

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年2月7日
【計算期間】	第25期 (自 平成23年11月8日 至 平成24年11月7日)
【ファンド名】	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
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 村上 雅彦
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	小濱 公哉
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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	T O P I X（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	T O P I X（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
		債 券	
追加型投信	海 外	不動産投信	特殊型
	内 外	その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

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

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

(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、株式および債券に対象を行ないます。よって、商品分類の「投資対象資産（収益の源泉）」においては、「資産複合」に分類されます。

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

ファンドの特色

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

「インデックスポートフォリオ」

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

「バランスポートフォリオ」

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

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

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

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

2. お買付けは、原則として給与天引きです。

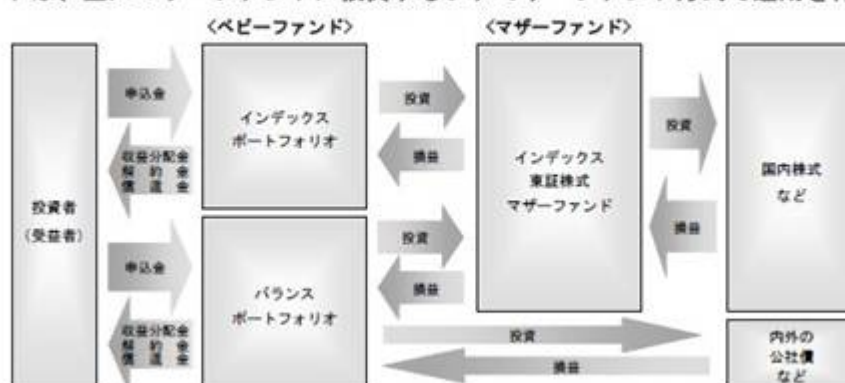
3. お買付けは、無手数料です。

4. ドル・コスト平均法の妙味を味わえます。

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

《ファンドの仕組み》

※当ファンドは、主にマザーファンドに投資するファミリーファンド方式で運用を行ないます。



主な投資制限

「インデックスポートフォリオ」

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

「バランスポートフォリオ」

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

分配方針

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」

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

ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

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

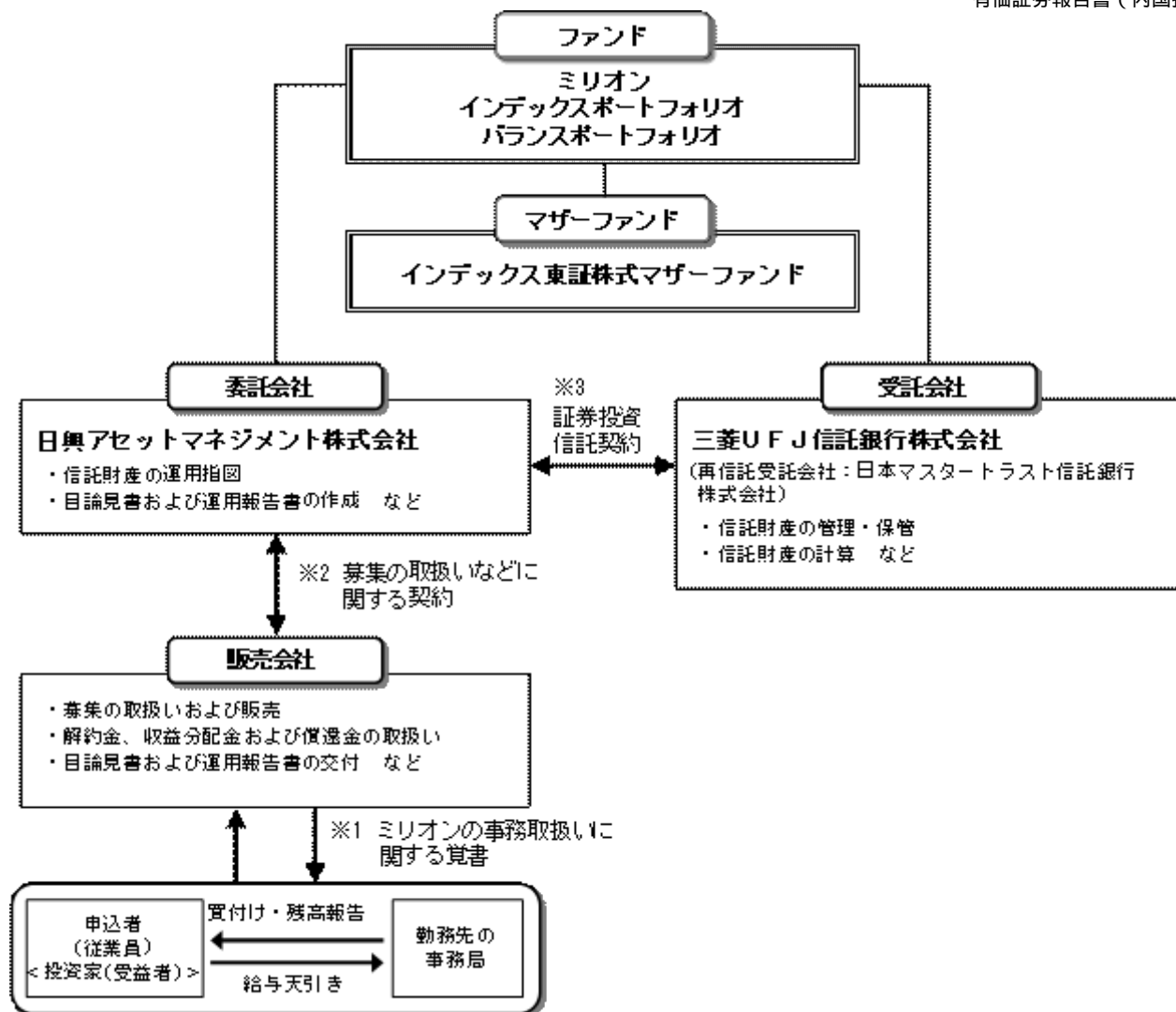
(2) 【ファンドの沿革】

昭和62年11月27日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 ミリオンの事務局と販売会社の間における、ミリオンのお申込み・入金・換金などに関する手続きを規定しています。
- 2 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。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。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24年11月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興證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、）
- 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、）
- 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、）
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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

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

次の取引ができます。

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

< インデックス東証株式マザーファンド >

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる

同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

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

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

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

次の取引ができます。

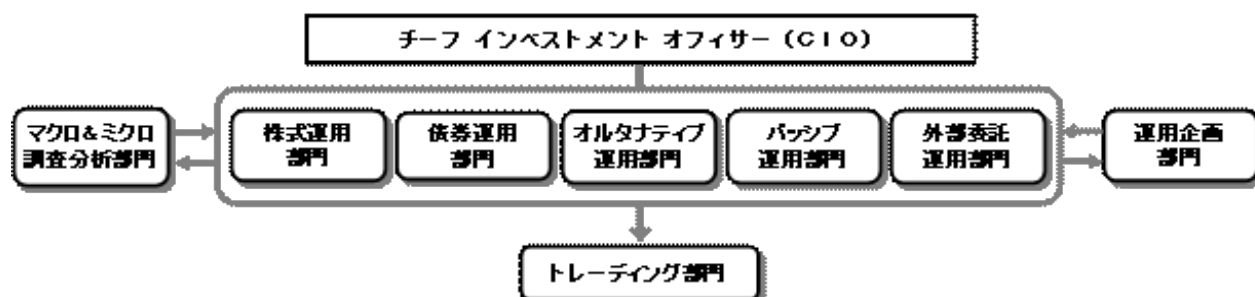
- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 有価証券の貸付

投資対象とするマザーファンドの概要
 <インデックス東証株式マザーファンド>

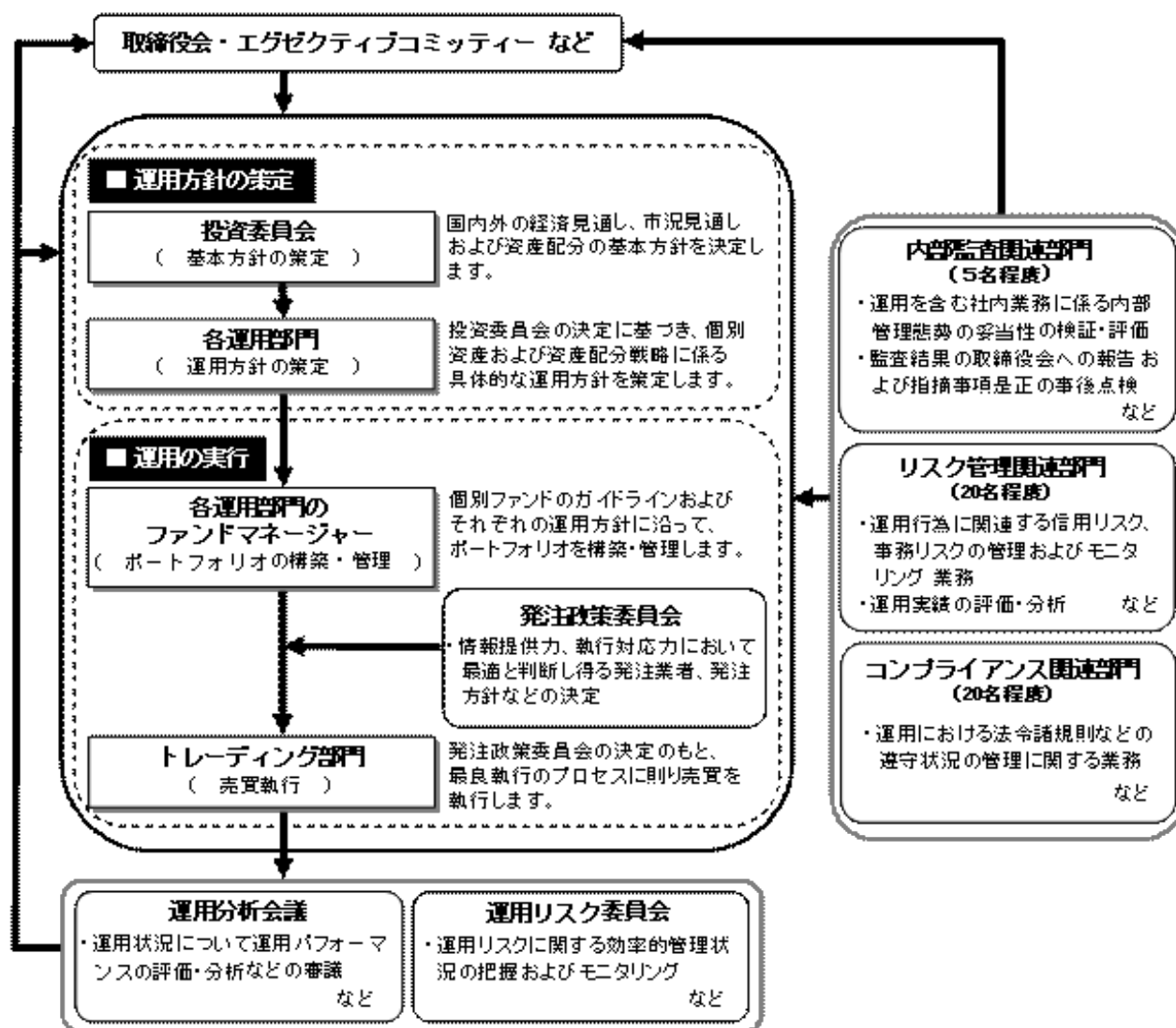
運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期的成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	・投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、バーラ日本株式モデルに従い次のポートフォリオ管理を行ないます。投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行ないます。資金の流出入に伴なう売買にあたっては、原則として買付の場合は時価比率の高い銘柄から順に、売却の場合は時価比率の低い銘柄から順番に行ないます。 ・株式の組入比率は、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	・株式への投資割合には制限を設けません ・外貨建資産への投資は行ないません。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など、 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社
信託期間	無期限（昭和61年10月22日設定）
決算日	毎年10月21日（休業日の場合は翌営業日）

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は平成24年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】**収益分配方針**

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

１）分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。

２）分配対象額についての分配方針

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

３）留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

収益分配金の支払い

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

（５）【投資制限】**約款に定める投資制限****<インデックスポートフォリオ>**

１）「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合には制限を設けません。

２）外貨建資産への投資は行ないません。

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

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

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

ハ）借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

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。

<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て、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。

< インデックス東証株式マザーファンド >

- 1) 株式への投資割合には制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受け取る組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 5) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

3【投資リスク】

（１）ファンドのリスク

<インデックスポートフォリオ>

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

<ＴＯＰＩＸ（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ＴＯＰＩＸ（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。

- ・ ＴＯＰＩＸ（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ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

<バランスポートフォリオ>

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・ 一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファ

ンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

流動性リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

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

<その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

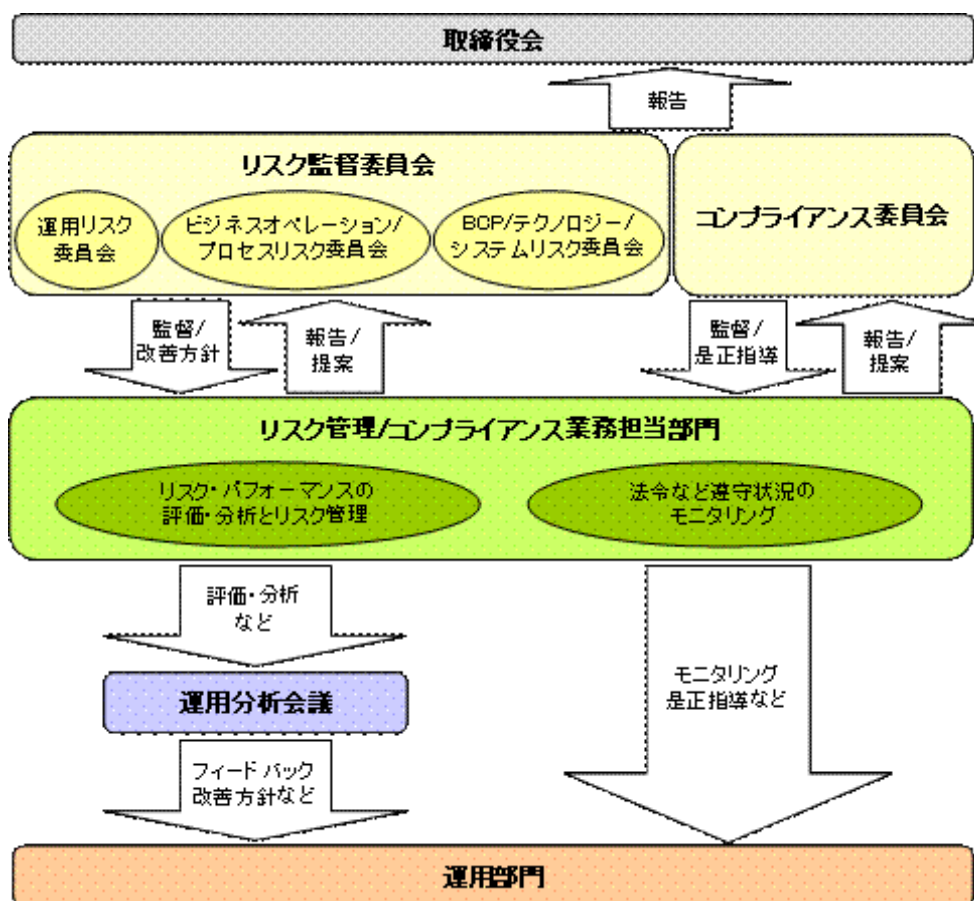
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



■ 全社的リスク管理

当社は運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況およびリスク管理状況については、リスクマネジメント部が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。本委員会およびその部門別委員会においては、各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重大なリスクの洗い出し、より予防的なリスクの軽減に繋がる施策、管理手法の構築などに努めております。

■ リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析と運用プロセスおよびリスク運営状況のモニタリングを行ないます。運用パフォーマンスおよびリスクに係る評価と分析の結果については運用分析会議に報告し、リスク管理状況についてはリスク監督委員会あるいはその部門別委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

■ 法令など遵守状況のモニタリング

運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス関連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24年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.596%（税抜1.52%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬（本書提出日現在）の配分は、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.596%	0.357%	1.155%	0.084%
（1.52%）	（0.34%）	（1.10%）	（0.08%）

括弧内は税抜です。

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。

組入の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>

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

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

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

- ・収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、10.147%（所得税7.147%および地方税3%）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。
- ・なお、上記の10.147%の税率は、平成26年1月1日以降は20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率となる予定です。

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、10.147%（所得税7.147%および地方税3%）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、10.147%（所得税7.147%および地方税3%）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

- ・なお、上記の10.147%の税率は、平成26年1月1日以降は20.315%（所得税15.315%および

地方税 5 %) の税率となる予定です。

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当等（申告分離課税を選択したものに限り、）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）および普通分配金（申告分離課税を選択したものに限り、）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

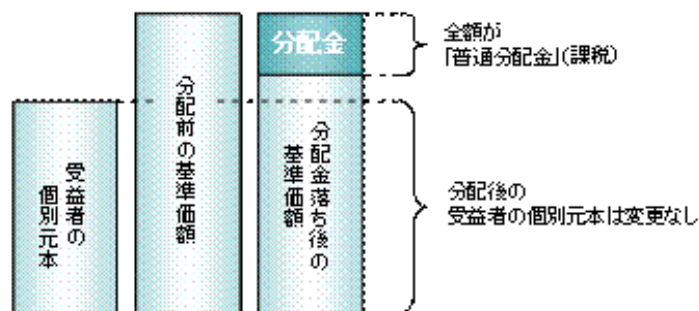
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

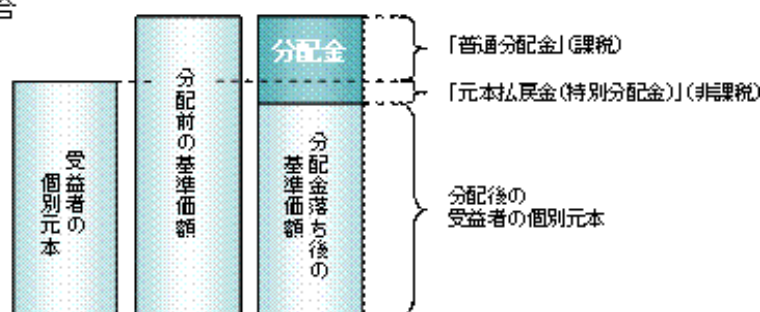
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- 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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成25年2月7日現在のものであり、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2012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	8,303,802,859	99.93
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	-	5,582,985	0.07
合計（純資産総額）		8,309,385,844	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	11,965,133,804	0.660	7,896,988,311	0.694	8,303,802,859	99.93

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.93
合 計	99.93

【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16計算期間末	2003年11月 7日	14,743	14,760	0.4315	0.4320
第17計算期間末	2004年11月 8日	15,068	15,085	0.4524	0.4529
第18計算期間末	2005年11月 7日	19,235	19,251	0.6130	0.6135
第19計算期間末	2006年11月 7日	18,844	18,858	0.6575	0.6580
第20計算期間末	2007年11月 7日	15,899	15,912	0.6318	0.6323
第21計算期間末	2008年11月 7日	9,110	9,123	0.3584	0.3589
第22計算期間末	2009年11月 9日	9,152	9,165	0.3557	0.3562
第23計算期間末	2010年11月 8日	8,949	8,962	0.3442	0.3447
第24計算期間末	2011年11月 7日	7,970	7,983	0.3088	0.3093
第25計算期間末	2012年11月 7日	7,945	7,958	0.3085	0.3090
2011年11月末日		7,737	-	0.2995	-
12月末日		7,707	-	0.2996	-
2012年 1月末日		7,980	-	0.3100	-
2月末日		8,802	-	0.3426	-
3月末日		9,063	-	0.3535	-
4月末日		8,527	-	0.3324	-
5月末日		7,632	-	0.2971	-
6月末日		8,173	-	0.3178	-
7月末日		7,835	-	0.3033	-
8月末日		7,771	-	0.3011	-
9月末日		7,899	-	0.3063	-
10月末日		7,928	-	0.3077	-
11月末日		8,309	-	0.3231	-

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第16期	2002年11月 8日～2003年11月 7日	0.0005
第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	0.0005
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	0.0005
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	0.0005
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	0.0005
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	0.0005
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.0005
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	0.0005
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0005
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第16期	2002年11月 8日～2003年11月 7日	18.39
第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	4.96
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	35.61
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	7.34
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	3.83
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	43.19
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.61
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	3.09
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	10.14
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.06

(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16期	2002年11月 8日～2003年11月 7日	2,350,914,067	2,209,700,994
第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	1,619,588,910	2,482,316,326
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	1,358,186,333	3,284,725,185
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	907,747,499	3,628,251,250
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	793,043,556	4,287,293,625
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	981,834,490	730,018,204
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	1,338,588,106	1,023,299,271
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	1,177,644,536	908,226,822
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	1,083,821,347	1,275,668,411
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	1,098,402,396	1,156,956,048

