

**【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29年10月6日提出
【計算期間】	第16期(自 平成28年7月9日至 平成29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】	新屋敷 昇
【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	アジア	
その他債券 クレジット属性 ( )	(毎月)	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 中近東 (中東)	その他 ( )
資産複合 ( )		エマージング	
資産配分固定型 資産配分変更型			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

株式 一般

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

年1回

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

日本

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

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

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

- ・ 売買単位は100口単位です。(有価証券届出書提出日現在)
  - ・ 売買手数料は、取扱会社が定めるものによります。
  - ・ 取引方法は原則として株式と同様です。
- ※詳しくは、取扱会社へお問い合わせください。

## 2. 株式をもって受益権の取得申込みを行いません。

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

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

## 3. 解約請求による途中換金をすることはできません。

## 4. 受益権をもって株式と交換することができます。

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

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

### 主な投資制限

- ・ 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ・ 投資することを指図する株式は、原則としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- ・ 外貨建資産への投資は行ないません。

### 分配方針

- ・ 信託財産から生ずる配当等収益などから諸経費などを控除後、全額分配することを原則とします。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

### 信託金限度額

- ・ 30兆円相当額を限度として有価証券または金銭を追加信託することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

### (2)【ファンドの沿革】

平成13年12月20日

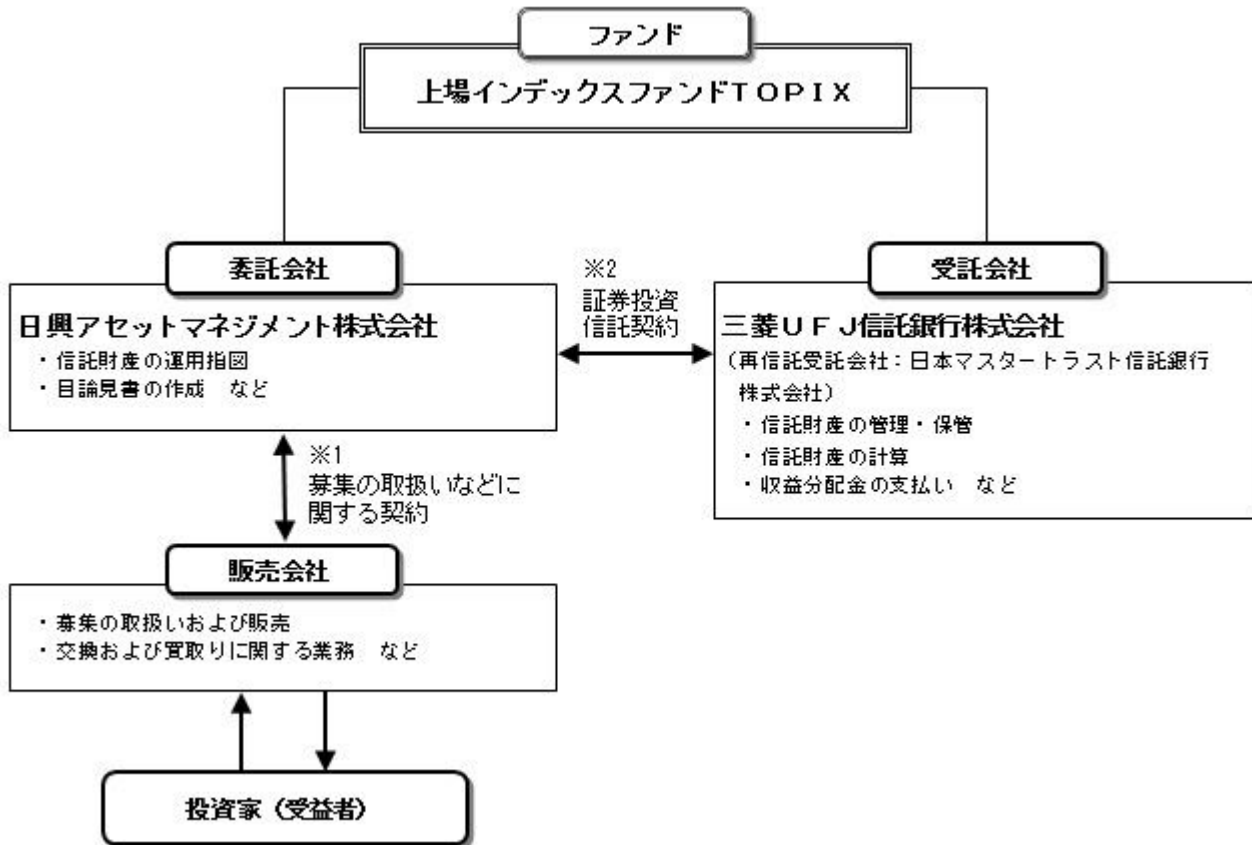
- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

平成14年1月9日

- ・ ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場

### (3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。販売会社が行なう募集の取扱い、交換および買取りに関する業務の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（平成29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

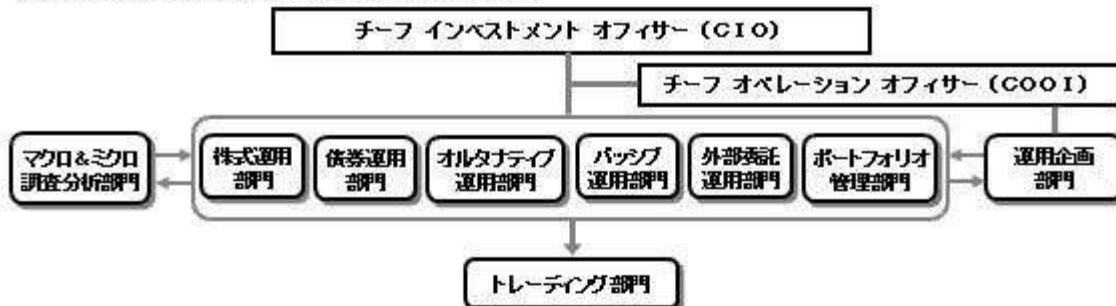
次の取引ができます。

### 1) 先物取引等

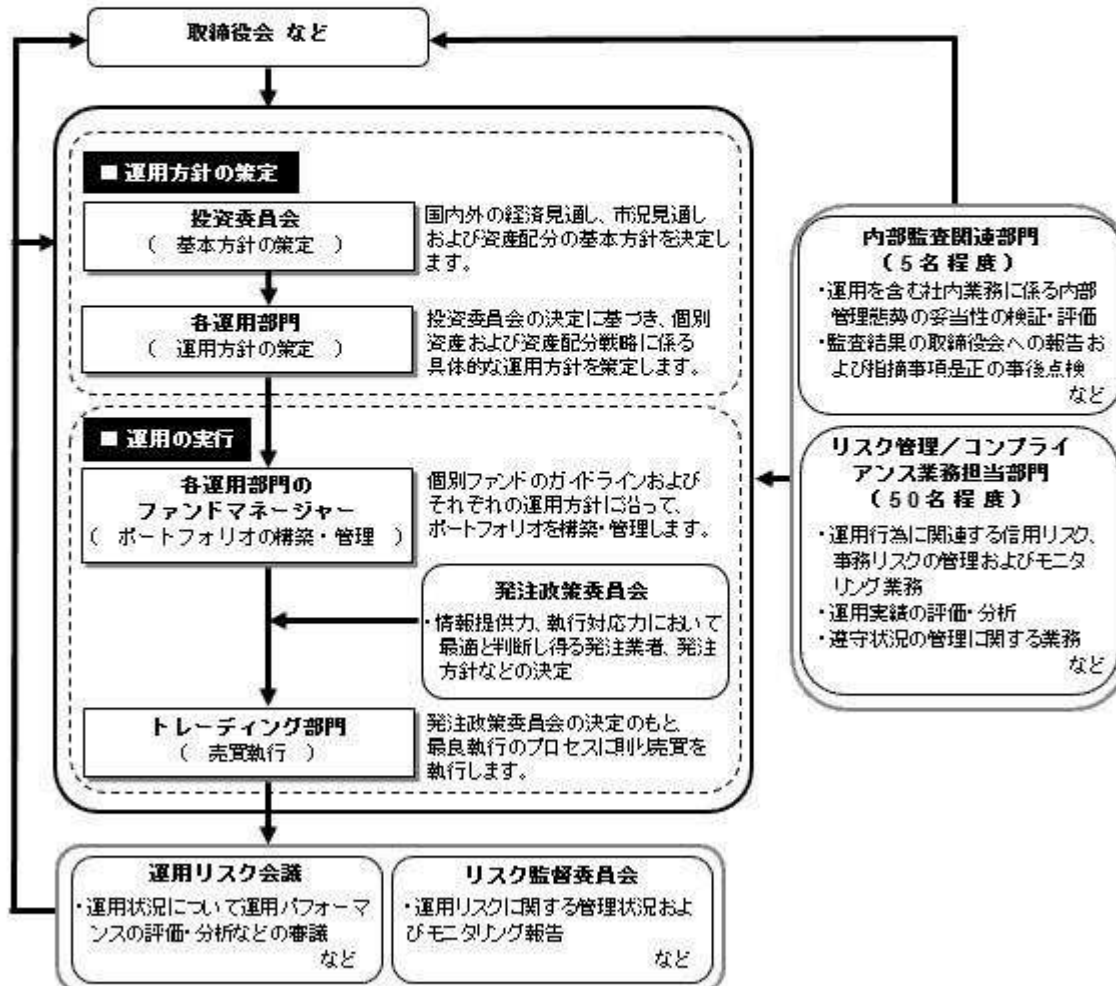
2) 有価証券の貸付

## (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29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・交換の取扱いを停止する場合があります。

##### ・ 運用制限や規制上の制限に関する事項

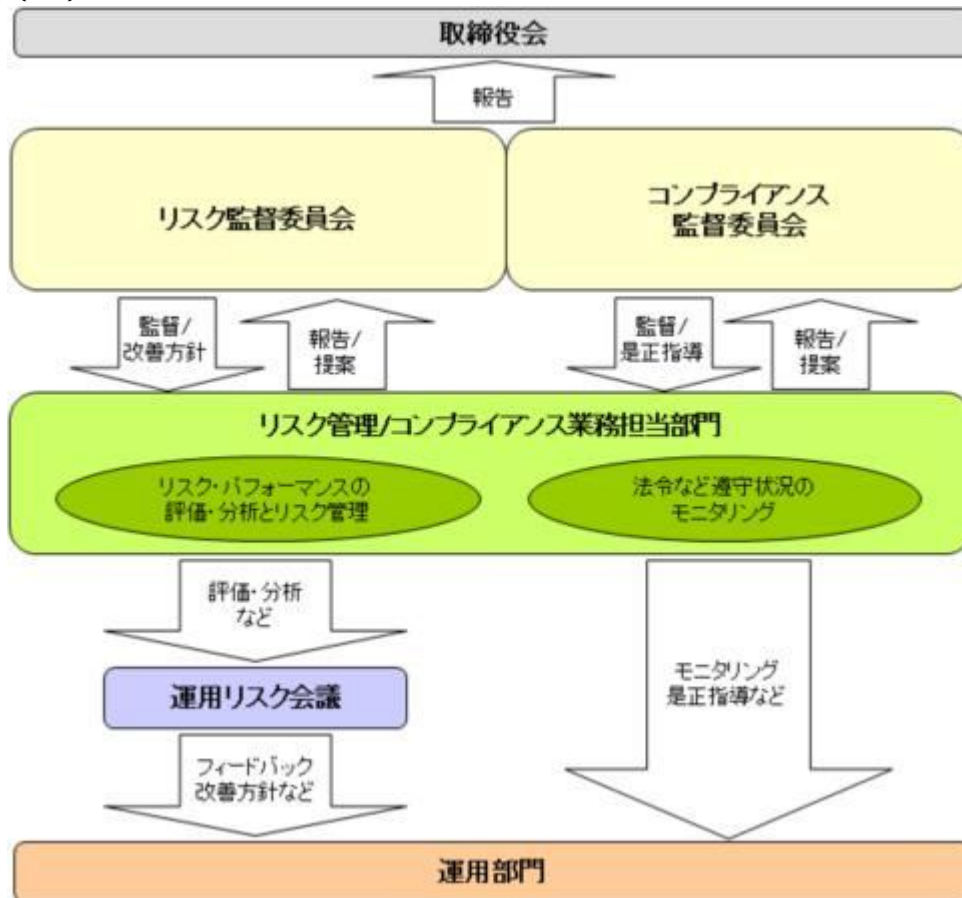
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連し

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

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

## (2) リスク管理体制



### 全社リスク管理

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

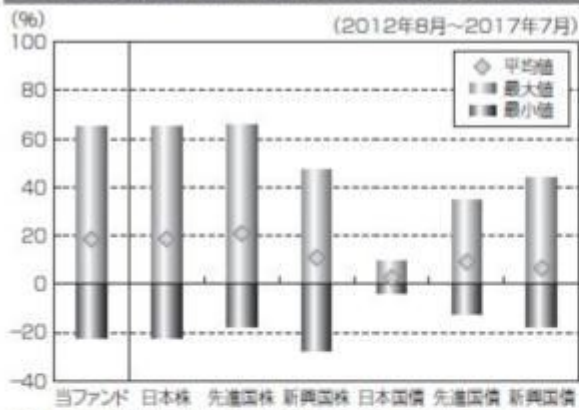
### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成29年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	18.4%	18.6%	20.8%	10.8%	2.6%	9.1%	6.5%
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%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2012年8月から2017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して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グローバルレディバースフィード(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、2012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して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29年10月6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2017年7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	2,412,819,794,610	99.78
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		5,387,630,485	0.22
合計(純資産総額)		2,418,207,425,095	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	5,392,935,000	0.22

(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	12,466,700	6,157.15	76,759,428,163	6,234.00	77,717,407,800	3.21
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	76,689,700	753.19	57,762,140,226	700.00	53,682,790,000	2.22
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	8,124,200	5,295.33	43,020,347,850	5,390.00	43,789,438,000	1.81
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	4,555,600	8,939.86	40,726,447,400	8,958.00	40,809,064,800	1.69
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	8,103,900	4,369.17	35,407,366,573	4,195.00	33,995,860,500	1.41
日本	株式	ソニー	電気機器	7,245,200	4,250.38	30,794,888,400	4,540.00	32,893,208,000	1.36
日本	株式	KDDI	情報・通信業	9,884,800	2,987.76	29,533,494,731	2,920.00	28,863,616,000	1.19
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	9,227,700	3,087.01	28,486,089,416	3,108.00	28,679,691,600	1.19
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	137,423,000	205.73	28,272,648,335	196.40	26,989,877,200	1.12

日本	株式	日本たばこ産業	食料品	6,367,700	3,861.14	24,586,629,599	3,834.00	24,413,761,800	1.01
日本	株式	キーエンス	電気機器	464,600	49,107.35	22,815,277,302	51,020.00	23,703,892,000	0.98
日本	株式	任天堂	その他製品	631,500	35,192.60	22,224,131,180	37,480.00	23,668,620,000	0.98
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	4,028,300	5,638.77	22,714,697,072	5,832.00	23,493,045,600	0.97
日本	株式	ファナック	電気機器	1,039,500	21,740.89	22,599,656,368	22,565.00	23,456,317,500	0.97
日本	株式	キヤノン	電気機器	5,520,400	3,655.35	20,179,037,635	3,837.00	21,181,774,800	0.88
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	1,983,700	10,648.49	21,123,428,931	10,350.00	20,531,295,000	0.85
日本	株式	信越化学工業	化学	1,926,100	9,950.52	19,165,702,428	10,110.00	19,472,871,000	0.81
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	7,449,400	2,649.11	19,734,343,625	2,563.00	19,092,812,200	0.79
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	4,075,800	4,751.42	19,365,869,665	4,645.00	18,932,091,000	0.78
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	4,235,700	4,557.86	19,305,747,252	4,445.00	18,827,686,500	0.78
日本	株式	三菱電機	電気機器	10,938,200	1,659.74	18,154,641,273	1,710.50	18,709,791,100	0.77
日本	株式	日立製作所	電気機器	24,622,000	698.95	17,209,756,850	759.60	18,702,871,200	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,075,800	16,697.71	17,963,401,780	17,180.00	18,482,244,000	0.76
日本	株式	三菱商事	卸売業	7,593,900	2,396.02	18,195,177,950	2,396.50	18,198,781,350	0.75
日本	株式	パナソニック	電気機器	11,776,200	1,465.37	17,256,492,193	1,521.00	17,911,600,200	0.74
日本	株式	花王	化学	2,521,600	6,656.62	16,785,332,992	6,714.00	16,930,022,400	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	3,624,300	4,794.73	17,377,553,811	4,657.00	16,878,365,100	0.70
日本	株式	ダイキン工業	機械	1,399,900	11,727.16	16,416,852,980	11,700.00	16,378,830,000	0.68
日本	株式	日本電産	電気機器	1,328,900	11,514.61	15,301,767,577	12,160.00	16,159,424,000	0.67
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	852,600	17,882.91	15,246,970,720	17,750.00	15,133,650,000	0.63

#### 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	0.31
		建設業	3.21
		食料品	4.54
		繊維製品	0.70
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.05
		医薬品	4.52
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.96
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.29
		非鉄金属	0.98
		金属製品	0.70
		機械	5.23
		電気機器	13.38
		輸送用機器	8.67
精密機器	1.62		
その他製品	2.12		



	電気・ガス業	1.79
	陸運業	4.08
	海運業	0.22
	空運業	0.57
	倉庫・運輸関連業	0.20
	情報・通信業	7.98
	卸売業	4.43
	小売業	4.60
	銀行業	7.72
	証券、商品先物取引業	1.09
	保険業	2.47
	その他金融業	1.28
	不動産業	2.39
	サービス業	3.84
合 計		99.78

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2017年09月	買建	333	日本円	5,355,518,500	5,392,935,000	0.22

(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

第16計算期間末 (2017年 7月 8日)	2,366,170	2,403,721	1,624.47	1,650.25	1,624
2016年 7月末日	1,267,831		1,330.79		1,330
8月末日	1,304,057		1,337.90		1,338
9月末日	1,424,673		1,341.98		1,341
10月末日	1,457,056		1,413.10		1,414
11月末日	1,592,964		1,490.85		1,489
12月末日	1,717,577		1,542.52		1,541
2017年 1月末日	1,822,987		1,545.69		1,545
2月末日	1,980,369		1,560.16		1,560
3月末日	2,109,416		1,550.71		1,552
4月末日	2,166,291		1,570.63		1,571
5月末日	2,328,246		1,608.92		1,608
6月末日	2,411,022		1,655.27		1,653
7月末日	2,418,207		1,636.14		1,635

(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
第16期	2016年 7月 9日～2017年 7月 8日	25.7800

### 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
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
第16期	2016年 7月 9日～2017年 7月 8日	35.57

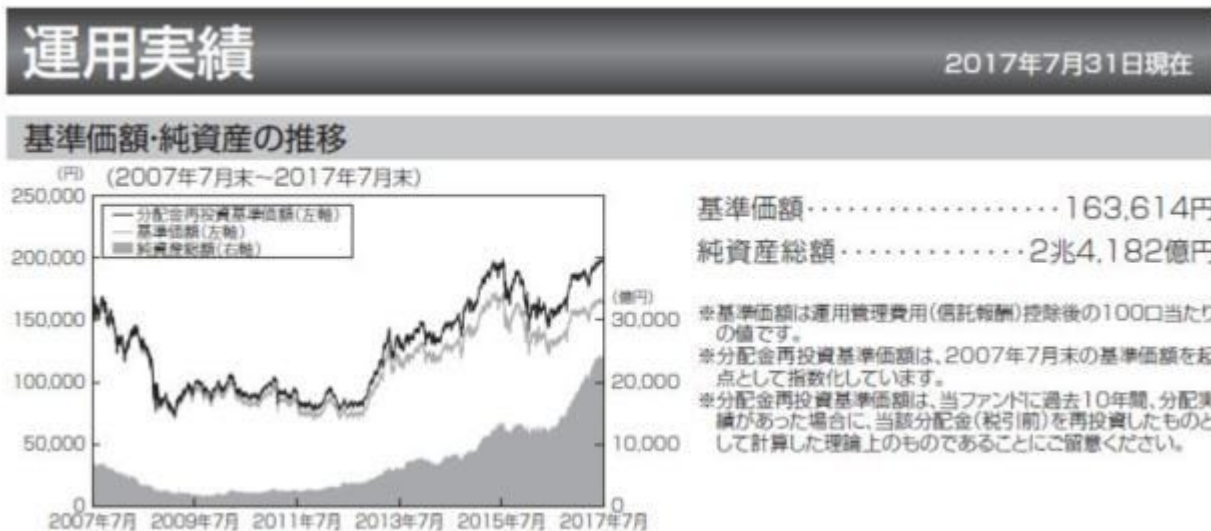
(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち、以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

#### （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
第16期	2016年 7月 9日～2017年 7月 8日	757,397,200	245,213,668

(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)

2013年7月	2014年7月	2015年7月	2016年7月	2017年7月	設定来累計
1,858円	2,076円	2,189円	2,566円	2,578円	29,029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	0.22%
現金その他	0.22%

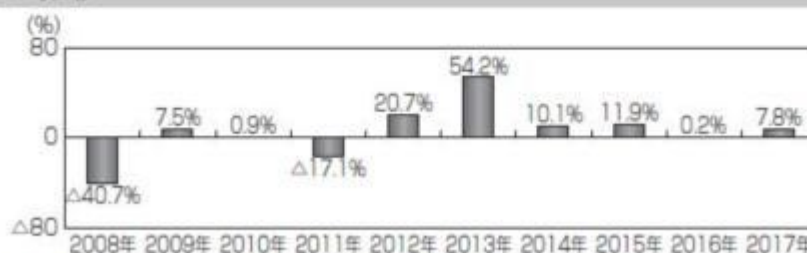
※対純資産総額比です。

### <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	3.21%
2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.22%
3 日本電信電話	情報・通信業	1.81%
4 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.69%
5 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.41%
6 ソニー	電気機器	1.36%
7 KDDI	情報・通信業	1.19%
8 本田技研工業	輸送用機器	1.19%
9 みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.12%
10 日本たばこ産業	食料品	1.01%

※対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



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

※2017年は、2017年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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

## ２【換金（解約）手続等】

### （１）受益権の解約

受益者は、信託期間中において解約の請求をすることはできません。

### （２）受益権と信託財産に属する株式との交換

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

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

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

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

交換請求日が次に該当することとなる場合には、交換請求の受付は行ないません。

- １）ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）構成銘柄の権利落日（配当落日を除きます。）の前営業日以降の４営業日間
- ２）ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）構成銘柄の変更および増減資などに伴う株数の変更日の３営業日前以降の６営業日間
- ３）ファンドの計算期間終了日（決算日）の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ます。受益権の買取価額は、買取約定日の基準価額とします。

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ます。

委託会社が指定する販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて買取りを中止すること、および既に受け付けた買取りを取り消すことができます。

買取請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとして取り扱います。

## 3【資産管理等の概要】

### (1)【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額(純資産総額)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは100口あたりに換算した価額で表示することがあります。

## &lt;基準価額算出の流れ&gt;



## 有価証券などの評価基準

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

## &lt;主な資産の評価方法&gt;

## 国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

## 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

## &lt;委託会社の照会先&gt;

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

無期限とします（平成13年12月20日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

## (4) 【計算期間】

毎年7月9日から翌年7月8日までとします。

## (5) 【その他】

## 信託の終了（繰上償還）

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

八) TOPIX（東証株価指数）が廃止された場合

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

ホ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合

へ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ト) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）

チ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

#### 信託約款の変更

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

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

3) この信託約款の変更に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。

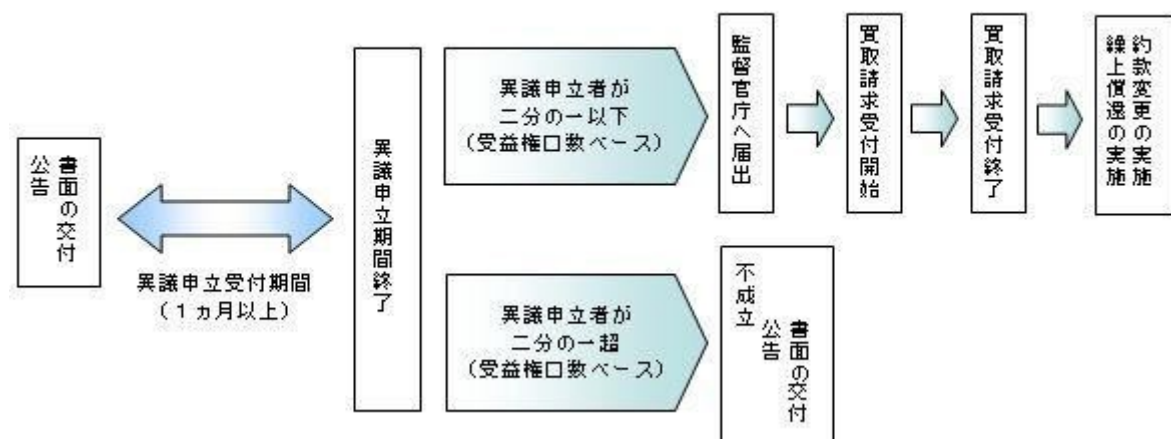
#### 異議の申立て

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を買取請求を行なうものとします。この場合、受益者は販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。
- 7) 受益者が、株式の交換および買取りに係る金銭の返還について、信託終了日から10年間請求をしないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

