

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年10月8日提出
【計算期間】	第14期(自 平成26年7月9日至 平成27年7月8日)
【ファンド名】	上場インデックスファンドTOPIX
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	森川 晃
【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】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町2番1号

## 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

TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行ない、TOPIX(東証株価指数)の計算方法に従ってポートフォリオを構成し、原則としてそれを維持することにより、基準価額が同指数の動きと高位に連動することをめざします。

※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全銘柄を対象に、浮動株調整後の時価総額を指数として算出します。算出方法は、基準時を昭和43年(1968年)1月4日(終値)に置き、その日の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。有償増資、新規上場、上場廃止など、市況以外の要因による時価総額の変動に影響されないよう時価総額を修正し、指数の連続性を確保しています。日本の代表的な株価指数として海外でも定着しております。

$$\text{TOPIX} = \frac{\text{算出時の時価総額(円)}}{\text{基準時の時価総額(円)}} \times 100$$

## 「TOPIX」の著作権などについて

- ・ 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。
- ・ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止、またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ・ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ・ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・ 当ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当ファンドの純資産価額とTOPIXの間に乖離が発生することがあります。
- ・ 当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ・ 株式会社東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資アドバイスをする義務を負いません。
- ・ 以上の項目に限らず、株式会社東京証券取引所は、当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## ファンドの基本的性格

## 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)	独立区分	補足分類
単位型投信	国内	株式	MMF	インデックス型
		債券		
追加型投信	海外	不動産投信	MRF	特殊型
		その他資産 ( )		
	内外	資産複合	ETF	

(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。

#### ETF

投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。

#### 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	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル	
大型株 中小型株	年2回	日本	
債券 一般	年4回	北米	日経225
公債	年6回 (隔月)	欧州	
社債	年12回 (毎月)	アジア	
その他債券 クレジット属性 ( )		オセアニア	TOPIX
不動産投信	日々	中南米	
その他資産 ( )	その他 ( )	アフリカ	その他 ( )
資産複合 ( )		中近東 (中東)	
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。

株式 一般

当ファンドは、株式に投資を行いません。「株式 一般」とは、大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。

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。

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

当ファンドは、契約型の投資信託ですが、以下の点で通常の投資信託とは異なる仕組みが採り入れられています。

## 1. 受益権を東京証券取引所に上場しており、取引時間中であればいつでも売買が可能です。

- ・ 売買単位は100口単位です。(有価証券届出書提出日現在)
- ・ 売買手数料は、取扱会社が定めるものによります。
- ・ 取引方法は原則として株式と同様です。

※詳しくは、取扱会社へお問い合わせください。

## 2. 株式をもって受益権の取得申込みを行いません。

ユニット株式の評価額を取得申込受付日の基準価額で除した口数(100口未満切上げ)を申込単位として、その整数倍とします。

※「ユニット株式」とは、委託会社がTOPIX(東証株価指数)に連動すると想定する、TOPIX(東証株価指数)における各構成銘柄の委託会社が指定する株数の株式すべてを指すものとします。

## 3. 解約請求による途中換金をすることはできません。

## 4. 受益権をもって株式と交換することができます。

※取得申込時に提出されたTOPIX(東証株価指数)構成銘柄と、交換時に取得される各株式は一致するものではありません。

※取得申込時に取得された受益権の口数と、交換時に必要とされる口数は一致するものではありません。

### 主な投資制限

- ・ 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ・ 投資することを指図する株式は、原則としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式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。
- ・ 外貨建資産への投資は行ないません。

### 分配方針

- ・ 信託財産から生ずる配当等収益などから諸経費などを控除後、全額分配することを原則とします。
- ※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

- ・ 30兆円相当額を限度として有価証券または金銭を追加信託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】

平成13年12月20日

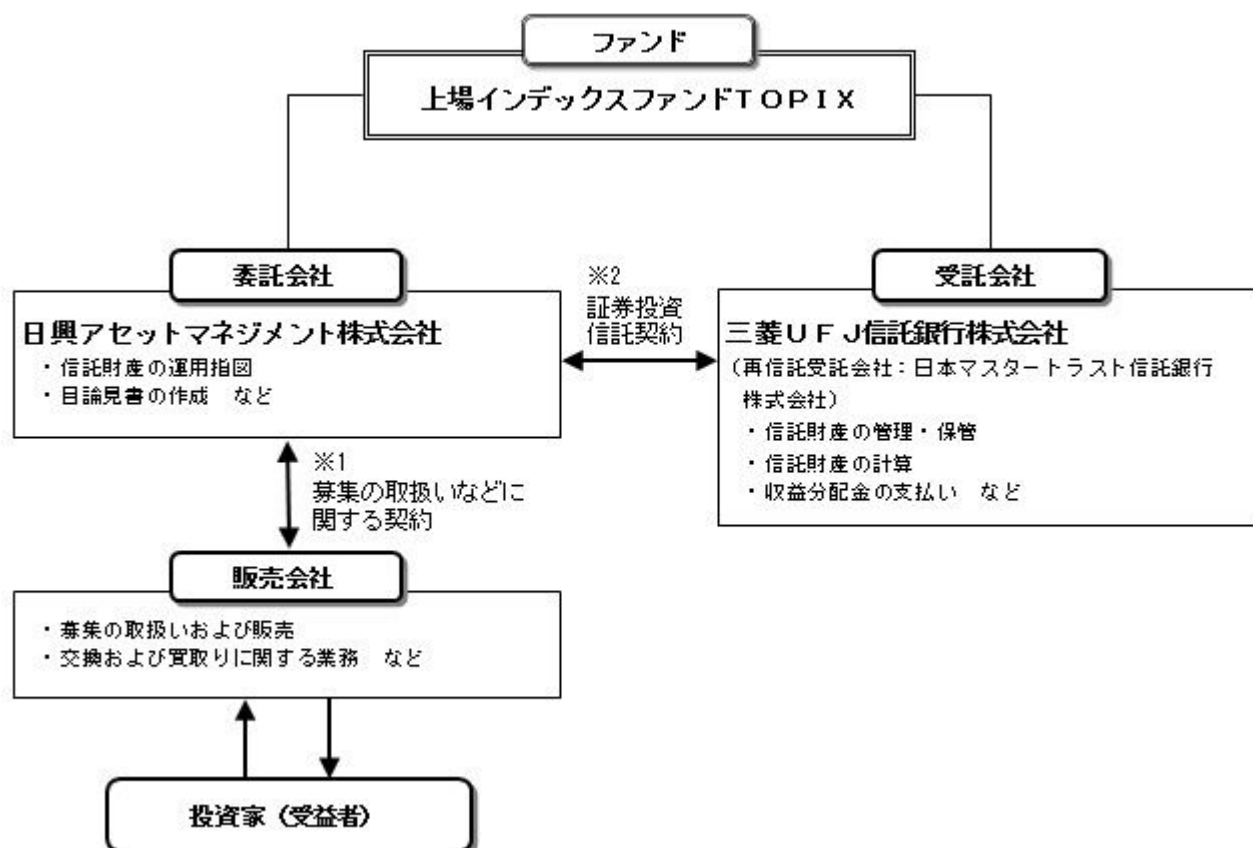
- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

平成14年1月9日

- ・ ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場

### (3) 【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



- 1 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の。販売会社が行なう募集の取扱い、交換および買取りに関する業務の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 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27年7月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

平成11年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

## 3) 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

- ・TOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行ない、信託財産中に占める各銘柄の株数の比率をTOPIX（東証株価指数）における個別銘柄の株数の構成比率に相当する比率に維持することを目的とした運用を行ない、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。
- ・次に掲げる場合には、信託財産の構成を調整するための指図を行なうことがあります。

TOPIX（東証株価指数）の計算方法が変更された場合

TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の変更または資本異動などにより、TOPIX(東証株価指数)における個別銘柄の時価総額の修正が行なわれた場合  
追加信託および受益権と株式との交換の指図を行なう場合  
その他流動性を維持するために委託会社が必要と認めた場合

- ・ TOPIX(東証株価指数)への連動率を向上させるため、資金動向に応じて約款に定める有価証券指数等先物取引などを行なう場合があります。
- ・ ファンドが信託を終了することとなった場合は、上記の方針のような運用ができない場合があります。

## (2)【投資対象】

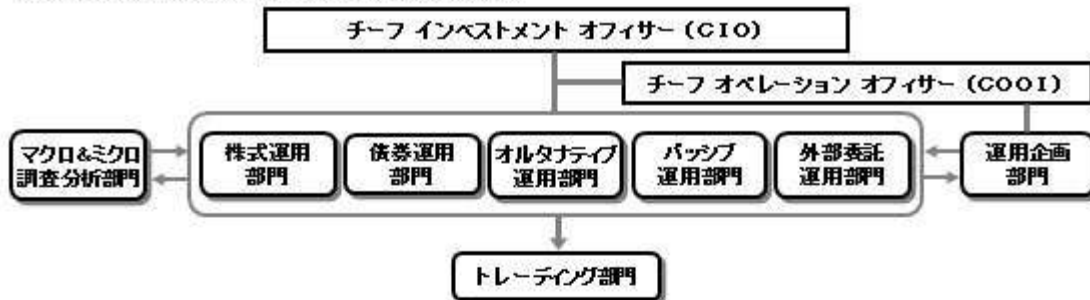
TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式を主要投資対象とします。

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。

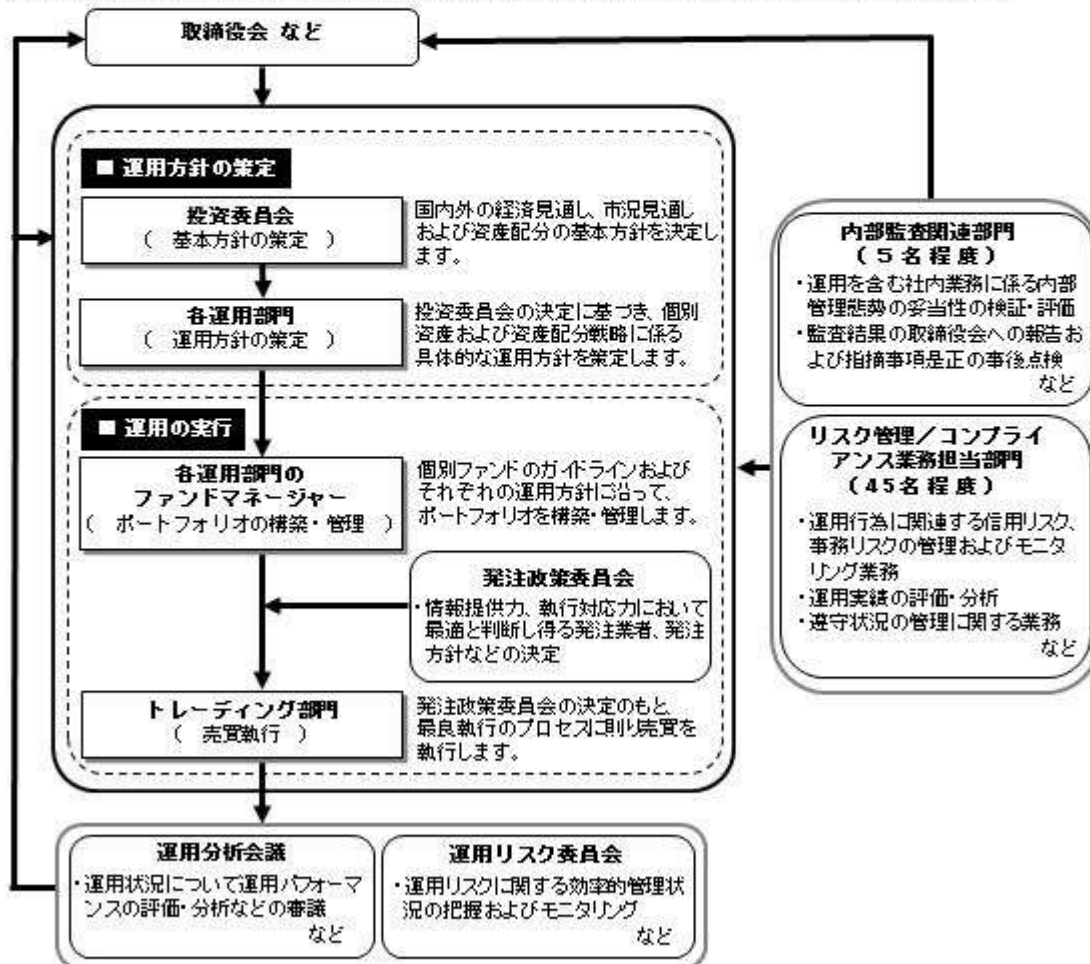
- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第26条に定めるものに限ります。)
- 3) 金銭債権  
主として株式に投資するほか、次に掲げる株式以外の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)および金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 3) 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。)
- 4) コール・ローン  
次の取引ができます。
  - 1) 先物取引等
  - 2) 有価証券の貸付

## (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27年7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

- 1) 信託財産から生ずる配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。）と前期から繰り越した分配準備積立金は、毎計算期末において諸経費、約款に定める報酬および当該報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、前期から繰り越した負数の分配準備積立金があるときはその全額を補てんした後、その残額を受益者に分配します。ただし、収益分配金額の調整のためその一部または全部を信託財産内に留保したときは分配準備積立金として積み立て、次期以降の分配に充てることができる。なお、諸経費、約款に定める報酬および当該報酬に係る消費税等に相当する金額ならびに負数の分配準備積立金を控除しきれないときは、その差額を負数の分配準備積立金として次期に繰り越します。
- 2) 毎計算期末に信託財産から生じたイ)に掲げる利益の合計額は、ロ)に掲げる損失を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を補てんした後、次期に繰り越します。



イ) 有価証券売買益(評価益を含む)、先物取引等取引益(評価益を含む)、追加信託差益金、交換差益金

ロ) 有価証券売買損(評価損を含む)、先物取引等取引損(評価損を含む)、追加信託差損金、交換差損金

#### 収益分配金の支払い

原則として受託会社が、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、受益者があらかじめ指定した預金口座などに振り込みます。なお、受益者が取扱会社と別途収益分配金の取扱いに係る契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとします。

### (5) 【投資制限】

#### 約款に定める投資制限

- 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、原則としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式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) わが国の金融商品取引所における東証株価指数先物取引および東証株価指数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東証株価指数先物取引および東証株価指数オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 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を超えないものとします。
- 6) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

#### 法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3 【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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。

#### 有価証券の貸付などにおけるリスク

有価証券の貸付行為などにおいては、取引相手先リスク(取引の相手方の倒産などにより貸付契約が不履行になったり、契約が解除されたりするリスク)を伴ない、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。貸付契約が不履行や契約解除の事態を受けて、貸付契約に基づく担保金を用いて清算手続きを行なう場合においても、買戻しを行なう際に、市場の時価変動などにより調達コストが担保金を上回る可能性もあり、不足金額をファンドが負担することにより、その結果ファンドに損害が発生する恐れがあります。

#### < T O P I X (東証株価指数)と基準価額の主なカイ離要因 >

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

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

#### 金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額のカイ離

当ファンドは東京証券取引所に上場され公に取引されますが、市場価格は、主に当ファンドの需要、当ファンドの運用成果および投資者が代替的な投資と比較して当ファンドが全般的にどの程度魅力的であるか、などの評価に左右されます。したがって、当ファンドの市場価格が、基準価額を下回って取引されるかまたは上回って取引されるかは予測することはできません。

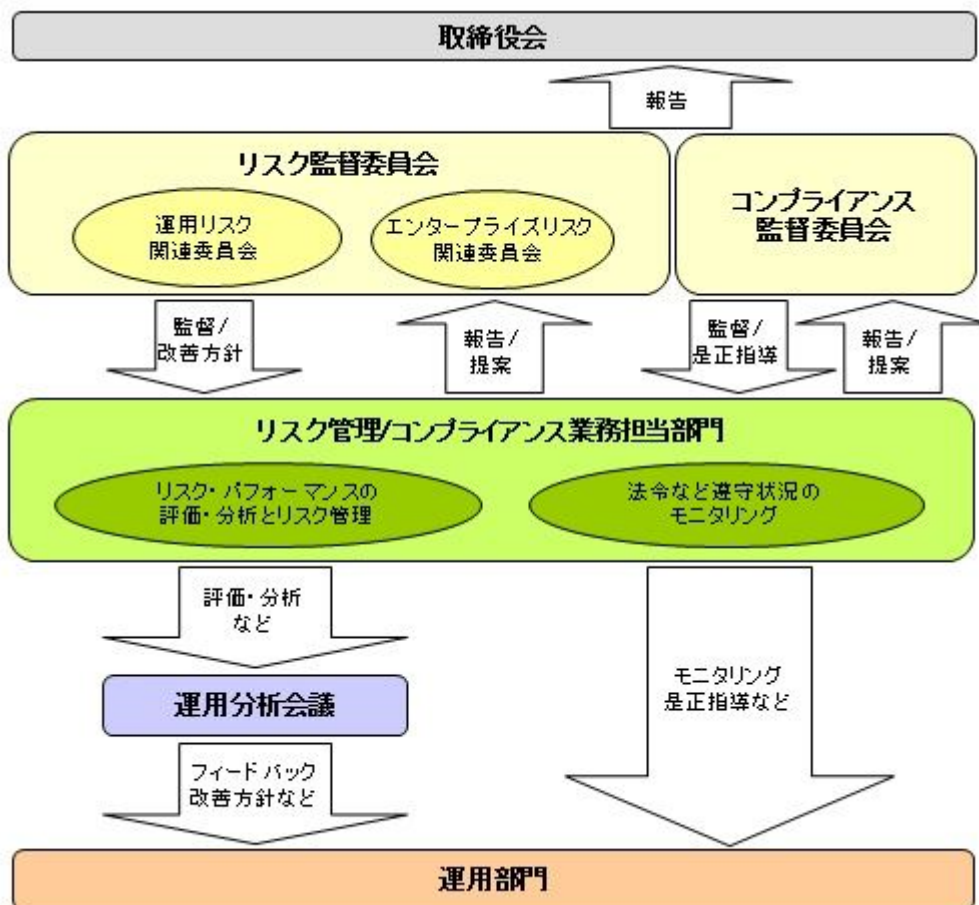
#### < その他の留意事項 >

- ・ 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・交換の取り扱いを停止することもあります。
- ・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・交換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・交換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カイ離する可能性があります。

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

## (2) リスク管理体制



### 全社的なリスク管理

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

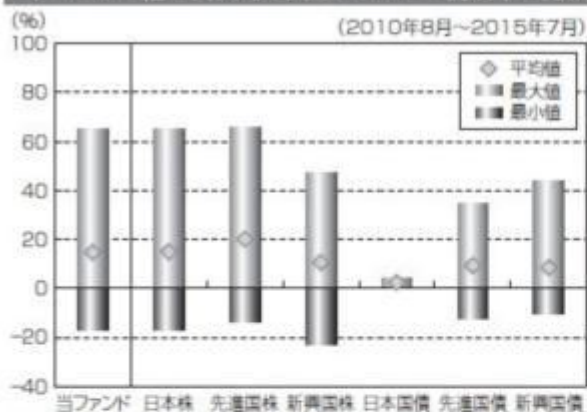
### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成27年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

**(参考情報)****当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較****当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%)**

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	14.8%	14.9%	20.1%	10.6%	2.4%	9.3%	8.5%
最大値	64.9%	65.0%	65.7%	47.4%	4.5%	34.9%	43.7%
最小値	-17.1%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-12.7%	-10.1%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2010年8月から2015年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

**<各資産クラスの指数>**

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

日本国債……NOMURA-ボンドパフォーマンス・インデックス国債

先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

**代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について****東証株価指数(TOPIX、配当込)**

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

**MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)**

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

**MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)**

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

**NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債**

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

**シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)**

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

**当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移**

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の100口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2010年8月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

Index LLC に帰属します。

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

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### （1）【申込手数料】

販売会社は、取得申込者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

##### （2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

販売会社は、受益者が交換を行なうときおよび受益権の買取りを行なうときは、当該受益者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金手数料は、換金時の事務手続きなどに係る対価です。

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0.2376%（税抜0.22%）以内（有価証券届出書提出日現在、年0.09504%（税抜0.088%））の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

当ファンドの信託報酬が税抜0.088%（有価証券届出書提出日現在）の場合の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率		
合計	委託会社	受託会社
0.088%	0.060%	0.028%

委託会社	委託した資金の運用の対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期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・報酬およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。

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

用。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息。

有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料に0.54（税抜0.5）以内（有価証券届出書提出日現在、0.54（税抜0.5））を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は1：1とし、信託報酬と同時期に支払います。

受益権の上場に係る費用ならびに「T O P I X（東証株価指数）」その他これに類する標章の使用料。

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、特定株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

個人受益者の場合

### 1) 受益権の売却時の課税

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

### 2) 収益分配金の受取り時の課税

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

確定申告等により、売却時の差損（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、売却時の差益（譲渡益）および収益分配金（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。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### <平成28年1月1日以降>

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、平成28年4月1日より、未成年者口座内の少額上場株式等に係る配当所得及び譲渡所得等の非課税措置（ジュニアNISA）が開始され、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となる予定です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## 3) 受益権と現物株式との交換

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、受益権の売却時と同様の取扱いとなります。

## 法人受益者の場合

## 1) 受益権の売却時の課税

受益権の売却価額と取得価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されます。

## 2) 収益分配金の受取り時の課税

・収益分配金は配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれ、他の法人所得と合算して課税されます。

・収益分配金は、原則として益金不算入の対象となります。

## 3) 受益権と現物株式との交換

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、受益権の売却時と同様の取扱いとなります。

上記は平成27年10月8日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

以下の運用状況は2015年7月31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	1,316,141,094,360	99.74
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		3,366,070,757	0.26
合計（純資産総額）		1,319,507,165,117	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	3,403,000,000	0.26

(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	7,458,000	7,934.65	59,176,619,700	8,253.00	61,550,874,000	4.66
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	42,807,000	841.27	36,012,244,890	900.00	38,526,300,000	2.92
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	4,034,800	5,233.12	21,114,592,576	5,544.00	22,368,931,200	1.70

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	74,839,600	253.57	18,977,776,150	267.90	20,049,528,840	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,175,400	4,354.08	18,180,025,632	4,763.50	19,889,517,900	1.51
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2,821,300	6,934.12	19,563,232,756	6,881.00	19,413,365,300	1.47
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,864,600	3,835.96	18,660,411,016	3,979.50	19,358,675,700	1.47
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	3,580,700	4,274.32	15,305,093,088	4,813.50	17,235,699,450	1.31
日本	株式	KDDI	情報・通信業	5,419,800	2,945.22	15,962,503,356	3,150.50	17,075,079,900	1.29
日本	株式	ソニー	電気機器	3,798,700	3,344.12	12,703,308,644	3,533.00	13,420,807,100	1.02
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	2,121,600	5,932.09	12,585,522,144	6,240.00	13,238,784,000	1.00
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2,231,800	5,292.83	11,812,537,994	5,724.00	12,774,823,200	0.97
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	990,700	11,055.42	10,952,604,594	12,250.00	12,136,075,000	0.92
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	6,339,700	1,772.48	11,236,991,456	1,867.00	11,836,219,900	0.90
日本	株式	ファナック	電気機器	562,800	23,927.71	13,466,515,188	20,680.00	11,638,704,000	0.88
日本	株式	キヤノン	電気機器	2,910,200	3,882.47	11,298,764,194	3,972.00	11,559,314,400	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	2,161,500	4,854.42	10,492,828,830	5,165.00	11,164,147,500	0.85
日本	株式	三菱商事	卸売業	4,088,900	2,580.60	10,551,815,340	2,679.50	10,956,207,550	0.83
日本	株式	三菱地所	不動産業	3,967,000	2,534.96	10,056,186,320	2,755.00	10,929,085,000	0.83
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	4,114,700	2,329.67	9,585,893,149	2,614.50	10,757,883,150	0.82
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	484,100	21,078.90	10,204,295,490	21,720.00	10,514,652,000	0.80
日本	株式	日立製作所	電気機器	12,980,000	774.66	10,055,086,800	804.40	10,441,112,000	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	567,100	20,232.65	11,473,935,815	18,400.00	10,434,640,000	0.79
日本	株式	三井不動産	不動産業	2,829,000	3,298.20	9,330,607,800	3,528.50	9,982,126,500	0.76
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	10,907,100	843.55	9,200,684,205	881.40	9,613,517,940	0.73
日本	株式	パナソニック	電気機器	6,588,000	1,568.67	10,334,397,960	1,457.00	9,598,716,000	0.73
日本	株式	花王	化学	1,522,700	5,753.93	8,761,509,211	6,291.00	9,579,305,700	0.73
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	7,587,800	1,191.37	9,039,877,286	1,198.50	9,093,978,300	0.69
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	1,910,600	4,503.57	8,604,523,911	4,678.00	8,937,786,800	0.68
日本	株式	第一生命保険	保険業	3,418,400	2,238.42	7,651,814,928	2,522.00	8,621,204,800	0.65

