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	221,731	173,322
未払受託者報酬	164,868	145,558
未払委託者報酬	2,968,858	2,621,182
その他未払費用	10,038	8,855
流動負債合計	3,365,495	2,948,917
負債合計	3,365,495	2,948,917
純資産の部		
元本等		
元本	443,462,456	346,644,659
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	61,233,164	24,256,885
(分配準備積立金)	9,099,575	22,735,626
元本等合計	382,229,292	322,387,774
純資産合計	382,229,292	322,387,774
負債純資産合計	385,594,787	325,336,691

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第27期		第28期	
	自	平成25年11月 8日 至 平成26年11月 7日	自	平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9日
営業収益				
受取利息		756,406		521,210
有価証券売買等損益		32,751,152		34,003,716
営業収益合計		33,507,558		34,524,926
営業費用				
受託者報酬		329,598		302,252
委託者報酬		5,935,010		5,442,730
その他費用		20,011		18,400
営業費用合計		6,284,619		5,763,382
営業利益又は営業損失 ()		27,222,939		28,761,544
経常利益又は経常損失 ()		27,222,939		28,761,544
当期純利益又は当期純損失 ()		27,222,939		28,761,544
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 ()		2,664,044		5,376,814
期首剰余金又は期首欠損金 ()		104,742,434		61,233,164
剰余金増加額又は欠損金減少額		21,239,299		14,660,234
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		21,239,299		14,660,234
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		2,067,193		895,363
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		2,067,193		895,363
分配金		221,731		173,322
期末剰余金又は期末欠損金 ()		61,233,164		24,256,885

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月8日から翌年11月7日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は平成26年11月 8日から平成27年11月 9日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		第27期 平成26年11月 7日現在	第28期 平成27年11月 9日現在
1.	期首元本額	541,728,278円	443,462,456円
	期中追加設定元本額	11,634,468円	9,591,772円
	期中一部解約元本額	109,900,290円	106,409,569円
2.	受益権の総数	443,462,456口	346,644,659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	61,233,164円	24,256,885円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第27期 自 平成25年11月 8日 至 平成26年11月 7日		第28期 自 平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	600,873円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 408,997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	15,562,657円
C	信託約款に定める収益調整金	61,049,093円	C	信託約款に定める収益調整金	47,898,221円
D	信託約款に定める分配準備積立金	8,720,433円	D	信託約款に定める分配準備積立金	6,937,294円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	70,370,399円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	70,807,169円
F	分配対象収益(1万口当たり)	1,586円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,042円
G	分配金額	221,731円	G	分配金額	173,322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27期 自 平成25年11月 8日 至 平成26年11月 7日	第28期 自 平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9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27期 平成26年11月 7日現在	第28期 平成27年11月 9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ぬ。	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。	(1)有価証券 同左

	(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。	(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

第28期（平成27年11月 9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	344,370
親投資信託受益証券	26,373,922
合計	26,029,552

（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27期 平成26年11月 7日現在		第28期 平成27年11月 9日現在	
1口当たり純資産額	0.8619円	1口当たり純資産額	0.9300円
(1万口当たり純資産額)	(8,619円)	(1万口当たり純資産額)	(9,300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93回利付国債(5年)	20,000,000	20,013,308	
	第96回利付国債(5年)	20,000,000	20,036,522	
	第101回利付国債(5年)	15,000,000	15,067,200	
	第293回利付国債(10年)	15,000,000	15,701,400	
国債証券 合計		70,000,000	70,818,430	
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	113,050,873	169,011,055	
親投資信託受益証券 合計		113,050,873	169,011,055	
合計		183,050,873	239,829,485	

(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26年11月 7日現在	平成27年11月 9日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	850,979	969,528
コール・ローン	199,780,583	188,473,774
株式	12,650,979,530	12,617,119,730
派生商品評価勘定	13,104,668	19,567,900
未収入金	108,265,377	1,937,602
未収配当金	94,013,280	91,897,557
未収利息	277	302
流動資産合計	13,066,994,694	12,919,966,393
資産合計	13,066,994,694	12,919,966,393
負債の部		
流動負債		
前受金	12,505,000	17,094,000
未払解約金	87,245,598	7,686,583
流動負債合計	99,750,598	24,780,583
負債合計	99,750,598	24,780,583
純資産の部		
元本等		
元本	10,315,049,407	8,626,831,832
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,652,194,689	4,268,353,978
元本等合計	12,967,244,096	12,895,185,810
純資産合計	12,967,244,096	12,895,185,810
負債純資産合計	13,066,994,694	12,919,966,393

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26年11月 7日現在	平成27年11月 9日現在
1.	期首	平成25年11月 8日	平成26年11月 8日
	期首元本額	11,343,291,621円	10,315,049,407円
	期首からの追加設定元本額	84,087,897円	25,129,325円
	期首からの一部解約元本額	1,112,330,111円	1,713,346,900円
	元本の内訳		
	インデックスポートフォリオ	10,161,861,108円	8,513,780,959円
	バランスポートフォリオ	153,188,299円	113,050,873円
	計	10,315,049,407円	8,626,831,832円
2.	受益権の総数	10,315,049,407口	8,626,831,832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	204,510,000円	109,161,780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25年11月 8日 至 平成26年11月 7日	自 平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9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26年11月 7日現在	平成27年11月 9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

(平成27年11月 9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	507,007,740
合計	507,007,740

(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

(平成27年11月 9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	218,849,000	-	238,425,000	19,576,000
合計		218,849,000	-	238,425,000	19,576,000

(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26年11月 7日現在		平成27年11月 9日現在	
1口当たり純資産額	1.257円	1口当たり純資産額	1.495円
(1千口当たり純資産額)	(1,257円)	(1千口当たり純資産額)	(1,495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	269.00	807,000	
日本水産	6,900	393.00	2,711,700	
マルハニチロ	1,300	1,958.00	2,545,400	
サカタのタネ	1,000	2,499.00	2,499,000	
ホクト	600	2,191.00	1,314,600	
住石ホールディングス	2,400	125.00	300,000	
日鉄鉱業	2,000	577.00	1,154,000	
三井松島産業	4,000	128.00	512,000	
国際石油開発帝石	31,700	1,179.00	37,374,300	
日本海洋掘削	200	2,601.00	520,200	
石油資源開発	900	3,465.00	3,118,500	
K & O エナジーグループ	400	1,620.00	648,000	
ショーボンドホールディングス	600	4,875.00	2,925,000	
ミライト・ホールディングス	1,800	1,052.00	1,893,600	
安藤・間	4,000	712.00	2,848,000	
東急建設	2,000	856.00	1,712,000	
コムシスホールディングス	2,600	1,633.00	4,245,800	
ミサワホーム	800	801.00	640,800	
高松コンストラクショングループ	500	2,525.00	1,262,500	
東建コーポレーション	200	9,570.00	1,914,000	
ヤマウラ	300	473.00	141,900	
大成建設	31,000	777.00	24,087,000	
大林組	18,000	1,048.00	18,864,000	
清水建設	19,000	1,043.00	19,817,000	

飛島建設	4,200	222.00	932,400
長谷工コーポレーション	7,100	1,229.00	8,725,900
松井建設	700	690.00	483,000
銭高組	1,000	578.00	578,000
鹿島建設	28,000	682.00	19,096,000
不動テトラ	4,200	158.00	663,600
大末建設	300	865.00	259,500
鉄建建設	4,000	331.00	1,324,000
西松建設	7,000	487.00	3,409,000
三井住友建設	23,200	120.00	2,784,000
大豊建設	2,000	562.00	1,124,000
前田建設工業	4,000	852.00	3,408,000
ナカノフード建設	500	681.00	340,500
奥村組	6,000	638.00	3,828,000
東鉄工業	700	2,648.00	1,853,600
イチケン	1,000	423.00	423,000
浅沼組	2,000	313.00	626,000
戸田建設	7,000	625.00	4,375,000
熊谷組	8,000	354.00	2,832,000
青木あすなる建設	500	867.00	433,500
北野建設	1,000	330.00	330,000
植木組	1,000	265.00	265,000
三井ホーム	1,000	590.00	590,000
矢作建設工業	800	909.00	727,200
ピーエス三菱	500	406.00	203,000
日本ハウスホールディングス	1,200	466.00	559,200
大東建託	2,300	12,790.00	29,417,000
新日本建設	900	565.00	508,500
N I P P O	1,000	2,094.00	2,094,000
東亜道路工業	1,000	477.00	477,000
前田道路	2,000	2,229.00	4,458,000
日本道路	2,000	652.00	1,304,000
東亜建設工業	5,000	295.00	1,475,000
若築建設	4,000	158.00	632,000
東洋建設	1,900	554.00	1,052,600
五洋建設	6,700	524.00	3,510,800

大林道路	1,000	838.00	838,000	
世紀東急工業	900	598.00	538,200	
福田組	1,000	1,216.00	1,216,000	
住友林業	4,200	1,609.00	6,757,800	
日本基礎技術	900	520.00	468,000	
日成ビルド工業	2,000	388.00	776,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	3,000	86.00	258,000	
巴コーポレーション	800	373.00	298,400	
パナホーム	2,000	907.00	1,814,000	
大和ハウス工業	17,800	3,294.00	58,633,200	
ライト工業	1,100	1,137.00	1,250,700	
積水ハウス	20,100	2,004.00	40,280,400	
日特建設	800	532.00	425,600	
ユアテック	1,000	1,185.00	1,185,000	
西部電気工業	1,000	425.00	425,000	
四電工	1,000	432.00	432,000	
中電工	900	2,617.00	2,355,300	
関電工	2,000	829.00	1,658,000	
きんでん	3,600	1,632.00	5,875,200	
東京エネシス	1,000	1,175.00	1,175,000	
トーエネック	1,000	889.00	889,000	
住友電設	500	1,657.00	828,500	
日本電設工業	1,000	2,365.00	2,365,000	
協和エクシオ	2,400	1,209.00	2,901,600	
新日本空調	600	1,054.00	632,400	
N D S	1,000	318.00	318,000	
九電工	1,000	2,348.00	2,348,000	
三機工業	1,400	1,094.00	1,531,600	
日揮	6,000	1,956.00	11,736,000	
中外炉工業	2,000	233.00	466,000	
ヤマト	1,000	493.00	493,000	
太平電業	1,000	1,293.00	1,293,000	
高砂熱学工業	1,800	1,863.00	3,353,400	
三晃金属工業	1,000	290.00	290,000	
朝日工業社	1,000	452.00	452,000	
明星工業	1,100	588.00	646,800	

大気社	700	2,944.00	2,060,800	
ダイダシ	1,000	886.00	886,000	
日比谷総合設備	700	1,690.00	1,183,000	
東芝プラントシステム	1,000	1,253.00	1,253,000	
東洋エンジニアリング	3,000	312.00	936,000	
千代田化工建設	4,000	920.00	3,680,000	
新興プランテック	1,200	1,001.00	1,201,200	
日本製粉	4,000	798.00	3,192,000	
日清製粉グループ本社	6,600	1,884.00	12,434,400	
日東富士製粉	1,000	353.00	353,000	
昭和産業	3,000	482.00	1,446,000	
鳥越製粉	600	808.00	484,800	
中部飼料	500	1,051.00	525,500	
フィード・ワン	3,900	140.00	546,000	
東洋精糖	1,000	117.00	117,000	
日本甜菜製糖	3,000	198.00	594,000	
三井製糖	2,000	509.00	1,018,000	
塩水港精糖	400	254.00	101,600	
森永製菓	5,000	637.00	3,185,000	
中村屋	1,000	474.00	474,000	
江崎グリコ	1,400	6,400.00	8,960,000	
名糖産業	300	1,314.00	394,200	
不二家	3,000	198.00	594,000	
山崎製パン	4,000	2,304.00	9,216,000	
第一屋製パン	1,000	122.00	122,000	
モロゾフ	1,000	418.00	418,000	
亀田製菓	300	4,770.00	1,431,000	
寿スピリッツ	100	4,600.00	460,000	
カルビー	2,200	4,695.00	10,329,000	
森永乳業	5,000	535.00	2,675,000	
六甲バター	200	1,730.00	346,000	
ヤクルト本社	3,200	6,620.00	21,184,000	
明治ホールディングス	3,600	9,670.00	34,812,000	
雪印メグミルク	1,400	2,479.00	3,470,600	
プリマハム	4,000	356.00	1,424,000	
日本ハム	4,000	2,400.00	9,600,000	

伊藤ハム	3,000	633.00	1,899,000	
林兼産業	2,000	119.00	238,000	
丸大食品	3,000	464.00	1,392,000	
米久	200	2,324.00	464,800	
S Foods	400	2,097.00	838,800	
サッポロホールディングス	9,000	501.00	4,509,000	
アサヒグループホールディングス	11,300	3,817.00	43,132,100	
キリンホールディングス	24,400	1,677.00	40,918,800	
宝ホールディングス	4,300	904.00	3,887,200	
オエノンホールディングス	2,000	225.00	450,000	
コカ・コーラウエスト	2,100	2,437.00	5,117,700	
コカ・コーライーストジャパン	2,100	1,730.00	3,633,000	
サントリー食品インターナショナル	4,100	4,885.00	20,028,500	
ダイトードリンク	300	5,290.00	1,587,000	
伊藤園	1,800	2,575.00	4,635,000	
キーコーヒー	500	1,938.00	969,000	
ユニカフェ	200	915.00	183,000	
ジャパンフーズ	100	1,141.00	114,100	
日清オイリオグループ	3,000	491.00	1,473,000	
不二製油グループ本社	1,600	1,794.00	2,870,400	
かどや製油	100	2,710.00	271,000	
J - オイルミルズ	2,000	345.00	690,000	
キッコーマン	5,000	3,925.00	19,625,000	
味の素	13,000	2,774.50	36,068,500	
キューピー	3,100	2,760.00	8,556,000	
ハウス食品グループ本社	2,000	2,115.00	4,230,000	
カゴメ	2,100	1,970.00	4,137,000	
焼津水産化学工業	400	990.00	396,000	
アリアケジャパン	500	5,540.00	2,770,000	
エバラ食品工業	100	2,070.00	207,000	
ニチレイ	6,000	823.00	4,938,000	
東洋水産	3,000	4,300.00	12,900,000	
日清食品ホールディングス	2,600	5,600.00	14,560,000	
永谷園ホールディングス	1,000	1,073.00	1,073,000	
一正蒲鉾	200	1,120.00	224,000	
フジッコ	600	2,298.00	1,378,800	

