

【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30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】	新屋敷 昇
【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30年 2月 8日から平成31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經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、原則として勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

インデックスポートフォリオ	TOPIX（東証株価指数）の動きに連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
バランスポートフォリオ	TOPIX（東証株価指数）の動きに連動した投資成果に、内外公社債への投資による安定性を加味した運用を行ない、信託財産の長期的成長と安定した収益の確保をはかることをめざします。

ファンドの基本的性格

<インデックスポートフォリオ>

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券 不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 () 資産複合	特殊型

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

インデックス型

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

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株 中小型株	年2回	日本		
	年4回	北米		日経 225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)			
社債		アジア		
その他債券	年12回			TOPIX
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
不動産投信	日々	中南米		
	その他	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	その他 ()
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))	()	中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（株式 一般））

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

< バランスポートフォリオ >

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

ンドをいいます。

国内

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

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

「インデックスポートフォリオ」

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

「バランスポートフォリオ」

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

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

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

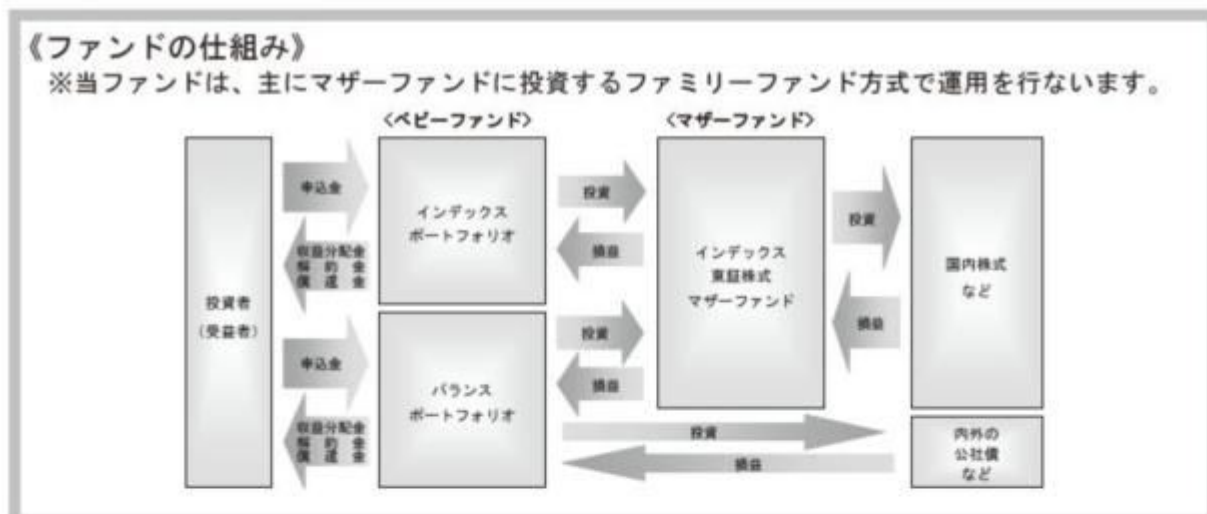
TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

2. お買付けは、原則として給与天引きです。

3. お買付けは、無手数料です。

4. ドル・コスト平均法の妙味を味わえます。

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



主な投資制限

「インデックスポートフォリオ」

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

「バランスポートフォリオ」

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

分配方針

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」

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

ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行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。

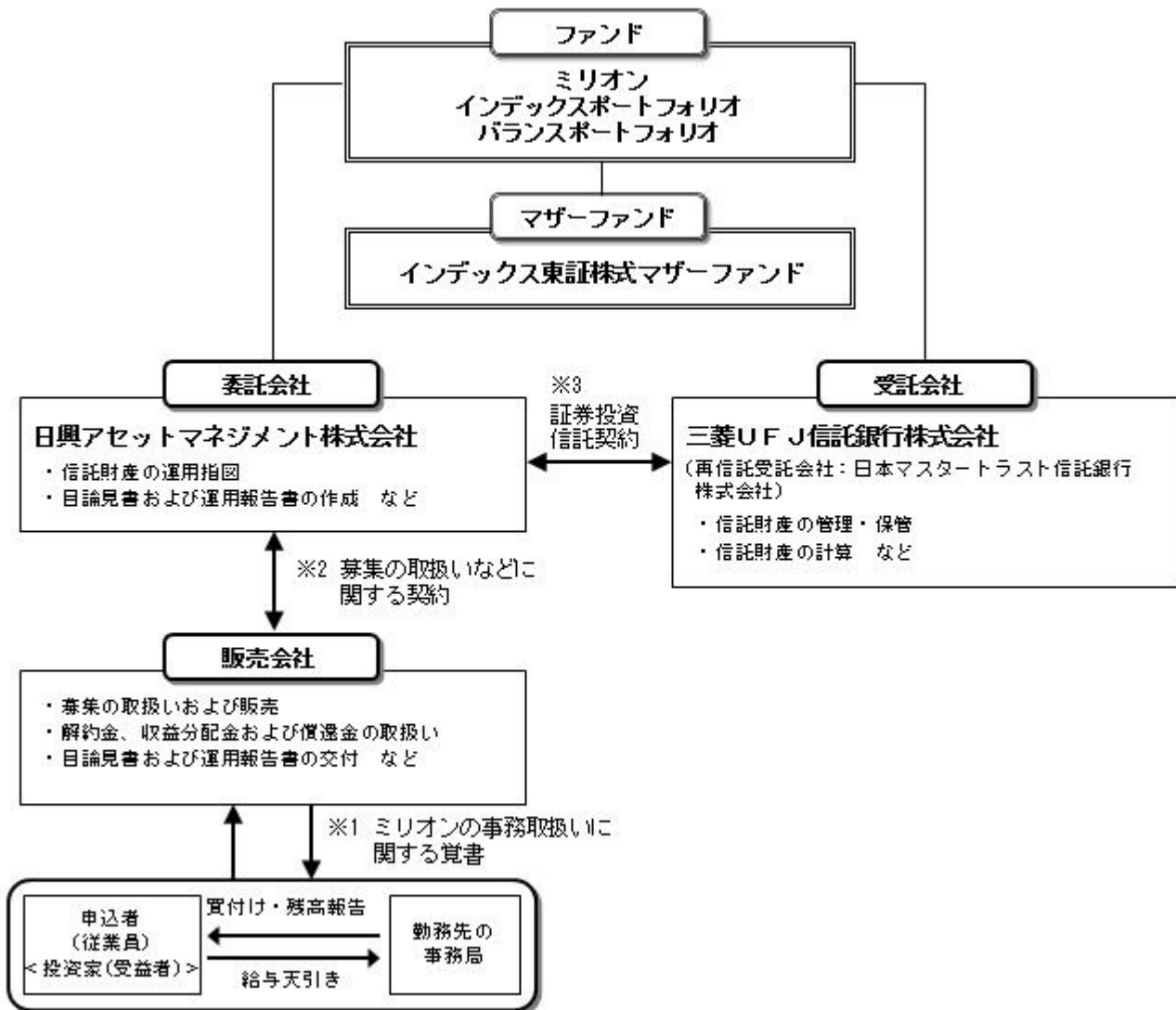
(2) 【ファンドの沿革】

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29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

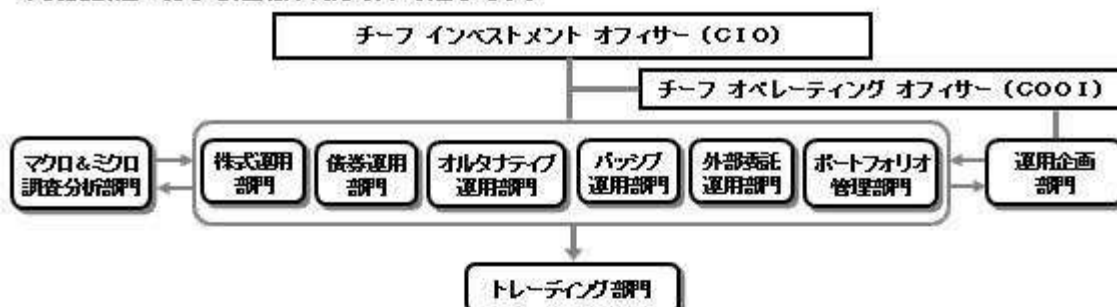
<インデックス東証株式マザーファンド>

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。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

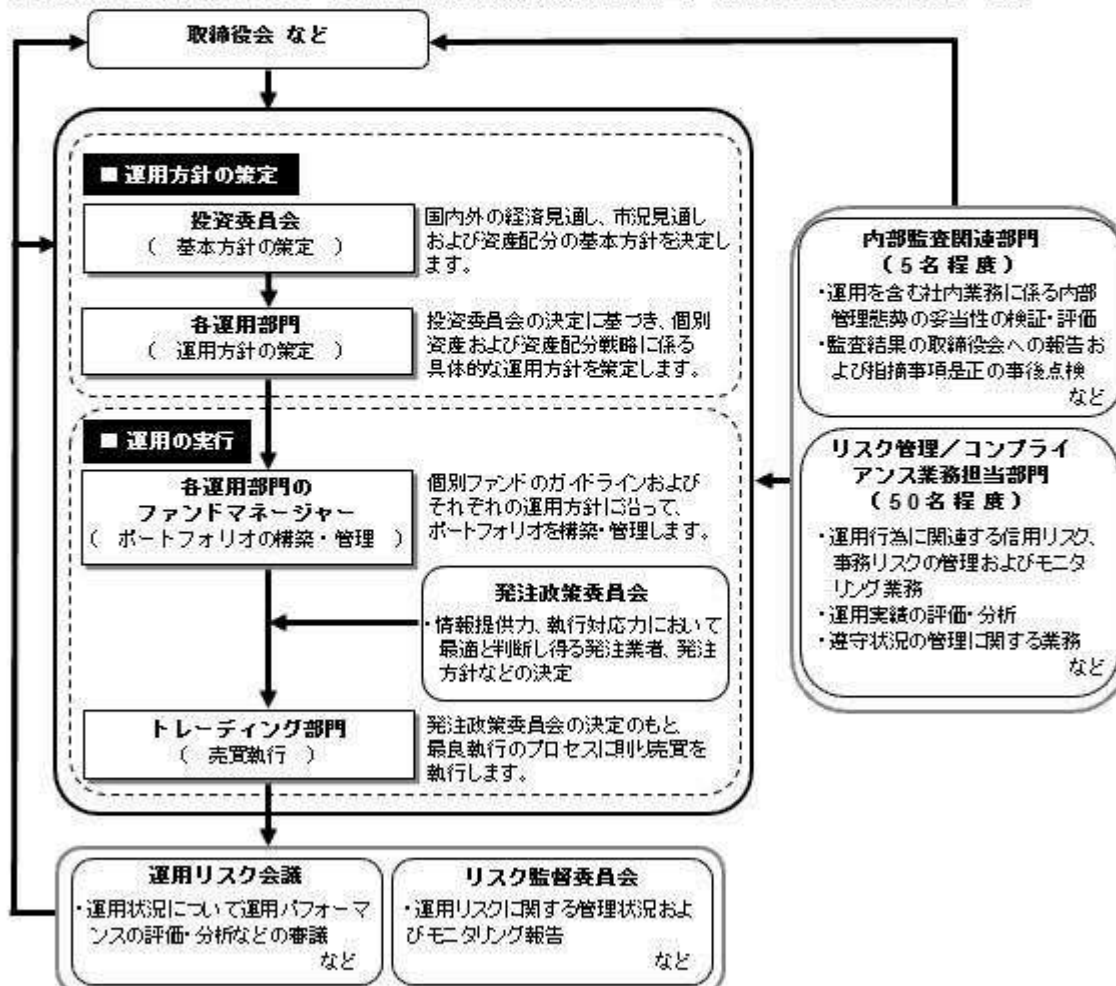
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
信託期間	無期限(昭和61年10月22日設定)
決算日	毎年10月21日(休業日の場合は翌営業日)

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

上記体制は平成29年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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

を行ないます。

収益分配金の支払い

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

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

<インデックスポートフォリオ>

- 1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合には制限を設けません。
 - 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
 - 3) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
 - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
 - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が弁済される日からその翌営業日までとします。
- 4) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<バランスポートフォリオ>

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

の範囲内とします。

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

囲内

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

ハ）借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

ホ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が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。

11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<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。
- 9) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

<インデックスポートフォリオ>

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

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

< T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

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。

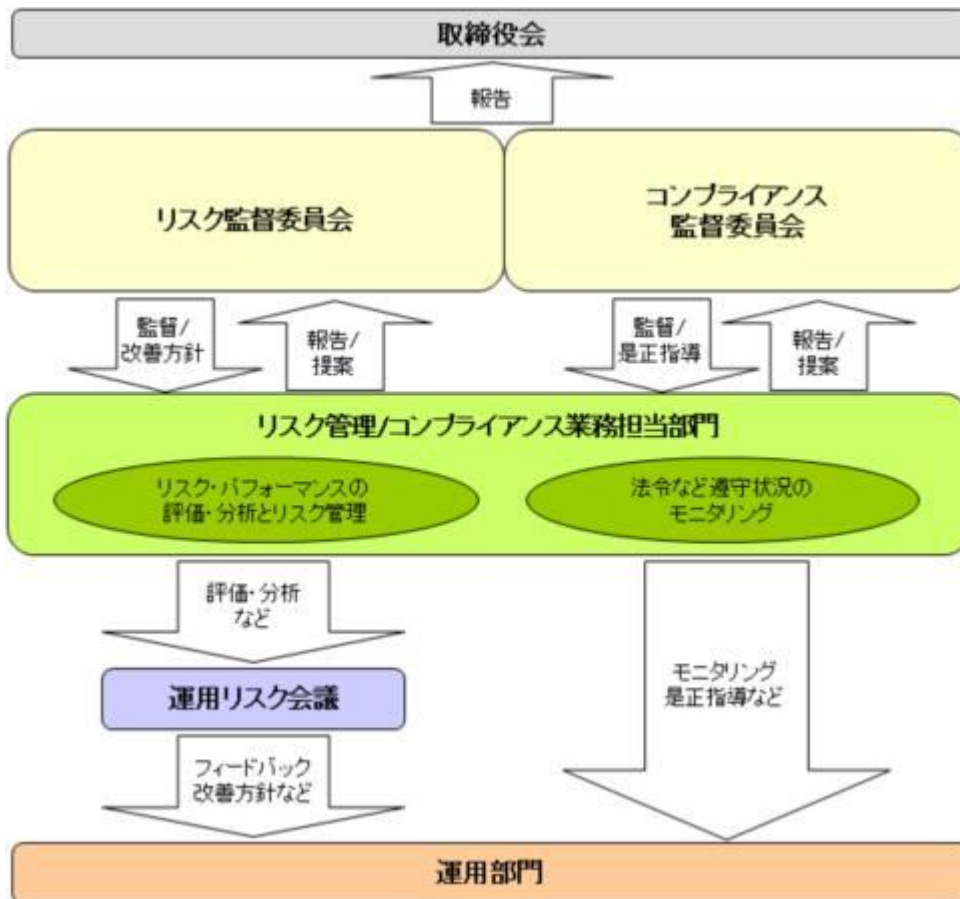
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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会議においては、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リスク会議に報告し、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

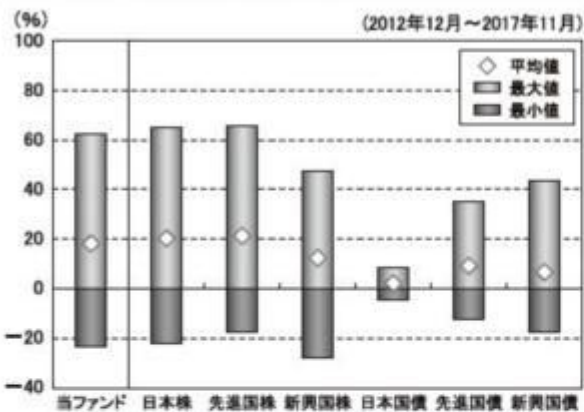
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成29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（%））

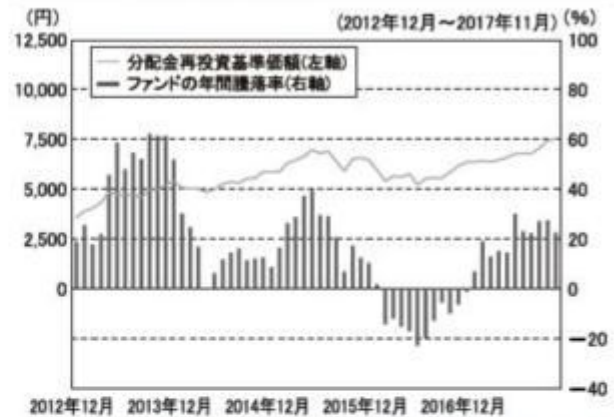
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	18.3%	20.3%	21.4%	12.5%	2.3%	9.3%	6.8%
最大値	62.2%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	-23.2%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※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2012年12月から2017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



2012年12月 2013年12月 2014年12月 2015年12月 2016年12月

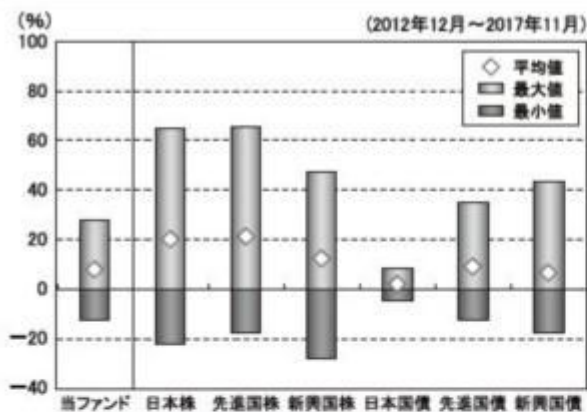
※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2012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	8.1%	20.3%	21.4%	12.5%	2.3%	9.3%	6.8%
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%	-4.0%	-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2012年12月から2017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……FTSE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・ディバシファイド（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。

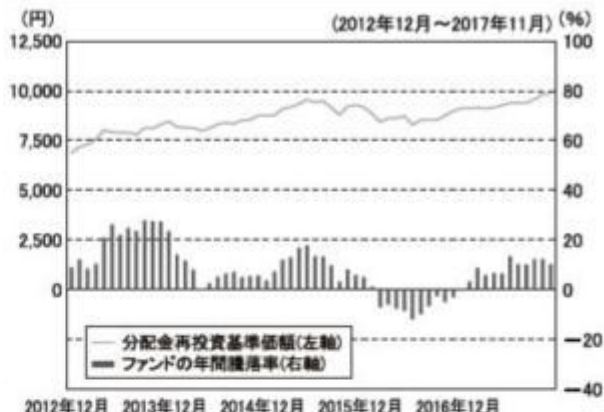
MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

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



2012年12月 2013年12月 2014年12月 2015年12月 2016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、2012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。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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）

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

4【手数料等及び税金】**（１）【申込手数料】**

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

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

信託報酬の配分

信託報酬（有価証券届出書提出日現在）の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用

(「バランスポートフォリオ」のみ)、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

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

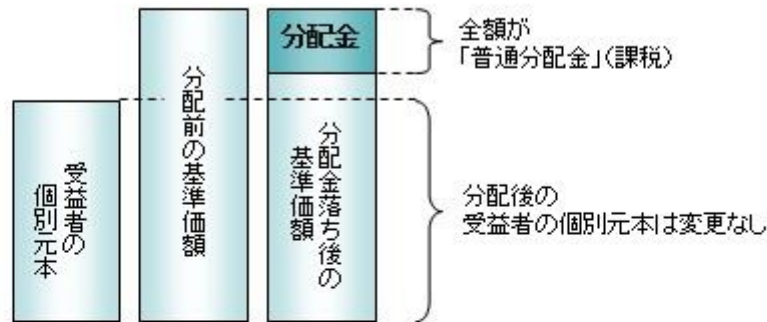
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