#### 運用報告書の作成

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

#### 関係法人との契約について

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### (1) 収益分配金受領権

- ・名義登録手続きによって受益者を確定し、当該受益者に対して収益分配金の支払いを行ないません。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16期計算期間（平成28年 7月 9日から平成29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15期 平成28年 7月 8日現在	第16期 平成29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	155,565,289,173
コール・ローン	11,848,654,378	18,268,693,250
株式	1,146,640,991,470	2,360,346,383,390
派生商品評価勘定	-	7,797,880
未収入金	15,195,700,550	24,605,821,820
未収配当金	1,652,636,568	2,702,408,060
前払金	882,281,000	-
その他未収収益	97,548,566	145,284,775
流動資産合計	1,288,414,274,984	2,561,641,678,348
資産合計		
	1,288,414,274,984	2,561,641,678,348
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	123,408,680	36,774,000
前受金	-	177,442,900
未払金	912,220,840	104,960
未払収益分配金	24,233,127,587	37,550,546,217
未払受託者報酬	443,705,561	656,127,707
未払委託者報酬	875,254,979	1,270,533,540
未払利息	17,396	57,048
受入担保金	112,096,462,452	155,565,289,173
その他未払費用	158,675,167	214,266,172
流動負債合計	138,842,872,662	195,471,141,717
負債合計		
	138,842,872,662	195,471,141,717
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	941,559,945,625	1,452,206,927,029
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	208,011,456,697	913,963,609,602
（分配準備積立金）	40,360,286	34,627,948
元本等合計	1,149,571,402,322	2,366,170,536,631
純資産合計	1,149,571,402,322	2,366,170,536,631
負債純資産合計	1,288,414,274,984	2,561,641,678,348

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	平成27年 7月 9日 至 平成28年 7月 8日	自	平成28年 7月 9日 至 平成29年 7月 8日
営業収益				
受取配当金		24,867,638,572		37,908,255,785
受取利息		6,276,473		40,301
有価証券売買等損益		331,530,181,101		440,314,239,746
派生商品取引等損益		960,876,640		3,199,738,000
その他収益		1,118,522,863		2,202,124,802
営業収益合計		306,498,619,833		483,624,398,634
営業費用				
支払利息		-		2,579,185
受託者報酬		443,705,561		656,127,707
委託者報酬		875,254,979		1,270,533,540
その他費用		417,769,022		636,366,577
営業費用合計		1,736,729,562		2,565,607,009
営業利益又は営業損失（ ）		308,235,349,395		481,058,791,625
経常利益又は経常損失（ ）		308,235,349,395		481,058,791,625
当期純利益又は当期純損失（ ）		308,235,349,395		481,058,791,625
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（ ）		463,989,789,260		208,011,456,697
剰余金増加額又は欠損金減少額		109,530,533,340		381,094,328,291
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		109,530,533,340		381,094,328,291
剰余金減少額又は欠損金増加額		33,040,388,921		118,650,420,794
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		33,040,388,921		118,650,420,794
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		24,233,127,587		37,550,546,217
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		208,011,456,697		913,963,609,602

## （ 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15期 平成28年 7月 8日現在	第16期 平成29年 7月 8日現在
1.	期首元本額	774,985,050,994円	941,559,945,625円
	期中追加設定元本額	239,399,440,600円	755,125,008,400円
	期中一部交換元本額	72,824,545,969円	244,478,026,996円
2.	受益権の総数	944,393,125口	1,456,576,657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	1,346,157,590円	1,991,472,930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	104,562,200,130円	147,104,742,090円

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第15期 自 平成27年 7月 9日 至 平成28年 7月 8日		第16期 自 平成28年 7月 9日 至 平成29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	25,992,437,908円	A 当期配当等収益額	40,107,841,703円
B 分配準備積立金	17,779,527円	B 分配準備積立金	40,360,286円

C 配当等収益額合計 (A+B)	26,010,217,435円	C 配当等収益額合計 (A+B)	40,148,201,989円
D 経費	1,736,729,562円	D 経費	2,563,027,824円
E 収益分配可能額 (C-D)	24,273,487,873円	E 収益分配可能額 (C-D)	37,585,174,165円
F 収益分配金額	24,233,127,587円	F 収益分配金額	37,550,546,217円
G 次期繰越金 (分配準備積立金) (E-F)	40,360,286円	G 次期繰越金 (分配準備積立金) (E-F)	34,627,948円
H 口数	944,393,125口	H 口数	1,456,576,657口
I 分配金額 (100口当たり)	2,566円	I 分配金額 (100口当たり)	2,578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15期 自 平成27年 7月 9日 至 平成28年 7月 8日	第16期 自 平成28年 7月 9日 至 平成29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15期 平成28年 7月 8日現在	第16期 平成29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

第16期（平成29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	385,662,402,084
合計	385,662,402,084

## (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
----	---------------	---	---------------	-------------

第16期(平成29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	5,862,190,100	-	5,833,410,000	28,780,100
合計		5,862,190,100	-	5,833,410,000	28,780,100

(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15期 平成28年 7月 8日現在		第16期 平成29年 7月 8日現在	
1口当たり純資産額	1,217.26円	1口当たり純資産額	1,624.47円
(100口当たり純資産額)	(121,726円)	(100口当たり純資産額)	(162,447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	44,400	3,110.00	138,084,000	貸付有価証券 27,600株
日本水産	1,465,900	633.00	927,914,700	
マル八二チ口	214,100	2,925.00	626,242,500	
カネコ種苗	38,700	1,449.00	56,076,300	



サカタのタネ	166,500	3,560.00	592,740,000	
ホクト	114,800	1,967.00	225,811,600	貸付有価証券 5,000株
ホクリヨウ	15,800	1,046.00	16,526,800	貸付有価証券 4,000株
住石ホールディングス	313,800	100.00	31,380,000	貸付有価証券 23,600株
日鉄鉱業	31,400	6,060.00	190,284,000	
三井松島産業	69,400	1,430.00	99,242,000	貸付有価証券 33,600株
国際石油開発帝石	5,945,700	1,069.00	6,355,953,300	
日本海洋掘削	39,400	2,202.00	86,758,800	貸付有価証券 28,000株
石油資源開発	178,800	2,296.00	410,524,800	
K & O エナジーグループ	75,900	1,775.00	134,722,500	貸付有価証券 10,000株
ショーボンドホールディングス	109,200	5,670.00	619,164,000	貸付有価証券 35,000株
ミライト・ホールディングス	347,200	1,292.00	448,582,400	貸付有価証券 71,300株
タマホーム	85,000	633.00	53,805,000	貸付有価証券 22,800株
サンヨーホームズ	23,600	637.00	15,033,200	
ファーストコーポレーション	24,900	1,083.00	26,966,700	
インベスターズクラウド	14,300	5,840.00	83,512,000	貸付有価証券 10,000株
ダイセキ環境ソリューション	31,500	1,341.00	42,241,500	
安藤・間	811,100	728.00	590,480,800	貸付有価証券 4,000株
東急建設	400,700	897.00	359,427,900	貸付有価証券 280,500株
コムシスホールディングス	441,000	2,300.00	1,014,300,000	
ミサワホーム	133,300	1,008.00	134,366,400	貸付有価証券 47,700株
ピーアールホールディングス	111,600	381.00	42,519,600	
高松コンストラクショングループ	85,100	2,789.00	237,343,900	
東建コーポレーション	42,100	13,630.00	573,823,000	貸付有価証券 29,800株
ソネック	14,100	825.00	11,632,500	
ヤマウラ	52,700	954.00	50,275,800	貸付有価証券 3,200株
大成建設	5,739,000	1,034.00	5,934,126,000	貸付有価証券 58,000株
大林組	3,385,000	1,310.00	4,434,350,000	貸付有価証券 45,900株
清水建設	3,452,700	1,196.00	4,129,429,200	
飛島建設	1,087,700	170.00	184,909,000	貸付有価証券 72,400株

長谷工コーポレーション	1,317,100	1,375.00	1,811,012,500	貸付有価証券 36,000株
松井建設	124,400	869.00	108,103,600	
銭高組	161,000	443.00	71,323,000	
鹿島建設	4,960,000	960.00	4,761,600,000	
不動テトラ	910,900	187.00	170,338,300	貸付有価証券 290,000株
大末建設	39,800	1,015.00	40,397,000	
鉄建建設	686,000	339.00	232,554,000	貸付有価証券 479,000株
西松建設	1,304,000	613.00	799,352,000	
三井住友建設	4,324,500	122.00	527,589,000	
大豊建設	409,000	549.00	224,541,000	
前田建設工業	743,000	1,302.00	967,386,000	
佐田建設	77,500	437.00	33,867,500	貸付有価証券 1,400株
ナカノフドー建設	86,400	633.00	54,691,200	
奥村組	928,000	751.00	696,928,000	
東鉄工業	135,500	3,360.00	455,280,000	貸付有価証券 12,000株
イチケン	102,000	406.00	41,412,000	
浅沼組	394,000	340.00	133,960,000	
戸田建設	1,312,000	709.00	930,208,000	貸付有価証券 190,000株
熊谷組	1,771,000	364.00	644,644,000	
青木あすなる建設	73,900	869.00	64,219,100	
北野建設	235,000	326.00	76,610,000	
植木組	141,000	272.00	38,352,000	
三井ホーム	145,000	717.00	103,965,000	貸付有価証券 17,000株
矢作建設工業	153,500	914.00	140,299,000	
ピーエス三菱	119,400	488.00	58,267,200	
日本ハウスホールディングス	230,000	523.00	120,290,000	貸付有価証券 34,100株
大東建託	408,700	17,905.00	7,317,773,500	貸付有価証券 33,000株
新日本建設	134,300	932.00	125,167,600	
N I P P O	261,000	2,251.00	587,511,000	
東亜道路工業	212,000	461.00	97,732,000	
前田道路	353,000	2,321.00	819,313,000	
日本道路	336,000	595.00	199,920,000	貸付有価証券 50,000株
東亜建設工業	91,500	1,769.00	161,863,500	貸付有価証券 26,700株
若築建設	649,000	178.00	115,522,000	貸付有価証券 104,000株
東洋建設	324,700	447.00	145,140,900	

五洋建設	1,252,300	638.00	798,967,400	貸付有価証券 60,000株
大林道路	117,200	940.00	110,168,000	
世紀東急工業	164,800	589.00	97,067,200	貸付有価証券 21,000株
福田組	36,500	5,180.00	189,070,000	貸付有価証券 1,000株
住友林業	776,800	1,735.00	1,347,748,000	貸付有価証券 70,000株
日本基礎技術	125,400	365.00	45,771,000	
日成ビルド工業	334,000	620.00	207,080,000	貸付有価証券 29,000株
ヤマダ・エスバイエルホーム	575,000	85.00	48,875,000	貸付有価証券 70,000株
巴コーポレーション	140,200	362.00	50,752,400	
パナホーム	211,000	1,201.00	253,411,000	
大和ハウス工業	3,334,000	3,780.00	12,602,520,000	
ライト工業	217,000	1,161.00	251,937,000	
積水ハウス	3,456,300	1,965.50	6,793,357,650	
日特建設	96,100	590.00	56,699,000	
北陸電気工事	54,600	933.00	50,941,800	
ユアテック	178,000	765.00	136,170,000	貸付有価証券 33,000株
西部電気工業	18,800	2,368.00	44,518,400	
四電工	86,000	550.00	47,300,000	
中電工	127,300	2,924.00	372,225,200	貸付有価証券 6,000株
関電工	450,000	1,132.00	509,400,000	貸付有価証券 54,000株
きんでん	750,500	1,819.00	1,365,159,500	
東京エネシス	116,500	1,037.00	120,810,500	
トーエネック	159,000	719.00	114,321,000	
住友電設	78,000	1,622.00	126,516,000	
日本電設工業	173,200	2,234.00	386,928,800	貸付有価証券 5,000株
協和エクシオ	442,200	1,878.00	830,451,600	
新日本空調	87,000	1,521.00	132,327,000	
N D S	17,700	3,085.00	54,604,500	
九電工	221,600	4,225.00	936,260,000	
三機工業	238,900	1,242.00	296,713,800	貸付有価証券 19,500株
日揮	1,053,300	1,849.00	1,947,551,700	
中外炉工業	343,000	224.00	76,832,000	
ヤマト	101,100	662.00	66,928,200	
太平電業	153,000	1,348.00	206,244,000	
高砂熱学工業	310,600	1,825.00	566,845,000	貸付有価証券 7,200株

三晃金属工業	9,900	3,330.00	32,967,000	貸付有価証券 800株
朝日工業社	25,500	3,085.00	78,667,500	
明星工業	204,300	676.00	138,106,800	
大気社	149,500	2,933.00	438,483,500	貸付有価証券 40,000株
ダイダン	151,000	1,467.00	221,517,000	
日比谷総合設備	126,000	1,916.00	241,416,000	
東芝プラントシステム	183,300	1,849.00	338,921,700	
OSJBホールディングス	344,700	289.00	99,618,300	貸付有価証券 36,700株
東洋エンジニアリング	664,000	274.00	181,936,000	貸付有価証券 469,000株
千代田化工建設	814,000	654.00	532,356,000	貸付有価証券 38,000株
新興プランテック	231,700	912.00	211,310,400	
日本製粉	335,500	1,746.00	585,783,000	
日清製粉グループ本社	1,237,500	1,786.00	2,210,175,000	貸付有価証券 2,700株
日東富士製粉	7,300	3,935.00	28,725,500	
昭和産業	464,000	599.00	277,936,000	
鳥越製粉	89,600	798.00	71,500,800	
中部飼料	123,500	1,433.00	176,975,500	
フィード・ワン	679,000	221.00	150,059,000	
東洋精糖	170,000	116.00	19,720,000	
日本甜菜製糖	57,500	2,145.00	123,337,500	貸付有価証券 7,000株
三井製糖	79,700	3,180.00	253,446,000	貸付有価証券 20,000株
塩水港精糖	120,300	243.00	29,232,900	
日新製糖	47,900	1,861.00	89,141,900	
森永製菓	220,300	6,290.00	1,385,687,000	貸付有価証券 20,000株
中村屋	26,200	5,010.00	131,262,000	
江崎グリコ	282,300	6,000.00	1,693,800,000	貸付有価証券 6,100株
名糖産業	48,600	1,438.00	69,886,800	
不二家	64,500	2,440.00	157,380,000	貸付有価証券 10,800株
山崎製パン	826,800	2,195.00	1,814,826,000	
第一屋製パン	17,300	1,217.00	21,054,100	
モロゾフ	172,000	642.00	110,424,000	貸付有価証券 20,000株
亀田製菓	62,800	5,410.00	339,748,000	貸付有価証券 13,000株
寿スピリッツ	107,100	3,530.00	378,063,000	
カルビー	460,400	4,270.00	1,965,908,000	貸付有価証券 322,200株

森永乳業	1,012,000	857.00	867,284,000	貸付有価証券 270,000株
六甲バター	50,300	2,585.00	130,025,500	
ヤクルト本社	605,200	7,520.00	4,551,104,000	貸付有価証券 34,900株
明治ホールディングス	668,600	8,940.00	5,977,284,000	
雪印メグミルク	243,500	3,155.00	768,242,500	
プリマハム	711,000	648.00	460,728,000	貸付有価証券 50,000株
日本ハム	792,000	3,330.00	2,637,360,000	
林兼産業	36,200	838.00	30,335,600	
丸大食品	539,000	513.00	276,507,000	貸付有価証券 30,000株
S Foods	60,600	4,130.00	250,278,000	貸付有価証券 14,700株
伊藤ハム米久ホールディングス	651,000	1,000.00	651,000,000	
サッポロホールディングス	369,600	3,095.00	1,143,912,000	
アサヒグループホールディングス	2,117,500	4,352.00	9,215,360,000	
キリンホールディングス	4,859,700	2,325.00	11,298,802,500	
宝ホールディングス	817,100	1,163.00	950,287,300	貸付有価証券 16,900株
オエノンホールディングス	287,300	283.00	81,305,900	
養命酒製造	34,800	2,087.00	72,627,600	
コカ・コーラボトラーズジャパン	711,700	3,365.00	2,394,870,500	
サントリー食品インターナショナル	773,100	5,210.00	4,027,851,000	貸付有価証券 108,400株
ダイドーグループホールディングス	51,800	5,670.00	293,706,000	
伊藤園	334,800	4,090.00	1,369,332,000	貸付有価証券 29,200株
キーコーヒー	99,300	2,187.00	217,169,100	貸付有価証券 16,300株
ユニカフェ	30,500	980.00	29,890,000	貸付有価証券 11,300株
ジャパンフーズ	14,300	1,372.00	19,619,600	貸付有価証券 500株
日清オイリオグループ	651,000	645.00	419,895,000	貸付有価証券 410,000株
不二製油グループ本社	301,300	2,547.00	767,411,100	
かどや製油	11,000	4,985.00	54,835,000	貸付有価証券 900株
J-オイルミルズ	52,400	3,890.00	203,836,000	
キッコーマン	789,600	3,510.00	2,771,496,000	貸付有価証券 8,500株
味の素	2,325,100	2,365.50	5,500,024,050	
キューピー	574,200	2,781.00	1,596,850,200	
ハウス食品グループ本社	417,800	2,773.00	1,158,559,400	貸付有価証券 5,000株
カゴメ	405,000	3,315.00	1,342,575,000	

焼津水産化学工業	53,100	1,180.00	62,658,000	貸付有価証券 500株
アリアケジャパン	92,300	7,650.00	706,095,000	貸付有価証券 52,800株
ピエトロ	13,200	1,630.00	21,516,000	
エバラ食品工業	27,100	2,050.00	55,555,000	
ニチレイ	525,200	3,125.00	1,641,250,000	貸付有価証券 14,000株
東洋水産	554,900	4,190.00	2,325,031,000	貸付有価証券 13,000株
イトアンド	12,500	2,290.00	28,625,000	
大冷	11,400	1,820.00	20,748,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,000	2,931.00	5,862,000	
日清食品ホールディングス	440,800	6,930.00	3,054,744,000	貸付有価証券 90,600株
永谷園ホールディングス	108,000	1,396.00	150,768,000	
一正蒲鉾	39,200	1,282.00	50,254,400	貸付有価証券 28,100株
フジッコ	109,400	2,519.00	275,578,600	貸付有価証券 11,300株
ロック・フィールド	108,900	1,850.00	201,465,000	
日本たばこ産業	6,255,200	3,862.00	24,157,582,400	
ケンコーマヨネーズ	60,800	3,165.00	192,432,000	貸付有価証券 23,800株
わらべや日洋ホールディングス	66,100	2,955.00	195,325,500	貸付有価証券 4,000株
なとり	56,400	2,057.00	116,014,800	貸付有価証券 10,000株
イフジ産業	17,200	746.00	12,831,200	
北の達人コーポレーション	48,800	839.00	40,943,200	貸付有価証券 27,200株
ユーグレナ	390,100	1,179.00	459,927,900	貸付有価証券 275,300株
ミヨシ油脂	38,700	1,404.00	54,334,800	
理研ビタミン	33,400	4,380.00	146,292,000	
片倉工業	132,200	1,312.00	173,446,400	
グンゼ	788,000	403.00	317,564,000	
東洋紡	4,178,000	210.00	877,380,000	
ユニチカ	2,890,000	83.00	239,870,000	
富士紡ホールディングス	51,300	3,310.00	169,803,000	貸付有価証券 2,000株
倉敷紡績	1,064,000	264.00	280,896,000	
シキボウ	568,000	149.00	84,632,000	
日本毛織	297,500	932.00	277,270,000	
ダイトウボウ	141,000	75.00	10,575,000	
トーア紡コーポレーション	44,700	552.00	24,674,400	
ダイドーリミテッド	118,300	438.00	51,815,400	貸付有価証券 10,800株

帝国繊維	110,500	1,938.00	214,149,000	貸付有価証券 35,000株
帝人	862,400	2,178.00	1,878,307,200	貸付有価証券 24,700株
東レ	7,654,000	956.90	7,324,112,600	貸付有価証券 317,600株
サカイオーベックス	24,900	1,787.00	44,496,300	
住江織物	288,000	274.00	78,912,000	
日本フェルト	60,400	507.00	30,622,800	
イチカワ	70,000	311.00	21,770,000	
日東製網	11,300	1,854.00	20,950,200	貸付有価証券 2,500株
アツギ	867,000	127.00	110,109,000	
ダイニック	200,000	188.00	37,600,000	
セーレン	262,800	1,762.00	463,053,600	貸付有価証券 62,900株
ソトー	39,200	1,148.00	45,001,600	
東海染工	148,000	135.00	19,980,000	
小松精練	148,500	710.00	105,435,000	貸付有価証券 15,000株
ワコールホールディングス	628,000	1,511.00	948,908,000	
ホギメディカル	66,400	7,300.00	484,720,000	貸付有価証券 46,400株
レナウン	285,800	151.00	43,155,800	貸付有価証券 200,000株
クラウドディア	24,200	641.00	15,512,200	貸付有価証券 14,200株
T S Iホールディングス	434,600	787.00	342,030,200	貸付有価証券 20,000株
三陽商会	55,300	1,775.00	98,157,500	
ナイガイ	385,000	67.00	25,795,000	貸付有価証券 69,000株
オンワードホールディングス	683,000	810.00	553,230,000	
ルック	192,000	265.00	50,880,000	貸付有価証券 24,000株
キムラタン	4,444,000	7.00	31,108,000	貸付有価証券 11,000株
ゴールドウイン	44,700	6,780.00	303,066,000	貸付有価証券 18,600株
デサント	240,600	1,493.00	359,215,800	
キング	52,200	409.00	21,349,800	
ヤマトインターナショナル	70,200	435.00	30,537,000	
特種東海製紙	61,300	4,040.00	247,652,000	
王子ホールディングス	4,125,000	570.00	2,351,250,000	
日本製紙	472,700	2,197.00	1,038,521,900	貸付有価証券 187,500株
三菱製紙	150,100	785.00	117,828,500	

北越紀州製紙	589,000	844.00	497,116,000	貸付有価証券 8,600株
中越パルプ工業	418,000	233.00	97,394,000	貸付有価証券 154,000株
巴川製紙所	162,000	236.00	38,232,000	貸付有価証券 14,000株
大王製紙	420,400	1,483.00	623,453,200	貸付有価証券 297,200株
阿波製紙	25,300	637.00	16,116,100	
レンゴー	1,017,300	650.00	661,245,000	貸付有価証券 100,000株
トーモク	332,000	390.00	129,480,000	
ザ・バック	74,700	3,615.00	270,040,500	
クラレ	1,775,800	2,119.00	3,762,920,200	貸付有価証券 127,800株
旭化成	6,580,000	1,201.00	7,902,580,000	
共和レザー	61,300	937.00	57,438,100	
昭和電工	702,400	2,647.00	1,859,252,800	貸付有価証券 5,500株
住友化学	7,766,000	642.00	4,985,772,000	
住友精化	43,700	5,400.00	235,980,000	貸付有価証券 10,000株
日産化学工業	570,500	3,790.00	2,162,195,000	
ラサ工業	397,000	144.00	57,168,000	貸付有価証券 16,000株
クレハ	79,600	5,500.00	437,800,000	貸付有価証券 56,200株
多木化学	14,400	4,600.00	66,240,000	
テイカ	161,000	964.00	155,204,000	
石原産業	189,400	1,141.00	216,105,400	貸付有価証券 23,000株
片倉コープアグリ	143,000	261.00	37,323,000	
日東エフシー	61,600	953.00	58,704,800	
日本曹達	633,000	623.00	394,359,000	
東ソー	3,050,000	1,178.00	3,592,900,000	
トクヤマ	1,641,000	550.00	902,550,000	
セントラル硝子	1,075,000	480.00	516,000,000	貸付有価証券 150,000株
東亜合成	660,600	1,431.00	945,318,600	
大阪ソーダ	454,000	537.00	243,798,000	貸付有価証券 324,000株
関東電化工業	216,000	1,024.00	221,184,000	貸付有価証券 152,700株
デンカ	2,077,000	588.00	1,221,276,000	
信越化学工業	1,892,100	9,944.00	18,815,042,400	
日本カーバイド工業	359,000	184.00	66,056,000	
堺化学工業	394,000	427.00	168,238,000	貸付有価証券 15,000株