ロック・フィールド	300	2,994.00	898,200
日本たばこ産業	35,700	4,455.00	159,043,500
ケンコーマヨネーズ	200	1,662.00	332,400
わらべや日洋	300	2,410.00	723,000
なとり	300	1,636.00	490,800
ユーグレナ	2,000	1,659.00	3,318,000
ミヨシ油脂	2,000	141.00	282,000
理研ビタミン	200	3,965.00	793,000
片倉工業	700	1,393.00	975,100
ゲンゼ	4,000	375.00	1,500,000
東洋紡	22,000	184.00	4,048,000
ユニチカ	16,000	60.00	960,000
富士紡ホールディングス	3,000	216.00	648,000
倉敷紡績	6,000	215.00	1,290,000
シキボウ	3,000	126.00	378,000
日本毛織	2,000	1,004.00	2,008,000
大東紡織	2,000	69.00	138,000
トーア紡コーポレーション	300	671.00	201,300
ダイドーリミテッド	700	498.00	348,600
帝国繊維	600	1,595.00	957,000
帝人	23,000	415.00	9,545,000
東レ	41,000	1,098.00	45,018,000
サカイオーベックス	3,000	213.00	639,000
住江織物	2,000	358.00	716,000
日本フェルト	400	504.00	201,600
イチカワ	1,000	344.00	344,000
日東製網	1,000	152.00	152,000
芦森工業	2,000	236.00	472,000
アツギ	5,000	120.00	600,000
ダイニック	1,000	169.00	169,000
セーレン	1,400	1,519.00	2,126,600
東海染工	1,000	124.00	124,000
小松精練	800	702.00	561,600
ワコールホールディングス	3,000	1,490.00	4,470,000
ホギメディカル	400	6,050.00	2,420,000
レナウン	1,400	141.00	197,400

T S Iホールディングス	2,500	886.00	2,215,000	
三陽商会	3,000	320.00	960,000	
ナイガイ	3,000	61.00	183,000	
オンワードホールディングス	4,000	780.00	3,120,000	
ルック	1,000	181.00	181,000	
キムラタン	11,000	8.00	88,000	
ゴールドウイン	200	6,160.00	1,232,000	
デサント	1,300	1,575.00	2,047,500	
キング	200	420.00	84,000	
特種東海製紙	3,000	410.00	1,230,000	
王子ホールディングス	23,000	603.00	13,869,000	
日本製紙	2,900	2,059.00	5,971,100	
三菱製紙	8,000	89.00	712,000	
北越紀州製紙	3,600	858.00	3,088,800	
中越パルプ工業	2,000	217.00	434,000	
巴川製紙所	1,000	242.00	242,000	
大王製紙	2,500	1,205.00	3,012,500	
レンゴー	5,000	556.00	2,780,000	
トーモク	2,000	281.00	562,000	
ザ・バック	400	2,985.00	1,194,000	
クラレ	8,900	1,543.00	13,732,700	
旭化成	35,000	755.10	26,428,500	
共和レザー	500	974.00	487,000	
昭和電工	37,000	152.00	5,624,000	
住友化学	42,000	691.00	29,022,000	
日本化成	1,000	134.00	134,000	
住友精化	1,000	763.00	763,000	
日産化学工業	3,400	3,125.00	10,625,000	
ラサ工業	2,000	140.00	280,000	
クレハ	4,000	476.00	1,904,000	
テイカ	1,000	561.00	561,000	
石原産業	10,000	122.00	1,220,000	
日東エフシー	300	951.00	285,300	
日本曹達	4,000	828.00	3,312,000	
東ソー	15,000	664.00	9,960,000	
トクヤマ	10,000	273.00	2,730,000	

セントラル硝子	6,000	605.00	3,630,000	
東亜合成	3,500	1,066.00	3,731,000	
大阪ソーダ	2,000	442.00	884,000	
関東電化工業	1,000	995.00	995,000	
デンカ	12,000	572.00	6,864,000	
信越化学工業	10,100	7,326.00	73,992,600	
日本カーバイド工業	2,000	185.00	370,000	
堺化学工業	2,000	385.00	770,000	
エア・ウォーター	5,000	1,998.00	9,990,000	
大陽日酸	4,400	1,228.00	5,403,200	
日本化学工業	2,000	279.00	558,000	
日本パーカラライジング	3,000	1,187.00	3,561,000	
高圧ガス工業	1,000	637.00	637,000	
四国化成工業	1,000	1,267.00	1,267,000	
戸田工業	1,000	334.00	334,000	
ステラ ケミファ	300	1,345.00	403,500	
保土谷化学工業	2,000	171.00	342,000	
日本触媒	800	9,430.00	7,544,000	
大日精化工業	2,000	589.00	1,178,000	
カネカ	8,000	1,063.00	8,504,000	
三菱瓦斯化学	10,000	635.00	6,350,000	
三井化学	24,000	489.00	11,736,000	
J S R	5,600	1,894.00	10,606,400	
東京応化工業	1,100	3,715.00	4,086,500	
大阪有機化学工業	400	650.00	260,000	
三菱ケミカルホールディングス	37,700	796.30	30,020,510	
日本合成化学工業	1,000	881.00	881,000	
ダイセル	7,900	1,864.00	14,725,600	
住友ベークライト	5,000	515.00	2,575,000	
積水化学工業	13,100	1,460.00	19,126,000	
日本ゼオン	5,000	1,001.00	5,005,000	
アイカ工業	1,700	2,424.00	4,120,800	
宇部興産	30,000	252.00	7,560,000	
積水樹脂	900	1,673.00	1,505,700	
タキロン	1,000	554.00	554,000	
旭有機材工業	2,000	232.00	464,000	

日立化成	2,800	2,063.00	5,776,400
ニチバン	1,000	597.00	597,000
リケンテクノス	1,000	413.00	413,000
大倉工業	1,000	363.00	363,000
積水化成成品工業	1,000	395.00	395,000
群栄化学工業	2,000	316.00	632,000
タイガースポリマー	300	734.00	220,200
ミライアル	200	1,201.00	240,200
ダイキョーニシカワ	200	6,660.00	1,332,000
日本化薬	4,000	1,365.00	5,460,000
カーリットホールディングス	500	546.00	273,000
日本精化	600	944.00	566,400
A D E K A	2,800	1,777.00	4,975,600
日油	4,000	945.00	3,780,000
新日本理化	500	219.00	109,500
ハリマ化成グループ	600	533.00	319,800
花王	15,200	6,129.00	93,160,800
第一工業製薬	1,000	389.00	389,000
ニイタカ	100	1,570.00	157,000
三洋化成工業	2,000	967.00	1,934,000
大日本塗料	3,000	193.00	579,000
日本ペイントホールディングス	4,400	2,785.00	12,254,000
関西ペイント	6,300	1,877.00	11,825,100
中国塗料	2,000	900.00	1,800,000
日本特殊塗料	500	1,115.00	557,500
藤倉化成	800	581.00	464,800
太陽ホールディングス	400	4,365.00	1,746,000
D I C	23,000	325.00	7,475,000
サカタインクス	1,200	1,156.00	1,387,200
東洋インキ S C ホールディングス	6,000	502.00	3,012,000
T & K T O K A	200	2,310.00	462,000
富士フイルムホールディングス	12,900	4,972.00	64,138,800
資生堂	10,700	2,740.00	29,318,000
ライオン	6,000	1,191.00	7,146,000
高砂香料工業	400	3,235.00	1,294,000
マンダム	500	4,650.00	2,325,000

ミルボン	300	4,640.00	1,392,000	
ファンケル	1,300	1,735.00	2,255,500	
コーセー	900	11,490.00	10,341,000	
コタ	200	1,242.00	248,400	
ドクターシーラボ	800	2,243.00	1,794,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	600	7,840.00	4,704,000	
ノエビアホールディングス	400	3,190.00	1,276,000	
エステー	400	1,034.00	413,600	
コニシ	400	2,370.00	948,000	
長谷川香料	700	1,613.00	1,129,100	
星光PMC	300	1,051.00	315,300	
小林製薬	900	9,340.00	8,406,000	
荒川化学工業	500	1,194.00	597,000	
メック	400	859.00	343,600	
日本高純度化学	200	2,331.00	466,200	
JCU	200	4,565.00	913,000	
新田ゼラチン	400	781.00	312,400	
デクセリアルズ	1,300	1,348.00	1,752,400	
アース製薬	400	5,030.00	2,012,000	
イハラケミカル工業	900	1,550.00	1,395,000	
北興化学工業	1,000	463.00	463,000	
大成ラミック	200	2,945.00	589,000	
クミアイ化学工業	1,200	994.00	1,192,800	
日本農薬	1,300	829.00	1,077,700	
アキレス	5,000	153.00	765,000	
有沢製作所	900	815.00	733,500	
日東電工	4,300	8,822.00	37,934,600	
レック	200	1,315.00	263,000	
きもと	700	273.00	191,100	
藤森工業	500	3,305.00	1,652,500	
前澤化成工業	400	1,082.00	432,800	
JSP	400	2,649.00	1,059,600	
エフピコ	500	4,665.00	2,332,500	
天馬	400	2,184.00	873,600	
信越ポリマー	1,100	649.00	713,900	
東リ	2,000	354.00	708,000	

ニフコ	1,100	5,030.00	5,533,000	
日本バルカー工業	2,000	315.00	630,000	
ユニ・チャーム	11,400	2,653.00	30,244,200	
協和発酵キリン	7,000	2,093.00	14,651,000	
武田薬品工業	22,500	6,143.00	138,217,500	
アステラス製薬	63,200	1,802.00	113,886,400	
大日本住友製薬	4,000	1,382.00	5,528,000	
塩野義製薬	8,200	5,186.00	42,525,200	
田辺三菱製薬	6,600	2,108.00	13,912,800	
わかもと製薬	1,000	284.00	284,000	
あすか製薬	700	1,227.00	858,900	
日本新薬	1,000	5,090.00	5,090,000	
ピオフェルミン製薬	100	3,575.00	357,500	
中外製薬	5,600	4,070.00	22,792,000	
科研製薬	1,000	8,060.00	8,060,000	
エーザイ	6,900	7,658.00	52,840,200	
ロート製薬	2,800	2,109.00	5,905,200	
小野薬品工業	2,600	16,895.00	43,927,000	
久光製薬	1,700	4,970.00	8,449,000	
有機合成薬品工業	1,000	281.00	281,000	
持田製薬	400	7,440.00	2,976,000	
参天製薬	10,300	1,773.00	18,261,900	
扶桑薬品工業	2,000	285.00	570,000	
日本ケミファ	1,000	617.00	617,000	
ツムラ	1,800	3,260.00	5,868,000	
日医工	1,300	3,100.00	4,030,000	
キッセイ薬品工業	1,000	3,190.00	3,190,000	
生化学工業	1,100	1,723.00	1,895,300	
栄研化学	500	2,217.00	1,108,500	
鳥居薬品	400	2,812.00	1,124,800	
JCRファーマ	400	2,740.00	1,096,000	
東和薬品	300	8,350.00	2,505,000	
富士製薬工業	200	2,188.00	437,600	
沢井製薬	1,000	7,340.00	7,340,000	
ゼリア新薬工業	1,100	1,777.00	1,954,700	
第一三共	18,900	2,447.00	46,248,300	

キョーリン製薬ホールディングス	1,500	2,209.00	3,313,500	
大幸薬品	300	1,849.00	554,700	
ダイト	200	2,826.00	565,200	
大塚ホールディングス	12,100	4,124.00	49,900,400	
大正製薬ホールディングス	1,400	7,930.00	11,102,000	
日本コークス工業	5,200	103.00	535,600	
昭和シェル石油	5,700	1,092.00	6,224,400	
ニチレキ	1,000	975.00	975,000	
東燃ゼネラル石油	9,000	1,285.00	11,565,000	
ユシロ化学工業	300	1,497.00	449,100	
ビービー・カストロール	300	1,281.00	384,300	
富士石油	1,500	396.00	594,000	
MORESCO	100	1,600.00	160,000	
出光興産	2,900	2,029.00	5,884,100	
JXホールディングス	66,700	479.00	31,949,300	
コスモエネルギーホールディングス	1,700	1,582.00	2,689,400	
横浜ゴム	3,400	2,372.00	8,064,800	
東洋ゴム工業	2,600	2,671.00	6,944,600	
ブリヂストン	19,000	4,560.00	86,640,000	
住友ゴム工業	5,300	1,734.00	9,190,200	
藤倉ゴム工業	400	603.00	241,200	
オカモト	2,000	1,004.00	2,008,000	
フコク	300	1,044.00	313,200	
ニッタ	600	3,575.00	2,145,000	
住友理工	1,200	1,007.00	1,208,400	
三ツ星ベルト	1,000	991.00	991,000	
バンドー化学	2,000	528.00	1,056,000	
日東紡績	4,000	373.00	1,492,000	
旭硝子	30,000	729.00	21,870,000	
日本板硝子	27,000	109.00	2,943,000	
石塚硝子	1,000	261.00	261,000	
日本山村硝子	2,000	187.00	374,000	
日本電気硝子	12,000	668.00	8,016,000	
オハラ	200	597.00	119,400	
住友大阪セメント	11,000	509.00	5,599,000	
太平洋セメント	35,000	398.00	13,930,000	

デイ・シイ	600	365.00	219,000
日本ヒューム	600	775.00	465,000
日本コンクリート工業	900	398.00	358,200
三谷セキサン	300	1,647.00	494,100
アジアパイルホールディングス	700	650.00	455,000
東海カーボン	5,000	360.00	1,800,000
日本カーボン	3,000	341.00	1,023,000
東洋炭素	300	1,799.00	539,700
ノリタケカンパニーリミテド	3,000	287.00	861,000
TOTO	4,100	4,365.00	17,896,500
日本碍子	7,000	2,841.00	19,887,000
日本特殊陶業	4,900	3,285.00	16,096,500
ダントーホールディングス	1,000	207.00	207,000
MARUWA	200	2,953.00	590,600
品川リフラクトリーズ	2,000	265.00	530,000
黒崎播磨	1,000	262.00	262,000
イソライト工業	100	226.00	22,600
東京窯業	1,000	193.00	193,000
ニッカトー	300	405.00	121,500
フジインコーポレーテッド	500	1,700.00	850,000
エーアンドエーマテリアル	2,000	103.00	206,000
ニチアス	3,000	777.00	2,331,000
ニチハ	800	1,714.00	1,371,200
新日鐵住金	25,500	2,485.00	63,367,500
神戸製鋼所	103,000	147.00	15,141,000
合同製鐵	3,000	232.00	696,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	15,400	1,921.00	29,583,400
日新製鋼	2,500	1,321.00	3,302,500
東京製鐵	3,100	819.00	2,538,900
共英製鋼	600	2,069.00	1,241,400
大和工業	1,300	3,300.00	4,290,000
東京鐵鋼	1,000	587.00	587,000
大阪製鐵	400	2,214.00	885,600
淀川製鋼所	800	2,372.00	1,897,600
東洋鋼鋳	1,400	384.00	537,600
丸一鋼管	1,900	3,170.00	6,023,000