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.37
		建設業	2.62
		食料品	4.50
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.23
		化学	5.88
		医薬品	4.96
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.92
		ガラス・土石製品	0.93



鉄鋼	1.29
非鉄金属	0.91
金属製品	0.58
機械	4.55
電気機器	11.80
輸送用機器	10.98
精密機器	1.43
その他製品	1.59
電気・ガス業	2.31
陸運業	4.19
海運業	0.27
空運業	0.69
倉庫・運輸関連業	0.21
情報・通信業	7.01
卸売業	4.04
小売業	4.87
銀行業	9.71
証券、商品先物取引業	1.42
保険業	2.77
その他金融業	1.34
不動産業	2.85
サービス業	3.21
合 計	99.74

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2015年 09月	買建	205	日本円	3,235,419,860	3,403,000,000	0.26

(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。

## (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)		東京証券取引所 取引価格(円)
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き	
第5計算期間末 (2006年 7月 8日)	703,779	710,970	1,576.78	1,592.89	1,575

第6計算期間末	(2007年 7月 8日)	826,215	834,364	1,787.47	1,805.10	1,785
第7計算期間末	(2008年 7月 8日)	334,805	344,173	1,275.18	1,310.86	1,275
第8計算期間末	(2009年 7月 8日)	185,742	190,837	875.94	899.97	874
第9計算期間末	(2010年 7月 8日)	226,138	229,413	850.67	862.99	851
第10計算期間末	(2011年 7月 8日)	259,711	264,533	865.65	881.72	868
第11計算期間末	(2012年 7月 8日)	378,397	384,822	768.54	781.59	769
第12計算期間末	(2013年 7月 8日)	602,953	612,496	1,173.87	1,192.45	1,174
第13計算期間末	(2014年 7月 8日)	790,486	803,304	1,280.23	1,300.99	1,281
第14計算期間末	(2015年 7月 8日)	1,238,974	1,255,990	1,593.91	1,615.80	1,595
	2014年 7月末日	804,728		1,293.99		1,293
	8月末日	817,787		1,282.66		1,281
	9月末日	802,477		1,340.34		1,338
	10月末日	826,377		1,347.79		1,345
	11月末日	844,985		1,425.43		1,424
	12月末日	885,162		1,423.94		1,424
	2015年 1月末日	904,295		1,431.53		1,433
	2月末日	1,016,884		1,541.95		1,542
	3月末日	1,097,398		1,573.51		1,576
	4月末日	1,129,827		1,624.50		1,625
	5月末日	1,242,130		1,707.62		1,704
	6月末日	1,294,063		1,664.78		1,662
	7月末日	1,319,507		1,671.50		1,668

(注)計算期間末が東京証券取引所の休業日にあたる場合、東京証券取引所取引価格は直前営業日の終値を表示しています。

### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第5期	2005年 7月 9日～2006年 7月 8日	16.1100
第6期	2006年 7月 9日～2007年 7月 8日	17.6300
第7期	2007年 7月 9日～2008年 7月 8日	35.6800
第8期	2008年 7月 9日～2009年 7月 8日	24.0300
第9期	2009年 7月 9日～2010年 7月 8日	12.3200
第10期	2010年 7月 9日～2011年 7月 8日	16.0700
第11期	2011年 7月 9日～2012年 7月 8日	13.0500
第12期	2012年 7月 9日～2013年 7月 8日	18.5800
第13期	2013年 7月 9日～2014年 7月 8日	20.7600
第14期	2014年 7月 9日～2015年 7月 8日	21.8900

### 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
---	----	--------

第5期	2005年 7月 9日～2006年 7月 8日	35.28
第6期	2006年 7月 9日～2007年 7月 8日	14.48
第7期	2007年 7月 9日～2008年 7月 8日	26.66
第8期	2008年 7月 9日～2009年 7月 8日	29.42
第9期	2009年 7月 9日～2010年 7月 8日	1.48
第10期	2010年 7月 9日～2011年 7月 8日	3.65
第11期	2011年 7月 9日～2012年 7月 8日	9.71
第12期	2012年 7月 9日～2013年 7月 8日	55.16
第13期	2013年 7月 9日～2014年 7月 8日	10.83
第14期	2014年 7月 9日～2015年 7月 8日	26.21

(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5期	2005年 7月 9日～2006年 7月 8日	225,183,000	219,359,555
第6期	2006年 7月 9日～2007年 7月 8日	149,980,000	134,094,553
第7期	2007年 7月 9日～2008年 7月 8日	75,019,000	274,688,561
第8期	2008年 7月 9日～2009年 7月 8日	53,938,000	104,444,518
第9期	2009年 7月 9日～2010年 7月 8日	127,653,000	73,867,906
第10期	2010年 7月 9日～2011年 7月 8日	72,871,300	38,684,676
第11期	2011年 7月 9日～2012年 7月 8日	263,649,600	71,312,149
第12期	2012年 7月 9日～2013年 7月 8日	199,396,100	178,109,648
第13期	2013年 7月 9日～2014年 7月 8日	216,920,100	113,108,630
第14期	2014年 7月 9日～2015年 7月 8日	337,726,500	177,866,039

(注)解約口数は交換口数を表示しております。

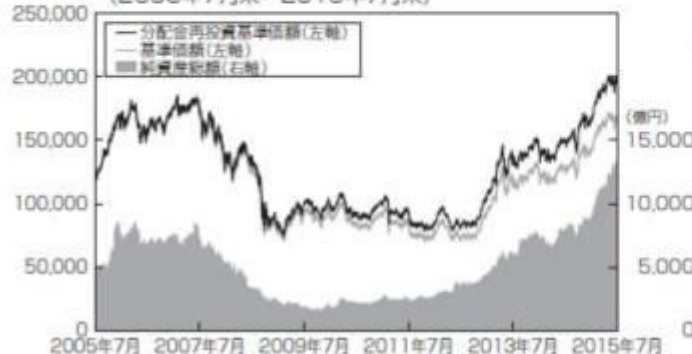
#### 参考情報

## 運用実績

2015年7月31日現在

### 基準価額・純資産の推移

(円) (2005年7月末～2015年7月末)



基準価額……………167,150円  
純資産総額……………13,195.07億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の100口当たりの値です。  
※分配金再投資基準価額は、2005年7月末の基準価額を起点として指数化しています。  
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものととして計算した理論上のものであることにご留意ください。

## 分配の推移(税引前、100口当たり)

2011年7月	2012年7月	2013年7月	2014年7月	2015年7月	設定来累計
1,607円	1,305円	1,858円	2,076円	2,189円	23,885円

## 主要な資産の状況

## &lt;資産構成比率&gt;

組入資産	比率
株式	100.00%
うち先物	0.26%
現金その他	0.26%

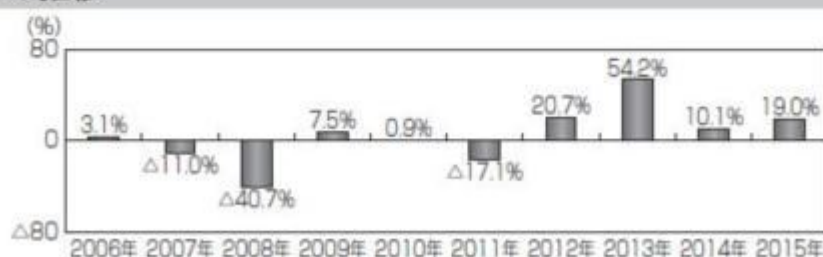
※対純資産総額比です。

## &lt;組入上位10銘柄&gt;

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	4.66%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.92%
3	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.70%
4	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.52%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.51%
6	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.47%
7	本田技研工業	輸送用機器	1.47%
8	日本たばこ産業	食料品	1.31%
9	KDDI	情報・通信業	1.29%
10	ソニー	電気機器	1.02%

※対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
 ※2015年は、2015年7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。  
 ※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## (1) 申込方法

- 取得申込者は、販売会社所定の方法により、その保有する株式をもって取得の申込みを行なうものとします。当該株式は、TOPIX(東証株価指数)における各構成銘柄の株式の数の構成比率に相当するものとして委託会社が定める比率により構成される各銘柄の株式とします。申込時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。
- なお、拋出された株式の評価額が、取得する受益権口数の評価額(取得申込受益権口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額)に満たない場合、その差額に相当する部分に限り金銭をもって充当することができます。また取得申込者が、TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式の発行会社またはその子会社(会社法第2条第3号に規定する子会社をいいます。当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。)である場合には、取得申込みに係る株式のうち当該発行会社等の株式の評価額に相当する部分に限り金銭をもって充当することができます。
- 当ファンドは、東京証券取引所に上場しております。委託会社は、当該金融商品取引所が定める諸規則などを遵守し、当該金融商品取引所が諸規則などに基づいて行なう売買取引の停止または上場廃止その他の措置に従うものとします。

## (2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

### （３）取扱時間

原則として、午後３時までに販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。ただし、取得申込者がＴＯＰＩＸ（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合の受付締切時間は午後２時までとします。なお、販売会社によっては、取得の申込みの受付締切時間および受付方法が異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### （４）取得申込日が次に該当することとなる場合には、取得の申込みの受付は行ないません。

- １）ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）構成銘柄の権利落日（配当落日を除きます。）の前営業日以降の４営業日間
- ２）ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）構成銘柄の変更および増減資などに伴う株数の変更日の３営業日前以降の６営業日間
- ３）ファンドの計算期間終了日（決算日）の前営業日
- ４）ファンドが信託を終了することとなる場合において、信託終了日の直前５営業日間
- ５）１）～４）のほか、委託会社が約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

なお、上記１）～４）に該当する期日および期間であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向などに鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微であるなどと判断される期日および期間については、取得の申込みを受け付ける場合があります。

### （５）申込単位

ユニット株式の評価額を取得申込受付日の基準価額で除した口数（100口未満切上げ）を申込単位とし、その整数倍とします。

### （６）受付の中止および取消

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

金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

## ２【換金（解約）手続等】

### （１）受益権の解約

受益者は、信託期間中において解約の請求をすることはできません。

### （２）受益権と信託財産に属する株式との交換

受益者は、委託会社が指定する販売会社に対し、最小交換請求口数の整数倍の受益権をもって、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式と交換すること（以下「交換」といいます。）を請求することができます。最小交換請求口数とは、当該口数に交換請求日の基準価額を乗じて得た額が、交換請求日において委託会社がＴＯＰＩＸ（東証株価指数）に連動すると想定する、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）における各構成銘柄の評価額の合計に相当する口数として委託会社が定める口数とします。

受益者が交換によって取得できる個別銘柄の株数は、交換請求日の基準価額に基づいて計算された株数とし、金融商品取引所が定める一売買単位（以下「取引所売買単位」といいます。）の整数倍とします。

交換請求日の午後３時までに委託会社に交換請求をして受理されたものを、当日の受付分として取り扱います。ただし、受益者がＴＯＰＩＸ（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合の受付締切時間は午後２時までとします。なお、販売会社によっては、交換請求の受付締切時間および受付方法が異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

受益者は交換時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。

交換請求日が次に該当することとなる場合には、交換請求の受付は行ないません。

- １）ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）構成銘柄の権利落日（配当落日を除きます。）の前営業日以降の４営業日間
- ２）ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）構成銘柄の変更および増減資などに伴う株数の変更日の３営業日前以降の６営業日間
- ３）ファンドの計算期間終了日（決算日）の前営業日および前々営業日
- ４）ファンドが信託を終了することとなる場合において、信託終了日の直前５営業日間

5) 1) ~ 4) のほか、委託会社が約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れのあるやむを得ない事情が生じたものと認めたとき

なお、上記1) ~ 4) に該当する期日および期間であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向などに鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微であるなどと判断される期日および期間については、交換請求を受け付ける場合があります。

交換請求を行なった受益者が交換に係る株式の発行会社等である場合には、委託会社は、交換請求を受け付けた口数から当該発行会社等の株式の評価額の合計に相当する金額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる株式(当該発行会社等の株式を除きます。)を交換するものとしします。

受託会社は、原則として販売会社に交換請求日から起算して4営業日目から信託財産に属する株式の交付を行ないます。当該販売会社は、受託会社から交付を受けた株式を所定の手続きを経て受益者に速やかに交付するものとしします。

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、約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合は、交換請求の受付を中止すること、および既に受け付けた交換請求の受付を取り消すことができます。

交換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交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換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交換請求を受け付けたものとして取り扱います。

### (3) 受益権の買取り

受益者は、保有する受益権口数の合計が金融商品取引所の定める受益権の取引単位に満たない場合は、委託会社が指定する販売会社に当該受益権の買取りを請求することができます。

原則として、午後3時までに委託会社が指定する販売会社において所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分としします。受益権の買取価額は、買取約定日の基準価額としします。

受益者は買取時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとしします。

委託会社が指定する販売会社は、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100口あたりに換算した価額で表示することがあります。

## &lt;基準価額算出の流れ&gt;



## 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。

## &lt;主な資産の評価方法&gt;

## 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。

## 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。

## &lt;委託会社の照会先&gt;

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（平成13年12月20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7月9日から翌年7月8日までとします。

## (5) 【その他】

## 信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、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。
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 受益権の口数が300万口を下回る事となった場合
  - ロ) 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合

八) TOPIX（東証株価指数）が廃止された場合

二) TOPIX（東証株価指数）の計算方法の変更などに伴って委託会社または受託会社が必要と認めた信託約款の変更が、異議申立の結果、行なわれないこととなった場合

ホ) 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

へ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ト) 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。）

チ) 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。

#### 信託約款の変更

1) 委託会社は、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

3) この信託約款の変更に関する異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

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

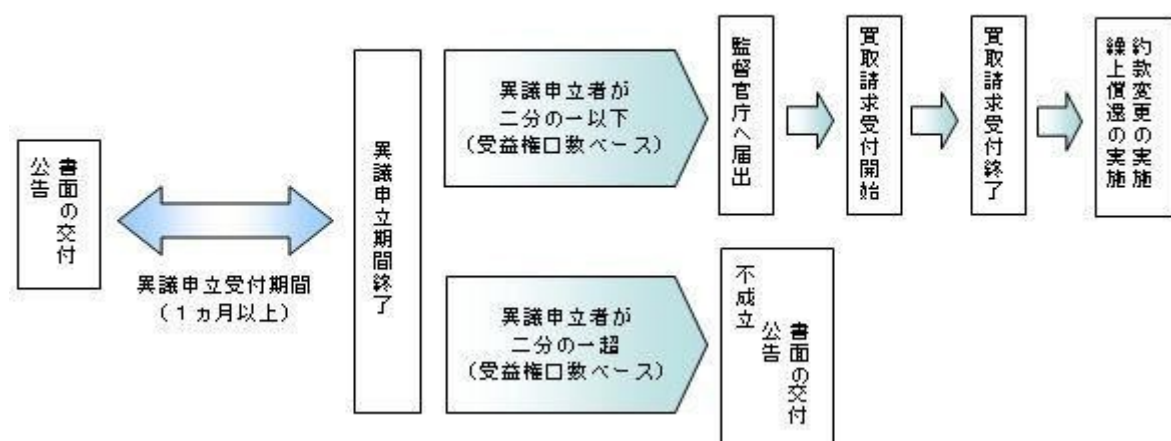
#### 異議の申立て

1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、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。

#### 信託終了時の交換等

1) ファンドが信託を終了することとなる場合は、交換に必要な受益権口数を有する受益者に対しては、信託終了時における当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権と引き換えに交換するものとします。

2) 交換は、委託会社の指定する販売会社で取り扱うものとします。



- 3) 受益者が取得する個別銘柄の株数は、償還価額に基づいて計算された株数とし、取引所売買単位の整数倍とします。
- 4) 受益者は交換時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。
- 5) 受益者がTOPIX(東証株価指数)構成銘柄である株式の発行会社等である場合は、当該発行会社等の株式の評価額の合計に相当する受益権について金銭をもって返還するものとします。
- 6) 交換に必要な受益権口数を有しない受益者は、償還価額をもって委託会社が指定する販売会社を買取請求を行なうものとします。この場合、受益者は販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。
- 7) 受益者が、株式の交換および買取りに係る金銭の返還について、信託終了日から10年間請求をしないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

#### 運用報告書の作成

投資信託及び投資法人に関する法律により、運用報告書の作成・交付は行ないません。

#### 関係法人との契約について

販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### (1) 収益分配金受領権

- ・名義登録手続きによって受益者を確定し、当該受益者に対して収益分配金の支払いを行ないます。当ファンドの収益分配金は、計算期間終了日現在において、受託会社に名義登録している受益者に支払われます。受益者は、取扱会社を経由して名義登録を行なうことができます。
- ・計算期間終了日現在において、氏名または名称および住所が受託会社に登録されている受益者は、ファンドの収益分配金を登録されている受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・計算期間終了日現在において、受益証券の所持者であっても、受託会社に名義登録されていない受益者は、収益分配金の受領権を有しません。
- ・ただし、受益者が収益分配金について支払開始日から5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) 受益権と信託財産に属する株式との交換権

- ・受益者は、一定口数以上の受益権をもって、その持分に相当する信託財産に属する株式と交換することを請求できます。
- ・ただし、受益者が信託の終了による株式の交換および買取りに係る金銭の返還について、信託終了日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、委託会社に帰属します。

### (3) 受益権の買取請求権

受益者が保有する受益権の口数の合計が、金融商品取引所の定める受益権の取引単位に満たない場合は、販売会社に対して、受益権の買取りを請求することができます。

### (4) 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】

- (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14期計算期間(平成26年7月9日から平成27年7月8日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

#### 【上場インデックスファンドTOPIX】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第13期 平成26年 7月 8日現在	第14期 平成27年 7月 8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	83,130,957,905	75,642,990,660
株式	788,341,635,850	1,235,855,856,242
派生商品評価勘定	53,871,262	-
未収入金	6,976,761,215	11,427,425,710
未収配当金	595,283,840	1,165,966,167
未収利息	12,247	14,148
前払金	-	132,706,000
その他未収収益	44,629,258	42,800,748
流動資産合計	879,143,151,577	1,324,267,759,675
資産合計	879,143,151,577	1,324,267,759,675
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	174,412,920
前受金	248,030,000	-
未払金	-	303,425,320
未払収益分配金	12,818,397,791	17,015,469,173
未払受託者報酬	239,700,952	325,692,116
未払委託者報酬	478,160,789	656,532,018
未払利息	2,895,149	673,745
受入担保金	74,762,011,875	66,672,678,187
その他未払費用	107,550,263	144,035,942
流動負債合計	88,656,746,819	85,292,919,421
負債合計	88,656,746,819	85,292,919,421
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	615,604,171,377	774,985,050,994
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	174,882,233,381	463,989,789,260
（分配準備積立金）	11,676,521	17,779,527
元本等合計	790,486,404,758	1,238,974,840,254
純資産合計	790,486,404,758	1,238,974,840,254
負債純資産合計	879,143,151,577	1,324,267,759,675

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自 至	平成25年 7月 9日 平成26年 7月 8日	自 至	平成26年 7月 9日 平成27年 7月 8日
営業収益				
受取配当金		13,080,744,310		17,472,080,131
受取利息		27,146,167		14,109,140
有価証券売買等損益		63,574,078,835		193,984,553,903
派生商品取引等損益		861,055,570		1,187,032,184
その他収益		691,448,301		833,700,336
営業収益合計		78,234,473,183		213,491,475,694
営業費用				
支払利息		25,521,229		11,858,326
受託者報酬		239,700,952		325,692,116
委託者報酬		478,160,789		656,532,018
その他費用		233,995,198		304,234,968
営業費用合計		977,378,168		1,298,317,428
営業利益又は営業損失（ ）		77,257,095,015		212,193,158,266
経常利益又は経常損失（ ）		77,257,095,015		212,193,158,266
当期純利益又は当期純損失（ ）		77,257,095,015		212,193,158,266
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		-		-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		90,849,188,326		174,882,233,381
剰余金増加額又は欠損金減少額		44,426,326,541		167,646,434,233
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		44,426,326,541		167,646,434,233
剰余金減少額又は欠損金増加額		24,831,978,710		73,716,567,447
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		24,831,978,710		73,716,567,447
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		12,818,397,791		17,015,469,173
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		174,882,233,381		463,989,789,260

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

		第13期 平成26年 7月 8日現在	第14期 平成27年 7月 8日現在
1.	期首元本額	512,104,135,787円	615,604,171,377円
	期中追加設定元本額	216,269,339,700円	336,713,320,500円
	期中一部交換元本額	112,769,304,110円	177,332,440,883円
2.	受益権の総数	617,456,541口	777,317,002口
3.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	2,647,560,000円	2,203,896,010円
4.	有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券は次のとおりであります。 株式	70,782,785,872円	62,240,036,600円

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第13期 自 平成25年 7月 9日 至 平成26年 7月 8日		第14期 自 平成26年 7月 9日 至 平成27年 7月 8日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 当期配当等収益額	13,773,817,549円	A 当期配当等収益額	18,308,031,281円
B 分配準備積立金	8,113,702円	B 分配準備積立金	11,676,521円

C 配当等収益額合計 (A+B)	13,781,931,251円	C 配当等収益額合計 (A+B)	18,319,707,802円
D 経費	951,856,939円	D 経費	1,286,459,102円
E 収益分配可能額 (C-D)	12,830,074,312円	E 収益分配可能額 (C-D)	17,033,248,700円
F 収益分配金額	12,818,397,791円	F 収益分配金額	17,015,469,173円
G 次期繰越金 (分配準備積立金) (E-F)	11,676,521円	G 次期繰越金 (分配準備積立金) (E-F)	17,779,527円
H 口数	617,456,541口	H 口数	777,317,002口
I 分配金額 (100口当たり)	2,076円	I 分配金額 (100口当たり)	2,189円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	第13期 自 平成25年 7月 9日 至 平成26年 7月 8日	第14期 自 平成26年 7月 9日 至 平成27年 7月 8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、オプション取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第13期 平成26年 7月 8日現在	第14期 平成27年 7月 8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	(1)有価証券 同左 (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。	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13期（平成26年 7月 8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	59,527,489,510
合計	59,527,489,510

第14期（平成27年 7月 8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	171,163,503,125
合計	171,163,503,125

## (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)

第13期（平成26年 7月 8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	2,092,050,000	-	2,146,200,000	54,150,000

合計	2,092,050,000	-	2,146,200,000	54,150,000
----	---------------	---	---------------	------------

第14期(平成27年 7月 8日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,292,806,000	-	3,118,500,000	174,306,000
	合計	3,292,806,000	-	3,118,500,000	174,306,000

(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)

第13期 平成26年 7月 8日現在		第14期 平成27年 7月 8日現在	
1口当たり純資産額	1,280.23円	1口当たり純資産額	1,593.91円
(100口当たり純資産額)	(128,023円)	(100口当たり純資産額)	(159,391円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	255,000	281.00	71,655,000	貸付有価証券 127,000株
日本水産	734,400	346.00	254,102,400	