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

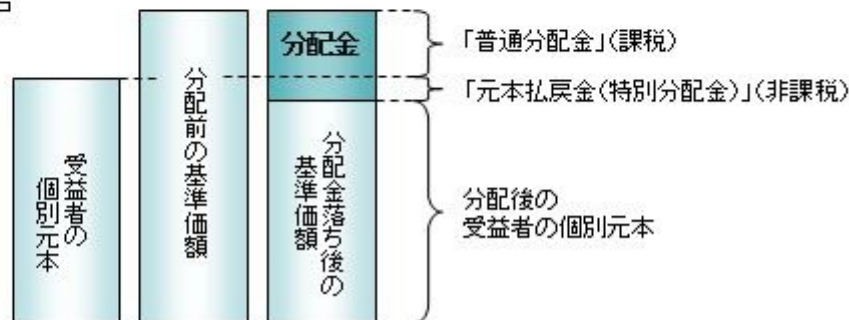
者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成30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2017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	11,823,119,247	99.94
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		7,385,608	0.06
合計(純資産総額)		11,830,504,855	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	6,732,983,626	1.7760	11,957,778,920	1.7560	11,823,119,247	99.94
----	-----------	-------------------	---------------	--------	----------------	--------	----------------	-------

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.94
合 計	99.94

【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
第30計算期間末 (2017年11月 7日)	12,193	12,201	0.7599	0.7604
2016年11月末日	11,242		0.6131	
12月末日	11,416		0.6335	
2017年 1月末日	11,359		0.6339	
2月末日	11,401		0.6392	
3月末日	11,235		0.6344	
4月末日	11,334		0.6418	
5月末日	11,488		0.6563	
6月末日	11,653		0.6744	
7月末日	11,549		0.6764	
8月末日	11,436		0.6751	

9月末日	11,839		0.7033	
10月末日	12,018		0.7405	
11月末日	11,830		0.7501	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	33.64

(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
第30期	2016年11月8日～2017年11月7日	324,013,392	2,744,057,822

【バランスポートフォリオ】

以下の運用状況は2017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	35,260,008	13.59
地方債証券	日本	32,946,930	12.70
親投資信託受益証券	日本	130,328,186	50.25
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		60,845,273	23.46
合計(純資産総額)		259,380,397	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	74,218,785	1.7770	131,886,781	1.7560	130,328,186			50.25
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	20,000,000	100.59	20,118,600	100.50	20,100,400	0.100	2019/12/20	7.75
日本	地方債証券	第29回兵庫県民債	20,000,000	99.91	19,983,400	99.87	19,975,400	0.190	2019/3/19	7.70
日本	国債証券	第293回利付国債(10年)	15,000,000	101.06	15,159,608	101.06	15,159,608	1.800	2018/6/20	5.84
日本	地方債証券	平成26年度京都安心づくりみらい債	13,000,000	99.83	12,978,680	99.78	12,971,530	0.160	2019/9/2	5.00

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	13.59

地方債証券	12.70
親投資信託受益証券	50.25
合 計	76.54

【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
第30計算期間末 (2017年11月 7日)	268	268	0.9920	0.9925
2016年11月末日	281		0.8957	
12月末日	278		0.9104	
2017年 1月末日	269		0.9101	
2月末日	266		0.9135	
3月末日	261		0.9091	
4月末日	262		0.9140	
5月末日	266		0.9240	
6月末日	267		0.9359	
7月末日	262		0.9367	
8月末日	260		0.9354	
9月末日	265		0.9547	
10月末日	265		0.9793	
11月末日	259		0.9849	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	15.02

(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
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	7,480,324	50,984,226

(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2017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	11,746,863,820	98.27
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		206,594,612	1.73
合計(純資産総額)		11,953,458,432	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	179,700,000	1.50

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	55,800	6,982.88	389,644,704	7,044.00	393,055,200	3.29
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	320,000	739.50	236,640,000	792.10	253,472,000	2.12
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	20,400	10,101.72	206,075,088	9,485.00	193,494,000	1.62
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	32,300	5,272.00	170,285,600	5,879.00	189,891,700	1.59
日本	株式	ソニー	電気機器	30,700	4,277.00	131,303,900	5,201.00	159,670,700	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	34,200	4,422.00	151,232,400	4,547.00	155,507,400	1.30
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	41,300	3,472.62	143,419,206	3,744.00	154,627,200	1.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,300	61,104.78	140,541,000	64,910.00	149,293,000	1.25
日本	株式	KDDI	情報・通信業	40,500	3,060.00	123,930,000	3,215.00	130,207,500	1.09

日本	株式	任天堂	その他製品	2,800	43,710.00	122,388,000	45,200.00	126,560,000	1.06
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	614,300	200.45	123,136,435	203.90	125,255,770	1.05
日本	株式	ファナック	電気機器	4,400	25,585.00	112,574,000	27,945.00	122,958,000	1.03
日本	株式	キヤノン	電気機器	24,700	4,072.07	100,580,129	4,298.00	106,160,600	0.89
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	28,500	3,874.02	110,409,570	3,720.00	106,020,000	0.89
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	16,900	6,322.00	106,841,800	6,184.00	104,509,600	0.87
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	33,300	2,674.72	89,068,176	2,907.50	96,819,750	0.81
日本	株式	信越化学工業	化学	8,000	11,330.00	90,640,000	11,765.00	94,120,000	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	110,000	868.54	95,539,400	834.20	91,762,000	0.77
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	33,800	2,718.36	91,880,568	2,647.00	89,468,600	0.75
日本	株式	三菱商事	卸売業	31,700	2,607.50	82,657,750	2,813.00	89,172,100	0.75
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	8,200	10,930.00	89,626,000	10,865.00	89,093,000	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	19,000	4,644.19	88,239,610	4,605.00	87,495,000	0.73
日本	株式	パナソニック	電気機器	52,400	1,666.68	87,334,032	1,668.00	87,403,200	0.73
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	4,100	20,826.17	85,387,300	20,775.00	85,177,500	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	45,900	1,940.50	89,068,950	1,852.50	85,029,750	0.71
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	17,100	4,794.00	81,977,400	4,960.00	84,816,000	0.71
日本	株式	花王	化学	11,300	7,198.00	81,337,400	7,438.00	84,049,400	0.70
日本	株式	日本電産	電気機器	5,500	14,820.00	81,510,000	15,270.00	83,985,000	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	16,200	5,540.28	89,752,536	5,095.00	82,539,000	0.69
日本	株式	ダイキン工業	機械	6,300	12,180.06	76,734,378	12,920.00	81,396,000	0.68

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.30
		建設業	3.27
		食料品	4.39
		繊維製品	0.68
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.16
		医薬品	4.30
		石油・石炭製品	0.63
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	1.01
		鉄鋼	1.14
		非鉄金属	0.96
		金属製品	0.69
		機械	5.38
		電気機器	13.73
輸送用機器	8.61		
精密機器	1.59		

	その他製品	2.10
	電気・ガス業	1.56
	陸運業	3.88
	海運業	0.23
	空運業	0.60
	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	7.62
	卸売業	4.41
	小売業	4.59
	銀行業	7.16
	証券、商品先物取引業	0.97
	保険業	2.22
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.25
	サービス業	4.13
合 計		98.27

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 2017年12月	買建	10	日本円	177,830,400	179,700,000	1.50

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

参考情報

運用実績

2017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……………7,501円

純資産総額……………118.30億円

※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、2007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）

2013年11月	2014年11月	2015年11月	2016年11月	2017年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	150円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

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

※当ファンドの実質組入比率です。

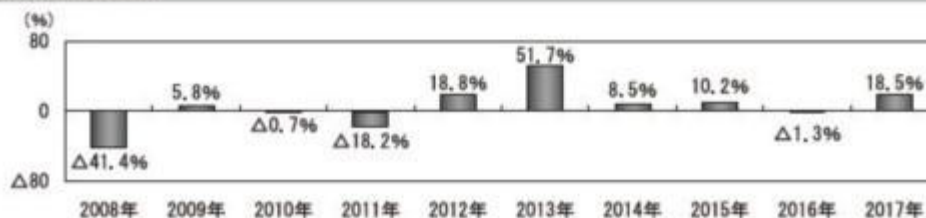
＜組入上位10銘柄＞

インデックス東証株式マザーファンド

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.29%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.12%
3 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.62%
4 日本電信電話	情報・通信業	1.59%
5 ソニー	電気機器	1.34%
6 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.30%
7 本田技研工業	輸送用機器	1.29%
8 キーエンス	電気機器	1.25%
9 KDDI	情報・通信業	1.09%
10 任天堂	その他製品	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



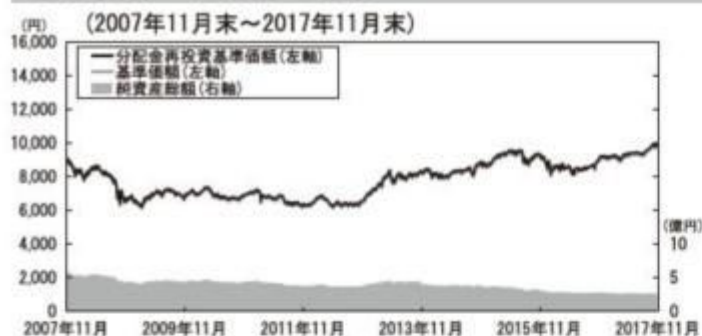
※ファンドの年間収益率は、分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。

※2017年は、2017年11月末までの騰落率です。

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

「バランスポートフォリオ」

基準価額・純資産の推移



基準価額……………9,849円

純資産総額……………2.59億円

※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、2007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）

2013年11月	2014年11月	2015年11月	2016年11月	2017年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	150円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産	比率
株式	49.38%
株式先物	0.76%
債券	26.30%
債券先物	0.00%
現金その他	24.33%

※当ファンドの実質組入比率です。

＜組入上位銘柄＞

当ファンド

	銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1	インデックス東証株式マザーファンド	親投資信託受益証券	—	—	50.25%
2	第122回利付国債（5年）	国債証券	0.100%	2019年12月20日	7.75%
3	第29回兵庫県民債	地方債証券	0.190%	2019年3月19日	7.70%
4	第293回利付国債（10年）	国債証券	1.800%	2018年6月20日	5.84%
5	平成26年度京都安心づくりみらい債	地方債証券	0.160%	2019年9月2日	5.00%

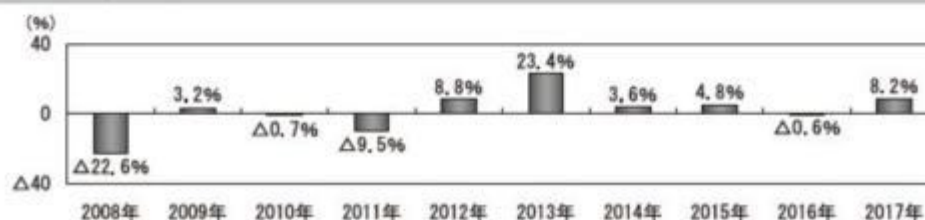
※当ファンドの対純資産総額比です。

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	3.29%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.12%
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.62%
4	日本電信電話	情報・通信業	1.59%
5	ソニー	電気機器	1.34%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2017年は、2017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。

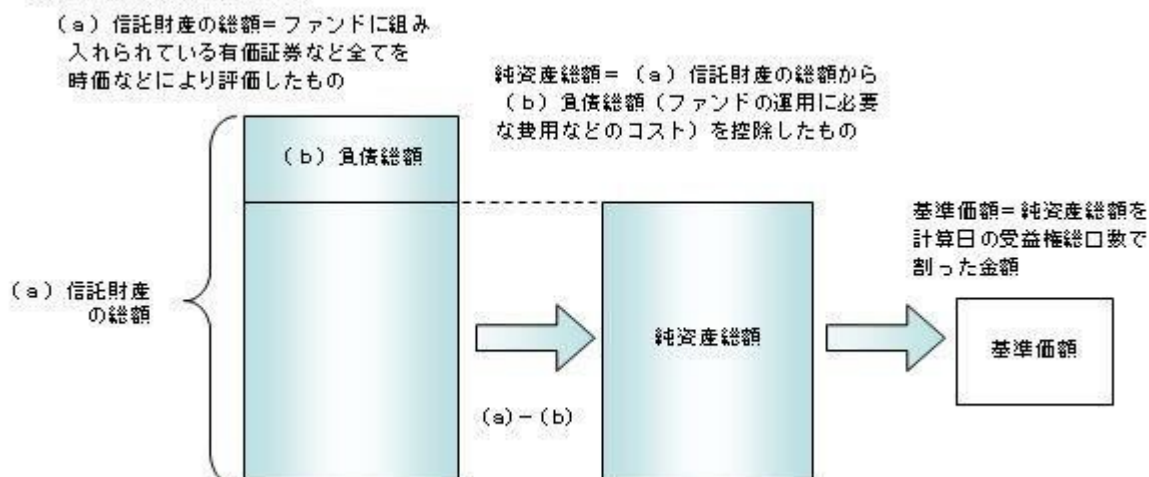
3【資産管理等の概要】

(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30期計算期間（平成28年11月 8日から平成29年11月 7日まで）の財務諸表について、P w C 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29期 平成28年11月 7日現在	第30期 平成29年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	92,197,811	106,126,587
親投資信託受益証券	10,509,863,948	12,209,433,218
未収入金	-	33,463,641
流動資産合計	10,602,061,759	12,349,023,446
資産合計	10,602,061,759	12,349,023,446
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,233,850	8,023,828
未払解約金	1,439,402	50,852,940
未払受託者報酬	4,389,463	5,047,955
未払委託者報酬	79,011,471	90,864,321
未払利息	75	157
その他未払費用	268,798	309,127
流動負債合計	94,343,059	155,098,328
負債合計	94,343,059	155,098,328
純資産の部		
元本等		
元本	18,467,701,053	16,047,656,623
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	7,959,982,353	3,853,731,505
(分配準備積立金)	1,571,728,058	2,960,779,886
元本等合計	10,507,718,700	12,193,925,118
純資産合計	10,507,718,700	12,193,925,118
負債純資産合計	10,602,061,759	12,349,023,446

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第29期		第30期	
	自	平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日	自	平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7日
営業収益				
受取利息		5,680		374
有価証券売買等損益		1,552,123,561		3,524,706,486
営業収益合計		1,552,117,881		3,524,706,860
営業費用				
支払利息		13,770		24,884
受託者報酬		9,144,917		9,940,028
委託者報酬		164,610,653		178,922,750
その他費用		560,357		608,711
営業費用合計		174,329,697		189,496,373
営業利益又は営業損失（ ）		1,726,447,578		3,335,210,487
経常利益又は経常損失（ ）		1,726,447,578		3,335,210,487
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,726,447,578		3,335,210,487
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（ ）		64,559,606		289,517,587
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,512,055,163		7,959,982,353
剰余金増加額又は欠損金減少額		398,367,254		1,180,501,748
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		398,367,254		1,180,501,748
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		175,172,622		111,919,972
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		175,172,622		111,919,972
分配金		9,233,850		8,023,828
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,959,982,353		3,853,731,505

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

		第29期 平成28年11月 7日現在	第30期 平成29年11月 7日現在
1.	期首元本額	19,238,407,356円	18,467,701,053円
	期中追加設定元本額	404,194,947円	324,013,392円
	期中一部解約元本額	1,174,901,250円	2,744,057,822円
2.	受益権の総数	18,467,701,053口	16,047,656,623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	7,959,982,353円	3,853,731,505円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第29期 自 平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日		第30期 自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益
C	信託約款に定める収益調整金	2,210,818,766円	C 信託約款に定める収益調整金
D	信託約款に定める分配準備積立 金	1,580,961,908円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	3,791,780,674円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,053円	F 分配対象収益(1万口当たり)
G	分配金額	9,233,850円	G 分配金額
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第29期 自 平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日	第30期 自 平成28年11月 8日 至 平成29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29期 平成28年11月 7日現在	第30期 平成29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

第30期（平成29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	3,222,410,904
合計	3,222,410,904

(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29期 平成28年11月 7日現在		第30期 平成29年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.5690円	1口当たり純資産額	0.7599円
(1万口当たり純資産額)	(5,690円)	(1万口当たり純資産額)	(7,599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	6,870,812,166	12,209,433,218	
合計		6,870,812,166	12,209,433,218	

(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29期 平成28年11月 7日現在	第30期 平成29年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	64,638,070	65,060,566
国債証券	50,726,140	35,296,240
地方債証券	19,997,400	32,962,080
親投資信託受益証券	138,216,080	137,642,014
未収利息	139,076	119,812
流動資産合計	273,716,766	271,080,712
資産合計		
273,716,766		
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	157,211	135,459
未払受託者報酬	117,305	114,587
未払委託者報酬	2,112,687	2,063,768
未払利息	53	96
その他未払費用	7,121	6,955
流動負債合計	2,394,377	2,320,865
負債合計		
2,394,377		
純資産の部		
元本等		
元本	314,422,612	270,918,710
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	43,100,223	2,158,863
(分配準備積立金)	19,884,372	34,156,407
元本等合計	271,322,389	268,759,847
純資産合計		
271,322,389		
負債純資産合計		
273,716,766		

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第29期		第30期	
	自	平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日	自	平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7日
営業収益				
受取利息		428,626		353,394
有価証券売買等損益		18,013,265		41,814,465
営業収益合計		17,584,639		42,167,859
営業費用				
支払利息		16,316		27,108
受託者報酬		242,181		231,049
委託者報酬		4,361,499		4,161,221
その他費用		14,967		14,022
営業費用合計		4,634,963		4,433,400
営業利益又は営業損失（ ）		22,219,602		37,734,459
経常利益又は経常損失（ ）		22,219,602		37,734,459
当期純利益又は当期純損失（ ）		22,219,602		37,734,459
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（ ）		1,853,944		3,038,437
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		24,256,885		43,100,223
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,932,894		6,959,551
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,932,894		6,959,551
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		1,253,363		578,754
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		1,253,363		578,754
分配金		157,211		135,459
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		43,100,223		2,158,863

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		第29期 平成28年11月 7日現在	第30期 平成29年11月 7日現在
1.	期首元本額	346,644,659円	314,422,612円
	期中追加設定元本額	9,326,069円	7,480,324円
	期中一部解約元本額	41,548,116円	50,984,226円
2.	受益権の総数	314,422,612口	270,918,710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	43,100,223円	2,158,863円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第29期 自 平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日		第30期 自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 286,996円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 17,307,187円
C	信託約款に定める収益調整金	44,026,500円	C 信託約款に定める収益調整金 38,370,747円

D 信託約款に定める分配準備積立金	20,041,583円	D 信託約款に定める分配準備積立金	16,697,683円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	64,068,083円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	72,662,613円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,037円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,682円
G 分配金額	157,211円	G 分配金額	135,459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29期 自 平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日	第30期 自 平成28年11月 8日 至 平成29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29期 平成28年11月 7日現在	第30期 平成29年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

（有価証券に関する注記）

第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

第30期（平成29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	421,710
地方債証券	70,420
親投資信託受益証券	36,327,576
合計	35,835,446

（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29期 平成28年11月 7日現在		第30期 平成29年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.8629円	1口当たり純資産額	0.9920円
(1万口当たり純資産額)	(8,629円)	(1万口当たり純資産額)	(9,920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122回利付国債（5年）	20,000,000	20,118,600	
	第293回利付国債（10年）	15,000,000	15,177,640	
国債証券 合計		35,000,000	35,296,240	
地方債証券	平成26年度京都安心づくりみらい債	13,000,000	12,978,680	
	第29回兵庫県民債	20,000,000	19,983,400	
地方債証券 合計		33,000,000	32,962,080	
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	77,457,521	137,642,014	
親投資信託受益証券 合計		77,457,521	137,642,014	
合計		145,457,521	205,900,334	

(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28年11月 7日現在	平成29年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	738,006	222,887
コール・ローン	140,074,995	60,704,420
株式	10,388,387,390	12,074,312,800
派生商品評価勘定	4,640,820	12,153,520
未収入金	30,978,820	146,556,910
未収配当金	88,003,408	94,640,725
流動資産合計	10,652,823,439	12,388,591,262
資産合計		
	10,652,823,439	12,388,591,262
負債の部		
流動負債		
前受金	910,000	10,785,000
未払解約金	-	33,463,641
未払利息	115	90
流動負債合計	910,115	44,248,731
負債合計		
	910,115	44,248,731
純資産の部		
元本等		
元本	8,140,733,967	6,948,269,687
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,511,179,357	5,396,072,844
元本等合計	10,651,913,324	12,344,342,531
純資産合計		
	10,651,913,324	12,344,342,531
負債純資産合計		
	10,652,823,439	12,388,591,262