モリ工業	1,000	374.00	374,000
大同特殊鋼	9,000	485.00	4,365,000
日本高周波鋼業	3,000	99.00	297,000
日本冶金工業	4,100	165.00	676,500
山陽特殊製鋼	3,000	515.00	1,545,000
愛知製鋼	3,000	514.00	1,542,000
日立金属	6,400	1,413.00	9,043,200
日本金属	2,000	145.00	290,000
大平洋金属	4,000	342.00	1,368,000
新日本電工	3,100	229.00	709,900
栗本鐵工所	3,000	221.00	663,000
日本鑄鉄管	1,000	198.00	198,000
三菱製鋼	4,000	246.00	984,000
日垂鋼業	1,000	269.00	269,000
日本精線	1,000	559.00	559,000
シンニッタン	800	598.00	478,400
新家工業	2,000	144.00	288,000
大紀アルミニウム工業所	1,000	335.00	335,000
日本軽金属ホールディングス	12,800	216.00	2,764,800
三井金属鉱業	15,000	239.00	3,585,000
東邦亜鉛	3,000	325.00	975,000
三菱マテリアル	35,000	415.00	14,525,000
住友金属鉱山	16,000	1,514.00	24,224,000
DOWAホールディングス	7,000	913.00	6,391,000
古河機械金属	9,000	257.00	2,313,000
エス・サイエンス	1,300	45.00	58,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	600	3,175.00	1,905,000
東邦チタニウム	900	1,548.00	1,393,200
UACJ	8,000	275.00	2,200,000
古河電気工業	18,000	248.00	4,464,000
住友電気工業	22,500	1,695.50	38,148,750
フジクラ	8,000	640.00	5,120,000
昭和電線ホールディングス	7,000	80.00	560,000
タツタ電線	1,200	480.00	576,000
沖電線	1,000	269.00	269,000
カナレ電気	100	2,004.00	200,400

リヨービ	3,000	426.00	1,278,000	
アーレスティ	700	853.00	597,100	
アサヒホールディングス	800	1,825.00	1,460,000	
稲葉製作所	300	1,312.00	393,600	
宮地エンジニアリンググループ	2,000	213.00	426,000	
トーカロ	400	2,729.00	1,091,600	
アルファC o	200	1,374.00	274,800	
SUMCO	4,500	1,085.00	4,882,500	
川田テクノロジーズ	100	4,460.00	446,000	
東洋製罐グループホールディングス	4,000	2,253.00	9,012,000	
ホッカンホールディングス	1,000	329.00	329,000	
コロナ	300	1,166.00	349,800	
横河ブリッジホールディングス	1,100	1,142.00	1,256,200	
駒井ハルテック	1,000	233.00	233,000	
高田機工	1,000	214.00	214,000	
三和ホールディングス	5,700	1,002.00	5,711,400	
文化シャッター	1,600	983.00	1,572,800	
三協立山	700	1,775.00	1,242,500	
アルインコ	200	1,157.00	231,400	
東洋シャッター	100	784.00	78,400	
LIXILグループ	7,800	2,789.00	21,754,200	
日本フィルコン	500	542.00	271,000	
ノーリツ	1,100	1,984.00	2,182,400	
長府製作所	600	2,624.00	1,574,400	
リンナイ	1,000	10,540.00	10,540,000	
ダイニチ工業	300	724.00	217,200	
日東精工	1,000	331.00	331,000	
三洋工業	1,000	174.00	174,000	
岡部	1,200	967.00	1,160,400	
ジーテクト	600	1,716.00	1,029,600	
中国工業	100	739.00	73,900	
東プレ	1,100	2,663.00	2,929,300	
高周波熱錬	1,000	924.00	924,000	
東京製綱	4,000	194.00	776,000	
モリテック スチール	200	292.00	58,400	
パイオラックス	300	6,480.00	1,944,000	

日本発條	5,300	1,274.00	6,752,200
中央発條	1,000	293.00	293,000
アドバネクス	200	1,767.00	353,400
三益半導体工業	400	1,208.00	483,200
日本製鋼所	9,000	473.00	4,257,000
三浦工業	2,500	1,537.00	3,842,500
タクマ	2,000	980.00	1,960,000
ツガミ	2,000	619.00	1,238,000
オークマ	4,000	1,061.00	4,244,000
東芝機械	3,000	443.00	1,329,000
アマダホールディングス	8,400	1,133.00	9,517,200
アイダエンジニアリング	1,500	1,238.00	1,857,000
滝澤鉄工所	2,000	181.00	362,000
富士機械製造	1,800	1,123.00	2,021,400
牧野フライス製作所	3,000	1,021.00	3,063,000
オーエスジー	2,600	2,342.00	6,089,200
ダイジェット工業	1,000	180.00	180,000
旭ダイヤモンド工業	1,600	1,361.00	2,177,600
D M G 森精機	3,100	1,863.00	5,775,300
ソディック	1,000	942.00	942,000
ディスコ	700	10,860.00	7,602,000
日東工器	300	2,670.00	801,000
パンチ工業	100	1,003.00	100,300
豊和工業	400	677.00	270,800
O K K	2,000	147.00	294,000
東洋機械金属	600	457.00	274,200
津田駒工業	2,000	132.00	264,000
島精機製作所	800	1,819.00	1,455,200
日阪製作所	700	982.00	687,400
やまびこ	1,100	1,103.00	1,213,300
ペガサスマシン製造	700	504.00	352,800
ナブテスコ	3,000	2,453.00	7,359,000
三井海洋開発	700	1,820.00	1,274,000
レオン自動機	800	689.00	551,200
S M C	1,700	32,020.00	54,434,000
新川	500	717.00	358,500

ホソカワミクロン	1,000	611.00	611,000	
ユニオンツール	200	3,145.00	629,000	
オイレス工業	700	1,971.00	1,379,700	
日精エー・エス・ビー機械	200	2,567.00	513,400	
サトーホールディングス	800	2,687.00	2,149,600	
日本エアテック	300	720.00	216,000	
日精樹脂工業	400	979.00	391,600	
ワイエイシイ	300	949.00	284,700	
小松製作所	27,600	2,040.50	56,317,800	
住友重機械工業	16,000	564.00	9,024,000	
日立建機	2,500	1,984.00	4,960,000	
日工	1,000	419.00	419,000	
巴工業	200	1,543.00	308,600	
井関農機	6,000	202.00	1,212,000	
T O W A	600	702.00	421,200	
丸山製作所	1,000	202.00	202,000	
北川鉄工所	3,000	321.00	963,000	
クボタ	27,000	1,994.50	53,851,500	
荏原実業	200	1,508.00	301,600	
三菱化工機	2,000	308.00	616,000	
月島機械	1,100	1,195.00	1,314,500	
帝国電機製作所	400	885.00	354,000	
新東工業	1,300	1,089.00	1,415,700	
澁谷工業	500	1,821.00	910,500	
アイチ コーポレーション	800	814.00	651,200	
小森コーポレーション	1,400	1,540.00	2,156,000	
鶴見製作所	400	2,269.00	907,600	
住友精密工業	1,000	464.00	464,000	
酒井重工業	1,000	254.00	254,000	
荏原製作所	12,000	533.00	6,396,000	
石井鐵工所	1,000	203.00	203,000	
西島製作所	700	964.00	674,800	
ダイキン工業	7,900	8,366.00	66,091,400	
オルガノ	1,000	489.00	489,000	
トーヨーカネツ	3,000	200.00	600,000	
栗田工業	3,400	2,722.00	9,254,800	

椿本チエイン	3,000	969.00	2,907,000	
大同工業	1,000	236.00	236,000	
日本コンベヤ	2,000	182.00	364,000	
木村化工機	600	527.00	316,200	
アネスト岩田	900	955.00	859,500	
ダイフク	2,700	1,849.00	4,992,300	
サムコ	100	937.00	93,700	
加藤製作所	1,000	533.00	533,000	
油研工業	1,000	249.00	249,000	
タダノ	3,000	1,562.00	4,686,000	
フジテック	1,600	1,350.00	2,160,000	
C K D	1,500	1,152.00	1,728,000	
キトー	700	1,003.00	702,100	
平和	1,700	2,273.00	3,864,100	
理想科学工業	600	2,044.00	1,226,400	
S A N K Y O	1,500	4,695.00	7,042,500	
日本金銭機械	500	1,317.00	658,500	
マースエンジニアリング	300	2,152.00	645,600	
福島工業	300	2,604.00	781,200	
オーイズミ	400	648.00	259,200	
ダイコク電機	200	1,597.00	319,400	
竹内製作所	800	2,529.00	2,023,200	
アマノ	1,700	1,652.00	2,808,400	
J U K I	800	1,215.00	972,000	
サンデンホールディングス	3,000	453.00	1,359,000	
蛇の目マシン工業	500	852.00	426,000	
マックス	1,000	1,275.00	1,275,000	
グローリー	1,900	3,450.00	6,555,000	
新晃工業	400	1,339.00	535,600	
大和冷機工業	800	830.00	664,000	
セガサミーホールディングス	5,800	1,295.00	7,511,000	
日本ピストンリング	200	2,197.00	439,400	
リケン	2,000	474.00	948,000	
T P R	700	3,145.00	2,201,500	
ホシザキ電機	1,200	8,460.00	10,152,000	
大豊工業	400	1,397.00	558,800	

日本精工	11,100	1,457.00	16,172,700	
N T N	13,000	584.00	7,592,000	
ジェイテクト	5,700	2,234.00	12,733,800	
不二越	5,000	566.00	2,830,000	
日本トムソン	2,000	550.00	1,100,000	
T H K	3,600	2,385.00	8,586,000	
ユーシン精機	200	2,418.00	483,600	
前澤給装工業	200	1,615.00	323,000	
イーグル工業	700	2,517.00	1,761,900	
前澤工業	700	425.00	297,500	
日本ピラー工業	600	1,012.00	607,200	
キット	2,600	574.00	1,492,400	
日立工機	1,500	913.00	1,369,500	
マキタ	3,500	6,610.00	23,135,000	
日立造船	4,300	645.00	2,773,500	
三菱重工業	96,000	615.40	59,078,400	
I H I	41,000	355.00	14,555,000	
日清紡ホールディングス	3,000	1,640.00	4,920,000	
イビデン	3,500	1,892.00	6,622,000	
コニカミノルタ	13,400	1,292.00	17,312,800	
ブラザー工業	7,000	1,537.00	10,759,000	
ミネベア	9,000	1,537.00	13,833,000	
日立製作所	137,000	729.60	99,955,200	
東芝	113,000	310.00	35,030,000	
三菱電機	58,000	1,321.50	76,647,000	
富士電機	16,000	557.00	8,912,000	
東洋電機製造	1,000	442.00	442,000	
安川電機	6,700	1,534.00	10,277,800	
シンフォニアテクノロジー	3,000	207.00	621,000	
明電舎	5,000	408.00	2,040,000	
オリジン電気	1,000	335.00	335,000	
山洋電気	1,000	807.00	807,000	
デンヨー	500	1,998.00	999,000	
東芝テック	4,000	405.00	1,620,000	
芝浦メカトロニクス	1,000	256.00	256,000	
マブチモーター	1,500	6,590.00	9,885,000	

日本電産	6,500	9,582.00	62,283,000
東光高岳	300	1,443.00	432,900
ダイヘン	3,000	573.00	1,719,000
田淵電機	600	863.00	517,800
JVCケンウッド	3,900	299.00	1,166,100
ミマキエンジニアリング	300	573.00	171,900
第一精工	200	1,792.00	358,400
日新電機	1,200	800.00	960,000
大崎電気工業	1,000	657.00	657,000
オムロン	6,200	4,435.00	27,497,000
日東工業	900	2,171.00	1,953,900
I D E C	700	1,045.00	731,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	11,000	456.00	5,016,000
サクサホールディングス	2,000	242.00	484,000
メルコホールディングス	300	2,149.00	644,700
テクノメディカ	200	2,720.00	544,000
日本電気	74,000	390.00	28,860,000
富士通	52,000	604.30	31,423,600
沖電気工業	23,000	161.00	3,703,000
岩崎通信機	3,000	81.00	243,000
電気興業	1,000	527.00	527,000
サンケン電気	3,000	510.00	1,530,000
ナカヨ	1,000	356.00	356,000
アイホン	300	1,978.00	593,400
ルネサスエレクトロニクス	2,800	730.00	2,044,000
セイコーエプソン	8,000	1,930.00	15,440,000
ワコム	4,200	470.00	1,974,000
アルバック	900	2,274.00	2,046,600
アクセル	300	1,421.00	426,300
E I Z O	500	2,765.00	1,382,500
ジャパンディスプレイ	10,000	403.00	4,030,000
日本信号	1,500	1,287.00	1,930,500
京三製作所	1,000	353.00	353,000
能美防災	600	1,499.00	899,400
ホーチキ	600	1,220.00	732,000
エレコム	500	1,558.00	779,000

日本無線	1,000	436.00	436,000	
パナソニック	61,500	1,427.50	87,791,250	
シャープ	46,000	130.00	5,980,000	
アンリツ	3,300	787.00	2,597,100	
富士通ゼネラル	2,000	1,604.00	3,208,000	
日立国際電気	1,000	1,755.00	1,755,000	
ソニー	38,000	3,478.00	132,164,000	
T D K	3,200	8,840.00	28,288,000	
帝国通信工業	1,000	211.00	211,000	
ミツミ電機	2,100	638.00	1,339,800	
タムラ製作所	2,000	395.00	790,000	
アルプス電気	4,600	3,980.00	18,308,000	
池上通信機	2,000	155.00	310,000	
パイオニア	9,000	338.00	3,042,000	
日本電波工業	500	810.00	405,000	
鈴木	200	619.00	123,800	
日本トリム	100	4,695.00	469,500	
ローランド ディー . ジー .	300	2,932.00	879,600	
フォスター電機	700	3,055.00	2,138,500	
クラリオン	3,000	414.00	1,242,000	
S M K	2,000	616.00	1,232,000	
ヨコオ	600	702.00	421,200	
東光	1,000	385.00	385,000	
ティアック	4,000	44.00	176,000	
ホシデン	1,700	691.00	1,174,700	
ヒロセ電機	900	15,420.00	13,878,000	
日本航空電子工業	2,000	2,260.00	4,520,000	
T O A	600	1,167.00	700,200	
日立マクセル	900	2,095.00	1,885,500	
古野電気	600	868.00	520,800	
ユニデンホールディングス	2,000	196.00	392,000	
アルパイン	1,300	1,659.00	2,156,700	
スミダコーポレーション	400	776.00	310,400	
アイコム	300	2,515.00	754,500	
リオン	100	1,808.00	180,800	
船井電機	500	1,304.00	652,000	