エア・ウォーター	870,100	2,051.00	1,784,575,100	
大陽日酸	812,700	1,244.00	1,010,998,800	
日本化学工業	391,000	239.00	93,449,000	
日本パーカラライジング	539,100	1,608.00	866,872,800	貸付有価証券 30,000株
高压ガス工業	156,400	804.00	125,745,600	
チタン工業	122,000	197.00	24,034,000	
四国化成工業	152,000	1,340.00	203,680,000	貸付有価証券 13,000株
戸田工業	211,000	279.00	58,869,000	貸付有価証券 49,000株
ステラ ケミファ	51,200	2,958.00	151,449,600	貸付有価証券 35,800株
保土谷化学工業	36,800	4,430.00	163,024,000	
日本触媒	165,900	7,220.00	1,197,798,000	
大日精化工業	437,000	908.00	396,796,000	
カネカ	1,423,000	866.00	1,232,318,000	
三菱瓦斯化学	982,900	2,449.00	2,407,122,100	貸付有価証券 45,000株
三井化学	4,795,000	598.00	2,867,410,000	
J S R	1,060,600	1,944.00	2,061,806,400	
東京応化工業	197,500	3,720.00	734,700,000	貸付有価証券 5,000株
大阪有機化学工業	68,300	1,349.00	92,136,700	貸付有価証券 48,200株
三菱ケミカルホールディングス	7,108,100	950.50	6,756,249,050	
K Hネオケム	172,400	2,156.00	371,694,400	
ダイセル	1,422,800	1,413.00	2,010,416,400	
住友ベークライト	931,000	808.00	752,248,000	
積水化学工業	2,348,100	1,981.00	4,651,586,100	
日本ゼオン	890,000	1,220.00	1,085,800,000	貸付有価証券 443,000株
アイカ工業	338,200	3,390.00	1,146,498,000	
宇部興産	5,314,000	295.00	1,567,630,000	
積水樹脂	162,800	2,020.00	328,856,000	貸付有価証券 12,000株
タキロンシーアイ	222,000	581.00	128,982,000	貸付有価証券 10,000株
旭有機材	342,000	254.00	86,868,000	
日立化成	586,500	3,320.00	1,947,180,000	
ニチバン	104,000	971.00	100,984,000	
リケンテクノス	227,500	626.00	142,415,000	貸付有価証券 158,600株
大倉工業	252,000	583.00	146,916,000	
積水化成成品工業	146,900	936.00	137,498,400	
群栄化学工業	25,300	3,555.00	89,941,500	

タイガースポリマー	51,800	735.00	38,073,000	
ミライアル	38,000	1,053.00	40,014,000	
ダイキアクシス	34,900	1,002.00	34,969,800	
ダイキョーニシカワ	184,900	1,576.00	291,402,400	
日本化薬	685,000	1,588.00	1,087,780,000	
カーリットホールディングス	97,600	602.00	58,755,200	
日本精化	87,300	1,002.00	87,474,600	
扶桑化学工業	75,000	3,460.00	259,500,000	
A D E K A	453,800	1,678.00	761,476,400	
日油	815,000	1,440.00	1,173,600,000	
新日本理化	166,300	157.00	26,109,100	貸付有価証券 83,700株
ハリマ化成グループ	89,700	1,022.00	91,673,400	
花王	2,631,900	6,652.00	17,507,398,800	
第一工業製薬	234,000	528.00	123,552,000	
日華化学	33,200	1,177.00	39,076,400	
ニイタカ	15,400	1,736.00	26,734,400	
三洋化成工業	66,200	5,280.00	349,536,000	貸付有価証券 5,000株
有機合成薬品工業	68,700	283.00	19,442,100	
大日本塗料	604,000	305.00	184,220,000	
日本ペイントホールディングス	814,200	4,140.00	3,370,788,000	貸付有価証券 48,000株
関西ペイント	1,108,500	2,540.00	2,815,590,000	貸付有価証券 126,100株
神東塗料	78,000	202.00	15,756,000	
中国塗料	302,400	856.00	258,854,400	貸付有価証券 85,800株
日本特殊塗料	73,900	1,844.00	136,271,600	
藤倉化成	143,200	626.00	89,643,200	
太陽ホールディングス	85,900	4,980.00	427,782,000	貸付有価証券 37,000株
D I C	416,700	4,210.00	1,754,307,000	
サカタインクス	215,300	1,786.00	384,525,800	
東洋インキ S C ホールディングス	1,043,000	577.00	601,811,000	
T & K T O K A	76,300	1,153.00	87,973,900	
富士フイルムホールディングス	2,092,400	4,013.00	8,396,801,200	
資生堂	2,001,700	3,862.00	7,730,565,400	
ライオン	1,309,700	2,276.00	2,980,877,200	貸付有価証券 871,700株
高砂香料工業	69,300	4,215.00	292,099,500	貸付有価証券 2,000株
マンダム	105,700	6,010.00	635,257,000	
ミルボン	57,000	6,050.00	344,850,000	貸付有価証券 5,000株

ファンケル	224,300	2,045.00	458,693,500	貸付有価証券 37,000株
コーセー	170,600	11,930.00	2,035,258,000	貸付有価証券 13,000株
コタ	43,600	1,217.00	53,061,200	
シーズ・ホールディングス	136,900	4,125.00	564,712,500	
シーボン	12,000	2,460.00	29,520,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	430,000	2,960.00	1,272,800,000	
ノエビアホールディングス	66,500	5,560.00	369,740,000	
アジュバンコスメジャパン	19,700	956.00	18,833,200	貸付有価証券 12,000株
エステー	72,000	2,505.00	180,360,000	
アグロ カネショウ	40,800	1,501.00	61,240,800	
コニシ	165,500	1,603.00	265,296,500	貸付有価証券 3,100株
長谷川香料	133,600	2,289.00	305,810,400	貸付有価証券 5,000株
星光PMC	57,700	1,295.00	74,721,500	貸付有価証券 41,000株
小林製薬	282,300	6,590.00	1,860,357,000	貸付有価証券 5,000株
荒川化学工業	90,400	1,897.00	171,488,800	
メック	81,600	1,346.00	109,833,600	貸付有価証券 36,500株
日本高純度化学	29,600	2,360.00	69,856,000	
タカラバイオ	301,300	1,544.00	465,207,200	貸付有価証券 73,700株
JCU	66,200	4,010.00	265,462,000	
新田ゼラチン	63,200	747.00	47,210,400	貸付有価証券 2,600株
OATアグリオ	12,200	1,616.00	19,715,200	
デクセリアルズ	277,200	1,087.00	301,316,400	
アース製薬	75,800	6,070.00	460,106,000	貸付有価証券 15,000株
北興化学工業	103,100	491.00	50,622,100	
大成ラミック	32,600	2,874.00	93,692,400	貸付有価証券 2,000株
クミアイ化学工業	446,800	615.00	274,782,000	貸付有価証券 94,900株
日本農薬	262,800	646.00	169,768,800	貸付有価証券 28,100株
アキレス	86,200	1,912.00	164,814,400	貸付有価証券 6,000株
有沢製作所	178,900	908.00	162,441,200	貸付有価証券 5,000株
日東電工	760,800	9,653.00	7,344,002,400	
レック	65,700	2,651.00	174,170,700	貸付有価証券 9,700株

きもと	188,400	259.00	48,795,600	貸付有価証券 10,000株
藤森工業	78,300	3,300.00	258,390,000	貸付有価証券 2,600株
前澤化成工業	68,900	1,220.00	84,058,000	
J S P	49,100	3,255.00	159,820,500	貸付有価証券 10,200株
エフピコ	93,500	6,090.00	569,415,000	貸付有価証券 33,900株
天馬	69,600	2,094.00	145,742,400	
信越ポリマー	206,700	899.00	185,823,300	
東リ	250,900	362.00	90,825,800	
ニフコ	184,900	6,180.00	1,142,682,000	
日本バルカー工業	81,800	2,356.00	192,720,800	
ユニ・チャーム	2,135,900	2,829.00	6,042,461,100	貸付有価証券 1,500,500株
協和発酵キリン	1,262,100	1,971.00	2,487,599,100	
武田薬品工業	3,956,400	5,637.00	22,302,226,800	貸付有価証券 76,600株
アステラス製薬	10,352,700	1,379.50	14,281,549,650	貸付有価証券 63,600株
大日本住友製薬	746,600	1,519.00	1,134,085,400	貸付有価証券 291,000株
塩野義製薬	1,338,300	6,028.00	8,067,272,400	貸付有価証券 9,500株
田辺三菱製薬	1,229,100	2,627.00	3,228,845,700	
わかもと製薬	121,000	276.00	33,396,000	
あすか製薬	114,700	1,674.00	192,007,800	貸付有価証券 36,000株
日本新薬	241,700	7,020.00	1,696,734,000	貸付有価証券 6,800株
バイオフェルミン製薬	17,100	3,025.00	51,727,500	
中外製薬	1,049,900	4,085.00	4,288,841,500	貸付有価証券 237,900株
科研製薬	196,900	5,870.00	1,155,803,000	
エーザイ	1,298,600	6,033.00	7,834,453,800	貸付有価証券 88,700株
ロート製薬	516,400	2,270.00	1,172,228,000	
小野薬品工業	2,395,700	2,475.00	5,929,357,500	貸付有価証券 215,000株
久光製薬	297,600	5,280.00	1,571,328,000	貸付有価証券 24,000株
持田製薬	70,600	7,880.00	556,328,000	
参天製薬	1,905,600	1,544.00	2,942,246,400	
扶桑薬品工業	35,500	2,717.00	96,453,500	
日本ケミファ	14,700	5,100.00	74,970,000	
ツムラ	354,200	4,395.00	1,556,709,000	

日医工	246,700	1,751.00	431,971,700	貸付有価証券 174,400株
キッセイ薬品工業	186,900	2,926.00	546,869,400	貸付有価証券 17,000株
生化学工業	195,400	1,836.00	358,754,400	貸付有価証券 6,000株
栄研化学	88,500	3,450.00	305,325,000	貸付有価証券 7,000株
日水製薬	42,200	1,383.00	58,362,600	
鳥居薬品	72,100	2,689.00	193,876,900	
J C R ファーマ	81,100	2,777.00	225,214,700	貸付有価証券 40,500株
東和薬品	48,300	5,100.00	246,330,000	貸付有価証券 9,400株
富士製薬工業	34,200	3,715.00	127,053,000	貸付有価証券 2,000株
沢井製薬	179,100	6,160.00	1,103,256,000	
ゼリア新薬工業	216,000	2,104.00	454,464,000	貸付有価証券 25,500株
第一三共	3,104,600	2,525.50	7,840,667,300	
キョーリン製薬ホールディングス	257,900	2,433.00	627,470,700	貸付有価証券 5,000株
大幸薬品	53,000	2,419.00	128,207,000	
ダイト	62,700	2,442.00	153,113,400	
大塚ホールディングス	2,268,100	4,736.00	10,741,721,600	
大正製薬ホールディングス	225,500	8,420.00	1,898,710,000	
ペプチドリーム	394,300	3,330.00	1,313,019,000	貸付有価証券 260,000株
日本コークス工業	851,100	98.00	83,407,800	
昭和シェル石油	942,900	1,115.00	1,051,333,500	
ニチレキ	128,900	1,388.00	178,913,200	貸付有価証券 5,000株
ユシロ化学工業	56,500	1,519.00	85,823,500	
ビーピー・カストロール	43,100	1,863.00	80,295,300	貸付有価証券 22,200株
富士石油	244,500	334.00	81,663,000	
M O R E S C O	36,200	2,161.00	78,228,200	
出光興産	500,400	2,805.00	1,403,622,000	貸付有価証券 353,900株
J X T Gホールディングス	16,086,000	491.30	7,903,051,800	
コスモエネルギーホールディングス	318,200	1,780.00	566,396,000	貸付有価証券 62,000株
横浜ゴム	636,400	2,291.00	1,457,992,400	
東洋ゴム工業	556,900	2,344.00	1,305,373,600	貸付有価証券 393,700株
ブリヂストン	3,560,300	4,794.00	17,068,078,200	
住友ゴム工業	987,200	1,994.00	1,968,476,800	貸付有価証券 321,700株

藤倉ゴム工業	87,800	690.00	60,582,000	貸付有価証券 27,500株
オカモト	319,000	1,298.00	414,062,000	
フコク	44,000	1,017.00	44,748,000	
ニッタ	94,700	3,565.00	337,605,500	
住友理工	195,300	1,156.00	225,766,800	
三ツ星ベルト	245,000	1,225.00	300,125,000	
バンドー化学	191,900	1,088.00	208,787,200	
日東紡績	852,000	589.00	501,828,000	貸付有価証券 93,000株
旭硝子	1,029,800	4,780.00	4,922,444,000	
日本板硝子	480,700	962.00	462,433,400	貸付有価証券 5,400株
石塚硝子	148,000	217.00	32,116,000	
日本山村硝子	418,000	184.00	76,912,000	
日本電気硝子	435,800	3,915.00	1,706,157,000	
オハラ	39,800	1,206.00	47,998,800	貸付有価証券 27,500株
住友大阪セメント	1,958,000	537.00	1,051,446,000	貸付有価証券 45,000株
太平洋セメント	6,362,000	418.00	2,659,316,000	
日本ヒューム	101,400	679.00	68,850,600	
日本コンクリート工業	235,600	423.00	99,658,800	貸付有価証券 82,800株
三谷セキサン	52,700	2,781.00	146,558,700	貸付有価証券 5,000株
アジアパイルホールディングス	129,600	751.00	97,329,600	貸付有価証券 28,800株
東海カーボン	984,900	646.00	636,245,400	
日本カーボン	51,800	3,250.00	168,350,000	貸付有価証券 35,600株
東洋炭素	58,400	1,899.00	110,901,600	貸付有価証券 3,000株
ノリタケカンパニーリミテド	59,500	3,835.00	228,182,500	
TOTO	774,900	4,185.00	3,242,956,500	
日本碍子	1,331,800	2,252.00	2,999,213,600	
日本特殊陶業	908,900	2,373.00	2,156,819,700	貸付有価証券 67,300株
ダントーホールディングス	84,000	148.00	12,432,000	貸付有価証券 34,000株
MARUWA	38,700	4,495.00	173,956,500	
品川リフラクトリーズ	265,000	273.00	72,345,000	
黒崎播磨	228,000	428.00	97,584,000	貸付有価証券 75,000株
ヨータイ	60,000	375.00	22,500,000	
イソライト工業	52,200	372.00	19,418,400	
東京窯業	127,700	213.00	27,200,100	

ニッカトー	34,000	590.00	20,060,000	
フジインコーポレーテッド	89,700	2,363.00	211,961,100	貸付有価証券 35,400株
エーアンドエーマテリアル	218,000	125.00	27,250,000	貸付有価証券 62,000株
ニチアス	551,000	1,330.00	732,830,000	
ニチハ	140,100	3,990.00	558,999,000	
新日鐵住金	4,755,600	2,630.00	12,507,228,000	
神戸製鋼所	1,823,300	1,212.00	2,209,839,600	貸付有価証券 1,277,500株
中山製鋼所	118,300	677.00	80,089,100	貸付有価証券 17,900株
合同製鐵	59,000	2,298.00	135,582,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	2,882,500	2,020.00	5,822,650,000	貸付有価証券 17,500株
日新製鋼	343,500	1,257.00	431,779,500	
東京製鐵	533,500	991.00	528,698,500	貸付有価証券 118,700株
共英製鋼	112,300	1,907.00	214,156,100	貸付有価証券 51,000株
大和工業	211,600	2,976.00	629,721,600	
東京鐵鋼	220,000	446.00	98,120,000	
大阪製鐵	66,100	2,206.00	145,816,600	
淀川製鋼所	145,700	3,050.00	444,385,000	
東洋鋼鈹	252,200	420.00	105,924,000	
丸一鋼管	352,800	3,400.00	1,199,520,000	貸付有価証券 41,000株
モリ工業	32,800	2,265.00	74,292,000	
大同特殊鋼	1,767,000	676.00	1,194,492,000	貸付有価証券 50,000株
日本高周波鋼業	367,000	84.00	30,828,000	貸付有価証券 110,000株
日本冶金工業	872,300	241.00	210,224,300	貸付有価証券 89,400株
山陽特殊製鋼	627,000	656.00	411,312,000	貸付有価証券 80,000株
愛知製鋼	62,200	4,580.00	284,876,000	
日立金属	1,073,100	1,620.00	1,738,422,000	
日本金属	25,100	1,608.00	40,360,800	貸付有価証券 13,200株
大平洋金属	674,000	294.00	198,156,000	貸付有価証券 7,000株
新日本電工	596,700	403.00	240,470,100	貸付有価証券 50,000株
栗本鐵工所	50,300	2,064.00	103,819,200	貸付有価証券 5,000株
虹技	148,000	235.00	34,780,000	貸付有価証券 5,000株

日本鋳鉄管	103,000	177.00	18,231,000	貸付有価証券 1,000株
三菱製鋼	734,000	278.00	204,052,000	
日亜鋼業	145,300	284.00	41,265,200	
日本精線	71,000	697.00	49,487,000	貸付有価証券 2,000株
シンニッタン	86,000	694.00	59,684,000	
新家工業	227,000	192.00	43,584,000	
大紀アルミニウム工業所	177,000	609.00	107,793,000	
日本軽金属ホールディングス	2,714,300	278.00	754,575,400	
三井金属鉱業	2,867,000	465.00	1,333,155,000	貸付有価証券 178,000株
東邦亜鉛	595,000	477.00	283,815,000	貸付有価証券 20,000株
三菱マテリアル	658,000	3,400.00	2,237,200,000	
住友金属鉱山	2,729,000	1,508.00	4,115,332,000	貸付有価証券 56,000株
DOWAホールディングス	1,163,000	874.00	1,016,462,000	
古河機械金属	1,645,000	203.00	333,935,000	貸付有価証券 117,000株
エス・サイエンス	471,900	187.00	88,245,300	貸付有価証券 334,300株
大阪チタニウムテクノロジーズ	115,100	1,764.00	203,036,400	貸付有価証券 34,800株
東邦チタニウム	178,400	803.00	143,255,200	貸付有価証券 113,700株
UACJ	1,489,000	318.00	473,502,000	
古河電気工業	353,600	4,860.00	1,718,496,000	貸付有価証券 6,500株
住友電気工業	3,973,100	1,781.00	7,076,091,100	
フジクラ	1,388,100	945.00	1,311,754,500	貸付有価証券 12,300株
昭和電線ホールディングス	1,254,000	91.00	114,114,000	
東京特殊電線	14,900	2,015.00	30,023,500	貸付有価証券 9,800株
タツタ電線	197,400	676.00	133,442,400	貸付有価証券 80,000株
沖電線	110,000	269.00	29,590,000	貸付有価証券 24,000株
カナレ電気	14,900	2,429.00	36,192,100	
平河ヒューテック	49,600	1,491.00	73,953,600	貸付有価証券 4,400株
リョービ	613,000	476.00	291,788,000	貸付有価証券 30,000株
アーレスティ	122,100	1,142.00	139,438,200	
アサヒホールディングス	158,700	1,876.00	297,721,200	貸付有価証券 12,700株
稲葉製作所	56,000	1,453.00	81,368,000	
宮地エンジニアリンググループ	303,000	262.00	79,386,000	



トーカロ	69,200	3,770.00	260,884,000	
アルファC o	35,100	2,413.00	84,696,300	
SUMCO	1,100,700	1,730.00	1,904,211,000	
川田テクノロジーズ	20,100	7,590.00	152,559,000	貸付有価証券 7,600株
RS Technologies	10,400	3,885.00	40,404,000	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	749,200	1,833.00	1,373,283,600	貸付有価証券 8,000株
ホッカンホールディングス	274,000	423.00	115,902,000	
コロナ	55,100	1,154.00	63,585,400	
横河ブリッジホールディングス	185,200	1,566.00	290,023,200	
駒井ハルテック	20,300	2,209.00	44,842,700	
高田機工	91,000	279.00	25,389,000	
三和ホールディングス	1,046,500	1,176.00	1,230,684,000	貸付有価証券 52,000株
文化シャッター	293,600	875.00	256,900,000	
三協立山	138,200	1,729.00	238,947,800	貸付有価証券 57,700株
アルインコ	72,400	1,106.00	80,074,400	
東洋シャッター	25,800	631.00	16,279,800	貸付有価証券 900株
LIXILグループ	1,468,700	2,770.00	4,068,299,000	貸付有価証券 115,000株
日本ファイルコン	76,300	592.00	45,169,600	貸付有価証券 15,300株
ノーリツ	206,600	2,180.00	450,388,000	貸付有価証券 12,600株
長府製作所	112,500	2,581.00	290,362,500	
リンナイ	179,600	10,120.00	1,817,552,000	貸付有価証券 4,000株
ダイニチ工業	53,600	791.00	42,397,600	
日東精工	150,500	471.00	70,885,500	
三洋工業	132,000	221.00	29,172,000	
岡部	218,700	1,026.00	224,386,200	
ジーテクト	109,900	2,188.00	240,461,200	貸付有価証券 2,000株
中国工業	15,200	745.00	11,324,000	
東プレ	202,800	3,010.00	610,428,000	貸付有価証券 115,100株
高周波熱錬	191,700	1,028.00	197,067,600	貸付有価証券 12,000株
東京製網	71,200	1,707.00	121,538,400	貸付有価証券 1,800株
サンコール	55,900	634.00	35,440,600	
モリテック スチール	53,500	292.00	15,622,000	
パイオラックス	159,600	3,030.00	483,588,000	貸付有価証券 10,000株

エイチワン	79,900	1,211.00	96,758,900	
日本発條	992,300	1,216.00	1,206,636,800	
中央発條	120,000	346.00	41,520,000	
アドバネクス	18,200	1,663.00	30,266,600	貸付有価証券 700株
立川ブラインド工業	43,800	1,225.00	53,655,000	
三益半導体工業	88,800	1,716.00	152,380,800	
日本ドライケミカル	13,500	2,356.00	31,806,000	
日本製鋼所	348,500	1,869.00	651,346,500	貸付有価証券 9,100株
三浦工業	431,100	2,166.00	933,762,600	貸付有価証券 25,000株
タクマ	337,400	1,148.00	387,335,200	貸付有価証券 26,000株
ツガミ	284,000	862.00	244,808,000	貸付有価証券 100,000株
オークマ	686,000	1,056.00	724,416,000	貸付有価証券 26,000株
東芝機械	626,000	515.00	322,390,000	貸付有価証券 110,000株
アマダホールディングス	1,419,200	1,286.00	1,825,091,200	
アイダエンジニアリング	299,400	1,083.00	324,250,200	貸付有価証券 28,100株
滝澤鉄工所	310,000	180.00	55,800,000	
富士機械製造	321,300	1,699.00	545,888,700	貸付有価証券 15,000株
牧野フライス製作所	525,000	924.00	485,100,000	貸付有価証券 310,000株
オーエスジー	480,200	2,338.00	1,122,707,600	貸付有価証券 317,500株
ダイジェット工業	122,000	175.00	21,350,000	貸付有価証券 5,000株
旭ダイヤモンド工業	296,200	866.00	256,509,200	貸付有価証券 79,600株
D M G 森精機	607,300	1,827.00	1,109,537,100	
ソディック	267,400	1,336.00	357,246,400	貸付有価証券 185,000株
ディスコ	123,400	18,210.00	2,247,114,000	
日東工器	61,400	2,633.00	161,666,200	
パンチ工業	38,000	1,279.00	48,602,000	
富士ダイス	37,600	729.00	27,410,400	
豊和工業	58,900	815.00	48,003,500	貸付有価証券 39,400株
O K K	383,000	129.00	49,407,000	
石川製作所	26,100	1,209.00	31,554,900	貸付有価証券 18,200株
東洋機械金属	71,500	785.00	56,127,500	
津田駒工業	235,000	179.00	42,065,000	貸付有価証券 133,000株