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券</p>
--------------------	---

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

		平成28年11月 7日現在	平成29年11月 7日現在
1.	期首	平成27年11月10日	平成28年11月 8日
	期首元本額	8,626,831,832円	8,140,733,967円
	期首からの追加設定元本額	87,701,593円	35,347,294円
	期首からの一部解約元本額	573,799,458円	1,227,811,574円
	元本の内訳		
	インデックスポートフォリオ	8,035,064,181円	6,870,812,166円
	バランスポートフォリオ	105,669,786円	77,457,521円
	計	8,140,733,967円	6,948,269,687円
2.	受益権の総数	8,140,733,967口	6,948,269,687口
3.	担保資産		
	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
	株式	80,600,160円	108,799,250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27年11月10日 至 平成28年11月 7日	自 平成28年11月 8日 至 平成29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28年11月 7日現在	平成29年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成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

(平成29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	449,062,394
合計	449,062,394

(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

(平成29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	206,060,000	-	218,220,000	12,160,000
合計		206,060,000	-	218,220,000	12,160,000

(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28年11月 7日現在		平成29年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.308円	1口当たり純資産額	1.777円
(1千口当たり純資産額)	(1,308円)	(1千口当たり純資産額)	(1,777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	3,710.00	742,000	
日本水産	5,800	645.00	3,741,000	
マルハニチロ	1,000	3,220.00	3,220,000	
カネコ種苗	200	1,716.00	343,200	
サカタのタネ	800	3,610.00	2,888,000	
ホクト	500	1,975.00	987,500	
ホクリヨウ	100	1,148.00	114,800	
住石ホールディングス	1,700	159.00	270,300	
日鉄鉱業	100	7,710.00	771,000	
三井松島産業	300	1,486.00	445,800	
国際石油開発帝石	25,400	1,319.50	33,515,300	
日本海洋掘削	200	2,188.00	437,600	
石油資源開発	800	2,589.00	2,071,200	
K & O エナジーグループ	300	1,896.00	568,800	
ショーボンドホールディングス	500	7,080.00	3,540,000	
ミライト・ホールディングス	1,600	1,479.00	2,366,400	
ファーストコーポレーション	200	1,216.00	243,200	
ベステラ	100	2,174.00	217,400	
インベスターズクラウド	100	5,940.00	594,000	
安藤・間	4,000	950.00	3,800,000	
東急建設	1,900	1,012.00	1,922,800	
コムシスホールディングス	1,900	3,015.00	5,728,500	
ミサワホーム	400	1,083.00	433,200	
高松コンストラクショングループ	300	3,105.00	931,500	
東建コーポレーション	200	13,570.00	2,714,000	
ヤマウラ	300	966.00	289,800	
大成建設	5,300	6,610.00	35,033,000	
大林組	15,700	1,561.00	24,507,700	
清水建設	16,000	1,389.00	22,224,000	
飛島建設	4,800	170.00	816,000	

長谷工コーポレーション	6,100	1,684.00	10,272,400
松井建設	600	1,033.00	619,800
銭高組	100	5,770.00	577,000
鹿島建設	23,000	1,260.00	28,980,000
不動テトラ	3,800	193.00	733,400
大末建設	200	1,074.00	214,800
鉄建建設	300	3,840.00	1,152,000
西松建設	1,200	3,545.00	4,254,000
三井住友建設	3,700	722.00	2,671,400
大豊建設	2,000	585.00	1,170,000
前田建設工業	3,800	1,575.00	5,985,000
ナカノフドー建設	300	650.00	195,000
奥村組	900	4,610.00	4,149,000
東鉄工業	600	3,855.00	2,313,000
イチケン	200	2,785.00	557,000
浅沼組	2,000	422.00	844,000
戸田建設	6,000	974.00	5,844,000
熊谷組	800	3,640.00	2,912,000
青木あすなろ建設	300	1,035.00	310,500
北野建設	1,000	512.00	512,000
植木組	100	2,736.00	273,600
三井ホーム	1,000	753.00	753,000
矢作建設工業	700	1,017.00	711,900
ピーエス三菱	700	769.00	538,300
日本ハウスホールディングス	1,000	620.00	620,000
大東建託	1,900	20,035.00	38,066,500
新日本建設	600	1,024.00	614,400
N I P P O	1,000	2,462.00	2,462,000
東亜道路工業	100	4,500.00	450,000
前田道路	2,000	2,508.00	5,016,000
日本道路	100	6,610.00	661,000
東亜建設工業	400	2,555.00	1,022,000
若築建設	300	1,938.00	581,400
東洋建設	1,600	586.00	937,600
五洋建設	6,300	776.00	4,888,800
世紀東急工業	700	664.00	464,800
福田組	200	6,750.00	1,350,000
住友林業	3,400	1,935.00	6,579,000
日本基礎技術	500	406.00	203,000
日成ビルド工業	800	1,267.00	1,013,600
ヤマダ・エスバイエルホーム	3,000	84.00	252,000
巴コーポレーション	600	488.00	292,800

大和ハウス工業	15,400	4,274.00	65,819,600
ライト工業	1,000	1,172.00	1,172,000
積水ハウス	17,000	2,178.50	37,034,500
日特建設	400	630.00	252,000
北陸電気工事	300	1,049.00	314,700
ユアテック	800	1,019.00	815,200
西部電気工業	100	2,550.00	255,000
中電工	700	3,140.00	2,198,000
関電工	2,100	1,145.00	2,404,500
きんでん	3,500	1,897.00	6,639,500
東京エネシス	600	1,362.00	817,200
トーエネック	100	3,365.00	336,500
住友電設	400	2,550.00	1,020,000
日本電設工業	800	2,418.00	1,934,400
協和エクシオ	1,900	2,452.00	4,658,800
新日本空調	400	1,616.00	646,400
九電工	1,000	4,985.00	4,985,000
三機工業	1,100	1,338.00	1,471,800
日揮	4,500	2,032.00	9,144,000
中外炉工業	200	2,242.00	448,400
ヤマト	400	818.00	327,200
太平電業	400	2,926.00	1,170,400
高砂熱学工業	1,400	2,032.00	2,844,800
三晃金属工業	100	4,155.00	415,500
朝日工業社	100	3,655.00	365,500
明星工業	900	854.00	768,600
大気社	700	3,500.00	2,450,000
ダイダン	400	2,908.00	1,163,200
日比谷総合設備	600	2,445.00	1,467,000
東芝プラントシステム	1,100	1,988.00	2,186,800
OSJBホールディングス	2,200	348.00	765,600
東洋エンジニアリング	600	1,413.00	847,800
千代田化工建設	3,400	745.00	2,533,000
新興プランテック	1,000	1,097.00	1,097,000
日本製粉	1,500	1,767.00	2,650,500
日清製粉グループ本社	5,800	2,085.00	12,093,000
昭和産業	400	2,973.00	1,189,200
鳥越製粉	400	971.00	388,400
中部飼料	500	2,151.00	1,075,500
フィード・ワン	3,300	291.00	960,300
東洋精糖	100	1,197.00	119,700
日本甜菜製糖	300	2,445.00	733,500

三井製糖	400	3,915.00	1,566,000
塩水港精糖	700	269.00	188,300
日新製糖	200	2,091.00	418,200
森永製菓	1,100	6,530.00	7,183,000
中村屋	100	5,030.00	503,000
江崎グリコ	1,300	5,710.00	7,423,000
名糖産業	200	1,499.00	299,800
不二家	300	2,629.00	788,700
山崎製パン	3,800	2,075.00	7,885,000
第一屋製パン	100	1,232.00	123,200
モロゾフ	100	7,520.00	752,000
亀田製菓	300	5,300.00	1,590,000
寿スピリッツ	500	4,860.00	2,430,000
カルビー	2,100	3,875.00	8,137,500
森永乳業	900	4,435.00	3,991,500
六甲バター	200	2,639.00	527,800
ヤクルト本社	2,800	9,450.00	26,460,000
明治ホールディングス	3,100	9,390.00	29,109,000
雪印メグミルク	1,100	3,235.00	3,558,500
プリマハム	3,000	740.00	2,220,000
日本ハム	4,000	2,901.00	11,604,000
林兼産業	200	971.00	194,200
丸大食品	3,000	534.00	1,602,000
S Foods	300	4,320.00	1,296,000
伊藤ハム米久ホールディングス	3,000	1,093.00	3,279,000
サッポロホールディングス	1,700	3,410.00	5,797,000
アサヒグループホールディングス	9,800	5,330.00	52,234,000
キリンホールディングス	22,500	2,654.50	59,726,250
宝ホールディングス	3,800	1,143.00	4,343,400
オエノンホールディングス	1,300	330.00	429,000
養命酒製造	100	2,336.00	233,600
コカ・コーラボトラーズジャパン	3,300	4,045.00	13,348,500
サントリー食品インターナショナル	3,500	5,000.00	17,500,000
ダイトーグループホールディングス	200	5,600.00	1,120,000
伊藤園	1,600	4,035.00	6,456,000
キーコーヒー	400	2,123.00	849,200
ユニカフェ	200	1,154.00	230,800
ジャパンフーズ	100	1,428.00	142,800
日清オイリオグループ	600	3,335.00	2,001,000
不二製油グループ本社	1,200	3,005.00	3,606,000
かどや製油	100	6,200.00	620,000
J - オイルミルズ	200	4,090.00	818,000

キッコーマン	3,700	4,055.00	15,003,500
味の素	10,700	2,308.50	24,700,950
キューピー	2,700	2,871.00	7,751,700
ハウス食品グループ本社	1,800	3,445.00	6,201,000
カゴメ	1,900	4,010.00	7,619,000
焼津水産化学工業	300	1,221.00	366,300
アリアケジャパン	400	8,690.00	3,476,000
ピエトロ	100	1,672.00	167,200
エバラ食品工業	100	2,088.00	208,800
ニチレイ	2,300	3,075.00	7,072,500
東洋水産	2,600	4,685.00	12,181,000
日清食品ホールディングス	2,000	7,260.00	14,520,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,360.00	1,360,000
一正蒲鉾	200	1,340.00	268,000
フジッコ	500	2,550.00	1,275,000
ロック・フィールド	500	2,001.00	1,000,500
日本たばこ産業	29,000	3,840.00	111,360,000
ケンコーマヨネーズ	300	2,900.00	870,000
わらべや日洋ホールディングス	300	2,881.00	864,300
なとり	300	2,019.00	605,700
イフジ産業	200	808.00	161,600
ユーグレナ	1,800	1,135.00	2,043,000
ミヨシ油脂	200	1,485.00	297,000
理研ビタミン	200	4,385.00	877,000
片倉工業	600	1,339.00	803,400
ゲンゼ	400	5,300.00	2,120,000
東洋紡	1,800	2,202.00	3,963,600
ユニチカ	1,400	999.00	1,398,600
富士紡ホールディングス	300	3,535.00	1,060,500
倉敷紡績	5,000	327.00	1,635,000
シキボウ	300	1,521.00	456,300
日本毛織	1,400	1,030.00	1,442,000
ダイトウボウ	1,800	102.00	183,600
ダイドーリミテッド	600	441.00	264,600
帝国繊維	500	2,388.00	1,194,000
帝人	4,000	2,474.00	9,896,000
東レ	35,400	1,188.00	42,055,200
サカイオーベックス	100	2,278.00	227,800
住江織物	1,000	315.00	315,000
日本フェルト	300	511.00	153,300
日東製網	100	1,845.00	184,500
アツギ	300	1,309.00	392,700

ダイニック	200	1,209.00	241,800
セーレン	1,100	1,926.00	2,118,600
ソトー	200	1,153.00	230,600
東海染工	100	1,504.00	150,400
小松精練	800	937.00	749,600
ワコールホールディングス	1,400	3,305.00	4,627,000
ホギメディカル	300	7,980.00	2,394,000
レナウン	1,600	193.00	308,800
T S Iホールディングス	1,800	930.00	1,674,000
三陽商会	300	2,134.00	640,200
ナイガイ	300	582.00	174,600
オンワードホールディングス	3,000	941.00	2,823,000
ルック	1,000	421.00	421,000
キムラタン	2,500	56.00	140,000
ゴールドウイン	100	8,280.00	828,000
デサント	1,100	1,556.00	1,711,600
キング	400	597.00	238,800
特種東海製紙	300	4,500.00	1,350,000
王子ホールディングス	21,000	678.00	14,238,000
日本製紙	2,200	2,352.00	5,174,400
三菱製紙	700	778.00	544,600
北越紀州製紙	2,800	740.00	2,072,000
中越パルプ工業	200	2,198.00	439,600
巴川製紙所	1,000	315.00	315,000
大王製紙	1,900	1,428.00	2,713,200
阿波製紙	200	706.00	141,200
レンゴー	4,700	770.00	3,619,000
トモク	300	2,158.00	647,400
ザ・パックス	400	3,935.00	1,574,000
クラレ	8,200	2,354.00	19,302,800
旭化成	30,400	1,407.50	42,788,000
共和レザー	300	963.00	288,900
昭和電工	3,300	3,940.00	13,002,000
住友化学	35,000	821.00	28,735,000
住友精化	200	6,830.00	1,366,000
日産化学工業	2,900	4,495.00	13,035,500
ラサ工業	200	2,320.00	464,000
クレハ	400	6,860.00	2,744,000
多木化学	100	5,120.00	512,000
テイカ	400	2,694.00	1,077,600
石原産業	900	1,729.00	1,556,100
日東エフシー	300	853.00	255,900

日本曹達	4,000	720.00	2,880,000
東ソー	7,100	2,565.00	18,211,500
トクヤマ	1,400	3,475.00	4,865,000
セントラル硝子	1,000	2,273.00	2,273,000
東亜合成	2,800	1,421.00	3,978,800
大阪ソーダ	400	2,963.00	1,185,200
関東電化工業	1,200	1,109.00	1,330,800
デンカ	1,800	3,895.00	7,011,000
信越化学工業	8,200	12,510.00	102,582,000
日本カーバイド工業	200	2,328.00	465,600
堺化学工業	300	2,635.00	790,500
エア・ウォーター	4,000	2,225.00	8,900,000
大陽日酸	3,800	1,468.00	5,578,400
日本化学工業	200	2,659.00	531,800
日本パーカライズング	2,500	1,784.00	4,460,000
高圧ガス工業	700	878.00	614,600
四国化成工業	700	1,864.00	1,304,800
戸田工業	100	4,635.00	463,500
ステラ ケミファ	200	3,695.00	739,000
保土谷化学工業	200	6,640.00	1,328,000
日本触媒	800	8,610.00	6,888,000
大日精化工業	400	5,260.00	2,104,000
カネカ	7,000	955.00	6,685,000
三菱瓦斯化学	4,200	3,010.00	12,642,000
三井化学	4,400	3,420.00	15,048,000
J S R	4,900	2,222.00	10,887,800
東京応化工業	800	4,205.00	3,364,000
大阪有機化学工業	300	1,353.00	405,900
三菱ケミカルホールディングス	32,800	1,213.50	39,802,800
K Hネオケム	700	2,792.00	1,954,400
ダイセル	6,600	1,285.00	8,481,000
住友ベークライト	4,000	935.00	3,740,000
積水化学工業	10,100	2,274.00	22,967,400
日本ゼオン	4,200	1,577.00	6,623,400
アイカ工業	1,400	3,950.00	5,530,000
宇部興産	2,500	3,375.00	8,437,500
積水樹脂	700	2,487.00	1,740,900
タキロンシーアイ	1,000	735.00	735,000
旭有機材	300	1,721.00	516,300
日立化成	2,400	3,210.00	7,704,000
リケンテクノス	1,000	672.00	672,000
大倉工業	1,000	806.00	806,000

積水化成成品工業	600	1,459.00	875,400
群栄化学工業	100	3,800.00	380,000
タイガースポリマー	300	809.00	242,700
ミライアル	200	1,612.00	322,400
ダイキョーニシカワ	900	1,899.00	1,709,100
日本化薬	3,200	1,813.00	5,801,600
カーリットホールディングス	500	802.00	401,000
日本精化	400	1,079.00	431,600
扶桑化学工業	300	3,375.00	1,012,500
A D E K A	2,100	1,846.00	3,876,600
日油	1,900	3,095.00	5,880,500
新日本理化	1,000	290.00	290,000
ハリマ化成グループ	400	896.00	358,400
花王	11,500	7,023.00	80,764,500
第一工業製薬	1,000	834.00	834,000
日華化学	200	1,210.00	242,000
ニイタカ	100	1,924.00	192,400
三洋化成工業	300	5,730.00	1,719,000
有機合成薬品工業	500	298.00	149,000
大日本塗料	600	1,748.00	1,048,800
日本ペイントホールディングス	3,700	3,975.00	14,707,500
関西ペイント	5,200	2,900.00	15,080,000
中国塗料	1,400	941.00	1,317,400
日本特殊塗料	300	2,005.00	601,500
藤倉化成	600	709.00	425,400
太陽ホールディングス	400	5,510.00	2,204,000
D I C	1,900	4,205.00	7,989,500
サカタインクス	1,000	2,137.00	2,137,000
東洋インキ S C ホールディングス	5,000	659.00	3,295,000
T & K T O K A	300	1,295.00	388,500
富士フイルムホールディングス	9,700	4,624.00	44,852,800
資生堂	8,700	4,721.00	41,072,700
ライオン	6,500	2,164.00	14,066,000
高砂香料工業	300	3,950.00	1,185,000
マンダム	900	3,525.00	3,172,500
ミルボン	300	7,230.00	2,169,000
ファンケル	1,100	3,055.00	3,360,500
コーセー	800	15,180.00	12,144,000
コタ	200	1,436.00	287,200
シーズ・ホールディングス	600	4,250.00	2,550,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,000	3,840.00	7,680,000
ノエビアホールディングス	300	7,060.00	2,118,000

エステー	300	2,765.00	829,500
コニシ	800	1,992.00	1,593,600
長谷川香料	600	2,350.00	1,410,000
星光PMC	200	1,262.00	252,400
小林製薬	1,300	6,820.00	8,866,000
荒川化学工業	400	2,411.00	964,400
メック	300	2,205.00	661,500
日本高純度化学	100	2,659.00	265,900
タカラバイオ	1,200	1,530.00	1,836,000
JCU	300	5,940.00	1,782,000
新田ゼラチン	300	810.00	243,000
デクセリアルズ	1,200	1,459.00	1,750,800
アース製薬	300	5,210.00	1,563,000
北興化学工業	400	691.00	276,400
大成ラミック	200	3,105.00	621,000
クミアイ化学工業	2,100	755.00	1,585,500
日本農薬	1,300	660.00	858,000
アキレス	400	2,290.00	916,000
有沢製作所	800	1,011.00	808,800
日東電工	3,500	11,685.00	40,897,500
レック	300	2,963.00	888,900
きもと	1,000	280.00	280,000
藤森工業	400	3,875.00	1,550,000
前澤化成工業	300	1,230.00	369,000
JSP	300	3,585.00	1,075,500
エフピコ	400	6,230.00	2,492,000
天馬	400	2,399.00	959,600
信越ポリマー	900	1,183.00	1,064,700
東リ	1,100	411.00	452,100
ニフコ	800	7,790.00	6,232,000
日本バルカー工業	400	2,627.00	1,050,800
ユニ・チャーム	9,900	2,626.00	25,997,400
協和発酵キリン	5,900	2,194.00	12,944,600
武田薬品工業	17,200	6,433.00	110,647,600
アステラス製薬	48,000	1,512.00	72,576,000
大日本住友製薬	3,500	1,681.00	5,883,500
塩野義製薬	6,700	6,264.00	41,968,800
田辺三菱製薬	5,700	2,471.00	14,084,700
わかもと製薬	1,000	290.00	290,000
あすか製薬	500	2,045.00	1,022,500
日本新薬	1,200	7,740.00	9,288,000
バイオフェルミン製薬	100	3,130.00	313,000

