【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年2月7日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田　拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目７番１号
【事務連絡者氏名】	森川　晃
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）（以下「ファンド」といいます。）

※当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

※ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社債、株式等の振替に関する法律第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情などがある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

１円以上１円単位

（７）【申込期間】

平成29年 2月 8日から平成30年 2月 6日までとします。
・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　http://www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（9）【払込期日】

・取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。
・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①　ファンドの目的
わが国の株式市場全体の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

②　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）	補足分類
		株　式	
	国　内		
単位型投信		債　券	インデックス型
	海　外	不動産投信	
追加型投信		その他資産（　　）	特殊型
	内　外		
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

◇追加型投信
一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
◇国内
目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
◇株式
目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
◇インデックス型
目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

２）属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

◇その他資産（投資信託証券（株式　一般））

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

◇年１回

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

◇日本

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

◇ファミリーファンド

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

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。

③　ファンドの特色

ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

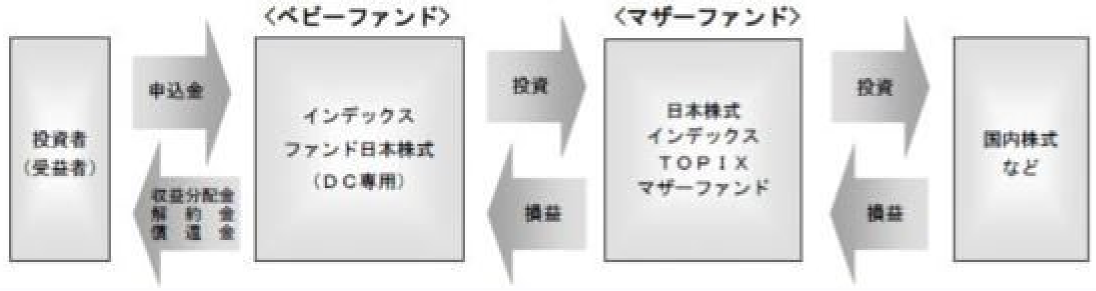
主として、「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」に投資を行ない、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」の組入比率は高位を保つことを原則とします。また、購入・換金動向に応じて有価証券指数先物取引などを活用し、組入比率を調整することがあります。

ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

※当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。購入申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて購入の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

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



主な投資制限

・株式への投資割合には、制限を設けません。
・外貨建資産への投資は行ないません。

分配方針

・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
※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。

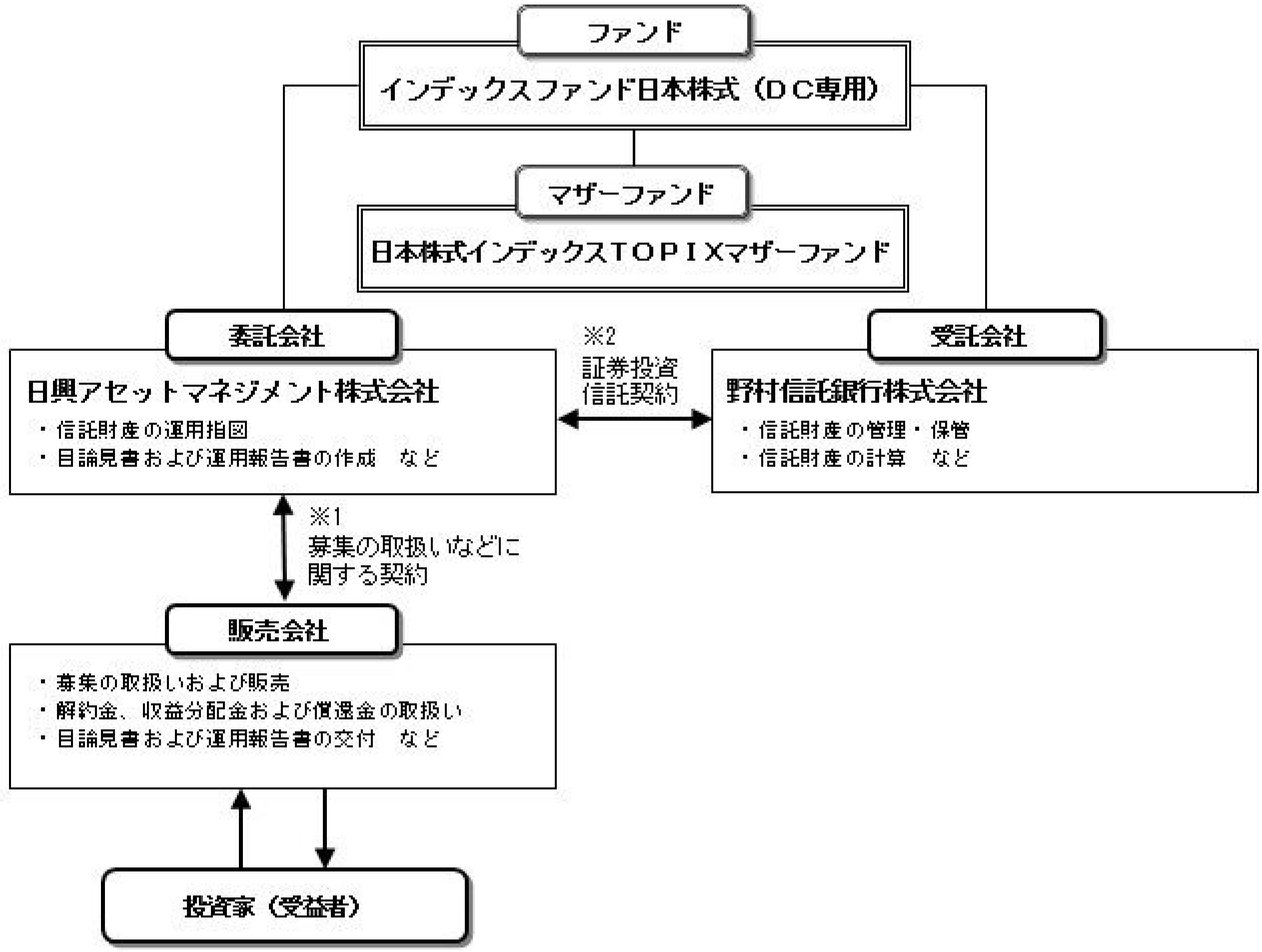
④　**信託金限度額**
・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（２）【ファンドの沿革】

平成15年11月 7日
・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

①　**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。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
※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。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。

② 委託会社の概況（平成28年11月末現在）

１）資本金

17,363百万円

２）沿革

昭和34年：日興證券投資信託委託株式会社として設立

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

３）大株主の状況

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

２【投資方針】

（１）【投資方針】

・主として、「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」受益証券に投資を行ない、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
・マザーファンド受益証券の組入比率は高位を保つことを原則とします。また、設定・解約動向に応じて有価証券指数先物取引などを活用し、組入比率を調整することがあります。
・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投

資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
・ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

＜インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）＞
「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
① 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20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形
② 主として「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）株券または新株引受権証書
２）国債証券
３）地方債証券
４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７）コマーシャル・ペーパー
８）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
９）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、２）～８）の証券の性質を有するもの
10）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
11）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
12）預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
13）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。）
14）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
④ 次の取引ができます。
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）金利先渡取引

５）有価証券の貸付
６）公社債の空売
７）公社債の借入
８）資金の借入

＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

①　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15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

②　主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
１）株券または新株引受権証書
２）国債証券
３）地方債証券
４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７）コマーシャル・ペーパー
８）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
９）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、２）～８）の証券の性質を有するもの
10）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
11）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
12）預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
13）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。）
14）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

④　次の取引ができます。
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）金利先渡取引
５）有価証券の貸付
６）公社債の空売

7）公社債の借入

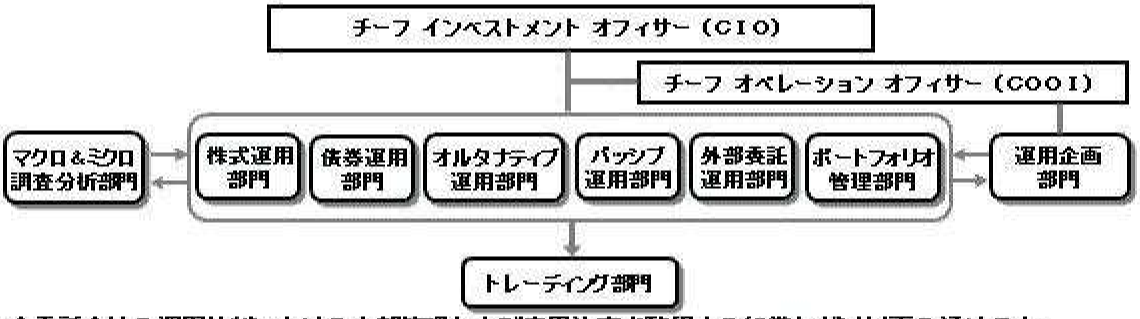
◆投資対象とするマザーファンドの概要
＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	投資方針	・主としてわが国の株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（平成11年10月29日設定）
	決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

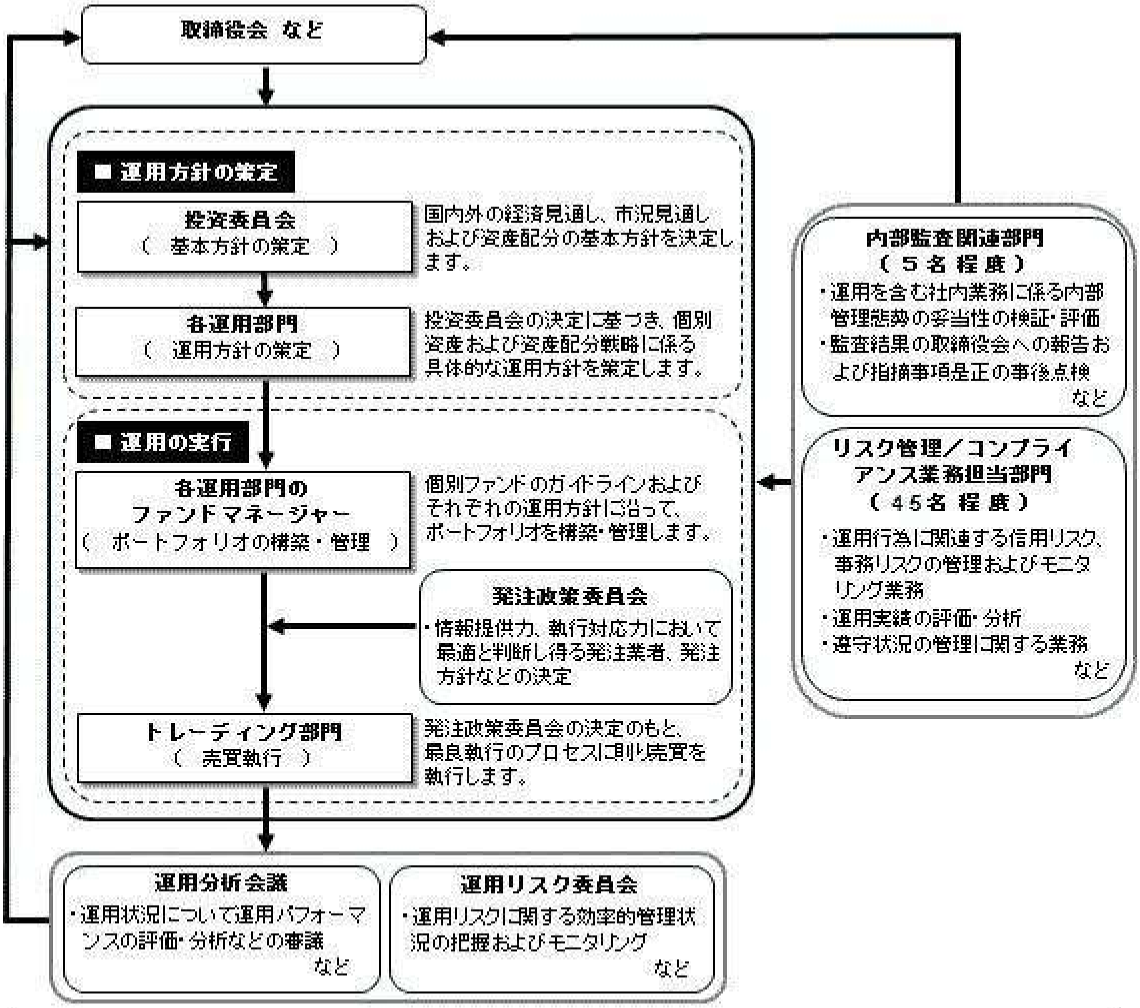
＊ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。
ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっております。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なっており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

※上記体制は平成28年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

① 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

１）分配対象額の範囲

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

２）分配対象額についての分配方針

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

３）留保益の運用方針

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

② 収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限

＜インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）＞

１）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）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、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

３）外貨建資産への投資は行ないません。

４）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

５）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

６）わが国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

７）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

８）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

９）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および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50％を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50％を超えないものとします。

10）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

12）信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴なう支払資金の手当て（解約に伴なう支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含み

ます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
イ）解約に伴なう支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
ロ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
ハ）借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
ニ）解約に伴なう支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とします。
ホ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
13）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。
14）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。
＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞
１）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）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、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
３）外貨建資産への投資は行ないません。
４）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
５）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
６）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
７）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
８）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
９）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および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

10）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

12）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。

13）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。

② 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ないます。お申込みの際は、当ファンドのリスクを充分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

・当ファンドは、主に株式を実質的な投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 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。

② 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。

③ 信用リスク

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

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

＜ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）と基準価額の主なカイ離要因＞

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

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

＜その他の留意事項＞

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴なう資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

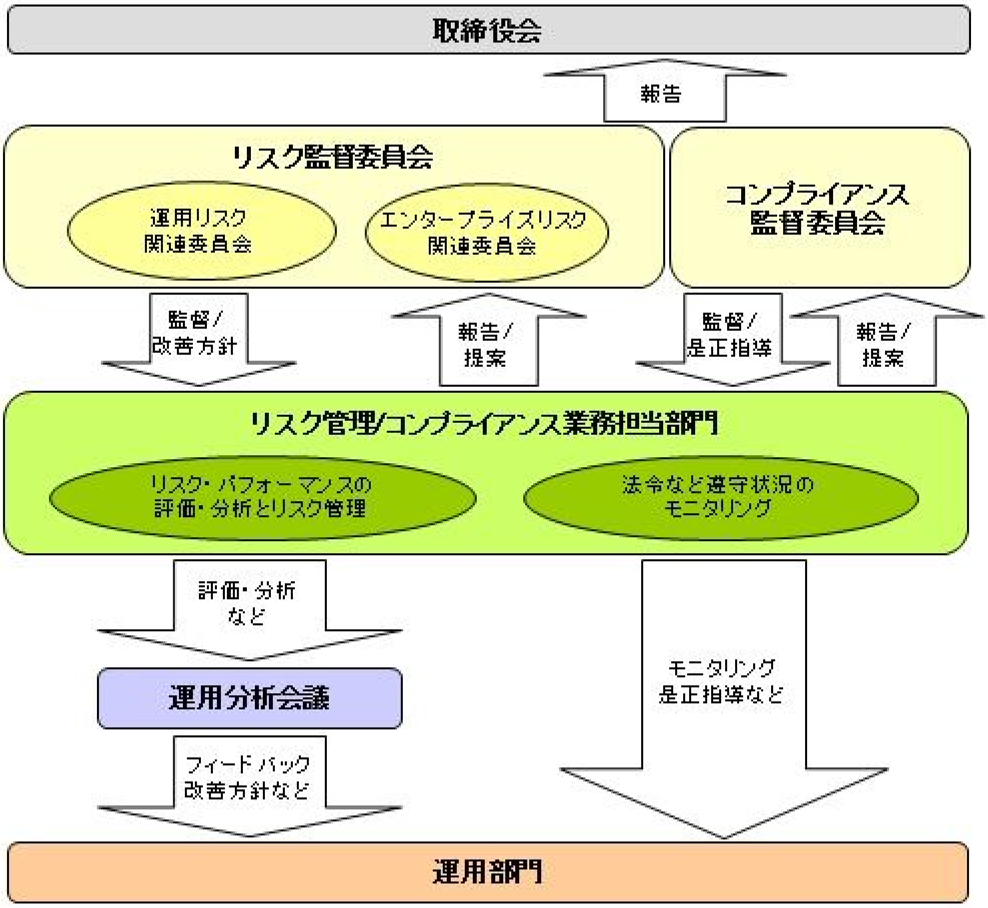
・解約によるファンドの資金流出に伴なう基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

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

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

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

（２）リスク管理体制



■全社的リスク管理

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

■運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

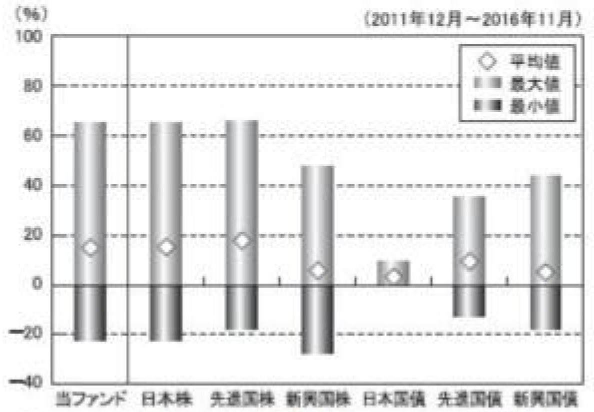
■法令など遵守状況のモニタリング

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

※上記体制は平成28年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



（当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率（%））

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	14.9%	15.1%	17.7%	5.7%	3.1%	9.3%	5.0%
最大値	64.9%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	−22.2%	−22.0%	−17.5%	−27.4%	0.5%	−12.3%	−17.4%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
※上記は2011年12月から2016年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものと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・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）
※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2011年12月末の基準価額を起点として指数化しています。
※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）は、分配金（税引前）を再投資したものと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。

○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・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）
当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLC に帰属します。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

① 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0.27%（税抜0.25%）の率を乗じて得た額とします。
② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.25%	0.12%	0.10%	0.03%

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。
③ 支払時期
信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。
① 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。
② 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。）。

③　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、解約に伴なう支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

＜投資対象とするマザーファンドに係る費用＞
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
・信託事務の処理に要する諸費用
・信託財産に関する租税　など

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。
＊監査費用、売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。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。

≪確定拠出年金の場合≫

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会の場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

≪確定拠出年金でない場合≫

①　個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

２）解約金および償還金に対する課税

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

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

※確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）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。なお、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②　法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額について

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ます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2）益金不算入制度の適用
益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③　個別元本

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

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

④　普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2）受益者が収益分配金を受け取る際

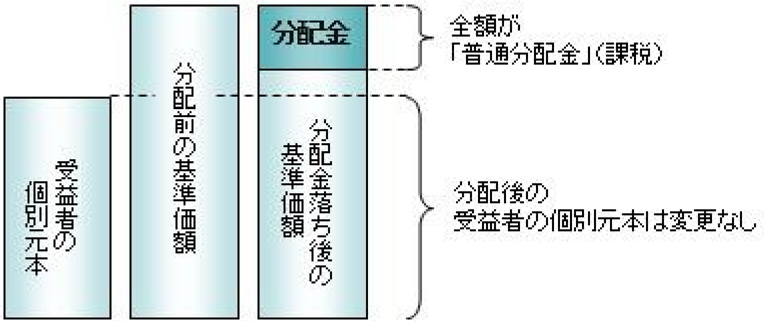
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

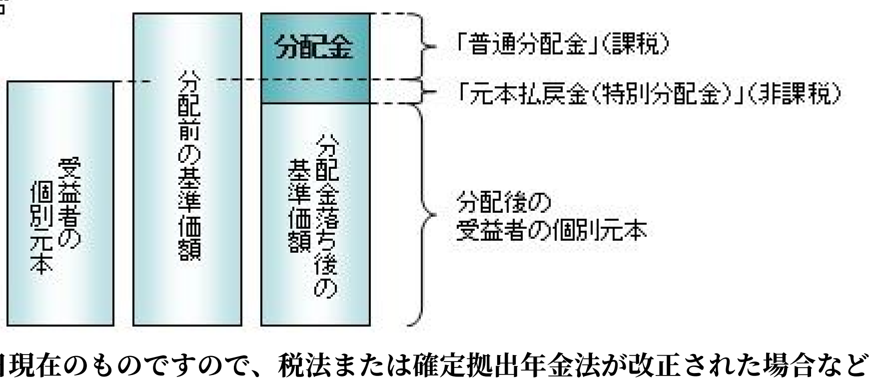
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



※上記は平成29年 2月 7日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）】

以下の運用状況は2016年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（1）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	1,728,860,616	100.00
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	17,021	0.00
合計（純資産総額）		1,728,877,637	100.00

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	1,359,060,307	1.1805	1,604,370,693	1.2721	1,728,860,616	100.00

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合　　計	100.00

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第4計算期間末　(2007年11月 6日)	693	693	1.5871	1.5881
第5計算期間末　(2008年11月 6日)	556	557	0.9320	0.9330
第6計算期間末　(2009年11月 6日)	477	478	0.9100	0.9110
第7計算期間末　(2010年11月 8日)	528	529	0.8912	0.8922

