

## 【表紙】

|  |                     |
|--|---------------------|
| 【提出書類】                                   | 訂正有価証券届出書           |
| 【提出先】                                    | 関東財務局長殿             |
| 【提出日】                                    | 2019年4月10日提出        |
| 【発行者名】                                   | 野村アセットマネジメント株式会社    |
| 【代表者の役職氏名】                               | C E O兼代表取締役社長 中川 順子 |
| 【本店の所在の場所】                               | 東京都中央区日本橋一丁目12番1号   |
| 【事務連絡者氏名】                                | 松井 秀仁               |
| 【電話番号】                                   | 03-3241-9511        |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | 野村R A F I（R）日本株投信   |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券の金額】        | 2兆円を上限とします。         |
| 【縦覧に供する場所】                               | 該当事項はありません。         |

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2018年10月4日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

また、それ以外の訂正事項につきましては、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部\_\_は訂正部分を示し、＜更新後＞の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

## 第一部【証券情報】

## (5) 申込手数料

## &lt;訂正前&gt;

取得申込日の基準価額に2.16%(税抜2.0%)以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

## &lt;訂正後&gt;

取得申込日の基準価額に2.16%<sup>\*</sup>(税抜2.0%)以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

\*2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、2.2%となります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

## 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

###### <更新後>

わが国の株式を実質的な主要投資対象<sup>1</sup>とし、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行なうことを基本とします。

ファンダメンタル・インデックス構成手法<sup>2</sup>を活用して、委託会社が独自に銘柄・ウェイトを選定・計算し、これをベースに株式ポートフォリオを構築することを基本とします。

株式の実質組入比率は高位を基本とします。

- 1 ファンドは、「野村RAFI<sup>(R)</sup> 日本株投信マザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。
- 2 当該手法は、株主資本、配当額、キャッシュフロー等のファンダメンタル指標をもとに銘柄のウェイト付けを行なう運用手法で、2019年4月現在、リサーチ・アフィリエイツ社が知的所有権を申請中です。

##### 《ファミリーファンド方式について》

ファンドは「野村RAFI<sup>(R)</sup> 日本株投信マザーファンド」を親投資信託（マザーファンド）とするファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



マザーファンドの運用の方針等については、『第1 ファンドの状況 2 投資方針（参考）マザーファンドの概要』をご参照ください。

ファンドは、マザーファンドのほかに、直接株式等に投資する場合があります。

「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されます。

##### 信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、1兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

##### <商品分類>

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類は以下の通りで

す。

なお、ファンドに該当する商品分類及び属性区分は下記の表中に**網掛け表示**しております。

(野村RAFI<sup>(R)</sup> 日本株投信)

《商品分類表》

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>(収益の源泉) |
|---------|--------|-------------------|
| 単位型     | 国内     | 株式                |
|         |        | 債券                |
|         | 海外     | 不動産投信             |
| 追加型     | 内外     | その他資産<br>( )      |
|         |        | 資産複合              |

《属性区分表》

| 投資対象資産   | 決算頻度       | 投資対象地域      | 投資形態             |
|--|------------|-------------|------------------|
| 株式<br>一般   | 年1回        | グローバル       |                  |
| 大型株  | <b>年2回</b> | <b>日本</b>   |                  |
| 中小型株   | 年4回        | 北米          | <b>ファミリーファンド</b> |
| 債券<br>一般   | 年6回        | 欧州          |                  |
| 公債   | (隔月)       | アジア         |                  |
| 社債   | 年12回       | オセアニア       |                  |
| その他債券<br>クレジット属性<br>( )                          | (毎月)       | 中南米         |                  |
| 不動産投信  | 日々         | アフリカ        | ファンド・オブ・ファンズ     |
| <b>その他資産</b><br><b>(投資信託証券</b><br><b>(株式一般))</b> | その他<br>( ) | 中近東<br>(中東) |                  |
| 資産複合<br>( )                                      |            | エマージング      |                  |
| 資産配分固定型  |            |             |                  |
| 資産配分変更型  |            |             |                  |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産（その他資産(投資信託証券)）と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(株式)とが異なります。

(3) ファンドの仕組み

< 更新後 >

## 委託会社の概況(2019年2月末現在)

## ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

## ・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

## ・資本金の額

17,180百万円

## ・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村  
アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

## ・大株主の状況

| 名称             | 住所               | 所有株式数      | 比率   |
|----------------|------------------|------------|------|
| 野村ホールディングス株式会社 | 東京都中央区日本橋一丁目9番1号 | 5,150,693株 | 100% |

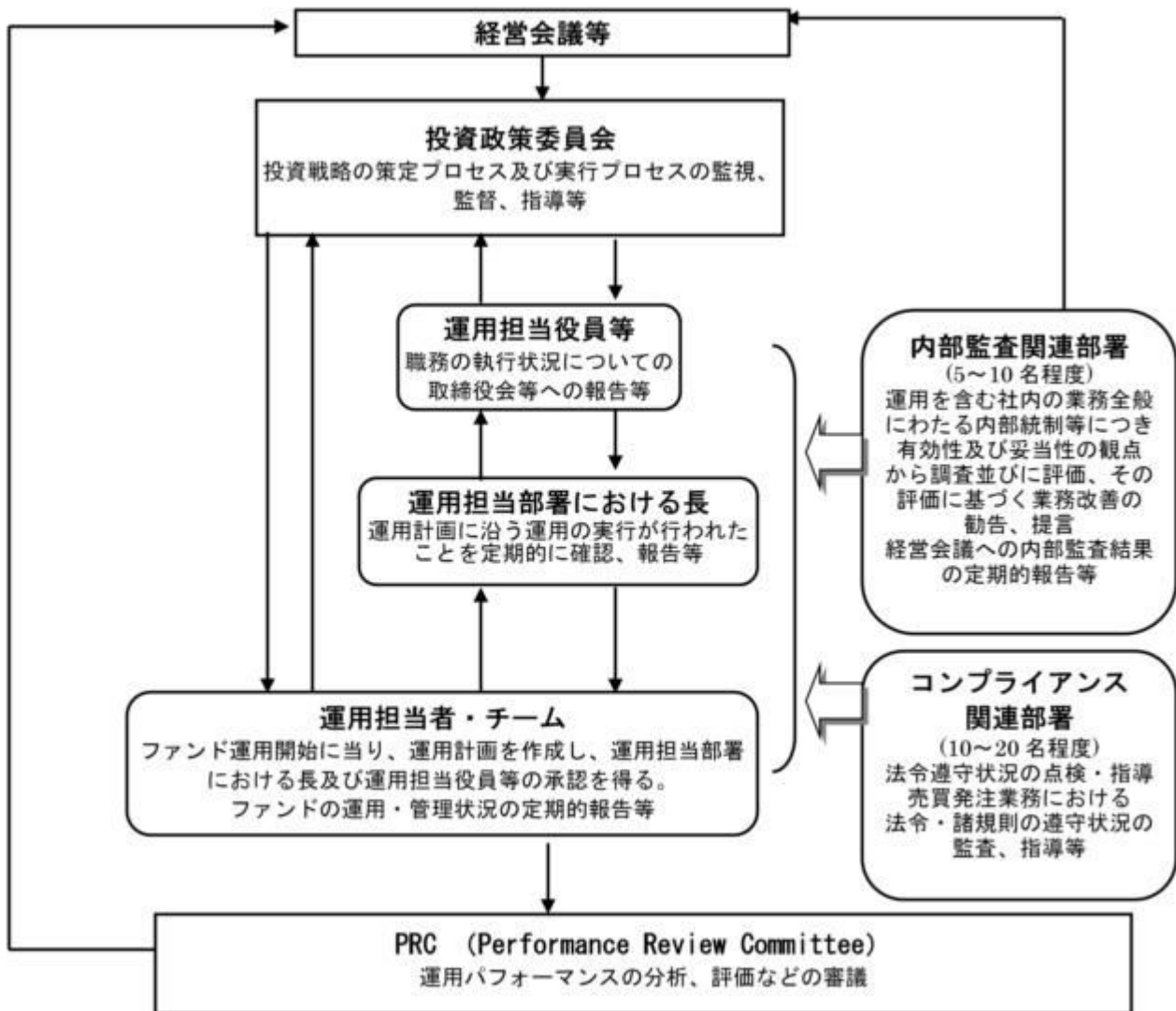
## 2 投資方針

## (3) 運用体制

## &lt;更新後&gt;

ファンドを含む委託会社における投資信託の内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りで

す。



#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

運用の外部委託を行う場合、「運用の外部委託先」に対しては、外部委託先が行った日々の約定について、投資ガイドラインに沿ったものであるかを確認しています。また、コンプライアンスレポートの提出を義務付け、定期的に管理状況に関する報告を受けています。さらに、外部委託先の管理体制、コンプライアンス体制等について調査ならびに評価を行い、定期的に商品に関する委員会に報告しています。

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

### 3 投資リスク

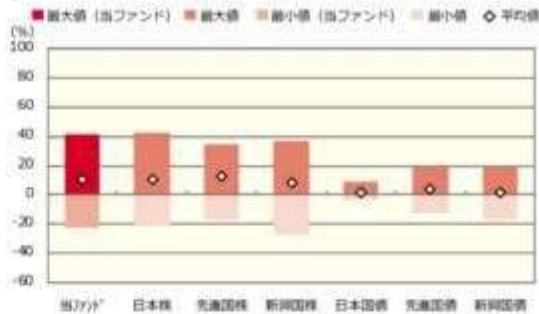
< 更新後 >

## ■ リスクの定量的比較 (2014年3月末～2019年2月末；月次)

### 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



### ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



|         | 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   |
|---------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|
| 最大値 (%) | 41.3   | 41.9   | 34.1   | 37.2   | 9.3   | 19.3   | 19.3   |
| 最小値 (%) | △ 23.1 | △ 22.0 | △ 17.5 | △ 27.4 | △ 4.0 | △ 12.3 | △ 17.4 |
| 平均値 (%) | 10.5   | 10.9   | 12.3   | 8.1    | 2.0   | 3.4    | 1.5    |

※ 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2014年3月末を10,000として指数化しております。  
※ 年間騰落率は、2014年3月から2019年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※ 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。  
※ 2014年3月から2019年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。  
※ 決算日に対応した数値とは異なります。  
※ 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※ 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

#### <代表的な資産クラスの指数>

- 日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
- 先進国株：MSCI-KOKUSA1 指数 (配当込み、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 (配当込み、円ベース)
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし、円ベース)
- 新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)

#### ■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) ・ ・ ・ 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) は、株式会社東京証券取引所 (東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数額の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
  - MSCI-KOKUSA1 指数 (配当込み、円ベース)、MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) ・ ・ ・ MSCI-KOKUSA1 指数 (配当込み、円ベース)、MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
  - NOMURA-BPI 国債 ・ ・ ・ NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村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。
  - FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし、円ベース) ・ ・ ・ FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし、円ベース) は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、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債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
  - JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース) ・ ・ ・ 「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)」 (ここでは「指数」とよびます) についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンパレーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社 (以下、JPM) がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC (ここでは「JPMSLLC」と呼びます) (「指数スポンサー」) は、指数に関する証券、金融商品または取引 (ここでは「プロダクト」と呼びます) についての提供、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPPI, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

(出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他)