横河電機	5,400	1,471.00	7,943,400
新電元工業	2,000	494.00	988,000
アズビル	1,800	3,230.00	5,814,000
東亜ディーケーケー	200	503.00	100,600
日本光電工業	2,300	2,547.00	5,858,100
チノー	200	1,121.00	224,200
共和電業	700	455.00	318,500
日本電子材料	200	626.00	125,200
堀場製作所	1,000	4,640.00	4,640,000
アドバンテスト	3,700	1,004.00	3,714,800
小野測器	400	951.00	380,400
エスベック	600	1,290.00	774,000
パナソニック デバイスSUNX	600	685.00	411,000
キーエンス	1,200	66,900.00	80,280,000
日置電機	300	2,270.00	681,000
シスメックス	4,200	7,230.00	30,366,000
メガチップス	500	1,209.00	604,500
OBARA GROUP	400	5,500.00	2,200,000
コーセル	700	1,215.00	850,500
新日本無線	1,000	659.00	659,000
オブテックス	400	2,408.00	963,200
千代田インテグレ	300	3,005.00	901,500
レーザーテック	500	1,328.00	664,000
スタンレー電気	3,800	2,498.00	9,492,400
岩崎電気	2,000	244.00	488,000
ウシオ電機	3,300	1,810.00	5,973,000
ヘリオス テクノ ホールディング	600	414.00	248,400
日本セラミック	300	1,848.00	554,400
遠藤照明	300	1,141.00	342,300
日本デジタル研究所	500	1,693.00	846,500
双信電機	300	325.00	97,500
山一電機	700	895.00	626,500
図研	400	1,134.00	453,600
日本電子	2,000	752.00	1,504,000
カシオ計算機	5,400	2,477.00	13,375,800
ファナック	5,500	22,035.00	121,192,500

日本シイエムケイ	1,300	223.00	289,900
エンプラス	300	4,975.00	1,492,500
大真空	1,000	252.00	252,000
ローム	2,600	6,680.00	17,368,000
浜松ホトニクス	4,200	3,270.00	13,734,000
三井ハイテック	800	755.00	604,000
新光電気工業	2,000	807.00	1,614,000
京セラ	8,800	6,002.00	52,817,600
太陽誘電	2,600	1,869.00	4,859,400
村田製作所	5,700	19,565.00	111,520,500
ユーシン	700	758.00	530,600
双葉電子工業	900	1,601.00	1,440,900
北陸電気工業	2,000	170.00	340,000
ニチコン	1,700	1,057.00	1,796,900
日本ケミコン	4,000	257.00	1,028,000
K O A	700	1,068.00	747,600
市光工業	2,000	214.00	428,000
小糸製作所	3,200	4,810.00	15,392,000
ミツバ	900	2,125.00	1,912,500
スター精密	1,000	1,704.00	1,704,000
S C R E E Nホールディングス	6,000	751.00	4,506,000
キャノン電子	500	2,125.00	1,062,500
キャノン	29,000	3,775.00	109,475,000
リコー	17,400	1,357.00	23,611,800
M U T O Hホールディングス	1,000	300.00	300,000
東京エレクトロン	4,800	7,668.00	36,806,400
トヨタ紡織	1,900	2,727.00	5,181,300
鬼怒川ゴム工業	1,000	720.00	720,000
ユニプレス	1,100	2,914.00	3,205,400
豊田自動織機	4,900	6,760.00	33,124,000
モリタホールディングス	900	1,280.00	1,152,000
三櫻工業	700	801.00	560,700
デンソー	13,300	5,856.00	77,884,800
東海理化電機製作所	1,600	2,642.00	4,227,200
三井造船	21,000	195.00	4,095,000
川崎重工業	42,000	492.00	20,664,000

名村造船所	1,600	1,039.00	1,662,400	
サノヤスホールディングス	300	268.00	80,400	
日本車輛製造	2,000	301.00	602,000	
ニチユ三菱フォークリフト	600	538.00	322,800	
近畿車輛	1,000	402.00	402,000	
日産自動車	75,600	1,285.00	97,146,000	
いすゞ自動車	15,600	1,484.00	23,150,400	
トヨタ自動車	68,600	7,625.00	523,075,000	代用有価証券 2,300株
日野自動車	7,700	1,472.00	11,334,400	
三菱自動車工業	21,300	1,099.00	23,408,700	
エフテック	200	1,166.00	233,200	
レシップホールディングス	200	846.00	169,200	
武蔵精密工業	600	2,628.00	1,576,800	
日産車体	2,600	1,431.00	3,720,600	
新明和工業	2,000	1,311.00	2,622,000	
極東開発工業	1,100	1,399.00	1,538,900	
日信工業	1,200	1,821.00	2,185,200	
トピー工業	5,000	273.00	1,365,000	
ティラド	2,000	192.00	384,000	
曙ブレーキ工業	2,600	319.00	829,400	
タチエス	900	1,784.00	1,605,600	
NOK	2,600	3,055.00	7,943,000	
フタバ産業	1,600	539.00	862,400	
K Y B	6,000	377.00	2,262,000	
シロキ工業	1,000	370.00	370,000	
大同メタル工業	800	1,194.00	955,200	
プレス工業	2,800	560.00	1,568,000	
ミクニ	500	489.00	244,500	
カルソニックカンセイ	4,000	1,042.00	4,168,000	
太平洋工業	1,200	1,352.00	1,622,400	
ケーヒン	1,200	1,986.00	2,383,200	
河西工業	600	1,615.00	969,000	
アイシン精機	5,400	5,050.00	27,270,000	
富士機工	800	516.00	412,800	
マツダ	17,000	2,526.50	42,950,500	

ダイハツ工業	6,400	1,521.00	9,734,400	
今仙電機製作所	500	1,156.00	578,000	
本田技研工業	48,500	4,063.00	197,055,500	代用有価証券 4,700株
スズキ	11,200	3,960.00	44,352,000	
富士重工業	17,000	5,014.00	85,238,000	
安永	200	553.00	110,600	
ヤマハ発動機	7,600	2,935.00	22,306,000	
ショーワ	1,400	1,170.00	1,638,000	
T B K	700	469.00	328,300	
エクセディ	700	2,934.00	2,053,800	
豊田合成	2,000	2,980.00	5,960,000	
愛三工業	1,000	1,256.00	1,256,000	
ヨロズ	500	2,559.00	1,279,500	
エフ・シー・シー	900	2,414.00	2,172,600	
シマノ	2,200	19,000.00	41,800,000	
タカタ	1,000	830.00	830,000	
テイ・エス テック	1,200	3,345.00	4,014,000	
ジャムコ	200	4,140.00	828,000	
テルモ	8,200	3,900.00	31,980,000	
クリエートメディック	200	947.00	189,400	
日機装	2,000	959.00	1,918,000	
島津製作所	7,000	1,909.00	13,363,000	
J M S	1,000	302.00	302,000	
モリテックス	200	221.00	44,200	
長野計器	500	849.00	424,500	
ブイ・テクノロジー	100	4,380.00	438,000	
東京計器	2,000	249.00	498,000	
愛知時計電機	1,000	344.00	344,000	
オーバル	400	270.00	108,000	
東京精密	1,000	2,810.00	2,810,000	
マニー	500	2,294.00	1,147,000	
ニコン	10,000	1,662.00	16,620,000	
トプコン	1,800	1,842.00	3,315,600	
オリンパス	8,000	4,830.00	38,640,000	
理研計器	400	1,573.00	629,200	

タムロン	400	2,330.00	932,000
H O Y A	12,500	5,038.00	62,975,000
ノーリツ鋼機	500	613.00	306,500
エー・アンド・デイ	600	476.00	285,600
シチズンホールディングス	6,800	953.00	6,480,400
リズム時計工業	3,000	172.00	516,000
大研医器	400	1,159.00	463,600
メニコン	300	2,672.00	801,600
松風	300	1,487.00	446,100
セイコーホールディングス	3,000	781.00	2,343,000
ニプロ	4,000	1,396.00	5,584,000
パラマウントベッドホールディングス	600	4,060.00	2,436,000
S H O - B I	100	399.00	39,900
ニホンフラッシュ	200	1,259.00	251,800
前田工織	600	963.00	577,800
永大産業	1,000	421.00	421,000
アートネイチャー	500	1,170.00	585,000
ダンロップスポーツ	300	1,201.00	360,300
バンダイナムコホールディングス	5,500	2,819.00	15,504,500
アイフィスジャパン	100	497.00	49,700
共立印刷	900	315.00	283,500
フランスベッドホールディングス	700	1,000.00	700,000
パイロットコーポレーション	900	5,430.00	4,887,000
萩原工業	100	2,110.00	211,000
トッパン・フォームズ	1,000	1,593.00	1,593,000
フジシールインターナショナル	700	4,190.00	2,933,000
タカラトミー	1,800	618.00	1,112,400
廣濟堂	700	392.00	274,400
A s - m e エステール	100	742.00	74,200
タカノ	300	717.00	215,100
プロネクサス	600	924.00	554,400
ホクシン	400	130.00	52,000
ウッドワン	1,000	245.00	245,000
大建工業	2,000	362.00	724,000
凸版印刷	15,000	1,094.00	16,410,000
大日本印刷	16,000	1,273.00	20,368,000

図書印刷	1,000	538.00	538,000	
共同印刷	2,000	350.00	700,000	
日本写真印刷	900	2,780.00	2,502,000	
光村印刷	1,000	251.00	251,000	
宝印刷	400	1,370.00	548,000	
アシックス	5,000	2,710.00	13,550,000	
ツツミ	300	2,546.00	763,800	
小松ウオール工業	200	2,113.00	422,600	
ヤマハ	3,900	3,175.00	12,382,500	
河合楽器製作所	200	2,428.00	485,600	
クリナップ	800	738.00	590,400	
ピジョン	3,100	3,340.00	10,354,000	
兼松日産農林	1,000	169.00	169,000	
キングジム	500	862.00	431,000	
リンテック	1,300	2,632.00	3,421,600	
T A S A K I	100	2,092.00	209,200	
イトーキ	1,100	912.00	1,003,200	
任天堂	3,300	20,820.00	68,706,000	
三菱鉛筆	400	5,650.00	2,260,000	
タカラスタンダード	2,000	956.00	1,912,000	
コクヨ	2,800	1,365.00	3,822,000	
ナカバヤシ	2,000	327.00	654,000	
岡村製作所	1,900	1,142.00	2,169,800	
美津濃	3,000	607.00	1,821,000	
アデランス	900	889.00	800,100	
東京電力	45,600	808.00	36,844,800	
中部電力	16,500	1,817.50	29,988,750	
関西電力	21,900	1,525.50	33,408,450	
中国電力	7,500	1,714.00	12,855,000	
北陸電力	5,300	1,830.00	9,699,000	
東北電力	13,500	1,658.00	22,383,000	
四国電力	4,800	1,971.00	9,460,800	
九州電力	11,900	1,462.00	17,397,800	
北海道電力	5,000	1,226.00	6,130,000	
沖縄電力	600	3,020.00	1,812,000	
電源開発	4,600	4,175.00	19,205,000	

東京瓦斯	60,000	596.90	35,814,000	
大阪瓦斯	56,000	454.00	25,424,000	
東邦瓦斯	14,000	782.00	10,948,000	
北海道瓦斯	1,000	281.00	281,000	
広島ガス	900	473.00	425,700	
西部瓦斯	6,000	272.00	1,632,000	
静岡ガス	1,600	839.00	1,342,400	
メタウォーター	300	2,797.00	839,100	
SBSホールディングス	500	1,076.00	538,000	
東武鉄道	29,000	584.00	16,936,000	
相鉄ホールディングス	9,000	649.00	5,841,000	
東京急行電鉄	31,000	977.00	30,287,000	
京浜急行電鉄	15,000	990.00	14,850,000	
小田急電鉄	17,000	1,155.00	19,635,000	
京王電鉄	15,000	960.00	14,400,000	
京成電鉄	8,000	1,493.00	11,944,000	
富士急行	1,000	1,153.00	1,153,000	
新京成電鉄	1,000	433.00	433,000	
東日本旅客鉄道	9,800	11,720.00	114,856,000	
西日本旅客鉄道	5,200	8,215.00	42,718,000	
東海旅客鉄道	4,800	22,205.00	106,584,000	
西武ホールディングス	4,300	2,493.00	10,719,900	
鴻池運輸	800	1,531.00	1,224,800	
西日本鉄道	7,000	623.00	4,361,000	
ハマキョウレックス	400	2,351.00	940,400	
サカイ引越センター	100	6,150.00	615,000	
近鉄グループホールディングス	54,000	471.00	25,434,000	
阪急阪神ホールディングス	36,000	773.00	27,828,000	
南海電気鉄道	12,000	598.00	7,176,000	
京阪電気鉄道	12,000	834.00	10,008,000	
神戸電鉄	1,000	360.00	360,000	
名古屋鉄道	20,000	488.00	9,760,000	
山陽電気鉄道	2,000	475.00	950,000	
日本通運	21,000	572.00	12,012,000	
ヤマトホールディングス	9,900	2,372.00	23,482,800	
山九	7,000	656.00	4,592,000	