< バランスポートフォリオ >

以下の運用状況は2012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	96,066,013	25.58
親投資信託受益証券	日本	194,493,057	51.78
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	-	85,041,332	22.64
合計（純資産総額）		375,600,402	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	利率（％）	償還期限	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	—	—	280,249,362	0.662	185,525,077	0.694	194,493,057	51.78
日本	国債証券	第7 1 回利付国債（ 5 年）	1.300	2013/03/20	30,000,000	100.35	30,107,344	100.36	30,107,344	8.02
日本	国債証券	第2 6 7 回利付国債（ 1 0 年）	1.300	2014/12/20	20,000,000	102.54	20,508,000	102.46	20,491,600	5.46
日本	国債証券	第2 5 2 回利付国債（ 1 0 年）	1.000	2013/06/20	20,000,000	100.49	20,099,419	100.50	20,099,419	5.35
日本	国債証券	第8 9 回利付国債（ 5 年）	0.400	2015/06/20	15,000,000	100.79	15,119,100	100.77	15,115,950	4.02
日本	国債証券	第2 6 4 回利付国債（ 1 0 年）	1.500	2014/09/20	10,000,000	102.61	10,261,200	102.52	10,251,700	2.73

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	25.58
親投資信託受益証券	51.78
合 計	77.36

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16計算期間末	2003年11月 7日	724	725	0.7560	0.7565
第17計算期間末	2004年11月 8日	701	701	0.7722	0.7727
第18計算期間末	2005年11月 7日	744	745	0.8973	0.8978
第19計算期間末	2006年11月 7日	725	725	0.9269	0.9274
第20計算期間末	2007年11月 7日	579	580	0.9053	0.9058
第21計算期間末	2008年11月 7日	443	443	0.6881	0.6886
第22計算期間末	2009年11月 9日	438	438	0.6884	0.6889
第23計算期間末	2010年11月 8日	424	424	0.6749	0.6754
第24計算期間末	2011年11月 7日	381	381	0.6403	0.6408
第25計算期間末	2012年11月 7日	366	366	0.6377	0.6382
2011年11月末日		374	-	0.6302	-
12月末日		375	-	0.6299	-
2012年 1月末日		378	-	0.6407	-
2月末日		392	-	0.6744	-
3月末日		395	-	0.6848	-
4月末日		380	-	0.6637	-
5月末日		361	-	0.6279	-
6月末日		372	-	0.6491	-
7月末日		363	-	0.6335	-
8月末日		362	-	0.6308	-
9月末日		366	-	0.6358	-
10月末日		365	-	0.6369	-
11月末日		375	-	0.6526	-

分配の推移

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第16期	2002年11月 8日～2003年11月 7日	0.0005
第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	0.0005
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	0.0005
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	0.0005
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	0.0005
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	0.0005
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.0005
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	0.0005
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0005
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005

収益率の推移

期	期間	収益率（％）
第16期	2002年11月 8日～2003年11月 7日	8.55
第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	2.21
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	16.27
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	3.35
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	2.28
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	23.94
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.12
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	1.89
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	5.05
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.33

(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16期	2002年11月 8日～2003年11月 7日	54,445,112	75,027,275
第17期	2003年11月 8日～2004年11月 8日	43,737,134	94,670,811
第18期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	36,080,277	114,073,407
第19期	2005年11月 8日～2006年11月 7日	28,971,601	76,263,650
第20期	2006年11月 8日～2007年11月 7日	26,280,695	168,533,817
第21期	2007年11月 8日～2008年11月 7日	26,940,763	23,007,376
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	29,474,951	37,415,222
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	26,059,079	33,889,327
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	24,624,836	57,559,266
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	21,493,518	42,290,225

（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2012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（％）
株式	日本	8,262,084,660	97.21
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	-	236,771,791	2.79
合計（純資産総額）		8,498,856,451	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	218,680,000	2.57

(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。

（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	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	98,600	3,150.00	310,590,000	3,535.00	348,551,000	4.10
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	573,800	373.00	214,027,400	377.00	216,322,600	2.55
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	64,800	2,613.00	169,322,400	2,732.00	177,033,600	2.08
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	57,300	2,475.00	141,817,500	2,654.00	152,074,200	1.79
日本	株式	キヤノン	電気機器	47,700	2,654.00	126,595,800	2,883.00	137,519,100	1.62
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	974,900	129.00	125,762,100	132.00	128,686,800	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	31,900	3,860.00	123,134,000	3,685.00	117,551,500	1.38
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	30,100	3,680.00	110,768,000	3,770.00	113,477,000	1.34
日本	株式	ファナック	電気機器	8,000	12,960.00	103,680,000	13,900.00	111,200,000	1.31
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	34,500	2,590.00	89,355,000	3,090.00	106,605,000	1.25
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	38,100	2,291.00	87,287,100	2,470.00	94,107,000	1.11
日本	株式	三菱商事	卸売業	59,100	1,402.81	82,906,400	1,561.00	92,255,100	1.09
日本	株式	日立製作所	電気機器	180,000	435.71	78,428,000	476.00	85,680,000	1.01
日本	株式	三菱地所	不動産業	53,000	1,589.00	84,217,000	1,589.00	84,217,000	0.99
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	97,000	704.00	68,288,000	799.00	77,503,000	0.91
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	14,300	5,466.08	78,165,000	5,410.00	77,363,000	0.91
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	31,700	2,419.00	76,682,300	2,402.00	76,143,400	0.90
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	17,900	3,925.00	70,257,500	4,170.00	74,643,000	0.88
日本	株式	三井物産	卸売業	65,400	1,146.00	74,948,400	1,139.00	74,490,600	0.88
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	625	126,300.00	78,937,500	118,900.00	74,312,500	0.87
日本	株式	信越化学工業	化学	14,400	4,625.00	66,600,000	4,850.00	69,840,000	0.82
日本	株式	小松製作所	機械	37,500	1,710.00	64,125,000	1,847.00	69,262,500	0.81
日本	株式	KDDI	情報・通信業	10,700	6,020.00	64,414,000	6,100.00	65,270,000	0.77
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	340,000	173.75	59,075,000	189.00	64,260,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	29,300	2,174.86	63,723,500	2,114.00	61,940,200	0.73
日本	株式	三井不動産	不動産業	36,000	1,648.16	59,334,000	1,719.00	61,884,000	0.73

日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	154,700	293.00	45,327,100	341.00	52,752,700	0.62
日本	株式	デンソー	輸送用機器	19,000	2,552.00	48,488,000	2,709.00	51,471,000	0.61
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	25,200	1,857.00	46,796,400	1,989.00	50,122,800	0.59
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	60,400	804.00	48,561,600	824.00	49,769,600	0.59

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	0.09
		鉱業	0.61
		建設業	2.50
		食料品	4.07
		繊維製品	0.83
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.69
		医薬品	5.14
		石油・石炭製品	0.76
		ゴム製品	0.80
		ガラス・土石製品	0.97
		鉄鋼	1.55
		非鉄金属	1.04
		金属製品	0.68
		機械	4.89
		電気機器	11.55
		輸送用機器	10.69
		精密機器	1.40
		その他製品	1.45
		電気・ガス業	2.41
		陸運業	4.10
		海運業	0.28
		空運業	0.61
		倉庫・運輸関連業	0.22
		情報・通信業	6.27
		卸売業	5.17
		小売業	4.13
		銀行業	9.66
		証券、商品先物取引業	1.20
		保険業	2.26
		その他金融業	0.92
		不動産業	2.91
		サービス業	2.10
合 計			97.21

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
< 有価証券先物取引等 >

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 （各通貨）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	日本	東京証券取引所	東証株価指数先物 2012年12月	買建	28	日本円	210,912,485	218,680,000	2.57

(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。

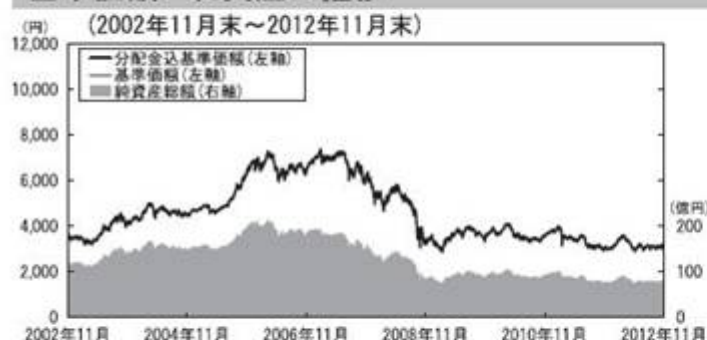
(参考情報)

運用実績

2012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……………3,231 円

純資産総額……………83.09 億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。

※分配金込基準価額は、2002年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

分配の推移（税引前、1万口当たり）

2008年11月	2009年11月	2010年11月	2011年11月	2012年11月	設定来累計
5 円	5 円	5 円	5 円	5 円	125円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産	比 率
株式	97.16%
株式先物	2.57%
債券	—
債券先物	—
現金その他	2.84%

※当ファンドの実質組入比率です。

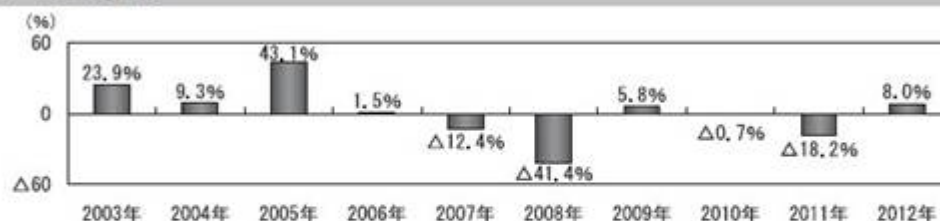
＜組入上位10銘柄＞

インデックス東証株式マザーファンド

銘柄	業 種	比 率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	4.10%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.55%
3 本田技研工業	輸送用機器	2.08%
4 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.79%
5 キヤノン	電気機器	1.62%
6 みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.51%
7 日本電信電話	情報・通信業	1.38%
8 武田薬品工業	医薬品	1.34%
9 ファナック	電気機器	1.31%
10 ソフトバンク	情報・通信業	1.25%

※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



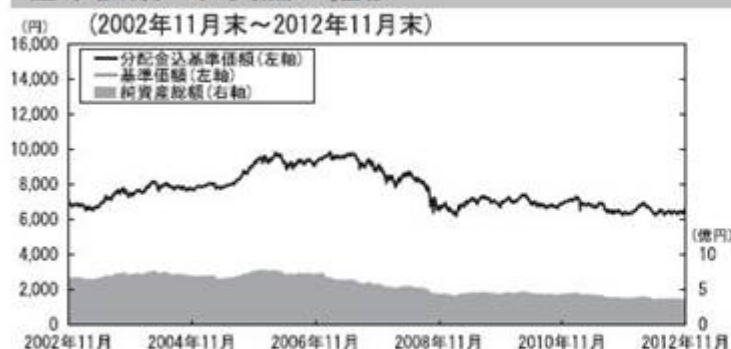
※ファンドの年間収益率は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。

※2012年は、2012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.....6,526 円

純資産総額.....3.75 億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。

※分配金込基準価額は、2002年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

分配の推移（税引前、1万口当たり）

2008年11月	2009年11月	2010年11月	2011年11月	2012年11月	設定来累計
5 円	5 円	5 円	5 円	5 円	125 円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産	比率
株式	50.34%
株式先物	1.33%
債券	25.58%
債券先物	0.00%
現金その他	24.08%

※当ファンドの実質組入比率です。

＜組入上位銘柄＞

当ファンド

銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1 インデックス東証株式マザーファンド	親投資信託受益証券	—	—	51.78%
2 第71回利付国債（5年）	国債証券	1.3%	2013年3月20日	8.02%
3 第267回利付国債（10年）	国債証券	1.3%	2014年12月20日	5.46%
4 第252回利付国債（10年）	国債証券	1.0%	2013年6月20日	5.35%
5 第89回利付国債（5年）	国債証券	0.4%	2015年6月20日	4.02%
6 第264回利付国債（10年）	国債証券	1.5%	2014年9月20日	2.73%

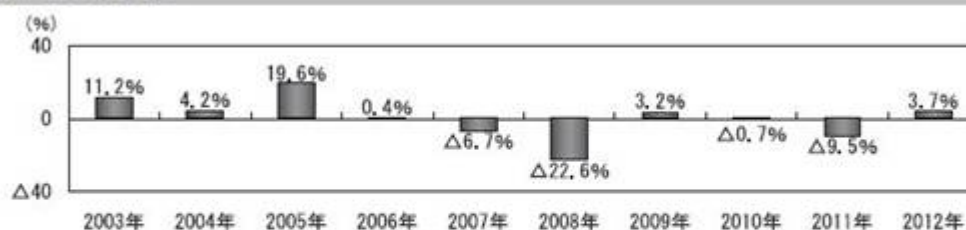
※当ファンドの対純資産総額比です。

インデックス東証株式マザーファンド

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	4.10%
2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.55%
3 本田技研工業	輸送用機器	2.08%
4 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.79%
5 キヤノン	電気機器	1.62%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2012年は、2012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づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（3）解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（4）手取額

- 1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。
- 税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
- 詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（5）解約単位

1口単位

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

（6）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

（7）受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準

価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

< 買取請求による換金 >

(1) 買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

(2) 買取制限

ファンドの規模および商品性格などに基つき、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。

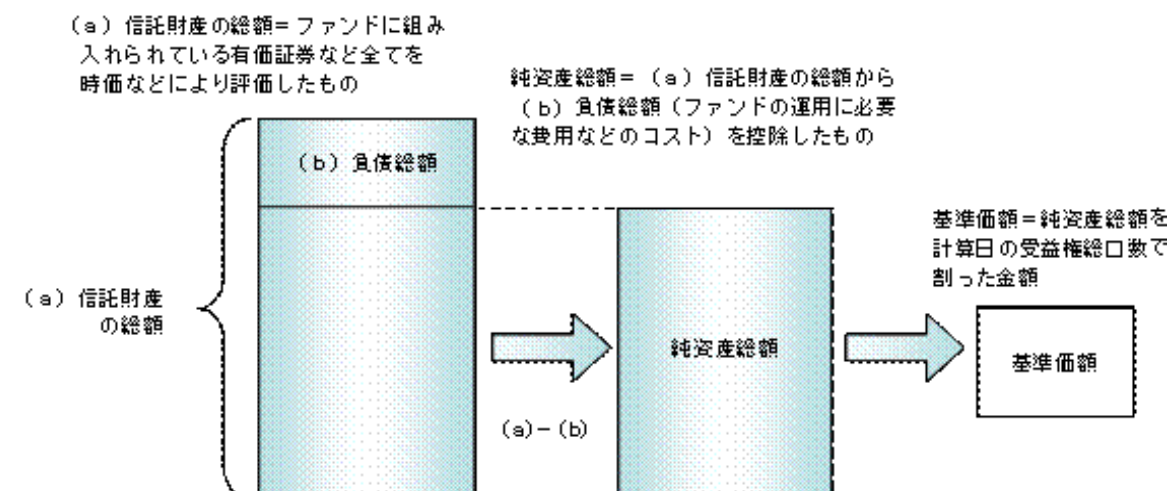
3【資産管理等の概要】

(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）

- 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

- 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。

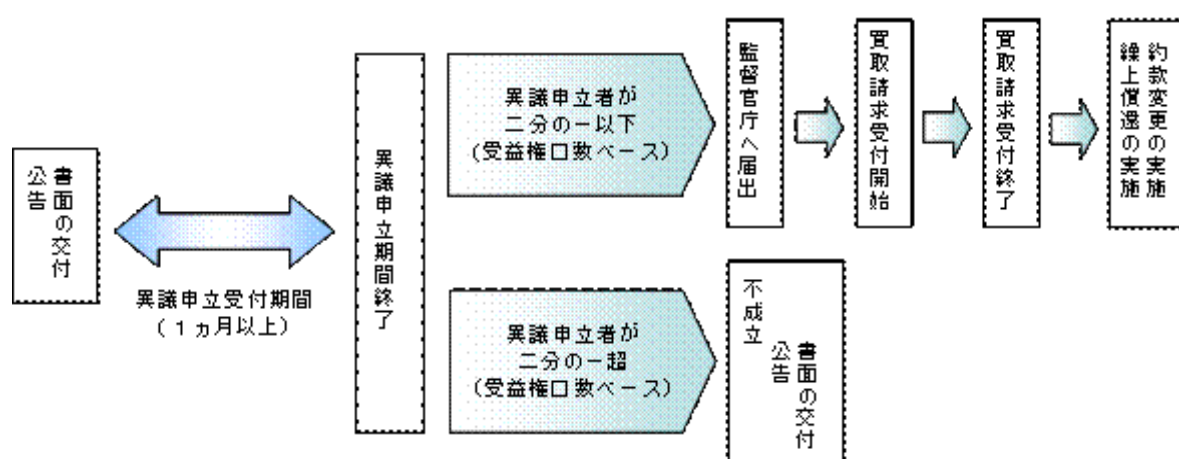
- この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（１ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

- 4) 委託会社は、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 ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して 5 営業日まで）から受益者に支払います。
 - ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。
- 信託約款の変更
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
 - 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
 - 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
 - 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べる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なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。運用報告書は原則として知れている受益者に対して交付されます。

関係法人との契約について

販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より 1 年間とします。ただし、期間満了の 3 ヶ月前までに、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25期計算期間（平成23年11月8日から平成24年11月7日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【インデックスポートフォリオ】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第24期 平成23年11月 7 日現在	第25期 平成24年11月 7 日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	73,367,155	70,081,253
親投資信託受益証券	7,976,934,125	7,951,637,469
未収入金	1,599,282	2,395,918
未収利息	108	118
流動資産合計	8,051,900,670	8,024,114,758
資産合計	8,051,900,670	8,024,114,758
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	12,905,628	12,876,351
未払解約金	821,535	2,083,332
未払受託者報酬	3,525,429	3,330,326
未払委託者報酬	63,458,803	59,947,155
その他未払費用	352,486	203,922
流動負債合計	81,063,881	78,441,086
負債合計	81,063,881	78,441,086
純資産の部		
元本等		
元本	25,811,256,260	25,752,702,608
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,840,419,471	17,807,028,936
（ 分配準備積立金 ）	544,816,584	507,997,532
元本等合計	7,970,836,789	7,945,673,672
純資産合計	7,970,836,789	7,945,673,672
負債純資産合計	8,051,900,670	8,024,114,758

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第24期 自 平成22年11月 9 日 至 平成23年11月 7 日	第25期 自 平成23年11月 8 日 至 平成24年11月 7 日
営業収益		
受取利息	25,888	23,288
有価証券売買等損益	743,643,252	136,008,051
営業収益合計	743,617,364	136,031,339
営業費用		
受託者報酬	7,466,567	6,773,925
委託者報酬	134,400,312	121,933,019
その他費用	746,292	414,786
営業費用合計	142,613,171	129,121,730
営業利益又は営業損失（ ）	886,230,535	6,909,609
経常利益又は経常損失（ ）	886,230,535	6,909,609
当期純利益又は当期純損失（ ）	886,230,535	6,909,609
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（ ）	13,939,585	4,800,071
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	17,053,322,213	17,840,419,471
剰余金増加額又は欠損金減少額	836,327,871	799,614,381
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	836,327,871	799,614,381
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	710,349,381	755,457,033
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	710,349,381	755,457,033
分配金	12,905,628	12,876,351
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,840,419,471	17,807,028,936

(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。
-----------------	--

(追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

		第24期 平成23年11月 7日現在	第25期 平成24年11月 7日現在
1.	期首元本額	26,003,103,324円	25,811,256,260円
	期中追加設定元本額	1,083,821,347円	1,098,402,396円
	期中一部解約元本額	1,275,668,411円	1,156,956,048円
2.	受益権の総数	25,811,256,260口	25,752,702,608口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	17,840,419,471円	17,807,028,936円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第24期 自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日			第25期 自 平成23年11月 8日 至 平成24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	0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	2,984,478,330円	C	信託約款に定める収益調整金	3,000,411,669円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	557,722,212円	D	信託約款に定める分配準備積立金	520,873,883円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	3,542,200,542円	E	分配対象収益 (A+B+C+D)	3,521,285,552円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.1372円 1,372円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.1367円 1,367円
G	分配金額	12,905,628円	G	分配金額	12,876,351円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0005円 5円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0005円 5円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	第24期 自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日	第25期 自 平成23年11月 8日 至 平成24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マネジメント部を設置し、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24期 平成23年11月 7日現在	第25期 平成24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24期（平成23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	551,400,977
合計	551,400,977

第25期（平成24年11月7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（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24期 平成23年11月 7日現在		第25期 平成24年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.3088円	1口当たり純資産額	0.3085円
（1万口当たり純資産額）	（3,088円）	（1万口当たり純資産額）	（3,085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	12,011,536,963	7,951,637,469	
親投資信託受益証券 合計		12,011,536,963	7,951,637,469	
合計		12,011,536,963	7,951,637,469	

(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24期 平成23年11月 7 日現在	第25期 平成24年11月 7 日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	94,511,088	87,832,382
国債証券	96,339,394	96,128,436
親投資信託受益証券	193,802,310	185,525,077
未収利息	188,595	254,569
前払費用	12,328	15,780
流動資産合計	384,853,715	369,756,244
資産合計	384,853,715	369,756,244
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	297,791	287,393
未払受託者報酬	167,202	154,398
未払委託者報酬	3,010,734	2,780,289
その他未払費用	16,666	9,395
流動負債合計	3,492,393	3,231,475
負債合計	3,492,393	3,231,475
純資産の部		
元本等		
元本	595,582,890	574,786,183
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	214,221,568	208,261,414
（分配準備積立金）	12,429,635	11,272,934
元本等合計	381,361,322	366,524,769
純資産合計	381,361,322	366,524,769
負債純資産合計	384,853,715	369,756,244

