

【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29年2月7日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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29年 2月 8日から平成30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
	海外	債券
追加型投信	内外	不動産投信
	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

ンドをいいます。

国内

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

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

「インデックスポートフォリオ」

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

「バランスポートフォリオ」

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

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

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

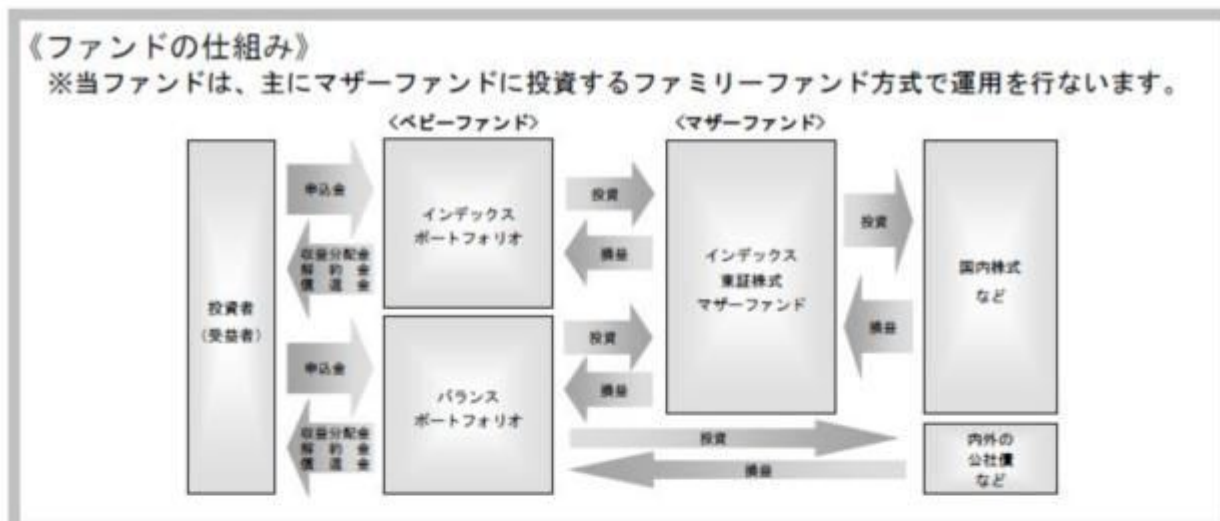
TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

2. お買付けは、原則として給与天引きです。

3. お買付けは、無手数料です。

4. ドル・コスト平均法の妙味を味わえます。

ドル・コスト平均法とは、一定の金額を継続して投資する方法で、価格が安いときは多くの口数を、高いときは少ない口数を買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。

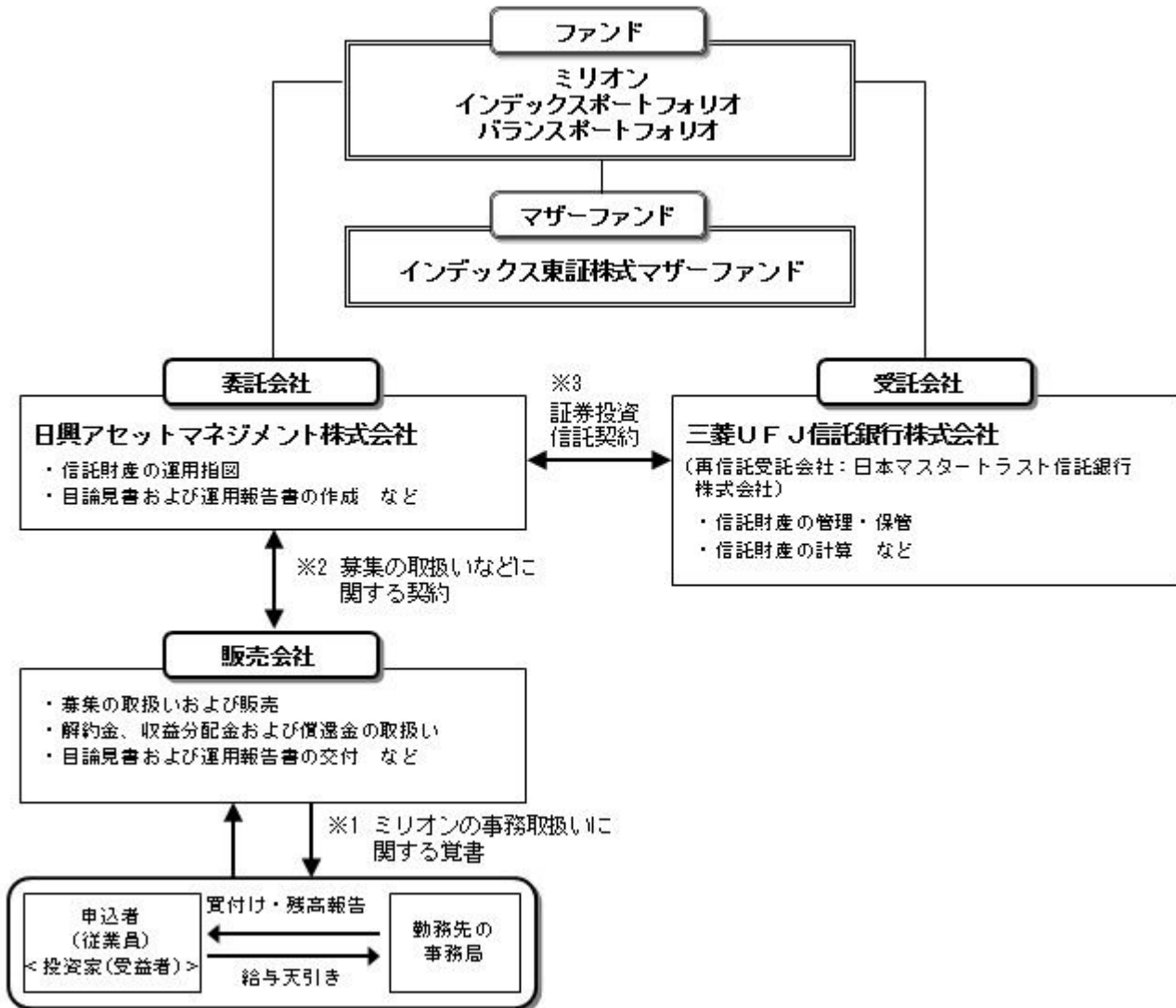
(2) 【ファンドの沿革】

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28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。

- 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。
- 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。)
- 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。)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。

- 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
- 2) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 3) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)の証券の性質を有するもの
- 4) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 有価証券の貸付

投資対象とするマザーファンドの概要

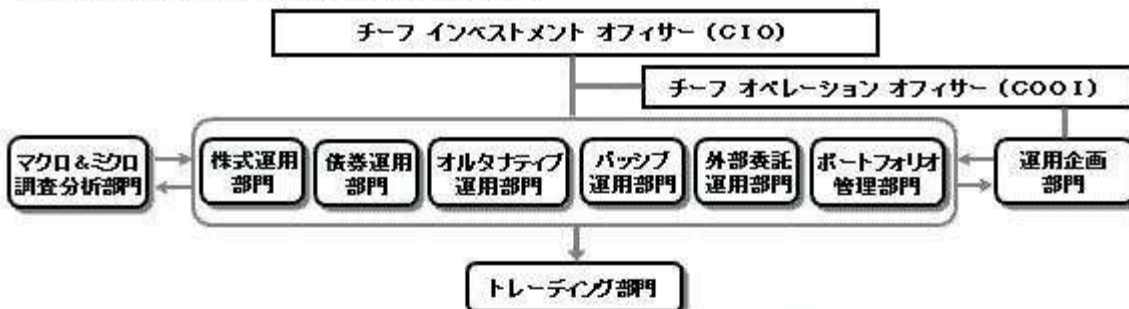
<インデックス東証株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期的成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・投資成果をTOPIX（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、バラ日本株式モデルに従い次のポートフォリオ管理を行いません。投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。 ・資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として買付の場合は時価比率の高い銘柄から順に、売却の場合は時価比率の低い銘柄から順番に行いません。 ・株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合には制限を設けません ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

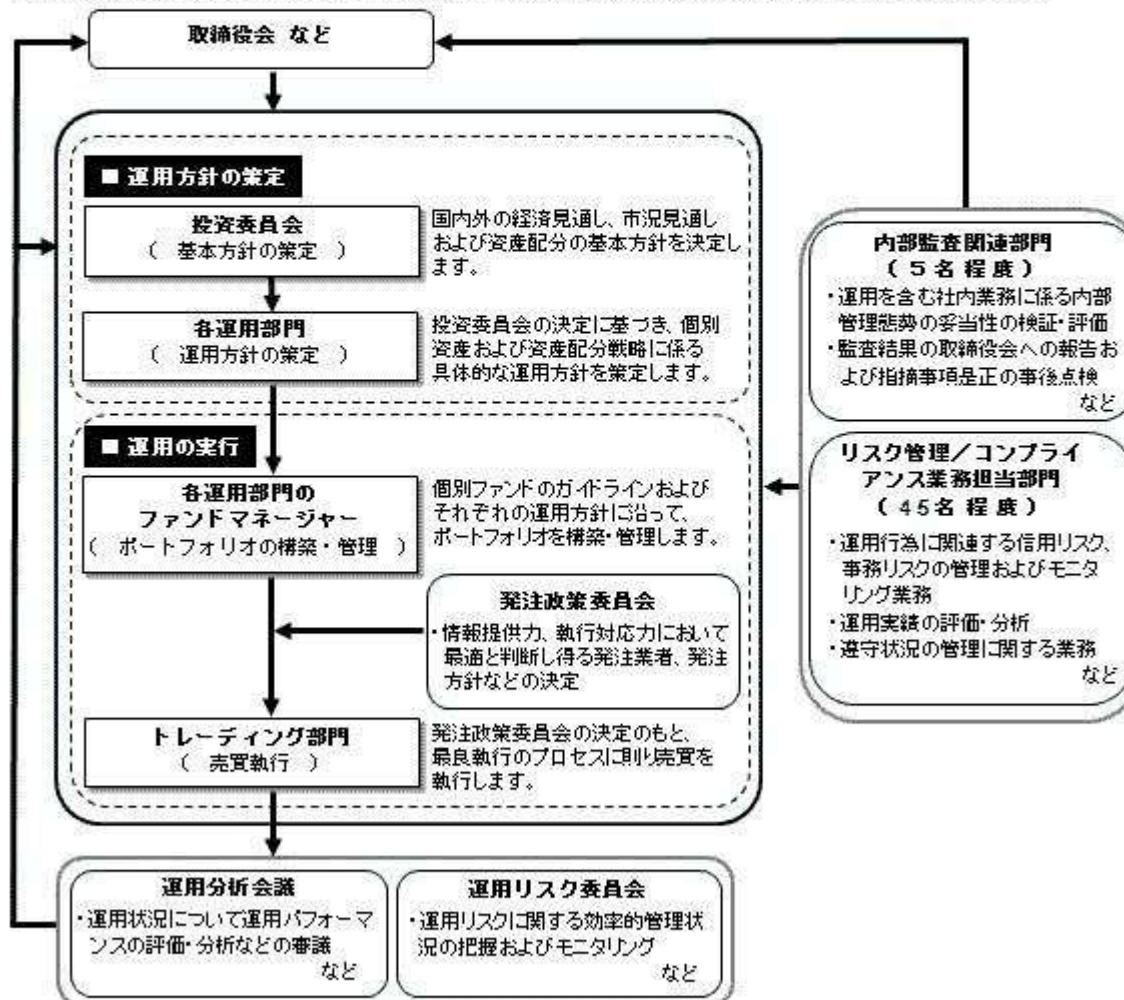
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
信託期間	無期限(昭和61年10月22日設定)
決算日	毎年10月21日(休業日の場合は翌営業日)

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は平成28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

を行いません。

収益分配金の支払い

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

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

<インデックスポートフォリオ>

- 1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合には制限を設けません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が弁済される日からその翌営業日までとします。

<バランスポートフォリオ>

- 1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
 - 2) 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
 - 3) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
 - 4) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 5) 信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にか

かる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

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

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

イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

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

8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

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

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

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

ハ) 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から

信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

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

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。

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

- ・ 一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・ ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

< T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

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

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

< バランスポートフォリオ >

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

流動性リスク

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

信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

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

< その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの

投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

・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出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

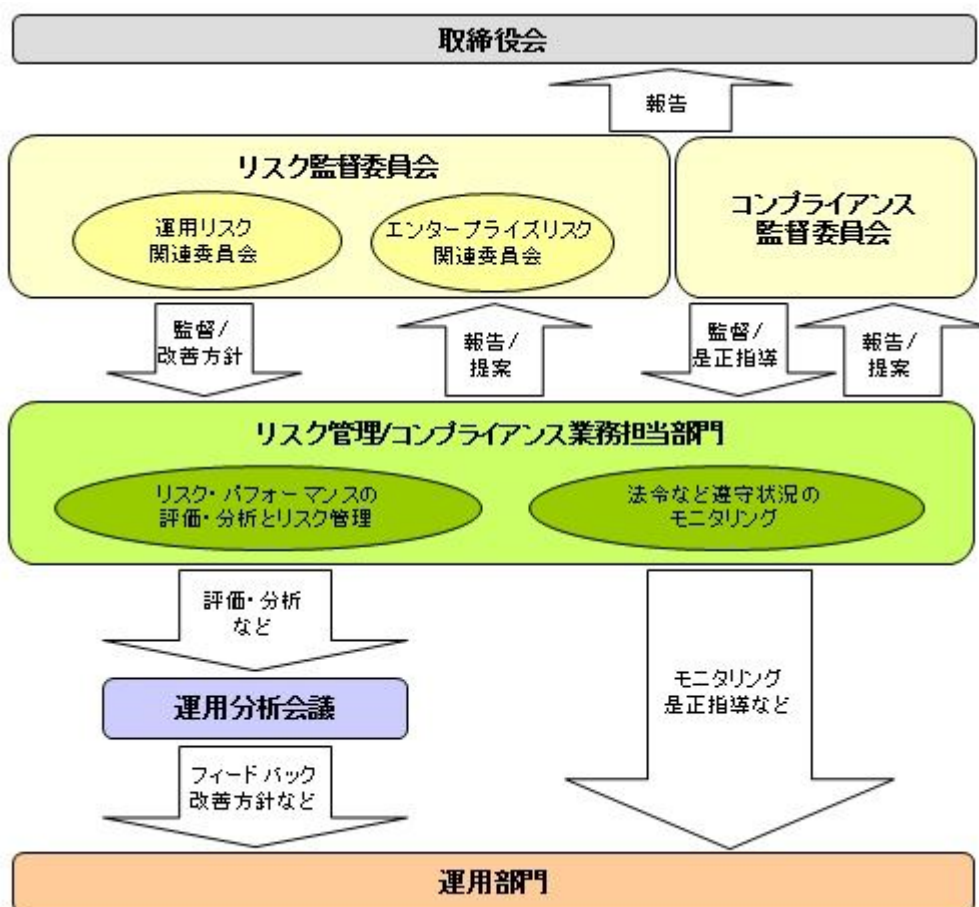
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

（２）リスク管理体制



全社的なリスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/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

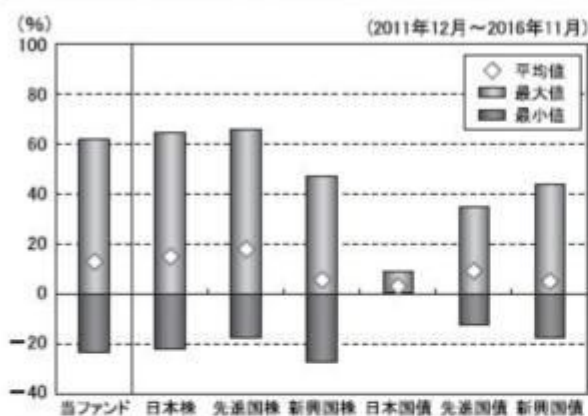
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成28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	13.2%	15.1%	17.7%	5.7%	3.1%	9.3%	5.0%
最大値	62.2%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	-23.2%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	0.5%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2011年12月から2016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。

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



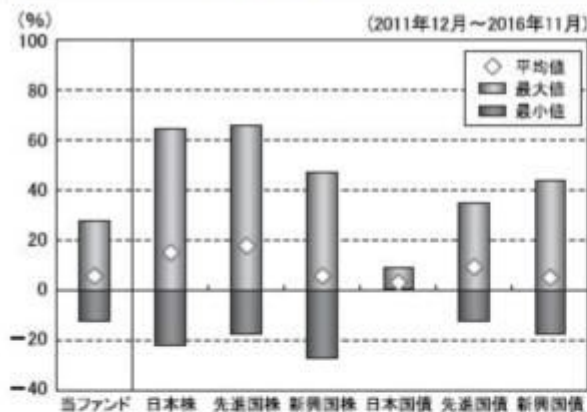
※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2011年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

「バランスポートフォリオ」

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	5.7%	15.1%	17.7%	5.7%	3.1%	9.3%	5.0%
最大値	27.8%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	-12.1%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	0.5%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2011年12月から2016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-BPI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-BPI国債

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

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



2011年12月 2012年12月 2013年12月 2014年12月 2015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、2011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。

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

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

4【手数料等及び税金】**（１）【申込手数料】**

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.6416%（税抜1.52%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬（有価証券届出書提出日現在）の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用（「バランスポートフォリオ」のみ）、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

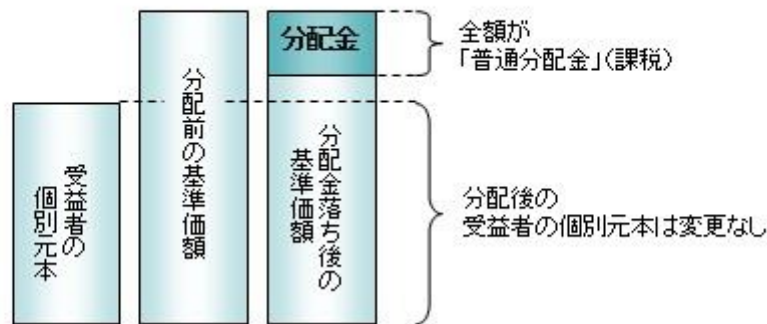
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

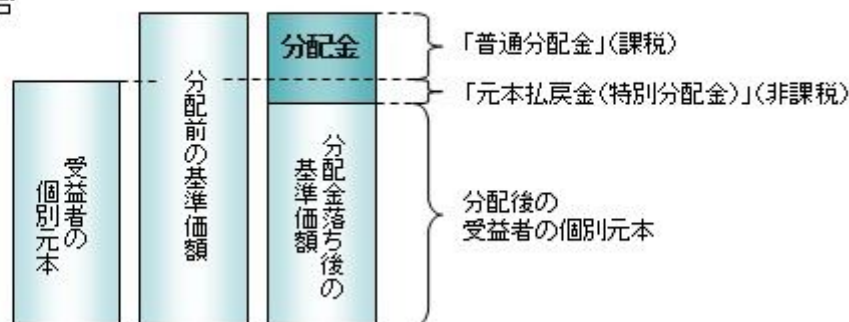
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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29年 2月 7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2016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	11,240,755,647	99.98
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,805,731	0.02
合計(純資産総額)		11,242,561,378	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	7,966,517,114	1.3080	10,420,204,386	1.4110	11,240,755,647	99.98
----	-----------	-------------------	---------------	--------	----------------	--------	----------------	-------