丸運	300	259.00	77,700
丸全昭和運輸	2,000	445.00	890,000
センコー	2,000	836.00	1,672,000
トナミホールディングス	1,000	354.00	354,000
ニッコンホールディングス	1,800	2,236.00	4,024,800
日本石油輸送	1,000	236.00	236,000
福山通運	3,000	633.00	1,899,000
セイノーホールディングス	3,800	1,380.00	5,244,000
神奈川中央交通	1,000	680.00	680,000
日立物流	1,100	2,141.00	2,355,100
丸和運輸機関	200	2,173.00	434,600
C & F ロジホールディングス	200	939.00	187,800
日本郵船	48,000	332.00	15,936,000
商船三井	26,000	328.00	8,528,000
川崎汽船	24,000	252.00	6,048,000
N S ユナイテッド海運	3,000	237.00	711,000
明治海運	600	510.00	306,000
飯野海運	2,700	556.00	1,501,200
共栄タンカー	1,000	191.00	191,000
乾汽船	300	1,000.00	300,000
日本航空	10,300	4,639.00	47,781,700
A N A ホールディングス	100,000	375.50	37,550,000
パスコ	1,000	323.00	323,000
トランコム	200	6,220.00	1,244,000
日新	2,000	374.00	748,000
三菱倉庫	4,000	1,719.00	6,876,000
三井倉庫ホールディングス	3,000	374.00	1,122,000
住友倉庫	4,000	666.00	2,664,000
澁澤倉庫	2,000	317.00	634,000
東陽倉庫	1,000	255.00	255,000
日本トランスシティ	1,000	468.00	468,000
ケイヒン	1,000	188.00	188,000
中央倉庫	200	992.00	198,400
安田倉庫	400	950.00	380,000
東洋埠頭	2,000	194.00	388,000
宇徳	400	418.00	167,200

上組	6,000	1,050.00	6,300,000
サンリツ	200	552.00	110,400
キューソー流通システム	200	2,570.00	514,000
郵船ロジスティクス	500	1,438.00	719,000
近鉄エクスプレス	1,000	2,271.00	2,271,000
エーアイティー	200	1,108.00	221,600
内外トランスライン	200	1,171.00	234,200
NEC ネットエスアイ	700	2,134.00	1,493,800
システナ	500	1,180.00	590,000
デジタルアーツ	300	2,043.00	612,900
新日鉄住金ソリューションズ	400	5,770.00	2,308,000
キューブシステム	200	582.00	116,400
コア	300	844.00	253,200
ソフトクリエイティブホールディングス	200	945.00	189,000
ITホールディングス	1,800	2,999.00	5,398,200
電算システム	100	1,920.00	192,000
グリー	3,300	583.00	1,923,900
コーエーテクモホールディングス	1,300	1,850.00	2,405,000
三菱総合研究所	200	3,020.00	604,000
AGS	100	996.00	99,600
ファインデックス	300	749.00	224,700
ヒト・コミュニケーションズ	100	2,495.00	249,500
ブレインパッド	100	504.00	50,400
K L a b	800	1,154.00	923,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	300	1,065.00	319,500
イーブックイニシアティブジャパン	100	786.00	78,600
ネクソン	5,100	1,716.00	8,751,600
アイスタイル	200	1,305.00	261,000
エイチーム	200	1,818.00	363,600
コロブラ	1,500	2,111.00	3,166,500
モバイルクリエイティブ	200	454.00	90,800
オルトプラス	100	498.00	49,800
ブロードリーフ	600	1,206.00	723,600
ハーツユナイテッドグループ	100	1,936.00	193,600
ティーガイア	500	1,887.00	943,500

日本アジアグループ	500	474.00	237,000
豆蔵ホールディングス	300	602.00	180,600
テクマトリックス	200	1,276.00	255,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	9,300	400.00	3,720,000
GMOペイメントゲートウェイ	500	4,590.00	2,295,000
ザッパラス	400	487.00	194,800
インターネットイニシアティブ	900	2,281.00	2,052,900
GMOクラウド	100	757.00	75,700
SRAホールディングス	300	2,567.00	770,100
gumi	500	1,278.00	639,000
フェイス	200	1,401.00	280,200
ハイマックス	100	1,193.00	119,300
野村総合研究所	3,700	4,840.00	17,908,000
サイバネットシステム	700	414.00	289,800
CEホールディングス	100	979.00	97,900
インテージホールディングス	300	1,792.00	537,600
東邦システムサイエンス	100	711.00	71,100
ティー・ワイ・オー	300	203.00	60,900
クレスコ	300	1,997.00	599,100
フジ・メディア・ホールディングス	5,600	1,434.00	8,030,400
オービック	1,800	6,100.00	10,980,000
ジャストシステム	1,000	970.00	970,000
TDCソフトウェアエンジニアリング	200	1,341.00	268,200
ヤフー	38,000	493.00	18,734,000
トレンドマイクロ	2,600	4,720.00	12,272,000
日本オラクル	900	5,540.00	4,986,000
アルファシステムズ	200	2,077.00	415,400
フューチャーアーキテクト	700	684.00	478,800
CAC Holdings	400	998.00	399,200
ソフトバンク・テクノロジー	200	1,241.00	248,200
トーセ	200	824.00	164,800
オービックビジネスコンサルタント	300	7,440.00	2,232,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,200	2,587.00	3,104,400
アイティフォー	800	528.00	422,400
東計電算	100	2,230.00	223,000
エクスネット	100	1,524.00	152,400

大塚商会	1,400	5,750.00	8,050,000
サイボウズ	1,200	318.00	381,600
ソフトブレーン	1,200	176.00	211,200
電通国際情報サービス	300	1,788.00	536,400
E Mシステムズ	100	2,165.00	216,500
ウェザーニューズ	200	4,065.00	813,000
C I J	800	499.00	399,200
日本エンタープライズ	300	257.00	77,100
WOWOW	300	3,300.00	990,000
フュージョンパートナー	200	546.00	109,200
日本コロムビア	300	517.00	155,100
イマジカ・ロボット ホールディングス	300	504.00	151,200
ネットワンシステムズ	2,300	725.00	1,667,500
アルゴグラフィックス	200	1,822.00	364,400
マーベラス	900	986.00	887,400
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,000	1,500.00	1,500,000
日本ユニシス	1,500	1,385.00	2,077,500
兼松エレクトロニクス	300	1,930.00	579,000
東京放送ホールディングス	3,200	1,788.00	5,721,600
日本テレビホールディングス	4,800	2,188.00	10,502,400
朝日放送	600	831.00	498,600
テレビ朝日ホールディングス	1,500	2,084.00	3,126,000
スカパーJ S A Tホールディングス	4,000	618.00	2,472,000
テレビ東京ホールディングス	500	2,278.00	1,139,000
日本BS放送	100	1,021.00	102,100
コネクシオ	500	1,220.00	610,000
日本通信	2,700	276.00	745,200
日本電信電話	41,100	4,813.00	197,814,300
K D D I	54,000	3,007.00	162,378,000
光通信	600	9,450.00	5,670,000
N T T ドコモ	41,000	2,494.00	102,254,000
エムティーアイ	800	786.00	628,800
G M O インターネット	1,900	1,723.00	3,273,700
カドカワ	1,700	1,585.00	2,694,500
学研ホールディングス	2,000	237.00	474,000
ゼンリン	700	1,779.00	1,245,300

昭文社	400	712.00	284,800	
インプレスホールディングス	700	164.00	114,800	
アイネット	400	1,183.00	473,200	
松竹	3,000	1,112.00	3,336,000	
東宝	3,800	3,195.00	12,141,000	
東映	2,000	1,063.00	2,126,000	
AOI Pro.	300	943.00	282,900	
エヌ・ティ・ティ・データ	3,300	5,900.00	19,470,000	
ピー・シー・エー	100	1,525.00	152,500	
ビジネスブレイン太田昭和	100	1,025.00	102,500	
D T S	600	2,796.00	1,677,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,300	3,125.00	7,187,500	
シーイーシー	500	1,053.00	526,500	
カブコン	1,300	2,630.00	3,419,000	
ジャステック	500	1,162.00	581,000	
S C S K	1,300	4,660.00	6,058,000	
日本システムウエア	400	968.00	387,200	
アイネス	700	1,058.00	740,600	
T K C	500	2,919.00	1,459,500	
富士ソフト	800	2,326.00	1,860,800	
N S D	1,100	1,715.00	1,886,500	
コナミホールディングス	2,400	2,906.00	6,974,400	
福井コンピュータホールディングス	200	949.00	189,800	
J B C Cホールディングス	500	782.00	391,000	
ミロク情報サービス	400	851.00	340,400	
ソフトバンクグループ	30,100	6,916.00	208,171,600	代用有価証券 2,700株
ハウスイ	1,000	130.00	130,000	
高千穂交易	200	1,014.00	202,800	
伊藤忠食品	100	4,180.00	418,000	
エレマテック	300	2,904.00	871,200	
J A L U X	200	2,543.00	508,600	
あらた	200	2,676.00	535,200	
トーメンデバイス	100	2,021.00	202,100	
東京エレクトロン デバイス	100	1,606.00	160,600	
フィールズ	300	1,995.00	598,500	

双日	33,600	279.00	9,374,400	
アルフレッサ ホールディングス	6,700	2,391.00	16,019,700	
横浜冷凍	1,400	985.00	1,379,000	
神栄	1,000	138.00	138,000	
ラサ商事	300	611.00	183,300	
アルコニックス	300	1,694.00	508,200	
神戸物産	400	4,880.00	1,952,000	
あい ホールディングス	900	3,015.00	2,713,500	
ダイワボウホールディングス	5,000	256.00	1,280,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	1,000	1,513.00	1,513,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	900	931.00	837,900	
八洲電機	400	587.00	234,800	
U K C ホールディングス	300	2,675.00	802,500	
O C H I ホールディングス	100	1,039.00	103,900	
T O K A I ホールディングス	2,600	536.00	1,393,600	
三洋貿易	300	1,571.00	471,300	
ミタチ産業	100	739.00	73,900	
シップヘルスケアホールディングス	1,100	2,936.00	3,229,600	
明治電機工業	200	1,200.00	240,000	
デリカフーズ	100	1,021.00	102,100	
富士興産	200	497.00	99,400	
協栄産業	1,000	176.00	176,000	
小野建	500	1,084.00	542,000	
佐鳥電機	400	867.00	346,800	
エコートレーディング	100	640.00	64,000	
伯東	400	1,390.00	556,000	
コンドーテック	200	777.00	155,400	
中山福	400	878.00	351,200	
ナガイレーベン	700	2,163.00	1,514,100	
三菱食品	600	3,025.00	1,815,000	
松田産業	400	1,425.00	570,000	
メディバルホールディングス	5,300	2,195.00	11,633,500	
アドヴァン	500	1,103.00	551,500	
S P K	100	2,332.00	233,200	
萩原電気	100	1,995.00	199,500	
アズワン	400	4,400.00	1,760,000	

尾家産業	200	898.00	179,600	
シモジマ	400	1,112.00	444,800	
ドウシシャ	600	2,337.00	1,402,200	
小津産業	100	2,151.00	215,100	
高速	400	959.00	383,600	
たけびし	200	1,069.00	213,800	
黒田電気	1,000	2,518.00	2,518,000	
丸文	500	919.00	459,500	
ハビネット	500	1,306.00	653,000	
エクセル	300	1,664.00	499,200	
マルカキカイ	200	1,906.00	381,200	
ガリバーインターナショナル	1,400	1,258.00	1,761,200	
日本エム・ディ・エム	800	676.00	540,800	
進和	300	1,739.00	521,700	
エスケイジャパン	200	353.00	70,600	
ダイトエレクトロン	300	862.00	258,600	
シークス	300	3,440.00	1,032,000	
田中商事	200	713.00	142,600	
オーハシテクニカ	300	1,450.00	435,000	
白銅	300	1,395.00	418,500	
伊藤忠商事	41,800	1,568.50	65,563,300	
丸紅	52,200	701.90	36,639,180	
高島	1,000	260.00	260,000	
長瀬産業	3,200	1,550.00	4,960,000	
蝶理	300	1,707.00	512,100	
豊田通商	5,900	2,878.00	16,980,200	
三共生興	1,100	483.00	531,300	
兼松	11,000	203.00	2,233,000	
ツカモトコーポレーション	1,000	136.00	136,000	
三井物産	48,100	1,540.50	74,098,050	
日本紙パルプ商事	3,000	342.00	1,026,000	
日立ハイテクノロジーズ	1,900	3,275.00	6,222,500	
カメイ	700	1,273.00	891,100	
東都水産	1,000	195.00	195,000	
OUGホールディングス	1,000	249.00	249,000	
スターゼン	200	3,330.00	666,000	

山善	2,000	1,118.00	2,236,000
椿本興業	1,000	333.00	333,000
住友商事	33,400	1,343.50	44,872,900
内田洋行	2,000	413.00	826,000
三菱商事	39,900	2,098.00	83,710,200
第一実業	1,000	508.00	508,000
キヤノンマーケティングジャパン	1,500	1,882.00	2,823,000
西華産業	2,000	290.00	580,000
佐藤商事	600	749.00	449,400
菱洋エレクトロ	600	1,542.00	925,200
東京産業	600	536.00	321,600
ユアサ商事	500	2,941.00	1,470,500
神鋼商事	2,000	257.00	514,000
小林産業	200	229.00	45,800
阪和興業	5,000	516.00	2,580,000
菱電商事	1,000	824.00	824,000
フルサト工業	300	1,742.00	522,600
岩谷産業	6,000	673.00	4,038,000
すてきナイスグループ	2,000	166.00	332,000
昭光通商	2,000	89.00	178,000
ニチモウ	1,000	213.00	213,000
極東貿易	1,000	257.00	257,000
イワキ	1,000	228.00	228,000
三愛石油	1,000	958.00	958,000
稲畑産業	1,300	1,419.00	1,844,700
G S Iクレオス	2,000	121.00	242,000
明和産業	500	439.00	219,500
ワキタ	1,200	977.00	1,172,400
東邦ホールディングス	1,700	2,950.00	5,015,000
サンゲツ	1,900	2,251.00	4,276,900
ミツウロコグループホールディングス	900	581.00	522,900
シナネンホールディングス	1,000	461.00	461,000
伊藤忠エネクス	1,400	978.00	1,369,200
サンリオ	1,600	2,964.00	4,742,400
サンワテクノス	400	1,060.00	424,000
リョーサン	800	3,025.00	2,420,000