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第24期 自 平成22年11月 9 日 至 平成23年11月 7 日	第25期 自 平成23年11月 8 日 至 平成24年11月 7 日
営業収益		
受取利息	1,098,055	1,193,731
有価証券売買等損益	14,539,372	3,759,209
営業収益合計	13,441,317	4,952,940
営業費用		
受託者報酬	349,661	313,922
委託者報酬	6,296,021	5,652,764
その他費用	34,863	19,109
営業費用合計	6,680,545	5,985,795
営業利益又は営業損失（ ）	20,121,862	1,032,855
経常利益又は経常損失（ ）	20,121,862	1,032,855
当期純利益又は当期純損失（ ）	20,121,862	1,032,855
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（ ）	190,521	263,253
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	204,353,926	214,221,568
剰余金増加額又は欠損金減少額	18,697,027	15,210,286
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	18,697,027	15,210,286
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,954,495	7,666,631
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,954,495	7,666,631
分配金	297,791	287,393
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	214,221,568	208,261,414

(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	国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (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。 (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。 (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。 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。
-----------------	--

(追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

		第24期 平成23年11月 7日現在	第25期 平成24年11月 7日現在
1.	期首元本額	628,517,320円	595,582,890円
	期中追加設定元本額	24,624,836円	21,493,518円
	期中一部解約元本額	57,559,266円	42,290,225円
2.	受益権の総数	595,582,890口	574,786,183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	214,221,568円	208,261,414円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第24期 自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日			第25期 自 平成23年11月 8日 至 平成24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	0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	80,933,883円	C	信託約款に定める収益調整金	78,543,082円
D	信託約款に定める分配準備積立金	12,727,426円	D	信託約款に定める分配準備積立金	11,560,327円
E	分配対象収益 (A + B + C + D)	93,661,309円	E	分配対象収益 (A + B + C + D)	90,103,409円
F	分配対象収益 (1口当たり)	0.1572円	F	分配対象収益 (1口当たり)	0.1567円
	(1万口当たり)	1,572円		(1万口当たり)	1,567円
G	分配金額	297,791円	G	分配金額	287,393円
H	分配金額 (1口当たり)	0.0005円	H	分配金額 (1口当たり)	0.0005円
	(1万口当たり)	5円		(1万口当たり)	5円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	第24期 自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日	第25期 自 平成23年11月 8日 至 平成24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マネジメント部を設置し、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24期 平成23年11月 7日現在	第25期 平成24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24期（平成23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	852,856
親投資信託受益証券	16,089,796
合計	16,942,652

第25期（平成24年11月7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（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24期 平成23年11月 7日現在		第25期 平成24年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.6403円	1口当たり純資産額	0.6377円
（1万口当たり純資産額）	（6,403円）	（1万口当たり純資産額）	（6,377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 7 1 回利付国債（ 5 年 ）	30,000,000	30,129,516	
	第 8 9 回利付国債（ 5 年 ）	15,000,000	15,119,100	
	第 2 5 2 回利付国債（ 1 0 年 ）	20,000,000	20,110,620	
	第 2 6 4 回利付国債（ 1 0 年 ）	10,000,000	10,261,200	
	第 2 6 7 回利付国債（ 1 0 年 ）	20,000,000	20,508,000	
国債証券 合計		95,000,000	96,128,436	
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	280,249,362	185,525,077	
親投資信託受益証券 合計		280,249,362	185,525,077	
合計		375,249,362	281,653,513	

(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。

(参考)

「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。

「インデックス東証株式マザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

インデックス東証株式マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

科目	対象年月日	平成23年11月 7日現在	平成24年11月 7日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		654,688	999,225
コール・ローン		111,825,560	179,586,289
株式		7,979,832,395	7,882,174,640
派生商品評価勘定		114,113	3,291,292
未収入金		—	410,688
未収配当金		80,406,042	80,836,941
未収利息		165	304
流動資産合計		8,172,832,963	8,147,299,379
資産合計		8,172,832,963	8,147,299,379
負債の部			
流動負債			

派生商品評価勘定	467,867	215,039
前受金	286,000	4,315,000
未払金	48,000	—
未払解約金	1,599,282	2,395,918
流動負債合計	2,401,149	6,925,957
負債合計	2,401,149	6,925,957
純資産の部		
元本等		
元本	12,551,054,432	12,291,786,325
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,380,622,618	4,151,412,903
元本等合計	8,170,431,814	8,140,373,422
純資産合計	8,170,431,814	8,140,373,422
負債純資産合計	8,172,832,963	8,147,299,379

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

		平成23年11月 7日現在	平成24年11月 7日現在
1.	期首	平成22年11月 9日	平成23年11月 8日
	期首元本額	12,862,201,026円	12,551,054,432円
	期首からの追加設定元本額	289,956,558円	285,013,172円
	期首からの一部解約元本額	601,103,152円	544,281,279円
	元本の内訳		
	インデックスポートフォリオ	12,253,355,031円	12,011,536,963円
	バランスポートフォリオ	297,699,401円	280,249,362円
	計	12,551,054,432円	12,291,786,325円
2.	受益権の総数	12,551,054,432口	12,291,786,325口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	4,380,622,618円	4,151,412,903円
4.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	76,380,000円	97,200,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日	自 平成23年11月 8日 至 平成24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マネジメント部を設置し、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23年11月 7日現在	平成24年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成23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	60,905,398
合計	60,905,398

（平成24年11月7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（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23年11月7日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	157,801,000	—	157,500,000	301,000
合計		157,801,000	—	157,500,000	301,000

（平成24年11月7日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	219,905,000	—	223,050,000	3,145,000
合計		219,905,000	—	223,050,000	3,145,000

（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23年11月 7日現在		平成24年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.651円	1口当たり純資産額	0.662円
（1千口当たり純資産額）	（651円）	（1千口当たり純資産額）	（662円）

（3）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	
1301	極洋	4,000	177.00	708,000	
1332	日本水産	9,200	154.00	1,416,800	
1334	マルハニチロホールディングス	17,000	131.00	2,227,000	
1377	サカタのタネ	1,300	1,046.00	1,359,800	
1379	ホクト	900	1,580.00	1,422,000	
1514	住石ホールディングス	2,700	72.00	194,400	
1515	日鉄鉱業	2,000	335.00	670,000	
1518	三井松島産業	6,000	127.00	762,000	
1605	国際石油開発帝石	104	457,000.00	47,528,000	
1606	日本海洋掘削	200	2,329.00	465,800	
1661	関東天然瓦斯開発	1,000	418.00	418,000	
1662	石油資源開発	1,200	2,891.00	3,469,200	
1414	ショーボンドホールディングス	800	2,388.00	1,910,400	
1417	ミライト・ホールディングス	2,400	630.00	1,512,000	
1712	ダイセキ環境ソリューション	1	113,400.00	113,400	
1719	間組	3,000	180.00	540,000	
1720	東急建設	2,920	147.00	429,240	
1721	コムシスホールディングス	4,200	1,032.00	4,334,400	
1722	ミサワホーム	1,000	1,159.00	1,159,000	
1762	高松コンストラクショングループ	600	1,294.00	776,400	
1766	東建コーポレーション	320	3,525.00	1,128,000	
1780	ヤマウラ	500	227.00	113,500	
1801	大成建設	44,000	216.00	9,504,000	
1802	大林組	26,000	338.00	8,788,000	
1803	清水建設	26,000	253.00	6,578,000	
1808	長谷工コーポレーション	54,000	51.00	2,754,000	
1810	松井建設	1,000	278.00	278,000	
1812	鹿島建設	38,000	216.00	8,208,000	
1813	不動テトラ	6,000	101.00	606,000	
1814	大末建設	4,000	44.00	176,000	
1815	鉄建建設	5,000	99.00	495,000	
1816	安藤建設	3,000	94.00	282,000	
1819	太平工業	2,000	299.00	598,000	
1820	西松建設	10,000	121.00	1,210,000	
1821	三井住友建設	11,900	50.00	595,000	
1822	大豊建設	3,000	92.00	276,000	
1824	前田建設工業	5,000	325.00	1,625,000	
1827	ナカノフドー建設	500	145.00	72,500	
1833	奥村組	8,000	246.00	1,968,000	
1834	大和小田急建設	500	152.00	76,000	
1835	東鉄工業	1,100	913.00	1,004,300	
1847	イチケン	1,000	158.00	158,000	
1852	浅沼組	2,000	53.00	106,000	
1860	戸田建設	10,000	207.00	2,070,000	
1861	熊谷組	6,000	70.00	420,000	
1865	青木あすなろ建設	500	444.00	222,000	

1866	北野建設	2,000	189.00	378,000	
1867	植木組	1,000	159.00	159,000	
1868	三井ホーム	1,000	400.00	400,000	
1870	矢作建設工業	1,100	342.00	376,200	
1871	ピーエス三菱	600	328.00	196,800	
1878	大東建託	3,300	8,070.00	26,631,000	
1879	新日本建設	1,000	182.00	182,000	
1881	N I P P O	2,000	904.00	1,808,000	
1882	東亜道路工業	2,000	211.00	422,000	
1883	前田道路	2,000	1,048.00	2,096,000	
1884	日本道路	3,000	286.00	858,000	
1885	東亜建設工業	7,000	114.00	798,000	
1888	若築建設	5,000	69.00	345,000	
1890	東洋建設	2,600	221.00	574,600	
1893	五洋建設	10,000	185.00	1,850,000	
1896	大林道路	1,000	201.00	201,000	
1898	世紀東急工業	3,000	53.00	159,000	
1899	福田組	1,000	304.00	304,000	
1911	住友林業	5,900	705.00	4,159,500	
1914	日本基礎技術	1,100	281.00	309,100	
1916	日成ビルド工業	2,000	169.00	338,000	
1919	エス・バイ・エル	4,000	121.00	484,000	
1921	巴コーポレーション	1,200	255.00	306,000	
1924	パナホーム	3,000	506.00	1,518,000	
1925	大和ハウス工業	21,000	1,187.00	24,927,000	
1926	ライト工業	1,900	349.00	663,100	
1928	積水ハウス	26,000	804.00	20,904,000	
1929	日特建設	500	267.00	133,500	
1930	北陸電気工事	1,000	228.00	228,000	
1934	ユアテック	1,000	253.00	253,000	
1937	西部電気工業	1,000	341.00	341,000	
1939	四電工	1,000	290.00	290,000	
1941	中電工	1,200	702.00	842,400	
1942	関電工	4,000	349.00	1,396,000	
1944	きんでん	6,000	466.00	2,796,000	
1945	東京エネシス	1,000	368.00	368,000	
1946	トーエネック	1,000	433.00	433,000	
1949	住友電設	600	761.00	456,600	
1950	日本電設工業	2,000	705.00	1,410,000	
1951	協和エクシオ	3,100	795.00	2,464,500	
1952	新日本空調	600	432.00	259,200	
1956	N D S	1,000	250.00	250,000	
1959	九電工	1,000	345.00	345,000	
1961	三機工業	2,000	378.00	756,000	
1963	日揮	9,000	2,670.00	24,030,000	
1964	中外炉工業	3,000	218.00	654,000	
1967	ヤマト	1,000	269.00	269,000	
1968	太平電業	1,000	532.00	532,000	
1969	高砂熱学工業	2,400	595.00	1,428,000	

1972	三晃金属工業	1,000	196.00	196,000	
1975	朝日工業社	1,000	257.00	257,000	
1979	大気社	1,200	1,656.00	1,987,200	
1980	ダイダン	1,000	466.00	466,000	
1982	日比谷総合設備	1,100	897.00	986,700	
1983	東芝プラントシステム	1,000	1,087.00	1,087,000	
6330	東洋エンジニアリング	5,000	323.00	1,615,000	
6366	千代田化工建設	6,000	1,200.00	7,200,000	
6379	新興ブランテック	1,700	662.00	1,125,400	
2001	日本製粉	5,000	345.00	1,725,000	
2002	日清製粉グループ本社	7,500	1,004.00	7,530,000	
2003	日東富士製粉	1,000	295.00	295,000	
2004	昭和産業	3,000	265.00	795,000	
2009	鳥越製粉	700	631.00	441,700	
2052	協同飼料	3,000	93.00	279,000	
2053	中部飼料	800	500.00	400,000	
2056	日本配合飼料	3,000	100.00	300,000	
2107	東洋精糖	2,000	85.00	170,000	
2108	日本甜菜製糖	4,000	151.00	604,000	
2109	三井製糖	3,000	248.00	744,000	
2201	森永製菓	8,000	176.00	1,408,000	
2204	中村屋	2,000	393.00	786,000	
2206	江崎グリコ	3,000	882.00	2,646,000	
2207	名糖産業	400	1,000.00	400,000	
2211	不二家	5,000	199.00	995,000	
2212	山崎製パン	6,000	942.00	5,652,000	
2215	第一屋製パン	1,000	84.00	84,000	
2217	モロゾフ	1,000	278.00	278,000	
2220	亀田製菓	500	1,950.00	975,000	
2229	カルビー	800	7,230.00	5,784,000	
2264	森永乳業	7,000	266.00	1,862,000	
2267	ヤクルト本社	5,000	3,840.00	19,200,000	
2269	明治ホールディングス	2,500	3,665.00	9,162,500	
2270	雪印メグミルク	1,700	1,346.00	2,288,200	
2281	プリマハム	5,000	145.00	725,000	
2282	日本ハム	7,000	1,116.00	7,812,000	
2284	伊藤ハム	5,000	316.00	1,580,000	
2286	林兼産業	3,000	66.00	198,000	
2288	丸大食品	4,000	279.00	1,116,000	
2290	米久	800	658.00	526,400	
2292	S F o o d s	500	743.00	371,500	
2501	サッポロホールディングス	14,000	220.00	3,080,000	
2502	アサヒグループホールディングス	17,300	1,826.00	31,589,800	
2503	キリンホールディングス	37,000	1,029.00	38,073,000	
2531	宝ホールディングス	7,000	598.00	4,186,000	
2533	オエノンホールディングス	2,000	197.00	394,000	
2540	養命酒製造	1,000	700.00	700,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	900	673.00	605,700	
2579	コカ・コーラウエスト	3,000	1,216.00	3,648,000	

2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	1,100	987.00	1,085,700	
2590	ダイドードリンコ	400	3,395.00	1,358,000	
2593	伊藤園	2,400	1,484.00	3,561,600	
2594	キーコーヒー	700	1,531.00	1,071,700	
2597	ユニカフェ	200	404.00	80,800	
2599	ジャパンフーズ	100	876.00	87,600	
2602	日清オイリオグループ	4,000	290.00	1,160,000	
2607	不二製油	2,100	1,118.00	2,347,800	
2613	J - オイルミルズ	3,000	210.00	630,000	
2801	キッコーマン	7,000	1,148.00	8,036,000	
2802	味の素	23,000	1,187.00	27,301,000	
2809	キューピー	4,400	1,300.00	5,720,000	
2810	ハウス食品	3,100	1,283.00	3,977,300	
2811	カゴメ	3,100	1,629.00	5,049,900	
2812	焼津水産化学工業	400	731.00	292,400	
2815	アリアケジャパン	800	1,740.00	1,392,000	
2871	ニチレイ	10,000	430.00	4,300,000	
2875	東洋水産	4,000	2,175.00	8,700,000	
2897	日清食品ホールディングス	3,400	3,105.00	10,557,000	
2899	永谷園	1,000	779.00	779,000	
2908	フジッコ	1,000	1,005.00	1,005,000	
2910	ロック・フィールド	500	1,430.00	715,000	
2914	日本たばこ産業	38,100	2,250.00	85,725,000	
2915	ケンコーマヨネーズ	200	787.00	157,400	
2918	わらべや日洋	500	1,636.00	818,000	
2922	なとり	400	860.00	344,000	
4404	ミヨシ油脂	3,000	99.00	297,000	
3001	片倉工業	1,000	679.00	679,000	
3002	ゲンゼ	6,000	198.00	1,188,000	
3101	東洋紡	34,000	94.00	3,196,000	
3103	ユニチカ	22,000	38.00	836,000	
3104	富士紡ホールディングス	4,000	383.00	1,532,000	
3105	日清紡ホールディングス	5,000	513.00	2,565,000	
3106	倉敷紡績	8,000	127.00	1,016,000	
3109	シキボウ	5,000	102.00	510,000	
3201	日本毛織	3,000	558.00	1,674,000	
3202	大東紡織	2,000	62.00	124,000	
3204	トーア紡コーポレーション	4,000	55.00	220,000	
3205	ダイドーリミテッド	900	462.00	415,800	
3302	帝国繊維	1,000	597.00	597,000	
3401	帝人	30,000	174.00	5,220,000	
3402	東レ	62,000	465.00	28,830,000	
3408	サカイオーベックス	3,000	115.00	345,000	
3501	住江織物	2,000	150.00	300,000	
3512	日本フェルト	500	400.00	200,000	
3513	イチカワ	1,000	146.00	146,000	
3514	日本バイリーン	1,000	342.00	342,000	
3524	日東製網	2,000	113.00	226,000	
3526	芦森工業	2,000	102.00	204,000	

3529	アツギ	7,000	119.00	833,000	
3551	ダイニック	2,000	150.00	300,000	
3569	セーレン	2,100	483.00	1,014,300	
3577	東海染工	1,000	83.00	83,000	
3580	小松精練	1,000	367.00	367,000	
3591	ワコールホールディングス	5,000	886.00	4,430,000	
3593	ホギメディカル	500	4,180.00	2,090,000	

[次へ](#)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2012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	8,325,150,877 円
負債総額	15,765,033 円
純資産総額（ - ）	8,309,385,844 円
発行済口数	25,715,722,392 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.3231 円

<バランスポートフォリオ>

純資産額計算書

資産総額	376,502,868 円
負債総額	902,466 円
純資産総額（ - ）	375,600,402 円
発行済口数	575,529,909 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6526 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	8,502,807,111 円
負債総額	3,950,660 円
純資産総額（ - ）	8,498,856,451 円
発行済口数	12,245,383,166 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.694 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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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24年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去5年間における主な資本金の増減

年月日	変更後（変更前）
平成20年6月23日	16,403,045,900円（16,287,728,400円）
平成21年10月1日	17,363,045,900円（16,403,045,900円）

(2) 会社の意思決定機関

・株主総会

取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などを行ないます。

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

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

10名以内の取締役で構成され、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を任期とします。

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。また、取締役中より取締役会長および取締役社長各1名、取締役副社長、専務取締役および常務取締役各若干名を定めることができます。

・監査役会

5名以内の監査役で構成され、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最終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。

（平成24年11月末現在）

(3) 運用の意思決定プロセス

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

（平成24年11月末現在）

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24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	435	69,713
株式投資信託	370	55,949
単位型	44	1,228
追加型	326	54,721
公社債投資信託	65	13,763
単位型	48	563
追加型	17	13,200
投資法人合計	1	32

3【委託会社等の経理状況】

- 1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第52期 (平成23年 3 月31日)		第53期 (平成24年 3 月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	21,290	3	17,352
前払費用		330		332
未収入金		4		1
未収委託者報酬		6,173		5,872
未収収益	3	422	3	543
関係会社短期貸付金		-		33
立替金		504		1,094
繰延税金資産		1,142		1,084
その他	2	30	2	30
流動資産合計		29,897		26,345
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	67	1	66
器具備品	1	147	1	137
有形固定資産合計		215		203
無形固定資産				
ソフトウェア		101		72
無形固定資産合計		101		72
投資その他の資産				
投資有価証券		7,030		3,002
関係会社株式		16,225		24,320
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		962		774
繰延税金資産		868		723
投資その他の資産合計		25,147		28,880
固定資産合計		25,463		29,156
資産合計		55,361		55,502

	第52期 (平成23年 3 月31日)		第53期 (平成24年 3 月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		150		194
未払金		3,354		3,086
未払収益分配金		8		7
未払償還金		181		129
未払手数料	3	2,870	3	2,486
その他未払金		294		462
未払費用	3	3,253	3	2,807
未払法人税等		945		1,295
未払消費税等		108		281
賞与引当金		2,149		2,039
役員賞与引当金		237		105
流動負債合計		10,199		9,809
固定負債				
退職給付引当金		818		907
その他		55		55
固定負債合計		874		963
負債合計		11,073		10,773
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
その他資本剰余金		4		-
資本剰余金合計		5,225		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		21,703		22,172
利益剰余金合計		21,703		22,172
自己株式		68		68
株主資本合計		44,224		44,687
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		63		42
評価・換算差額等合計		63		42
純資産合計		44,287		44,729
負債純資産合計		55,361		55,502

（２）【損益計算書】

(単位：百万円)