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.98
合 計	99.98

【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
第29計算期間末 (2016年11月 7日)	10,507	10,516	0.5690	0.5695
2015年11月末日	12,479		0.6564	
12月末日	12,046		0.6427	
2016年 1月末日	11,146		0.5943	
2月末日	10,077		0.5381	
3月末日	10,523		0.5628	
4月末日	10,392		0.5591	
5月末日	10,682		0.5749	
6月末日	9,678		0.5194	
7月末日	10,253		0.5506	
8月末日	10,292		0.5529	

9月末日	10,266		0.5539
10月末日	10,756		0.5823
11月末日	11,242		0.6131

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	13.91

(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
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	404,194,947	1,174,901,250

【バランスポートフォリオ】

以下の運用状況は2016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	50,617,400	17.99
地方債証券	日本	19,954,400	7.09
親投資信託受益証券	日本	143,954,187	51.15
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		66,903,809	23.77
合計(純資産総額)		281,429,796	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	102,022,812	1.3080	133,445,839	1.4110	143,954,187			51.15
日本	国債証券	第122回利付国 債(5年)	20,000,000	101.06	20,213,200	100.75	20,150,000	0.100	2019/12/20	7.16
日本	地方債証券	第29回兵庫民 債	20,000,000	99.98	19,997,400	99.77	19,954,400	0.190	2019/3/19	7.09
日本	国債証券	第293回利付国 債(10年)	15,000,000	103.36	15,504,750	103.08	15,463,350	1.800	2018/6/20	5.49
日本	国債証券	第101回利付国 債(5年)	15,000,000	100.02	15,004,050	100.02	15,004,050	0.400	2016/12/20	5.33

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	17.99

地方債証券	7.09
親投資信託受益証券	51.15
合 計	76.23

【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】

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
第29計算期間末 (2016年11月 7日)	271	271	0.8629	0.8634
2015年11月末日	316		0.9260	
12月末日	300		0.9160	
2016年 1月末日	288		0.8827	
2月末日	275		0.8416	
3月末日	282		0.8603	
4月末日	282		0.8585	
5月末日	284		0.8701	
6月末日	267		0.8264	
7月末日	276		0.8509	
8月末日	271		0.8517	
9月末日	267		0.8523	
10月末日	274		0.8734	
11月末日	281		0.8957	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	7.16

(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
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	9,326,069	41,548,116

(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2016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	11,145,881,680	97.92
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		237,335,744	2.08
合計(純資産総額)		11,383,217,424	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	206,360,000	1.81

(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	64,600	5,972.00	385,791,200	6,649.00	429,525,400	3.77
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	388,700	524.20	203,756,540	669.80	260,351,260	2.29
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	41,200	4,633.86	190,915,032	4,625.00	190,550,000	1.67
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	41,100	3,490.65	143,465,715	4,206.00	172,866,600	1.52
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	46,800	3,097.87	144,980,316	3,332.00	155,937,600	1.37
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	23,100	6,573.00	151,836,300	6,712.00	155,047,200	1.36
日本	株式	KDDI	情報・通信業	50,700	3,055.09	154,893,063	2,999.00	152,049,300	1.34
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	696,300	170.90	118,997,670	202.60	141,070,380	1.24

日本	株式	日本たばこ産業	食料品	32,300	3,883.41	125,434,143	3,946.00	127,455,800	1.12
日本	株式	ソニー	電気機器	36,700	3,320.79	121,872,993	3,288.00	120,669,600	1.06
日本	株式	ファナック	電気機器	5,300	19,432.67	102,993,200	19,305.00	102,316,500	0.90
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	20,800	4,040.64	84,045,312	4,899.00	101,899,200	0.90
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	38,300	2,515.97	96,361,651	2,624.00	100,499,200	0.88
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	10,000	9,244.91	92,449,100	9,766.00	97,660,000	0.86
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	20,400	4,780.00	97,512,000	4,685.00	95,574,000	0.84
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	21,500	4,521.36	97,209,240	4,435.00	95,352,500	0.84
日本	株式	三菱商事	卸売業	38,500	2,409.13	92,751,505	2,471.50	95,152,750	0.84
日本	株式	キーエンス	電気機器	1,200	76,840.00	92,208,000	78,230.00	93,876,000	0.82
日本	株式	キヤノン	電気機器	27,900	3,047.27	85,018,833	3,261.00	90,981,900	0.80
日本	株式	任天堂	その他製品	3,200	25,185.00	80,592,000	27,775.00	88,880,000	0.78
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	55,500	1,525.00	84,637,500	1,579.50	87,662,250	0.77
日本	株式	三菱地所	不動産業	38,000	2,012.50	76,475,000	2,305.50	87,609,000	0.77
日本	株式	三菱電機	電気機器	55,300	1,377.21	76,159,713	1,576.50	87,180,450	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	5,400	14,386.87	77,689,098	15,425.00	83,295,000	0.73
日本	株式	信越化学工業	化学	9,700	7,519.69	72,940,993	8,460.00	82,062,000	0.72
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	18,400	3,907.29	71,894,136	4,367.00	80,352,800	0.71
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	4,300	17,245.00	74,153,500	18,680.00	80,324,000	0.71
日本	株式	日立製作所	電気機器	125,000	523.90	65,487,500	609.30	76,162,500	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	7,100	9,758.00	69,281,800	10,715.00	76,076,500	0.67
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	16,200	3,976.58	64,420,596	4,645.00	75,249,000	0.66

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	0.11
		鉱業	0.34
		建設業	3.08
		食料品	4.44
		繊維製品	0.69
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.26
		医薬品	4.66
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	0.92
		鉄鋼	1.24
		非鉄金属	0.89
		金属製品	0.68
		機械	4.97
		電気機器	12.30
		輸送用機器	9.59
精密機器	1.49		

	その他製品	1.89
	電気・ガス業	1.79
	陸運業	4.20
	海運業	0.22
	空運業	0.55
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	7.39
	卸売業	4.34
	小売業	4.71
	銀行業	8.13
	証券、商品先物取引業	1.13
	保険業	2.58
	その他金融業	1.30
	不動産業	2.62
	サービス業	3.59
合 計		97.92

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 2016年12月	買建	14	日本円	191,561,620	206,360,000	1.81

(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

2016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……………6,131円

純資産総額……………112.42億円

※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、2006年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

分配の推移（税引前、1万口当たり）

2012年11月	2013年11月	2014年11月	2015年11月	2016年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	145円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産	比率
株式	97.89%
株式先物	1.81%
債券	—
債券先物	—
現金その他	2.11%

※当ファンドの実質組入比率です。

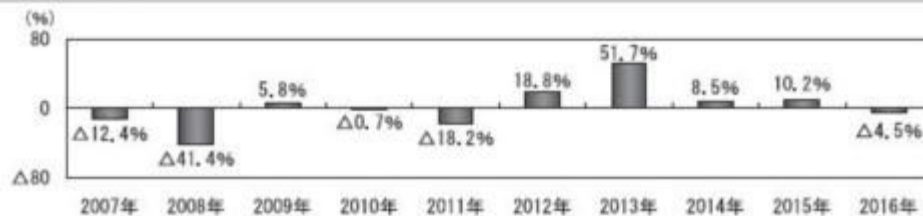
＜組入上位10銘柄＞

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	3.77%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.29%
3 日本電信電話	情報・通信業	1.67%
4 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.52%
5 本田技研工業	輸送用機器	1.37%
6 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.36%
7 KDDI	情報・通信業	1.34%
8 みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.24%
9 日本たばこ産業	食料品	1.12%
10 ソニー	電気機器	1.06%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



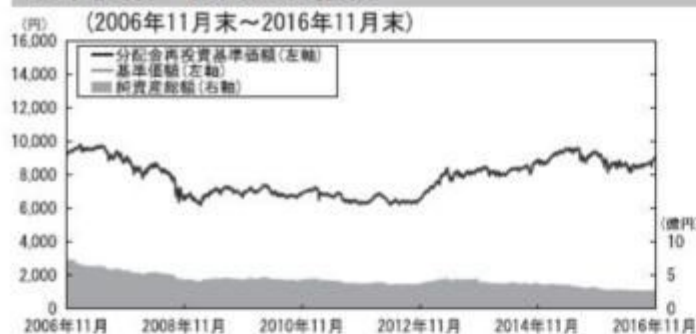
※ファンドの年間収益率は分配金（税引前）を再投資したもとして計算しております。

※2016年は、2016年11月末までの騰落率です。

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

「バランスポートフォリオ」

基準価額・純資産の推移



基準価額.....8,957円

純資産総額.....2.81億円

※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、2006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）

2012年11月	2013年11月	2014年11月	2015年11月	2016年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	145円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産	比率
株式	50.08%
株式先物	0.93%
債券	25.08%
債券先物	0.00%
現金その他	24.85%

※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	—	—	51.15%
2	第122回利付国債（5年）	国債証券	0.100%	2019年12月20日	7.16%
3	第29回兵庫県民債	地方債証券	0.190%	2019年3月19日	7.09%
4	第293回利付国債（10年）	国債証券	1.800%	2018年6月20日	5.49%
5	第101回利付国債（5年）	国債証券	0.400%	2016年12月20日	5.33%

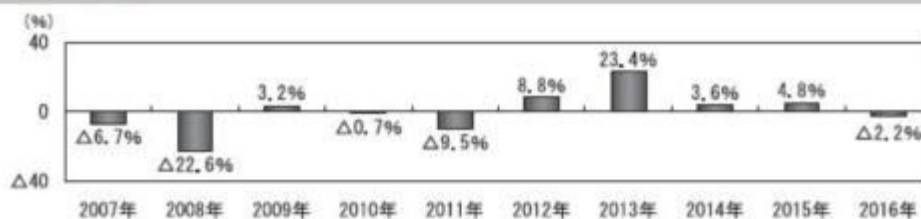
※当ファンドの対純資産総額比です。

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	3.77%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.29%
3	日本電信電話	情報・通信業	1.67%
4	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.52%
5	本田技研工業	輸送用機器	1.37%

※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。

※2016年は、2016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号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金(解約)手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

(2) 解約制限

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

(3) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(4) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(5) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

(6) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(7) 受付の中止および取消

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

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の解約請求を撤回できます。ただ

し、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

< 買取請求による換金 >

(1) 買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

(2) 買取制限

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

(3) 買取価額

買取請求受付日の基準価額から、当該買取りを行なう販売会社に係る源泉徴収税額に相当する金額を控除した価額となります。なお、一定の要件の下では、買取請求受付日の基準価額となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(4) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(5) 買取単位

1口単位

販売会社によっては、買取単位が異なる場合があります。詳しくは、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

(6) 受付の中止および取消

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

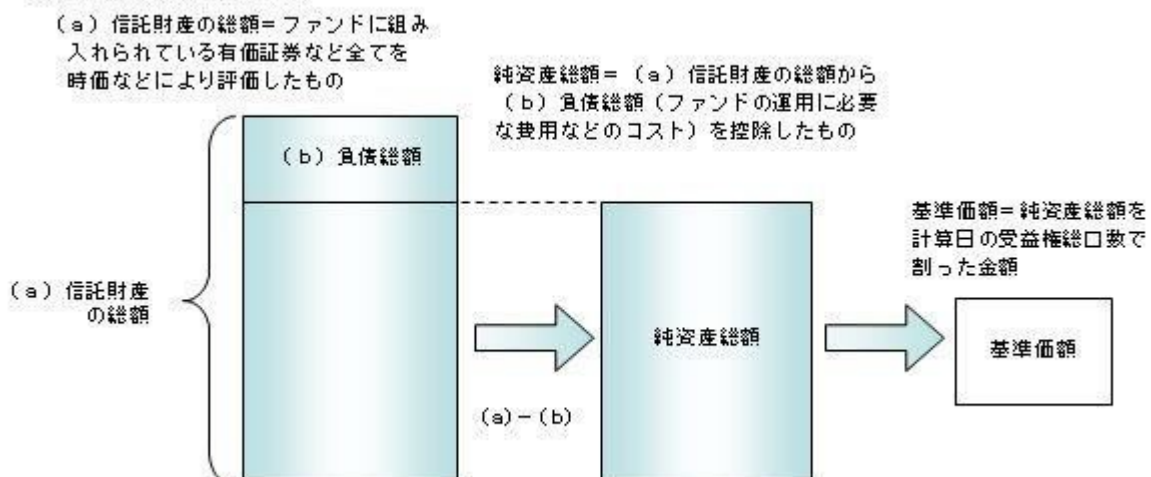
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

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

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

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。

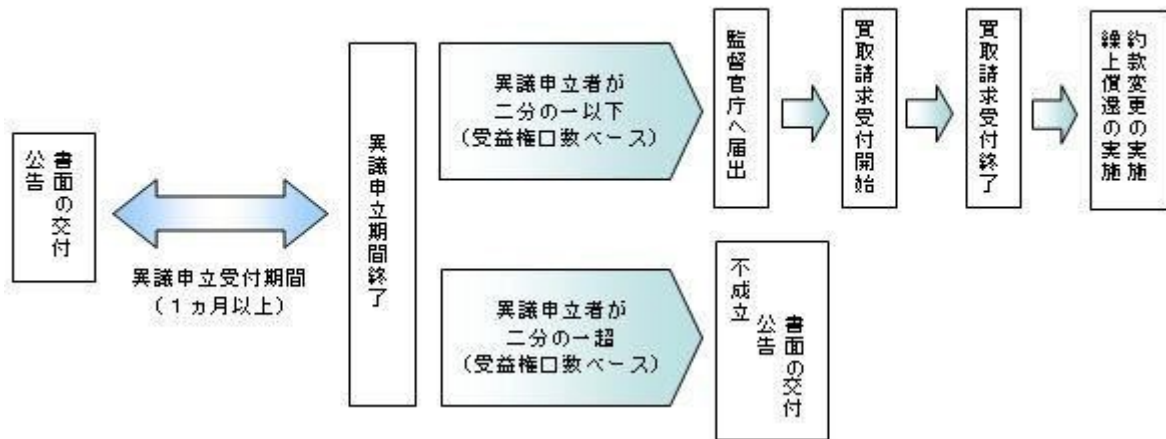
信託約款の変更

 - 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することができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、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29期計算期間（平成27年11月10日から平成28年11月7日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【インデックスポートフォリオ】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第28期 平成27年11月 9日現在	第29期 平成28年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	113,599,359	92,197,811
親投資信託受益証券	12,728,102,533	10,509,863,948
未収入金	7,686,583	-
未収利息	182	-
流動資産合計	12,849,388,657	10,602,061,759
資産合計	12,849,388,657	10,602,061,759
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,619,203	9,233,850
未払解約金	5,558,094	1,439,402
未払受託者報酬	5,658,502	4,389,463
未払委託者報酬	101,854,145	79,011,471
未払利息	-	75
その他未払費用	346,520	268,798
流動負債合計	123,036,464	94,343,059
負債合計	123,036,464	94,343,059
純資産の部		
元本等		
元本	19,238,407,356	18,467,701,053
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	6,512,055,163	7,959,982,353
(分配準備積立金)	1,682,960,841	1,571,728,058
元本等合計	12,726,352,193	10,507,718,700
純資産合計	12,726,352,193	10,507,718,700
負債純資産合計	12,849,388,657	10,602,061,759

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第28期		第29期	
	自	平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9日	自	平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日
営業収益				
受取利息		33,985		5,680
有価証券売買等損益		2,279,288,359		1,552,123,561
営業収益合計		2,279,322,344		1,552,117,881
営業費用				
支払利息		-		13,770
受託者報酬		11,216,203		9,144,917
委託者報酬		201,893,891		164,610,653
その他費用		686,872		560,357
営業費用合計		213,796,966		174,329,697
営業利益又は営業損失（ ）		2,065,525,378		1,726,447,578
経常利益又は経常損失（ ）		2,065,525,378		1,726,447,578
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,065,525,378		1,726,447,578
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（ ）		244,436,961		64,559,606
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,786,415,597		6,512,055,163
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,608,952,504		398,367,254
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,608,952,504		398,367,254
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		146,061,284		175,172,622
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		146,061,284		175,172,622
分配金		9,619,203		9,233,850
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,512,055,163		7,959,982,353

（ 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27年11月10日から平成28年11月 7日までとなっております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

		第28期 平成27年11月 9日現在	第29期 平成28年11月 7日現在
1.	期首元本額	22,551,165,652円	19,238,407,356円
	期中追加設定元本額	397,656,514円	404,194,947円
	期中一部解約元本額	3,710,414,810円	1,174,901,250円
2.	受益権の総数	19,238,407,356口	18,467,701,053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	6,512,055,163円	7,959,982,353円

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第28期 自 平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9日		第29期 自 平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	33,648円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	1,357,862,451円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	2,267,062,904円	C 信託約款に定める収益調整金 2,210,818,766円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	334,683,945円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 1,580,961,908円
E	分配対象収益（ A+B+C+D ）	3,959,642,948円	E 分配対象収益（ A+B+C+D ） 3,791,780,674円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,058円	F 分配対象収益(1万口当たり) 2,053円
G	分配金額	9,619,203円	G 分配金額 9,233,850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28期 自 平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9日	第29期 自 平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第28期 平成27年11月 9日現在	第29期 平成28年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第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

第29期（平成28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	1,285,610,270
合計	1,285,610,270

（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28期 平成27年11月 9日現在		第29期 平成28年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.6615円	1口当たり純資産額	0.5690円
(1万口当たり純資産額)	(6,615円)	(1万口当たり純資産額)	(5,690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	8,035,064,181	10,509,863,948	
合計		8,035,064,181	10,509,863,948	

(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28期 平成27年11月 9日現在	第29期 平成28年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	85,326,425	64,638,070
国債証券	70,818,430	50,726,140
地方債証券	-	19,997,400
親投資信託受益証券	169,011,055	138,216,080
未収利息	177,823	139,076
前払費用	2,958	-
流動資産合計	325,336,691	273,716,766
資産合計	325,336,691	273,716,766
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	173,322	157,211
未払受託者報酬	145,558	117,305
未払委託者報酬	2,621,182	2,112,687
未払利息	-	53
その他未払費用	8,855	7,121
流動負債合計	2,948,917	2,394,377
負債合計	2,948,917	2,394,377
純資産の部		
元本等		
元本	346,644,659	314,422,612
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	24,256,885	43,100,223
(分配準備積立金)	22,735,626	19,884,372
元本等合計	322,387,774	271,322,389
純資産合計	322,387,774	271,322,389
負債純資産合計	325,336,691	273,716,766

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第28期		第29期	
	自	平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9日	自	平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日
営業収益				
受取利息		521,210		428,626
有価証券売買等損益		34,003,716		18,013,265
営業収益合計		34,524,926		17,584,639
営業費用				
支払利息		-		16,316
受託者報酬		302,252		242,181
委託者報酬		5,442,730		4,361,499
その他費用		18,400		14,967
営業費用合計		5,763,382		4,634,963
営業利益又は営業損失（ ）		28,761,544		22,219,602
経常利益又は経常損失（ ）		28,761,544		22,219,602
当期純利益又は当期純損失（ ）		28,761,544		22,219,602
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		5,376,814		1,853,944
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		61,233,164		24,256,885
剰余金増加額又は欠損金減少額		14,660,234		2,932,894
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		14,660,234		2,932,894
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		895,363		1,253,363
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		895,363		1,253,363
分配金		173,322		157,211
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		24,256,885		43,100,223

