

**【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28年10月7日提出
【計算期間】	第15期(自 平成27年7月9日至 平成28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。

※取得申込時に抽出された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

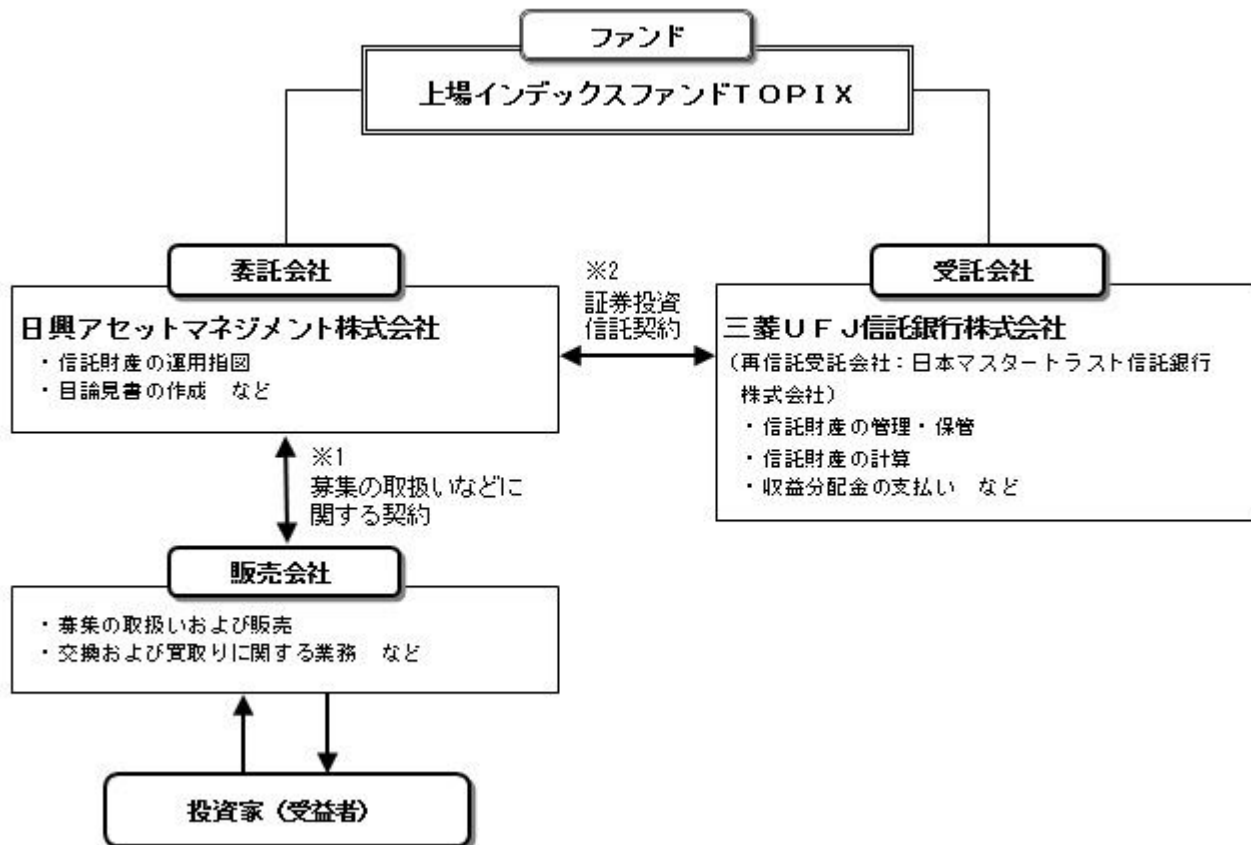
- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

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28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

その他連動性を維持するために委託会社が必要と認めた場合

- ・ T O P I X (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】

T O P I X (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

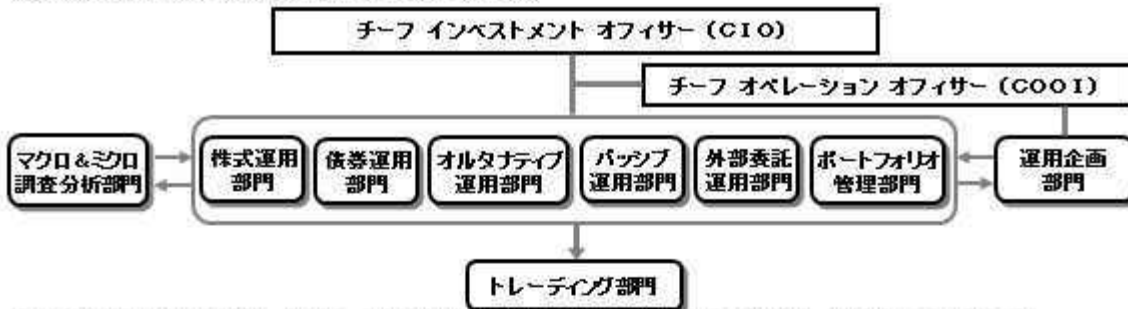
次の取引ができます。

1) 先物取引等

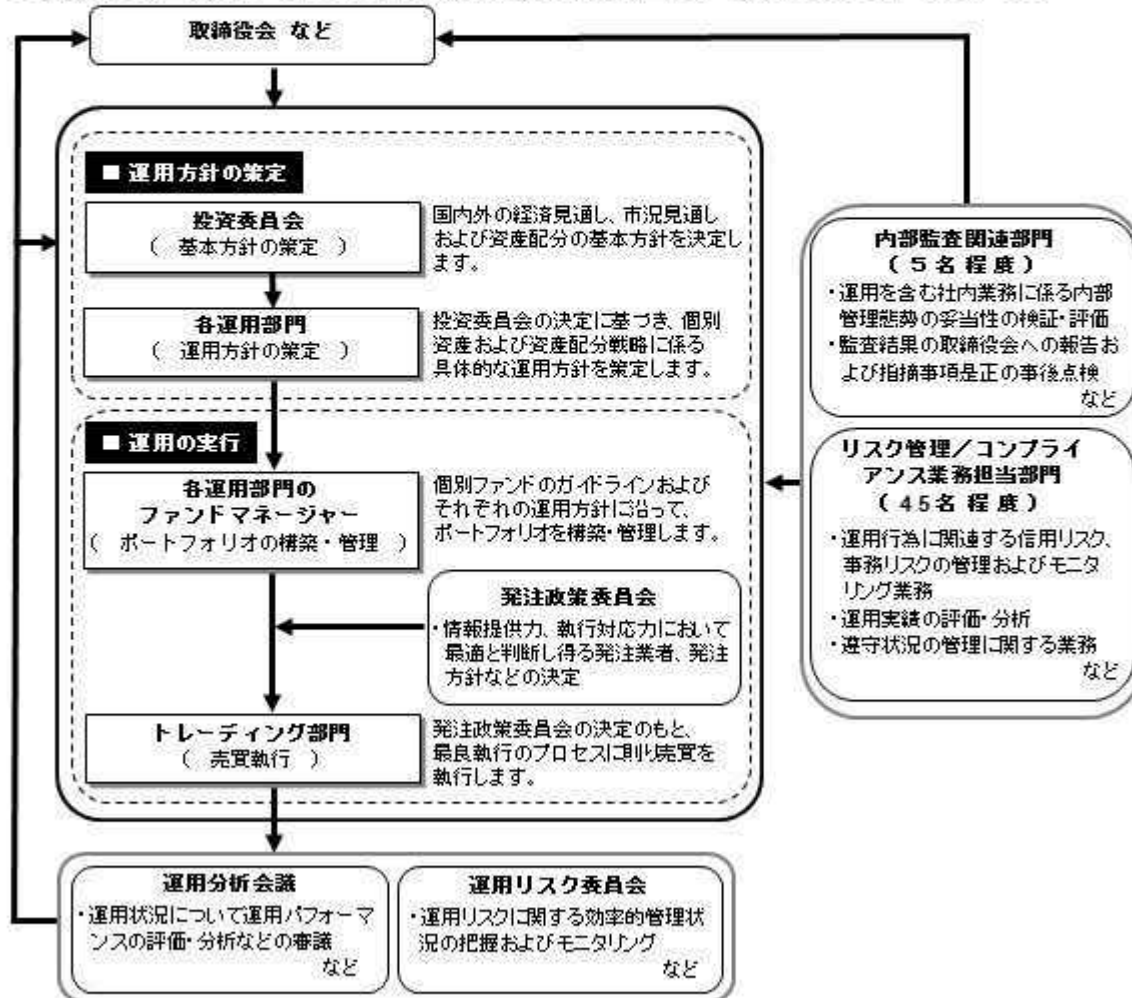
2) 有価証券の貸付

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

上記体制は平成28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ます。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・交換の取り扱いを停止する場合があります。

##### ・ 運用制限や規制上の制限に関する事項

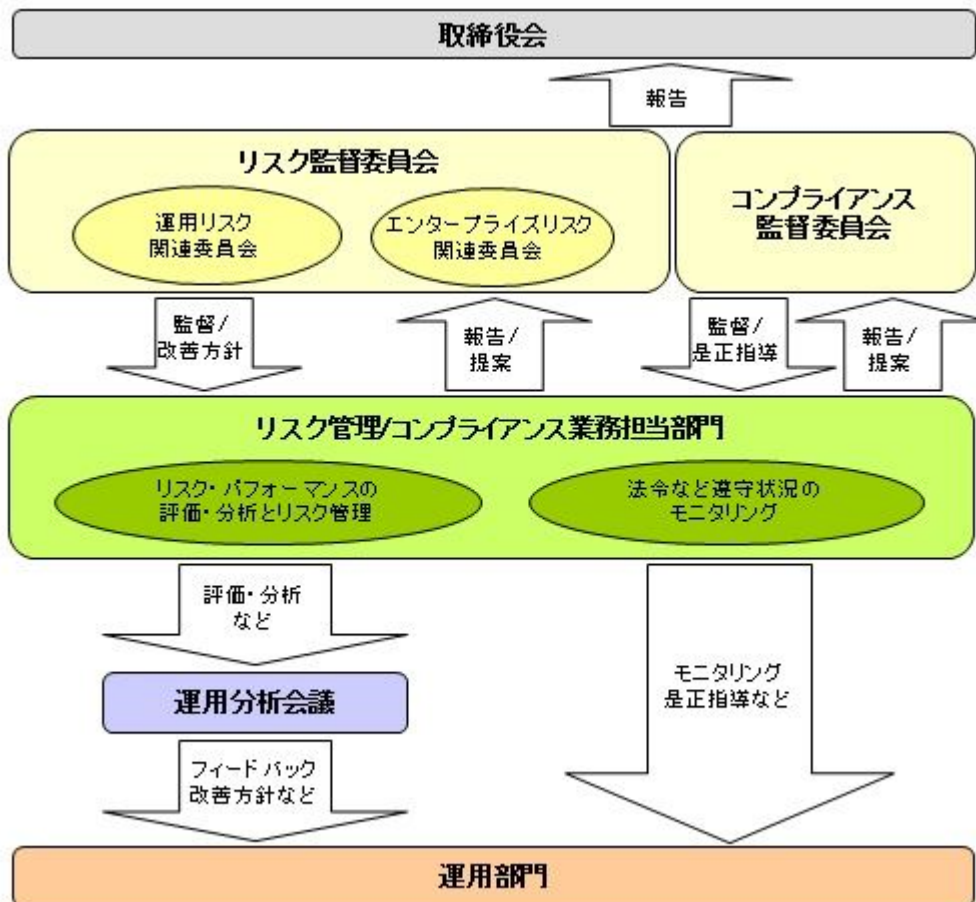
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連し

て、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性やインデックスと基準価額が乖離する可能性があります。

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

## (2) リスク管理体制



### 全社的リスク管理

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

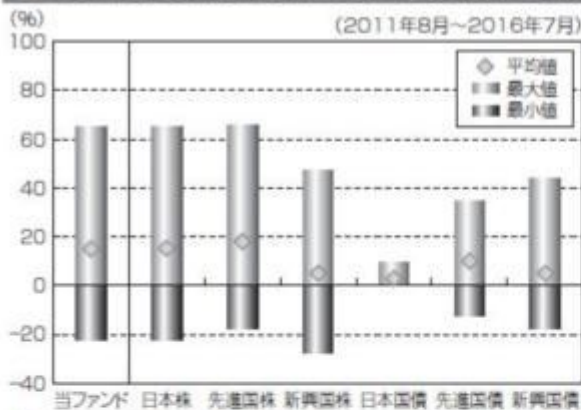
### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成28年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	15.0%	15.2%	18.0%	5.0%	2.8%	9.9%	4.9%
最大値	64.9%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	-22.1%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	0.4%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2011年8月から2016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-BPI国債

先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

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

**MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)**

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

**MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)**

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

**NOMURA-BPI国債**

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

**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

**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、2011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。

加重平均した指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLC に帰属します。

#### JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(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賃料に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「TOPIX(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、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、未成年者少額投資非課税制度(ジュニアNISA)をご利用の場合、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年間非課税となります。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28年10月7日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【上場インデックスファンドTOPIX】

以下の運用状況は2016年7月29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	1,264,057,570,910	99.70
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		3,774,190,582	0.30
合計(純資産総額)		1,267,831,761,492	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	3,772,940,000	0.30

(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	8,031,800	5,062.96	40,664,718,838	5,894.00	47,339,429,200	3.73
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	51,139,600	429.54	21,966,916,784	522.00	26,694,871,200	2.11
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,926,700	4,830.54	23,798,650,540	4,881.00	24,047,222,700	1.90
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3,611,400	5,402.30	19,509,879,920	5,703.00	20,595,814,200	1.62
日本	株式	KDDI	情報・通信業	6,305,300	3,135.32	19,769,163,040	3,145.00	19,830,168,500	1.56
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	5,103,900	2,779.29	14,185,224,375	3,308.00	16,883,701,200	1.33
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	5,811,600	2,480.15	14,413,658,652	2,841.50	16,513,661,400	1.30
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	4,011,100	4,289.05	17,203,808,455	4,025.00	16,144,677,500	1.27
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	90,665,800	142.26	12,898,936,444	167.10	15,150,255,180	1.19

日本	株式	ソニー	電気機器	4,557,200	3,015.01	13,740,020,321	3,282.00	14,956,730,400	1.18
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	4,762,600	2,795.59	13,314,276,950	2,749.50	13,094,768,700	1.03
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	7,342,500	1,604.44	11,780,600,700	1,721.50	12,640,113,750	1.00
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	2,694,200	4,256.34	11,467,446,199	4,588.00	12,360,989,600	0.97
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2,666,100	4,082.81	10,885,189,856	4,303.00	11,472,228,300	0.90
日本	株式	ファナック	電気機器	654,700	15,523.47	10,163,215,809	17,325.00	11,342,677,500	0.89
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	1,180,300	9,342.25	11,026,665,380	9,485.00	11,195,145,500	0.88
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	578,200	18,078.23	10,452,835,977	19,220.00	11,113,004,000	0.88
日本	株式	キーエンス	電気機器	146,300	70,751.17	10,350,896,910	72,920.00	10,668,196,000	0.84
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	2,582,400	3,258.78	8,415,492,770	4,040.00	10,432,896,000	0.82
日本	株式	キヤノン	電気機器	3,477,100	2,804.94	9,753,086,244	2,935.00	10,205,288,500	0.80
日本	株式	花王	化学	1,718,400	5,828.99	10,016,536,416	5,553.00	9,542,275,200	0.75
日本	株式	三菱地所	不動産業	4,738,000	1,730.18	8,197,594,030	1,929.00	9,139,602,000	0.72
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	8,804,700	920.22	8,102,261,034	1,012.00	8,910,356,400	0.70
日本	株式	村田製作所	電気機器	681,200	10,497.21	7,150,700,000	12,825.00	8,736,390,000	0.69
日本	株式	信越化学工業	化学	1,213,100	5,905.87	7,164,421,994	7,064.00	8,569,338,400	0.68
日本	株式	任天堂	その他製品	397,700	16,370.71	6,510,634,816	21,505.00	8,552,538,500	0.67
日本	株式	三菱商事	卸売業	4,782,900	1,749.84	8,369,334,926	1,778.50	8,506,387,650	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	940,300	8,041.49	7,561,420,443	9,012.00	8,473,983,600	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	6,890,000	1,110.05	7,648,306,560	1,217.50	8,388,575,000	0.66
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	2,282,500	3,144.53	7,177,393,672	3,601.00	8,219,282,500	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	0.11
		鉱業	0.28
		建設業	3.31
		食料品	5.08
		繊維製品	0.74
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.23
		医薬品	5.75
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.86
		ガラス・土石製品	0.93
		鉄鋼	1.15
		非鉄金属	0.87
		金属製品	0.66
		機械	4.81
		電気機器	11.94
輸送用機器	9.56		
精密機器	1.51		



	その他製品	1.78
	電気・ガス業	1.88
	陸運業	4.57
	海運業	0.21
	空運業	0.59
	倉庫・運輸関連業	0.20
	情報・通信業	8.40
	卸売業	4.05
	小売業	4.88
	銀行業	7.51
	証券、商品先物取引業	1.00
	保険業	2.40
	その他金融業	1.27
	不動産業	2.61
	サービス業	3.86
合 計		99.70

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2016年09月	買建	284	日本円	3,489,850,380	3,772,940,000	0.30

(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
第15計算期間末 (2016年 7月 8日)	1,149,571	1,173,804	1,217.26	1,242.92	1,216
2015年 7月末日	1,319,507		1,671.50		1,668
8月末日	1,246,986		1,548.33		1,546
9月末日	1,161,999		1,432.23		1,431
10月末日	1,278,473		1,581.42		1,581
11月末日	1,302,979		1,603.85		1,605
12月末日	1,325,914		1,572.13		1,572
2016年 1月末日	1,286,667		1,455.04		1,461
2月末日	1,191,247		1,318.88		1,319
3月末日	1,242,751		1,381.91		1,381
4月末日	1,235,076		1,374.82		1,375
5月末日	1,287,286		1,415.58		1,413
6月末日	1,204,768		1,279.89		1,281
7月末日	1,267,831		1,330.79		1,330

(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
第15期	2015年 7月 9日～2016年 7月 8日	25.6600

#### 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
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
第15期	2015年 7月 9日～2016年 7月 8日	22.02

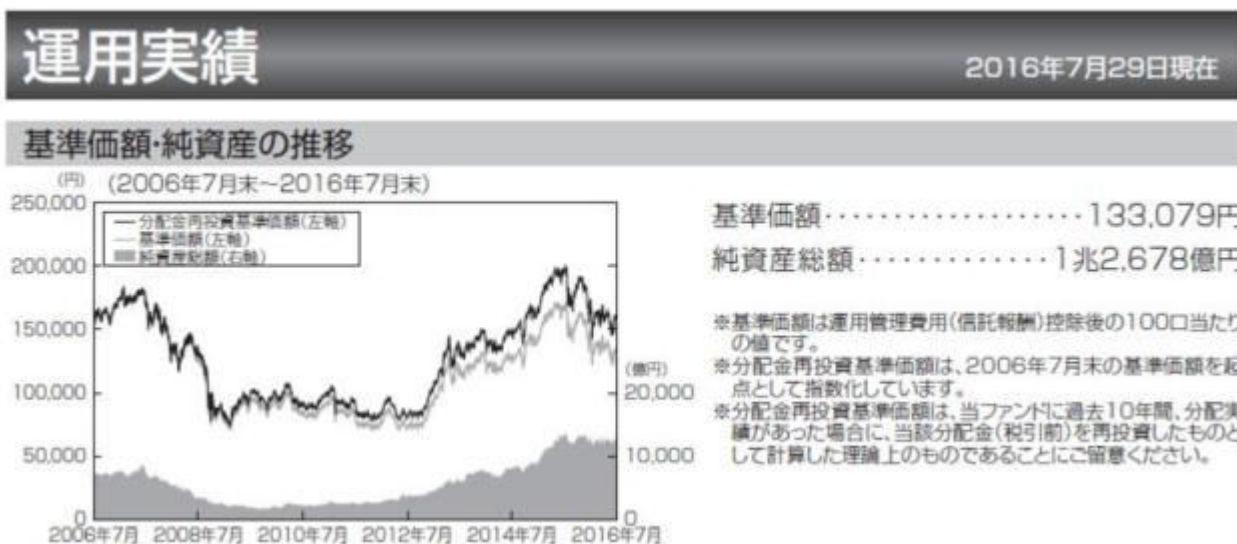
(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配落ち)に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

#### (4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第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
第15期	2015年 7月 9日～2016年 7月 8日	240,119,800	73,043,677

(注)解約口数は交換口数を表示しております。

#### 参考情報



## 分配の推移(税引前、100口当たり)

2012年7月	2013年7月	2014年7月	2015年7月	2016年7月	設定来累計
1,305円	1,858円	2,076円	2,189円	2,566円	26,451円

## 主要な資産の状況

### <資産構成比率>

組入資産	比率
株式	100.00%
うち先物	0.30%
現金その他	0.30%

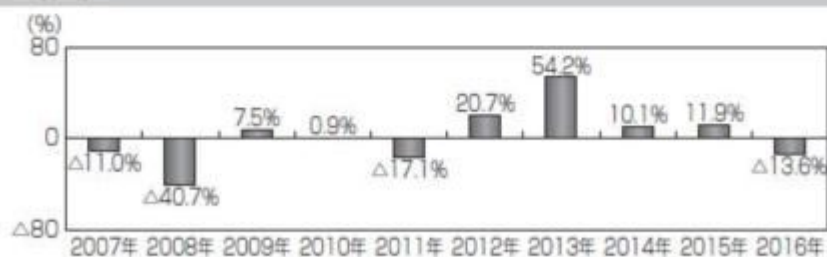
※対純資産総額比です。

### <組入上位10銘柄>

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.73%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.11%
3	日本電信電話	情報・通信業	1.90%
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.62%
5	KDDI	情報・通信業	1.56%
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.33%
7	本田技研工業	輸送用機器	1.30%
8	日本たばこ産業	食料品	1.27%
9	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.19%
10	ソニー	電気機器	1.18%

※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。

※2016年は、2016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、拠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3営業日前以降の3営業日間（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の4営業日前以降の4営業日間）
- 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号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

## 2【換金（解約）手続等】

### (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3営業日前以降の3営業日間(ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の4営業日前以降の4営業日間)

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、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。

### <基準価額算出の流れ>



#### 有価証券などの評価基準

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

#### <主な資産の評価方法>

##### 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。

#### <委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

無期限とします（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

ハ) TOPIX（東証株価指数）が廃止された場合

ニ) 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

ヘ) 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異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