## 4 手数料等及び税金

### (1) 申込手数料



## &lt; 更新後 &gt;

取得申込日の基準価額に、2.16%<sup>\*</sup>（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）  
（税抜2.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

\* 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、2.2%となります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせ下さい。

収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

購入時手数料は、商品及び関連する投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務コストの対価として、購入時に頂戴するものです。

## (3) 信託報酬等

## &lt; 更新後 &gt;

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年10,000分の108（税抜年10,000分の100）の率を乗じて得た額とします。

また、信託報酬の配分については、ファンドの純資産総額の残高に応じて次の通り（税抜）とします。

| < ファンドの純資産総額 >   | < 委託会社 >    | < 販売会社 >    | < 受託会社 >   |
|------------------|-------------|-------------|------------|
| 250億円以下の部分       | 年10,000分の45 | 年10,000分の50 | 年10,000分の5 |
| 250億円超500億円以下の部分 | 年10,000分の46 | 年10,000分の50 | 年10,000分の4 |
| 500億円超の部分        | 年10,000分の47 | 年10,000分の50 | 年10,000分の3 |

ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、年10,000分の110となります。

## 支払先の役務の内容

| < 委託会社 >                                   | < 販売会社 >                                     | < 受託会社 >                    |
|--|--|-----------------------------|
| ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等 | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等 |

## (5) 課税上の取扱い

## &lt; 更新後 &gt;

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315% (国税(所得税及び復興特別所得税)15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除の適用があります。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により20.315% (国税15.315%および地方税5%)の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は20.315%の税率により源泉徴収が行なわれます。

損益通算について

以下の所得間で損益通算が可能です。上場株式等の配当所得については申告分離課税を選択したものに限りです。

| 《利子所得》   | 《上場株式等に係る譲渡所得等》 <sup>(注2)</sup>   | 《配当所得》  |
|--|---|---|
| <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 特定公社債<sup>(注1)</sup>の利子</li> <li>・ 公募公社債投資信託の収益分配金</li> </ul> | 特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 譲渡益</li> <li>・ 譲渡損</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 上場株式の配当</li> <li>・ 公募株式投資信託の収益分配金</li> </ul> |

(注1) 「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

(注2) 株式等に係る譲渡所得等について、上場株式等に係る譲渡所得等とそれ以外の株式等に係る譲渡所得等に区分し、別々の分離課税制度とすることとされ、原則として、これら相互の通算等ができないこととされました。

上場株式、公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額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及び譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資家に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315% (国税15.315%)の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の差益 については、譲渡所得とみなして課税が行われます。

換金（解約）時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益を譲渡益として課税対象となります。

#### [法人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が源泉徴収の対象（配当所得）となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

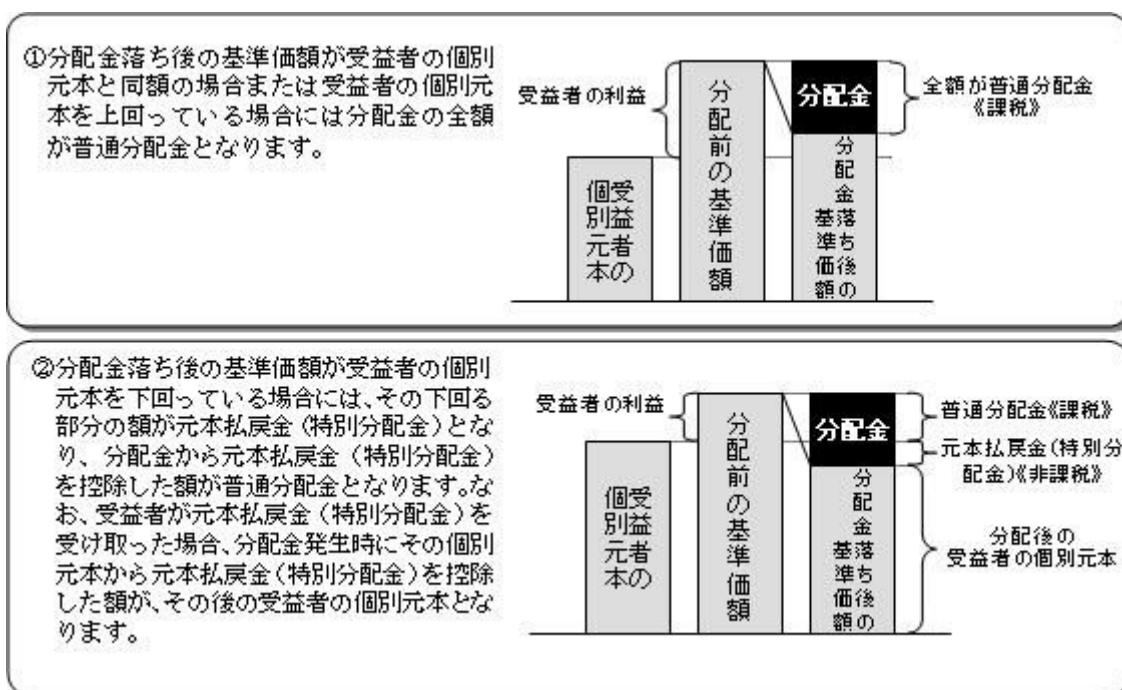
#### 個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

#### 分配金の課税について

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）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。



上図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

税法が改正された場合等は、上記「(5) 課税上の取扱い」の内容(2019年2月末現在)が変更になる場合があります。

## 5 運用状況

以下は2019年2月28日現在の運用状況であります。

また、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

野村 R A F I ( R ) 日本株投信

| 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   | 2,360,516,329 | 99.79   |
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) |      | 4,770,892     | 0.20    |
| 合計(純資産総額)          |      | 2,365,287,221 | 100.00  |

(参考) 野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド

| 資産の種類              | 国/地域 | 時価合計(円)        | 投資比率(%) |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 株式                 | 日本   | 20,132,280,100 | 99.52   |
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) |      | 96,504,706     | 0.47    |
| 合計(純資産総額)          |      | 20,228,784,806 | 100.00  |

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

野村 R A F I ( R ) 日本株投信

| 順位 | 国/地域 | 種類        | 銘柄名                           | 数量            | 簿価単価(円) | 簿価金額(円)       | 評価単価(円) | 評価金額(円)       | 投資比率(%) |
|----|------|-----------|-------------------------------|---------------|---------|---------------|---------|---------------|---------|
| 1  | 日本   | 親投資信託受益証券 | 野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド | 1,685,120,167 | 1.3564  | 2,285,696,995 | 1.4008  | 2,360,516,329 | 99.79   |

種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.79   |
| 合計        | 99.79   |

(参考) 野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名               | 業種     | 数量        | 簿価単価(円)  | 簿価金額(円)       | 評価単価(円)  | 評価金額(円)       | 投資比率(%) |
|----|------|----|-------------------|--------|-----------|----------|---------------|----------|---------------|---------|
| 1  | 日本   | 株式 | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 176,400   | 6,865.86 | 1,211,138,735 | 6,697.00 | 1,181,350,800 | 5.83    |
| 2  | 日本   | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 1,059,600 | 588.51   | 623,591,759   | 576.70   | 611,071,320   | 3.02    |
| 3  | 日本   | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 121,000   | 4,692.97 | 567,849,824   | 4,801.00 | 580,921,000   | 2.87    |
| 4  | 日本   | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 114,000   | 3,985.77 | 454,378,803   | 3,942.00 | 449,388,000   | 2.22    |
| 5  | 日本   | 株式 | N T T ドコモ         | 情報・通信業 | 156,000   | 2,616.50 | 408,174,343   | 2,591.50 | 404,274,000   | 1.99    |
| 6  | 日本   | 株式 | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業    | 2,246,200 | 178.43   | 400,797,674   | 175.20   | 393,534,240   | 1.94    |

|    |    |    |                 |        |         |           |             |           |             |      |
|----|----|----|-----------------|--------|---------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 7  | 日本 | 株式 | 本田技研工業          | 輸送用機器  | 120,700 | 3,180.05  | 383,832,636 | 3,153.00  | 380,567,100 | 1.88 |
| 8  | 日本 | 株式 | 日産自動車           | 輸送用機器  | 330,500 | 938.02    | 310,015,883 | 962.40    | 318,073,200 | 1.57 |
| 9  | 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ      | 情報・通信業 | 29,300  | 8,334.97  | 244,214,837 | 10,280.00 | 301,204,000 | 1.48 |
| 10 | 日本 | 株式 | KDDI            | 情報・通信業 | 104,000 | 2,770.18  | 288,098,908 | 2,688.50  | 279,604,000 | 1.38 |
| 11 | 日本 | 株式 | 日本たばこ産業         | 食料品    | 88,100  | 2,766.51  | 243,729,533 | 2,833.00  | 249,587,300 | 1.23 |
| 12 | 日本 | 株式 | 三菱商事            | 卸売業    | 70,600  | 3,113.23  | 219,794,499 | 3,139.00  | 221,613,400 | 1.09 |
| 13 | 日本 | 株式 | キヤノン            | 電気機器   | 61,600  | 3,172.39  | 195,419,800 | 3,201.00  | 197,181,600 | 0.97 |
| 14 | 日本 | 株式 | 三井物産            | 卸売業    | 105,600 | 1,782.06  | 188,186,489 | 1,750.00  | 184,800,000 | 0.91 |
| 15 | 日本 | 株式 | デンソー            | 輸送用機器  | 35,800  | 5,104.34  | 182,735,649 | 4,782.00  | 171,195,600 | 0.84 |
| 16 | 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス    | 保険業    | 28,500  | 5,290.72  | 150,785,789 | 5,426.00  | 154,641,000 | 0.76 |
| 17 | 日本 | 株式 | ブリヂストン          | ゴム製品   | 35,200  | 4,204.83  | 148,010,086 | 4,393.00  | 154,633,600 | 0.76 |
| 18 | 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道         | 陸運業    | 14,500  | 10,024.10 | 145,349,497 | 10,660.00 | 154,570,000 | 0.76 |
| 19 | 日本 | 株式 | 伊藤忠商事           | 卸売業    | 76,400  | 1,947.60  | 148,797,258 | 1,998.00  | 152,647,200 | 0.75 |
| 20 | 日本 | 株式 | 東海旅客鉄道          | 陸運業    | 6,100   | 23,109.58 | 140,968,460 | 24,975.00 | 152,347,500 | 0.75 |
| 21 | 日本 | 株式 | 日立製作所           | 電気機器   | 45,300  | 3,487.71  | 157,993,555 | 3,335.00  | 151,075,500 | 0.74 |
| 22 | 日本 | 株式 | S U B A R U     | 輸送用機器  | 51,500  | 2,617.65  | 134,809,149 | 2,826.50  | 145,564,750 | 0.71 |
| 23 | 日本 | 株式 | ソニー             | 電気機器   | 27,100  | 5,448.22  | 147,646,928 | 5,341.00  | 144,741,100 | 0.71 |
| 24 | 日本 | 株式 | 東京電力ホールディングス    | 電気・ガス業 | 202,100 | 663.66    | 134,127,002 | 694.00    | 140,257,400 | 0.69 |
| 25 | 日本 | 株式 | 新日鐵住金           | 鉄鋼     | 65,200  | 2,012.39  | 131,208,444 | 2,003.50  | 130,628,200 | 0.64 |
| 26 | 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業    | 26,400  | 4,718.27  | 124,562,396 | 4,894.00  | 129,201,600 | 0.63 |
| 27 | 日本 | 株式 | 武田薬品工業          | 医薬品    | 28,600  | 4,396.93  | 125,752,462 | 4,469.00  | 127,813,400 | 0.63 |
| 28 | 日本 | 株式 | オリックス           | その他金融業 | 78,900  | 1,711.02  | 134,999,690 | 1,612.00  | 127,186,800 | 0.62 |
| 29 | 日本 | 株式 | 三菱電機            | 電気機器   | 81,800  | 1,330.98  | 108,874,281 | 1,394.00  | 114,029,200 | 0.56 |
| 30 | 日本 | 株式 | 住友商事            | 卸売業    | 70,300  | 1,673.94  | 117,678,325 | 1,600.50  | 112,515,150 | 0.55 |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 国内/国外 | 業種       | 投資比率(%) |
|----|-------|----------|---------|
| 株式 | 国内    | 水産・農林業   | 0.08    |
|    |       | 鉱業       | 0.50    |
|    |       | 建設業      | 2.78    |
|    |       | 食料品      | 3.48    |
|    |       | 繊維製品     | 0.53    |
|    |       | パルプ・紙    | 0.38    |
|    |       | 化学       | 5.49    |
|    |       | 医薬品      | 3.54    |
|    |       | 石油・石炭製品  | 0.77    |
|    |       | ゴム製品     | 1.12    |
|    |       | ガラス・土石製品 | 0.84    |
|    |       | 鉄鋼       | 1.47    |
|    |       | 非鉄金属     | 0.97    |
|    |       | 金属製品     | 0.64    |