第8計算期間末	(2011年11月 7日)	506	506	0.8109	0.8119
第9計算期間末	(2012年11月 6日)	581	582	0.8215	0.8225
第10計算期間末	(2013年11月 6日)	1,031	1,032	1.3381	1.3391
第11計算期間末	(2014年11月 6日)	1,198	1,199	1.5489	1.5499
第12計算期間末	(2015年11月 6日)	1,542	1,543	1.8154	1.8164
第13計算期間末	(2016年11月 7日)	1,582	1,583	1.6113	1.6123
	2015年11月末日	1,541	—	1.8345	—
	12月末日	1,546	—	1.7981	—
	2016年 1月末日	1,481	—	1.6639	—
	2月末日	1,356	—	1.5081	—
	3月末日	1,454	—	1.5799	—
	4月末日	1,434	—	1.5715	—
	5月末日	1,519	—	1.6179	—
	6月末日	1,406	—	1.4626	—
	7月末日	1,491	—	1.5526	—
	8月末日	1,523	—	1.5607	—
	9月末日	1,536	—	1.5654	—
	10月末日	1,621	—	1.6481	—
	11月末日	1,728	—	1.7376	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第4期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	0.0010
第5期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	0.0010
第6期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	0.0010
第7期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.0010
第8期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0010
第9期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	0.0010
第10期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010
第11期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010
第12期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010
第13期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.0010

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第4期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	△1.53
第5期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	△41.21
第6期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	△2.25
第7期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	△1.96

第8期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	△8.90
第9期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	1.43
第10期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	63.01
第11期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	15.83
第12期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	17.27
第13期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	△11.19

(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4期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	142,651,171	540,572,332
第5期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	235,186,103	74,846,469
第6期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	135,596,052	207,615,850
第7期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	123,746,636	55,739,383
第8期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	136,508,266	105,650,698
第9期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	147,118,920	63,433,210
第10期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	294,742,645	231,483,165
第11期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	237,384,876	234,829,395
第12期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	312,411,268	236,517,460
第13期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	288,363,284	155,583,971

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

以下の運用状況は2016年11月30日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	26,320,034,960	98.71
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	345,224,270	1.29
合計（純資産総額）		26,665,259,230	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	324,280,000	1.22

(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。

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	152,600	6,025.00	919,415,000	6,649.00	1,014,637,400	3.81
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	917,900	532.90	489,148,910	669.80	614,809,420	2.31
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	97,200	4,721.67	458,946,324	4,625.00	449,550,000	1.69
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	97,000	3,547.87	344,143,390	4,206.00	407,982,000	1.53
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	110,500	3,144.17	347,430,785	3,332.00	368,186,000	1.38
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	54,500	6,585.00	358,882,500	6,712.00	365,804,000	1.37
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	119,800	3,111.46	372,752,908	2,999.00	359,280,200	1.35
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,644,600	171.50	282,048,900	202.60	333,195,960	1.25
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	76,200	3,965.44	302,166,528	3,946.00	300,685,200	1.13
日本	株式	ソニー	電気機器	86,700	3,324.68	288,249,756	3,288.00	285,069,600	1.07
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	49,100	4,056.39	199,168,749	4,899.00	240,540,900	0.90
日本	株式	ファナック	電気機器	12,400	19,717.70	244,499,480	19,305.00	239,382,000	0.90
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	90,500	2,600.60	235,354,300	2,624.00	237,472,000	0.89
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	23,800	9,404.76	223,833,288	9,766.00	232,430,800	0.87
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	48,200	4,804.00	231,552,800	4,685.00	225,817,000	0.85
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	50,700	4,492.78	227,783,946	4,435.00	224,854,500	0.84
日本	株式	三菱商事	卸売業	90,900	2,361.49	214,659,441	2,471.50	224,659,350	0.84
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,800	77,230.00	216,244,000	78,230.00	219,044,000	0.82
日本	株式	キヤノン	電気機器	66,100	3,052.26	201,754,386	3,261.00	215,552,100	0.81
日本	株式	任天堂	その他製品	7,600	24,534.34	186,460,984	27,775.00	211,090,000	0.79
日本	株式	三菱地所	不動産業	90,000	2,041.13	183,701,700	2,305.50	207,495,000	0.78
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	131,300	1,557.00	204,434,100	1,579.50	207,388,350	0.78
日本	株式	三菱電機	電気機器	130,900	1,399.27	183,164,443	1,576.50	206,363,850	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,900	14,447.35	186,370,815	15,425.00	198,982,500	0.75
日本	株式	信越化学工業	化学	23,000	7,693.30	176,945,900	8,460.00	194,580,000	0.73
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	10,200	17,520.00	178,704,000	18,680.00	190,536,000	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	43,400	3,960.73	171,895,682	4,367.00	189,527,800	0.71
日本	株式	日立製作所	電気機器	295,000	525.10	154,904,500	609.30	179,743,500	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	16,700	9,879.00	164,979,300	10,715.00	178,940,500	0.67
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	38,100	4,025.27	153,362,787	4,645.00	176,974,500	0.66

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	0.34
		建設業	3.08
		食料品	4.47
		繊維製品	0.69
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.31
		医薬品	4.70
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	0.93
		鉄鋼	1.24
		非鉄金属	0.90
		金属製品	0.69
		機械	5.02
		電気機器	12.39
		輸送用機器	9.66
		精密機器	1.50
		その他製品	1.90
		電気・ガス業	1.81
		陸運業	4.25
		海運業	0.22
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	7.46
		卸売業	4.37
		小売業	4.71
		銀行業	8.19
		証券、商品先物取引業	1.14
		保険業	2.60
		その他金融業	1.31
		不動産業	2.66
		サービス業	3.64
合　計			98.71

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物　２０１６年１２月	買建	22	日本円	306,246,880	324,280,000	1.22

(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。

≪参考情報≫

運用実績

2016年11月30日現在

基準価額・純資産の推移

（2006年11月末～2016年11月末）

基準価額……………………… 17,376円
純資産総額……………………17.28億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の１万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2006年11月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金（税引前）を再投資したものとして計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移（税引前、１万口当たり）

2012年11月	2013年11月	2014年11月	2015年11月	2016年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	100円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産	比率
株式	98.71%
先物	1.22%
現金その他	1.29%

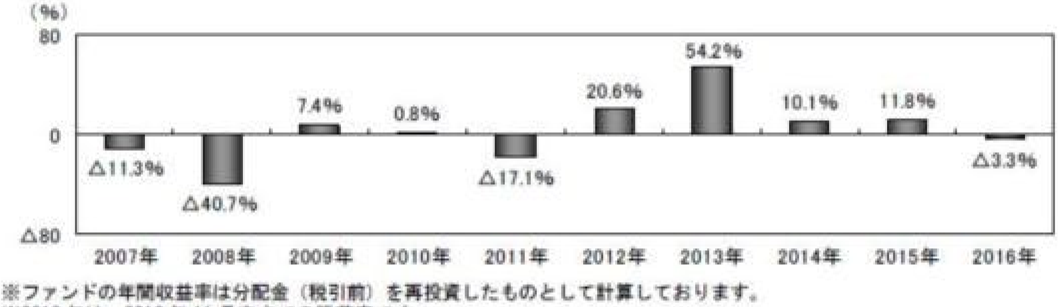
※当ファンドの実質組入比率です。

＜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	3.81%
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	2.31%
3	日本電信電話	情報・通信業	1.69%
4	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.53%
5	本田技研工業	輸送用機器	1.38%
6	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.37%
7	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1.35%
8	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.25%
9	日本たばこ産業	食料品	1.13%
10	ソニー	電気機器	1.07%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は分配金（税引前）を再投資したものとして計算しております。
※2016年は、2016年11月末までの騰落率です。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込方法

・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。

・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

（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。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

（４）申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

（５）申込単位

１円以上１円単位

（６）申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

（７）受付の中止および取消

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

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

２【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

（１）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（２）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。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

（３）解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（４）解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　http://www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（５）手取額

１口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

※上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関の場合を記載しています。

※税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。

（６）解約単位

１口単位

※販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

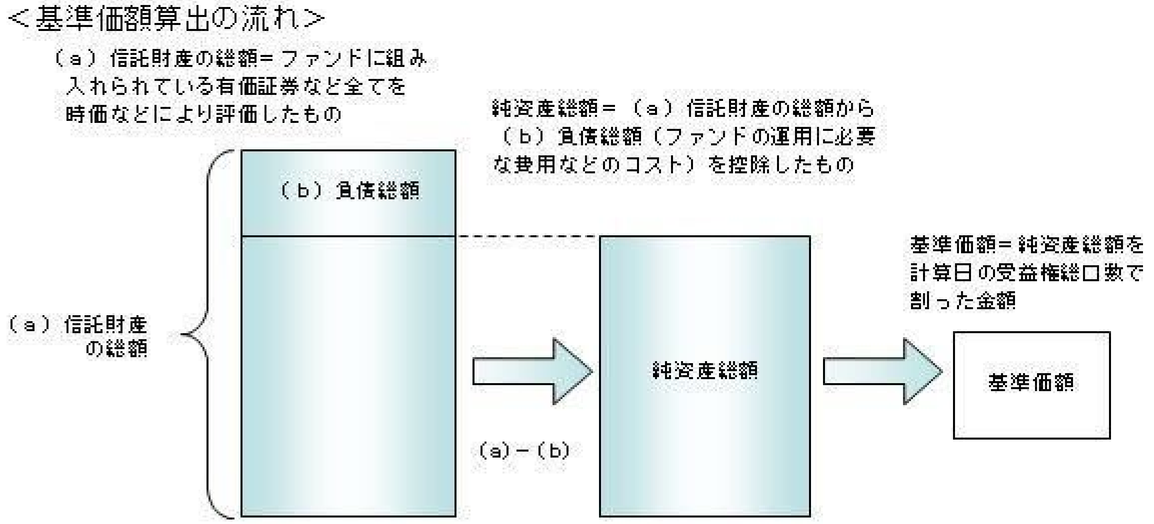
（７）解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して５営業日目からお支払いします。

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

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

①　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および借入有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは１万口当たりに換算した価額で表示することがあります。



②　有価証券などの評価基準
・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。
＜主な資産の評価方法＞
◇マザーファンド受益証券
　基準価額計算日の基準価額で評価します。
◇国内上場株式
　原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

③　基準価額の照会方法
販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞ 日興アセットマネジメント株式会社 ホームページ アドレス　http://www.nikkoam.com/ コールセンター 電話番号　0120-25-1404 午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（平成15年11月 7日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年11月７日から翌年11月６日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ロ）やむを得ない事情が発生したとき

２）この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

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

４）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

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

ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

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

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

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

② 償還金について

・償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して５営業日まで）から受益者に支払います。

・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

③ 信託約款の変更

１）委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

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

３）この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（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。

④ 異議の申立て

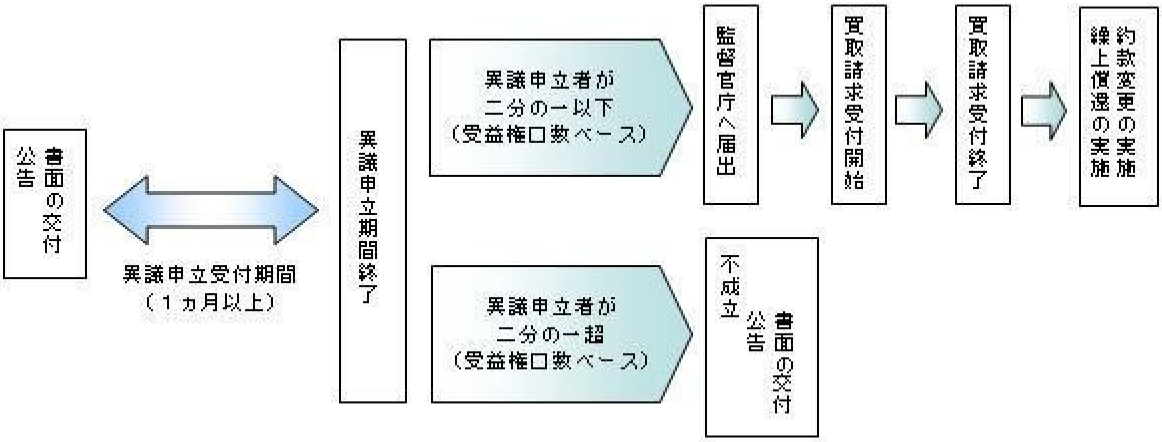
１）繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

２）委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告

し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

3）なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

＜繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ＞



⑤　公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥　運用報告書の作成

・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。
・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス　　http://www.nikkoam.com/

⑦　関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（1）収益分配金・償還金受領権

・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から５年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

（2）解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき販売会社を通じて、委託会社に解約の請求をすることができます。

（3）帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

第３【ファンドの経理状況】

（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13期計算期間（平成27年11月 7日から平成28年11月 7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】

【インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 平成27年11月 6日現在	第13期 平成28年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,373,849	2,150,507
親投資信託受益証券	1,542,164,690	1,582,777,234
未収入金	2,879,314	3,848,937
未収利息	3	-
流動資産合計	1,547,417,856	1,588,776,678
資産合計	1,547,417,856	1,588,776,678
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	849,519	982,299
未払解約金	2,343,391	2,931,073
未払受託者報酬	240,651	243,689
未払委託者報酬	1,765,229	1,787,574
未払利息	-	2
その他未払費用	39,256	39,753
流動負債合計	5,238,046	5,984,390
負債合計	5,238,046	5,984,390
純資産の部		
元本等		
元本	849,519,726	982,299,039
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	692,660,084	600,493,249
（分配準備積立金）	381,057,764	348,688,881
元本等合計	1,542,179,810	1,582,792,288
純資産合計	1,542,179,810	1,582,792,288
負債純資産合計	1,547,417,856	1,588,776,678

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期 自　平成26年11月 7日 至　平成27年11月 6日	第13期 自　平成27年11月 7日 至　平成28年11月 7日
営業収益		
受取利息	2,207	517
有価証券売買等損益	216,297,886	△163,622,538
営業収益合計	216,300,093	△163,622,021
営業費用		
支払利息	-	571
受託者報酬	452,388	479,097
委託者報酬	3,318,390	3,514,335
その他費用	73,791	78,159
営業費用合計	3,844,569	4,072,162
営業利益又は営業損失（△）	212,455,524	△167,694,183
経常利益又は経常損失（△）	212,455,524	△167,694,183
当期純利益又は当期純損失（△）	212,455,524	△167,694,183
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	39,341,039	△27,523,030
期首剰余金又は期首欠損金（△）	424,631,651	692,660,084
剰余金増加額又は欠損金減少額	230,946,449	171,600,710
当期一部解約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	230,946,449	171,600,710
剰余金減少額又は欠損金増加額	135,182,982	122,614,093
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	135,182,982	122,614,093
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	849,519	982,299
期末剰余金又は期末欠損金（△）	692,660,084	600,493,249

（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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月7日から翌年11月6日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は平成27年11月 7日から平成28年11月 7日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

		第12期 平成27年11月 6日現在	第13期 平成28年11月 7日現在
1.	期首元本額	773,625,918円	849,519,726円
	期中追加設定元本額	312,411,268円	288,363,284円
	期中一部解約元本額	236,517,460円	155,583,971円
2.	受益権の総数	849,519,726口	982,299,039口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第12期 自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日			第13期 自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日		
	分配金の計算過程			分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	26,450,462円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	28,237,901円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	146,664,023円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	548,381,938円	C	信託約款に定める収益調整金	753,530,065円
D	信託約款に定める分配準備積立金	208,792,798円	D	信託約款に定める分配準備積立金	321,433,279円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	930,289,221円	E	分配対象収益（A+B+C+D）	1,103,201,245円
F	分配対象収益(1万口当たり)	10,950円	F	分配対象収益(1万口当たり)	11,230円
G	分配金額	849,519円	G	分配金額	982,299円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第12期 自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日	第13期 自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日

金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第12期 平成27年11月 6日現在	第13期 平成28年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

第12期（平成27年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	191,634,757
合計	191,634,757

第13期（平成28年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	△140,777,796
合計	△140,777,796

（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12期 平成27年11月 6日現在		第13期 平成28年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.8154円	1口当たり純資産額	1.6113円
(1万口当たり純資産額)	(18,154円)	(1万口当たり純資産額)	(16,113円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考

親投資信託受益証券	日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	1,342,019,022	1,582,777,234	
合計		1,342,019,022	1,582,777,234	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

　当ファンドは、「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	68,621,670	44,977,231
株式	27,907,326,060	25,119,698,830
派生商品評価勘定	18,679,740	1,774,600
未収入金	77,357,070	201,776,220
未収配当金	207,525,785	217,451,697
未収利息	112	-
前払金	-	3,550,000
流動資産合計	28,279,510,437	25,589,228,578
資産合計	28,279,510,437	25,589,228,578
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	852,020
前受金	17,540,000	-
未払解約金	46,138,822	95,632,741
未払利息	-	42
流動負債合計	63,678,822	96,484,803
負債合計	63,678,822	96,484,803
純資産の部		
元本等		

元本	21,313,752,367	21,614,291,321
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	6,902,079,248	3,878,452,454
元本等合計	28,215,831,615	25,492,743,775
純資産合計	28,215,831,615	25,492,743,775
負債純資産合計	28,279,510,437	25,589,228,578

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		平成27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
1.	期首	平成26年11月 7日	平成27年11月 7日
	期首元本額	25,502,591,555円	21,313,752,367円
	期首からの追加設定元本額	1,825,029,839円	3,753,988,127円
	期首からの一部解約元本額	6,013,869,027円	3,453,449,173円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	182,944,304円	240,921,581円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	713,946,648円	812,659,519円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	1,348,998,781円	1,476,706,820円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	1,605,725,499円	1,674,820,350円
	インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）	1,164,952,931円	1,342,019,022円
	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	5,497,114,326円	5,350,505,667円
	全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型	5,124,803円	5,113,692円
	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	23,674,244円	4,079,233円

	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	65,422,399円	64,849,435円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	52,091,722円	52,835,497円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	80,607,291円	79,884,061円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	95,992,107円	99,146,523円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	6,996,040,892円	6,690,320,683円
	世界アセットバランスファンド４０（適格機関投資家向け）	19,068,512円	17,528,685円
	世界アセットバランスファンド２５（適格機関投資家向け）	42,455,918円	39,632,807円
	グローバルバランスファンド３５（適格機関投資家向け）	41,930,365円	36,400,738円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	266,671,393円	301,756,164円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	812,132,628円	900,722,367円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	1,143,415,021円	1,211,519,643円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	1,155,442,583円	1,212,868,834円
	計	21,313,752,367円	21,614,291,321円
２．	受益権の総数	21,313,752,367口	21,614,291,321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	489,070,000円	366,605,000円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年11月 7日 至 平成27年11月 6日	自 平成27年11月 7日 至 平成28年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	平成27年11月 6日現在	平成28年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
（平成27年11月 6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	85,344,064
合計	85,344,064

（平成28年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△371,955,556
合計	△371,955,556

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（平成27年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	278,755,000	－	297,445,000	18,690,000
合計		278,755,000	－	297,445,000	18,690,000

（平成28年11月 7日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	313,360,000	－	314,295,000	935,000
合計		313,360,000	－	314,295,000	935,000

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

平成27年11月 6日現在		平成28年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.3238円	1口当たり純資産額	1.1794円
(1万口当たり純資産額)	(13,238円)	(1万口当たり純資産額)	(11,794円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	600	2,633.00	1,579,800	
日本水産	18,400	504.00	9,273,600	
マルハニチロ	2,700	2,873.00	7,757,100	
カネコ種苗	500	1,423.00	711,500	
サカタのタネ	2,100	2,948.00	6,190,800	
ホクト	1,400	2,001.00	2,801,400	
ホクリヨウ	200	752.00	150,400	
住石ホールディングス	4,500	88.00	396,000	
日鉄鉱業	400	4,150.00	1,660,000	
三井松島産業	900	1,228.00	1,105,200	
国際石油開発帝石	74,500	947.30	70,573,850	
日本海洋掘削	500	2,260.00	1,130,000	
石油資源開発	2,200	2,209.00	4,859,800	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	1,000	1,450.00	1,450,000	
ショーボンドホールディングス	1,500	4,935.00	7,402,500	
ミライト・ホールディングス	4,300	989.00	4,252,700	
サンヨーホームズ	300	576.00	172,800	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,458.00	583,200	
安藤・間	10,200	694.00	7,078,800	
東急建設	5,000	1,048.00	5,240,000	
コムシスホールディングス	5,600	1,853.00	10,376,800	
ミサワホーム	1,700	825.00	1,402,500	
高松コンストラクショングループ	1,100	2,501.00	2,751,100	
東建コーポレーション	600	7,470.00	4,482,000	