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

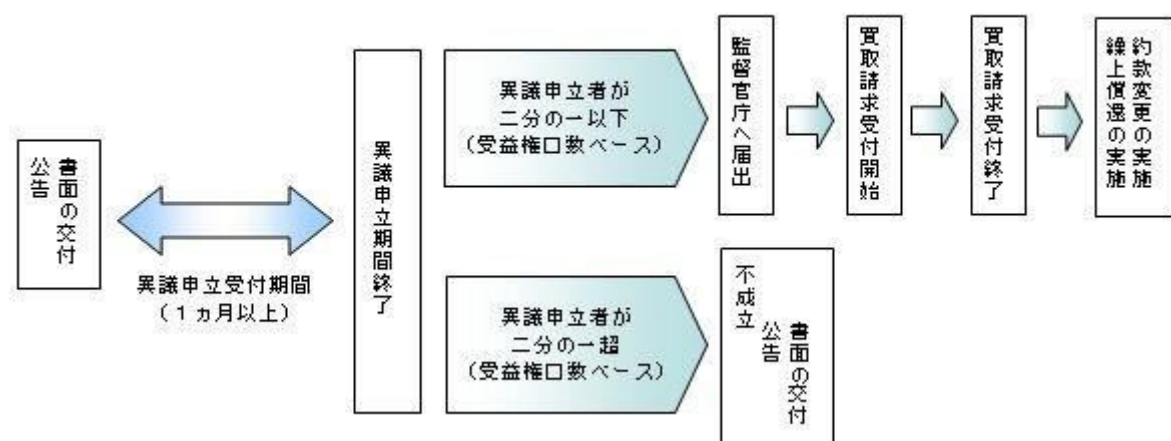
#### 異議の申立て

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

2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、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へ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せん。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15期計算期間（平成27年 7月 9日から平成28年 7月 8日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【上場インデックスファンドTOPIX】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 平成27年 7月 8日現在	第15期 平成28年 7月 8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	112,096,462,452
コール・ローン	75,642,990,660	11,848,654,378
株式	1,235,855,856,242	1,146,640,991,470
未収入金	11,427,425,710	15,195,700,550
未収配当金	1,165,966,167	1,652,636,568
未収利息	14,148	-
前払金	132,706,000	882,281,000
その他未収収益	42,800,748	97,548,566
流動資産合計	1,324,267,759,675	1,288,414,274,984
資産合計		
	1,324,267,759,675	1,288,414,274,984
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	174,412,920	123,408,680
未払金	303,425,320	912,220,840
未払収益分配金	17,015,469,173	24,233,127,587
未払受託者報酬	325,692,116	443,705,561
未払委託者報酬	656,532,018	875,254,979
未払利息	673,745	17,396
受入担保金	66,672,678,187	112,096,462,452
その他未払費用	144,035,942	158,675,167
流動負債合計	85,292,919,421	138,842,872,662
負債合計		
	85,292,919,421	138,842,872,662
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	774,985,050,994	941,559,945,625
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	463,989,789,260	208,011,456,697
(分配準備積立金)	17,779,527	40,360,286
元本等合計	1,238,974,840,254	1,149,571,402,322
純資産合計		
	1,238,974,840,254	1,149,571,402,322
負債純資産合計		
	1,324,267,759,675	1,288,414,274,984

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	平成26年 7月 9日 至 平成27年 7月 8日	自	平成27年 7月 9日 至 平成28年 7月 8日
営業収益				
受取配当金		17,472,080,131		24,867,638,572
受取利息		14,109,140		6,276,473
有価証券売買等損益		193,984,553,903		331,530,181,101
派生商品取引等損益		1,187,032,184		960,876,640
その他収益		833,700,336		1,118,522,863
営業収益合計		213,491,475,694		306,498,619,833
営業費用				
支払利息		11,858,326		-
受託者報酬		325,692,116		443,705,561
委託者報酬		656,532,018		875,254,979
その他費用		304,234,968		417,769,022
営業費用合計		1,298,317,428		1,736,729,562
営業利益又は営業損失（ ）		212,193,158,266		308,235,349,395
経常利益又は経常損失（ ）		212,193,158,266		308,235,349,395
当期純利益又は当期純損失（ ）		212,193,158,266		308,235,349,395
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（ ）		174,882,233,381		463,989,789,260
剰余金増加額又は欠損金減少額		167,646,434,233		109,530,533,340
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		167,646,434,233		109,530,533,340
剰余金減少額又は欠損金増加額		73,716,567,447		33,040,388,921
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		73,716,567,447		33,040,388,921
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		17,015,469,173		24,233,127,587
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		463,989,789,260		208,011,456,697

## （ 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14期 平成27年 7月 8日現在	第15期 平成28年 7月 8日現在
1.	期首元本額	615,604,171,377円	774,985,050,994円
	期中追加設定元本額	336,713,320,500円	239,399,440,600円
	期中一部交換元本額	177,332,440,883円	72,824,545,969円
2.	受益権の総数	777,317,002口	944,393,125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	2,203,896,010円	1,346,157,590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	62,240,036,600円	104,562,200,130円

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第14期 自 平成26年 7月 9日 至 平成27年 7月 8日		第15期 自 平成27年 7月 9日 至 平成28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	18,308,031,281円	A 当期配当等収益額	25,992,437,908円
B 分配準備積立金	11,676,521円	B 分配準備積立金	17,779,527円

C 配当等収益額合計 (A+B)	18,319,707,802円	C 配当等収益額合計 (A+B)	26,010,217,435円
D 経費	1,286,459,102円	D 経費	1,736,729,562円
E 収益分配可能額 (C-D)	17,033,248,700円	E 収益分配可能額 (C-D)	24,273,487,873円
F 収益分配金額	17,015,469,173円	F 収益分配金額	24,233,127,587円
G 次期繰越金 (分配準備積立金) (E-F)	17,779,527円	G 次期繰越金 (分配準備積立金) (E-F)	40,360,286円
H 口数	777,317,002口	H 口数	944,393,125口
I 分配金額 (100口当たり)	2,189円	I 分配金額 (100口当たり)	2,566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14期 自 平成26年 7月 9日 至 平成27年 7月 8日	第15期 自 平成27年 7月 9日 至 平成28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14期 平成27年 7月 8日現在	第15期 平成28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

第15期（平成28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	314,546,716,481
合計	314,546,716,481

## (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14期（平成27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	3,292,806,000	-	3,118,500,000	174,306,000

合計	3,292,806,000	-	3,118,500,000	174,306,000
----	---------------	---	---------------	-------------

第15期（平成28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	3,053,898,000	-	2,930,620,000	123,278,000
合計		3,053,898,000	-	2,930,620,000	123,278,000

（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14期 平成27年 7月 8日現在		第15期 平成28年 7月 8日現在	
1口当たり純資産額	1,593.91円	1口当たり純資産額	1,217.26円
(100口当たり純資産額)	(159,391円)	(100口当たり純資産額)	(121,726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	304,000	257.00	78,128,000	貸付有価証券 216,000株
日本水産	826,600	500.00	413,300,000	
マルハニチロ	146,500	2,698.00	395,257,000	貸付有価証券 100株



カネコ種苗	24,700	1,318.00	32,554,600	貸付有価証券 17,200株
サカタのタネ	105,800	2,142.00	226,623,600	
ホクト	72,900	1,845.00	134,500,500	
ホクリヨウ	7,600	844.00	6,414,400	貸付有価証券 5,300株
住石ホールディングス	213,400	79.00	16,858,600	貸付有価証券 80,600株
日鉄鉱業	198,000	312.00	61,776,000	
三井松島産業	469,000	95.00	44,555,000	
国際石油開発帝石	3,778,600	741.50	2,801,831,900	
日本海洋掘削	21,400	2,108.00	45,111,200	貸付有価証券 14,900株
石油資源開発	113,600	1,948.00	221,292,800	
K & O エナジーグループ	48,300	1,252.00	60,471,600	
ショーボンドホールディングス	75,200	4,480.00	336,896,000	貸付有価証券 53,300株
ミライト・ホールディングス	220,700	1,072.00	236,590,400	貸付有価証券 2,800株
タマホーム	53,400	423.00	22,588,200	貸付有価証券 36,000株
サンヨーホームズ	15,300	473.00	7,236,900	
ダイセキ環境ソリューション	16,700	987.00	16,482,900	貸付有価証券 5,200株
安藤・間	478,500	547.00	261,739,500	貸付有価証券 211,000株
東急建設	233,400	929.00	216,828,600	貸付有価証券 53,500株
コムシスホールディングス	308,300	1,636.00	504,378,800	
ミサワホーム	84,600	672.00	56,851,200	貸付有価証券 59,600株
ビーアールホールディングス	27,900	393.00	10,964,700	
高松コンストラクショングループ	54,100	2,361.00	127,730,100	貸付有価証券 5,300株
東建コーポレーション	29,500	8,000.00	236,000,000	
ソネック	7,800	581.00	4,531,800	
ヤマウラ	34,400	520.00	17,888,000	貸付有価証券 200株
大成建設	3,725,000	811.00	3,020,975,000	
大林組	2,151,200	1,045.00	2,248,004,000	貸付有価証券 495,100株
清水建設	2,194,000	931.00	2,042,614,000	貸付有価証券 133,000株
飛鳥建設	576,200	160.00	92,192,000	貸付有価証券 354,300株
長谷工コーポレーション	837,100	928.00	776,828,800	
松井建設	79,000	1,067.00	84,293,000	
銭高組	102,000	296.00	30,192,000	

鹿島建設	3,363,000	694.00	2,333,922,000	
不動テトラ	507,000	154.00	78,078,000	貸付有価証券 338,200株
大末建設	27,500	880.00	24,200,000	
鉄建建設	436,000	275.00	119,900,000	貸付有価証券 204,000株
西松建設	829,000	480.00	397,920,000	貸付有価証券 8,000株
三井住友建設	2,747,100	84.00	230,756,400	貸付有価証券 52,600株
大豊建設	277,000	462.00	127,974,000	貸付有価証券 100,000株
前田建設工業	442,000	785.00	346,970,000	貸付有価証券 10,000株
佐田建設	50,300	351.00	17,655,300	貸付有価証券 1,400株
ナカノフドー建設	55,300	382.00	21,124,600	
奥村組	681,000	546.00	371,826,000	
東鉄工業	86,100	2,857.00	245,987,700	
イチケン	77,000	245.00	18,865,000	貸付有価証券 40,000株
浅沼組	229,000	198.00	45,342,000	
戸田建設	834,000	436.00	363,624,000	貸付有価証券 200,000株
熊谷組	1,051,000	280.00	294,280,000	
青木あすなろ建設	46,900	617.00	28,937,300	
北野建設	149,000	239.00	35,611,000	
植木組	86,000	205.00	17,630,000	
三井ホーム	89,000	419.00	37,291,000	
矢作建設工業	97,600	800.00	78,080,000	
ピーエス三菱	84,700	353.00	29,899,100	貸付有価証券 18,100株
日本ハウスホールディングス	147,700	307.00	45,343,900	貸付有価証券 77,100株
大東建託	263,900	16,255.00	4,289,694,500	
新日本建設	85,400	764.00	65,245,600	貸付有価証券 10,000株
N I P P O	166,000	1,694.00	281,204,000	貸付有価証券 2,000株
東亜道路工業	134,000	251.00	33,634,000	
前田道路	224,000	1,748.00	391,552,000	貸付有価証券 10,000株
日本道路	212,000	371.00	78,652,000	貸付有価証券 73,000株
東亜建設工業	629,000	153.00	96,237,000	貸付有価証券 115,000株
若築建設	412,000	136.00	56,032,000	貸付有価証券 105,000株

東洋建設	225,000	417.00	93,825,000	貸付有価証券 20,000株
五洋建設	795,900	518.00	412,276,200	
大林道路	83,600	609.00	50,912,400	
世紀東急工業	112,900	473.00	53,401,700	
福田組	116,000	968.00	112,288,000	貸付有価証券 47,000株
住友林業	493,700	1,420.00	701,054,000	
日本基礎技術	80,600	318.00	25,630,800	
日成ビルド工業	197,000	570.00	112,290,000	貸付有価証券 50,000株
ヤマダ・エスバイエルホーム	373,000	67.00	24,991,000	貸付有価証券 203,000株
巴コーポレーション	90,000	322.00	28,980,000	貸付有価証券 2,100株
パナホーム	268,000	796.00	213,328,000	貸付有価証券 30,000株
大和ハウス工業	2,118,800	2,757.50	5,842,591,000	貸付有価証券 271,300株
ライト工業	137,900	1,049.00	144,657,100	
積水ハウス	2,398,100	1,653.00	3,964,059,300	貸付有価証券 17,600株
日特建設	79,800	383.00	30,563,400	
北陸電気工事	35,500	675.00	23,962,500	
ユアテック	113,000	661.00	74,693,000	
西部電気工業	59,000	407.00	24,013,000	
四電工	54,000	378.00	20,412,000	
中電工	103,600	1,968.00	203,884,800	貸付有価証券 5,500株
関電工	286,000	855.00	244,530,000	貸付有価証券 10,000株
きんでん	433,500	1,094.00	474,249,000	
東京エネシス	79,000	985.00	77,815,000	
トーエネック	101,000	533.00	53,833,000	
住友電設	56,600	1,130.00	63,958,000	
日本電設工業	116,900	1,676.00	195,924,400	
協和エクシオ	281,000	1,284.00	360,804,000	貸付有価証券 46,000株
新日本空調	60,300	1,019.00	61,445,700	
N D S	112,000	249.00	27,888,000	
九電工	131,300	3,050.00	400,465,000	貸付有価証券 88,600株
三機工業	159,000	783.00	124,497,000	貸付有価証券 10,400株
日揮	720,900	1,439.00	1,037,375,100	貸付有価証券 5,000株
中外炉工業	216,000	210.00	45,360,000	
ヤマト	63,900	522.00	33,355,800	

太平電業	105,000	1,055.00	110,775,000	
高砂熱学工業	213,800	1,180.00	252,284,000	貸付有価証券 2,200株
三晃金属工業	70,000	283.00	19,810,000	
朝日工業社	79,000	491.00	38,789,000	
明星工業	129,600	460.00	59,616,000	
大気社	87,700	2,436.00	213,637,200	
ダイダン	96,000	738.00	70,848,000	
日比谷総合設備	86,200	1,526.00	131,541,200	
東芝プラントシステム	116,500	1,648.00	191,992,000	貸付有価証券 79,200株
OSJBホールディングス	145,600	181.00	26,353,600	貸付有価証券 36,700株
東洋エンジニアリング	383,000	324.00	124,092,000	
千代田化工建設	517,000	665.00	343,805,000	
新興プランテック	147,300	720.00	106,056,000	
日本製粉	459,000	796.00	365,364,000	
日清製粉グループ本社	786,500	1,645.00	1,293,792,500	貸付有価証券 2,700株
日東富士製粉	55,000	332.00	18,260,000	
昭和産業	295,000	448.00	132,160,000	
鳥越製粉	56,700	663.00	37,592,100	
中部飼料	66,700	675.00	45,022,500	
フィード・ワン	430,600	113.00	48,657,800	
東洋精糖	108,000	100.00	10,800,000	
日本甜菜製糖	365,000	182.00	66,430,000	
三井製糖	282,000	480.00	135,360,000	
塩水港精糖	75,900	219.00	16,622,100	
日新製糖	30,600	1,379.00	42,197,400	貸付有価証券 4,500株
森永製菓	646,000	690.00	445,740,000	
中村屋	166,000	460.00	76,360,000	
江崎グリコ	165,600	6,200.00	1,026,720,000	貸付有価証券 4,100株
名糖産業	31,600	1,293.00	40,858,800	
不二家	411,000	193.00	79,323,000	貸付有価証券 280,000株
山崎製パン	525,400	2,927.00	1,537,845,800	
第一屋製パン	108,000	107.00	11,556,000	
モロゾフ	109,000	421.00	45,889,000	貸付有価証券 77,000株
亀田製菓	39,900	5,860.00	233,814,000	
寿スピリッツ	51,000	3,360.00	171,360,000	貸付有価証券 34,300株
カルビー	265,900	4,300.00	1,143,370,000	貸付有価証券 59,600株

森永乳業	643,000	759.00	488,037,000	
六甲バター	32,000	2,313.00	74,016,000	
ヤクルト本社	384,600	4,875.00	1,874,925,000	貸付有価証券 119,800株
明治ホールディングス	424,900	10,560.00	4,486,944,000	
雪印メグミルク	168,800	3,660.00	617,808,000	
プリマハム	452,000	310.00	140,120,000	
日本ハム	527,000	2,517.00	1,326,459,000	貸付有価証券 38,000株
林兼産業	227,000	83.00	18,841,000	貸付有価証券 100,000株
丸大食品	369,000	473.00	174,537,000	
S Foods	44,900	2,822.00	126,707,800	貸付有価証券 30,100株
伊藤ハム米久ホールディングス	428,400	1,052.00	450,676,800	貸付有価証券 1,000株
サッポロホールディングス	219,300	2,964.00	650,005,200	
アサヒグループホールディングス	1,345,700	3,366.00	4,529,626,200	貸付有価証券 8,200株
キリンホールディングス	2,906,800	1,778.50	5,169,743,800	
宝ホールディングス	519,200	929.00	482,336,800	
オエノンホールディングス	194,000	195.00	37,830,000	
養命酒製造	22,000	1,702.00	37,444,000	
コカ・コーラウエスト	243,000	2,902.00	705,186,000	
コカ・コーライーストジャパン	253,800	1,957.00	496,686,600	
サントリー食品インターナショナル	491,300	4,620.00	2,269,806,000	貸付有価証券 13,900株
ダイトードリンク	36,200	5,530.00	200,186,000	貸付有価証券 4,600株
伊藤園	212,800	3,930.00	836,304,000	貸付有価証券 144,100株
キーコーヒー	63,100	1,864.00	117,618,400	
ユニカフェ	19,500	867.00	16,906,500	貸付有価証券 11,300株
ジャパンフーズ	8,900	1,158.00	10,306,200	貸付有価証券 500株
日清オイリオグループ	379,000	484.00	183,436,000	
不二製油グループ本社	191,500	2,046.00	391,809,000	
かどや製油	6,900	2,942.00	20,299,800	貸付有価証券 900株
J - オイルミルズ	300,000	342.00	102,600,000	
キッコーマン	544,000	3,800.00	2,067,200,000	貸付有価証券 6,000株
味の素	1,508,500	2,479.50	3,740,325,750	
キューピー	364,900	3,350.00	1,222,415,000	
ハウス食品グループ本社	245,100	2,416.00	592,161,600	貸付有価証券 5,000株

カゴメ	257,400	2,707.00	696,781,800	貸付有価証券 164,800株
焼津水産化学工業	33,600	982.00	32,995,200	貸付有価証券 500株
アリアケジャパン	58,700	6,010.00	352,787,000	
ピエトロ	7,400	1,677.00	12,409,800	貸付有価証券 5,100株
エバラ食品工業	17,300	1,855.00	32,091,500	
ニチレイ	764,000	952.00	727,328,000	
東洋水産	352,600	4,165.00	1,468,579,000	
イトアンド	7,800	1,976.00	15,412,800	
日清食品ホールディングス	303,500	5,520.00	1,675,320,000	
永谷園ホールディングス	67,000	1,198.00	80,266,000	貸付有価証券 6,000株
一正蒲鉾	25,000	1,054.00	26,350,000	貸付有価証券 15,100株
フジッコ	69,600	2,978.00	207,268,800	貸付有価証券 19,600株
ロック・フィールド	74,600	1,536.00	114,585,600	
日本たばこ産業	4,240,300	4,289.00	18,186,646,700	貸付有価証券 51,800株
ケンコーマヨネーズ	23,300	3,305.00	77,006,500	
わらべや日洋	38,500	2,181.00	83,968,500	貸付有価証券 11,000株
なとり	35,900	1,514.00	54,352,600	
北の達人コーポレーション	13,100	476.00	6,235,600	
ユーグレナ	229,800	1,364.00	313,447,200	貸付有価証券 163,500株
ミヨシ油脂	244,000	115.00	28,060,000	
理研ビタミン	21,100	4,905.00	103,495,500	貸付有価証券 14,200株
片倉工業	84,000	1,080.00	90,720,000	
ゲンゼ	542,000	272.00	147,424,000	
東洋紡	2,655,000	196.00	520,380,000	
ユニチカ	1,952,000	57.00	111,264,000	貸付有価証券 2,000株
富士紡ホールディングス	326,000	238.00	77,588,000	
倉敷紡績	676,000	167.00	112,892,000	
シキボウ	412,000	100.00	41,200,000	
日本毛織	206,300	682.00	140,696,600	
大東紡織	94,000	62.00	5,828,000	
トーア紡コーポレーション	29,700	454.00	13,483,800	貸付有価証券 5,000株
ガイドーリミテッド	74,400	419.00	31,173,600	貸付有価証券 9,000株
帝国繊維	70,000	1,283.00	89,810,000	
帝人	2,740,000	355.00	972,700,000	

東レ	4,864,000	882.00	4,290,048,000	
サカイオーベックス	175,000	132.00	23,100,000	
住江織物	168,000	179.00	30,072,000	
日本フェルト	36,000	451.00	16,236,000	
イチカワ	44,000	260.00	11,440,000	
日東製網	72,000	162.00	11,664,000	貸付有価証券 25,000株
芦森工業	146,000	153.00	22,338,000	貸付有価証券 1,000株
アツギ	516,000	105.00	54,180,000	
ダイニック	128,000	149.00	19,072,000	
セーレン	167,000	906.00	151,302,000	貸付有価証券 9,400株
東海染工	93,000	112.00	10,416,000	
小松精練	102,800	666.00	68,464,800	
ワコールホールディングス	399,000	1,010.00	402,990,000	
ホギメディカル	42,200	7,060.00	297,932,000	貸付有価証券 17,600株
レナウン	183,300	104.00	19,063,200	貸付有価証券 123,800株
クラウドディア	15,100	492.00	7,429,200	貸付有価証券 10,000株
T S Iホールディングス	299,200	529.00	158,276,800	貸付有価証券 10,000株
三陽商会	376,000	187.00	70,312,000	貸付有価証券 197,000株
ナイガイ	255,000	40.00	10,200,000	貸付有価証券 70,000株
オンワードホールディングス	434,000	604.00	262,136,000	貸付有価証券 301,000株
ルック	121,000	126.00	15,246,000	貸付有価証券 73,000株
キムラタン	2,843,000	6.00	17,058,000	貸付有価証券 11,000株
ゴールドウイン	28,400	4,510.00	128,084,000	貸付有価証券 18,600株
デサント	152,900	1,043.00	159,474,700	
キング	33,900	343.00	11,627,700	
ヤマトインターナショナル	41,500	385.00	15,977,500	
特種東海製紙	390,000	356.00	138,840,000	貸付有価証券 30,000株
王子ホールディングス	2,621,000	384.00	1,006,464,000	
日本製紙	346,600	1,801.00	624,226,600	貸付有価証券 210,200株
三菱製紙	1,022,000	66.00	67,452,000	貸付有価証券 350,000株
北越紀州製紙	416,100	738.00	307,081,800	
中越パルプ工業	265,000	200.00	53,000,000	貸付有価証券 153,000株