エンシュウ	256,000	118.00	30,208,000	貸付有価証券 177,000株
島精機製作所	137,400	5,230.00	718,602,000	貸付有価証券 68,100株
N Cホールディングス	34,200	867.00	29,651,400	貸付有価証券 12,300株
フリー	62,100	1,307.00	81,164,700	
ヤマシンフィルタ	27,200	2,194.00	59,676,800	貸付有価証券 18,700株
日阪製作所	143,400	958.00	137,377,200	
やまびこ	193,100	1,303.00	251,609,300	
ペガサスミシン製造	100,900	726.00	73,253,400	
ナブテスコ	547,900	3,230.00	1,769,717,000	貸付有価証券 182,700株
三井海洋開発	105,900	2,598.00	275,128,200	貸付有価証券 21,800株
レオン自動機	88,800	1,219.00	108,247,200	貸付有価証券 16,000株
S M C	316,100	34,690.00	10,965,509,000	
新川	87,800	739.00	64,884,200	貸付有価証券 60,800株
ホソカワミクロン	37,700	5,210.00	196,417,000	
ユニオンツール	45,500	3,170.00	144,235,000	貸付有価証券 16,600株
オイレス工業	128,700	1,991.00	256,241,700	貸付有価証券 2,200株
日精エー・エス・ビー機械	33,600	3,810.00	128,016,000	
サトーホールディングス	131,100	2,645.00	346,759,500	貸付有価証券 61,700株
日本エアーテック	34,100	840.00	28,644,000	貸付有価証券 21,500株
日精樹脂工業	83,600	1,099.00	91,876,400	
オカダアイヨン	29,600	1,385.00	40,996,000	貸付有価証券 5,000株
ワイエイシイホールディングス	39,300	1,324.00	52,033,200	貸付有価証券 4,600株
小松製作所	4,863,900	2,855.50	13,888,866,450	
住友重機械工業	3,075,000	771.00	2,370,825,000	
日立建機	471,000	2,818.00	1,327,278,000	貸付有価証券 136,400株
日工	31,700	2,206.00	69,930,200	
巴工業	42,800	1,805.00	77,254,000	
井関農機	107,800	2,225.00	239,855,000	貸付有価証券 26,900株
T O W A	86,100	1,681.00	144,734,100	
丸山製作所	22,100	1,781.00	39,360,100	貸付有価証券 800株
北川鉄工所	48,300	2,421.00	116,934,300	

ローツェ	49,700	2,708.00	134,587,600	貸付有価証券 35,000株
タカキタ	34,900	520.00	18,148,000	
クボタ	5,046,300	1,925.00	9,714,127,500	貸付有価証券 467,900株
荏原実業	29,300	1,498.00	43,891,400	貸付有価証券 600株
三菱化工機	346,000	249.00	86,154,000	貸付有価証券 26,000株
月島機械	199,800	1,279.00	255,544,200	
帝国電機製作所	76,600	1,130.00	86,558,000	
東京機械製作所	395,000	74.00	29,230,000	貸付有価証券 100,000株
新東工業	239,000	1,145.00	273,655,000	
澁谷工業	88,000	3,245.00	285,560,000	貸付有価証券 30,000株
アイチ コーポレーション	149,100	795.00	118,534,500	
小森コーポレーション	253,200	1,384.00	350,428,800	貸付有価証券 54,000株
鶴見製作所	78,400	1,844.00	144,569,600	貸付有価証券 9,000株
住友精密工業	166,000	345.00	57,270,000	貸付有価証券 8,000株
酒井重工業	200,000	333.00	66,600,000	
荏原製作所	477,300	3,235.00	1,544,065,500	
石井鐵工所	15,300	1,644.00	25,153,200	
西島製作所	102,800	1,133.00	116,472,400	
北越工業	113,200	1,064.00	120,444,800	
ダイキン工業	1,375,100	11,725.00	16,123,047,500	
オルガノ	199,000	556.00	110,644,000	
トーヨーカネツ	455,000	333.00	151,515,000	
栗田工業	581,500	2,996.00	1,742,174,000	貸付有価証券 30,000株
樺本チエイン	599,000	987.00	591,213,000	
大同工業	207,000	307.00	63,549,000	
木村化工機	90,300	374.00	33,772,200	貸付有価証券 500株
アネスト岩田	182,800	1,029.00	188,101,200	
ダイフク	502,600	3,270.00	1,643,502,000	
サムコ	27,600	928.00	25,612,800	貸付有価証券 3,800株
加藤製作所	55,100	3,365.00	185,411,500	貸付有価証券 10,000株
油研工業	198,000	227.00	44,946,000	
タダノ	526,600	1,371.00	721,968,600	貸付有価証券 202,400株
フジテック	293,300	1,496.00	438,776,800	貸付有価証券 100,000株

C K D	301,700	1,891.00	570,514,700	貸付有価証券 40,000株
キトー	126,900	1,252.00	158,878,800	貸付有価証券 12,000株
平和	312,200	2,505.00	782,061,000	貸付有価証券 20,000株
理想科学工業	100,100	2,146.00	214,814,600	貸付有価証券 7,900株
S A N K Y O	280,200	3,730.00	1,045,146,000	貸付有価証券 35,000株
日本金銭機械	92,800	1,169.00	108,483,200	貸付有価証券 22,700株
マースエンジニアリング	56,800	2,402.00	136,433,600	
福島工業	62,100	4,745.00	294,664,500	貸付有価証券 30,500株
オーイズミ	42,200	594.00	25,066,800	貸付有価証券 24,700株
ダイコク電機	41,600	1,716.00	71,385,600	貸付有価証券 16,700株
竹内製作所	183,900	2,039.00	374,972,100	貸付有価証券 10,000株
アマノ	311,700	2,353.00	733,430,100	
J U K I	158,800	1,646.00	261,384,800	貸付有価証券 50,000株
サンデンホールディングス	614,000	336.00	206,304,000	貸付有価証券 110,000株
蛇の目ミシン工業	97,700	880.00	85,976,000	貸付有価証券 36,400株
マックス	155,000	1,589.00	246,295,000	
グローリー	322,000	3,715.00	1,196,230,000	貸付有価証券 10,000株
新晃工業	93,600	1,770.00	165,672,000	
大和冷機工業	161,800	1,222.00	197,719,600	
セガサミーホールディングス	999,300	1,500.00	1,498,950,000	貸付有価証券 120,000株
日本ピストンリング	39,300	2,279.00	89,564,700	
リケン	46,600	5,210.00	242,786,000	
T P R	112,800	3,690.00	416,232,000	貸付有価証券 15,000株
ツバキ・ナカシマ	113,000	2,150.00	242,950,000	貸付有価証券 78,100株
ホシザキ	294,400	10,080.00	2,967,552,000	貸付有価証券 135,400株
大豊工業	81,800	1,450.00	118,610,000	
日本精工	2,069,000	1,443.00	2,985,567,000	貸付有価証券 36,300株
N T N	2,332,000	522.00	1,217,304,000	貸付有価証券 56,000株
ジェイテクト	1,073,700	1,691.00	1,815,626,700	貸付有価証券 4,000株

不二越	1,013,000	621.00	629,073,000	貸付有価証券 34,000株
日本トムソン	321,800	586.00	188,574,800	
T H K	711,700	3,195.00	2,273,881,500	
ユーシン精機	44,600	2,674.00	119,260,400	貸付有価証券 26,600株
前澤給装工業	36,600	1,526.00	55,851,600	
イーグル工業	108,900	1,901.00	207,018,900	
前澤工業	66,900	320.00	21,408,000	
日本ピラー工業	101,800	1,703.00	173,365,400	
キッツ	483,400	994.00	480,499,600	貸付有価証券 66,700株
マキタ	1,313,700	4,160.00	5,464,992,000	
日立造船	798,400	559.00	446,305,600	
三菱重工業	16,883,000	463.10	7,818,517,300	
I H I	7,741,000	374.00	2,895,134,000	貸付有価証券 1,237,000株
スター精密	176,500	1,912.00	337,468,000	貸付有価証券 124,600株
日清紡ホールディングス	559,200	1,147.00	641,402,400	貸付有価証券 53,000株
イビデン	704,900	1,911.00	1,347,063,900	貸付有価証券 180,300株
コニカミノルタ	2,358,200	935.00	2,204,917,000	
ブラザー工業	1,230,200	2,632.00	3,237,886,400	
ミネベアミツミ	1,832,900	1,754.00	3,214,906,600	貸付有価証券 24,500株
日立製作所	24,188,000	698.30	16,890,480,400	
東芝	22,531,000	261.90	5,900,868,900	
三菱電機	10,745,000	1,659.50	17,831,327,500	
富士電機	3,035,000	603.00	1,830,105,000	
東洋電機製造	42,700	1,661.00	70,924,700	
安川電機	1,167,700	2,352.00	2,746,430,400	貸付有価証券 540,000株
シンフォニアテクノロジー	652,000	461.00	300,572,000	貸付有価証券 30,000株
明電舎	926,000	387.00	358,362,000	
オリジン電気	146,000	309.00	45,114,000	
山洋電気	264,000	1,131.00	298,584,000	
デンヨー	93,000	1,934.00	179,862,000	
東芝テック	631,000	605.00	381,755,000	
芝浦メカトロニクス	162,000	327.00	52,974,000	
マブチモーター	281,100	5,570.00	1,565,727,000	
日本電産	1,305,500	11,510.00	15,026,305,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	31,500	1,714.00	53,991,000	

東光高岳	50,900	1,679.00	85,461,100	貸付有価証券 35,900株
ダブル・スコープ	97,400	2,055.00	200,157,000	貸付有価証券 68,700株
宮越ホールディングス	34,300	464.00	15,915,200	貸付有価証券 11,000株
ダイヘン	551,000	873.00	481,023,000	貸付有価証券 40,000株
田淵電機	152,000	341.00	51,832,000	貸付有価証券 51,100株
ヤーマン	12,800	8,250.00	105,600,000	貸付有価証券 8,800株
JVCケンウッド	739,000	328.00	242,392,000	貸付有価証券 71,700株
ミマキエンジニアリング	90,200	817.00	73,693,400	貸付有価証券 20,000株
第一精工	47,100	2,111.00	99,428,100	貸付有価証券 11,900株
日新電機	202,300	1,230.00	248,829,000	
大崎電気工業	200,000	867.00	173,400,000	
オムロン	1,070,700	4,970.00	5,321,379,000	
日東工業	147,900	1,751.00	258,972,900	貸付有価証券 10,000株
I D E C	131,500	1,453.00	191,069,500	貸付有価証券 54,000株
不二電機工業	10,800	1,398.00	15,098,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,940,000	485.00	940,900,000	
サクサホールディングス	254,000	228.00	57,912,000	貸付有価証券 177,000株
メルコホールディングス	55,600	3,215.00	178,754,000	貸付有価証券 7,600株
テクノメディカ	22,700	1,929.00	43,788,300	
日本電気	13,849,000	295.00	4,085,455,000	
富士通	9,711,000	813.80	7,902,811,800	貸付有価証券 275,000株
沖電気工業	436,500	1,606.00	701,019,000	貸付有価証券 19,500株
岩崎通信機	442,000	84.00	37,128,000	
電気興業	286,000	565.00	161,590,000	貸付有価証券 33,000株
サンケン電気	589,000	538.00	316,882,000	
ナカヨ	105,000	378.00	39,690,000	
アイホン	57,000	1,942.00	110,694,000	
ルネサスエレクトロニクス	521,500	987.00	514,720,500	貸付有価証券 50,000株
セイコーエプソン	1,499,900	2,548.00	3,821,745,200	貸付有価証券 328,000株
ワコム	781,300	359.00	280,486,700	貸付有価証券 405,600株

アルバック	169,800	5,320.00	903,336,000	貸付有価証券 10,000株
アクセル	41,900	807.00	33,813,300	
E I Z O	99,500	4,350.00	432,825,000	
ジャパンディスプレイ	1,881,000	202.00	379,962,000	貸付有価証券 1,320,900株
日本信号	277,900	1,062.00	295,129,800	貸付有価証券 35,000株
京三製作所	236,000	589.00	139,004,000	
能美防災	114,200	1,661.00	189,686,200	貸付有価証券 5,000株
ホーチキ	73,000	1,798.00	131,254,000	
エレコム	87,200	2,236.00	194,979,200	
日本無線	61,600	1,448.00	89,196,800	貸付有価証券 1,000株
パナソニック	11,568,200	1,464.50	16,941,628,900	
アンリツ	734,300	986.00	724,019,800	
富士通ゼネラル	341,800	2,626.00	897,566,800	
日立国際電気	263,300	2,655.00	699,061,500	貸付有価証券 35,000株
ソニー	7,116,000	4,245.00	30,207,420,000	貸付有価証券 8,200株
T D K	567,400	7,490.00	4,249,826,000	
帝国通信工業	223,000	208.00	46,384,000	
タムラ製作所	388,000	523.00	202,924,000	
アルプス電気	929,900	3,180.00	2,957,082,000	貸付有価証券 403,300株
池上通信機	319,000	156.00	49,764,000	貸付有価証券 31,000株
パイオニア	1,513,600	217.00	328,451,200	
日本電波工業	97,600	880.00	85,888,000	
鈴木	38,600	722.00	27,869,200	貸付有価証券 27,700株
日本トリム	24,400	4,255.00	103,822,000	貸付有価証券 16,100株
ローランド ディー . ジー .	51,500	2,599.00	133,848,500	貸付有価証券 31,000株
フォスター電機	117,900	2,004.00	236,271,600	貸付有価証券 3,300株
クラリオン	531,000	434.00	230,454,000	貸付有価証券 280,000株
S M K	258,000	448.00	115,584,000	
ヨコオ	71,700	1,419.00	101,742,300	貸付有価証券 50,100株
ティアック	724,000	49.00	35,476,000	貸付有価証券 478,000株
ホシデン	305,300	1,198.00	365,749,400	貸付有価証券 105,000株



ヒロセ電機	162,700	15,790.00	2,569,033,000	貸付有価証券 1,000株
日本航空電子工業	289,000	1,641.00	474,249,000	貸付有価証券 39,000株
TOA	118,800	1,059.00	125,809,200	
日立マクセル	150,200	2,345.00	352,219,000	
古野電気	129,700	654.00	84,823,800	
ユニデンホールディングス	296,000	262.00	77,552,000	
アルパイン	240,100	1,689.00	405,528,900	
スミダコーポレーション	91,200	2,140.00	195,168,000	貸付有価証券 52,700株
アイコム	55,700	2,517.00	140,196,900	貸付有価証券 1,500株
リオン	38,400	1,749.00	67,161,600	
本多通信工業	43,100	1,681.00	72,451,100	
船井電機	113,000	1,053.00	118,989,000	貸付有価証券 79,100株
横河電機	1,092,200	1,775.00	1,938,655,000	貸付有価証券 4,000株
新電元工業	388,000	613.00	237,844,000	貸付有価証券 85,000株
アズビル	301,900	4,185.00	1,263,451,500	
東亜ディーケーケー	49,600	703.00	34,868,800	貸付有価証券 24,700株
日本光電工業	421,000	2,566.00	1,080,286,000	
チノー	35,800	1,256.00	44,964,800	
共和電業	114,200	451.00	51,504,200	
日本電子材料	39,600	709.00	28,076,400	
堀場製作所	199,500	6,730.00	1,342,635,000	貸付有価証券 22,400株
アドバンテスト	686,600	1,930.00	1,325,138,000	貸付有価証券 21,900株
小野測器	48,700	755.00	36,768,500	
エスベック	89,200	1,703.00	151,907,600	
キーエンス	456,400	49,070.00	22,395,548,000	貸付有価証券 2,100株
日置電機	52,600	2,197.00	115,562,200	
シスメックス	783,100	6,340.00	4,964,854,000	貸付有価証券 365,000株
日本マイクロニクス	175,300	1,110.00	194,583,000	貸付有価証券 123,500株
メガチップス	93,700	2,781.00	260,579,700	貸付有価証券 12,100株
OBARA GROUP	58,800	5,970.00	351,036,000	貸付有価証券 41,100株
澤藤電機	61,000	562.00	34,282,000	貸付有価証券 42,000株
コーセル	139,700	1,354.00	189,153,800	貸付有価証券 26,000株

イリソ電子工業	42,300	8,880.00	375,624,000	
新日本無線	85,600	695.00	59,492,000	貸付有価証券 13,000株
オブテックスグループ	76,500	3,540.00	270,810,000	貸付有価証券 16,800株
千代田インテグレ	53,000	2,246.00	119,038,000	
アイ・オー・データ機器	41,700	1,195.00	49,831,500	貸付有価証券 1,700株
レーザーテック	221,100	1,519.00	335,850,900	
スタンレー電気	716,800	3,555.00	2,548,224,000	
岩崎電気	367,000	198.00	72,666,000	貸付有価証券 92,000株
ウシオ電機	611,400	1,423.00	870,022,200	
岡谷電機産業	53,600	398.00	21,332,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	92,700	779.00	72,213,300	
日本セラミック	83,400	2,593.00	216,256,200	
遠藤照明	50,800	1,148.00	58,318,400	貸付有価証券 17,800株
古河電池	72,000	770.00	55,440,000	
双信電機	48,600	300.00	14,580,000	
山一電機	94,700	1,738.00	164,588,600	貸付有価証券 8,200株
図研	65,500	1,496.00	97,988,000	貸付有価証券 2,000株
日本電子	367,000	585.00	214,695,000	貸付有価証券 262,000株
カシオ計算機	810,100	1,699.00	1,376,359,900	貸付有価証券 491,000株
ファナック	1,021,100	21,725.00	22,183,397,500	
日本シイエムケイ	217,000	949.00	205,933,000	貸付有価証券 8,800株
エンプラス	45,600	3,525.00	160,740,000	貸付有価証券 32,100株
大真空	36,800	1,772.00	65,209,600	
ローム	486,900	8,470.00	4,124,043,000	貸付有価証券 2,000株
浜松ホトニクス	733,600	3,435.00	2,519,916,000	貸付有価証券 41,500株
三井ハイテック	132,800	1,679.00	222,971,200	貸付有価証券 93,300株
新光電気工業	380,500	956.00	363,758,000	
京セラ	1,653,500	6,437.00	10,643,579,500	
太陽誘電	489,900	1,755.00	859,774,500	貸付有価証券 22,900株
村田製作所	1,056,800	16,685.00	17,632,708,000	
ユーシン	140,500	768.00	107,904,000	貸付有価証券 89,500株
双葉電子工業	164,700	2,027.00	333,846,900	貸付有価証券 43,000株

北陸電気工業	405,000	139.00	56,295,000	
ニチコン	317,100	1,213.00	384,642,300	貸付有価証券 5,000株
日本ケミコン	867,000	456.00	395,352,000	貸付有価証券 156,000株
K O A	139,300	2,245.00	312,728,500	貸付有価証券 96,800株
市光工業	211,000	885.00	186,735,000	貸付有価証券 50,000株
小糸製作所	603,500	5,790.00	3,494,265,000	貸付有価証券 77,100株
ミツバ	185,300	2,090.00	387,277,000	貸付有価証券 23,000株
S C R E E Nホールディングス	206,500	7,660.00	1,581,790,000	
キャノン電子	92,400	2,199.00	203,187,600	貸付有価証券 8,000株
キャノン	5,423,000	3,652.00	19,804,796,000	貸付有価証券 892,300株
リコー	3,028,800	953.00	2,886,446,400	
M U T O Hホールディングス	138,000	250.00	34,500,000	
東京エレクトロン	671,700	15,230.00	10,229,991,000	
トヨタ紡織	352,100	2,239.00	788,351,900	貸付有価証券 80,000株
芦森工業	227,000	349.00	79,223,000	貸付有価証券 161,000株
ユニプレス	194,500	2,628.00	511,146,000	貸付有価証券 20,000株
豊田自動織機	917,200	6,190.00	5,677,468,000	
モリタホールディングス	176,100	1,694.00	298,313,400	貸付有価証券 18,000株
三櫻工業	127,700	810.00	103,437,000	
デンソー	2,483,500	4,766.00	11,836,361,000	
東海理化電機製作所	265,300	2,132.00	565,619,600	
三井造船	3,640,000	160.00	582,400,000	貸付有価証券 100,000株
川崎重工業	7,839,000	339.00	2,657,421,000	
名村造船所	302,300	677.00	204,657,100	貸付有価証券 37,700株
サノヤスホールディングス	122,100	261.00	31,868,100	貸付有価証券 55,800株
日本車輛製造	367,000	281.00	103,127,000	貸付有価証券 216,000株
ニチユ三菱フォークリフト	119,700	789.00	94,443,300	貸付有価証券 33,100株
近畿車輛	15,100	2,552.00	38,535,200	
日産自動車	11,880,700	1,146.50	13,621,222,550	
いすゞ自動車	2,919,000	1,413.50	4,126,006,500	貸付有価証券 42,100株

トヨタ自動車	12,246,500	6,157.00	75,401,700,500	代用有価証券 46,500株
日野自動車	1,437,700	1,265.00	1,818,690,500	貸付有価証券 57,000株
三菱自動車工業	3,691,600	746.00	2,753,933,600	貸付有価証券 1,158,200株
エフテック	57,600	1,448.00	83,404,800	貸付有価証券 20,200株
レシップホールディングス	33,100	896.00	29,657,600	貸付有価証券 200株
G M B	16,200	1,191.00	19,294,200	
ファルテック	17,700	1,387.00	24,549,900	
武蔵精密工業	117,100	3,270.00	382,917,000	貸付有価証券 17,000株
日産車体	442,700	1,088.00	481,657,600	貸付有価証券 29,400株
新明和工業	406,500	953.00	387,394,500	
極東開発工業	200,500	1,811.00	363,105,500	
日信工業	225,200	1,829.00	411,890,800	貸付有価証券 41,900株
トピー工業	82,800	3,335.00	276,138,000	貸付有価証券 20,000株
ティラド	392,000	353.00	138,376,000	
曙ブレーキ工業	467,800	367.00	171,682,600	貸付有価証券 12,200株
タチエス	171,000	2,099.00	358,929,000	貸付有価証券 32,000株
N O K	487,400	2,422.00	1,180,482,800	貸付有価証券 20,000株
フタバ産業	306,700	1,032.00	316,514,400	
K Y B	1,127,000	591.00	666,057,000	
大同メタル工業	126,600	1,009.00	127,739,400	貸付有価証券 12,200株
プレス工業	534,900	537.00	287,241,300	
ミクニ	128,100	467.00	59,822,700	
太平洋工業	227,700	1,507.00	343,143,900	貸付有価証券 138,600株
ケーヒン	231,400	1,612.00	373,016,800	
河西工業	136,000	1,466.00	199,376,000	
アイシン精機	921,600	5,880.00	5,419,008,000	
富士機工	99,700	737.00	73,478,900	
マツダ	3,189,500	1,629.00	5,195,695,500	貸付有価証券 134,500株
今仙電機製作所	92,200	1,282.00	118,200,400	
本田技研工業	9,064,700	3,087.00	27,982,728,900	代用有価証券 93,900株 貸付有価証券 30,700株
スズキ	1,996,300	5,291.00	10,562,423,300	

S U B A R U	3,127,400	4,086.00	12,778,556,400	
安永	48,500	1,224.00	59,364,000	貸付有価証券 34,400株
ヤマハ発動機	1,422,800	2,910.00	4,140,348,000	
ショーワ	261,500	1,112.00	290,788,000	貸付有価証券 10,000株
T B K	128,700	516.00	66,409,200	
エクセディ	136,800	3,205.00	438,444,000	
豊田合成	325,300	2,739.00	890,996,700	貸付有価証券 1,500株
愛三工業	176,500	920.00	162,380,000	
盟和産業	15,500	1,219.00	18,894,500	
ヨロズ	94,000	1,804.00	169,576,000	貸付有価証券 5,000株
エフ・シー・シー	164,700	2,236.00	368,269,200	貸付有価証券 2,000株
シマノ	406,000	17,870.00	7,255,220,000	貸付有価証券 10,500株
テイ・エス テック	234,000	3,315.00	775,710,000	貸付有価証券 500株
ジャムコ	58,800	2,533.00	148,940,400	貸付有価証券 40,900株
テルモ	1,544,100	4,330.00	6,685,953,000	貸付有価証券 27,200株
クリエートメディック	33,100	981.00	32,471,100	
日機装	348,600	1,095.00	381,717,000	貸付有価証券 130,000株
島津製作所	1,296,400	2,162.00	2,802,816,800	貸付有価証券 25,700株
J M S	186,000	324.00	60,264,000	貸付有価証券 4,000株
クボテック	21,600	588.00	12,700,800	貸付有価証券 14,100株
長野計器	79,000	750.00	59,250,000	
ブイ・テクノロジー	20,400	18,860.00	384,744,000	貸付有価証券 13,100株
東京計器	347,000	312.00	108,264,000	
愛知時計電機	13,200	3,660.00	48,312,000	
インターアクション	37,600	767.00	28,839,200	
オーバル	98,100	266.00	26,094,600	貸付有価証券 23,700株
東京精密	194,700	3,605.00	701,893,500	
マニー	122,600	2,721.00	333,594,600	貸付有価証券 31,900株
ニコン	1,755,200	1,879.00	3,298,020,800	貸付有価証券 135,200株
トプコン	507,100	1,949.00	988,337,900	貸付有価証券 48,000株