(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>国債証券及び地方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27年11月10日から平成28年11月7日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		第28期 平成27年11月9日現在	第29期 平成28年11月7日現在
1.	期首元本額	443,462,456円	346,644,659円
	期中追加設定元本額	9,591,772円	9,326,069円
	期中一部解約元本額	106,409,569円	41,548,116円
2.	受益権の総数	346,644,659口	314,422,612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	24,256,885円	43,100,223円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第28期 自 平成26年11月8日 至 平成27年11月9日	第29期 自 平成27年11月10日 至 平成28年11月7日
分配金の計算過程	分配金の計算過程

A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	408,997円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	15,562,657円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	47,898,221円	C	信託約款に定める収益調整金	44,026,500円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,937,294円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	20,041,583円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	70,807,169円	E	分配対象収益（A+B+C+D）	64,068,083円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,042円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,037円
G	分配金額	173,322円	G	分配金額	157,211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28期 自 平成26年11月 8日 至 平成27年11月 9日	第29期 自 平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第28期 平成27年11月 9日現在	第29期 平成28年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	<p>売買目的有価証券</p> <p>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 該当事項はありません。</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>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	<p>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。</p>	<p>同左</p>

（有価証券に関する注記）

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

第29期（平成28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	112,460
地方債証券	56,000
親投資信託受益証券	14,265,422
合計	14,433,882

（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28期 平成27年11月 9日現在		第29期 平成28年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.9300円	1口当たり純資産額	0.8629円
(1万口当たり純資産額)	(9,300円)	(1万口当たり純資産額)	(8,629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101回利付国債（5年）	15,000,000	15,008,190	
	第122回利付国債（5年）	20,000,000	20,213,200	
	第293回利付国債（10年）	15,000,000	15,504,750	
国債証券 合計		50,000,000	50,726,140	
地方債証券	第29回兵庫県民債	20,000,000	19,997,400	
地方債証券 合計		20,000,000	19,997,400	
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	105,669,786	138,216,080	
親投資信託受益証券 合計		105,669,786	138,216,080	
合計		175,669,786	208,939,620	

(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27年11月 9日現在	平成28年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	969,528	738,006
コール・ローン	188,473,774	140,074,995
株式	12,617,119,730	10,388,387,390
派生商品評価勘定	19,567,900	4,640,820
未収入金	1,937,602	30,978,820
未収配当金	91,897,557	88,003,408
未収利息	302	-
流動資産合計	12,919,966,393	10,652,823,439
資産合計	12,919,966,393	10,652,823,439
負債の部		
流動負債		
前受金	17,094,000	910,000
未払解約金	7,686,583	-
未払利息	-	115
流動負債合計	24,780,583	910,115
負債合計	24,780,583	910,115
純資産の部		
元本等		
元本	8,626,831,832	8,140,733,967
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,268,353,978	2,511,179,357
元本等合計	12,895,185,810	10,651,913,324
純資産合計	12,895,185,810	10,651,913,324
負債純資産合計	12,919,966,393	10,652,823,439

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

		平成27年11月 9日現在	平成28年11月 7日現在
1.	期首	平成26年11月 8日	平成27年11月10日
	期首元本額	10,315,049,407円	8,626,831,832円
	期首からの追加設定元本額	25,129,325円	87,701,593円
	期首からの一部解約元本額	1,713,346,900円	573,799,458円
	元本の内訳		
	インデックスポートフォリオ	8,513,780,959円	8,035,064,181円
	バランスポートフォリオ	113,050,873円	105,669,786円
	計	8,626,831,832円	8,140,733,967円
2.	受益権の総数	8,626,831,832口	8,140,733,967口
3.	担保資産		
	<p>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。</p> <p>株式</p>	109,161,780円	80,600,160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26年11月 8日 至 平成27年11月 9日	自 平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年11月 9日現在	平成28年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成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

（平成28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	22,879,888
合計	22,879,888

(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

（平成28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	227,655,000	-	232,305,000	4,650,000
合計		227,655,000	-	232,305,000	4,650,000

（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27年11月 9日現在		平成28年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.495円	1口当たり純資産額	1.308円
(1千口当たり純資産額)	(1,495円)	(1千口当たり純資産額)	(1,308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	200	2,633.00	526,600	
日本水産	7,700	504.00	3,880,800	
マルハニチロ	1,100	2,873.00	3,160,300	
カネコ種苗	200	1,423.00	284,600	
サカタのタネ	900	2,948.00	2,653,200	
ホクト	600	2,001.00	1,200,600	
ホクリヨウ	100	752.00	75,200	
住石ホールディングス	2,400	88.00	211,200	
日鉄鉱業	200	4,150.00	830,000	
三井松島産業	400	1,228.00	491,200	
国際石油開発帝石	30,700	947.30	29,082,110	
日本海洋掘削	200	2,260.00	452,000	
石油資源開発	900	2,209.00	1,988,100	
K & O エナジーグループ	400	1,450.00	580,000	
ショーボンドホールディングス	600	4,935.00	2,961,000	
ミライト・ホールディングス	1,800	989.00	1,780,200	
安藤・間	4,300	694.00	2,984,200	
東急建設	2,100	1,048.00	2,200,800	
コムシスホールディングス	2,300	1,853.00	4,261,900	

ミサワホーム	700	825.00	577,500
高松コンストラクショングループ	400	2,501.00	1,000,400
東建コーポレーション	200	7,470.00	1,494,000
ヤマウラ	300	525.00	157,500
大成建設	30,000	783.00	23,490,000
大林組	17,500	993.00	17,377,500
清水建設	18,000	921.00	16,578,000
飛鳥建設	5,800	182.00	1,055,600
長谷工コーポレーション	6,800	1,020.00	6,936,000
松井建設	600	1,100.00	660,000
銭高組	1,000	344.00	344,000
鹿島建設	26,000	699.00	18,174,000
不動テトラ	4,700	177.00	831,900
大末建設	300	870.00	261,000
鉄建建設	4,000	330.00	1,320,000
西松建設	7,000	495.00	3,465,000
三井住友建設	22,500	99.00	2,227,500
大豊建設	2,000	570.00	1,140,000
前田建設工業	4,000	947.00	3,788,000
ナカノフドー建設	500	417.00	208,500
奥村組	5,000	610.00	3,050,000
東鉄工業	700	2,939.00	2,057,300
イチケン	1,000	380.00	380,000
浅沼組	2,000	250.00	500,000
戸田建設	7,000	561.00	3,927,000
熊谷組	9,000	274.00	2,466,000
青木あすなる建設	500	719.00	359,500
北野建設	1,000	272.00	272,000
植木組	1,000	220.00	220,000
三井ホーム	1,000	450.00	450,000
矢作建設工業	800	1,048.00	838,400
ピーエス三菱	500	356.00	178,000
日本ハウスホールディングス	1,200	392.00	470,400
大東建託	2,200	17,435.00	38,357,000
新日本建設	700	1,007.00	704,900
N I P P O	1,000	2,009.00	2,009,000
東亜道路工業	1,000	276.00	276,000
前田道路	2,000	1,940.00	3,880,000
日本道路	2,000	427.00	854,000
東亜建設工業	500	2,249.00	1,124,500
若築建設	3,000	153.00	459,000
東洋建設	1,600	420.00	672,000

五洋建設	6,400	618.00	3,955,200
大林道路	800	652.00	521,600
世紀東急工業	900	494.00	444,600
福田組	1,000	1,188.00	1,188,000
住友林業	4,000	1,468.00	5,872,000
日本基礎技術	900	343.00	308,700
日成ビルド工業	2,000	472.00	944,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	3,000	75.00	225,000
巴コーポレーション	800	338.00	270,400
パナホーム	2,000	759.00	1,518,000
大和ハウス工業	17,300	2,844.50	49,209,850
ライト工業	1,100	1,257.00	1,382,700
積水ハウス	18,400	1,712.00	31,500,800
日特建設	800	486.00	388,800
北陸電気工事	300	852.00	255,600
ユアテック	1,000	743.00	743,000
西部電気工業	200	2,001.00	400,200
四電工	1,000	409.00	409,000
中電工	700	2,126.00	1,488,200
関電工	2,000	1,007.00	2,014,000
きんでん	3,900	1,416.00	5,522,400
東京エネシス	1,000	953.00	953,000
トーエネック	1,000	502.00	502,000
住友電設	500	1,104.00	552,000
日本電設工業	900	1,789.00	1,610,100
協和エクシオ	2,300	1,569.00	3,608,700
新日本空調	400	1,129.00	451,600
N D S	100	2,573.00	257,300
九電工	1,100	3,250.00	3,575,000
三機工業	1,300	917.00	1,192,100
日揮	5,500	1,788.00	9,834,000
中外炉工業	2,000	199.00	398,000
ヤマト	800	557.00	445,600
太平電業	1,000	1,000.00	1,000,000
高砂熱学工業	1,600	1,453.00	2,324,800
三晃金属工業	100	2,948.00	294,800
朝日工業社	200	2,930.00	586,000
明星工業	1,000	537.00	537,000
大気社	800	2,581.00	2,064,800
ダイダン	1,000	867.00	867,000
日比谷総合設備	700	1,622.00	1,135,400
東芝プラントシステム	1,000	1,667.00	1,667,000

東洋エンジニアリング	3,000	348.00	1,044,000
千代田化工建設	4,000	872.00	3,488,000
新興プランテック	1,200	774.00	928,800
日本製粉	1,800	1,542.00	2,775,600
日清製粉グループ本社	6,400	1,553.00	9,939,200
日東富士製粉	100	3,730.00	373,000
昭和産業	2,000	585.00	1,170,000
鳥越製粉	600	762.00	457,200
中部飼料	600	899.00	539,400
フィード・ワン	3,800	135.00	513,000
東洋精糖	1,000	109.00	109,000
日本甜菜製糖	300	2,048.00	614,400
三井製糖	400	2,348.00	939,200
塩水港精糖	400	238.00	95,200
日新製糖	300	1,478.00	443,400
森永製菓	1,100	4,900.00	5,390,000
中村屋	100	4,575.00	457,500
江崎グリコ	1,500	5,830.00	8,745,000
名糖産業	300	1,357.00	407,100
不二家	3,000	204.00	612,000
山崎製パン	4,300	2,332.00	10,027,600
第一屋製パン	1,000	134.00	134,000
モロゾフ	1,000	435.00	435,000
亀田製菓	300	5,240.00	1,572,000
寿スピリッツ	400	2,934.00	1,173,600
カルビー	2,400	3,465.00	8,316,000
森永乳業	5,000	882.00	4,410,000
六甲バター	200	2,757.00	551,400
ヤクルト本社	3,100	4,840.00	15,004,000
明治ホールディングス	3,500	10,420.00	36,470,000
雪印メグミルク	1,300	3,450.00	4,485,000
プリマハム	4,000	413.00	1,652,000
日本ハム	4,000	2,823.00	11,292,000
林兼産業	200	870.00	174,000
丸大食品	3,000	514.00	1,542,000
S Foods	300	2,798.00	839,400
伊藤ハム米久ホールディングス	3,400	1,035.00	3,519,000
サッポロホールディングス	1,900	2,842.00	5,399,800
アサヒグループホールディングス	11,000	3,670.00	40,370,000
キリンホールディングス	25,300	1,853.50	46,893,550
宝ホールディングス	4,200	972.00	4,082,400
オエノンホールディングス	1,000	242.00	242,000

コカ・コーラウエスト	1,900	3,070.00	5,833,000
コカ・コーライーストジャパン	2,300	2,276.00	5,234,800
サントリー食品インターナショナル	4,000	4,715.00	18,860,000
ダイドードリンコ	300	5,710.00	1,713,000
伊藤園	1,700	3,770.00	6,409,000
キーコーヒー	500	2,046.00	1,023,000
ユニカフェ	200	954.00	190,800
ジャパンフーズ	100	1,146.00	114,600
日清オイリオグループ	3,000	476.00	1,428,000
不二製油グループ本社	1,600	2,030.00	3,248,000
かどや製油	100	3,180.00	318,000
J - オイルミルズ	300	3,755.00	1,126,500
キッコーマン	4,000	3,440.00	13,760,000
味の素	12,000	2,348.00	28,176,000
キューピー	3,000	2,855.00	8,565,000
ハウス食品グループ本社	2,200	2,323.00	5,110,600
カゴメ	2,100	2,660.00	5,586,000
焼津水産化学工業	400	1,009.00	403,600
アリアケジャパン	500	5,990.00	2,995,000
ピエトロ	100	1,564.00	156,400
エバラ食品工業	100	1,959.00	195,900
ニチレイ	2,900	2,365.00	6,858,500
東洋水産	2,900	4,140.00	12,006,000
日清食品ホールディングス	2,300	5,930.00	13,639,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,315.00	1,315,000
一正蒲鉾	200	1,102.00	220,400
フジッコ	500	2,349.00	1,174,500
ロック・フィールド	600	1,448.00	868,800
日本たばこ産業	32,400	3,925.00	127,170,000
ケンコーマヨネーズ	200	3,690.00	738,000
わらべや日洋ホールディングス	300	2,450.00	735,000
なとり	300	1,804.00	541,200
ユーグレナ	1,900	1,366.00	2,595,400
ミヨシ油脂	2,000	131.00	262,000
理研ビタミン	200	4,375.00	875,000
片倉工業	700	1,223.00	856,100
ゲンゼ	4,000	369.00	1,476,000
東洋紡	22,000	171.00	3,762,000
ユニチカ	15,000	73.00	1,095,000
富士紡ホールディングス	300	3,485.00	1,045,500
倉敷紡績	6,000	208.00	1,248,000
シキボウ	3,000	120.00	360,000

日本毛織	1,600	759.00	1,214,400
ダイトウボウ	2,000	68.00	136,000
トーア紡コーポレーション	300	512.00	153,600
ダイドーリミテッド	600	402.00	241,200
帝国繊維	600	1,528.00	916,800
帝人	4,500	1,955.00	8,797,500
東レ	40,000	954.70	38,188,000
サカイオーベックス	200	1,872.00	374,400
住江織物	2,000	213.00	426,000
日本フェルト	400	489.00	195,600
イチカワ	1,000	269.00	269,000
日東製網	100	1,650.00	165,000
アツギ	5,000	115.00	575,000
ダイニック	1,000	170.00	170,000
セーレン	1,400	1,199.00	1,678,600
ソトー	200	1,185.00	237,000
東海染工	1,000	128.00	128,000
小松精練	800	629.00	503,200
ワコールホールディングス	3,000	1,228.00	3,684,000
ホギメディカル	300	6,810.00	2,043,000
レナウン	1,200	103.00	123,600
T S Iホールディングス	2,400	577.00	1,384,800
三陽商会	3,000	158.00	474,000
ナイガイ	3,000	56.00	168,000
オンワードホールディングス	4,000	706.00	2,824,000
ルック	1,000	158.00	158,000
キムラタン	11,000	7.00	77,000
ゴールドウイン	200	4,940.00	988,000
デサント	1,200	1,273.00	1,527,600
キング	200	393.00	78,600
特種東海製紙	300	3,480.00	1,044,000
王子ホールディングス	21,000	417.00	8,757,000
日本製紙	2,500	1,869.00	4,672,500
三菱製紙	800	682.00	545,600
北越紀州製紙	3,000	644.00	1,932,000
中越パルプ工業	2,000	220.00	440,000
巴川製紙所	1,000	250.00	250,000
大王製紙	2,200	1,234.00	2,714,800
レンゴー	5,300	669.00	3,545,700
トモク	2,000	304.00	608,000
ザ・パック	400	2,715.00	1,086,000
クラレ	9,200	1,580.00	14,536,000

旭化成	34,000	949.50	32,283,000
共和レザー	500	783.00	391,500
昭和電工	3,600	1,493.00	5,374,800
住友化学	40,000	483.00	19,320,000
日本化成	1,000	142.00	142,000
住友精化	200	3,860.00	772,000
日産化学工業	3,000	3,615.00	10,845,000
ラサ工業	2,000	125.00	250,000
クレハ	400	3,950.00	1,580,000
テイカ	1,000	526.00	526,000
石原産業	1,000	787.00	787,000
日東エフシー	300	846.00	253,800
日本曹達	3,000	464.00	1,392,000
東ソー	16,000	710.00	11,360,000
トクヤマ	9,000	448.00	4,032,000
セントラル硝子	5,000	405.00	2,025,000
東亜合成	3,400	1,133.00	3,852,200
大阪ソーダ	2,000	457.00	914,000
関東電化工業	1,000	868.00	868,000
デンカ	11,000	468.00	5,148,000
信越化学工業	9,800	7,916.00	77,576,800
日本カーバイド工業	2,000	139.00	278,000
堺化学工業	2,000	370.00	740,000
エア・ウォーター	4,500	1,887.00	8,491,500
大陽日酸	4,200	1,031.00	4,330,200
日本化学工業	2,000	269.00	538,000
日本パーカライズン	2,700	1,366.00	3,688,200
高圧ガス工業	800	656.00	524,800
四国化成工業	1,000	964.00	964,000
戸田工業	1,000	284.00	284,000
ステラ ケミファ	300	3,040.00	912,000
保土谷化学工業	200	2,901.00	580,200
日本触媒	900	6,750.00	6,075,000
大日精化工業	2,000	553.00	1,106,000
カネカ	7,000	839.00	5,873,000
三菱瓦斯化学	5,100	1,610.00	8,211,000
三井化学	25,000	481.00	12,025,000
J S R	5,500	1,531.00	8,420,500
東京応化工業	1,000	3,700.00	3,700,000
大阪有機化学工業	400	775.00	310,000
三菱ケミカルホールディングス	36,600	681.30	24,935,580
ダイセル	7,400	1,149.00	8,502,600

住友ベークライト	5,000	557.00	2,785,000
積水化学工業	12,400	1,645.00	20,398,000
日本ゼオン	5,000	968.00	4,840,000
アイカ工業	1,800	3,030.00	5,454,000
宇部興産	27,000	215.00	5,805,000
積水樹脂	900	1,695.00	1,525,500
タキロン	1,000	482.00	482,000
旭有機材	2,000	204.00	408,000
日立化成	3,000	2,450.00	7,350,000
ニチバン	1,000	886.00	886,000
リケンテクノス	1,200	543.00	651,600
大倉工業	1,000	411.00	411,000
積水化成成品工業	700	759.00	531,300
群栄化学工業	200	2,924.00	584,800
タイガースポリマー	300	681.00	204,300
ミライアル	200	754.00	150,800
ダイキョーニシカワ	900	1,366.00	1,229,400
日本化薬	4,000	1,222.00	4,888,000
カーリットホールディングス	500	523.00	261,500
日本精化	600	761.00	456,600
扶桑化学工業	400	2,417.00	966,800
A D E K A	2,300	1,511.00	3,475,300
日油	4,000	1,044.00	4,176,000
新日本理化	500	159.00	79,500
ハリマ化成グループ	600	643.00	385,800
花王	13,900	5,282.00	73,419,800
第一工業製薬	1,000	335.00	335,000
ニイタカ	100	1,487.00	148,700
三洋化成工業	300	4,585.00	1,375,500
有機合成薬品工業	1,000	223.00	223,000
大日本塗料	3,000	220.00	660,000
日本ペイントホールディングス	4,200	3,435.00	14,427,000
関西ペイント	5,700	2,201.00	12,545,700
中国塗料	1,600	733.00	1,172,800
日本特殊塗料	400	1,395.00	558,000
藤倉化成	800	614.00	491,200
太陽ホールディングス	500	3,890.00	1,945,000
D I C	2,200	3,155.00	6,941,000
サカタインクス	1,100	1,367.00	1,503,700
東洋インキ S C ホールディングス	6,000	490.00	2,940,000
T & K T O K A	400	976.00	390,400
富士フイルムホールディングス	10,900	3,981.00	43,392,900