マルハニチロ	122,100	2,067.00	252,380,700	
サカタのタネ	96,200	2,244.00	215,872,800	
ホクト	66,400	2,426.00	161,086,400	
住石ホールディングス	167,700	123.00	20,627,100	貸付有価証券 88,800株
日鉄鉱業	163,000	535.00	87,205,000	
三井松島産業	395,000	132.00	52,140,000	
国際石油開発帝石	3,147,800	1,322.50	4,162,965,500	
日本海洋掘削	17,500	3,340.00	58,450,000	貸付有価証券 11,100株
石油資源開発	85,200	3,695.00	314,814,000	
K & O エナジーグループ	40,400	1,695.00	68,478,000	
ショーボンドホールディングス	57,800	5,010.00	289,578,000	貸付有価証券 34,600株
ミライト・ホールディングス	183,800	1,360.00	249,968,000	
タマホーム	45,700	532.00	24,312,400	貸付有価証券 30,000株
サンヨーホームズ	8,200	620.00	5,084,000	
ダイセキ環境ソリューション	6,700	2,066.00	13,842,200	貸付有価証券 2,300株
安藤・間	398,700	647.00	257,958,900	
東急建設	212,100	893.00	189,405,300	
コムシスホールディングス	266,000	1,781.00	473,746,000	
ミサワホーム	70,800	1,051.00	74,410,800	
高松コンストラクショングループ	45,100	2,590.00	116,809,000	
東建コーポレーション	22,300	7,840.00	174,832,000	貸付有価証券 8,200株
ヤマウラ	29,500	502.00	14,809,000	貸付有価証券 200株
大成建設	3,103,000	711.00	2,206,233,000	
大林組	1,792,000	943.00	1,689,856,000	
清水建設	1,828,000	1,029.00	1,881,012,000	
飛鳥建設	412,000	202.00	83,224,000	貸付有価証券 256,900株
長谷工コーポレーション	747,200	1,538.00	1,149,193,600	
松井建設	65,000	623.00	40,495,000	
銭高組	84,000	341.00	28,644,000	貸付有価証券 46,000株
鹿島建設	2,626,000	589.00	1,546,714,000	

不動テトラ	453,000	197.00	89,241,000	貸付有価証券 297,000株
大末建設	24,100	750.00	18,075,000	
鉄建建設	364,000	356.00	129,584,000	貸付有価証券 240,000株
日鉄住金テックスエンジ	110,000	605.00	66,550,000	
西松建設	644,000	468.00	301,392,000	貸付有価証券 275,000株
三井住友建設	2,425,700	151.00	366,280,700	貸付有価証券 1,503,900株
大豊建設	160,000	575.00	92,000,000	貸付有価証券 100,000株
前田建設工業	399,000	836.00	333,564,000	貸付有価証券 263,000株
佐田建設	213,000	128.00	27,264,000	貸付有価証券 7,000株
ナカノフドー建設	45,200	633.00	28,611,600	
奥村組	567,000	617.00	349,839,000	
大和小田急建設	33,000	1,125.00	37,125,000	
東鉄工業	71,700	2,475.00	177,457,500	
イチケン	64,000	257.00	16,448,000	貸付有価証券 40,000株
浅沼組	195,000	170.00	33,150,000	貸付有価証券 8,000株
戸田建設	748,000	545.00	407,660,000	
熊谷組	750,000	341.00	255,750,000	
青木あすなろ建設	39,600	831.00	32,907,600	
北野建設	124,000	317.00	39,308,000	
植木組	72,000	237.00	17,064,000	
三井ホーム	77,000	553.00	42,581,000	
矢作建設工業	74,700	845.00	63,121,500	
ピーエス三菱	63,700	405.00	25,798,500	貸付有価証券 18,100株
日本ハウスホールディングス	99,300	578.00	57,395,400	貸付有価証券 46,100株
大東建託	223,300	12,175.00	2,718,677,500	
新日本建設	72,400	569.00	41,195,600	
N I P P O	137,000	2,045.00	280,165,000	
東亜道路工業	109,000	458.00	49,922,000	

前田道路	183,000	2,152.00	393,816,000	
日本道路	174,000	598.00	104,052,000	
東亜建設工業	448,000	199.00	89,152,000	
若築建設	344,000	168.00	57,792,000	貸付有価証券 72,000株
東洋建設	179,400	457.00	81,985,800	貸付有価証券 119,100株
五洋建設	663,000	487.00	322,881,000	貸付有価証券 312,400株
大林道路	68,000	666.00	45,288,000	
世紀東急工業	87,100	536.00	46,685,600	
福田組	89,000	842.00	74,938,000	貸付有価証券 5,000株
住友林業	440,600	1,474.00	649,444,400	
日本基礎技術	72,500	405.00	29,362,500	貸付有価証券 8,600株
日成ビルド工業	162,000	379.00	61,398,000	貸付有価証券 33,000株
ヤマダ・エスバイエルホーム	280,000	94.00	26,320,000	貸付有価証券 167,000株
巴コーポレーション	75,000	414.00	31,050,000	貸付有価証券 2,100株
パナホーム	223,000	838.00	186,874,000	
大和ハウス工業	1,749,700	2,842.50	4,973,522,250	
ライト工業	95,700	938.00	89,766,600	
積水ハウス	1,879,400	1,834.50	3,447,759,300	
日特建設	80,800	460.00	37,168,000	
北陸電気工事	29,000	1,236.00	35,844,000	
ユアテック	94,000	847.00	79,618,000	
西部電気工業	49,000	458.00	22,442,000	
四電工	50,000	430.00	21,500,000	
中電工	86,300	2,302.00	198,662,600	
関電工	272,000	751.00	204,272,000	
きんでん	397,300	1,585.00	629,720,500	
東京エネシス	67,000	1,241.00	83,147,000	
トーエネック	84,000	758.00	63,672,000	
住友電設	47,300	1,682.00	79,558,600	
日本電設工業	97,400	2,129.00	207,364,600	

協和エクシオ	253,600	1,407.00	356,815,200	
新日本空調	50,200	1,024.00	51,404,800	
N D S	96,000	319.00	30,624,000	
九電工	108,000	2,067.00	223,236,000	
三機工業	122,300	940.00	114,962,000	
日揮	601,000	2,305.50	1,385,605,500	
中外炉工業	176,000	266.00	46,816,000	
ヤマト	52,000	393.00	20,436,000	
太平電業	81,000	1,178.00	95,418,000	
高砂熱学工業	165,000	1,495.00	246,675,000	貸付有価証券 2,700株
三晃金属工業	58,000	233.00	13,514,000	貸付有価証券 34,000株
朝日工業社	65,000	438.00	28,470,000	
明星工業	99,600	600.00	59,760,000	
大気社	85,600	2,878.00	246,356,800	
ダイダン	80,000	801.00	64,080,000	
日比谷総合設備	77,000	1,586.00	122,122,000	
東芝プラントシステム	97,000	1,424.00	138,128,000	
O S J Bホールディングス	81,400	243.00	19,780,200	貸付有価証券 48,000株
東洋エンジニアリング	288,000	305.00	87,840,000	貸付有価証券 181,000株
千代田化工建設	431,000	1,079.00	465,049,000	貸付有価証券 88,000株
新興プランテック	123,600	1,041.00	128,667,600	
日本製粉	367,000	746.00	273,782,000	
日清製粉グループ本社	655,200	1,630.00	1,067,976,000	
日東富士製粉	46,000	342.00	15,732,000	
昭和産業	246,000	494.00	121,524,000	
鳥越製粉	47,800	711.00	33,985,800	
中部飼料	57,100	934.00	53,331,400	
フィード・ワンホールディングス	359,500	179.00	64,350,500	貸付有価証券 23,000株
東洋精糖	88,000	123.00	10,824,000	
日本甜菜製糖	306,000	202.00	61,812,000	
三井製糖	235,000	478.00	112,330,000	
塩水港精糖	65,600	259.00	16,990,400	

森永製菓	539,000	521.00	280,819,000	
中村屋	137,000	452.00	61,924,000	
江崎グリコ	138,000	5,870.00	810,060,000	
名糖産業	27,000	1,320.00	35,640,000	
不二家	342,000	194.00	66,348,000	貸付有価証券 87,000株
山崎製パン	438,000	1,889.00	827,382,000	貸付有価証券 281,000株
第一屋製パン	79,000	120.00	9,480,000	
モロゾフ	91,000	391.00	35,581,000	貸付有価証券 50,000株
亀田製菓	33,300	4,715.00	157,009,500	貸付有価証券 4,600株
寿スピリッツ	14,000	3,670.00	51,380,000	貸付有価証券 7,300株
カルビー	221,400	5,160.00	1,142,424,000	
森永乳業	538,000	451.00	242,638,000	
六甲バター	26,900	1,756.00	47,236,400	貸付有価証券 14,800株
ヤクルト本社	320,400	7,200.00	2,306,880,000	貸付有価証券 19,700株
明治ホールディングス	177,000	16,020.00	2,835,540,000	
雪印メグミルク	140,600	1,545.00	217,227,000	
プリマハム	357,000	362.00	129,234,000	貸付有価証券 210,000株
日本ハム	439,000	2,813.00	1,234,907,000	
伊藤ハム	328,000	655.00	214,840,000	貸付有価証券 177,000株
林兼産業	194,000	160.00	31,040,000	
丸大食品	307,000	448.00	137,536,000	貸付有価証券 150,000株
米久	18,500	2,484.00	45,954,000	貸付有価証券 9,800株
S Foods	37,400	2,470.00	92,378,000	貸付有価証券 20,000株
サッポロホールディングス	979,000	446.00	436,634,000	
アサヒグループホールディングス	1,201,100	3,730.50	4,480,703,550	
キリンホールディングス	2,421,500	1,664.50	4,030,586,750	
宝ホールディングス	468,800	960.00	450,048,000	

オエノンホールディングス	151,000	216.00	32,616,000	
養命酒製造	35,000	988.00	34,580,000	
コカ・コーラウエスト	202,400	2,067.00	418,360,800	貸付有価証券 4,700株
コカ・コーライーストジャパン	181,800	2,030.00	369,054,000	
サントリー食品インターナショナル	358,100	4,815.00	1,724,251,500	
ダイドードリンコ	30,200	5,300.00	160,060,000	貸付有価証券 400株
伊藤園	177,300	2,520.00	446,796,000	貸付有価証券 110,800株
キーコーヒー	52,700	2,004.00	105,610,800	
ユニカフェ	15,800	900.00	14,220,000	貸付有価証券 10,200株
ジャパンフーズ	7,500	1,112.00	8,340,000	貸付有価証券 4,200株
日清オイリオグループ	287,000	501.00	143,787,000	
不二製油	159,500	2,059.00	328,410,500	
かどや製油	5,700	2,696.00	15,367,200	貸付有価証券 900株
J - オイルミルズ	250,000	409.00	102,250,000	
キッコーマン	488,000	3,850.00	1,878,800,000	貸付有価証券 7,000株
味の素	1,378,000	2,602.00	3,585,556,000	
キューピー	304,000	2,500.00	760,000,000	
ハウス食品グループ本社	221,300	2,249.00	497,703,700	貸付有価証券 151,700株
カゴメ	231,100	1,959.00	452,724,900	貸付有価証券 152,100株
焼津水産化学工業	28,400	1,001.00	28,428,400	貸付有価証券 500株
アリアケジャパン	54,500	4,980.00	271,410,000	
エバラ食品工業	9,800	2,001.00	19,609,800	
ニチレイ	637,000	862.00	549,094,000	
東洋水産	312,100	4,365.00	1,362,316,500	
イトアンド	6,400	1,995.00	12,768,000	貸付有価証券 3,500株
日清食品ホールディングス	252,800	5,310.00	1,342,368,000	貸付有価証券 167,700株
永谷園	56,000	1,074.00	60,144,000	

一正蒲鉾	21,700	1,045.00	22,676,500	貸付有価証券 13,400株
フジッコ	57,000	2,339.00	133,323,000	
ロック・フィールド	31,100	3,080.00	95,788,000	貸付有価証券 19,000株
日本たばこ産業	3,311,600	4,237.00	14,031,249,200	
ケンコーマヨネーズ	19,600	1,685.00	33,026,000	
わらべや日洋	35,100	2,957.00	103,790,700	
なとり	27,700	1,463.00	40,525,100	貸付有価証券 16,700株
ユーグレナ	199,900	1,679.00	335,632,100	貸付有価証券 79,300株
ミヨシ油脂	207,000	156.00	32,292,000	
理研ビタミン	17,300	3,840.00	66,432,000	貸付有価証券 10,200株
片倉工業	70,000	1,310.00	91,700,000	
ゲンゼ	452,000	317.00	143,284,000	
東洋紡	2,212,000	184.00	407,008,000	
ユニチカ	1,631,000	57.00	92,967,000	貸付有価証券 979,000株
富士紡ホールディングス	273,000	271.00	73,983,000	
日清紡ホールディングス	355,000	1,330.00	472,150,000	
倉敷紡績	572,000	245.00	140,140,000	
シキボウ	324,000	124.00	40,176,000	
日本毛織	172,000	914.00	157,208,000	貸付有価証券 101,000株
大東紡織	85,000	79.00	6,715,000	貸付有価証券 59,000株
トーア紡コーポレーション	25,800	679.00	17,518,200	貸付有価証券 5,000株
ダイドーリミテッド	63,900	504.00	32,205,600	
帝国繊維	58,500	1,700.00	99,450,000	貸付有価証券 33,000株
帝人	2,283,000	444.00	1,013,652,000	
東レ	4,322,000	980.00	4,235,560,000	
サカイオーベックス	144,000	202.00	29,088,000	
住江織物	137,000	315.00	43,155,000	
日本フェルト	30,800	525.00	16,170,000	貸付有価証券 1,300株

イチカワ	36,000	348.00	12,528,000	
日本バイリーン	79,000	786.00	62,094,000	
日東製網	63,000	158.00	9,954,000	貸付有価証券 35,000株
芦森工業	118,000	202.00	23,836,000	貸付有価証券 63,000株
アツギ	469,000	114.00	53,466,000	
ダイニック	103,000	181.00	18,643,000	
セーレン	139,100	1,230.00	171,093,000	
東海染工	78,000	129.00	10,062,000	
小松精練	93,200	544.00	50,700,800	
ワコールホールディングス	332,000	1,400.00	464,800,000	
ホギメディカル	35,200	6,470.00	227,744,000	貸付有価証券 14,000株
レナウン	136,500	195.00	26,617,500	貸付有価証券 86,800株
クラウディア	14,000	611.00	8,554,000	貸付有価証券 600株
T S Iホールディングス	249,200	835.00	208,082,000	
三陽商会	293,000	327.00	95,811,000	
ナイガイ	220,000	64.00	14,080,000	貸付有価証券 69,000株
オンワードホールディングス	401,000	782.00	313,582,000	貸付有価証券 265,000株
ルック	94,000	213.00	20,022,000	
キムラタン	2,513,000	9.00	22,617,000	貸付有価証券 11,000株
ゴールドウイン	127,000	835.00	106,045,000	
デザート	127,400	1,775.00	226,135,000	
キング	29,300	432.00	12,657,600	貸付有価証券 15,300株
ヤマトインターナショナル	36,200	425.00	15,385,000	
特種東海製紙	324,000	298.00	96,552,000	
王子ホールディングス	2,291,000	519.00	1,189,029,000	
日本製紙	269,500	2,073.00	558,673,500	貸付有価証券 190,300株
三菱製紙	859,000	88.00	75,592,000	貸付有価証券 601,000株
北越紀州製紙	346,800	676.00	234,436,800	



中越パルプ工業	215,000	221.00	47,515,000	貸付有価証券 121,000株
巴川製紙所	84,000	250.00	21,000,000	貸付有価証券 54,000株
大王製紙	247,000	1,136.00	280,592,000	
レンゴー	494,000	479.00	236,626,000	貸付有価証券 345,000株
トモク	173,000	278.00	48,094,000	
ザ・バック	39,600	2,375.00	94,050,000	
クラレ	950,800	1,401.00	1,332,070,800	
旭化成	3,484,000	941.10	3,278,792,400	
共和レザー	36,900	912.00	33,652,800	
コープケミカル	82,000	104.00	8,528,000	貸付有価証券 45,000株
昭和電工	3,718,000	155.00	576,290,000	貸付有価証券 457,000株
住友化学	4,112,000	690.00	2,837,280,000	
日本化成	100,000	147.00	14,700,000	貸付有価証券 1,000株
住友精化	116,000	798.00	92,568,000	
日産化学工業	366,300	2,735.00	1,001,830,500	
ラサ工業	217,000	143.00	31,031,000	貸付有価証券 16,000株
クレハ	391,000	461.00	180,251,000	貸付有価証券 276,000株
多木化学	34,000	707.00	24,038,000	
テイカ	93,000	473.00	43,989,000	
石原産業	938,000	116.00	108,808,000	
片倉チッカリン	33,000	299.00	9,867,000	
日本曹達	358,000	751.00	268,858,000	
東ソー	1,394,000	665.00	927,010,000	
トクヤマ	868,000	225.00	195,300,000	貸付有価証券 612,000株
セントラル硝子	569,000	510.00	290,190,000	
東亜合成	349,700	950.00	332,215,000	
ダイソー	222,000	446.00	99,012,000	
関東電化工業	132,000	837.00	110,484,000	
電気化学工業	1,157,000	507.00	586,599,000	
信越化学工業	1,001,700	7,311.00	7,323,428,700	

日本カーバイド工業	187,000	213.00	39,831,000	
堺化学工業	226,000	425.00	96,050,000	
エア・ウォーター	494,000	2,080.00	1,027,520,000	
大陽日酸	717,100	1,411.00	1,011,828,100	貸付有価証券 452,000株
日本化学工業	209,000	218.00	45,562,000	
日本パーカラライジング	263,600	1,186.00	312,629,600	
高压ガス工業	83,000	631.00	52,373,000	
チタン工業	63,000	219.00	13,797,000	貸付有価証券 25,000株
四国化成工業	81,000	942.00	76,302,000	
戸田工業	108,000	345.00	37,260,000	貸付有価証券 70,000株
ステラ ケミファ	29,200	1,292.00	37,726,400	貸付有価証券 14,900株
保土谷化学工業	162,000	177.00	28,674,000	
日本触媒	439,000	1,626.00	713,814,000	
大日精化工業	231,000	585.00	135,135,000	
カネカ	754,000	839.00	632,606,000	
三菱瓦斯化学	961,000	645.00	619,845,000	
三井化学	2,539,000	432.00	1,096,848,000	
J S R	551,700	2,069.00	1,141,467,300	
東京応化工業	116,000	3,400.00	394,400,000	
大阪有機化学工業	40,600	686.00	27,851,600	
三菱ケミカルホールディングス	3,491,600	740.40	2,585,180,640	
日本合成化学工業	129,000	804.00	103,716,000	
ダイセル	785,600	1,529.00	1,201,182,400	
住友ベークライト	523,000	523.00	273,529,000	
積水化学工業	1,293,000	1,460.00	1,887,780,000	
日本ゼオン	481,000	1,089.00	523,809,000	
アイカ工業	167,900	2,720.00	456,688,000	
宇部興産	2,814,000	217.00	610,638,000	
積水樹脂	86,700	1,511.00	131,003,700	
タキロン	117,000	528.00	61,776,000	
旭有機材工業	198,000	253.00	50,094,000	
日立化成	276,000	2,110.00	582,360,000	
ニチバン	54,000	562.00	30,348,000	

リケンテクノス	90,500	481.00	43,530,500	
大倉工業	131,000	326.00	42,706,000	
積水化成成品工業	155,000	414.00	64,170,000	
群栄化学工業	147,000	320.00	47,040,000	貸付有価証券 32,000株
タイガースポリマー	28,200	769.00	21,685,800	
ミライアル	20,400	1,351.00	27,560,400	貸付有価証券 9,700株
ダイキアクシス	8,200	1,222.00	10,020,400	
ダイキョーニシカワ	17,600	4,150.00	73,040,000	
日本化薬	363,000	1,245.00	451,935,000	
カーリットホールディングス	44,400	591.00	26,240,400	
日本精化	46,600	907.00	42,266,200	
A D E K A	257,400	1,635.00	420,849,000	
日油	457,000	977.00	446,489,000	
新日本理化	87,600	225.00	19,710,000	貸付有価証券 51,800株
ハリマ化成グループ	47,000	478.00	22,466,000	
花王	1,502,200	5,747.00	8,633,143,400	
第一工業製薬	119,000	353.00	42,007,000	
ニイタカ	8,000	1,500.00	12,000,000	
三洋化成工業	172,000	889.00	152,908,000	
大日本塗料	320,000	180.00	57,600,000	
日本ペイントホールディングス	483,400	3,580.00	1,730,572,000	貸付有価証券 320,700株
関西ペイント	677,000	1,897.00	1,284,269,000	貸付有価証券 269,000株
神東塗料	42,000	212.00	8,904,000	
中国塗料	158,000	952.00	150,416,000	
日本特殊塗料	43,400	847.00	36,759,800	
藤倉化成	77,000	558.00	42,966,000	
太陽ホールディングス	45,500	4,815.00	219,082,500	
D I C	2,238,000	288.00	644,544,000	
サカティンクス	114,000	1,028.00	117,192,000	
東洋インキ S C ホールディングス	552,000	482.00	266,064,000	
T & K T O K A	18,100	2,217.00	40,127,700	
富士フイルムホールディングス	1,278,200	4,286.00	5,478,365,200	

資生堂	993,400	2,723.00	2,705,028,200	貸付有価証券 518,200株
ライオン	644,000	1,003.00	645,932,000	貸付有価証券 420,000株
高砂香料工業	180,000	514.00	92,520,000	
マンダム	55,900	5,270.00	294,593,000	
ミルボン	33,000	4,065.00	134,145,000	
ファンケル	129,700	1,677.00	217,506,900	貸付有価証券 85,400株
コーセー	90,300	10,510.00	949,053,000	
コタ	18,500	1,380.00	25,530,000	
ドクターシーラボ	37,900	4,445.00	168,465,500	貸付有価証券 25,100株
シーボン	6,200	2,675.00	16,585,000	貸付有価証券 3,500株
ポーラ・オルビスホールディングス	66,400	7,100.00	471,440,000	
ノエビアホールディングス	35,300	2,627.00	92,733,100	
アジュバンコスメジャパン	10,100	902.00	9,110,200	貸付有価証券 5,500株
エステー	37,900	1,060.00	40,174,000	
アグロ カネショウ	14,800	925.00	13,690,000	貸付有価証券 9,300株
コニシ	43,800	2,202.00	96,447,600	
長谷川香料	70,800	1,710.00	121,068,000	
星光PMC	31,200	928.00	28,953,600	貸付有価証券 21,800株
小林製薬	91,500	8,840.00	808,860,000	貸付有価証券 17,300株
荒川化学工業	47,000	1,399.00	65,753,000	
メック	43,200	838.00	36,201,600	貸付有価証券 25,500株
日本高純度化学	15,500	2,449.00	37,959,500	
JCU	14,900	4,730.00	70,477,000	
新田ゼラチン	33,700	720.00	24,264,000	貸付有価証券 19,200株
アース製薬	40,100	4,540.00	182,054,000	貸付有価証券 12,400株
イハラケミカル工業	86,500	1,416.00	122,484,000	貸付有価証券 53,500株
北興化学工業	58,000	483.00	28,014,000	

大成ラミック	15,400	2,853.00	43,936,200	貸付有価証券 5,500株
クミアイ化学工業	115,200	932.00	107,366,400	貸付有価証券 78,200株
日本農薬	127,500	1,106.00	141,015,000	貸付有価証券 90,000株
アキレス	474,000	153.00	72,522,000	
有沢製作所	94,400	862.00	81,372,800	
日東電工	431,600	9,509.00	4,104,084,400	
レック	18,400	1,326.00	24,398,400	
きもと	101,100	282.00	28,510,200	
藤森工業	47,900	3,590.00	171,961,000	
前澤化成工業	39,600	1,210.00	47,916,000	貸付有価証券 21,500株
J S P	41,900	1,904.00	79,777,600	貸付有価証券 19,600株
エフピコ	49,500	4,240.00	209,880,000	貸付有価証券 27,300株
天馬	43,300	1,932.00	83,655,600	
信越ポリマー	110,400	547.00	60,388,800	
東リ	142,000	311.00	44,162,000	
ニフコ	124,600	5,210.00	649,166,000	
日本バルカー工業	233,000	322.00	75,026,000	
ユニ・チャーム	1,130,800	2,843.50	3,215,429,800	
協和発酵キリン	668,000	1,558.00	1,040,744,000	
武田薬品工業	2,092,900	5,929.00	12,408,804,100	
アステラス製薬	6,254,200	1,771.00	11,076,188,200	
大日本住友製薬	395,300	1,373.00	542,746,900	貸付有価証券 279,300株
塩野義製薬	872,100	4,820.00	4,203,522,000	
田辺三菱製薬	650,700	1,956.00	1,272,769,200	
わかもと製薬	62,000	269.00	16,678,000	
あすか製薬	66,000	1,284.00	84,744,000	
日本新薬	127,000	3,935.00	499,745,000	
ピオフェルミン製薬	9,100	2,829.00	25,743,900	貸付有価証券 2,300株
中外製薬	556,000	4,365.00	2,426,940,000	
科研製薬	192,000	4,400.00	844,800,000	