中外製薬	4,900	5,630.00	27,587,000
科研製薬	800	5,840.00	4,672,000
エーザイ	5,600	6,512.00	36,467,200
ロート製薬	2,600	2,712.00	7,051,200
小野薬品工業	11,900	2,587.00	30,785,300
久光製薬	1,400	6,520.00	9,128,000
持田製薬	300	8,290.00	2,487,000
参天製薬	8,800	1,757.00	15,461,600
扶桑薬品工業	200	2,834.00	566,800
日本ケミファ	100	5,020.00	502,000
ツムラ	1,700	4,235.00	7,199,500
日医工	1,200	1,786.00	2,143,200
キッセイ薬品工業	900	3,190.00	2,871,000
生化学工業	900	2,035.00	1,831,500
栄研化学	400	4,355.00	1,742,000
鳥居薬品	300	3,065.00	919,500
JCRファーマ	300	4,415.00	1,324,500
東和薬品	200	5,940.00	1,188,000
富士製薬工業	200	4,245.00	849,000
沢井製薬	800	6,530.00	5,224,000
ゼリア新薬工業	1,000	2,159.00	2,159,000
第一三共	13,300	2,704.50	35,969,850
キョーリン製薬ホールディングス	1,300	2,184.00	2,839,200
大幸薬品	200	2,493.00	498,600
ダイト	300	3,015.00	904,500
大塚ホールディングス	9,700	4,826.00	46,812,200
大正製薬ホールディングス	1,000	8,730.00	8,730,000
ペプチドリーム	1,900	3,590.00	6,821,000
日本コークス工業	4,200	131.00	550,200
昭和シェル石油	4,400	1,440.00	6,336,000
ニチレキ	600	1,441.00	864,600
ユシロ化学工業	300	1,720.00	516,000
ビーピー・カストロール	200	2,012.00	402,400
富士石油	1,200	497.00	596,400
MORESCO	200	2,068.00	413,600
出光興産	3,900	3,510.00	13,689,000
JXTGホールディングス	74,400	630.60	46,916,640
コスモエネルギーホールディングス	1,300	2,794.00	3,632,200
横浜ゴム	2,700	2,581.00	6,968,700
東洋ゴム工業	2,700	2,549.00	6,882,300
ブリヂストン	16,500	5,591.00	92,251,500
住友ゴム工業	4,500	2,173.00	9,778,500

藤倉ゴム工業	400	918.00	367,200
オカモト	2,000	1,218.00	2,436,000
フコク	200	1,090.00	218,000
ニッタ	500	4,540.00	2,270,000
住友理工	900	1,165.00	1,048,500
三ツ星ベルト	1,000	1,456.00	1,456,000
バンドー化学	900	1,239.00	1,115,100
日東紡績	700	3,460.00	2,422,000
旭硝子	4,800	4,845.00	23,256,000
日本板硝子	2,400	1,035.00	2,484,000
石塚硝子	100	2,584.00	258,400
日本山村硝子	2,000	203.00	406,000
日本電気硝子	2,000	4,735.00	9,470,000
オハラ	200	2,215.00	443,000
住友大阪セメント	9,000	495.00	4,455,000
太平洋セメント	2,900	4,595.00	13,325,500
日本ヒューム	500	780.00	390,000
日本コンクリート工業	1,000	468.00	468,000
三谷セキサン	200	2,658.00	531,600
アジアパイルホールディングス	600	648.00	388,800
東海カーボン	4,300	1,206.00	5,185,800
日本カーボン	200	4,665.00	933,000
東洋炭素	300	3,170.00	951,000
ノリタケカンパニーリミテド	300	5,580.00	1,674,000
TOTO	3,600	5,760.00	20,736,000
日本碍子	5,700	2,187.00	12,465,900
日本特殊陶業	4,000	2,706.00	10,824,000
MARUWA	200	7,350.00	1,470,000
品川リフラクトリーズ	100	3,370.00	337,000
黒崎播磨	100	4,490.00	449,000
イソライト工業	400	1,196.00	478,400
東京窯業	800	397.00	317,600
ニッカトー	300	677.00	203,100
フジインコーポレーテッド	400	2,500.00	1,000,000
エーアンドエーマテリアル	200	1,371.00	274,200
ニチアス	3,000	1,385.00	4,155,000
ニチハ	600	4,520.00	2,712,000
新日鐵住金	20,600	2,687.50	55,362,500
神戸製鋼所	8,500	1,082.00	9,197,000
中山製鋼所	600	807.00	484,200
合同製鐵	300	2,164.00	649,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	12,400	2,593.50	32,159,400

日新製鋼	1,300	1,653.00	2,148,900
東京製鐵	2,500	978.00	2,445,000
共英製鋼	500	1,881.00	940,500
大和工業	1,000	3,235.00	3,235,000
東京鐵鋼	200	2,121.00	424,200
大阪製鐵	300	2,484.00	745,200
淀川製鋼所	700	3,435.00	2,404,500
東洋鋼鋳	1,100	470.00	517,000
丸一鋼管	1,600	3,445.00	5,512,000
モリ工業	200	3,565.00	713,000
大同特殊鋼	800	7,160.00	5,728,000
日本高周波鋼業	200	969.00	193,800
日本冶金工業	4,000	222.00	888,000
山陽特殊製鋼	500	3,105.00	1,552,500
愛知製鋼	300	4,680.00	1,404,000
日立金属	5,000	1,530.00	7,650,000
日本金属	100	2,867.00	286,700
大平洋金属	300	3,330.00	999,000
新日本電工	2,800	484.00	1,355,200
栗本鐵工所	200	2,314.00	462,800
日本鑄鉄管	1,000	184.00	184,000
三菱製鋼	300	2,768.00	830,400
日亜鋼業	800	337.00	269,600
シンニッタン	500	738.00	369,000
新家工業	100	2,188.00	218,800
大紀アルミニウム工業所	700	903.00	632,100
日本軽金属ホールディングス	13,600	329.00	4,474,400
三井金属鉱業	1,300	6,080.00	7,904,000
東邦亜鉛	300	6,060.00	1,818,000
三菱マテリアル	3,000	4,480.00	13,440,000
住友金属鉱山	5,900	4,890.00	28,851,000
D O W Aホールディングス	1,200	4,965.00	5,958,000
古河機械金属	800	2,122.00	1,697,600
エス・サイエンス	1,900	104.00	197,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	500	1,699.00	849,500
東邦チタニウム	800	969.00	775,200
U A C J	700	3,130.00	2,191,000
古河電気工業	1,500	6,010.00	9,015,000
住友電気工業	17,200	1,934.50	33,273,400
フジクラ	5,600	996.00	5,577,600
昭和電線ホールディングス	600	1,095.00	657,000
タツタ電線	900	819.00	737,100

沖電線	100	3,640.00	364,000
カナレ電気	100	2,530.00	253,000
平河ヒューテック	200	1,330.00	266,000
リョービ	600	2,907.00	1,744,200
アーレスティ	600	917.00	550,200
アサヒホールディングス	700	2,473.00	1,731,100
稲葉製作所	300	1,441.00	432,300
宮地エンジニアリンググループ	100	3,040.00	304,000
トーカロ	300	4,825.00	1,447,500
アルファC o	200	2,369.00	473,800
SUMCO	4,300	2,587.00	11,124,100
川田テクノロジーズ	100	6,790.00	679,000
東洋製罐グループホールディングス	3,100	1,943.00	6,023,300
ホッカンホールディングス	1,000	438.00	438,000
コロナ	300	1,355.00	406,500
横河ブリッジホールディングス	900	2,470.00	2,223,000
駒井ハルテック	100	2,662.00	266,200
高田機工	100	3,420.00	342,000
三和ホールディングス	4,500	1,499.00	6,745,500
文化シャッター	1,400	973.00	1,362,200
三協立山	600	1,669.00	1,001,400
アルインコ	300	1,280.00	384,000
東洋シャッター	200	619.00	123,800
LIXILグループ	6,800	3,040.00	20,672,000
日本フィルコン	400	799.00	319,600
ノーリツ	1,000	2,102.00	2,102,000
長府製作所	500	2,767.00	1,383,500
リンナイ	800	9,710.00	7,768,000
ダイニチ工業	300	843.00	252,900
日東精工	600	668.00	400,800
三洋工業	100	2,173.00	217,300
岡部	900	1,007.00	906,300
ジーテクト	500	2,388.00	1,194,000
中国工業	100	819.00	81,900
東プレ	900	3,255.00	2,929,500
高周波熱錬	900	1,202.00	1,081,800
東京製綱	300	1,768.00	530,400
モリテック スチール	400	660.00	264,000
パイオラックス	600	3,260.00	1,956,000
エイチワン	400	1,603.00	641,200
日本発條	4,600	1,351.00	6,214,600
中央発條	100	3,735.00	373,500

アドバネクス	100	3,100.00	310,000
三益半導体工業	400	2,036.00	814,400
日本製鋼所	1,500	3,380.00	5,070,000
三浦工業	2,000	2,940.00	5,880,000
タクマ	1,600	1,448.00	2,316,800
ツガミ	1,000	1,167.00	1,167,000
オークマ	500	7,230.00	3,615,000
東芝機械	3,000	731.00	2,193,000
アマダホールディングス	7,100	1,456.00	10,337,600
アイダエンジニアリング	1,200	1,367.00	1,640,400
滝澤鉄工所	200	2,151.00	430,200
富士機械製造	1,400	2,316.00	3,242,400
牧野フライス製作所	2,000	1,142.00	2,284,000
オーエスジー	2,100	2,476.00	5,199,600
ダイジェット工業	100	1,867.00	186,700
旭ダイヤモンド工業	1,400	1,224.00	1,713,600
D M G 森精機	2,600	2,417.00	6,284,200
ソディック	1,000	1,584.00	1,584,000
ディスコ	600	26,500.00	15,900,000
日東工器	300	2,940.00	882,000
日進工具	100	2,391.00	239,100
パンチ工業	200	1,979.00	395,800
富士ダイス	300	929.00	278,700
豊和工業	300	1,641.00	492,300
O K K	200	1,237.00	247,400
東洋機械金属	400	879.00	351,600
津田駒工業	1,000	202.00	202,000
島精機製作所	600	7,370.00	4,422,000
N C ホールディングス	200	871.00	174,200
フリー	300	1,154.00	346,200
ヤマシンフィルタ	100	4,755.00	475,500
日阪製作所	700	1,055.00	738,500
やまびこ	900	1,559.00	1,403,100
平田機工	100	14,190.00	1,419,000
ペガサスミシン製造	400	752.00	300,800
ナブテスコ	2,500	4,585.00	11,462,500
三井海洋開発	500	2,866.00	1,433,000
レオン自動機	400	1,726.00	690,400
S M C	1,500	45,640.00	68,460,000
新川	400	883.00	353,200
ホソカワミクロン	200	7,130.00	1,426,000
ユニオンツール	200	3,820.00	764,000

オイレス工業	600	2,208.00	1,324,800
日精エー・エス・ビー機械	200	5,490.00	1,098,000
サトーホールディングス	600	3,365.00	2,019,000
技研製作所	200	3,230.00	646,000
日本エアテック	300	869.00	260,700
日精樹脂工業	400	1,520.00	608,000
ワイエイシイホールディングス	200	1,137.00	227,400
小松製作所	22,600	3,832.00	86,603,200
住友重機械工業	2,700	5,100.00	13,770,000
日立建機	2,200	4,050.00	8,910,000
日工	100	2,298.00	229,800
巴工業	200	2,140.00	428,000
井関農機	500	2,508.00	1,254,000
TOWA	400	2,008.00	803,200
丸山製作所	100	1,972.00	197,200
北川鉄工所	200	3,120.00	624,000
ローツェ	200	2,945.00	589,000
クボタ	25,200	2,176.00	54,835,200
荏原実業	200	1,847.00	369,400
三菱化工機	200	2,398.00	479,600
月島機械	900	1,331.00	1,197,900
帝国電機製作所	400	1,207.00	482,800
新東工業	1,100	1,331.00	1,464,100
澁谷工業	400	4,375.00	1,750,000
アイチ コーポレーション	700	840.00	588,000
小森コーポレーション	1,200	1,583.00	1,899,600
鶴見製作所	400	1,926.00	770,400
住友精密工業	1,000	380.00	380,000
酒井重工業	100	3,930.00	393,000
荏原製作所	1,900	4,300.00	8,170,000
石井鐵工所	100	1,803.00	180,300
西島製作所	500	1,198.00	599,000
北越工業	500	1,193.00	596,500
ダイキン工業	6,400	13,230.00	84,672,000
オルガノ	200	2,840.00	568,000
トーヨーカネツ	200	4,330.00	866,000
栗田工業	2,500	3,555.00	8,887,500
椿本チエイン	3,000	939.00	2,817,000
大同工業	200	1,790.00	358,000
木村化工機	600	451.00	270,600
アネスト岩田	800	1,151.00	920,800
ダイフク	2,300	5,950.00	13,685,000

サムコ	200	1,089.00	217,800
加藤製作所	200	3,770.00	754,000
油研工業	100	2,715.00	271,500
タダノ	2,200	1,763.00	3,878,600
フジテック	1,500	1,797.00	2,695,500
C K D	1,300	2,399.00	3,118,700
キトー	300	1,487.00	446,100
平和	1,400	2,152.00	3,012,800
理想科学工業	500	2,141.00	1,070,500
S A N K Y O	1,200	3,710.00	4,452,000
日本金銭機械	400	1,121.00	448,400
マースエンジニアリング	300	2,282.00	684,600
福島工業	300	4,460.00	1,338,000
オーイズミ	400	567.00	226,800
ダイコク電機	200	1,713.00	342,600
竹内製作所	700	2,495.00	1,746,500
アマノ	1,400	2,771.00	3,879,400
J U K I	700	1,930.00	1,351,000
サンデンホールディングス	600	2,330.00	1,398,000
蛇の目マシン工業	400	790.00	316,000
マックス	700	1,614.00	1,129,800
グローリー	1,400	4,375.00	6,125,000
新晃工業	500	1,958.00	979,000
大和冷機工業	700	1,331.00	931,700
セガサミーホールディングス	4,600	1,465.00	6,739,000
日本ピストンリング	200	2,485.00	497,000
リケン	200	5,960.00	1,192,000
T P R	500	4,055.00	2,027,500
ツバキ・ナカシマ	500	2,650.00	1,325,000
ホシザキ	1,500	11,160.00	16,740,000
大豊工業	400	1,778.00	711,200
日本精工	9,600	1,691.00	16,233,600
N T N	10,800	566.00	6,112,800
ジェイテクト	5,000	2,045.00	10,225,000
不二越	4,000	746.00	2,984,000
日本トムソン	1,500	679.00	1,018,500
T H K	2,900	4,440.00	12,876,000
ユーシン精機	200	3,110.00	622,000
前澤給装工業	200	1,852.00	370,400
イーグル工業	600	2,217.00	1,330,200
前澤工業	500	421.00	210,500
日本ピラー工業	500	1,551.00	775,500

キッツ	2,100	904.00	1,898,400
マキタ	6,100	4,950.00	30,195,000
日立造船	3,600	627.00	2,257,200
三菱重工業	7,800	4,449.00	34,702,200
I H I	3,600	3,695.00	13,302,000
スター精密	800	2,030.00	1,624,000
日清紡ホールディングス	2,800	1,386.00	3,880,800
イビデン	2,900	1,861.00	5,396,900
コニカミノルタ	11,000	1,085.00	11,935,000
ブラザー工業	5,700	2,817.00	16,056,900
ミネベアミツミ	8,700	2,177.00	18,939,900
日立製作所	112,000	899.80	100,777,600
三菱電機	46,700	1,936.50	90,434,550
富士電機	14,000	854.00	11,956,000
東洋電機製造	200	1,982.00	396,400
安川電機	5,400	4,305.00	23,247,000
シンフォニアテクノロジー	3,000	436.00	1,308,000
明電舎	4,000	450.00	1,800,000
オリジン電気	200	1,980.00	396,000
山洋電気	200	7,950.00	1,590,000
デンヨー	400	1,980.00	792,000
東芝テック	3,000	680.00	2,040,000
芝浦メカトロニクス	1,000	496.00	496,000
マブチモーター	1,300	6,290.00	8,177,000
日本電産	5,600	15,675.00	87,780,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	2,510.00	502,000
東光高岳	200	1,844.00	368,800
ダブル・スコープ	700	2,097.00	1,467,900
ダイヘン	3,000	1,090.00	3,270,000
田淵電機	700	308.00	215,600
ヤーマン	600	1,351.00	810,600
JVCケンウッド	3,400	378.00	1,285,200
ミマキエンジニアリング	400	961.00	384,400
第一精工	200	2,890.00	578,000
日新電機	1,100	1,442.00	1,586,200
大崎電気工業	1,000	834.00	834,000
オムロン	5,000	6,500.00	32,500,000
日東工業	700	1,944.00	1,360,800
I D E C	600	2,438.00	1,462,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	8,000	580.00	4,640,000
サクサホールディングス	100	2,135.00	213,500
メルコホールディングス	200	3,555.00	711,000

テクノメディカ	100	1,935.00	193,500
日本電気	6,000	3,025.00	18,150,000
富士通	48,000	863.10	41,428,800
沖電気工業	1,900	1,589.00	3,019,100
岩崎通信機	300	835.00	250,500
電気興業	300	2,866.00	859,800
サンケン電気	3,000	718.00	2,154,000
ナカヨ	200	1,928.00	385,600
アイホン	300	1,919.00	575,700
ルネサスエレクトロニクス	2,400	1,499.00	3,597,600
セイコーエプソン	7,000	2,729.00	19,103,000
ワコム	3,600	556.00	2,001,600
アルバック	800	8,390.00	6,712,000
アクセル	200	787.00	157,400
E I Z O	400	5,080.00	2,032,000
ジャパンディスプレイ	9,600	240.00	2,304,000
日本信号	1,300	1,291.00	1,678,300
京三製作所	1,000	671.00	671,000
能美防災	600	2,069.00	1,241,400
ホーチキ	300	2,741.00	822,300
エレコム	400	2,467.00	986,800
パナソニック	53,400	1,729.50	92,355,300
アンリツ	3,400	1,041.00	3,539,400
富士通ゼネラル	1,400	2,152.00	3,012,800
日立国際電気	900	3,175.00	2,857,500
ソニー	31,100	5,261.00	163,617,100
T D K	2,400	9,110.00	21,864,000
帝国通信工業	200	1,173.00	234,600
タムラ製作所	1,800	791.00	1,423,800
アルプス電気	4,000	3,705.00	14,820,000
池上通信機	2,000	174.00	348,000
パイオニア	7,800	230.00	1,794,000
日本電波工業	400	812.00	324,800
鈴木	200	1,091.00	218,200
日本トリム	100	4,900.00	490,000
ローランド ディー . ジー .	200	3,155.00	631,000
フォスター電機	500	2,674.00	1,337,000
クラリオン	3,000	449.00	1,347,000
S M K	1,000	537.00	537,000
ヨコオ	300	1,518.00	455,400
ホシデン	1,200	1,792.00	2,150,400
ヒロセ電機	700	17,210.00	12,047,000

日本航空電子工業	1,000	2,186.00	2,186,000
TOA	500	1,286.00	643,000
マクセルホールディングス	900	2,557.00	2,301,300
古野電気	600	770.00	462,000
ユニデンホールディングス	1,000	345.00	345,000
アルパイン	1,100	2,698.00	2,967,800
スミダコーポレーション	500	1,961.00	980,500
アイコム	200	2,600.00	520,000
リオン	200	2,210.00	442,000
本多通信工業	200	2,384.00	476,800
船井電機	500	880.00	440,000
横河電機	4,700	2,168.00	10,189,600
新電元工業	200	8,470.00	1,694,000
アズビル	1,400	5,120.00	7,168,000
東亜ディーケーケー	300	870.00	261,000
日本光電工業	2,000	2,470.00	4,940,000
チノー	200	1,341.00	268,200
共和電業	500	450.00	225,000
日本電子材料	300	628.00	188,400
堀場製作所	900	7,120.00	6,408,000
アドバンテスト	2,600	2,603.00	6,767,800
小野測器	300	750.00	225,000
エスベック	400	2,613.00	1,045,200
キーエンス	2,300	66,570.00	153,111,000
日置電機	200	2,511.00	502,200
シスメックス	3,600	8,120.00	29,232,000
日本マイクロニクス	800	1,178.00	942,400
メガチップス	400	3,535.00	1,414,000
OBARA GROUP	300	7,390.00	2,217,000
コーセル	600	1,546.00	927,600
イリソ電子工業	400	7,010.00	2,804,000
新日本無線	400	929.00	371,600
オブテックスグループ	400	4,785.00	1,914,000
千代田インテグレ	200	2,724.00	544,800
アイ・オー・データ機器	200	1,126.00	225,200
レーザーテック	1,000	2,579.00	2,579,000
スタンレー電気	3,600	4,405.00	15,858,000
岩崎電気	200	1,820.00	364,000
ウシオ電機	2,900	1,667.00	4,834,300
ヘリオス テクノ ホールディング	300	768.00	230,400
日本セラミック	500	3,325.00	1,662,500
遠藤照明	200	1,295.00	259,000