資生堂	10,400	2,637.50	27,430,000
ライオン	7,000	1,895.00	13,265,000
高砂香料工業	400	2,782.00	1,112,800
マンダム	500	4,745.00	2,372,500
ミルボン	300	4,715.00	1,414,500
ファンケル	1,100	1,524.00	1,676,400
コーセー	900	8,570.00	7,713,000
コタ	200	1,219.00	243,800
シーズ・ホールディングス	700	2,917.00	2,041,900
ポーラ・オルビスホールディングス	600	8,080.00	4,848,000
ノエビアホールディングス	300	3,135.00	940,500
エステー	400	1,263.00	505,200
コニシ	900	1,233.00	1,109,700
長谷川香料	700	1,850.00	1,295,000
星光P M C	300	1,129.00	338,700
小林製薬	1,500	5,100.00	7,650,000
荒川化学工業	500	1,502.00	751,000
メック	400	973.00	389,200
日本高純度化学	200	2,426.00	485,200
タカラバイオ	1,200	1,458.00	1,749,600
J C U	200	4,890.00	978,000
新田ゼラチン	400	707.00	282,800
デクセリアルズ	1,400	821.00	1,149,400
アース製薬	400	4,805.00	1,922,000
イハラケミカル工業	800	889.00	711,200
北興化学工業	1,000	352.00	352,000
大成ラミック	200	2,911.00	582,200
クミアイ化学工業	1,100	580.00	638,000
日本農薬	1,300	570.00	741,000
アキレス	400	1,478.00	591,200
有沢製作所	900	559.00	503,100
日東電工	3,900	7,241.00	28,239,900
レック	200	2,780.00	556,000
きもと	700	237.00	165,900
藤森工業	400	2,525.00	1,010,000
前澤化成工業	400	1,134.00	453,600
J S P	200	2,566.00	513,200
エフピコ	500	5,610.00	2,805,000
天馬	400	1,769.00	707,600
信越ポリマー	1,000	700.00	700,000
東リ	1,700	366.00	622,200
ニフコ	1,000	6,020.00	6,020,000

日本バルカー工業	400	1,388.00	555,200
ユニ・チャーム	11,100	2,388.50	26,512,350
協和発酵キリン	6,600	1,507.00	9,946,200
武田薬品工業	20,500	4,540.00	93,070,000
アステラス製薬	55,800	1,483.00	82,751,400
大日本住友製薬	3,900	1,716.00	6,692,400
塩野義製薬	7,400	5,092.00	37,680,800
田辺三菱製薬	6,400	2,026.00	12,966,400
わかもと製薬	1,000	225.00	225,000
あすか製薬	600	1,733.00	1,039,800
日本新薬	1,300	5,140.00	6,682,000
ピオフェルミン製薬	100	2,626.00	262,600
中外製薬	5,500	3,335.00	18,342,500
科研製薬	1,000	6,370.00	6,370,000
エーザイ	6,700	6,435.00	43,114,500
ロート製薬	2,700	1,791.00	4,835,700
小野薬品工業	12,400	2,644.50	32,791,800
久光製薬	1,500	5,540.00	8,310,000
持田製薬	400	8,050.00	3,220,000
参天製薬	10,100	1,447.00	14,614,700
扶桑薬品工業	200	2,671.00	534,200
日本ケミファ	100	4,600.00	460,000
ツムラ	1,800	3,030.00	5,454,000
日医工	1,300	1,780.00	2,314,000
キッセイ薬品工業	1,000	2,688.00	2,688,000
生化学工業	1,000	1,620.00	1,620,000
栄研化学	500	2,759.00	1,379,500
鳥居薬品	400	2,345.00	938,000
JCRファーマ	400	2,735.00	1,094,000
東和薬品	300	3,805.00	1,141,500
富士製薬工業	200	2,462.00	492,400
沢井製薬	900	6,500.00	5,850,000
ゼリア新薬工業	1,100	1,696.00	1,865,600
第一三共	16,100	2,307.50	37,150,750
キョーリン製薬ホールディングス	1,300	2,259.00	2,936,700
大幸薬品	300	1,615.00	484,500
ダイト	300	2,230.00	669,000
大塚ホールディングス	11,800	4,542.00	53,595,600
大正製薬ホールディングス	1,200	9,580.00	11,496,000
ペプチドリーム	900	5,080.00	4,572,000
日本コークス工業	5,200	90.00	468,000
昭和シェル石油	4,900	958.00	4,694,200

ニチレキ	700	824.00	576,800
東燃ゼネラル石油	9,000	1,003.00	9,027,000
ユシロ化学工業	300	1,424.00	427,200
ピーピー・カストロール	300	1,367.00	410,100
富士石油	1,400	312.00	436,800
MORESCO	100	1,482.00	148,200
出光興産	2,600	2,325.00	6,045,000
JXホールディングス	60,700	404.40	24,547,080
コスモエネルギーホールディングス	1,700	1,324.00	2,250,800
横浜ゴム	3,300	1,808.00	5,966,400
東洋ゴム工業	2,900	1,585.00	4,596,500
ブリヂストン	18,500	3,892.00	72,002,000
住友ゴム工業	5,100	1,724.00	8,792,400
藤倉ゴム工業	400	562.00	224,800
オカモト	2,000	1,138.00	2,276,000
フコク	300	820.00	246,000
ニッタ	500	2,667.00	1,333,500
住友理工	1,000	998.00	998,000
三ツ星ベルト	1,000	858.00	858,000
バンドー化学	1,000	995.00	995,000
日東紡績	4,000	378.00	1,512,000
旭硝子	27,000	708.00	19,116,000
日本板硝子	2,500	805.00	2,012,500
石塚硝子	1,000	188.00	188,000
日本山村硝子	2,000	194.00	388,000
日本電気硝子	11,000	570.00	6,270,000
オハラ	200	600.00	120,000
住友大阪セメント	10,000	423.00	4,230,000
太平洋セメント	33,000	301.00	9,933,000
日本ヒューム	600	678.00	406,800
日本コンクリート工業	900	365.00	328,500
三谷セキサン	300	2,575.00	772,500
アジアパイルホールディングス	700	446.00	312,200
東海カーボン	5,000	362.00	1,810,000
日本カーボン	3,000	215.00	645,000
東洋炭素	300	1,535.00	460,500
ノリタケカンパニーリミテド	300	2,387.00	716,100
TOTO	4,000	4,090.00	16,360,000
日本碍子	6,900	1,944.00	13,413,600
日本特殊陶業	4,700	2,023.00	9,508,100
MARUWA	200	4,150.00	830,000
品川リフラクトリーズ	2,000	228.00	456,000

黒崎播磨	1,000	323.00	323,000
イソライト工業	100	269.00	26,900
東京窯業	1,000	176.00	176,000
ニッカトー	300	387.00	116,100
フジインコーポレーテッド	400	1,827.00	730,800
エーアンドエーマテリアル	2,000	95.00	190,000
ニチアス	3,000	927.00	2,781,000
ニチハ	700	2,462.00	1,723,400
新日鐵住金	24,700	2,147.00	53,030,900
神戸製鋼所	9,400	862.00	8,102,800
合同製鐵	300	1,910.00	573,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	14,900	1,475.50	21,984,950
日新製鋼	2,500	1,364.00	3,410,000
東京製鐵	2,800	731.00	2,046,800
共英製鋼	600	1,907.00	1,144,200
大和工業	1,100	2,900.00	3,190,000
東京鐵鋼	1,000	462.00	462,000
大阪製鐵	300	1,883.00	564,900
淀川製鋼所	800	2,956.00	2,364,800
東洋鋼鈑	1,400	319.00	446,600
丸一鋼管	1,800	3,380.00	6,084,000
モリ工業	200	1,958.00	391,600
大同特殊鋼	9,000	436.00	3,924,000
日本高周波鋼業	3,000	76.00	228,000
日本冶金工業	4,500	155.00	697,500
山陽特殊製鋼	3,000	526.00	1,578,000
愛知製鋼	300	5,020.00	1,506,000
日立金属	5,500	1,343.00	7,386,500
日本金属	200	1,070.00	214,000
大平洋金属	4,000	321.00	1,284,000
新日本電工	3,100	203.00	629,300
栗本鐵工所	300	1,997.00	599,100
日本鑄鉄管	1,000	179.00	179,000
三菱製鋼	4,000	183.00	732,000
日亜鋼業	1,000	240.00	240,000
日本精線	1,000	509.00	509,000
シンニッタン	800	500.00	400,000
新家工業	2,000	146.00	292,000
大紀アルミニウム工業所	1,000	443.00	443,000
日本輕金属ホールディングス	12,000	237.00	2,844,000
三井金属鉱業	15,000	235.00	3,525,000
東邦亜鉛	3,000	390.00	1,170,000

三菱マテリアル	3,400	3,015.00	10,251,000
住友金属鉱山	14,000	1,372.50	19,215,000
DOWAホールディングス	6,000	785.00	4,710,000
古河機械金属	8,000	155.00	1,240,000
エス・サイエンス	1,300	35.00	45,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	600	1,333.00	799,800
東邦チタニウム	1,000	679.00	679,000
UACJ	7,000	333.00	2,331,000
古河電気工業	1,800	3,150.00	5,670,000
住友電気工業	20,600	1,388.00	28,592,800
フジクラ	7,200	602.00	4,334,400
昭和電線ホールディングス	7,000	74.00	518,000
タツタ電線	1,100	430.00	473,000
沖電線	1,000	216.00	216,000
カナレ電気	100	1,981.00	198,100
リョービ	3,000	428.00	1,284,000
アーレスティ	600	1,141.00	684,600
アサヒホールディングス	800	1,934.00	1,547,200
稲葉製作所	300	1,314.00	394,200
宮地エンジニアリンググループ	2,000	171.00	342,000
トーカロ	400	2,327.00	930,800
アルファC o	200	993.00	198,600
SUMCO	5,600	1,111.00	6,221,600
川田テクノロジーズ	100	4,630.00	463,000
東洋製罐グループホールディングス	3,900	1,955.00	7,624,500
ホッカンホールディングス	1,000	384.00	384,000
コロナ	300	1,104.00	331,200
横河ブリッジホールディングス	1,000	1,170.00	1,170,000
駒井ハルテック	100	2,001.00	200,100
高田機工	1,000	210.00	210,000
三和ホールディングス	5,400	1,049.00	5,664,600
文化シャッター	1,500	858.00	1,287,000
三協立山	700	1,633.00	1,143,100
アルインコ	300	975.00	292,500
東洋シャッター	100	525.00	52,500
LIXILグループ	7,600	2,397.00	18,217,200
日本フィルコン	500	558.00	279,000
ノーリツ	1,100	2,077.00	2,284,700
長府製作所	600	2,608.00	1,564,800
リンナイ	900	9,290.00	8,361,000
ダイニチ工業	300	656.00	196,800
日東精工	1,000	405.00	405,000

三洋工業	1,000	179.00	179,000
岡部	1,100	948.00	1,042,800
ジーテクト	600	2,100.00	1,260,000
中国工業	100	683.00	68,300
東プレ	1,000	2,527.00	2,527,000
高周波熱錬	1,000	840.00	840,000
東京製網	400	1,735.00	694,000
モリテック スチール	200	256.00	51,200
パイオラックス	300	6,530.00	1,959,000
日本発條	5,100	1,001.00	5,105,100
中央発條	1,000	295.00	295,000
アドバネクス	200	1,239.00	247,800
三益半導体工業	400	1,265.00	506,000
日本製鋼所	1,800	2,315.00	4,167,000
三浦工業	2,200	1,731.00	3,808,200
タクマ	2,000	967.00	1,934,000
ツガミ	2,000	571.00	1,142,000
オークマ	4,000	885.00	3,540,000
東芝機械	3,000	379.00	1,137,000
アマダホールディングス	7,300	1,207.00	8,811,100
アイダエンジニアリング	1,600	905.00	1,448,000
滝澤鉄工所	2,000	140.00	280,000
富士機械製造	1,700	1,330.00	2,261,000
牧野フライス製作所	3,000	663.00	1,989,000
オーエスジー	2,500	2,254.00	5,635,000
ダイジェット工業	1,000	150.00	150,000
旭ダイヤモンド工業	1,600	775.00	1,240,000
D M G 森精機	3,200	1,105.00	3,536,000
ソディック	1,400	753.00	1,054,200
ディスコ	600	12,580.00	7,548,000
日東工器	300	2,364.00	709,200
パンチ工業	100	870.00	87,000
豊和工業	400	526.00	210,400
O K K	2,000	105.00	210,000
東洋機械金属	600	407.00	244,200
津田駒工業	1,000	147.00	147,000
島精機製作所	700	3,390.00	2,373,000
N C ホールディングス	200	874.00	174,800
フリーー	100	3,255.00	325,500
日阪製作所	800	798.00	638,400
やまびこ	1,000	1,050.00	1,050,000
ペガサスミシン製造	700	654.00	457,800

ナブテスコ	2,800	2,935.00	8,218,000
三井海洋開発	600	1,743.00	1,045,800
レオン自動機	700	821.00	574,700
S M C	1,600	30,700.00	49,120,000
新川	500	726.00	363,000
ホソカワミクロン	1,000	633.00	633,000
ユニオンツール	200	2,668.00	533,600
オイレス工業	700	1,862.00	1,303,400
日精エー・エス・ピー機械	200	1,949.00	389,800
サトーホールディングス	700	2,077.00	1,453,900
日本エアテック	300	625.00	187,500
日精樹脂工業	400	832.00	332,800
ワイエイシイ	300	1,189.00	356,700
小松製作所	25,200	2,259.50	56,939,400
住友重機械工業	16,000	601.00	9,616,000
日立建機	2,400	2,179.00	5,229,600
日工	200	1,688.00	337,600
巴工業	200	1,528.00	305,600
井関農機	6,000	247.00	1,482,000
T O W A	500	1,153.00	576,500
丸山製作所	2,000	169.00	338,000
北川鉄工所	200	1,731.00	346,200
ローツェ	200	1,774.00	354,800
クボタ	26,300	1,664.50	43,776,350
荏原実業	200	1,267.00	253,400
三菱化工機	2,000	202.00	404,000
月島機械	1,000	1,145.00	1,145,000
帝国電機製作所	400	794.00	317,600
新東工業	1,200	881.00	1,057,200
澁谷工業	400	2,110.00	844,000
アイチ コーポレーション	800	842.00	673,600
小森コーポレーション	1,300	1,349.00	1,753,700
鶴見製作所	400	1,482.00	592,800
住友精密工業	1,000	314.00	314,000
酒井重工業	1,000	211.00	211,000
荏原製作所	2,300	3,050.00	7,015,000
石井鐵工所	100	1,521.00	152,100
西島製作所	500	1,116.00	558,000
ダイキン工業	7,100	10,055.00	71,390,500
オルガノ	1,000	443.00	443,000
トーヨーカネツ	2,000	229.00	458,000
栗田工業	3,100	2,403.00	7,449,300

椿本チエイン	3,000	827.00	2,481,000
大同工業	1,000	240.00	240,000
木村化工機	600	347.00	208,200
アネスト岩田	900	1,120.00	1,008,000
ダイフク	2,600	1,912.00	4,971,200
サムコ	100	910.00	91,000
加藤製作所	300	2,616.00	784,800
油研工業	1,000	181.00	181,000
タダノ	2,700	1,088.00	2,937,600
フジテック	1,500	1,170.00	1,755,000
C K D	1,600	1,281.00	2,049,600
キトー	700	959.00	671,300
平和	1,600	2,445.00	3,912,000
理想科学工業	500	1,769.00	884,500
S A N K Y O	1,400	3,670.00	5,138,000
日本金銭機械	500	1,615.00	807,500
マースエンジニアリング	300	1,999.00	599,700
福島工業	300	3,365.00	1,009,500
オーイズミ	400	704.00	281,600
ダイコク電機	200	1,564.00	312,800
竹内製作所	1,000	1,943.00	1,943,000
アマノ	1,600	1,939.00	3,102,400
J U K I	800	899.00	719,200
サンデンホールディングス	3,000	318.00	954,000
蛇の目ミシン工業	500	813.00	406,500
マックス	1,000	1,297.00	1,297,000
グローリー	1,700	3,465.00	5,890,500
新晃工業	400	1,287.00	514,800
大和冷機工業	800	900.00	720,000
セガサミーホールディングス	5,200	1,629.00	8,470,800
日本ピストンリング	200	1,540.00	308,000
リケン	300	3,725.00	1,117,500
T P R	600	3,035.00	1,821,000
ツバキ・ナカシマ	600	1,706.00	1,023,600
ホシザキ	1,100	9,280.00	10,208,000
大豊工業	400	1,510.00	604,000
日本精工	10,700	1,106.00	11,834,200
N T N	12,000	353.00	4,236,000
ジェイテクト	5,600	1,563.00	8,752,800
不二越	5,000	398.00	1,990,000
日本トムソン	1,700	376.00	639,200
T H K	3,700	2,191.00	8,106,700

ユーシン精機	200	2,434.00	486,800
前澤給装工業	200	1,376.00	275,200
イーグル工業	600	1,482.00	889,200
前澤工業	700	346.00	242,200
日本ピラー工業	500	1,076.00	538,000
キット	2,500	647.00	1,617,500
日立工機	1,500	908.00	1,362,000
マキタ	3,400	7,340.00	24,956,000
日立造船	4,100	536.00	2,197,600
三菱重工業	87,000	426.30	37,088,100
I H I	40,000	279.00	11,160,000
スター精密	900	1,460.00	1,314,000
日清紡ホールディングス	2,900	1,091.00	3,163,900
イビデン	3,700	1,360.00	5,032,000
コニカミノルタ	12,200	923.00	11,260,600
ブラザー工業	6,700	1,844.00	12,354,800
ミネベア	8,400	969.00	8,139,600
日立製作所	126,000	548.30	69,085,800
東芝	117,000	375.50	43,933,500
三菱電機	55,700	1,470.50	81,906,850
富士電機	16,000	532.00	8,512,000
東洋電機製造	1,000	297.00	297,000
安川電機	6,000	1,670.00	10,020,000
シンフォニアテクノロジー	4,000	194.00	776,000
明電舎	5,000	327.00	1,635,000
オリジン電気	1,000	269.00	269,000
山洋電気	1,000	712.00	712,000
デンヨー	500	1,291.00	645,500
東芝テック	3,000	457.00	1,371,000
芝浦メカトロニクス	1,000	244.00	244,000
マブチモーター	1,500	6,340.00	9,510,000
日本電産	6,800	10,150.00	69,020,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	2,358.00	235,800
東光高岳	300	1,991.00	597,300
ダブル・スコープ	500	1,817.00	908,500
ダイヘン	3,000	607.00	1,821,000
田淵電機	600	324.00	194,400
JVCケンウッド	3,800	317.00	1,204,600
ミマキエンジニアリング	300	538.00	161,400
第一精工	200	1,149.00	229,800
日新電機	1,000	1,302.00	1,302,000
大崎電気工業	1,000	963.00	963,000