オリンパス	1,607,600	4,080.00	6,559,008,000	貸付有価証券 40,000株
理研計器	88,800	2,022.00	179,553,600	
タムロン	89,300	1,974.00	176,278,200	貸付有価証券 43,000株
H O Y A	2,072,400	5,653.00	11,715,277,200	
シード	12,800	2,429.00	31,091,200	
ノーリツ鋼機	101,800	964.00	98,135,200	
エー・アンド・デイ	92,200	449.00	41,397,800	
シチズン時計	1,102,100	804.00	886,088,400	貸付有価証券 8,200株
リズム時計工業	403,000	235.00	94,705,000	貸付有価証券 100,000株
大研医器	89,600	782.00	70,067,200	貸付有価証券 26,900株
メニコン	69,100	3,560.00	245,996,000	
松風	52,900	1,326.00	70,145,400	貸付有価証券 10,000株
セイコーホールディングス	712,000	467.00	332,504,000	貸付有価証券 497,000株
ニプロ	697,200	1,501.00	1,046,497,200	貸付有価証券 295,000株
スノーピーク	15,400	3,180.00	48,972,000	貸付有価証券 9,500株
パラマウントベッドホールディングス	96,600	4,925.00	475,755,000	貸付有価証券 59,300株
トランザクション	45,200	1,349.00	60,974,800	貸付有価証券 28,200株
S H O - B I	34,000	447.00	15,198,000	
ニホンフラッシュ	47,100	1,500.00	70,650,000	
前田工織	100,800	1,653.00	166,622,400	
永大産業	132,000	504.00	66,528,000	
アートネイチャー	107,500	711.00	76,432,500	貸付有価証券 8,000株
ダンロップスポーツ	63,500	1,128.00	71,628,000	
バンダイナムコホールディングス	1,110,900	3,905.00	4,338,064,500	
アイフィスジャパン	22,400	726.00	16,262,400	
共立印刷	167,100	339.00	56,646,900	貸付有価証券 15,000株
S H O E I	45,200	3,090.00	139,668,000	貸付有価証券 23,000株
フランスベッドホールディングス	126,400	984.00	124,377,600	貸付有価証券 10,000株
パイロットコーポレーション	175,700	4,700.00	825,790,000	貸付有価証券 10,000株
萩原工業	28,000	2,926.00	81,928,000	
トッパン・フォームズ	179,800	1,210.00	217,558,000	
フジシールインターナショナル	225,800	3,005.00	678,529,000	貸付有価証券 11,000株

タカラトミー	391,500	1,340.00	524,610,000	
廣濟堂	101,400	360.00	36,504,000	
A s - m e エステール	26,800	703.00	18,840,400	
アーク	423,900	114.00	48,324,600	貸付有価証券 125,700株
タカノ	44,300	1,112.00	49,261,600	
プロネクサス	94,100	1,234.00	116,119,400	
ホクシン	70,400	192.00	13,516,800	貸付有価証券 11,700株
ウッドワン	169,000	283.00	47,827,000	
大建工業	70,900	2,480.00	175,832,000	
凸版印刷	2,844,000	1,201.00	3,415,644,000	貸付有価証券 11,000株
大日本印刷	2,840,000	1,234.00	3,504,560,000	
図書印刷	135,000	501.00	67,635,000	貸付有価証券 49,000株
共同印刷	310,000	379.00	117,490,000	
日本写真印刷	175,700	2,998.00	526,748,600	貸付有価証券 124,200株
光村印刷	89,000	248.00	22,072,000	
宝印刷	52,600	1,638.00	86,158,800	貸付有価証券 1,600株
アシックス	1,000,600	2,032.00	2,033,219,200	貸付有価証券 528,200株
ツツミ	37,700	2,113.00	79,660,100	
小松ウオール工業	34,100	2,050.00	69,905,000	
ヤマハ	678,600	3,945.00	2,677,077,000	
河合楽器製作所	39,500	2,295.00	90,652,500	
クリナップ	105,400	878.00	92,541,200	
ビジョン	608,800	4,065.00	2,474,772,000	貸付有価証券 346,500株
兼松サステック	104,000	227.00	23,608,000	貸付有価証券 30,000株
キングジム	83,800	985.00	82,543,000	貸付有価証券 56,000株
リンテック	239,500	2,699.00	646,410,500	貸付有価証券 10,000株
イトーキ	212,100	918.00	194,707,800	貸付有価証券 90,000株
任天堂	620,300	35,160.00	21,809,748,000	
三菱鉛筆	165,900	3,020.00	501,018,000	貸付有価証券 17,400株
タカラスタンダード	208,100	1,813.00	377,285,300	
コクヨ	523,400	1,494.00	781,959,600	
ナカパヤシ	180,000	319.00	57,420,000	
グロープライド	48,800	1,900.00	92,720,000	
岡村製作所	351,600	1,037.00	364,609,200	

美津濃	540,000	644.00	347,760,000	貸付有価証券 160,000株
東京電力ホールディングス	8,544,500	460.00	3,930,470,000	
中部電力	3,319,000	1,451.00	4,815,869,000	
関西電力	4,110,400	1,484.50	6,101,888,800	
中国電力	1,392,600	1,228.00	1,710,112,800	貸付有価証券 70,000株
北陸電力	986,800	996.00	982,852,800	貸付有価証券 534,600株
東北電力	2,516,500	1,514.00	3,809,981,000	貸付有価証券 5,200株
四国電力	907,000	1,301.00	1,180,007,000	貸付有価証券 107,500株
九州電力	2,224,600	1,325.00	2,947,595,000	貸付有価証券 1,353,700株
北海道電力	942,700	851.00	802,237,700	貸付有価証券 60,000株
沖縄電力	162,800	2,611.00	425,070,800	貸付有価証券 13,300株
電源開発	801,500	2,724.00	2,183,286,000	
エフオン	49,700	1,004.00	49,898,800	貸付有価証券 18,400株
イーレックス	126,600	1,015.00	128,499,000	貸付有価証券 88,500株
東京瓦斯	10,804,000	571.30	6,172,325,200	
大阪瓦斯	9,774,000	441.40	4,314,243,600	
東邦瓦斯	2,512,000	787.00	1,976,944,000	貸付有価証券 1,437,000株
北海道瓦斯	257,000	274.00	70,418,000	貸付有価証券 89,000株
広島ガス	207,200	350.00	72,520,000	
西部瓦斯	1,134,000	270.00	306,180,000	貸付有価証券 80,000株
静岡ガス	309,700	772.00	239,088,400	
メタウォーター	56,700	3,105.00	176,053,500	貸付有価証券 31,100株
SBSホールディングス	99,300	870.00	86,391,000	
東武鉄道	5,382,000	602.00	3,239,964,000	
相鉄ホールディングス	1,611,000	550.00	886,050,000	
東京急行電鉄	5,472,000	848.00	4,640,256,000	貸付有価証券 80,000株
京浜急行電鉄	2,760,000	1,317.00	3,634,920,000	貸付有価証券 1,408,000株
小田急電鉄	1,613,600	2,213.00	3,570,896,800	貸付有価証券 14,700株
京王電鉄	2,814,000	925.00	2,602,950,000	
京成電鉄	754,900	2,944.00	2,222,425,600	貸付有価証券 14,300株



富士急行	275,000	1,173.00	322,575,000	貸付有価証券 167,000株
新京成電鉄	128,000	415.00	53,120,000	
東日本旅客鉄道	1,948,700	10,650.00	20,753,655,000	貸付有価証券 65,900株
西日本旅客鉄道	969,500	7,916.00	7,674,562,000	貸付有価証券 104,000株
東海旅客鉄道	837,600	17,885.00	14,980,476,000	貸付有価証券 131,400株
西武ホールディングス	1,391,100	1,994.00	2,773,853,400	貸付有価証券 50,000株
鴻池運輸	142,400	1,518.00	216,163,200	貸付有価証券 77,000株
西日本鉄道	1,210,000	496.00	600,160,000	貸付有価証券 30,000株
ハマキョウレックス	65,400	2,754.00	180,111,600	貸付有価証券 7,000株
サカイ引越センター	46,300	4,400.00	203,720,000	貸付有価証券 17,200株
近鉄グループホールディングス	10,138,000	425.00	4,308,650,000	貸付有価証券 4,739,000株
阪急阪神ホールディングス	1,272,500	4,005.00	5,096,362,500	
南海電気鉄道	2,128,000	569.00	1,210,832,000	貸付有価証券 100,000株
京阪ホールディングス	2,257,000	701.00	1,582,157,000	貸付有価証券 100,000株
神戸電鉄	246,000	393.00	96,678,000	貸付有価証券 10,000株
名古屋鉄道	3,668,000	516.00	1,892,688,000	貸付有価証券 1,037,000株
山陽電気鉄道	367,000	560.00	205,520,000	貸付有価証券 102,000株
日本通運	3,746,000	697.00	2,610,962,000	
ヤマトホールディングス	1,801,100	2,244.00	4,041,668,400	貸付有価証券 135,900株
山九	1,326,000	741.00	982,566,000	貸付有価証券 281,000株
丸運	54,200	282.00	15,284,400	
丸全昭和運輸	338,000	451.00	152,438,000	貸付有価証券 15,000株
センコーグループホールディングス	478,100	738.00	352,837,800	
トナミホールディングス	206,000	425.00	87,550,000	
ニッコンホールディングス	341,500	2,538.00	866,727,000	
日本石油輸送	11,500	2,738.00	31,487,000	
福山通運	610,000	715.00	436,150,000	貸付有価証券 12,000株
セイノーホールディングス	714,500	1,485.00	1,061,032,500	貸付有価証券 10,000株
神奈川中央交通	118,000	734.00	86,612,000	
日立物流	209,700	2,591.00	543,332,700	

丸和運輸機関	25,100	3,950.00	99,145,000	貸付有価証券 17,500株
C & F ロジホールディングス	104,500	1,319.00	137,835,500	
九州旅客鉄道	1,000,900	3,595.00	3,598,235,500	貸付有価証券 233,000株
日本郵船	8,510,000	217.00	1,846,670,000	貸付有価証券 5,757,000株
商船三井	5,282,000	339.00	1,790,598,000	貸付有価証券 3,216,000株
川崎汽船	3,819,000	273.00	1,042,587,000	貸付有価証券 2,668,000株
N S ユナイテッド海運	450,000	230.00	103,500,000	貸付有価証券 220,000株
明治海運	90,000	408.00	36,720,000	
飯野海運	520,900	497.00	258,887,300	貸付有価証券 30,000株
共栄タンカー	84,000	211.00	17,724,000	貸付有価証券 28,000株
乾汽船	73,400	840.00	61,656,000	貸付有価証券 100株
日本航空	1,770,000	3,504.00	6,202,080,000	
A N A ホールディングス	18,697,000	378.60	7,078,684,200	貸付有価証券 4,897,000株
パスコ	92,000	369.00	33,948,000	貸付有価証券 63,000株
トランコム	29,100	5,440.00	158,304,000	貸付有価証券 6,000株
日新	412,000	519.00	213,828,000	貸付有価証券 50,000株
三菱倉庫	660,000	1,471.00	970,860,000	貸付有価証券 79,000株
三井倉庫ホールディングス	584,000	309.00	180,456,000	貸付有価証券 412,000株
住友倉庫	735,000	715.00	525,525,000	貸付有価証券 120,000株
澁澤倉庫	262,000	364.00	95,368,000	
東陽倉庫	173,000	298.00	51,554,000	
日本トランスシティ	231,000	448.00	103,488,000	
ケイヒン	184,000	160.00	29,440,000	
中央倉庫	58,100	1,069.00	62,108,900	
安田倉庫	78,200	741.00	57,946,200	
東洋埠頭	291,000	185.00	53,835,000	
宇徳	81,300	464.00	37,723,200	貸付有価証券 100株
上組	1,201,000	1,165.00	1,399,165,000	貸付有価証券 20,000株
サンリツ	24,200	698.00	16,891,600	
キムラユニティ	25,500	1,156.00	29,478,000	

キユーソー流通システム	31,700	2,749.00	87,143,300	貸付有価証券 16,100株
郵船ロジスティクス	92,600	1,003.00	92,877,800	
近鉄エクスプレス	180,200	1,857.00	334,631,400	貸付有価証券 58,000株
東海運	54,100	429.00	23,208,900	貸付有価証券 300株
エーアイティー	61,800	1,008.00	62,294,400	貸付有価証券 1,900株
内外トランスライン	30,300	1,292.00	39,147,600	
N E C ネットズエスアイ	109,000	2,482.00	270,538,000	
システナ	79,300	2,185.00	173,270,500	貸付有価証券 20,000株
デジタルアーツ	44,200	3,880.00	171,496,000	貸付有価証券 21,700株
新日鉄住金ソリューションズ	155,600	2,555.00	397,558,000	
キューブシステム	57,300	847.00	48,533,100	
コア	41,700	1,463.00	61,007,100	貸付有価証券 2,300株
ソフトクリエイティブホールディングス	47,400	1,449.00	68,682,600	貸付有価証券 11,300株
T I S	329,500	3,035.00	1,000,032,500	
ネオス	29,300	483.00	14,151,900	貸付有価証券 12,600株
電算システム	34,500	1,756.00	60,582,000	貸付有価証券 3,300株
グリー	605,300	936.00	566,560,800	貸付有価証券 50,000株
コーエーテックモホールディングス	235,900	2,154.00	508,128,600	
三菱総合研究所	42,400	3,255.00	138,012,000	
ボルテージ	17,800	1,563.00	27,821,400	貸付有価証券 9,800株
電算	11,100	2,189.00	24,297,900	貸付有価証券 4,200株
A G S	25,100	1,601.00	40,185,100	
ファインデックス	73,500	912.00	67,032,000	貸付有価証券 25,400株
ヒト・コミュニケーションズ	22,400	2,076.00	46,502,400	貸付有価証券 10,000株
ブレインパッド	21,100	1,300.00	27,430,000	貸付有価証券 13,800株
K L a b	190,100	1,920.00	364,992,000	貸付有価証券 127,000株
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	71,500	1,515.00	108,322,500	
イーブックイニシアティブジャパン	15,500	1,123.00	17,406,500	
ネクソン	1,097,800	2,121.00	2,328,433,800	
アイスタイル	223,700	848.00	189,697,600	貸付有価証券 1,000株

エムアップ	28,100	1,830.00	51,423,000	貸付有価証券 19,600株
エイチーム	67,000	2,900.00	194,300,000	貸付有価証券 36,600株
テクノスジャパン	76,500	1,124.00	85,986,000	貸付有価証券 45,400株
e n i s h	29,300	2,799.00	82,010,700	貸付有価証券 20,600株
コロプラ	318,800	1,137.00	362,475,600	貸付有価証券 194,500株
モバイルクリエイト	72,400	419.00	30,335,600	貸付有価証券 36,300株
オルトプラス	44,400	1,150.00	51,060,000	貸付有価証券 28,400株
ブロードリーフ	245,000	699.00	171,255,000	貸付有価証券 57,000株
ハーツユナイテッドグループ	52,300	1,717.00	89,799,100	貸付有価証券 34,600株
メディアドゥ	28,300	2,670.00	75,561,000	貸付有価証券 2,400株
ブイキューブ	54,500	586.00	31,937,000	貸付有価証券 22,800株
サイバーリンクス	15,100	1,257.00	18,980,700	
ディー・エル・イー	44,100	597.00	26,327,700	貸付有価証券 31,300株
フィックスターズ	16,800	4,205.00	70,644,000	貸付有価証券 11,800株
VOYAGE GROUP	49,400	2,413.00	119,202,200	貸付有価証券 6,600株
オブティム	20,800	2,948.00	61,318,400	貸付有価証券 10,800株
セレス	23,500	1,532.00	36,002,000	貸付有価証券 16,500株
ベリサーブ	11,400	3,380.00	38,532,000	貸付有価証券 7,900株
ティーガイア	98,900	2,115.00	209,173,500	貸付有価証券 64,400株
日本アジアグループ	112,400	431.00	48,444,400	
豆蔵ホールディングス	72,900	982.00	71,587,800	貸付有価証券 9,800株
テクマトリックス	61,900	1,788.00	110,677,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,084,400	291.00	606,560,400	
GMOペイメントゲートウェイ	69,700	6,160.00	429,352,000	貸付有価証券 35,500株
ザッパラス	51,000	519.00	26,469,000	
システムリサーチ	9,800	2,193.00	21,491,400	
インターネットイニシアティブ	146,100	2,040.00	298,044,000	
さくらインターネット	80,700	912.00	73,598,400	貸付有価証券 47,200株
GMOクラウド	21,900	3,720.00	81,468,000	貸付有価証券 15,400株

S R Aホールディングス	52,400	3,090.00	161,916,000	
M i n o r iソリューションズ	22,100	1,298.00	28,685,800	
システムインテグレータ	13,600	771.00	10,485,600	貸付有価証券 2,200株
朝日ネット	90,300	520.00	46,956,000	
アドソル日進	26,100	1,202.00	31,372,200	貸付有価証券 10,200株
フリービット	73,200	924.00	67,636,800	貸付有価証券 51,600株
コムチュア	16,800	4,800.00	80,640,000	貸付有価証券 2,900株
サイバーコム	17,500	1,085.00	18,987,500	貸付有価証券 12,600株
メディカル・データ・ビジョン	43,800	2,664.00	116,683,200	貸付有価証券 2,200株
g u m i	112,800	1,365.00	153,972,000	貸付有価証券 74,200株
ショーケース・ティービー	14,800	1,187.00	17,567,600	貸付有価証券 10,300株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	14,500	1,960.00	28,420,000	貸付有価証券 10,300株
P C Iホールディングス	16,400	2,557.00	41,934,800	貸付有価証券 6,500株
パイプドHD	17,700	1,213.00	21,470,100	貸付有価証券 5,300株
アイピーシー	10,100	1,089.00	10,998,900	貸付有価証券 7,000株
オープンドア	13,000	3,160.00	41,080,000	貸付有価証券 6,000株
L I N E	223,100	3,845.00	857,819,500	貸付有価証券 155,400株
オークネット	30,800	1,384.00	42,627,200	
A O I T Y O H o l d i n g s	81,000	1,098.00	88,938,000	
マクロミル	127,500	2,546.00	324,615,000	
ソルクシーズ	37,700	792.00	29,858,400	貸付有価証券 26,900株
フェイス	26,200	1,179.00	30,889,800	貸付有価証券 17,200株
ハイマックス	13,100	1,611.00	21,104,100	
野村総合研究所	743,100	4,285.00	3,184,183,500	
サイバネットシステム	81,000	720.00	58,320,000	貸付有価証券 49,500株
C Eホールディングス	13,900	1,119.00	15,554,100	
インテージホールディングス	56,600	2,244.00	127,010,400	貸付有価証券 21,300株
東邦システムサイエンス	32,600	724.00	23,602,400	
ソースネクスト	59,500	612.00	36,414,000	
フォーカスシステムズ	51,000	1,223.00	62,373,000	貸付有価証券 15,700株

クレスコ	22,500	3,390.00	76,275,000	
フジ・メディア・ホールディングス	1,035,300	1,515.00	1,568,479,500	貸付有価証券 174,800株
オービック	342,700	6,790.00	2,326,933,000	
ジャストシステム	160,700	1,584.00	254,548,800	貸付有価証券 29,800株
TDCソフトウェアエンジニアリング	43,300	1,232.00	53,345,600	
ヤフー	7,125,100	487.00	3,469,923,700	貸付有価証券 4,972,100株
トレンドマイクロ	526,500	5,690.00	2,995,785,000	
インフォメーション・ディベロプメント	28,500	1,416.00	40,356,000	貸付有価証券 14,400株
日本オラクル	159,800	7,310.00	1,168,138,000	
アルファシステムズ	32,600	2,101.00	68,492,600	
フューチャー	134,200	928.00	124,537,600	
CAC Holdings	74,100	1,012.00	74,989,200	
ソフトバンク・テクノロジー	47,700	1,994.00	95,113,800	貸付有価証券 20,800株
トーセ	26,800	2,450.00	65,660,000	貸付有価証券 18,500株
オービックビジネスコンサルタント	50,500	5,720.00	288,860,000	貸付有価証券 20,400株
伊藤忠テクノソリューションズ	225,200	3,915.00	881,658,000	
アイティフォー	128,900	629.00	81,078,100	
東計電算	17,600	2,740.00	48,224,000	
エクスネット	18,300	892.00	16,323,600	
大塚商会	267,400	6,830.00	1,826,342,000	
サイボウズ	132,000	498.00	65,736,000	貸付有価証券 14,400株
ソフトブレーン	135,900	502.00	68,221,800	貸付有価証券 42,200株
電通国際情報サービス	61,200	2,542.00	155,570,400	貸付有価証券 40,800株
デジタルガレージ	192,300	2,072.00	398,445,600	貸付有価証券 47,400株
EMシステムズ	34,000	2,560.00	87,040,000	貸付有価証券 14,900株
ウェザーニューズ	33,300	3,470.00	115,551,000	貸付有価証券 22,400株
C I J	83,500	557.00	46,509,500	
東洋ビジネスエンジニアリング	9,900	1,740.00	17,226,000	
日本エンタープライズ	102,200	271.00	27,696,200	貸付有価証券 2,800株
WOWOW	47,400	3,085.00	146,229,000	貸付有価証券 32,300株
スカラ	68,500	857.00	58,704,500	貸付有価証券 44,900株
日本コロムビア	30,000	688.00	20,640,000	貸付有価証券 10,800株

イマジカ・ロボット ホールディングス	84,000	723.00	60,732,000	貸付有価証券 7,300株
ネットワンシステムズ	430,400	1,100.00	473,440,000	
システムソフト	234,900	161.00	37,818,900	貸付有価証券 164,400株
アルゴグラフィックス	45,400	2,532.00	114,952,800	
マーベラス	167,600	1,109.00	185,868,400	貸付有価証券 118,200株
エイベックス・グループ・ホールディングス	183,000	1,484.00	271,572,000	
日本ユニシス	274,400	1,840.00	504,896,000	貸付有価証券 5,000株
兼松エレクトロニクス	62,700	3,560.00	223,212,000	
東京放送ホールディングス	655,200	1,903.00	1,246,845,600	
日本テレビホールディングス	907,600	1,829.00	1,660,000,400	
朝日放送	98,100	802.00	78,676,200	
テレビ朝日ホールディングス	271,600	1,927.00	523,373,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	646,700	475.00	307,182,500	貸付有価証券 93,100株
テレビ東京ホールディングス	81,000	2,220.00	179,820,000	貸付有価証券 53,900株
日本BS放送	33,400	1,256.00	41,950,400	貸付有価証券 13,400株
ビジョン	30,500	2,445.00	74,572,500	
U - N E X T	26,000	1,107.00	28,782,000	貸付有価証券 16,200株
ワイヤレスゲート	45,900	1,464.00	67,197,600	貸付有価証券 21,800株
コネクシオ	87,500	1,973.00	172,637,500	貸付有価証券 10,000株
日本通信	855,200	165.00	141,108,000	貸付有価証券 470,600株
クロップス	20,600	591.00	12,174,600	
日本電信電話	7,980,700	5,294.00	42,249,825,800	貸付有価証券 42,700株
K D D I	9,710,100	2,989.50	29,028,343,950	
光通信	119,500	11,560.00	1,381,420,000	貸付有価証券 11,900株
N T T ドコモ	7,317,900	2,650.00	19,392,435,000	貸付有価証券 189,000株
エムティーアイ	133,000	707.00	94,031,000	貸付有価証券 54,500株
G M O インターネット	362,700	1,401.00	508,142,700	貸付有価証券 256,100株
アイドママーケティングコミュニケーション	12,900	710.00	9,159,000	
カドカワ	288,200	1,409.00	406,073,800	
学研ホールディングス	33,100	3,220.00	106,582,000	
ゼンリン	131,400	3,215.00	422,451,000	貸付有価証券 91,100株
昭文社	57,300	717.00	41,084,100	