エーザイ	736,600	8,172.00	6,019,495,200	
ロート製薬	253,900	1,972.00	500,690,800	
小野薬品工業	253,700	13,390.00	3,397,043,000	
久光製薬	157,600	4,830.00	761,208,000	
有機合成薬品工業	34,000	274.00	9,316,000	
持田製薬	38,400	6,920.00	265,728,000	
参天製薬	1,026,700	1,673.00	1,717,669,100	
扶桑薬品工業	184,000	290.00	53,360,000	
日本ケミファ	69,000	625.00	43,125,000	
ツムラ	176,000	2,620.00	461,120,000	貸付有価証券 124,400株
日医工	130,600	3,385.00	442,081,000	
キッセイ薬品工業	98,900	2,988.00	295,513,200	
生化学工業	106,700	1,996.00	212,973,200	
栄研化学	47,100	2,376.00	111,909,600	
日水製薬	22,700	1,358.00	30,826,600	
鳥居薬品	38,300	3,205.00	122,751,500	
JCRファーマ	42,900	2,843.00	121,964,700	貸付有価証券 21,600株
東和薬品	28,500	7,890.00	224,865,000	
富士製薬工業	15,100	2,149.00	32,449,900	
沢井製薬	88,400	7,040.00	622,336,000	貸付有価証券 30,800株
ゼリア新薬工業	114,300	1,764.00	201,625,200	
第一三共	1,878,400	2,385.00	4,479,984,000	
キョーリン製薬ホールディングス	149,000	2,467.00	367,583,000	
大幸薬品	25,000	1,850.00	46,250,000	貸付有価証券 4,100株
ダイト	25,000	2,432.00	60,800,000	
大塚ホールディングス	1,108,400	4,068.50	4,509,525,400	
大正製薬ホールディングス	134,300	8,200.00	1,101,260,000	貸付有価証券 95,200株
日本コークス工業	502,200	115.00	57,753,000	
昭和シェル石油	499,200	1,062.00	530,150,400	
コスモ石油	1,545,000	190.00	293,550,000	
ニチレキ	67,000	1,005.00	67,335,000	
東燃ゼネラル石油	842,000	1,156.00	973,352,000	

ユシロ化学工業	30,300	1,383.00	41,904,900	
ビーピー・カストロール	23,300	1,302.00	30,336,600	貸付有価証券 12,600株
富士石油	130,300	455.00	59,286,500	貸付有価証券 47,800株
MORESCO	14,100	2,230.00	31,443,000	貸付有価証券 2,600株
出光興産	264,900	2,396.00	634,700,400	
JXホールディングス	6,198,100	502.10	3,112,066,010	
横浜ゴム	308,800	2,394.00	739,267,200	
東洋ゴム工業	252,700	2,530.00	639,331,000	
ブリヂストン	1,750,300	4,492.00	7,862,347,600	
住友ゴム工業	435,600	1,809.00	788,000,400	
藤倉ゴム工業	46,900	693.00	32,501,700	貸付有価証券 27,500株
オカモト	187,000	486.00	90,882,000	
フコク	23,600	1,174.00	27,706,400	
ニッタ	55,200	3,170.00	174,984,000	
住友理工	103,600	965.00	99,974,000	
三ツ星ベルト	135,000	898.00	121,230,000	
バンドー化学	203,000	484.00	98,252,000	
日東紡績	411,000	592.00	243,312,000	
旭硝子	2,751,000	688.00	1,892,688,000	
日本板硝子	2,693,000	120.00	323,160,000	
石塚硝子	70,000	208.00	14,560,000	貸付有価証券 44,000株
日本山村硝子	224,000	182.00	40,768,000	
日本電気硝子	1,071,000	582.00	623,322,000	
オハラ	22,300	613.00	13,669,900	
住友大阪セメント	1,037,000	448.00	464,576,000	
太平洋セメント	3,484,000	356.00	1,240,304,000	
デイ・シイ	56,900	429.00	24,410,100	
日本ヒューム	59,400	763.00	45,322,200	
日本コンクリート工業	96,900	497.00	48,159,300	貸付有価証券 63,100株
三谷セキサン	28,300	1,645.00	46,553,500	
ジャパンパイル	74,300	796.00	59,142,800	貸付有価証券 28,800株

東海カーボン	485,000	362.00	175,570,000	
日本カーボン	294,000	367.00	107,898,000	
東洋炭素	31,300	1,925.00	60,252,500	貸付有価証券 14,600株
ノリタケカンパニーリミテド	316,000	273.00	86,268,000	
TOTO	821,000	1,942.00	1,594,382,000	
日本碍子	705,000	3,045.00	2,146,725,000	
日本特殊陶業	481,200	3,190.00	1,535,028,000	貸付有価証券 340,200株
ダントーホールディングス	72,000	182.00	13,104,000	貸付有価証券 46,000株
MARUWA	16,100	2,702.00	43,502,200	
品川リフラクトリーズ	139,000	287.00	39,893,000	
黒崎播磨	120,000	262.00	31,440,000	
ヨータイ	30,000	357.00	10,710,000	
イソライト工業	28,700	218.00	6,256,600	
東京窯業	67,000	211.00	14,137,000	
ニッカトー	20,600	413.00	8,507,800	
フジインコーポレーテッド	54,300	1,746.00	94,807,800	
エーアンドエーマテリアル	113,000	106.00	11,978,000	貸付有価証券 62,000株
ニチアス	248,000	732.00	181,536,000	貸付有価証券 151,000株
ニチハ	74,500	1,716.00	127,842,000	
新日鐵住金	23,603,000	290.10	6,847,230,300	
神戸製鋼所	9,653,000	188.00	1,814,764,000	
中山製鋼所	417,000	87.00	36,279,000	貸付有価証券 179,000株
合同製鐵	285,000	208.00	59,280,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	1,424,400	2,419.50	3,446,335,800	
日新製鋼	236,400	1,398.00	330,487,200	
東京製鐵	283,000	856.00	242,248,000	
共英製鋼	59,800	2,079.00	124,324,200	貸付有価証券 40,000株
大和工業	127,000	2,581.00	327,787,000	
東京鐵鋼	106,000	565.00	59,890,000	
大阪製鐵	35,300	2,140.00	75,542,000	



淀川製鋼所	386,000	499.00	192,614,000	貸付有価証券 19,000株
東洋鋼鈑	134,100	563.00	75,498,300	
丸一鋼管	171,200	3,010.00	515,312,000	貸付有価証券 113,500株
モリ工業	88,000	376.00	33,088,000	
大同特殊鋼	936,000	487.00	455,832,000	
日本高周波鋼業	223,000	113.00	25,199,000	貸付有価証券 10,000株
日本冶金工業	436,200	224.00	97,708,800	貸付有価証券 222,700株
山陽特殊製鋼	332,000	510.00	169,320,000	
愛知製鋼	329,000	507.00	166,803,000	
日立金属	568,200	1,714.00	973,894,800	
日本金属	142,000	148.00	21,016,000	
大太平洋金属	357,000	350.00	124,950,000	貸付有価証券 181,000株
新日本電工	341,200	277.00	94,512,400	
栗本鐵工所	289,000	252.00	72,828,000	
虹技	79,000	198.00	15,642,000	貸付有価証券 5,000株
日本鑄鉄管	52,000	224.00	11,648,000	貸付有価証券 16,000株
三菱製鋼	363,000	244.00	88,572,000	
日亜鋼業	77,600	304.00	23,590,400	
日本精線	43,000	558.00	23,994,000	貸付有価証券 25,000株
シンニッタン	59,200	578.00	34,217,600	
新家工業	107,000	172.00	18,404,000	
大紀アルミニウム工業所	92,000	377.00	34,684,000	
日本軽金属ホールディングス	1,354,700	199.00	269,585,300	
三井金属鉱業	1,520,000	298.00	452,960,000	
東邦亜鉛	316,000	355.00	112,180,000	
三菱マテリアル	3,484,000	437.00	1,522,508,000	
住友金属鉱山	1,541,000	1,706.50	2,629,716,500	
DOWAホールディングス	667,000	1,096.00	731,032,000	
古河機械金属	871,000	216.00	188,136,000	
エス・サイエンス	274,800	50.00	13,740,000	貸付有価証券 121,800株

大阪チタニウムテクノロジーズ	54,800	3,040.00	166,592,000	貸付有価証券 32,700株
東邦チタニウム	94,400	1,264.00	119,321,600	貸付有価証券 61,600株
U A C J	638,000	284.00	181,192,000	
古河電気工業	1,638,000	206.00	337,428,000	
住友電気工業	2,103,400	1,849.00	3,889,186,600	
フジクラ	777,000	654.00	508,158,000	
昭和電線ホールディングス	614,000	92.00	56,488,000	貸付有価証券 407,000株
東京特殊電線	7,900	1,262.00	9,969,800	
タツタ電線	105,800	498.00	52,688,400	貸付有価証券 38,800株
沖電線	57,000	272.00	15,504,000	貸付有価証券 32,000株
カナレ電気	8,600	2,090.00	17,974,000	貸付有価証券 4,400株
平河ヒューテック	13,000	1,330.00	17,290,000	貸付有価証券 2,200株
リヨービ	312,000	464.00	144,768,000	
アーレスティ	65,500	1,005.00	65,827,500	貸付有価証券 27,500株
アサヒホールディングス	84,000	2,011.00	168,924,000	
稲葉製作所	30,400	1,494.00	45,417,600	貸付有価証券 21,200株
宮地エンジニアリンググループ	156,000	172.00	26,832,000	貸付有価証券 83,000株
トーカロ	36,700	2,654.00	97,401,800	
アルファC o	18,100	1,311.00	23,729,100	貸付有価証券 300株
S U M C O	434,600	1,364.00	592,794,400	貸付有価証券 278,000株
川田テクノロジーズ	10,300	4,430.00	45,629,000	貸付有価証券 7,200株
東洋製罐グループホールディングス	396,700	1,818.00	721,200,600	
ホッカンホールディングス	131,000	284.00	37,204,000	
コロナ	29,600	1,199.00	35,490,400	
横河ブリッジホールディングス	105,700	1,179.00	124,620,300	
駒井ハルテック	97,000	246.00	23,862,000	

高田機工	48,000	232.00	11,136,000	貸付有価証券 28,000株
三和ホールディングス	525,100	977.00	513,022,700	
文化シャッター	155,400	906.00	140,792,400	
三協立山	73,100	1,962.00	143,422,200	
アルインコ	24,200	1,117.00	27,031,400	
東洋シャッター	13,400	952.00	12,756,800	貸付有価証券 900株
LIXILグループ	829,400	2,457.00	2,037,835,800	
日本フィルコン	40,900	526.00	21,513,400	貸付有価証券 19,200株
ノーリツ	109,800	2,050.00	225,090,000	
長府製作所	59,600	2,735.00	163,006,000	
リンナイ	103,800	9,130.00	947,694,000	貸付有価証券 58,500株
ダイニチ工業	29,500	742.00	21,889,000	
日東精工	79,000	325.00	25,675,000	
三洋工業	68,000	213.00	14,484,000	
岡部	110,600	954.00	105,512,400	
ジーテクト	50,800	1,142.00	58,013,600	
中国工業	8,300	798.00	6,623,400	貸付有価証券 4,200株
東プレ	107,400	2,160.00	231,984,000	
高周波熱錬	96,400	868.00	83,675,200	
東京製網	377,000	229.00	86,333,000	貸付有価証券 18,000株
サンコール	32,000	680.00	21,760,000	
モリテック スチール	29,300	320.00	9,376,000	貸付有価証券 11,400株
パイオラックス	28,200	6,430.00	181,326,000	
日本発條	485,000	1,283.00	622,255,000	
中央発條	69,000	321.00	22,149,000	
アドバネクス	101,000	175.00	17,675,000	貸付有価証券 7,000株
三益半導体工業	41,400	1,128.00	46,699,200	
日本ドライケミカル	7,700	2,370.00	18,249,000	
日本製鋼所	800,000	477.00	381,600,000	
三浦工業	249,000	1,468.00	365,532,000	

タクマ	175,000	734.00	128,450,000	貸付有価証券 11,000株
ツガミ	159,000	620.00	98,580,000	貸付有価証券 60,000株
オークマ	363,000	1,315.00	477,345,000	
東芝機械	304,000	525.00	159,600,000	
アマダホールディングス	832,000	1,224.00	1,018,368,000	
アイダエンジニアリング	122,200	1,250.00	152,750,000	
滝澤鉄工所	172,000	232.00	39,904,000	
富士機械製造	182,200	1,205.00	219,551,000	
牧野フライス製作所	278,000	1,195.00	332,210,000	
オーエスジー	254,300	2,547.00	647,702,100	貸付有価証券 15,000株
ダイジェット工業	63,000	211.00	13,293,000	貸付有価証券 37,000株
旭ダイヤモンド工業	152,900	1,301.00	198,922,900	
D M G 森精機	352,200	2,213.00	779,418,600	
ソディック	106,500	938.00	99,897,000	貸付有価証券 60,200株
ディスコ	65,000	9,700.00	630,500,000	
日東工器	32,600	2,592.00	84,499,200	
パンチ工業	19,900	1,222.00	24,317,800	
豊和工業	32,100	735.00	23,593,500	
大阪機工	220,000	180.00	39,600,000	貸付有価証券 11,000株
石川製作所	134,000	99.00	13,266,000	貸付有価証券 76,000株
東洋機械金属	37,900	490.00	18,571,000	貸付有価証券 21,200株
津田駒工業	134,000	139.00	18,626,000	貸付有価証券 77,000株
エンシュウ	134,000	115.00	15,410,000	貸付有価証券 85,000株
島精機製作所	78,900	1,887.00	148,884,300	
日阪製作所	70,600	1,091.00	77,024,600	
やまびこ	22,100	5,200.00	114,920,000	
ペガサスミシン製造	49,200	579.00	28,486,800	貸付有価証券 26,100株
ナブテスコ	339,800	2,904.00	986,779,200	

三井海洋開発	55,900	1,897.00	106,042,300	貸付有価証券 34,000株
レオン自動機	42,900	536.00	22,994,400	貸付有価証券 4,000株
S M C	167,300	34,500.00	5,771,850,000	
新川	46,600	994.00	46,320,400	
ホソカワミクロン	92,000	583.00	53,636,000	
ユニオンツール	27,700	3,735.00	103,459,500	貸付有価証券 13,700株
オイレス工業	66,100	2,168.00	143,304,800	
日精エー・エス・ビー機械	20,600	2,210.00	45,526,000	貸付有価証券 13,400株
サトーホールディングス	69,300	3,210.00	222,453,000	
日本エアージェット	16,000	665.00	10,640,000	貸付有価証券 9,000株
日精樹脂工業	41,000	1,057.00	43,337,000	貸付有価証券 1,200株
ワイエイシイ	23,200	1,002.00	23,246,400	貸付有価証券 600株
小松製作所	2,736,000	2,231.50	6,105,384,000	
住友重機械工業	1,526,000	659.00	1,005,634,000	
日立建機	249,300	2,009.00	500,843,700	貸付有価証券 55,200株
日工	76,000	430.00	32,680,000	
巴工業	21,200	1,627.00	34,492,400	
井関農機	572,000	231.00	132,132,000	貸付有価証券 248,000株
T O W A	45,600	1,048.00	47,788,800	貸付有価証券 31,900株
丸山製作所	116,000	228.00	26,448,000	貸付有価証券 8,000株
北川鉄工所	256,000	302.00	77,312,000	
クボタ	2,683,000	1,983.00	5,320,389,000	
荏原実業	16,200	1,402.00	22,712,400	貸付有価証券 10,600株
三菱化工機	179,000	365.00	65,335,000	貸付有価証券 115,000株
月島機械	98,200	1,243.00	122,062,600	貸付有価証券 1,400株

帝国電機製作所	37,400	1,002.00	37,474,800	貸付有価証券 24,000株
東京機械製作所	218,000	77.00	16,786,000	貸付有価証券 15,000株
新東工業	131,100	1,085.00	142,243,500	
澁谷工業	46,700	2,110.00	98,537,000	貸付有価証券 9,000株
アイチ コーポレーション	79,500	734.00	58,353,000	
小森コーポレーション	135,800	1,565.00	212,527,000	
鶴見製作所	41,700	1,878.00	78,312,600	
住友精密工業	87,000	457.00	39,759,000	貸付有価証券 53,000株
酒井重工業	103,000	253.00	26,059,000	
荏原製作所	1,157,000	559.00	646,763,000	
石井鐵工所	79,000	212.00	16,748,000	
西島製作所	54,500	931.00	50,739,500	貸付有価証券 30,000株
北越工業	54,600	859.00	46,901,400	貸付有価証券 1,000株
ダイキン工業	776,600	8,523.00	6,618,961,800	
オルガノ	104,000	507.00	52,728,000	
トーヨーカネツ	323,000	222.00	71,706,000	
栗田工業	315,700	2,846.00	898,482,200	
椿本チエイン	285,000	1,118.00	318,630,000	
大同工業	108,000	234.00	25,272,000	
日本コンベヤ	169,000	188.00	31,772,000	貸付有価証券 111,000株
木村化工機	51,500	501.00	25,801,500	
アネスト岩田	83,600	738.00	61,696,800	
ダイフク	263,600	1,804.00	475,534,400	
サムコ	7,900	1,178.00	9,306,200	貸付有価証券 3,800株
加藤製作所	117,000	695.00	81,315,000	
油研工業	102,000	259.00	26,418,000	
タダノ	257,000	1,764.00	453,348,000	
フジテック	155,300	1,402.00	217,730,600	
C K D	149,500	1,380.00	206,310,000	
キトー	58,400	1,170.00	68,328,000	

平和	115,900	2,475.00	286,852,500	
理想科学工業	64,800	2,219.00	143,791,200	
SANKYO	148,400	4,425.00	656,670,000	
日本金銭機械	49,000	1,645.00	80,605,000	貸付有価証券 32,400株
マースエンジニアリング	30,100	2,107.00	63,420,700	
福島工業	29,500	2,258.00	66,611,000	
オーイズミ	18,200	779.00	14,177,800	貸付有価証券 11,400株
ダイコク電機	22,300	1,774.00	39,560,200	
竹内製作所	22,400	6,900.00	154,560,000	
アマノ	177,700	1,683.00	299,069,100	
JUKI	79,300	1,533.00	121,566,900	貸付有価証券 56,000株
サンデンホールディングス	325,000	528.00	171,600,000	
蛇の目ミシン工業	516,000	125.00	64,500,000	貸付有価証券 328,000株
マックス	82,000	1,276.00	104,632,000	
グローリー	170,500	3,490.00	595,045,000	
新晃工業	37,400	1,212.00	45,328,800	貸付有価証券 100株
大和冷機工業	77,400	776.00	60,062,400	
セガサミーホールディングス	573,100	1,538.00	881,427,800	
日本ピストンリング	211,000	216.00	45,576,000	
リケン	230,000	477.00	109,710,000	
T P R	59,500	3,660.00	217,770,000	
ホシザキ電機	116,900	7,560.00	883,764,000	
大豊工業	43,400	1,491.00	64,709,400	
日本精工	1,095,400	1,700.00	1,862,180,000	
NTN	1,234,000	713.00	879,842,000	
ジェイテクト	568,400	2,185.00	1,241,954,000	
不二越	495,000	689.00	341,055,000	
日本トムソン	179,000	637.00	114,023,000	貸付有価証券 111,000株
THK	354,600	2,515.00	891,819,000	
ユーシン精機	23,700	2,751.00	65,198,700	貸付有価証券 11,300株

前澤給装工業	20,400	1,567.00	31,966,800	貸付有価証券 11,100株
イーグル工業	74,200	2,584.00	191,732,800	
前澤工業	39,400	432.00	17,020,800	
日本ピラー工業	58,200	1,007.00	58,607,400	
キット	239,200	588.00	140,649,600	
日立工機	142,700	974.00	138,989,800	貸付有価証券 3,700株
マキタ	347,700	6,910.00	2,402,607,000	
日立造船	416,900	688.00	286,827,200	
三菱重工業	8,938,000	697.40	6,233,361,200	
I H I	3,842,000	534.00	2,051,628,000	
イビデン	349,800	1,985.00	694,353,000	貸付有価証券 231,700株
コニカミノルタ	1,270,700	1,435.00	1,823,454,500	
ブラザー工業	689,300	1,670.00	1,151,131,000	
ミネベア	793,000	1,891.00	1,499,563,000	
日立製作所	12,805,000	775.00	9,923,875,000	
東芝	11,227,000	394.70	4,431,296,900	
三菱電機	5,333,000	1,500.50	8,002,166,500	
富士電機	1,484,000	514.00	762,776,000	
東洋電機製造	102,000	417.00	42,534,000	
安川電機	651,000	1,501.00	977,151,000	貸付有価証券 431,100株
シンフォニアテクノロジー	372,000	232.00	86,304,000	
明電舎	491,000	428.00	210,148,000	
オリジン電気	77,000	411.00	31,647,000	
山洋電気	118,000	926.00	109,268,000	
デンヨー	45,600	1,942.00	88,555,200	
東芝テック	383,000	636.00	243,588,000	
芝浦メカトロニクス	85,000	270.00	22,950,000	貸付有価証券 39,000株
マブチモーター	152,700	7,440.00	1,136,088,000	
日本電産	586,400	9,182.00	5,384,324,800	貸付有価証券 117,000株
東光高岳	27,500	1,627.00	44,742,500	
宮越ホールディングス	17,200	595.00	10,234,000	貸付有価証券 6,400株



ダイヘン	292,000	608.00	177,536,000	
田淵電機	61,000	1,081.00	65,941,000	貸付有価証券 37,000株
ヤーマン	6,600	1,552.00	10,243,200	貸付有価証券 4,200株
JVCケンウッド	394,600	296.00	116,801,600	貸付有価証券 212,500株
ミマキエンジニアリング	32,300	887.00	28,650,100	貸付有価証券 20,000株
第一精工	19,700	1,799.00	35,440,300	貸付有価証券 11,900株
日新電機	125,300	837.00	104,876,100	
大崎電気工業	95,000	662.00	62,890,000	貸付有価証券 45,000株
オムロン	576,000	5,090.00	2,931,840,000	
日東工業	85,600	2,751.00	235,485,600	
I D E C	63,700	1,102.00	70,197,400	
不二電機工業	5,000	1,512.00	7,560,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,028,000	468.00	481,104,000	
サクサホールディングス	134,000	290.00	38,860,000	貸付有価証券 18,000株
メルコホールディングス	29,900	2,160.00	64,584,000	貸付有価証券 5,200株
テクノメディカ	12,000	2,772.00	33,264,000	
日本電気	6,900,000	362.00	2,497,800,000	
富士通	5,141,000	649.20	3,337,537,200	
沖電気工業	1,877,000	251.00	471,127,000	
岩崎通信機	240,000	91.00	21,840,000	貸付有価証券 88,000株
電気興業	150,000	561.00	84,150,000	
サンケン電気	270,000	722.00	194,940,000	
ナカヨ	51,000	360.00	18,360,000	
アイホン	30,900	2,048.00	63,283,200	
ルネサスエレクトロニクス	276,000	804.00	221,904,000	貸付有価証券 90,800株
セイコーエプソン	727,800	2,100.00	1,528,380,000	
ワコム	419,900	438.00	183,916,200	貸付有価証券 251,200株
アルバック	89,900	1,787.00	160,651,300	