ソネック	200	611.00	122,200	
ヤマウラ	700	525.00	367,500	
大成建設	72,000	783.00	56,376,000	
大林組	42,500	993.00	42,202,500	
清水建設	43,000	921.00	39,603,000	
飛島建設	13,900	182.00	2,529,800	
長谷工コーポレーション	16,500	1,020.00	16,830,000	
松井建設	1,600	1,100.00	1,760,000	
錢高組	2,000	344.00	688,000	
鹿島建設	62,000	699.00	43,338,000	
不動テトラ	11,700	177.00	2,070,900	
大末建設	500	870.00	435,000	
鉄建建設	9,000	330.00	2,970,000	
西松建設	16,000	495.00	7,920,000	
三井住友建設	54,600	99.00	5,405,400	
大豊建設	5,000	570.00	2,850,000	
前田建設工業	9,000	947.00	8,523,000	
ナカノフドー建設	1,100	417.00	458,700	
奥村組	11,000	610.00	6,710,000	
東鉄工業	1,700	2,939.00	4,996,300	
イチケン	2,000	380.00	760,000	
淺沼組	5,000	250.00	1,250,000	
戸田建設	16,000	561.00	8,976,000	
熊谷組	22,000	274.00	6,028,000	
青木あすなろ建設	1,000	719.00	719,000	
北野建設	3,000	272.00	816,000	
植木組	2,000	220.00	440,000	
三井ホーム	2,000	450.00	900,000	
矢作建設工業	1,900	1,048.00	1,991,200	
ピーエス三菱	1,700	356.00	605,200	
日本ハウスホールディングス	2,900	392.00	1,136,800	
大東建託	5,200	17,435.00	90,662,000	
新日本建設	1,700	1,007.00	1,711,900	
ＮＩＰＰＯ	3,000	2,009.00	6,027,000	
東亜道路工業	3,000	276.00	828,000	
前田道路	4,000	1,940.00	7,760,000	

日本道路	4,000	427.00	1,708,000	
東亜建設工業	1,100	2,249.00	2,473,900	
若築建設	9,000	153.00	1,377,000	
東洋建設	4,100	420.00	1,722,000	
五洋建設	15,700	618.00	9,702,600	
大林道路	1,500	652.00	978,000	
福田組	2,000	1,188.00	2,376,000	
住友林業	9,700	1,468.00	14,239,600	
日本基礎技術	1,600	343.00	548,800	
日成ビルド工業	4,000	472.00	1,888,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	8,000	75.00	600,000	
巴コーポレーション	1,900	338.00	642,200	
パナホーム	5,000	759.00	3,795,000	
大和ハウス工業	41,800	2,844.50	118,900,100	
ライト工業	2,800	1,257.00	3,519,600	
積水ハウス	44,500	1,712.00	76,184,000	
日特建設	1,300	486.00	631,800	
北陸電気工事	700	852.00	596,400	
ユアテック	2,000	743.00	1,486,000	
西部電気工業	300	2,001.00	600,300	
四電工	1,000	409.00	409,000	
中電工	1,800	2,126.00	3,826,800	
関電工	6,000	1,007.00	6,042,000	
きんでん	9,500	1,416.00	13,452,000	
東京エネシス	2,000	953.00	1,906,000	
トーエネック	2,000	502.00	1,004,000	
住友電設	1,000	1,104.00	1,104,000	
日本電設工業	2,300	1,789.00	4,114,700	
協和エクシオ	5,600	1,569.00	8,786,400	
新日本空調	1,100	1,129.00	1,241,900	
ＮＤＳ	200	2,573.00	514,600	
九電工	2,800	3,250.00	9,100,000	
三機工業	3,100	917.00	2,842,700	
日揮	13,200	1,788.00	23,601,600	
中外炉工業	4,000	199.00	796,000	
ヤマト	1,400	557.00	779,800	

太平電業	2,000	1,000.00	2,000,000	
高砂熱学工業	3,900	1,453.00	5,666,700	
三晃金属工業	200	2,948.00	589,600	
朝日工業社	300	2,930.00	879,000	
明星工業	2,600	537.00	1,396,200	
大氣社	1,800	2,581.00	4,645,800	
ダイダン	2,000	867.00	1,734,000	
日比谷総合設備	1,600	1,622.00	2,595,200	
東芝プラントシステム	2,300	1,667.00	3,834,100	
東洋エンジニアリング	8,000	348.00	2,784,000	
千代田化工建設	10,000	872.00	8,720,000	
新興プランテック	2,900	774.00	2,244,600	
日本製粉	4,200	1,542.00	6,476,400	
日清製粉グループ本社	15,500	1,553.00	24,071,500	
日東富士製粉	100	3,730.00	373,000	
昭和産業	6,000	585.00	3,510,000	
鳥越製粉	1,100	762.00	838,200	
中部飼料	1,500	899.00	1,348,500	
フィード・ワン	8,500	135.00	1,147,500	
東洋精糖	2,000	109.00	218,000	
日本甜菜製糖	700	2,048.00	1,433,600	
三井製糖	1,000	2,348.00	2,348,000	
塩水港精糖	1,700	238.00	404,600	
日新製糖	600	1,478.00	886,800	
森永製菓	2,700	4,900.00	13,230,000	
中村屋	300	4,575.00	1,372,500	
江崎グリコ	3,500	5,830.00	20,405,000	
名糖産業	600	1,357.00	814,200	
不二家	8,000	204.00	1,632,000	
山崎製パン	10,400	2,332.00	24,252,800	
第一屋製パン	2,000	134.00	268,000	
モロゾフ	2,000	435.00	870,000	
亀田製菓	800	5,240.00	4,192,000	
寿スピリッツ	1,000	2,934.00	2,934,000	
カルビー	5,800	3,465.00	20,097,000	
森永乳業	13,000	882.00	11,466,000	

六甲バター	600	2,757.00	1,654,200	
ヤクルト本社	7,600	4,840.00	36,784,000	
明治ホールディングス	8,400	10,420.00	87,528,000	
雪印メグミルク	3,100	3,450.00	10,695,000	
プリマハム	9,000	413.00	3,717,000	
日本ハム	10,000	2,823.00	28,230,000	
林兼産業	500	870.00	435,000	
丸大食品	7,000	514.00	3,598,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	800	2,798.00	2,238,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	8,200	1,035.00	8,487,000	
サッポロホールディングス	4,600	2,842.00	13,073,200	
アサヒグループホールディングス	26,500	3,670.00	97,255,000	
キリンホールディングス	60,900	1,853.50	112,878,150	
宝ホールディングス	10,300	972.00	10,011,600	
オエノンホールディングス	4,000	242.00	968,000	
養命酒製造	400	1,825.00	730,000	
コカ・コーラウエスト	4,800	3,070.00	14,736,000	
コカ・コーライーストジャパン	5,500	2,276.00	12,518,000	
サントリー食品インターナショナル	9,700	4,715.00	45,735,500	
ダイドードリンコ	700	5,710.00	3,997,000	
伊藤園	4,200	3,770.00	15,834,000	
キーコーヒー	1,200	2,046.00	2,455,200	
ユニカフェ	400	954.00	381,600	
ジャパンフーズ	200	1,146.00	229,200	
日清オイリオグループ	8,000	476.00	3,808,000	
不二製油グループ本社	3,800	2,030.00	7,714,000	
かどや製油	100	3,180.00	318,000	
Ｊ－オイルミルズ	600	3,755.00	2,253,000	
キッコーマン	10,000	3,440.00	34,400,000	
味の素	29,100	2,348.00	68,326,800	
キユーピー	7,200	2,855.00	20,556,000	
ハウス食品グループ本社	5,200	2,323.00	12,079,600	
カゴメ	5,100	2,660.00	13,566,000	
焼津水産化学工業	700	1,009.00	706,300	
アリアケジャパン	1,100	5,990.00	6,589,000	
ピエトロ	200	1,564.00	312,800	

エバラ食品工業	300	1,959.00	587,700	
ニチレイ	7,000	2,365.00	16,555,000	
東洋水産	6,900	4,140.00	28,566,000	
イートアンド	200	2,109.00	421,800	
日清食品ホールディングス	5,500	5,930.00	32,615,000	
永谷園ホールディングス	1,000	1,315.00	1,315,000	
一正蒲鉾	500	1,102.00	551,000	
フジッコ	1,400	2,349.00	3,288,600	
ロック・フィールド	1,500	1,448.00	2,172,000	
日本たばこ産業	78,400	3,925.00	307,720,000	
ケンコーマヨネーズ	500	3,690.00	1,845,000	
わらべや日洋ホールディングス	800	2,450.00	1,960,000	
なとり	700	1,804.00	1,262,800	
北の達人コーポレーション	300	451.00	135,300	
ユーグレナ	4,500	1,366.00	6,147,000	
ミヨシ油脂	5,000	131.00	655,000	
理研ビタミン	400	4,375.00	1,750,000	
片倉工業	1,700	1,223.00	2,079,100	
グンゼ	10,000	369.00	3,690,000	
東洋紡	53,000	171.00	9,063,000	
ユニチカ	37,000	73.00	2,701,000	
富士紡ホールディングス	600	3,485.00	2,091,000	
倉敷紡績	13,000	208.00	2,704,000	
シキボウ	7,000	120.00	840,000	
日本毛織	3,700	759.00	2,808,300	
ダイトウボウ	2,000	68.00	136,000	
トーア紡コーポレーション	600	512.00	307,200	
ダイドーリミテッド	1,500	402.00	603,000	
帝国繊維	1,400	1,528.00	2,139,200	
帝人	10,800	1,955.00	21,114,000	
東レ	96,000	954.70	91,651,200	
サカイオーベックス	400	1,872.00	748,800	
住江織物	3,000	213.00	639,000	
日本フエルト	800	489.00	391,200	
イチカワ	1,000	269.00	269,000	
日東製網	100	1,650.00	165,000	

アツギ	11,000	115.00	1,265,000	
ダイニック	3,000	170.00	510,000	
セーレン	3,300	1,199.00	3,956,700	
ソトー	500	1,185.00	592,500	
東海染工	2,000	128.00	256,000	
小松精練	1,900	629.00	1,195,100	
ワコールホールディングス	8,000	1,228.00	9,824,000	
ホギメディカル	800	6,810.00	5,448,000	
レナウン	3,600	103.00	370,800	
クラウディア	300	492.00	147,600	
ＴＳＩホールディングス	5,400	577.00	3,115,800	
三陽商会	7,000	158.00	1,106,000	
ナイガイ	5,000	56.00	280,000	
オンワードホールディングス	9,000	706.00	6,354,000	
ルック	3,000	158.00	474,000	
キムラタン	58,000	7.00	406,000	
ゴールドウイン	600	4,940.00	2,964,000	
デサント	3,000	1,273.00	3,819,000	
キング	600	393.00	235,800	
ヤマトインターナショナル	800	384.00	307,200	
特種東海製紙	800	3,480.00	2,784,000	
王子ホールディングス	51,000	417.00	21,267,000	
日本製紙	5,900	1,869.00	11,027,100	
三菱製紙	1,900	682.00	1,295,800	
北越紀州製紙	7,400	644.00	4,765,600	
中越パルプ工業	5,000	220.00	1,100,000	
巴川製紙所	2,000	250.00	500,000	
大王製紙	5,200	1,234.00	6,416,800	
レンゴー	12,800	669.00	8,563,200	
トーモク	4,000	304.00	1,216,000	
ザ・パック	900	2,715.00	2,443,500	
クラレ	22,300	1,580.00	35,234,000	
旭化成	83,000	949.50	78,808,500	
共和レザー	800	783.00	626,400	
昭和電工	8,800	1,493.00	13,138,400	
住友化学	97,000	483.00	46,851,000	

日本化成	3,000	142.00	426,000	
住友精化	500	3,860.00	1,930,000	
日産化学工業	7,200	3,615.00	26,028,000	
ラサ工業	5,000	125.00	625,000	
クレハ	1,000	3,950.00	3,950,000	
多木化学	1,000	757.00	757,000	
テイカ	2,000	526.00	1,052,000	
石原産業	2,400	787.00	1,888,800	
片倉コープアグリ	2,000	203.00	406,000	
日東エフシー	800	846.00	676,800	
日本曹達	8,000	464.00	3,712,000	
東ソー	38,000	710.00	26,980,000	
トクヤマ	21,000	448.00	9,408,000	
セントラル硝子	13,000	405.00	5,265,000	
東亞合成	8,300	1,133.00	9,403,900	
大阪ソーダ	6,000	457.00	2,742,000	
関東電化工業	3,000	868.00	2,604,000	
デンカ	27,000	468.00	12,636,000	
信越化学工業	23,700	7,916.00	187,609,200	
日本カーバイド工業	5,000	139.00	695,000	
堺化学工業	5,000	370.00	1,850,000	
エア・ウォーター	10,900	1,887.00	20,568,300	
大陽日酸	10,200	1,031.00	10,516,200	
日本化学工業	5,000	269.00	1,345,000	
日本パーカライジング	6,800	1,366.00	9,288,800	
高圧ガス工業	2,000	656.00	1,312,000	
四国化成工業	2,000	964.00	1,928,000	
戸田工業	3,000	284.00	852,000	
ステラ　ケミファ	600	3,040.00	1,824,000	
保土谷化学工業	500	2,901.00	1,450,500	
日本触媒	2,100	6,750.00	14,175,000	
大日精化工業	5,000	553.00	2,765,000	
カネカ	18,000	839.00	15,102,000	
三菱瓦斯化学	12,300	1,610.00	19,803,000	
三井化学	60,000	481.00	28,860,000	
ＪＳＲ	13,300	1,531.00	20,362,300	

東京応化工業	2,500	3,700.00	9,250,000	
大阪有機化学工業	900	775.00	697,500	
三菱ケミカルホールディングス	88,500	681.30	60,295,050	
ダイセル	17,800	1,149.00	20,452,200	
住友ベークライト	12,000	557.00	6,684,000	
積水化学工業	30,000	1,645.00	49,350,000	
日本ゼオン	11,000	968.00	10,648,000	
アイカ工業	4,200	3,030.00	12,726,000	
宇部興産	67,000	215.00	14,405,000	
積水樹脂	2,100	1,695.00	3,559,500	
タキロン	3,000	482.00	1,446,000	
旭有機材	4,000	204.00	816,000	
日立化成	7,400	2,450.00	18,130,000	
ニチバン	1,000	886.00	886,000	
リケンテクノス	2,800	543.00	1,520,400	
大倉工業	3,000	411.00	1,233,000	
積水化成品工業	1,900	759.00	1,442,100	
群栄化学工業	300	2,924.00	877,200	
タイガースポリマー	600	681.00	408,600	
ミライアル	500	754.00	377,000	
ダイキアクシス	200	963.00	192,600	
ダイキョーニシカワ	2,300	1,366.00	3,141,800	
日本化薬	9,000	1,222.00	10,998,000	
カーリットホールディングス	1,300	523.00	679,900	
日本精化	1,100	761.00	837,100	
扶桑化学工業	900	2,417.00	2,175,300	
ＡＤＥＫＡ	5,700	1,511.00	8,612,700	
日油	11,000	1,044.00	11,484,000	
新日本理化	2,200	159.00	349,800	
ハリマ化成グループ	1,100	643.00	707,300	
花王	33,600	5,282.00	177,475,200	
第一工業製薬	3,000	335.00	1,005,000	
ニイタカ	200	1,487.00	297,400	
三洋化成工業	800	4,585.00	3,668,000	
有機合成薬品工業	800	223.00	178,400	
大日本塗料	8,000	220.00	1,760,000	

日本ペイントホールディングス	10,200	3,435.00	35,037,000	
関西ペイント	13,900	2,201.00	30,593,900	
神東塗料	1,000	201.00	201,000	
中国塗料	3,800	733.00	2,785,400	
日本特殊塗料	900	1,395.00	1,255,500	
藤倉化成	1,800	614.00	1,105,200	
太陽ホールディングス	1,100	3,890.00	4,279,000	
ＤＩＣ	5,200	3,155.00	16,406,000	
サカタインクス	2,700	1,367.00	3,690,900	
東洋インキＳＣホールディングス	13,000	490.00	6,370,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,000	976.00	976,000	
富士フイルムホールディングス	26,200	3,981.00	104,302,200	
資生堂	25,100	2,637.50	66,201,250	
ライオン	17,000	1,895.00	32,215,000	
高砂香料工業	900	2,782.00	2,503,800	
マンダム	1,300	4,745.00	6,168,500	
ミルボン	700	4,715.00	3,300,500	
ファンケル	2,800	1,524.00	4,267,200	
コーセー	2,100	8,570.00	17,997,000	
コタ	500	1,219.00	609,500	
シーズ・ホールディングス	1,700	2,917.00	4,958,900	
シーボン	200	2,188.00	437,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	1,300	8,080.00	10,504,000	
ノエビアホールディングス	800	3,135.00	2,508,000	
アジュバンコスメジャパン	300	862.00	258,600	
エステー	900	1,263.00	1,136,700	
アグロ　カネショウ	500	1,128.00	564,000	
コニシ	2,100	1,233.00	2,589,300	
長谷川香料	1,700	1,850.00	3,145,000	
星光ＰＭＣ	700	1,129.00	790,300	
小林製薬	3,700	5,100.00	18,870,000	
荒川化学工業	1,100	1,502.00	1,652,200	
メック	1,000	973.00	973,000	
日本高純度化学	400	2,426.00	970,400	
タカラバイオ	2,900	1,458.00	4,228,200	
ＪＣＵ	400	4,890.00	1,956,000	

新田ゼラチン	800	707.00	565,600	
ＯＡＴアグリオ	200	1,271.00	254,200	
デクセリアルズ	3,400	821.00	2,791,400	
アース製薬	900	4,805.00	4,324,500	
イハラケミカル工業	1,800	889.00	1,600,200	
北興化学工業	1,000	352.00	352,000	
大成ラミック	400	2,911.00	1,164,400	
クミアイ化学工業	2,700	580.00	1,566,000	
日本農薬	3,000	570.00	1,710,000	
アキレス	1,100	1,478.00	1,625,800	
有沢製作所	2,200	559.00	1,229,800	
日東電工	9,500	7,241.00	68,789,500	
レック	400	2,780.00	1,112,000	
きもと	2,400	237.00	568,800	
藤森工業	1,000	2,525.00	2,525,000	
前澤化成工業	900	1,134.00	1,020,600	
ＪＳＰ	600	2,566.00	1,539,600	
エフピコ	1,200	5,610.00	6,732,000	
天馬	900	1,769.00	1,592,100	
信越ポリマー	2,600	700.00	1,820,000	
東リ	3,000	366.00	1,098,000	
ニフコ	2,300	6,020.00	13,846,000	
日本バルカー工業	1,000	1,388.00	1,388,000	
ユニ・チャーム	26,800	2,388.50	64,011,800	
協和発酵キリン	15,800	1,507.00	23,810,600	
武田薬品工業	49,600	4,540.00	225,184,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	135,100	1,483.00	200,353,300	
大日本住友製薬	9,400	1,716.00	16,130,400	
塩野義製薬	17,900	5,092.00	91,146,800	
田辺三菱製薬	15,400	2,026.00	31,200,400	
わかもと製薬	2,000	225.00	450,000	
あすか製薬	1,500	1,733.00	2,599,500	
日本新薬	3,000	5,140.00	15,420,000	
ビオフェルミン製薬	200	2,626.00	525,200	
中外製薬	13,200	3,335.00	44,022,000	

科研製薬	2,500	6,370.00	15,925,000	
エーザイ	16,300	6,435.00	104,890,500	
ロート製薬	6,500	1,791.00	11,641,500	
小野薬品工業	30,000	2,644.50	79,335,000	
久光製薬	3,700	5,540.00	20,498,000	
持田製薬	900	8,050.00	7,245,000	
参天製薬	24,400	1,447.00	35,306,800	
扶桑薬品工業	500	2,671.00	1,335,500	
日本ケミファ	200	4,600.00	920,000	
ツムラ	4,500	3,030.00	13,635,000	
日医工	3,100	1,780.00	5,518,000	
キッセイ薬品工業	2,300	2,688.00	6,182,400	
生化学工業	2,500	1,620.00	4,050,000	
栄研化学	1,100	2,759.00	3,034,900	
日水製薬	500	1,135.00	567,500	
鳥居薬品	900	2,345.00	2,110,500	
ＪＣＲファーマ	1,000	2,735.00	2,735,000	
東和薬品	600	3,805.00	2,283,000	
富士製薬工業	400	2,462.00	984,800	
沢井製薬	2,300	6,500.00	14,950,000	
ゼリア新薬工業	2,700	1,696.00	4,579,200	
第一三共	38,900	2,307.50	89,761,750	
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	2,259.00	7,228,800	
大幸薬品	700	1,615.00	1,130,500	
ダイト	600	2,230.00	1,338,000	
大塚ホールディングス	28,400	4,542.00	128,992,800	
大正製薬ホールディングス	2,800	9,580.00	26,824,000	
ペプチドリーム	2,300	5,080.00	11,684,000	
日本コークス工業	10,900	90.00	981,000	
昭和シェル石油	11,800	958.00	11,304,400	
ニチレキ	1,700	824.00	1,400,800	
東燃ゼネラル石油	21,000	1,003.00	21,063,000	
ユシロ化学工業	700	1,424.00	996,800	
ビーピー・カストロール	600	1,367.00	820,200	
富士石油	3,100	312.00	967,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	500	1,482.00	741,000	