巴川製紙所	105,000	168.00	17,640,000	貸付有価証券 14,000株
大王製紙	296,900	1,120.00	332,528,000	貸付有価証券 199,700株
レンゴー	593,000	693.00	410,949,000	貸付有価証券 5,000株
トーモク	210,000	287.00	60,270,000	
ザ・バック	47,500	2,631.00	124,972,500	
クラレ	1,058,000	1,201.00	1,270,658,000	貸付有価証券 42,300株
旭化成	4,182,000	698.50	2,921,127,000	
共和レザー	43,900	751.00	32,968,900	
昭和電工	446,300	909.00	405,686,700	貸付有価証券 39,100株
住友化学	4,936,000	396.00	1,954,656,000	
日本化成	128,000	101.00	12,928,000	貸付有価証券 21,000株
住友精化	140,000	590.00	82,600,000	貸付有価証券 76,000株
日産化学工業	400,500	3,070.00	1,229,535,000	
ラサ工業	251,000	91.00	22,841,000	貸付有価証券 16,000株
クレハ	505,000	359.00	181,295,000	
多木化学	42,000	640.00	26,880,000	貸付有価証券 28,000株
テイカ	112,000	444.00	49,728,000	
石原産業	1,204,000	59.00	71,036,000	
片倉コープアグリ	78,000	193.00	15,054,000	
日東エフシー	39,100	814.00	31,827,400	
日本曹達	433,000	385.00	166,705,000	貸付有価証券 3,000株
東ソー	1,809,000	438.00	792,342,000	
トクヤマ	1,112,000	286.00	318,032,000	貸付有価証券 82,000株
セントラル硝子	726,000	419.00	304,194,000	
東亜合成	419,800	941.00	395,031,800	
大阪ソーダ	289,000	418.00	120,802,000	貸付有価証券 180,000株
関東電化工業	160,000	1,033.00	165,280,000	貸付有価証券 112,000株
デンカ	1,389,000	400.00	555,600,000	
信越化学工業	1,202,500	5,901.00	7,095,952,500	
日本カーバイド工業	228,000	130.00	29,640,000	貸付有価証券 1,000株
堺化学工業	271,000	263.00	71,273,000	
エア・ウォーター	553,000	1,460.00	807,380,000	
大陽日酸	516,500	863.00	445,739,500	
日本化学工業	248,000	193.00	47,864,000	



日本パーカライズング	342,600	1,093.00	374,461,800	貸付有価証券 48,000株
高压ガス工業	99,000	627.00	62,073,000	
チタン工業	77,000	160.00	12,320,000	貸付有価証券 25,000株
四国化成工業	97,000	765.00	74,205,000	
戸田工業	134,000	265.00	35,510,000	貸付有価証券 70,000株
ステラ ケミファ	34,200	3,425.00	117,135,000	貸付有価証券 1,500株
保土谷化学工業	200,000	258.00	51,600,000	貸付有価証券 123,000株
日本触媒	97,300	5,740.00	558,502,000	
大日精化工業	259,000	403.00	104,377,000	
カネカ	904,000	654.00	591,216,000	
三菱瓦斯化学	1,153,000	506.00	583,418,000	貸付有価証券 5,000株
三井化学	2,844,000	351.00	998,244,000	
J S R	629,100	1,328.00	835,444,800	貸付有価証券 20,000株
東京応化工業	134,500	2,464.00	331,408,000	貸付有価証券 15,500株
大阪有機化学工業	48,800	537.00	26,205,600	
三菱ケミカルホールディングス	4,490,800	445.70	2,001,549,560	
日本合成化学工業	157,000	499.00	78,343,000	貸付有価証券 10,000株
ダイセル	904,200	983.00	888,828,600	
住友ベークライト	591,000	447.00	264,177,000	貸付有価証券 3,000株
積水化学工業	1,522,000	1,274.00	1,939,028,000	
日本ゼオン	565,000	625.00	353,125,000	貸付有価証券 393,000株
アイカ工業	201,500	2,273.00	458,009,500	貸付有価証券 400株
宇部興産	3,589,000	163.00	585,007,000	貸付有価証券 251,000株
積水樹脂	103,500	1,437.00	148,729,500	
タキロン	156,000	439.00	68,484,000	
旭有機材	216,000	188.00	40,608,000	
日立化成	331,300	1,812.00	600,315,600	
ニチバン	65,000	745.00	48,425,000	
リケンテクノス	144,400	404.00	58,337,600	貸付有価証券 97,500株
大倉工業	161,000	268.00	43,148,000	
積水化成成品工業	172,000	297.00	51,084,000	
群栄化学工業	179,000	281.00	50,299,000	貸付有価証券 1,000株
タイガースポリマー	33,400	477.00	15,931,800	

ミライアル	24,300	724.00	17,593,200	貸付有価証券 9,700株
ダイキアクシス	12,700	802.00	10,185,400	
ダイキョーニシカワ	86,300	1,126.00	97,173,800	貸付有価証券 52,000株
日本化薬	435,000	916.00	398,460,000	
カーリットホールディングス	62,900	452.00	28,430,800	
日本精化	55,600	736.00	40,921,600	
扶桑化学工業	42,600	1,517.00	64,624,200	貸付有価証券 2,200株
A D E K A	329,700	1,161.00	382,781,700	
日油	503,000	803.00	403,909,000	
新日本理化	105,700	131.00	13,846,700	貸付有価証券 70,400株
ハリマ化成グループ	57,100	477.00	27,236,700	
花王	1,803,200	5,827.00	10,507,246,400	
第一工業製薬	150,000	313.00	46,950,000	
ニイタカ	9,800	1,312.00	12,857,600	
三洋化成工業	210,000	755.00	158,550,000	
大日本塗料	384,000	181.00	69,504,000	貸付有価証券 100,000株
日本ペイントホールディングス	517,400	2,320.00	1,200,368,000	貸付有価証券 162,000株
関西ペイント	758,600	1,927.00	1,461,822,200	貸付有価証券 516,300株
神東塗料	48,000	160.00	7,680,000	
中国塗料	192,000	598.00	114,816,000	
日本特殊塗料	46,900	988.00	46,337,200	
藤倉化成	91,100	535.00	48,738,500	
太陽ホールディングス	49,100	2,956.00	145,139,600	貸付有価証券 10,000株
D I C	264,800	2,078.00	550,254,400	
サカタインクス	136,900	1,130.00	154,697,000	
東洋インキSCホールディングス	663,000	413.00	273,819,000	
T & K T O K A	48,900	797.00	38,973,300	
富士フイルムホールディングス	1,534,400	3,724.00	5,714,105,600	
資生堂	1,272,100	2,885.50	3,670,644,550	
ライオン	773,000	1,689.00	1,305,597,000	貸付有価証券 12,000株
高砂香料工業	44,100	2,695.00	118,849,500	
マンダム	62,400	4,710.00	293,904,000	
ミルボン	39,500	4,705.00	185,847,500	
ファンケル	155,500	1,404.00	218,322,000	貸付有価証券 99,300株
コーセー	108,400	8,590.00	931,156,000	
コタ	22,700	1,109.00	25,174,300	

シーズ・ホールディングス	84,400	2,281.00	192,516,400	貸付有価証券 50,600株
シーボン	7,500	2,060.00	15,450,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	68,300	9,700.00	662,510,000	貸付有価証券 100株
ノエビアホールディングス	42,300	3,160.00	133,668,000	貸付有価証券 300株
アジュバンコスメジャパン	12,400	887.00	10,998,800	
エステー	45,900	1,121.00	51,453,900	
アグロ カネショウ	25,900	1,029.00	26,651,100	貸付有価証券 9,300株
コニシ	105,200	1,268.00	133,393,600	貸付有価証券 5,000株
長谷川香料	84,900	1,785.00	151,546,500	
星光PMC	36,600	999.00	36,563,400	貸付有価証券 24,900株
小林製薬	202,900	4,430.00	898,847,000	
荒川化学工業	57,600	899.00	51,782,400	
メック	51,900	856.00	44,426,400	貸付有価証券 31,500株
日本高純度化学	18,600	2,013.00	37,441,800	
タカラバイオ	143,600	1,351.00	194,003,600	
JCU	19,600	3,005.00	58,898,000	貸付有価証券 2,000株
新田ゼラチン	43,900	760.00	33,364,000	貸付有価証券 4,200株
OATアグリオ	7,700	1,236.00	9,517,200	貸付有価証券 2,500株
デクセリアルズ	200,400	699.00	140,079,600	貸付有価証券 73,700株
アース製薬	48,200	4,960.00	239,072,000	貸付有価証券 22,500株
イハラケミカル工業	103,000	916.00	94,348,000	貸付有価証券 23,300株
北興化学工業	70,000	273.00	19,110,000	
大成ラミック	18,800	2,783.00	52,320,400	貸付有価証券 300株
クミアイ化学工業	138,300	563.00	77,862,900	貸付有価証券 84,900株
日本農薬	153,100	455.00	69,660,500	貸付有価証券 89,700株
アキレス	547,000	124.00	67,828,000	
有沢製作所	99,800	491.00	49,001,800	
日東電工	518,100	6,173.00	3,198,231,300	
レック	20,600	1,790.00	36,874,000	
きもと	108,900	147.00	16,008,300	貸付有価証券 10,500株
藤森工業	57,500	1,873.00	107,697,500	貸付有価証券 5,600株

前澤化成工業	46,800	991.00	46,378,800	
JSP	43,900	1,930.00	84,727,000	貸付有価証券 7,200株
エフピコ	59,400	5,050.00	299,970,000	
天馬	49,800	1,494.00	74,401,200	
信越ポリマー	131,600	578.00	76,064,800	貸付有価証券 35,000株
東リ	173,000	281.00	48,613,000	
ニフコ	128,200	5,190.00	665,358,000	貸付有価証券 2,900株
日本バルカー工業	260,000	255.00	66,300,000	
ユニ・チャーム	1,357,400	2,060.50	2,796,922,700	貸付有価証券 125,500株
協和発酵キリン	802,100	1,769.00	1,418,914,900	
武田薬品工業	2,670,600	4,253.00	11,358,061,800	
アステラス製薬	7,507,600	1,603.50	12,038,436,600	貸付有価証券 63,600株
大日本住友製薬	474,500	1,874.00	889,213,000	貸付有価証券 327,900株
塩野義製薬	977,100	5,539.00	5,412,156,900	
田辺三菱製薬	781,200	1,834.00	1,432,720,800	
わかもと製薬	76,000	220.00	16,720,000	
あすか製薬	85,100	1,717.00	146,116,700	貸付有価証券 28,000株
日本新薬	153,600	5,320.00	817,152,000	貸付有価証券 6,800株
バイオフェルミン製薬	10,900	2,708.00	29,517,200	
中外製薬	667,500	3,680.00	2,456,400,000	
科研製薬	115,500	6,900.00	796,950,000	
エーザイ	825,200	5,509.00	4,546,026,800	
ロート製薬	328,100	1,506.00	494,118,600	
小野薬品工業	1,522,600	3,952.00	6,017,315,200	
久光製薬	208,100	6,020.00	1,252,762,000	貸付有価証券 600株
有機合成薬品工業	42,100	220.00	9,262,000	
持田製薬	45,900	8,560.00	392,904,000	
参天製薬	1,234,900	1,635.00	2,019,061,500	貸付有価証券 58,500株
扶桑薬品工業	224,000	274.00	61,376,000	
日本ケミファ	93,000	439.00	40,827,000	
ツムラ	211,000	2,779.00	586,369,000	貸付有価証券 141,800株
日医工	156,700	1,995.00	312,616,500	
キッセイ薬品工業	118,700	2,003.00	237,756,100	
生化学工業	124,200	1,601.00	198,844,200	貸付有価証券 12,100株
栄研化学	56,200	2,305.00	129,541,000	

日水製薬	27,200	1,111.00	30,219,200	
鳥居薬品	45,800	2,307.00	105,660,600	
JCRファーマ	51,600	2,970.00	153,252,000	貸付有価証券 31,700株
東和薬品	30,700	4,820.00	147,974,000	貸付有価証券 6,000株
富士製薬工業	21,300	2,331.00	49,650,300	
沢井製薬	113,800	7,920.00	901,296,000	
ゼリア新薬工業	137,300	1,544.00	211,991,200	貸付有価証券 3,500株
第一三共	2,254,800	2,547.50	5,744,103,000	
キョーリン製薬ホールディングス	178,800	2,050.00	366,540,000	
大幸薬品	33,000	1,591.00	52,503,000	貸付有価証券 22,000株
ダイト	37,300	2,873.00	107,162,900	
大塚ホールディングス	1,441,400	4,835.00	6,969,169,000	
大正製薬ホールディングス	161,200	10,730.00	1,729,676,000	
ペプチドリーム	112,100	5,550.00	622,155,000	貸付有価証券 78,000株
日本コークス工業	540,400	59.00	31,883,600	
昭和シェル石油	674,100	889.00	599,274,900	
ニチレキ	81,700	632.00	51,634,400	貸付有価証券 16,500株
東燃ゼネラル石油	1,011,000	917.00	927,087,000	貸付有価証券 44,000株
ユシロ化学工業	35,900	1,323.00	47,495,700	
ピーピー・カストロール	27,400	1,167.00	31,975,800	貸付有価証券 2,200株
富士石油	155,900	311.00	48,484,900	
MORESCO	20,800	1,105.00	22,984,000	
出光興産	349,800	1,954.00	683,509,200	貸付有価証券 245,400株
JXホールディングス	7,936,400	381.00	3,023,768,400	
コスモエネルギーホールディングス	202,200	1,172.00	236,978,400	貸付有価証券 3,000株
横浜ゴム	404,400	1,237.00	500,242,800	貸付有価証券 1,000株
東洋ゴム工業	303,400	1,048.00	317,963,200	
ブリヂストン	2,262,700	3,140.00	7,104,878,000	
住友ゴム工業	627,400	1,300.00	815,620,000	
藤倉ゴム工業	55,900	464.00	25,937,600	貸付有価証券 27,500株
オカモト	203,000	1,116.00	226,548,000	貸付有価証券 70,000株
フコク	24,800	708.00	17,558,400	
ニッタ	72,200	2,257.00	162,955,400	
住友理工	144,900	802.00	116,209,800	貸付有価証券 15,000株

三ツ星ベルト	163,000	788.00	128,444,000	貸付有価証券 6,000株
バンドー化学	244,000	467.00	113,948,000	
日東紡績	443,000	342.00	151,506,000	貸付有価証券 133,000株
旭硝子	3,538,000	490.00	1,733,620,000	貸付有価証券 49,000株
日本板硝子	3,232,000	60.00	193,920,000	貸付有価証券 1,380,000株
石塚硝子	95,000	148.00	14,060,000	貸付有価証券 44,000株
日本山村硝子	265,000	153.00	40,545,000	
日本電気硝子	1,385,000	418.00	578,930,000	
オハラ	25,100	486.00	12,198,600	
住友大阪セメント	1,328,000	448.00	594,944,000	
太平洋セメント	4,183,000	248.00	1,037,384,000	貸付有価証券 427,000株
デイ・シイ	62,600	339.00	21,221,400	
日本ヒューム	64,500	524.00	33,798,000	
日本コンクリート工業	139,600	280.00	39,088,000	貸付有価証券 82,800株
三谷セキサン	33,500	2,036.00	68,206,000	貸付有価証券 2,000株
アジアパイルホールディングス	82,300	359.00	29,545,700	貸付有価証券 28,800株
東海カーボン	581,000	251.00	145,831,000	貸付有価証券 20,000株
日本カーボン	330,000	181.00	59,730,000	貸付有価証券 233,000株
東洋炭素	37,100	1,252.00	46,449,200	貸付有価証券 3,000株
ノリタケカンパニーリミテド	378,000	228.00	86,184,000	
TOTO	492,500	3,900.00	1,920,750,000	貸付有価証券 1,000株
日本碍子	846,400	1,918.00	1,623,395,200	
日本特殊陶業	577,600	1,393.00	804,596,800	貸付有価証券 64,200株
ダントーホールディングス	76,000	182.00	13,832,000	貸付有価証券 53,000株
MARUWA	24,600	3,060.00	75,276,000	
品川リフラクトリーズ	170,000	176.00	29,920,000	
黒崎播磨	145,000	231.00	33,495,000	
ヨータイ	38,000	273.00	10,374,000	
イソライト工業	32,200	183.00	5,892,600	
東京窯業	80,700	148.00	11,943,600	
ニッカトー	24,600	355.00	8,733,000	
フジインコーポレーテッド	59,000	1,435.00	84,665,000	貸付有価証券 39,900株

エーアンドエーマテリアル	140,000	77.00	10,780,000	貸付有価証券 62,000株
ニチアス	344,000	800.00	275,200,000	
ニチハ	89,000	1,549.00	137,861,000	
新日鐵住金	3,022,300	1,864.00	5,633,567,200	貸付有価証券 688,600株
神戸製鋼所	12,313,000	82.00	1,009,666,000	貸付有価証券 2,342,000株
中山製鋼所	751,000	48.00	36,048,000	貸付有価証券 379,000株
合同製鐵	374,000	148.00	55,352,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	1,831,900	1,242.50	2,276,135,750	貸付有価証券 669,800株
日新製鋼	305,700	1,242.00	379,679,400	
東京製鐵	369,900	558.00	206,404,200	貸付有価証券 73,000株
共英製鋼	71,400	1,556.00	111,098,400	貸付有価証券 50,200株
大和工業	148,000	2,194.00	324,712,000	
東京鐵鋼	139,000	350.00	48,650,000	
大阪製鐵	42,000	1,639.00	68,838,000	
淀川製鋼所	99,700	2,433.00	242,570,100	貸付有価証券 2,800株
東洋鋼鈹	159,800	231.00	36,913,800	
丸一鋼管	224,200	3,510.00	786,942,000	貸付有価証券 18,800株
モリ工業	107,000	278.00	29,746,000	
大同特殊鋼	1,123,000	349.00	391,927,000	
日本高周波鋼業	267,000	64.00	17,088,000	貸付有価証券 10,000株
日本冶金工業	492,200	111.00	54,634,200	貸付有価証券 346,200株
山陽特殊製鋼	399,000	484.00	193,116,000	
愛知製鋼	395,000	432.00	170,640,000	
日立金属	767,300	954.00	732,004,200	貸付有価証券 36,600株
日本金属	172,000	88.00	15,136,000	
大太平洋金属	467,000	278.00	129,826,000	貸付有価証券 273,000株
新日本電工	381,900	150.00	57,285,000	
栗本鐵工所	319,000	151.00	48,169,000	
虹技	96,000	144.00	13,824,000	貸付有価証券 5,000株
日本鑄鉄管	72,000	127.00	9,144,000	
三菱製鋼	467,000	146.00	68,182,000	
日垂鋼業	94,300	207.00	19,520,100	
日本精線	45,000	382.00	17,190,000	貸付有価証券 2,000株

シンニッタン	60,000	507.00	30,420,000	
新家工業	134,000	125.00	16,750,000	
大紀アルミニウム工業所	105,000	282.00	29,610,000	
日本軽金属ホールディングス	1,516,900	216.00	327,650,400	貸付有価証券 139,200株
三井金属鉱業	1,709,000	173.00	295,657,000	
東邦亜鉛	351,000	333.00	116,883,000	貸付有価証券 35,000株
三菱マテリアル	4,182,000	241.00	1,007,862,000	
住友金属鉱山	1,850,000	1,031.00	1,907,350,000	
DOWAホールディングス	863,000	526.00	453,938,000	貸付有価証券 29,000株
古河機械金属	1,045,000	123.00	128,535,000	
エス・サイエンス	307,800	31.00	9,541,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	66,300	1,197.00	79,361,100	貸付有価証券 46,600株
東邦チタニウム	113,300	629.00	71,265,700	貸付有価証券 77,000株
UACJ	937,000	247.00	231,439,000	
古河電気工業	2,107,000	243.00	512,001,000	
住友電気工業	2,682,800	1,244.00	3,337,403,200	
フジクラ	932,000	435.00	405,420,000	
昭和電線ホールディングス	798,000	53.00	42,294,000	貸付有価証券 535,000株
東京特殊電線	9,800	702.00	6,879,600	
タツタ電線	139,400	280.00	39,032,000	
沖電線	76,000	169.00	12,844,000	貸付有価証券 32,000株
カナレ電気	10,600	1,823.00	19,323,800	
平河ヒューテック	31,500	800.00	25,200,000	貸付有価証券 4,400株
リョービ	408,000	394.00	160,752,000	貸付有価証券 79,000株
アーレスティ	77,600	667.00	51,759,200	貸付有価証券 5,000株
アサヒホールディングス	100,900	1,541.00	155,486,900	貸付有価証券 12,700株
稲葉製作所	35,600	1,364.00	48,558,400	貸付有価証券 600株
宮地エンジニアリンググループ	204,000	127.00	25,908,000	貸付有価証券 83,000株
トーカロ	47,100	1,691.00	79,646,100	
アルファCO	22,100	910.00	20,111,000	
SUMCO	524,600	597.00	313,186,200	貸付有価証券 370,800株
川田テクノロジーズ	12,800	3,105.00	39,744,000	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	476,200	1,921.00	914,780,200	



ホッカンホールディングス	174,000	292.00	50,808,000	
コロナ	34,900	1,027.00	35,842,300	
横河ブリッジホールディングス	126,800	982.00	124,517,600	
駒井ハルテック	120,000	185.00	22,200,000	
高田機工	58,000	179.00	10,382,000	貸付有価証券 28,000株
三和ホールディングス	665,000	908.00	603,820,000	
文化シャッター	186,500	768.00	143,232,000	
三協立山	87,800	1,450.00	127,310,000	
アルインコ	50,600	949.00	48,019,400	
東洋シャッター	17,000	492.00	8,364,000	貸付有価証券 900株
L I X I Lグループ	933,300	1,640.00	1,530,612,000	
日本ファイルコン	47,900	418.00	20,022,200	貸付有価証券 17,400株
ノーリツ	131,300	1,775.00	233,057,500	
長府製作所	71,500	2,424.00	173,316,000	
リンナイ	124,500	8,990.00	1,119,255,000	
ダイニチ工業	33,900	591.00	20,034,900	
日東精工	96,000	266.00	25,536,000	
三洋工業	81,000	158.00	12,798,000	
岡部	139,000	708.00	98,412,000	貸付有価証券 24,100株
ジーテクト	69,800	1,242.00	86,691,600	貸付有価証券 2,000株
中国工業	10,300	651.00	6,705,300	貸付有価証券 6,700株
東プレ	128,900	2,117.00	272,881,300	貸付有価証券 19,800株
高周波熱錬	124,400	677.00	84,218,800	
東京製綱	453,000	148.00	67,044,000	貸付有価証券 305,000株
サンコール	36,600	430.00	15,738,000	
モリテック スチール	33,900	238.00	8,068,200	貸付有価証券 11,400株
パイオラックス	33,800	4,215.00	142,467,000	
日本発條	630,700	780.00	491,946,000	貸付有価証券 38,300株
中央発條	84,000	272.00	22,848,000	
アドバネクス	12,600	1,111.00	13,998,600	貸付有価証券 700株
立川ブラインド工業	27,800	682.00	18,959,600	
三益半導体工業	49,300	863.00	42,545,900	
日本ドライケミカル	8,300	2,075.00	17,222,500	
日本製鋼所	1,108,000	436.00	483,088,000	
三浦工業	298,800	2,216.00	662,140,800	貸付有価証券 53,000株