インプレスホールディングス	83,100	141.00	11,717,100	貸付有価証券 7,000株
アイネット	55,800	1,328.00	74,102,400	
松竹	654,000	1,398.00	914,292,000	貸付有価証券 130,000株
東宝	650,200	3,385.00	2,200,927,000	
東映	370,000	1,077.00	398,490,000	貸付有価証券 22,000株
エヌ・ティ・ティ・データ	3,070,600	1,226.00	3,764,555,600	貸付有価証券 92,000株
ピー・シー・エー	14,400	1,451.00	20,894,400	
ビジネスブレイン太田昭和	16,700	1,048.00	17,501,600	
D T S	102,500	3,445.00	353,112,500	貸付有価証券 3,000株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	382,800	3,495.00	1,337,886,000	貸付有価証券 10,000株
シーイーシー	58,800	2,108.00	123,950,400	貸付有価証券 5,000株
カプコン	233,000	2,551.00	594,383,000	貸付有価証券 135,500株
アイ・エス・ビー	19,200	1,528.00	29,337,600	貸付有価証券 13,300株
ジャステック	63,100	1,244.00	78,496,400	貸付有価証券 2,000株
S C S K	270,200	4,820.00	1,302,364,000	
日本システムウエア	32,600	1,769.00	57,669,400	貸付有価証券 13,200株
アイネス	125,300	1,120.00	140,336,000	貸付有価証券 5,000株
T K C	91,900	3,215.00	295,458,500	
富士ソフト	147,600	3,145.00	464,202,000	
N S D	210,900	2,007.00	423,276,300	
コナミホールディングス	448,800	5,960.00	2,674,848,000	貸付有価証券 11,500株
福井コンピュータホールディングス	28,800	3,620.00	104,256,000	貸付有価証券 19,600株
J B C Cホールディングス	83,000	833.00	69,139,000	
ミロク情報サービス	98,000	2,283.00	223,734,000	
ソフトバンクグループ	4,475,200	8,934.00	39,981,436,800	代用有価証券 53,700株
ハウスイ	79,000	125.00	9,875,000	
高千穂交易	38,200	1,069.00	40,835,800	
伊藤忠食品	24,500	4,635.00	113,557,500	
エレマテック	39,700	1,836.00	72,889,200	
J A L U X	32,000	2,702.00	86,464,000	貸付有価証券 7,900株
あらた	45,100	3,830.00	172,733,000	貸付有価証券 32,100株
トーメンデバイス	14,900	2,205.00	32,854,500	



東京エレクトロン デバイス	35,900	1,676.00	60,168,400	
フィールズ	76,000	1,195.00	90,820,000	貸付有価証券 35,800株
双日	5,871,200	281.00	1,649,807,200	
アルフレッサ ホールディングス	1,176,100	2,107.00	2,478,042,700	
横浜冷凍	233,900	1,057.00	247,232,300	貸付有価証券 45,200株
神栄	136,000	168.00	22,848,000	貸付有価証券 53,000株
山下医科器械	7,900	1,786.00	14,109,400	貸付有価証券 5,200株
ラサ商事	42,600	965.00	41,109,000	
ラクーン	63,000	652.00	41,076,000	貸付有価証券 43,800株
アルコニックス	56,500	1,985.00	112,152,500	
神戸物産	53,500	5,110.00	273,385,000	
あい ホールディングス	141,600	2,937.00	415,879,200	貸付有価証券 86,300株
ディーブイエックス	35,300	1,291.00	45,572,300	貸付有価証券 20,600株
ダイワボウホールディングス	844,000	405.00	341,820,000	貸付有価証券 85,000株
マクニカ・富士エレホールディングス	183,800	1,632.00	299,961,600	貸付有価証券 34,000株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	186,700	893.00	166,723,100	
八洲電機	76,600	800.00	61,280,000	
メディアスホールディングス	15,200	3,000.00	45,600,000	貸付有価証券 10,600株
U K C ホールディングス	63,800	1,887.00	120,390,600	
大光	22,800	1,127.00	25,695,600	
O C H I ホールディングス	28,700	1,330.00	38,171,000	貸付有価証券 16,400株
T O K A I ホールディングス	437,000	829.00	362,273,000	貸付有価証券 307,000株
大阪工機	14,900	800.00	11,920,000	
三洋貿易	54,500	2,656.00	144,752,000	
ビューティガレージ	13,100	1,551.00	20,318,100	
ウイン・パートナーズ	71,500	1,293.00	92,449,500	
ミタチ産業	23,000	654.00	15,042,000	
シップヘルスケアホールディングス	190,800	3,395.00	647,766,000	
明治電機工業	34,200	1,332.00	45,554,400	貸付有価証券 9,500株
デリカフーズ	20,900	1,674.00	34,986,600	
スターティア	22,300	657.00	14,651,100	貸付有価証券 16,000株
コメダホールディングス	179,800	1,819.00	327,056,200	貸付有価証券 74,200株
富士興産	35,300	515.00	18,179,500	

協栄産業	121,000	184.00	22,264,000	
小野建	86,400	1,770.00	152,928,000	
佐島電機	73,000	846.00	61,758,000	
エコートレーディング	22,800	718.00	16,370,400	
伯東	67,900	1,458.00	98,998,200	
コンドーテック	78,600	977.00	76,792,200	
中山福	56,900	791.00	45,007,900	貸付有価証券 2,500株
ナガイレーベン	131,500	2,541.00	334,141,500	貸付有価証券 15,500株
三菱食品	109,100	3,165.00	345,301,500	貸付有価証券 31,100株
松田産業	72,300	1,472.00	106,425,600	貸付有価証券 3,400株
第一興商	161,700	5,110.00	826,287,000	貸付有価証券 1,000株
メディバルホールディングス	994,200	2,026.00	2,014,249,200	
S P K	21,200	2,643.00	56,031,600	貸付有価証券 100株
萩原電気	33,800	2,214.00	74,833,200	
アズワン	77,600	5,330.00	413,608,000	貸付有価証券 12,600株
スズデン	35,500	1,290.00	45,795,000	貸付有価証券 6,500株
尾家産業	31,800	1,211.00	38,509,800	
シモジマ	60,600	1,115.00	67,569,000	
ドウシシャ	116,900	2,155.00	251,919,500	
小津産業	21,700	2,157.00	46,806,900	貸付有価証券 200株
高速	59,000	1,059.00	62,481,000	
たけびし	34,700	1,423.00	49,378,100	貸付有価証券 15,400株
黒田電気	135,700	2,144.00	290,940,800	貸付有価証券 17,000株
リックス	22,300	1,783.00	39,760,900	
丸文	87,900	788.00	69,265,200	
ハビネット	82,700	1,917.00	158,535,900	
橋本総業ホールディングス	20,400	1,631.00	33,272,400	
日本ライフライン	113,100	4,540.00	513,474,000	
エクセル	42,600	1,442.00	61,429,200	
マルカキカイ	32,100	1,883.00	60,444,300	
I D O M	267,400	779.00	208,304,600	貸付有価証券 188,700株
日本エム・ディ・エム	74,800	938.00	70,162,400	
進和	58,600	2,130.00	124,818,000	
エスケイジャパン	19,300	292.00	5,635,600	貸付有価証券 8,700株

ダイترون	45,300	1,429.00	64,733,700	
シークス	70,900	4,410.00	312,669,000	貸付有価証券 46,300株
田中商事	30,300	732.00	22,179,600	貸付有価証券 200株
オーハシテクニカ	55,800	1,410.00	78,678,000	
白銅	24,800	1,742.00	43,201,600	
伊藤忠商事	7,281,200	1,713.00	12,472,695,600	
丸紅	9,784,200	739.50	7,235,415,900	
高島	172,000	207.00	35,604,000	
長瀬産業	597,700	1,725.00	1,031,032,500	
蝶理	63,300	2,046.00	129,511,800	貸付有価証券 12,000株
豊田通商	1,107,400	3,355.00	3,715,327,000	
三共生興	149,900	388.00	58,161,200	
兼松	2,114,000	237.00	501,018,000	貸付有価証券 250,000株
ツカモトコーポレーション	177,000	128.00	22,656,000	
三井物産	8,990,000	1,608.00	14,455,920,000	貸付有価証券 232,600株
日本紙パルプ商事	517,000	427.00	220,759,000	
日立ハイテクノロジーズ	344,600	4,280.00	1,474,888,000	
カメイ	129,300	1,521.00	196,665,300	
東都水産	15,100	1,865.00	28,161,500	
OUGホールディングス	156,000	263.00	41,028,000	
スターゼン	41,500	4,650.00	192,975,000	貸付有価証券 27,600株
山善	381,600	1,133.00	432,352,800	貸付有価証券 60,000株
椿本興業	112,000	428.00	47,936,000	
住友商事	6,258,200	1,482.50	9,277,781,500	
内田洋行	45,600	2,809.00	128,090,400	
三菱商事	7,459,700	2,396.00	17,873,441,200	
第一実業	225,000	612.00	137,700,000	
キャノンマーケティングジャパン	283,600	2,489.00	705,880,400	
西華産業	308,000	401.00	123,508,000	
佐藤商事	88,700	905.00	80,273,500	
菱洋エレクトロ	92,200	1,804.00	166,328,800	貸付有価証券 24,700株
東京産業	98,500	440.00	43,340,000	
ユアサ商事	94,100	3,450.00	324,645,000	
神鋼商事	24,900	2,579.00	64,217,100	
小林産業	73,000	319.00	23,287,000	貸付有価証券 48,200株
阪和興業	993,000	808.00	802,344,000	
カナデン	94,800	1,142.00	108,261,600	

菱電商事	157,000	797.00	125,129,000	
フルサト工業	54,700	1,668.00	91,239,600	
岩谷産業	1,101,000	698.00	768,498,000	貸付有価証券 7,000株
すてきナイスグループ	423,000	159.00	67,257,000	
昭光通商	352,000	99.00	34,848,000	
ニチモウ	142,000	176.00	24,992,000	
極東貿易	152,000	276.00	41,952,000	
イワキ	149,000	439.00	65,411,000	貸付有価証券 103,000株
三愛石油	266,500	1,147.00	305,675,500	貸付有価証券 7,000株
稲畑産業	238,300	1,482.00	353,160,600	
G S I クレオス	242,000	140.00	33,880,000	
明和産業	91,300	434.00	39,624,200	貸付有価証券 3,000株
ワキタ	211,500	1,295.00	273,892,500	貸付有価証券 36,000株
東邦ホールディングス	318,300	2,146.00	683,071,800	貸付有価証券 66,400株
サンゲツ	337,300	1,951.00	658,072,300	
ミツウロコグループホールディングス	159,800	714.00	114,097,200	
シナネンホールディングス	42,700	2,246.00	95,904,200	貸付有価証券 14,000株
伊藤忠エネクス	219,300	959.00	210,308,700	貸付有価証券 43,100株
サンリオ	306,400	2,155.00	660,292,000	貸付有価証券 20,600株
サンワテクノス	58,700	1,493.00	87,639,100	
リョーサン	133,700	4,205.00	562,208,500	貸付有価証券 21,500株
新光商事	108,800	1,374.00	149,491,200	
トーヨー	44,800	3,025.00	135,520,000	
三信電気	109,900	1,436.00	157,816,400	貸付有価証券 6,000株
東陽テクニカ	114,200	1,082.00	123,564,400	貸付有価証券 62,600株
モスフードサービス	130,100	3,355.00	436,485,500	貸付有価証券 83,800株
加賀電子	89,700	2,321.00	208,193,700	
ソーダニッカ	102,300	521.00	53,298,300	
立花エレテック	67,200	1,510.00	101,472,000	
フォーバル	43,300	762.00	32,994,600	
P A L T A C	159,000	3,845.00	611,355,000	貸付有価証券 15,000株
三谷産業	105,700	419.00	44,288,300	貸付有価証券 1,500株
太平洋興発	413,000	103.00	42,539,000	

ヤマタネ	49,700	1,618.00	80,414,600	
丸紅建材リース	96,000	222.00	21,312,000	
日鉄住金物産	87,100	5,580.00	486,018,000	
トラスコ中山	227,100	2,759.00	626,568,900	貸付有価証券 20,000株
オートバックスセブン	368,000	1,844.00	678,592,000	貸付有価証券 161,800株
モリト	79,400	916.00	72,730,400	
加藤産業	155,100	2,910.00	451,341,000	貸付有価証券 10,000株
イノテック	85,400	650.00	55,510,000	
イエローハット	93,700	2,723.00	255,145,100	貸付有価証券 16,000株
J Kホールディングス	99,500	671.00	66,764,500	
日伝	41,100	3,815.00	156,796,500	
北沢産業	81,600	202.00	16,483,200	
杉本商事	57,000	1,543.00	87,951,000	
因幡電機産業	139,500	4,240.00	591,480,000	
バイテックホールディングス	40,400	1,412.00	57,044,800	貸付有価証券 9,800株
ミスミグループ本社	1,133,000	2,606.00	2,952,598,000	貸付有価証券 52,000株
アルテック	84,800	234.00	19,843,200	
タキヒヨー	150,000	468.00	70,200,000	
蔵王産業	16,300	1,453.00	23,683,900	
スズケン	452,500	3,635.00	1,644,837,500	貸付有価証券 18,000株
ジェコス	68,400	1,332.00	91,108,800	
ルネサスイーストン	90,700	591.00	53,603,700	
ローソン	313,700	7,350.00	2,305,695,000	貸付有価証券 17,900株
サンエー	75,000	4,720.00	354,000,000	
カワチ薬品	76,900	2,672.00	205,476,800	貸付有価証券 38,000株
エービーシー・マート	180,700	6,400.00	1,156,480,000	貸付有価証券 5,000株
ハードオフコーポレーション	43,600	1,120.00	48,832,000	
アスクル	103,700	3,680.00	381,616,000	貸付有価証券 67,800株
ゲオホールディングス	166,100	1,163.00	193,174,300	貸付有価証券 116,100株
アダストリア	152,600	2,799.00	427,127,400	
ジーフット	59,900	793.00	47,500,700	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	12,300	771.00	9,483,300	貸付有価証券 5,800株
くらコーポレーション	64,700	5,260.00	340,322,000	貸付有価証券 17,000株

キャンドウ	52,400	1,683.00	88,189,200	貸付有価証券 17,300株
パルグループホールディングス	50,600	2,846.00	144,007,600	
エディオン	385,300	997.00	384,144,100	貸付有価証券 262,700株
サーラコーポレーション	123,900	765.00	94,783,500	
ワッツ	39,300	1,277.00	50,186,100	
ハローズ	32,600	2,310.00	75,306,000	
あみやき亭	19,300	4,125.00	79,612,500	貸付有価証券 8,300株
ひらまつ	136,800	645.00	88,236,000	
ゲンキー	39,700	3,060.00	121,482,000	貸付有価証券 28,000株
大黒天物産	23,700	5,540.00	131,298,000	
ハニーズホールディングス	96,000	1,176.00	112,896,000	貸付有価証券 42,700株
ファーマライズホールディングス	23,100	527.00	12,173,700	貸付有価証券 11,400株
アルペン	76,000	1,953.00	148,428,000	貸付有価証券 33,600株
クオール	112,100	1,688.00	189,224,800	
ジンス	67,500	6,050.00	408,375,000	貸付有価証券 47,300株
ビックカメラ	570,800	1,168.00	666,694,400	
D C Mホールディングス	603,200	960.00	579,072,000	貸付有価証券 412,800株
MonotaRO	352,400	3,505.00	1,235,162,000	貸付有価証券 194,900株
東京一番フーズ	24,900	579.00	14,417,100	貸付有価証券 14,900株
ダイヤモンドダイニング	22,000	2,196.00	48,312,000	貸付有価証券 200株
きちり	26,200	667.00	17,475,400	
アークランドサービスホールディングス	82,800	1,868.00	154,670,400	
J.フロント リテイリング	1,257,800	1,630.00	2,050,214,000	
ドトール・日レスホールディングス	174,100	2,387.00	415,576,700	貸付有価証券 500株
マツモトキヨシホールディングス	188,000	6,320.00	1,188,160,000	
ブロンコピラー	51,900	2,607.00	135,303,300	貸付有価証券 36,800株
スタートトゥデイ	907,400	2,706.00	2,455,424,400	貸付有価証券 8,000株
トレジャー・ファクトリー	28,100	798.00	22,423,800	貸付有価証券 16,300株
物語コーポレーション	28,200	5,600.00	157,920,000	貸付有価証券 14,400株
ココカラファイン	103,600	5,360.00	555,296,000	
三越伊勢丹ホールディングス	1,978,000	1,108.00	2,191,624,000	貸付有価証券 22,900株

H a m e e	29,900	1,603.00	47,929,700	貸付有価証券 20,400株
ウエルシアホールディングス	262,300	4,035.00	1,058,380,500	
クリエイティブSDホールディングス	146,300	2,517.00	368,237,100	貸付有価証券 20,000株
丸善CHIホールディングス	115,700	364.00	42,114,800	貸付有価証券 50,600株
ミサワ	18,200	451.00	8,208,200	
ティーライフ	13,300	1,704.00	22,663,200	貸付有価証券 9,300株
エー・ピーカンパニー	16,400	890.00	14,596,000	貸付有価証券 10,900株
チムニー	30,200	2,802.00	84,620,400	貸付有価証券 10,700株
シュッピン	37,400	2,054.00	76,819,600	貸付有価証券 3,600株
ネクステージ	38,900	1,913.00	74,415,700	貸付有価証券 24,900株
ジョイフル本田	161,400	3,215.00	518,901,000	貸付有価証券 81,900株
鳥貴族	36,300	2,550.00	92,565,000	貸付有価証券 25,700株
麒麟堂ホールディングス	32,000	990.00	31,680,000	
ホットランド	46,000	1,381.00	63,526,000	貸付有価証券 32,300株
すかいらーく	429,400	1,665.00	714,951,000	貸付有価証券 65,100株
綿半ホールディングス	40,100	2,387.00	95,718,700	貸付有価証券 12,700株
ヨシックス	12,900	1,638.00	21,130,200	貸付有価証券 9,000株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	329,400	1,080.00	355,752,000	貸付有価証券 110,000株
ブックオフコーポレーション	56,400	793.00	44,725,200	貸付有価証券 34,800株
ゴルフダイジェスト・オンライン	39,900	788.00	31,441,200	貸付有価証券 20,200株
B E E N O S	15,400	1,418.00	21,837,200	
あさひ	73,800	1,314.00	96,973,200	貸付有価証券 24,600株
日本調剤	35,100	3,520.00	123,552,000	貸付有価証券 5,400株
コスモス薬品	50,000	21,560.00	1,078,000,000	貸付有価証券 4,000株
トーエル	47,800	901.00	43,067,800	
一六堂	21,400	391.00	8,367,400	
オンリー	14,700	823.00	12,098,100	
セブン&アイ・ホールディングス	4,160,900	4,560.00	18,973,704,000	
薬王堂	49,400	2,929.00	144,692,600	貸付有価証券 9,500株

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	266,600	1,013.00	270,065,800	貸付有価証券 188,300株
ツルハホールディングス	199,000	11,670.00	2,322,330,000	
サンマルクホールディングス	64,100	3,405.00	218,260,500	
フェリシモ	28,400	1,143.00	32,461,200	
トリドールホールディングス	122,100	2,849.00	347,862,900	貸付有価証券 51,800株
TOKYO BASE	12,700	5,010.00	63,627,000	貸付有価証券 8,100株
サツドラホールディングス	13,100	1,967.00	25,767,700	
ダイユー・リックホールディングス	32,200	794.00	25,566,800	
パロックジャパンリミテッド	78,300	1,225.00	95,917,500	貸付有価証券 55,000株
クスリのアオキホールディングス	78,700	5,700.00	448,590,000	
スシローグローバルホールディングス	90,200	3,335.00	300,817,000	貸付有価証券 10,000株
LIXILビバ	94,400	2,000.00	188,800,000	
メディカルシステムネットワーク	112,100	495.00	55,489,500	
総合メディカル	48,000	4,715.00	226,320,000	貸付有価証券 25,400株
はるやまホールディングス	46,400	992.00	46,028,800	
ノジマ	154,900	1,713.00	265,343,700	
カッパ・クリエイト	139,100	1,253.00	174,292,300	貸付有価証券 55,100株
ライトオン	83,400	971.00	80,981,400	貸付有価証券 45,100株
ジーンズメイト	31,600	725.00	22,910,000	貸付有価証券 22,400株
良品計画	131,700	27,110.00	3,570,387,000	貸付有価証券 15,600株
三城ホールディングス	123,400	464.00	57,257,600	貸付有価証券 2,000株
アドヴァン	101,000	1,127.00	113,827,000	貸付有価証券 8,000株
アルピス	26,000	4,700.00	122,200,000	貸付有価証券 14,300株
コナカ	126,700	593.00	75,133,100	
ハウス オブ ローゼ	12,100	1,551.00	18,767,100	貸付有価証券 7,400株
G-7ホールディングス	29,300	2,142.00	62,760,600	
イオン北海道	99,700	606.00	60,418,200	貸付有価証券 26,400株
コジマ	171,100	304.00	52,014,400	貸付有価証券 21,600株
ヒマラヤ	26,900	870.00	23,403,000	貸付有価証券 7,000株
コーナン商事	141,000	2,048.00	288,768,000	貸付有価証券 98,600株
エコス	39,700	1,205.00	47,838,500	



ワタミ	117,300	1,341.00	157,299,300	貸付有価証券 5,900株
マルシェ	22,300	823.00	18,352,900	貸付有価証券 13,600株
ドンキホーテホールディングス	643,100	4,090.00	2,630,279,000	貸付有価証券 155,200株
西松屋チェーン	174,100	1,181.00	205,612,100	貸付有価証券 120,800株
ゼンショーホールディングス	514,800	2,002.00	1,030,629,600	
幸楽苑ホールディングス	63,000	1,805.00	113,715,000	貸付有価証券 38,000株
ハークスレイ	24,100	1,099.00	26,485,900	貸付有価証券 2,000株
サイゼリヤ	147,100	3,200.00	470,720,000	貸付有価証券 18,700株
V Tホールディングス	336,000	567.00	190,512,000	
魚力	30,900	1,236.00	38,192,400	貸付有価証券 2,200株
ポブラ	24,800	571.00	14,160,800	貸付有価証券 3,500株
フジ・コーポレーション	14,700	1,984.00	29,164,800	
ユナイテッドアローズ	132,300	3,435.00	454,450,500	貸付有価証券 5,000株
ハイデイ日高	108,500	2,944.00	319,424,000	
京都きもの友禅	62,900	928.00	58,371,200	貸付有価証券 23,700株
コロワイド	329,600	1,879.00	619,318,400	貸付有価証券 232,900株
ピーシーデポコーポレーション	131,600	572.00	75,275,200	貸付有価証券 78,500株
壺番屋	69,900	3,790.00	264,921,000	貸付有価証券 36,300株
トップカルチャー	36,000	495.00	17,820,000	貸付有価証券 17,300株
P L A N T	22,700	1,216.00	27,603,200	
スギホールディングス	217,900	5,370.00	1,170,123,000	貸付有価証券 28,000株
ヴィア・ホールディングス	75,300	966.00	72,739,800	貸付有価証券 44,200株
スクロール	150,200	374.00	56,174,800	
ヨンドシーホールディングス	100,900	2,634.00	265,770,600	貸付有価証券 71,300株
ユニー・ファミリーマートホールディングス	435,900	6,230.00	2,715,657,000	貸付有価証券 161,000株
木曽路	121,600	2,680.00	325,888,000	貸付有価証券 24,100株
サトレストランシステムズ	116,900	901.00	105,326,900	貸付有価証券 77,400株
千趣会	179,700	782.00	140,525,400	
タカキュー	76,400	196.00	14,974,400	貸付有価証券 44,400株