出光興産	6,300	2,325.00	14,647,500	
ＪＸホールディングス	146,600	404.40	59,285,040	
コスモエネルギーホールディングス	4,000	1,324.00	5,296,000	
横浜ゴム	8,000	1,808.00	14,464,000	
東洋ゴム工業	7,000	1,585.00	11,095,000	
ブリヂストン	44,600	3,892.00	173,583,200	
住友ゴム工業	12,400	1,724.00	21,377,600	
藤倉ゴム工業	1,200	562.00	674,400	
オカモト	4,000	1,138.00	4,552,000	
フコク	500	820.00	410,000	
ニッタ	1,200	2,667.00	3,200,400	
住友理工	2,400	998.00	2,395,200	
三ツ星ベルト	3,000	858.00	2,574,000	
バンドー化学	2,400	995.00	2,388,000	
日東紡績	11,000	378.00	4,158,000	
旭硝子	65,000	708.00	46,020,000	
日本板硝子	6,100	805.00	4,910,500	
石塚硝子	2,000	188.00	376,000	
日本山村硝子	5,000	194.00	970,000	
日本電気硝子	27,000	570.00	15,390,000	
オハラ	500	600.00	300,000	
住友大阪セメント	25,000	423.00	10,575,000	
太平洋セメント	80,000	301.00	24,080,000	
日本ヒューム	1,300	678.00	881,400	
日本コンクリート工業	3,000	365.00	1,095,000	
三谷セキサン	700	2,575.00	1,802,500	
アジアパイルホールディングス	1,700	446.00	758,200	
東海カーボン	12,000	362.00	4,344,000	
日本カーボン	7,000	215.00	1,505,000	
東洋炭素	800	1,535.00	1,228,000	
ノリタケカンパニーリミテド	700	2,387.00	1,670,900	
ＴＯＴＯ	9,700	4,090.00	39,673,000	
日本碍子	16,700	1,944.00	32,464,800	
日本特殊陶業	11,400	2,023.00	23,062,200	
ダントーホールディングス	1,000	188.00	188,000	
ＭＡＲＵＷＡ	500	4,150.00	2,075,000	

品川リフラクトリーズ	3,000	228.00	684,000	
黒崎播磨	3,000	323.00	969,000	
ヨータイ	1,000	309.00	309,000	
イソライト工業	700	269.00	188,300	
東京窯業	1,600	176.00	281,600	
ニッカトー	500	387.00	193,500	
フジミインコーポレーテッド	1,100	1,827.00	2,009,700	
エーアンドエーマテリアル	3,000	95.00	285,000	
ニチアス	7,000	927.00	6,489,000	
ニチハ	1,800	2,462.00	4,431,600	
新日鐵住金	59,600	2,147.00	127,961,200	
神戸製鋼所	22,900	862.00	19,739,800	
合同製鐵	800	1,910.00	1,528,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	36,100	1,475.50	53,265,550	
日新製鋼	6,000	1,364.00	8,184,000	
東京製鐵	6,700	731.00	4,897,700	
共英製鋼	1,400	1,907.00	2,669,800	
大和工業	2,700	2,900.00	7,830,000	
東京鐵鋼	3,000	462.00	1,386,000	
大阪製鐵	800	1,883.00	1,506,400	
淀川製鋼所	1,800	2,956.00	5,320,800	
東洋鋼鈑	3,200	319.00	1,020,800	
丸一鋼管	4,400	3,380.00	14,872,000	
モリ工業	400	1,958.00	783,200	
大同特殊鋼	22,000	436.00	9,592,000	
日本高周波鋼業	5,000	76.00	380,000	
日本冶金工業	11,200	155.00	1,736,000	
山陽特殊製鋼	8,000	526.00	4,208,000	
愛知製鋼	800	5,020.00	4,016,000	
日立金属	13,500	1,343.00	18,130,500	
日本金属	400	1,070.00	428,000	
大平洋金属	9,000	321.00	2,889,000	
新日本電工	7,600	203.00	1,542,800	
栗本鐵工所	500	1,997.00	998,500	
虹技	2,000	239.00	478,000	
日本鋳鉄管	2,000	179.00	358,000	

三菱製鋼	9,000	183.00	1,647,000	
日亜鋼業	1,900	240.00	456,000	
日本精線	1,000	509.00	509,000	
シンニッタン	1,100	500.00	550,000	
新家工業	3,000	146.00	438,000	
大紀アルミニウム工業所	2,000	443.00	886,000	
日本軽金属ホールディングス	30,000	237.00	7,110,000	
三井金属鉱業	36,000	235.00	8,460,000	
東邦亜鉛	8,000	390.00	3,120,000	
三菱マテリアル	8,300	3,015.00	25,024,500	
住友金属鉱山	34,000	1,372.50	46,665,000	
ＤＯＷＡホールディングス	15,000	785.00	11,775,000	
古河機械金属	21,000	155.00	3,255,000	
エス・サイエンス	6,800	35.00	238,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,500	1,333.00	1,999,500	
東邦チタニウム	2,300	679.00	1,561,700	
ＵＡＣＪ	17,000	333.00	5,661,000	
古河電気工業	4,400	3,150.00	13,860,000	
住友電気工業	49,800	1,388.00	69,122,400	
フジクラ	17,400	602.00	10,474,800	
昭和電線ホールディングス	17,000	74.00	1,258,000	
タツタ電線	2,600	430.00	1,118,000	
沖電線	1,000	216.00	216,000	
カナレ電気	200	1,981.00	396,200	
平河ヒューテック	600	1,039.00	623,400	
リョービ	8,000	428.00	3,424,000	
アーレスティ	1,500	1,141.00	1,711,500	
アサヒホールディングス	2,000	1,934.00	3,868,000	
稲葉製作所	700	1,314.00	919,800	
宮地エンジニアリンググループ	4,000	171.00	684,000	
トーカロ	900	2,327.00	2,094,300	
アルファＣｏ	400	993.00	397,200	
ＳＵＭＣＯ	13,800	1,111.00	15,331,800	
川田テクノロジーズ	200	4,630.00	926,000	
東洋製罐グループホールディングス	9,400	1,955.00	18,377,000	
ホッカンホールディングス	2,000	384.00	768,000	

コロナ	700	1,104.00	772,800	
横河ブリッジホールディングス	2,400	1,170.00	2,808,000	
駒井ハルテック	300	2,001.00	600,300	
高田機工	1,000	210.00	210,000	
三和ホールディングス	13,100	1,049.00	13,741,900	
文化シヤッター	3,700	858.00	3,174,600	
三協立山	1,700	1,633.00	2,776,100	
アルインコ	900	975.00	877,500	
東洋シヤッター	300	525.00	157,500	
ＬＩＸＩＬグループ	18,400	2,397.00	44,104,800	
日本フイルコン	1,000	558.00	558,000	
ノーリツ	2,600	2,077.00	5,400,200	
長府製作所	1,400	2,608.00	3,651,200	
リンナイ	2,300	9,290.00	21,367,000	
ダイニチ工業	700	656.00	459,200	
日東精工	2,000	405.00	810,000	
三洋工業	2,000	179.00	358,000	
岡部	2,700	948.00	2,559,600	
ジーテクト	1,400	2,100.00	2,940,000	
中国工業	300	683.00	204,900	
東プレ	2,500	2,527.00	6,317,500	
高周波熱錬	2,500	840.00	2,100,000	
東京製綱	900	1,735.00	1,561,500	
サンコール	700	458.00	320,600	
モリテック　スチール	800	256.00	204,800	
パイオラックス	700	6,530.00	4,571,000	
日本発條	12,400	1,001.00	12,412,400	
中央発條	2,000	295.00	590,000	
アドバネクス	300	1,239.00	371,700	
立川ブラインド工業	600	761.00	456,600	
三益半導体工業	1,000	1,265.00	1,265,000	
日本ドライケミカル	200	2,243.00	448,600	
日本製鋼所	4,400	2,315.00	10,186,000	
三浦工業	5,400	1,731.00	9,347,400	
タクマ	4,000	967.00	3,868,000	
ツガミ	4,000	571.00	2,284,000	

オークマ	9,000	885.00	7,965,000	
東芝機械	8,000	379.00	3,032,000	
アマダホールディングス	17,800	1,207.00	21,484,600	
アイダエンジニアリング	3,700	905.00	3,348,500	
滝澤鉄工所	4,000	140.00	560,000	
富士機械製造	4,000	1,330.00	5,320,000	
牧野フライス製作所	6,000	663.00	3,978,000	
オーエスジー	6,000	2,254.00	13,524,000	
ダイジェット工業	2,000	150.00	300,000	
旭ダイヤモンド工業	3,800	775.00	2,945,000	
ＤＭＧ森精機	7,800	1,105.00	8,619,000	
ソディック	3,400	753.00	2,560,200	
ディスコ	1,600	12,580.00	20,128,000	
日東工器	800	2,364.00	1,891,200	
パンチ工業	500	870.00	435,000	
豊和工業	800	526.00	420,800	
ＯＫＫ	5,000	105.00	525,000	
東洋機械金属	900	407.00	366,300	
津田駒工業	3,000	147.00	441,000	
島精機製作所	1,700	3,390.00	5,763,000	
ＮＣホールディングス	500	874.00	437,000	
フリュー	300	3,255.00	976,500	
ヤマシンフィルタ	300	650.00	195,000	
日阪製作所	1,800	798.00	1,436,400	
やまびこ	2,400	1,050.00	2,520,000	
ペガサスミシン製造	1,300	654.00	850,200	
ナブテスコ	6,900	2,935.00	20,251,500	
三井海洋開発	1,300	1,743.00	2,265,900	
レオン自動機	1,100	821.00	903,100	
ＳＭＣ	3,900	30,700.00	119,730,000	
新川	1,100	726.00	798,600	
ホソカワミクロン	2,000	633.00	1,266,000	
ユニオンツール	600	2,668.00	1,600,800	
オイレス工業	1,700	1,862.00	3,165,400	
日精エー・エス・ビー機械	400	1,949.00	779,600	
サトーホールディングス	1,700	2,077.00	3,530,900	

日本エアーテック	400	625.00	250,000	
日精樹脂工業	1,100	832.00	915,200	
オカダアイヨン	300	811.00	243,300	
ワイエイシイ	500	1,189.00	594,500	
小松製作所	61,000	2,259.50	137,829,500	
住友重機械工業	39,000	601.00	23,439,000	
日立建機	5,900	2,179.00	12,856,100	
日工	400	1,688.00	675,200	
巴工業	400	1,528.00	611,200	
井関農機	14,000	247.00	3,458,000	
ＴＯＷＡ	1,100	1,153.00	1,268,300	
丸山製作所	3,000	169.00	507,000	
北川鉄工所	600	1,731.00	1,038,600	
ローツェ	500	1,774.00	887,000	
タカキタ	400	523.00	209,200	
クボタ	63,500	1,664.50	105,695,750	
荏原実業	400	1,267.00	506,800	
三菱化工機	4,000	202.00	808,000	
月島機械	2,500	1,145.00	2,862,500	
帝国電機製作所	1,000	794.00	794,000	
新東工業	3,000	881.00	2,643,000	
澁谷工業	1,100	2,110.00	2,321,000	
アイチ　コーポレーション	1,900	842.00	1,599,800	
小森コーポレーション	3,200	1,349.00	4,316,800	
鶴見製作所	1,000	1,482.00	1,482,000	
住友精密工業	2,000	314.00	628,000	
酒井重工業	2,000	211.00	422,000	
荏原製作所	5,500	3,050.00	16,775,000	
石井鐵工所	200	1,521.00	304,200	
酉島製作所	1,300	1,116.00	1,450,800	
北越工業	1,400	678.00	949,200	
ダイキン工業	17,200	10,055.00	172,946,000	
オルガノ	3,000	443.00	1,329,000	
トーヨーカネツ	6,000	229.00	1,374,000	
栗田工業	7,500	2,403.00	18,022,500	
椿本チエイン	8,000	827.00	6,616,000	

大同工業	3,000	240.00	720,000	
木村化工機	1,200	347.00	416,400	
アネスト岩田	2,300	1,120.00	2,576,000	
ダイフク	6,300	1,912.00	12,045,600	
サムコ	400	910.00	364,000	
加藤製作所	700	2,616.00	1,831,200	
油研工業	2,000	181.00	362,000	
タダノ	6,600	1,088.00	7,180,800	
フジテック	3,700	1,170.00	4,329,000	
ＣＫＤ	3,800	1,281.00	4,867,800	
キトー	1,600	959.00	1,534,400	
平和	3,900	2,445.00	9,535,500	
理想科学工業	1,200	1,769.00	2,122,800	
ＳＡＮＫＹＯ	3,500	3,670.00	12,845,000	
日本金銭機械	1,200	1,615.00	1,938,000	
マースエンジニアリング	700	1,999.00	1,399,300	
福島工業	800	3,365.00	2,692,000	
オーイズミ	500	704.00	352,000	
ダイコク電機	500	1,564.00	782,000	
竹内製作所	2,300	1,943.00	4,468,900	
アマノ	3,900	1,939.00	7,562,100	
ＪＵＫＩ	2,000	899.00	1,798,000	
サンデンホールディングス	8,000	318.00	2,544,000	
蛇の目ミシン工業	1,300	813.00	1,056,900	
マックス	2,000	1,297.00	2,594,000	
グローリー	4,000	3,465.00	13,860,000	
新晃工業	900	1,287.00	1,158,300	
大和冷機工業	2,000	900.00	1,800,000	
セガサミーホールディングス	12,500	1,629.00	20,362,500	
日本ピストンリング	500	1,540.00	770,000	
リケン	600	3,725.00	2,235,000	
ＴＰＲ	1,400	3,035.00	4,249,000	
ツバキ・ナカシマ	1,400	1,706.00	2,388,400	
ホシザキ	2,800	9,280.00	25,984,000	
大豊工業	1,000	1,510.00	1,510,000	
日本精工	25,900	1,106.00	28,645,400	

ＮＴＮ	29,000	353.00	10,237,000	
ジェイテクト	13,500	1,563.00	21,100,500	
不二越	13,000	398.00	5,174,000	
日本トムソン	4,000	376.00	1,504,000	
ＴＨＫ	8,900	2,191.00	19,499,900	
ユーシン精機	600	2,434.00	1,460,400	
前澤給装工業	500	1,376.00	688,000	
イーグル工業	1,400	1,482.00	2,074,800	
前澤工業	900	346.00	311,400	
日本ピラー工業	1,300	1,076.00	1,398,800	
キッツ	6,100	647.00	3,946,700	
日立工機	3,300	908.00	2,996,400	
マキタ	8,200	7,340.00	60,188,000	
日立造船	10,000	536.00	5,360,000	
三菱重工業	212,000	426.30	90,375,600	
ＩＨＩ	97,000	279.00	27,063,000	
スター精密	2,200	1,460.00	3,212,000	
日清紡ホールディングス	7,000	1,091.00	7,637,000	
イビデン	8,800	1,360.00	11,968,000	
コニカミノルタ	29,500	923.00	27,228,500	
ブラザー工業	16,300	1,844.00	30,057,200	
ミネベア	20,300	969.00	19,670,700	
日立製作所	303,000	548.30	166,134,900	
東芝	282,000	375.50	105,891,000	
三菱電機	134,700	1,470.50	198,076,350	
富士電機	38,000	532.00	20,216,000	
東洋電機製造	3,000	297.00	891,000	
安川電機	14,600	1,670.00	24,382,000	
シンフォニアテクノロジー	8,000	194.00	1,552,000	
明電舎	12,000	327.00	3,924,000	
オリジン電気	2,000	269.00	538,000	
山洋電気	3,000	712.00	2,136,000	
デンヨー	1,200	1,291.00	1,549,200	
東芝テック	8,000	457.00	3,656,000	
芝浦メカトロニクス	2,000	244.00	488,000	
マブチモーター	3,500	6,340.00	22,190,000	

日本電産	16,400	10,150.00	166,460,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	2,358.00	471,600	
東光高岳	600	1,991.00	1,194,600	
ダブル・スコープ	1,200	1,817.00	2,180,400	
ダイヘン	7,000	607.00	4,249,000	
田淵電機	2,000	324.00	648,000	
ヤーマン	100	3,080.00	308,000	
ＪＶＣケンウッド	9,300	317.00	2,948,100	
ミマキエンジニアリング	1,200	538.00	645,600	
第一精工	600	1,149.00	689,400	
日新電機	2,600	1,302.00	3,385,200	
大崎電気工業	3,000	963.00	2,889,000	
オムロン	13,400	3,985.00	53,399,000	
日東工業	1,900	1,515.00	2,878,500	
ＩＤＥＣ	1,600	967.00	1,547,200	
不二電機工業	100	1,392.00	139,200	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	24,000	448.00	10,752,000	
サクサホールディングス	3,000	213.00	639,000	
メルコホールディングス	700	2,884.00	2,018,800	
テクノメディカ	300	1,778.00	533,400	
日本電気	174,000	288.00	50,112,000	
富士通	122,000	611.60	74,615,200	
沖電気工業	5,400	1,350.00	7,290,000	
岩崎通信機	6,000	75.00	450,000	
電気興業	4,000	565.00	2,260,000	
サンケン電気	7,000	356.00	2,492,000	
ナカヨ	1,000	361.00	361,000	
アイホン	700	1,795.00	1,256,500	
ルネサスエレクトロニクス	6,600	743.00	4,903,800	
セイコーエプソン	18,800	2,138.00	40,194,400	
ワコム	9,800	306.00	2,998,800	
アルバック	2,300	3,205.00	7,371,500	
アクセル	500	782.00	391,000	
ＥＩＺＯ	1,300	3,170.00	4,121,000	
ジャパンディスプレイ	23,600	206.00	4,861,600	
日本信号	3,500	910.00	3,185,000	

京三製作所	3,000	389.00	1,167,000	
能美防災	1,400	1,646.00	2,304,400	
ホーチキ	900	1,262.00	1,135,800	
エレコム	1,100	2,040.00	2,244,000	
日本無線	700	1,350.00	945,000	
パナソニック	144,300	995.00	143,578,500	
アンリツ	9,200	546.00	5,023,200	
富士通ゼネラル	4,000	2,364.00	9,456,000	
日立国際電気	3,300	2,131.00	7,032,300	
ソニー	89,200	3,149.00	280,890,800	
ＴＤＫ	7,100	7,050.00	50,055,000	
帝国通信工業	3,000	160.00	480,000	
ミツミ電機	4,500	579.00	2,605,500	
タムラ製作所	5,000	424.00	2,120,000	
アルプス電気	11,600	2,441.00	28,315,600	
池上通信機	4,000	131.00	524,000	
パイオニア	19,000	249.00	4,731,000	
日本電波工業	1,200	828.00	993,600	
鈴木	500	509.00	254,500	
日本トリム	300	4,445.00	1,333,500	
ローランド　ディー．ジー．	500	2,349.00	1,174,500	
フォスター電機	1,500	1,810.00	2,715,000	
クラリオン	7,000	345.00	2,415,000	
ＳＭＫ	2,000	403.00	806,000	
ヨコオ	900	678.00	610,200	
ホシデン	3,800	827.00	3,142,600	
ヒロセ電機	2,000	13,470.00	26,940,000	
日本航空電子工業	3,000	1,432.00	4,296,000	
ＴＯＡ	1,500	938.00	1,407,000	
日立マクセル	1,900	1,902.00	3,613,800	
古野電気	1,600	758.00	1,212,800	
ユニデンホールディングス	4,000	148.00	592,000	
アルパイン	3,000	1,399.00	4,197,000	
スミダコーポレーション	1,000	1,046.00	1,046,000	
アイコム	700	1,938.00	1,356,600	
リオン	500	1,443.00	721,500	

本多通信工業	400	1,277.00	510,800	
船井電機	1,400	859.00	1,202,600	
横河電機	13,700	1,479.00	20,262,300	
新電元工業	5,000	424.00	2,120,000	
アズビル	3,800	3,085.00	11,723,000	
東亜ディーケーケー	700	485.00	339,500	
日本光電工業	5,300	2,621.00	13,891,300	
チノー	400	1,031.00	412,400	
共和電業	1,500	375.00	562,500	
日本電子材料	500	555.00	277,500	
堀場製作所	2,500	4,980.00	12,450,000	
アドバンテスト	8,600	1,477.00	12,702,200	
小野測器	600	872.00	523,200	
エスペック	1,100	1,229.00	1,351,900	
パナソニック　デバイスＳＵＮＸ	1,100	619.00	680,900	
キーエンス	2,900	74,430.00	215,847,000	
日置電機	700	2,004.00	1,402,800	
シスメックス	9,800	7,100.00	69,580,000	
日本マイクロニクス	2,400	1,189.00	2,853,600	
メガチップス	1,200	2,235.00	2,682,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	700	4,495.00	3,146,500	
澤藤電機	1,000	204.00	204,000	
コーセル	1,700	1,205.00	2,048,500	
イリソ電子工業	400	6,150.00	2,460,000	
新日本無線	1,100	321.00	353,100	
オプテックス	900	2,572.00	2,314,800	
千代田インテグレ	700	2,168.00	1,517,600	
アイ・オー・データ機器	400	973.00	389,200	
レーザーテック	1,500	1,898.00	2,847,000	
スタンレー電気	9,000	2,959.00	26,631,000	
岩崎電気	5,000	163.00	815,000	
ウシオ電機	7,700	1,342.00	10,333,400	
岡谷電機産業	700	385.00	269,500	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,200	426.00	511,200	
日本セラミック	1,000	2,048.00	2,048,000	
遠藤照明	600	835.00	501,000	