	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	52,650	56,698
その他営業収益	2,581	2,025
営業収益合計	55,231	58,724
営業費用		
支払手数料	26,518	29,251
広告宣伝費	803	673
公告費	13	3
調査費	11,373	11,397
調査費	698	719
委託調査費	10,654	10,660
図書費	20	18
委託計算費	335	348
営業雑経費	557	577
通信費	176	206
印刷費	287	247
協会費	41	43
諸会費	8	9
その他	43	70
営業費用計	39,601	42,252
一般管理費		
給料	7,045	6,991
役員報酬	239	237
役員賞与引当金繰入額	237	105
給料・手当	4,391	4,508
賞与	27	101
賞与引当金繰入額	2,149	2,039
交際費	73	74
寄付金	140	111
旅費交通費	389	328
租税公課	133	145
不動産賃借料	921	749
退職給付費用	305	307
退職金	12	8
固定資産減価償却費	175	143
諸経費	2,953	3,110
一般管理費計	12,149	11,971
営業利益	3,480	4,500

	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)		第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)	
営業外収益				
受取利息		2		15
受取配当金	1	1,071	1	757
有価証券償還益		29		19
時効成立分配金・償還金		8		35
その他		10		18
営業外収益合計		1,121		846
営業外費用				
支払利息		10		10
時効成立後支払分配金・償還金		34		77
支払源泉所得税		106		74
為替差損		1		35
弁護士報酬等		-		180
その他		0		4
営業外費用合計		153		381
経常利益		4,448		4,965
特別利益				
投資有価証券売却益		49		1
子会社投資損失引当金戻入額		576		-
その他		23		-
特別利益合計		649		1
特別損失				
投資有価証券売却損		0		0
固定資産処分損		4		6
役員退職一時金		-		369
過年度敷金償却費用		58		-
特別損失合計		62		376
税引前当期純利益		5,034		4,590
法人税、住民税及び事業税		1,134		1,795
法人税等調整額		705		224
法人税等合計		1,839		2,020
当期純利益		3,195		2,570

（３）【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	17,363	17,363
当期末残高	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	5,220	5,220
当期末残高	5,220	5,220
その他資本剰余金		
当期首残高	4	4
当期変動額		
自己株式の処分	-	4
当期変動額合計	-	4
当期末残高	4	-
資本剰余金合計		
当期首残高	5,225	5,225
当期変動額		
自己株式の処分	-	4
当期変動額合計	-	4
当期末残高	5,225	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	18,814	21,703
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の処分	-	599
当期変動額合計	2,889	468
当期末残高	21,703	22,172
利益剰余金合計		
当期首残高	18,814	21,703
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の処分	-	599
当期変動額合計	2,889	468
当期末残高	21,703	22,172

	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
自己株式		
当期首残高	53	68
当期変動額		
自己株式の取得	14	8,700
自己株式の処分	-	8,700
当期変動額合計	14	-
当期末残高	68	68
株主資本合計		
当期首残高	41,349	44,224
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の取得	14	8,700
自己株式の処分	-	8,095
当期変動額合計	2,874	463
当期末残高	44,224	44,687
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	121	63
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	57	21
当期変動額合計	57	21
当期末残高	63	42
評価・換算差額等合計		
当期首残高	121	63
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	57	21
当期変動額合計	57	21
当期末残高	63	42
純資産合計		
当期首残高	41,470	44,287
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の取得	14	8,700
自己株式の処分	-	8,095
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	57	21
当期変動額合計	2,817	441
当期末残高	44,287	44,729

重要な会計方針

第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)	
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法
2 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 4年～5年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。 (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。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理することとしております。
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

追加情報

第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」等の適用 当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

第52期 (平成23年3月31日)	第53期 (平成24年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 971百万円 器具備品 571百万円 2 信託資産 その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。なお、野村信託銀行株式会社は平成22年7月20日付でN C T 信託銀行株式会社を合併しております。 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 10,013百万円 未収収益 31百万円 (流動負債) 未払手数料 24百万円 未払費用 226百万円 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112百万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177百万円に対して保証を行っております。	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,012百万円 器具備品 590百万円 2 信託資産 その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 5,802百万円 未収収益 217百万円 (流動負債) 未払手数料 42百万円 未払費用 259百万円 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110百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務138百万円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
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。 受取配当金 1,066百万円	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。 受取配当金 743百万円

（株主資本等変動計算書関係）

第52期（自 平成22年4月1日 至 平成23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）	85,000	24,600	-	109,600

（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

区分	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	
提出会社	平成21年度 ストックオプション（１）	普通株式	19,559,100	-	231,000	19,328,100	-
	平成21年度 ストックオプション（２）	普通株式	-	1,702,800	-	1,702,800	-
	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	-
合計			19,559,100	4,012,800	231,000	23,340,900	-

（注）１ 平成21年度ストックオプション（１）の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

２ 平成21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。

３ 平成22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。

４ 平成21年度ストックオプション（１）、平成21年度ストックオプション（２）及び平成22年度ストックオプション（１）は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年5月20日 取締役会	普通株式	305	1.55	平成22年3月31日	平成22年6月23日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度後となるもの

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

第53期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

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

3 新株予約権等に関する事項

区分	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	
提出会社	平成21年度 ストックオプション（１）	普通株式	19,328,100	-	112,200	19,215,900	-
	平成21年度 ストックオプション（２）	普通株式	1,702,800	-	26,400	1,676,400	-
	平成22年度 ストックオプション（１）	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
	第１回新株予約権	普通株式	-	2,955,200	-	2,955,200	-
	平成23年度 ストックオプション（１）	普通株式	-	6,101,700	9,900	6,091,800	-
合計			23,340,900	9,056,900	148,500	32,249,300	-

（注） 1 平成21年度ストックオプション（１）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（２）の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

3 第１回新株予約権の増加は、新株予約権の発行によるものであります。第１回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に６を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。

4 平成23年度ストックオプション（１）の増加は、新株予約権の発行によるものであり、減少は新株予約権の失効によるものであります。

5 平成21年度ストックオプション（１）9,837,300株、平成21年度ストックオプション（２）871,200株、平成22年度ストックオプション（１）1,155,000株、第１回新株予約権2,955,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション（１）は、権利行使期間の初日が到来していません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度後となるもの

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

(リース取引関係)

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24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	731百万円	1年内	740百万円
1年超	2,234百万円	1年超	1,548百万円
合計	2,966百万円	合計	2,288百万円

(金融商品関係)

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

おります。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金及び預金	21,290	21,290	-
(2) 未収委託者報酬	6,173	6,173	-
(3) 未収収益	422	422	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	6,882	6,882	-
(5) 関係会社株式 子会社株式	1,404	1,672	268
(6) 未払金	(3,354)	(3,354)	-
(7) 未払費用	(3,253)	(3,253)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

3 子会社株式（貸借対照表計上額11,928百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)関係会社株式」には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,290	-	-	-
未収委託者報酬	6,173	-	-	-
未収収益	422	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	5,733	556	421
合 計	27,885	5,733	556	421

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

（ ）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注） 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

第52期(自 平成22年4月1日至 平成23年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時 価	差 額
子会社株式	1,404	1,672	268
合 計	1,404	1,672	268

（注）子会社株式（貸借対照表計上額11,928百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

2 その他有価証券

（単位：百万円）

	種 類	貸借対照表計上額	取 得 原 価	差 額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株 式	31	7	24
	そ の 他	5,560	5,363	196
	小 計	5,591	5,370	220
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	そ の 他	1,291	1,404	113
	小 計	1,291	1,404	113
合 計		6,882	6,775	107

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

種 類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	144	49	0
合 計	144	49	0

第53期(自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時 価	差 額
関連会社株式	1,404	1,615	210
合 計	1,404	1,615	210

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種 類	貸借対照表計上額	取 得 原 価	差 額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株 式	35	7	28
	そ の 他	1,177	999	177
	小 計	1,212	1,006	206
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	そ の 他	1,642	1,784	141
	小 計	1,642	1,784	141
合 計		2,854	2,790	64

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種 類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	112	1	0
合 計	112	1	0

(持分法損益等)

第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24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) (1) 関連会社に対する投資の金額 2,892 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,703 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,054	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 4,407 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,834 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 927

（退職給付関係）

第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)																																																
1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュ・バランスプラン型退職金制度を設けております。 2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円) <table> <tr> <td>イ 退職給付債務</td><td>890</td></tr> <tr> <td>ロ 未積立退職給付債務</td><td>890</td></tr> <tr> <td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td>72</td></tr> <tr> <td>ニ 退職給付引当金残高</td><td>818</td></tr> </table> 3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円) <table> <tr> <td>イ 勤務費用</td><td>95</td></tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td><td>14</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td>30</td></tr> <tr> <td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td>165</td></tr> <tr> <td>ホ 退職給付費用合計</td><td>305</td></tr> </table> 4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 <table> <tr> <td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td>勤続期間比例</td></tr> <tr> <td>ロ 割引率</td><td>1.6%</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の処理年数</td><td>10年</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	890	ロ 未積立退職給付債務	890	ハ 未認識数理計算上の差異	72	ニ 退職給付引当金残高	818	イ 勤務費用	95	ロ 利息費用	14	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	30	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	165	ホ 退職給付費用合計	305	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.6%	ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年	1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュ・バランスプラン型退職金制度を設けております。 2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円) <table> <tr> <td>イ 退職給付債務</td><td>985</td></tr> <tr> <td>ロ 未積立退職給付債務</td><td>985</td></tr> <tr> <td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td>77</td></tr> <tr> <td>ニ 退職給付引当金残高</td><td>907</td></tr> </table> 3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円) <table> <tr> <td>イ 勤務費用</td><td>97</td></tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td><td>14</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td>27</td></tr> <tr> <td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td>168</td></tr> <tr> <td>ホ 退職給付費用合計</td><td>307</td></tr> </table> 4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 <table> <tr> <td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td>勤続期間比例</td></tr> <tr> <td>ロ 割引率</td><td>1.4%</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の処理年数</td><td>10年</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	985	ロ 未積立退職給付債務	985	ハ 未認識数理計算上の差異	77	ニ 退職給付引当金残高	907	イ 勤務費用	97	ロ 利息費用	14	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168	ホ 退職給付費用合計	307	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.4%	ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年
イ 退職給付債務	890																																																
ロ 未積立退職給付債務	890																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	72																																																
ニ 退職給付引当金残高	818																																																
イ 勤務費用	95																																																
ロ 利息費用	14																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	30																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	165																																																
ホ 退職給付費用合計	305																																																
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																
ロ 割引率	1.6%																																																
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																
イ 退職給付債務	985																																																
ロ 未積立退職給付債務	985																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	77																																																
ニ 退職給付引当金残高	907																																																
イ 勤務費用	97																																																
ロ 利息費用	14																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168																																																
ホ 退職給付費用合計	307																																																
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																
ロ 割引率	1.4%																																																
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																

（ストックオプション等関係）

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

	平成22年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1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
付与日	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。
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
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

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年 2 月 8 日	平成22年 8 月20日
権利確定前(株)		
期首	19,559,100	-
付与	0	1,702,800
失効	231,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	19,328,100	1,702,800
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8 月20日
権利確定前(株)	
期首	-
付与	2,310,000
失効	0
権利確定	0
権利未確定残	2,310,000
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22年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8 月20日
権利行使価格(円)	625
付与日における公正な評価単価 (円) (注) 1	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

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24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	当社の従業員 186名
株式の種類別のストックオプション の付与数（注）	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定条件	平成24年1月22日（以下「権利行使 可能初日」といいます。）、当該権利 行使可能初日から1年経過した日の 翌日、及び当該権利行使可能初日か ら2年経過した日の翌日まで原則と して従業員等の地位にあることを要 し、それぞれ保有する新株予約権の 2分の1、4分の1、4分の1ずつ権 利確定する。ただし、本新株予約権の 行使時において、当社が株式公開し ていることを要する。	平成25年10月7日（以下「権利行使 可能初日」といいます。）、当該権利 行使可能初日から1年経過した日の 翌日、及び当該権利行使可能初日か ら2年経過した日の翌日まで原則と して従業員等の地位にあることを要 し、それぞれ保有する新株予約権の 2分の1、4分の1、4分の1ずつ権 利確定する。ただし、本新株予約権の 行使時において、当社が株式公開し ていることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年 2 月 8 日	平成22年 8 月20日
権利確定前(株)		
期首	19,328,100	1,702,800
付与	0	0
失効	112,200	26,400
権利確定	0	0
権利未確定残	19,215,900	1,676,400
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8 月20日	平成23年10月 7 日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	-
付与	0	6,101,700
失効	0	9,900
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	6,091,800
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

(注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額

当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円

3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第52期 (平成23年3月31日)		第53期 (平成24年3月31日)	
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
(単位：百万円)		(単位：百万円)	
繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)	
賞与引当金繰入超過額	886	賞与引当金繰入超過額	775
その他	255	その他	309
	1,142		1,084
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
投資有価証券等評価損	60	投資有価証券等評価損	52
関係会社株式評価損	185	関係会社株式評価損	205
退職給付引当金超過額	333	退職給付引当金超過額	329
固定資産減価償却超過額	234	固定資産減価償却超過額	190
その他	99	その他	28
	912		806
繰延税金資産合計	2,054	繰延税金資産小計	1,890
		評価性引当金	61
繰延税金負債(固定)		繰延税金資産合計	1,829
その他有価証券評価差額金	43		
繰延税金負債合計	43	繰延税金負債(固定)	
繰延税金資産の純額	2,010	その他有価証券評価差額金	22
		繰延税金負債合計	22
		繰延税金資産の純額	1,807
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	40.6%	法定実効税率	40.6%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.7%	交際費等永久に損金に算入されない項目	2.5%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	7.3%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%
海外子会社の留保利益の影響額等	0.5%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.5%	海外子会社の留保利益の影響額等	2.7%
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.0%

第52期 (平成23年 3 月31日)	第53期 (平成24年 3 月31日)
	3 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正 経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律及び東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法が平成23年12月 2 日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算（ただし、平成24年 4 月 1 日以降解消されるものに限り）に使用した法定実効税率は、前事業年度の40.6%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成24年 4 月 1 日から平成27年 3 月31日までのものは38.0%、平成27年 4 月 1 日以降のものについては35.6%にそれぞれ変更されております。 その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債を控除した金額）が170百万円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が174百万円、その他有価証券評価差額金額が 4 百万円、それぞれ増加しております。

（関連当事者情報）

第52期(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の 名称又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等の 所有(被所有) 割合(%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	住友信託銀行株式会社	大阪市 中央区	342,037	信託銀行 業	(被所有) 直接 98.60 (注)2	投資信託受 益証券の募 集販売	信託約款に定める 受益者に対する収 益分配金及び償還 金の支払委託に係 る代行手数料の支 払 (注)1	308	未払手 数料	24

上記の金額のうち、取引金額には消費税が含まれておらず、未払手数料の期末残高には消費税が含まれております。

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち委託者報酬分を、市場価格を勘案し両者協議の上配分を合理的に決定しております。

2 議決権等の被所有割合は、自己株式（109,600 株）を控除して計算しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は 氏名	所在地	資本金又は出 資金 (千SGD)	事業の 内容	議決権等の所 有(被所有)割 合(%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management Singapore Limited	シンガポ ール 国	115,000	アセットマ ネジメント業	直接 100.00	-	増資の引受 (注)1	7,351

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

Nikko Asset Management Singapore Limitedの行った112,500千株の新株発行増資を、1 株につき 1 シンガポールドルで当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(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22年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	9,325百万円
負債合計	1,342百万円
純資産合計	7,982百万円

営業収益	9,228百万円
税引前当期純利益	3,523百万円
当期純利益	2,729百万円

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の 名称又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等の 所有(被所有) 割合(%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	住友信託銀行株式会社 (注)3	大阪市 中央区	342,037	信託銀行 業	(被所有) 直接 91.34 (注)2	投資信託受 益証券の募 集販売	自己株式の取得 (注)1	8,700	-	-

上記の金額のうち、取引金額には消費税が含まれておりません。

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成23年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	9,309百万円
負債合計	1,103百万円
純資産合計	8,206百万円

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

第52期(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23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53期(自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)

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

関連情報

第52期(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第53期(自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（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52期(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)

該当事項はありません。

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52期(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)

該当事項はありません。

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52期(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
1株当たり純資産額	224円92銭	227円16銭
1株当たり当期純利益金額	16円22銭	13円09銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益（百万円）	3,195	2,570
普通株主に帰属しない金額（百万円）	-	-
普通株式に係る当期純利益（百万円）	3,195	2,570
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,926	196,278
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後 1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 19,328,100株、平成21年度ストックオプション(2) 1,702,800株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株	平成21年度ストックオプション(1) 19,215,900株、平成21年度ストックオプション(2) 1,676,400株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 6,091,800株

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52期 (平成23年 3 月31日)	第53期 (平成24年 3 月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	44,287	44,729
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-	-
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	44,287	44,729
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	196,903	196,903

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

- 1 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期中間会計期間（平成24年4月1日から平成24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。
なお、当社の監査法人は次のとおり、交代しております。
第53期事業年度 あらた監査法人
第54期中間会計期間 有限責任 あずさ監査法人

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第54期中間会計期間 (平成24年 9 月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		14,955
未収委託者報酬		4,974
未収収益		529
関係会社短期貸付金		63
繰延税金資産		473
その他	2	1,096
流動資産合計		22,092
固定資産		
有形固定資産	1	208
無形固定資産		73
投資その他の資産		
投資有価証券		3,794
関係会社株式		24,340
関係会社長期貸付金		313
長期差入保証金		770
繰延税金資産		779
投資その他の資産合計		29,996
固定資産合計		30,279
資産合計		52,371

(単位：百万円)

第54期中間会計期間
(平成24年 9 月30日)

負債の部

流動負債

未払金		2,741
未払費用		2,622
未払法人税等		124
未払消費税等	3	112
賞与引当金		810
役員賞与引当金		105
その他		291

流動負債合計		6,807
--------	--	-------

固定負債

退職給付引当金		952
その他		55

固定負債合計		1,007
--------	--	-------

負債合計		7,814
------	--	-------

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		22,055
利益剰余金合計		22,055

自己株式		68
------	--	----

株主資本合計		44,571
--------	--	--------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		14
--------------	--	----

評価・換算差額等合計		14
------------	--	----

純資産合計		44,556
-------	--	--------

負債純資産合計		52,371
---------	--	--------

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第54期中間会計期間 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日)		
営業収益		
委託者報酬		24,943
その他営業収益		928
営業収益合計		25,872
営業費用及び一般管理費	1	24,332
営業利益		1,540
営業外収益	2	577
営業外費用	3	70
経常利益		2,047
特別損失	4	1
税引前中間純利益		2,046
法人税、住民税及び事業税		106
法人税等調整額		586
中間純利益		1,352

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

	第54期中間会計期間 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	17,363
当中間期末残高	17,363
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	5,220
当中間期末残高	5,220
資本剰余金合計	
当期首残高	5,220
当中間期末残高	5,220
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	
当期首残高	22,172
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,468
中間純利益	1,352
当中間期変動額合計	116
当中間期末残高	22,055
利益剰余金合計	
当期首残高	22,172
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,468
中間純利益	1,352
当中間期変動額合計	116
当中間期末残高	22,055

(単位：百万円)

	第54期中間会計期間 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日)
自己株式	
当期首残高	68
当中間期末残高	68
株主資本合計	
当期首残高	44,687
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,468
中間純利益	1,352
当中間期変動額合計	116
当中間期末残高	44,571
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	42
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	56
当中間期変動額合計	56
当中間期末残高	14
評価・換算差額等合計	
当期首残高	42
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	56
当中間期変動額合計	56
当中間期末残高	14
純資産合計	
当期首残高	44,729
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,468
中間純利益	1,352
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	56
当中間期変動額合計	172
当中間期末残高	44,556

会計方針の変更等

第54期中間会計期間 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日)
（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更） 当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年 4 月 1 日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。 この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。

重要な会計方針

項目	第54期中間会計期間 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 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 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 (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。
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (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。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理することとしております。
4 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第54期中間会計期間 (平成24年 9 月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,625百万円
2 信託資産	
その他流動資産のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。	
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91百万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37百万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54期中間会計期間 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	44百万円
無形固定資産	12百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	4百万円
受取配当金	570百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	9百万円
時効成立後支払分配金・償還金	1百万円
支払源泉所得税	55百万円
4 特別損失のうち主要なもの	
固定資産処分損	1百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第54期中間会計期間（自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計 期間末残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	19,215,900	-	2,237,400	16,978,500	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,676,400	-	49,500	1,626,900	-
平成22年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	6,091,800	-	158,400	5,933,400	-
合計		32,249,300	-	2,445,300	29,804,000	-

(注) 1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)及び平成23年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 平成21年度ストックオプション(1)9,837,300株、平成21年度ストックオプション(2)871,200株、平成22年度ストックオプション(1)1,155,000株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1)配当金支払額

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

(2)基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの
該当事項はありません。

(リース取引関係)

第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24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	740百万円
1年超	1,178百万円
合計	1,918百万円

(金融商品関係)

第54期中間会計期間(平成24年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成24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（（注）2をご参照ください。）。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金及び預金	14,955	14,955	-
(2) 未収委託者報酬	4,974	4,974	-
(3) 未収収益	529	529	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	3,646	3,646	-
(5) 関係会社株式 関連会社株式	1,404	1,523	119
(6) 未払金	(2,741)	(2,741)	-
(7) 未払費用	(2,622)	(2,622)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

3 子会社株式（中間貸借対照表計上額20,042百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)関係会社株式」には含めておりません。

（有価証券関係）

第54期中間会計期間(平成24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	時 価	差 額
関連会社株式	1,404	1,523	119
合 計	1,404	1,523	119