ケーヨー	167,400	830.00	138,942,000	貸付有価証券 27,400株
上新電機	234,000	1,557.00	364,338,000	
日本瓦斯	182,300	3,575.00	651,722,500	貸付有価証券 91,500株
ロイヤルホールディングス	163,500	2,525.00	412,837,500	貸付有価証券 115,500株
東天紅	80,000	199.00	15,920,000	貸付有価証券 54,000株
いなげや	110,600	1,846.00	204,167,600	貸付有価証券 13,000株
島忠	257,200	2,647.00	680,808,400	
チヨダ	117,100	2,874.00	336,545,400	貸付有価証券 12,000株
ライフコーポレーション	75,200	3,030.00	227,856,000	貸付有価証券 7,000株
リンガーハット	111,900	2,408.00	269,455,200	貸付有価証券 2,700株
さが美	89,000	120.00	10,680,000	
MrMax	123,800	543.00	67,223,400	
テナアライド	91,300	398.00	36,337,400	貸付有価証券 1,200株
AOKIホールディングス	198,500	1,432.00	284,252,000	貸付有価証券 8,300株
オークワ	141,000	1,249.00	176,109,000	
コメリ	153,100	2,828.00	432,966,800	貸付有価証券 10,000株
青山商事	207,900	3,955.00	822,244,500	
しまむら	115,400	13,700.00	1,580,980,000	
はせがわ	52,300	476.00	24,894,800	
高島屋	1,668,000	1,026.00	1,711,368,000	
松屋	216,700	993.00	215,183,100	貸付有価証券 19,000株
エイチ・ツー・オー リテイリング	509,100	1,939.00	987,144,900	
近鉄百貨店	379,000	350.00	132,650,000	貸付有価証券 35,000株
パルコ	95,200	1,306.00	124,331,200	貸付有価証券 33,500株
丸井グループ	1,045,900	1,571.00	1,643,108,900	貸付有価証券 111,500株
アクシアル リテイリング	76,800	4,150.00	318,720,000	
井筒屋	54,200	422.00	22,872,400	貸付有価証券 19,500株
イオン	4,090,600	1,734.00	7,093,100,400	貸付有価証券 2,507,800株
イズミ	179,300	6,100.00	1,093,730,000	
東武ストア	11,900	3,075.00	36,592,500	貸付有価証券 7,000株
平和堂	201,500	2,273.00	458,009,500	

フジ	110,400	2,639.00	291,345,600	
ヤオコー	112,600	4,700.00	529,220,000	
ゼビオホールディングス	134,800	1,960.00	264,208,000	
ケースホールディングス	420,500	2,166.00	910,803,000	貸付有価証券 294,200株
O l y m p i cグループ	58,400	596.00	34,806,400	
日産東京販売ホールディングス	145,900	445.00	64,925,500	貸付有価証券 25,000株
アインホールディングス	129,700	7,990.00	1,036,303,000	貸付有価証券 7,700株
元気寿司	25,000	2,230.00	55,750,000	貸付有価証券 16,000株
ヤマダ電機	3,414,664	565.00	1,929,285,160	貸付有価証券 2,320,200株
アークランドサカモト	168,300	1,491.00	250,935,300	
ニトリホールディングス	429,500	15,220.00	6,536,990,000	
グルメ杵屋	71,000	1,106.00	78,526,000	貸付有価証券 2,000株
愛眼	72,000	215.00	15,480,000	貸付有価証券 48,600株
ケーユーホールディングス	51,700	995.00	51,441,500	貸付有価証券 13,400株
吉野家ホールディングス	346,300	1,839.00	636,845,700	貸付有価証券 86,800株
松屋フーズ	47,700	4,135.00	197,239,500	貸付有価証券 3,500株
サガミチェーン	124,300	1,373.00	170,663,900	
関西スーパーマーケット	80,900	1,507.00	121,916,300	貸付有価証券 44,200株
王将フードサービス	72,800	4,285.00	311,948,000	貸付有価証券 5,000株
プレナス	111,100	2,311.00	256,752,100	貸付有価証券 63,000株
ミニストップ	73,500	2,326.00	170,961,000	貸付有価証券 27,000株
アークス	186,000	2,379.00	442,494,000	
パローホールディングス	214,100	2,486.00	532,252,600	
藤久	7,900	1,720.00	13,588,000	
ベルク	44,100	4,925.00	217,192,500	
大庄	53,000	1,760.00	93,280,000	貸付有価証券 300株
ファーストリテイリング	165,900	36,820.00	6,108,438,000	貸付有価証券 44,900株
サンドラッグ	378,100	4,060.00	1,535,086,000	
サックスパー ホールディングス	93,400	1,235.00	115,349,000	
ヤマザワ	20,500	1,780.00	36,490,000	
やまや	20,300	1,642.00	33,332,600	
ベルーナ	212,900	1,316.00	280,176,400	

島根銀行	21,000	1,314.00	27,594,000	
じもとホールディングス	713,700	202.00	144,167,400	貸付有価証券 52,000株
めぶきフィナンシャルグループ	4,793,800	432.00	2,070,921,600	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	143,800	3,125.00	449,375,000	貸付有価証券 5,200株
九州フィナンシャルグループ	1,630,200	729.00	1,188,415,800	
ゆうちょ銀行	2,814,800	1,444.00	4,064,571,200	
富山第一銀行	252,600	518.00	130,846,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	6,443,600	572.60	3,689,605,360	
西日本フィナンシャルホールディングス	674,200	1,187.00	800,275,400	
新生銀行	9,463,000	193.00	1,826,359,000	貸付有価証券 518,000株
あおぞら銀行	6,289,000	433.00	2,723,137,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	75,335,100	754.00	56,802,665,400	代用有価証券 434,200株
りそなホールディングス	11,630,400	609.70	7,091,054,880	貸付有価証券 1,428,000株
三井住友トラスト・ホールディングス	2,075,500	4,030.00	8,364,265,000	
三井住友フィナンシャルグループ	7,960,700	4,372.00	34,804,180,400	代用有価証券 70,500株
第四銀行	1,218,000	509.00	619,962,000	
北越銀行	107,400	2,637.00	283,213,800	貸付有価証券 12,000株
千葉銀行	3,834,000	809.00	3,101,706,000	
群馬銀行	2,209,200	667.00	1,473,536,400	
武蔵野銀行	158,600	3,460.00	548,756,000	
千葉興業銀行	272,600	596.00	162,469,600	
筑波銀行	413,200	336.00	138,835,200	貸付有価証券 70,000株
七十七銀行	1,558,000	552.00	860,016,000	
青森銀行	770,000	391.00	301,070,000	貸付有価証券 156,000株
秋田銀行	637,000	320.00	203,840,000	
山形銀行	558,000	490.00	273,420,000	貸付有価証券 377,000株
岩手銀行	65,100	4,480.00	291,648,000	貸付有価証券 38,500株
東邦銀行	888,000	393.00	348,984,000	貸付有価証券 30,000株
東北銀行	506,000	152.00	76,912,000	
みちのく銀行	595,000	185.00	110,075,000	貸付有価証券 160,000株
ふくおかフィナンシャルグループ	4,034,000	547.00	2,206,598,000	
静岡銀行	2,623,000	1,020.00	2,675,460,000	
十六銀行	1,335,000	368.00	491,280,000	
スルガ銀行	1,016,500	2,762.00	2,807,573,000	貸付有価証券 136,600株

八十二銀行	1,918,300	726.00	1,392,685,800	
山梨中央銀行	615,000	459.00	282,285,000	貸付有価証券 85,000株
大垣共立銀行	1,536,000	324.00	497,664,000	
福井銀行	849,000	272.00	230,928,000	貸付有価証券 85,000株
北國銀行	1,055,000	427.00	450,485,000	貸付有価証券 100,000株
清水銀行	33,800	3,590.00	121,342,000	貸付有価証券 16,500株
富山銀行	19,200	4,180.00	80,256,000	貸付有価証券 2,000株
滋賀銀行	934,000	587.00	548,258,000	
南都銀行	113,600	3,195.00	362,952,000	
百五銀行	894,000	457.00	408,558,000	
京都銀行	1,779,000	1,050.00	1,867,950,000	貸付有価証券 30,000株
紀陽銀行	373,800	1,969.00	736,012,200	
三重銀行	44,300	2,488.00	110,218,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	661,400	1,837.00	1,214,991,800	貸付有価証券 30,000株
広島銀行	2,934,000	486.00	1,425,924,000	
山陰合同銀行	589,100	917.00	540,204,700	
中国銀行	704,700	1,704.00	1,200,808,800	貸付有価証券 112,400株
鳥取銀行	31,600	1,694.00	53,530,400	
伊予銀行	1,417,800	925.00	1,311,465,000	貸付有価証券 346,700株
百十四銀行	1,091,000	371.00	404,761,000	
四国銀行	762,000	302.00	230,124,000	貸付有価証券 142,000株
阿波銀行	849,000	752.00	638,448,000	貸付有価証券 170,000株
大分銀行	571,000	419.00	239,249,000	貸付有価証券 393,000株
宮崎銀行	662,000	362.00	239,644,000	貸付有価証券 150,000株
佐賀銀行	603,000	262.00	157,986,000	
十八銀行	611,000	304.00	185,744,000	貸付有価証券 10,000株
沖縄銀行	96,700	4,480.00	433,216,000	貸付有価証券 15,000株
琉球銀行	204,800	1,627.00	333,209,600	貸付有価証券 52,300株
セブン銀行	3,726,800	416.00	1,550,348,800	貸付有価証券 2,232,300株
みずほフィナンシャルグループ	134,995,400	205.90	27,795,552,860	代用有価証券 1,456,700株

高知銀行	360,000	124.00	44,640,000	貸付有価証券 112,000株
山口フィナンシャルグループ	930,000	1,340.00	1,246,200,000	貸付有価証券 650,000株
長野銀行	32,700	1,975.00	64,582,500	貸付有価証券 22,800株
名古屋銀行	80,300	4,135.00	332,040,500	貸付有価証券 56,000株
北洋銀行	1,622,700	393.00	637,721,100	
愛知銀行	33,400	6,140.00	205,076,000	貸付有価証券 2,000株
第三銀行	56,200	1,702.00	95,652,400	
中京銀行	40,800	2,308.00	94,166,400	
大光銀行	340,000	235.00	79,900,000	
愛媛銀行	126,400	1,413.00	178,603,200	貸付有価証券 69,800株
トマト銀行	38,300	1,556.00	59,594,800	
みなと銀行	89,900	2,090.00	187,891,000	
京葉銀行	810,000	481.00	389,610,000	貸付有価証券 359,000株
関西アーバン銀行	138,500	1,303.00	180,465,500	
栃木銀行	548,400	468.00	256,651,200	貸付有価証券 110,000株
北日本銀行	30,900	3,145.00	97,180,500	
東和銀行	1,861,000	127.00	236,347,000	
福島銀行	1,079,000	87.00	93,873,000	
大東銀行	516,000	164.00	84,624,000	
トモニホールディングス	819,100	535.00	438,218,500	貸付有価証券 212,200株
フィデアホールディングス	964,700	183.00	176,540,100	貸付有価証券 9,000株
池田泉州ホールディングス	1,054,700	456.00	480,943,200	貸付有価証券 270,000株
F P G	354,800	1,149.00	407,665,200	貸付有価証券 206,100株
S B Iホールディングス	1,123,700	1,541.00	1,731,621,700	貸付有価証券 786,500株
日本アジア投資	95,600	431.00	41,203,600	貸付有価証券 45,300株
ジャフコ	166,200	4,465.00	742,083,000	貸付有価証券 22,000株
大和証券グループ本社	9,035,000	667.40	6,029,959,000	
野村ホールディングス	20,324,300	657.10	13,355,097,530	
岡三証券グループ	847,000	735.00	622,545,000	貸付有価証券 60,000株
丸三証券	316,200	930.00	294,066,000	貸付有価証券 196,100株
東洋証券	355,000	255.00	90,525,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,140,800	630.00	718,704,000	

光世証券	238,000	160.00	38,080,000	貸付有価証券 11,000株
水戸証券	307,500	307.00	94,402,500	貸付有価証券 30,000株
いちよし証券	222,300	941.00	209,184,300	貸付有価証券 75,000株
松井証券	567,600	919.00	521,624,400	
だいこう証券ビジネス	48,000	611.00	29,328,000	
マネックスグループ	1,053,100	306.00	322,248,600	貸付有価証券 665,900株
カブドットコム証券	741,600	376.00	278,841,600	
極東証券	133,300	1,607.00	214,213,100	貸付有価証券 1,200株
岩井コスモホールディングス	93,900	1,253.00	117,656,700	
藍澤証券	185,900	667.00	123,995,300	
マネーパートナーズグループ	126,800	513.00	65,048,400	貸付有価証券 89,000株
小林洋行	28,000	270.00	7,560,000	
かんぽ生命保険	375,300	2,488.00	933,746,400	
S O M P Oホールディングス	2,078,500	4,364.00	9,070,574,000	
アニコム ホールディングス	67,400	2,588.00	174,431,200	貸付有価証券 44,800株
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	2,971,100	3,869.00	11,495,185,900	
ソニーフィナンシャルホールディングス	952,300	2,037.00	1,939,835,100	貸付有価証券 625,800株
第一生命ホールディングス	5,995,100	2,072.50	12,424,844,750	
東京海上ホールディングス	4,003,800	4,752.00	19,026,057,600	
T & Dホールディングス	3,623,400	1,740.00	6,304,716,000	貸付有価証券 76,500株
アドバンスクリエイト	23,200	1,967.00	45,634,400	
全国保証	280,000	4,685.00	1,311,800,000	貸付有価証券 8,800株
クレディセゾン	754,000	2,214.00	1,669,356,000	
アクリーティブ	81,200	402.00	32,642,400	貸付有価証券 43,800株
芙蓉総合リース	113,700	6,450.00	733,365,000	
興銀リース	186,700	2,636.00	492,141,200	
東京センチュリー	200,100	4,675.00	935,467,500	
日本証券金融	437,900	574.00	251,354,600	貸付有価証券 98,900株
アイフル	1,667,300	393.00	655,248,900	貸付有価証券 1,168,400株
ポケットカード	74,700	766.00	57,220,200	貸付有価証券 700株
リコーリース	78,200	3,870.00	302,634,000	貸付有価証券 50,000株
イオンフィナンシャルサービス	634,800	2,393.00	1,519,076,400	貸付有価証券 417,200株

アコム	1,997,000	510.00	1,018,470,000	
ジャックス	549,000	539.00	295,911,000	
オリエントコーポレーション	2,149,400	192.00	412,684,800	
日立キャピタル	234,300	2,730.00	639,639,000	
アプラスフィナンシャル	476,700	109.00	51,960,300	貸付有価証券 206,400株
オリックス	7,040,200	1,775.50	12,499,875,100	貸付有価証券 165,000株
三菱UFJリース	2,521,700	622.00	1,568,497,400	
日本取引所グループ	3,091,100	2,005.00	6,197,655,500	貸付有価証券 109,300株
イー・ギャランティ	29,600	2,575.00	76,220,000	貸付有価証券 18,500株
アサックス	17,200	1,660.00	28,552,000	
NECキャピタルソリューション	40,400	1,782.00	71,992,800	
いちご	945,100	336.00	317,553,600	
日本駐車場開発	1,198,600	163.00	195,371,800	貸付有価証券 531,200株
ヒューリック	2,073,800	1,132.00	2,347,541,600	貸付有価証券 460,200株
三栄建築設計	39,800	1,750.00	69,650,000	
野村不動産ホールディングス	660,200	2,192.00	1,447,158,400	
三重交通グループホールディングス	175,900	389.00	68,425,100	
サムティ	79,800	1,208.00	96,398,400	貸付有価証券 50,100株
ディア・ライフ	89,500	423.00	37,858,500	
エー・ディー・ワークス	909,800	46.00	41,850,800	
日本商業開発	55,900	1,651.00	92,290,900	貸付有価証券 39,200株
プレサンスコーポレーション	154,200	1,530.00	235,926,000	
ユニゾホールディングス	81,800	2,575.00	210,635,000	
THEグローバル社	46,300	540.00	25,002,000	貸付有価証券 32,400株
日本管理センター	71,400	1,433.00	102,316,200	貸付有価証券 15,000株
サンセイランディック	20,600	766.00	15,779,600	
エストラスト	17,800	706.00	12,566,800	
フージャースホールディングス	128,300	979.00	125,605,700	
オープンハウス	161,700	3,455.00	558,673,500	貸付有価証券 114,200株
東急不動産ホールディングス	2,405,100	654.00	1,572,935,400	
飯田グループホールディングス	828,800	1,849.00	1,532,451,200	貸付有価証券 30,000株
ムゲンエステート	45,700	922.00	42,135,400	
ファーストブラザーズ	13,600	1,493.00	20,304,800	
ハウスドゥ	15,900	1,651.00	26,250,900	貸付有価証券 11,200株



シーアールイー	15,800	1,501.00	23,715,800	
ケイアイスター不動産	26,700	2,040.00	54,468,000	
エコナックホールディングス	374,000	71.00	26,554,000	
パーク24	504,600	2,915.00	1,470,909,000	貸付有価証券 290,800株
パラカ	31,700	2,048.00	64,921,600	
三井不動産	5,271,300	2,578.50	13,592,047,050	
三菱地所	7,394,500	2,011.50	14,874,036,750	
平和不動産	188,000	1,758.00	330,504,000	貸付有価証券 12,100株
東京建物	1,153,600	1,441.00	1,662,337,600	
ダイビル	255,800	1,127.00	288,286,600	貸付有価証券 10,000株
京阪神ビルディング	164,600	682.00	112,257,200	
住友不動産	2,382,000	3,367.00	8,020,194,000	貸付有価証券 23,000株
大京	1,847,000	234.00	432,198,000	貸付有価証券 380,000株
テーオーシー	385,300	1,017.00	391,850,100	貸付有価証券 187,100株
東京楽天地	163,000	591.00	96,333,000	
レオパレス21	1,254,700	712.00	893,346,400	
スターツコーポレーション	135,100	2,665.00	360,041,500	貸付有価証券 89,100株
フジ住宅	126,700	740.00	93,758,000	
空港施設	120,100	614.00	73,741,400	
明和地所	54,400	814.00	44,281,600	
ゴールドクレスト	89,500	2,396.00	214,442,000	貸付有価証券 15,000株
日本エスリード	38,700	1,756.00	67,957,200	
日神不動産	117,300	580.00	68,034,000	
日本エスコン	173,200	474.00	82,096,800	貸付有価証券 12,000株
タカラレーベン	426,600	481.00	205,194,600	貸付有価証券 224,100株
サンヨーハウジング名古屋	51,200	1,099.00	56,268,800	
イオンモール	640,100	2,054.00	1,314,765,400	貸付有価証券 30,000株
ファースト住建	37,000	1,563.00	57,831,000	
ランド	1,040,500	17.00	17,688,500	
トーセイ	136,000	789.00	107,304,000	貸付有価証券 10,600株
穴吹興産	10,800	2,917.00	31,503,600	貸付有価証券 7,500株
エヌ・ティ・ティ都市開発	617,600	1,063.00	656,508,800	貸付有価証券 80,000株
サンフロンティア不動産	107,000	1,124.00	120,268,000	貸付有価証券 51,600株

エフ・ジェー・ネクスト	86,700	837.00	72,567,900	貸付有価証券 60,300株
インテリックス	30,600	837.00	25,612,200	
ランドビジネス	58,800	291.00	17,110,800	
グランディハウス	87,300	425.00	37,102,500	
日本空港ビルデング	317,100	4,290.00	1,360,359,000	貸付有価証券 185,500株
日本工営	70,500	3,115.00	219,607,500	
L I F U L L	260,000	935.00	243,100,000	貸付有価証券 158,200株
ジェイエシーリクルートメント	64,600	1,842.00	118,993,200	貸付有価証券 45,200株
日本M&Aセンター	303,700	4,055.00	1,231,503,500	
メンバーズ	26,600	688.00	18,300,800	
中広	9,900	748.00	7,405,200	
タケエイ	92,100	1,074.00	98,915,400	
トラスト・テック	42,500	2,266.00	96,305,000	
コシダカホールディングス	50,500	3,085.00	155,792,500	貸付有価証券 11,900株
パソナグループ	78,400	1,018.00	79,811,200	
C D S	23,800	1,287.00	30,630,600	貸付有価証券 7,800株
リンクアンドモチベーション	247,600	758.00	187,680,800	貸付有価証券 174,100株
G C A	93,200	1,042.00	97,114,400	貸付有価証券 64,500株
エス・エム・エス	149,300	3,315.00	494,929,500	貸付有価証券 39,100株
パーソルホールディングス	814,200	2,078.00	1,691,907,600	貸付有価証券 50,000株
リニカル	61,900	1,714.00	106,096,600	貸付有価証券 12,400株
クックパッド	234,600	908.00	213,016,800	貸付有価証券 163,200株
エスクリ	37,300	726.00	27,079,800	
アイ・ケイ・ケイ	46,800	786.00	36,784,800	貸付有価証券 28,500株
学情	43,800	1,278.00	55,976,400	貸付有価証券 30,100株
スタジオアリス	43,000	2,406.00	103,458,000	貸付有価証券 20,000株
シミックホールディングス	53,300	1,492.00	79,523,600	
N J S	23,600	1,363.00	32,166,800	
総合警備保障	383,000	4,940.00	1,892,020,000	貸付有価証券 121,200株
カカクコム	739,700	1,636.00	1,210,149,200	貸付有価証券 13,900株
アイロムグループ	32,100	1,545.00	49,594,500	貸付有価証券 13,500株

セントケア・ホールディング	13,500	1,666.00	22,491,000	
サイネックス	10,000	1,001.00	10,010,000	
ルネサンス	53,500	1,980.00	105,930,000	
ディップ	135,800	2,289.00	310,846,200	貸付有価証券 30,000株
オプトホールディング	76,700	1,390.00	106,613,000	貸付有価証券 300株
新日本科学	117,200	681.00	79,813,200	貸付有価証券 38,400株
ツクイ	249,300	674.00	168,028,200	貸付有価証券 12,200株
キャリアデザインセンター	22,000	1,431.00	31,482,000	
エムスリー	911,500	3,015.00	2,748,172,500	
ツカダ・グローバルホールディング	77,000	603.00	46,431,000	貸付有価証券 20,200株
プラス	5,300	1,125.00	5,962,500	
アウトソーシング	68,100	5,120.00	348,672,000	貸付有価証券 48,000株
ウェルネット	78,900	1,337.00	105,489,300	
ワールドホールディングス	31,600	2,671.00	84,403,600	貸付有価証券 4,000株
ディー・エヌ・エー	471,700	2,596.00	1,224,533,200	
博報堂D Yホールディングス	1,458,300	1,455.00	2,121,826,500	
ぐるなび	152,200	1,795.00	273,199,000	
エスアールジータカミヤ	113,300	553.00	62,654,900	貸付有価証券 11,100株
ジャパンベストレスキューシステム	119,800	279.00	33,424,200	
ファンコミュニケーションズ	267,200	970.00	259,184,000	貸付有価証券 40,900株
ライク	18,800	3,165.00	59,502,000	貸付有価証券 12,800株
ビジネス・ブレークスルー	44,400	388.00	17,227,200	
WDBホールディングス	37,600	2,180.00	81,968,000	
ティア	50,400	776.00	39,110,400	
C D G	7,300	1,805.00	13,176,500	
バリューコマース	96,900	680.00	65,892,000	貸付有価証券 6,700株
インフォマート	446,300	800.00	357,040,000	
J Pホールディングス	302,100	295.00	89,119,500	貸付有価証券 186,700株
E P Sホールディングス	144,800	1,737.00	251,517,600	
レグス	23,600	778.00	18,360,800	
プレステージ・インターナショナル	199,000	1,171.00	233,029,000	
アミューズ	58,300	2,965.00	172,859,500	貸付有価証券 36,500株
ドリームインキュベータ	32,000	2,143.00	68,576,000	貸付有価証券 13,700株
クイック	53,700	1,481.00	79,529,700	