タクマ	248,000	803.00	199,144,000	貸付有価証券 42,000株
ツガミ	193,000	400.00	77,200,000	貸付有価証券 45,000株
オークマ	436,000	640.00	279,040,000	貸付有価証券 17,000株
東芝機械	365,000	292.00	106,580,000	貸付有価証券 100,000株
アマダホールディングス	977,100	967.00	944,855,700	
アイダエンジニアリング	175,700	801.00	140,735,700	
滝澤鉄工所	209,000	117.00	24,453,000	
富士機械製造	218,700	918.00	200,766,600	貸付有価証券 148,000株
牧野フライス製作所	334,000	497.00	165,998,000	
オーエスジー	305,200	1,552.00	473,670,400	貸付有価証券 205,100株
ダイジェット工業	74,000	122.00	9,028,000	
旭ダイヤモンド工業	180,300	735.00	132,520,500	
D M G 森精機	369,900	927.00	342,897,300	貸付有価証券 195,900株
ソディック	169,900	749.00	127,255,100	貸付有価証券 20,000株
ディスコ	85,400	8,750.00	747,250,000	
日東工器	39,000	2,086.00	81,354,000	
パンチ工業	26,300	715.00	18,804,500	
豊和工業	37,800	517.00	19,542,600	
O K K	259,000	93.00	24,087,000	貸付有価証券 11,000株
石川製作所	165,000	68.00	11,220,000	貸付有価証券 113,000株
東洋機械金属	50,000	345.00	17,250,000	貸付有価証券 21,200株
津田駒工業	162,000	113.00	18,306,000	貸付有価証券 102,000株
エンシュウ	160,000	54.00	8,640,000	貸付有価証券 85,000株
島精機製作所	94,600	1,818.00	171,982,800	貸付有価証券 6,400株
N C ホールディングス	21,800	834.00	18,181,200	貸付有価証券 14,000株
フリー	13,100	2,640.00	34,584,000	
ヤマシンフィルタ	12,800	440.00	5,632,000	貸付有価証券 8,600株
日阪製作所	84,600	805.00	68,103,000	
やまびこ	122,800	706.00	86,696,800	
ペガサスミシン製造	69,600	440.00	30,624,000	
ナプテスコ	348,200	2,419.00	842,295,800	
三井海洋開発	78,500	1,474.00	115,709,000	貸付有価証券 24,900株

レオン自動機	56,900	540.00	30,726,000	
S M C	200,900	23,200.00	4,660,880,000	
新川	60,200	474.00	28,534,800	貸付有価証券 21,500株
ホソカワミクロン	111,000	518.00	57,498,000	貸付有価証券 25,000株
ユニオンツール	29,000	2,681.00	77,749,000	貸付有価証券 19,700株
オイレス工業	86,600	1,606.00	139,079,600	
日精エー・エス・ビー機械	21,300	1,650.00	35,145,000	貸付有価証券 12,700株
サトーホールディングス	90,200	1,918.00	173,003,600	
日本エアーテック	23,100	605.00	13,975,500	貸付有価証券 11,500株
日精樹脂工業	48,600	583.00	28,333,800	貸付有価証券 1,200株
オカダアイヨン	12,900	721.00	9,300,900	
ワイエイシイ	26,900	1,443.00	38,816,700	貸付有価証券 19,100株
小松製作所	3,284,300	1,759.00	5,777,083,700	貸付有価証券 1,296,000株
住友重機械工業	1,954,000	426.00	832,404,000	
日立建機	299,300	1,378.00	412,435,400	貸付有価証券 52,800株
日工	100,000	291.00	29,100,000	
巴工業	27,200	1,465.00	39,848,000	貸付有価証券 16,200株
井関農機	685,000	214.00	146,590,000	貸付有価証券 453,000株
T O W A	64,600	999.00	64,535,400	
丸山製作所	142,000	155.00	22,010,000	貸付有価証券 8,000株
北川鉄工所	306,000	160.00	48,960,000	
タカキタ	21,900	489.00	10,709,100	貸付有価証券 2,000株
クボタ	3,216,800	1,276.00	4,104,636,800	
荏原実業	19,900	1,153.00	22,944,700	貸付有価証券 600株
三菱化工機	220,000	179.00	39,380,000	貸付有価証券 124,000株
月島機械	126,900	914.00	115,986,600	
帝国電機製作所	48,700	760.00	37,012,000	
東京機械製作所	256,000	36.00	9,216,000	貸付有価証券 10,000株
新東工業	151,900	692.00	105,114,800	
澁谷工業	56,300	1,625.00	91,487,500	貸付有価証券 15,000株
アイチ コーポレーション	94,800	704.00	66,739,200	貸付有価証券 800株

小森コーポレーション	162,900	1,140.00	185,706,000	貸付有価証券 77,100株
鶴見製作所	49,800	1,208.00	60,158,400	
住友精密工業	106,000	298.00	31,588,000	貸付有価証券 8,000株
酒井重工業	128,000	159.00	20,352,000	
荏原製作所	1,482,000	559.00	828,438,000	貸付有価証券 50,000株
石井鐵工所	100,000	144.00	14,400,000	
西島製作所	71,300	1,022.00	72,868,600	貸付有価証券 30,000株
北越工業	72,000	557.00	40,104,000	
ダイキン工業	932,200	8,029.00	7,484,633,800	
オルガノ	115,000	377.00	43,355,000	貸付有価証券 20,000株
トーヨーカネツ	321,000	196.00	62,916,000	貸付有価証券 35,000株
栗田工業	402,700	2,148.00	864,999,600	貸付有価証券 50,000株
椿本チエイン	380,000	601.00	228,380,000	貸付有価証券 2,000株
大同工業	131,000	185.00	24,235,000	
木村化工機	57,000	285.00	16,245,000	
アネスト岩田	107,900	861.00	92,901,900	
ダイフク	344,000	1,782.00	613,008,000	
サムコ	15,900	825.00	13,117,500	貸付有価証券 7,800株
加藤製作所	151,000	375.00	56,625,000	貸付有価証券 102,000株
油研工業	128,000	161.00	20,608,000	
タダノ	308,800	787.00	243,025,600	
フジテック	186,400	886.00	165,150,400	貸付有価証券 34,000株
C K D	178,100	770.00	137,137,000	
キトー	80,600	751.00	60,530,600	
平和	198,400	2,017.00	400,172,800	
理想科学工業	70,600	1,260.00	88,956,000	貸付有価証券 7,900株
S A N K Y O	178,100	3,850.00	685,685,000	貸付有価証券 4,600株
日本金銭機械	59,500	737.00	43,851,500	貸付有価証券 41,400株
マースエンジニアリング	36,200	2,107.00	76,273,400	貸付有価証券 5,700株
福島工業	39,500	3,170.00	125,215,000	貸付有価証券 26,800株
オーイズミ	27,700	357.00	9,888,900	貸付有価証券 3,800株

ダイコク電機	26,700	1,458.00	38,928,600	貸付有価証券 16,700株
竹内製作所	126,600	1,031.00	130,524,600	貸付有価証券 55,000株
アマノ	198,100	1,708.00	338,354,800	貸付有価証券 20,600株
J U K I	95,000	780.00	74,100,000	貸付有価証券 57,400株
サンデンホールディングス	391,000	262.00	102,442,000	貸付有価証券 16,000株
蛇の目ミシン工業	62,600	511.00	31,988,600	貸付有価証券 36,400株
マックス	98,000	1,163.00	113,974,000	
グローリー	218,300	2,704.00	590,283,200	
新晃工業	44,600	1,064.00	47,454,400	
大和冷機工業	102,900	862.00	88,699,800	
セガサミーホールディングス	688,000	1,105.00	760,240,000	
日本ピストンリング	26,600	1,325.00	35,245,000	
リケン	296,000	300.00	88,800,000	
T P R	78,800	1,800.00	141,840,000	貸付有価証券 1,300株
ツバキ・ナカシマ	79,100	1,089.00	86,139,900	貸付有価証券 300株
ホシザキ	140,300	9,160.00	1,285,148,000	貸付有価証券 15,000株
大豊工業	51,500	996.00	51,294,000	
日本精工	1,314,900	702.00	923,059,800	貸付有価証券 146,000株
N T N	1,587,000	243.00	385,641,000	
ジェイテクト	682,300	1,041.00	710,274,300	貸付有価証券 46,400株
不二越	594,000	259.00	153,846,000	貸付有価証券 413,000株
日本トムソン	219,000	287.00	62,853,000	貸付有価証券 80,000株
T H K	425,700	1,691.00	719,858,700	貸付有価証券 15,000株
ユーシン精機	24,700	1,594.00	39,371,800	貸付有価証券 4,000株
前澤給装工業	26,400	1,337.00	35,296,800	
イーグル工業	79,100	1,110.00	87,801,000	
前澤工業	46,500	266.00	12,369,000	
日本ピラー工業	65,200	980.00	63,896,000	
キッツ	285,300	487.00	138,941,100	貸付有価証券 20,000株
日立工機	171,100	568.00	97,184,800	
マキタ	417,400	6,260.00	2,612,924,000	貸付有価証券 12,800株
日立造船	507,600	464.00	235,526,400	

三菱重工業	11,399,000	413.60	4,714,626,400	
I H I	4,919,000	274.00	1,347,806,000	貸付有価証券 3,399,000株
日清紡ホールディングス	355,400	893.00	317,372,200	
イビデン	392,000	1,082.00	424,144,000	貸付有価証券 149,600株
コニカミノルタ	1,598,600	715.00	1,142,999,000	貸付有価証券 15,600株
ブラザー工業	827,500	1,000.00	827,500,000	貸付有価証券 102,700株
ミネベア	1,031,500	617.00	636,435,500	貸付有価証券 296,600株
日立製作所	16,333,000	403.30	6,587,098,900	貸付有価証券 631,000株
東芝	13,477,000	269.50	3,632,051,500	貸付有価証券 9,357,000株
三菱電機	6,829,000	1,108.00	7,566,532,000	
富士電機	1,929,000	398.00	767,742,000	
東洋電機製造	126,000	238.00	29,988,000	
安川電機	795,100	1,204.00	957,300,400	貸付有価証券 509,100株
シンフォニアテクノロジー	414,000	156.00	64,584,000	
明電舎	588,000	313.00	184,044,000	
オリジン電気	94,000	248.00	23,312,000	
山洋電気	168,000	435.00	73,080,000	
デンヨー	59,000	990.00	58,410,000	
東芝テック	458,000	345.00	158,010,000	貸付有価証券 11,000株
芝浦メカトロニクス	102,000	196.00	19,992,000	貸付有価証券 39,000株
マブチモーター	180,700	3,820.00	690,274,000	貸付有価証券 5,100株
日本電産	770,400	7,131.00	5,493,722,400	貸付有価証券 110,000株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,200	2,485.00	17,892,000	貸付有価証券 4,200株
東光高岳	35,500	1,542.00	54,741,000	
ダブル・スコープ	55,200	1,712.00	94,502,400	貸付有価証券 38,900株
宮越ホールディングス	20,900	496.00	10,366,400	貸付有価証券 14,300株
ダイヘン	377,000	437.00	164,749,000	
田淵電機	73,900	321.00	23,721,900	貸付有価証券 43,800株
ヤーマン	7,900	1,974.00	15,594,600	貸付有価証券 5,300株
JVCケンウッド	469,700	205.00	96,288,500	貸付有価証券 322,000株

ミマキエンジニアリング	57,400	413.00	23,706,200	貸付有価証券 39,000株
第一精工	27,100	923.00	25,013,300	貸付有価証券 11,900株
日新電機	150,100	1,468.00	220,346,800	
大崎電気工業	119,000	810.00	96,390,000	
オムロン	723,000	3,060.00	2,212,380,000	
日東工業	102,500	1,219.00	124,947,500	
I D E C	83,600	886.00	74,069,600	貸付有価証券 10,000株
不二電機工業	5,900	1,395.00	8,230,500	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,233,000	386.00	475,938,000	貸付有価証券 25,000株
サクサホールディングス	161,000	180.00	28,980,000	貸付有価証券 18,000株
メルコホールディングス	35,400	2,127.00	75,295,800	貸付有価証券 22,100株
テクノメディカ	14,300	1,442.00	20,620,600	
日本電気	8,802,000	247.00	2,174,094,000	
富士通	6,172,000	343.70	2,121,316,400	貸付有価証券 4,150,000株
沖電気工業	2,774,000	126.00	349,524,000	貸付有価証券 65,000株
岩崎通信機	298,000	61.00	18,178,000	
電気興業	168,000	443.00	74,424,000	貸付有価証券 70,000株
サンケン電気	349,000	298.00	104,002,000	貸付有価証券 240,000株
ナカヨ	62,000	305.00	18,910,000	
アイホン	36,300	1,671.00	60,657,300	貸付有価証券 400株
ルネサスエレクトロニクス	331,300	520.00	172,276,000	
セイコーエプソン	953,200	1,549.00	1,476,506,800	
ワコム	496,500	380.00	188,670,000	貸付有価証券 351,200株
アルバック	117,700	2,834.00	333,561,800	
アクセル	28,800	653.00	18,806,400	貸付有価証券 6,000株
E I Z O	63,300	2,604.00	164,833,200	
ジャパンディスプレイ	1,195,200	179.00	213,940,800	貸付有価証券 637,000株
日本信号	176,600	834.00	147,284,400	
京三製作所	151,000	343.00	51,793,000	
能美防災	72,600	1,429.00	103,745,400	貸付有価証券 700株
ホーチキ	46,400	1,163.00	53,963,200	
エレコム	55,400	2,206.00	122,212,400	貸付有価証券 37,600株

日本無線	187,000	250.00	46,750,000	貸付有価証券 14,000株
パナソニック	7,313,800	863.00	6,311,809,400	貸付有価証券 674,700株
シャープ	5,410,000	103.00	557,230,000	貸付有価証券 941,000株
アンリツ	384,300	564.00	216,745,200	貸付有価証券 271,800株
富士通ゼネラル	195,000	2,231.00	435,045,000	
日立国際電気	146,400	1,584.00	231,897,600	貸付有価証券 78,800株
ソニー	4,517,300	3,013.00	13,610,624,900	貸付有価証券 533,200株
T D K	386,400	5,250.00	2,028,600,000	
帝国通信工業	153,000	138.00	21,114,000	
ミツミ電機	243,500	381.00	92,773,500	貸付有価証券 167,400株
タムラ製作所	247,000	277.00	68,419,000	
アルプス電気	551,600	1,664.00	917,862,400	貸付有価証券 66,400株
池上通信機	201,000	117.00	23,517,000	貸付有価証券 137,000株
パイオニア	1,035,700	164.00	169,854,800	貸付有価証券 170,600株
日本電波工業	57,900	836.00	48,404,400	
鈴木	25,000	485.00	12,125,000	
日本トリム	17,200	7,690.00	132,268,000	
ローランド ディー . ジー .	31,400	1,777.00	55,797,800	
フォスター電機	80,300	1,552.00	124,625,600	
クラリオン	337,000	222.00	74,814,000	貸付有価証券 157,000株
S M K	188,000	321.00	60,348,000	貸付有価証券 52,000株
ヨコオ	45,400	499.00	22,654,600	貸付有価証券 200株
ティアック	457,000	33.00	15,081,000	貸付有価証券 277,000株
ホシデン	194,200	575.00	111,665,000	貸付有価証券 3,400株
ヒロセ電機	103,400	11,870.00	1,227,358,000	
日本航空電子工業	183,000	1,303.00	238,449,000	貸付有価証券 128,000株
T O A	75,500	912.00	68,856,000	
日立マクセル	106,000	1,323.00	140,238,000	貸付有価証券 1,300株
古野電気	76,300	513.00	39,141,900	
ユニデンホールディングス	199,000	111.00	22,089,000	貸付有価証券 70,000株



アルパイン	152,600	943.00	143,901,800	貸付有価証券 11,000株
スミダコーポレーション	53,000	647.00	34,291,000	
アイコム	35,400	1,892.00	66,976,800	
リオン	24,400	1,356.00	33,086,400	
本多通信工業	16,600	705.00	11,703,000	貸付有価証券 11,200株
船井電機	64,600	856.00	55,297,600	貸付有価証券 44,500株
横河電機	640,800	1,151.00	737,560,800	貸付有価証券 9,100株
新電元工業	225,000	305.00	68,625,000	
アズビル	209,000	2,982.00	623,238,000	
東亜ディーケーケー	36,300	441.00	16,008,300	
日本光電工業	267,600	2,881.00	770,955,600	
チノー	22,400	1,037.00	23,228,800	
共和電業	78,000	310.00	24,180,000	
日本電子材料	26,400	381.00	10,058,400	
堀場製作所	118,400	4,295.00	508,528,000	貸付有価証券 40,500株
アドバンテスト	436,400	1,029.00	449,055,600	貸付有価証券 173,500株
小野測器	31,000	840.00	26,040,000	貸付有価証券 500株
エスペック	66,300	1,178.00	78,101,400	貸付有価証券 24,000株
パナソニック デバイスSUNX	56,100	590.00	33,099,000	
キーエンス	145,000	70,710.00	10,252,950,000	貸付有価証券 33,500株
日置電機	33,400	1,818.00	60,721,200	貸付有価証券 5,000株
シスメックス	497,100	6,880.00	3,420,048,000	
日本マイクロニクス	119,400	853.00	101,848,200	
メガチップス	64,500	1,069.00	68,950,500	貸付有価証券 44,100株
OBARA GROUP	37,300	3,730.00	139,129,000	貸付有価証券 26,300株
澤藤電機	35,000	169.00	5,915,000	貸付有価証券 23,000株
コーセル	88,700	974.00	86,393,800	貸付有価証券 5,000株
新日本無線	47,200	344.00	16,236,800	貸付有価証券 13,000株
オブテックス	47,300	2,559.00	121,040,700	貸付有価証券 5,000株
千代田インテグレ	33,700	1,782.00	60,053,400	
アイ・オー・データ機器	19,600	616.00	12,073,600	
レーザーテック	74,900	1,310.00	98,119,000	貸付有価証券 200株

スタンレー電気	457,600	2,096.00	959,129,600	
岩崎電気	217,000	125.00	27,125,000	貸付有価証券 110,000株
ウシオ電機	388,500	1,135.00	440,947,500	
岡谷電機産業	34,900	352.00	12,284,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	54,600	331.00	18,072,600	貸付有価証券 13,500株
日本セラミック	36,600	1,949.00	71,333,400	貸付有価証券 25,300株
遠藤照明	32,100	914.00	29,339,400	貸付有価証券 17,800株
日本デジタル研究所	53,900	1,371.00	73,896,900	
古河電池	45,000	593.00	26,685,000	貸付有価証券 21,000株
双信電機	32,100	260.00	8,346,000	
山一電機	56,000	606.00	33,936,000	貸付有価証券 39,100株
図研	46,200	841.00	38,854,200	
日本電子	252,000	352.00	88,704,000	
カシオ計算機	641,600	1,422.00	912,355,200	貸付有価証券 452,700株
ファナック	655,000	15,500.00	10,152,500,000	貸付有価証券 5,900株
日本シイエムケイ	137,900	389.00	53,643,100	貸付有価証券 91,900株
エンプラス	32,800	2,512.00	82,393,600	
大真空	118,000	255.00	30,090,000	貸付有価証券 58,000株
ローム	309,400	3,640.00	1,126,216,000	
浜松ホトニクス	499,500	2,800.00	1,398,600,000	貸付有価証券 340,100株
三井ハイテック	92,900	586.00	54,439,400	
新光電気工業	241,900	468.00	113,209,200	貸付有価証券 162,300株
京セラ	1,050,800	4,613.00	4,847,340,400	
太陽誘電	311,200	781.00	243,047,200	
村田製作所	675,100	10,475.00	7,071,672,500	貸付有価証券 100,000株
ユーシン	84,400	614.00	51,821,600	貸付有価証券 52,300株
双葉電子工業	104,700	1,819.00	190,449,300	貸付有価証券 2,100株
北陸電気工業	257,000	102.00	26,214,000	
ニチコン	201,500	626.00	126,139,000	貸付有価証券 53,400株
日本ケミコン	519,000	117.00	60,723,000	貸付有価証券 222,000株
K O A	88,500	699.00	61,861,500	

市光工業	152,000	245.00	37,240,000	貸付有価証券 73,000株
小糸製作所	383,500	4,340.00	1,664,390,000	貸付有価証券 400株
ミツバ	108,700	973.00	105,765,100	
スター精密	121,500	1,059.00	128,668,500	貸付有価証券 40,000株
S C R E E Nホールディングス	656,000	1,045.00	685,520,000	貸付有価証券 2,000株
キヤノン電子	58,800	1,369.00	80,497,200	
キヤノン	3,446,600	2,802.50	9,659,096,500	貸付有価証券 118,900株
リコー	2,073,000	823.00	1,706,079,000	貸付有価証券 506,100株
M U T O Hホールディングス	75,000	222.00	16,650,000	貸付有価証券 44,000株
東京エレクトロン	525,400	8,490.00	4,460,646,000	
トヨタ紡織	223,800	1,941.00	434,395,800	
鬼怒川ゴム工業	147,000	776.00	114,072,000	
ユニプレス	132,800	1,478.00	196,278,400	
豊田自動織機	582,900	3,750.00	2,185,875,000	
モリタホールディングス	111,900	1,321.00	147,819,900	
三櫻工業	81,400	510.00	41,514,000	
デンソー	1,581,500	3,399.00	5,375,518,500	
東海理化電機製作所	187,300	1,360.00	254,728,000	
三井造船	2,478,000	133.00	329,574,000	貸付有価証券 311,000株
川崎重工業	4,982,000	260.00	1,295,320,000	
名村造船所	192,000	497.00	95,424,000	
サノヤスホールディングス	79,800	161.00	12,847,800	
日本車輛製造	263,000	270.00	71,010,000	貸付有価証券 142,000株
ニチユ三菱フォークリフト	73,800	609.00	44,944,200	貸付有価証券 100株
近畿車輛	97,000	254.00	24,638,000	貸付有価証券 57,000株
日産自動車	8,934,300	918.90	8,209,728,270	貸付有価証券 1,488,700株
いすゞ自動車	1,855,000	1,232.00	2,285,360,000	
トヨタ自動車	7,961,800	5,055.00	40,246,899,000	代用有価証券 46,500株 貸付有価証券 1,245,700株
日野自動車	913,700	916.00	836,949,200	貸付有価証券 10,400株
三菱自動車工業	2,541,800	442.00	1,123,475,600	
エフテック	33,700	865.00	29,150,500	貸付有価証券 21,300株