アクセル	24,900	1,761.00	43,848,900	貸付有価証券 15,400株
E I Z O	49,000	2,708.00	132,692,000	貸付有価証券 32,200株
ジャパンディスプレイ	1,097,100	410.00	449,811,000	貸付有価証券 774,200株
日本信号	147,100	1,337.00	196,672,700	
京三製作所	123,000	372.00	45,756,000	
能美防災	70,600	1,405.00	99,193,000	
ホーチキ	39,300	928.00	36,470,400	貸付有価証券 22,000株
エレコム	22,300	2,767.00	61,704,100	貸付有価証券 13,400株
日本無線	111,000	389.00	43,179,000	
パナソニック	6,498,900	1,568.00	10,190,275,200	
シャープ	4,507,000	161.00	725,627,000	貸付有価証券 3,184,000株
アンリツ	320,200	817.00	261,603,400	貸付有価証券 224,200株
富士通ゼネラル	160,000	1,482.00	237,120,000	
日立国際電気	138,000	1,721.00	237,498,000	
ソニー	3,487,300	3,322.00	11,584,810,600	
T D K	321,900	8,720.00	2,806,968,000	
帝国通信工業	124,000	221.00	27,404,000	
ミツミ電機	188,500	776.00	146,276,000	
タムラ製作所	206,000	463.00	95,378,000	
アルプス電気	420,900	3,575.00	1,504,717,500	
池上通信機	178,000	166.00	29,548,000	
パイオニア	801,200	221.00	177,065,200	貸付有価証券 98,400株
日本電波工業	48,100	904.00	43,482,400	
鈴木	13,400	709.00	9,500,600	貸付有価証券 8,200株
日本トリム	12,700	3,085.00	39,179,500	貸付有価証券 8,500株
ローランド ディー・ジー・	21,600	3,170.00	68,472,000	
フォスター電機	62,500	2,553.00	159,562,500	貸付有価証券 28,200株

クラリオン	282,000	332.00	93,624,000	貸付有価証券 178,000株
S M K	154,000	521.00	80,234,000	
ヨコオ	42,000	755.00	31,710,000	貸付有価証券 200株
東光	125,000	329.00	41,125,000	貸付有価証券 70,000株
ティアック	296,000	46.00	13,616,000	貸付有価証券 193,000株
ホシデン	162,200	728.00	118,081,600	
ヒロセ電機	90,400	16,080.00	1,453,632,000	
日本航空電子工業	151,000	2,932.00	442,732,000	
T O A	57,000	1,317.00	75,069,000	
日立マクセル	106,000	1,916.00	203,096,000	
古野電気	63,700	844.00	53,762,800	貸付有価証券 26,300株
ユニデン	143,000	221.00	31,603,000	
アルパイン	127,300	2,059.00	262,110,700	
スミダコーポレーション	47,600	867.00	41,269,200	
アイコム	29,600	2,852.00	84,419,200	
リオン	20,700	1,817.00	37,611,900	
船井電機	54,000	1,338.00	72,252,000	貸付有価証券 30,900株
横河電機	533,900	1,430.00	763,477,000	貸付有価証券 158,500株
新電元工業	205,000	580.00	118,900,000	
アズビル	174,100	3,115.00	542,321,500	
東亜ディーケーケー	23,500	548.00	12,878,000	
日本光電工業	222,900	2,802.00	624,565,800	
チノー	18,400	1,228.00	22,595,200	
共和電業	66,100	486.00	32,124,600	
日本電子材料	23,900	729.00	17,423,100	貸付有価証券 12,900株
堀場製作所	98,600	4,990.00	492,014,000	
アドバンテスト	363,900	1,231.00	447,960,900	貸付有価証券 103,100株
小野測器	26,200	981.00	25,702,200	貸付有価証券 500株
エスベック	59,300	1,418.00	84,087,400	

パナソニック デバイスSUNX	47,100	820.00	38,622,000	
キーエンス	120,800	64,530.00	7,795,224,000	
日置電機	28,000	2,662.00	74,536,000	
シスメックス	413,200	7,300.00	3,016,360,000	
メガチップス	55,900	1,421.00	79,433,900	貸付有価証券 31,000株
OBARA GROUP	34,600	6,100.00	211,060,000	貸付有価証券 24,500株
澤藤電機	30,000	229.00	6,870,000	貸付有価証券 1,000株
コーセル	78,000	1,406.00	109,668,000	貸付有価証券 49,800株
新日本無線	39,000	707.00	27,573,000	貸付有価証券 22,000株
オブテックス	36,600	2,528.00	92,524,800	
千代田インテグレ	28,100	3,215.00	90,341,500	
レーザーテック	54,600	1,587.00	86,650,200	貸付有価証券 200株
スタンレー電気	382,700	2,440.00	933,788,000	貸付有価証券 6,000株
岩崎電気	178,000	259.00	46,102,000	
ウシオ電機	323,900	1,497.00	484,878,300	
岡谷電機産業	29,800	411.00	12,247,800	貸付有価証券 15,700株
ヘリオス テクノ ホールディング	48,400	415.00	20,086,000	貸付有価証券 31,000株
日本セラミック	31,100	1,707.00	53,087,700	貸付有価証券 19,100株
遠藤照明	24,700	1,341.00	33,122,700	貸付有価証券 15,600株
日本デジタル研究所	45,100	1,619.00	73,016,900	
古河電池	36,000	801.00	28,836,000	貸付有価証券 21,000株
双信電機	27,600	398.00	10,984,800	
山一電機	61,700	1,183.00	72,991,100	貸付有価証券 8,300株
図研	39,100	1,209.00	47,271,900	
日本電子	227,000	526.00	119,402,000	
カシオ計算機	534,500	2,271.00	1,213,849,500	貸付有価証券 336,400株

ファナック	555,200	23,930.00	13,285,936,000	
日本シイエムケイ	137,400	301.00	41,357,400	
エンプラス	24,300	4,950.00	120,285,000	
大真空	95,000	278.00	26,410,000	貸付有価証券 58,000株
ローム	262,900	7,740.00	2,034,846,000	
浜松ホトニクス	416,100	3,320.00	1,381,452,000	
三井ハイテック	70,300	817.00	57,435,100	
新光電気工業	201,400	834.00	167,967,600	
京セラ	875,400	6,186.00	5,415,224,400	
太陽誘電	279,500	1,568.00	438,256,000	
村田製作所	559,500	20,255.00	11,332,672,500	
ユーシン	76,400	704.00	53,785,600	貸付有価証券 48,800株
双葉電子工業	91,200	2,132.00	194,438,400	
北陸電気工業	232,000	172.00	39,904,000	
ニチコン	167,900	932.00	156,482,800	貸付有価証券 111,200株
日本ケミコン	432,000	361.00	155,952,000	
K O A	73,700	1,224.00	90,208,800	
市光工業	125,000	285.00	35,625,000	貸付有価証券 73,000株
小糸製作所	319,500	4,565.00	1,458,517,500	
ミツバ	98,200	2,943.00	289,002,600	
スター精密	101,200	1,862.00	188,434,400	
S C R E E Nホールディングス	505,000	750.00	378,750,000	
キャノン電子	48,900	2,370.00	115,893,000	
キャノン	3,091,900	3,882.00	12,002,755,800	
リコー	1,603,500	1,206.50	1,934,622,750	
M U T O Hホールディングス	70,000	368.00	25,760,000	貸付有価証券 44,000株
東京エレクトロン	448,600	7,750.00	3,476,650,000	
トヨタ紡織	186,700	2,057.00	384,041,900	貸付有価証券 121,400株
鬼怒川ゴム工業	122,000	625.00	76,250,000	
ユニプレス	102,500	2,399.00	245,897,500	
豊田自動織機	485,600	6,600.00	3,204,960,000	
モリタホールディングス	93,600	1,135.00	106,236,000	

三櫻工業	68,400	796.00	54,446,400	
デンソー	1,317,500	5,778.00	7,612,515,000	
東海理化電機製作所	140,500	2,872.00	403,516,000	
三井造船	2,065,000	205.00	423,325,000	
川崎重工業	3,873,000	540.00	2,091,420,000	
名村造船所	148,600	986.00	146,519,600	
サノヤスホールディングス	66,400	243.00	16,135,200	貸付有価証券 35,200株
日本車輛製造	195,000	332.00	64,740,000	貸付有価証券 64,000株
ニチユ三菱フォークリフト	62,400	573.00	35,755,200	貸付有価証券 100株
近畿車輛	80,000	340.00	27,200,000	貸付有価証券 49,000株
日産自動車	7,485,500	1,191.00	8,915,230,500	貸付有価証券 39,100株
いすゞ自動車	1,685,700	1,555.00	2,621,263,500	
トヨタ自動車	7,357,500	7,931.00	58,352,332,500	代用有価証券 46,500株
日野自動車	761,100	1,410.00	1,073,151,000	
三菱自動車工業	1,954,500	1,011.00	1,975,999,500	
エフテック	31,200	1,196.00	37,315,200	貸付有価証券 17,500株
レシップホールディングス	17,300	858.00	14,843,400	
G M B	7,700	1,242.00	9,563,400	貸付有価証券 900株
ファルテック	7,500	1,521.00	11,407,500	
武蔵精密工業	56,800	2,150.00	122,120,000	貸付有価証券 5,000株
日産車体	234,500	1,571.00	368,399,500	
新明和工業	215,000	1,091.00	234,565,000	
極東開発工業	99,200	1,280.00	126,976,000	
日信工業	97,500	2,013.00	196,267,500	
トビー工業	440,000	295.00	129,800,000	貸付有価証券 16,000株
ティラド	209,000	236.00	49,324,000	
曙ブレーキ工業	226,000	388.00	87,688,000	貸付有価証券 127,800株
タチエス	84,500	1,671.00	141,199,500	

N O K	258,000	3,620.00	933,960,000	
フタバ産業	162,800	562.00	91,493,600	
カヤバ工業	598,000	409.00	244,582,000	
シロキ工業	118,000	354.00	41,772,000	
大同メタル工業	74,700	1,143.00	85,382,100	
プレス工業	264,300	542.00	143,250,600	
ミクニ	50,200	565.00	28,363,000	
カルソニックカンセイ	407,000	833.00	339,031,000	
太平洋工業	108,900	1,167.00	127,086,300	
ケーヒン	122,500	1,638.00	200,655,000	
河西工業	65,400	1,386.00	90,644,400	
アイシン精機	487,900	4,970.00	2,424,863,000	
富士機工	62,800	725.00	45,530,000	
マツダ	1,589,300	2,360.50	3,751,542,650	貸付有価証券 108,600株
ダイハツ工業	636,500	1,701.00	1,082,686,500	貸付有価証券 449,900株
今仙電機製作所	45,500	1,261.00	57,375,500	
本田技研工業	4,799,000	3,835.00	18,404,165,000	代用有価証券 93,900株
スズキ	1,114,800	3,852.00	4,294,209,600	貸付有価証券 78,500株
富士重工業	1,814,800	4,318.50	7,837,213,800	
安永	17,100	570.00	9,747,000	貸付有価証券 10,000株
ヤマハ発動機	811,100	2,574.00	2,087,771,400	
ショーワ	126,000	1,155.00	145,530,000	
T B K	69,500	546.00	37,947,000	
エクセディ	72,400	2,954.00	213,869,600	
豊田合成	172,200	2,761.00	475,444,200	貸付有価証券 93,800株
愛三工業	83,200	1,126.00	93,683,200	
盟和産業	44,000	146.00	6,424,000	
ヨロズ	50,000	2,517.00	125,850,000	
エフ・シー・シー	78,500	1,839.00	144,361,500	貸付有価証券 55,200株
シマノ	230,300	16,900.00	3,892,070,000	

タカタ	96,500	1,304.00	125,836,000	貸付有価証券 68,000株
テイ・エス テック	112,700	3,285.00	370,219,500	
ジャムコ	20,000	3,730.00	74,600,000	
テルモ	817,500	2,990.00	2,444,325,000	
クリエートメディック	17,100	1,001.00	17,117,100	
日機装	172,800	1,232.00	212,889,600	貸付有価証券 107,000株
島津製作所	637,000	1,792.00	1,141,504,000	
J M S	96,000	297.00	28,512,000	貸付有価証券 20,000株
クボテック	10,900	870.00	9,483,000	貸付有価証券 7,400株
モリテックス	11,100	244.00	2,708,400	貸付有価証券 6,700株
長野計器	34,300	769.00	26,376,700	
ブイ・テクノロジー	10,100	3,825.00	38,632,500	貸付有価証券 2,900株
東京計器	180,000	247.00	44,460,000	貸付有価証券 11,000株
愛知時計電機	68,000	355.00	24,140,000	
オーバル	51,400	292.00	15,008,800	貸付有価証券 22,200株
東京精密	96,200	2,539.00	244,251,800	
マニー	16,000	7,850.00	125,600,000	
ニコン	995,700	1,431.00	1,424,846,700	貸付有価証券 634,200株
トプコン	161,100	2,885.00	464,773,500	
オリンパス	794,400	4,410.00	3,503,304,000	
理研計器	47,200	1,311.00	61,879,200	
タムロン	41,100	2,507.00	103,037,700	
H O Y A	1,269,000	4,796.00	6,086,124,000	
ノーリツ鋼機	48,100	693.00	33,333,300	貸付有価証券 5,400株
エー・アンド・デイ	48,300	487.00	23,522,100	
シチズンホールディングス	656,400	828.00	543,499,200	
リズム時計工業	236,000	175.00	41,300,000	
大研医器	37,200	1,164.00	43,300,800	貸付有価証券 23,300株



松風	26,500	1,348.00	35,722,000	貸付有価証券 13,400株
セイコーホールディングス	377,000	599.00	225,823,000	貸付有価証券 249,000株
ニプロ	340,700	1,219.00	415,313,300	
パラマウントベッドホールディングス	56,300	3,530.00	198,739,000	
トランザクション	4,100	1,400.00	5,740,000	貸付有価証券 2,800株
S H O - B I	17,200	410.00	7,052,000	貸付有価証券 800株
前田工織	58,800	1,035.00	60,858,000	貸付有価証券 37,400株
永大産業	73,000	451.00	32,923,000	
アートネイチャー	38,900	1,074.00	41,778,600	貸付有価証券 21,500株
ダンロップスポーツ	33,900	1,170.00	39,663,000	貸付有価証券 23,600株
バンダイナムコホールディングス	588,100	2,272.00	1,336,163,200	
共立印刷	98,200	299.00	29,361,800	貸付有価証券 100株
フランスベッドホールディングス	374,000	183.00	68,442,000	貸付有価証券 153,000株
パイロットコーポレーション	93,000	4,600.00	427,800,000	
萩原工業	10,700	2,039.00	21,817,300	
トッパン・フォームズ	95,200	1,664.00	158,412,800	
フジシールインターナショナル	64,800	3,435.00	222,588,000	貸付有価証券 45,800株
タカラトミー	191,300	650.00	124,345,000	貸付有価証券 126,800株
廣濟堂	49,600	566.00	28,073,600	
A s - m e エステール	14,100	785.00	11,068,500	
アーク	167,700	128.00	21,465,600	貸付有価証券 93,600株
タカノ	24,200	828.00	20,037,600	
プロネクサス	50,300	784.00	39,435,200	
ホクシン	42,300	145.00	6,133,500	貸付有価証券 15,000株
ウッドワン	88,000	273.00	24,024,000	
大建工業	218,000	309.00	67,362,000	
凸版印刷	1,506,000	1,004.00	1,512,024,000	

大日本印刷	1,577,000	1,263.50	1,992,539,500	
図書印刷	86,000	426.00	36,636,000	貸付有価証券 49,000株
共同印刷	160,000	339.00	54,240,000	
日本写真印刷	89,500	2,045.00	183,027,500	貸付有価証券 31,100株
光村印刷	47,000	259.00	12,173,000	
宝印刷	28,300	1,226.00	34,695,800	貸付有価証券 18,500株
アシックス	529,800	3,240.00	1,716,552,000	貸付有価証券 332,600株
ツツミ	26,700	2,740.00	73,158,000	
小松ウオール工業	16,000	2,386.00	38,176,000	
ヤマハ	391,900	2,495.00	977,790,500	
河合楽器製作所	17,900	2,237.00	40,042,300	貸付有価証券 10,000株
クリナップ	48,500	878.00	42,583,000	
ピジョン	302,200	3,595.00	1,086,409,000	
兼松日産農林	67,000	153.00	10,251,000	貸付有価証券 30,000株
キングジム	44,800	824.00	36,915,200	貸付有価証券 29,400株
リンテック	126,800	2,711.00	343,754,800	
T A S A K I	9,800	2,591.00	25,391,800	貸付有価証券 5,900株
イトーキ	112,900	653.00	73,723,700	貸付有価証券 100株
任天堂	328,400	19,840.00	6,515,456,000	貸付有価証券 56,000株
三菱鉛筆	43,900	5,510.00	241,889,000	
タカラスタANDARD	220,000	811.00	178,420,000	
コクヨ	277,100	1,050.00	290,955,000	
ナカバヤシ	108,000	229.00	24,732,000	
グロープライド	261,000	166.00	43,326,000	
岡村製作所	204,700	1,046.00	214,116,200	
美津濃	287,000	575.00	165,025,000	貸付有価証券 81,000株
アデランス	62,100	1,044.00	64,832,400	
東京電力	4,523,600	679.00	3,071,524,400	

中部電力	1,631,600	1,798.00	2,933,616,800	
関西電力	2,176,100	1,351.00	2,939,911,100	
中国電力	737,300	1,728.00	1,274,054,400	
北陸電力	522,400	1,768.00	923,603,200	
東北電力	1,332,300	1,603.00	2,135,676,900	
四国電力	480,300	1,788.00	858,776,400	貸付有価証券 88,400株
九州電力	1,177,700	1,467.00	1,727,685,900	貸付有価証券 832,300株
北海道電力	499,100	1,405.00	701,235,500	貸付有価証券 6,500株
沖縄電力	52,300	2,971.00	155,383,300	
電源開発	386,500	4,125.00	1,594,312,500	
東京瓦斯	6,482,000	643.00	4,167,926,000	
大阪瓦斯	5,519,000	477.40	2,634,770,600	
東邦瓦斯	1,356,000	718.00	973,608,000	
北海道瓦斯	112,000	286.00	32,032,000	貸付有価証券 57,000株
広島ガス	84,900	475.00	40,327,500	
西部瓦斯	600,000	285.00	171,000,000	貸付有価証券 69,000株
静岡ガス	151,700	826.00	125,304,200	
メタウォーター	33,100	2,923.00	96,751,300	
SBSホールディングス	52,500	997.00	52,342,500	
東武鉄道	2,849,000	559.00	1,592,591,000	
相鉄ホールディングス	914,000	676.00	617,864,000	
東京急行電鉄	2,897,000	847.00	2,453,759,000	
京浜急行電鉄	1,461,000	963.00	1,406,943,000	貸付有価証券 88,000株
小田急電鉄	1,708,000	1,168.00	1,994,944,000	貸付有価証券 84,000株
京王電鉄	1,490,000	939.00	1,399,110,000	
京成電鉄	799,000	1,478.00	1,180,922,000	
富士急行	144,000	1,057.00	152,208,000	貸付有価証券 69,000株
新京成電鉄	68,000	410.00	27,880,000	
東日本旅客鉄道	977,300	11,045.00	10,794,278,500	
西日本旅客鉄道	513,300	7,890.00	4,049,937,000	

東海旅客鉄道	477,500	21,070.00	10,060,925,000	
西武ホールディングス	424,900	2,850.00	1,210,965,000	
鴻池運輸	66,100	1,389.00	91,812,900	
西日本鉄道	691,000	565.00	390,415,000	
ハマキョウレックス	16,300	4,600.00	74,980,000	
サカイ引越センター	9,100	4,915.00	44,726,500	貸付有価証券 4,900株
近鉄グループホールディングス	5,367,000	425.00	2,280,975,000	
阪急阪神ホールディングス	3,579,000	735.00	2,630,565,000	
南海電気鉄道	1,195,000	552.00	659,640,000	貸付有価証券 219,000株
京阪電気鉄道	1,195,000	727.00	868,765,000	貸付有価証券 744,000株
神戸電鉄	128,000	358.00	45,824,000	貸付有価証券 62,000株
名糖運輸	23,100	730.00	16,863,000	貸付有価証券 11,900株
名古屋鉄道	1,942,000	458.00	889,436,000	
山陽電気鉄道	195,000	465.00	90,675,000	貸付有価証券 1,000株
日本通運	2,062,000	591.00	1,218,642,000	
ヤマトホールディングス	937,600	2,360.00	2,212,736,000	
山九	649,000	610.00	395,890,000	
丸運	30,300	257.00	7,787,100	
丸全昭和運輸	174,000	414.00	72,036,000	
センコー	235,000	763.00	179,305,000	貸付有価証券 146,000株
トナミホールディングス	106,000	390.00	41,340,000	
日本梱包運輸倉庫	174,500	2,009.00	350,570,500	
日本石油輸送	59,000	237.00	13,983,000	
福山通運	323,000	631.00	203,813,000	貸付有価証券 203,000株
セイノーホールディングス	412,700	1,279.00	527,843,300	
神奈川中央交通	62,000	585.00	36,270,000	
日立物流	111,000	2,016.00	223,776,000	
丸和運輸機関	4,800	3,400.00	16,320,000	
日本郵船	4,505,000	339.00	1,527,195,000	
商船三井	2,796,000	380.00	1,062,480,000	貸付有価証券 1,723,000株

川崎汽船	2,333,000	284.00	662,572,000	
N S ユナイテッド海運	231,000	263.00	60,753,000	貸付有価証券 137,000株
明治海運	47,400	405.00	19,197,000	
飯野海運	276,200	551.00	152,186,200	
共栄タンカー	44,000	209.00	9,196,000	貸付有価証券 20,000株
第一中央汽船	627,000	38.00	23,826,000	貸付有価証券 266,000株
日本航空	1,021,000	4,150.00	4,237,150,000	
A N A ホールディングス	10,481,000	341.20	3,576,117,200	貸付有価証券 4,501,000株
パスコ	48,000	340.00	16,320,000	貸付有価証券 21,000株
トランコム	15,200	6,170.00	93,784,000	貸付有価証券 400株
日新	202,000	351.00	70,902,000	
三菱倉庫	350,000	1,591.00	556,850,000	
三井倉庫ホールディングス	309,000	398.00	122,982,000	
住友倉庫	389,000	664.00	258,296,000	
澁澤倉庫	136,000	349.00	47,464,000	
東陽倉庫	91,000	281.00	25,571,000	
乾汽船	35,800	944.00	33,795,200	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	122,000	425.00	51,850,000	
ケイヒン	95,000	202.00	19,190,000	
中央倉庫	31,200	957.00	29,858,400	
安田倉庫	41,800	996.00	41,632,800	
東洋埠頭	162,000	209.00	33,858,000	貸付有価証券 2,000株
宇徳	43,700	540.00	23,598,000	貸付有価証券 100株
上組	636,000	1,081.00	687,516,000	
サンリツ	13,000	555.00	7,215,000	
キムラユニティー	13,000	1,200.00	15,600,000	
キューソー流通システム	14,400	2,103.00	30,283,200	貸付有価証券 8,000株
郵船ロジスティクス	48,800	1,318.00	64,318,400	
近鉄エクスプレス	47,800	5,090.00	243,302,000	

東海運	29,400	285.00	8,379,000	
エーアイティー	25,200	1,153.00	29,055,600	貸付有価証券 1,900株
内外トランスライン	11,800	1,247.00	14,714,600	
N E C ネットズエスアイ	65,900	2,553.00	168,242,700	
システナ	51,200	1,138.00	58,265,600	
デジタルアーツ	28,700	1,612.00	46,264,400	貸付有価証券 10,500株
新日鉄住金ソリューションズ	43,900	3,925.00	172,307,500	
キューブシステム	24,000	646.00	15,504,000	
コア	22,900	850.00	19,465,000	貸付有価証券 13,800株
ソフトクリエイトホールディングス	16,900	914.00	15,446,600	貸付有価証券 10,000株
I T ホールディングス	174,400	2,707.00	472,100,800	
ネオス	14,000	674.00	9,436,000	貸付有価証券 9,800株
電算システム	17,700	1,702.00	30,125,400	貸付有価証券 10,000株
グリー	319,300	700.00	223,510,000	貸付有価証券 126,600株
コーエーテクモホールディングス	119,100	2,011.00	239,510,100	
三菱総合研究所	20,400	2,850.00	58,140,000	貸付有価証券 600株
ボルテージ	9,300	1,928.00	17,930,400	貸付有価証券 6,300株
電算	5,700	2,238.00	12,756,600	貸付有価証券 2,500株
A G S	7,700	1,000.00	7,700,000	
ファインデックス	30,500	1,320.00	40,260,000	
ヒト・コミュニケーションズ	5,800	1,941.00	11,257,800	貸付有価証券 4,200株
ブレインパッド	7,800	860.00	6,708,000	貸付有価証券 3,000株
K L a b	55,700	1,522.00	84,775,400	貸付有価証券 33,100株
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	35,100	1,208.00	42,400,800	
イーブックイニシアティブジャパン	11,800	971.00	11,457,800	貸付有価証券 4,000株