日本デジタル研究所	1,200	2,411.00	2,893,200	
古河電池	1,000	725.00	725,000	
双信電機	600	273.00	163,800	
山一電機	1,200	875.00	1,050,000	
図研	800	1,043.00	834,400	
日本電子	5,000	443.00	2,215,000	
カシオ計算機	10,600	1,323.00	14,023,800	
ファナック	12,800	18,840.00	241,152,000	
日本シイエムケイ	2,700	559.00	1,509,300	
エンプラス	600	3,275.00	1,965,000	
大真空	500	1,090.00	545,000	
ローム	6,100	5,910.00	36,051,000	
浜松ホトニクス	9,800	3,065.00	30,037,000	
三井ハイテック	1,700	677.00	1,150,900	
新光電気工業	4,800	658.00	3,158,400	
京セラ	20,700	5,125.00	106,087,500	
太陽誘電	6,100	1,065.00	6,496,500	
村田製作所	13,200	13,465.00	177,738,000	
ユーシン	1,700	744.00	1,264,800	
双葉電子工業	2,100	1,746.00	3,666,600	
北陸電気工業	5,000	126.00	630,000	
ニチコン	3,900	926.00	3,611,400	
日本ケミコン	11,000	175.00	1,925,000	
ＫＯＡ	1,700	938.00	1,594,600	
市光工業	3,000	303.00	909,000	
小糸製作所	7,600	5,420.00	41,192,000	
ミツバ	2,300	1,532.00	3,523,600	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2,600	7,070.00	18,382,000	
キヤノン電子	1,100	1,610.00	1,771,000	
キヤノン	68,000	2,951.50	200,702,000	代用有価証券 10,000株
リコー	38,000	851.00	32,338,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,000	237.00	474,000	
東京エレクトロン	8,400	9,590.00	80,556,000	
トヨタ紡織	4,400	2,724.00	11,985,600	
芦森工業	3,000	160.00	480,000	

ユニプレス	2,400	1,912.00	4,588,800	
豊田自動織機	11,500	4,670.00	53,705,000	
モリタホールディングス	2,200	1,547.00	3,403,400	
三櫻工業	1,600	718.00	1,148,800	
デンソー	31,100	4,512.00	140,323,200	
東海理化電機製作所	3,300	1,967.00	6,491,100	
三井造船	46,000	144.00	6,624,000	
川崎重工業	98,000	293.00	28,714,000	
名村造船所	3,800	609.00	2,314,200	
サノヤスホールディングス	1,600	266.00	425,600	
日本車輌製造	5,000	263.00	1,315,000	
ニチユ三菱フォークリフト	1,500	695.00	1,042,500	
近畿車輛	200	2,393.00	478,600	
日産自動車	151,100	1,029.00	155,481,900	
いすゞ自動車	36,600	1,256.50	45,987,900	
トヨタ自動車	157,000	5,810.00	912,170,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	18,000	1,140.00	20,520,000	
三菱自動車工業	46,300	544.00	25,187,200	
エフテック	700	1,350.00	945,000	
レシップホールディングス	400	860.00	344,000	
ＧＭＢ	200	1,040.00	208,000	
ファルテック	200	1,265.00	253,000	
武蔵精密工業	1,500	2,481.00	3,721,500	
日産車体	5,500	1,052.00	5,786,000	
新明和工業	5,000	874.00	4,370,000	
極東開発工業	2,500	1,273.00	3,182,500	
日信工業	2,800	1,549.00	4,337,200	
トピー工業	1,000	2,508.00	2,508,000	
ティラド	5,000	239.00	1,195,000	
曙ブレーキ工業	6,000	263.00	1,578,000	
タチエス	2,200	1,718.00	3,779,600	
ＮＯＫ	6,100	2,326.00	14,188,600	
フタバ産業	3,800	661.00	2,511,800	
ＫＹＢ	14,000	464.00	6,496,000	
大同メタル工業	1,600	1,118.00	1,788,800	

プレス工業	6,700	495.00	3,316,500	
ミクニ	1,600	350.00	560,000	
カルソニックカンセイ	8,000	1,330.00	10,640,000	
太平洋工業	2,600	1,275.00	3,315,000	
ケーヒン	2,900	1,677.00	4,863,300	
河西工業	1,700	1,178.00	2,002,600	
アイシン精機	11,500	4,565.00	52,497,500	
富士機工	1,300	381.00	495,300	
マツダ	40,000	1,616.50	64,660,000	
今仙電機製作所	1,200	877.00	1,052,400	
本田技研工業	113,600	2,941.00	334,097,600	
スズキ	25,000	3,831.00	95,775,000	
富士重工業	39,200	3,933.00	154,173,600	
安永	500	520.00	260,000	
ヤマハ発動機	17,800	2,393.00	42,595,400	
ショーワ	3,300	617.00	2,036,100	
ＴＢＫ	1,600	429.00	686,400	
エクセディ	1,700	2,943.00	5,003,100	
豊田合成	4,100	2,341.00	9,598,100	
愛三工業	2,200	850.00	1,870,000	
盟和産業	200	1,087.00	217,400	
ヨロズ	1,200	1,662.00	1,994,400	
エフ・シー・シー	2,100	1,929.00	4,050,900	
シマノ	5,100	17,880.00	91,188,000	
タカタ	2,300	356.00	818,800	
テイ・エス　テック	2,900	2,735.00	7,931,500	
ジャムコ	700	1,937.00	1,355,900	
テルモ	19,300	4,065.00	78,454,500	
クリエートメディック	500	926.00	463,000	
日機装	4,400	892.00	3,924,800	
島津製作所	16,000	1,488.00	23,808,000	
ＪＭＳ	2,000	271.00	542,000	
長野計器	1,000	634.00	634,000	
ブイ・テクノロジー	300	12,320.00	3,696,000	
東京計器	5,000	176.00	880,000	
愛知時計電機	200	3,375.00	675,000	

オーバル	1,300	255.00	331,500	
東京精密	2,400	2,833.00	6,799,200	
マニー	1,700	2,359.00	4,010,300	
ニコン	22,000	1,626.00	35,772,000	
トプコン	6,400	1,718.00	10,995,200	
オリンパス	20,200	3,525.00	71,205,000	
理研計器	1,100	1,273.00	1,400,300	
タムロン	1,100	1,671.00	1,838,100	
ＨＯＹＡ	26,500	4,312.00	114,268,000	
ノーリツ鋼機	1,300	776.00	1,008,800	
エー・アンド・デイ	1,200	426.00	511,200	
シチズン時計	14,300	580.00	8,294,000	
リズム時計工業	5,000	182.00	910,000	
大研医器	1,200	792.00	950,400	
メニコン	900	2,943.00	2,648,700	
松風	700	1,257.00	879,900	
セイコーホールディングス	9,000	336.00	3,024,000	
ニプロ	8,700	1,262.00	10,979,400	
スノーピーク	200	3,450.00	690,000	
パラマウントベッドホールディングス	1,200	4,100.00	4,920,000	
トランザクション	300	1,800.00	540,000	
ＳＨＯ－ＢＩ	500	418.00	209,000	
ニホンフラッシュ	600	1,137.00	682,200	
前田工繊	1,300	1,087.00	1,413,100	
永大産業	2,000	463.00	926,000	
アートネイチャー	1,400	606.00	848,400	
ダンロップスポーツ	800	1,007.00	805,600	
バンダイナムコホールディングス	13,900	3,055.00	42,464,500	
アイフィスジャパン	300	418.00	125,400	
共立印刷	2,200	304.00	668,800	
ＳＨＯＥＩ	600	1,896.00	1,137,600	
フランスベッドホールディングス	1,600	888.00	1,420,800	
パイロットコーポレーション	2,200	4,530.00	9,966,000	
萩原工業	400	2,422.00	968,800	
トッパン・フォームズ	2,200	1,036.00	2,279,200	
フジシールインターナショナル	1,400	4,185.00	5,859,000	

タカラトミー	4,900	1,098.00	5,380,200	
廣済堂	1,300	306.00	397,800	
Ａｓ－ｍｅエステール	400	646.00	258,400	
アーク	5,800	78.00	452,400	
タカノ	600	746.00	447,600	
プロネクサス	1,200	1,000.00	1,200,000	
ホクシン	1,000	207.00	207,000	
ウッドワン	2,000	260.00	520,000	
大建工業	900	2,003.00	1,802,700	
凸版印刷	35,000	968.00	33,880,000	
大日本印刷	36,000	1,041.00	37,476,000	
図書印刷	2,000	456.00	912,000	
共同印刷	4,000	350.00	1,400,000	
日本写真印刷	2,100	2,483.00	5,214,300	
光村印刷	1,000	217.00	217,000	
宝印刷	600	1,440.00	864,000	
アシックス	12,600	2,318.00	29,206,800	
ツツミ	400	1,658.00	663,200	
小松ウオール工業	500	1,705.00	852,500	
ヤマハ	8,500	3,735.00	31,747,500	
河合楽器製作所	500	2,038.00	1,019,000	
クリナップ	1,500	876.00	1,314,000	
ピジョン	7,600	2,846.00	21,629,600	
兼松サステック	1,000	159.00	159,000	
キングジム	1,000	833.00	833,000	
リンテック	3,000	2,294.00	6,882,000	
ＴＡＳＡＫＩ	300	1,452.00	435,600	
イトーキ	2,700	637.00	1,719,900	
任天堂	7,800	24,535.00	191,373,000	
三菱鉛筆	1,000	5,330.00	5,330,000	
タカラスタンダード	2,600	1,798.00	4,674,800	
コクヨ	6,500	1,338.00	8,697,000	
ナカバヤシ	2,000	237.00	474,000	
岡村製作所	4,400	980.00	4,312,000	
美津濃	7,000	572.00	4,004,000	
アデランス	2,300	618.00	1,421,400	

東京電力ホールディングス	107,200	410.00	43,952,000	
中部電力	41,600	1,534.50	63,835,200	
関西電力	51,500	1,027.50	52,916,250	
中国電力	17,500	1,192.00	20,860,000	
北陸電力	12,400	1,166.00	14,458,400	
東北電力	31,500	1,249.00	39,343,500	
四国電力	11,400	1,003.00	11,434,200	
九州電力	27,900	1,062.00	29,629,800	
北海道電力	11,800	797.00	9,404,600	
沖縄電力	1,900	2,410.00	4,579,000	
電源開発	10,100	2,259.00	22,815,900	
エフオン	600	715.00	429,000	
イーレックス	500	3,120.00	1,560,000	
東京瓦斯	135,000	479.70	64,759,500	
大阪瓦斯	122,000	434.10	52,960,200	
東邦瓦斯	32,000	928.00	29,696,000	
北海道瓦斯	3,000	268.00	804,000	
広島ガス	2,600	362.00	941,200	
西部瓦斯	14,000	244.00	3,416,000	
静岡ガス	3,900	822.00	3,205,800	
メタウォーター	700	2,780.00	1,946,000	
ＳＢＳホールディングス	1,300	932.00	1,211,600	
東武鉄道	67,000	522.00	34,974,000	
相鉄ホールディングス	20,000	488.00	9,760,000	
東京急行電鉄	69,000	783.00	54,027,000	
京浜急行電鉄	34,000	1,050.00	35,700,000	
小田急電鉄	20,200	2,095.00	42,319,000	
京王電鉄	35,000	867.00	30,345,000	
京成電鉄	9,500	2,508.00	23,826,000	
富士急行	4,000	1,034.00	4,136,000	
東日本旅客鉄道	24,400	9,088.00	221,747,200	
西日本旅客鉄道	12,100	6,367.00	77,040,700	
東海旅客鉄道	10,500	17,510.00	183,855,000	
西武ホールディングス	17,500	1,776.00	31,080,000	
鴻池運輸	1,800	1,404.00	2,527,200	
西日本鉄道	15,000	483.00	7,245,000	

ハマキョウレックス	800	1,907.00	1,525,600	
サカイ引越センター	400	2,314.00	925,600	
近鉄グループホールディングス	127,000	416.00	52,832,000	
阪急阪神ホールディングス	16,000	3,450.00	55,200,000	
南海電気鉄道	26,000	491.00	12,766,000	
京阪ホールディングス	28,000	681.00	19,068,000	
神戸電鉄	3,000	366.00	1,098,000	
名古屋鉄道	46,000	552.00	25,392,000	
山陽電気鉄道	5,000	510.00	2,550,000	
日本通運	49,000	539.00	26,411,000	
ヤマトホールディングス	22,600	2,234.50	50,499,700	
山九	16,000	619.00	9,904,000	
丸運	600	240.00	144,000	
丸全昭和運輸	4,000	430.00	1,720,000	
センコー	5,700	750.00	4,275,000	
トナミホールディングス	3,000	282.00	846,000	
ニッコンホールディングス	4,300	2,179.00	9,369,700	
日本石油輸送	100	2,267.00	226,700	
福山通運	8,000	583.00	4,664,000	
セイノーホールディングス	9,000	1,174.00	10,566,000	
神奈川中央交通	2,000	743.00	1,486,000	
日立物流	2,600	2,143.00	5,571,800	
丸和運輸機関	300	2,993.00	897,900	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,300	1,031.00	1,340,300	
日本郵船	107,000	190.00	20,330,000	
商船三井	66,000	247.00	16,302,000	
川崎汽船	48,000	242.00	11,616,000	
ＮＳユナイテッド海運	6,000	142.00	852,000	
明治海運	1,100	360.00	396,000	
飯野海運	6,600	374.00	2,468,400	
共栄タンカー	1,000	192.00	192,000	
乾汽船	900	991.00	891,900	
日本航空	22,800	3,146.00	71,728,800	
ＡＮＡホールディングス	234,000	293.30	68,632,200	
パスコ	1,000	368.00	368,000	
トランコム	400	5,560.00	2,224,000	

日新	5,000	353.00	1,765,000	
三菱倉庫	8,000	1,410.00	11,280,000	
三井倉庫ホールディングス	7,000	301.00	2,107,000	
住友倉庫	9,000	565.00	5,085,000	
澁澤倉庫	3,000	301.00	903,000	
東陽倉庫	2,200	268.00	589,600	
日本トランスシティ	3,000	387.00	1,161,000	
ケイヒン	2,000	142.00	284,000	
中央倉庫	700	1,000.00	700,000	
安田倉庫	1,000	680.00	680,000	
東洋埠頭	4,000	171.00	684,000	
宇徳	1,000	373.00	373,000	
上組	15,000	906.00	13,590,000	
サンリツ	300	486.00	145,800	
キムラユニティー	300	1,085.00	325,500	
キユーソー流通システム	400	2,281.00	912,400	
郵船ロジスティクス	1,200	1,022.00	1,226,400	
近鉄エクスプレス	2,200	1,381.00	3,038,200	
東海運	700	380.00	266,000	
エーアイテイー	800	917.00	733,600	
内外トランスライン	400	992.00	396,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	1,400	1,963.00	2,748,200	
システナ	1,000	1,769.00	1,769,000	
デジタルアーツ	600	2,651.00	1,590,600	
新日鉄住金ソリューションズ	2,100	1,959.00	4,113,900	
キューブシステム	500	657.00	328,500	
コア	500	1,184.00	592,000	
ソフトクリエイトホールディングス	600	1,178.00	706,800	
ＴＩＳ	4,100	2,307.00	9,458,700	
ネオス	400	466.00	186,400	
電算システム	500	1,700.00	850,000	
グリー	7,600	608.00	4,620,800	
コーエーテクモホールディングス	3,000	1,928.00	5,784,000	
三菱総合研究所	500	3,125.00	1,562,500	
ボルテージ	200	1,000.00	200,000	
電算	100	2,023.00	202,300	

ＡＧＳ	300	1,130.00	339,000	
ファインデックス	900	890.00	801,000	
ヒト・コミュニケーションズ	300	1,473.00	441,900	
ブレインパッド	200	940.00	188,000	
ＫＬａｂ	2,400	621.00	1,490,400	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	900	855.00	769,500	
イーブックイニシアティブジャパン	200	852.00	170,400	
ネクソン	13,700	1,670.00	22,879,000	
アイスタイル	1,900	653.00	1,240,700	
エムアップ	400	586.00	234,400	
エイチーム	700	2,241.00	1,568,700	
テクノスジャパン	500	2,488.00	1,244,000	
ｅｎｉｓｈ	400	454.00	181,600	
コロプラ	3,500	1,417.00	4,959,500	
モバイルクリエイト	800	356.00	284,800	
ブロードリーフ	1,500	1,019.00	1,528,500	
ハーツユナイテッドグループ	700	1,843.00	1,290,100	
メディアドゥ	300	1,400.00	420,000	
ブイキューブ	700	779.00	545,300	
サイバーリンクス	200	903.00	180,600	
ディー・エル・イー	400	717.00	286,800	
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	400	908.00	363,200	
オプティム	100	5,890.00	589,000	
ベリサーブ	100	2,973.00	297,300	
ティーガイア	1,100	1,602.00	1,762,200	
日本アジアグループ	1,500	357.00	535,500	
豆蔵ホールディングス	900	1,023.00	920,700	
テクマトリックス	400	1,883.00	753,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	26,200	253.00	6,628,600	
GMOペイメントゲートウェイ	1,000	5,010.00	5,010,000	
ザッパラス	800	390.00	312,000	
インターネットイニシアティブ	1,800	1,628.00	2,930,400	
さくらインターネット	1,000	951.00	951,000	
GMOクラウド	300	1,045.00	313,500	
ＳＲＡホールディングス	700	2,357.00	1,649,900	

Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	300	997.00	299,100	
システムインテグレータ	200	586.00	117,200	
朝日ネット	1,200	424.00	508,800	
アドソル日進	300	1,340.00	402,000	
フリービット	700	835.00	584,500	
コムチュア	200	3,205.00	641,000	
サイバーコム	200	827.00	165,400	
ｇｕｍｉ	1,300	692.00	899,600	
ＰＣＩホールディングス	200	2,329.00	465,800	
パイプドＨＤ	200	1,111.00	222,200	
ＬＩＮＥ	2,100	4,015.00	8,431,500	
ソルクシーズ	400	544.00	217,600	
フェイス	400	1,150.00	460,000	
ハイマックス	200	1,256.00	251,200	
野村総合研究所	8,500	3,565.00	30,302,500	
サイバネットシステム	1,000	661.00	661,000	
ＣＥホールディングス	200	1,060.00	212,000	
インテージホールディングス	700	1,795.00	1,256,500	
東邦システムサイエンス	400	595.00	238,000	
ソースネクスト	800	510.00	408,000	
ティー・ワイ・オー	2,700	150.00	405,000	
フォーカスシステムズ	500	495.00	247,500	
クレスコ	300	2,184.00	655,200	
フジ・メディア・ホールディングス	13,000	1,502.00	19,526,000	
オービック	4,300	5,180.00	22,274,000	
ジャストシステム	2,000	1,033.00	2,066,000	
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	600	1,280.00	768,000	
ヤフー	89,300	418.00	37,327,400	
トレンドマイクロ	6,600	3,585.00	23,661,000	
インフォメーション・ディベロプメント	200	1,391.00	278,200	
日本オラクル	2,000	5,570.00	11,140,000	
アルファシステムズ	400	1,739.00	695,600	
フューチャー	1,700	711.00	1,208,700	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	900	863.00	776,700	
ソフトバンク・テクノロジー	300	3,110.00	933,000	
トーセ	400	759.00	303,600	

オービックビジネスコンサルタント	600	4,965.00	2,979,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	2,800	2,924.00	8,187,200	
アイティフォー	1,600	619.00	990,400	
東計電算	200	2,016.00	403,200	
エックスネット	100	1,553.00	155,300	
大塚商会	3,400	5,300.00	18,020,000	
サイボウズ	1,700	424.00	720,800	
ソフトブレーン	1,700	356.00	605,200	
電通国際情報サービス	800	1,767.00	1,413,600	
デジタルガレージ	2,000	1,870.00	3,740,000	
ＥMシステムズ	400	1,548.00	619,200	
ウェザーニューズ	400	3,300.00	1,320,000	
ＣＩＪ	1,100	497.00	546,700	
東洋ビジネスエンジニアリング	200	1,441.00	288,200	
日本エンタープライズ	1,300	262.00	340,600	
WOWOW	600	2,931.00	1,758,600	
フュージョンパートナー	800	902.00	721,600	
日本コロムビア	400	582.00	232,800	
イマジカ・ロボット　ホールディングス	1,100	586.00	644,600	
ネットワンシステムズ	5,400	742.00	4,006,800	
システムソフト	2,300	153.00	351,900	
アルゴグラフィックス	600	1,969.00	1,181,400	
マーベラス	2,100	759.00	1,593,900	
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,300	1,386.00	3,187,800	
日本ユニシス	3,400	1,229.00	4,178,600	
兼松エレクトロニクス	800	2,205.00	1,764,000	
東京放送ホールディングス	8,200	1,637.00	13,423,400	
日本テレビホールディングス	11,400	1,867.00	21,283,800	
朝日放送	1,200	659.00	790,800	
テレビ朝日ホールディングス	3,400	2,037.00	6,925,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	8,100	496.00	4,017,600	
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,283.00	2,283,000	
日本ＢＳ放送	300	1,000.00	300,000	
Ｕ－ＮＥＸＴ	400	610.00	244,000	
ワイヤレスゲート	500	1,717.00	858,500	
コネクシオ	1,100	1,398.00	1,537,800	