レシップホールディングス	21,000	790.00	16,590,000	貸付有価証券 12,300株
G M B	10,700	914.00	9,779,800	貸付有価証券 900株
ファルテック	11,300	1,143.00	12,915,900	
武蔵精密工業	68,200	1,823.00	124,328,600	
日産車体	312,500	946.00	295,625,000	貸付有価証券 57,900株
新明和工業	278,000	584.00	162,352,000	
極東開発工業	127,400	892.00	113,640,800	
日信工業	143,100	1,235.00	176,728,500	貸付有価証券 56,300株
トビー工業	527,000	200.00	105,400,000	貸付有価証券 20,000株
ティラド	249,000	175.00	43,575,000	
曙ブレーキ工業	324,100	181.00	58,662,100	貸付有価証券 223,000株
タチエス	101,400	1,384.00	140,337,600	
N O K	309,800	1,581.00	489,793,800	
フタバ産業	194,900	429.00	83,612,100	貸付有価証券 122,000株
K Y B	717,000	319.00	228,723,000	貸付有価証券 100,000株
大同メタル工業	89,300	980.00	87,514,000	貸付有価証券 5,000株
プレス工業	340,000	314.00	106,760,000	貸付有価証券 38,200株
ミクニ	82,200	285.00	23,427,000	貸付有価証券 7,000株
カルソニックカンセイ	489,000	742.00	362,838,000	
太平洋工業	142,300	885.00	125,935,500	貸付有価証券 98,900株
ケーヒン	147,000	1,424.00	209,328,000	貸付有価証券 3,000株
河西工業	78,600	862.00	67,753,200	
アイシン精機	656,100	3,760.00	2,466,936,000	貸付有価証券 230,000株
富士機工	74,800	286.00	21,392,800	
マツダ	2,027,100	1,211.50	2,455,831,650	貸付有価証券 257,000株
ダイハツ工業	764,100	1,314.00	1,004,027,400	貸付有価証券 374,500株
今仙電機製作所	58,500	820.00	47,970,000	
本田技研工業	5,760,800	2,476.50	14,266,621,200	代用有価証券 93,900株
スズキ	1,171,200	2,691.00	3,151,699,200	貸付有価証券 17,400株
富士重工業	2,022,900	3,288.00	6,651,295,200	
安永	21,300	470.00	10,011,000	

ヤマハ発動機	904,200	1,426.00	1,289,389,200	貸付有価証券 47,300株
ショーワ	166,100	550.00	91,355,000	貸付有価証券 112,600株
T B K	76,100	344.00	26,178,400	
エクセディ	86,900	2,024.00	175,885,600	貸付有価証券 45,000株
豊田合成	232,600	1,708.00	397,280,800	貸付有価証券 27,500株
愛三工業	112,100	628.00	70,398,800	
盟和産業	10,600	991.00	10,504,600	
ヨロズ	60,200	1,368.00	82,353,600	
エフ・シー・シー	104,700	1,608.00	168,357,600	貸付有価証券 6,100株
シマノ	258,000	13,740.00	3,544,920,000	
タカタ	115,500	347.00	40,078,500	貸付有価証券 80,200株
テイ・エス テック	148,700	2,371.00	352,567,700	貸付有価証券 5,800株
ジャムコ	37,400	1,819.00	68,030,600	貸付有価証券 3,000株
テルモ	981,300	4,495.00	4,410,943,500	貸付有価証券 7,500株
クリエートメディック	21,200	798.00	16,917,600	
日機装	230,400	629.00	144,921,600	貸付有価証券 161,600株
島津製作所	824,000	1,348.00	1,110,752,000	
J M S	119,000	270.00	32,130,000	貸付有価証券 4,000株
クボテック	14,000	427.00	5,978,000	貸付有価証券 7,400株
長野計器	39,100	552.00	21,583,200	
ブイ・テクノロジー	15,300	12,100.00	185,130,000	貸付有価証券 10,500株
東京計器	204,000	150.00	30,600,000	貸付有価証券 28,000株
愛知時計電機	81,000	299.00	24,219,000	
オーバル	62,300	228.00	14,204,400	貸付有価証券 23,700株
東京精密	123,500	2,219.00	274,046,500	
マニー	85,000	1,637.00	139,145,000	貸付有価証券 39,200株
ニコン	1,195,100	1,366.00	1,632,506,600	貸付有価証券 808,300株
トプコン	214,800	922.00	198,045,600	貸付有価証券 146,300株
オリンパス	953,600	3,425.00	3,266,080,000	
理研計器	51,600	1,066.00	55,005,600	

タムロン	51,500	1,272.00	65,508,000	貸付有価証券 10,000株
H O Y A	1,447,600	3,527.00	5,105,685,200	
ノーリツ鋼機	58,000	675.00	39,150,000	貸付有価証券 2,200株
エー・アンド・デイ	58,500	353.00	20,650,500	
シチズンホールディングス	788,100	482.00	379,864,200	
リズム時計工業	280,000	178.00	49,840,000	貸付有価証券 11,000株
大研医器	51,400	785.00	40,349,000	貸付有価証券 28,600株
メニコン	42,900	3,145.00	134,920,500	貸付有価証券 15,000株
松風	31,200	1,320.00	41,184,000	貸付有価証券 13,400株
セイコーホールディングス	411,000	292.00	120,012,000	貸付有価証券 125,000株
ニプロ	477,100	1,248.00	595,420,800	
スノーピーク	6,800	4,330.00	29,444,000	貸付有価証券 1,300株
パラマウントベッドホールディングス	67,500	4,835.00	326,362,500	貸付有価証券 25,000株
トランザクション	12,700	1,037.00	13,169,900	貸付有価証券 5,000株
S H O - B I	20,700	397.00	8,217,900	貸付有価証券 800株
ニホンフラッシュ	24,800	1,161.00	28,792,800	貸付有価証券 12,200株
前田工織	64,000	990.00	63,360,000	貸付有価証券 21,500株
永大産業	88,000	381.00	33,528,000	
アートネイチャー	68,700	782.00	53,723,400	貸付有価証券 21,500株
ダンロップスポーツ	40,600	901.00	36,580,600	
バンダイナムコホールディングス	661,900	2,639.00	1,746,754,100	
アイフィスジャパン	14,100	356.00	5,019,600	
共立印刷	105,900	292.00	30,922,800	貸付有価証券 100株
S H O E I	28,900	1,473.00	42,569,700	
フランスベッドホールディングス	89,200	905.00	80,726,000	貸付有価証券 1,000株
パイロットコーポレーション	111,700	4,135.00	461,879,500	貸付有価証券 10,000株
萩原工業	17,700	2,518.00	44,568,600	
トッパン・フォームズ	114,200	1,042.00	118,996,400	
フジシールインターナショナル	77,700	3,700.00	287,490,000	
タカラトミー	210,500	879.00	185,029,500	
廣済堂	59,500	291.00	17,314,500	
A s - m e エステール	16,900	580.00	9,802,000	

アーケ	272,100	68.00	18,502,800	貸付有価証券 91,200株
タカノ	28,000	596.00	16,688,000	
プロネクサス	59,900	978.00	58,582,200	
ホクシン	51,300	106.00	5,437,800	貸付有価証券 19,800株
ウッドワン	117,000	223.00	26,091,000	
大建工業	251,000	316.00	79,316,000	
凸版印刷	1,807,000	854.00	1,543,178,000	
大日本印刷	1,846,000	1,165.00	2,150,590,000	
図書印刷	121,000	462.00	55,902,000	貸付有価証券 64,000株
共同印刷	215,000	315.00	67,725,000	貸付有価証券 7,000株
日本写真印刷	107,400	1,781.00	191,279,400	貸付有価証券 75,200株
光村印刷	60,000	179.00	10,740,000	
宝印刷	31,000	1,363.00	42,253,000	貸付有価証券 6,600株
アシックス	596,200	1,584.00	944,380,800	貸付有価証券 314,700株
ツツミ	31,900	1,965.00	62,683,500	
小松ウオール工業	21,500	1,534.00	32,981,000	
ヤマハ	470,500	2,589.00	1,218,124,500	
河合楽器製作所	23,800	1,850.00	44,030,000	
クリナップ	75,100	750.00	56,325,000	
ビジョン	362,700	2,816.00	1,021,363,200	貸付有価証券 246,400株
兼松日産農林	63,000	135.00	8,505,000	貸付有価証券 30,000株
キングジム	53,500	814.00	43,549,000	貸付有価証券 5,700株
リンテック	152,200	1,956.00	297,703,200	
T A S A K I	11,900	1,121.00	13,339,900	貸付有価証券 7,300株
イトーキ	134,700	520.00	70,044,000	
任天堂	394,200	16,270.00	6,413,634,000	貸付有価証券 70,000株
三菱鉛筆	47,900	4,565.00	218,663,500	貸付有価証券 33,600株
タカスタンダード	265,000	935.00	247,775,000	貸付有価証券 3,000株
コクヨ	332,800	1,387.00	461,593,600	貸付有価証券 93,300株
ナカバヤシ	125,000	231.00	28,875,000	
グロープライド	31,100	1,644.00	51,128,400	
岡村製作所	223,400	962.00	214,910,800	

美津濃	344,000	454.00	156,176,000	貸付有価証券 150,000株
アデランス	111,000	468.00	51,948,000	貸付有価証券 73,900株
東京電力ホールディングス	5,430,200	403.00	2,188,370,600	
中部電力	1,958,700	1,422.00	2,785,271,400	
関西電力	2,612,300	956.70	2,499,187,410	
中国電力	885,000	1,291.00	1,142,535,000	貸付有価証券 19,800株
北陸電力	627,200	1,249.00	783,372,800	
東北電力	1,599,200	1,266.00	2,024,587,200	貸付有価証券 180,000株
四国電力	576,400	1,142.00	658,248,800	貸付有価証券 79,200株
九州電力	1,413,800	994.00	1,405,317,200	貸付有価証券 858,200株
北海道電力	599,100	779.00	466,698,900	
沖縄電力	101,900	2,127.00	216,741,300	貸付有価証券 11,000株
電源開発	545,800	2,392.00	1,305,553,600	
ファーストエスコ	26,500	687.00	18,205,500	貸付有価証券 18,400株
イーレックス	19,200	2,343.00	44,985,600	貸付有価証券 12,800株
東京瓦斯	7,146,000	414.60	2,962,731,600	
大阪瓦斯	6,626,000	390.50	2,587,453,000	貸付有価証券 275,000株
東邦瓦斯	1,614,000	866.00	1,397,724,000	貸付有価証券 151,000株
北海道瓦斯	156,000	276.00	43,056,000	貸付有価証券 47,000株
広島ガス	111,900	302.00	33,793,800	
西部瓦斯	721,000	242.00	174,482,000	
静岡ガス	181,600	713.00	129,480,800	貸付有価証券 300株
メタウォーター	41,200	2,903.00	119,603,600	貸付有価証券 28,700株
SBSホールディングス	63,600	693.00	44,074,800	
東武鉄道	3,420,000	563.00	1,925,460,000	
相鉄ホールディングス	1,097,000	553.00	606,641,000	
東京急行電鉄	3,726,000	861.00	3,208,086,000	
京浜急行電鉄	1,754,000	1,028.00	1,803,112,000	貸付有価証券 50,000株
小田急電鉄	2,051,000	1,197.00	2,455,047,000	貸付有価証券 84,000株
京王電鉄	1,789,000	956.00	1,710,284,000	
京成電鉄	960,000	1,294.00	1,242,240,000	貸付有価証券 185,000株



富士急行	175,000	1,457.00	254,975,000	貸付有価証券 116,000株
新京成電鉄	79,000	375.00	29,625,000	
東日本旅客鉄道	1,170,200	9,339.00	10,928,497,800	貸付有価証券 168,700株
西日本旅客鉄道	616,100	6,486.00	3,996,024,600	
東海旅客鉄道	573,200	18,065.00	10,354,858,000	貸付有価証券 256,200株
西武ホールディングス	680,000	1,582.00	1,075,760,000	
鴻池運輸	90,500	1,023.00	92,581,500	貸付有価証券 55,000株
西日本鉄道	828,000	509.00	421,452,000	
ハマキョウレックス	49,200	1,890.00	92,988,000	貸付有価証券 17,400株
サカイ引越センター	25,200	2,897.00	73,004,400	貸付有価証券 17,000株
近鉄グループホールディングス	6,443,000	432.00	2,783,376,000	
阪急阪神ホールディングス	4,296,000	756.00	3,247,776,000	
南海電気鉄道	1,437,000	574.00	824,838,000	
京阪ホールディングス	1,434,000	711.00	1,019,574,000	貸付有価証券 225,000株
神戸電鉄	157,000	361.00	56,677,000	貸付有価証券 72,000株
名古屋鉄道	2,331,000	588.00	1,370,628,000	貸付有価証券 1,635,000株
山陽電気鉄道	233,000	478.00	111,374,000	貸付有価証券 11,000株
日本通運	2,476,000	469.00	1,161,244,000	
ヤマトホールディングス	1,144,600	2,546.00	2,914,151,600	
山九	843,000	527.00	444,261,000	貸付有価証券 1,000株
丸運	34,500	239.00	8,245,500	貸付有価証券 5,000株
丸全昭和運輸	214,000	359.00	76,826,000	
センコー	287,900	617.00	177,634,300	貸付有価証券 182,200株
トナミホールディングス	131,000	264.00	34,584,000	
ニッコンホールディングス	203,500	1,812.00	368,742,000	貸付有価証券 6,700株
日本石油輸送	72,000	218.00	15,696,000	
福山通運	388,000	559.00	216,892,000	貸付有価証券 272,000株
セイノーホールディングス	454,000	973.00	441,742,000	
神奈川中央交通	74,000	589.00	43,586,000	
日立物流	133,300	1,645.00	219,278,500	貸付有価証券 500株
丸和運輸機関	19,100	3,010.00	57,491,000	貸付有価証券 12,800株
C & F ロジホールディングス	61,300	1,031.00	63,200,300	

日本郵船	5,746,000	169.00	971,074,000	
商船三井	3,117,000	202.00	629,634,000	貸付有価証券 2,165,000株
川崎汽船	2,801,000	244.00	683,444,000	貸付有価証券 1,978,000株
N S ユナイテッド海運	284,000	120.00	34,080,000	
明治海運	57,500	292.00	16,790,000	
飯野海運	331,100	357.00	118,202,700	貸付有価証券 100,000株
共栄タンカー	51,000	147.00	7,497,000	貸付有価証券 25,000株
乾汽船	50,500	860.00	43,430,000	貸付有価証券 100株
日本航空	1,225,600	3,022.00	3,703,763,200	
A N A ホールディングス	11,882,000	276.70	3,287,749,400	貸付有価証券 8,237,000株
パスコ	58,000	295.00	17,110,000	貸付有価証券 40,000株
トランコム	18,500	6,600.00	122,100,000	
日新	262,000	281.00	73,622,000	
三菱倉庫	455,000	1,360.00	618,800,000	貸付有価証券 8,000株
三井倉庫ホールディングス	371,000	253.00	93,863,000	
住友倉庫	467,000	480.00	224,160,000	
澁澤倉庫	165,000	272.00	44,880,000	
東陽倉庫	111,300	212.00	23,595,600	
日本トランスシティ	146,000	346.00	50,516,000	
ケイヒン	117,000	128.00	14,976,000	
中央倉庫	36,800	892.00	32,825,600	
安田倉庫	49,700	585.00	29,074,500	
東洋埠頭	183,000	135.00	24,705,000	貸付有価証券 2,000株
宇徳	53,100	287.00	15,239,700	貸付有価証券 100株
上組	764,000	893.00	682,252,000	
サンリツ	15,800	485.00	7,663,000	
キムラユニティー	16,200	1,007.00	16,313,400	
キューソー流通システム	17,600	2,523.00	44,404,800	貸付有価証券 12,200株
郵船ロジスティクス	58,900	947.00	55,778,300	貸付有価証券 10,100株
近鉄エクスプレス	114,500	1,213.00	138,888,500	貸付有価証券 45,000株
東海運	35,300	251.00	8,860,300	
エーアイティー	38,900	829.00	32,248,100	貸付有価証券 1,900株
内外トランスライン	20,900	902.00	18,851,800	

NEC ネットエスアイ	79,200	1,828.00	144,777,600	貸付有価証券 29,200株
システナ	61,600	1,450.00	89,320,000	貸付有価証券 10,000株
デジタルアーツ	30,900	2,836.00	87,632,400	貸付有価証券 19,900株
新日鉄住金ソリューションズ	105,300	1,487.00	156,581,100	貸付有価証券 5,000株
キューブシステム	27,800	696.00	19,348,800	
コア	26,500	897.00	23,770,500	貸付有価証券 5,800株
ソフトクリエイティブホールディングス	30,100	973.00	29,287,300	貸付有価証券 10,000株
T I S	209,400	2,230.00	466,962,000	
ネオス	18,500	554.00	10,249,000	貸付有価証券 12,600株
電算システム	21,600	1,403.00	30,304,800	貸付有価証券 12,100株
グリー	383,300	576.00	220,780,800	貸付有価証券 2,000株
コーエーテクモホールディングス	149,900	1,811.00	271,468,900	
三菱総合研究所	24,500	3,025.00	74,112,500	貸付有価証券 4,000株
ボルテージ	12,200	1,128.00	13,761,600	貸付有価証券 4,400株
電算	6,900	1,884.00	12,999,600	貸付有価証券 2,500株
A G S	14,000	972.00	13,608,000	
ファインデックス	41,500	1,260.00	52,290,000	貸付有価証券 25,400株
ヒト・コミュニケーションズ	14,400	1,797.00	25,876,800	貸付有価証券 9,500株
ブレインパッド	9,600	1,061.00	10,185,600	貸付有価証券 6,400株
K L a b	97,800	767.00	75,012,600	貸付有価証券 61,600株
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	41,900	738.00	30,922,200	
イーブックイニシアティブジャパン	14,200	832.00	11,814,400	貸付有価証券 9,800株
ネクソン	607,000	1,477.00	896,539,000	
アイスタイル	96,100	745.00	71,594,500	貸付有価証券 65,400株
エムアップ	16,400	579.00	9,495,600	貸付有価証券 11,200株
エイチーム	34,800	1,832.00	63,753,600	貸付有価証券 24,000株
テクノスジャパン	18,300	1,930.00	35,319,000	貸付有価証券 12,800株
e n i s h	20,300	566.00	11,489,800	貸付有価証券 12,600株

コロプラ	175,700	1,988.00	349,291,600	貸付有価証券 119,700株
モバイルクリエイト	41,500	335.00	13,902,500	貸付有価証券 28,900株
オルトプラス	23,900	333.00	7,958,700	貸付有価証券 15,900株
ブロードリーフ	63,600	948.00	60,292,800	貸付有価証券 42,400株
ハーツユナイテッドグループ	19,000	3,240.00	61,560,000	貸付有価証券 12,600株
メディアドゥ	13,500	1,811.00	24,448,500	貸付有価証券 8,800株
ブイキューブ	41,700	792.00	33,026,400	貸付有価証券 28,900株
サイバーリンクス	9,600	982.00	9,427,200	
ディー・エル・イー	17,400	889.00	15,468,600	貸付有価証券 12,100株
VOYAGE GROUP	21,000	1,044.00	21,924,000	貸付有価証券 13,900株
オブティム	5,100	4,740.00	24,174,000	貸付有価証券 3,100株
ベリサーブ	7,100	3,315.00	23,536,500	貸付有価証券 4,900株
ティーガイア	62,900	1,439.00	90,513,100	貸付有価証券 43,400株
日本アジアグループ	71,000	387.00	27,477,000	
豆蔵ホールディングス	50,400	918.00	46,267,200	貸付有価証券 24,800株
テクマトリックス	27,100	2,310.00	62,601,000	貸付有価証券 18,900株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,471,900	283.00	416,547,700	貸付有価証券 1,039,000株
GMOペイメントゲートウェイ	51,700	5,540.00	286,418,000	貸付有価証券 35,900株
ザッパラス	35,200	359.00	12,636,800	貸付有価証券 14,000株
インターネットイニシアティブ	102,100	2,054.00	209,713,400	
さくらインターネット	41,800	812.00	33,941,600	貸付有価証券 28,900株
GMOクラウド	14,100	1,015.00	14,311,500	貸付有価証券 8,400株
SRAホールディングス	36,400	2,068.00	75,275,200	
Minor iソリューションズ	12,300	843.00	10,368,900	
システムインテグレータ	8,400	634.00	5,325,600	貸付有価証券 2,200株
朝日ネット	58,100	411.00	23,879,100	
コムチュア	10,800	3,495.00	37,746,000	貸付有価証券 2,400株
サイバーコム	7,000	791.00	5,537,000	
gumi	65,100	810.00	52,731,000	貸付有価証券 45,900株

パイプドHD	8,000	946.00	7,568,000	貸付有価証券 5,300株
フェイス	16,400	1,034.00	16,957,600	
ハイマックス	7,900	1,074.00	8,484,600	
野村総合研究所	442,700	3,475.00	1,538,382,500	
サイバネットシステム	52,000	662.00	34,424,000	貸付有価証券 36,100株
C Eホールディングス	9,800	905.00	8,869,000	
インタージホールディングス	33,000	1,563.00	51,579,000	
東邦システムサイエンス	18,400	600.00	11,040,000	
ソースネクスト	32,600	496.00	16,169,600	貸付有価証券 14,800株
ティー・ワイ・オー	125,000	164.00	20,500,000	
フォーカスシステムズ	24,900	440.00	10,956,000	貸付有価証券 4,700株
クレスコ	14,500	2,333.00	33,828,500	
フジ・メディア・ホールディングス	657,900	1,110.00	730,269,000	貸付有価証券 14,800株
オービック	217,800	5,550.00	1,208,790,000	
ジャストシステム	114,800	843.00	96,776,400	貸付有価証券 41,000株
TDCソフトウェアエンジニアリング	27,700	583.00	16,149,100	
ヤフー	4,527,900	452.00	2,046,610,800	貸付有価証券 3,082,900株
トレンドマイクロ	306,700	3,630.00	1,113,321,000	
インフォメーション・ディベロプメント	12,000	942.00	11,304,000	
日本オラクル	101,400	5,580.00	565,812,000	貸付有価証券 1,500株
アルファシステムズ	20,600	1,656.00	34,113,600	
フューチャー	75,700	750.00	56,775,000	
CAC Holdings	47,100	778.00	36,643,800	
ソフトバンク・テクノロジー	17,100	1,814.00	31,019,400	貸付有価証券 11,900株
トーセ	16,500	631.00	10,411,500	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	32,100	4,700.00	150,870,000	貸付有価証券 21,800株
伊藤忠テクノソリューションズ	143,100	2,188.00	313,102,800	
アイティフォー	82,700	501.00	41,432,700	
東計電算	11,200	1,748.00	19,577,600	
エクスネット	5,800	1,492.00	8,653,600	
大塚商会	169,900	4,765.00	809,573,500	貸付有価証券 40,000株
サイボウズ	85,000	366.00	31,110,000	貸付有価証券 9,400株
ソフトブレイン	92,300	482.00	44,488,600	貸付有価証券 65,000株
電通国際情報サービス	38,800	1,692.00	65,649,600	