|     |            |       |
|-----|------------|-------|
|     | 機械         | 3.91  |
|     | 電気機器       | 9.04  |
|     | 輸送用機器      | 14.29 |
|     | 精密機器       | 0.87  |
|     | その他製品      | 1.06  |
|     | 電気・ガス業     | 3.01  |
|     | 陸運業        | 3.70  |
|     | 海運業        | 0.24  |
|     | 空運業        | 0.65  |
|     | 倉庫・運輸関連業   | 0.17  |
|     | 情報・通信業     | 10.07 |
|     | 卸売業        | 5.49  |
|     | 小売業        | 3.67  |
|     | 銀行業        | 11.73 |
|     | 証券、商品先物取引業 | 0.73  |
|     | 保険業        | 2.56  |
|     | その他金融業     | 1.59  |
|     | 不動産業       | 1.57  |
|     | サービス業      | 2.40  |
| 合 計 |            | 99.52 |

#### 投資不動産物件

野村 R A F I ( R ) 日本株投信

該当事項はありません。

(参考) 野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

野村 R A F I ( R ) 日本株投信

該当事項はありません。

(参考) 野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド

該当事項はありません。

#### ( 3 ) 運用実績

##### 純資産の推移

## 野村 R A F I ( R ) 日本株投信

2019年2月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

|                       | 純資産総額（百万円） |        | 1口当たり純資産額(円) |        |
|-----------------------|------------|--------|--------------|--------|
|                       | （分配落）      | （分配付）  | （分配落）        | （分配付）  |
| 第4計算期間 (2009年 7月13日)  | 13,621     | 13,621 | 0.5551       | 0.5551 |
| 第5計算期間 (2010年 1月13日)  | 12,237     | 12,237 | 0.6246       | 0.6246 |
| 第6計算期間 (2010年 7月13日)  | 9,143      | 9,143  | 0.5766       | 0.5766 |
| 第7計算期間 (2011年 1月13日)  | 8,267      | 8,267  | 0.6361       | 0.6361 |
| 第8計算期間 (2011年 7月13日)  | 6,712      | 6,712  | 0.5926       | 0.5926 |
| 第9計算期間 (2012年 1月13日)  | 5,347      | 5,347  | 0.5181       | 0.5181 |
| 第10計算期間 (2012年 7月13日) | 4,827      | 4,827  | 0.5266       | 0.5266 |
| 第11計算期間 (2013年 1月15日) | 5,324      | 5,324  | 0.6372       | 0.6372 |
| 第12計算期間 (2013年 7月16日) | 5,588      | 5,588  | 0.8526       | 0.8526 |
| 第13計算期間 (2014年 1月14日) | 5,427      | 5,427  | 0.8975       | 0.8975 |
| 第14計算期間 (2014年 7月14日) | 5,083      | 5,083  | 0.9178       | 0.9178 |
| 第15計算期間 (2015年 1月13日) | 4,724      | 4,724  | 0.9871       | 0.9871 |
| 第16計算期間 (2015年 7月13日) | 4,452      | 4,490  | 1.1758       | 1.1858 |
| 第17計算期間 (2016年 1月13日) | 3,634      | 3,644  | 1.0625       | 1.0655 |
| 第18計算期間 (2016年 7月13日) | 3,058      | 3,058  | 0.9568       | 0.9568 |
| 第19計算期間 (2017年 1月13日) | 3,213      | 3,240  | 1.1731       | 1.1831 |
| 第20計算期間 (2017年 7月13日) | 2,776      | 2,799  | 1.2036       | 1.2136 |
| 第21計算期間 (2018年 1月15日) | 2,841      | 2,862  | 1.3888       | 1.3988 |
| 第22計算期間 (2018年 7月13日) | 2,486      | 2,510  | 1.2602       | 1.2722 |
| 第23計算期間 (2019年 1月15日) | 2,299      | 2,319  | 1.1515       | 1.1615 |
| 2018年 2月末日            | 2,616      |        | 1.2962       |        |
| 3月末日                  | 2,552      |        | 1.2661       |        |
| 4月末日                  | 2,641      |        | 1.3194       |        |
| 5月末日                  | 2,550      |        | 1.2838       |        |
| 6月末日                  | 2,519      |        | 1.2753       |        |
| 7月末日                  | 2,543      |        | 1.2858       |        |
| 8月末日                  | 2,488      |        | 1.2682       |        |
| 9月末日                  | 2,598      |        | 1.3410       |        |
| 10月末日                 | 2,362      |        | 1.2313       |        |
| 11月末日                 | 2,428      |        | 1.2370       |        |
| 12月末日                 | 2,232      |        | 1.1178       |        |
| 2019年 1月末日            | 2,342      |        | 1.1686       |        |
| 2月末日                  | 2,365      |        | 1.1876       |        |

## 分配の推移

## 野村 R A F I ( R ) 日本株投信

|         | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|---------|-------------------------|-----------|
| 第4計算期間  | 2009年 1月14日～2009年 7月13日 | 0.0000円   |
| 第5計算期間  | 2009年 7月14日～2010年 1月13日 | 0.0000円   |
| 第6計算期間  | 2010年 1月14日～2010年 7月13日 | 0.0000円   |
| 第7計算期間  | 2010年 7月14日～2011年 1月13日 | 0.0000円   |
| 第8計算期間  | 2011年 1月14日～2011年 7月13日 | 0.0000円   |
| 第9計算期間  | 2011年 7月14日～2012年 1月13日 | 0.0000円   |
| 第10計算期間 | 2012年 1月14日～2012年 7月13日 | 0.0000円   |
| 第11計算期間 | 2012年 7月14日～2013年 1月15日 | 0.0000円   |
| 第12計算期間 | 2013年 1月16日～2013年 7月16日 | 0.0000円   |
| 第13計算期間 | 2013年 7月17日～2014年 1月14日 | 0.0000円   |
| 第14計算期間 | 2014年 1月15日～2014年 7月14日 | 0.0000円   |
| 第15計算期間 | 2014年 7月15日～2015年 1月13日 | 0.0000円   |
| 第16計算期間 | 2015年 1月14日～2015年 7月13日 | 0.0100円   |
| 第17計算期間 | 2015年 7月14日～2016年 1月13日 | 0.0030円   |
| 第18計算期間 | 2016年 1月14日～2016年 7月13日 | 0.0000円   |
| 第19計算期間 | 2016年 7月14日～2017年 1月13日 | 0.0100円   |
| 第20計算期間 | 2017年 1月14日～2017年 7月13日 | 0.0100円   |
| 第21計算期間 | 2017年 7月14日～2018年 1月15日 | 0.0100円   |
| 第22計算期間 | 2018年 1月16日～2018年 7月13日 | 0.0120円   |
| 第23計算期間 | 2018年 7月14日～2019年 1月15日 | 0.0100円   |

## 収益率の推移

## 野村 R A F I ( R ) 日本株投信

|         | 計算期間                    | 収益率   |
|---------|-------------------------|-------|
| 第4計算期間  | 2009年 1月14日～2009年 7月13日 | 9.4%  |
| 第5計算期間  | 2009年 7月14日～2010年 1月13日 | 12.5% |
| 第6計算期間  | 2010年 1月14日～2010年 7月13日 | 7.7%  |
| 第7計算期間  | 2010年 7月14日～2011年 1月13日 | 10.3% |
| 第8計算期間  | 2011年 1月14日～2011年 7月13日 | 6.8%  |
| 第9計算期間  | 2011年 7月14日～2012年 1月13日 | 12.6% |
| 第10計算期間 | 2012年 1月14日～2012年 7月13日 | 1.6%  |
| 第11計算期間 | 2012年 7月14日～2013年 1月15日 | 21.0% |
| 第12計算期間 | 2013年 1月16日～2013年 7月16日 | 33.8% |
| 第13計算期間 | 2013年 7月17日～2014年 1月14日 | 5.3%  |
| 第14計算期間 | 2014年 1月15日～2014年 7月14日 | 2.3%  |



|         |                         |       |
|---------|-------------------------|-------|
| 第15計算期間 | 2014年 7月15日～2015年 1月13日 | 7.6%  |
| 第16計算期間 | 2015年 1月14日～2015年 7月13日 | 20.1% |
| 第17計算期間 | 2015年 7月14日～2016年 1月13日 | 9.4%  |
| 第18計算期間 | 2016年 1月14日～2016年 7月13日 | 9.9%  |
| 第19計算期間 | 2016年 7月14日～2017年 1月13日 | 23.7% |
| 第20計算期間 | 2017年 1月14日～2017年 7月13日 | 3.5%  |
| 第21計算期間 | 2017年 7月14日～2018年 1月15日 | 16.2% |
| 第22計算期間 | 2018年 1月16日～2018年 7月13日 | 8.4%  |
| 第23計算期間 | 2018年 7月14日～2019年 1月15日 | 7.8%  |

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。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を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### （４）設定及び解約の実績