ネクソン	497,100	1,537.00	764,042,700	
アイスタイル	22,800	1,300.00	29,640,000	貸付有価証券 13,800株
エムアップ	14,800	725.00	10,730,000	貸付有価証券 7,100株
エイチーム	19,500	2,347.00	45,766,500	貸付有価証券 14,000株
e n i s h	13,700	1,175.00	16,097,500	貸付有価証券 8,300株
コロプラ	144,700	2,320.00	335,704,000	貸付有価証券 100,700株
モバイルクリエイト	31,100	763.00	23,729,300	貸付有価証券 19,100株
オルトプラス	20,500	778.00	15,949,000	貸付有価証券 12,300株
ブロードリーフ	42,300	1,585.00	67,045,500	貸付有価証券 29,600株
ハーツユナイテッドグループ	15,400	1,923.00	29,614,200	
ベリサーブ	6,000	1,112.00	6,672,000	
ティーガイア	52,500	2,116.00	111,090,000	
日本アジアグループ	42,300	580.00	24,534,000	
豆蔵ホールディングス	41,400	612.00	25,336,800	貸付有価証券 24,800株
テクマトリックス	23,100	919.00	21,228,900	貸付有価証券 8,200株
GMOペイメントゲートウェイ	45,800	3,710.00	169,918,000	貸付有価証券 28,700株
ザッパラス	30,700	570.00	17,499,000	貸付有価証券 14,000株
インターネットイニシアティブ	85,100	2,101.00	178,795,100	
GMOクラウド	11,400	934.00	10,647,600	
ビットアイル	60,100	468.00	28,126,800	
S R Aホールディングス	27,800	2,281.00	63,411,800	
システムインテグレータ	6,900	598.00	4,126,200	貸付有価証券 2,200株
パイブドピッツ	6,600	1,727.00	11,398,200	貸付有価証券 4,100株
朝日ネット	54,100	515.00	27,861,500	
コムチュア	8,800	2,236.00	19,676,800	貸付有価証券 2,400株

g u m i	52,700	1,386.00	73,042,200	貸付有価証券 32,700株
パナソニック インフォメーションシステムズ	12,300	3,920.00	48,216,000	
フェイス	15,500	1,555.00	24,102,500	
ハイマックス	6,700	1,153.00	7,725,100	
野村総合研究所	298,000	4,675.00	1,393,150,000	
サイバネットシステム	43,800	446.00	19,534,800	貸付有価証券 2,300株
C E ホールディングス	8,000	1,163.00	9,304,000	
インテージホールディングス	30,000	1,905.00	57,150,000	
東邦システムサイエンス	15,100	666.00	10,056,600	
ソースネクスト	27,000	695.00	18,765,000	貸付有価証券 14,800株
ティー・ワイ・オー	73,900	202.00	14,927,800	
クレスコ	11,800	1,964.00	23,175,200	
フジ・メディア・ホールディングス	548,100	1,611.00	882,989,100	
オービック	181,400	5,510.00	999,514,000	
ジャストシステム	96,100	749.00	71,978,900	貸付有価証券 26,600株
T D C ソフトウェアエンジニアリング	11,000	1,272.00	13,992,000	
ヤフー	3,771,600	478.00	1,802,824,800	貸付有価証券 2,502,600株
トレンドマイクロ	278,800	3,985.00	1,111,018,000	
インフォメーション・ディベロプメント	9,800	969.00	9,496,200	
日本オラクル	84,300	4,905.00	413,491,500	
アルファシステムズ	16,700	1,825.00	30,477,500	
フューチャーアーキテクト	55,400	805.00	44,597,000	
C A C H o l d i n g s	35,800	1,108.00	39,666,400	
ソフトバンク・テクノロジー	13,800	1,350.00	18,630,000	貸付有価証券 6,800株
トーセ	13,500	830.00	11,205,000	貸付有価証券 7,400株
オービックビジネスコンサルタント	33,600	4,805.00	161,448,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	119,300	2,897.00	345,612,100	貸付有価証券 36,100株
アイティフォー	65,200	457.00	29,796,400	
東計電算	9,200	2,025.00	18,630,000	
エクスネット	4,800	1,519.00	7,291,200	



大塚商会	141,600	5,920.00	838,272,000	
サイボウズ	70,600	330.00	23,298,000	貸付有価証券 42,800株
ソフトブレーン	72,500	168.00	12,180,000	貸付有価証券 40,100株
電通国際情報サービス	33,000	1,415.00	46,695,000	
E Mシステムズ	8,000	2,222.00	17,776,000	
ウェザーニューズ	15,400	4,115.00	63,371,000	
C I J	48,000	514.00	24,672,000	
東洋ビジネスエンジニアリング	5,200	1,422.00	7,394,400	
日本エンタープライズ	46,300	328.00	15,186,400	貸付有価証券 22,400株
WOWOW	25,100	3,650.00	91,615,000	貸付有価証券 14,200株
フュージョンパートナー	30,400	684.00	20,793,600	
日本コロムビア	18,000	422.00	7,596,000	貸付有価証券 10,800株
イマジカ・ロボット ホールディングス	37,000	553.00	20,461,000	貸付有価証券 15,000株
ネットワンシステムズ	213,600	806.00	172,161,600	
アルゴグラフィックス	22,000	1,882.00	41,404,000	
マーベラス	88,700	1,516.00	134,469,200	貸付有価証券 55,700株
エイベックス・グループ・ホールディングス	104,300	2,005.00	209,121,500	貸付有価証券 73,800株
日本ユニシス	145,300	1,248.00	181,334,400	
兼松エレクトロニクス	33,300	1,914.00	63,736,200	
東京放送ホールディングス	315,300	1,782.00	561,864,600	貸付有価証券 222,500株
日本テレビホールディングス	480,500	2,180.00	1,047,490,000	
朝日放送	51,800	975.00	50,505,000	
テレビ朝日ホールディングス	143,900	1,923.00	276,719,700	貸付有価証券 72,600株
スカパーJ S A Tホールディングス	399,400	636.00	254,018,400	
テレビ東京ホールディングス	43,200	1,862.00	80,438,400	貸付有価証券 28,300株
日本BS放送	8,700	1,144.00	9,952,800	貸付有価証券 5,000株
コネクシオ	37,400	1,311.00	49,031,400	

クロップス	6,400	515.00	3,296,000	貸付有価証券 2,700株
日本電信電話	4,119,100	4,350.00	17,918,085,000	
K D D I	5,346,800	2,942.50	15,732,959,000	
光通信	47,400	7,830.00	371,142,000	
N T T ドコモ	4,059,200	2,328.00	9,449,817,600	
エムティーアイ	67,700	779.00	52,738,300	
G M O インターネット	175,600	1,715.00	301,154,000	
K A D O K A W A ・ D W A N G O	129,100	1,477.00	190,680,700	貸付有価証券 71,600株
学研ホールディングス	173,000	245.00	42,385,000	
ゼンリン	69,600	1,505.00	104,748,000	貸付有価証券 42,700株
昭文社	32,300	867.00	28,004,100	
インプレスホールディングス	37,700	197.00	7,426,900	貸付有価証券 23,800株
アイネット	27,600	1,124.00	31,022,400	
松竹	346,000	1,094.00	378,524,000	貸付有価証券 205,000株
東宝	375,500	2,962.00	1,112,231,000	
東映	196,000	825.00	161,700,000	
A O I P r o .	25,400	1,060.00	26,924,000	貸付有価証券 13,600株
エヌ・ティ・ティ・データ	325,100	5,150.00	1,674,265,000	
ピー・シー・エー	6,500	1,515.00	9,847,500	
D T S	54,300	2,603.00	141,342,900	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	202,400	2,833.00	573,399,200	
シーイーシー	34,300	1,077.00	36,941,100	
カブコン	134,600	2,322.00	312,541,200	
アイ・エス・ピー	5,500	880.00	4,840,000	
ジャステック	31,000	1,155.00	35,805,000	
S C S K	125,400	3,605.00	452,067,000	
日本システムウエア	20,200	1,049.00	21,189,800	貸付有価証券 900株
アイネス	71,800	1,273.00	91,401,400	
T K C	48,800	3,475.00	169,580,000	
富士ソフト	72,500	2,415.00	175,087,500	
N S D	122,800	1,594.00	195,743,200	

コナミ	214,000	2,319.00	496,266,000	
福井コンピュータホールディングス	14,000	841.00	11,774,000	貸付有価証券 7,800株
J B C Cホールディングス	43,900	780.00	34,242,000	貸付有価証券 7,600株
ミロク情報サービス	34,800	778.00	27,074,400	
ソフトバンクグループ	2,783,300	6,934.00	19,299,402,200	代用有価証券 53,700株
ハウスイ	42,000	147.00	6,174,000	貸付有価証券 25,000株
高千穂交易	20,700	1,087.00	22,500,900	貸付有価証券 11,700株
伊藤忠食品	12,900	4,155.00	53,599,500	
エレマテック	24,700	2,778.00	68,616,600	
J A L U X	14,400	2,349.00	33,825,600	貸付有価証券 7,900株
あらた	118,000	415.00	48,970,000	
トーメンデバイス	7,800	2,083.00	16,247,400	
東京エレクトロン デバイス	13,500	1,661.00	22,423,500	貸付有価証券 6,500株
フィールズ	34,900	1,857.00	64,809,300	
双日	3,522,800	280.00	986,384,000	
アルフレッサ ホールディングス	622,700	1,845.00	1,148,881,500	
横浜冷凍	131,000	954.00	124,974,000	貸付有価証券 91,200株
神栄	80,000	185.00	14,800,000	
山下医科器械	4,200	1,811.00	7,606,200	貸付有価証券 2,600株
ラサ商事	26,000	600.00	15,600,000	
アルコニックス	29,900	1,916.00	57,288,400	
神戸物産	16,700	8,000.00	133,600,000	貸付有価証券 9,200株
あい ホールディングス	84,300	2,042.00	172,140,600	
ディーブイエックス	15,200	1,254.00	19,060,800	
ダイワボウホールディングス	479,000	225.00	107,775,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	94,500	1,427.00	134,851,500	貸付有価証券 13,100株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	99,000	872.00	86,328,000	貸付有価証券 57,900株

八洲電機	41,100	604.00	24,824,400	
U K Cホールディングス	33,900	2,421.00	82,071,900	貸付有価証券 7,300株
O C H Iホールディングス	13,400	1,271.00	17,031,400	
T O K A Iホールディングス	257,000	489.00	125,673,000	
三洋貿易	29,000	1,643.00	47,647,000	
ウイン・パートナーズ	16,600	1,563.00	25,945,800	
ミタチ産業	12,000	739.00	8,868,000	
シップヘルスケアホールディングス	96,400	2,500.00	241,000,000	
明治電機工業	14,700	1,278.00	18,786,600	貸付有価証券 9,500株
デリカフーズ	8,900	1,020.00	9,078,000	
スターティア	5,900	1,671.00	9,858,900	
富士興産	21,000	556.00	11,676,000	
協栄産業	60,000	203.00	12,180,000	貸付有価証券 37,000株
小野建	45,900	1,129.00	51,821,100	
佐島電機	41,500	834.00	34,611,000	
エコートレーディング	12,100	666.00	8,058,600	貸付有価証券 6,300株
伯東	36,100	1,428.00	51,550,800	
コンドーテック	38,200	775.00	29,605,000	
中山福	30,800	851.00	26,210,800	貸付有価証券 2,500株
ナガイレーベン	76,000	2,303.00	175,028,000	
三菱食品	57,700	2,621.00	151,231,700	
松田産業	38,700	1,430.00	55,341,000	
メディバルホールディングス	526,400	1,909.00	1,004,897,600	
アドヴァン	26,900	1,707.00	45,918,300	貸付有価証券 300株
S P K	11,000	2,352.00	25,872,000	貸付有価証券 100株
萩原電気	14,100	1,984.00	27,974,400	
アズワン	37,900	4,060.00	153,874,000	貸付有価証券 2,600株
スズデン	16,500	904.00	14,916,000	貸付有価証券 9,800株
尾家産業	16,000	880.00	14,080,000	
シモジマ	32,900	1,021.00	33,590,900	

ドウシシャ	68,100	2,106.00	143,418,600	
小津産業	10,200	2,030.00	20,706,000	貸付有価証券 5,900株
高速	31,600	882.00	27,871,200	
たけびし	17,800	1,081.00	19,241,800	貸付有価証券 10,000株
黒田電気	91,400	2,269.00	207,386,600	
丸文	46,400	924.00	42,873,600	
ハピネット	32,200	1,269.00	40,861,800	貸付有価証券 18,200株
橋本総業	9,500	1,390.00	13,205,000	
エクセル	24,400	1,356.00	33,086,400	貸付有価証券 15,200株
マルカキカイ	16,600	1,975.00	32,785,000	
ガリバーインターナショナル	159,300	1,153.00	183,672,900	
日本エム・ディ・エム	44,000	514.00	22,616,000	
進和	31,400	2,161.00	67,855,400	
エスケイジャパン	12,400	233.00	2,889,200	貸付有価証券 500株
ダイトエレクトロン	24,700	848.00	20,945,600	
シークス	33,400	3,005.00	100,367,000	貸付有価証券 22,100株
田中商事	15,700	747.00	11,727,900	貸付有価証券 200株
オーハシテクニカ	32,600	1,575.00	51,345,000	
白銅	14,800	1,439.00	21,297,200	
伊藤忠商事	4,405,500	1,404.00	6,185,322,000	
丸紅	4,604,400	677.20	3,118,099,680	
高島	96,000	268.00	25,728,000	
長瀬産業	295,500	1,596.00	471,618,000	
蝶理	33,800	1,910.00	64,558,000	貸付有価証券 1,000株
豊田通商	586,300	3,150.00	1,846,845,000	
三共生興	90,100	502.00	45,230,200	
兼松	1,050,000	204.00	214,200,000	
ツカモトコーポレーション	94,000	148.00	13,912,000	
三井物産	4,462,100	1,570.00	7,005,497,000	
日本紙パルプ商事	274,000	336.00	92,064,000	

日立ハイテクノロジーズ	182,500	3,220.00	587,650,000	
カメイ	69,100	1,115.00	77,046,500	
東都水産	84,000	197.00	16,548,000	
OUGホールディングス	83,000	253.00	20,999,000	
スターゼン	204,000	376.00	76,704,000	貸付有価証券 101,000株
山善	202,000	1,013.00	204,626,000	
椿本興業	58,000	360.00	20,880,000	
住友商事	3,106,200	1,350.00	4,193,370,000	
内田洋行	127,000	420.00	53,340,000	
三菱商事	4,033,700	2,579.00	10,402,912,300	
第一実業	127,000	649.00	82,423,000	貸付有価証券 1,000株
キャノンマーケティングジャパン	150,100	2,064.00	309,806,400	
西華産業	170,000	306.00	52,020,000	
佐藤商事	46,700	797.00	37,219,900	
菱洋エレクトロ	60,900	1,535.00	93,481,500	
東京産業	53,100	476.00	25,275,600	貸付有価証券 100株
ユアサ商事	46,100	2,784.00	128,342,400	
神鋼商事	131,000	260.00	34,060,000	
小林産業	38,600	239.00	9,225,400	貸付有価証券 200株
阪和興業	526,000	526.00	276,676,000	
カナデン	45,300	960.00	43,488,000	
菱電商事	83,000	934.00	77,522,000	
フルサト工業	29,200	1,740.00	50,808,000	
岩谷産業	583,000	750.00	437,250,000	貸付有価証券 335,000株
すてきナイスグループ	226,000	207.00	46,782,000	貸付有価証券 80,000株
昭光通商	181,000	115.00	20,815,000	貸付有価証券 119,000株
二チモウ	80,000	191.00	15,280,000	貸付有価証券 4,000株
極東貿易	59,000	315.00	18,585,000	
イワキ	77,000	225.00	17,325,000	
三愛石油	134,000	788.00	105,592,000	

稲畑産業	126,400	1,255.00	158,632,000	
G S I クレオス	137,000	136.00	18,632,000	
明和産業	41,800	418.00	17,472,400	
ワキタ	112,200	1,194.00	133,966,800	
東邦ホールディングス	181,400	2,771.00	502,659,400	
サンゲツ	180,100	1,847.00	332,644,700	
ミツウロコグループホールディングス	85,200	594.00	50,608,800	
シナネン	110,000	474.00	52,140,000	
伊藤忠エネクス	116,500	1,129.00	131,528,500	
サンリオ	147,500	3,305.00	487,487,500	貸付有価証券 86,000株
サンワテクノス	33,800	1,341.00	45,325,800	
リョーサン	88,700	3,140.00	278,518,000	
新光商事	61,700	1,250.00	77,125,000	
トーヨー	118,000	493.00	58,174,000	貸付有価証券 65,000株
三信電気	72,900	1,217.00	88,719,300	
東陽テクニカ	77,600	1,022.00	79,307,200	貸付有価証券 500株
モスフードサービス	68,900	2,520.00	173,628,000	貸付有価証券 40,100株
加賀電子	47,600	1,502.00	71,495,200	
ソーダニッカ	53,900	525.00	28,297,500	
立花エレテック	39,100	1,380.00	53,958,000	
フォーバル	10,200	1,740.00	17,748,000	
P A L T A C	84,200	2,176.00	183,219,200	
三谷産業	55,400	478.00	26,481,200	貸付有価証券 36,500株
太平洋興発	210,000	95.00	19,950,000	
ヤマタネ	264,000	202.00	53,328,000	
丸紅建材リース	45,000	254.00	11,430,000	
日鉄住金物産	347,000	426.00	147,822,000	
トラスコ中山	65,600	3,965.00	260,104,000	
オートボックスセブン	187,300	2,048.00	383,590,400	貸付有価証券 128,100株
加藤産業	82,100	2,742.00	225,118,200	
イノテック	48,700	474.00	23,083,800	
イエローハット	49,700	2,307.00	114,657,900	

J Kホールディングス	52,700	578.00	30,460,600	
日伝	21,800	2,922.00	63,699,600	
北沢産業	44,200	182.00	8,044,400	
杉本商事	28,700	1,411.00	40,495,700	
因幡電機産業	78,300	4,110.00	321,813,000	
バイテック	17,300	1,420.00	24,566,000	貸付有価証券 9,800株
ミスミグループ本社	590,300	1,636.00	965,730,800	
アルテック	39,500	250.00	9,875,000	
タキヒヨー	86,000	460.00	39,560,000	貸付有価証券 3,000株
蔵王産業	6,800	1,434.00	9,751,200	
スズケン	239,600	3,850.00	922,460,000	
ジェコス	36,700	1,220.00	44,774,000	貸付有価証券 3,000株
ルネサスイーストン	27,000	592.00	15,984,000	
ローソン	199,300	8,320.00	1,658,176,000	貸付有価証券 50,500株
サンエー	39,800	5,550.00	220,890,000	
ダイユーエイト	12,400	810.00	10,044,000	
カワチ薬品	40,700	1,849.00	75,254,300	
エービーシー・マート	74,900	7,350.00	550,515,000	貸付有価証券 9,700株
ハードオフコーポレーション	26,000	1,431.00	37,206,000	
アスクル	54,900	4,085.00	224,266,500	貸付有価証券 34,000株
ゲオホールディングス	99,300	1,592.00	158,085,600	貸付有価証券 49,600株
アダストリア	44,500	5,390.00	239,855,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	65,000	151.00	9,815,000	貸付有価証券 5,000株
くらコーポレーション	30,900	4,005.00	123,754,500	
キャンドウ	25,600	1,549.00	39,654,400	貸付有価証券 14,200株
パル	30,600	3,950.00	120,870,000	
エディオン	241,100	844.00	203,488,400	貸付有価証券 170,000株
サーラコーポレーション	44,900	608.00	27,299,200	



ワッツ	21,700	1,017.00	22,068,900	貸付有価証券 400株
あみやき亭	9,100	5,130.00	46,683,000	貸付有価証券 5,000株
ひらまつ	72,700	849.00	61,722,300	
ゲンキー	5,200	9,900.00	51,480,000	貸付有価証券 2,800株
サッポロドラッグストアー	4,300	1,733.00	7,451,900	貸付有価証券 2,500株
大黒天物産	12,300	4,680.00	57,564,000	
ハニーズ	46,300	1,019.00	47,179,700	貸付有価証券 28,200株
ファーマライズホールディングス	12,100	566.00	6,848,600	
アルペン	47,000	1,989.00	93,483,000	貸付有価証券 30,500株
クオール	53,200	1,588.00	84,481,600	
ジェイアイエヌ	35,700	5,420.00	193,494,000	貸付有価証券 17,400株
ビックカメラ	258,500	1,543.00	398,865,500	貸付有価証券 169,900株
D C Mホールディングス	263,300	1,081.00	284,627,300	
MonotaRO	102,900	5,280.00	543,312,000	貸付有価証券 64,200株
東京一番フーズ	8,100	798.00	6,463,800	貸付有価証券 100株
きちり	13,600	703.00	9,560,800	貸付有価証券 8,200株
アークランドサービス	6,100	5,660.00	34,526,000	貸付有価証券 3,000株
J.フロント リテイリング	665,900	2,274.00	1,514,256,600	
ドトール・日レスホールディングス	92,200	2,133.00	196,662,600	
マツモトキヨシホールディングス	117,600	5,280.00	620,928,000	
ブロンコビリー	18,400	2,570.00	47,288,000	貸付有価証券 11,400株
スタートトゥデイ	163,800	3,445.00	564,291,000	
トレジャー・ファクトリー	12,700	1,623.00	20,612,100	貸付有価証券 5,400株
物語コーポレーション	14,700	4,445.00	65,341,500	貸付有価証券 9,500株
ココカラファイン	54,800	4,030.00	220,844,000	貸付有価証券 19,000株

三越伊勢丹ホールディングス	1,046,400	2,156.00	2,256,038,400	
ウエルシアホールディングス	45,200	5,570.00	251,764,000	貸付有価証券 25,200株
クリエイトSDホールディングス	25,800	6,290.00	162,282,000	貸付有価証券 16,000株
丸善CHIホールディングス	62,200	398.00	24,755,600	貸付有価証券 18,700株
ミサワ	6,000	642.00	3,852,000	
エー・ピーカンパニー	7,200	1,979.00	14,248,800	貸付有価証券 4,200株
チムニー	12,600	3,095.00	38,997,000	貸付有価証券 7,900株
ネクステージ	6,500	864.00	5,616,000	
ジョイフル本田	76,900	2,596.00	199,632,400	貸付有価証券 45,200株
キリン堂ホールディングス	16,400	1,419.00	23,271,600	
すかいらーく	257,900	1,587.00	409,287,300	貸付有価証券 104,000株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	173,000	1,036.00	179,228,000	
ブックオフコーポレーション	30,600	891.00	27,264,600	貸付有価証券 19,100株
あさひ	35,000	1,417.00	49,595,000	貸付有価証券 22,000株
日本調剤	6,500	6,540.00	42,510,000	貸付有価証券 2,700株
コスモス薬品	26,500	17,610.00	466,665,000	貸付有価証券 18,900株
トーエル	29,100	754.00	21,941,400	貸付有価証券 16,800株
一六堂	12,400	436.00	5,406,400	
セブン&アイ・ホールディングス	2,201,700	5,291.00	11,649,194,700	
薬王堂	7,100	3,455.00	24,530,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	36,900	2,851.00	105,201,900	貸付有価証券 21,100株
ツルハホールディングス	112,500	10,200.00	1,147,500,000	
サンマルクホールディングス	37,800	4,005.00	151,389,000	
フェリシモ	13,000	1,155.00	15,015,000	貸付有価証券 7,300株
トリドール	56,200	1,568.00	88,121,600	貸付有価証券 200株