デジタルガレージ	98,700	2,147.00	211,908,900	
E Mシステムズ	21,000	1,245.00	26,145,000	
ウェザーニューズ	21,200	3,150.00	66,780,000	貸付有価証券 14,700株
C I J	58,200	447.00	26,015,400	
東洋ビジネスエンジニアリング	6,200	1,371.00	8,500,200	
日本エンタープライズ	65,200	294.00	19,168,800	貸付有価証券 43,700株
WOWOW	30,100	2,287.00	68,838,700	貸付有価証券 16,200株
フュージョンパートナー	39,600	538.00	21,304,800	貸付有価証券 27,400株
日本コロムビア	21,500	445.00	9,567,500	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	53,500	460.00	24,610,000	貸付有価証券 3,300株
ネットワンシステムズ	273,600	609.00	166,622,400	
アルゴグラフィックス	28,700	1,548.00	44,427,600	
マーベラス	106,700	815.00	86,960,500	貸付有価証券 74,400株
エイベックス・グループ・ホールディングス	116,300	1,115.00	129,674,500	
日本ユニシス	174,400	1,291.00	225,150,400	貸付有価証券 20,000株
兼松エレクトロニクス	39,800	1,812.00	72,117,600	
東京放送ホールディングス	378,500	1,318.00	498,863,000	貸付有価証券 38,300株
日本テレビホールディングス	576,800	1,654.00	954,027,200	
朝日放送	62,800	605.00	37,994,000	
テレビ朝日ホールディングス	172,600	1,603.00	276,677,800	貸付有価証券 32,400株
スカパーJ S A Tホールディングス	479,500	443.00	212,418,500	
テレビ東京ホールディングス	57,200	1,963.00	112,283,600	貸付有価証券 38,800株
日本BS放送	14,000	992.00	13,888,000	貸付有価証券 7,000株
U - N E X T	19,200	732.00	14,054,400	貸付有価証券 13,300株
ワイヤレスゲート	18,500	1,591.00	29,433,500	
コネクシオ	55,600	1,370.00	76,172,000	貸付有価証券 37,300株
日本通信	447,200	209.00	93,464,800	貸付有価証券 311,100株
クロップス	11,700	511.00	5,978,700	
日本電信電話	4,883,700	4,829.00	23,583,387,300	
K D D I	6,250,400	3,134.00	19,588,753,600	貸付有価証券 54,000株
光通信	75,900	8,580.00	651,222,000	貸付有価証券 22,000株
N T T ドコモ	4,721,000	2,795.00	13,195,195,000	

エムティーアイ	96,700	633.00	61,211,100	貸付有価証券 65,700株
GMOインターネット	230,400	1,025.00	236,160,000	貸付有価証券 7,200株
カドカワ	197,300	1,390.00	274,247,000	貸付有価証券 20,500株
学研ホールディングス	210,000	254.00	53,340,000	貸付有価証券 102,000株
ゼンリン	83,500	1,916.00	159,986,000	貸付有価証券 29,100株
昭文社	34,800	536.00	18,652,800	
インプレスホールディングス	52,500	131.00	6,877,500	貸付有価証券 25,700株
アイネット	35,200	1,077.00	37,910,400	
松竹	416,000	1,074.00	446,784,000	貸付有価証券 135,000株
東宝	450,800	2,696.00	1,215,356,800	
東映	235,000	908.00	213,380,000	貸付有価証券 23,000株
AOI Pro.	31,700	956.00	30,305,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	390,300	4,725.00	1,844,167,500	
ピー・シー・エー	7,800	1,172.00	9,141,600	貸付有価証券 2,500株
ビジネスブレイン太田昭和	9,700	907.00	8,797,900	
DTS	70,200	1,878.00	131,835,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	267,400	3,290.00	879,746,000	貸付有価証券 1,500株
シーイーシー	41,000	1,286.00	52,726,000	貸付有価証券 600株
カプコン	161,500	2,169.00	350,293,500	
アイ・エス・ビー	10,200	824.00	8,404,800	
ジャステック	40,500	960.00	38,880,000	貸付有価証券 2,000株
SCSK	150,300	3,675.00	552,352,500	
日本システムウエア	23,800	1,021.00	24,299,800	貸付有価証券 900株
アイネス	89,300	982.00	87,692,600	
TKC	58,400	2,651.00	154,818,400	
富士ソフト	93,800	2,258.00	211,800,400	
NSD	134,000	1,623.00	217,482,000	
コナミホールディングス	285,200	4,050.00	1,155,060,000	貸付有価証券 11,400株
福井コンピュータホールディングス	18,100	2,085.00	37,738,500	
JBCホールディングス	53,300	642.00	34,218,600	
ミロク情報サービス	46,700	1,449.00	67,668,300	
ソフトバンクグループ	3,579,800	5,399.00	19,327,340,200	代用有価証券 53,700株 貸付有価証券 668,500株

ハウスイ	48,000	106.00	5,088,000	
高千穂交易	24,200	865.00	20,933,000	貸付有価証券 14,400株
伊藤忠食品	15,600	4,070.00	63,492,000	貸付有価証券 2,100株
エレマテック	29,400	1,922.00	56,506,800	貸付有価証券 1,700株
JALUX	20,300	1,579.00	32,053,700	貸付有価証券 7,900株
あらた	28,300	2,122.00	60,052,600	
トーメンデバイス	9,500	1,790.00	17,005,000	
東京エレクトロン デバイス	22,500	1,482.00	33,345,000	
フィールズ	55,200	1,176.00	64,915,200	貸付有価証券 25,100株
双日	3,980,100	238.00	947,263,800	貸付有価証券 202,300株
アルフレッサ ホールディングス	794,100	2,119.00	1,682,697,900	
横浜冷凍	156,400	1,076.00	168,286,400	貸付有価証券 34,800株
神栄	83,000	108.00	8,964,000	貸付有価証券 53,000株
山下医科器械	5,100	1,623.00	8,277,300	貸付有価証券 3,000株
ラサ商事	29,200	469.00	13,694,800	
ラクーン	27,500	493.00	13,557,500	貸付有価証券 18,200株
アルコニックス	35,800	1,435.00	51,373,000	
神戸物産	41,000	1,959.00	80,319,000	貸付有価証券 24,000株
あい ホールディングス	112,500	2,232.00	251,100,000	貸付有価証券 41,700株
ディーブイエックス	22,200	1,225.00	27,195,000	
ダイワボウホールディングス	574,000	216.00	123,984,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	113,800	1,012.00	115,165,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	109,500	993.00	108,733,500	貸付有価証券 57,900株
八洲電機	49,100	515.00	25,286,500	
UKCホールディングス	40,600	1,488.00	60,412,800	貸付有価証券 6,200株
OCHIホールディングス	18,400	981.00	18,050,400	
TOKAIホールディングス	277,600	670.00	185,992,000	貸付有価証券 147,600株
三洋貿易	34,600	1,123.00	38,855,800	
ウイン・パートナーズ	22,600	1,394.00	31,504,400	
ミタチ産業	16,500	534.00	8,811,000	
シップヘルスケアホールディングス	128,300	3,105.00	398,371,500	
明治電機工業	19,700	958.00	18,872,600	貸付有価証券 9,500株



デリカフーズ	13,500	959.00	12,946,500	
スターティア	12,400	463.00	5,741,200	貸付有価証券 8,400株
富士興産	25,300	405.00	10,246,500	
協栄産業	78,000	123.00	9,594,000	
小野建	55,100	1,170.00	64,467,000	
佐島電機	50,500	658.00	33,229,000	
エコートレーディング	14,700	570.00	8,379,000	貸付有価証券 100株
伯東	47,900	850.00	40,715,000	
コンドーテック	50,600	707.00	35,774,200	
中山福	39,100	762.00	29,794,200	貸付有価証券 2,500株
ナガイレーベン	91,200	2,359.00	215,140,800	貸付有価証券 10,000株
三菱食品	69,300	2,694.00	186,694,200	貸付有価証券 4,100株
松田産業	45,900	1,258.00	57,742,200	貸付有価証券 2,500株
第一興商	111,700	4,295.00	479,751,500	
メディバルホールディングス	631,900	1,543.00	975,021,700	貸付有価証券 20,200株
アドヴァン	64,500	830.00	53,535,000	
S P K	14,600	1,968.00	28,732,800	貸付有価証券 100株
萩原電気	21,400	1,868.00	39,975,200	
アズワン	49,300	4,160.00	205,088,000	貸付有価証券 600株
スズデン	20,300	891.00	18,087,300	貸付有価証券 6,500株
尾家産業	20,500	864.00	17,712,000	
シモジマ	43,500	1,064.00	46,284,000	
ドウシシャ	74,300	1,978.00	146,965,400	
小津産業	13,800	1,995.00	27,531,000	貸付有価証券 9,600株
高速	37,300	844.00	31,481,200	
たけびし	22,100	994.00	21,967,400	貸付有価証券 15,400株
黒田電気	117,600	1,773.00	208,504,800	貸付有価証券 17,000株
リックス	14,200	1,617.00	22,961,400	
丸文	56,100	560.00	31,416,000	
ハビネット	57,300	822.00	47,100,600	
橋本総業ホールディングス	13,100	1,453.00	19,034,300	
日本ライフライン	30,400	3,870.00	117,648,000	
エクセル	30,700	1,283.00	39,388,100	貸付有価証券 15,200株
マルカキカイ	20,500	993.00	20,356,500	

ガリバーインターナショナル	169,900	783.00	133,031,700	貸付有価証券 115,500株
日本エム・ディ・エム	52,500	669.00	35,122,500	貸付有価証券 18,000株
進和	37,200	1,355.00	50,406,000	
エスケイジャパン	15,500	245.00	3,797,500	貸付有価証券 10,800株
ダイトエレクトロン	28,900	552.00	15,952,800	
シークス	40,100	3,290.00	131,929,000	貸付有価証券 27,300株
田中商事	19,400	625.00	12,125,000	貸付有価証券 200株
オーハシテクニカ	35,500	1,131.00	40,150,500	
白銅	18,000	1,056.00	19,008,000	
伊藤忠商事	4,957,900	1,226.00	6,078,385,400	
丸紅	6,218,000	459.00	2,854,062,000	貸付有価証券 4,330,600株
高島	120,000	151.00	18,120,000	
長瀬産業	379,800	1,076.00	408,664,800	
蝶理	40,500	1,290.00	52,245,000	貸付有価証券 12,000株
豊田通商	703,700	2,177.00	1,531,954,900	貸付有価証券 9,800株
三共生興	95,000	326.00	30,970,000	
兼松	1,344,000	158.00	212,352,000	
ツカモトコーポレーション	112,000	98.00	10,976,000	
三井物産	5,713,500	1,188.00	6,787,638,000	貸付有価証券 237,300株
日本紙パルプ商事	328,000	334.00	109,552,000	
日立ハイテクノロジーズ	219,000	2,700.00	591,300,000	貸付有価証券 1,700株
カメイ	82,100	756.00	62,067,600	
東都水産	106,000	153.00	16,218,000	
OUGホールディングス	88,000	234.00	20,592,000	
スターゼン	22,500	3,900.00	87,750,000	貸付有価証券 5,800株
山善	242,500	797.00	193,272,500	
椿本興業	70,000	251.00	17,570,000	
住友商事	3,977,200	1,015.00	4,036,858,000	
内田洋行	156,000	462.00	72,072,000	
三菱商事	4,741,000	1,748.00	8,287,268,000	
第一実業	144,000	427.00	61,488,000	
キヤノンマーケティングジャパン	180,200	1,870.00	336,974,000	
西華産業	200,000	232.00	46,400,000	
佐藤商事	56,400	590.00	33,276,000	
菱洋エレクトロ	71,300	1,285.00	91,620,500	貸付有価証券 8,700株

東京産業	62,000	333.00	20,646,000	貸付有価証券 100株
ユアサ商事	59,800	2,100.00	125,580,000	
神鋼商事	141,000	160.00	22,560,000	
小林産業	42,000	254.00	10,668,000	貸付有価証券 200株
阪和興業	631,000	541.00	341,371,000	
カナデン	60,200	886.00	53,337,200	
菱電商事	100,000	606.00	60,600,000	
フルサト工業	34,900	1,209.00	42,194,100	
岩谷産業	749,000	573.00	429,177,000	貸付有価証券 327,000株
すてきナイスグループ	268,000	131.00	35,108,000	
昭光通商	223,000	71.00	15,833,000	貸付有価証券 119,000株
二チモウ	99,000	159.00	15,741,000	貸付有価証券 4,000株
極東貿易	88,000	173.00	15,224,000	
イワキ	95,000	183.00	17,385,000	
三愛石油	155,300	594.00	92,248,200	
稲畑産業	151,500	906.00	137,259,000	
G S Iクレオス	167,000	91.00	15,197,000	
明和産業	58,600	296.00	17,345,600	貸付有価証券 3,000株
ワキタ	134,500	645.00	86,752,500	
東邦ホールディングス	202,200	2,328.00	470,721,600	貸付有価証券 77,600株
サンゲツ	220,000	1,924.00	423,280,000	
ミツウロコグループホールディングス	102,000	485.00	49,470,000	
シナネンホールディングス	135,000	391.00	52,785,000	
伊藤忠エネクス	162,600	949.00	154,307,400	貸付有価証券 55,000株
サンリオ	194,800	1,720.00	335,056,000	貸付有価証券 132,200株
サンワテクノス	40,600	718.00	29,150,800	
リョーサン	100,200	2,357.00	236,171,400	貸付有価証券 15,000株
新光商事	74,100	959.00	71,061,900	
トーホー	28,500	2,427.00	69,169,500	
三信電気	87,300	810.00	70,713,000	
東陽テクニカ	83,700	953.00	79,766,100	貸付有価証券 38,200株
モスフードサービス	82,700	2,908.00	240,491,600	貸付有価証券 40,300株
加賀電子	57,100	1,152.00	65,779,200	
ソーダニッカ	65,900	444.00	29,259,600	
立花エレクトック	46,600	1,042.00	48,557,200	

フォーバル	33,100	715.00	23,666,500	
PALTAC	101,100	2,139.00	216,252,900	
三谷産業	67,000	310.00	20,770,000	貸付有価証券 46,600株
太平洋興発	266,000	66.00	17,556,000	
ヤマタネ	295,000	131.00	38,645,000	
丸紅建材リース	53,000	166.00	8,798,000	
日鉄住金物産	554,000	327.00	181,158,000	
トラスコ中山	72,200	5,190.00	374,718,000	
オートボックスセブン	233,900	1,385.00	323,951,500	貸付有価証券 166,300株
加藤産業	98,600	2,330.00	229,738,000	
イノテック	57,700	408.00	23,541,600	
イエローハット	59,500	2,267.00	134,886,500	貸付有価証券 5,500株
JKホールディングス	63,800	460.00	29,348,000	
日伝	26,100	3,060.00	79,866,000	
北沢産業	53,600	151.00	8,093,600	
杉本商事	36,200	1,120.00	40,544,000	
因幡電機産業	88,600	3,350.00	296,810,000	
バイテックホールディングス	26,100	1,014.00	26,465,400	貸付有価証券 9,800株
ミスミグループ本社	709,600	1,686.00	1,196,385,600	貸付有価証券 488,200株
アルテック	54,300	128.00	6,950,400	
タキヒヨー	105,000	420.00	44,100,000	
蔵王産業	10,400	1,271.00	13,218,400	
スズケン	287,600	3,095.00	890,122,000	
ジェコス	43,800	918.00	40,208,400	
ルネサスイーストン	52,900	393.00	20,789,700	貸付有価証券 5,000株
ローソン	239,200	8,040.00	1,923,168,000	貸付有価証券 6,200株
サンエー	42,900	4,990.00	214,071,000	
ダイユーエイト	16,700	633.00	10,571,100	貸付有価証券 1,000株
カワチ薬品	48,900	2,256.00	110,318,400	貸付有価証券 20,500株
エービーシー・マート	82,000	6,610.00	542,020,000	貸付有価証券 27,000株
ハードオフコーポレーション	30,400	1,154.00	35,081,600	
アスクル	76,900	3,405.00	261,844,500	貸付有価証券 42,600株
ゲオホールディングス	105,600	1,329.00	140,342,400	貸付有価証券 77,300株
アダストリア	116,400	3,285.00	382,374,000	

ジーフット	37,800	705.00	26,649,000	貸付有価証券 4,500株
シー・ヴィ・エス・バイエリア	84,000	70.00	5,880,000	貸付有価証券 45,000株
くらコーポレーション	37,000	6,000.00	222,000,000	貸付有価証券 10,000株
キャンドウ	33,300	1,630.00	54,279,000	貸付有価証券 22,400株
パル	36,800	2,316.00	85,228,800	貸付有価証券 24,700株
エディオン	267,100	869.00	232,109,900	貸付有価証券 188,500株
サーラコーポレーション	88,700	549.00	48,696,300	
ワッツ	27,000	1,096.00	29,592,000	貸付有価証券 400株
ハローズ	20,500	2,002.00	41,041,000	貸付有価証券 2,000株
あみやき亭	12,300	4,085.00	50,245,500	貸付有価証券 8,300株
ひらまつ	86,900	630.00	54,747,000	貸付有価証券 50,000株
ゲンキー	12,700	3,745.00	47,561,500	貸付有価証券 6,600株
サッポロドラッグストア	8,200	1,990.00	16,318,000	
大黒天物産	15,000	4,800.00	72,000,000	
ハニーズ	55,400	1,364.00	75,565,600	貸付有価証券 38,700株
ファーマライズホールディングス	14,100	502.00	7,078,200	貸付有価証券 8,800株
アルペン	56,300	1,630.00	91,769,000	貸付有価証券 39,400株
クオール	64,100	1,288.00	82,560,800	
ジェイアイエヌ	42,900	4,075.00	174,817,500	貸付有価証券 29,100株
ビックカメラ	362,700	924.00	335,134,800	貸付有価証券 64,600株
D C Mホールディングス	310,600	922.00	286,373,200	貸付有価証券 202,600株
MonotaRO	223,400	3,135.00	700,359,000	貸付有価証券 155,000株
東京一番フーズ	16,000	548.00	8,768,000	貸付有価証券 11,100株
ダイヤモンドダイニング	13,000	983.00	12,779,000	貸付有価証券 2,100株
きちり	16,500	593.00	9,784,500	
アークランドサービスホールディングス	19,700	2,923.00	57,583,100	
J.フロント リテイリング	799,400	1,010.00	807,394,000	
ドトール・日レスホールディングス	110,600	1,795.00	198,527,000	貸付有価証券 6,600株
マツモトキヨシホールディングス	130,300	4,595.00	598,728,500	

ブロンコピラー	33,000	3,445.00	113,685,000	
スタートトゥデイ	192,200	5,220.00	1,003,284,000	
トレジャー・ファクトリー	17,500	962.00	16,835,000	貸付有価証券 200株
物語コーポレーション	16,700	5,280.00	88,176,000	貸付有価証券 3,400株
ココカラファイン	65,800	4,800.00	315,840,000	
三越伊勢丹ホールディングス	1,256,600	891.00	1,119,630,600	貸付有価証券 64,700株
ウエルシアホールディングス	54,700	6,930.00	379,071,000	貸付有価証券 2,000株
クリエイトSDホールディングス	93,000	2,615.00	243,195,000	貸付有価証券 23,000株
丸善CHIホールディングス	73,100	379.00	27,704,900	貸付有価証券 50,600株
ミサワ	9,900	502.00	4,969,800	
エー・ピーカンパニー	10,400	812.00	8,444,800	貸付有価証券 7,100株
チムニー	15,400	2,720.00	41,888,000	貸付有価証券 10,700株
シュッピン	23,700	1,082.00	25,643,400	貸付有価証券 16,300株
ネクステージ	10,600	820.00	8,692,000	貸付有価証券 7,400株
ジョイフル本田	102,700	2,283.00	234,464,100	貸付有価証券 18,100株
鳥貴族	15,500	2,083.00	32,286,500	貸付有価証券 10,700株
キリン堂ホールディングス	20,000	897.00	17,940,000	
ホットランド	21,900	907.00	19,863,300	貸付有価証券 15,200株
すかいらーく	193,300	1,310.00	253,223,000	貸付有価証券 122,300株
綿半ホールディングス	23,500	1,484.00	34,874,000	貸付有価証券 15,100株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	209,400	990.00	207,306,000	
ブックオフコーポレーション	35,900	818.00	29,366,200	貸付有価証券 25,300株
ゴルフダイジェスト・オンライン	17,700	986.00	17,452,200	貸付有価証券 12,300株
あさひ	46,900	1,526.00	71,569,400	貸付有価証券 31,700株
日本調剤	16,000	4,495.00	71,920,000	貸付有価証券 10,200株
コスモス薬品	31,800	19,690.00	626,142,000	貸付有価証券 13,800株
トーエル	30,500	789.00	24,064,500	
一六堂	15,500	316.00	4,898,000	
セブン&アイ・ホールディングス	2,642,900	4,078.00	10,777,746,200	

葉王堂	11,800	5,100.00	60,180,000	
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	169,500	955.00	161,872,500	貸付有価証券 43,000株
ツルハホールディングス	145,200	11,770.00	1,709,004,000	貸付有価証券 9,900株
サンマルクホールディングス	49,800	3,015.00	150,147,000	
フェリシモ	18,100	1,023.00	18,516,300	貸付有価証券 4,400株
トリドール	77,500	3,055.00	236,762,500	貸付有価証券 30,000株
クスリのアオキ	56,200	4,925.00	276,785,000	貸付有価証券 3,000株
メディカルシステムネットワーク	71,000	456.00	32,376,000	貸付有価証券 48,500株
総合メディカル	30,500	3,695.00	112,697,500	貸付有価証券 21,700株
はるやま商事	26,100	726.00	18,948,600	
カッパ・クリエイティブ	88,500	1,293.00	114,430,500	貸付有価証券 50,500株
ライトオン	47,200	1,300.00	61,360,000	貸付有価証券 33,300株
ジーンズメイト	20,200	165.00	3,333,000	貸付有価証券 10,500株
良品計画	72,600	22,070.00	1,602,282,000	貸付有価証券 6,100株
三城ホールディングス	77,900	403.00	31,393,700	貸付有価証券 2,000株
アルビス	16,600	2,115.00	35,109,000	
コナカ	80,400	490.00	39,396,000	
ハウス オブ ローゼ	7,700	1,395.00	10,741,500	貸付有価証券 5,100株
G-7ホールディングス	18,400	1,175.00	21,620,000	
イオン北海道	42,300	508.00	21,488,400	貸付有価証券 26,400株
コジマ	94,400	238.00	22,467,200	貸付有価証券 22,100株
ヒマラヤ	19,500	910.00	17,745,000	貸付有価証券 12,500株
コーナン商事	89,600	1,935.00	173,376,000	貸付有価証券 1,800株
エコス	24,300	1,217.00	29,573,100	貸付有価証券 15,800株
ワタミ	74,900	1,062.00	79,543,800	貸付有価証券 42,100株
マルシェ	15,400	817.00	12,581,800	貸付有価証券 9,800株
ドンキホーテホールディングス	408,600	3,565.00	1,456,659,000	
西松屋チェーン	124,500	1,522.00	189,489,000	
ゼンショーホールディングス	324,900	1,543.00	501,320,700	貸付有価証券 113,500株