##### 野村 R A F I（R）日本株投信

|         | 計算期間                    | 設定口数        | 解約口数          | 発行済み口数         |
|---------|-------------------------|-------------|---------------|----------------|
| 第4計算期間  | 2009年 1月14日～2009年 7月13日 | 573,929,615 | 7,671,234,288 | 24,539,001,865 |
| 第5計算期間  | 2009年 7月14日～2010年 1月13日 | 13,267,936  | 4,959,565,663 | 19,592,704,138 |
| 第6計算期間  | 2010年 1月14日～2010年 7月13日 | 66,813,351  | 3,802,771,216 | 15,856,746,273 |
| 第7計算期間  | 2010年 7月14日～2011年 1月13日 | 4,715,019   | 2,863,890,201 | 12,997,571,091 |
| 第8計算期間  | 2011年 1月14日～2011年 7月13日 | 2,167,402   | 1,671,312,476 | 11,328,426,017 |
| 第9計算期間  | 2011年 7月14日～2012年 1月13日 | 103,773,680 | 1,109,734,274 | 10,322,465,423 |
| 第10計算期間 | 2012年 1月14日～2012年 7月13日 | 4,671,625   | 1,159,998,799 | 9,167,138,249  |
| 第11計算期間 | 2012年 7月14日～2013年 1月15日 | 3,406,825   | 813,957,001   | 8,356,588,073  |
| 第12計算期間 | 2013年 1月16日～2013年 7月16日 | 32,655,646  | 1,834,249,186 | 6,554,994,533  |
| 第13計算期間 | 2013年 7月17日～2014年 1月14日 | 96,593,027  | 603,455,479   | 6,048,132,081  |
| 第14計算期間 | 2014年 1月15日～2014年 7月14日 | 93,473,265  | 603,124,402   | 5,538,480,944  |
| 第15計算期間 | 2014年 7月15日～2015年 1月13日 | 246,579,675 | 998,142,131   | 4,786,918,488  |
| 第16計算期間 | 2015年 1月14日～2015年 7月13日 | 271,758,131 | 1,271,677,504 | 3,786,999,115  |
| 第17計算期間 | 2015年 7月14日～2016年 1月13日 | 147,361,632 | 513,422,645   | 3,420,938,102  |
| 第18計算期間 | 2016年 1月14日～2016年 7月13日 | 111,331,351 | 335,788,991   | 3,196,480,462  |
| 第19計算期間 | 2016年 7月14日～2017年 1月13日 | 911,390     | 458,162,960   | 2,739,228,892  |
| 第20計算期間 | 2017年 1月14日～2017年 7月13日 | 13,094,147  | 445,652,480   | 2,306,670,559  |
| 第21計算期間 | 2017年 7月14日～2018年 1月15日 | 11,338,998  | 271,932,617   | 2,046,076,940  |
| 第22計算期間 | 2018年 1月16日～2018年 7月13日 | 11,122,487  | 84,130,596    | 1,973,068,831  |
| 第23計算期間 | 2018年 7月14日～2019年 1月15日 | 111,768,465 | 87,931,942    | 1,996,905,354  |

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 参考情報

&lt; 更新後 &gt;



## 運用実績 (2019年2月28日現在)

### ■ 基準価額・純資産の推移 (日次)



### ■ 分配の推移

(1万口あたり、課税前)

|         |       |
|---------|-------|
| 2019年1月 | 100 円 |
| 2018年7月 | 120 円 |
| 2018年1月 | 100 円 |
| 2017年7月 | 100 円 |
| 2017年1月 | 100 円 |
| 設定来累計   | 650 円 |

### ■ 主要な資産の状況

実質的な銘柄別投資比率 (上位)

| 順位 | 銘柄                | 業種     | 投資比率 (%) |
|----|-------------------|--------|----------|
| 1  | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 5.8      |
| 2  | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 3.0      |
| 3  | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 2.9      |
| 4  | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 2.2      |
| 5  | NTTドコモ            | 情報・通信業 | 2.0      |
| 6  | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業    | 1.9      |
| 7  | 本田技研工業            | 輸送用機器  | 1.9      |
| 8  | 日産自動車             | 輸送用機器  | 1.6      |
| 9  | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 1.5      |
| 10 | KDDI              | 情報・通信業 | 1.4      |

実質的な業種別投資比率 (上位)

| 順位 | 業種     | 投資比率 (%) |
|----|--------|----------|
| 1  | 輸送用機器  | 14.3     |
| 2  | 銀行業    | 11.7     |
| 3  | 情報・通信業 | 10.0     |
| 4  | 電気機器   | 9.0      |
| 5  | 化学     | 5.5      |
| 5  | 卸売業    | 5.5      |

### ■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2019年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

## 1 申込（販売）手続等

## &lt; 訂正前 &gt;

申込期間中の各営業日に、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれます。

取得申込の受付については、午後3時までに、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

分配金の受取方法により、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、申込取扱場所によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。

ファンドの申込（販売）手続についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

販売の単位は、1万口以上1口単位（当初元本1口＝1円）または1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。なお、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合や、取得申込単位が前記と異なる場合等があります。原則として、お買付け後のコース変更はできません。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 積立方式

販売会社によっては、「定時定額購入サービス」等に関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込の単位でお申込みいただけます。

当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあります。

受益権の販売価額は、取得申込日の基準価額とします。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消す場合があります。

## &lt; 申込手数料 &gt;

( )取得申込日の基準価額に、2.16%（税抜2.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせ下さい。

( )収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該

口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

#### <訂正後>

申込期間中の各営業日に、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれます。

取得申込の受付については、午後3時までに、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

分配金の受取方法により、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、申込取扱場所によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。

ファンドの申込(販売)手続についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

販売の単位は、1万口以上1口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。なお、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合や、取得申込単位が前記と異なる場合等があります。原則として、お買付け後のコース変更はできません。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### 積立方式

販売会社によっては、「定時定額購入サービス」等に関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込の単位でお申込みいただけます。

当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあります。

受益権の販売価額は、取得申込日の基準価額とします。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消す場合があります。

取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該

口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないません。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないません。

## 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)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第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)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。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23期計算期間(2018年7月14日から2019年1月15日まで)の財務諸表について、EY新日本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

## 野村 R A F I ( R ) 日本株投信

## (1) 貸借対照表

|                 | (単位：円)                  |                         |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
|                 | 第22期<br>(2018年 7月13日現在) | 第23期<br>(2019年 1月15日現在) |
| <b>資産の部</b>     |                         |                         |
| 流動資産            |                         |                         |
| コール・ローン         | 42,634,488              | 37,975,180              |
| 親投資信託受益証券       | 2,483,789,609           | 2,294,878,879           |
| 流動資産合計          | 2,526,424,097           | 2,332,854,059           |
| 資産合計            | 2,526,424,097           | 2,332,854,059           |
| <b>負債の部</b>     |                         |                         |
| 流動負債            |                         |                         |
| 未払収益分配金         | 23,676,825              | 19,969,053              |
| 未払解約金           | 2,487,449               | -                       |
| 未払受託者報酬         | 690,580                 | 667,856                 |
| 未払委託者報酬         | 13,121,039              | 12,689,150              |
| 未払利息            | 80                      | 73                      |
| その他未払費用         | 41,371                  | 40,009                  |
| 流動負債合計          | 40,017,344              | 33,366,141              |
| 負債合計            | 40,017,344              | 33,366,141              |
| <b>純資産の部</b>    |                         |                         |
| 元本等             |                         |                         |
| 元本              | 1,973,068,831           | 1,996,905,354           |
| 剰余金             |                         |                         |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 513,337,922             | 302,582,564             |
| (分配準備積立金)       | 784,475,934             | 754,193,015             |
| 元本等合計           | 2,486,406,753           | 2,299,487,918           |
| 純資産合計           | 2,486,406,753           | 2,299,487,918           |
| 負債純資産合計         | 2,526,424,097           | 2,332,854,059           |

## (2) 損益及び剰余金計算書

|             | (単位：円)                                 |  |
|-------------|--|--|
|             | 第22期<br>自 2018年 1月16日<br>至 2018年 7月13日 | 第23期<br>自 2018年 7月14日<br>至 2019年 1月15日 |
| <b>営業収益</b> |  |  |
| 有価証券売買等損益   | 222,991,767                            | 179,910,730                            |
| 営業収益合計      | 222,991,767                            | 179,910,730                            |
| <b>営業費用</b> |  |  |
| 支払利息        | 3,766                                  | 4,246                                  |
| 受託者報酬       | 690,580                                | 667,856                                |

|   | 第22期<br>自 2018年 1月16日<br>至 2018年 7月13日 | 第23期<br>自 2018年 7月14日<br>至 2019年 1月15日 |
|---|--|--|
| 委託者報酬                                     | 13,121,039                             | 12,689,150                             |
| その他費用                                     | 41,371                                 | 40,009                                 |
| 営業費用合計                                    | 13,856,756                             | 13,401,261                             |
| 営業利益又は営業損失( )                             | 236,848,523                            | 193,311,991                            |
| 経常利益又は経常損失( )                             | 236,848,523                            | 193,311,991                            |
| 当期純利益又は当期純損失( )                           | 236,848,523                            | 193,311,991                            |
| 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( ) | 6,641,048                              | 113,892                                |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           | 795,500,277                            | 513,337,922                            |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 4,108,892                              | 25,178,096                             |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 4,108,892                              | 25,178,096                             |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 32,386,947                             | 22,538,518                             |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 32,386,947                             | 22,538,518                             |
| 分配金                                       | 23,676,825                             | 19,969,053                             |
| 期末剰余金又は期末欠損金( )                           | 513,337,922                            | 302,582,564                            |

## (3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br>基準価額で評価しております。   |
| 2. 費用・収益の計上基準              | 有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。  |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補<br>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。 |
| 4. その他                     | 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年 7月14日から2019年 1月15日までとなっております。  |

(貸借対照表に関する注記)

| 第22期<br>2018年 7月13日現在   | 第23期<br>2019年 1月15日現在   |
|---|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>1,973,068,831口  | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>1,996,905,354口  |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.2602円<br>(10,000口当たり純資産額) (12,602円) | 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.1515円<br>(10,000口当たり純資産額) (11,515円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第22期<br>自 2018年 1月16日<br>至 2018年 7月13日 | 第23期<br>自 2018年 7月14日<br>至 2019年 1月15日 |
|--|--|
|  |  |

| 1. 分配金の計算過程               |                |                | 1. 分配金の計算過程               |                |                |
|---------------------------|----------------|----------------|---------------------------|----------------|----------------|
| 項目                        |                |                | 項目                        |                |                |
| 費用控除後の配当等収益額              | A              | 19,546,696円    | 費用控除後の配当等収益額              | A              | 23,794,359円    |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B              | 0円             | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B              | 0円             |
| 収益調整金額                    | C              | 60,488,425円    | 収益調整金額                    | C              | 105,231,771円   |
| 分配準備積立金額                  | D              | 788,606,063円   | 分配準備積立金額                  | D              | 750,367,709円   |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D      | 868,641,184円   | 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D      | 879,393,839円   |
| 当ファンドの期末残存口数              | F              | 1,973,068,831口 | 当ファンドの期末残存口数              | F              | 1,996,905,354口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F × 10,000 | 4,402円         | 10,000口当たり収益分配対象額         | G=E/F × 10,000 | 4,403円         |
| 10,000口当たり分配金額            | H              | 120円           | 10,000口当たり分配金額            | H              | 100円           |
| 収益分配金金額                   | I=F × H/10,000 | 23,676,825円    | 収益分配金金額                   | I=F × H/10,000 | 19,969,053円    |

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

| 第22期<br>自 2018年 1月16日<br>至 2018年 7月13日  | 第23期<br>自 2018年 7月14日<br>至 2019年 1月15日  |
|---|---|
| <p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p> | <p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p> |



## (2)金融商品の時価等に関する事項

| 第22期<br>2018年 7月13日現在  | 第23期<br>2019年 1月15日現在                                     |
|--|---|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ<br/>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法<br/>親投資信託受益証券<br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載して<br/>おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時<br/>価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお<br/>ります。</p> | <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>同左</p> <p>2. 時価の算定方法<br/>同左</p> |