オムロン	5,600	3,985.00	22,316,000
日東工業	800	1,515.00	1,212,000
I D E C	700	967.00	676,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	10,000	448.00	4,480,000
サクサホールディングス	2,000	213.00	426,000
メルコホールディングス	300	2,884.00	865,200
テクノメディカ	200	1,778.00	355,600
日本電気	72,000	288.00	20,736,000
富士通	50,000	611.60	30,580,000
沖電気工業	2,300	1,350.00	3,105,000
岩崎通信機	3,000	75.00	225,000
電気興業	1,000	565.00	565,000
サンケン電気	3,000	356.00	1,068,000
ナカヨ	1,000	361.00	361,000
アイホン	300	1,795.00	538,500
ルネサスエレクトロニクス	2,700	743.00	2,006,100
セイコーエプソン	7,800	2,138.00	16,676,400
ワコム	4,100	306.00	1,254,600
アルバック	1,000	3,205.00	3,205,000
アクセル	300	782.00	234,600
E I Z O	500	3,170.00	1,585,000
ジャパンディスプレイ	9,700	206.00	1,998,200
日本信号	1,500	910.00	1,365,000
京三製作所	1,000	389.00	389,000
能美防災	600	1,646.00	987,600
ホーチキ	400	1,262.00	504,800
エレコム	400	2,040.00	816,000
日本無線	200	1,350.00	270,000
パナソニック	59,700	995.00	59,401,500
アンリツ	3,900	546.00	2,129,400
富士通ゼネラル	2,000	2,364.00	4,728,000
日立国際電気	1,400	2,131.00	2,983,400
ソニー	36,900	3,149.00	116,198,100
T D K	2,900	7,050.00	20,445,000
帝国通信工業	1,000	160.00	160,000
ミツミ電機	2,000	579.00	1,158,000
タムラ製作所	2,000	424.00	848,000
アルプス電気	4,800	2,441.00	11,716,800
池上通信機	2,000	131.00	262,000
パイオニア	7,900	249.00	1,967,100
日本電波工業	500	828.00	414,000
鈴木	100	509.00	50,900

日本トリム	100	4,445.00	444,500
ローランド ディー.ジー.	300	2,349.00	704,700
フォスター電機	600	1,810.00	1,086,000
クラリオン	3,000	345.00	1,035,000
S M K	1,000	403.00	403,000
ヨコオ	600	678.00	406,800
ホシデン	1,600	827.00	1,323,200
ヒロセ電機	800	13,470.00	10,776,000
日本航空電子工業	2,000	1,432.00	2,864,000
T O A	600	938.00	562,800
日立マクセル	800	1,902.00	1,521,600
古野電気	700	758.00	530,600
ユニデンホールディングス	2,000	148.00	296,000
アルパイン	1,200	1,399.00	1,678,800
スミダコーポレーション	400	1,046.00	418,400
アイコム	300	1,938.00	581,400
リオン	100	1,443.00	144,300
船井電機	500	859.00	429,500
横河電機	5,600	1,479.00	8,282,400
新電元工業	2,000	424.00	848,000
アズビル	1,600	3,085.00	4,936,000
東亜ディーケーケー	200	485.00	97,000
日本光電工業	2,200	2,621.00	5,766,200
チノー	300	1,031.00	309,300
共和電業	700	375.00	262,500
日本電子材料	200	555.00	111,000
堀場製作所	1,000	4,980.00	4,980,000
アドバンテスト	3,600	1,477.00	5,317,200
小野測器	400	872.00	348,800
エスペック	500	1,229.00	614,500
パナソニック デバイス S U N X	500	619.00	309,500
キーエンス	1,200	74,430.00	89,316,000
日置電機	300	2,004.00	601,200
シスメックス	4,100	7,100.00	29,110,000
日本マイクロニクス	1,000	1,189.00	1,189,000
メガチップス	500	2,235.00	1,117,500
O B A R A G R O U P	300	4,495.00	1,348,500
コーセル	700	1,205.00	843,500
イリソ電子工業	200	6,150.00	1,230,000
新日本無線	600	321.00	192,600
オブテックス	400	2,572.00	1,028,800
千代田インテグレ	300	2,168.00	650,400

アイ・オー・データ機器	200	973.00	194,600
レーザーテック	600	1,898.00	1,138,800
スタンレー電気	3,700	2,959.00	10,948,300
岩崎電気	2,000	163.00	326,000
ウシオ電機	3,100	1,342.00	4,160,200
ハリオス テクノ ホールディング	600	426.00	255,600
日本セラミック	400	2,048.00	819,200
遠藤照明	300	835.00	250,500
日本デジタル研究所	500	2,411.00	1,205,500
双信電機	300	273.00	81,900
山一電機	500	875.00	437,500
図研	400	1,043.00	417,200
日本電子	2,000	443.00	886,000
カシオ計算機	4,400	1,323.00	5,821,200
ファナック	5,300	18,840.00	99,852,000
日本シイエムケイ	1,100	559.00	614,900
エンプラス	200	3,275.00	655,000
大真空	200	1,090.00	218,000
ローム	2,500	5,910.00	14,775,000
浜松ホトニクス	4,100	3,065.00	12,566,500
三井ハイテック	800	677.00	541,600
新光電気工業	2,000	658.00	1,316,000
京セラ	8,600	5,125.00	44,075,000
太陽誘電	2,600	1,065.00	2,769,000
村田製作所	5,500	13,465.00	74,057,500
ユーシン	700	744.00	520,800
双葉電子工業	900	1,746.00	1,571,400
北陸電気工業	2,000	126.00	252,000
ニチコン	1,700	926.00	1,574,200
日本ケミコン	5,000	175.00	875,000
K O A	700	938.00	656,600
市光工業	2,000	303.00	606,000
小糸製作所	3,100	5,420.00	16,802,000
ミツバ	1,000	1,532.00	1,532,000
S C R E E Nホールディングス	1,100	7,070.00	7,777,000
キャノン電子	500	1,610.00	805,000
キャノン	28,100	2,951.50	82,937,150
リコー	15,700	851.00	13,360,700
M U T O Hホールディングス	1,000	237.00	237,000
東京エレクトロン	3,500	9,590.00	33,565,000
トヨタ紡織	1,800	2,724.00	4,903,200
芦森工業	2,000	160.00	320,000

ユニプレス	1,000	1,912.00	1,912,000	
豊田自動織機	4,800	4,670.00	22,416,000	
モリタホールディングス	900	1,547.00	1,392,300	
三櫻工業	600	718.00	430,800	
デンソー	12,900	4,512.00	58,204,800	
東海理化電機製作所	1,400	1,967.00	2,753,800	
三井造船	19,000	144.00	2,736,000	
川崎重工業	41,000	293.00	12,013,000	
名村造船所	1,600	609.00	974,400	
サノヤスホールディングス	300	266.00	79,800	
日本車輛製造	2,000	263.00	526,000	
ニチユ三菱フォークリフト	600	695.00	417,000	
近畿車輛	100	2,393.00	239,300	
日産自動車	62,500	1,029.00	64,312,500	
いすゞ自動車	15,100	1,256.50	18,973,150	
トヨタ自動車	64,900	5,810.00	377,069,000	代用有価証券 2,300株
日野自動車	7,400	1,140.00	8,436,000	
三菱自動車工業	19,100	544.00	10,390,400	
エフテック	200	1,350.00	270,000	
レシップホールディングス	200	860.00	172,000	
武蔵精密工業	600	2,481.00	1,488,600	
日産車体	2,300	1,052.00	2,419,600	
新明和工業	2,000	874.00	1,748,000	
極東開発工業	1,000	1,273.00	1,273,000	
日信工業	1,200	1,549.00	1,858,800	
トピー工業	400	2,508.00	1,003,200	
ティラド	2,000	239.00	478,000	
曙ブレーキ工業	2,300	263.00	604,900	
タチエス	900	1,718.00	1,546,200	
N O K	2,500	2,326.00	5,815,000	
フタバ産業	1,500	661.00	991,500	
K Y B	6,000	464.00	2,784,000	
大同メタル工業	600	1,118.00	670,800	
プレス工業	2,700	495.00	1,336,500	
ミクニ	500	350.00	175,000	
カルソニックカンセイ	4,000	1,330.00	5,320,000	
太平洋工業	1,100	1,275.00	1,402,500	
ケーヒン	1,200	1,677.00	2,012,400	
河西工業	700	1,178.00	824,600	
アイシン精機	4,800	4,565.00	21,912,000	
富士機工	900	381.00	342,900	
マツダ	16,500	1,616.50	26,672,250	

今仙電機製作所	500	877.00	438,500	
本田技研工業	47,000	2,941.00	138,227,000	代用有価証券 4,700株
スズキ	10,300	3,831.00	39,459,300	
富士重工業	16,200	3,933.00	63,714,600	
安永	200	520.00	104,000	
ヤマハ発動機	7,400	2,393.00	17,708,200	
ショーワ	1,300	617.00	802,100	
T B K	700	429.00	300,300	
エクセディ	700	2,943.00	2,060,100	
豊田合成	1,700	2,341.00	3,979,700	
愛三工業	900	850.00	765,000	
ヨロズ	400	1,662.00	664,800	
エフ・シー・シー	900	1,929.00	1,736,100	
シマノ	2,100	17,880.00	37,548,000	
タカタ	900	356.00	320,400	
テイ・エス テック	1,200	2,735.00	3,282,000	
ジャムコ	300	1,937.00	581,100	
テルモ	8,000	4,065.00	32,520,000	
クリエートメディック	200	926.00	185,200	
日機装	1,800	892.00	1,605,600	
島津製作所	7,000	1,488.00	10,416,000	
J M S	1,000	271.00	271,000	
長野計器	400	634.00	253,600	
ブイ・テクノロジー	100	12,320.00	1,232,000	
東京計器	2,000	176.00	352,000	
愛知時計電機	100	3,375.00	337,500	
オーバル	400	255.00	102,000	
東京精密	1,000	2,833.00	2,833,000	
マニー	700	2,359.00	1,651,300	
ニコン	9,100	1,626.00	14,796,600	
トプコン	2,600	1,718.00	4,466,800	
オリンパス	8,300	3,525.00	29,257,500	
理研計器	500	1,273.00	636,500	
タムロン	500	1,671.00	835,500	
H O Y A	11,000	4,312.00	47,432,000	
ノーリツ鋼機	500	776.00	388,000	
エー・アンド・デイ	600	426.00	255,600	
シチズン時計	5,800	580.00	3,364,000	
リズム時計工業	3,000	182.00	546,000	
大研医器	400	792.00	316,800	
メニコン	400	2,943.00	1,177,200	
松風	300	1,257.00	377,100	

セイコーホールディングス	4,000	336.00	1,344,000
ニプロ	3,600	1,262.00	4,543,200
スノーピーク	100	3,450.00	345,000
パラマウントベッドホールディングス	500	4,100.00	2,050,000
S H O - B I	100	418.00	41,800
ニホンフラッシュ	200	1,137.00	227,400
前田工織	500	1,087.00	543,500
永大産業	1,000	463.00	463,000
アートネイチャー	400	606.00	242,400
ダンロップスポーツ	300	1,007.00	302,100
バンダイナムコホールディングス	5,800	3,055.00	17,719,000
アイフィスジャパン	100	418.00	41,800
共立印刷	900	304.00	273,600
S H O E I	200	1,896.00	379,200
フランスベッドホールディングス	700	888.00	621,600
パイロットコーポレーション	900	4,530.00	4,077,000
萩原工業	100	2,422.00	242,200
トッパン・フォームズ	1,000	1,036.00	1,036,000
フジシールインターナショナル	600	4,185.00	2,511,000
タカラトミー	2,000	1,098.00	2,196,000
廣済堂	700	306.00	214,200
A s - m e エステール	100	646.00	64,600
タカノ	300	746.00	223,800
プロネクサス	500	1,000.00	500,000
ホクシン	400	207.00	82,800
ウッドワン	1,000	260.00	260,000
大建工業	400	2,003.00	801,200
凸版印刷	15,000	968.00	14,520,000
大日本印刷	15,000	1,041.00	15,615,000
図書印刷	1,000	456.00	456,000
共同印刷	2,000	350.00	700,000
日本写真印刷	900	2,483.00	2,234,700
光村印刷	1,000	217.00	217,000
宝印刷	400	1,440.00	576,000
アシックス	5,200	2,318.00	12,053,600
ツツミ	300	1,658.00	497,400
小松ウオール工業	200	1,705.00	341,000
ヤマハ	3,500	3,735.00	13,072,500
河合楽器製作所	200	2,038.00	407,600
クリナップ	600	876.00	525,600
ピジョン	3,200	2,846.00	9,107,200
兼松サステック	1,000	159.00	159,000

キングジム	500	833.00	416,500
リンテック	1,200	2,294.00	2,752,800
T A S A K I	100	1,452.00	145,200
イトーキ	1,100	637.00	700,700
任天堂	3,200	24,535.00	78,512,000
三菱鉛筆	400	5,330.00	2,132,000
タカラスタANDARD	1,100	1,798.00	1,977,800
コクヨ	2,700	1,338.00	3,612,600
ナカバヤシ	2,000	237.00	474,000
岡村製作所	1,800	980.00	1,764,000
美津濃	3,000	572.00	1,716,000
アデランス	1,000	618.00	618,000
東京電力ホールディングス	44,400	410.00	18,204,000
中部電力	17,200	1,534.50	26,393,400
関西電力	21,300	1,027.50	21,885,750
中国電力	7,200	1,192.00	8,582,400
北陸電力	5,200	1,166.00	6,063,200
東北電力	13,000	1,249.00	16,237,000
四国電力	4,700	1,003.00	4,714,100
九州電力	11,500	1,062.00	12,213,000
北海道電力	4,900	797.00	3,905,300
沖縄電力	700	2,410.00	1,687,000
電源開発	4,200	2,259.00	9,487,800
エフオン	200	715.00	143,000
イーレックス	200	3,120.00	624,000
東京瓦斯	56,000	479.70	26,863,200
大阪瓦斯	51,000	434.10	22,139,100
東邦瓦斯	13,000	928.00	12,064,000
北海道瓦斯	1,000	268.00	268,000
広島ガス	900	362.00	325,800
西部瓦斯	6,000	244.00	1,464,000
静岡ガス	1,600	822.00	1,315,200
メタウォーター	300	2,780.00	834,000
S B S ホールディングス	500	932.00	466,000
東武鉄道	28,000	522.00	14,616,000
相鉄ホールディングス	8,000	488.00	3,904,000
東京急行電鉄	28,000	783.00	21,924,000
京浜急行電鉄	14,000	1,050.00	14,700,000
小田急電鉄	8,400	2,095.00	17,598,000
京王電鉄	15,000	867.00	13,005,000
京成電鉄	3,900	2,508.00	9,781,200
富士急行	1,000	1,034.00	1,034,000

新京成電鉄	1,000	405.00	405,000
東日本旅客鉄道	10,100	9,088.00	91,788,800
西日本旅客鉄道	5,000	6,367.00	31,835,000
東海旅客鉄道	4,300	17,510.00	75,293,000
西武ホールディングス	7,200	1,776.00	12,787,200
鴻池運輸	700	1,404.00	982,800
西日本鉄道	6,000	483.00	2,898,000
ハマキョウレックス	300	1,907.00	572,100
サカイ引越センター	200	2,314.00	462,800
近鉄グループホールディングス	52,000	416.00	21,632,000
阪急阪神ホールディングス	6,600	3,450.00	22,770,000
南海電気鉄道	11,000	491.00	5,401,000
京阪ホールディングス	12,000	681.00	8,172,000
神戸電鉄	1,000	366.00	366,000
名古屋鉄道	19,000	552.00	10,488,000
山陽電気鉄道	2,000	510.00	1,020,000
日本通運	20,000	539.00	10,780,000
ヤマトホールディングス	9,300	2,234.50	20,780,850
山九	7,000	619.00	4,333,000
丸運	300	240.00	72,000
丸全昭和運輸	2,000	430.00	860,000
センコー	2,300	750.00	1,725,000
トナミホールディングス	1,000	282.00	282,000
ニッコンホールディングス	1,700	2,179.00	3,704,300
日本石油輸送	100	2,267.00	226,700
福山通運	3,000	583.00	1,749,000
セイノーホールディングス	3,700	1,174.00	4,343,800
神奈川中央交通	1,000	743.00	743,000
日立物流	1,100	2,143.00	2,357,300
丸和運輸機関	100	2,993.00	299,300
C & F ロジホールディングス	500	1,031.00	515,500
日本郵船	44,000	190.00	8,360,000
商船三井	27,000	247.00	6,669,000
川崎汽船	20,000	242.00	4,840,000
N S ユナイテッド海運	2,000	142.00	284,000
明治海運	600	360.00	216,000
飯野海運	2,700	374.00	1,009,800
共栄タンカー	1,000	192.00	192,000
乾汽船	300	991.00	297,300
日本航空	9,400	3,146.00	29,572,400
A N A ホールディングス	97,000	293.30	28,450,100
パスコ	1,000	368.00	368,000

トランコム	100	5,560.00	556,000
日新	2,000	353.00	706,000
三菱倉庫	3,000	1,410.00	4,230,000
三井倉庫ホールディングス	3,000	301.00	903,000
住友倉庫	4,000	565.00	2,260,000
澁澤倉庫	1,000	301.00	301,000
東陽倉庫	1,100	268.00	294,800
日本トランスシティ	1,000	387.00	387,000
ケイヒン	1,000	142.00	142,000
中央倉庫	200	1,000.00	200,000
安田倉庫	400	680.00	272,000
東洋埠頭	2,000	171.00	342,000
宇徳	300	373.00	111,900
上組	6,000	906.00	5,436,000
サンリツ	200	486.00	97,200
キューソー流通システム	200	2,281.00	456,200
郵船ロジスティクス	500	1,022.00	511,000
近鉄エクスプレス	900	1,381.00	1,242,900
エーアイティー	200	917.00	183,400
内外トランスライン	100	992.00	99,200
NEC ネットズエスアイ	600	1,963.00	1,177,800
システナ	400	1,769.00	707,600
デジタルアーツ	200	2,651.00	530,200
新日鉄住金ソリューションズ	900	1,959.00	1,763,100
キューブシステム	200	657.00	131,400
コア	300	1,184.00	355,200
ソフトクリエイイトホールディングス	100	1,178.00	117,800
T I S	1,700	2,307.00	3,921,900
電算システム	100	1,700.00	170,000
グリー	3,100	608.00	1,884,800
コーエーテクモホールディングス	1,200	1,928.00	2,313,600
三菱総合研究所	200	3,125.00	625,000
A G S	100	1,130.00	113,000
ファインデックス	400	890.00	356,000
ヒト・コミュニケーションズ	200	1,473.00	294,600
ブレインパッド	100	940.00	94,000
K L a b	1,000	621.00	621,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	300	855.00	256,500
イーブクイニシアティブジャパン	100	852.00	85,200
ネクソン	5,700	1,670.00	9,519,000
アイスタイル	800	653.00	522,400
エイチーム	300	2,241.00	672,300