T A C	58,800	246.00	14,464,800	貸付有価証券 19,600株
ケネディクス	1,334,200	527.00	703,123,400	貸付有価証券 942,600株
電通	1,172,600	5,240.00	6,144,424,000	貸付有価証券 20,200株
テイクアンドギヴ・ニーズ	48,900	816.00	39,902,400	貸付有価証券 23,200株
ぴあ	31,900	3,610.00	115,159,000	貸付有価証券 900株
イオンファンタジー	30,800	3,215.00	99,022,000	
シーティーエス	56,100	1,257.00	70,517,700	
ネクシィーズグループ	37,800	1,790.00	67,662,000	貸付有価証券 26,300株
みらかホールディングス	268,800	4,900.00	1,317,120,000	
アルプス技研	42,200	3,685.00	155,507,000	
サニックス	168,100	290.00	48,749,000	貸付有価証券 118,900株
ダイオーズ	18,900	1,261.00	23,832,900	貸付有価証券 5,300株
日本空調サービス	100,600	690.00	69,414,000	
オリエンタルランド	1,137,500	7,502.00	8,533,525,000	貸付有価証券 624,700株
ダスキン	258,900	2,807.00	726,732,300	貸付有価証券 10,000株
明光ネットワークジャパン	121,700	1,449.00	176,343,300	
ファルコホールディングス	49,400	1,529.00	75,532,600	
秀英予備校	21,500	452.00	9,718,000	
田谷	17,900	667.00	11,939,300	貸付有価証券 5,600株
ラウンドワン	328,400	1,079.00	354,343,600	貸付有価証券 14,000株
リゾートトラスト	407,300	2,049.00	834,557,700	貸付有価証券 18,000株
ビー・エム・エル	137,600	2,159.00	297,078,400	
ワタベウェディング	15,700	543.00	8,525,100	貸付有価証券 10,500株
りらいあコミュニケーションズ	173,900	1,209.00	210,245,100	貸付有価証券 45,000株
リソー教育	179,100	895.00	160,294,500	
早稲田アカデミー	13,700	1,446.00	19,810,200	
ユー・エス・エス	1,273,700	2,200.00	2,802,140,000	貸付有価証券 68,000株
東京個別指導学院	33,900	1,501.00	50,883,900	貸付有価証券 23,500株
サイバーエージェント	632,700	3,555.00	2,249,248,500	
楽天	5,379,900	1,316.00	7,079,948,400	貸付有価証券 3,269,900株
クリーク・アンド・リバー社	49,500	1,236.00	61,182,000	

テー・オー・ダブリュー	84,200	855.00	71,991,000	
セントラルスポーツ	35,900	4,440.00	159,396,000	
フルキャストホールディングス	108,300	1,277.00	138,299,100	貸付有価証券 17,500株
リソルホールディングス	104,000	365.00	37,960,000	貸付有価証券 2,000株
テクノプロ・ホールディングス	171,200	4,445.00	760,984,000	
アトラ	16,200	678.00	10,983,600	
インターワークス	21,400	1,095.00	23,433,000	
K e e P e r 技研	30,800	1,294.00	39,855,200	
ファーストロジック	7,400	2,598.00	19,225,200	貸付有価証券 3,200株
三機サービス	10,600	1,332.00	14,119,200	
デザインワン・ジャパン	19,000	1,575.00	29,925,000	貸付有価証券 5,000株
イー・ガーディアン	48,600	2,313.00	112,411,800	
リブセンス	70,300	625.00	43,937,500	貸付有価証券 20,800株
ジャパンマテリアル	76,700	1,957.00	150,101,900	貸付有価証券 53,500株
ベクトル	85,500	1,765.00	150,907,500	貸付有価証券 25,500株
ウチヤマホールディングス	47,300	463.00	21,899,900	
サクセスホールディングス	9,800	1,617.00	15,846,600	貸付有価証券 3,500株
キャリアリンク	23,400	643.00	15,046,200	貸付有価証券 16,500株
I B J	82,200	730.00	60,006,000	貸付有価証券 57,500株
アサンテ	38,600	2,108.00	81,368,800	
N・フィールド	49,700	1,448.00	71,965,600	貸付有価証券 200株
バリューHR	10,700	3,020.00	32,314,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	18,800	4,905.00	92,214,000	貸付有価証券 12,300株
ライドオン・エクスプレス	26,200	1,195.00	31,309,000	貸付有価証券 16,100株
E R Iホールディングス	26,900	813.00	21,869,700	貸付有価証券 2,100株
アピスト	13,600	4,095.00	55,692,000	
ウィルグループ	42,700	951.00	40,607,700	貸付有価証券 12,400株
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	23,400	2,367.00	55,387,800	
日本ビューホテル	21,200	1,435.00	30,422,000	貸付有価証券 200株
リクルートホールディングス	6,895,600	1,890.00	13,032,684,000	
エラン	13,900	2,606.00	36,223,400	貸付有価証券 9,100株

土木管理総合試験所	14,100	1,707.00	24,068,700	貸付有価証券 9,800株
日本郵政	2,745,700	1,406.00	3,860,454,200	
ベルシステム24ホールディングス	160,300	1,132.00	181,459,600	貸付有価証券 104,900株
一蔵	10,100	1,111.00	11,221,100	
LITALICO	12,300	1,504.00	18,499,200	貸付有価証券 8,100株
エボラブルアジア	19,700	2,909.00	57,307,300	貸付有価証券 13,800株
ソラスト	66,600	1,469.00	97,835,400	貸付有価証券 44,300株
リログループ	526,200	2,163.00	1,138,170,600	貸付有価証券 39,600株
東祥	30,000	5,090.00	152,700,000	貸付有価証券 20,900株
エイチ・アイ・エス	171,500	3,450.00	591,675,000	貸付有価証券 55,900株
ラックランド	18,400	2,030.00	37,352,000	
共立メンテナンス	170,900	3,245.00	554,570,500	貸付有価証券 48,000株
イチネンホールディングス	107,700	1,217.00	131,070,900	
建設技術研究所	66,400	1,135.00	75,364,000	
スペース	56,700	1,455.00	82,498,500	
燦ホールディングス	20,900	2,109.00	44,078,100	
スバル興業	75,000	608.00	45,600,000	
東京テアトル	401,000	142.00	56,942,000	貸付有価証券 204,000株
タナベ経営	20,600	1,404.00	28,922,400	
ナガワ	19,200	3,965.00	76,128,000	貸付有価証券 1,000株
よみうりランド	209,000	541.00	113,069,000	貸付有価証券 10,000株
東京都競馬	72,000	2,977.00	214,344,000	
常磐興産	38,500	1,771.00	68,183,500	貸付有価証券 17,600株
カナモト	146,700	3,765.00	552,325,500	貸付有価証券 25,000株
東京ドーム	419,800	1,022.00	429,035,600	
西尾レントオール	84,700	3,580.00	303,226,000	貸付有価証券 43,000株
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	531,000	36.00	19,116,000	貸付有価証券 4,000株
トランス・コスモス	122,100	2,600.00	317,460,000	貸付有価証券 10,000株
乃村工藝社	225,000	2,293.00	515,925,000	貸付有価証券 12,400株
藤田観光	34,400	3,730.00	128,312,000	貸付有価証券 24,100株

KNT - CTホールディングス	598,000	199.00	119,002,000	貸付有価証券 41,000株
日本管財	90,200	1,938.00	174,807,600	
トーカイ	46,500	4,565.00	212,272,500	貸付有価証券 300株
白洋舎	10,000	2,971.00	29,710,000	
セコム	1,094,400	8,427.00	9,222,508,800	
セントラル警備保障	46,400	1,915.00	88,856,000	貸付有価証券 3,000株
丹青社	181,700	1,120.00	203,504,000	貸付有価証券 6,500株
メイテック	122,000	4,655.00	567,910,000	貸付有価証券 65,000株
アサツー ディ・ケイ	169,800	2,770.00	470,346,000	
応用地質	99,400	1,528.00	151,883,200	貸付有価証券 43,000株
船井総研ホールディングス	133,300	2,799.00	373,106,700	貸付有価証券 16,900株
進学会	43,800	574.00	25,141,200	
オオバ	81,500	511.00	41,646,500	貸付有価証券 54,800株
いであ	19,200	1,040.00	19,968,000	
学究社	27,700	1,560.00	43,212,000	
ベネッセホールディングス	352,500	4,300.00	1,515,750,000	貸付有価証券 26,000株
イオンディライト	118,600	3,605.00	427,553,000	
ナック	64,400	1,007.00	64,850,800	
ニチイ学館	182,600	1,111.00	202,868,600	貸付有価証券 111,500株
ダイセキ	183,500	2,781.00	510,313,500	貸付有価証券 60,000株
ステップ	35,200	1,436.00	50,547,200	
合計	1,524,701,264		2,360,346,383,390	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2017年 7月31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	2,707,650,718,755円
負債総額	289,443,293,660円
純資産総額（ - ）	2,418,207,425,095円
発行済口数	1,477,991,308口
1口当たり純資産額（ / ）	1,636.14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29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29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29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29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	738	147,280

株式投資信託	692	119,218
単位型	201	8,364
追加型	491	110,854
公社債投資信託	46	28,061
単位型	32	340
追加型	14	27,721

### 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58期事業年度(平成28年4月1日から平成29年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第57期 (平成28年3月31日)		第58期 (平成29年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	14,308	3	16,761
金銭の信託	3	153	3	152
有価証券		86		10
前払費用	3	489		506
未収入金		10		136
未収委託者報酬		9,374		10,757
未収収益	3	2,280	3	2,799
関係会社短期貸付金		5,333		962
立替金		2,960		1,240
繰延税金資産		819		865
その他	2,3	428	2,3	385
流動資産合計		36,243		34,577
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	146	1	93
器具備品	1	210	1	190
有形固定資産合計		356		283
無形固定資産				
ソフトウェア		140		138
無形固定資産合計		140		138
投資その他の資産				
投資有価証券		12,195		11,783
関係会社株式		21,702		23,203
関係会社長期貸付金		60		60

長期差入保証金	781	782
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	425	423
投資その他の資産合計	35,165	36,253
固定資産合計	35,662	36,674
資産合計	71,905	71,252

(単位：百万円)

	第57期 (平成28年3月31日)		第58期 (平成29年3月31日)	
<b>負債の部</b>				
<b>流動負債</b>				
預り金	410	3	589	
未払金	3,841		4,043	
未払収益分配金	6		7	
未払償還金	112		91	
未払手数料	3	3,269	3	3,499
その他未払金		453		445
未払費用	3	4,920	3	4,229
未払法人税等		354		1,808
未払消費税等	4	649	4	538
関係会社短期借入金		5,631		-
賞与引当金		2,080		2,077
役員賞与引当金		145		168
その他	3	278	3	62
流動負債合計		18,312		13,517
<b>固定負債</b>				
退職給付引当金		1,154		1,259
固定負債合計		1,154		1,259
負債合計		19,466		14,777
<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		29,948		34,015
利益剰余金合計		29,948		34,015
自己株式		502		672
株主資本合計		52,028		55,926
<b>評価・換算差額等</b>				
その他有価証券評価差額金		151		282
繰延ヘッジ損益		258		266

評価・換算差額等合計	410	548
純資産合計	52,438	56,475
負債純資産合計	71,905	71,252

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	66,339	64,680
その他営業収益	4,382	4,218
営業収益合計	70,722	68,898
営業費用		
支払手数料	30,529	28,675
広告宣伝費	1,098	969
公告費	3	2
調査費	17,470	17,322
調査費	821	841
委託調査費	16,600	16,456
図書費	48	24
委託計算費	505	498
営業雑経費	718	656
通信費	195	185
印刷費	321	276
協会費	65	66
諸会費	22	17
その他	113	111
営業費用計	50,327	48,124
一般管理費		
給料	8,138	8,243
役員報酬	365	360
役員賞与引当金繰入額	145	168
給料・手当	5,495	5,576
賞与	51	61
賞与引当金繰入額	2,080	2,077
交際費	185	99
寄付金	27	17
旅費交通費	503	412
租税公課	258	375
不動産賃借料	875	889
退職給付費用	372	390
退職金	113	20
固定資産減価償却費	196	192
福利費	952	959
諸経費	2,952	2,791
一般管理費計	14,577	14,394
営業利益	5,817	6,380

(単位：百万円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						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
当期変動額							

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算差額 等合計	
当期首残高	1,002	88	913	49,265
当期変動額				
剰余金の配当				850
当期純利益				4,962
自己株式の取得				434
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	851	347	503	503
当期変動額合計	851	347	503	3,173
当期末残高	151	258	410	52,438

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本						自己 株式	株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				
		資本準備金	資本 剰余金 合計	その他利益剰 余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028	
当期変動額								
剰余金の配当				1,495	1,495		1,495	
当期純利益				5,562	5,562		5,562	
自己株式の取得						170	170	
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)								
当期変動額合計	-	-	-	4,067	4,067	170	3,897	
当期末残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926	

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算差額 等合計	
当期首残高	151	258	410	52,438
当期変動額				
剰余金の配当				1,495
当期純利益				5,562

自己株式の取得				170
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	130	7	138	138
当期変動額合計	130	7	138	4,036
当期末残高	282	266	548	56,475

## [ 注記事項 ]

## ( 重要な会計方針 )

項目	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 5年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>



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

## (会計方針の変更)

<p>第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)</p>	
<p>(減価償却方法)</p> <p>法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。</p> <p>この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p>	

## (追加情報)

<p>第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)</p>	
<p>「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当事業年度から適用しております。</p>	

## (貸借対照表関係)

第57期 (平成28年3月31日)	第58期 (平成29年3月31日)								
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table border="0" style="width: 100%;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建物</td> <td style="text-align: right;">1,170百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">653百万円</td> </tr> </table>	建物	1,170百万円	器具備品	653百万円	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table border="0" style="width: 100%;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建物</td> <td style="text-align: right;">1,222百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">603百万円</td> </tr> </table>	建物	1,222百万円	器具備品	603百万円
建物	1,170百万円								
器具備品	653百万円								
建物	1,222百万円								
器具備品	603百万円								
<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>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> <table border="0"> <tr><td>現金・預金</td><td style="text-align: right;">4,072百万円</td></tr> <tr><td>金銭の信託</td><td style="text-align: right;">153百万円</td></tr> <tr><td>前払費用</td><td style="text-align: right;">2百万円</td></tr> <tr><td>未収収益</td><td style="text-align: right;">147百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">193百万円</td></tr> </table> <p>(流動負債)</p> <table border="0"> <tr><td>未払手数料</td><td style="text-align: right;">93百万円</td></tr> <tr><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">722百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">266百万円</td></tr> </table> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務728百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務689百万円に対して保証を行っております。</p>	現金・預金	4,072百万円	金銭の信託	153百万円	前払費用	2百万円	未収収益	147百万円	その他	193百万円	未払手数料	93百万円	未払費用	722百万円	その他	266百万円	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <table border="0"> <tr><td>現金・預金</td><td style="text-align: right;">3,243百万円</td></tr> <tr><td>金銭の信託</td><td style="text-align: right;">152百万円</td></tr> <tr><td>未収収益</td><td style="text-align: right;">619百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">20百万円</td></tr> </table> <p>(流動負債)</p> <table border="0"> <tr><td>預り金</td><td style="text-align: right;">177百万円</td></tr> <tr><td>未払手数料</td><td style="text-align: right;">144百万円</td></tr> <tr><td>未払費用</td><td style="text-align: right;">251百万円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">61百万円</td></tr> </table> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務587百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc.がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務546百万円に対して保証を行っております。</p>	現金・預金	3,243百万円	金銭の信託	152百万円	未収収益	619百万円	その他	20百万円	預り金	177百万円	未払手数料	144百万円	未払費用	251百万円	その他	61百万円
現金・預金	4,072百万円																																
金銭の信託	153百万円																																
前払費用	2百万円																																
未収収益	147百万円																																
その他	193百万円																																
未払手数料	93百万円																																
未払費用	722百万円																																
その他	266百万円																																
現金・預金	3,243百万円																																
金銭の信託	152百万円																																
未収収益	619百万円																																
その他	20百万円																																
預り金	177百万円																																
未払手数料	144百万円																																
未払費用	251百万円																																
その他	61百万円																																

## ( 損益計算書関係 )

第57期 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	第58期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)												
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr><td>受取配当金</td><td style="text-align: right;">1,193百万円</td></tr> <tr><td>支払利息</td><td style="text-align: right;">123百万円</td></tr> <tr><td>デリバティブ費用</td><td style="text-align: right;">889百万円</td></tr> </table>	受取配当金	1,193百万円	支払利息	123百万円	デリバティブ費用	889百万円	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr><td>受取配当金</td><td style="text-align: right;">1,550百万円</td></tr> <tr><td>デリバティブ収益</td><td style="text-align: right;">347百万円</td></tr> <tr><td>支払利息</td><td style="text-align: right;">58百万円</td></tr> </table> <p>2 過年度の取引に関する法人税等の追加費用計上額です。</p>	受取配当金	1,550百万円	デリバティブ収益	347百万円	支払利息	58百万円
受取配当金	1,193百万円												
支払利息	123百万円												
デリバティブ費用	889百万円												
受取配当金	1,550百万円												
デリバティブ収益	347百万円												
支払利息	58百万円												

## ( 株主資本等変動計算書関係 )

第57期(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

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

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

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

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

##### 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

##### 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	814,100	305,000	-	1,119,100

##### 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,762,200	-	72,600	1,689,600	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	-	174,900	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,738,800	-	1,848,000	2,890,800	-
平成28年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,437,000	33,000	4,404,000	-
合計		6,675,900	4,437,000	1,953,600	9,159,300	-

- (注) 1 平成28年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。  
 2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります  
 3 平成21年度ストックオプション(1)1,689,600株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,890,800株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

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

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

##### (リース取引関係)

第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	865百万円	1年内	865百万円
1年超	2,653百万円	1年超	1,787百万円
合計	3,518百万円	合計	2,653百万円

##### (金融商品関係)

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

#### 1 金融商品の状況に関する事項

##### (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変

動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」4「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

#### 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

#### 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

ヘッジ会計が適用されているもの	170	170	-
デリバティブ取引計	(84)	(84)	-

(1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用並びに(8) 関係会社短期借入金

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

(9) デリバティブ取引

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,308	-	-	-
未収委託者報酬	9,374	-	-	-
未収収益	2,280	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	86	714	1,766	963
合計	26,049	714	1,766	963

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

### 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

### 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

平成29年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額( 1)	時価( 1)	差額
(1) 現金・預金	16,761	16,761	-
(2) 未収委託者報酬	10,757	10,757	-
(3) 未収収益	2,799	2,799	-
(4) 関係会社短期貸付金	962	962	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	11,777	11,777	-
(6) 未払金	(4,043)	(4,043)	-
(7) 未払費用	(4,229)	(4,229)	-
(8) デリバティブ取引( 2) ヘッジ会計が適用されていないもの	35	35	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(1)	(1)	-
デリバティブ取引計	34	34	-

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち75百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、39百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち20百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、22百万円は流動負債のその他に含まれております。

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

3 子会社株式(貸借対照表計上額20,310百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	16,761	-	-	-
未収委託者報酬	10,757	-	-	-
未収収益	2,799	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	10	616	907	735



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

## (有価証券関係)

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,310
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	3,198	174	120
合計	3,198	174	120

(デリバティブ取引関係)

第57期(平成28年3月31日)

### 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### (1) 株式関連

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

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

#### 2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

#### (2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
為替予約取引					

市場取引以外の取引	買建 米ドル	5,631	-	243	243
合計		5,631	-	243	243

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

### (1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		3,943	-	179
	豪ドル		767	-	18
	シンガポールドル		75	-	4
	香港ドル		151	-	5
	人民元		1,948	-	8
	ユーロ		173	-	0
合計			7,060	-	170

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第58期(平成29年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### (1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	1,729	-	35	35
	買建	-	-	-	-
合計		1,729	-	35	35

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

### (1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
	為替予約取引				
	売建				
	米ドル		2,993	-	11
	豪ドル		77	-	2

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

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

第57期 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	第58期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,037	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,030
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,686	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,455
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,901	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,092

## (退職給付関係)

第57期(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,233
勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	33
退職給付の支払額	119
退職給付債務の期末残高	1,299

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

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、209百万円でありました。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,299
勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	190
退職給付の支払額	72
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,190</u>

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

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

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、213百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	15,902,700	1,567,500
付与	0	0
失効	14,140,500	1,392,600
権利確定	0	0
権利未確定残	1,762,200	174,900

権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第58期(自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31日)

## 1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定条件	平成25年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成30年7月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成25年10月7日から平成33年10月6日まで	平成30年7月15日から平成38年7月31日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,762,200	174,900
付与	0	0
失効	72,600	0
権利確定	0	0
権利未確定残	1,689,600	174,900



権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定前(株)		
期首	4,738,800	-
付与	0	4,437,000
失効	1,848,000	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,890,800	4,404,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利行使価格(円)	737 (注)3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

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

- 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第57期 (平成28年3月31日)		第58期 (平成29年3月31日)	
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
(単位：百万円)		(単位：百万円)	
繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)	
賞与引当金	642	賞与引当金	641
その他	177	その他	224
小計	819	小計	865
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	96	投資有価証券評価損	96
関係会社株式評価損	1,430	関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	353	退職給付引当金	385
固定資産減価償却費	122	固定資産減価償却費	119
その他	65	その他	63
小計	2,068	小計	2,095
繰延税金資産小計	2,888	繰延税金資産小計	2,961
評価性引当金	1,430	評価性引当金	1,430
繰延税金資産合計	1,457	繰延税金資産合計	1,530
繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(流動)	
その他有価証券評価差額金	71	その他有価証券評価差額金	0
繰延ヘッジ利益	114	小計	0
その他	26	繰延税金負債(固定)	
小計	213	その他有価証券評価差額金	123
繰延税金負債合計	213	繰延ヘッジ利益	117
繰延税金資産の純額	1,244	小計	241
		繰延税金負債合計	242
		繰延税金資産の純額	1,288
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	33.1%	法定実効税率	30.9%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.4%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.8%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.3%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.3%	過年度法人税等	1.5%
所得拡大促進税制	2.2%	海外子会社の留保利益の影響額等	0.2%
海外子会社の留保利益の影響額等	0.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%		

第57期 (平成28年3月31日)	第58期 (平成29年3月31日)
----------------------	----------------------

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

## ( 関連当事者情報 )

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	90 (SGD 1,000 千)(注2)	関係会社短期貸付金	333 (SGD 4,000 千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	18 (SGD 215 千)	未収収益	6 (SGD 74 千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	5,000	関係会社短期貸付金	5,000
							貸付金利息(円貸建)(注3)	70	未収収益	70
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542 (USD 千)(注4)	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入(米ドル貸建)(注5)	6,176 (USD 50,000 千)	関係会社短期借入金	5,631 (USD 50,000 千)
							借入金利息(米ドル貸建)(注5)	113 (USD 949 千)	未払費用	106 (USD 949 千)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	30,897百万円
負債合計	9,936百万円
純資産合計	20,960百万円

営業収益	26,843百万円
税引前当期純利益	9,553百万円
当期純利益	6,411百万円

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

### 1 関連当事者との取引

#### (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

##### (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

##### (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	312,000(SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貨建)(注1)	65(SGD800千)(注2)	関係会社短期貸付金	385(SGD4,800千)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	13(SGD177千)	未収収益	8(SGD105千)
							資金の貸付(円貨建)(注3)	4,422(注4)	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貨建)(注3)	3	未収収益	3

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 資金の貸付に係る取引金額65百万円 (SGD800千) の内訳は、貸付505百万円 (SGD6,600千) 及び返済439百万円 (SGD5,800千) であります。
- 3 融資枠5,000百万円、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 資金の貸付に係る取引金額 4,422百万円の内訳は、貸付577百万円及び返済5,000百万円であります。
- 5 Nikko Asset Management International Limitedの行った20,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
- 6 Nikko Asset Management Americas, Inc.の「資本金」は、資本金と資本剰余金の合計額を記載しております。
- 7 融資枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 8 資金の借入に係る取引金額 5,549百万円 (USD 50,000千) は、返済であります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成28年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

#### 関連情報

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

##### 1 製品及びサービスごとの情報

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

##### 2 地域ごとの情報

###### (1) 営業収益

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

###### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

##### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

##### 1 製品及びサービスごとの情報

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

##### 2 地域ごとの情報

###### (1) 営業収益

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

###### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

##### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

#### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

#### 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

項目	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	267円27銭	288円29銭
1株当たり当期純利益金額	25円25銭	28円38銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益(百万円)	4,962	5,562
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	4,962	5,562
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,464	196,009
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 1,762,200株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株、平成23年度ストックオプション(1) 4,738,800株	平成21年度ストックオプション(1) 1,689,600株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,890,800株、平成28年度ストックオプション(1) 4,404,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第57期 (平成28年3月31日)	第58期 (平成29年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	52,438	56,475
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	52,438	56,475
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	196,198	195,893

## (重要な後発事象)

## 新株予約権(ストックオプション)の付与

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

名に付与いたしました。

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更  
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

### 第2【その他の関係法人の概況】

#### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

##### (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成29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29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29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	5,500百万円	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	
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	
野村證券株式会社	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M U F G 証券株式会社	62,100百万円	
U B S 証券株式会社	61,450百万円	

## 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28年10月 7日	有価証券届出書
平成28年10月 7日	有価証券報告書
平成29年 4月 7日	有価証券届出書の訂正届出書

平成29年 4月 7日	半期報告書
-------------	-------

## 独立監査人の監査報告書

平成29年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年8月2日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### PWCあらた有限責任監査法人

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

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28年7月9日から平成29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29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。