新光商事	600	1,313.00	787,800
トーヨー	200	2,365.00	473,000
三信電気	700	1,433.00	1,003,100
東陽テクニカ	800	1,003.00	802,400
モスフードサービス	700	2,906.00	2,034,200
加賀電子	500	1,808.00	904,000
ソーダニッカ	600	515.00	309,000
立花エレテック	400	1,410.00	564,000
フォーバル	200	729.00	145,800
PALTA C	900	2,252.00	2,026,800
三谷産業	500	400.00	200,000
太平洋興発	2,000	90.00	180,000
ヤマタネ	3,000	185.00	555,000
日鉄住金物産	3,000	421.00	1,263,000
トラスコ中山	600	4,325.00	2,595,000
オートバックスセブン	2,000	2,246.00	4,492,000
加藤産業	800	2,999.00	2,399,200
イノテック	400	490.00	196,000
イエローハット	500	2,759.00	1,379,500
J Kホールディングス	600	504.00	302,400
日伝	200	3,030.00	606,000
北沢産業	600	207.00	124,200
杉本商事	300	1,491.00	447,300
因幡電機産業	700	3,920.00	2,744,000
バイテックホールディングス	100	1,310.00	131,000
ミスミグループ本社	6,000	1,677.00	10,062,000
アルテック	400	189.00	75,600
タキヒヨー	1,000	458.00	458,000
蔵王産業	100	1,441.00	144,100
スズケン	2,400	4,770.00	11,448,000
ジェコス	400	1,078.00	431,200
ローソン	2,000	9,070.00	18,140,000
サンエー	400	5,190.00	2,076,000
ダイユーエイト	100	829.00	82,900
カワチ薬品	400	2,304.00	921,600
エービーシー・マート	700	6,900.00	4,830,000

ハードオフコーポレーション	300	1,544.00	463,200
アスクル	500	4,500.00	2,250,000
ゲオホールディングス	1,000	1,888.00	1,888,000
アダストリア	500	7,060.00	3,530,000
くらコーポレーション	300	3,840.00	1,152,000
キャンドウ	300	1,588.00	476,400
パル	300	2,896.00	868,800
エディオン	2,300	900.00	2,070,000
サーラコーポレーション	500	626.00	313,000
ワッツ	200	894.00	178,800
あみやき亭	200	4,415.00	883,000
ひらまつ	800	667.00	533,600
大黒天物産	100	4,290.00	429,000
ハニーズ	400	1,030.00	412,000
ファーマライズホールディングス	100	598.00	59,800
アルペン	500	2,028.00	1,014,000
クオール	500	1,452.00	726,000
ジェイアイエヌ	400	4,850.00	1,940,000
ビックカメラ	2,800	1,019.00	2,853,200
D C Mホールディングス	2,600	824.00	2,142,400
MonotaRO	1,900	3,065.00	5,823,500
きちり	100	744.00	74,400
アーランドサービス	100	4,820.00	482,000
J . フロント リテイリング	6,700	2,007.00	13,446,900
ドトール・日レスホールディングス	900	1,800.00	1,620,000
マツモトキヨシホールディングス	1,100	5,450.00	5,995,000
ブロンコビリー	200	2,269.00	453,800
スタートトゥデイ	1,700	3,975.00	6,757,500
物語コーポレーション	100	5,070.00	507,000
ココカラファイン	600	4,555.00	2,733,000
三越伊勢丹ホールディングス	10,600	1,983.00	21,019,800
ウエルシアホールディングス	500	5,900.00	2,950,000
クリエイトSDホールディングス	300	7,490.00	2,247,000
丸善CHIホールディングス	200	353.00	70,600
ミサワ	100	727.00	72,700
チムニー	200	3,175.00	635,000

ジョイフル本田	800	2,342.00	1,873,600	
キリン堂ホールディングス	300	1,412.00	423,600	
すかいらーく	1,600	1,629.00	2,606,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,800	1,062.00	1,911,600	
ブックオフコーポレーション	300	920.00	276,000	
あさひ	300	1,222.00	366,600	
日本調剤	100	5,010.00	501,000	
コスモス薬品	300	15,560.00	4,668,000	
トーエル	300	640.00	192,000	
セブン&アイ・ホールディングス	22,200	5,735.00	127,317,000	
薬王堂	100	3,045.00	304,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	500	2,961.00	1,480,500	
ツルハホールディングス	1,100	9,880.00	10,868,000	
サンマルクホールディングス	400	3,700.00	1,480,000	
フェリシモ	200	1,126.00	225,200	
トリドール	600	1,821.00	1,092,600	
クスリのアオキ	400	5,810.00	2,324,000	
メディカルシステムネットワーク	100	754.00	75,400	
総合メディカル	300	4,350.00	1,305,000	
はるやま商事	400	743.00	297,200	
カッパ・クリエイト	700	1,222.00	855,400	
ライトオン	400	1,410.00	564,000	
ジーンズメイト	200	255.00	51,000	
良品計画	600	25,370.00	15,222,000	
三城ホールディングス	700	465.00	325,500	
アルピス	100	2,279.00	227,900	
コナカ	700	644.00	450,800	
ハウス オブ ローゼ	100	1,447.00	144,700	
G - 7ホールディングス	200	1,694.00	338,800	
イオン北海道	700	551.00	385,700	
コジマ	800	288.00	230,400	
ヒマラヤ	200	1,123.00	224,600	
コーナン商事	800	1,748.00	1,398,400	
エコス	300	1,759.00	527,700	
ドンキホーテホールディングス	3,400	4,665.00	15,861,000	

西松屋チェーン	1,100	1,141.00	1,255,100	
ゼンショーホールディングス	2,700	1,362.00	3,677,400	
幸楽苑ホールディングス	400	1,565.00	626,000	
ハークスレイ	200	1,380.00	276,000	
サイゼリヤ	900	2,836.00	2,552,400	
V Tホールディングス	1,800	763.00	1,373,400	
魚力	200	1,719.00	343,800	
ポプラ	200	530.00	106,000	
ユナイテッドアローズ	800	5,340.00	4,272,000	
ハイデイ日高	400	3,050.00	1,220,000	
京都きもの友禅	400	981.00	392,400	
コロワイド	1,800	1,765.00	3,177,000	
壱番屋	200	5,870.00	1,174,000	
トップカルチャー	300	481.00	144,300	
P L A N T	100	1,314.00	131,400	
スギホールディングス	1,000	5,930.00	5,930,000	
スクロール	900	434.00	390,600	
ヨンドシーホールディングス	400	2,624.00	1,049,600	
ファミリーマート	1,600	5,140.00	8,224,000	
木曽路	700	2,068.00	1,447,600	
サトレストランシステムズ	600	896.00	537,600	
千趣会	1,000	834.00	834,000	
タカキュー	600	197.00	118,200	
ケーヨー	1,000	502.00	502,000	
上新電機	1,000	995.00	995,000	
日本瓦斯	600	3,275.00	1,965,000	
ベスト電器	1,900	139.00	264,100	
ロイヤルホールディングス	900	2,234.00	2,010,600	
東天紅	1,000	167.00	167,000	
いなげや	500	1,302.00	651,000	
島忠	1,400	2,822.00	3,950,800	
チヨダ	600	3,780.00	2,268,000	
ライフコーポレーション	300	3,090.00	927,000	
リンガーハット	500	2,493.00	1,246,500	
さが美	1,000	144.00	144,000	
MrMax	600	359.00	215,400	

テンアライド	500	393.00	196,500
AOKIホールディングス	1,200	1,554.00	1,864,800
オークワ	1,000	1,056.00	1,056,000
コメリ	800	2,693.00	2,154,400
青山商事	1,000	4,535.00	4,535,000
しまむら	600	13,510.00	8,106,000
はせがわ	200	481.00	96,200
高島屋	8,000	1,124.00	8,992,000
松屋	1,100	1,521.00	1,673,100
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,700	2,510.00	6,777,000
近鉄百貨店	2,000	340.00	680,000
丸栄	1,000	114.00	114,000
ニッセンホールディングス	1,200	186.00	223,200
パルコ	500	1,083.00	541,500
丸井グループ	6,500	1,720.00	11,180,000
アクシアル リテイリング	400	4,675.00	1,870,000
イオン	21,800	1,822.00	39,719,600
ユニーグループ・ホールディングス	5,000	696.00	3,480,000
イズミ	1,100	4,620.00	5,082,000
東武ストア	1,000	305.00	305,000
平和堂	1,100	2,789.00	3,067,900
フジ	600	2,633.00	1,579,800
ヤオコー	600	5,400.00	3,240,000
ゼビオホールディングス	700	2,206.00	1,544,200
ケーズホールディングス	1,100	4,465.00	4,911,500
Olympicグループ	400	619.00	247,600
日産東京販売ホールディングス	800	336.00	268,800
アインホールディングス	600	5,710.00	3,426,000
元気寿司	200	2,362.00	472,400
ヤマダ電機	16,200	576.00	9,331,200
アークランドサカモト	500	2,637.00	1,318,500
ニトリホールディングス	2,300	9,750.00	22,425,000
愛眼	500	248.00	124,000
ケーユーホールディングス	200	828.00	165,600
吉野家ホールディングス	2,000	1,496.00	2,992,000
松屋フーズ	200	2,485.00	497,000

サガミチェーン	700	1,307.00	914,900	
関西スーパーマーケット	300	834.00	250,200	
王将フードサービス	400	4,190.00	1,676,000	
プレナス	600	1,972.00	1,183,200	
ミニストップ	400	2,256.00	902,400	
アークス	1,000	2,493.00	2,493,000	
パローホールディングス	1,100	2,641.00	2,905,100	
ベルク	300	4,600.00	1,380,000	
大庄	300	1,468.00	440,400	
ファーストリテイリング	1,100	46,720.00	51,392,000	
サンドラッグ	1,100	6,860.00	7,546,000	
サックスパー ホールディングス	500	1,805.00	902,500	
ヤマザワ	200	1,710.00	342,000	
やまや	100	2,505.00	250,500	
ペルーナ	1,300	687.00	893,100	
島根銀行	100	1,435.00	143,500	
じもとホールディングス	3,900	212.00	826,800	
足利ホールディングス	3,900	494.00	1,926,600	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	700	4,070.00	2,849,000	
九州フィナンシャルグループ	8,200	915.00	7,503,000	
新生銀行	46,000	247.00	11,362,000	
あおぞら銀行	34,000	445.00	15,130,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	426,600	822.20	350,750,520	代用有価証券 21,400株
りそなホールディングス	62,000	659.30	40,876,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	111,000	501.90	55,710,900	
三井住友フィナンシャルグループ	42,600	5,118.00	218,026,800	代用有価証券 3,500株
第四銀行	7,000	563.00	3,941,000	
北越銀行	6,000	256.00	1,536,000	
西日本シティ銀行	17,000	341.00	5,797,000	
千葉銀行	20,000	880.00	17,600,000	
横浜銀行	36,000	755.20	27,187,200	
常陽銀行	19,000	592.00	11,248,000	
群馬銀行	12,000	771.00	9,252,000	
武蔵野銀行	800	4,725.00	3,780,000	
千葉興業銀行	1,500	751.00	1,126,500	

筑波銀行	2,200	431.00	948,200	
七十七銀行	8,000	656.00	5,248,000	
青森銀行	4,000	397.00	1,588,000	
秋田銀行	3,000	400.00	1,200,000	
山形銀行	3,000	489.00	1,467,000	
岩手銀行	400	5,540.00	2,216,000	
東邦銀行	5,000	456.00	2,280,000	
東北銀行	3,000	153.00	459,000	
みちのく銀行	3,000	212.00	636,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	23,000	643.00	14,789,000	
静岡銀行	16,000	1,237.00	19,792,000	
十六銀行	7,000	533.00	3,731,000	
スルガ銀行	5,600	2,396.00	13,417,600	
八十二銀行	10,000	817.00	8,170,000	
山梨中央銀行	3,000	584.00	1,752,000	
大垣共立銀行	7,000	486.00	3,402,000	
福井銀行	5,000	255.00	1,275,000	
北國銀行	6,000	422.00	2,532,000	
清水銀行	200	3,080.00	616,000	
滋賀銀行	5,000	668.00	3,340,000	
南都銀行	5,000	391.00	1,955,000	
百五銀行	5,000	614.00	3,070,000	
京都銀行	10,000	1,251.00	12,510,000	
紀陽銀行	2,100	1,861.00	3,908,100	
三重銀行	2,000	267.00	534,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	36,000	270.00	9,720,000	
広島銀行	16,000	679.00	10,864,000	
山陰合同銀行	3,300	1,116.00	3,682,800	
中国銀行	3,800	1,734.00	6,589,200	
鳥取銀行	2,000	214.00	428,000	
伊予銀行	5,700	1,272.00	7,250,400	
百十四銀行	6,000	460.00	2,760,000	
四国銀行	4,000	261.00	1,044,000	
阿波銀行	4,000	677.00	2,708,000	
大分銀行	3,000	513.00	1,539,000	
宮崎銀行	4,000	443.00	1,772,000	

佐賀銀行	3,000	279.00	837,000	
十八銀行	3,000	391.00	1,173,000	
沖縄銀行	400	4,865.00	1,946,000	
琉球銀行	1,100	1,746.00	1,920,600	
セブン銀行	20,000	556.00	11,120,000	
みずほフィナンシャルグループ	748,700	256.60	192,116,420	代用有価証券 71,500株
高知銀行	2,000	151.00	302,000	
山口フィナンシャルグループ	5,000	1,484.00	7,420,000	
長野銀行	2,000	204.00	408,000	
名古屋銀行	4,000	457.00	1,828,000	
北洋銀行	8,000	472.00	3,776,000	
愛知銀行	200	6,900.00	1,380,000	
第三銀行	3,000	182.00	546,000	
中京銀行	2,000	245.00	490,000	
東日本銀行	3,000	414.00	1,242,000	
大光銀行	2,000	239.00	478,000	
愛媛銀行	3,000	250.00	750,000	
トマト銀行	2,000	173.00	346,000	
みなと銀行	5,000	211.00	1,055,000	
京葉銀行	4,000	595.00	2,380,000	
関西アーバン銀行	800	1,399.00	1,119,200	
栃木銀行	3,000	707.00	2,121,000	
北日本銀行	200	3,355.00	671,000	
東和銀行	7,000	112.00	784,000	
福島銀行	6,000	96.00	576,000	
大東銀行	3,000	196.00	588,000	
トモニホールディングス	4,100	475.00	1,947,500	
フィデアホールディングス	3,200	268.00	857,600	
池田泉州ホールディングス	5,800	525.00	3,045,000	
F P G	1,600	866.00	1,385,600	
S B Iホールディングス	6,400	1,413.00	9,043,200	
ジャフコ	900	4,735.00	4,261,500	
大和証券グループ本社	50,000	869.40	43,470,000	
野村ホールディングス	102,300	799.50	81,788,850	
岡三証券グループ	4,000	741.00	2,964,000	