## (関連当事者との取引に関する注記)

| 第22期<br>自 2018年 1月16日<br>至 2018年 7月13日  | 第23期<br>自 2018年 7月14日<br>至 2019年 1月15日 |
|---|--|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般<br>の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない<br>ため、該当事項はございません。 | 同左                                     |

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

| 第22期<br>自 2018年 1月16日<br>至 2018年 7月13日 | 第23期<br>自 2018年 7月14日<br>至 2019年 1月15日 |
|--|--|
| 期首元本額 2,046,076,940円                   | 期首元本額 1,973,068,831円                   |
| 期中追加設定元本額 11,122,487円                  | 期中追加設定元本額 111,768,465円                 |
| 期中一部解約元本額 84,130,596円                  | 期中一部解約元本額 87,931,942円                  |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第22期<br>自 2018年 1月16日<br>至 2018年 7月13日 | 第23期<br>自 2018年 7月14日<br>至 2019年 1月15日 |
|-----------|--|--|
|           | 損益に含まれた評価差額（円）                         | 損益に含まれた評価差額（円）                         |
| 親投資信託受益証券 | 213,526,196                            | 177,289,219                            |

|    |             |             |
|----|-------------|-------------|
| 合計 | 213,526,196 | 177,289,219 |
|----|-------------|-------------|

### 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

#### （４）附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式(2019年1月15日現在)

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券(2019年1月15日現在)

（単位：円）

| 種類        | 通貨  | 銘柄                            | 券面総額          | 評価額                     | 備考 |
|-----------|-----|-------------------------------|---------------|-------------------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド | 1,691,764,747 | 2,294,878,879           |    |
|           | 小計  | 銘柄数：1<br>組入時価比率：99.8%         | 1,691,764,747 | 2,294,878,879<br>100.0% |    |
| 合計        |     |                               |               | 2,294,878,879           |    |

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

##### 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### （参考）

当ファンドは「野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド」受益証券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、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

#### 野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド

##### 貸借対照表

（単位：円）

(2019年 1月15日現在)

| 資産の部     |                |
|----------|----------------|
| 流動資産     |                |
| コール・ローン  | 4,770,801,617  |
| 株式       | 12,220,231,728 |
| 派生商品評価勘定 | 2,334,168      |
| 未収入金     | 1,180,000      |
| 未収配当金    | 8,570,890      |
| 差入委託証拠金  | 6,780,000      |

(2019年 1月15日現在)

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 流動資産合計          | 17,009,898,403 |
| 資産合計            | 17,009,898,403 |
| 負債の部            |                |
| 流動負債            |                |
| 未払金             | 4,532,895,753  |
| 未払利息            | 9,184          |
| 流動負債合計          | 4,532,904,937  |
| 負債合計            | 4,532,904,937  |
| 純資産の部           |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 9,197,807,032  |
| 剰余金             |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 3,279,186,434  |
| 元本等合計           | 12,476,993,466 |
| 純資産合計           | 12,476,993,466 |
| 負債純資産合計         | 17,009,898,403 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                        |   |
|------------------------|---|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法     | 株式<br>原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。<br>先物取引<br>取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。  |
| 2. 費用・収益の計上基準          | 受取配当金<br>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。<br>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。<br>有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。<br>派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。  |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 |

(貸借対照表に関する注記)

|                            |         |
|----------------------------|---------|
| 2019年 1月15日現在              |         |
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |         |
| 1口当たり純資産額                  | 1.3565円 |

(10,000口当たり純資産額)

(13,565円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

| 自 2018年 7月14日<br>至 2019年 1月15日   |
|--|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> |

## (2)金融商品の時価等に関する事項

| 2019年 1月15日現在  |
|--|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

## (その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 1月15日現在

|                                   |                |
|-----------------------------------|----------------|
| 期首                                | 2018年 7月14日    |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額  | 4,052,513,189円 |
| 同期中における追加設定元本額                    | 5,869,262,928円 |
| 同期中における一部解約元本額                    | 723,969,085円   |
| 期末元本額                             | 9,197,807,032円 |
| 期末元本額の内訳*                         |                |
| 野村R A F I ( R ) 日本株投信             | 1,691,764,747円 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式            | 482,613,671円   |
| 野村R A F I ( R ) 日本株投信F(適格機関投資家専用) | 7,023,428,614円 |

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年1月15日現在)

(単位:円)

| 種類   | 通貨     | 銘柄              | 株式数        | 評価額      |            | 備考 |
|------|--------|-----------------|------------|----------|------------|----|
|      |        |                 |            | 単価       | 金額         |    |
| 株式   | 日本円    | 日本水産            | 5,900      | 650.00   | 3,835,000  |    |
|      |        | マルハニチロ          | 900        | 3,725.00 | 3,352,500  |    |
|      |        | サカタのタネ          | 300        | 3,525.00 | 1,057,500  |    |
|      |        | ホクト             | 800        | 1,972.00 | 1,577,600  |    |
|      |        | 日鉄鉱業            | 400        | 4,715.00 | 1,886,000  |    |
|      |        | 国際石油開発帝石        | 47,400     | 1,018.00 | 48,253,200 |    |
|      |        | 石油資源開発          | 3,700      | 2,064.00 | 7,636,800  |    |
|      |        | K & O エナジーグループ  | 1,000      | 1,447.00 | 1,447,000  |    |
|      |        | ショーボンドホールディングス  | 200        | 7,810.00 | 1,562,000  |    |
|      |        | ミライト・ホールディングス   | 1,900      | 1,518.00 | 2,884,200  |    |
|      |        | 安藤・間            | 5,700      | 737.00   | 4,200,900  |    |
|      |        | 東急建設            | 2,300      | 995.00   | 2,288,500  |    |
|      |        | コムシスホールディングス    | 1,900      | 2,828.00 | 5,373,200  |    |
|      |        | ミサワホーム          | 1,900      | 754.00   | 1,432,600  |    |
|      |        | 高松コンストラクショングループ | 700        | 2,797.00 | 1,957,900  |    |
|      |        | 東建コーポレーション      | 400        | 6,460.00 | 2,584,000  |    |
|      |        | 大成建設            | 4,700      | 4,915.00 | 23,100,500 |    |
|      |        | 大林組             | 19,000     | 1,038.00 | 19,722,000 |    |
| 清水建設 | 19,000 | 912.00          | 17,328,000 |          |            |    |

|             |        |           |            |
|-------------|--------|-----------|------------|
| 長谷工コーポレーション | 9,100  | 1,252.00  | 11,393,200 |
| 鹿島建設        | 12,700 | 1,537.00  | 19,519,900 |
| 西松建設        | 1,600  | 2,483.00  | 3,972,800  |
| 三井住友建設      | 3,500  | 694.00    | 2,429,000  |
| 大豊建設        | 200    | 3,520.00  | 704,000    |
| 前田建設工業      | 4,800  | 1,028.00  | 4,934,400  |
| 奥村組         | 1,100  | 3,330.00  | 3,663,000  |
| 東鉄工業        | 600    | 2,929.00  | 1,757,400  |
| 戸田建設        | 7,900  | 698.00    | 5,514,200  |
| 熊谷組         | 900    | 3,375.00  | 3,037,500  |
| 大東建託        | 1,600  | 14,785.00 | 23,656,000 |
| 新日本建設       | 1,600  | 1,075.00  | 1,720,000  |
| N I P P O   | 3,500  | 2,043.00  | 7,150,500  |
| 前田道路        | 2,400  | 2,153.00  | 5,167,200  |
| 日本道路        | 300    | 6,200.00  | 1,860,000  |
| 五洋建設        | 4,700  | 639.00    | 3,003,300  |
| 福田組         | 300    | 4,225.00  | 1,267,500  |
| 住友林業        | 5,200  | 1,454.00  | 7,560,800  |
| 大和ハウス工業     | 14,800 | 3,569.00  | 52,821,200 |
| ライト工業       | 1,000  | 1,439.00  | 1,439,000  |
| 積水ハウス       | 21,800 | 1,644.00  | 35,839,200 |
| ユアテック       | 2,800  | 885.00    | 2,478,000  |
| 中電工         | 1,700  | 2,342.00  | 3,981,400  |
| 関電工         | 3,800  | 1,057.00  | 4,016,600  |
| きんでん        | 4,500  | 1,789.00  | 8,050,500  |
| トーエネック      | 600    | 3,065.00  | 1,839,000  |
| 住友電設        | 900    | 1,747.00  | 1,572,300  |
| 日本電設工業      | 1,200  | 2,238.00  | 2,685,600  |
| 協和エクシオ      | 1,700  | 2,670.00  | 4,539,000  |
| 九電工         | 1,100  | 3,835.00  | 4,218,500  |
| 三機工業        | 1,300  | 1,164.00  | 1,513,200  |
| 日揮          | 4,700  | 1,680.00  | 7,896,000  |
| 太平電業        | 300    | 2,388.00  | 716,400    |
| 高砂熱学工業      | 1,400  | 1,798.00  | 2,517,200  |
| 大気社         | 700    | 2,995.00  | 2,096,500  |
| 日比谷総合設備     | 700    | 1,847.00  | 1,292,900  |

|                          |        |          |            |
|--------------------------|--------|----------|------------|
| 東芝プラントシステム               | 1,700  | 2,076.00 | 3,529,200  |
| 新興プランテック                 | 1,000  | 1,154.00 | 1,154,000  |
| 日本製粉                     | 1,700  | 1,910.00 | 3,247,000  |
| 日清製粉グループ本社               | 3,700  | 2,242.00 | 8,295,400  |
| 昭和産業                     | 700    | 2,957.00 | 2,069,900  |
| 三井製糖                     | 800    | 2,923.00 | 2,338,400  |
| 森永製菓                     | 500    | 4,705.00 | 2,352,500  |
| 江崎グリコ                    | 900    | 5,290.00 | 4,761,000  |
| 山崎製パン                    | 3,600  | 2,165.00 | 7,794,000  |
| 亀田製菓                     | 200    | 4,900.00 | 980,000    |
| カルビー                     | 1,400  | 3,415.00 | 4,781,000  |
| 森永乳業                     | 1,200  | 3,195.00 | 3,834,000  |
| ヤクルト本社                   | 1,300  | 7,280.00 | 9,464,000  |
| 明治ホールディングス               | 1,800  | 8,810.00 | 15,858,000 |
| 雪印メグミルク                  | 1,300  | 2,889.00 | 3,755,700  |
| プリマハム                    | 1,100  | 2,042.00 | 2,246,200  |
| 日本ハム                     | 2,400  | 4,480.00 | 10,752,000 |
| 丸大食品                     | 800    | 1,810.00 | 1,448,000  |
| S F o o d s              | 400    | 3,900.00 | 1,560,000  |
| 伊藤ハム米久ホールディングス           | 5,800  | 668.00   | 3,874,400  |
| サッポロホールディングス             | 1,800  | 2,430.00 | 4,374,000  |
| アサヒグループホールディングス          | 7,400  | 4,272.00 | 31,612,800 |
| キリンホールディングス              | 15,100 | 2,427.50 | 36,655,250 |
| 宝ホールディングス                | 2,300  | 1,365.00 | 3,139,500  |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパン<br>ホールデ | 3,000  | 3,075.00 | 9,225,000  |
| サントリー食品インターナショナル         | 4,800  | 4,775.00 | 22,920,000 |
| ダイドーグループホールディングス         | 300    | 5,720.00 | 1,716,000  |
| 伊藤園                      | 1,000  | 4,740.00 | 4,740,000  |
| 日清オイリオグループ               | 800    | 3,150.00 | 2,520,000  |
| 不二製油グループ本社               | 1,100  | 3,405.00 | 3,745,500  |
| J - オイルミルズ               | 400    | 3,885.00 | 1,554,000  |
| キッコーマン                   | 1,200  | 5,700.00 | 6,840,000  |
| 味の素                      | 10,700 | 1,855.50 | 19,853,850 |
| キューピー                    | 2,500  | 2,483.00 | 6,207,500  |
| ハウス食品グループ本社              | 1,200  | 3,780.00 | 4,536,000  |