日本通信	10,500	165.00	1,732,500	
クロップス	300	535.00	160,500	
日本電信電話	100,000	4,558.00	455,800,000	
ＫＤＤＩ	123,300	3,009.00	371,009,700	
光通信	1,500	9,520.00	14,280,000	
ＮＴＴドコモ	93,100	2,555.50	237,917,050	
エムティーアイ	1,900	707.00	1,343,300	
GMOインターネット	4,500	1,344.00	6,048,000	
カドカワ	3,600	1,563.00	5,626,800	
学研ホールディングス	4,000	339.00	1,356,000	
ゼンリン	1,600	1,797.00	2,875,200	
昭文社	700	601.00	420,700	
インプレスホールディングス	1,100	136.00	149,600	
アイネット	700	1,045.00	731,500	
松竹	8,000	1,163.00	9,304,000	
東宝	8,200	3,075.00	25,215,000	
東映	5,000	817.00	4,085,000	
ＡＯＩ　Ｐｒｏ．	600	819.00	491,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	7,700	5,610.00	43,197,000	
ピー・シー・エー	200	1,232.00	246,400	
ビジネスブレイン太田昭和	200	967.00	193,400	
ＤＴＳ	1,300	2,391.00	3,108,300	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,800	3,450.00	16,560,000	
シーイーシー	700	1,960.00	1,372,000	
カプコン	2,900	2,649.00	7,682,100	
アイ・エス・ビー	300	879.00	263,700	
ジャステック	800	1,092.00	873,600	
ＳＣＳＫ	3,300	3,800.00	12,540,000	
日本システムウエア	400	1,542.00	616,800	
アイネス	1,600	1,169.00	1,870,400	
ＴＫＣ	1,200	2,926.00	3,511,200	
富士ソフト	1,800	2,784.00	5,011,200	
ＮＳＤ	2,600	1,697.00	4,412,200	
コナミホールディングス	5,600	4,385.00	24,556,000	
福井コンピュータホールディングス	400	2,584.00	1,033,600	
ＪＢＣＣホールディングス	1,100	669.00	735,900	

ミロク情報サービス	900	2,139.00	1,925,100	
ソフトバンクグループ	61,200	6,364.00	389,476,800	
ホウスイ	1,000	115.00	115,000	
高千穂交易	500	939.00	469,500	
伊藤忠食品	300	4,025.00	1,207,500	
エレマテック	500	1,738.00	869,000	
ＪＡＬＵＸ	400	1,770.00	708,000	
あらた	600	2,457.00	1,474,200	
トーメンデバイス	200	1,991.00	398,200	
東京エレクトロン　デバイス	500	1,500.00	750,000	
フィールズ	1,000	1,222.00	1,222,000	
双日	73,600	268.00	19,724,800	
アルフレッサ　ホールディングス	14,700	1,781.00	26,180,700	
横浜冷凍	3,100	1,060.00	3,286,000	
神栄	2,000	140.00	280,000	
山下医科器械	100	1,712.00	171,200	
ラサ商事	600	609.00	365,400	
ラクーン	500	499.00	249,500	
アルコニックス	700	1,374.00	961,800	
神戸物産	700	3,275.00	2,292,500	
あい　ホールディングス	2,200	2,583.00	5,682,600	
ディーブイエックス	500	1,399.00	699,500	
ダイワボウホールディングス	11,000	252.00	2,772,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	2,300	1,366.00	3,141,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,300	1,065.00	2,449,500	
八洲電機	1,000	568.00	568,000	
ＵＫＣホールディングス	800	1,826.00	1,460,800	
ＯＣＨＩホールディングス	400	1,069.00	427,600	
ＴＯＫＡＩホールディングス	5,500	712.00	3,916,000	
大阪工機	100	693.00	69,300	
三洋貿易	700	1,298.00	908,600	
ビューティガレージ	100	1,145.00	114,500	
ウイン・パートナーズ	500	1,723.00	861,500	
ミタチ産業	300	617.00	185,100	
シップヘルスケアホールディングス	2,400	2,930.00	7,032,000	
明治電機工業	400	1,072.00	428,800	

デリカフーズ	300	970.00	291,000	
スターティア	300	504.00	151,200	
コメダホールディングス	1,700	1,691.00	2,874,700	
富士興産	500	420.00	210,000	
協栄産業	2,000	136.00	272,000	
小野建	1,100	1,173.00	1,290,300	
佐鳥電機	1,000	735.00	735,000	
エコートレーディング	300	644.00	193,200	
伯東	800	947.00	757,600	
コンドーテック	1,000	786.00	786,000	
中山福	800	759.00	607,200	
ナガイレーベン	1,800	2,186.00	3,934,800	
三菱食品	1,400	3,400.00	4,760,000	
松田産業	900	1,444.00	1,299,600	
第一興商	2,000	4,450.00	8,900,000	
メディパルホールディングス	12,500	1,510.00	18,875,000	
ＳＰＫ	300	2,142.00	642,600	
萩原電気	400	1,951.00	780,400	
アズワン	1,000	4,555.00	4,555,000	
スズデン	400	973.00	389,200	
シモジマ	800	1,046.00	836,800	
ドウシシャ	1,500	1,974.00	2,961,000	
小津産業	300	2,064.00	619,200	
高速	700	1,030.00	721,000	
たけびし	400	1,079.00	431,600	
黒田電気	1,700	2,088.00	3,549,600	
リックス	300	1,369.00	410,700	
丸文	1,100	618.00	679,800	
ハピネット	1,000	1,110.00	1,110,000	
橋本総業ホールディングス	300	1,583.00	474,900	
日本ライフライン	500	5,360.00	2,680,000	
エクセル	600	1,414.00	848,400	
マルカキカイ	400	1,341.00	536,400	
ＩＤＯＭ	3,400	538.00	1,829,200	
日本エム・ディ・エム	1,000	813.00	813,000	
進和	700	1,556.00	1,089,200	

エスケイジャパン	300	285.00	85,500	
ダイトエレクトロン	600	857.00	514,200	
シークス	900	4,110.00	3,699,000	
田中商事	400	677.00	270,800	
オーハシテクニカ	700	1,357.00	949,900	
白銅	400	1,205.00	482,000	
伊藤忠商事	91,300	1,365.50	124,670,150	
丸紅	122,600	533.20	65,370,320	
高島	3,000	169.00	507,000	
長瀬産業	7,500	1,309.00	9,817,500	
蝶理	800	1,606.00	1,284,800	
豊田通商	13,900	2,477.00	34,430,300	
三共生興	1,900	359.00	682,100	
兼松	27,000	172.00	4,644,000	
ツカモトコーポレーション	2,000	112.00	224,000	
三井物産	112,700	1,400.00	157,780,000	
日本紙パルプ商事	5,000	351.00	1,755,000	
日立ハイテクノロジーズ	4,300	4,360.00	18,748,000	
カメイ	1,600	988.00	1,580,800	
東都水産	200	1,672.00	334,400	
ＯＵＧホールディングス	2,000	264.00	528,000	
スターゼン	500	5,140.00	2,570,000	
山善	4,800	824.00	3,955,200	
椿本興業	2,000	309.00	618,000	
住友商事	78,400	1,223.50	95,922,400	
内田洋行	3,000	427.00	1,281,000	
三菱商事	93,500	2,280.50	213,226,750	
第一実業	3,000	610.00	1,830,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,500	1,808.00	6,328,000	
西華産業	4,000	305.00	1,220,000	
佐藤商事	1,100	798.00	877,800	
菱洋エレクトロ	1,200	1,274.00	1,528,800	
東京産業	1,300	396.00	514,800	
ユアサ商事	1,200	2,549.00	3,058,800	
神鋼商事	300	1,945.00	583,500	
小林産業	1,000	254.00	254,000	

阪和興業	13,000	640.00	8,320,000	
カナデン	1,200	1,003.00	1,203,600	
菱電商事	2,000	676.00	1,352,000	
フルサト工業	700	1,493.00	1,045,100	
岩谷産業	14,000	609.00	8,526,000	
すてきナイスグループ	6,000	140.00	840,000	
昭光通商	5,000	87.00	435,000	
ニチモウ	2,000	165.00	330,000	
極東貿易	2,000	208.00	416,000	
イワキ	2,000	203.00	406,000	
三愛石油	3,300	693.00	2,286,900	
稲畑産業	3,000	1,113.00	3,339,000	
ＧＳＩクレオス	3,000	114.00	342,000	
明和産業	1,200	329.00	394,800	
ワキタ	2,700	880.00	2,376,000	
東邦ホールディングス	4,000	2,030.00	8,120,000	
サンゲツ	4,300	1,887.00	8,114,100	
ミツウロコグループホールディングス	2,000	691.00	1,382,000	
シナネンホールディングス	500	2,019.00	1,009,500	
伊藤忠エネクス	2,800	836.00	2,340,800	
サンリオ	3,800	1,823.00	6,927,400	
サンワテクノス	700	866.00	606,200	
リョーサン	1,900	3,200.00	6,080,000	
新光商事	1,300	1,149.00	1,493,700	
トーホー	600	2,399.00	1,439,400	
三信電気	1,400	915.00	1,281,000	
東陽テクニカ	1,600	941.00	1,505,600	
モスフードサービス	1,600	3,470.00	5,552,000	
加賀電子	1,100	1,610.00	1,771,000	
ソーダニッカ	1,300	483.00	627,900	
立花エレテック	800	1,160.00	928,000	
フォーバル	600	742.00	445,200	
ＰＡＬＴＡＣ	2,000	2,576.00	5,152,000	
三谷産業	1,300	328.00	426,400	
太平洋興発	5,000	89.00	445,000	
ヤマタネ	700	1,364.00	954,800	

丸紅建材リース	1,000	189.00	189,000	
日鉄住金物産	1,100	3,795.00	4,174,500	
トラスコ中山	1,400	5,140.00	7,196,000	
オートバックスセブン	4,600	1,458.00	6,706,800	
加藤産業	1,900	2,448.00	4,651,200	
イノテック	1,100	488.00	536,800	
イエローハット	1,200	2,265.00	2,718,000	
ＪＫホールディングス	1,300	542.00	704,600	
日伝	500	2,978.00	1,489,000	
北沢産業	1,100	168.00	184,800	
杉本商事	700	1,357.00	949,900	
因幡電機産業	1,800	3,720.00	6,696,000	
バイテックホールディングス	500	1,080.00	540,000	
ミスミグループ本社	14,000	1,970.00	27,580,000	
アルテック	1,200	246.00	295,200	
タキヒヨー	2,000	439.00	878,000	
蔵王産業	200	1,330.00	266,000	
スズケン	5,600	3,200.00	17,920,000	
ジェコス	900	951.00	855,900	
ルネサスイーストン	1,000	462.00	462,000	
ローソン	4,300	7,730.00	33,239,000	
サンエー	900	5,560.00	5,004,000	
カワチ薬品	1,000	2,691.00	2,691,000	
エービーシー・マート	2,300	6,450.00	14,835,000	
ハードオフコーポレーション	600	1,051.00	630,600	
アスクル	1,500	4,345.00	6,517,500	
ゲオホールディングス	2,100	1,292.00	2,713,200	
アダストリア	1,900	2,895.00	5,500,500	
ジーフット	800	778.00	622,400	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	200	768.00	153,600	
くらコーポレーション	800	5,050.00	4,040,000	
キャンドゥ	700	1,831.00	1,281,700	
パルグループホールディングス	600	2,719.00	1,631,400	
エディオン	4,800	963.00	4,622,400	
サーラコーポレーション	1,600	621.00	993,600	
ワッツ	500	1,096.00	548,000	

ハローズ	400	2,305.00	922,000	
あみやき亭	300	3,800.00	1,140,000	
ひらまつ	1,700	599.00	1,018,300	
ゲンキー	300	6,780.00	2,034,000	
大黒天物産	300	4,960.00	1,488,000	
ハニーズ	1,100	1,189.00	1,307,900	
ファーマライズホールディングス	300	543.00	162,900	
アルペン	1,100	2,115.00	2,326,500	
クオール	1,400	1,462.00	2,046,800	
ジェイアイエヌ	800	5,450.00	4,360,000	
ビックカメラ	7,200	909.00	6,544,800	
ＤＣＭホールディングス	7,200	916.00	6,595,200	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	4,400	2,408.00	10,595,200	
東京一番フーズ	300	537.00	161,100	
ダイヤモンドダイニング	300	1,099.00	329,700	
きちり	400	683.00	273,200	
アークランドサービスホールディングス	400	3,005.00	1,202,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	15,800	1,433.00	22,641,400	
ドトール・日レスホールディングス	2,200	2,099.00	4,617,800	
マツモトキヨシホールディングス	2,400	5,240.00	12,576,000	
ブロンコビリー	700	2,981.00	2,086,700	
スタートトゥデイ	11,400	1,808.00	20,611,200	
トレジャー・ファクトリー	300	803.00	240,900	
物語コーポレーション	300	4,780.00	1,434,000	
ココカラファイン	1,300	3,905.00	5,076,500	
三越伊勢丹ホールディングス	24,800	1,075.00	26,660,000	
Ｈａｍｅｅ	200	839.00	167,800	
ウエルシアホールディングス	1,200	7,210.00	8,652,000	
クリエイトＳＤホールディングス	1,800	2,191.00	3,943,800	
丸善ＣＨＩホールディングス	1,500	366.00	549,000	
ミサワ	300	474.00	142,200	
エー・ピーカンパニー	200	696.00	139,200	
チムニー	400	2,927.00	1,170,800	
シュッピン	500	1,190.00	595,000	
ネクステージ	300	1,490.00	447,000	
ジョイフル本田	2,000	2,620.00	5,240,000	

鳥貴族	300	2,612.00	783,600	
キリン堂ホールディングス	400	788.00	315,200	
ホットランド	600	1,012.00	607,200	
すかいらーく	5,300	1,470.00	7,791,000	
綿半ホールディングス	500	1,547.00	773,500	
ヨシックス	100	1,456.00	145,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,100	944.00	3,870,400	
ブックオフコーポレーション	700	766.00	536,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	500	784.00	392,000	
あさひ	900	1,251.00	1,125,900	
日本調剤	400	4,280.00	1,712,000	
コスモス薬品	600	22,560.00	13,536,000	
トーエル	600	919.00	551,400	
一六堂	400	368.00	147,200	
オンリー	100	770.00	77,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	52,200	4,362.00	227,696,400	
薬王堂	200	6,980.00	1,396,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,300	992.00	3,273,600	
ツルハホールディングス	2,800	11,610.00	32,508,000	
サンマルクホールディングス	800	2,961.00	2,368,800	
フェリシモ	400	1,014.00	405,600	
トリドールホールディングス	1,500	2,479.00	3,718,500	
クスリのアオキ	1,100	5,350.00	5,885,000	
サツドラホールディングス	200	1,970.00	394,000	
ダイユー・リックホールディングス	400	655.00	262,000	
メディカルシステムネットワーク	1,400	434.00	607,600	
総合メディカル	600	3,325.00	1,995,000	
はるやま商事	500	797.00	398,500	
ノジマ	1,400	1,345.00	1,883,000	
カッパ・クリエイト	1,800	1,226.00	2,206,800	
ライトオン	1,000	1,005.00	1,005,000	
ジーンズメイト	500	176.00	88,000	
良品計画	1,600	22,550.00	36,080,000	
三城ホールディングス	1,500	445.00	667,500	
アドヴァン	1,300	959.00	1,246,700	

アルビス	300	2,217.00	665,100	
コナカ	1,500	502.00	753,000	
ハウス　オブ　ローゼ	200	1,465.00	293,000	
Ｇ－７ホールディングス	400	1,310.00	524,000	
イオン北海道	1,300	542.00	704,600	
コジマ	1,900	234.00	444,600	
ヒマラヤ	400	803.00	321,200	
コーナン商事	1,800	2,118.00	3,812,400	
エコス	500	1,192.00	596,000	
ワタミ	1,500	1,091.00	1,636,500	
マルシェ	300	816.00	244,800	
ドンキホーテホールディングス	8,100	4,080.00	33,048,000	
西松屋チェーン	2,200	1,443.00	3,174,600	
ゼンショーホールディングス	6,500	1,942.00	12,623,000	
幸楽苑ホールディングス	800	1,572.00	1,257,600	
ハークスレイ	300	950.00	285,000	
サイゼリヤ	2,100	2,752.00	5,779,200	
ＶＴホールディングス	4,200	560.00	2,352,000	
魚力	400	1,269.00	507,600	
ポプラ	400	487.00	194,800	
ユナイテッドアローズ	1,700	2,869.00	4,877,300	
ハイデイ日高	1,100	2,522.00	2,774,200	
京都きもの友禅	800	928.00	742,400	
コロワイド	4,100	1,923.00	7,884,300	
ピーシーデポコーポレーション	1,700	520.00	884,000	
壱番屋	1,100	3,870.00	4,257,000	
トップカルチャー	500	475.00	237,500	
ＰＬＡＮＴ	300	1,074.00	322,200	
スギホールディングス	2,700	5,460.00	14,742,000	
スクロール	1,900	350.00	665,000	
ヨンドシーホールディングス	900	2,649.00	2,384,100	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	5,500	6,700.00	36,850,000	
木曽路	1,500	2,232.00	3,348,000	
サトレストランシステムズ	1,500	802.00	1,203,000	
千趣会	2,300	716.00	1,646,800	
タカキュー	1,200	185.00	222,000	

ケーヨー	2,100	530.00	1,113,000	
上新電機	3,000	894.00	2,682,000	
日本瓦斯	2,300	3,080.00	7,084,000	
ベスト電器	4,100	141.00	578,100	
ロイヤルホールディングス	2,100	1,840.00	3,864,000	
東天紅	1,000	142.00	142,000	
いなげや	1,400	1,383.00	1,936,200	
島忠	3,200	2,814.00	9,004,800	
チヨダ	1,500	2,520.00	3,780,000	
ライフコーポレーション	900	3,330.00	2,997,000	
リンガーハット	1,200	2,320.00	2,784,000	
さが美	1,000	106.00	106,000	
ＭｒＭａｘ	1,600	383.00	612,800	
テンアライド	1,300	368.00	478,400	
ＡＯＫＩホールディングス	2,500	1,281.00	3,202,500	
オークワ	2,000	1,112.00	2,224,000	
コメリ	1,900	2,544.00	4,833,600	
青山商事	2,600	3,750.00	9,750,000	
しまむら	1,500	13,310.00	19,965,000	
はせがわ	800	444.00	355,200	
高島屋	21,000	869.00	18,249,000	
松屋	2,700	885.00	2,389,500	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	6,400	1,534.00	9,817,600	
近鉄百貨店	5,000	341.00	1,705,000	
丸栄	3,000	81.00	243,000	
パルコ	1,200	977.00	1,172,400	
丸井グループ	13,100	1,415.00	18,536,500	
アクシアル　リテイリング	1,000	3,715.00	3,715,000	
イオン	51,300	1,462.50	75,026,250	
イズミ	2,500	4,810.00	12,025,000	
東武ストア	100	2,795.00	279,500	
平和堂	2,500	2,164.00	5,410,000	
フジ	1,400	2,183.00	3,056,200	
ヤオコー	1,400	4,320.00	6,048,000	
ゼビオホールディングス	1,700	1,608.00	2,733,600	
ケーズホールディングス	5,700	1,955.00	11,143,500	

Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	800	595.00	476,000	
日産東京販売ホールディングス	1,900	251.00	476,900	
アインホールディングス	1,500	7,070.00	10,605,000	
元気寿司	300	2,042.00	612,600	
ヤマダ電機	41,700	547.00	22,809,900	
アークランドサカモト	2,100	1,226.00	2,574,600	
ニトリホールディングス	5,400	12,140.00	65,556,000	
愛眼	1,000	197.00	197,000	
ケーユーホールディングス	600	782.00	469,200	
吉野家ホールディングス	4,400	1,559.00	6,859,600	
松屋フーズ	600	3,410.00	2,046,000	
サガミチェーン	1,600	1,242.00	1,987,200	
関西スーパーマーケット	1,000	1,335.00	1,335,000	
王将フードサービス	900	4,060.00	3,654,000	
プレナス	1,400	2,181.00	3,053,400	
ミニストップ	900	1,820.00	1,638,000	
アークス	2,300	2,652.00	6,099,600	
バローホールディングス	2,700	2,746.00	7,414,200	
藤久	100	1,700.00	170,000	
ベルク	500	4,090.00	2,045,000	
大庄	700	1,525.00	1,067,500	
ファーストリテイリング	2,100	36,640.00	76,944,000	
サンドラッグ	2,400	7,940.00	19,056,000	
サックスバー　ホールディングス	1,200	1,143.00	1,371,600	
ヤマザワ	200	1,719.00	343,800	
やまや	300	1,517.00	455,100	
ベルーナ	3,100	651.00	2,018,100	
島根銀行	300	1,251.00	375,300	
じもとホールディングス	9,100	171.00	1,556,100	
めぶきフィナンシャルグループ	60,100	374.00	22,477,400	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,800	3,335.00	6,003,000	
九州フィナンシャルグループ	20,500	675.00	13,837,500	
ゆうちょ銀行	35,300	1,213.00	42,818,900	
富山第一銀行	3,100	511.00	1,584,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	81,600	477.00	38,923,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,500	1,004.00	8,534,000	