幸楽苑ホールディングス	39,900	1,526.00	60,887,400	貸付有価証券 26,800株
ハークスレイ	17,600	958.00	16,860,800	貸付有価証券 2,000株
サイゼリヤ	103,900	1,830.00	190,137,000	貸付有価証券 200株
V Tホールディングス	213,600	442.00	94,411,200	
魚力	19,500	1,320.00	25,740,000	貸付有価証券 12,200株
ポブラ	15,900	480.00	7,632,000	貸付有価証券 3,500株
ユニテッドアローズ	90,200	3,070.00	276,914,000	
ハイデイ日高	57,400	2,502.00	143,614,800	
京都きもの友禅	43,700	805.00	35,178,500	貸付有価証券 22,400株
コロワイド	209,600	1,852.00	388,179,200	貸付有価証券 148,100株
ピーシーデポコーポレーション	69,700	1,420.00	98,974,000	貸付有価証券 49,100株
壱番屋	57,100	3,550.00	202,705,000	貸付有価証券 38,400株
トップカルチャー	22,800	455.00	10,374,000	貸付有価証券 6,600株
P L A N T	14,100	1,120.00	15,792,000	
スギホールディングス	113,300	4,930.00	558,569,000	
スクロール	95,100	350.00	33,285,000	
ヨンドシーホールディングス	48,100	1,901.00	91,438,100	貸付有価証券 33,900株
ファミリーマート	194,100	6,200.00	1,203,420,000	貸付有価証券 134,600株
木曽路	77,300	2,241.00	173,229,300	貸付有価証券 48,200株
サトレストランシステムズ	74,300	808.00	60,034,400	貸付有価証券 52,500株
千趣会	124,600	651.00	81,114,600	貸付有価証券 87,400株
タカキュー	49,400	173.00	8,546,200	貸付有価証券 700株
ケーヨー	106,400	518.00	55,115,200	貸付有価証券 68,800株
上新電機	149,000	838.00	124,862,000	
日本瓦斯	96,500	2,244.00	216,546,000	貸付有価証券 43,600株
ベスト電器	206,500	100.00	20,650,000	貸付有価証券 95,800株
ロイヤルホールディングス	104,700	1,825.00	191,077,500	貸付有価証券 57,500株
東天紅	45,000	129.00	5,805,000	貸付有価証券 21,000株
いなげや	70,300	1,372.00	96,451,600	貸付有価証券 13,000株



島忠	163,400	2,208.00	360,787,200	
チヨダ	74,400	2,232.00	166,060,800	貸付有価証券 5,000株
ライフコーポレーション	39,800	2,561.00	101,927,800	
リンガーハット	57,000	2,290.00	130,530,000	貸付有価証券 38,000株
さが美	48,000	75.00	3,600,000	貸付有価証券 31,000株
MrMax	55,100	271.00	14,932,100	
テンアライド	59,100	364.00	21,512,400	貸付有価証券 1,200株
AOKIホールディングス	144,100	1,045.00	150,584,500	貸付有価証券 8,300株
オークワ	99,000	1,032.00	102,168,000	
コメリ	97,300	2,546.00	247,725,800	貸付有価証券 43,300株
青山商事	121,100	3,675.00	445,042,500	
しまむら	73,400	15,140.00	1,111,276,000	貸付有価証券 500株
はせがわ	30,300	414.00	12,544,200	
高島屋	919,000	697.00	640,543,000	貸付有価証券 12,000株
松屋	127,000	661.00	83,947,000	貸付有価証券 85,400株
エイチ・ツー・オー リテイリング	323,500	1,287.00	416,344,500	
近鉄百貨店	241,000	316.00	76,156,000	貸付有価証券 126,000株
丸栄	131,000	78.00	10,218,000	貸付有価証券 9,000株
ニッセンホールディングス	93,800	91.00	8,535,800	貸付有価証券 63,900株
パルコ	61,100	816.00	49,857,600	貸付有価証券 42,000株
丸井グループ	775,500	1,399.00	1,084,924,500	貸付有価証券 390,600株
アクシアル リテイリング	48,800	3,345.00	163,236,000	
井筒屋	352,000	42.00	14,784,000	貸付有価証券 212,000株
イオン	2,599,600	1,444.50	3,755,122,200	貸付有価証券 1,740,900株
ユニグループ・ホールディングス	604,900	856.00	517,794,400	
イズミ	125,400	3,810.00	477,774,000	
東武ストア	74,000	292.00	21,608,000	
平和堂	128,000	1,872.00	239,616,000	
フジ	70,200	2,261.00	158,722,200	
ヤオコー	71,600	4,340.00	310,744,000	
ゼビオホールディングス	85,700	1,368.00	117,237,600	貸付有価証券 15,000株

ケースホールディングス	266,800	2,026.00	540,536,800	貸付有価証券 185,000株
Olympicグループ	36,900	503.00	18,560,700	貸付有価証券 4,200株
日産東京販売ホールディングス	106,500	204.00	21,726,000	貸付有価証券 25,000株
アインホールディングス	76,100	6,920.00	526,612,000	貸付有価証券 2,000株
元気寿司	17,700	2,047.00	36,231,900	貸付有価証券 11,500株
ヤマダ電機	1,921,200	536.00	1,029,763,200	貸付有価証券 1,331,800株
アークランドサカモト	106,900	1,130.00	120,797,000	
ニトリホールディングス	273,000	13,120.00	3,581,760,000	
グルメ杵屋	44,000	964.00	42,416,000	貸付有価証券 30,000株
愛眼	50,800	199.00	10,109,200	貸付有価証券 11,000株
ケーユーホールディングス	32,900	707.00	23,260,300	貸付有価証券 13,400株
吉野家ホールディングス	233,000	1,393.00	324,569,000	貸付有価証券 164,700株
松屋フーズ	30,500	2,758.00	84,119,000	貸付有価証券 3,600株
サガミチェーン	84,300	1,192.00	100,485,600	貸付有価証券 59,200株
関西スーパーマーケット	51,300	985.00	50,530,500	貸付有価証券 34,900株
王将フードサービス	46,300	3,790.00	175,477,000	
プレナス	70,600	1,750.00	123,550,000	貸付有価証券 35,400株
ミニストップ	46,700	1,647.00	76,914,900	貸付有価証券 27,000株
アークス	118,200	2,586.00	305,665,200	
パローホールディングス	136,100	2,656.00	361,481,600	
藤久	4,800	1,674.00	8,035,200	貸付有価証券 3,300株
ベルク	31,100	4,280.00	133,108,000	
大庄	33,800	1,527.00	51,612,600	貸付有価証券 100株
ファーストリテイリング	105,400	25,445.00	2,681,903,000	貸付有価証券 34,500株
サンドラッグ	133,500	9,060.00	1,209,510,000	貸付有価証券 5,600株
サクスパー ホールディングス	59,500	904.00	53,788,000	
ヤマザワ	13,100	1,680.00	22,008,000	
やまや	13,000	1,588.00	20,644,000	
ペルーナ	157,500	573.00	90,247,500	
島根銀行	13,500	1,140.00	15,390,000	

じもとホールディングス	453,000	136.00	61,608,000	貸付有価証券 40,000株
足利ホールディングス	463,700	301.00	139,573,700	貸付有価証券 900株
東京ＴＹフィナンシャルグループ	87,100	2,017.00	175,680,700	貸付有価証券 15,700株
九州フィナンシャルグループ	967,100	487.00	470,977,700	
ゆうちょ銀行	1,618,900	1,111.00	1,798,597,900	貸付有価証券 200,000株
富山第一銀行	160,500	450.00	72,225,000	貸付有価証券 107,500株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	4,401,700	379.00	1,668,244,300	
新生銀行	5,467,000	134.00	732,578,000	
あおぞら銀行	3,997,000	339.00	1,354,983,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	50,693,300	428.70	21,732,217,710	代用有価証券 434,200株
りそなホールディングス	7,391,700	358.00	2,646,228,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	13,190,000	289.80	3,822,462,000	
三井住友フィナンシャルグループ	5,059,200	2,775.00	14,039,280,000	代用有価証券 70,500株
第四銀行	799,000	312.00	249,288,000	貸付有価証券 250,000株
北越銀行	682,000	165.00	112,530,000	貸付有価証券 48,000株
西日本シティ銀行	2,059,000	167.00	343,853,000	
千葉銀行	2,436,000	445.00	1,084,020,000	
常陽銀行	2,285,000	353.00	806,605,000	貸付有価証券 258,000株
群馬銀行	1,404,000	346.00	485,784,000	
武蔵野銀行	100,800	2,166.00	218,332,800	
千葉興業銀行	173,100	342.00	59,200,200	
筑波銀行	262,600	254.00	66,700,400	
七十七銀行	990,000	321.00	317,790,000	貸付有価証券 250,000株
青森銀行	459,000	270.00	123,930,000	貸付有価証券 67,000株
秋田銀行	411,000	291.00	119,601,000	貸付有価証券 20,000株
山形銀行	355,000	378.00	134,190,000	貸付有価証券 235,000株
岩手銀行	44,100	3,850.00	169,785,000	貸付有価証券 29,900株
東邦銀行	565,000	307.00	173,455,000	貸付有価証券 14,000株
東北銀行	321,000	140.00	44,940,000	貸付有価証券 11,000株
みちのく銀行	314,000	176.00	55,264,000	貸付有価証券 177,000株
ふくおかフィナンシャルグループ	2,734,000	319.00	872,146,000	

静岡銀行	1,851,000	657.00	1,216,107,000	
十六銀行	791,000	251.00	198,541,000	
スルガ銀行	599,800	2,085.00	1,250,583,000	貸付有価証券 423,000株
八十二銀行	1,142,900	419.00	478,875,100	貸付有価証券 341,300株
山梨中央銀行	391,000	348.00	136,068,000	貸付有価証券 89,000株
大垣共立銀行	843,000	269.00	226,767,000	貸付有価証券 39,000株
福井銀行	540,000	214.00	115,560,000	貸付有価証券 40,000株
北國銀行	671,000	266.00	178,486,000	貸付有価証券 70,000株
清水銀行	21,200	2,131.00	45,177,200	貸付有価証券 14,500株
富山銀行	12,200	3,300.00	40,260,000	貸付有価証券 8,200株
滋賀銀行	593,000	427.00	253,211,000	貸付有価証券 8,000株
南都銀行	610,000	311.00	189,710,000	貸付有価証券 20,000株
百五銀行	568,000	332.00	188,576,000	貸付有価証券 46,000株
京都銀行	1,206,000	580.00	699,480,000	
紀陽銀行	248,100	1,218.00	302,185,800	
三重銀行	281,000	171.00	48,051,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	4,299,000	111.00	477,189,000	
広島銀行	1,864,000	315.00	587,160,000	
山陰合同銀行	379,900	615.00	233,638,500	
中国銀行	447,900	973.00	435,806,700	貸付有価証券 130,000株
鳥取銀行	201,000	157.00	31,557,000	
伊予銀行	675,700	570.00	385,149,000	
百十四銀行	693,000	285.00	197,505,000	貸付有価証券 2,000株
四国銀行	489,000	193.00	94,377,000	貸付有価証券 30,000株
阿波銀行	506,000	509.00	257,554,000	貸付有価証券 133,000株
大分銀行	363,000	290.00	105,270,000	貸付有価証券 42,000株
宮崎銀行	421,000	231.00	97,251,000	
佐賀銀行	383,000	214.00	81,962,000	
十八銀行	389,000	228.00	88,692,000	
沖縄銀行	57,860	2,796.00	161,776,560	
琉球銀行	130,100	979.00	127,367,900	貸付有価証券 35,900株

セブン銀行	2,367,500	293.00	693,677,500	貸付有価証券 1,661,200株
みずほフィナンシャルグループ	89,604,500	142.00	12,723,839,000	代用有価証券 1,456,700株
高知銀行	245,000	99.00	24,255,000	貸付有価証券 112,000株
山口フィナンシャルグループ	591,000	907.00	536,037,000	貸付有価証券 401,000株
長野銀行	206,000	192.00	39,552,000	貸付有価証券 143,000株
名古屋銀行	530,000	298.00	157,940,000	貸付有価証券 362,000株
北洋銀行	951,700	257.00	244,586,900	
愛知銀行	21,100	3,985.00	84,083,500	
第三銀行	357,000	150.00	53,550,000	貸付有価証券 16,000株
中京銀行	259,000	226.00	58,534,000	貸付有価証券 19,000株
大光銀行	223,000	172.00	38,356,000	
愛媛銀行	372,000	216.00	80,352,000	貸付有価証券 252,000株
トマト銀行	242,000	133.00	32,186,000	
みなと銀行	577,000	143.00	82,511,000	
京葉銀行	515,000	364.00	187,460,000	貸付有価証券 352,000株
関西アーバン銀行	88,000	863.00	75,944,000	
栃木銀行	327,000	319.00	104,313,000	貸付有価証券 2,000株
北日本銀行	19,600	2,370.00	46,452,000	
東和銀行	1,183,000	77.00	91,091,000	
福島銀行	777,000	86.00	66,822,000	
大東銀行	379,000	171.00	64,809,000	貸付有価証券 266,000株
トモニホールディングス	484,800	305.00	147,864,000	
フィデアホールディングス	515,000	129.00	66,435,000	貸付有価証券 9,000株
池田泉州ホールディングス	670,000	364.00	243,880,000	
F P G	225,300	993.00	223,722,900	貸付有価証券 12,000株
S B Iホールディングス	758,800	952.00	722,377,600	貸付有価証券 164,100株
日本アジア投資	43,000	298.00	12,814,000	貸付有価証券 29,900株
ジャフコ	105,600	2,369.00	250,166,400	貸付有価証券 5,200株
大和証券グループ本社	5,911,000	513.90	3,037,662,900	
野村ホールディングス	12,156,600	352.60	4,286,417,160	
岡三証券グループ	538,000	436.00	234,568,000	貸付有価証券 126,000株

丸三証券	187,600	814.00	152,706,400	貸付有価証券 1,600株
東洋証券	243,000	171.00	41,553,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	725,200	414.00	300,232,800	
光世証券	153,000	102.00	15,606,000	貸付有価証券 91,000株
水戸証券	198,000	207.00	40,986,000	
いちよし証券	141,200	698.00	98,557,600	
松井証券	309,000	829.00	256,161,000	貸付有価証券 4,000株
だいこう証券ビジネス	30,300	542.00	16,422,600	
マネックスグループ	734,200	219.00	160,789,800	貸付有価証券 510,200株
カブドットコム証券	538,700	304.00	163,764,800	貸付有価証券 237,900株
極東証券	84,700	1,041.00	88,172,700	貸付有価証券 51,300株
岩井コスモホールディングス	59,600	800.00	47,680,000	
藍澤證券	118,000	490.00	57,820,000	貸付有価証券 10,700株
マネースクウェアHD	21,700	782.00	16,969,400	
マネーパートナーズグループ	58,800	510.00	29,988,000	貸付有価証券 39,200株
小林洋行	18,300	278.00	5,087,400	
かんぽ生命保険	257,100	1,927.00	495,431,700	貸付有価証券 20,000株
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1,403,500	2,600.00	3,649,100,000	
アニコムホールディングス	42,800	2,683.00	114,832,400	貸付有価証券 12,000株
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	1,888,100	2,429.00	4,586,194,900	
ソニーフィナンシャルホールディングス	605,300	1,050.00	635,565,000	
第一生命保険	4,048,200	1,011.50	4,094,754,300	
東京海上ホールディングス	2,559,800	3,252.00	8,324,469,600	
T & Dホールディングス	2,302,700	813.00	1,872,095,100	
全国保証	164,200	3,845.00	631,349,000	貸付有価証券 33,000株
クレディセゾン	479,200	1,598.00	765,761,600	
アクリーティブ	52,300	328.00	17,154,400	貸付有価証券 4,500株
芙蓉総合リース	72,200	4,025.00	290,605,000	
興銀リース	118,700	1,681.00	199,534,700	貸付有価証券 13,000株
東京センチュリーリース	148,400	3,175.00	471,170,000	
日本証券金融	278,300	363.00	101,022,900	貸付有価証券 196,200株
アイフル	1,058,000	297.00	314,226,000	貸付有価証券 730,500株

ポケットカード	63,100	494.00	31,171,400	貸付有価証券 700株
リコーリース	49,700	2,494.00	123,951,800	貸付有価証券 33,800株
イオンフィナンシャルサービス	414,500	2,140.00	887,030,000	
アコム	1,269,100	467.00	592,669,700	貸付有価証券 186,500株
ジャックス	349,000	472.00	164,728,000	
オリエントコーポレーション	2,731,800	176.00	480,796,800	貸付有価証券 359,700株
日立キャピタル	148,900	1,731.00	257,745,900	
アプラスフィナンシャル	306,200	89.00	27,251,800	貸付有価証券 209,900株
オリックス	4,474,000	1,251.00	5,596,974,000	
三菱UFJリース	1,602,600	351.00	562,512,600	貸付有価証券 14,700株
日本取引所グループ	1,855,200	1,155.00	2,142,756,000	貸付有価証券 200,000株
イー・ギャランティ	20,500	3,050.00	62,525,000	
アサックス	11,200	1,336.00	14,963,200	
NECキャピタルソリューション	25,700	1,377.00	35,388,900	
いちごグループホールディングス	699,400	362.00	253,182,800	貸付有価証券 485,000株
日本駐車場開発	759,800	129.00	98,014,200	貸付有価証券 405,500株
ヒューリック	1,317,300	978.00	1,288,319,400	
三栄建築設計	25,200	1,030.00	25,956,000	
野村不動産ホールディングス	419,100	1,656.00	694,029,600	貸付有価証券 31,100株
三重交通グループホールディングス	112,900	347.00	39,176,300	
サムティ	46,000	938.00	43,148,000	
ディア・ライフ	43,300	312.00	13,509,600	貸付有価証券 30,100株
エー・ディー・ワークス	585,000	36.00	21,060,000	
日本商業開発	27,800	1,393.00	38,725,400	貸付有価証券 19,800株
プレサンスコーポレーション	21,300	3,860.00	82,218,000	
ユニゾホールディングス	39,400	3,495.00	137,703,000	貸付有価証券 26,600株
日本管理センター	41,500	1,258.00	52,207,000	
サンセイランディック	14,400	734.00	10,569,600	貸付有価証券 10,000株
エストラスト	11,000	515.00	5,665,000	
フージャースホールディングス	87,900	521.00	45,795,900	
オープンハウス	91,200	2,540.00	231,648,000	貸付有価証券 12,600株
東急不動産ホールディングス	1,528,500	570.00	871,245,000	

飯田グループホールディングス	585,200	2,019.00	1,181,518,800	貸付有価証券 89,200株
ムゲンエステート	18,000	856.00	15,408,000	
シーアールイー	4,400	2,549.00	11,215,600	
エコナックホールディングス	203,000	38.00	7,714,000	貸付有価証券 49,000株
パーク24	319,100	3,355.00	1,070,580,500	貸付有価証券 156,100株
パラカ	18,000	1,447.00	26,046,000	
三井不動産	3,350,000	2,039.00	6,830,650,000	
三菱地所	4,698,000	1,727.50	8,115,795,000	
平和不動産	119,500	1,199.00	143,280,500	貸付有価証券 700株
東京建物	690,000	1,143.00	788,670,000	
ダイビル	162,600	802.00	130,405,200	貸付有価証券 10,000株
京阪神ビルディング	104,700	494.00	51,721,800	
住友不動産	1,514,000	2,453.50	3,714,599,000	
大京	1,174,000	142.00	166,708,000	
テオーシー	244,900	770.00	188,573,000	貸付有価証券 80,000株
東京楽天地	103,000	471.00	48,513,000	
レオパレス21	744,200	688.00	512,009,600	
スターツコーポレーション	72,500	1,881.00	136,372,500	
フジ住宅	80,500	635.00	51,117,500	貸付有価証券 42,500株
空港施設	76,300	471.00	35,937,300	
明和地所	35,300	540.00	19,062,000	貸付有価証券 800株
住友不動産販売	45,500	1,980.00	90,090,000	
ゴールドクレスト	49,800	1,442.00	71,811,600	貸付有価証券 5,700株
日本エスリード	24,600	987.00	24,280,200	
日神不動産	85,000	330.00	28,050,000	
タカラレーベン	275,500	779.00	214,614,500	
サンヨーハウジング名古屋	32,500	879.00	28,567,500	
イオンモール	407,700	1,212.00	494,132,400	
ファースト住建	23,300	1,161.00	27,051,300	
ランド	296,400	19.00	5,631,600	
トーセイ	96,000	760.00	72,960,000	貸付有価証券 64,000株
穴吹興産	67,000	242.00	16,214,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	392,500	1,014.00	397,995,000	
サンフロンティア不動産	76,600	963.00	73,765,800	貸付有価証券 51,600株
エフ・ジェー・ネクスト	55,100	491.00	27,054,100	



ランドビジネス	37,700	236.00	8,897,200	貸付有価証券 6,100株
グランディハウス	55,700	314.00	17,489,800	
日本空港ビルデング	201,500	3,540.00	713,310,000	貸付有価証券 141,300株
日本工営	223,000	299.00	66,677,000	
ネクスト	188,900	862.00	162,831,800	貸付有価証券 126,600株
ジェイエシーリクルートメント	41,400	1,479.00	61,230,600	貸付有価証券 28,700株
日本M&Aセンター	103,300	6,610.00	682,813,000	貸付有価証券 15,000株
ノバレーゼ	17,200	807.00	13,880,400	貸付有価証券 9,800株
アコーディア・ゴルフ	185,300	1,048.00	194,194,400	
中広	6,200	603.00	3,738,600	
タケエイ	58,800	835.00	49,098,000	貸付有価証券 34,400株
トラスト・テック	26,800	1,317.00	35,295,600	貸付有価証券 5,000株
パソナグループ	58,100	750.00	43,575,000	貸付有価証券 40,600株
CDS	15,300	745.00	11,398,500	貸付有価証券 7,800株
リンクアンドモチベーション	133,900	209.00	27,985,100	貸付有価証券 95,100株
GCAサヴィアン	59,700	796.00	47,521,200	貸付有価証券 10,000株
エス・エム・エス	83,200	2,149.00	178,796,800	貸付有価証券 39,700株
テンプホールディングス	468,800	1,701.00	797,428,800	
リニカル	39,400	1,489.00	58,666,600	貸付有価証券 24,000株
クックパッド	149,000	1,371.00	204,279,000	貸付有価証券 77,600株
エスクリ	28,500	568.00	16,188,000	
アイ・ケイ・ケイ	35,500	538.00	19,099,000	貸付有価証券 24,300株
学情	24,700	1,346.00	33,246,200	貸付有価証券 17,400株
スタジオアリス	30,700	2,392.00	73,434,400	
シミックホールディングス	33,800	1,570.00	53,066,000	貸付有価証券 17,700株
NJS	13,300	1,101.00	14,643,300	
総合警備保障	223,100	4,730.00	1,055,263,000	
カカコム	480,100	2,007.00	963,560,700	貸付有価証券 331,800株
アイロムグループ	19,000	954.00	18,126,000	貸付有価証券 13,300株