（注）子会社株式（中間貸借対照表計上額20,042百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

2 その他有価証券

（単位：百万円）

	種 類	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	株 式	29	7	22
	そ の 他	1,670	1,505	165
	小 計	1,700	1,512	187
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	そ の 他	1,946	2,157	211
	小 計	1,946	2,157	211
合 計		3,646	3,670	23

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

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

（持分法損益等）

第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24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	4,297百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	6,089百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	323百万円

（ストックオプション等関係）

第54期中間会計期間(自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

第54期中間会計期間(自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24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54期中間会計期間(自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24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。

（１株当たり情報）

項目	第54期中間会計期間 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日)
１株当たり純資産額	226円28銭
１株当たり中間純利益金額	6円86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54期中間会計期間 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日)
１株当たり中間純利益金額	
中間純利益（百万円）	1,352
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）	1,352
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり中間純利益金額の算定に含まなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション（１）16,978,500株、平成21年度ストックオプション（２）1,626,900株、平成22年度ストックオプション（１）2,310,000株、第１回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション（１）5,933,400株

３ １株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期中間会計期間 (平成24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）	44,556
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）	44,556
１株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	196,903

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常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24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24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24年9月末現在)	事業の内容
アーク証券株式会社	2,619百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
かざか証券株式会社	3,000百万円	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成24年2月7日	有価証券報告書
平成24年2月7日	有価証券届出書
平成24年8月7日	半期報告書
平成24年8月7日	有価証券届出書の訂正届出書

3606	レナウン	1,500	102.00	153,000	
3608	T S I ホールディングス	4,100	480.00	1,968,000	
8011	三陽商会	4,000	230.00	920,000	
8013	ナイガイ	3,000	49.00	147,000	
8016	オンワードホールディングス	5,000	580.00	2,900,000	
8029	ルック	1,000	435.00	435,000	
8111	ゴールドウイン	2,000	502.00	1,004,000	
8114	デサント	2,000	465.00	930,000	
3708	特種東海製紙	5,000	212.00	1,060,000	
3861	王子ホールディングス	36,000	243.00	8,748,000	
3864	三菱製紙	11,000	72.00	792,000	
3865	北越紀州製紙	5,000	440.00	2,200,000	
3877	中越パルプ工業	3,000	133.00	399,000	
3878	巴川製紙所	1,000	148.00	148,000	
3880	大王製紙	3,000	448.00	1,344,000	
3893	日本製紙グループ本社	3,900	926.00	3,611,400	
3941	レンゴー	6,000	388.00	2,328,000	
3946	トーモク	2,000	230.00	460,000	
3950	ザ・バック	600	1,420.00	852,000	
3405	クラレ	13,700	943.00	12,919,100	
3407	旭化成	50,000	454.00	22,700,000	
3553	共和レザー	500	256.00	128,000	
4003	コープケミカル	1,000	90.00	90,000	
4004	昭和電工	50,000	113.00	5,650,000	
4005	住友化学	55,000	219.00	12,045,000	
4007	日本化成	2,000	106.00	212,000	
4008	住友精化	1,000	279.00	279,000	
4021	日産化学工業	5,700	906.00	5,164,200	
4022	ラサ工業	3,000	71.00	213,000	
4023	クレハ	6,000	308.00	1,848,000	
4027	テイカ	1,000	227.00	227,000	
4028	石原産業	14,000	62.00	868,000	
4031	片倉チッカリン	1,000	188.00	188,000	
4041	日本曹達	5,000	362.00	1,810,000	
4042	東ソー	22,000	158.00	3,476,000	
4043	トクヤマ	11,000	142.00	1,562,000	
4044	セントラル硝子	7,000	242.00	1,694,000	
4045	東亜合成	10,000	334.00	3,340,000	
4046	ダイソー	3,000	218.00	654,000	
4047	関東電化工業	2,000	127.00	254,000	
4061	電気化学工業	16,000	247.00	3,952,000	
4063	信越化学工業	14,400	4,630.00	66,672,000	
4064	日本カーバイド工業	3,000	206.00	618,000	
4078	堺化学工業	3,000	205.00	615,000	
4088	エア・ウォーター	7,000	1,015.00	7,105,000	
4091	大陽日酸	11,000	445.00	4,895,000	
4092	日本化学工業	3,000	103.00	309,000	
4095	日本パーカライジング	2,000	1,180.00	2,360,000	
4097	高圧ガス工業	1,000	418.00	418,000	

4099	四国化成工業	1,000	430.00	430,000	
4100	戸田工業	1,000	239.00	239,000	
4109	ステラ ケミファ	300	1,461.00	438,300	
4112	保土谷化学工業	2,000	151.00	302,000	
4114	日本触媒	6,000	798.00	4,788,000	
4116	大日精化工業	3,000	334.00	1,002,000	
4118	カネカ	10,000	387.00	3,870,000	
4182	三菱瓦斯化学	13,000	427.00	5,551,000	
4183	三井化学	34,000	168.00	5,712,000	
4185	J S R	8,000	1,430.00	11,440,000	
4186	東京応化工業	1,600	1,551.00	2,481,600	
4187	大阪有機化学工業	500	343.00	171,500	
4188	三菱ケミカルホールディングス	50,500	328.00	16,564,000	
4201	日本合成化学工業	2,000	581.00	1,162,000	
4202	ダイセル	9,000	484.00	4,356,000	
4203	住友ベークライト	6,000	308.00	1,848,000	
4204	積水化学工業	17,000	643.00	10,931,000	
4205	日本ゼオン	7,000	590.00	4,130,000	
4206	アイカ工業	2,300	1,402.00	3,224,600	
4208	宇部興産	39,000	183.00	7,137,000	
4212	積水樹脂	1,000	797.00	797,000	
4215	タキロン	2,000	291.00	582,000	
4216	旭有機材工業	3,000	188.00	564,000	
4217	日立化成工業	3,500	1,105.00	3,867,500	
4218	ニチバン	1,000	250.00	250,000	
4220	リケンテクノス	1,000	203.00	203,000	
4221	大倉工業	2,000	221.00	442,000	
4228	積水化成品工業	2,000	173.00	346,000	
4229	群栄化学工業	2,000	193.00	386,000	
4231	タイガースポリマー	400	269.00	107,600	
4271	日本カーリット	600	392.00	235,200	
4272	日本化薬	6,000	906.00	5,436,000	
4362	日本精化	700	533.00	373,100	
4401	A D E K A	3,400	606.00	2,060,400	
4403	日油	6,000	374.00	2,244,000	
4410	ハリマ化成グループ	700	352.00	246,400	
4452	花王	21,300	2,208.00	47,030,400	
4461	第一工業製薬	2,000	196.00	392,000	
4471	三洋化成工業	3,000	418.00	1,254,000	
4611	大日本塗料	5,000	87.00	435,000	
4612	日本ペイント	7,000	678.00	4,746,000	
4613	関西ペイント	9,000	878.00	7,902,000	
4617	中国塗料	2,000	411.00	822,000	
4619	日本特殊塗料	600	339.00	203,400	
4620	藤倉化成	1,000	324.00	324,000	
4626	太陽ホールディングス	600	2,277.00	1,366,200	
4631	D I C	28,000	145.00	4,060,000	
4633	サカティンクス	2,000	370.00	740,000	
4634	東洋インキ S C ホールディングス	7,000	297.00	2,079,000	

4901	富士フイルムホールディングス	17,100	1,300.00	22,230,000	
4911	資生堂	14,300	1,058.00	15,129,400	
4912	ライオン	9,000	430.00	3,870,000	
4914	高砂香料工業	3,000	406.00	1,218,000	
4917	マンダム	800	2,101.00	1,680,800	
4919	ミルボン	400	2,571.00	1,028,400	
4921	ファンケル	2,000	858.00	1,716,000	
4922	コーセー	1,400	1,721.00	2,409,400	
4924	ドクターシーラボ	5	262,100.00	1,310,500	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	1,000	2,402.00	2,402,000	
4928	ノエビアホールディングス	500	1,199.00	599,500	
4951	エスデー	500	883.00	441,500	
4956	コニシ	600	1,271.00	762,600	
4958	長谷川香料	1,000	1,010.00	1,010,000	
4963	星光 P M C	300	287.00	86,100	
4967	小林製薬	1,200	4,155.00	4,986,000	
4968	荒川化学工業	700	609.00	426,300	
4971	メック	600	223.00	133,800	
4973	日本高純度化学	2	179,700.00	359,400	
4985	アース製薬	600	2,970.00	1,782,000	
4989	イハラケミカル工業	1,000	374.00	374,000	
4992	北興化学工業	1,000	218.00	218,000	
4994	大成ラミック	200	2,330.00	466,000	
4996	クミアイ化学工業	2,000	361.00	722,000	
4997	日本農薬	2,000	356.00	712,000	
5142	アキレス	7,000	105.00	735,000	
5208	有沢製作所	1,300	242.00	314,600	
6988	日東電工	6,600	3,750.00	24,750,000	
7874	レック	200	976.00	195,200	
7908	きもと	700	505.00	353,500	
7917	藤森工業	600	1,825.00	1,095,000	
7925	前澤化成工業	600	834.00	500,400	
7942	J S P	500	1,028.00	514,000	
7947	エフピコ	400	5,860.00	2,344,000	
7958	天馬	700	790.00	553,000	
7970	信越ポリマー	1,500	262.00	393,000	
7971	東リ	2,000	162.00	324,000	
7988	ニフコ	1,800	1,750.00	3,150,000	
7995	日本バルカー工業	3,000	209.00	627,000	
8113	ユニ・チャーム	4,400	4,165.00	18,326,000	
4151	協和発酵キリン	10,000	855.00	8,550,000	
4502	武田薬品工業	30,100	3,730.00	112,273,000	
4503	アステラス製薬	17,900	4,085.00	73,121,500	
4506	大日本住友製薬	5,700	938.00	5,346,600	
4507	塩野義製薬	11,700	1,386.00	16,216,200	
4508	田辺三菱製薬	6,700	1,126.00	7,544,200	
4512	わかもと製薬	1,000	209.00	209,000	
4514	あすか製薬	1,000	419.00	419,000	
4516	日本新薬	2,000	979.00	1,958,000	

4519	中外製薬	9,400	1,627.00	15,293,800	
4521	科研製薬	3,000	1,295.00	3,885,000	
4523	エーザイ	9,900	3,490.00	34,551,000	
4527	ロート製薬	3,000	1,080.00	3,240,000	
4528	小野薬品工業	3,900	4,600.00	17,940,000	
4530	久光製薬	2,500	4,140.00	10,350,000	
4531	有機合成薬品工業	1,000	222.00	222,000	
4534	持田製薬	3,000	1,104.00	3,312,000	
4536	参天製薬	2,900	3,450.00	10,005,000	
4538	扶桑薬品工業	3,000	284.00	852,000	
4539	日本ケミファ	1,000	539.00	539,000	
4540	ツムラ	2,200	2,561.00	5,634,200	
4541	日医工	1,200	1,678.00	2,013,600	
4547	キッセイ薬品工業	1,500	1,415.00	2,122,500	
4548	生化学工業	1,500	912.00	1,368,000	
4549	栄研化学	600	1,095.00	657,000	
4551	鳥居薬品	500	1,837.00	918,500	
4553	東和薬品	400	5,130.00	2,052,000	
4554	富士製薬工業	200	1,240.00	248,000	
4555	沢井製薬	500	8,770.00	4,385,000	
4559	ゼリア新薬工業	1,000	1,267.00	1,267,000	
4568	第一三共	25,300	1,213.00	30,688,900	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	2,200	1,673.00	3,680,600	
4574	大幸薬品	300	739.00	221,700	
4577	ダイト	200	1,479.00	295,800	
4578	大塚ホールディングス	16,000	2,439.00	39,024,000	
4581	大正製薬ホールディングス	1,900	6,180.00	11,742,000	
3315	日本コークス工業	6,500	95.00	617,500	
5002	昭和シェル石油	7,200	480.00	3,456,000	
5007	コスモ石油	22,000	152.00	3,344,000	
5011	ニチレキ	1,000	393.00	393,000	
5012	東燃ゼネラル石油	12,000	722.00	8,664,000	
5013	ユシロ化学工業	400	767.00	306,800	
5015	ビーピー・カストロール	400	349.00	139,600	
5017	AOCホールディングス	1,900	276.00	524,400	
5018	MORESCO	100	715.00	71,500	
5019	出光興産	1,000	6,840.00	6,840,000	
5020	JXホールディングス	89,200	423.00	37,731,600	
5101	横浜ゴム	9,000	574.00	5,166,000	
5105	東洋ゴム工業	7,000	198.00	1,386,000	
5108	ブリヂストン	25,200	1,869.00	47,098,800	
5110	住友ゴム工業	6,300	951.00	5,991,300	
5121	藤倉ゴム工業	500	271.00	135,500	
5122	オカモト	3,000	310.00	930,000	
5185	フコク	400	692.00	276,800	
5186	ニッタ	800	1,289.00	1,031,200	
5191	東海ゴム工業	1,500	715.00	1,072,500	
5192	三ツ星ベルト	2,000	470.00	940,000	
5195	バンドー化学	3,000	257.00	771,000	

3110	日東紡績	6,000	272.00	1,632,000	
5201	旭硝子	40,000	565.00	22,600,000	
5202	日本板硝子	37,000	74.00	2,738,000	
5204	石塚硝子	1,000	133.00	133,000	
5210	日本山村硝子	3,000	166.00	498,000	
5214	日本電気硝子	14,000	429.00	6,006,000	
5218	オハラ	300	614.00	184,200	
5232	住友大阪セメント	14,000	258.00	3,612,000	
5233	太平洋セメント	44,000	174.00	7,656,000	
5234	デイ・シイ	800	231.00	184,800	
5262	日本ヒューム	1,000	415.00	415,000	
5269	日本コンクリート工業	1,000	246.00	246,000	
5301	東海カーボン	7,000	274.00	1,918,000	
5302	日本カーボン	4,000	164.00	656,000	
5310	東洋炭素	400	1,576.00	630,400	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	4,000	190.00	760,000	
5332	T O T O	12,000	555.00	6,660,000	
5333	日本碍子	10,000	836.00	8,360,000	
5334	日本特殊陶業	7,000	909.00	6,363,000	
5337	ダントーホールディングス	2,000	82.00	164,000	
5344	M A R U W A	200	2,281.00	456,200	
5351	品川リフラクトリーズ	2,000	164.00	328,000	
5352	黒崎播磨	2,000	199.00	398,000	
5363	東京窯業	1,000	151.00	151,000	
5367	ニッカトー	300	431.00	129,300	
5384	フジミインコーポレーテッド	700	1,656.00	1,159,200	
5391	エーアンドエーマテリアル	2,000	68.00	136,000	
5393	ニチアス	4,000	380.00	1,520,000	
7943	ニチハ	900	871.00	783,900	
5401	新日鐵住金	340,000	177.00	60,180,000	
5406	神戸製鋼所	111,000	68.00	7,548,000	
5410	合同製鐵	5,000	122.00	610,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	20,500	1,149.00	23,554,500	
5413	日新製鋼ホールディングス	3,400	513.00	1,744,200	
5423	東京製鐵	4,400	264.00	1,161,600	
5440	共英製鋼	800	1,209.00	967,200	
5444	大和工業	1,700	2,231.00	3,792,700	
5445	東京鐵鋼	2,000	278.00	556,000	
5449	大阪製鐵	400	1,342.00	536,800	
5451	淀川製鋼所	6,000	258.00	1,548,000	
5453	東洋鋼鈑	2,000	205.00	410,000	
5457	住友鋼管	500	557.00	278,500	
5463	丸一鋼管	2,700	1,693.00	4,571,100	
5464	モリ工業	1,000	224.00	224,000	
5471	大同特殊鋼	12,000	317.00	3,804,000	
5476	日本高周波鋼業	3,000	74.00	222,000	
5480	日本冶金工業	6,000	70.00	420,000	
5481	山陽特殊製鋼	4,000	221.00	884,000	
5482	愛知製鋼	4,000	289.00	1,156,000	

5486	日立金属	5,500	699.00	3,844,500	
5491	日本金属	2,000	105.00	210,000	
5541	大平洋金属	5,000	282.00	1,410,000	
5563	日本電工	3,000	184.00	552,000	
5602	栗本鐵工所	3,000	273.00	819,000	
5612	日本鋳鉄管	1,000	188.00	188,000	
5632	三菱製鋼	5,000	141.00	705,000	
5658	日亜鋼業	1,000	204.00	204,000	
5659	日本精線	1,000	286.00	286,000	
6319	シンニッタン	900	335.00	301,500	
7305	新家工業	2,000	108.00	216,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	1,000	197.00	197,000	
5703	日本軽金属ホールディングス	16,700	72.00	1,202,400	
5706	三井金属鉱業	21,000	172.00	3,612,000	
5707	東邦亜鉛	5,000	279.00	1,395,000	
5711	三菱マテリアル	47,000	218.00	10,246,000	
5713	住友金属鉱山	21,000	1,091.00	22,911,000	
5714	D O W Aホールディングス	9,000	526.00	4,734,000	
5715	古河機械金属	13,000	71.00	923,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	800	1,536.00	1,228,800	
5727	東邦チタニウム	1,400	692.00	968,800	
5738	住友軽金属工業	19,000	68.00	1,292,000	
5741	古河スカイ	3,000	202.00	606,000	
5801	古河電気工業	25,000	146.00	3,650,000	
5802	住友電気工業	28,400	833.00	23,657,200	
5803	フジクラ	13,000	227.00	2,951,000	
5805	昭和電線ホールディングス	10,000	57.00	570,000	
5809	タツタ電線	1,000	825.00	825,000	
5812	日立電線	6,000	106.00	636,000	
5815	沖電線	1,000	120.00	120,000	
5819	カナレ電気	100	1,303.00	130,300	
5851	リョービ	4,000	180.00	720,000	
5857	アサヒホールディングス	1,200	1,398.00	1,677,600	
3421	稲葉製作所	300	986.00	295,800	
3431	宮地エンジニアリンググループ	3,000	129.00	387,000	
3432	三協・立山ホールディングス	11,000	185.00	2,035,000	
3433	トーカロ	500	1,256.00	628,000	
3434	アルファ C o	300	890.00	267,000	
3436	S U M C O	4,900	558.00	2,734,200	
3443	川田テクノロジーズ	200	1,044.00	208,800	
5901	東洋製罐	5,700	873.00	4,976,100	
5902	ホッカンホールディングス	2,000	229.00	458,000	
5909	コロナ	400	987.00	394,800	
5911	横河ブリッジホールディングス	2,000	571.00	1,142,000	
5915	駒井ハルテック	2,000	207.00	414,000	
5923	高田機工	1,000	152.00	152,000	
5929	三和ホールディングス	7,000	336.00	2,352,000	
5930	文化シャッター	2,000	351.00	702,000	
5936	東洋シャッター	200	436.00	87,200	

5938	ＬＩＸＩＬグループ	11,200	1,678.00	18,793,600	
5942	日本フィルコン	500	389.00	194,500	
5943	ノーリツ	1,600	1,274.00	2,038,400	
5946	長府製作所	800	1,842.00	1,473,600	
5947	リンナイ	1,300	5,180.00	6,734,000	
5951	ダイニチ工業	400	798.00	319,200	
5957	日東精工	1,000	201.00	201,000	
5958	三洋工業	1,000	148.00	148,000	
5959	岡部	1,500	503.00	754,500	
5974	中国工業	1,000	81.00	81,000	
5975	東プレ	1,500	703.00	1,054,500	
5976	高周波熱錬	1,000	460.00	460,000	
5981	東京製綱	6,000	100.00	600,000	
5988	バイオラックス	300	1,731.00	519,300	
5991	日本発條	5,800	663.00	3,845,400	
5992	中央発條	1,000	281.00	281,000	
5998	アドバネクス	2,000	71.00	142,000	
8155	三益半導体工業	700	629.00	440,300	
1978	アタカ大機	1,000	316.00	316,000	
5631	日本製鋼所	12,000	477.00	5,724,000	
6005	三浦工業	1,200	1,918.00	2,301,600	
6013	タクマ	3,000	404.00	1,212,000	
6101	ツガミ	2,000	521.00	1,042,000	
6103	オークマ	5,000	492.00	2,460,000	
6104	東芝機械	4,000	357.00	1,428,000	
6113	アマダ	12,000	417.00	5,004,000	
6118	アイダエンジニアリング	1,900	507.00	963,300	
6135	牧野フライス製作所	4,000	414.00	1,656,000	
6136	オーエスジー	3,300	1,023.00	3,375,900	
6138	ダイジェット工業	1,000	137.00	137,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	2,000	718.00	1,436,000	
6141	森精機製作所	4,200	515.00	2,163,000	
6146	ディスコ	900	3,925.00	3,532,500	
6151	日東工器	500	1,793.00	896,500	
6203	豊和工業	5,000	74.00	370,000	
6205	大阪機工	3,000	94.00	282,000	
6210	東洋機械金属	700	181.00	126,700	
6217	津田駒工業	2,000	102.00	204,000	
6222	島精機製作所	1,000	1,087.00	1,087,000	
6247	日阪製作所	1,000	621.00	621,000	
6250	やまびこ	300	1,039.00	311,700	
6262	ペガサスミシン製造	800	167.00	133,600	
6268	ナブテスコ	4,000	1,593.00	6,372,000	
6269	三井海洋開発	700	1,534.00	1,073,800	
6272	レオン自動機	1,000	176.00	176,000	
6273	S M C	2,400	12,690.00	30,456,000	
6274	新川	600	347.00	208,200	
6277	ホソカワミクロン	1,000	447.00	447,000	
6278	ユニオンツール	400	1,246.00	498,400	