双信電機	300	826.00	247,800
山一電機	300	2,380.00	714,000
図研	300	1,882.00	564,600
日本電子	2,000	607.00	1,214,000
カシオ計算機	3,800	1,695.00	6,441,000
ファナック	4,400	28,170.00	123,948,000
日本シイエムケイ	800	1,187.00	949,600
エンプラス	200	4,790.00	958,000
大真空	200	1,927.00	385,400
ローム	2,100	11,460.00	24,066,000
浜松ホトニクス	3,400	3,775.00	12,835,000
三井ハイテック	600	2,379.00	1,427,400
新光電気工業	1,800	899.00	1,618,200
京セラ	7,600	8,144.00	61,894,400
太陽誘電	2,100	2,016.00	4,233,600
村田製作所	4,900	16,305.00	79,894,500
ユーシン	700	778.00	544,600
双葉電子工業	800	2,268.00	1,814,400
北陸電気工業	200	1,597.00	319,400
ニチコン	1,400	1,590.00	2,226,000
日本ケミコン	400	4,320.00	1,728,000
K O A	700	2,431.00	1,701,700
市光工業	800	863.00	690,400
小糸製作所	2,800	7,790.00	21,812,000
ミツバ	900	1,939.00	1,745,100
S C R E E Nホールディングス	900	10,950.00	9,855,000
キャノン電子	400	2,602.00	1,040,800
キャノン	25,200	4,356.00	109,771,200
リコー	14,000	1,023.00	14,322,000
M U T O Hホールディングス	100	2,576.00	257,600
東京エレクトロン	3,100	22,490.00	69,719,000
トヨタ紡織	1,400	2,199.00	3,078,600
芦森工業	100	3,085.00	308,500
ユニプレス	900	3,115.00	2,803,500
豊田自動織機	3,800	7,040.00	26,752,000
モリタホールディングス	700	1,993.00	1,395,100
三櫻工業	600	991.00	594,600
デンソー	10,400	6,474.00	67,329,600
東海理化電機製作所	1,200	2,406.00	2,887,200
三井造船	1,700	1,612.00	2,740,400
川崎重工業	3,600	3,980.00	14,328,000
名村造船所	1,400	723.00	1,012,200

サノヤスホールディングス	700	297.00	207,900	
日本車輛製造	2,000	310.00	620,000	
三菱ロジスネクスト	600	994.00	596,400	
近畿車輛	100	2,784.00	278,400	
日産自動車	54,900	1,111.00	60,993,900	
いすゞ自動車	13,500	1,771.50	23,915,250	
トヨタ自動車	56,700	7,183.00	407,276,100	代用有価証券 2,300株
日野自動車	6,700	1,387.00	9,292,900	
三菱自動車工業	17,300	905.00	15,656,500	
エフテック	300	1,788.00	536,400	
レシップホールディングス	200	947.00	189,400	
武蔵精密工業	500	3,450.00	1,725,000	
日産車体	1,800	1,216.00	2,188,800	
新明和工業	2,000	1,167.00	2,334,000	
極東開発工業	900	2,043.00	1,838,700	
日信工業	1,000	2,310.00	2,310,000	
トピー工業	400	3,410.00	1,364,000	
ティラド	200	4,215.00	843,000	
曙ブレーキ工業	2,200	373.00	820,600	
タチエス	800	2,127.00	1,701,600	
N O K	2,400	2,853.00	6,847,200	
フタバ産業	1,400	1,058.00	1,481,200	
K Y B	500	7,020.00	3,510,000	
大同メタル工業	600	1,039.00	623,400	
プレス工業	2,500	636.00	1,590,000	
ミクニ	600	602.00	361,200	
太平洋工業	1,000	1,465.00	1,465,000	
ケーヒン	1,100	2,368.00	2,604,800	
河西工業	600	1,760.00	1,056,000	
アイシン精機	3,800	5,770.00	21,926,000	
富士機工	400	738.00	295,200	
マツダ	14,600	1,585.50	23,148,300	
今仙電機製作所	400	1,479.00	591,600	
本田技研工業	42,000	3,837.00	161,154,000	代用有価証券 4,700株
スズキ	9,200	6,320.00	58,144,000	
S U B A R U	14,500	3,778.00	54,781,000	
安永	200	2,987.00	597,400	
ヤマハ発動機	6,600	3,540.00	23,364,000	
ショーワ	1,200	1,355.00	1,626,000	
T B K	500	525.00	262,500	
エクセディ	600	3,430.00	2,058,000	

豊田合成	1,700	2,818.00	4,790,600
愛三工業	800	1,289.00	1,031,200
ヨロズ	500	2,312.00	1,156,000
エフ・シー・シー	800	2,845.00	2,276,000
シマノ	1,900	15,600.00	29,640,000
テイ・エス テック	1,100	4,540.00	4,994,000
ジャムコ	200	2,734.00	546,800
テルモ	7,200	4,875.00	35,100,000
クリエートメディック	200	1,132.00	226,400
日機装	1,600	1,081.00	1,729,600
島津製作所	5,600	2,439.00	13,658,400
JMS	500	688.00	344,000
長野計器	400	1,261.00	504,400
ブイ・テクノロジー	100	19,630.00	1,963,000
東京計器	300	1,524.00	457,200
愛知時計電機	100	4,490.00	449,000
インターアクション	300	780.00	234,000
オーバル	700	304.00	212,800
東京精密	800	4,700.00	3,760,000
マニー	600	3,235.00	1,941,000
ニコン	8,200	2,241.00	18,376,200
トプコン	2,500	2,453.00	6,132,500
オリンパス	7,000	4,370.00	30,590,000
理研計器	500	2,491.00	1,245,500
タムロン	400	2,451.00	980,400
HOYA	9,600	6,215.00	59,664,000
シード	100	3,765.00	376,500
ノーリツ鋼機	400	1,786.00	714,400
エー・アンド・デイ	400	532.00	212,800
シチズン時計	5,700	848.00	4,833,600
リズム時計工業	200	2,354.00	470,800
大研医器	400	776.00	310,400
メニコン	300	5,140.00	1,542,000
松風	200	1,385.00	277,000
セイコーホールディングス	700	2,815.00	1,970,500
ニプロ	3,300	1,657.00	5,468,100
スノーピーク	100	2,993.00	299,300
パラマウントベッドホールディングス	400	5,370.00	2,148,000
S H O - B I	200	453.00	90,600
ニホンフラッシュ	200	2,047.00	409,400
前田工織	500	2,117.00	1,058,500
永大産業	1,000	560.00	560,000

アートネイチャー	600	783.00	469,800
ダンロップスポーツ	300	1,700.00	510,000
バンダイナムコホールディングス	4,800	3,885.00	18,648,000
アイフィスジャパン	100	613.00	61,300
共立印刷	700	354.00	247,800
SHOEI	200	4,050.00	810,000
フランスベッドホールディングス	600	1,078.00	646,800
パイロットコーポレーション	800	5,590.00	4,472,000
萩原工業	200	1,863.00	372,600
トッパン・フォームズ	1,000	1,247.00	1,247,000
フジシールインターナショナル	1,000	3,725.00	3,725,000
タカラトミー	2,000	1,864.00	3,728,000
廣済堂	500	503.00	251,500
タカノ	200	1,213.00	242,600
プロネクサス	400	1,358.00	543,200
ホクシン	300	214.00	64,200
ウッドワン	200	1,682.00	336,400
大建工業	400	2,977.00	1,190,800
凸版印刷	13,000	1,176.00	15,288,000
大日本印刷	6,100	2,849.00	17,378,900
図書印刷	300	1,131.00	339,300
共同印刷	200	3,720.00	744,000
NISSHA	800	3,570.00	2,856,000
光村印刷	100	2,369.00	236,900
宝印刷	200	1,780.00	356,000
アシックス	4,600	1,617.00	7,438,200
ツツミ	200	2,009.00	401,800
小松ウオール工業	100	2,196.00	219,600
ヤマハ	3,200	4,130.00	13,216,000
河合楽器製作所	200	2,361.00	472,200
クリナップ	500	874.00	437,000
ピジョン	2,800	4,055.00	11,354,000
兼松サステック	100	2,246.00	224,600
キングジム	400	1,030.00	412,000
リンテック	1,100	3,195.00	3,514,500
イトーキ	1,000	871.00	871,000
任天堂	2,800	42,810.00	119,868,000
三菱鉛筆	800	2,652.00	2,121,600
タカラスタANDARD	1,000	1,872.00	1,872,000
コクヨ	2,300	2,095.00	4,818,500
ナカバヤシ	500	724.00	362,000
グローブライド	200	1,968.00	393,600

岡村製作所	1,700	1,478.00	2,512,600
美津濃	500	3,235.00	1,617,500
東京電力ホールディングス	37,300	473.00	17,642,900
中部電力	14,300	1,508.50	21,571,550
関西電力	19,000	1,557.50	29,592,500
中国電力	6,500	1,316.00	8,554,000
北陸電力	4,600	1,032.00	4,747,200
東北電力	11,000	1,524.00	16,764,000
四国電力	4,200	1,482.00	6,224,400
九州電力	10,300	1,311.00	13,503,300
北海道電力	4,400	879.00	3,867,600
沖縄電力	700	2,910.00	2,037,000
電源開発	3,700	3,365.00	12,450,500
エフオン	200	1,520.00	304,000
イーレックス	700	1,105.00	773,500
東京瓦斯	9,900	2,800.00	27,720,000
大阪瓦斯	9,100	2,230.50	20,297,550
東邦瓦斯	2,300	3,275.00	7,532,500
北海道瓦斯	1,000	292.00	292,000
広島ガス	1,000	368.00	368,000
西部瓦斯	600	2,832.00	1,699,200
静岡ガス	1,300	908.00	1,180,400
メタウォーター	300	2,864.00	859,200
SBSホールディングス	500	892.00	446,000
東武鉄道	5,000	3,440.00	17,200,000
相鉄ホールディングス	1,500	2,955.00	4,432,500
東京急行電鉄	12,600	1,767.00	22,264,200
京浜急行電鉄	6,400	2,369.00	15,161,600
小田急電鉄	7,000	2,309.00	16,163,000
京王電鉄	2,600	4,995.00	12,987,000
京成電鉄	3,300	3,400.00	11,220,000
富士急行	600	2,931.00	1,758,600
新京成電鉄	200	2,206.00	441,200
東日本旅客鉄道	8,400	11,245.00	94,458,000
西日本旅客鉄道	4,200	8,342.00	35,036,400
東海旅客鉄道	4,100	21,010.00	86,141,000
西武ホールディングス	6,000	2,144.00	12,864,000
鴻池運輸	600	1,786.00	1,071,600
西日本鉄道	1,300	2,980.00	3,874,000
ハマキョウレックス	300	3,130.00	939,000
サカイ引越センター	300	6,430.00	1,929,000
近鉄グループホールディングス	4,400	4,355.00	19,162,000

阪急阪神ホールディングス	5,900	4,440.00	26,196,000
南海電気鉄道	2,100	2,834.00	5,951,400
京阪ホールディングス	2,000	3,395.00	6,790,000
神戸電鉄	100	3,810.00	381,000
名古屋鉄道	3,400	2,577.00	8,761,800
山陽電気鉄道	300	2,889.00	866,700
日本通運	1,700	6,990.00	11,883,000
ヤマトホールディングス	7,800	2,299.00	17,932,200
山九	1,100	4,615.00	5,076,500
丸運	300	327.00	98,100
丸全昭和運輸	2,000	536.00	1,072,000
センコーグループホールディングス	2,600	804.00	2,090,400
トナミホールディングス	100	5,370.00	537,000
ニッコンホールディングス	1,700	2,917.00	4,958,900
福山通運	700	3,785.00	2,649,500
セイノーホールディングス	3,300	1,653.00	5,454,900
日立物流	1,000	2,779.00	2,779,000
丸和運輸機関	200	2,288.00	457,600
C & F ロジホールディングス	500	1,433.00	716,500
九州旅客鉄道	3,700	3,610.00	13,357,000
日本郵船	3,700	2,770.00	10,249,000
商船三井	2,800	3,745.00	10,486,000
川崎汽船	2,000	2,988.00	5,976,000
N S ユナイテッド海運	200	2,807.00	561,400
明治海運	500	474.00	237,000
飯野海運	2,300	585.00	1,345,500
共栄タンカー	100	2,264.00	226,400
乾汽船	400	824.00	329,600
日本航空	8,200	4,088.00	33,521,600
A N A ホールディングス	8,700	4,442.00	38,645,400
パスコ	1,000	349.00	349,000
トランコム	100	6,920.00	692,000
日新	400	3,280.00	1,312,000
三菱倉庫	1,500	3,080.00	4,620,000
三井倉庫ホールディングス	3,000	352.00	1,056,000
住友倉庫	3,000	791.00	2,373,000
澁澤倉庫	300	2,076.00	622,800
東陽倉庫	1,000	338.00	338,000
日本トランスシティ	1,000	497.00	497,000
ケイヒン	200	1,715.00	343,000
中央倉庫	300	1,250.00	375,000
安田倉庫	400	929.00	371,600

東洋埠頭	200	1,912.00	382,400
宇徳	500	508.00	254,000
上組	2,800	2,766.00	7,744,800
キューソー流通システム	100	3,155.00	315,500
郵船ロジスティクス	400	1,497.00	598,800
近鉄エクスプレス	900	1,995.00	1,795,500
エーアイティー	300	1,394.00	418,200
内外トランスライン	200	1,719.00	343,800
日本コンセプト	100	1,274.00	127,400
NEC ネットエスアイ	500	3,110.00	1,555,000
システナ	400	3,500.00	1,400,000
デジタルアーツ	200	4,615.00	923,000
新日鉄住金ソリューションズ	700	2,784.00	1,948,800
キューブシステム	300	839.00	251,700
コア	200	1,658.00	331,600
ソフトクリエイトホールディングス	200	1,599.00	319,800
T I S	1,500	3,820.00	5,730,000
ネオス	100	447.00	44,700
電算システム	100	2,072.00	207,200
グリー	2,800	762.00	2,133,600
コーエーテクモホールディングス	800	2,338.00	1,870,400
三菱総合研究所	200	3,660.00	732,000
A G S	400	976.00	390,400
ファインデックス	300	819.00	245,700
ヒト・コミュニケーションズ	100	1,943.00	194,300
ブレインパッド	200	1,251.00	250,200
K L a b	900	1,829.00	1,646,100
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	300	1,753.00	525,900
イーブックイニシアティブジャパン	100	1,131.00	113,100
ネクソン	5,100	3,270.00	16,677,000
アイスタイル	1,100	747.00	821,700
エイチーム	300	2,942.00	882,600
テクノスジャパン	400	993.00	397,200
コロプラ	1,400	1,318.00	1,845,200
モバイルクリエイト	500	369.00	184,500
オルトプラス	300	957.00	287,100
ブロードリーフ	1,100	931.00	1,024,100
ハーツユナイテッドグループ	300	1,670.00	501,000
メディアドゥホールディングス	200	2,582.00	516,400
ブイキューブ	400	585.00	234,000
サイバーリンクス	100	1,408.00	140,800
ディー・エル・イー	400	422.00	168,800

フィックスターズ	100	4,085.00	408,500
VOYAGE GROUP	200	1,417.00	283,400
セレス	200	1,284.00	256,800
ティーガイア	500	2,294.00	1,147,000
日本アジアグループ	600	469.00	281,400
豆蔵ホールディングス	400	1,260.00	504,000
テクマトリックス	300	1,518.00	455,400
プロシップ	100	2,424.00	242,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	12,200	326.00	3,977,200
GMOペイメントゲートウェイ	300	8,250.00	2,475,000
ザッパラス	500	427.00	213,500
インターネットイニシアティブ	700	2,177.00	1,523,900
さくらインターネット	500	852.00	426,000
GMOクラウド	100	2,632.00	263,200
SRAホールディングス	200	3,260.00	652,000
フリービット	300	908.00	272,400
コムチュア	200	2,406.00	481,200
サイバーコム	200	1,033.00	206,600
メディカル・データ・ビジョン	200	2,049.00	409,800
gumi	500	1,109.00	554,500
ショーケース・ティービー	200	1,623.00	324,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	100	2,075.00	207,500
アカツキ	100	9,130.00	913,000
LINE	1,300	4,870.00	6,331,000
オークネット	200	1,484.00	296,800
AOI TYO Holdings	400	1,216.00	486,400
マクロミル	600	3,285.00	1,971,000
フェイス	300	1,327.00	398,100
ハイマックス	100	1,666.00	166,600
野村総合研究所	3,100	5,130.00	15,903,000
サイバネットシステム	400	754.00	301,600
CEホールディングス	200	726.00	145,200
インテージホールディングス	500	1,466.00	733,000
東邦システムサイエンス	300	805.00	241,500
クレスコ	100	5,270.00	527,000
フジ・メディア・ホールディングス	4,800	1,726.00	8,284,800
オービック	1,400	7,720.00	10,808,000
ジャストシステム	700	2,175.00	1,522,500
TDCソフト	300	1,146.00	343,800
ヤフー	33,200	508.00	16,865,600
トレンドマイクロ	2,200	6,150.00	13,530,000
日本オラクル	700	9,740.00	6,818,000

アルファシステムズ	200	2,471.00	494,200
フューチャー	600	1,147.00	688,200
CAC Holdings	400	1,142.00	456,800
ソフトバンク・テクノロジー	200	2,029.00	405,800
トーセ	100	2,950.00	295,000
オービックビジネスコンサルタント	200	5,740.00	1,148,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,000	4,780.00	4,780,000
アイティフォー	600	663.00	397,800
東計電算	100	3,430.00	343,000
大塚商会	1,400	8,300.00	11,620,000
サイボウズ	600	514.00	308,400
ソフトブレーン	400	414.00	165,600
電通国際情報サービス	300	2,346.00	703,800
デジタルガレージ	800	2,442.00	1,953,600
EMシステムズ	100	2,141.00	214,100
ウェザーニューズ	200	3,710.00	742,000
C I J	400	707.00	282,800
日本エンタープライズ	800	256.00	204,800
WOWOW	200	3,335.00	667,000
スカラ	300	779.00	233,700
イマジカ・ロボット ホールディングス	400	929.00	371,600
ネットワンシステムズ	1,900	1,540.00	2,926,000
アルゴグラフィックス	200	3,495.00	699,000
マーベラス	800	1,125.00	900,000
エイベックス	800	1,454.00	1,163,200
日本ユニシス	1,300	2,191.00	2,848,300
兼松エレクトロニクス	300	3,460.00	1,038,000
東京放送ホールディングス	2,800	2,530.00	7,084,000
日本テレビホールディングス	4,200	2,072.00	8,702,400
朝日放送	500	926.00	463,000
テレビ朝日ホールディングス	1,300	2,483.00	3,227,900
スカパーJ S A Tホールディングス	3,400	520.00	1,768,000
テレビ東京ホールディングス	400	2,510.00	1,004,000
日本BS放送	200	1,272.00	254,400
ビジョン	100	2,678.00	267,800
ワイヤレスゲート	200	1,230.00	246,000
コネクシオ	300	2,078.00	623,400
日本通信	4,200	128.00	537,600
日本電信電話	32,800	5,750.00	188,600,000
K D D I	41,200	3,142.00	129,450,400
光通信	600	14,760.00	8,856,000
N T T ドコモ	33,900	2,807.00	95,157,300