丸三証券	1,600	1,195.00	1,912,000	
東洋証券	2,000	405.00	810,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	6,000	768.00	4,608,000	
光世証券	1,000	190.00	190,000	
水戸証券	1,600	440.00	704,000	
いちよし証券	1,200	1,138.00	1,365,600	
松井証券	2,800	1,116.00	3,124,800	
だいこう証券ビジネス	400	1,120.00	448,000	
マネックスグループ	6,300	359.00	2,261,700	
カブドットコム証券	4,800	404.00	1,939,200	
極東証券	700	1,621.00	1,134,700	
岩井コスモホールディングス	500	1,404.00	702,000	
藍澤証券	700	737.00	515,900	
マネースクウェアHD	100	1,629.00	162,900	
マネーパートナーズグループ	400	433.00	173,200	
小林洋行	200	265.00	53,000	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	11,800	4,030.00	47,554,000	
アニコム ホールディングス	400	2,925.00	1,170,000	
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	15,900	3,815.00	60,658,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	5,100	2,251.00	11,480,100	
第一生命保険	34,100	2,342.50	79,879,250	
東京海上ホールディングス	21,500	4,964.00	106,726,000	
T & Dホールディングス	19,400	1,795.00	34,823,000	
全国保証	1,400	4,250.00	5,950,000	
クレディセゾン	4,000	2,465.00	9,860,000	
芙蓉総合リース	600	6,110.00	3,666,000	
興銀リース	1,000	2,812.00	2,812,000	
東京センチュリーリース	1,300	4,375.00	5,687,500	
日本証券金融	2,300	666.00	1,531,800	
アイフル	8,800	468.00	4,118,400	
ポケットカード	600	603.00	361,800	
リコーリース	400	3,775.00	1,510,000	
イオンフィナンシャルサービス	3,500	2,996.00	10,486,000	
アコム	10,700	617.00	6,601,900	
ジャックス	3,000	497.00	1,491,000	

オリエントコーポレーション	23,100	240.00	5,544,000	
日立キャピタル	1,300	3,515.00	4,569,500	
アプラスフィナンシャル	2,700	121.00	326,700	
オリックス	37,700	1,841.50	69,424,550	
三菱UFJリース	13,600	663.00	9,016,800	
日本取引所グループ	15,600	1,949.00	30,404,400	
イー・ギャランティ	200	2,418.00	483,600	
アサックス	100	1,617.00	161,700	
NECキャピタルソリューション	200	1,758.00	351,600	
日本駐車場開発	5,900	144.00	849,600	
ヒューリック	11,000	1,063.00	11,693,000	
三栄建築設計	100	1,350.00	135,000	
野村不動産ホールディングス	3,500	2,426.00	8,491,000	
三重交通グループホールディングス	1,000	468.00	468,000	
ディア・ライフ	300	420.00	126,000	
プレサンスコーポレーション	200	4,210.00	842,000	
ユニゾホールディングス	300	4,865.00	1,459,500	
フージャースホールディングス	800	462.00	369,600	
オープンハウス	800	2,001.00	1,600,800	
東急不動産ホールディングス	13,000	811.00	10,543,000	
飯田グループホールディングス	5,000	2,326.00	11,630,000	
パーク24	2,700	2,469.00	6,666,300	
三井不動産	28,000	3,127.00	87,556,000	
三菱地所	40,000	2,546.00	101,840,000	
平和不動産	1,000	1,500.00	1,500,000	
東京建物	5,900	1,460.00	8,614,000	
ダイビル	1,400	1,048.00	1,467,200	
京阪神ビルディング	900	697.00	627,300	
住友不動産	13,000	3,747.00	48,711,000	
大京	10,000	206.00	2,060,000	
テーオーシー	2,100	928.00	1,948,800	
東京楽天地	1,000	504.00	504,000	
レオパレス21	6,200	693.00	4,296,600	
スターツコーポレーション	600	1,903.00	1,141,800	
フジ住宅	700	731.00	511,700	
空港施設	700	566.00	396,200	

明和地所	400	539.00	215,600
住友不動産販売	400	2,768.00	1,107,200
ゴールドクレスト	400	2,248.00	899,200
日本エスリード	300	1,158.00	347,400
日神不動産	800	436.00	348,800
タカラレーベン	2,300	615.00	1,414,500
サンヨーハウジング名古屋	300	1,164.00	349,200
イオンモール	3,500	1,984.00	6,944,000
ファースト住建	100	1,273.00	127,300
トーセイ	800	744.00	595,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	3,300	1,195.00	3,943,500
サンフロンティア不動産	600	916.00	549,600
エフ・ジェー・ネクスト	200	507.00	101,400
ランドビジネス	400	361.00	144,400
グランディハウス	400	416.00	166,400
日本空港ビルデング	1,700	6,790.00	11,543,000
日本工営	2,000	495.00	990,000
ネクスト	1,600	840.00	1,344,000
ジェイエシーリクルートメント	300	804.00	241,200
日本M&Aセンター	900	4,890.00	4,401,000
ノバレーゼ	100	916.00	91,600
アコーディア・ゴルフ	1,500	1,104.00	1,656,000
タケエイ	500	1,001.00	500,500
トラスト・テック	100	2,378.00	237,800
パソナグループ	500	911.00	455,500
CDS	100	960.00	96,000
リンクアンドモチベーション	900	134.00	120,600
GCAサヴィアン	500	1,394.00	697,000
エス・エム・エス	700	2,113.00	1,479,100
テンプホールディングス	3,600	1,923.00	6,922,800
リニカル	100	1,741.00	174,100
クックパッド	1,300	2,246.00	2,919,800
エスクリ	100	918.00	91,800
アイ・ケイ・ケイ	200	553.00	110,600
学情	400	1,012.00	404,800
スタジオアリス	200	2,252.00	450,400

シミックホールディングス	200	1,711.00	342,200	
N J S	100	1,463.00	146,300	
総合警備保障	1,900	5,740.00	10,906,000	
カカクコム	4,100	2,189.00	8,974,900	
ルネサンス	400	1,328.00	531,200	
ディップ	600	2,450.00	1,470,000	
オプトホールディング	200	662.00	132,400	
新日本科学	500	619.00	309,500	
ツクイ	700	1,372.00	960,400	
総合臨床ホールディングス	100	478.00	47,800	
キャリアデザインセンター	100	1,190.00	119,000	
エムスリー	4,900	2,359.00	11,559,100	
ツカダ・グローバルホールディング	100	787.00	78,700	
アウトソーシング	300	2,800.00	840,000	
ウェルネット	200	2,598.00	519,600	
ディー・エヌ・エー	2,500	1,916.00	4,790,000	
博報堂D Yホールディングス	7,800	1,308.00	10,202,400	
ぐるなび	700	2,284.00	1,598,800	
エスアールジータカミヤ	400	559.00	223,600	
一休	400	2,235.00	894,000	
ファンコミュニケーションズ	1,300	861.00	1,119,300	
ジェイコムホールディングス	100	1,263.00	126,300	
W D Bホールディングス	100	1,256.00	125,600	
ティア	100	744.00	74,400	
バリューコマース	400	526.00	210,400	
J Pホールディングス	1,400	320.00	448,000	
E P Sホールディングス	500	1,236.00	618,000	
レッグス	100	755.00	75,500	
プレステージ・インターナショナル	500	1,167.00	583,500	
アミューズ	200	4,840.00	968,000	
ドリームインキュベータ	200	2,033.00	406,600	
T A C	300	231.00	69,300	
ケネディクス	7,200	438.00	3,153,600	
電通	6,300	6,950.00	43,785,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	300	686.00	205,800	
ぴあ	200	2,211.00	442,200	

イオンファンタジー	200	2,094.00	418,800
シーティーエス	100	794.00	79,400
みらかホールディングス	1,400	5,250.00	7,350,000
アルプス技研	200	2,286.00	457,200
サニックス	900	281.00	252,900
ダイオーズ	200	1,228.00	245,600
オリエンタルランド	6,100	7,569.00	46,170,900
ダスキン	1,600	2,100.00	3,360,000
明光ネットワークジャパン	600	1,461.00	876,600
ファルコホールディングス	300	1,473.00	441,900
秀英予備校	100	613.00	61,300
田谷	100	699.00	69,900
ラウンドワン	1,700	562.00	955,400
リゾートトラスト	2,400	3,250.00	7,800,000
ビー・エム・エル	300	3,725.00	1,117,500
ワタベウェディング	100	498.00	49,800
りらいあコミュニケーションズ	900	1,122.00	1,009,800
リソー教育	700	303.00	212,100
早稲田アカデミー	100	842.00	84,200
ユー・エス・エス	6,800	2,200.00	14,960,000
東京個別指導学院	600	606.00	363,600
サイバーエージェント	1,400	4,590.00	6,426,000
楽天	26,200	1,570.00	41,134,000
セントラルスポーツ	200	2,289.00	457,800
リゾートソリューション	1,000	303.00	303,000
テクノプロ・ホールディングス	800	3,515.00	2,812,000
リブセンス	300	412.00	123,600
ジャパンマテリアル	100	2,013.00	201,300
ベクトル	100	1,722.00	172,200
キャリアリンク	100	1,679.00	167,900
アサンテ	100	1,525.00	152,500
N・フィールド	100	1,418.00	141,800
E R Iホールディングス	100	860.00	86,000
アピスト	100	1,626.00	162,600
リクルートホールディングス	11,300	3,895.00	44,013,500
リロ・ホールディング	200	12,980.00	2,596,000

東祥	200	3,075.00	615,000	
エイチ・アイ・エス	900	4,085.00	3,676,500	
共立メンテナンス	400	8,260.00	3,304,000	
イチネンホールディングス	600	1,107.00	664,200	
建設技術研究所	300	1,227.00	368,100	
スペース	400	1,369.00	547,600	
燦ホールディングス	100	1,564.00	156,400	
スバル興業	1,000	425.00	425,000	
東京テアトル	2,000	134.00	268,000	
よみうりランド	1,000	434.00	434,000	
東京都競馬	4,000	288.00	1,152,000	
常磐興産	2,000	152.00	304,000	
カナモト	800	2,609.00	2,087,200	
東京ドーム	5,000	569.00	2,845,000	
西尾レントオール	500	2,922.00	1,461,000	
トランス・コスモス	700	3,275.00	2,292,500	
乃村工藝社	1,200	1,695.00	2,034,000	
藤田観光	2,000	475.00	950,000	
KNT-CTホールディングス	3,000	282.00	846,000	
日本管財	500	1,882.00	941,000	
トーカイ	200	4,010.00	802,000	
白洋舎	1,000	276.00	276,000	
セコム	5,800	8,150.00	47,270,000	
セントラル警備保障	300	1,602.00	480,600	
丹青社	1,000	917.00	917,000	
メイテック	700	4,175.00	2,922,500	
アサツー ディ・ケイ	1,000	3,060.00	3,060,000	
応用地質	600	1,471.00	882,600	
船井総研ホールディングス	700	1,953.00	1,367,100	
進学会	400	746.00	298,400	
オオバ	300	495.00	148,500	
ベネッセホールディングス	1,900	3,280.00	6,232,000	
イオンディライト	500	3,620.00	1,810,000	
ナック	400	839.00	335,600	
ニチイ学館	1,000	902.00	902,000	
ダイセキ	1,100	2,000.00	2,200,000	

ステップ	200	1,056.00	211,200	
合 計	8,870,200		12,617,119,730	

(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2015年11月30日現在です。

【インデックスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	12,508,371,663円
負債総額	28,626,833円
純資産総額（ - ）	12,479,744,830円
発行済口数	19,010,983,909口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6564円

【バランスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	317,048,018円
負債総額	302,216円
純資産総額（ - ）	316,745,802円
発行済口数	342,045,021口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9260円

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	12,649,658,748円
負債総額	10,619,562円
純資産総額（ - ）	12,639,039,186円
発行済口数	8,512,375,915口
1口当たり純資産額（ / ）	1.485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27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27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27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. 運用状況の評価・分析および運用リスク管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成27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	603	117,025

株式投資信託	548	91,804
単位型	105	2,988
追加型	443	88,815
公社債投資信託	55	25,221
単位型	39	383
追加型	16	24,837
投資法人合計	1	11

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成26年4月1日から平成27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57期中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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55期 (平成26年3月31日)		第56期 (平成27年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	17,805	3	14,206
有価証券		234		277
前払費用	3	419	3	509
未収入金		37		3
未収委託者報酬		7,162		8,441
未収収益	3	608	3	1,566
関係会社短期貸付金		240		436
立替金		303		666
繰延税金資産		984		1,446
その他	2	30	2	195
流動資産合計		27,826		27,750
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	47	1	56
器具備品	1	134	1	166
有形固定資産合計		181		222
無形固定資産				

ソフトウェア	91	113
無形固定資産合計	91	113
投資その他の資産		
投資有価証券	7,290	14,184
関係会社株式	21,702	21,702
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	692	740
長期前払費用	-	0
繰延税金資産	525	248
投資その他の資産合計	30,271	36,936
固定資産合計	30,544	37,273
資産合計	58,371	65,023

(単位：百万円)

	第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	329	387
未払金	3,404	5,545
未払収益分配金	6	6
未払償還金	112	112
未払手数料	3 2,743	3 3,145
その他未払金	542	2,282
未払費用	3 3,239	3 4,636
未払法人税等	2,286	814
未払消費税等	4 356	4 1,070
賞与引当金	1,935	1,990
役員賞与引当金	150	120
その他	-	3 82
流動負債合計	11,702	14,646
固定負債		
退職給付引当金	1,081	1,111
その他	55	-
固定負債合計	1,137	1,111
負債合計	12,840	15,758
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	22,694	25,836
利益剰余金合計	22,694	25,836

自己株式	68	68
株主資本合計	45,209	48,351
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	321	1,002
繰延ヘッジ損益	-	88
評価・換算差額等合計	321	913
純資産合計	45,531	49,265
負債純資産合計	58,371	65,023

(2)【損益計算書】

	(単位:百万円)	
	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,120	63,990
その他営業収益	2,557	3,729
営業収益合計	65,678	67,719
営業費用		
支払手数料	31,207	30,408
広告宣伝費	1,081	1,045
公告費	2	5
調査費	13,405	15,571
調査費	712	747
委託調査費	12,669	14,782
図書費	23	41
委託計算費	465	502
営業雑経費	558	660
通信費	186	199
印刷費	252	263
協会費	43	64
諸会費	11	27
その他	65	106
営業費用計	46,721	48,193
一般管理費		
給料	7,171	7,585
役員報酬	316	289
役員賞与引当金繰入額	150	120
給料・手当	4,719	5,127
賞与	50	59
賞与引当金繰入額	1,935	1,990
交際費	108	163
寄付金	54	36
旅費交通費	448	503
租税公課	209	208
不動産賃借料	755	785
退職給付費用	313	349
退職金	32	16
固定資産減価償却費	109	148
福利費	847	908