6282	オイレス工業	800	1,614.00	1,291,200	
6287	サトーホールディングス	800	1,239.00	991,200	
6291	日本エアータック	300	342.00	102,600	
6293	日精樹脂工業	600	320.00	192,000	
6298	ワイエイシイ	300	490.00	147,000	
6301	小松製作所	37,500	1,758.00	65,925,000	
6302	住友重機械工業	22,000	302.00	6,644,000	
6305	日立建機	4,100	1,400.00	5,740,000	
6306	日工	1,000	302.00	302,000	
6309	巴工業	300	1,349.00	404,700	
6310	井関農機	8,000	186.00	1,488,000	
6315	T O W A	700	443.00	310,100	
6316	丸山製作所	2,000	158.00	316,000	

[次へ](#)

6317	北川鉄工所	3,000	136.00	408,000	
6326	クボタ	43,000	820.00	35,260,000	
6328	荏原実業	200	1,210.00	242,000	
6331	三菱化工機	2,000	126.00	252,000	
6332	月島機械	1,000	665.00	665,000	
6333	帝国電機製作所	300	1,061.00	318,300	
6339	新東工業	1,600	546.00	873,600	
6340	澁谷工業	500	865.00	432,500	
6345	アイチ コーポレーション	1,300	317.00	412,100	
6349	小森コーポレーション	1,900	457.00	868,300	
6351	鶴見製作所	1,000	588.00	588,000	
6355	住友精密工業	1,000	323.00	323,000	
6358	酒井重工業	1,000	238.00	238,000	
6361	荏原製作所	15,000	310.00	4,650,000	
6362	石井鐵工所	1,000	131.00	131,000	
6363	西島製作所	900	568.00	511,200	
6367	ダイキン工業	10,400	2,242.00	23,316,800	
6368	オルガノ	1,000	490.00	490,000	
6369	トーヨーカネツ	4,000	177.00	708,000	
6370	栗田工業	4,400	1,787.00	7,862,800	
6371	椿本チエイン	4,000	391.00	1,564,000	
6373	大同工業	1,000	126.00	126,000	
6375	日本コンベヤ	3,000	73.00	219,000	
6378	木村化工機	700	252.00	176,400	
6381	アネスト岩田	1,000	307.00	307,000	
6383	ダイフク	3,500	413.00	1,445,500	
6390	加藤製作所	2,000	219.00	438,000	
6393	油研工業	2,000	131.00	262,000	
6395	タダノ	4,000	587.00	2,348,000	
6406	フジテック	2,000	502.00	1,004,000	
6407	C K D	2,200	433.00	952,600	
6409	キトー	2	62,100.00	124,200	
6412	平和	1,700	1,227.00	2,085,900	
6413	理想科学工業	600	1,453.00	871,800	
6417	S A N K Y O	2,300	3,405.00	7,831,500	
6418	日本金銭機械	700	652.00	456,400	
6419	マースエンジニアリング	400	1,860.00	744,000	
6420	福島工業	200	1,600.00	320,000	
6428	オーイズミ	400	294.00	117,600	
6430	ダイコク電機	300	2,159.00	647,700	
6436	アマノ	2,200	673.00	1,480,600	
6440	J U K I	5,000	98.00	490,000	
6444	サンデン	4,000	266.00	1,064,000	
6445	蛇の目シン工業	7,000	57.00	399,000	
6454	マックス	1,000	917.00	917,000	
6457	グローリー	2,300	1,788.00	4,112,400	
6459	大和冷機工業	1,000	347.00	347,000	
6460	セガサミーホールディングス	8,300	1,399.00	11,611,700	
6461	日本ビストンリング	3,000	133.00	399,000	

6462	リケン	3,000	286.00	858,000	
6463	T P R	800	893.00	714,400	
6465	ホシザキ電機	1,700	2,157.00	3,666,900	
6470	大豊工業	500	772.00	386,000	
6471	日本精工	17,000	448.00	7,616,000	
6472	N T N	17,000	140.00	2,380,000	
6473	ジェイテクト	8,200	602.00	4,936,400	
6474	不二越	7,000	253.00	1,771,000	
6480	日本トムソン	3,000	278.00	834,000	
6481	T H K	5,100	1,325.00	6,757,500	
6482	ユーシン精機	400	1,367.00	546,800	
6485	前澤給装工業	300	1,028.00	308,400	
6486	イーグル工業	1,000	516.00	516,000	
6489	前澤工業	800	189.00	151,200	
6490	日本ビラー工業	1,000	491.00	491,000	
6498	キッツ	3,100	351.00	1,088,100	
6581	日立工機	2,000	584.00	1,168,000	
6586	マキタ	4,700	3,220.00	15,134,000	
7004	日立造船	30,500	101.00	3,080,500	
7011	三菱重工業	129,000	334.00	43,086,000	
7013	I H I	52,000	165.00	8,580,000	
4062	イビデン	4,700	955.00	4,488,500	
4902	コニカミノルタホールディングス	20,500	547.00	11,213,500	
6448	ブラザー工業	10,000	750.00	7,500,000	
6479	ミネベア	11,000	287.00	3,157,000	
6501	日立製作所	180,000	420.00	75,600,000	
6502	東芝	151,000	289.00	43,639,000	
6503	三菱電機	77,000	590.00	45,430,000	
6504	富士電機	23,000	156.00	3,588,000	
6505	東洋電機製造	2,000	215.00	430,000	
6506	安川電機	8,000	596.00	4,768,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	5,000	133.00	665,000	
6508	明電舎	8,000	265.00	2,120,000	
6513	オリジン電気	1,000	301.00	301,000	
6517	デンヨー	700	828.00	579,600	
6588	東芝テック	5,000	403.00	2,015,000	
6590	芝浦メカトロニクス	1,000	136.00	136,000	
6592	マブチモーター	1,100	3,405.00	3,745,500	
6594	日本電産	4,100	5,210.00	21,361,000	
6617	東光高岳ホールディングス	400	1,154.00	461,600	
6620	宮越ホールディングス	200	271.00	54,200	
6622	ダイヘン	4,000	216.00	864,000	
6630	ヤーマン	100	1,168.00	116,800	
6632	J V C ケンウッド	4,600	261.00	1,200,600	
6640	第一精工	200	1,106.00	221,200	
6641	日新電機	2,000	492.00	984,000	
6644	大崎電気工業	1,000	435.00	435,000	
6645	オムロン	8,600	1,689.00	14,525,400	
6651	日東工業	1,100	1,201.00	1,321,100	

6652	I D E C	1,000	681.00	681,000	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	15,000	307.00	4,605,000	
6675	サクサホールディングス	2,000	139.00	278,000	
6676	メルコホールディングス	500	1,556.00	778,000	
6678	テクノメディカ	1	456,500.00	456,500	
6701	日本電気	99,000	153.00	15,147,000	
6702	富士通	74,000	286.00	21,164,000	
6703	沖電気工業	28,000	85.00	2,380,000	
6704	岩崎通信機	4,000	58.00	232,000	
6706	電気興業	2,000	363.00	726,000	
6707	サンケン電気	4,000	244.00	976,000	
6715	ナカヨ通信機	1,000	272.00	272,000	
6718	アイホン	400	1,384.00	553,600	
6723	ルネサスエレクトロニクス	2,000	298.00	596,000	
6724	セイコーエプソン	5,300	450.00	2,385,000	
6727	ワコム	14	229,500.00	3,213,000	
6728	アルバック	1,500	492.00	738,000	
6730	アクセル	400	1,997.00	798,800	
6737	ナナオ	600	1,224.00	734,400	
6741	日本信号	2,000	456.00	912,000	
6742	京三製作所	2,000	265.00	530,000	
6744	能美防災	1,000	504.00	504,000	
6745	ホーチキ	1,000	398.00	398,000	
6751	日本無線	2,000	186.00	372,000	
6752	パナソニック	87,600	397.00	34,777,200	
6753	シャープ	39,000	153.00	5,967,000	
6754	アンリツ	4,000	1,044.00	4,176,000	
6755	富士通ゼネラル	2,000	719.00	1,438,000	
6756	日立国際電気	2,000	543.00	1,086,000	
6758	ソニー	47,900	914.00	43,780,600	
6762	T D K	4,300	2,817.00	12,113,100	
6763	帝国通信工業	2,000	131.00	262,000	
6767	ミツミ電機	2,900	393.00	1,139,700	
6768	タムラ製作所	3,000	172.00	516,000	
6770	アルプス電気	5,700	438.00	2,496,600	
6771	池上通信機	3,000	47.00	141,000	
6773	パイオニア	9,200	173.00	1,591,600	
6779	日本電波工業	700	843.00	590,100	
6788	日本トリム	100	2,129.00	212,900	
6789	ローランド ディー . ジー .	300	858.00	257,400	
6794	フォスター電機	800	1,405.00	1,124,000	
6796	クラリオン	4,000	121.00	484,000	
6798	S M K	2,000	197.00	394,000	
6800	ヨコオ	600	379.00	227,400	
6801	東光	4,000	183.00	732,000	
6803	ティアック	5,000	26.00	130,000	
6804	ホシデン	2,100	458.00	961,800	
6806	ヒロセ電機	1,300	8,670.00	11,271,000	

6807	日本航空電子工業	2,000	623.00	1,246,000	
6809	T O A	1,000	555.00	555,000	
6815	ユニデン	2,000	176.00	352,000	
6816	アルパイン	1,500	647.00	970,500	
6817	スミダコーポレーション	500	383.00	191,500	
6820	アイコム	400	1,667.00	666,800	
6823	リオン	200	543.00	108,600	
6839	船井電機	800	947.00	757,600	
6841	横河電機	7,700	795.00	6,121,500	
6844	新電元工業	2,000	216.00	432,000	
6845	アズビル	2,200	1,597.00	3,513,400	
6849	日本光電工業	1,500	2,760.00	4,140,000	
6850	チノー	1,000	192.00	192,000	
6853	共和電業	1,000	240.00	240,000	
6855	日本電子材料	300	378.00	113,400	
6856	堀場製作所	1,500	2,383.00	3,574,500	
6857	アドバンテスト	5,200	969.00	5,038,800	
6858	小野測器	1,000	354.00	354,000	
6859	エスベック	800	645.00	516,000	
6860	パナソニック デバイス S U N X	700	314.00	219,800	
6861	キーエンス	1,900	21,200.00	40,280,000	
6866	日置電機	400	1,349.00	539,600	
6869	シスメックス	2,700	3,455.00	9,328,500	
6875	メガチップス	600	1,764.00	1,058,400	
6877	O B A R A G R O U P	600	890.00	534,000	
6883	日本電産コパル電子	700	386.00	270,200	
6885	ミヤチテクノス	400	493.00	197,200	
6900	東京電波	200	437.00	87,400	
6901	澤藤電機	1,000	188.00	188,000	
6905	コーセル	1,100	1,042.00	1,146,200	
6910	日立メディコ	1,000	1,008.00	1,008,000	
6911	新日本無線	1,000	150.00	150,000	
6914	オブテックス	500	869.00	434,500	
6915	千代田インテグレ	400	823.00	329,200	
6923	スタンレー電気	6,000	1,114.00	6,684,000	
6924	岩崎電気	3,000	115.00	345,000	
6925	ウシオ電機	4,700	858.00	4,032,600	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	700	149.00	104,300	
6929	日本セラミック	500	1,043.00	521,500	
6935	日本デジタル研究所	600	822.00	493,200	
6937	古河電池	1,000	367.00	367,000	
6938	双信電機	400	292.00	116,800	
6941	山一電機	900	133.00	119,700	
6947	図研	500	496.00	248,000	
6951	日本電子	3,000	166.00	498,000	
6952	カシオ計算機	7,300	578.00	4,219,400	
6954	ファナック	8,000	13,140.00	105,120,000	
6958	日本シイエムケイ	1,600	259.00	414,400	
6961	エンブラス	300	2,964.00	889,200	

6963	ローム	4,100	2,472.00	10,135,200	
6965	浜松ホトニクス	3,000	2,780.00	8,340,000	
6966	三井ハイテック	1,100	575.00	632,500	
6967	新光電気工業	2,600	467.00	1,214,200	
6971	京セラ	6,400	7,310.00	46,784,000	
6976	太陽誘電	3,800	623.00	2,367,400	
6981	村田製作所	8,000	4,065.00	32,520,000	
6985	ユーシン	1,300	353.00	458,900	
6986	双葉電子工業	1,400	914.00	1,279,600	
6989	北陸電気工業	3,000	87.00	261,000	
6996	ニチコン	2,400	503.00	1,207,200	
6997	日本ケミコン	4,000	114.00	456,000	
6999	K O A	900	605.00	544,500	
7244	市光工業	2,000	114.00	228,000	
7276	小糸製作所	4,000	1,018.00	4,072,000	
7280	ミツバ	1,000	535.00	535,000	
7718	スター精密	1,300	756.00	982,800	
7735	大日本スクリーン製造	8,000	404.00	3,232,000	
7739	キャノン電子	700	1,779.00	1,245,300	
7751	キャノン	47,700	2,570.00	122,589,000	
7752	リコー	23,000	665.00	15,295,000	
7999	M U T O Hホールディングス	1,000	170.00	170,000	
8035	東京エレクトロン	6,400	3,590.00	22,976,000	
3116	トヨタ紡織	2,700	769.00	2,076,300	
5196	鬼怒川ゴム工業	1,000	470.00	470,000	
5949	ユニプレス	1,400	1,788.00	2,503,200	
6201	豊田自動織機	7,000	2,297.00	16,079,000	
6455	モリタホールディングス	1,000	682.00	682,000	
6584	三櫻工業	900	465.00	418,500	
6902	デンソー	19,000	2,459.00	46,721,000	
6995	東海理化電機製作所	1,800	983.00	1,769,400	
7003	三井造船	30,000	100.00	3,000,000	
7007	佐世保重工業	5,000	73.00	365,000	
7012	川崎重工業	60,000	173.00	10,380,000	
7102	日本車輛製造	3,000	304.00	912,000	
7105	日本輸送機	1,000	222.00	222,000	
7122	近畿車輛	1,000	259.00	259,000	
7201	日産自動車	97,000	705.00	68,385,000	
7202	いすゞ自動車	44,000	428.00	18,832,000	
7203	トヨタ自動車	98,600	3,240.00	319,464,000	代用有価証券30,000株
7205	日野自動車	10,000	617.00	6,170,000	
7211	三菱自動車工業	178,000	70.00	12,460,000	
7212	エフテック	300	1,090.00	327,000	
7220	武蔵精密工業	800	1,567.00	1,253,600	
7222	日産車体	3,000	902.00	2,706,000	
7224	新明和工業	3,000	455.00	1,365,000	
7226	極東開発工業	1,500	720.00	1,080,000	
7230	日信工業	1,600	1,180.00	1,888,000	
7231	トピー工業	6,000	155.00	930,000	

7236	ティラド	3,000	192.00	576,000	
7238	曙ブレーキ工業	3,500	357.00	1,249,500	
7239	タチエス	1,000	1,448.00	1,448,000	
7240	N O K	3,700	1,208.00	4,469,600	
7241	フタバ産業	2,300	302.00	694,600	
7242	カヤバ工業	6,000	274.00	1,644,000	
7243	シロキ工業	2,000	180.00	360,000	
7245	大同メタル工業	1,000	526.00	526,000	
7246	プレス工業	3,000	344.00	1,032,000	
7248	カルソニックカンセイ	5,000	345.00	1,725,000	

[次へ](#)

7250	太平洋工業	1,500	465.00	697,500	
7251	ケーヒン	1,600	1,018.00	1,628,800	
7256	河西工業	1,000	309.00	309,000	
7259	アイシン精機	7,000	2,229.00	15,603,000	
7260	富士機工	1,000	224.00	224,000	
7261	マツダ	122,000	107.00	13,054,000	
7262	ダイハツ工業	8,000	1,391.00	11,128,000	
7266	今仙電機製作所	600	921.00	552,600	
7267	本田技研工業	64,800	2,481.00	160,768,800	
7269	スズキ	16,000	1,830.00	29,280,000	
7270	富士重工業	24,000	780.00	18,720,000	
7272	ヤマハ発動機	11,700	767.00	8,973,900	
7274	ショーワ	1,800	771.00	1,387,800	
7277	T B K	1,000	416.00	416,000	
7278	エクセディ	1,000	1,612.00	1,612,000	
7282	豊田合成	2,200	1,652.00	3,634,400	
7283	愛三工業	800	600.00	480,000	
7294	ヨロズ	600	1,122.00	673,200	
7296	エフ・シー・シー	1,300	1,428.00	1,856,400	
7309	シマノ	3,100	5,070.00	15,717,000	
7312	タカタ	1,400	1,472.00	2,060,800	
7313	テイ・エス テック	1,600	1,382.00	2,211,200	
7728	日本電産トーソク	300	521.00	156,300	
4543	テルモ	5,900	3,415.00	20,148,500	
5187	クリエートメディック	300	800.00	240,000	
6376	日機装	3,000	875.00	2,625,000	
7701	島津製作所	9,000	524.00	4,716,000	
7702	J M S	1,000	268.00	268,000	
7714	モリテックス	200	272.00	54,400	
7715	長野計器	600	643.00	385,800	
7717	ブイ・テクノロジー	1	138,000.00	138,000	
7721	東京計器	3,000	130.00	390,000	
7723	愛知時計電機	1,000	273.00	273,000	
7729	東京精密	1,300	1,244.00	1,617,200	
7730	マニー	200	3,015.00	603,000	
7731	ニコン	14,300	1,886.00	26,969,800	
7732	トプコン	1,600	492.00	787,200	
7733	オリンパス	9,100	1,315.00	11,966,500	
7734	理研計器	600	494.00	296,400	
7740	タムロン	600	2,102.00	1,261,200	
7741	H O Y A	18,700	1,564.00	29,246,800	
7744	ノーリツ鋼機	600	308.00	184,800	
7745	エー・アンド・デイ	700	259.00	181,300	
7756	日本電産コパル	600	626.00	375,600	
7762	シチズンホールディングス	9,400	392.00	3,684,800	
7769	リズム時計工業	3,000	157.00	471,000	
7775	大研医器	100	1,365.00	136,500	
7979	松風	400	838.00	335,200	
8050	セイコーホールディングス	5,000	214.00	1,070,000	

8086	ニプロ	4,100	556.00	2,279,600	
7817	パラマウントベッドホールディングス	700	2,803.00	1,962,100	
7819	S H O - B I	100	397.00	39,700	
7822	永大産業	1,000	329.00	329,000	
7825	ダンロップスポーツ	400	1,025.00	410,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	7,900	1,201.00	9,487,900	
7838	共立印刷	900	235.00	211,500	
7840	フランスベッドホールディングス	5,000	169.00	845,000	
7846	パイロットコーポレーション	7	144,300.00	1,010,100	
7862	トッパン・フォームズ	1,400	759.00	1,062,600	
7864	フジシールインターナショナル	900	1,695.00	1,525,500	
7867	タカラトミー	2,500	461.00	1,152,500	
7868	廣済堂	800	269.00	215,200	
7885	タカノ	400	386.00	154,400	
7893	プロネクサス	900	465.00	418,500	
7897	ホクシン	600	172.00	103,200	
7898	ウッドワン	1,000	222.00	222,000	
7905	大建工業	3,000	180.00	540,000	
7911	凸版印刷	22,000	469.00	10,318,000	
7912	大日本印刷	23,000	570.00	13,110,000	
7913	図書印刷	1,000	125.00	125,000	
7914	共同印刷	2,000	180.00	360,000	
7915	日本写真印刷	1,100	578.00	635,800	
7916	光村印刷	1,000	241.00	241,000	
7921	宝印刷	400	576.00	230,400	
7936	アシックス	7,200	1,120.00	8,064,000	
7937	ツツミ	400	1,855.00	742,000	
7944	ローランド	800	562.00	449,600	
7949	小松ウオール工業	300	1,071.00	321,300	
7951	ヤマハ	5,600	714.00	3,998,400	
7952	河合楽器製作所	3,000	155.00	465,000	
7955	クリナップ	800	557.00	445,600	
7956	ビジョン	600	3,540.00	2,124,000	
7961	兼松日産農林	2,000	129.00	258,000	
7962	キングジム	600	642.00	385,200	
7966	リンテック	1,700	1,401.00	2,381,700	
7968	T A S A K I	100	289.00	28,900	
7972	イトーキ	1,600	507.00	811,200	
7974	任天堂	4,400	10,130.00	44,572,000	
7976	三菱鉛筆	600	1,368.00	820,800	
7981	タカラスタンダード	4,000	599.00	2,396,000	
7984	コクヨ	4,100	627.00	2,570,700	
7987	ナカバヤシ	2,000	168.00	336,000	
7994	岡村製作所	3,000	551.00	1,653,000	
8022	美津濃	4,000	374.00	1,496,000	
8170	アデランス	1,000	1,106.00	1,106,000	
9501	東京電力	65,500	127.00	8,318,500	
9502	中部電力	23,400	995.00	23,283,000	