コロプラ	1,400	1,417.00	1,983,800
モバイルクリエイト	200	356.00	71,200
ブロードリーフ	600	1,019.00	611,400
ハーツユナイテッドグループ	300	1,843.00	552,900
メディアドゥ	100	1,400.00	140,000
ブイキューブ	300	779.00	233,700
サイバーリンクス	100	903.00	90,300
ディー・エル・イー	100	717.00	71,700
VOYAGE GROUP	200	908.00	181,600
ティーガイア	500	1,602.00	801,000
日本アジアグループ	500	357.00	178,500
豆蔵ホールディングス	300	1,023.00	306,900
テクマトリックス	200	1,883.00	376,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	10,800	253.00	2,732,400
GMOペイメントゲートウェイ	400	5,010.00	2,004,000
ザッパラス	400	390.00	156,000
インターネットイニシアティブ	800	1,628.00	1,302,400
さくらインターネット	300	951.00	285,300
GMOクラウド	100	1,045.00	104,500
SRAホールディングス	300	2,357.00	707,100
フリービット	300	835.00	250,500
サイバーコム	100	827.00	82,700
gumi	500	692.00	346,000
LINE	900	4,015.00	3,613,500
フェイス	200	1,150.00	230,000
ハイマックス	100	1,256.00	125,600
野村総合研究所	3,500	3,565.00	12,477,500
サイバネットシステム	700	661.00	462,700
CEホールディングス	100	1,060.00	106,000
インテージホールディングス	300	1,795.00	538,500
東邦システムサイエンス	100	595.00	59,500
ティー・ワイ・オー	500	150.00	75,000
クレスコ	200	2,184.00	436,800
フジ・メディア・ホールディングス	5,400	1,502.00	8,110,800
オービック	1,800	5,180.00	9,324,000
ジャストシステム	800	1,033.00	826,400
TDCソフトウェアエンジニアリング	400	1,280.00	512,000
ヤフー	36,900	418.00	15,424,200
トレンドマイクロ	2,700	3,585.00	9,679,500
日本オラクル	800	5,570.00	4,456,000
アルファシステムズ	200	1,739.00	347,800
フューチャー	700	711.00	497,700

CAC Holdings	400	863.00	345,200
ソフトバンク・テクノロジー	200	3,110.00	622,000
トーセ	200	759.00	151,800
オービックビジネスコンサルタント	300	4,965.00	1,489,500
伊藤忠テクノソリューションズ	1,100	2,924.00	3,216,400
アイティフォー	800	619.00	495,200
東計電算	100	2,016.00	201,600
エクスネット	100	1,553.00	155,300
大塚商会	1,400	5,300.00	7,420,000
サイボウズ	1,200	424.00	508,800
ソフトブレーン	700	356.00	249,200
電通国際情報サービス	300	1,767.00	530,100
デジタルガレージ	800	1,870.00	1,496,000
EMシステムズ	200	1,548.00	309,600
ウェザーニューズ	200	3,300.00	660,000
C I J	800	497.00	397,600
日本エンタープライズ	300	262.00	78,600
WOWOW	200	2,931.00	586,200
フュージョンパートナー	200	902.00	180,400
日本コロムビア	300	582.00	174,600
イマジカ・ロボット ホールディングス	300	586.00	175,800
ネットワンシステムズ	2,200	742.00	1,632,400
アルゴグラフィックス	200	1,969.00	393,800
マーベラス	900	759.00	683,100
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,000	1,386.00	1,386,000
日本ユニシス	1,400	1,229.00	1,720,600
兼松エレクトロニクス	300	2,205.00	661,500
東京放送ホールディングス	3,400	1,637.00	5,565,800
日本テレビホールディングス	4,700	1,867.00	8,774,900
朝日放送	500	659.00	329,500
テレビ朝日ホールディングス	1,400	2,037.00	2,851,800
スカパーJ S A Tホールディングス	3,300	496.00	1,636,800
テレビ東京ホールディングス	400	2,283.00	913,200
日本BS放送	100	1,000.00	100,000
ワイヤレスゲート	200	1,717.00	343,400
コネクシオ	500	1,398.00	699,000
日本通信	4,200	165.00	693,000
日本電信電話	41,400	4,558.00	188,701,200
K D D I	51,000	3,009.00	153,459,000
光通信	600	9,520.00	5,712,000
N T T ドコモ	38,500	2,555.50	98,386,750
エムティーアイ	800	707.00	565,600

GMOインターネット	1,900	1,344.00	2,553,600	
カドカワ	1,500	1,563.00	2,344,500	
学研ホールディングス	2,000	339.00	678,000	
ゼンリン	700	1,797.00	1,257,900	
昭文社	400	601.00	240,400	
インプレスホールディングス	700	136.00	95,200	
アイネット	400	1,045.00	418,000	
松竹	3,000	1,163.00	3,489,000	
東宝	3,400	3,075.00	10,455,000	
東映	2,000	817.00	1,634,000	
AOI Pro.	300	819.00	245,700	
エヌ・ティ・ティ・データ	3,200	5,610.00	17,952,000	
ピー・シー・エー	100	1,232.00	123,200	
ビジネスブレイン太田昭和	100	967.00	96,700	
D T S	500	2,391.00	1,195,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,000	3,450.00	6,900,000	
シーイーシー	300	1,960.00	588,000	
カプコン	1,200	2,649.00	3,178,800	
ジャステック	500	1,092.00	546,000	
S C S K	1,400	3,800.00	5,320,000	
日本システムウエア	400	1,542.00	616,800	
アイネス	600	1,169.00	701,400	
T K C	500	2,926.00	1,463,000	
富士ソフト	800	2,784.00	2,227,200	
N S D	1,100	1,697.00	1,866,700	
コナミホールディングス	2,300	4,385.00	10,085,500	
福井コンピュータホールディングス	200	2,584.00	516,800	
J B C Cホールディングス	500	669.00	334,500	
ミロク情報サービス	300	2,139.00	641,700	
ソフトバンクグループ	25,300	6,364.00	161,009,200	代用有価証券 2,700株
ハウスイ	1,000	115.00	115,000	
高千穂交易	200	939.00	187,800	
伊藤忠食品	100	4,025.00	402,500	
エレマテック	200	1,738.00	347,600	
J A L U X	200	1,770.00	354,000	
あらた	200	2,457.00	491,400	
トーメンデバイス	100	1,991.00	199,100	
東京エレクトロン デバイス	100	1,500.00	150,000	
フィールズ	400	1,222.00	488,800	
双日	30,400	268.00	8,147,200	
アルフレッサ ホールディングス	6,100	1,781.00	10,864,100	
横浜冷凍	1,300	1,060.00	1,378,000	

神栄	1,000	140.00	140,000
ラサ商事	300	609.00	182,700
アルコニックス	300	1,374.00	412,200
神戸物産	300	3,275.00	982,500
あい ホールディングス	900	2,583.00	2,324,700
ディーブイエックス	200	1,399.00	279,800
ダイワボウホールディングス	4,000	252.00	1,008,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,000	1,366.00	1,366,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	900	1,065.00	958,500
八洲電機	400	568.00	227,200
U K Cホールディングス	300	1,826.00	547,800
O C H Iホールディングス	100	1,069.00	106,900
T O K A Iホールディングス	2,200	712.00	1,566,400
三洋貿易	300	1,298.00	389,400
ミタチ産業	100	617.00	61,700
シップヘルスケアホールディングス	1,000	2,930.00	2,930,000
明治電機工業	200	1,072.00	214,400
デリカフーズ	100	970.00	97,000
コメダホールディングス	700	1,691.00	1,183,700
富士興産	200	420.00	84,000
協栄産業	1,000	136.00	136,000
小野建	400	1,173.00	469,200
佐島電機	400	735.00	294,000
エコートレーディング	100	644.00	64,400
伯東	400	947.00	378,800
コンドーテック	200	786.00	157,200
中山福	400	759.00	303,600
ナガイレーベン	700	2,186.00	1,530,200
三菱食品	600	3,400.00	2,040,000
松田産業	400	1,444.00	577,600
第一興商	800	4,450.00	3,560,000
メディバルホールディングス	5,100	1,510.00	7,701,000
S P K	100	2,142.00	214,200
萩原電気	100	1,951.00	195,100
アズワン	400	4,555.00	1,822,000
尾家産業	200	1,026.00	205,200
シモジマ	400	1,046.00	418,400
ドウシシャ	600	1,974.00	1,184,400
小津産業	100	2,064.00	206,400
高速	400	1,030.00	412,000
たけびし	200	1,079.00	215,800
黒田電気	700	2,088.00	1,461,600

リックス	100	1,369.00	136,900
丸文	500	618.00	309,000
ハビネット	500	1,110.00	555,000
日本ライフライン	200	5,360.00	1,072,000
エクセル	300	1,414.00	424,200
マルカキカイ	200	1,341.00	268,200
I D O M	1,300	538.00	699,400
日本エム・ディ・エム	800	813.00	650,400
進和	300	1,556.00	466,800
エスケイジャパン	200	285.00	57,000
ダイトエレクトロン	300	857.00	257,100
シークス	400	4,110.00	1,644,000
田中商事	200	677.00	135,400
オーハシテクニカ	300	1,357.00	407,100
白銅	300	1,205.00	361,500
伊藤忠商事	37,800	1,365.50	51,615,900
丸紅	50,700	533.20	27,033,240
高島	1,000	169.00	169,000
長瀬産業	3,000	1,309.00	3,927,000
蝶理	300	1,606.00	481,800
豊田通商	5,700	2,477.00	14,118,900
三共生興	1,100	359.00	394,900
兼松	11,000	172.00	1,892,000
ツカモトコーポレーション	1,000	112.00	112,000
三井物産	46,600	1,400.00	65,240,000
日本紙パルプ商事	3,000	351.00	1,053,000
日立ハイテクノロジーズ	1,800	4,360.00	7,848,000
カメイ	700	988.00	691,600
東都水産	100	1,672.00	167,200
O U Gホールディングス	1,000	264.00	264,000
スターゼン	200	5,140.00	1,028,000
山善	2,000	824.00	1,648,000
椿本興業	1,000	309.00	309,000
住友商事	32,500	1,223.50	39,763,750
内田洋行	1,000	427.00	427,000
三菱商事	38,700	2,280.50	88,255,350
第一実業	1,000	610.00	610,000
キャノンマーケティングジャパン	1,500	1,808.00	2,712,000
西華産業	2,000	305.00	610,000
佐藤商事	500	798.00	399,000
菱洋エレクトロ	500	1,274.00	637,000
東京産業	600	396.00	237,600

ユアサ商事	500	2,549.00	1,274,500
神鋼商事	200	1,945.00	389,000
小林産業	200	254.00	50,800
阪和興業	5,000	640.00	3,200,000
カナデン	500	1,003.00	501,500
菱電商事	1,000	676.00	676,000
フルサト工業	300	1,493.00	447,900
岩谷産業	6,000	609.00	3,654,000
すてきナイスグループ	2,000	140.00	280,000
昭光通商	2,000	87.00	174,000
ニチモウ	1,000	165.00	165,000
極東貿易	1,000	208.00	208,000
イワキ	1,000	203.00	203,000
三愛石油	1,400	693.00	970,200
稲畑産業	1,200	1,113.00	1,335,600
G S Iクレオス	2,000	114.00	228,000
明和産業	500	329.00	164,500
ワキタ	1,100	880.00	968,000
東邦ホールディングス	1,600	2,030.00	3,248,000
サンゲツ	1,700	1,887.00	3,207,900
ミツウロコグループホールディングス	800	691.00	552,800
シナネンホールディングス	200	2,019.00	403,800
伊藤忠エネクス	1,100	836.00	919,600
サンリオ	1,600	1,823.00	2,916,800
サンワテクノス	400	866.00	346,400
リョーサン	800	3,200.00	2,560,000
新光商事	600	1,149.00	689,400
トーホー	200	2,399.00	479,800
三信電気	600	915.00	549,000
東陽テクニカ	700	941.00	658,700
モスフードサービス	700	3,470.00	2,429,000
加賀電子	400	1,610.00	644,000
ソーダニッカ	600	483.00	289,800
立花エレテック	400	1,160.00	464,000
フォーバル	200	742.00	148,400
P A L T A C	800	2,576.00	2,060,800
三谷産業	500	328.00	164,000
太平洋興発	2,000	89.00	178,000
ヤマタネ	300	1,364.00	409,200
日鉄住金物産	500	3,795.00	1,897,500
トラスコ中山	600	5,140.00	3,084,000
オートバックスセブン	1,900	1,458.00	2,770,200

加藤産業	800	2,448.00	1,958,400
イノテック	400	488.00	195,200
イエローハット	500	2,265.00	1,132,500
J Kホールディングス	600	542.00	325,200
日伝	200	2,978.00	595,600
北沢産業	600	168.00	100,800
杉本商事	300	1,357.00	407,100
因幡電機産業	700	3,720.00	2,604,000
バイテックホールディングス	100	1,080.00	108,000
ミスミグループ本社	5,800	1,970.00	11,426,000
アルテック	400	246.00	98,400
タキヒヨー	1,000	439.00	439,000
蔵王産業	100	1,330.00	133,000
スズケン	2,300	3,200.00	7,360,000
ジェコス	400	951.00	380,400
ローソン	1,800	7,730.00	13,914,000
サンエー	400	5,560.00	2,224,000
カワチ薬品	400	2,691.00	1,076,400
エービーシー・マート	900	6,450.00	5,805,000
ハードオフコーポレーション	300	1,051.00	315,300
アスクル	600	4,345.00	2,607,000
ゲオホールディングス	900	1,292.00	1,162,800
アダストリア	800	2,895.00	2,316,000
ジーフット	300	778.00	233,400
くらコーポレーション	300	5,050.00	1,515,000
キャンドゥ	300	1,831.00	549,300
パルグループホールディングス	300	2,719.00	815,700
エディオン	2,000	963.00	1,926,000
サーラコーポレーション	500	621.00	310,500
ワッツ	200	1,096.00	219,200
ハローズ	200	2,305.00	461,000
あみやき亭	100	3,800.00	380,000
ひらまつ	700	599.00	419,300
ゲンキー	100	6,780.00	678,000
大黒天物産	100	4,960.00	496,000
ハニーズ	500	1,189.00	594,500
ファーマライズホールディングス	100	543.00	54,300
アルペン	400	2,115.00	846,000
クオール	600	1,462.00	877,200
ジェイアイエヌ	400	5,450.00	2,180,000
ビックカメラ	2,900	909.00	2,636,100
D C Mホールディングス	3,000	916.00	2,748,000

MonotaRO	1,900	2,408.00	4,575,200
ダイヤモンドダイニング	100	1,099.00	109,900
きちり	100	683.00	68,300
アークランドサービスホールディングス	100	3,005.00	300,500
J.フロント リテイリング	6,500	1,433.00	9,314,500
ドトール・日レスホールディングス	900	2,099.00	1,889,100
マツモトキヨシホールディングス	1,000	5,240.00	5,240,000
ブロンコビリー	300	2,981.00	894,300
スタートトゥデイ	4,700	1,808.00	8,497,600
物語コーポレーション	100	4,780.00	478,000
ココカラファイン	500	3,905.00	1,952,500
三越伊勢丹ホールディングス	10,200	1,075.00	10,965,000
ウエルシアホールディングス	500	7,210.00	3,605,000
クリエイティブSDホールディングス	800	2,191.00	1,752,800
丸善CHIIホールディングス	300	366.00	109,800
チムニー	200	2,927.00	585,400
シュッピン	200	1,190.00	238,000
ジョイフル本田	900	2,620.00	2,358,000
鳥貴族	100	2,612.00	261,200
キリン堂ホールディングス	300	788.00	236,400
ホットランド	200	1,012.00	202,400
すかいらーく	2,200	1,470.00	3,234,000
綿半ホールディングス	100	1,547.00	154,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,700	944.00	1,604,800
ブックオフコーポレーション	300	766.00	229,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	784.00	156,800
あさひ	400	1,251.00	500,400
日本調剤	200	4,280.00	856,000
コスモス薬品	300	22,560.00	6,768,000
トーエル	300	919.00	275,700
オンリー	100	770.00	77,000
セブン&アイ・ホールディングス	21,600	4,362.00	94,219,200
薬王堂	100	6,980.00	698,000
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	1,400	992.00	1,388,800
ツルハホールディングス	1,200	11,610.00	13,932,000
サンマルクホールディングス	300	2,961.00	888,300
フェリシモ	200	1,014.00	202,800
トリドールホールディングス	700	2,479.00	1,735,300
クスリのアオキ	500	5,350.00	2,675,000
サツドラホールディングス	100	1,970.00	197,000
ダイユー・リックホールディングス	100	655.00	65,500

メディカルシステムネットワーク	200	434.00	86,800
総合メディカル	200	3,325.00	665,000
はるやま商事	400	797.00	318,800
ノジマ	600	1,345.00	807,000
カップ・クリエイト	700	1,226.00	858,200
ライトオン	400	1,005.00	402,000
ジーンズメイト	200	176.00	35,200
良品計画	700	22,550.00	15,785,000
三城ホールディングス	700	445.00	311,500
アドヴァン	500	959.00	479,500
アルビス	100	2,217.00	221,700
コナカ	700	502.00	351,400
ハウス オブ ローゼ	100	1,465.00	146,500
G - 7ホールディングス	200	1,310.00	262,000
イオン北海道	700	542.00	379,400
コジマ	800	234.00	187,200
ヒマラヤ	200	803.00	160,600
コーナン商事	800	2,118.00	1,694,400
エコス	200	1,192.00	238,400
ワタミ	600	1,091.00	654,600
ドンキホーテホールディングス	3,300	4,080.00	13,464,000
西松屋チェーン	900	1,443.00	1,298,700
ゼンショーホールディングス	2,700	1,942.00	5,243,400
幸楽苑ホールディングス	300	1,572.00	471,600
ハークスレイ	200	950.00	190,000
サイゼリヤ	800	2,752.00	2,201,600
V Tホールディングス	1,700	560.00	952,000
魚力	200	1,269.00	253,800
ポブラ	200	487.00	97,400
ユナイテッドアローズ	700	2,869.00	2,008,300
ハイデイ日高	500	2,522.00	1,261,000
京都きもの友禅	400	928.00	371,200
コロワイド	1,700	1,923.00	3,269,100
ピーシーデポコーポレーション	700	520.00	364,000
壱番屋	500	3,870.00	1,935,000
トップカルチャー	300	475.00	142,500
P L A N T	100	1,074.00	107,400
スギホールディングス	1,100	5,460.00	6,006,000
スクロール	900	350.00	315,000
ヨンドシーホールディングス	400	2,649.00	1,059,600
ユニー・ファミリーマートホールディングス	2,300	6,700.00	15,410,000
木曽路	600	2,232.00	1,339,200

サトレストランシステムズ	600	802.00	481,200
千趣会	900	716.00	644,400
タカキュー	500	185.00	92,500
ケーヨー	1,000	530.00	530,000
上新電機	1,000	894.00	894,000
日本瓦斯	900	3,080.00	2,772,000
ベスト電器	1,900	141.00	267,900
ロイヤルホールディングス	900	1,840.00	1,656,000
東天紅	1,000	142.00	142,000
いなげや	600	1,383.00	829,800
島忠	1,400	2,814.00	3,939,600
チヨダ	600	2,520.00	1,512,000
ライフコーポレーション	400	3,330.00	1,332,000
リンガーハット	500	2,320.00	1,160,000
さが美	1,000	106.00	106,000
MrMax	600	383.00	229,800
テンアライド	400	368.00	147,200
AOKIホールディングス	1,000	1,281.00	1,281,000
オークワ	1,000	1,112.00	1,112,000
コメリ	800	2,544.00	2,035,200
青山商事	1,100	3,750.00	4,125,000
しまむら	600	13,310.00	7,986,000
はせがわ	200	444.00	88,800
高島屋	9,000	869.00	7,821,000
松屋	1,100	885.00	973,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,600	1,534.00	3,988,400
近鉄百貨店	2,000	341.00	682,000
丸栄	1,000	81.00	81,000
パルコ	500	977.00	488,500
丸井グループ	5,400	1,415.00	7,641,000
アクシアル リテイリング	400	3,715.00	1,486,000
イオン	21,200	1,462.50	31,005,000
イズミ	1,000	4,810.00	4,810,000
東武ストア	100	2,795.00	279,500
平和堂	1,100	2,164.00	2,380,400
フジ	600	2,183.00	1,309,800
ヤオコー	600	4,320.00	2,592,000
ゼビオホールディングス	700	1,608.00	1,125,600
ケーズホールディングス	2,400	1,955.00	4,692,000
Olympicグループ	400	595.00	238,000
日産東京販売ホールディングス	800	251.00	200,800
アインホールディングス	600	7,070.00	4,242,000