|                |        |          |             |
|----------------|--------|----------|-------------|
| カゴメ            | 800    | 2,864.00 | 2,291,200   |
| アリアケジャパン       | 200    | 6,970.00 | 1,394,000   |
| ニチレイ           | 1,700  | 2,965.00 | 5,040,500   |
| 東洋水産           | 1,800  | 3,885.00 | 6,993,000   |
| 日清食品ホールディングス   | 1,400  | 6,670.00 | 9,338,000   |
| フジッコ           | 400    | 2,346.00 | 938,400     |
| 日本たばこ産業        | 56,300 | 2,688.00 | 151,334,400 |
| わらべや日洋ホールディングス | 600    | 1,807.00 | 1,084,200   |
| 理研ビタミン         | 300    | 3,540.00 | 1,062,000   |
| グンゼ            | 400    | 4,520.00 | 1,808,000   |
| 東洋紡            | 2,800  | 1,559.00 | 4,365,200   |
| 倉敷紡績           | 700    | 2,468.00 | 1,727,600   |
| 日本毛織           | 2,200  | 874.00   | 1,922,800   |
| 帝人             | 6,000  | 1,844.00 | 11,064,000  |
| 東レ             | 38,200 | 793.50   | 30,311,700  |
| セーレン           | 1,200  | 1,726.00 | 2,071,200   |
| ワコールホールディングス   | 1,700  | 2,842.00 | 4,831,400   |
| ホギメディカル        | 600    | 3,230.00 | 1,938,000   |
| T S Iホールディングス  | 2,500  | 720.00   | 1,800,000   |
| オンワードホールディングス  | 5,400  | 623.00   | 3,364,200   |
| デサント           | 1,000  | 1,830.00 | 1,830,000   |
| 特種東海製紙         | 300    | 4,030.00 | 1,209,000   |
| 王子ホールディングス     | 28,200 | 601.00   | 16,948,200  |
| 日本製紙           | 4,600  | 2,131.00 | 9,802,600   |
| 三菱製紙           | 2,400  | 597.00   | 1,432,800   |
| 北越コーポレーション     | 7,500  | 546.00   | 4,095,000   |
| 大王製紙           | 3,700  | 1,326.00 | 4,906,200   |
| レンゴー           | 6,200  | 898.00   | 5,567,600   |
| トーモク           | 800    | 1,702.00 | 1,361,600   |
| ザ・バック          | 300    | 2,985.00 | 895,500     |
| クラレ            | 9,500  | 1,640.00 | 15,580,000  |
| 旭化成            | 35,400 | 1,135.00 | 40,179,000  |
| 昭和電工           | 2,200  | 3,735.00 | 8,217,000   |
| 住友化学           | 57,000 | 567.00   | 32,319,000  |
| 住友精化           | 400    | 4,320.00 | 1,728,000   |
| 日産化学           | 1,100  | 5,820.00 | 6,402,000   |



|                |        |          |            |
|----------------|--------|----------|------------|
| クレハ            | 400    | 6,570.00 | 2,628,000  |
| 石原産業           | 1,600  | 1,132.00 | 1,811,200  |
| 日本曹達           | 1,100  | 2,830.00 | 3,113,000  |
| 東ソー            | 11,400 | 1,467.00 | 16,723,800 |
| トクヤマ           | 1,100  | 2,544.00 | 2,798,400  |
| セントラル硝子        | 1,500  | 2,219.00 | 3,328,500  |
| 東亜合成           | 3,300  | 1,266.00 | 4,177,800  |
| 大阪ソーダ          | 400    | 2,501.00 | 1,000,400  |
| デンカ            | 2,200  | 3,360.00 | 7,392,000  |
| 信越化学工業         | 7,000  | 8,797.00 | 61,579,000 |
| 堺化学工業          | 500    | 2,193.00 | 1,096,500  |
| エア・ウォーター       | 4,800  | 1,740.00 | 8,352,000  |
| 大陽日酸           | 6,400  | 1,751.00 | 11,206,400 |
| 日本パーカライジング     | 2,700  | 1,302.00 | 3,515,400  |
| 高圧ガス工業         | 1,400  | 785.00   | 1,099,000  |
| 四国化成工業         | 1,500  | 1,087.00 | 1,630,500  |
| 日本触媒           | 1,000  | 7,210.00 | 7,210,000  |
| 大日精化工業         | 700    | 2,822.00 | 1,975,400  |
| カネカ            | 1,900  | 4,185.00 | 7,951,500  |
| 三菱瓦斯化学         | 7,600  | 1,718.00 | 13,056,800 |
| 三井化学           | 5,100  | 2,634.00 | 13,433,400 |
| J S R          | 6,600  | 1,674.00 | 11,048,400 |
| 東京応化工業         | 1,000  | 3,085.00 | 3,085,000  |
| 三菱ケミカルホールディングス | 49,500 | 886.30   | 43,871,850 |
| K Hネオケム        | 1,100  | 2,529.00 | 2,781,900  |
| ダイセル           | 10,600 | 1,126.00 | 11,935,600 |
| 住友ベークライト       | 900    | 4,015.00 | 3,613,500  |
| 積水化学工業         | 11,700 | 1,566.00 | 18,322,200 |
| 日本ゼオン          | 6,400  | 1,086.00 | 6,950,400  |
| アイカ工業          | 1,000  | 3,655.00 | 3,655,000  |
| 宇部興産           | 3,900  | 2,288.00 | 8,923,200  |
| 積水樹脂           | 1,100  | 1,998.00 | 2,197,800  |
| タキロンシーアイ       | 2,600  | 574.00   | 1,492,400  |
| 日立化成           | 7,000  | 1,689.00 | 11,823,000 |
| 積水化成品工業        | 1,400  | 943.00   | 1,320,200  |
| ダイキョーニシカワ      | 2,400  | 1,149.00 | 2,757,600  |

|                    |        |           |            |
|--------------------|--------|-----------|------------|
| 森六ホールディングス         | 600    | 2,580.00  | 1,548,000  |
| 日本化薬               | 4,100  | 1,409.00  | 5,776,900  |
| 扶桑化学工業             | 600    | 2,056.00  | 1,233,600  |
| A D E K A          | 2,600  | 1,744.00  | 4,534,400  |
| 日油                 | 1,200  | 3,690.00  | 4,428,000  |
| 花王                 | 5,100  | 7,466.00  | 38,076,600 |
| 三洋化成工業             | 600    | 5,170.00  | 3,102,000  |
| 日本ペイントホールディングス     | 4,500  | 3,560.00  | 16,020,000 |
| 関西ペイント             | 3,700  | 1,914.00  | 7,081,800  |
| 中国塗料               | 1,700  | 930.00    | 1,581,000  |
| 太陽ホールディングス         | 700    | 3,190.00  | 2,233,000  |
| エスケー化研             | 100    | 49,000.00 | 4,900,000  |
| D I C              | 3,000  | 3,425.00  | 10,275,000 |
| サカタインクス            | 1,800  | 1,226.00  | 2,206,800  |
| 東洋インキ S C ホールディングス | 2,000  | 2,474.00  | 4,948,000  |
| 富士フイルムホールディングス     | 10,700 | 4,565.00  | 48,845,500 |
| 資生堂                | 2,000  | 6,231.00  | 12,462,000 |
| ライオン               | 2,200  | 2,094.00  | 4,606,800  |
| 高砂香料工業             | 500    | 3,470.00  | 1,735,000  |
| マンダム               | 600    | 2,934.00  | 1,760,400  |
| ファンケル              | 800    | 2,257.00  | 1,805,600  |
| コーセー               | 300    | 15,310.00 | 4,593,000  |
| ポーラ・オルビスホールディングス   | 2,300  | 2,886.00  | 6,637,800  |
| ノエビアホールディングス       | 400    | 4,340.00  | 1,736,000  |
| コニシ                | 800    | 1,622.00  | 1,297,600  |
| 長谷川香料              | 1,000  | 1,589.00  | 1,589,000  |
| 上村工業               | 200    | 6,560.00  | 1,312,000  |
| 小林製薬               | 600    | 6,950.00  | 4,170,000  |
| デクセリアルズ            | 2,300  | 840.00    | 1,932,000  |
| アース製薬              | 300    | 5,030.00  | 1,509,000  |
| クミアイ化学工業           | 2,000  | 674.00    | 1,348,000  |
| 日本農薬               | 700    | 502.00    | 351,400    |
| 日東電工               | 4,300  | 5,735.00  | 24,660,500 |
| 藤森工業               | 400    | 2,895.00  | 1,158,000  |
| 未来工業               | 300    | 3,025.00  | 907,500    |
| J S P              | 900    | 2,166.00  | 1,949,400  |

|                 |        |           |            |
|-----------------|--------|-----------|------------|
| エフピコ            | 500    | 6,250.00  | 3,125,000  |
| 天馬              | 800    | 1,744.00  | 1,395,200  |
| 信越ポリマー          | 2,000  | 706.00    | 1,412,000  |
| ニフコ             | 2,200  | 2,547.00  | 5,603,400  |
| ユニ・チャーム         | 4,400  | 3,248.00  | 14,291,200 |
| 協和発酵キリン         | 6,700  | 2,104.00  | 14,096,800 |
| 武田薬品工業          | 17,900 | 4,369.00  | 78,205,100 |
| アステラス製薬         | 38,700 | 1,543.00  | 59,714,100 |
| 大日本住友製薬         | 2,900  | 3,730.00  | 10,817,000 |
| 塩野義製薬           | 3,400  | 6,373.00  | 21,668,200 |
| 田辺三菱製薬          | 14,700 | 1,618.00  | 23,784,600 |
| 日本新薬            | 400    | 6,310.00  | 2,524,000  |
| 中外製薬            | 3,400  | 6,540.00  | 22,236,000 |
| 科研製薬            | 900    | 5,270.00  | 4,743,000  |
| エーザイ            | 3,200  | 8,560.00  | 27,392,000 |
| ロート製薬           | 1,100  | 2,861.00  | 3,147,100  |
| 小野薬品工業          | 6,700  | 2,266.50  | 15,185,550 |
| 久光製薬            | 1,300  | 5,290.00  | 6,877,000  |
| 持田製薬            | 300    | 9,730.00  | 2,919,000  |
| 参天製薬            | 6,400  | 1,480.00  | 9,472,000  |
| ツムラ             | 1,600  | 3,095.00  | 4,952,000  |
| 日医工             | 1,400  | 1,681.00  | 2,353,400  |
| キッセイ薬品工業        | 1,100  | 2,831.00  | 3,114,100  |
| 生化学工業           | 1,200  | 1,316.00  | 1,579,200  |
| 鳥居薬品            | 600    | 2,522.00  | 1,513,200  |
| 東和薬品            | 200    | 7,930.00  | 1,586,000  |
| 沢井製薬            | 900    | 5,540.00  | 4,986,000  |
| ゼリア新薬工業         | 800    | 1,932.00  | 1,545,600  |
| 第一三共            | 11,100 | 3,618.00  | 40,159,800 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 1,800  | 2,263.00  | 4,073,400  |
| 大塚ホールディングス      | 11,100 | 4,356.00  | 48,351,600 |
| 大正製薬ホールディングス    | 1,100  | 11,300.00 | 12,430,000 |
| 日本コークス工業        | 12,900 | 96.00     | 1,238,400  |
| 昭和シェル石油         | 7,100  | 1,639.00  | 11,636,900 |
| 富士石油            | 3,800  | 305.00    | 1,159,000  |
| 出光興産            | 4,600  | 3,845.00  | 17,687,000 |