諸経費	2,517	2,673
一般管理費計	12,568	13,380
営業利益	6,388	6,146

(単位：百万円)

	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		17		10
受取配当金	1	1,774	1	1,152
有価証券償還益		-		13
時効成立分配金・償還金		4		1
為替差益		26		-
その他		19		107
営業外収益合計		1,842		1,285
営業外費用				
支払利息		19		28
有価証券償還損		-		81
デリバティブ費用		-		269
時効成立後支払分配金・償還金		22		295
支払源泉所得税		57		71
為替差損		-		26
その他		13		21
営業外費用合計		114		795
経常利益		8,116		6,636
特別利益				
投資有価証券売却益		135		270
特別利益合計		135		270
特別損失				
投資有価証券売却損		12		22
関係会社株式評価損		4,500		-
固定資産処分損		0		0
割増退職金		59		243
役員退職一時金		235		-
外国税関連費用		-	2	1,650
特別損失合計		4,807		1,916
税引前当期純利益		3,445		4,991
法人税、住民税及び事業税		3,020		2,356
法人税等調整額		119		466
法人税等合計		2,900		1,890
当期純利益		544		3,101

(3) 【株主資本等変動計算書】

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
会計方針の変更による累積的影響額							-
会計方針の変更を反映した当期首残高	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
会計方針の変更による累積的影響額		-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	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

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27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	22,694	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

当期変動額							
当期純利益				3,101	3,101		3,101
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)							
当期変動額合計	-	-	-	3,101	3,101	-	3,101
当期末残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	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
当期変動額				
当期純利益				3,101
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	680	88	591	591
当期変動額合計	680	88	591	3,692
当期末残高	1,002	88	913	49,265

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法 (2) デリバティブ 時価法
2 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。

<p>4 ヘッジ会計の方法</p> <p>5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</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。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 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> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>
--	--

（会計方針の変更）

<p style="text-align: center;">第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)</p> <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事業年度より適用し、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するとともに、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。</p> <p>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い、当事業年度の期首において、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。</p> <p>この結果、当事業年度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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期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株当たり当期純利益金額に対する影響額は、軽微であります。</p>

（表示方法の変更）

<p style="text-align: center;">第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)</p>
--

(損益計算書関係)

前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「福利費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた3,364百万円は、「福利費」847百万円、「諸経費」2,517百万円として組み替えております。

(貸借対照表関係)

第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27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 1,091百万円</p> <p>器具備品 625百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,122百万円</p> <p>器具備品 679百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他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>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</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>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 4,256百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 110百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 108百万円</p> <p>未払費用 500百万円</p> <p>その他 57百万円</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>	<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27百万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842百万円に対して保証を行っております。</p>

(損益計算書関係)

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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 1,290百万円</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 719百万円</p> <p>2 外国税関連費用1,650百万円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成21年11月17日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算したものであります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株マザーファンド」及び「中国A株CSI300インデックスマザーファンド」の2ファンドであり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社が負担しております。</p>
--	--

(株主資本等変動計算書関係)

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。

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27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	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	-	359,700	5,029,200	-
合計		28,124,300	-	3,314,900	24,809,400	-

(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、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。なお、当該新株予約権は平成27年2月8日に失効いたしました。

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株及び平成23年度ストックオプション(1)4,075,500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

該当事項はありません。

- (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27年5月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	850	4.32	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(リース取引関係)

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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 751百万円	1年内 841百万円
1年超 77百万円	1年超 3,420百万円
合計 828百万円	合計 4,261百万円

(金融商品関係)

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成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ん。

（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 その他有価証券	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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成27年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,206	14,206	-
(2) 未収委託者報酬	8,441	8,441	-
(3) 未収収益	1,566	1,566	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,431	14,431	-
(5) 未払金	(5,545)	(5,545)	-
(6) 未払費用	(4,636)	(4,636)	-
(7) デリバティブ取引(2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(25)	(25)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(57)	(57)	-
デリバティブ取引計	(82)	(82)	-

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(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。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上、流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額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 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	14,206	-	-	-
未収委託者報酬	8,441	-	-	-
未収収益	1,566	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	277	1,219	3,205	1,232
合計	24,492	1,219	3,205	1,232

(有価証券関係)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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	12,839	11,293	1,546
	小計	12,839	11,293	1,546
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	1,591	1,656	64
	小計	1,591	1,656	64
合計		14,431	12,949	1,482

(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 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。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	3,661	270	22
合計	3,661	270	22

（デリバティブ取引関係）

第55期(平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(平成27年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,337	-	25	25
	買建	-	-	-	-
合計		2,337	-	25	25

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理方	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価	2,586	-	68

法	豪ドル	証券	276	-	8
	シンガポールドル		878	-	4
	ユーロ		219	-	1
合計			3,961	-	57

(注) 1時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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	3,065	(1) 関連会社に対する投資の金額	3,078
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	7,660	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,396
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,379	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,720

(退職給付関係)

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

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,101
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
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
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
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。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,174
会計方針の変更による累積的影響額	63
会計方針の変更を反映した期首残高	1,110
勤務費用	126
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	47
退職給付の支払額	59
退職給付債務の期末残高	1,233

(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	1,233
未積立退職給付債務	1,233
未認識数理計算上の差異	121
貸借対照表に計上された負債の額	1,111

退職給付引当金	1,111
貸借対照表に計上された負債の額	1,111

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	126
利息費用	7
数理計算上の差異の費用処理額	18
確定給付制度に係る退職給付費用	152

(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 0.6%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、196百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

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	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 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

	平成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	15,902,700	1,567,500
付与	0	0
失効	0	0
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	5,388,900
付与	0	0
失効	0	359,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,029,200
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55期 (平成26年 3 月31日)	第56期 (平成27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	689	賞与引当金	658
その他	294	その他	813
小計	984	小計	1,472
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	148	投資有価証券評価損	134
関係会社株式評価損	1,665	関係会社株式評価損	1,510
退職給付引当金	385	退職給付引当金	360
固定資産減価償却費	158	固定資産減価償却費	133
その他	34	その他	73
小計	2,391	小計	2,213
繰延税金資産小計	3,375	繰延税金資産小計	3,685
評価性引当金	1,665	評価性引当金	1,510
繰延税金資産合計	1,710	繰延税金資産合計	2,174
繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(流動)	
その他有価証券評価差額金	200	その他有価証券評価差額金	25
繰延税金負債合計	200	小計	25
繰延税金資産の純額	1,510	繰延税金負債(固定)	
		その他有価証券評価差額金	454
		小計	454
		繰延税金負債合計	480
		繰延税金資産の純額	1,694
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	38.0%	法定実効税率	35.6%
(調整)		(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	1.3%
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	4.3%
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	3.6%
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	1.7%
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	37.9%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	84.2%		

<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>	<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27年法律第9号)の施行に伴い平成26年4月1日に開始する事業年度から、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.1%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.3%となります。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135百万円、繰延ヘッジ損益が4百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が48百万円、法人税等調整額が179百万円、それぞれ増加しております。</p>
--	--

(関連当事者情報)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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 ドル貨 建) (注1)	184 (千 SGD 2,059) (注2)	関係 会社 短期 貸付 金	436 (千 SGD 5,000)
							貸付金 利息 (シンガ ポール ドル貨 建) (注1)	7 (千 SGD 92)	未収 収益	7 (千 SGD 82)

(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184百万円(2,059千 SGD)の内訳は、貸付424百万円(5,000千 SGD)及び返済240百万円(2,940千 SGD)であります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）
三井住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成26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	23,832百万円
負債合計	6,549百万円
純資産合計	17,283百万円
営業収益	15,406百万円
税引前当期純利益	4,977百万円
当期純利益	3,441百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

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。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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場合、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場合、記載しておりません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	231円23銭	250円20銭
1株当たり当期純利益金額	2円76銭	15円74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55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(百万円)	544	3,101
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)	544	3,101
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) 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	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) 5,029,200株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	45,531	49,265
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）	45,531	49,265
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57期中間会計期間 (平成27年9月30日)		
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		13,390
金銭の信託		99
有価証券		87
未収委託者報酬		7,326
未収収益		1,121
関係会社短期貸付金		5,925
繰延税金資産		436
その他	2	2,325
流動資産合計		30,712
固定資産		
有形固定資産	1	364
無形固定資産		122
投資その他の資産		
投資有価証券		13,748
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		775
繰延税金資産		546
その他		0
投資その他の資産合計		36,834
固定資産合計		37,321
資産合計		68,033

(単位：百万円)

第57期中間会計期間 (平成27年9月30日)		
負債の部		
流動負債		
未払金		4,051

未払費用		4,163
未払法人税等		52
未払消費税等	3	457
関係会社短期借入金		5,997
賞与引当金		976
役員賞与引当金		115
その他		708
流動負債合計		16,521
固定負債		
退職給付引当金		1,130
固定負債合計		1,130
負債合計		17,652
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		28,043
利益剰余金合計		28,043
自己株式		502
株主資本合計		50,124
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		310
繰延ヘッジ損益		53
評価・換算差額等合計		257
純資産合計		50,381
負債純資産合計		68,033

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第57期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		33,707
その他営業収益		1,944
営業収益合計		35,652
営業費用及び一般管理費	1	32,417
営業利益		3,235
営業外収益	2	2,115
営業外費用	3	1,200
経常利益		4,150
特別利益	4	504

特別損失	5	510
税引前中間純利益		4,145
法人税、住民税及び事業税		60
法人税等調整額		1,026
中間純利益		3,058

(3) 中間株主資本等変動計算書

第57期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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	25,836	25,836	68	48,351
当中間期変動額							
剰余金の配当				850	850		850
中間純利益				3,058	3,058		3,058
自己株式の取得						434	434
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				2,207	2,207	434	1,772
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	28,043	28,043	502	50,124

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有 価証券評 価差額金	繰延 ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,002	88	913	49,265
当中間期変動額				
剰余金の配当				850
中間純利益				3,058
自己株式の取得				434
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	692	35	656	656
当中間期変動額合計	692	35	656	1,116
当中間期末残高	310	53	257	50,381

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法

	<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) 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>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p> <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 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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いません。</p>

(会計方針の変更)

第57期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日)

（企業結合に関する会計基準等の適用）

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。）及び「事業分離等に関する会計基準」（企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。）等を当中間会計期間から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更しております。また、当中間会計期間の期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する中間会計期間の中間財務諸表に反映させる方法に変更しております。

企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58 - 2項（4）及び事業分離等会計基準第57 - 4項（4）に定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

（中間貸借対照表関係）

第57期中間会計期間 (平成27年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,748百万円
2	信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
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6百万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779百万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57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	

1	減価償却実施額	
	有形固定資産	59百万円
	無形固定資産	22百万円
2	営業外収益のうち主要なもの	
	受取利息	25百万円
	受取配当金	1,271百万円
	デリバティブ収益	816百万円
3	営業外費用のうち主要なもの	
	支払利息	63百万円
	デリバティブ費用	907百万円
	支払源泉所得税	119百万円
4	特別利益のうち主要なもの	
	投資有価証券売却益	504百万円
5	特別損失のうち主要なもの	
	特別賞与	348百万円
	割増退職金	91百万円
	役員退職一時金	64百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第57期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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	704,500	-	814,100

（注）自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	15,902,700	-	10,282,800	5,619,900	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,567,500	-	587,400	980,100	-
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	-	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	5,029,200	-	290,400	4,738,800	-
合計		24,809,400	-	13,470,600	11,338,800	-

（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)、平成22年度ストックオプション(1)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 平成21年度ストックオプション(1)5,619,900株、平成21年度ストックオプション(2)980,100株及び平成23年度ストックオプション(1)4,075,500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

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27年5月25日 取締役会	普通株式	850	4.32	平成27年3月31日	平成27年6月30日

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27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	853百万円
1年超	3,047百万円
合計	3,900百万円

(金融商品関係)

第57期中間会計期間(平成27年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	13,390	13,390	-
(2) 未収委託者報酬	7,326	7,326	-
(3) 未収収益	1,121	1,121	-
(4) 金銭の信託	99	99	-
(5) 関係会社短期貸付金	5,925	5,925	-
(6) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	13,819	13,819	-
(7) 未払金	(4,051)	(4,051)	-
(8) 未払費用	(4,163)	(4,163)	-
(9) 関係会社短期借入金	(5,997)	(5,997)	-
(10) デリバティブ取引(2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(120)	(120)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	169	169	-
デリバティブ取引計	48	48	-

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(5) 関係会社短期貸付金

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

(4) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は金融商品取引所が定める清算指数、為替予約取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(6) 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。

(7) 未払金、(8) 未払費用並びに(9) 関係会社短期借入金

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

(10) デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上、流動資産のその他及び流動負債のその他に含まれております。

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

3 子会社株式（中間貸借対照表計上額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57期中間会計期間(平成27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	7,923	7,062	860
	小計	7,923	7,062	860
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	5,896	6,298	402
	小計	5,896	6,298	402
合計		13,819	13,361	458

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

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

(デリバティブ取引関係)

第57期中間会計期間(平成27年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	4,686	-	49	49
合計		4,686	-	49	49

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

2 時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	為替予約取引 買建 米ドル	5,997	-	170	170
合計		5,997	-	170	170

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		4,550	-	148
	豪ドル		219	-	21
	シンガポールドル		738	-	57
	ユーロ		194	-	0
	香港ドル		178	-	5
	人民元		2,155	-	63
合計			8,035	-	169

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27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	3,071百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,269百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,461百万円

(ストックオプション等関係)

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
1株当たり純資産額	256円79銭
1株当たり中間純利益金額	15円54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57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
中間純利益（百万円）	3,058
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）	3,058
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,730
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) 5,619,900株、平成21年度ストックオプション(2) 980,100株、平成23年度ストックオプション(1) 4,738,800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57期中間会計期間 (平成27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）	50,381
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）	50,381
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）	196,198

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

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27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27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27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。
SMB 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27年6月15日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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27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27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

PWC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26年11月8日から平成27年11月9日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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27年11月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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. XBR 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27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

PWC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26年11月8日から平成27年11月9日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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27年11月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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. XBR 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27年12月4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 竹 内 知 明
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27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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27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27年4月1日から平成27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。