クスリのアオキ	41,600	5,470.00	227,552,000	貸付有価証券 26,200株
メディカルシステムネットワーク	53,300	467.00	24,891,100	貸付有価証券 9,000株
総合メディカル	25,500	3,400.00	86,700,000	
はるやま商事	23,200	741.00	17,191,200	
カップ・クリエイトホールディングス	82,600	1,151.00	95,072,600	貸付有価証券 51,200株
ライトオン	39,600	992.00	39,283,200	貸付有価証券 22,900株
ジーンズメイト	16,800	259.00	4,351,200	貸付有価証券 9,200株
良品計画	65,100	22,920.00	1,492,092,000	
三城ホールディングス	65,400	472.00	30,868,800	貸付有価証券 1,900株
アルビス	11,700	2,050.00	23,985,000	
コナカ	62,600	702.00	43,945,200	
ハウス オブ ローゼ	5,800	1,422.00	8,247,600	貸付有価証券 3,200株
G - 7ホールディングス	10,700	1,527.00	16,338,900	
イオン北海道	33,600	660.00	22,176,000	貸付有価証券 18,800株
コジマ	77,700	376.00	29,215,200	貸付有価証券 23,300株
ヒマラヤ	16,000	1,126.00	18,016,000	貸付有価証券 6,500株
コーナン商事	80,500	1,546.00	124,453,000	
エコス	17,700	1,014.00	17,947,800	
ワタミ	62,500	1,027.00	64,187,500	貸付有価証券 44,300株
マルシェ	12,100	883.00	10,684,300	貸付有価証券 7,100株
ドンキホーテホールディングス	339,700	5,040.00	1,712,088,000	
西松屋チェーン	103,900	1,231.00	127,900,900	貸付有価証券 55,100株
ゼンショーホールディングス	270,700	1,161.00	314,282,700	貸付有価証券 145,900株
幸楽苑ホールディングス	33,100	1,545.00	51,139,500	貸付有価証券 20,000株
ハークスレイ	14,300	1,006.00	14,385,800	

サイゼリヤ	86,600	2,710.00	234,686,000	
V Tホールディングス	154,400	702.00	108,388,800	
魚力	14,200	2,240.00	31,808,000	
ポブラ	12,700	525.00	6,667,500	貸付有価証券 7,500株
ユナイテッドアローズ	68,800	4,145.00	285,176,000	貸付有価証券 48,700株
ハイデイ日高	40,100	2,975.00	119,297,500	貸付有価証券 20,400株
京都きもの友禅	31,400	1,015.00	31,871,000	貸付有価証券 20,700株
コロワイド	174,500	1,861.00	324,744,500	貸付有価証券 109,900株
壱番屋	23,800	5,020.00	119,476,000	貸付有価証券 15,600株
トップカルチャー	21,900	520.00	11,388,000	貸付有価証券 12,300株
P L A N T	11,900	1,477.00	17,576,300	
スギホールディングス	94,400	6,350.00	599,440,000	貸付有価証券 53,100株
スクロール	69,300	294.00	20,374,200	
ヨンドシーホールディングス	40,100	2,817.00	112,961,700	貸付有価証券 12,600株
ファミリーマート	177,900	5,780.00	1,028,262,000	貸付有価証券 117,100株
木曽路	64,500	2,007.00	129,451,500	貸付有価証券 40,600株
サトレストランシステムズ	58,500	905.00	52,942,500	貸付有価証券 29,000株
千趣会	95,000	866.00	82,270,000	貸付有価証券 60,000株
タカキュー	36,100	211.00	7,617,100	貸付有価証券 700株
ケーヨー	99,000	556.00	55,044,000	貸付有価証券 58,900株
上新電機	112,000	929.00	104,048,000	貸付有価証券 7,000株
日本瓦斯	84,400	3,830.00	323,252,000	
ベスト電器	168,000	166.00	27,888,000	貸付有価証券 102,400株

ロイヤルホールディングス	87,800	2,063.00	181,131,400	貸付有価証券 50,000株
東天紅	39,000	181.00	7,059,000	
いなげや	58,700	1,454.00	85,349,800	貸付有価証券 8,300株
島忠	136,200	3,420.00	465,804,000	
チヨダ	62,000	2,978.00	184,636,000	
ライフコーポレーション	33,300	2,860.00	95,238,000	貸付有価証券 12,500株
リンガーハット	51,100	2,661.00	135,977,100	貸付有価証券 28,800株
さが美	42,000	200.00	8,400,000	貸付有価証券 28,000株
MrMax	51,600	411.00	21,207,600	
テンアライド	44,000	386.00	16,984,000	貸付有価証券 25,400株
AOKIホールディングス	120,900	1,610.00	194,649,000	
オークワ	82,000	971.00	79,622,000	
コメリ	90,300	2,694.00	243,268,200	貸付有価証券 48,400株
青山商事	132,200	4,845.00	640,509,000	
しまむら	61,100	12,070.00	737,477,000	貸付有価証券 23,000株
CFSコーポレーション	35,000	1,105.00	38,675,000	
はせがわ	18,200	548.00	9,973,600	
高島屋	765,000	1,095.00	837,675,000	貸付有価証券 433,000株
松屋	106,100	2,284.00	242,332,400	貸付有価証券 13,100株
エイチ・ツー・オー リテイリング	248,800	2,637.00	656,085,600	
近鉄百貨店	203,000	331.00	67,193,000	貸付有価証券 102,000株
丸栄	85,000	134.00	11,390,000	貸付有価証券 52,000株
ニッセンホールディングス	110,800	230.00	25,484,000	貸付有価証券 46,800株
パルコ	50,300	1,181.00	59,404,300	貸付有価証券 26,600株
丸井グループ	553,700	1,673.00	926,340,100	
アクシアル リテイリング	40,800	3,675.00	149,940,000	

井筒屋	294,000	80.00	23,520,000	貸付有価証券 17,000株
イオン	2,170,500	1,735.00	3,765,817,500	貸付有価証券 1,515,800株
ユニーグループ・ホールディングス	505,200	795.00	401,634,000	
イズミ	117,500	5,080.00	596,900,000	
東武ストア	66,000	322.00	21,252,000	貸付有価証券 33,000株
平和堂	106,600	2,727.00	290,698,200	
フジ	58,500	2,354.00	137,709,000	貸付有価証券 14,800株
ヤオコー	59,700	5,550.00	331,335,000	
ゼビオ	71,400	2,306.00	164,648,400	
ケースホールディングス	121,300	3,980.00	482,774,000	貸付有価証券 75,000株
Olympicグループ	31,900	768.00	24,499,200	貸付有価証券 4,600株
日産東京販売ホールディングス	88,800	358.00	31,790,400	貸付有価証券 25,000株
アインファーマシーズ	63,400	5,370.00	340,458,000	
元気寿司	16,000	2,479.00	39,664,000	貸付有価証券 8,800株
ヤマダ電機	2,080,400	462.00	961,144,800	貸付有価証券 1,364,300株
アークランドサカモト	37,900	2,541.00	96,303,900	
ニトリホールディングス	227,400	10,060.00	2,287,644,000	
グルメ杵屋	36,000	970.00	34,920,000	貸付有価証券 23,000株
愛眼	41,800	256.00	10,700,800	
ケーユーホールディングス	28,100	727.00	20,428,700	貸付有価証券 13,400株
吉野家ホールディングス	148,400	1,484.00	220,225,600	貸付有価証券 10,800株
松屋フーズ	25,400	2,337.00	59,359,800	貸付有価証券 2,100株
サガミチェーン	65,000	1,232.00	80,080,000	貸付有価証券 37,000株
関西スーパーマーケット	39,700	802.00	31,839,400	
王将フードサービス	38,700	4,100.00	158,670,000	

プレナス	59,100	2,147.00	126,887,700	貸付有価証券 31,200株
ミニストップ	39,000	2,155.00	84,045,000	
アークス	91,500	2,529.00	231,403,500	
パロー	113,400	2,915.00	330,561,000	
藤久	4,100	1,679.00	6,883,900	
ベルク	23,300	3,790.00	88,307,000	
大庄	25,200	1,522.00	38,354,400	
ファーストリテイリング	105,400	55,180.00	5,815,972,000	貸付有価証券 3,500株
サンドラッグ	111,200	6,930.00	770,616,000	
サクスパー ホールディングス	39,600	2,132.00	84,427,200	
ヤマザワ	10,600	1,705.00	18,073,000	
やまや	8,700	2,162.00	18,809,400	貸付有価証券 5,000株
ペルーナ	131,800	678.00	89,360,400	
島根銀行	10,600	1,535.00	16,271,000	
じもとホールディングス	379,300	208.00	78,894,400	貸付有価証券 100株
足利ホールディングス	331,100	507.00	167,867,700	貸付有価証券 100株
東京ＴＹフィナンシャルグループ	67,800	3,995.00	270,861,000	
新生銀行	5,009,000	253.00	1,267,277,000	
あおぞら銀行	3,552,000	462.00	1,641,024,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	42,230,000	840.50	35,494,315,000	代用有価証券 434,200株
りそなホールディングス	6,157,300	642.30	3,954,833,790	
三井住友トラスト・ホールディングス	11,634,000	536.30	6,239,314,200	貸付有価証券 2,240,000株
三井住友フィナンシャルグループ	3,980,400	5,230.00	20,817,492,000	代用有価証券 70,500株
第四銀行	666,000	500.00	333,000,000	
北越銀行	568,000	240.00	136,320,000	
西日本シティ銀行	1,847,000	337.00	622,439,000	
千葉銀行	2,030,000	921.00	1,869,630,000	
横浜銀行	3,530,000	745.40	2,631,262,000	
常陽銀行	1,903,000	679.00	1,292,137,000	
群馬銀行	1,248,000	872.00	1,088,256,000	貸付有価証券 91,000株

武蔵野銀行	84,100	4,565.00	383,916,500	
千葉興業銀行	109,400	827.00	90,473,800	
筑波銀行	219,000	387.00	84,753,000	
七十七銀行	888,000	726.00	644,688,000	
青森銀行	412,000	384.00	158,208,000	
秋田銀行	349,000	377.00	131,573,000	
山形銀行	317,000	510.00	161,670,000	貸付有価証券 186,000株
岩手銀行	36,800	5,190.00	190,992,000	貸付有価証券 17,900株
東邦銀行	470,000	526.00	247,220,000	
東北銀行	290,000	168.00	48,720,000	
みちのく銀行	263,000	210.00	55,230,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	2,135,000	613.00	1,308,755,000	
静岡銀行	1,542,000	1,251.00	1,929,042,000	
十六銀行	659,000	478.00	315,002,000	
スルガ銀行	555,700	2,535.00	1,408,699,500	貸付有価証券 68,700株
八十二銀行	952,000	892.00	849,184,000	
山梨中央銀行	326,000	553.00	180,278,000	
大垣共立銀行	658,000	434.00	285,572,000	
福井銀行	452,000	254.00	114,808,000	
北國銀行	586,000	434.00	254,324,000	
清水銀行	17,500	3,255.00	56,962,500	
滋賀銀行	527,000	639.00	336,753,000	
南都銀行	508,000	415.00	210,820,000	
百五銀行	505,000	580.00	292,900,000	
京都銀行	1,005,000	1,345.00	1,351,725,000	
紀陽銀行	206,700	1,787.00	369,372,900	貸付有価証券 5,600株
三重銀行	237,000	278.00	65,886,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	3,581,000	272.00	974,032,000	
広島銀行	1,553,000	709.00	1,101,077,000	貸付有価証券 751,000株
山陰合同銀行	319,000	1,144.00	364,936,000	
中国銀行	373,100	1,858.00	693,219,800	
鳥取銀行	163,000	225.00	36,675,000	



伊予銀行	563,100	1,446.00	814,242,600	
百十四銀行	578,000	423.00	244,494,000	
四国銀行	407,000	266.00	108,262,000	
阿波銀行	430,000	756.00	325,080,000	
鹿児島銀行	366,000	832.00	304,512,000	
大分銀行	323,000	516.00	166,668,000	
宮崎銀行	351,000	426.00	149,526,000	
肥後銀行	430,000	745.00	320,350,000	
佐賀銀行	319,000	294.00	93,786,000	
十八銀行	324,000	361.00	116,964,000	
沖縄銀行	41,700	5,020.00	209,334,000	
琉球銀行	108,400	1,773.00	192,193,200	
セブン銀行	1,774,900	576.00	1,022,342,400	貸付有価証券 928,300株
みずほフィナンシャルグループ	73,440,700	253.30	18,602,529,310	代用有価証券 1,456,700株
高知銀行	206,000	163.00	33,578,000	貸付有価証券 112,000株
山口フィナンシャルグループ	525,000	1,476.00	774,900,000	貸付有価証券 88,000株
長野銀行	168,000	223.00	37,464,000	貸付有価証券 102,000株
名古屋銀行	476,000	465.00	221,340,000	貸付有価証券 300,000株
北洋銀行	792,900	525.00	416,272,500	
愛知銀行	18,600	6,550.00	121,830,000	
第三銀行	298,000	194.00	57,812,000	
中京銀行	218,000	224.00	48,832,000	
東日本銀行	230,000	438.00	100,740,000	
大光銀行	183,000	231.00	42,273,000	
愛媛銀行	310,000	263.00	81,530,000	貸付有価証券 164,000株
トマト銀行	205,000	194.00	39,770,000	
みなと銀行	477,000	302.00	144,054,000	
京葉銀行	433,000	603.00	261,099,000	
関西アーバン銀行	73,600	1,407.00	103,555,200	
栃木銀行	265,000	665.00	176,225,000	
北日本銀行	16,100	3,345.00	53,854,500	

東和銀行	744,000	114.00	84,816,000	
福島銀行	651,000	98.00	63,798,000	
大東銀行	337,000	169.00	56,953,000	
トモニホールディングス	404,100	535.00	216,193,500	
フィデアホールディングス	323,600	262.00	84,783,200	貸付有価証券 184,000株
池田泉州ホールディングス	501,700	545.00	273,426,500	
F P G	155,800	913.00	142,245,400	貸付有価証券 12,000株
S B Iホールディングス	632,100	1,574.00	994,925,400	
日本アジア投資	404,000	58.00	23,432,000	貸付有価証券 26,000株
ジャフコ	72,000	5,110.00	367,920,000	
大和証券グループ本社	4,924,000	883.80	4,351,831,200	
野村ホールディングス	10,760,100	843.00	9,070,764,300	
岡三証券グループ	448,000	842.00	377,216,000	
丸三証券	167,400	1,322.00	221,302,800	
東洋証券	203,000	370.00	75,110,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	604,000	868.00	524,272,000	
光世証券	124,000	220.00	27,280,000	貸付有価証券 75,000株
水戸証券	163,700	428.00	70,063,600	
いちよし証券	110,400	1,142.00	126,076,800	貸付有価証券 57,600株
松井証券	267,500	1,056.00	282,480,000	
だいこう証券ビジネス	25,900	975.00	25,252,500	貸付有価証券 15,600株
マネックスグループ	619,300	310.00	191,983,000	貸付有価証券 437,400株
カブドットコム証券	466,600	400.00	186,640,000	
極東証券	70,600	1,760.00	124,256,000	
岩井コスモホールディングス	54,100	1,481.00	80,122,100	
藍澤證券	74,600	794.00	59,232,400	
マネースクウェアHD	22,500	1,387.00	31,207,500	貸付有価証券 8,900株
マネーパートナーズグループ	53,000	409.00	21,677,000	貸付有価証券 29,700株
小林洋行	14,800	321.00	4,750,800	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1,169,200	4,114.50	4,810,673,400	

アニコム ホールディングス	29,700	2,007.00	59,607,900	貸付有価証券 12,100株
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	1,677,800	3,584.00	6,013,235,200	
ソニーフィナンシャルホールディングス	504,200	2,134.00	1,075,962,800	貸付有価証券 143,100株
第一生命保険	3,372,300	2,236.00	7,540,462,800	
東京海上ホールディングス	2,132,700	4,850.00	10,343,595,000	
T & Dホールディングス	1,918,300	1,716.50	3,292,761,950	
全国保証	136,800	4,300.00	588,240,000	
クレディセゾン	429,900	2,665.00	1,145,683,500	貸付有価証券 5,600株
アクリーティブ	36,900	756.00	27,896,400	貸付有価証券 22,000株
芙蓉総合リース	55,200	4,955.00	273,516,000	
興銀リース	98,900	2,715.00	268,513,500	
東京センチュリーリース	123,600	3,725.00	460,410,000	
日本証券金融	231,800	679.00	157,392,200	
アイフル	880,700	371.00	326,739,700	貸付有価証券 440,000株
ポケットカード	39,700	528.00	20,961,600	貸付有価証券 700株
リコーリース	41,600	3,640.00	151,424,000	
イオンフィナンシャルサービス	345,200	3,325.00	1,147,790,000	貸付有価証券 223,400株
アコム	1,057,800	451.00	477,067,800	貸付有価証券 711,100株
ジャックス	290,000	541.00	156,890,000	
オリエントコーポレーション	1,217,000	214.00	260,438,000	貸付有価証券 32,800株
日立キャピタル	103,300	3,130.00	323,329,000	
アプラスフィナンシャル	255,200	130.00	33,176,000	貸付有価証券 159,000株
オリックス	3,726,200	1,722.50	6,418,379,500	
三菱UFJリース	1,335,000	643.00	858,405,000	
日本取引所グループ	772,800	3,880.00	2,998,464,000	
イー・ギャランティ	14,900	2,457.00	36,609,300	
アサックス	8,800	1,550.00	13,640,000	
NECキャピタルソリューション	21,700	1,812.00	39,320,400	

日本駐車場開発	574,900	175.00	100,607,500	貸付有価証券 404,900株
ヒューリック	977,600	1,095.00	1,070,472,000	
三栄建築設計	22,000	1,079.00	23,738,000	
野村不動産ホールディングス	316,600	2,553.00	808,279,800	
三重交通グループホールディングス	94,000	462.00	43,428,000	
日本商業開発	16,500	2,175.00	35,887,500	
プレサンスコーポレーション	17,500	4,025.00	70,437,500	
ユニゾホールディングス	28,900	5,290.00	152,881,000	
日本管理センター	34,100	1,840.00	62,744,000	貸付有価証券 11,000株
サンセイランディック	8,000	793.00	6,344,000	貸付有価証券 5,000株
エストラスト	6,900	615.00	4,243,500	
フージャースホールディングス	78,200	498.00	38,943,600	
オープンハウス	76,400	1,998.00	152,647,200	
東急不動産ホールディングス	1,379,300	956.00	1,318,610,800	
飯田グループホールディングス	341,300	1,978.00	675,091,400	
エコナックホールディングス	183,000	97.00	17,751,000	貸付有価証券 40,000株
パーク24	264,900	2,152.00	570,064,800	貸付有価証券 175,200株
バラカ	17,700	1,555.00	27,523,500	
三井不動産	2,791,000	3,295.00	9,196,345,000	
三菱地所	3,914,000	2,531.00	9,906,334,000	
平和不動産	99,500	1,679.00	167,060,500	
東京建物	582,092	1,611.00	937,750,212	
ダイビル	135,400	1,080.00	146,232,000	
京阪神ビルディング	87,100	698.00	60,795,800	
住友不動産	1,261,000	4,118.00	5,192,798,000	
大京	838,000	206.00	172,628,000	
テーオーシー	181,300	769.00	139,419,700	
東京楽天地	86,000	503.00	43,258,000	貸付有価証券 3,000株
レオパレス21	576,500	670.00	386,255,000	
スターツコーポレーション	60,500	1,898.00	114,829,000	
フジ住宅	68,400	686.00	46,922,400	貸付有価証券 42,500株

空港施設	65,100	650.00	42,315,000	
明和地所	31,400	607.00	19,059,800	貸付有価証券 800株
住友不動産販売	38,100	2,954.00	112,547,400	
ゴールドクレスト	47,400	2,444.00	115,845,600	貸付有価証券 19,700株
日本エスリード	21,200	1,245.00	26,394,000	貸付有価証券 11,400株
日神不動産	71,000	423.00	30,033,000	
タカラレーベン	233,100	689.00	160,605,900	貸付有価証券 94,800株
サンヨーハウジング名古屋	30,100	1,229.00	36,992,900	
イオンモール	339,600	2,249.00	763,760,400	
ファースト住建	19,900	1,370.00	27,263,000	貸付有価証券 11,100株
ランド	201,000	21.00	4,221,000	
トーセイ	72,300	828.00	59,864,400	
穴吹興産	47,000	235.00	11,045,000	貸付有価証券 26,000株
エヌ・ティ・ティ都市開発	327,600	1,177.00	385,585,200	
サンフロンティア不動産	56,600	939.00	53,147,400	貸付有価証券 700株
エフ・ジェー・ネクスト	40,600	609.00	24,725,400	貸付有価証券 23,000株
ランドビジネス	36,200	388.00	14,045,600	貸付有価証券 6,100株
グランディハウス	46,700	397.00	18,539,900	
日本空港ビルデング	181,800	6,370.00	1,158,066,000	貸付有価証券 128,600株
日本工営	182,000	463.00	84,266,000	
ネクスト	131,000	799.00	104,669,000	
日本M&Aセンター	86,100	5,300.00	456,330,000	
ノバレーゼ	14,000	885.00	12,390,000	貸付有価証券 8,800株
アコーディア・ゴルフ	210,200	1,160.00	243,832,000	
タケエイ	54,100	1,250.00	67,625,000	貸付有価証券 14,500株
トラスト・テック	9,400	2,259.00	21,234,600	
パソナグループ	41,400	1,096.00	45,374,400	貸付有価証券 23,000株

C D S	12,300	968.00	11,906,400	貸付有価証券 7,800株
リンクアンドモチベーション	75,900	166.00	12,599,400	貸付有価証券 3,500株
G C A サヴィアン	44,600	1,525.00	68,015,000	貸付有価証券 6,500株
エス・エム・エス	62,600	1,622.00	101,537,200	貸付有価証券 33,800株
テンプホールディングス	109,900	4,520.00	496,748,000	貸付有価証券 58,100株
リニカル	14,000	1,261.00	17,654,000	
クックパッド	106,100	2,392.00	253,791,200	貸付有価証券 61,200株
エスクリ	20,300	1,140.00	23,142,000	
アイ・ケイ・ケイ	30,200	610.00	18,422,000	貸付有価証券 18,000株
学情	21,100	1,236.00	26,079,600	貸付有価証券 12,100株
スタジオアリス	25,800	2,161.00	55,753,800	
シミックホールディングス	25,400	1,700.00	43,180,000	貸付有価証券 16,000株
N J S	12,300	1,500.00	18,450,000	
総合警備保障	185,900	4,900.00	910,910,000	
カカクコム	367,200	1,756.00	644,803,200	貸付有価証券 259,700株
アイロムグループ	13,700	1,938.00	26,550,600	貸付有価証券 8,000株
ルネサンス	29,000	1,351.00	39,179,000	貸付有価証券 16,000株
ディップ	12,300	12,350.00	151,905,000	貸付有価証券 7,000株
オプトホールディング	25,500	660.00	16,830,000	貸付有価証券 12,000株
新日本科学	52,500	706.00	37,065,000	貸付有価証券 34,700株
ツクイ	66,100	966.00	63,852,600	貸付有価証券 41,500株
総合臨床ホールディングス	29,500	487.00	14,366,500	
キャリアデザインセンター	14,900	1,418.00	21,128,200	
エムスリー	482,200	2,587.00	1,247,451,400	貸付有価証券 186,700株