|                    |        |          |            |
|--------------------|--------|----------|------------|
| J X T Gホールディングス    | 98,100 | 605.50   | 59,399,550 |
| コスモエネルギーホールディングス   | 2,800  | 2,510.00 | 7,028,000  |
| 横浜ゴム               | 5,200  | 2,258.00 | 11,741,600 |
| TOYO TIRE          | 3,800  | 1,420.00 | 5,396,000  |
| ブリヂストン             | 21,500 | 4,329.00 | 93,073,500 |
| 住友ゴム工業             | 12,400 | 1,373.00 | 17,025,200 |
| オカモト               | 200    | 5,830.00 | 1,166,000  |
| 西川ゴム工業             | 400    | 1,950.00 | 780,000    |
| ニッタ                | 600    | 3,495.00 | 2,097,000  |
| 住友理工               | 3,300  | 999.00   | 3,296,700  |
| 三ツ星ベルト             | 800    | 2,102.00 | 1,681,600  |
| バンドー化学             | 1,400  | 1,098.00 | 1,537,200  |
| 日東紡績               | 1,200  | 1,844.00 | 2,212,800  |
| A G C              | 8,000  | 3,540.00 | 28,320,000 |
| 日本電気硝子             | 3,400  | 2,837.00 | 9,645,800  |
| 住友大阪セメント           | 1,200  | 4,605.00 | 5,526,000  |
| 太平洋セメント            | 3,800  | 3,520.00 | 13,376,000 |
| 東海カーボン             | 1,500  | 1,499.00 | 2,248,500  |
| ノリタケカンパニーリミテド      | 300    | 4,930.00 | 1,479,000  |
| T O T O            | 2,700  | 4,015.00 | 10,840,500 |
| 日本碍子               | 8,600  | 1,572.00 | 13,519,200 |
| 日本特殊陶業             | 5,300  | 2,150.00 | 11,395,000 |
| フジインコーポレーテッド       | 500    | 2,216.00 | 1,108,000  |
| ニチアス               | 1,700  | 1,914.00 | 3,253,800  |
| ニチハ                | 800    | 2,659.00 | 2,127,200  |
| 新日鐵住金              | 42,452 | 1,960.00 | 83,205,920 |
| 神戸製鋼所              | 7,700  | 822.00   | 6,329,400  |
| 合同製鐵               | 700    | 1,650.00 | 1,155,000  |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 24,000 | 1,861.50 | 44,676,000 |
| 東京製鐵               | 3,300  | 903.00   | 2,979,900  |
| 共英製鋼               | 1,200  | 1,783.00 | 2,139,600  |
| 大和工業               | 1,900  | 2,747.00 | 5,219,300  |
| 大阪製鐵               | 1,100  | 1,819.00 | 2,000,900  |
| 淀川製鋼所              | 1,000  | 2,199.00 | 2,199,000  |
| 丸一鋼管               | 1,800  | 3,435.00 | 6,183,000  |

|                  |        |          |            |
|------------------|--------|----------|------------|
| 大同特殊鋼            | 1,300  | 4,465.00 | 5,804,500  |
| 山陽特殊製鋼           | 1,100  | 2,272.00 | 2,499,200  |
| 愛知製鋼             | 800    | 3,515.00 | 2,812,000  |
| 日立金属             | 14,100 | 1,209.00 | 17,046,900 |
| 新日本電工            | 5,300  | 221.00   | 1,171,300  |
| 三菱製鋼             | 700    | 1,644.00 | 1,150,800  |
| 日本軽金属ホールディングス    | 22,000 | 228.00   | 5,016,000  |
| 三井金属鉱業           | 1,900  | 2,399.00 | 4,558,100  |
| 東邦亜鉛             | 200    | 3,465.00 | 693,000    |
| 三菱マテリアル          | 5,800  | 3,040.00 | 17,632,000 |
| 住友金属鉱山           | 7,200  | 3,079.00 | 22,168,800 |
| DOWAホールディングス     | 2,100  | 3,385.00 | 7,108,500  |
| 古河機械金属           | 1,500  | 1,295.00 | 1,942,500  |
| UACJ             | 1,800  | 2,289.00 | 4,120,200  |
| 古河電気工業           | 1,900  | 3,010.00 | 5,719,000  |
| 住友電気工業           | 26,000 | 1,504.00 | 39,104,000 |
| フジクラ             | 11,500 | 456.00   | 5,244,000  |
| リョービ             | 1,000  | 2,764.00 | 2,764,000  |
| アーレスティ           | 2,700  | 642.00   | 1,733,400  |
| アサヒホールディングス      | 700    | 2,371.00 | 1,659,700  |
| SUMCO            | 4,300  | 1,300.00 | 5,590,000  |
| 東洋製罐グループホールディングス | 3,400  | 2,620.00 | 8,908,000  |
| ホッカンホールディングス     | 700    | 1,747.00 | 1,222,900  |
| コロナ              | 1,000  | 1,063.00 | 1,063,000  |
| 横河ブリッジホールディングス   | 800    | 1,681.00 | 1,344,800  |
| 三和ホールディングス       | 4,200  | 1,208.00 | 5,073,600  |
| 文化シャッター          | 2,500  | 728.00   | 1,820,000  |
| 三協立山             | 1,600  | 1,410.00 | 2,256,000  |
| LIXILグループ        | 13,200 | 1,431.00 | 18,889,200 |
| ノーリツ             | 1,400  | 1,590.00 | 2,226,000  |
| 長府製作所            | 800    | 2,115.00 | 1,692,000  |
| リンナイ             | 1,000  | 6,940.00 | 6,940,000  |
| 岡部               | 1,600  | 894.00   | 1,430,400  |
| ジーテクト            | 2,200  | 1,514.00 | 3,330,800  |
| 東プレ              | 1,600  | 2,303.00 | 3,684,800  |
| 高周波熱錬            | 1,300  | 851.00   | 1,106,300  |

|                   |        |           |            |
|-------------------|--------|-----------|------------|
| パイオラックス           | 800    | 2,305.00  | 1,844,000  |
| エイチワン             | 1,800  | 1,034.00  | 1,861,200  |
| 日本発條              | 8,400  | 1,004.00  | 8,433,600  |
| 三益半導体工業           | 800    | 1,279.00  | 1,023,200  |
| 日本製鋼所             | 1,200  | 1,936.00  | 2,323,200  |
| 三浦工業              | 1,000  | 2,646.00  | 2,646,000  |
| タクマ               | 1,500  | 1,374.00  | 2,061,000  |
| オークマ              | 700    | 5,360.00  | 3,752,000  |
| 東芝機械              | 700    | 2,124.00  | 1,486,800  |
| アマダホールディングス       | 10,200 | 1,044.00  | 10,648,800 |
| アイダエンジニアリング       | 2,600  | 753.00    | 1,957,800  |
| F U J I           | 2,500  | 1,358.00  | 3,395,000  |
| 牧野フライス製作所         | 700    | 4,145.00  | 2,901,500  |
| オーエスジー            | 1,900  | 2,024.00  | 3,845,600  |
| 旭ダイヤモンド工業         | 2,300  | 636.00    | 1,462,800  |
| D M G 森精機         | 2,600  | 1,347.00  | 3,502,200  |
| ソディック             | 1,700  | 772.00    | 1,312,400  |
| ディスコ              | 500    | 13,740.00 | 6,870,000  |
| 日東工器              | 500    | 2,155.00  | 1,077,500  |
| 島精機製作所            | 400    | 3,430.00  | 1,372,000  |
| やまびこ              | 1,200  | 1,078.00  | 1,293,600  |
| ニューフレアテクノロジー      | 400    | 5,200.00  | 2,080,000  |
| ナブテスコ             | 2,200  | 2,668.00  | 5,869,600  |
| 三井海洋開発            | 1,200  | 2,473.00  | 2,967,600  |
| S M C             | 800    | 36,530.00 | 29,224,000 |
| ユニオンツール           | 200    | 3,045.00  | 609,000    |
| オイレス工業            | 800    | 1,787.00  | 1,429,600  |
| サトーホールディングス       | 600    | 2,611.00  | 1,566,600  |
| 小松製作所             | 22,000 | 2,693.50  | 59,257,000 |
| 住友重機械工業           | 3,100  | 3,520.00  | 10,912,000 |
| 日立建機              | 5,200  | 2,622.00  | 13,634,400 |
| 井関農機              | 500    | 1,615.00  | 807,500    |
| ハーモニック・ドライブ・システムズ | 700    | 3,010.00  | 2,107,000  |
| クボタ               | 25,300 | 1,653.50  | 41,833,550 |
| 月島機械              | 800    | 1,427.00  | 1,141,600  |

|                  |        |           |            |
|------------------|--------|-----------|------------|
| 新東工業             | 1,600  | 939.00    | 1,502,400  |
| アイチ コーポレーション     | 2,400  | 595.00    | 1,428,000  |
| 小森コーポレーション       | 2,200  | 1,149.00  | 2,527,800  |
| 荏原製作所            | 2,400  | 2,765.00  | 6,636,000  |
| ダイキン工業           | 3,400  | 12,395.00 | 42,143,000 |
| 栗田工業             | 2,300  | 2,650.00  | 6,095,000  |
| 椿本チエイン           | 1,200  | 3,795.00  | 4,554,000  |
| ダイフク             | 900    | 5,020.00  | 4,518,000  |
| 加藤製作所            | 500    | 2,674.00  | 1,337,000  |
| タダノ              | 3,800  | 1,159.00  | 4,404,200  |
| フジテック            | 2,400  | 1,181.00  | 2,834,400  |
| C K D            | 2,000  | 1,005.00  | 2,010,000  |
| 平和               | 3,400  | 2,250.00  | 7,650,000  |
| 理想科学工業           | 1,000  | 1,662.00  | 1,662,000  |
| S A N K Y O      | 2,100  | 4,095.00  | 8,599,500  |
| マースグループホールディングス  | 500    | 2,225.00  | 1,112,500  |
| ユニバーサルエンターテインメント | 900    | 3,410.00  | 3,069,000  |
| 竹内製作所            | 900    | 1,943.00  | 1,748,700  |
| アマノ              | 1,400  | 2,204.00  | 3,085,600  |
| サンデンホールディングス     | 1,600  | 824.00    | 1,318,400  |
| マックス             | 1,200  | 1,470.00  | 1,764,000  |
| グローリー            | 1,700  | 2,607.00  | 4,431,900  |
| 大和冷機工業           | 1,100  | 1,111.00  | 1,222,100  |
| セガサミーホールディングス    | 5,600  | 1,549.00  | 8,674,400  |
| リケン              | 300    | 4,725.00  | 1,417,500  |
| T P R            | 1,500  | 2,318.00  | 3,477,000  |
| ツバキ・ナカシマ         | 1,000  | 1,671.00  | 1,671,000  |
| ホシザキ             | 300    | 8,000.00  | 2,400,000  |
| 大豊工業             | 1,600  | 989.00    | 1,582,400  |
| 日本精工             | 17,900 | 1,018.00  | 18,222,200 |
| N T N            | 19,300 | 345.00    | 6,658,500  |
| ジェイテクト           | 12,600 | 1,329.00  | 16,745,400 |
| 不二越              | 700    | 4,235.00  | 2,964,500  |
| T H K            | 3,100  | 2,239.00  | 6,940,900  |
| イーグル工業           | 2,100  | 1,269.00  | 2,664,900  |
| キッツ              | 2,100  | 901.00    | 1,892,100  |