エムティーアイ	600	676.00	405,600	
GMOインターネット	1,700	1,803.00	3,065,100	
アйдママーケティングコミュニケーション	200	681.00	136,200	
カドカワ	1,300	1,309.00	1,701,700	
学研ホールディングス	100	3,225.00	322,500	
ゼンリン	500	3,580.00	1,790,000	
昭文社	300	754.00	226,200	
インプレスホールディングス	800	154.00	123,200	
アイネット	300	1,777.00	533,100	
松竹	300	17,620.00	5,286,000	
東宝	3,000	3,755.00	11,265,000	
東映	200	12,200.00	2,440,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	14,300	1,358.00	19,419,400	
ピー・シー・エー	100	1,822.00	182,200	
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,595.00	319,000	
D T S	500	4,150.00	2,075,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,100	4,950.00	10,395,000	
シーイーシー	300	2,675.00	802,500	
カブコン	1,000	3,175.00	3,175,000	
ジャステック	300	1,338.00	401,400	
S C S K	1,100	4,860.00	5,346,000	
日本システムウエア	200	2,492.00	498,400	
アイネス	600	1,060.00	636,000	
T K C	400	3,875.00	1,550,000	
富士ソフト	600	3,505.00	2,103,000	
N S D	800	2,385.00	1,908,000	
コナミホールディングス	1,900	6,210.00	11,799,000	
福井コンピュータホールディングス	100	2,991.00	299,100	
J B C Cホールディングス	400	997.00	398,800	
ミロク情報サービス	300	2,878.00	863,400	
ソフトバンクグループ	20,700	10,060.00	208,242,000	代用有価証券 2,700株
高千穂交易	200	1,185.00	237,000	
伊藤忠食品	100	5,430.00	543,000	
エレマテック	200	2,732.00	546,400	
J A L U X	100	2,860.00	286,000	
あらた	200	5,470.00	1,094,000	
トーメンデバイス	100	3,325.00	332,500	
東京エレクトロン デバイス	200	2,087.00	417,400	
フィールズ	400	1,097.00	438,800	
双日	27,200	336.00	9,139,200	
アルフレッサ ホールディングス	5,100	2,280.00	11,628,000	
横浜冷凍	1,100	1,092.00	1,201,200	

神栄	100	1,628.00	162,800
ラサ商事	300	1,122.00	336,600
ラクーン	300	630.00	189,000
アルコニックス	500	1,974.00	987,000
神戸物産	300	4,835.00	1,450,500
ペッパーフードサービス	200	7,080.00	1,416,000
あい ホールディングス	600	2,850.00	1,710,000
ディーブイエックス	200	1,340.00	268,000
ダイワボウホールディングス	400	4,660.00	1,864,000
マクニカ・富士エレホールディングス	800	2,238.00	1,790,400
ラクト・ジャパン	100	4,030.00	403,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	900	902.00	811,800
八洲電機	400	1,033.00	413,200
メディアスホールディングス	100	2,794.00	279,400
U K Cホールディングス	300	1,979.00	593,700
ジューテックホールディングス	100	1,597.00	159,700
大光	200	1,065.00	213,000
O C H Iホールディングス	200	1,404.00	280,800
T O K A Iホールディングス	2,400	882.00	2,116,800
三洋貿易	200	2,925.00	585,000
ウイン・パートナーズ	300	1,318.00	395,400
ミタチ産業	200	1,519.00	303,800
シップヘルスケアホールディングス	1,000	3,530.00	3,530,000
明治電機工業	200	1,804.00	360,800
デリカフーズホールディングス	100	1,504.00	150,400
コメダホールディングス	900	1,938.00	1,744,200
富士興産	300	607.00	182,100
協栄産業	100	2,369.00	236,900
小野建	400	1,949.00	779,600
佐島電機	300	1,040.00	312,000
エコートレーディング	200	702.00	140,400
伯東	300	1,764.00	529,200
コンドーテック	400	1,199.00	479,600
中山福	300	768.00	230,400
ナガイレーベン	600	2,758.00	1,654,800
三菱食品	500	3,350.00	1,675,000
松田産業	300	1,650.00	495,000
第一興商	700	5,360.00	3,752,000
メディバルホールディングス	4,600	2,252.00	10,359,200
S P K	100	3,240.00	324,000
萩原電気	200	3,730.00	746,000
アズワン	400	6,270.00	2,508,000

尾家産業	200	1,253.00	250,600
シモジマ	300	1,180.00	354,000
ドウシシャ	500	2,356.00	1,178,000
小津産業	100	2,223.00	222,300
高速	300	1,332.00	399,600
たけびし	200	1,645.00	329,000
黒田電気	600	2,708.00	1,624,800
リックス	100	1,950.00	195,000
丸文	400	994.00	397,600
ハピネット	300	2,016.00	604,800
日本ライフライン	700	4,350.00	3,045,000
エクセル	200	2,707.00	541,400
マルカキカイ	200	2,246.00	449,200
I D O M	1,400	839.00	1,174,600
日本エム・ディ・エム	300	908.00	272,400
進和	300	2,690.00	807,000
エスケイジャパン	300	352.00	105,600
ダイトロン	200	2,295.00	459,000
シークス	300	4,910.00	1,473,000
田中商事	200	784.00	156,800
オーハシテクニカ	300	1,714.00	514,200
白銅	200	2,318.00	463,600
伊藤忠商事	33,700	2,018.00	68,006,600
丸紅	37,700	789.10	29,749,070
高島	100	2,267.00	226,700
長瀬産業	2,800	2,146.00	6,008,800
蝶理	300	2,100.00	630,000
豊田通商	5,100	4,345.00	22,159,500
三共生興	800	479.00	383,200
兼松	2,000	1,445.00	2,890,000
ツカモトコーポレーション	100	1,299.00	129,900
三井物産	39,000	1,742.00	67,938,000
日本紙パルプ商事	200	4,735.00	947,000
日立ハイテクノロジーズ	1,600	4,980.00	7,968,000
カメイ	600	1,992.00	1,195,200
O U Gホールディングス	100	2,741.00	274,100
スターゼン	200	5,630.00	1,126,000
山善	1,800	1,374.00	2,473,200
椿本興業	200	2,857.00	571,400
住友商事	28,900	1,761.00	50,892,900
内田洋行	200	3,450.00	690,000
三菱商事	32,300	2,896.00	93,540,800

第一実業	200	3,680.00	736,000
キヤノンマーケティングジャパン	1,300	2,922.00	3,798,600
西華産業	300	2,939.00	881,700
佐藤商事	400	1,293.00	517,200
菱洋エレクトロ	400	2,158.00	863,200
東京産業	400	543.00	217,200
ユアサ商事	400	4,130.00	1,652,000
神鋼商事	100	3,330.00	333,000
小林産業	500	384.00	192,000
阪和興業	900	4,410.00	3,969,000
正栄食品工業	300	4,500.00	1,350,000
カナデン	500	1,342.00	671,000
菱電商事	300	1,749.00	524,700
フルサト工業	200	1,843.00	368,600
岩谷産業	1,000	3,565.00	3,565,000
すてきナイスグループ	200	1,614.00	322,800
昭光通商	2,000	119.00	238,000
ニチモウ	100	2,031.00	203,100
極東貿易	1,000	400.00	400,000
イワキ	1,000	480.00	480,000
三愛石油	1,100	1,369.00	1,505,900
稲畑産業	1,100	1,686.00	1,854,600
G S Iクレオス	100	1,862.00	186,200
明和産業	500	531.00	265,500
ワキタ	1,000	1,409.00	1,409,000
東邦ホールディングス	1,400	2,275.00	3,185,000
サンゲツ	1,600	2,044.00	3,270,400
ミツウロコグループホールディングス	700	843.00	590,100
シナネンホールディングス	200	2,503.00	500,600
伊藤忠エネクス	1,000	1,169.00	1,169,000
サンリオ	1,300	1,845.00	2,398,500
サンワテクノス	300	2,053.00	615,900
リョーサン	600	4,345.00	2,607,000
新光商事	500	2,037.00	1,018,500
トーヨー	200	2,830.00	566,000
三信電気	400	1,591.00	636,400
東陽テクニカ	500	1,041.00	520,500
モスフードサービス	600	3,495.00	2,097,000
加賀電子	400	3,470.00	1,388,000
ソーダニッカ	400	579.00	231,600
立花エレテック	300	1,900.00	570,000
フォーバル	300	751.00	225,300

PAL TAC	600	4,640.00	2,784,000
三谷産業	500	429.00	214,500
太平洋興発	200	1,008.00	201,600
西本Wismettacホールディングス	100	4,365.00	436,500
ヤマタネ	200	2,103.00	420,600
日鉄住金物産	400	5,980.00	2,392,000
トラスコ中山	900	3,255.00	2,929,500
オートバックスセブン	1,800	2,035.00	3,663,000
モリト	400	1,099.00	439,600
加藤産業	700	3,560.00	2,492,000
イノテック	400	1,012.00	404,800
イエローハット	400	3,335.00	1,334,000
J Kホールディングス	500	898.00	449,000
日伝	400	2,435.00	974,000
北沢産業	500	233.00	116,500
杉本商事	200	1,764.00	352,800
因幡電機産業	600	5,160.00	3,096,000
バイテックホールディングス	200	1,925.00	385,000
ミスミグループ本社	5,300	3,240.00	17,172,000
アルテック	500	309.00	154,500
タキヒヨー	200	2,282.00	456,400
蔵王産業	100	1,739.00	173,900
スズケン	2,100	4,095.00	8,599,500
ジェコス	400	1,352.00	540,800
ローソン	1,200	7,500.00	9,000,000
サンエー	300	5,140.00	1,542,000
カワチ薬品	400	2,834.00	1,133,600
エービーシー・マート	800	5,910.00	4,728,000
ハードオフコーポレーション	200	1,154.00	230,800
アスクル	500	3,025.00	1,512,500
ゲオホールディングス	900	1,819.00	1,637,100
アダストリア	700	2,413.00	1,689,100
ジーフット	300	764.00	229,200
くらコーポレーション	300	5,050.00	1,515,000
キャンドウ	200	1,793.00	358,600
パルグループホールディングス	200	3,280.00	656,000
エディオン	1,700	1,137.00	1,932,900
サーラコーポレーション	800	743.00	594,400
ワッツ	200	1,157.00	231,400
ハローズ	200	2,645.00	529,000
あみやき亭	100	5,490.00	549,000
ひらまつ	700	627.00	438,900

ゲンキー	200	4,135.00	827,000
大黒天物産	100	5,270.00	527,000
ハニーズホールディングス	500	1,204.00	602,000
ファーマライズホールディングス	200	640.00	128,000
アルペン	300	2,154.00	646,200
クオール	500	2,345.00	1,172,500
ジinz	300	5,780.00	1,734,000
ビックカメラ	2,600	1,438.00	3,738,800
D C Mホールディングス	2,500	1,056.00	2,640,000
Monotaro	1,600	3,105.00	4,968,000
DDホールディングス	100	4,915.00	491,500
きちり	200	755.00	151,000
アークランドサービスホールディングス	400	2,555.00	1,022,000
J.フロント リテイリング	5,500	1,754.00	9,647,000
ドトール・日レスホールディングス	800	2,716.00	2,172,800
マツモトキヨシホールディングス	900	8,630.00	7,767,000
ブロンコビリー	200	2,949.00	589,800
スタートトゥデイ	4,500	3,195.00	14,377,500
物語コーポレーション	100	8,150.00	815,000
ココカラファイン	500	6,690.00	3,345,000
三越伊勢丹ホールディングス	8,600	1,242.00	10,681,200
Hamee	200	1,576.00	315,200
ウエルシアホールディングス	1,200	4,385.00	5,262,000
クリエイトSDホールディングス	700	2,875.00	2,012,500
丸善CHIホールディングス	600	348.00	208,800
チムニー	200	2,879.00	575,800
シュッピン	100	2,577.00	257,700
ジョイフル本田	800	3,185.00	2,548,000
鳥貴族	200	3,145.00	629,000
麒麟堂ホールディングス	200	1,465.00	293,000
ホットランド	300	1,434.00	430,200
すかいらーく	2,900	1,728.00	5,011,200
綿半ホールディングス	200	2,567.00	513,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,500	1,086.00	1,629,000
ブックオフコーポレーション	300	815.00	244,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	300	1,022.00	306,600
あさひ	400	1,426.00	570,400
日本調剤	200	3,785.00	757,000
コスモス薬品	200	23,700.00	4,740,000
トーエル	300	973.00	291,900
オンリー	100	907.00	90,700
セブン&アイ・ホールディングス	19,300	4,649.00	89,725,700

葉王堂	200	3,150.00	630,000
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	1,200	1,236.00	1,483,200
ツルハホールディングス	900	13,930.00	12,537,000
サンマルクホールディングス	300	3,510.00	1,053,000
フェリシモ	200	1,336.00	267,200
トリドールホールディングス	600	3,705.00	2,223,000
TOKYO BASE	100	4,715.00	471,500
サツドラホールディングス	100	2,022.00	202,200
ダイユー・リックホールディングス	200	1,032.00	206,400
パロックジャパンリミテッド	400	962.00	384,800
クスリのアオキホールディングス	400	6,430.00	2,572,000
スシローグローバルホールディングス	400	3,525.00	1,410,000
LIXILピバ	400	1,777.00	710,800
メディカルシステムネットワーク	400	541.00	216,400
総合メディカル	200	6,280.00	1,256,000
はるやまホールディングス	300	1,021.00	306,300
ノジマ	800	2,306.00	1,844,800
カッパ・クリエイティブ	600	1,255.00	753,000
ライトオン	400	940.00	376,000
ジーンズメイト	200	753.00	150,600
良品計画	600	34,150.00	20,490,000
三城ホールディングス	600	473.00	283,800
アドヴァン	500	1,102.00	551,000
アルビス	100	4,675.00	467,500
コナカ	600	599.00	359,400
ハウスオブローゼ	100	1,700.00	170,000
G-7ホールディングス	100	2,357.00	235,700
イオン北海道	400	669.00	267,600
コジマ	700	377.00	263,900
ヒマラヤ	200	1,007.00	201,400
コーナン商事	700	2,352.00	1,646,400
エコス	200	1,257.00	251,400
ワタミ	600	1,485.00	891,000
ドンキホーテホールディングス	3,000	4,950.00	14,850,000
西松屋チェーン	1,000	1,270.00	1,270,000
ゼンショーホールディングス	2,400	2,131.00	5,114,400
幸楽苑ホールディングス	300	2,255.00	676,500
ハークスレイ	200	1,219.00	243,800
サイゼリヤ	700	3,515.00	2,460,500
V Tホールディングス	1,500	593.00	889,500
魚力	200	1,188.00	237,600
ポブラ	200	665.00	133,000

フジ・コーポレーション	100	2,164.00	216,400
ユニテッドアローズ	600	3,920.00	2,352,000
ハイデイ日高	500	3,365.00	1,682,500
京都きもの友禅	300	812.00	243,600
コロワイド	1,500	2,179.00	3,268,500
ピーシーデポコーポレーション	700	881.00	616,700
壱番屋	300	4,420.00	1,326,000
トップカルチャー	300	500.00	150,000
P L A N T	200	1,269.00	253,800
スギホールディングス	1,000	5,910.00	5,910,000
ヴィア・ホールディングス	400	825.00	330,000
スクロール	700	453.00	317,100
ヨンドシーホールディングス	500	3,115.00	1,557,500
ユニー・ファミリーマートホールディングス	1,500	6,700.00	10,050,000
木曽路	600	2,787.00	1,672,200
S R Sホールディングス	600	927.00	556,200
千趣会	900	691.00	621,900
タカキュー	500	216.00	108,000
ケーヨー	800	732.00	585,600
上新電機	500	3,995.00	1,997,500
日本瓦斯	900	3,935.00	3,541,500
ロイヤルホールディングス	800	2,922.00	2,337,600
東天紅	100	2,311.00	231,100
いなげや	500	1,833.00	916,500
島忠	1,200	3,220.00	3,864,000
チヨダ	500	2,890.00	1,445,000
ライフコーポレーション	400	3,025.00	1,210,000
リンガーハット	600	2,495.00	1,497,000
M r M a x H D	600	741.00	444,600
テンアライド	500	442.00	221,000
A O K Iホールディングス	900	1,594.00	1,434,600
オークワ	1,000	1,155.00	1,155,000
コメリ	700	3,170.00	2,219,000
青山商事	900	4,250.00	3,825,000
しまむら	500	12,880.00	6,440,000
はせがわ	300	514.00	154,200
高島屋	7,000	1,070.00	7,490,000
松屋	900	1,204.00	1,083,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,200	2,132.00	4,690,400
近鉄百貨店	200	3,740.00	748,000
パルコ	400	1,557.00	622,800
丸井グループ	4,400	1,772.00	7,796,800

アクシアル リテイリング	400	4,280.00	1,712,000
イオン	17,700	1,766.00	31,258,200
イズミ	800	6,240.00	4,992,000
平和堂	900	2,482.00	2,233,800
フジ	500	2,521.00	1,260,500
ヤオコー	500	5,620.00	2,810,000
ゼビオホールディングス	600	2,217.00	1,330,200
ケーズホールディングス	2,000	2,706.00	5,412,000
O l y m p i cグループ	400	600.00	240,000
日産東京販売ホールディングス	700	428.00	299,600
アインホールディングス	700	7,550.00	5,285,000
元気寿司	100	3,500.00	350,000
ヤマダ電機	15,400	607.00	9,347,800
アークランドサカモト	700	1,846.00	1,292,200
ニトリホールディングス	1,800	16,915.00	30,447,000
愛眼	600	319.00	191,400
ケーユーホールディングス	300	1,033.00	309,900
吉野家ホールディングス	1,600	1,913.00	3,060,800
松屋フーズ	200	4,275.00	855,000
サガミチェーン	600	1,377.00	826,200
関西スーパーマーケット	300	1,364.00	409,200
王将フードサービス	300	5,140.00	1,542,000
プレナス	500	2,328.00	1,164,000
ミニストップ	300	2,322.00	696,600
アークス	900	2,576.00	2,318,400
パローホールディングス	1,100	2,541.00	2,795,100
ベルク	200	6,220.00	1,244,000
大庄	300	1,698.00	509,400
ファーストリテイリング	800	39,910.00	31,928,000
サンドラッグ	1,900	5,070.00	9,633,000
サックスパー ホールディングス	400	1,395.00	558,000
ヤマザワ	100	1,742.00	174,200
やまや	100	2,342.00	234,200
ベルーナ	1,100	1,254.00	1,379,400
島根銀行	200	1,356.00	271,200
じもとホールディングス	2,900	210.00	609,000
めぶきフィナンシャルグループ	24,000	476.00	11,424,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	600	3,120.00	1,872,000
九州フィナンシャルグループ	7,600	730.00	5,548,000
ゆうちょ銀行	13,000	1,427.00	18,551,000
富山第一銀行	1,100	548.00	602,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	28,100	596.00	16,747,600