元気寿司	200	2,042.00	408,400	
ヤマダ電機	17,200	547.00	9,408,400	
アークランドサカモト	900	1,226.00	1,103,400	
ニトリホールディングス	2,200	12,140.00	26,708,000	
愛眼	500	197.00	98,500	
ケーユーホールディングス	200	782.00	156,400	
吉野家ホールディングス	1,700	1,559.00	2,650,300	
松屋フーズ	200	3,410.00	682,000	
サガミチェーン	600	1,242.00	745,200	
関西スーパーマーケット	400	1,335.00	534,000	
王将フードサービス	400	4,060.00	1,624,000	
プレナス	600	2,181.00	1,308,600	
ミニストップ	400	1,820.00	728,000	
アークス	1,000	2,652.00	2,652,000	
パローホールディングス	1,100	2,746.00	3,020,600	
ベルク	200	4,090.00	818,000	
大庄	300	1,525.00	457,500	
ファーストリテイリング	900	36,640.00	32,976,000	
サンドラッグ	1,000	7,940.00	7,940,000	
サックスパー ホールディングス	500	1,143.00	571,500	
ヤマザワ	200	1,719.00	343,800	
やまや	100	1,517.00	151,700	
ベルーナ	1,300	651.00	846,300	
島根銀行	100	1,251.00	125,100	
じもとホールディングス	3,600	171.00	615,600	
めぶきフィナンシャルグループ	24,900	374.00	9,312,600	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	700	3,335.00	2,334,500	
九州フィナンシャルグループ	8,400	675.00	5,670,000	
ゆうちょ銀行	14,600	1,213.00	17,709,800	
富山第一銀行	1,300	511.00	664,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	33,700	477.00	16,074,900	
西日本フィナンシャルホールディングス	3,500	1,004.00	3,514,000	
新生銀行	49,000	168.00	8,232,000	
あおぞら銀行	32,000	345.00	11,040,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	390,600	529.40	206,783,640	代用有価証券 21,400株
りそなホールディングス	60,300	455.30	27,454,590	
三井住友トラスト・ホールディングス	10,700	3,492.00	37,364,400	
三井住友フィナンシャルグループ	41,300	3,540.00	146,202,000	代用有価証券 3,500株
第四銀行	6,000	442.00	2,652,000	
北越銀行	600	2,454.00	1,472,400	
千葉銀行	20,000	640.00	12,800,000	

群馬銀行	11,500	493.00	5,669,500
武蔵野銀行	800	2,878.00	2,302,400
千葉興業銀行	1,500	454.00	681,000
筑波銀行	2,100	302.00	634,200
七十七銀行	8,000	465.00	3,720,000
青森銀行	4,000	341.00	1,364,000
秋田銀行	3,000	337.00	1,011,000
山形銀行	3,000	444.00	1,332,000
岩手銀行	300	4,360.00	1,308,000
東邦銀行	5,000	397.00	1,985,000
東北銀行	3,000	143.00	429,000
みちのく銀行	2,000	206.00	412,000
ふくおかフィナンシャルグループ	21,000	445.00	9,345,000
静岡銀行	14,000	856.00	11,984,000
十六銀行	7,000	315.00	2,205,000
スルガ銀行	5,300	2,503.00	13,265,900
八十二銀行	10,000	565.00	5,650,000
山梨中央銀行	3,000	494.00	1,482,000
大垣共立銀行	7,000	370.00	2,590,000
福井銀行	5,000	270.00	1,350,000
北國銀行	5,000	357.00	1,785,000
清水銀行	200	3,040.00	608,000
富山銀行	100	3,990.00	399,000
滋賀銀行	5,000	538.00	2,690,000
南都銀行	500	3,835.00	1,917,500
百五銀行	5,000	379.00	1,895,000
京都銀行	9,000	746.00	6,714,000
紀陽銀行	2,000	1,717.00	3,434,000
三重銀行	200	2,038.00	407,600
ほくほくフィナンシャルグループ	3,500	1,524.00	5,334,000
広島銀行	15,000	443.00	6,645,000
山陰合同銀行	3,200	758.00	2,425,600
中国銀行	3,700	1,397.00	5,168,900
鳥取銀行	200	1,660.00	332,000
伊予銀行	5,400	647.00	3,493,800
百十四銀行	6,000	355.00	2,130,000
四国銀行	4,000	246.00	984,000
阿波銀行	4,000	677.00	2,708,000
大分銀行	3,000	393.00	1,179,000
宮崎銀行	3,000	295.00	885,000
佐賀銀行	3,000	266.00	798,000
十八銀行	3,000	325.00	975,000

沖縄銀行	500	3,620.00	1,810,000	
琉球銀行	1,000	1,377.00	1,377,000	
セブン銀行	19,700	310.00	6,107,000	
みずほフィナンシャルグループ	699,800	175.00	122,465,000	代用有価証券 71,500株
高知銀行	2,000	113.00	226,000	
山口フィナンシャルグループ	5,000	1,149.00	5,745,000	
長野銀行	200	1,976.00	395,200	
名古屋銀行	400	3,640.00	1,456,000	
北洋銀行	8,200	392.00	3,214,400	
愛知銀行	200	5,520.00	1,104,000	
第三銀行	300	1,716.00	514,800	
中京銀行	200	2,340.00	468,000	
大光銀行	2,000	261.00	522,000	
愛媛銀行	600	1,356.00	813,600	
トマト銀行	200	1,556.00	311,200	
みなと銀行	500	1,850.00	925,000	
京葉銀行	4,000	444.00	1,776,000	
関西アーバン銀行	700	1,143.00	800,100	
栃木銀行	2,800	485.00	1,358,000	
北日本銀行	200	3,010.00	602,000	
東和銀行	10,000	101.00	1,010,000	
福島銀行	6,000	94.00	564,000	
大東銀行	3,000	171.00	513,000	
トモニホールディングス	4,300	539.00	2,317,700	
フィデアホールディングス	5,000	188.00	940,000	
池田泉州ホールディングス	5,500	473.00	2,601,500	
F P G	1,800	852.00	1,533,600	
S B I ホールディングス	5,800	1,225.00	7,105,000	
ジャフコ	800	3,415.00	2,732,000	
大和証券グループ本社	48,000	604.40	29,011,200	
野村ホールディングス	105,500	513.90	54,216,450	
岡三証券グループ	4,000	547.00	2,188,000	
丸三証券	1,600	845.00	1,352,000	
東洋証券	2,000	183.00	366,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	5,800	518.00	3,004,400	
光世証券	1,000	123.00	123,000	
水戸証券	1,500	234.00	351,000	
いちよし証券	1,100	762.00	838,200	
松井証券	2,900	821.00	2,380,900	
だいこう証券ビジネス	400	510.00	204,000	
マネックスグループ	5,600	231.00	1,293,600	
カブドットコム証券	3,900	317.00	1,236,300	

極東証券	700	1,479.00	1,035,300
岩井コスモホールディングス	500	880.00	440,000
藍澤証券	1,000	560.00	560,000
マネースクウェアHD	100	1,240.00	124,000
マネーパートナーズグループ	400	470.00	188,000
小林洋行	200	282.00	56,400
かんぽ生命保険	1,900	2,147.00	4,079,300
SOMPOホールディングス	10,800	3,235.00	34,938,000
アニコムホールディングス	300	2,374.00	712,200
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	15,400	3,009.00	46,338,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	4,900	1,411.00	6,913,900
第一生命ホールディングス	31,100	1,491.00	46,370,100
東京海上ホールディングス	20,800	4,011.00	83,428,800
T&Dホールディングス	18,800	1,234.50	23,208,600
アドバンスクリエイト	100	1,519.00	151,900
全国保証	1,500	4,065.00	6,097,500
クレディセゾン	3,900	1,804.00	7,035,600
芙蓉総合リース	600	4,920.00	2,952,000
興銀リース	1,000	2,125.00	2,125,000
東京センチュリー	1,100	3,535.00	3,888,500
日本証券金融	2,300	461.00	1,060,300
アイフル	9,000	317.00	2,853,000
ポケットカード	600	503.00	301,800
リコーリース	400	2,981.00	1,192,400
イオンフィナンシャルサービス	3,300	1,809.00	5,969,700
アコム	10,400	489.00	5,085,600
ジャックス	3,000	455.00	1,365,000
オリエントコーポレーション	11,200	190.00	2,128,000
日立キャピタル	1,200	2,322.00	2,786,400
アプラスフィナンシャル	2,700	104.00	280,800
オリックス	36,500	1,609.50	58,746,750
三菱UFJリース	13,100	496.00	6,497,600
日本取引所グループ	16,000	1,504.00	24,064,000
イー・ギャランティ	200	2,612.00	522,400
アサックス	100	1,508.00	150,800
NECキャピタルソリューション	200	1,606.00	321,200
いちご	4,900	429.00	2,102,100
日本駐車場開発	6,000	142.00	852,000
ヒューリック	10,800	993.00	10,724,400
三栄建築設計	100	1,752.00	175,200
野村不動産ホールディングス	3,500	1,732.00	6,062,000
三重交通グループホールディングス	900	379.00	341,100

サムティ	300	1,080.00	324,000
ディア・ライフ	300	336.00	100,800
エー・ディー・ワークス	3,400	38.00	129,200
日本商業開発	300	1,786.00	535,800
プレサンスコーポレーション	800	1,212.00	969,600
ユニゾホールディングス	400	2,664.00	1,065,600
THEグローバル社	200	448.00	89,600
日本管理センター	400	1,368.00	547,200
フージャースホールディングス	800	528.00	422,400
オープンハウス	700	2,223.00	1,556,100
東急不動産ホールディングス	12,400	606.00	7,514,400
飯田グループホールディングス	4,300	1,979.00	8,509,700
ムゲンエステート	200	777.00	155,400
パーク24	2,600	3,265.00	8,489,000
三井不動産	27,000	2,352.50	63,517,500
三菱地所	38,000	2,113.50	80,313,000
平和不動産	1,000	1,533.00	1,533,000
東京建物	6,000	1,322.00	7,932,000
ダイビル	1,400	897.00	1,255,800
京阪神ビルディング	900	544.00	489,600
住友不動産	12,000	2,665.50	31,986,000
大京	10,000	223.00	2,230,000
テオーシー	2,000	975.00	1,950,000
東京楽天地	1,000	500.00	500,000
レオパレス21	6,500	592.00	3,848,000
スターツコーポレーション	500	1,930.00	965,000
フジ住宅	700	691.00	483,700
空港施設	700	541.00	378,700
明和地所	400	577.00	230,800
住友不動産販売	500	2,459.00	1,229,500
ゴールドクレスト	400	1,958.00	783,200
日本エスリード	300	1,232.00	369,600
日神不動産	800	396.00	316,800
日本エスコン	700	316.00	221,200
タカラレーベン	2,200	682.00	1,500,400
サンヨーハウジング名古屋	300	917.00	275,100
イオンモール	3,300	1,527.00	5,039,100
ファースト住建	100	1,426.00	142,600
トーセイ	700	784.00	548,800
穴吹興産	1,000	247.00	247,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	3,100	957.00	2,966,700
サンフロンティア不動産	500	985.00	492,500

エフ・ジェー・ネクスト	200	607.00	121,400
ランドビジネス	400	263.00	105,200
グランディハウス	400	372.00	148,800
日本空港ビルデング	1,600	4,030.00	6,448,000
日本工営	2,000	472.00	944,000
ネクスト	1,300	883.00	1,147,900
ジェイエイシーリクルートメント	300	1,430.00	429,000
日本M&Aセンター	1,600	3,410.00	5,456,000
アコーディア・ゴルフ	1,600	1,042.00	1,667,200
タケエイ	500	828.00	414,000
トラスト・テック	200	1,545.00	309,000
パソナグループ	400	825.00	330,000
C D S	100	961.00	96,100
リンクアンドモチベーション	900	309.00	278,100
G C A	500	763.00	381,500
エス・エム・エス	700	2,769.00	1,938,300
テンプホールディングス	4,200	1,771.00	7,438,200
リニカル	300	1,340.00	402,000
クックパッド	1,200	1,010.00	1,212,000
エスクリ	100	541.00	54,100
アイ・ケイ・ケイ	200	600.00	120,000
学情	400	1,132.00	452,800
スタジオアリス	200	2,056.00	411,200
シミックホールディングス	200	1,450.00	290,000
N J S	100	1,279.00	127,900
総合警備保障	2,000	4,540.00	9,080,000
カカクコム	3,900	1,740.00	6,786,000
ルネサンス	400	1,463.00	585,200
ディップ	700	2,628.00	1,839,600
オプトホールディング	400	683.00	273,200
新日本科学	500	565.00	282,500
ツクイ	1,200	677.00	812,400
キャリアデザインセンター	100	908.00	90,800
エムスリー	4,700	3,080.00	14,476,000
ツカダ・グローバルホールディング	200	720.00	144,000
アウトソーシング	300	3,835.00	1,150,500
ウェルネット	400	1,314.00	525,600
ワールドホールディングス	100	1,583.00	158,300
ディー・エヌ・エー	2,400	3,265.00	7,836,000
博報堂DYホールディングス	7,600	1,248.00	9,484,800
ぐるなび	800	2,643.00	2,114,400
エスアールジータカミヤ	400	558.00	223,200

ファンコミュニケーションズ	1,400	769.00	1,076,600
ジェイコムホールディングス	100	1,903.00	190,300
WDBホールディングス	100	1,091.00	109,100
ティア	100	616.00	61,600
バリューコマース	400	333.00	133,200
インフォマート	1,200	1,131.00	1,357,200
J Pホールディングス	1,400	261.00	365,400
E P Sホールディングス	700	1,356.00	949,200
レックス	100	827.00	82,700
プレステージ・インターナショナル	700	762.00	533,400
アミューズ	300	1,764.00	529,200
ドリームインキュベータ	200	2,836.00	567,200
T A C	300	203.00	60,900
ケネディクス	7,100	443.00	3,145,300
電通	6,100	5,130.00	31,293,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	200	601.00	120,200
ぴあ	200	2,418.00	483,600
イオンファンタジー	200	3,040.00	608,000
シーティーエス	100	1,031.00	103,100
みらかホールディングス	1,400	5,000.00	7,000,000
アルプス技研	200	2,190.00	438,000
ダイオーズ	200	952.00	190,400
オリエンタルランド	5,900	6,041.00	35,641,900
ダスキン	1,400	2,136.00	2,990,400
明光ネットワークジャパン	700	970.00	679,000
ファルコホールディングス	300	1,379.00	413,700
秀英予備校	100	359.00	35,900
田谷	100	638.00	63,800
ラウンドワン	1,800	745.00	1,341,000
リゾートトラスト	2,100	2,113.00	4,437,300
ビー・エム・エル	700	2,728.00	1,909,600
ワタベウェディング	100	403.00	40,300
りらいあコミュニケーションズ	1,000	995.00	995,000
リソー教育	900	569.00	512,100
早稲田アカデミー	100	896.00	89,600
ユー・エス・エス	6,500	1,707.00	11,095,500
東京個別指導学院	200	581.00	116,200
サイバーエージェント	2,900	2,847.00	8,256,300
楽天	27,800	1,165.00	32,387,000
クリーク・アンド・リバー社	200	716.00	143,200
テー・オー・ダブリュー	400	651.00	260,400
セントラルスポーツ	200	2,521.00	504,200

フルキャストホールディングス	500	953.00	476,500
リソルホールディングス	1,000	317.00	317,000
テクノプロ・ホールディングス	900	3,595.00	3,235,500
アトラ	100	1,045.00	104,500
イー・ガーディアン	200	1,256.00	251,200
リブセンス	300	439.00	131,700
ジャパンマテリアル	200	3,565.00	713,000
ベクトル	400	1,168.00	467,200
キャリアリンク	200	763.00	152,600
I B J	400	770.00	308,000
アサンテ	100	1,619.00	161,900
N・フィールド	300	1,110.00	333,000
E R Iホールディングス	100	798.00	79,800
アビスト	100	2,632.00	263,200
リクルートホールディングス	11,900	4,150.00	49,385,000
エラン	100	1,312.00	131,200
日本郵政	14,300	1,284.00	18,361,200
ベルシステム24ホールディングス	800	962.00	769,600
ソラスト	200	1,108.00	221,600
リログループ	200	16,960.00	3,392,000
東祥	100	4,750.00	475,000
エイチ・アイ・エス	900	2,879.00	2,591,100
ラックランド	100	1,808.00	180,800
共立メンテナンス	400	6,310.00	2,524,000
イチネンホールディングス	500	1,067.00	533,500
建設技術研究所	300	970.00	291,000
スペース	400	1,233.00	493,200
燦ホールディングス	100	1,472.00	147,200
東京テアトル	2,000	121.00	242,000
ナガワ	100	4,160.00	416,000
よみうりランド	1,000	448.00	448,000
東京都競馬	4,000	233.00	932,000
常磐興産	200	1,502.00	300,400
カナモト	700	2,412.00	1,688,400
東京ドーム	2,200	1,065.00	2,343,000
西尾レントオール	400	3,070.00	1,228,000
トランス・コスモス	600	2,621.00	1,572,600
乃村工藝社	1,200	1,710.00	2,052,000
藤田観光	2,000	340.00	680,000
K N T - C Tホールディングス	3,000	117.00	351,000
日本管財	400	1,519.00	607,600
トーカイ	200	3,515.00	703,000

白洋舎	100	2,489.00	248,900	
セコム	5,700	7,669.00	43,713,300	
セントラル警備保障	300	2,059.00	617,700	
丹青社	900	767.00	690,300	
メイテック	700	3,550.00	2,485,000	
アサツー ディ・ケイ	900	2,882.00	2,593,800	
応用地質	500	1,179.00	589,500	
船井総研ホールディングス	700	1,580.00	1,106,000	
進学会	400	493.00	197,200	
オオバ	300	426.00	127,800	
ベネッセホールディングス	1,800	2,910.00	5,238,000	
イオンディライト	600	3,025.00	1,815,000	
ナック	400	854.00	341,600	
ニチイ学館	1,000	855.00	855,000	
ダイセキ	900	2,128.00	1,915,200	
ステップ	200	1,194.00	238,800	
合 計	7,881,900		10,388,387,390	

(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2016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	11,273,745,419円
負債総額	31,184,041円
純資産総額（ - ）	11,242,561,378円
発行済口数	18,337,023,511口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6131円

【バランスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	281,717,215円
負債総額	287,419円
純資産総額（ - ）	281,429,796円
発行済口数	314,195,790口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8957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	11,406,030,892円
負債総額	22,813,468円
純資産総額（ - ）	11,383,217,424円
発行済口数	8,068,539,926口
1口当たり純資産額（ / ）	1.411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28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28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28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28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	676	124,426

株式投資信託	627	100,560
単位型	166	7,329
追加型	461	93,231
公社債投資信託	49	23,865
単位型	35	429
追加型	14	23,435

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57期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第58期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	14,206	3	14,308
金銭の信託		-	3	153
有価証券		277		86
前払費用	3	509	3	489
未収入金		3		10
未収委託者報酬		8,441		9,374
未収収益	3	1,566	3	2,280
関係会社短期貸付金		436		5,333
立替金		666		2,960
繰延税金資産		1,446		819
その他	2	195	2,3	428
流動資産合計		27,750		36,243
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	56	1	146
器具備品	1	166	1	210
有形固定資産合計		222		356