9503	関西電力	31,300	631.00	19,750,300	
9504	中国電力	10,600	997.00	10,568,200	
9505	北陸電力	7,400	815.00	6,031,000	
9506	東北電力	19,300	641.00	12,371,300	
9507	四国電力	6,900	892.00	6,154,800	
9508	九州電力	16,900	650.00	10,985,000	
9509	北海道電力	7,200	656.00	4,723,200	
9511	沖縄電力	500	2,486.00	1,243,000	
9513	電源開発	4,800	1,961.00	9,412,800	
9531	東京瓦斯	92,000	420.00	38,640,000	
9532	大阪瓦斯	75,000	333.00	24,975,000	
9533	東邦瓦斯	19,000	487.00	9,253,000	
9534	北海道瓦斯	1,000	225.00	225,000	
9536	西部瓦斯	9,000	211.00	1,899,000	
9543	静岡瓦斯	2,000	583.00	1,166,000	
9001	東武鉄道	44,000	427.00	18,788,000	
9003	相鉄ホールディングス	12,000	271.00	3,252,000	
9005	東京急行電鉄	45,000	412.00	18,540,000	
9006	京浜急行電鉄	20,000	752.00	15,040,000	
9007	小田急電鉄	25,000	843.00	21,075,000	
9008	京王電鉄	21,000	609.00	12,789,000	
9009	京成電鉄	12,000	715.00	8,580,000	
9010	富士急行	2,000	508.00	1,016,000	
9014	新京成電鉄	1,000	358.00	358,000	
9020	東日本旅客鉄道	14,300	5,500.00	78,650,000	
9021	西日本旅客鉄道	6,700	3,445.00	23,081,500	
9022	東海旅客鉄道	6,400	6,810.00	43,584,000	
9031	西日本鉄道	10,000	338.00	3,380,000	
9037	ハマキョウレックス	200	2,441.00	488,200	
9039	サカイ引越センター	100	1,685.00	168,500	
9041	近畿日本鉄道	69,000	315.00	21,735,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	48,000	437.00	20,976,000	
9044	南海電気鉄道	16,000	359.00	5,744,000	
9045	京阪電気鉄道	17,000	385.00	6,545,000	
9047	名糖運輸	300	593.00	177,900	
9048	名古屋鉄道	27,000	219.00	5,913,000	
9062	日本通運	30,000	286.00	8,580,000	
9064	ヤマトホールディングス	14,500	1,213.00	17,588,500	
9065	山九	9,000	295.00	2,655,000	
9067	丸運	300	184.00	55,200	
9068	丸全昭和運輸	3,000	233.00	699,000	
9069	センコー	3,000	341.00	1,023,000	
9070	トナミホールディングス	2,000	180.00	360,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	2,500	977.00	2,442,500	
9074	日本石油輸送	1,000	184.00	184,000	
9075	福山通運	5,000	420.00	2,100,000	
9076	セイノーホールディングス	6,000	456.00	2,736,000	
9081	神奈川中央交通	1,000	449.00	449,000	
9086	日立物流	1,300	1,181.00	1,535,300	

9101	日本郵船	61,000	152.00	9,272,000	
9104	商船三井	37,000	191.00	7,067,000	
9107	川崎汽船	34,000	100.00	3,400,000	
9110	N S ユナイテッド海運	3,000	86.00	258,000	
9113	乾汽船	800	188.00	150,400	
9115	明治海運	700	280.00	196,000	
9119	飯野海運	3,200	227.00	726,400	
9130	共栄タンカー	1,000	163.00	163,000	
9201	日本航空	6,500	3,720.00	24,180,000	
9202	全日本空輸	150,000	166.00	24,900,000	
9232	パスコ	1,000	227.00	227,000	
9066	日新	3,000	195.00	585,000	
9301	三菱倉庫	5,000	1,049.00	5,245,000	
9302	三井倉庫	4,000	243.00	972,000	
9303	住友倉庫	5,000	343.00	1,715,000	
9304	澁澤倉庫	2,000	224.00	448,000	
9306	東陽倉庫	1,000	176.00	176,000	
9310	日本トランスシティ	2,000	273.00	546,000	
9312	ケイヒン	1,000	90.00	90,000	
9324	安田倉庫	600	511.00	306,600	
9351	東洋埠頭	2,000	126.00	252,000	
9358	宇徳	400	219.00	87,600	
9364	上組	9,000	652.00	5,868,000	
9366	サンリツ	200	494.00	98,800	
9369	キューソー流通システム	200	943.00	188,600	
9370	郵船ロジスティクス	600	670.00	402,000	
9375	近鉄エクスプレス	700	2,346.00	1,642,200	
9381	エーアイティー	100	1,156.00	115,600	
1973	N E C ネットズエスアイ	700	1,517.00	1,061,900	
2317	システナ	8	72,400.00	579,200	
2327	新日鉄住金ソリューションズ	500	1,587.00	793,500	
2359	コア	300	733.00	219,900	
3371	ソフトクリエイトホールディングス	100	1,222.00	122,200	
3620	デジタルハーツ	100	691.00	69,100	
3626	I T ホールディングス	2,500	1,014.00	2,535,000	
3627	ネオス	1	64,400.00	64,400	
3630	電算システム	100	1,140.00	114,000	
3632	グリー	3,900	1,390.00	5,421,000	
3635	コーエーテクモホールディングス	1,500	672.00	1,008,000	
3636	三菱総合研究所	300	1,719.00	515,700	
3639	ボルテージ	100	848.00	84,800	
3656	K L a b	200	562.00	112,400	
3659	ネクソン	6,200	910.00	5,642,000	
3715	ダウンゴ	4	134,600.00	538,400	
3730	マクロミル	700	965.00	675,500	
3738	ティーガイア	1,000	766.00	766,000	
3769	G M O ペイメントゲートウェイ	200	1,279.00	255,800	
3770	ザッパラス	4	73,400.00	293,600	
3774	インターネットイニシアティブ	900	2,094.00	1,884,600	

3789	ソネットエンタテインメント	1	540,000.00	540,000	
3817	S R Aホールディングス	400	886.00	354,400	
4283	パナソニック インフォメーションシステムズ	200	1,800.00	360,000	
4295	フェイス	27	8,920.00	240,840	
4307	野村総合研究所	4,300	1,602.00	6,888,600	
4312	サイバネットシステム	8	21,960.00	175,680	
4326	インテージ	200	1,674.00	334,800	
4340	シンプレクス・ホールディングス	14	23,200.00	324,800	
4674	クレスコ	300	520.00	156,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	74	118,100.00	8,739,400	
4684	オービック	260	16,150.00	4,199,000	
4687	T D Cソフトウェアエンジニアリング	200	749.00	149,800	
4689	ヤフー	556	27,420.00	15,245,520	
4704	トレンドマイクロ	3,000	2,210.00	6,630,000	
4716	日本オラクル	1,500	3,390.00	5,085,000	
4719	アルファシステムズ	200	958.00	191,600	
4722	フューチャーアーキテクト	10	31,000.00	310,000	
4725	シーエーシー	600	667.00	400,200	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	200	781.00	156,200	
4728	トーセ	300	502.00	150,600	
4733	オービックビジネスコンサルタント	250	4,200.00	1,050,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	900	4,015.00	3,613,500	
4743	アイティフォー	900	285.00	256,500	
4746	東計電算	200	1,172.00	234,400	
4762	エクスネット	1	114,400.00	114,400	
4768	大塚商会	700	6,350.00	4,445,000	
4776	サイボウズ	14	25,360.00	355,040	
4779	ソフトブレーン	13	10,740.00	139,620	
4812	電通国際情報サービス	500	692.00	346,000	
4825	ウェザーニューズ	200	2,595.00	519,000	
4826	C I J	900	319.00	287,100	
4839	WOWOW	2	188,000.00	376,000	
6791	日本コロムビア	6,000	24.00	144,000	
7518	ネットワンシステムズ	2,800	819.00	2,293,200	
7595	アルゴグラフィックス	300	1,039.00	311,700	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	1,400	1,577.00	2,207,800	
8056	日本ユニシス	2,100	574.00	1,205,400	
8096	兼松エレクトロニクス	500	887.00	443,500	
9401	東京放送ホールディングス	4,100	776.00	3,181,600	
9404	日本テレビホールディングス	6,900	1,055.00	7,279,500	
9409	テレビ朝日	1,900	1,048.00	1,991,200	
9412	スカパー J S A Tホールディングス	66	35,600.00	2,349,600	
9413	テレビ東京ホールディングス	600	882.00	529,200	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	700	644.00	450,800	
9427	イー・アクセス	83	53,800.00	4,465,400	
9430	N E C モバイルリング	300	3,330.00	999,000	
9432	日本電信電話	31,900	3,630.00	115,797,000	

9433	K D D I	10,700	6,250.00	66,875,000	
9435	光通信	800	4,395.00	3,516,000	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	625	117,800.00	73,625,000	
9449	G M Oインターネット	2,500	519.00	1,297,500	
9470	学研ホールディングス	2,000	223.00	446,000	
9474	ゼンリン	1,000	1,015.00	1,015,000	
9475	昭文社	400	521.00	208,400	
9477	角川グループホールディングス	700	2,500.00	1,750,000	
9479	インプレスホールディングス	700	124.00	86,800	
9600	アイネット	500	565.00	282,500	
9601	松竹	5,000	774.00	3,870,000	
9602	東宝	5,400	1,355.00	7,317,000	
9605	東映	3,000	428.00	1,284,000	
9607	A O I P r o .	500	559.00	279,500	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	47	236,800.00	11,129,600	
9682	D T S	700	1,062.00	743,400	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,700	1,074.00	2,899,800	
9692	シーイーシー	500	456.00	228,000	
9697	カプコン	1,400	1,493.00	2,090,200	
9717	ジャステック	600	550.00	330,000	
9719	S C S K	1,800	1,400.00	2,520,000	
9739	日本システムウエア	400	311.00	124,400	
9742	アイネス	1,000	494.00	494,000	
9746	T K C	700	1,522.00	1,065,400	
9749	富士ソフト	1,100	1,684.00	1,852,400	
9759	N S D	1,500	781.00	1,171,500	
9766	コナミ	3,400	1,874.00	6,371,600	
9790	福井コンピュータホールディングス	100	444.00	44,400	
9889	J B C Cホールディングス	600	539.00	323,400	
9984	ソフトバンク	34,500	2,772.00	95,634,000	
1352	ハウスイ	1,000	99.00	99,000	
2676	高千穂交易	300	852.00	255,600	
2692	伊藤忠食品	200	2,861.00	572,200	
2715	エレマテック	400	1,025.00	410,000	
2729	J A L U X	200	836.00	167,200	
2733	あらた	2,000	330.00	660,000	
2737	トーメンデバイス	100	1,691.00	169,100	
2760	東京エレクトロン デバイス	2	130,900.00	261,800	
2768	双日	47,600	99.00	4,712,400	
2784	アルフレッサ ホールディングス	2,000	3,550.00	7,100,000	
2874	横浜冷凍	1,900	548.00	1,041,200	
3004	神栄	1,000	101.00	101,000	
3023	ラサ商事	300	360.00	108,000	
3036	アルコニックス	200	1,280.00	256,000	
3076	あい ホールディングス	1,200	508.00	609,600	
3107	ダイワボウホールディングス	7,000	149.00	1,043,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,400	788.00	1,103,200	

3153	八洲電機	500	341.00	170,500	
3156	U K C ホールディングス	400	1,560.00	624,000	
3167	T O K A I ホールディングス	3,000	340.00	1,020,000	
3321	ミタチ産業	100	368.00	36,800	
3360	シップヘルスケアホールディングス	1,100	2,658.00	2,923,800	
5009	富士興産	300	460.00	138,000	
6973	協栄産業	1,000	131.00	131,000	
7414	小野建	700	620.00	434,000	
7420	佐島電機	500	431.00	215,500	
7427	エコートレーディング	100	719.00	71,900	
7433	伯東	500	730.00	365,000	
7438	コンドーテック	300	462.00	138,600	
7442	中山福	400	616.00	246,400	
7447	ナガイレーベン	1,000	1,171.00	1,171,000	
7451	三菱食品	800	2,010.00	1,608,000	
7456	松田産業	500	1,017.00	508,500	
7459	メディパルホールディングス	7,600	995.00	7,562,000	
7463	アドヴァン	500	811.00	405,500	
7466	S P K	200	1,359.00	271,800	
7476	アズワン	500	1,674.00	837,000	
7481	尾家産業	300	814.00	244,200	
7482	シモジマ	500	925.00	462,500	
7483	ドウシシャ	400	2,296.00	918,400	
7504	高速	500	674.00	337,000	
7517	黒田電気	1,000	964.00	964,000	
7537	丸文	600	334.00	200,400	
7552	ハピネット	200	594.00	118,800	
7558	トーメンエレクトロニクス	500	995.00	497,500	
7591	エクセル	400	668.00	267,200	
7594	マルカキカイ	200	968.00	193,600	
7599	ガリバーインターナショナル	250	3,230.00	807,500	
7600	日本エム・ディ・エム	900	241.00	216,900	
7607	進和	400	905.00	362,000	
7608	エスケイジャパン	200	242.00	48,400	
7609	ダイトエレクトロン	400	327.00	130,800	
7613	シークス	500	1,134.00	567,000	
7619	田中商事	200	418.00	83,600	
7628	オーハシテクニカ	500	554.00	277,000	
7631	マクニカ	400	1,579.00	631,600	
7637	白銅	300	747.00	224,100	
8001	伊藤忠商事	60,400	800.00	48,320,000	
8002	丸紅	62,000	529.00	32,798,000	
8007	高島	1,000	276.00	276,000	
8008	F & A アクアホールディングス	600	942.00	565,200	
8012	長瀬産業	4,300	862.00	3,706,600	
8014	蝶理	500	882.00	441,000	
8015	豊田通商	8,400	1,821.00	15,296,400	
8018	三共生興	1,300	276.00	358,800	
8020	兼松	16,000	95.00	1,520,000	

8025	ツカモトコーポレーション	2,000	125.00	250,000	
8031	三井物産	65,400	1,115.00	72,921,000	
8032	日本紙パルプ商事	4,000	242.00	968,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	2,300	1,713.00	3,939,900	
8037	カメイ	1,000	676.00	676,000	
8038	東都水産	1,000	121.00	121,000	
8043	スターゼン	2,000	237.00	474,000	
8051	山善	2,900	521.00	1,510,900	
8052	椿本興業	1,000	228.00	228,000	
8053	住友商事	44,700	1,049.00	46,890,300	
8057	内田洋行	2,000	214.00	428,000	
8058	三菱商事	59,100	1,480.00	87,468,000	
8059	第一実業	2,000	356.00	712,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	2,500	1,149.00	2,872,500	
8061	西華産業	3,000	223.00	669,000	
8065	佐藤商事	700	480.00	336,000	
8068	菱洋エレクトロ	900	776.00	698,400	
8070	東京産業	500	251.00	125,500	
8074	ユアサ商事	8,000	141.00	1,128,000	
8075	神鋼商事	2,000	144.00	288,000	
8078	阪和興業	8,000	278.00	2,224,000	
8081	カナデン	1,000	465.00	465,000	
8084	菱電商事	1,000	460.00	460,000	
8087	フルサト工業	400	716.00	286,400	
8088	岩谷産業	8,000	311.00	2,488,000	
8089	すてきナイスグループ	3,000	163.00	489,000	
8090	昭光通商	3,000	121.00	363,000	
8091	ニチモウ	1,000	163.00	163,000	
8093	極東貿易	1,000	129.00	129,000	
8095	イワキ	1,000	168.00	168,000	
8097	三愛石油	2,000	348.00	696,000	
8098	稲畑産業	1,900	515.00	978,500	
8101	G S I クレオス	3,000	105.00	315,000	
8103	明和産業	600	308.00	184,800	
8129	東邦ホールディングス	2,400	1,621.00	3,890,400	
8130	サンゲツ	1,400	2,064.00	2,889,600	
8131	ミツウロコグループホールディングス	1,200	512.00	614,400	
8132	シナネン	2,000	342.00	684,000	
8133	伊藤忠エネクス	1,600	413.00	660,800	
8136	サンリオ	1,900	2,774.00	5,270,600	
8137	サンワテクノス	500	571.00	285,500	
8140	リョーサン	1,200	1,372.00	1,646,400	
8141	新光商事	900	662.00	595,800	
8142	トーヨー	2,000	308.00	616,000	
8150	三信電気	1,100	592.00	651,200	
8151	東陽テクニカ	1,100	939.00	1,032,900	
8153	モスフードサービス	1,000	1,531.00	1,531,000	
8154	加賀電子	800	748.00	598,400	

8158	ソーダニッカ	1,000	345.00	345,000	
8159	立花エレテック	500	654.00	327,000	
8283	P a l t a c	800	1,173.00	938,400	
8835	太平洋興発	3,000	74.00	222,000	
9305	ヤマタネ	4,000	104.00	416,000	
9810	日鐵商事	2,000	185.00	370,000	
9830	トラスコ中山	900	1,343.00	1,208,700	
9832	オートバックスセブン	900	3,170.00	2,853,000	
9869	加藤産業	1,100	1,466.00	1,612,600	
9880	イノテック	400	310.00	124,000	
9882	イエローハット	700	1,208.00	845,600	
9883	富士エレクトロニクス	400	1,066.00	426,400	
9896	J Kホールディングス	700	389.00	272,300	
9902	日伝	300	2,044.00	613,200	

[次へ](#)

9930	北沢産業	500	152.00	76,000	
9932	杉本商事	400	750.00	300,000	
9934	因幡電機産業	900	2,211.00	1,989,900	
9938	住金物産	4,000	196.00	784,000	
9962	ミスミグループ本社	2,800	2,078.00	5,818,400	
9963	江守商事	200	810.00	162,000	
9972	アルテック	400	196.00	78,400	
9982	タキヒヨー	1,000	416.00	416,000	
9987	スズケン	2,900	2,452.00	7,110,800	
9991	ジェコス	600	528.00	316,800	
2651	ローソン	2,900	5,680.00	16,472,000	
2659	サンエー	300	3,055.00	916,500	
2660	キリン堂	300	545.00	163,500	
2662	ダイユーエイト	100	548.00	54,800	
2664	カワチ薬品	500	1,816.00	908,000	
2670	エービーシー・マート	900	3,460.00	3,114,000	
2674	ハードオフコーポレーション	300	537.00	161,100	
2678	アスクル	500	1,176.00	588,000	
2681	ゲオホールディングス	13	89,100.00	1,158,300	
2685	ポイント	700	2,961.00	2,072,700	
2695	くらコーポレーション	500	1,110.00	555,000	
2698	キャンドウ	4	108,000.00	432,000	
2726	バル	250	4,115.00	1,028,750	
2730	エディオン	3,200	321.00	1,027,200	
2734	サーラコーポレーション	600	488.00	292,800	
2753	あみやき亭	2	198,600.00	397,200	
2764	ひらまつ	1	74,100.00	74,100	
2772	ゲンキー	100	1,733.00	173,300	
2791	大黒天物産	100	2,440.00	244,000	
2792	ハニーズ	660	1,263.00	833,580	
3028	アルペン	600	1,493.00	895,800	
3048	ビックカメラ	28	39,100.00	1,094,800	
3050	D C Mホールディングス	3,900	527.00	2,055,300	
3064	M o n o t a R O	500	2,129.00	1,064,500	
3086	J . フロント リテイリング	18,000	399.00	7,182,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	1,300	1,016.00	1,320,800	
3088	マツモトキヨシホールディングス	1,300	1,891.00	2,458,300	
3092	スタートトゥデイ	1,600	845.00	1,352,000	
3097	物語コーポレーション	100	1,838.00	183,800	
3098	ココカラファイン	800	2,586.00	2,068,800	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	15,100	751.00	11,340,100	
3141	ウエルシアホールディングス	300	2,808.00	842,400	
3148	クリエイト S Dホールディングス	300	2,130.00	639,000	
3159	丸善 C H Iホールディングス	300	213.00	63,900	
3313	ブックオフコーポレーション	300	647.00	194,100	
3333	あさひ	400	1,187.00	474,800	
3341	日本調剤	100	2,137.00	213,700	
3349	コスモス薬品	300	7,850.00	2,355,000	
3382	セブン＆アイ・ホールディングス	31,700	2,399.00	76,048,300	