新生銀行	119,000	168.00	19,992,000	
あおぞら銀行	79,000	345.00	27,255,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	944,400	529.40	499,965,360	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	145,800	455.30	66,382,740	
三井住友トラスト・ホールディングス	26,400	3,492.00	92,188,800	
三井住友フィナンシャルグループ	99,800	3,540.00	353,292,000	代用有価証券 10,000株
第四銀行	15,000	442.00	6,630,000	
北越銀行	1,400	2,454.00	3,435,600	
千葉銀行	48,000	640.00	30,720,000	
群馬銀行	27,700	493.00	13,656,100	
武蔵野銀行	2,000	2,878.00	5,756,000	
千葉興業銀行	3,500	454.00	1,589,000	
筑波銀行	5,200	302.00	1,570,400	
七十七銀行	20,000	465.00	9,300,000	
青森銀行	10,000	341.00	3,410,000	
秋田銀行	8,000	337.00	2,696,000	
山形銀行	7,000	444.00	3,108,000	
岩手銀行	800	4,360.00	3,488,000	
東邦銀行	11,000	397.00	4,367,000	
東北銀行	7,000	143.00	1,001,000	
みちのく銀行	6,000	206.00	1,236,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	51,000	445.00	22,695,000	
静岡銀行	33,000	856.00	28,248,000	
十六銀行	17,000	315.00	5,355,000	
スルガ銀行	12,800	2,503.00	32,038,400	
八十二銀行	24,000	565.00	13,560,000	
山梨中央銀行	8,000	494.00	3,952,000	
大垣共立銀行	17,000	370.00	6,290,000	
福井銀行	11,000	270.00	2,970,000	
北國銀行	13,000	357.00	4,641,000	
清水銀行	400	3,040.00	1,216,000	
富山銀行	300	3,990.00	1,197,000	
滋賀銀行	12,000	538.00	6,456,000	
南都銀行	1,200	3,835.00	4,602,000	
百五銀行	11,000	379.00	4,169,000	

京都銀行	22,000	746.00	16,412,000	
紀陽銀行	4,900	1,717.00	8,413,300	
三重銀行	600	2,038.00	1,222,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	8,300	1,524.00	12,649,200	
広島銀行	36,000	443.00	15,948,000	
山陰合同銀行	7,500	758.00	5,685,000	
中国銀行	8,800	1,397.00	12,293,600	
鳥取銀行	400	1,660.00	664,000	
伊予銀行	13,300	647.00	8,605,100	
百十四銀行	14,000	355.00	4,970,000	
四国銀行	9,000	246.00	2,214,000	
阿波銀行	11,000	677.00	7,447,000	
大分銀行	7,000	393.00	2,751,000	
宮崎銀行	8,000	295.00	2,360,000	
佐賀銀行	8,000	266.00	2,128,000	
十八銀行	8,000	325.00	2,600,000	
沖縄銀行	1,100	3,620.00	3,982,000	
琉球銀行	2,600	1,377.00	3,580,200	
セブン銀行	46,800	310.00	14,508,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,692,000	175.00	296,100,000	
高知銀行	5,000	113.00	565,000	
山口フィナンシャルグループ	12,000	1,149.00	13,788,000	
長野銀行	400	1,976.00	790,400	
名古屋銀行	900	3,640.00	3,276,000	
北洋銀行	20,300	392.00	7,957,600	
愛知銀行	400	5,520.00	2,208,000	
第三銀行	700	1,716.00	1,201,200	
中京銀行	500	2,340.00	1,170,000	
大光銀行	5,000	261.00	1,305,000	
愛媛銀行	1,500	1,356.00	2,034,000	
トマト銀行	500	1,556.00	778,000	
みなと銀行	1,100	1,850.00	2,035,000	
京葉銀行	10,000	444.00	4,440,000	
関西アーバン銀行	1,700	1,143.00	1,943,100	
栃木銀行	6,900	485.00	3,346,500	
北日本銀行	400	3,010.00	1,204,000	

東和銀行	24,000	101.00	2,424,000	
福島銀行	14,000	94.00	1,316,000	
大東銀行	7,000	171.00	1,197,000	
トモニホールディングス	10,300	539.00	5,551,700	
フィデアホールディングス	12,100	188.00	2,274,800	
池田泉州ホールディングス	13,200	473.00	6,243,600	
ＦＰＧ	4,400	852.00	3,748,800	
ＳＢＩホールディングス	14,100	1,225.00	17,272,500	
ジャフコ	2,100	3,415.00	7,171,500	
大和証券グループ本社	116,000	604.40	70,110,400	
野村ホールディングス	254,800	513.90	130,941,720	
岡三証券グループ	11,000	547.00	6,017,000	
丸三証券	4,000	845.00	3,380,000	
東洋証券	5,000	183.00	915,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	14,300	518.00	7,407,400	
光世証券	3,000	123.00	369,000	
水戸証券	4,000	234.00	936,000	
いちよし証券	2,800	762.00	2,133,600	
松井証券	7,100	821.00	5,829,100	
だいこう証券ビジネス	600	510.00	306,000	
マネックスグループ	13,400	231.00	3,095,400	
カブドットコム証券	9,200	317.00	2,916,400	
極東証券	1,700	1,479.00	2,514,300	
岩井コスモホールディングス	1,200	880.00	1,056,000	
藍澤證券	2,300	560.00	1,288,000	
マネースクウェアＨＤ	500	1,240.00	620,000	
マネーパートナーズグループ	1,600	470.00	752,000	
かんぽ生命保険	4,700	2,147.00	10,090,900	
ＳＯＭＰＯホールディングス	26,100	3,235.00	84,433,500	
アニコム　ホールディングス	800	2,374.00	1,899,200	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	37,200	3,009.00	111,934,800	
ソニーフィナンシャルホールディングス	12,000	1,411.00	16,932,000	
第一生命ホールディングス	75,100	1,491.00	111,974,100	
東京海上ホールディングス	50,500	4,011.00	202,555,500	
Ｔ＆Ｄホールディングス	45,400	1,234.50	56,046,300	

アドバンスクリエイト	300	1,519.00	455,700	
全国保証	3,500	4,065.00	14,227,500	
クレディセゾン	9,500	1,804.00	17,138,000	
芙蓉総合リース	1,400	4,920.00	6,888,000	
興銀リース	2,300	2,125.00	4,887,500	
東京センチュリー	2,500	3,535.00	8,837,500	
日本証券金融	5,500	461.00	2,535,500	
アイフル	21,000	317.00	6,657,000	
ポケットカード	1,000	503.00	503,000	
リコーリース	1,000	2,981.00	2,981,000	
イオンフィナンシャルサービス	8,000	1,809.00	14,472,000	
アコム	25,100	489.00	12,273,900	
ジャックス	7,000	455.00	3,185,000	
オリエントコーポレーション	27,300	190.00	5,187,000	
日立キャピタル	2,900	2,322.00	6,733,800	
アプラスフィナンシャル	6,500	104.00	676,000	
オリックス	88,200	1,609.50	141,957,900	
三菱ＵＦＪリース	31,600	496.00	15,673,600	
日本取引所グループ	38,700	1,504.00	58,204,800	
イー・ギャランティ	400	2,612.00	1,044,800	
アサックス	200	1,508.00	301,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	500	1,606.00	803,000	
いちご	11,900	429.00	5,105,100	
日本駐車場開発	15,100	142.00	2,144,200	
ヒューリック	26,000	993.00	25,818,000	
三栄建築設計	500	1,752.00	876,000	
野村不動産ホールディングス	8,300	1,732.00	14,375,600	
三重交通グループホールディングス	2,200	379.00	833,800	
サムティ	1,000	1,080.00	1,080,000	
ディア・ライフ	900	336.00	302,400	
エー・ディー・ワークス	12,200	38.00	463,600	
日本商業開発	700	1,786.00	1,250,200	
プレサンスコーポレーション	2,000	1,212.00	2,424,000	
ユニゾホールディングス	1,000	2,664.00	2,664,000	
ＴＨＥグローバル社	500	448.00	224,000	
日本管理センター	900	1,368.00	1,231,200	

サンセイランディック	300	687.00	206,100	
エストラスト	300	568.00	170,400	
フージャースホールディングス	1,700	528.00	897,600	
オープンハウス	1,800	2,223.00	4,001,400	
東急不動産ホールディングス	30,200	606.00	18,301,200	
飯田グループホールディングス	10,400	1,979.00	20,581,600	
ムゲンエステート	500	777.00	388,500	
シーアールイー	200	1,636.00	327,200	
エコナックホールディングス	5,000	45.00	225,000	
パーク２４	6,300	3,265.00	20,569,500	
パラカ	400	1,817.00	726,800	
三井不動産	66,000	2,352.50	155,265,000	
三菱地所	93,000	2,113.50	196,555,500	
平和不動産	2,300	1,533.00	3,525,900	
東京建物	14,500	1,322.00	19,169,000	
ダイビル	3,200	897.00	2,870,400	
京阪神ビルディング	2,100	544.00	1,142,400	
住友不動産	30,000	2,665.50	79,965,000	
大京	23,000	223.00	5,129,000	
テーオーシー	4,800	975.00	4,680,000	
東京楽天地	2,000	500.00	1,000,000	
レオパレス２１	15,800	592.00	9,353,600	
スターツコーポレーション	1,300	1,930.00	2,509,000	
フジ住宅	1,600	691.00	1,105,600	
空港施設	1,500	541.00	811,500	
明和地所	700	577.00	403,900	
住友不動産販売	1,100	2,459.00	2,704,900	
ゴールドクレスト	1,100	1,958.00	2,153,800	
日本エスリード	500	1,232.00	616,000	
日神不動産	1,500	396.00	594,000	
日本エスコン	1,700	316.00	537,200	
タカラレーベン	5,400	682.00	3,682,800	
サンヨーハウジング名古屋	600	917.00	550,200	
イオンモール	8,000	1,527.00	12,216,000	
ファースト住建	500	1,426.00	713,000	
トーセイ	1,700	784.00	1,332,800	

エヌ・ティ・ティ都市開発	7,700	957.00	7,368,900	
サンフロンティア不動産	1,400	985.00	1,379,000	
エフ・ジェー・ネクスト	1,100	607.00	667,700	
インテリックス	300	710.00	213,000	
ランドビジネス	900	263.00	236,700	
グランディハウス	1,100	372.00	409,200	
日本空港ビルデング	3,900	4,030.00	15,717,000	
日本工営	4,000	472.00	1,888,000	
ネクスト	3,300	883.00	2,913,900	
ジェイエイシーリクルートメント	800	1,430.00	1,144,000	
日本M＆Aセンター	3,800	3,410.00	12,958,000	
アコーディア・ゴルフ	4,000	1,042.00	4,168,000	
中広	100	672.00	67,200	
タケエイ	1,200	828.00	993,600	
トラスト・テック	500	1,545.00	772,500	
パソナグループ	1,200	825.00	990,000	
ＣＤＳ	400	961.00	384,400	
リンクアンドモチベーション	3,100	309.00	957,900	
ＧＣＡ	1,200	763.00	915,600	
エス・エム・エス	1,800	2,769.00	4,984,200	
テンプホールディングス	10,200	1,771.00	18,064,200	
リニカル	800	1,340.00	1,072,000	
クックパッド	2,900	1,010.00	2,929,000	
エスクリ	500	541.00	270,500	
アイ・ケイ・ケイ	600	600.00	360,000	
学情	600	1,132.00	679,200	
スタジオアリス	500	2,056.00	1,028,000	
シミックホールディングス	700	1,450.00	1,015,000	
ＮＪＳ	300	1,279.00	383,700	
綜合警備保障	4,800	4,540.00	21,792,000	
カカクコム	9,400	1,740.00	16,356,000	
ルネサンス	700	1,463.00	1,024,100	
ディップ	1,700	2,628.00	4,467,600	
オプトホールディング	1,000	683.00	683,000	
新日本科学	1,500	565.00	847,500	
ツクイ	3,200	677.00	2,166,400	

キャリアデザインセンター	300	908.00	272,400	
エムスリー	11,400	3,080.00	35,112,000	
ツカダ・グローバルホールディング	900	720.00	648,000	
アウトソーシング	800	3,835.00	3,068,000	
ウェルネット	1,000	1,314.00	1,314,000	
ワールドホールディングス	300	1,583.00	474,900	
ディー・エヌ・エー	5,900	3,265.00	19,263,500	
博報堂ＤＹホールディングス	18,300	1,248.00	22,838,400	
ぐるなび	1,900	2,643.00	5,021,700	
エスアールジータカミヤ	1,400	558.00	781,200	
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	246.00	442,800	
ファンコミュニケーションズ	3,300	769.00	2,537,700	
ジェイコムホールディングス	300	1,903.00	570,900	
ＷＤＢホールディングス	500	1,091.00	545,500	
ティア	700	616.00	431,200	
バリューコマース	1,300	333.00	432,900	
インフォマート	2,800	1,131.00	3,166,800	
ＪＰホールディングス	3,900	261.00	1,017,900	
ＥＰＳホールディングス	1,600	1,356.00	2,169,600	
レッグス	300	827.00	248,100	
プレステージ・インターナショナル	1,900	762.00	1,447,800	
アミューズ	700	1,764.00	1,234,800	
ドリームインキュベータ	400	2,836.00	1,134,400	
クイック	700	911.00	637,700	
ＴＡＣ	900	203.00	182,700	
ケネディクス	17,800	443.00	7,885,400	
電通	14,700	5,130.00	75,411,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	601.00	360,600	
ぴあ	400	2,418.00	967,200	
イオンファンタジー	400	3,040.00	1,216,000	
シーティーエス	400	1,031.00	412,400	
みらかホールディングス	3,400	5,000.00	17,000,000	
アルプス技研	500	2,190.00	1,095,000	
ダイオーズ	200	952.00	190,400	
日本空調サービス	1,300	544.00	707,200	
オリエンタルランド	14,200	6,041.00	85,782,200	

ダスキン	3,400	2,136.00	7,262,400	
明光ネットワークジャパン	1,600	970.00	1,552,000	
ファルコホールディングス	600	1,379.00	827,400	
秀英予備校	300	359.00	107,700	
田谷	200	638.00	127,600	
ラウンドワン	4,100	745.00	3,054,500	
リゾートトラスト	5,100	2,113.00	10,776,300	
ビー・エム・エル	1,700	2,728.00	4,637,600	
ワタベウェディング	200	403.00	80,600	
りらいあコミュニケーションズ	2,200	995.00	2,189,000	
リソー教育	2,300	569.00	1,308,700	
早稲田アカデミー	200	896.00	179,200	
ユー・エス・エス	16,000	1,707.00	27,312,000	
東京個別指導学院	400	581.00	232,400	
サイバーエージェント	6,900	2,847.00	19,644,300	
楽天	67,400	1,165.00	78,521,000	
クリーク・アンド・リバー社	500	716.00	358,000	
テー・オー・ダブリュー	1,100	651.00	716,100	
セントラルスポーツ	400	2,521.00	1,008,400	
フルキャストホールディングス	1,400	953.00	1,334,200	
リソルホールディングス	2,000	317.00	634,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,100	3,595.00	7,549,500	
アトラ	200	1,045.00	209,000	
インターワークス	300	963.00	288,900	
ＫｅｅＰｅｒ技研	100	1,502.00	150,200	
ファーストロジック	100	1,683.00	168,300	
デザインワン・ジャパン	100	2,004.00	200,400	
イー・ガーディアン	400	1,256.00	502,400	
リブセンス	900	439.00	395,100	
ジャパンマテリアル	500	3,565.00	1,782,500	
ベクトル	1,100	1,168.00	1,284,800	
ウチヤマホールディングス	600	411.00	246,600	
サクセスホールディングス	100	1,190.00	119,000	
キャリアリンク	300	763.00	228,900	
ＩＢＪ	1,000	770.00	770,000	
アサンテ	500	1,619.00	809,500	

N・フィールド	600	1,110.00	666,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	200	2,839.00	567,800	
ライドオン・エクスプレス	300	1,025.00	307,500	
ＥＲＩホールディングス	400	798.00	319,200	
アビスト	200	2,632.00	526,400	
ウィルグループ	300	902.00	270,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	2,578.00	257,800	
日本ビューホテル	200	1,263.00	252,600	
リクルートホールディングス	28,800	4,150.00	119,520,000	
エラン	200	1,312.00	262,400	
日本郵政	34,400	1,284.00	44,169,600	
ベルシステム２４ホールディングス	2,000	962.00	1,924,000	
ソラスト	600	1,108.00	664,800	
リログループ	500	16,960.00	8,480,000	
東祥	300	4,750.00	1,425,000	
エイチ・アイ・エス	2,200	2,879.00	6,333,800	
ラックランド	200	1,808.00	361,600	
共立メンテナンス	1,100	6,310.00	6,941,000	
イチネンホールディングス	1,400	1,067.00	1,493,800	
建設技術研究所	900	970.00	873,000	
スペース	700	1,233.00	863,100	
燦ホールディングス	300	1,472.00	441,600	
スバル興業	1,000	419.00	419,000	
東京テアトル	6,000	121.00	726,000	
タナベ経営	300	1,195.00	358,500	
ナガワ	200	4,160.00	832,000	
よみうりランド	3,000	448.00	1,344,000	
東京都競馬	9,000	233.00	2,097,000	
常磐興産	500	1,502.00	751,000	
カナモト	1,800	2,412.00	4,341,600	
東京ドーム	5,300	1,065.00	5,644,500	
西尾レントオール	1,100	3,070.00	3,377,000	
トランス・コスモス	1,500	2,621.00	3,931,500	
乃村工藝社	2,800	1,710.00	4,788,000	
藤田観光	4,000	340.00	1,360,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	8,000	117.00	936,000	

日本管財	1,100	1,519.00	1,670,900	
トーカイ	600	3,515.00	2,109,000	
白洋舎	100	2,489.00	248,900	
セコム	13,700	7,669.00	105,065,300	
セントラル警備保障	600	2,059.00	1,235,400	
丹青社	2,300	767.00	1,764,100	
メイテック	1,600	3,550.00	5,680,000	
アサツー　ディ・ケイ	2,200	2,882.00	6,340,400	
応用地質	1,100	1,179.00	1,296,900	
船井総研ホールディングス	1,700	1,580.00	2,686,000	
進学会	600	493.00	295,800	
オオバ	1,000	426.00	426,000	
学究社	300	1,286.00	385,800	
ベネッセホールディングス	4,400	2,910.00	12,804,000	
イオンディライト	1,500	3,025.00	4,537,500	
ナック	800	854.00	683,200	
ニチイ学館	2,300	855.00	1,966,500	
ダイセキ	2,300	2,128.00	4,894,400	
ステップ	500	1,194.00	597,000	
合　　計	19,082,300		25,119,698,830	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2016年11月30日現在です。

【インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	1,745,183,355円
Ⅱ　負債総額	16,305,718円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,728,877,637円
Ⅳ　発行済口数	994,990,537口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7376円

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	26,841,205,101円
Ⅱ　負債総額	175,945,871円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,665,259,230円
Ⅳ　発行済口数	20,960,937,808口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2721円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換
　該当事項はありません。

（２）受益者に対する特典
　該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容
　①　譲渡制限はありません。
　②　受益権の譲渡
- 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- 前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- 前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止

期間を設けることができます。

③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

（4）受益証券の再発行

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

（5）受益権の再分割

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

平成28年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去５年間における主な資本金の増減　：　該当事項はありません。

（２）会社の意思決定機関（平成28年11月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

・監査役会

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

（３）運用の意思決定プロセス（平成28年11月末現在）

１．投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。

２．各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。

３．各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。

４．トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。

５．運用状況の評価・分析および運用リスク管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理／コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

２【事業の内容及び営業の概況】

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

・委託会社の運用する、平成28年11月末現在の投資信託などは次の通りです。

種　類	ファンド本数	純資産額 （単位：億円）
投資信託総合計	676	124,426

	株式投資信託		627	100,560
		単位型	166	7,329
		追加型	461	93,231
	公社債投資信託		49	23,865
		単位型	35	429
		追加型	14	23,435

3【委託会社等の経理状況】

1．　当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
　また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2．　当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第57期事業年度（平成27年４月１日から平成28年３月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
　また、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第58期中間会計期間（平成28年４月１日から平成28年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第56期 （平成27年３月31日）		第57期 （平成28年３月31日）
資産の部				
流動資産				
現金・預金	※3	14,206	※3	14,308
金銭の信託		－	※3	153
有価証券		277		86
前払費用	※3	509	※3	489
未収入金		3		10
未収委託者報酬		8,441		9,374
未収収益	※3	1,566	※3	2,280
関係会社短期貸付金		436		5,333
立替金		666		2,960
繰延税金資産		1,446		819
その他	※2	195	※2,3	428
流動資産合計		27,750		36,243
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	56	※1	146
器具備品	※1	166	※1	210
有形固定資産合計		222		356