西日本フィナンシャルホールディングス	3,200	1,312.00	4,198,400	
新生銀行	4,000	1,821.00	7,284,000	
あおぞら銀行	2,800	4,485.00	12,558,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	324,900	767.50	249,360,750	代用有価証券 21,400株
りそなホールディングス	50,500	617.30	31,173,650	
三井住友トラスト・ホールディングス	9,000	4,474.00	40,266,000	
三井住友フィナンシャルグループ	34,800	4,545.00	158,166,000	代用有価証券 3,500株
第四銀行	600	5,450.00	3,270,000	
北越銀行	500	2,627.00	1,313,500	
千葉銀行	17,000	848.00	14,416,000	
群馬銀行	9,500	714.00	6,783,000	
武蔵野銀行	700	3,580.00	2,506,000	
千葉興業銀行	1,200	632.00	758,400	
筑波銀行	1,800	388.00	698,400	
七十七銀行	1,500	2,859.00	4,288,500	
青森銀行	400	3,650.00	1,460,000	
秋田銀行	300	3,490.00	1,047,000	
山形銀行	500	2,618.00	1,309,000	
岩手銀行	300	4,565.00	1,369,500	
東邦銀行	4,100	417.00	1,709,700	
東北銀行	300	1,543.00	462,900	
みちのく銀行	300	1,906.00	571,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	19,000	581.00	11,039,000	
静岡銀行	12,000	1,097.00	13,164,000	
十六銀行	600	3,690.00	2,214,000	
スルガ銀行	4,700	2,565.00	12,055,500	
八十二銀行	8,400	689.00	5,787,600	
山梨中央銀行	3,000	491.00	1,473,000	
大垣共立銀行	700	3,145.00	2,201,500	
福井銀行	400	2,992.00	1,196,800	
北國銀行	500	4,645.00	2,322,500	
清水銀行	200	3,670.00	734,000	
富山銀行	100	4,390.00	439,000	
滋賀銀行	4,000	636.00	2,544,000	
南都銀行	500	3,180.00	1,590,000	
百五銀行	4,400	517.00	2,274,800	
京都銀行	1,800	5,900.00	10,620,000	
紀陽銀行	1,700	1,908.00	3,243,600	
三重銀行	200	2,641.00	528,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	3,000	1,812.00	5,436,000	
広島銀行	6,900	935.00	6,451,500	

山陰合同銀行	2,800	1,039.00	2,909,200	
中国銀行	3,200	1,601.00	5,123,200	
鳥取銀行	200	1,800.00	360,000	
伊予銀行	6,600	942.00	6,217,200	
百十四銀行	5,000	406.00	2,030,000	
四国銀行	700	1,745.00	1,221,500	
阿波銀行	4,000	769.00	3,076,000	
大分銀行	300	4,425.00	1,327,500	
宮崎銀行	300	3,945.00	1,183,500	
佐賀銀行	300	2,782.00	834,600	
十八銀行	3,000	298.00	894,000	
沖縄銀行	400	4,490.00	1,796,000	
琉球銀行	900	1,691.00	1,521,900	
セブン銀行	17,200	418.00	7,189,600	
みずほフィナンシャルグループ	624,800	206.30	128,896,240	代用有価証券 71,500株
高知銀行	200	1,294.00	258,800	
山口フィナンシャルグループ	4,000	1,344.00	5,376,000	
長野銀行	100	1,979.00	197,900	
名古屋銀行	400	4,365.00	1,746,000	
北洋銀行	7,000	377.00	2,639,000	
愛知銀行	200	6,850.00	1,370,000	
第三銀行	300	1,867.00	560,100	
中京銀行	200	2,316.00	463,200	
大光銀行	200	2,615.00	523,000	
愛媛銀行	700	1,468.00	1,027,600	
トマト銀行	200	1,567.00	313,400	
みなと銀行	400	2,110.00	844,000	
京葉銀行	4,000	529.00	2,116,000	
関西アーバン銀行	600	1,433.00	859,800	
栃木銀行	2,300	498.00	1,145,400	
北日本銀行	100	3,435.00	343,500	
東和銀行	800	1,172.00	937,600	
福島銀行	500	904.00	452,000	
大東銀行	200	1,663.00	332,600	
トモニホールディングス	3,800	531.00	2,017,800	
フィデアホールディングス	4,400	214.00	941,600	
池田泉州ホールディングス	4,900	437.00	2,141,300	
F P G	1,600	1,338.00	2,140,800	
S B Iホールディングス	5,200	1,737.00	9,032,400	
ジャフコ	700	5,760.00	4,032,000	
大和証券グループ本社	39,000	729.20	28,438,800	
野村ホールディングス	83,000	671.00	55,693,000	

岡三証券グループ	4,000	711.00	2,844,000
丸三証券	1,500	1,057.00	1,585,500
東洋証券	2,000	316.00	632,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	5,200	741.00	3,853,200
光世証券	100	1,662.00	166,200
水戸証券	1,400	394.00	551,600
いちよし証券	1,000	1,371.00	1,371,000
松井証券	2,200	998.00	2,195,600
だいこう証券ビジネス	300	740.00	222,000
マネックスグループ	4,900	356.00	1,744,400
カブドットコム証券	3,000	362.00	1,086,000
極東証券	600	1,691.00	1,014,600
岩井コスモホールディングス	500	1,519.00	759,500
藍澤証券	900	820.00	738,000
マネーパートナーズグループ	500	456.00	228,000
小林洋行	200	285.00	57,000
かんぽ生命保険	1,700	2,444.00	4,154,800
S O M P Oホールディングス	9,000	4,607.00	41,463,000
アニコム ホールディングス	300	2,886.00	865,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	12,000	3,838.00	46,056,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	3,800	1,840.00	6,992,000
第一生命ホールディングス	26,000	2,163.50	56,251,000
東京海上ホールディングス	17,400	4,886.00	85,016,400
T & Dホールディングス	14,200	1,777.50	25,240,500
アドバンスクリエイト	200	1,894.00	378,800
全国保証	1,300	5,110.00	6,643,000
クレディセゾン	3,500	2,314.00	8,099,000
芙蓉総合リース	500	7,240.00	3,620,000
興銀リース	900	2,937.00	2,643,300
東京センチュリー	900	4,875.00	4,387,500
日本証券金融	1,800	629.00	1,132,200
アイフル	7,700	374.00	2,879,800
ポケットカード	400	1,070.00	428,000
リコーリース	400	4,070.00	1,628,000
イオンフィナンシャルサービス	3,300	2,439.00	8,048,700
アコム	9,300	454.00	4,222,200
ジャックス	600	2,780.00	1,668,000
オリエントコーポレーション	9,900	181.00	1,791,900
日立キャピタル	1,300	2,967.00	3,857,100
アプラスフィナンシャル	2,200	110.00	242,000
オリックス	30,600	2,001.00	61,230,600
三菱UFJリース	11,800	611.00	7,209,800

日本取引所グループ	13,500	2,022.00	27,297,000
イー・ギャランティ	100	3,225.00	322,500
アサックス	100	1,835.00	183,500
NECキャピタルソリューション	200	2,233.00	446,600
いちご	6,600	401.00	2,646,600
日本駐車場開発	5,700	166.00	946,200
ヒューリック	9,600	1,199.00	11,510,400
三栄建築設計	200	2,399.00	479,800
スター・マイカ	200	1,610.00	322,000
野村不動産ホールディングス	3,000	2,493.00	7,479,000
三重交通グループホールディングス	1,000	473.00	473,000
サムティ	400	1,636.00	654,400
ディア・ライフ	500	460.00	230,000
エー・ディー・ワークス	7,500	41.00	307,500
日本商業開発	300	1,647.00	494,100
プレサンスコーポレーション	600	1,492.00	895,200
ユニゾホールディングス	500	2,977.00	1,488,500
THEグローバル社	200	849.00	169,800
日本管理センター	300	1,583.00	474,900
フージャースホールディングス	600	1,046.00	627,600
オープンハウス	800	4,390.00	3,512,000
東急不動産ホールディングス	11,100	780.00	8,658,000
飯田グループホールディングス	3,800	2,198.00	8,352,400
ムゲンエステート	400	1,125.00	450,000
ハウスドゥ	100	2,159.00	215,900
ケイアイスター不動産	200	2,306.00	461,200
パーク24	2,600	2,645.00	6,877,000
パラカ	100	2,475.00	247,500
三井不動産	22,900	2,750.00	62,975,000
三菱地所	34,300	2,137.00	73,299,100
平和不動産	800	2,097.00	1,677,600
東京建物	5,000	1,614.00	8,070,000
ダイビル	1,200	1,311.00	1,573,200
京阪神ビルディング	800	816.00	652,800
住友不動産	11,000	3,880.00	42,680,000
大京	700	2,281.00	1,596,700
テーオーシー	1,600	1,016.00	1,625,600
東京楽天地	100	5,910.00	591,000
レオパレス21	5,800	857.00	4,970,600
スターツコーポレーション	600	3,090.00	1,854,000
フジ住宅	600	820.00	492,000
空港施設	500	631.00	315,500

明和地所	400	903.00	361,200
ゴールドクレスト	400	2,461.00	984,400
日本エスリード	200	2,056.00	411,200
日神不動産	600	821.00	492,600
日本エスコン	900	519.00	467,100
タカラレーベン	2,200	512.00	1,126,400
サンヨーハウジング名古屋	300	1,214.00	364,200
イオンモール	3,000	2,025.00	6,075,000
ファースト住建	200	1,813.00	362,600
トーセイ	500	1,109.00	554,500
エヌ・ティ・ティ都市開発	2,900	1,198.00	3,474,200
サンフロンティア不動産	500	1,359.00	679,500
エフ・ジェー・ネクスト	300	949.00	284,700
インテリックス	300	995.00	298,500
ランドビジネス	600	333.00	199,800
グランディハウス	500	470.00	235,000
日本空港ビルデング	1,400	4,050.00	5,670,000
日本工営	300	4,075.00	1,222,500
L I F U L L	1,600	851.00	1,361,600
ジェイエシーリクルートメント	400	1,985.00	794,000
日本M&Aセンター	1,500	5,470.00	8,205,000
メンバーズ	200	700.00	140,000
タケエイ	500	1,132.00	566,000
トラスト・テック	200	3,505.00	701,000
コシダカホールディングス	200	4,720.00	944,000
パソナグループ	400	1,550.00	620,000
C D S	200	1,339.00	267,800
リンクアンドモチベーション	800	755.00	604,000
G C A	500	1,041.00	520,500
エス・エム・エス	900	3,395.00	3,055,500
パーソルホールディングス	4,100	2,832.00	11,611,200
リニカル	300	1,471.00	441,300
クックパッド	1,400	751.00	1,051,400
エスクリ	300	883.00	264,900
アイ・ケイ・ケイ	300	882.00	264,600
学情	200	1,377.00	275,400
スタジオアリス	200	2,623.00	524,600
シミックホールディングス	300	1,665.00	499,500
N J S	200	1,454.00	290,800
総合警備保障	1,800	6,060.00	10,908,000
カカクコム	3,400	1,690.00	5,746,000
アイロムグループ	200	1,632.00	326,400

セントケア・ホールディング	100	2,904.00	290,400
ルネサンス	200	1,781.00	356,200
ディップ	600	2,651.00	1,590,600
オプトホールディング	300	1,202.00	360,600
新日本科学	500	564.00	282,000
ツクイ	1,100	875.00	962,500
キャリアデザインセンター	100	1,679.00	167,900
エムスリー	4,700	3,545.00	16,661,500
ツカダ・グローバルホールディング	300	581.00	174,300
アウトソーシング	1,300	1,744.00	2,267,200
ウェルネット	400	1,098.00	439,200
ディー・エヌ・エー	2,400	2,610.00	6,264,000
博報堂D Yホールディングス	6,200	1,621.00	10,050,200
ぐるなび	700	1,361.00	952,700
エスアールジータカミヤ	600	696.00	417,600
ファンコミュニケーションズ	1,200	1,166.00	1,399,200
ライク	200	2,027.00	405,400
ビジネス・ブレークスルー	300	464.00	139,200
WDBホールディングス	200	2,711.00	542,200
ティア	300	951.00	285,300
バリューコマース	300	788.00	236,400
インフォマート	2,300	675.00	1,552,500
J Pホールディングス	1,400	362.00	506,800
E P Sホールディングス	700	2,278.00	1,594,600
レグス	200	898.00	179,600
プレステージ・インターナショナル	900	1,292.00	1,162,800
アミューズ	300	3,040.00	912,000
ドリームインキュベータ	100	2,258.00	225,800
クイック	300	1,692.00	507,600
T A C	400	282.00	112,800
ケネディクス	6,200	666.00	4,129,200
電通	5,400	4,900.00	26,460,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	300	828.00	248,400
ぴあ	100	5,580.00	558,000
イオンファンタジー	100	4,530.00	453,000
シーティーエス	500	833.00	416,500
ネクシィーズグループ	200	2,250.00	450,000
みらかホールディングス	1,200	5,320.00	6,384,000
アルプス技研	200	3,925.00	785,000
ダイオーズ	200	1,475.00	295,000
日本空調サービス	500	816.00	408,000
オリエンタルランド	5,300	9,371.00	49,666,300

ダスキン	1,200	3,035.00	3,642,000
明光ネットワークジャパン	500	1,278.00	639,000
ファルコホールディングス	200	1,770.00	354,000
秀英予備校	200	483.00	96,600
田谷	200	678.00	135,600
ラウンドワン	1,400	1,498.00	2,097,200
リゾートトラスト	1,900	2,281.00	4,333,900
ビー・エム・エル	600	2,529.00	1,517,400
ワタベウェディング	200	669.00	133,800
りらいあコミュニケーションズ	700	1,286.00	900,200
リソー教育	800	881.00	704,800
早稲田アカデミー	100	1,701.00	170,100
ユー・エス・エス	5,500	2,452.00	13,486,000
東京個別指導学院	200	989.00	197,800
サイバーエージェント	2,900	3,840.00	11,136,000
楽天	22,800	1,189.50	27,120,600
クリーク・アンド・リバー社	200	1,151.00	230,200
テー・オー・ダブリュー	400	900.00	360,000
セントラルスポーツ	200	4,090.00	818,000
フルキャストホールディングス	400	2,166.00	866,400
リソルホールディングス	100	4,010.00	401,000
テクノプロ・ホールディングス	800	5,360.00	4,288,000
アトラ	200	700.00	140,000
三機サービス	100	1,319.00	131,900
イー・ガーディアン	200	2,180.00	436,000
リブセンス	300	552.00	165,600
ジャパンマテリアル	300	3,365.00	1,009,500
ベクトル	500	1,428.00	714,000
キャリアリンク	200	572.00	114,400
I B J	400	916.00	366,400
アサンテ	200	2,115.00	423,000
N・フィールド	200	1,932.00	386,400
M&Aキャピタルパートナーズ	100	6,190.00	619,000
E R Iホールディングス	200	961.00	192,200
アビスト	100	4,445.00	444,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	3,160.00	316,000
日本ビューホテル	100	1,398.00	139,800
リクルートホールディングス	34,500	2,743.00	94,633,500
エラン	200	1,585.00	317,000
日本郵政	25,300	1,308.00	33,092,400
ベルシステム24ホールディングス	700	1,259.00	881,300
L I T A L I C O	100	1,667.00	166,700

エボラブルアジア	100	2,418.00	241,800
ソラスト	300	2,358.00	707,400
リログループ	2,400	2,790.00	6,696,000
東祥	300	3,240.00	972,000
エイチ・アイ・エス	700	4,100.00	2,870,000
ラックランド	100	2,191.00	219,100
共立メンテナンス	800	3,700.00	2,960,000
イチネンホールディングス	500	1,545.00	772,500
建設技術研究所	300	1,079.00	323,700
スペース	300	1,730.00	519,000
東京テアトル	200	1,465.00	293,000
ナガワ	100	4,800.00	480,000
よみうりランド	100	4,955.00	495,500
東京都競馬	300	3,980.00	1,194,000
常磐興産	200	1,870.00	374,000
カナモト	700	3,780.00	2,646,000
東京ドーム	1,800	1,106.00	1,990,800
西尾レントオール	400	4,100.00	1,640,000
トランス・コスモス	500	2,631.00	1,315,500
乃村工藝社	1,100	2,310.00	2,541,000
藤田観光	200	3,740.00	748,000
KNT-CTホールディングス	300	1,950.00	585,000
日本管財	500	2,069.00	1,034,500
トーカイ	200	5,180.00	1,036,000
白洋舎	100	3,620.00	362,000
セコム	4,700	8,947.00	42,050,900
セントラル警備保障	200	2,042.00	408,400
丹青社	900	1,370.00	1,233,000
メイテック	500	5,540.00	2,770,000
アサツー ディ・ケイ	900	3,675.00	3,307,500
応用地質	500	1,578.00	789,000
船井総研ホールディングス	600	3,725.00	2,235,000
進学会ホールディングス	300	650.00	195,000
オオバ	400	517.00	206,800
いであ	200	1,198.00	239,600
ベネッセホールディングス	1,600	4,215.00	6,744,000
イオンディライト	600	4,245.00	2,547,000
ナック	300	970.00	291,000
ニチイ学館	800	1,154.00	923,200
ダイセキ	800	2,865.00	2,292,000
ステップ	200	1,635.00	327,000
合 計	5,636,900		12,074,312,800

(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2017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	11,850,579,540円
負債総額	20,074,685円
純資産総額（ - ）	11,830,504,855円
発行済口数	15,772,478,315口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7501円

【バランスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	259,649,611円
負債総額	269,214円
純資産総額（ - ）	259,380,397円
発行済口数	263,350,234口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9849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	11,955,961,262円
負債総額	2,502,830円
純資産総額（ - ）	11,953,458,432円
発行済口数	6,807,202,411口
1口当たり純資産額（ / ）	1.756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29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29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29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29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	765	166,645

株式投資信託	719	136,706
単位型	215	8,855
追加型	504	127,851
公社債投資信託	46	29,938
単位型	32	320
追加型	14	29,618

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58期事業年度(平成28年4月1日から平成29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59期中間会計期間(平成29年4月1日から平成29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57期 (平成28年3月31日)		第58期 (平成29年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	14,308	3	16,761
金銭の信託	3	153	3	152
有価証券		86		10
前払費用	3	489		506
未収入金		10		136
未収委託者報酬		9,374		10,757
未収収益	3	2,280	3	2,799
関係会社短期貸付金		5,333		962
立替金		2,960		1,240
繰延税金資産		819		865
その他	2,3	428	2,3	385
流動資産合計		36,243		34,577
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	146	1	93
器具備品	1	210	1	190
有形固定資産合計		356		283

無形固定資産		
ソフトウェア	140	138
無形固定資産合計	140	138
投資その他の資産		
投資有価証券	12,195	11,783
関係会社株式	21,702	23,203
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	781	782
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	425	423
投資その他の資産合計	35,165	36,253
固定資産合計	35,662	36,674
資産合計	71,905	71,252

(単位：百万円)

	第57期 (平成28年3月31日)		第58期 (平成29年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金	410	3	589	
未払金	3,841		4,043	
未払収益分配金	6		7	
未払償還金	112		91	
未払手数料	3	3,269	3	3,499
その他未払金		453		445
未払費用	3	4,920	3	4,229
未払法人税等		354		1,808
未払消費税等	4	649	4	538
関係会社短期借入金		5,631		-
賞与引当金		2,080		2,077
役員賞与引当金		145		168
その他	3	278	3	62
流動負債合計		18,312		13,517
固定負債				
退職給付引当金		1,154		1,259
固定負債合計		1,154		1,259
負債合計		19,466		14,777
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		29,948		34,015

利益剰余金合計	29,948	34,015
自己株式	502	672
株主資本合計	52,028	55,926
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	151	282
繰延ヘッジ損益	258	266
評価・換算差額等合計	410	548
純資産合計	52,438	56,475
負債純資産合計	71,905	71,252

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	66,339	64,680
その他営業収益	4,382	4,218
営業収益合計	70,722	68,898
営業費用		
支払手数料	30,529	28,675
広告宣伝費	1,098	969
公告費	3	2
調査費	17,470	17,322
調査費	821	841
委託調査費	16,600	16,456
図書費	48	24
委託計算費	505	498
営業雑経費	718	656
通信費	195	185
印刷費	321	276
協会費	65	66
諸会費	22	17
その他	113	111
営業費用計	50,327	48,124
一般管理費		
給料	8,138	8,243
役員報酬	365	360
役員賞与引当金繰入額	145	168
給料・手当	5,495	5,576
賞与	51	61
賞与引当金繰入額	2,080	2,077
交際費	185	99
寄付金	27	17
旅費交通費	503	412
租税公課	258	375
不動産賃借料	875	889
退職給付費用	372	390
退職金	113	20
固定資産減価償却費	196	192
福利費	952	959

諸経費		2,952		2,791
一般管理費計		14,577		14,394
営業利益		5,817		6,380

(単位：百万円)