3391	ツルハホールディングス	600	5,790.00	3,474,000	
3395	サンマルクホールディングス	200	2,961.00	592,200	
3396	フェリシモ	200	1,005.00	201,000	
3397	トリドール	600	1,138.00	682,800	
3398	クスリのアオキ	100	4,010.00	401,000	
4350	メディカルシステムネットワーク	200	438.00	87,600	
4775	総合メディカル	200	2,925.00	585,000	
7416	はるやま商事	500	395.00	197,500	
7421	カップ・クリエイトホールディングス	550	1,719.00	945,450	
7445	ライトオン	600	647.00	388,200	
7448	ジーンズメイト	300	293.00	87,900	
7453	良品計画	800	5,200.00	4,160,000	
7455	三城ホールディングス	900	431.00	387,900	
7494	コナカ	900	801.00	720,900	
7506	ハウス オブ ローゼ	100	1,265.00	126,500	
7508	G - 7ホールディングス	300	412.00	123,600	
7512	イオン北海道	500	360.00	180,000	
7513	コジマ	1,000	267.00	267,000	
7514	ヒマラヤ	200	632.00	126,400	
7516	コーナン商事	1,000	957.00	957,000	
7520	エコス	300	513.00	153,900	
7522	ワタミ	900	1,773.00	1,595,700	
7532	ドン・キホーテ	2,000	3,230.00	6,460,000	
7541	メガネトップ	1,300	895.00	1,163,500	
7545	西松屋チェーン	1,500	666.00	999,000	
7550	ゼンショーホールディングス	2,900	967.00	2,804,300	
7554	幸楽苑	500	1,169.00	584,500	
7561	ハークスレイ	200	689.00	137,800	
7581	サイゼリヤ	1,100	1,147.00	1,261,700	
7601	ポプラ	200	516.00	103,200	
7606	ユナイテッドアローズ	900	2,048.00	1,843,200	
7611	ハイデイ日高	400	1,342.00	536,800	
7615	京都きもの友禅	500	944.00	472,000	
7616	コロワイド	2,500	691.00	1,727,500	
7630	壱番屋	300	2,590.00	777,000	
7640	トップカルチャー	300	359.00	107,700	
7649	スギホールディングス	1,200	2,753.00	3,303,600	
8005	スクロール	1,100	245.00	269,500	
8028	ファミリーマート	2,300	3,680.00	8,464,000	
8160	木曽路	900	1,614.00	1,452,600	
8165	千趣会	1,400	505.00	707,000	
8166	タカキュー	500	257.00	128,500	
8168	ケーヨー	1,300	441.00	573,300	
8173	上新電機	2,000	852.00	1,704,000	
8174	日本瓦斯	1,000	1,250.00	1,250,000	
8175	ベスト電器	2,000	110.00	220,000	
8178	マルエツ	2,000	261.00	522,000	
8179	ロイヤルホールディングス	1,300	1,004.00	1,305,200	

8181	東天紅	1,000	186.00	186,000	
8182	いなげや	800	965.00	772,000	
8184	島忠	1,700	1,744.00	2,964,800	
8185	チヨダ	900	2,217.00	1,995,300	
8194	ライフコーポレーション	500	1,226.00	613,000	
8196	カスミ	1,500	523.00	784,500	
8200	リンガーハット	700	1,032.00	722,400	
8201	さが美	1,000	119.00	119,000	
8203	M r M a x	800	307.00	245,600	
8207	テンアライド	500	272.00	136,000	
8214	A O K I ホールディングス	600	1,722.00	1,033,200	
8217	オークワ	1,000	1,031.00	1,031,000	
8218	コメリ	1,200	1,948.00	2,337,600	
8219	青山商事	2,100	1,468.00	3,082,800	
8227	しまむら	900	8,120.00	7,308,000	
8229	C F S コーポレーション	700	345.00	241,500	
8233	高島屋	10,000	504.00	5,040,000	
8237	松屋	1,500	809.00	1,213,500	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	5,000	785.00	3,925,000	
8245	丸栄	1,000	82.00	82,000	
8248	ニッセンホールディングス	1,300	311.00	404,300	
8251	パルコ	1,400	824.00	1,153,600	
8252	丸井グループ	9,900	547.00	5,415,300	
8255	原信ナルスホールディングス	400	1,436.00	574,400	
8263	ダイエー	4,500	151.00	679,500	
8266	イズミヤ	3,000	394.00	1,182,000	
8267	イオン	26,700	858.00	22,908,600	
8270	ユニー	7,200	553.00	3,981,600	
8273	イズミ	1,900	1,963.00	3,729,700	
8274	東武ストア	1,000	260.00	260,000	
8276	平和堂	1,500	1,067.00	1,600,500	
8278	フジ	800	1,691.00	1,352,800	
8279	ヤオコー	400	3,080.00	1,232,000	
8281	ゼビオ	1,000	1,635.00	1,635,000	
8282	ケーズホールディングス	1,900	2,085.00	3,961,500	
8289	O l y m p i c	500	738.00	369,000	
8291	日産東京販売ホールディングス	1,000	325.00	325,000	
9627	アインファーマシーズ	400	4,875.00	1,950,000	
9828	元気寿司	200	1,028.00	205,600	
9831	ヤマダ電機	3,480	3,145.00	10,944,600	
9842	アークランドサカモト	400	1,086.00	434,400	
9843	ニトリホールディングス	1,500	6,100.00	9,150,000	
9850	グルメ杵屋	1,000	520.00	520,000	
9854	愛眼	600	308.00	184,800	
9861	吉野家ホールディングス	20	102,000.00	2,040,000	
9887	松屋フーズ	300	1,452.00	435,600	
9900	サガミチェーン	1,000	640.00	640,000	
9945	プレナス	800	1,294.00	1,035,200	
9946	ミニストップ	500	1,367.00	683,500	

9948	アークス	1,300	1,697.00	2,206,100	
9956	パロー	1,600	1,288.00	2,060,800	
9974	ベルク	400	1,159.00	463,600	
9979	大庄	400	1,016.00	406,400	
9983	ファーストリテイリング	1,500	17,380.00	26,070,000	
9989	サンドラッグ	1,400	2,895.00	4,053,000	
9990	東京デリカ	200	1,168.00	233,600	
9993	ヤマザワ	200	1,315.00	263,000	
9994	やまや	200	1,065.00	213,000	
9997	ペルーナ	950	601.00	570,950	
7150	島根銀行	200	1,047.00	209,400	
8303	新生銀行	66,000	121.00	7,986,000	
8304	あおぞら銀行	27,000	230.00	6,210,000	
8306	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	573,800	359.00	205,994,200	
8308	りそなホールディングス	77,900	331.00	25,784,900	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	158,000	237.00	37,446,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	57,300	2,436.00	139,582,800	
8324	第四銀行	10,000	258.00	2,580,000	
8325	北越銀行	8,000	152.00	1,216,000	
8327	西日本シティ銀行	27,000	185.00	4,995,000	
8331	千葉銀行	29,000	460.00	13,340,000	
8332	横浜銀行	48,000	366.00	17,568,000	
8333	常陽銀行	29,000	384.00	11,136,000	
8334	群馬銀行	17,000	381.00	6,477,000	
8336	武蔵野銀行	1,200	2,317.00	2,780,400	
8337	千葉興業銀行	1,400	408.00	571,200	
8338	筑波銀行	3,100	262.00	812,200	
8339	東京都民銀行	1,400	678.00	949,200	
8341	七十七銀行	12,000	308.00	3,696,000	
8342	青森銀行	6,000	236.00	1,416,000	
8343	秋田銀行	5,000	222.00	1,110,000	
8344	山形銀行	5,000	347.00	1,735,000	
8345	岩手銀行	500	3,600.00	1,800,000	
8346	東邦銀行	6,000	269.00	1,614,000	
8349	東北銀行	4,000	117.00	468,000	
8350	みちのく銀行	4,000	159.00	636,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	31,000	312.00	9,672,000	
8355	静岡銀行	22,000	809.00	17,798,000	
8356	十六銀行	9,000	269.00	2,421,000	
8358	スルガ銀行	7,000	962.00	6,734,000	
8359	八十二銀行	14,000	415.00	5,810,000	
8360	山梨中央銀行	5,000	322.00	1,610,000	
8361	大垣共立銀行	10,000	278.00	2,780,000	
8362	福井銀行	6,000	161.00	966,000	
8363	北國銀行	9,000	291.00	2,619,000	
8364	清水銀行	300	2,309.00	692,700	
8366	滋賀銀行	7,000	524.00	3,668,000	

8367	南都銀行	8,000	398.00	3,184,000	
8368	百五銀行	7,000	352.00	2,464,000	
8369	京都銀行	14,000	706.00	9,884,000	
8374	三重銀行	3,000	172.00	516,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	53,000	128.00	6,784,000	
8379	広島銀行	22,000	286.00	6,292,000	
8381	山陰合同銀行	4,000	569.00	2,276,000	
8382	中国銀行	6,000	1,107.00	6,642,000	
8383	鳥取銀行	3,000	153.00	459,000	
8385	伊予銀行	8,000	618.00	4,944,000	
8386	百十四銀行	8,000	313.00	2,504,000	
8387	四国銀行	6,000	198.00	1,188,000	
8388	阿波銀行	6,000	480.00	2,880,000	
8390	鹿児島銀行	5,000	507.00	2,535,000	
8392	大分銀行	4,000	266.00	1,064,000	
8393	宮崎銀行	5,000	196.00	980,000	
8394	肥後銀行	6,000	479.00	2,874,000	
8395	佐賀銀行	5,000	176.00	880,000	
8396	十八銀行	5,000	205.00	1,025,000	
8397	沖縄銀行	600	3,290.00	1,974,000	
8399	琉球銀行	1,500	1,005.00	1,507,500	
8409	八千代銀行	400	1,474.00	589,600	
8410	セブン銀行	25,500	216.00	5,508,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	974,900	124.00	120,887,600	
8415	紀陽ホールディングス	30,000	110.00	3,300,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	8,000	669.00	5,352,000	
8521	長野銀行	3,000	149.00	447,000	
8522	名古屋銀行	7,000	260.00	1,820,000	
8524	北洋銀行	11,600	204.00	2,366,400	
8527	愛知銀行	300	4,295.00	1,288,500	
8529	第三銀行	4,000	140.00	560,000	
8530	中京銀行	3,000	174.00	522,000	
8536	東日本銀行	3,000	172.00	516,000	
8537	大光銀行	3,000	200.00	600,000	
8541	愛媛銀行	5,000	206.00	1,030,000	
8542	トマト銀行	3,000	140.00	420,000	
8543	みなと銀行	7,000	142.00	994,000	
8544	京葉銀行	6,000	356.00	2,136,000	
8545	関西アーバン銀行	11,000	102.00	1,122,000	
8550	栃木銀行	4,000	284.00	1,136,000	
8551	北日本銀行	200	2,165.00	433,000	
8558	東和銀行	8,000	77.00	616,000	
8562	福島銀行	9,000	53.00	477,000	
8563	大東銀行	5,000	71.00	355,000	
8600	トモニホールディングス	5,700	331.00	1,886,700	
8713	フィデアホールディングス	4,500	157.00	706,500	
8714	池田泉州ホールディングス	6,300	499.00	3,143,700	
8473	S B Iホールディングス	9,600	622.00	5,971,200	
8595	ジャフコ	1,000	1,863.00	1,863,000	

8601	大和証券グループ本社	75,000	321.00	24,075,000	
8604	野村ホールディングス	154,700	294.00	45,481,800	
8609	岡三証券グループ	6,000	317.00	1,902,000	
8613	丸三証券	2,300	296.00	680,800	
8614	東洋証券	3,000	143.00	429,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	9,000	305.00	2,745,000	
8617	光世証券	2,000	74.00	148,000	
8622	水戸証券	2,000	143.00	286,000	
8624	いちよし証券	1,700	446.00	758,200	
8628	松井証券	4,500	563.00	2,533,500	
8692	だいこう証券ビジネス	500	299.00	149,500	
8698	マネックスグループ	85	14,000.00	1,190,000	
8703	カブドットコム証券	3,100	230.00	713,000	
8706	極東証券	1,000	656.00	656,000	
8707	岩井コスモホールディングス	700	278.00	194,600	
8742	小林洋行	300	180.00	54,000	
8630	N K S Jホールディングス	16,800	1,471.00	24,712,800	
8725	M S & A D インシュアランスグループホールディングス	22,600	1,371.00	30,984,600	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	7,300	1,419.00	10,358,700	
8750	第一生命保険	405	90,700.00	36,733,500	
8766	東京海上ホールディングス	29,300	2,093.00	61,324,900	
8795	T & Dホールディングス	26,000	852.00	22,152,000	
8253	クレディセゾン	6,700	1,802.00	12,073,400	
8424	芙蓉総合リース	700	2,148.00	1,503,600	
8425	興銀リース	1,100	2,009.00	2,209,900	
8439	東京センチュリーリース	1,800	1,596.00	2,872,800	
8511	日本証券金融	2,900	361.00	1,046,900	
8512	大阪証券金融	1,400	176.00	246,400	
8515	アイフル	6,250	279.00	1,743,750	
8519	ポケットカード	1,100	335.00	368,500	
8566	リコーリース	500	1,878.00	939,000	
8570	イオンクレジットサービス	2,800	1,698.00	4,754,400	
8572	アコム	1,530	2,404.00	3,678,120	
8584	ジャックス	4,000	320.00	1,280,000	
8585	オリエントコーポレーション	15,000	158.00	2,370,000	
8586	日立キャピタル	1,500	1,624.00	2,436,000	
8591	オリックス	3,940	8,250.00	32,505,000	
8593	三菱ＵＦＪリース	1,910	3,470.00	6,627,700	
8772	アサックス	2	79,300.00	158,600	
8793	N E C キャピタルソリューション	300	1,109.00	332,700	
2353	日本駐車場開発	93	4,370.00	406,410	
3003	ヒューリック	8,900	644.00	5,731,600	
3225	東京建物不動産販売	400	266.00	106,400	
3228	三栄建築設計	200	711.00	142,200	
3231	野村不動産ホールディングス	3,600	1,479.00	5,324,400	
3258	常和ホールディングス	100	1,461.00	146,100	
4666	パーク 2 4	4,000	1,361.00	5,444,000	

8801	三井不動産	36,000	1,724.00	62,064,000	
8802	三菱地所	53,000	1,619.00	85,807,000	
8803	平和不動産	1,400	964.00	1,349,600	
8804	東京建物	14,000	335.00	4,690,000	
8806	ダイビル	1,900	660.00	1,254,000	
8815	東急不動産	17,000	462.00	7,854,000	
8818	京阪神ビルディング	1,200	371.00	445,200	
8830	住友不動産	18,000	2,265.00	40,770,000	
8833	東宝不動産	800	448.00	358,400	
8840	大京	12,000	205.00	2,460,000	
8841	テーオーシー	2,600	437.00	1,136,200	
8842	東京楽天地	1,000	298.00	298,000	
8848	レオパレス 2 1	6,000	239.00	1,434,000	
8860	フジ住宅	1,000	421.00	421,000	
8864	空港施設	900	365.00	328,500	
8869	明和地所	500	350.00	175,000	
8870	住友不動産販売	280	3,535.00	989,800	
8871	ゴールドクレスト	600	1,250.00	750,000	
8875	東栄住宅	500	855.00	427,500	
8877	日本エスリード	400	685.00	274,000	
8879	東急リパブル	800	1,051.00	840,800	
8880	飯田産業	700	722.00	505,400	
8881	日神不動産	500	420.00	210,000	
8895	アーネストワン	1,300	1,185.00	1,540,500	
8897	タカラレーベン	800	908.00	726,400	
8904	サンヨーハウジング名古屋	4	84,000.00	336,000	
8905	イオンモール	3,500	2,093.00	7,325,500	
8907	フージャースコーポレーション	10	62,700.00	627,000	
8915	タクトホーム	4	88,700.00	354,800	
8923	トーセイ	8	33,400.00	267,200	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	47	69,600.00	3,271,200	
8934	サンフロンティア不動産	8	35,150.00	281,200	
8944	ランドビジネス	5	15,110.00	75,550	
8999	グランディハウス	200	643.00	128,600	
9706	日本空港ビルデング	2,600	880.00	2,288,000	
1954	日本工営	3,000	259.00	777,000	
2120	ネクスト	100	665.00	66,500	
2127	日本M & A センター	400	2,525.00	1,010,000	
2128	ノバレーゼ	1	53,400.00	53,400	
2131	アコーディア・ゴルフ	35	54,300.00	1,900,500	
2151	タケエイ	100	1,908.00	190,800	
2168	パソナグループ	8	49,000.00	392,000	
2170	リンクアンドモチベーション	5	32,150.00	160,750	
2174	G C A サヴィアングループ	4	99,600.00	398,400	
2175	エス・エム・エス	2	164,200.00	328,400	
2181	テンプホールディングス	1,100	982.00	1,080,200	
2193	クックパッド	200	2,413.00	482,600	
2301	学情	400	263.00	105,200	
2305	スタジオアリス	300	1,242.00	372,600	

2309	シミックホールディングス	300	1,185.00	355,500	
2322	N E C フィールドینگ	600	926.00	555,600	
2331	総合警備保障	2,900	1,124.00	3,259,600	
2371	カカクコム	1,100	2,838.00	3,121,800	
2378	ルネサンス	400	545.00	218,000	
2398	ツクイ	300	1,780.00	534,000	
2413	エムスリー	19	154,200.00	2,929,800	
2418	ベストブライダル	1	85,400.00	85,400	
2432	ディー・エヌ・エー	3,900	2,642.00	10,303,800	
2433	博報堂 D Y ホールディングス	1,110	4,585.00	5,089,350	
2440	ぐるなび	600	885.00	531,000	
2450	一休	5	44,500.00	222,500	
2466	P G M ホールディングス	11	64,500.00	709,500	
2749	J P ホールディングス	200	969.00	193,800	
4282	イーピーエス	5	223,700.00	1,118,500	
4301	アミューズ	300	1,722.00	516,600	
4310	ドリームインキュベータ	4	66,900.00	267,600	
4319	T A C	300	130.00	39,000	
4321	ケネディクス	76	11,590.00	880,840	
4324	電通	7,300	1,818.00	13,271,400	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	24	7,680.00	184,320	
4337	ぴあ	200	1,082.00	216,400	
4343	イオンファンタジー	300	1,112.00	333,600	
4544	みらかホールディングス	2,100	3,270.00	6,867,000	
4641	アルプス技研	500	642.00	321,000	
4651	サニックス	1,200	233.00	279,600	
4653	ダイオーズ	200	502.00	100,400	
4661	オリエンタルランド	2,400	10,710.00	25,704,000	
4665	ダスキン	2,200	1,528.00	3,361,600	
4668	明光ネットワークジャパン	700	836.00	585,200	
4671	ファルコ S D ホールディングス	400	939.00	375,600	
4678	秀英予備校	200	280.00	56,000	
4679	田谷	100	684.00	68,400	
4680	ラウンドワン	2,500	412.00	1,030,000	
4681	リゾートトラスト	1,400	1,502.00	2,102,800	
4694	ビー・エム・エル	500	2,049.00	1,024,500	
4696	ワタベウェディング	200	632.00	126,400	
4708	もしもしホットライン	1,300	1,170.00	1,521,000	
4711	東急コミュニティー	200	2,872.00	574,400	
4714	リソー教育	82	6,040.00	495,280	
4724	ウェアハウス	200	202.00	40,400	
4732	ユー・エス・エス	900	8,420.00	7,578,000	
4745	東京個別指導学院	600	142.00	85,200	
4801	セントラルスポーツ	200	1,153.00	230,600	
5261	リゾートソリューション	1,000	159.00	159,000	
8876	リロ・ホールディング	300	2,725.00	817,500	
9603	エイチ・アイ・エス	700	2,431.00	1,701,700	
9616	共立メンテナンス	400	1,729.00	691,600	
9619	イチネンホールディングス	800	466.00	372,800	

9621	建設技術研究所	600	485.00	291,000	
9622	スペース	400	729.00	291,600	
9628	燦ホールディングス	200	1,350.00	270,000	
9632	スバル興業	1,000	249.00	249,000	
9633	東京テアトル	3,000	101.00	303,000	
9671	よみうりランド	2,000	260.00	520,000	
9672	東京都競馬	6,000	120.00	720,000	
9675	常磐興産	2,000	120.00	240,000	
9678	カナモト	1,000	975.00	975,000	
9681	東京ドーム	6,000	258.00	1,548,000	
9715	トランス・コスモス	1,100	869.00	955,900	
9716	乃村工藝社	2,000	300.00	600,000	
9722	藤田観光	2,000	266.00	532,000	
9726	近畿日本ツーリスト	3,000	96.00	288,000	
9728	日本管財	300	1,480.00	444,000	
9729	トーカイ	400	2,046.00	818,400	
9731	白洋舎	1,000	210.00	210,000	
9735	セコム	8,300	4,030.00	33,449,000	
9740	セントラル警備保障	400	794.00	317,600	
9743	丹青社	1,000	238.00	238,000	
9744	メイテック	1,200	1,736.00	2,083,200	
9747	アサツー ディ・ケイ	1,300	1,809.00	2,351,700	
9755	応用地質	800	944.00	755,200	
9757	船井総合研究所	800	524.00	419,200	
9760	進学会	500	282.00	141,000	
9783	ベネッセホールディングス	2,400	3,520.00	8,448,000	
9787	イオンディライト	800	1,623.00	1,298,400	
9788	ナック	200	1,759.00	351,800	
9792	ニチイ学館	1,500	724.00	1,086,000	
9793	ダイセキ	1,200	1,078.00	1,293,600	
合 計		11,854,128	—	7,882,174,640	

(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。

独立監査人の監査報告書

平成24年12月18日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 渉
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23年11月8日から平成24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24年11月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. 財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年12月18日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 渉
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23年11月8日から平成24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24年11月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. 財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月15日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 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、「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23年4月1日から平成24年3月31日までの第53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きが実施される。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24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）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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月7日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽太典明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 秋宗勝彦
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成24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24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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