無形固定資産				
ソフトウエア		113		140
無形固定資産合計		113		140
投資その他の資産				
投資有価証券		14,184		12,195
関係会社株式		21,702		21,702
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		740		781
長期前払費用		0		0
繰延税金資産		248		425
投資その他の資産合計		36,936		35,165
固定資産合計		37,273		35,662
資産合計		65,023		71,905

（単位：百万円）

		第56期 (平成27年３月31日)		第57期 (平成28年３月31日)
負債の部				
流動負債				
預り金		387		410
未払金		5,545		3,841
未払収益分配金		6		6
未払償還金		112		112
未払手数料	※3	3,145	※3	3,269
その他未払金		2,282		453
未払費用	※3	4,636	※3	4,920
未払法人税等		814		354
未払消費税等	※4	1,070	※4	649
関係会社短期借入金		－		5,631
賞与引当金		1,990		2,080
役員賞与引当金		120		145
その他	※3	82	※3	278
流動負債合計		14,646		18,312
固定負債				
退職給付引当金		1,111		1,154
固定負債合計		1,111		1,154
負債合計		15,758		19,466
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		25,836		29,948
利益剰余金合計		25,836		29,948

自己株式	△68	△502
株主資本合計	48,351	52,028
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,002	151
繰延ヘッジ損益	△88	258
評価・換算差額等合計	913	410
純資産合計	49,265	52,438
負債純資産合計	65,023	71,905

（２）【損益計算書】

(単位：百万円)

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

一般管理費計		13,380		14,577
営業利益		6,146		5,817

（単位：百万円）

		第56期 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）		第57期 （自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日）
営業外収益				
受取利息		10		91
受取配当金	※１	1,152	※１	1,330
有価証券償還益		13		－
時効成立分配金・償還金		1		1
為替差益		－		32
その他		107		32
営業外収益合計		1,285		1,488
営業外費用				
支払利息		28		242
有価証券償還損		81		－
デリバティブ費用		269		69
時効成立後支払分配金・償還金		295		5
支払源泉所得税		71		119
為替差損		26		－
その他		21		94
営業外費用合計		795		531
経常利益		6,636		6,774
特別利益				
投資有価証券売却益		270		720
その他		－		0
特別利益合計		270		720
特別損失				
投資有価証券売却損		22		100
固定資産処分損		0		6
特別賞与		－		204
割増退職金		243		91
役員退職一時金		－		64
外国税関連費用	※２	1,650		－
特別損失合計		1,916		467
税引前当期純利益		4,991		7,027
法人税、住民税及び事業税		2,356		1,359
法人税等調整額		△466		706
法人税等合計		1,890		2,065
当期純利益		3,101		4,962

（３）【株主資本等変動計算書】

第56期（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）

(単位：百万円)

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

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

第57期（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	△68	48,351

会計方針の変更による累積的影響額							―
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	△68	48,351
当期変動額							
剰余金の配当				△850	△850		△850
当期純利益				4,962	4,962		4,962
自己株式の取得						△434	△434
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	―	―	―	4,111	4,111	△434	3,676
当期末残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	△502	52,028

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

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第57期 (自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日)
1　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①　子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②　その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法

	(2) 金銭の信託 時価法 (3) デリバティブ 時価法
2　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物　３年～15年 器具備品　５年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウエア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。
3　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 ①　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。 ②　数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。
4　ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (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。 (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。 (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。
5　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

（会計方針の変更）

第57期 (自　平成27年４月１日 至　平成28年３月31日)

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

（未適用の会計基準等）

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

（１）　概要
繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いについて、監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」の枠組み、すなわち企業を５つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積もる枠組みを基本的に踏襲した上で、以下の取扱いについて必要な見直しが行われております。
①(分類１)から(分類５)に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い
②(分類２)及び(分類３)に係る分類の要件
③(分類２)に該当する企業におけるスケジューリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い
④(分類３)に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い
⑤(分類４)に係る分類の要件を満たす企業が（分類２）又は（分類３）に該当する場合の取扱い

（２）　適用予定日
平成29年３月期の期首より適用予定であります。

（３）　当該会計基準等の適用による影響
影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

第56期 (平成27年３月31日)	第57期 (平成28年３月31日)
※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,122百万円 器具備品　679百万円	※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,170百万円 器具備品　653百万円
※２　信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。	※２　信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金　4,256百万円 前払費用　2百万円 未収収益　110百万円 (流動負債) 未払手数料　108百万円 未払費用　500百万円 その他　57百万円	※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金　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 (流動負債) 未払手数料　93百万円 未払費用　722百万円 その他　266百万円

※４　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。 ※５　保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務27百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務842百万円に対して保証を行っております。	※４　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。 ※５　保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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。

（損益計算書関係）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第56期（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

３　新株予約権等に関する事項

		新株予約権の目的となる株式の数(株)	当事業

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

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

4　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

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

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

第57期（自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）

1　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2　自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度ストックオプション（1）	普通株式	15,902,700	－	14,140,500	1,762,200	－
平成21年度ストックオプション（2）	普通株式	1,567,500	－	1,392,600	174,900	－

平成22年度 ストックオプション（1）	普通株式	2,310,000	―	2,310,000	―	―
平成23年度 ストックオプション（1）	普通株式	5,029,200	―	290,400	4,738,800	―
合計		24,809,400	―	18,133,500	6,675,900	―

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

4　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

（金融商品関係）

第56期(自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）

１ 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自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。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

② 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、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

２ 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

ヘッジ会計が適用されているもの	(57)	(57)	－
デリバティブ取引計	(82)	(82)	－

(※1)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(※2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1　金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項
(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。
(4) 有価証券及び投資有価証券
投資信託は基準価額によっております。
(5) 未払金及び(6) 未払費用
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。
(7) デリバティブ取引
（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上、流動負債のその他に含まれております。

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

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

4　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第57期(自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）
1　金融商品の状況に関する事項
(1) 金融商品に対する取組方針
当社は、投資信託の運用を業として行っており、自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

① 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。

② 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、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。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。

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

２ 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(※1)	時価(※1)	差額
(1) 現金・預金	14,308	14,308	―
(2) 未収委託者報酬	9,374	9,374	―
(3) 未収収益	2,280	2,280	―
(4) 関係会社短期貸付金	5,333	5,333	
(5) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	12,265	12,265	―

(6) 未払金	(3,841)	(3,841)	－
(7) 未払費用	(4,920)	(4,920)	－
(8) 関係会社短期借入金	(5,631)	(5,631)	
(9) デリバティブ取引(※2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(254)	(254)	－
ヘッジ会計が適用されているもの	170	170	－
デリバティブ取引計	(84)	(84)	－

(※1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。
(※2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項
(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬 、(3) 未収収益並びに（4）関係会社短期貸付金
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。
(5) 有価証券及び投資有価証券
投資信託は基準価額によっております。
(6) 未払金、(7) 未払費用並びに (8) 関係会社短期借入金
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。
(9) デリバティブ取引
（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されないものは貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されるもののうち193百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万円は流動負債のその他に含まれております。

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

第56期(自 平成26年４月１日 至 平成27年３月31日)
1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809

関連会社株式	2,892

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

2　その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

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

3　当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

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

第57期(自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日)

1　子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

2　その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	5,593	4,872	720
	小計	5,593	4,872	720
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	6,672	7,175	△502
	小計	6,672	7,175	△502

合計	12,265	12,047	218

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

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

３　当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

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

（デリバティブ取引関係）

第56期(平成27年３月31日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

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

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

２　時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

２　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

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

（注）　１　時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第57期(平成28年３月31日)

1　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

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

(注)　1　上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
　　　2　時価の算定方法
　　　　金融商品取引所が定める清算指数によっております。

（2）通貨関連

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

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

2　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 （百万円）	契約額等のうち１年超 （百万円）	時価 （百万円）
原則的処理方法	為替予約取引	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。

（持分法損益等）

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

関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 （単位：百万円）		関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 （単位：百万円）	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,078	(1) 関連会社に対する投資の金額	3,037
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,396	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,686
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,720	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	2,901

（退職給付関係）

第56期(自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日)

１　採用している退職給付制度の概要

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

２　確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

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

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.6%

３ 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、196百万円でありました。

第57期(自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日)

1　採用している退職給付制度の概要

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

2　確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	（百万円）
退職給付債務の期首残高	1,233
会計方針の変更による累積的影響額	－
会計方針の変更を反映した期首残高	1,233
勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	33
退職給付の支払額	△119
退職給付債務の期末残高	1,299

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、209百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

第56期(自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日)

1　ストックオプション(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

①　ストックオプション（新株予約権）の数

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

権利未確定残	15,902,700	1,567,500
権利確定後(株)		
期首	－	－
権利確定	－	－
権利行使	－	－
失効	－	－
権利未行使残	－	－

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

(注)　株式数に換算して記載しております。

②　単価情報

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

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

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

第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

① 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。

② 単価情報

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

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

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

(税効果会計関係)

第56期 (平成27年３月31日)		第57期 (平成28年３月31日)	
1　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		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	658	賞与引当金	642
その他	813	その他	177
小計	1,472	小計	819
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
投資有価証券評価損	134	投資有価証券評価損	96
関係会社株式評価損	1,510	関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	360	退職給付引当金	353
固定資産減価償却費	133	固定資産減価償却費	122
その他	73	その他	65
小計	2,213	小計	2,068
繰延税金資産小計	3,685	繰延税金資産小計	2,888
評価性引当金	△1,510	評価性引当金	△1,430
繰延税金資産合計	2,174	繰延税金資産合計	1,457
繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(固定)	
その他有価証券評価差額金	25	その他有価証券評価差額金	71
小計	25	繰延ヘッジ利益	114
		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	454	繰延税金負債合計	213
小計	454	繰延税金資産の純額	1,244
繰延税金負債合計	480		
繰延税金資産の純額	1,694		
2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	35.6%	法定実効税率	33.1%
（調整）		（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.3%	交際費等永久に損金に算入されない項目	1.4%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△4.3%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△4.8%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.6%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.3%
海外子会社の留保利益の影響額等	1.7%	所得拡大促進税制	△2.2%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.9%	海外子会社の留保利益の影響額等	0.6%
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%

第56期 (平成27年３月31日)	第57期 (平成28年３月31日)
３　法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正 「所得税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第9号)の施行に伴い平成26年４月１日に開始する事業年度から、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成27年４月１日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.1%に、平成28年４月１日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.3%となります。この結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は135百万円、繰延ヘッジ損益が4百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が48百万円、法人税等調整額が179百万円、それぞれ増加しております。	３　法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正 「所得税法等の一部を改正する法律」（平成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。

（関連当事者情報）

第56期(自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日)

１　関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

（イ）財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千SGD)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貨建)(注1)	184 (千 SGD 2,059) (注2)	関係会社短期貸付金	436 (千 SGD 5,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	7 (千 SGD 92)	未収収益	7 (千 SGD 82)

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

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184百万円(2,059千 SGD)の内訳は、貸付424百万円(5,000千 SGD)及び返済240百万円(2,940千 SGD)であります。

２ 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第57期(自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日)

１　関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社
重要な該当事項はありません。

（イ）財務諸表提出会社の子会社

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

子会社	Management Americas, Inc.	カ 合衆国	(千USD) (注4)	マネジメント業	100.00	借入	借入金利息 (米ドル貨建) (注5)	113 (千 USD 949)	未払費用	106 (千 USD 949)

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 資金の貸付に係る取引金額△90百万円（SGD△1,000千）の内訳は、貸付957百万円（SGD11,000千）及び返済1,047百万円（SGD12,000千）であります。

3 融資枠5,000百万円、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

4 Nikko Asset Management Americas, Inc.の「資本金」は、資本金と資本剰余金の合計額を記載しております。

5 融資枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

第56期(自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日)

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

第57期(自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日)

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

関連情報

第56期(自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日)

1　製品及びサービスごとの情報

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

2　地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産
国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３ 主要な顧客ごとの情報
営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第57期(自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）
１ 製品及びサービスごとの情報
当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

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

（２）有形固定資産
国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３ 主要な顧客ごとの情報
営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
第56期(自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）
該当事項はありません。

第57期(自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
第56期(自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）
該当事項はありません。

第57期(自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
第56期(自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）
該当事項はありません。

第57期(自　平成27年４月１日　至　平成28年３月31日）
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

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

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

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

3　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表等

（１）中間貸借対照表

（単位：百万円）

	第58期中間会計期間 (平成28年９月30日)
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	16,370
金銭の信託	152
有価証券	29
未収委託者報酬	8,443
未収収益	1,681
関係会社短期貸付金	488

繰延税金資産		821
その他	※２	2,083
流動資産合計		30,070
固定資産		
有形固定資産	※１	323
無形固定資産		129
投資その他の資産		
投資有価証券		11,401
関係会社株式		23,203
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		781
繰延税金資産		409
長期前払費用		0
投資その他の資産合計		35,857
固定資産合計		36,311
資産合計		66,382

（単位：百万円）

		第58期中間会計期間 (平成28年９月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		4,011
未払費用		4,007
未払法人税等		1,052
未払消費税等	※３	440
賞与引当金		1,112
役員賞与引当金		60
その他		517
流動負債合計		11,201
固定負債		
退職給付引当金		1,203
固定負債合計		1,203
負債合計		12,404
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		31,627
利益剰余金合計		31,627
自己株式		△672
株主資本合計		53,537

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△340
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	439
純資産合計	53,977
負債純資産合計	66,382

（2）中間損益計算書

（単位：百万円）

		第58期中間会計期間 （自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		32,215
その他営業収益		1,942
営業収益合計		34,158
営業費用及び一般管理費	※１	31,520
営業利益		2,637
営業外収益	※２	1,760
営業外費用	※３	327
経常利益		4,070
特別利益	※４	50
特別損失	※５	19
税引前中間純利益		4,102
法人税等	※６	927
中間純利益		3,174

（3）中間株主資本等変動計算書

第58期中間会計期間（自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	△502	52,028
当中間期変動額							
剰余金の配当				△1,495	△1,495		△1,495
中間純利益				3,174	3,174		3,174
自己株式の取得						△170	△170
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計				1,679	1,679	△170	1,508
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	31,627	31,627	△672	53,537

	評価・換算差額等	

	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	純資産合計
当期首残高	151	258	410	52,438
当中間期変動額				
剰余金の配当				△1,495
中間純利益				3,174
自己株式の取得				△170
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△491	521	29	29
当中間期変動額合計	△491	521	29	1,538
当中間期末残高	△340	780	439	53,977

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第58期中間会計期間 (自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日)
1　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法 (2) 金銭の信託 時価法 (3) デリバティブ 時価法
2　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年４月１日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウエア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。
3　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

	①　退職給付見込額の期間帰属方法 　退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②　数理計算上の差異の費用処理方法 　数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。
4　ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 　繰延ヘッジ処理によっております。 (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。 (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。 (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。
5　その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 　消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。

（会計方針の変更）

第58期中間会計期間 (自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日)
（減価償却方法） 　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）を当中間会計期間に適用し、平成28年４月１日以後に取得した建物附属設備及び構築物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。 　この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。 （税金費用の計算方法） 　従来、年度決算と同様の方法による税金費用の計算を適用しておりましたが、当社の中間決算業務の一層の効率化を図るため、当中間会計期間より事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り算出された見積実効税率に、税引前中間純利益を乗ずる計算方法に変更しております。なお、この変更による影響は軽微であるため、遡及適用は行っておりません。

（追加情報）

第58期中間会計期間 (自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日)
「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）を当中間会計期間から適用しております。

（中間貸借対照表関係）

第58期中間会計期間 (平成28年９月30日)
※１　有形固定資産の減価償却累計額 1,891百万円

※２　信託資産
流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。

※３　消費税等の取扱い
仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

※４　保証債務
当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務582百万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558百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

第58期中間会計期間
（自　平成28年４月１日
至　平成28年９月30日）

※１　減価償却実施額	
有形固定資産	70百万円
無形固定資産	20百万円
※２　営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	7百万円
受取配当金	1,591百万円
デリバティブ収益	6百万円
※３　営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	128百万円
支払源泉所得税	155百万円
※４　特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	50百万円
※５　特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	18百万円

※６　中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。

（中間株主資本等変動計算書関係）

第58期中間会計期間（自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	814,100	305,000	－	1,119,100

(注)　自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
平成21年度ストックオプション（1）	普通株式	1,762,200	―	19,800	1,742,400	―
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	―	―	4,738,800	―
平成28年度ストックオプション（1）	普通株式	―	4,437,000	―	4,437,000	―
合計		6,675,900	4,437,000	19,800	11,093,100	―

(注) 1　平成21年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
2　平成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。
3　平成21年度ストックオプション(1)1,742,400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、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

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)基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第58期中間会計期間 (自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
１年内	865百万円
１年超	2,220百万円
合計	3,085百万円

（金融商品関係）

第58期中間会計期間(平成28年９月30日)

1　金融商品の時価等に関する事項

平成28年９月30日（当中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額(※1)	時価(※1)	差額

(1) 現金及び預金	16,370	16,370	－
(2) 未収委託者報酬	8,443	8,443	－
(3) 未収収益	1,681	1,681	－
(4) 金銭の信託	152	152	－
(5) 関係会社短期貸付金	488	488	－
(6) 有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	11,431	11,431	－
(7) 未払金	(4,011)	(4,011)	－
(8) 未払費用	(4,007)	(4,007)	－
(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	24	24	－
ヘッジ会計が適用されているもの	268	268	－
デリバティブ取引計	292	292	－

(※1)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬 、(3) 未収収益並びに(5) 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。

(4) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は金融商品取引所が定める清算指数、為替予約取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(6) 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。

(7) 未払金及び(8) 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。

(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、上記金額は貸借対照表上、流動資産のその他に含まれております。

2 非上場株式等（中間貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

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

（有価証券関係）

第58期中間会計期間(平成28年９月30日)

１　子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	20,310

関連会社株式	2,892

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

２　その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	3,215	2,649	565
	小計	3,215	2,649	565
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	8,199	9,255	△1,056
	小計	8,199	9,255	△1,056
合計		11,414	11,905	△490

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

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

（デリバティブ取引関係）

第58期中間会計期間(平成28年９月30日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち１年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	3,386	―	24	24
合計		3,386	―	24	24

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

2　時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

２　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等のうち１年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		3,575	―	156
	豪ドル		67	―	1
	シンガポールドル		685	―	38

	ユーロ		82	－	2
	香港ドル		87	－	4
	人民元		1,831	－	65
合計			6,329	－	268

(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58期中間会計期間 (自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (1) 関連会社に対する投資の金額　3,017百万円 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額　8,257百万円 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額　1,144百万円

（ストックオプション等関係）

第58期中間会計期間(自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日)

当中間会計期間において、ストックオプションを付与しておりますが、当該ストックオプションの付与による影響が当社の財政状態、経営成績等にとって重要でないと認められるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第58期中間会計期間(自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日)

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

[関連情報]

第58期中間会計期間(自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日)

1　製品及びサービスごとの情報

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

2　地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第58期中間会計期間(自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第58期中間会計期間(自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第58期中間会計期間(自　平成28年４月１日　至　平成28年９月30日)

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

項目	第58期中間会計期間 (自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日)
１株当たり純資産額	275円54銭
１株当たり中間純利益金額	16円18銭

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

２　１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期中間会計期間 (自　平成28年４月１日 至　平成28年９月30日)
中間純利益（百万円）	3,174
普通株主に帰属しない金額（百万円）	―
普通株式に係る中間純利益（百万円）	3,174
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,123
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1)　1,742,400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28年度ストックオプション(1)　4,437,000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58期中間会計期間 (平成28年９月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	53,977
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	―
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	53,977
１株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	195,893

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

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

禁止されています。

（１）自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

（２）運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

（３）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

（４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

（５）上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

（１）定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（２）訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名　　称	資本金の額 （平成28年9月末現在）	事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	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。

（２）販売会社

名　　称	資本金の額 （平成28年9月末現在）	事業の内容
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	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。
日本生命保険相互会社	150,000百万円 （基金の総額）	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

（１）受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

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

３【資本関係】

（１）受託会社
該当事項はありません。
（２）販売会社
該当事項はありません。

第３【その他】

（１）目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。
（２）目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。
① 委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
② ファンドの基本的性格など
③ 委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
④ 委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
⑤ 目論見書の使用開始日
（３）目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
① 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
② 投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
③ 投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
④ 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
⑤ 「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
⑥ 請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。
⑦ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
⑧ 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
⑨ 商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
⑩ 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
⑪ 有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
⑫ 委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
（４）有価証券届出書本文「第一部　証券情報」、「第二部　ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
（５）目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部　ファンド情報」中「第１　ファンドの状況」「２　投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
（６）投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
（７）目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
（８）交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
① ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の６の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。
② 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
③ 分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投

資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

平成28年６月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　羽　太　典　明

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　竹　内　知　明

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

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

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

以　上

(注)１.上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

平成28年12月15日

日興アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

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」に掲げられているインデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）の平成27年11月７日から平成28年11月７日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）の平成28年11月７日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月５日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　羽 太 典 明

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　竹 内 知 明

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期事業年度の中間会計期間（平成28年４月１日から平成28年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成28年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年４月１日から平成28年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

(注)1.上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。