	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		91		19
受取配当金	1	1,330	1	1,644
時効成立分配金・償還金		1		22
為替差益		32		177
その他		32		36
営業外収益合計		1,488		1,899
営業外費用				
支払利息	1	242	1	223
有価証券償還損		-		7
デリバティブ費用	1	69	1	146
時効成立後支払分配金・償還金		5		2
支払源泉所得税		119		155
その他		94		73
営業外費用合計		531		608
経常利益		6,774		7,670
特別利益				
投資有価証券売却益		720		174
その他		0		-
特別利益合計		720		174
特別損失				
投資有価証券売却損		100		120
固定資産処分損		6		13
特別賞与		204		-
割増退職金		91		-
役員退職一時金		64		-
特別損失合計		467		134
税引前当期純利益		7,027		7,710
法人税、住民税及び事業税		1,359		2,137
過年度法人税等		-	2	115
法人税等調整額		706		104
法人税等合計		2,065		2,147
当期純利益		4,962		5,562

(3) 【株主資本等変動計算書】

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
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
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

第58期（自 平成28年4月1日 至 平成29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	29,948	29,948	502	52,028
当期変動額							
剰余金の配当				1,495	1,495		1,495
当期純利益				5,562	5,562		5,562
自己株式の取得						170	170
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,067	4,067	170	3,897
当期末残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926

	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	151	258	410	52,438
当期変動額				
剰余金の配当				1,495
当期純利益				5,562
自己株式の取得				170
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	130	7	138	138
当期変動額合計	130	7	138	4,036
当期末残高	282	266	548	56,475

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <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日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 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。</p>

<p>4 ヘッジ会計の方法</p> <p>5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>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。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <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、当事業年度の費用として処理しております。</p>
--	--

（会計方針の変更）

<p>第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)</p>	
<p>(減価償却方法)</p>	<p>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）を当事業年度に適用し、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。</p> <p>この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p>

（追加情報）

<p>第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31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）を当事業年度から適用しております。</p>	

（貸借対照表関係）

第57期 (平成28年3月31日)		第58期 (平成29年3月31日)	
1	<p>有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,170百万円</p> <p>器具備品 653百万円</p>	1	<p>有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,222百万円</p> <p>器具備品 603百万円</p>
2	<p>信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	2	<p>信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>

<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <table border="0"> <tr><td>現金・預金</td><td style="text-align: right;">4,072百万円</td></tr> <tr><td>金銭の信託</td><td style="text-align: right;">153百万円</td></tr> <tr><td>前払費用</td><td style="text-align: right;">2百万円</td></tr> <tr><td>未収収益</td><td style="text-align: right;">147百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">193百万円</td></tr> </table> <p>(流動負債)</p> <table border="0"> <tr><td>未払手数料</td><td style="text-align: right;">93百万円</td></tr> <tr><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">722百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">266百万円</td></tr> </table> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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>	現金・預金	4,072百万円	金銭の信託	153百万円	前払費用	2百万円	未収収益	147百万円	その他	193百万円	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>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <table border="0"> <tr><td>現金・預金</td><td style="text-align: right;">3,243百万円</td></tr> <tr><td>金銭の信託</td><td style="text-align: right;">152百万円</td></tr> <tr><td>未収収益</td><td style="text-align: right;">619百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">20百万円</td></tr> </table> <p>(流動負債)</p> <table border="0"> <tr><td>預り金</td><td style="text-align: right;">177百万円</td></tr> <tr><td>未払手数料</td><td style="text-align: right;">144百万円</td></tr> <tr><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">251百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">61百万円</td></tr> </table> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務587百万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546百万円に対して保証を行っております。</p>	現金・預金	3,243百万円	金銭の信託	152百万円	未収収益	619百万円	その他	20百万円	預り金	177百万円	未払手数料	144百万円	未払費用	251百万円	その他	61百万円
現金・預金	4,072百万円																																
金銭の信託	153百万円																																
前払費用	2百万円																																
未収収益	147百万円																																
その他	193百万円																																
未払手数料	93百万円																																
未払費用	722百万円																																
その他	266百万円																																
現金・預金	3,243百万円																																
金銭の信託	152百万円																																
未収収益	619百万円																																
その他	20百万円																																
預り金	177百万円																																
未払手数料	144百万円																																
未払費用	251百万円																																
その他	61百万円																																

(損益計算書関係)

第57期 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	第58期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29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> <table border="0"> <tr><td>受取配当金</td><td style="text-align: right;">1,193百万円</td></tr> <tr><td>支払利息</td><td style="text-align: right;">123百万円</td></tr> <tr><td>デリバティブ費用</td><td style="text-align: right;">889百万円</td></tr> </table>	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>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> <table border="0"> <tr><td>受取配当金</td><td style="text-align: right;">1,550百万円</td></tr> <tr><td>デリバティブ収益</td><td style="text-align: right;">347百万円</td></tr> <tr><td>支払利息</td><td style="text-align: right;">58百万円</td></tr> </table> <p>2 過年度の取引に関する法人税等の追加費用計上額です。</p>	受取配当金	1,550百万円	デリバティブ収益	347百万円	支払利息	58百万円
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												
受取配当金	1,550百万円												
デリバティブ収益	347百万円												
支払利息	58百万円												

(株主資本等変動計算書関係)

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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)	814,100	305,000	-	1,119,100

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	1,762,200	-	72,600	1,689,600	-
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	-	1,848,000	2,890,800	-
平成28年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,437,000	33,000	4,404,000	-
合計		6,675,900	4,437,000	1,953,600	9,159,300	-

- (注) 1 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。
 2 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
 3 平成21年度ストックオプション(1)1,689,600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)2,890,800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。また、平成28年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成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29年5月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,036	5.29	平成29年3月31日	平成29年6月22日

(リース取引関係)

第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29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	865百万円	1年内	865百万円
1年超	2,653百万円	1年超	1,787百万円
合計	3,518百万円	合計	2,653百万円

(金融商品関係)

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、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29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	16,761	16,761	-
(2) 未収委託者報酬	10,757	10,757	-
(3) 未収収益	2,799	2,799	-
(4) 関係会社短期貸付金	962	962	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	11,777	11,777	-
(6) 未払金	(4,043)	(4,043)	-
(7) 未払費用	(4,229)	(4,229)	-
(8) 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	35	35	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(1)	(1)	-
デリバティブ取引計	34	34	-

(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) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) 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ていないもののうち75百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、39百万円は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ているもののうち20百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、22百万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 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額20,310百万円)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	16,761	-	-	-
未収委託者報酬	10,757	-	-	-
未収収益	2,799	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	10	616	907	735

合計	30,328	616	907	735
----	--------	-----	-----	-----

(有価証券関係)

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,310
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	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	6,299	5,590	708
	小計	6,299	5,590	708
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	5,478	5,780	302
	小計	5,478	5,780	302
合計		11,777	11,370	406

(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
投資信託	3,198	174	120
合計	3,198	174	120

(デリバティブ取引関係)

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)
為替予約取引					

市場取引以外の取引	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	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		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。

第58期(平成29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	1,729	-	35	35
	買建	-	-	-	-
合計		1,729	-	35	35

(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)
	為替予約取引				
	売建				
	米ドル		2,993	-	11
	豪ドル		77	-	2

原則的処理 方法	シンガポールドル	投資有価証券	1,639	-	20
	香港ドル		205	-	2
	人民元		1,946	-	6
	ユーロ		57	-	0
	合計		6,920	-	1

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第57期 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	第58期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29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 3,037	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,030
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,686	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,455
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,901	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,092

(退職給付関係)

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
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。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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	1,299
勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	190
退職給付の支払額	72
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,190</u>

(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	1,190
未積立退職給付債務	1,190
未認識数理計算上の差異	69
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,259</u>

退職給付引当金	1,259
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,259</u>

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	23
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>177</u>

(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、213百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

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58期(自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の取締役・従業員 16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 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定条件	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。	平成30年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3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25年10月7日から平成33年10月6日まで	平成30年7月15日から平成38年7月31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	1,762,200	174,900
付与	0	0
失効	72,600	0
権利確定	0	0
権利未確定残	1,689,600	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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定前(株)		
期首	4,738,800	-
付与	0	4,437,000
失効	1,848,000	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,890,800	4,404,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利行使価格(円)	737 (注)3	558
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（取引事例比準法等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57期 (平成28年3月31日)	第58期 (平成29年3月31日)																																																																		
<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">642</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">177</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">819</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">1,430</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">353</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却費</td> <td style="text-align: right;">122</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">65</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,068</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">1,430</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,457</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">71</td> </tr> <tr> <td>繰延ヘッジ利益</td> <td style="text-align: right;">114</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">26</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">213</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債合計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 1px solid black;">1,244</td> </tr> </table>	賞与引当金	642	その他	177	小計	819	投資有価証券評価損	96	関係会社株式評価損	1,430	退職給付引当金	353	固定資産減価償却費	122	その他	65	小計	2,068	評価性引当金	1,430	繰延税金資産合計	1,457	その他有価証券評価差額金	71	繰延ヘッジ利益	114	その他	26	小計	213	繰延税金資産の純額	1,244	<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">641</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">224</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">865</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">1,430</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">385</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却費</td> <td style="text-align: right;">119</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">63</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,095</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">1,430</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,530</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">0</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">0</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">123</td> </tr> <tr> <td>繰延ヘッジ利益</td> <td style="text-align: right;">117</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">241</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債合計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 1px solid black;">1,288</td> </tr> </table>	賞与引当金	641	その他	224	小計	865	投資有価証券評価損	96	関係会社株式評価損	1,430	退職給付引当金	385	固定資産減価償却費	119	その他	63	小計	2,095	評価性引当金	1,430	繰延税金資産合計	1,530	その他有価証券評価差額金	0	小計	0	その他有価証券評価差額金	123	繰延ヘッジ利益	117	小計	241	繰延税金資産の純額	1,288
賞与引当金	642																																																																		
その他	177																																																																		
小計	819																																																																		
投資有価証券評価損	96																																																																		
関係会社株式評価損	1,430																																																																		
退職給付引当金	353																																																																		
固定資産減価償却費	122																																																																		
その他	65																																																																		
小計	2,068																																																																		
評価性引当金	1,430																																																																		
繰延税金資産合計	1,457																																																																		
その他有価証券評価差額金	71																																																																		
繰延ヘッジ利益	114																																																																		
その他	26																																																																		
小計	213																																																																		
繰延税金資産の純額	1,244																																																																		
賞与引当金	641																																																																		
その他	224																																																																		
小計	865																																																																		
投資有価証券評価損	96																																																																		
関係会社株式評価損	1,430																																																																		
退職給付引当金	385																																																																		
固定資産減価償却費	119																																																																		
その他	63																																																																		
小計	2,095																																																																		
評価性引当金	1,430																																																																		
繰延税金資産合計	1,530																																																																		
その他有価証券評価差額金	0																																																																		
小計	0																																																																		
その他有価証券評価差額金	123																																																																		
繰延ヘッジ利益	117																																																																		
小計	241																																																																		
繰延税金資産の純額	1,288																																																																		
<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">33.1%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">1.4%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">4.8%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">1.3%</td> </tr> <tr> <td>所得拡大促進税制</td> <td style="text-align: right;">2.2%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">29.4%</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	33.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目	1.4%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.8%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.3%	所得拡大促進税制	2.2%	海外子会社の留保利益の影響額等	0.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">30.9%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">5.3%</td> </tr> <tr> <td>過年度法人税等</td> <td style="text-align: right;">1.5%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">0.2%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">27.9%</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	30.9%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.3%	過年度法人税等	1.5%	海外子会社の留保利益の影響額等	0.2%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9%																																								
法定実効税率 (調整)	33.1%																																																																		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.4%																																																																		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.8%																																																																		
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.3%																																																																		
所得拡大促進税制	2.2%																																																																		
海外子会社の留保利益の影響額等	0.6%																																																																		
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%																																																																		
法定実効税率 (調整)	30.9%																																																																		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%																																																																		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.3%																																																																		
過年度法人税等	1.5%																																																																		
海外子会社の留保利益の影響額等	0.2%																																																																		
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9%																																																																		

第57期 (平成28年3月31日)	第58期 (平成29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 (SGD 千)	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)	90 (SGD 1,000 千)(注2)	関係会社短期貸付金	333 (SGD 4,000 千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	18 (SGD 215 千)	未収収益	6 (SGD 74 千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	5,000	関係会社短期貸付金	5,000
							貸付金利息(円貸建)(注3)	70	未収収益	70
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542 (USD 千)(注4)	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入(米ドル貸建)(注5)	6,176 (USD 50,000 千)	関係会社短期借入金	5,631 (USD 50,000 千)
							借入金利息(米ドル貸建)(注5)	113 (USD 949 千)	未払費用	106 (USD 949 千)

(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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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	312,000(SGD千)	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)	65(SGD800千)(注2)	関係会社短期貸付金	385(SGD4,800千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	13(SGD177千)	未収収益	8(SGD105千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	4,422(注4)	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建)(注3)	3	未収収益	3

						-	増資の引受 (注5)	1,501 (SGD 20,000 千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリ カ 合衆国	181,542 (USD 千) (注6)	アセット マネジメ ント業	間接 100.00	資金の 借入	資金の借入 (米ドル貸建) (注7)	5,549 (USD 50,000 千) (注8)	関係会社 短期借入 金	-
							借入金利息 (米ドル貸建) (注7)	48 (USD 453 千)	未払費用	-

(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65百万円 (SGD800千) の内訳は、貸付505百万円 (SGD6,600千) 及び返済439百万円 (SGD5,800千) 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 資金の貸付に係る取引金額 4,422百万円の内訳は、貸付577百万円及び返済5,000百万円であります。
- 5 Nikko Asset Management International Limitedの行った20,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
- 6 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。
- 7 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。
- 8 資金の借入に係る取引金額 5,549百万円 (USD 50,000千) は、返済であります。

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28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	25,221百万円
負債合計	5,428百万円
純資産合計	19,792百万円
営業収益	18,250百万円
税引前当期純利益	6,809百万円
当期純利益	4,680百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

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。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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せん。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	267円27銭	288円29銭
1株当たり当期純利益金額	25円25銭	28円38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57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益(百万円)	4,962	5,562
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)	4,962	5,562
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,464	196,009
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) 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	平成21年度ストックオプション(1) 1,689,600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) 2,890,800株、平成28年度ストックオプション(1) 4,404,000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57期 (平成28年3月31日)	第58期 (平成29年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	52,438	56,475
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)	52,438	56,475
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)	196,198	195,893

(重要な後発事象)

新株予約権(ストックオプション)の付与

当社は平成29年3月15日付の臨時株主総会及び平成29年3月22日開催の取締役会の決議に基づき、平成29年4月27日にストックオプションとして新株予約権を当社、当社子会社の取締役及び従業員31

名に付与いたしました。

新株予約権の数	4,409個
新株予約権の目的となる株式の種類及び数	当社普通株式 4,409,000株
新株予約権の発行価額	無償
新株予約権の行使時の払込金額	1株当たり金553円
新株予約権の行使期間	平成31年4月27日から平成39年4月30日まで

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第59期中間会計期間 (平成29年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		16,734
有価証券		17
未収委託者報酬		9,940
未収収益		2,241
関係会社短期貸付金		976
繰延税金資産		866
その他	2	2,935
流動資産合計		33,712
固定資産		
有形固定資産	1	243
無形固定資産		118
投資その他の資産		
投資有価証券		14,687
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		784
繰延税金資産		298
長期前払費用		0
投資その他の資産合計		39,035
固定資産合計		39,397
資産合計		73,109

(単位：百万円)

		第59期中間会計期間 (平成29年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		4,545
未払費用		4,058
未払法人税等		1,473
未払消費税等	3	495
賞与引当金		1,207

役員賞与引当金	60
その他	943
流動負債合計	12,784
固定負債	
退職給付引当金	1,305
その他	43
固定負債合計	1,348
負債合計	14,133
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	36,351
利益剰余金合計	36,351
自己株式	786
株主資本合計	58,148
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	716
繰延ヘッジ損益	111
評価・換算差額等合計	827
純資産合計	58,976
負債純資産合計	73,109

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		33,067
その他営業収益		2,422
営業収益合計		35,490
営業費用及び一般管理費	1	31,576
営業利益		3,913
営業外収益	2	1,051
営業外費用	3	431
経常利益		4,533
特別利益	4	174
特別損失	5	124
税引前中間純利益		4,582
法人税等	6	1,211
中間純利益		3,371

(3) 中間株主資本等変動計算書

第59期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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	34,015	34,015	672	55,926
当中間期変動額							
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036
中間純利益				3,371	3,371		3,371
自己株式の取得						113	113
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計				2,335	2,335	113	2,221
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	36,351	36,351	786	58,148

	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	282	266	548	56,475
当中間期変動額				
剰余金の配当				1,036
中間純利益				3,371
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	434	155	279	279
当中間期変動額合計	434	155	279	2,501
当中間期末残高	716	111	827	58,976

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第59期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 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 (2) デリバティブ 時価法

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>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>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 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> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む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、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

第59期中間会計期間
(平成29年9月30日)

1	有形固定資産の減価償却累計額 1,819百万円
2	信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4	保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務599百万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476百万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59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 55百万円 無形固定資産 21百万円
2	営業外収益のうち主要なもの 受取利息 13百万円 受取配当金 1,005百万円
3	営業外費用のうち主要なもの 支払利息 104百万円 支払源泉所得税 97百万円 デリバティブ費用 205百万円
4	特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益 174百万円
5	特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損 119百万円
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59期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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)	1,119,100	182,600	-	1,301,700

(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	1,689,600	-	9,900	1,679,700	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	198,000	2,692,800	-
平成28年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	-	4,404,000	-
平成28年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	-	4,409,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	273,900	13,294,400	-

(注) 1 平成28年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 平成21年度ストックオプション(1)1,679,700株、平成21年度ストックオプション(2) 108,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,692,800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。また、平成28年度ストックオプション(1)及び平成28年度ストックオプション(2)は権利行使期間の初日が到来しておりません。

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29年5月25日 取締役会	普通株式	1,036	5.29	平成29年3月31日	平成29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の

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29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	1,355百万円
合計	2,220百万円

(金融商品関係)

第59期中間会計期間(平成29年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成29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	16,734	16,734	-
(2) 未収委託者報酬	9,940	9,940	-
(3) 未収収益	2,241	2,241	-
(4) 関係会社短期貸付金	976	976	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,688	14,688	-
(6) 未払金	(4,545)	(4,545)	-
(7) 未払費用	(4,058)	(4,058)	-
(8) 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	(263)	(263)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(52)	(52)	-
デリバティブ取引計	(316)	(316)	-

(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(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) 未払金及び(7) 未払費用
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。
- (8) 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ていないものは、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ているもののうち14百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、66百万円は、流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等（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59期中間会計期間(平成29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	11,892	10,815	1,077
	小計	11,892	10,815	1,077
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	2,796	2,841	44
	小計	2,796	2,841	44
合計		14,688	13,656	1,032

(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59期中間会計期間(平成29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	5,080	-	263	263
	合計	5,080	-	263	263

(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)
	為替予約取引				

原則的 処理方法	売建	投資有価証 券			
	米ドル		4,855	-	13
	豪ドル		140	-	1
	シンガ ポー ルドル		1,616	-	17
	ユーロ		167	-	3
	香港ドル		541	-	1
	人民元		2,050	-	43
	合計		9,372	-	52

(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59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29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	3,036百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,571百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	835百万円

(ストックオプション等関係)

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29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59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29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59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29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59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29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59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29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59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29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59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1株当たり純資産額	301円34銭
1株当たり中間純利益金額	17円21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59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
中間純利益(百万円)	3,371
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)	3,371
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,877
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) 1,679,700株、平成21年度ストックオプション(2) 108,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,692,800株、平成28年度ストックオプション(1) 4,404,000株、平成28年度ストックオプション(2) 4,409,000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59期中間会計期間 (平成29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)	58,976
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)	58,976

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）	195,711
--------------------------------------	---------

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

（1）定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（2）訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

名 称	資本金の額 （平成29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29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29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・計算事務などを行いません。

（２）販売会社

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

3【資本関係】

（１）受託会社

該当事項はありません。

（２）販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

（２）目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。
- (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29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29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29年12月20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28年11月8日から平成29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29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29年12月20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28年11月8日から平成29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29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29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29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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な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29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29年4月1日から平成29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。