ツカダ・グローバルホールディング	41,000	748.00	30,668,000	貸付有価証券 24,200株
アウトソーシング	22,000	2,167.00	47,674,000	貸付有価証券 2,300株
ウェルネット	19,500	2,883.00	56,218,500	
ディー・エヌ・エー	274,700	2,281.00	626,590,700	貸付有価証券 110,000株
博報堂D Yホールディングス	772,100	1,321.00	1,019,944,100	
ぐるなび	64,700	1,915.00	123,900,500	貸付有価証券 42,700株
エスアールジータカミヤ	44,500	722.00	32,129,000	貸付有価証券 27,500株
一休	44,100	2,568.00	113,248,800	
ジャパンベストレスキューシステム	64,200	249.00	15,985,800	貸付有価証券 12,800株
ファンコミュニケーションズ	128,800	853.00	109,866,400	貸付有価証券 58,500株
ジェイコムホールディングス	13,000	953.00	12,389,000	貸付有価証券 6,000株
P G Mホールディングス	78,800	1,330.00	104,804,000	
W D Bホールディングス	20,500	1,314.00	26,937,000	
ティア	24,100	726.00	17,496,600	
バリューコマース	45,100	549.00	24,759,900	貸付有価証券 6,700株
J Pホールディングス	140,900	330.00	46,497,000	貸付有価証券 89,000株
E P Sホールディングス	50,800	1,520.00	77,216,000	
プレステージ・インターナショナル	42,700	1,004.00	42,870,800	貸付有価証券 700株
アミューズ	16,500	3,995.00	65,917,500	
ドリームインキュベータ	17,900	2,364.00	42,315,600	貸付有価証券 8,000株
クイック	25,600	1,073.00	27,468,800	
T A C	29,800	214.00	6,377,200	
ケネディクス	792,100	440.00	348,524,000	貸付有価証券 520,800株
電通	620,800	6,230.00	3,867,584,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	22,500	792.00	17,820,000	
ぴあ	15,900	2,270.00	36,093,000	貸付有価証券 8,900株

イオンファンタジー	17,500	2,075.00	36,312,500	貸付有価証券 9,800株
ネクシィーズ	21,300	750.00	15,975,000	貸付有価証券 1,600株
みらかホールディングス	142,000	6,090.00	864,780,000	
アルプス技研	22,400	2,673.00	59,875,200	
サニックス	66,500	353.00	23,474,500	貸付有価証券 46,300株
ダイオーズ	11,600	1,191.00	13,815,600	貸付有価証券 5,300株
日本空調サービス	27,500	995.00	27,362,500	
オリエンタルランド	602,200	7,679.00	4,624,293,800	
ダスキン	157,800	2,133.00	336,587,400	
明光ネットワークジャパン	64,500	1,471.00	94,879,500	貸付有価証券 32,900株
ファルコホールディングス	24,700	1,495.00	36,926,500	
秀英予備校	10,400	746.00	7,758,400	
田谷	9,100	768.00	6,988,800	貸付有価証券 4,600株
ラウンドワン	159,100	583.00	92,755,300	
リゾートトラスト	211,500	3,095.00	654,592,500	
ビー・エム・エル	32,800	3,650.00	119,720,000	
ワタベウェディング	18,000	492.00	8,856,000	
もしもしホットライン	103,600	1,340.00	138,824,000	
リソー教育	85,600	306.00	26,193,600	貸付有価証券 46,900株
早稲田アカデミー	8,400	856.00	7,190,400	
ユー・エス・エス	674,300	2,115.00	1,426,144,500	
東京個別指導学院	27,700	654.00	18,115,800	貸付有価証券 17,200株
サイバーエージェント	136,100	5,850.00	796,185,000	貸付有価証券 43,200株
楽天	2,604,600	1,928.00	5,021,668,800	貸付有価証券 789,900株
テー・オー・ダブリュー	32,800	569.00	18,663,200	
セントラルスポーツ	18,400	2,280.00	41,952,000	貸付有価証券 10,900株
フルキャストホールディングス	56,800	836.00	47,484,800	貸付有価証券 17,500株



リゾートソリューション	55,000	303.00	16,665,000	
テクノプロ・ホールディングス	79,000	3,115.00	246,085,000	
リブセンス	33,400	584.00	19,505,600	貸付有価証券 20,800株
ジャパンマテリアル	23,300	1,745.00	40,658,500	貸付有価証券 12,700株
ベクトル	12,000	1,750.00	21,000,000	
ウチヤマホールディングス	32,600	502.00	16,365,200	
サクセスホールディングス	6,000	1,264.00	7,584,000	貸付有価証券 3,800株
キャリアリンク	7,100	1,808.00	12,836,800	
アサンテ	18,000	1,526.00	27,468,000	貸付有価証券 5,800株
N・フィールド	12,800	1,799.00	23,027,200	
M&Aキャピタルパートナーズ	2,100	3,250.00	6,825,000	
E R Iホールディングス	14,100	920.00	12,972,000	貸付有価証券 7,200株
アビスト	5,800	1,417.00	8,218,600	
ウィルグループ	6,300	1,760.00	11,088,000	
リクルートホールディングス	842,500	3,705.00	3,121,462,500	
リロ・ホールディング	18,600	12,820.00	238,452,000	
東祥	11,700	2,855.00	33,403,500	
エイチ・アイ・エス	90,800	4,230.00	384,084,000	
共立メンテナンス	33,200	7,690.00	255,308,000	貸付有価証券 17,400株
イチネンホールディングス	58,600	1,108.00	64,928,800	
建設技術研究所	33,100	1,170.00	38,727,000	
スペース	30,800	1,159.00	35,697,200	
燦ホールディングス	10,700	1,720.00	18,404,000	
スバル興業	40,000	431.00	17,240,000	
東京テアトル	219,000	139.00	30,441,000	
よみうりランド	108,000	426.00	46,008,000	貸付有価証券 58,000株
東京都競馬	381,000	282.00	107,442,000	貸付有価証券 242,000株
常磐興産	209,000	153.00	31,977,000	
カナモト	77,700	2,980.00	231,546,000	
東京ドーム	381,000	501.00	190,881,000	

西尾レントオール	45,100	2,933.00	132,278,300	
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	240,000	45.00	10,800,000	貸付有価証券 4,000株
トランス・コスモス	72,800	3,115.00	226,772,000	
乃村工藝社	109,200	1,438.00	157,029,600	
藤田観光	203,000	402.00	81,606,000	貸付有価証券 119,000株
KNT-CTホールディングス	272,000	161.00	43,792,000	貸付有価証券 153,000株
日本管財	27,400	2,705.00	74,117,000	
トーカイ	24,700	4,115.00	101,640,500	
白洋舎	57,000	279.00	15,903,000	
セコム	540,800	7,908.00	4,276,646,400	
セントラル警備保障	25,200	1,359.00	34,246,800	
丹青社	64,100	1,151.00	73,779,100	
メイテック	74,600	4,530.00	337,938,000	
アサツー ディ・ケイ	104,700	2,759.00	288,867,300	
応用地質	58,600	1,594.00	93,408,400	
船井総研ホールディングス	60,200	1,510.00	90,902,000	
進学会	24,000	632.00	15,168,000	
ベネッセホールディングス	203,600	3,155.00	642,358,000	貸付有価証券 143,600株
イオンディライト	53,800	3,815.00	205,247,000	
ナック	37,500	998.00	37,425,000	貸付有価証券 12,900株
ニチイ学館	109,600	1,056.00	115,737,600	貸付有価証券 75,000株
ダイセキ	89,700	2,348.00	210,615,600	貸付有価証券 49,100株
ステップ	18,000	1,026.00	18,468,000	
合 計	896,423,792		1,235,855,856,242	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2015年 7月31日現在です。

### 【純資産額計算書】

資産総額	1,414,878,522,926円
負債総額	95,371,357,809円
純資産総額（ - ）	1,319,507,165,117円
発行済口数	789,416,337口
1口当たり純資産額（ / ）	1,671.50円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）名義書換

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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。

### （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、交換請求の受付および交換株式の交付（信託終了時の交換等を含みます。）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27年7月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の意思決定機関（平成27年7月末現在）

###### ・株主総会

株主総会は、取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

当社の取締役会は10名以内の取締役で構成され、取締役の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、代表取締役若干名を選定します。

###### ・監査役会

当社の監査役会は5名以内の監査役で構成され、監査役の任期は選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までを任期とします。監査役会は、その決議をもって常勤の監査役を選定します。

##### (3) 運用の意思決定プロセス（平成27年7月末現在）

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

### 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成27年7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	576	120,318

株式投資信託	520	93,325
単位型	96	2,861
追加型	424	90,464
公社債投資信託	56	26,992
単位型	40	395
追加型	16	26,597
投資法人合計	1	12

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度(平成26年4月1日から平成27年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3 17,805	3 14,206
有価証券	234	277
前払費用	3 419	3 509
未収入金	37	3
未収委託者報酬	7,162	8,441
未収収益	3 608	3 1,566
関係会社短期貸付金	240	436
立替金	303	666
繰延税金資産	984	1,446
その他	2 30	2 195
流動資産合計	27,826	27,750
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 47	1 56
器具備品	1 134	1 166
有形固定資産合計	181	222
無形固定資産		
ソフトウェア	91	113
無形固定資産合計	91	113
投資その他の資産		
投資有価証券	7,290	14,184
関係会社株式	21,702	21,702

関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	692	740
長期前払費用	-	0
繰延税金資産	525	248
投資その他の資産合計	30,271	36,936
固定資産合計	30,544	37,273
資産合計	58,371	65,023

(単位：百万円)

	第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	329	387
未払金	3,404	5,545
未払収益分配金	6	6
未払償還金	112	112
未払手数料	3 2,743	3 3,145
その他未払金	542	2,282
未払費用	3 3,239	3 4,636
未払法人税等	2,286	814
未払消費税等	4 356	4 1,070
賞与引当金	1,935	1,990
役員賞与引当金	150	120
その他	-	3 82
流動負債合計	11,702	14,646
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	1,081	1,111
その他	55	-
固定負債合計	1,137	1,111
負債合計	12,840	15,758
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	22,694	25,836
利益剰余金合計	22,694	25,836
自己株式	68	68
株主資本合計	45,209	48,351
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	321	1,002
繰延ヘッジ損益	-	88
評価・換算差額等合計	321	913

純資産合計	45,531	49,265
負債純資産合計	58,371	65,023

## (2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,120	63,990
その他営業収益	2,557	3,729
営業収益合計	65,678	67,719
営業費用		
支払手数料	31,207	30,408
広告宣伝費	1,081	1,045
公告費	2	5
調査費	13,405	15,571
調査費	712	747
委託調査費	12,669	14,782
図書費	23	41
委託計算費	465	502
営業雑経費	558	660
通信費	186	199
印刷費	252	263
協会費	43	64
諸会費	11	27
その他	65	106
営業費用計	46,721	48,193
一般管理費		
給料	7,171	7,585
役員報酬	316	289
役員賞与引当金繰入額	150	120
給料・手当	4,719	5,127
賞与	50	59
賞与引当金繰入額	1,935	1,990
交際費	108	163
寄付金	54	36
旅費交通費	448	503
租税公課	209	208
不動産賃借料	755	785
退職給付費用	313	349
退職金	32	16
固定資産減価償却費	109	148
福利費	847	908
諸経費	2,517	2,673
一般管理費計	12,568	13,380
営業利益	6,388	6,146

(単位：百万円)



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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第55期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

(単位：百万円)

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

当期首残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045
会計方針の変更による累積的影響額							-
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045
当期変動額							
剰余金の配当				1,380	1,380		1,380
当期純利益				544	544		544
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	836	836	-	836
当期末残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	362	362	46,408
会計方針の変更による累積的影響額		-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	362	362	46,408
当期変動額			
剰余金の配当			1,380
当期純利益			544
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	40	40	40
当期変動額合計	40	40	876
当期末残高	321	321	45,531

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209
会計方針の変更による累積的影響額				41	41		41
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,735	22,735	68	45,250
当期変動額							
当期純利益				3,101	3,101		3,101
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	3,101	3,101	-	3,101
当期末残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	321	-	321	45,531
会計方針の変更による累積的影響額			-	41
会計方針の変更を反映した当期首残高	321	-	321	45,572
当期変動額				
当期純利益				3,101
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	680	88	591	591
当期変動額合計	680	88	591	3,692
当期末残高	1,002	88	913	49,265

## [注記事項]

(重要な会計方針)

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

	<p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

（会計方針の変更）

<p>第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)</p>
<p>「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を平均残存勤務年数に対応した高格付社債の流通利回りを基礎とする方法から退職給付の支払見込期間及び期間毎の金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。</p> <p>退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。</p> <p>この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が63百万円減少、繰延税金資産が22百万円減少、繰越利益剰余金が41百万円増加しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益への影響は軽微であります。なお、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益金額に対する影響額は、軽微であります。</p>

（表示方法の変更）

<p>第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)</p>
<p>（損益計算書関係） 前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「福利費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。</p> <p>この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた3,364百万円は、「福利費」847百万円、「諸経費」2,517百万円として組み替えております。</p>

## （貸借対照表関係）

第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,091百万円</p> <p>器具備品 625百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 6,249百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 74百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 98百万円</p> <p>未払費用 274百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務65百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務159百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,122百万円</p> <p>器具備品 679百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 4,256百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 110百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 108百万円</p> <p>未払費用 500百万円</p> <p>その他 57百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務27百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務842百万円に対して保証を行っております。</p>

## （損益計算書関係）

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

## (株主資本等変動計算書関係)

第55期(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	16,978,500	-	1,075,800	15,902,700	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,626,900	-	59,400	1,567,500	-
平成22年度ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	5,930,100	-	541,200	5,388,900	-
合計		29,800,700	-	1,676,400	28,124,300	-

- (注) 1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)及び平成23年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
- 2 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。
- 3 平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株及び平成23年度ストックオプション(1)2,887,500株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年5月27日 取締役会	普通株式	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18日

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

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高 (百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	15,902,700	-	-	15,902,700	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,567,500	-	-	1,567,500	-
平成22年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	2,955,200	-	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	5,388,900	-	359,700	5,029,200	-
合計		28,124,300	-	3,314,900	24,809,400	-

- (注) 1 平成23年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。  
2 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。なお、当該新株予約権は平成27年2月8日に失効いたしました。  
3 平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株及び平成23年度ストックオプション(1)4,075,500株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

該当事項はありません。

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年5月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	850	4.32	平成27年3月31日	平成27年6月30日

## (リース取引関係)

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料
1年内 751百万円	1年内 841百万円
1年超 77百万円	1年超 3,420百万円
合計 828百万円	合計 4,261百万円

## (金融商品関係)

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理



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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

平成26年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

( )負債に計上されているものについては、( )で示しております。

### (注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

#### (4) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

#### (5) 未払金及び(6) 未払費用

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

2 非上場株式等(貸借対照表計上額66百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額18,809百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

### 1 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

### 信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

### 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

### 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

( 1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

(7) デリバティブ取引

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

2 非上場株式等(貸借対照表計上額30百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額18,809百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,206	-	-	-
未収委託者報酬	8,441	-	-	-
未収収益	1,566	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	277	1,219	3,205	1,232
合計	24,492	1,219	3,205	1,232

(有価証券関係)

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
--	----	----------	------	----

貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	12,839	11,293	1,546
	小計	12,839	11,293	1,546
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	1,591	1,656	64
	小計	1,591	1,656	64
合計		14,431	12,949	1,482

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 30百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

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

### （デリバティブ取引関係）

第55期(平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(平成27年3月31日)

#### 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### （1）株式関連

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

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

#### 2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

#### 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

##### （1）通貨関連

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

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第55期 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)		第56期 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)		関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,065	(1) 関連会社に対する投資の金額	3,078
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	7,660	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,396
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,379	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,720

(退職給付関係)

第55期(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.8%

### 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、176百万円でありました。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

#### 1 採用している退職給付制度の概要

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

#### 2 確定給付制度

##### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,111
貸借対照表に計上された負債の額	1,111

##### (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

##### (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.6%

### 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、196百万円でありました。

## （ストックオプション等関係）

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。



## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション(新株予約権)の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	16,978,500	1,626,900
付与	0	0
失効	1,075,800	59,400
権利確定	0	0
権利未確定残	15,902,700	1,567,500
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,930,100
付与	0	0
失効	0	541,200
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,388,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

## 単価情報

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

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

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日

権利確定条件	平成24年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

### ストックオプション(新株予約権)の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	15,902,700	1,567,500
付与	0	0
失効	0	0
権利確定	0	0
権利未確定残	15,902,700	1,567,500
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,388,900
付与	0	0
失効	0	359,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,029,200
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-

失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

(税効果会計関係)

第55期 (平成26年 3 月31日)	第56期 (平成27年 3 月31日)
------------------------	------------------------

<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">689</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">294</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">984</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">148</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">1,665</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">385</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却費</td> <td style="text-align: right;">158</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">34</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,391</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">1,665</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,710</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">200</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">200</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,510</td> </tr> </table>	賞与引当金	689	その他	294	小計	984	投資有価証券評価損	148	関係会社株式評価損	1,665	退職給付引当金	385	固定資産減価償却費	158	その他	34	小計	2,391	評価性引当金	1,665	繰延税金資産合計	1,710	その他有価証券評価差額金	200	繰延税金負債合計	200	繰延税金資産の純額	1,510	<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">658</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">813</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,472</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">134</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">1,510</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">360</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却費</td> <td style="text-align: right;">133</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">73</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,213</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">1,510</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,174</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">25</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">25</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">454</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">454</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">480</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,694</td> </tr> </table>	賞与引当金	658	その他	813	小計	1,472	投資有価証券評価損	134	関係会社株式評価損	1,510	退職給付引当金	360	固定資産減価償却費	133	その他	73	小計	2,213	評価性引当金	1,510	繰延税金資産合計	2,174	その他有価証券評価差額金	25	小計	25	その他有価証券評価差額金	454	小計	454	繰延税金負債合計	480	繰延税金資産の純額	1,694
賞与引当金	689																																																														
その他	294																																																														
小計	984																																																														
投資有価証券評価損	148																																																														
関係会社株式評価損	1,665																																																														
退職給付引当金	385																																																														
固定資産減価償却費	158																																																														
その他	34																																																														
小計	2,391																																																														
評価性引当金	1,665																																																														
繰延税金資産合計	1,710																																																														
その他有価証券評価差額金	200																																																														
繰延税金負債合計	200																																																														
繰延税金資産の純額	1,510																																																														
賞与引当金	658																																																														
その他	813																																																														
小計	1,472																																																														
投資有価証券評価損	134																																																														
関係会社株式評価損	1,510																																																														
退職給付引当金	360																																																														
固定資産減価償却費	133																																																														
その他	73																																																														
小計	2,213																																																														
評価性引当金	1,510																																																														
繰延税金資産合計	2,174																																																														
その他有価証券評価差額金	25																																																														
小計	25																																																														
その他有価証券評価差額金	454																																																														
小計	454																																																														
繰延税金負債合計	480																																																														
繰延税金資産の純額	1,694																																																														
<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">38.0%</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>評価性引当金の増減</td> <td style="text-align: right;">46.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">3.7%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">12.9%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">1.9%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">6.9%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">84.2%</td> </tr> </table>	法定実効税率	38.0%	(調整)		評価性引当金の増減	46.6%	交際費等永久に損金に算入されない項目	3.7%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	12.9%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.9%	海外子会社の留保利益の影響額等	6.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	84.2%	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">35.6%</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">1.3%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">4.3%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">3.6%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">1.7%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">37.9%</td> </tr> </table>	法定実効税率	35.6%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	1.3%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.3%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.6%	海外子会社の留保利益の影響額等	1.7%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.9%																																
法定実効税率	38.0%																																																														
(調整)																																																															
評価性引当金の増減	46.6%																																																														
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.7%																																																														
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	12.9%																																																														
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.9%																																																														
海外子会社の留保利益の影響額等	6.9%																																																														
税効果会計適用後の法人税等の負担率	84.2%																																																														
法定実効税率	35.6%																																																														
(調整)																																																															
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.3%																																																														
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.3%																																																														
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.6%																																																														
海外子会社の留保利益の影響額等	1.7%																																																														
税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.9%																																																														

## 3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

## 3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第9号)の施行に伴い平成26年4月1日に開始する事業年度から、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.1%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.3%となります。この結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は135百万円、繰延ヘッジ損益が4百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が48百万円、法人税等調整額が179百万円、それぞれ増加しております。

## ( 関連当事者情報 )

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社  
重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (千SGD)	事業の 内容	議決権 等の所有(被所有) 割合 (%)	関連 当事 者との 関係	取引の 内容	取引金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	398 (千SGD 5,059) (注2)	関係会社短期貸付金	240 (千SGD 2,940)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	15 (千SGD 192)	未収収益	5 (千SGD 64)
							増資の引受(注3)	3,266 (千SGD 40,000)	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11百万、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額 398百万円( 5,059千SGD)の内訳は、貸付240百万円(2,940千SGD)及び返済638百万円(8,000千SGD)であります。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った40,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成25年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	15,790百万円
負債合計	1,713百万円
純資産合計	14,076百万円
営業収益	11,350百万円
税引前当期純利益	4,212百万円
当期純利益	3,096百万円

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社  
重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (千SGD)	事業の 内容	議決権 等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連 当事者 との 関係	取引の 内容	取引金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガ ポール 国	292,000	アセット マネジメ ント業	直接 100.00	資金の 貸付	資金の 貸付 (シンガ ポール ドル貨 建) (注1)	184 (千 SGD 2,059) (注2)	関係 会社 短期 貸付 金	436 (千 SGD 5,000)
							貸付金 利息 (シンガ ポール ドル貨 建) (注1)	7 (千 SGD 92)	未収 収益	7 (千 SGD 82)

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11百万、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額184百万円(2,059千 SGD)の内訳は、貸付424百万円(5,000千 SGD)及び返済240百万円(2,940千 SGD)であります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成26年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	23,832百万円
負債合計	6,549百万円
純資産合計	17,283百万円
営業収益	15,406百万円
税引前当期純利益	4,977百万円
当期純利益	3,441百万円

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

## 関連情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、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56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産



国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

( 1株当たり情報 )

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

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

### 2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(百万円)	544	3,101
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	544	3,101
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 15,902,700株、 平成21年度ストックオプション(2) 1,567,500株、 平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、 第1回新株予約権2,955,200株、 平成23年度ストックオプション(1) 5,388,900株	平成21年度ストックオプション(1) 15,902,700株、 平成21年度ストックオプション(2) 1,567,500株、 平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、 平成23年度ストックオプション(1) 5,029,200株

### 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	45,531	49,265
純資産の部の合計額から控除する金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	45,531	49,265
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末 の普通株式の数（千株）	196,903	196,903

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成27年3月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

- 名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社  
 資本金の額 : 10,000百万円（平成27年3月末現在）  
 事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。  
 再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本マスタートラスト信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

## （2）販売会社

名 称	資本金の額 （平成27年3月末現在）	事業の内容
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	4,500百万円	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	
クレディ・アグリコル証券会社 東京支店	38,500百万円	
クレディ・スイス証券株式会社	78,100百万円	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	
J P モルガン証券株式会社	73,272百万円	
シティグループ証券株式会社	96,307百万円	
ソシエテ ジェネラル証券会社 東京支店	31,703百万円	
大和証券株式会社	100,000百万円	
ドイツ証券株式会社	72,728百万円	
野村証券株式会社	10,000百万円	
パークレイズ証券株式会社	32,945百万円	
B N P パリバ証券株式会社	102,025百万円	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
メリルリンチ日本証券株式会社	119,440百万円	
モルガン・スタンレーM U F G 証券株式会社	62,100百万円	
U B S 証券株式会社	46,450百万円	

## 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などの管理・計算事務・収益分配金の支払いなどを行いません。

### （2）販売会社

日本におけるファンドの募集の取扱い、交換に関する業務、買取りに関する業務、信託終了時の交換などに関する業務などを行いません。

## 3【資本関係】

### （1）受託会社

該当事項はありません。

### （2）販売会社

該当事項はありません。

## 第3【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26年10月 8日	有価証券届出書
平成26年10月 8日	有価証券報告書
平成27年 4月 8日	有価証券届出書の訂正届出書
平成27年 4月 8日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

平成27年6月15日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成27年8月5日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### PWCあらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫  
業務執行社員

指定社員 公認会計士 辻村 和之  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている上場インデックスファンドTOPIXの平成26年7月9日から平成27年7月8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、上場インデックスファンドTOPIXの平成27年7月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。