無形固定資産		
ソフトウェア	113	140
無形固定資産合計	113	140
投資その他の資産		
投資有価証券	14,184	12,195
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	740	781
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	248	425
投資その他の資産合計	36,936	35,165
固定資産合計	37,273	35,662
資産合計	65,023	71,905

(単位：百万円)

	第56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28年3月31日)
負債の部			
流動負債			
預り金	387		410
未払金	5,545		3,841
未払収益分配金	6		6
未払償還金	112		112
未払手数料	3	3,145	3
その他未払金		2,282	
未払費用	3	4,636	3
未払法人税等		814	
未払消費税等	4	1,070	4
関係会社短期借入金		-	
賞与引当金		1,990	
役員賞与引当金		120	
その他	3	82	3
流動負債合計		14,646	
固定負債			
退職給付引当金		1,111	
固定負債合計		1,111	
負債合計		15,758	
純資産の部			
株主資本			
資本金		17,363	
資本剰余金			
資本準備金		5,220	
資本剰余金合計		5,220	
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		25,836	
利益剰余金合計		25,836	

自己株式	68	502
株主資本合計	48,351	52,028
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,002	151
繰延ヘッジ損益	88	258
評価・換算差額等合計	913	410
純資産合計	49,265	52,438
負債純資産合計	65,023	71,905

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,990	66,339
その他営業収益	3,729	4,382
営業収益合計	67,719	70,722
営業費用		
支払手数料	30,408	30,529
広告宣伝費	1,045	1,098
公告費	5	3
調査費	15,571	17,470
調査費	747	821
委託調査費	14,782	16,600
図書費	41	48
委託計算費	502	505
営業雑経費	660	718
通信費	199	195
印刷費	263	321
協会費	64	65
諸会費	27	22
その他	106	113
営業費用計	48,193	50,327
一般管理費		
給料	7,585	8,138
役員報酬	289	365
役員賞与引当金繰入額	120	145
給料・手当	5,127	5,495
賞与	59	51
賞与引当金繰入額	1,990	2,080
交際費	163	185
寄付金	36	27
旅費交通費	503	503
租税公課	208	258
不動産賃借料	785	875
退職給付費用	349	372
退職金	16	113
固定資産減価償却費	148	196
福利費	908	952
諸経費	2,673	2,952

一般管理費計	13,380	14,577
営業利益	6,146	5,817

(単位：百万円)

	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業外収益		
受取利息	10	91
受取配当金	1 1,152	1 1,330
有価証券償還益	13	-
時効成立分配金・償還金	1	1
為替差益	-	32
その他	107	32
営業外収益合計	1,285	1,488
営業外費用		
支払利息	28	242
有価証券償還損	81	-
デリバティブ費用	269	69
時効成立後支払分配金・償還金	295	5
支払源泉所得税	71	119
為替差損	26	-
その他	21	94
営業外費用合計	795	531
経常利益	6,636	6,774
特別利益		
投資有価証券売却益	270	720
その他	-	0
特別利益合計	270	720
特別損失		
投資有価証券売却損	22	100
固定資産処分損	0	6
特別賞与	-	204
割増退職金	243	91
役員退職一時金	-	64
外国税関連費用	2 1,650	-
特別損失合計	1,916	467
税引前当期純利益	4,991	7,027
法人税、住民税及び事業税	2,356	1,359
法人税等調整額	466	706
法人税等合計	1,890	2,065
当期純利益	3,101	4,962

(3) 【株主資本等変動計算書】

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

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28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	25,836	25,836	68	48,351

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	25,836	25,836	68	48,351
当期変動額							
剰余金の配当				850	850		850
当期純利益				4,962	4,962		4,962
自己株式の取得						434	434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,111	4,111	434	3,676
当期末残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028

	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
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	1,002	88	913	49,265
当期変動額				
剰余金の配当				850
当期純利益				4,962
自己株式の取得				434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	851	347	503	503
当期変動額合計	851	347	503	3,173
当期末残高	151	258	410	52,438

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1 資産の評価基準及び 評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産 直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法

2 固定資産の減価償却の方法	<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。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 5年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 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の日次事業年度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 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(会計方針の変更)

第57期
(自 平成27年 4月 1日
至 平成28年 3月31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。）等を当事業年度から適用し、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いたしました。また、当事業年度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事業年度の財務諸表に反映させる方法に変更いたします。

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、当事業年度の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、当事業年度において、財務諸表及び1株当たり情報に与える影響額はありません。

（未適用の会計基準等）

- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

（1）概要

繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いについて、監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」の枠組み、すなわち企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積もる枠組みを基本的に踏襲した上で、以下の取扱いについて必要な見直しが行われております。

（分類1）から（分類5）に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

（分類2）及び（分類3）に係る分類の要件

（分類2）に該当する企業におけるスケジュールリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い

（分類3）に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い

（分類4）に係る分類の要件を満たす企業が（分類2）又は（分類3）に該当する場合の取扱い

（2）適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	1 有形固定資産の減価償却累計額
建物 1,122百万円	建物 1,170百万円
器具備品 679百万円	器具備品 653百万円
2 信託資産	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。	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 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。	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。
(流動資産)	(流動資産)
現金・預金 4,256百万円	現金・預金 4,072百万円
前払費用 2百万円	金銭の信託 153百万円
未収収益 110百万円	前払費用 2百万円
(流動負債)	未収収益 147百万円
未払手数料 108百万円	その他 193百万円
未払費用 500百万円	(流動負債)
その他 57百万円	未払手数料 93百万円
	未払費用 722百万円
	その他 266百万円

<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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>	<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務728百万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689百万円に対して保証を行っております。</p>
--	---

(損益計算書関係)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28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 style="text-align: right;">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>	<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 style="text-align: right;">受取配当金 1,193百万円 支払利息 123百万円 デリバティブ費用 889百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

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

	新株予約権の目的となる株式の数(株)	当事業

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	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	年度末残高(百万円)
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

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28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	704,500	-	814,100

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度 ストックオプション (1)	普通株式	15,902,700	-	14,140,500	1,762,200	-
平成21年度 ストックオプション (2)	普通株式	1,567,500	-	1,392,600	174,900	-

平成22年度 ストックオプション (1)	普通株式	2,310,000	-	2,310,000	-	-
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	-	18,133,500	6,675,900	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 平成21年度ストックオプション(1)1,762,200株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)4,738,800株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

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28年5月30日 取締役会	普通株式	利益 剰余金	1,495	7.62	平成28年3月31日	平成28年6月22日

(リース取引関係)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28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	841百万円	1年内	865百万円
1年超	3,420百万円	1年超	2,653百万円
合計	4,261百万円	合計	3,518百万円

(金融商品関係)

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、自ら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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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、自ら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。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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。さらに、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

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28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	14,308	14,308	-
(2) 未収委託者報酬	9,374	9,374	-
(3) 未収収益	2,280	2,280	-
(4) 関係会社短期貸付金	5,333	5,333	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	12,265	12,265	-

(6) 未払金	(3,841)	(3,841)	-
(7) 未払費用	(4,920)	(4,920)	-
(8) 関係会社短期借入金	(5,631)	(5,631)	-
(9) 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	(254)	(254)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	170	170	-
デリバティブ取引計	(84)	(84)	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用並びに(8) 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。

(9) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されないものは貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されるもののうち193百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万円は流動負債のその他に含まれております。

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

3 子会社株式(貸借対照表計上額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	14,308			
未収委託者報酬	9,374			
未収収益	2,280			
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	86	714	1,766	963
合計	26,049	714	1,766	963

(有価証券関係)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	5,593	4,872	720
	小計	5,593	4,872	720
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	6,672	7,175	502
	小計	6,672	7,175	502

合計	12,265	12,047	218
----	--------	--------	-----

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	30	17	-
投資信託	5,442	703	100
合計	5,473	720	100

(デリバティブ取引関係)

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)
原則的処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資有価証券	2,586	-	68
	豪ドル		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。

第57期(平成28年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	1,093	-	11	11
	買建	-	-	-	-
合計		1,093	-	11	11

(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)
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建 米ドル	5,631	-	243	243
合計		5,631	-	243	243

(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				
	米ドル	投資有価証券	3,943	-	179
	豪ドル		767	-	18
	シンガポールドル		75	-	4
	香港ドル		151	-	5
	人民元		1,948	-	8
ユーロ	173		-	0	
合計			7,060	-	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。

(持分法損益等)

第56期 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	第57期 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28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 3,078	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,037
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,396	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,686
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,720	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,901

(退職給付関係)

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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	1,233
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期首残高	1,233
勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	33
退職給付の支払額	119
退職給付債務の期末残高	1,299

(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	1,299
未積立退職給付債務	1,299
未認識数理計算上の差異	144
貸借対照表に計上された負債の額	1,154
退職給付引当金	1,154
貸借対照表に計上された負債の額	1,154

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の費用処理額	9
確定給付制度に係る退職給付費用	162

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、209百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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	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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	14,140,500	1,392,600
権利確定	0	0
権利未確定残	1,762,200	174,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成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	5,029,200
付与	0	0
失効	2,310,000	290,400
権利確定	0	0
権利未確定残	0	4,738,800
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

(税効果会計関係)

第56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28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		賞与引当金
	658		642
	その他		その他
	813		177
	小計		小計
	1,472		819
	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		投資有価証券評価損
	134		96
	関係会社株式評価損		関係会社株式評価損
	1,510		1,430
	退職給付引当金		退職給付引当金
	360		353
	固定資産減価償却費		固定資産減価償却費
	133		122
	その他		その他
	73		65
	小計		小計
	2,213		2,068
	繰延税金資産小計		繰延税金資産小計
	3,685		2,888
	評価性引当金		評価性引当金
	1,510		1,430
	繰延税金資産合計		繰延税金資産合計
	2,174		1,457
	繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)
	その他有価証券評価差額金		その他有価証券評価差額金
	25		71
	小計		繰延ヘッジ利益
	25		114
	繰延税金負債(固定)		その他
	その他有価証券評価差額金		26
	454		小計
	454		213
	繰延税金負債合計		繰延税金負債合計
	480		213
	繰延税金資産の純額		繰延税金資産の純額
	1,694		1,244
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		法定実効税率
	35.6%		33.1%
	(調整)		(調整)
	交際費等永久に損金に算入され ない項目		交際費等永久に損金に算入され ない項目
	1.3%		1.4%
	受取配当金等永久に益金に算入 されない項目		受取配当金等永久に益金に算入 されない項目
	4.3%		4.8%
	税率変更による期末繰延税金資 産の減額修正		税率変更による期末繰延税金資 産の減額修正
	3.6%		1.3%
	海外子会社の留保利益の影響額 等		所得拡大促進税制
	1.7%		2.2%
	税効果会計適用後の法人税等の 負担率		海外子会社の留保利益の影響額 等
	37.9%		0.6%
			税効果会計適用後の法人税等の 負担率
			29.4%

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成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>	<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28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律第13号)が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28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28年4月1日に開始する事業年度及び平成29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30.9%に、平成30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30.6%となります。この税率変更により、繰延税金資産の純額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が59百万円減少し、その他有価証券評価差額金が3百万円、繰延ヘッジ損益が6百万円、法人税等調整額が69百万円、それぞれ増加しております。</p>

(関連当事者情報)

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 貸建) (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 貸建) (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

- 1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 資金の貸付に係る取引金額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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000(千SGD)	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)	90(千SGD1,000)(注2)	関係会社短期貸付金	333(千SGD4,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	18(千SGD215)	未収収益	6(千SGD74)
							資金の貸付(円貨建)(注3)	5,000	関係会社短期貸付金	5,000
							貸付金利息(円貨建)(注3)	70	未収収益	70
	Nikko Asset	アメリカ	181,542	アセット	直接	資金の借入	資金の借入(米ドル貨建)(注5)	6,176(千USD50,000)	関係会社短期借入金	5,631(千USD50,000)

子会社	Management Americas, Inc.	力合衆国	(千USD) (注4)	マネジメント業	100.00	借入	借入金利息 (米ドル 貸建) (注5)	113 (千 USD 949)	未払費用	106 (千 USD 949)
-----	---------------------------	------	----------------	---------	--------	----	------------------------------	-----------------------	------	-----------------------

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 資金の貸付に係る取引金額 90百万円 (SGD 1,000千) の内訳は、貸付957百万円 (SGD11,000千) 及び返済1,047百万円 (SGD12,000千) であります。
- 3 融資枠5,000百万円、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 Nikko Asset Management Americas, Inc.の「資本金」は、資本金と資本剰余金の合計額を記載しております。
- 5 融資枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

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27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	30,897百万円
負債合計	9,936百万円
純資産合計	20,960百万円
営業収益	26,843百万円
税引前当期純利益	9,553百万円
当期純利益	6,411百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	250円20銭	267円27銭
1株当たり当期純利益金額	15円74銭	25円25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いません。

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56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益（百万円）	3,101	4,962
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）	3,101	4,962
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,903	196,464
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、平成23年度ストックオプション(1)5,029,200株	平成21年度ストックオプション(1)1,762,200株、平成21年度ストックオプション(2)174,900株、平成23年度ストックオプション(1)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56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	49,265	52,438
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）	49,265	52,438
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	196,198

(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58期中間会計期間
(平成28年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	16,370
金銭の信託	152
有価証券	29
未収委託者報酬	8,443
未収収益	1,681
関係会社短期貸付金	488

繰延税金資産		821
その他	2	2,083
流動資産合計		30,070
固定資産		
有形固定資産	1	323
無形固定資産		129
投資その他の資産		
投資有価証券		11,401
関係会社株式		23,203
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		781
繰延税金資産		409
長期前払費用		0
投資その他の資産合計		35,857
固定資産合計		36,311
資産合計		66,382

(単位：百万円)

第58期中間会計期間
(平成28年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		4,011
未払費用		4,007
未払法人税等		1,052
未払消費税等	3	440
賞与引当金		1,112
役員賞与引当金		60
その他		517
流動負債合計		11,201

固定負債

退職給付引当金		1,203
固定負債合計		1,203

負債合計

12,404

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		31,627
利益剰余金合計		31,627

自己株式 672

株主資本合計 53,537

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	340
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	439
純資産合計	53,977
負債純資産合計	66,382

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第58期中間会計期間
(自 平成28年4月1日
至 平成28年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		32,215
その他営業収益		1,942
営業収益合計		34,158
営業費用及び一般管理費	1	31,520
営業利益		2,637
営業外収益	2	1,760
営業外費用	3	327
経常利益		4,070
特別利益	4	50
特別損失	5	19
税引前中間純利益		4,102
法人税等	6	927
中間純利益		3,174

(3) 中間株主資本等変動計算書

第58期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028
当中間期変動額							
剰余金の配当				1,495	1,495		1,495
中間純利益				3,174	3,174		3,174
自己株式の取得						170	170
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				1,679	1,679	170	1,508
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	31,627	31,627	672	53,537

評価・換算差額等

	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	純資産 合計
当期首残高	151	258	410	52,438
当中間期変動額				
剰余金の配当				1,495
中間純利益				3,174
自己株式の取得				170
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	491	521	29	29
当中間期変動額合計	491	521	29	1,538
当中間期末残高	340	780	439	53,977

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第58期中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 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> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年 4月 1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</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>4 ヘッジ会計の方法</p> <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>	<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。</p> <p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p>
--	---

(会計方針の変更)

<p style="text-align: center;">第58期中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)</p> <p>(減価償却方法) 法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年 6月17日)を当中間会計期間に適用し、平成28年 4月 1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。 この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>(税金費用の計算方法) 従来、年度決算と同様の方法による税金費用の計算を適用しておりましたが、当社の中間決算業務の一層の効率化を図るため、当中間会計期間より事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り算出された見積実効税率に、税引前中間純利益を乗ずる計算方法に変更しております。 なお、この変更による影響は軽微であるため、遡及適用は行っておりません。</p>

(追加情報)

<p style="text-align: center;">第58期中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)</p> <p>「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年 3月28日)を当中間会計期間から適用しております。</p>
--

(中間貸借対照表関係)

<p style="text-align: center;">第58期中間会計期間 (平成28年 9月30日)</p> <p>1 有形固定資産の減価償却累計額 1,891百万円</p>
--

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582百万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558百万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58期中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	70百万円
無形固定資産	20百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	7百万円
受取配当金	1,591百万円
デリバティブ収益	6百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	128百万円
支払源泉所得税	155百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	50百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	18百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

第58期中間会計期間（自 平成28年 4月 1日 至 平成28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）	814,100	305,000	-	1,119,100

(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	1,762,200	-	19,800	1,742,400	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	-	174,900	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	4,738,800	-	-	4,738,800	-
平成28年度ストックオプション(1)	普通株式	-	4,437,000	-	4,437,000	-
合計		6,675,900	4,437,000	19,800	11,093,100	-

- (注) 1 平成21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28年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
 3 平成21年度ストックオプション(1)1,742,400株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)4,738,800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28年5月30日取締役会	普通株式	1,495	7.62	平成28年3月31日	平成28年6月22日

(2) 基準日が当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58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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	865百万円
1年超	2,220百万円
合計	3,085百万円

(金融商品関係)

第58期中間会計期間(平成28年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成28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) 現金及び預金	16,370	16,370	-
(2) 未収委託者報酬	8,443	8,443	-
(3) 未収収益	1,681	1,681	-
(4) 金銭の信託	152	152	-
(5) 関係会社短期貸付金	488	488	-
(6) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	11,431	11,431	-
(7) 未払金	(4,011)	(4,011)	-
(8) 未払費用	(4,007)	(4,007)	-
(9) 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	24	24	-
ヘッジ会計が適用されているもの	268	268	-
デリバティブ取引計	292	292	-

(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) 現金及び預金、(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) 未払金及び(8) 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。

(9) 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20,310百万円）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58期中間会計期間(平成28年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	20,310

関連会社株式	2,892
--------	-------

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	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	3,215	2,649	565
	小計	3,215	2,649	565
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	8,199	9,255	1,056
	小計	8,199	9,255	1,056
合計		11,414	11,905	490

(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58期中間会計期間(平成28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	3,386	-	24	24
合計		3,386	-	24	24

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		3,575	-	156
	豪ドル		67	-	1
	シンガポールドル		685	-	38

	ユーロ		82	-	2
	香港ドル		87	-	4
	人民元		1,831	-	65
	合計		6,329	-	268

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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	3,017百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	8,257百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,144百万円

(ストックオプション等関係)

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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58期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
1株当たり純資産額	275円54銭
1株当たり中間純利益金額	16円18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58期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
中間純利益(百万円)	3,174
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)	3,174
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,123
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) 1,742,400株、 平成21年度ストックオプション(2) 174,900株、 平成23年度ストックオプション(1) 4,738,800株、 平成28年度ストックオプション(1) 4,437,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期中間会計期間 (平成28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)	53,977
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)	53,977
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間会計期間末の普通株式の数(千株)	195,893

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

禁止されています。

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成28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28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28年9月末現在)	事業の内容
アーク証券株式会社	2,619百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。

(2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

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

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

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

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

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

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

がない旨の記載。

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

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

独立監査人の監査報告書

平成28年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 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28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28年12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

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定有限責任社員 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27年11月10日から平成28年11月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスポートフォリオの平成28年11月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年12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

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定有限責任社員 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27年11月10日から平成28年11月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランスポートフォリオの平成28年11月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 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28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28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28年4月1日から平成28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。