ルネサンス	34,100	1,103.00	37,612,300	貸付有価証券 14,200株
ディップ	73,900	2,854.00	210,910,600	
オプトホールディング	41,900	787.00	32,975,300	
新日本科学	63,500	650.00	41,275,000	貸付有価証券 43,100株
ツクイ	79,200	1,677.00	132,818,400	貸付有価証券 6,100株
キャリアデザインセンター	13,800	927.00	12,792,600	
エムスリー	579,000	3,645.00	2,110,455,000	貸付有価証券 105,100株
ツカダ・グローバルホールディング	48,300	700.00	33,810,000	貸付有価証券 34,100株
アウトソーシング	31,200	4,140.00	129,168,000	貸付有価証券 900株
ウェルネット	50,200	2,078.00	104,315,600	
ディー・エヌ・エー	299,800	2,442.00	732,111,600	貸付有価証券 1,300株
博報堂DYホールディングス	926,800	1,136.00	1,052,844,800	
ぐるなび	77,400	2,885.00	223,299,000	貸付有価証券 5,000株
エスアールジータカミヤ	73,000	396.00	28,908,000	貸付有価証券 18,400株
ジャパンベストレスキューシステム	83,600	210.00	17,556,000	貸付有価証券 50,900株
ファンコミュニケーションズ	154,300	836.00	128,994,800	貸付有価証券 108,000株
ジェイコムホールディングス	14,000	2,426.00	33,964,000	貸付有価証券 9,800株
WDBホールディングス	23,700	846.00	20,050,200	
ティア	31,800	621.00	19,747,800	
バリューコマース	61,600	324.00	19,958,400	貸付有価証券 6,700株
インフォーマート	128,900	961.00	123,872,900	貸付有価証券 65,100株
J Pホールディングス	165,700	276.00	45,733,200	貸付有価証券 116,900株
E P Sホールディングス	82,800	1,241.00	102,754,800	
レッグス	12,800	680.00	8,704,000	
プレステージ・インターナショナル	56,500	1,529.00	86,388,500	貸付有価証券 700株
アミューズ	37,000	1,757.00	65,009,000	貸付有価証券 1,400株
ドリームインキュベータ	22,000	1,852.00	40,744,000	貸付有価証券 14,200株
クイック	34,100	788.00	26,870,800	
T A C	37,700	184.00	6,936,800	貸付有価証券 19,600株
ケネディクス	897,700	379.00	340,228,300	貸付有価証券 260,100株

電通	745,200	4,435.00	3,304,962,000	貸付有価証券 48,700株
テイクアンドギヴ・ニーズ	30,900	388.00	11,989,200	貸付有価証券 21,700株
ぴあ	20,100	2,112.00	42,451,200	貸付有価証券 13,100株
イオンファンタジー	23,500	2,669.00	62,721,500	貸付有価証券 16,500株
シーティーエス	19,700	758.00	14,932,600	
ネクシィーズグループ	23,900	1,239.00	29,612,100	貸付有価証券 16,500株
みらかホールディングス	170,700	4,470.00	763,029,000	
アルプス技研	24,500	1,908.00	46,746,000	
サニックス	107,200	144.00	15,436,800	貸付有価証券 70,400株
ダイオーズ	12,200	940.00	11,468,000	貸付有価証券 5,300株
日本空調サービス	58,800	516.00	30,340,800	
オリエンタルランド	722,900	6,359.00	4,596,921,100	
ダスキン	171,400	1,692.00	290,008,800	貸付有価証券 1,500株
明光ネットワークジャパン	82,900	1,261.00	104,536,900	
ファルコホールディングス	29,200	1,317.00	38,456,400	
秀英予備校	12,300	367.00	4,514,100	
田谷	11,000	672.00	7,392,000	貸付有価証券 4,600株
ラウンドワン	208,700	831.00	173,429,700	貸付有価証券 90,000株
リゾートトラスト	280,400	2,095.00	587,438,000	
ビー・エム・エル	39,400	4,785.00	188,529,000	
ワタベウェディング	19,700	411.00	8,096,700	
りらいあコミュニケーションズ	110,500	1,012.00	111,826,000	貸付有価証券 36,000株
リソー教育	124,300	407.00	50,590,100	貸付有価証券 10,200株
早稲田アカデミー	8,300	851.00	7,063,300	
ユー・エス・エス	809,400	1,589.00	1,286,136,600	
東京個別指導学院	32,500	633.00	20,572,500	貸付有価証券 10,000株
サイバーエージェント	175,900	6,200.00	1,090,580,000	貸付有価証券 56,500株
楽天	3,130,300	1,050.00	3,286,815,000	
テー・オー・ダブリュー	53,800	575.00	30,935,000	貸付有価証券 25,100株
セントラルスポーツ	22,700	2,305.00	52,323,500	
フルキャストホールディングス	61,700	821.00	50,655,700	貸付有価証券 17,500株
リゾートソリューション	66,000	292.00	19,272,000	

テクノプロ・ホールディングス	108,300	3,315.00	359,014,500	貸付有価証券 3,100株
インターワークス	11,500	1,196.00	13,754,000	貸付有価証券 7,900株
K e e P e r 技研	7,200	1,501.00	10,807,200	貸付有価証券 3,500株
ファーストロジック	3,500	1,746.00	6,111,000	貸付有価証券 400株
リブセンス	44,700	407.00	18,192,900	貸付有価証券 31,200株
ジャパンマテリアル	27,900	3,900.00	108,810,000	貸付有価証券 19,900株
ベクトル	20,600	2,996.00	61,717,600	貸付有価証券 9,900株
ウチヤマホールディングス	34,100	422.00	14,390,200	
サクセスホールディングス	6,200	1,167.00	7,235,400	貸付有価証券 3,500株
キャリアリンク	17,000	927.00	15,759,000	
I B J	52,600	602.00	31,665,200	
アサンテ	24,500	1,464.00	35,868,000	貸付有価証券 5,800株
N・フィールド	31,500	1,812.00	57,078,000	貸付有価証券 22,200株
M & Aキャピタルパートナーズ	8,300	2,292.00	19,023,600	貸付有価証券 5,800株
ライドオン・エクスプレス	14,300	1,412.00	20,191,600	貸付有価証券 9,700株
E R Iホールディングス	16,700	751.00	12,541,700	貸付有価証券 7,100株
アビスト	10,300	2,029.00	20,898,700	
ウィルグループ	15,300	921.00	14,091,300	
日本ビューホテル	9,700	1,249.00	12,115,300	貸付有価証券 4,800株
リクルートホールディングス	1,348,400	3,760.00	5,069,984,000	
エラン	7,000	1,329.00	9,303,000	貸付有価証券 4,900株
日本郵政	1,966,200	1,188.00	2,335,845,600	
ベルシステム24ホールディングス	130,800	767.00	100,323,600	貸付有価証券 91,600株
リログループ	25,100	16,780.00	421,178,000	貸付有価証券 2,500株
東祥	19,900	4,620.00	91,938,000	貸付有価証券 5,000株
エイチ・アイ・エス	109,000	3,085.00	336,265,000	貸付有価証券 76,800株
ラックランド	9,600	1,526.00	14,649,600	貸付有価証券 6,600株
共立メンテナンス	50,300	6,310.00	317,393,000	貸付有価証券 36,300株
イチネンホールディングス	70,000	907.00	63,490,000	貸付有価証券 3,300株

建設技術研究所	39,300	777.00	30,536,100	
スペース	36,000	1,119.00	40,284,000	
燦ホールディングス	13,500	1,331.00	17,968,500	
スバル興業	47,000	382.00	17,954,000	
東京テアトル	253,000	113.00	28,589,000	
ナガワ	12,200	3,510.00	42,822,000	
よみうりランド	134,000	431.00	57,754,000	
東京都競馬	457,000	201.00	91,857,000	貸付有価証券 25,000株
常磐興産	245,000	148.00	36,260,000	
カナモト	93,300	1,841.00	171,765,300	
東京ドーム	533,000	453.00	241,449,000	
西尾レントオール	53,900	2,023.00	109,039,700	貸付有価証券 4,000株
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	335,000	34.00	11,390,000	貸付有価証券 24,000株
トランス・コスモス	77,600	2,877.00	223,255,200	貸付有価証券 21,600株
乃村工藝社	143,000	1,604.00	229,372,000	貸付有価証券 12,400株
藤田観光	243,000	342.00	83,106,000	貸付有価証券 164,000株
KNT-CTホールディングス	324,000	131.00	42,444,000	貸付有価証券 73,000株
日本管財	57,300	1,647.00	94,373,100	
トーカイ	29,600	3,005.00	88,948,000	貸付有価証券 1,500株
白洋舎	6,800	2,394.00	16,279,200	
セコム	695,600	7,443.00	5,177,350,800	
セントラル警備保障	29,500	1,945.00	57,377,500	貸付有価証券 1,900株
丹青社	125,200	712.00	89,142,400	貸付有価証券 60,000株
メイテック	80,900	3,535.00	285,981,500	貸付有価証券 2,800株
アサツー ディ・ケイ	117,300	2,219.00	260,288,700	貸付有価証券 15,800株
応用地質	63,100	1,006.00	63,478,600	貸付有価証券 44,500株
船井総研ホールディングス	93,000	1,299.00	120,807,000	
進学会	32,100	494.00	15,857,400	
オオバ	49,000	390.00	19,110,000	
学究社	9,800	1,140.00	11,172,000	
ベネッセホールディングス	224,000	2,376.00	532,224,000	貸付有価証券 157,300株
イオンディライト	64,600	2,828.00	182,688,800	
ナック	41,200	792.00	32,630,400	貸付有価証券 15,900株

ニチイ学館	116,200	658.00	76,459,600	貸付有価証券 79,200株
ダイセキ	125,500	1,787.00	224,268,500	貸付有価証券 22,700株
ステップ	22,300	1,060.00	23,638,000	
合 計	1,059,248,360		1,146,640,991,470	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2016年 7月29日現在です。

### 【上場インデックスファンドTOPIX】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	1,410,213,942,163円
負債総額	142,382,180,671円
純資産総額（ - ）	1,267,831,761,492円
発行済口数	952,691,359口
1口当たり純資産額（ / ）	1,330.79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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

### （4）受益証券の再発行

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

### （5）受益権の再分割

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

### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、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28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28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28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28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	631	113,737

株式投資信託	581	91,617
単位型	131	4,941
追加型	450	86,676
公社債投資信託	50	22,119
単位型	36	450
追加型	14	21,669

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

#### (1)【貸借対照表】

	第56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28年3月31日)	
(単位:百万円)				
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	14,206	3	14,308
金銭の信託		-	3	153
有価証券		277		86
前払費用	3	509	3	489
未収入金		3		10
未収委託者報酬		8,441		9,374
未収収益	3	1,566	3	2,280
関係会社短期貸付金		436		5,333
立替金		666		2,960
繰延税金資産		1,446		819
その他	2	195	2,3	428
流動資産合計		27,750		36,243
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	56	1	146
器具備品	1	166	1	210
有形固定資産合計		222		356
無形固定資産				
ソフトウェア		113		140
無形固定資産合計		113		140
投資その他の資産				
投資有価証券		14,184		12,195
関係会社株式		21,702		21,702
関係会社長期貸付金		60		60

長期差入保証金	740	781
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	248	425
投資その他の資産合計	36,936	35,165
固定資産合計	37,273	35,662
資産合計	65,023	71,905

(単位：百万円)

	第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	387	410
未払金	5,545	3,841
未払収益分配金	6	6
未払償還金	112	112
未払手数料	3 3,145	3 3,269
その他未払金	2,282	453
未払費用	3 4,636	3 4,920
未払法人税等	814	354
未払消費税等	4 1,070	4 649
関係会社短期借入金	-	5,631
賞与引当金	1,990	2,080
役員賞与引当金	120	145
その他	3 82	3 278
流動負債合計	14,646	18,312
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	1,111	1,154
固定負債合計	1,111	1,154
負債合計	15,758	19,466
<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	25,836	29,948
利益剰余金合計	25,836	29,948
自己株式	68	502
株主資本合計	48,351	52,028
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	1,002	151
繰延ヘッジ損益	88	258
評価・換算差額等合計	913	410
純資産合計	49,265	52,438

負債純資産合計	65,023	71,905
---------	--------	--------

## (2)【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,990	66,339
その他営業収益	3,729	4,382
営業収益合計	67,719	70,722
営業費用		
支払手数料	30,408	30,529
広告宣伝費	1,045	1,098
公告費	5	3
調査費	15,571	17,470
調査費	747	821
委託調査費	14,782	16,600
図書費	41	48
委託計算費	502	505
営業雑経費	660	718
通信費	199	195
印刷費	263	321
協会費	64	65
諸会費	27	22
その他	106	113
営業費用計	48,193	50,327
一般管理費		
給料	7,585	8,138
役員報酬	289	365
役員賞与引当金繰入額	120	145
給料・手当	5,127	5,495
賞与	59	51
賞与引当金繰入額	1,990	2,080
交際費	163	185
寄付金	36	27
旅費交通費	503	503
租税公課	208	258
不動産賃借料	785	875
退職給付費用	349	372
退職金	16	113
固定資産減価償却費	148	196
福利費	908	952
諸経費	2,673	2,952
一般管理費計	13,380	14,577
営業利益	6,146	5,817

	(単位：百万円)	
	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本					株主資本	
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			自己株式
		資本剰余	その他利益剰余金	利益剰余			

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

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

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余 金合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余 金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351
会計方針の変更による 累積的影響額							-
会計方針の変更を反映した 当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351
当期変動額							
剰余金の配当				850	850		850
当期純利益				4,962	4,962		4,962

自己株式の取得						434	434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,111	4,111	434	3,676
当期末残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有 価証券評 価差額金	繰延ヘッ ジ損益	評価・換 算差額等 合計	
当期首残高	1,002	88	913	49,265
会計方針の変更による 累積的影響額				-
会計方針の変更を反映した 当期首残高	1,002	88	913	49,265
当期変動額				
剰余金の配当				850
当期純利益				4,962
自己株式の取得				434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	851	347	503	503
当期変動額合計	851	347	503	3,173
当期末残高	151	258	410	52,438

## [注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1 資産の評価基準及び 評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産 直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法 (2) 金銭の信託 時価法 (3) デリバティブ 時価法
2 固定資産の減価償却 の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 5年～20年

<p>3 引当金の計上基準</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> <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翌事業年度から費用処理しております。</p>
<p>4 ヘッジ会計の方法</p>	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
<p>5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(会計方針の変更)

<p style="text-align: center;">第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)</p> <p>(企業結合に関する会計基準等の適用) 「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。)及び「事業分離等に関する会計基準」(企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。)等を当事業年度から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更いたしました。また、当事業年度の期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する事業年度の財務諸表に反映させる方法に変更いたします。</p> <p>企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58 - 2項(4)及び事業分離等会計基準第57 - 4項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首時点から将来にわたって適用しております。</p> <p>なお、当事業年度において、財務諸表及び1株当たり情報に与える影響額はありません。</p>
---

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要



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

(分類1)から(分類5)に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

(分類2)及び(分類3)に係る分類の要件

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

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

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

(2) 適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

(貸借対照表関係)

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
<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>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,170百万円</p> <p>器具備品 653百万円</p> <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 4,072百万円</p> <p>金銭の信託 153百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 147百万円</p> <p>その他 193百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 93百万円</p> <p>未払費用 722百万円</p> <p>その他 266百万円</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728百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務689百万円に対して保証を行っております。</p>

## （損益計算書関係）

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">受取配当金 719百万円</p> <p>2 外国税関連費用1,650百万円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成21年11月17日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算したものであります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株マザーファンド」及び「中国A株CSI300インデックスマザーファンド」の2ファンドであり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社が負担しております。</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">受取配当金 1,193百万円 支払利息 123百万円 デリバティブ費用 889百万円</p>

## （株主資本等変動計算書関係）

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	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

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

##### 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

##### 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	109,600	704,500	-	814,100

##### 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業 年度末 残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業 年度 増加	当事業 年度 減少	当事業 年度末	
平成21年度 ストックオプション (1)	普通株式	15,902,700	-	14,140,500	1,762,200	-
平成21年度 ストックオプション (2)	普通株式	1,567,500	-	1,392,600	174,900	-
平成22年度 ストックオプション (1)	普通株式	2,310,000	-	2,310,000	-	-
平成23年度 ストックオプション (1)	普通株式	5,029,200	-	290,400	4,738,800	-
合計		24,809,400	-	18,133,500	6,675,900	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

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

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当の 原資	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年5月30日 取締役会	普通 株式	利益 剰余金	1,495	7.62	平成28年3月31日	平成28年6月22日

## (リース取引関係)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	841百万円	1年内	865百万円
1年超	3,420百万円	1年超	2,653百万円
合計	4,261百万円	合計	3,518百万円

## (金融商品関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

## 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

( 1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

## (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

## (4) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

## (5) 未払金及び(6) 未払費用

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

## (7) デリバティブ取引

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

- 2 非上場株式等（貸借対照表計上額30百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式（貸借対照表計上額18,809百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。
- 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

#### 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

#### 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

平成28年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額( 1)	時価( 1)	差額
(1) 現金・預金	14,308	14,308	-
(2) 未収委託者報酬	9,374	9,374	-
(3) 未収収益	2,280	2,280	-
(4) 関係会社短期貸付金	5,333	5,333	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	12,265	12,265	-
(6) 未払金	(3,841)	(3,841)	-
(7) 未払費用	(4,920)	(4,920)	-
(8) 関係会社短期借入金	(5,631)	(5,631)	-
(9) デリバティブ取引( 2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(254)	(254)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	170	170	-
デリバティブ取引計	(84)	(84)	-

( 1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

## (6) 未払金、(7) 未払費用並びに(8) 関係会社短期借入金

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

## (9) デリバティブ取引

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 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	14,308			
未収委託者報酬	9,374			
未収収益	2,280			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	86	714	1,766	963
合計	26,049	714	1,766	963

## (有価証券関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

（単位：百万円）

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



合計	14,431	12,949	1,482
----	--------	--------	-------

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

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

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

#### 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

#### 2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	5,593	4,872	720
	小計	5,593	4,872	720
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	6,672	7,175	502
	小計	6,672	7,175	502
合計		12,265	12,047	218

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

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

#### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	30	17	-

投資信託	5,442	703	100
合計	5,473	720	100

## (デリバティブ取引関係)

第56期(平成27年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ会計 の方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資有価証券	2,586	-	68
	豪ドル		276	-	8
	シンガポールドル		878	-	4
	ユーロ		219	-	1
合計			3,961	-	57

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第57期(平成28年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## (2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	5,631	-	243	243
	合計	5,631	-	243	243

(注) 1 時価の算定方法  
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ会計 の方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建 米ドル 豪ドル シンガポールドル 香港ドル 人民元 ユーロ	投資有価証券	3,943	-	179
			767	-	18
			75	-	4
			151	-	5
			1,948	-	8
			173	-	0
			合計	7,060	-

(注) 1 時価の算定方法  
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)		関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,078	(1) 関連会社に対する投資の金額	3,037
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,396	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,686
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,720	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	2,901

## (退職給付関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

### (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

### (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.6%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、196百万円でありました。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

### 1 採用している退職給付制度の概要

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

### 2 確定給付制度

#### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,233
会計方針の変更による累積的影響額	-
会計方針の変更を反映した期首残高	1,233
勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	33
退職給付の支払額	119

退職給付債務の期末残高	1,299
-------------	-------

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

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

退職給付引当金	1,154
貸借対照表に計上された負債の額	1,154

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、209百万円でありました。

## (ストックオプション等関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

### ストックオプション(新株予約権)の数

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

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,388,900
付与	0	0

失効	0	359,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,029,200
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

### 単価情報

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

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

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

2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

### (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

### ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	15,902,700	1,567,500
付与	0	0
失効	14,140,500	1,392,600
権利確定	0	0



権利未確定残	1,762,200	174,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,029,200
付与	0	0
失効	2,310,000	290,400
権利確定	0	0
権利未確定残	0	4,738,800
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円

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

#### (税効果会計関係)

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
----------------------	----------------------

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)
繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)	
賞与引当金	658	賞与引当金	642
その他	813	その他	177
小計	1,472	小計	819
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
投資有価証券評価損	134	投資有価証券評価損	96
関係会社株式評価損	1,510	関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	360	退職給付引当金	353
固定資産減価償却費	133	固定資産減価償却費	122
その他	73	その他	65
小計	2,213	小計	2,068
繰延税金資産小計	3,685	繰延税金資産小計	2,888
評価性引当金	1,510	評価性引当金	1,430
繰延税金資産合計	2,174	繰延税金資産合計	1,457
繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(固定)	
その他有価証券評価差額金	25	その他有価証券評価差額金	71
小計	25	繰延ヘッジ利益	114
繰延税金負債(固定)		その他	26
その他有価証券評価差額金	454	小計	213
小計	454	繰延税金負債合計	213
繰延税金負債合計	480	繰延税金資産の純額	1,244
繰延税金資産の純額	1,694		
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	35.6%	法定実効税率	33.1%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.3%	交際費等永久に損金に算入されない項目	1.4%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.3%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.8%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.6%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.3%
海外子会社の留保利益の影響額等	1.7%	所得拡大促進税制	2.2%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.9%	海外子会社の留保利益の影響額等	0.6%
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%

第56期  
(平成27年3月31日)

第57期  
(平成28年3月31日)

<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第9号)の施行に伴い平成26年4月1日に開始する事業年度から、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.1%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.3%となります。この結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は135百万円、繰延ヘッジ損益が4百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が48百万円、法人税等調整額が179百万円、それぞれ増加しております。</p>	<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律第13号)が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日に開始する事業年度から、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.9%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.6%となります。この税率変更により、繰延税金資産の純額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が59百万円減少し、その他有価証券評価差額金が3百万円、繰延ヘッジ損益が6百万円、法人税等調整額が69百万円、それぞれ増加しております。</p>
--	---

## ( 関連当事者情報 )

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千SGD)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貨建)(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SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額184百万円(2,059千SGD)の内訳は、貸付424百万円(5,000千SGD)及び返済240百万円(2,940千SGD)であります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000(千SGD)	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貨建)(注1)	90(千SGD1,000)(注2)	関係会社短期貸付金	333(千SGD4,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	18(千SGD215)	未収収益	6(千SGD74)
							資金の貸付(円貨建)(注3)	5,000	関係会社短期貸付金	5,000
							貸付金利息(円貨建)(注3)	70	未収収益	70
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542(千USD)(注4)	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の借入	資金の借入(米ドル貨建)(注5)	6,176(千USD50,000)	関係会社短期借入金	5,631(千USD50,000)
							借入金利息(米ドル貨建)(注5)	113(千USD949)	未払費用	106(千USD949)

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成27年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

## 関連情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

#### 1 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2 地域ごとの情報

##### (1) 営業収益

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

##### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

### (1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(百万円)	3,101	4,962
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	3,101	4,962
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903	196,464
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、平成23年度ストックオプション(1)5,029,200株	平成21年度ストックオプション(1)1,762,200株、平成21年度ストックオプション(2)174,900株、平成23年度ストックオプション(1)4,738,800株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	49,265	52,438
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	49,265	52,438
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	196,903	196,198

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 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つ

て、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成28年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28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28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・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・ジェネラル証券株式会社	30,765百万円 (平成28年5月1日現在)	
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	
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MUF G証券株式会社	62,100百万円
UBS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27年10月 8日	有価証券届出書
平成27年10月 8日	有価証券報告書
平成27年12月28日	有価証券届出書の訂正届出書
平成28年 4月 8日	有価証券届出書の訂正届出書
平成28年 4月 8日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年8月3日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている上場インデックスファンドTOPIXの平成27年7月9日から平成28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28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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。