|                   |        |           |            |
|-------------------|--------|-----------|------------|
| マキタ               | 3,600  | 3,975.00  | 14,310,000 |
| 日立造船              | 5,900  | 370.00    | 2,183,000  |
| 三菱重工業             | 11,300 | 4,141.00  | 46,793,300 |
| I H I             | 2,900  | 3,240.00  | 9,396,000  |
| スター精密             | 900    | 1,566.00  | 1,409,400  |
| 日清紡ホールディングス       | 6,600  | 898.00    | 5,926,800  |
| イビデン              | 3,800  | 1,529.00  | 5,810,200  |
| コニカミノルタ           | 13,900 | 1,052.00  | 14,622,800 |
| ブラザー工業            | 7,400  | 1,763.00  | 13,046,200 |
| ミネベアミツミ           | 7,000  | 1,668.00  | 11,676,000 |
| 日立製作所             | 27,600 | 3,583.00  | 98,890,800 |
| 三菱電機              | 56,200 | 1,286.00  | 72,273,200 |
| 富士電機              | 3,100  | 3,280.00  | 10,168,000 |
| 安川電機              | 2,600  | 2,866.00  | 7,451,600  |
| 明電舎               | 1,800  | 1,402.00  | 2,523,600  |
| 山洋電気              | 400    | 3,855.00  | 1,542,000  |
| 東芝テック             | 900    | 2,566.00  | 2,309,400  |
| マブチモーター           | 1,900  | 3,510.00  | 6,669,000  |
| 日本電産              | 2,300  | 12,240.00 | 28,152,000 |
| ダイヘン              | 800    | 2,355.00  | 1,884,000  |
| J V C ケンウッド       | 5,000  | 248.00    | 1,240,000  |
| 日新電機              | 3,200  | 867.00    | 2,774,400  |
| オムロン              | 4,100  | 4,160.00  | 17,056,000 |
| 日東工業              | 1,200  | 1,936.00  | 2,323,200  |
| I D E C           | 500    | 1,963.00  | 981,500    |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 2,000  | 2,336.00  | 4,672,000  |
| メルコホールディングス       | 200    | 3,440.00  | 688,000    |
| 日本電気              | 5,600  | 3,500.00  | 19,600,000 |
| 富士通               | 5,000  | 6,875.00  | 34,375,000 |
| 沖電気工業             | 3,400  | 1,382.00  | 4,698,800  |
| サンケン電気            | 600    | 2,075.00  | 1,245,000  |
| ルネサスエレクトロニクス      | 33,700 | 582.00    | 19,613,400 |
| セイコーエプソン          | 12,700 | 1,636.00  | 20,777,200 |
| ワコム               | 2,800  | 452.00    | 1,265,600  |
| アルバック             | 1,000  | 3,405.00  | 3,405,000  |



|                     |        |           |            |
|---------------------|--------|-----------|------------|
| E I Z O             | 400    | 3,990.00  | 1,596,000  |
| ジャパンディスプレイ          | 78,500 | 75.00     | 5,887,500  |
| 日本信号                | 1,800  | 915.00    | 1,647,000  |
| 能美防災                | 1,000  | 1,857.00  | 1,857,000  |
| エレコム                | 500    | 2,864.00  | 1,432,000  |
| パナソニック              | 63,500 | 1,042.50  | 66,198,750 |
| シャープ                | 4,800  | 1,166.00  | 5,596,800  |
| アンリツ                | 1,500  | 1,592.00  | 2,388,000  |
| 富士通ゼネラル             | 2,500  | 1,502.00  | 3,755,000  |
| ソニー                 | 15,400 | 5,447.00  | 83,883,800 |
| T D K               | 2,900  | 7,800.00  | 22,620,000 |
| アルプスアルパイン           | 4,376  | 2,168.00  | 9,487,168  |
| フォスター電機             | 1,200  | 1,390.00  | 1,668,000  |
| クラリオン               | 400    | 2,490.00  | 996,000    |
| ヒロセ電機               | 700    | 11,260.00 | 7,882,000  |
| 日本航空電子工業            | 3,200  | 1,313.00  | 4,201,600  |
| マクセルホールディングス        | 1,800  | 1,500.00  | 2,700,000  |
| 横河電機                | 3,700  | 1,984.00  | 7,340,800  |
| 新電元工業               | 400    | 4,090.00  | 1,636,000  |
| アズビル                | 2,100  | 2,245.00  | 4,714,500  |
| 日本光電工業              | 900    | 3,430.00  | 3,087,000  |
| 堀場製作所               | 800    | 4,800.00  | 3,840,000  |
| アドバンテスト             | 1,200  | 2,379.00  | 2,854,800  |
| キーエンス               | 600    | 54,860.00 | 32,916,000 |
| シスメックス              | 1,700  | 5,784.00  | 9,832,800  |
| O B A R A G R O U P | 400    | 3,890.00  | 1,556,000  |
| イリソ電子工業             | 300    | 4,310.00  | 1,293,000  |
| スタンレー電気             | 3,200  | 3,065.00  | 9,808,000  |
| ウシオ電機               | 3,400  | 1,208.00  | 4,107,200  |
| カシオ計算機              | 6,200  | 1,365.00  | 8,463,000  |
| ファナック               | 3,300  | 18,000.00 | 59,400,000 |
| フクダ電子               | 400    | 7,070.00  | 2,828,000  |
| エンプラス               | 500    | 2,988.00  | 1,494,000  |
| ローム                 | 2,200  | 7,250.00  | 15,950,000 |
| 浜松ホトニクス             | 1,500  | 3,605.00  | 5,407,500  |
| 新光電気工業              | 5,500  | 675.00    | 3,712,500  |

|                     |         |           |             |
|---------------------|---------|-----------|-------------|
| 京セラ                 | 8,000   | 5,876.00  | 47,008,000  |
| 太陽誘電                | 2,700   | 1,616.00  | 4,363,200   |
| 村田製作所               | 3,500   | 14,090.00 | 49,315,000  |
| 双葉電子工業              | 900     | 1,659.00  | 1,493,100   |
| ニチコン                | 1,700   | 871.00    | 1,480,700   |
| K O A               | 900     | 1,359.00  | 1,223,100   |
| 小糸製作所               | 2,300   | 5,800.00  | 13,340,000  |
| ミツバ                 | 3,200   | 672.00    | 2,150,400   |
| S C R E E Nホールディングス | 900     | 5,110.00  | 4,599,000   |
| キヤノン電子              | 1,300   | 1,923.00  | 2,499,900   |
| キヤノン                | 40,300  | 3,042.00  | 122,592,600 |
| リコー                 | 20,000  | 1,082.00  | 21,640,000  |
| 象印マホービン             | 1,500   | 1,053.00  | 1,579,500   |
| 東京エレクトロン            | 2,200   | 13,960.00 | 30,712,000  |
| トヨタ紡織               | 5,600   | 1,726.00  | 9,665,600   |
| ユニプレス               | 2,200   | 1,875.00  | 4,125,000   |
| 豊田自動織機              | 9,900   | 5,360.00  | 53,064,000  |
| モリタホールディングス         | 800     | 1,845.00  | 1,476,000   |
| 三櫻工業                | 1,300   | 658.00    | 855,400     |
| デンソー                | 20,700  | 5,142.00  | 106,439,400 |
| 東海理化電機製作所           | 3,000   | 1,913.00  | 5,739,000   |
| 三井E & Sホールディングス     | 3,500   | 1,175.00  | 4,112,500   |
| 川崎重工業               | 6,600   | 2,563.00  | 16,915,800  |
| 名村造船所               | 2,400   | 471.00    | 1,130,400   |
| 三菱ロジスネクスト           | 1,900   | 1,117.00  | 2,122,300   |
| 日産自動車               | 210,400 | 903.70    | 190,138,480 |
| いすゞ自動車              | 20,000  | 1,658.00  | 33,160,000  |
| トヨタ自動車              | 104,600 | 6,892.00  | 720,903,200 |
| 日野自動車               | 19,800  | 1,091.00  | 21,601,800  |
| 三菱自動車工業             | 33,300  | 644.00    | 21,445,200  |
| 武蔵精密工業              | 1,800   | 1,556.00  | 2,800,800   |
| 日産車体                | 3,400   | 978.00    | 3,325,200   |
| 新明和工業               | 1,900   | 1,342.00  | 2,549,800   |
| 極東開発工業              | 1,300   | 1,477.00  | 1,920,100   |
| 日信工業                | 2,600   | 1,456.00  | 3,785,600   |
| トピー工業               | 900     | 2,368.00  | 2,131,200   |

|                |        |           |             |
|----------------|--------|-----------|-------------|
| 曙ブレーキ工業        | 5,500  | 203.00    | 1,116,500   |
| タチエス           | 1,100  | 1,500.00  | 1,650,000   |
| NOK            | 7,900  | 1,601.00  | 12,647,900  |
| フタバ産業          | 3,800  | 563.00    | 2,139,400   |
| KYB            | 1,500  | 2,875.00  | 4,312,500   |
| 大同メタル工業        | 1,900  | 803.00    | 1,525,700   |
| プレス工業          | 4,100  | 553.00    | 2,267,300   |
| 太平洋工業          | 1,500  | 1,522.00  | 2,283,000   |
| ケーヒン           | 2,500  | 1,903.00  | 4,757,500   |
| 河西工業           | 2,800  | 851.00    | 2,382,800   |
| アイシン精機         | 10,900 | 4,110.00  | 44,799,000  |
| マツダ            | 29,400 | 1,167.00  | 34,309,800  |
| 今仙電機製作所        | 700    | 1,023.00  | 716,100     |
| 本田技研工業         | 67,900 | 3,219.00  | 218,570,100 |
| スズキ            | 8,000  | 5,630.00  | 45,040,000  |
| SUBARU         | 34,500 | 2,446.50  | 84,404,250  |
| ヤマハ発動機         | 9,200  | 2,229.00  | 20,506,800  |
| ショーワ           | 1,900  | 1,341.00  | 2,547,900   |
| エクセディ          | 1,900  | 2,621.00  | 4,979,900   |
| ハイレックスコーポレーション | 1,600  | 2,176.00  | 3,481,600   |
| 豊田合成           | 4,100  | 2,366.00  | 9,700,600   |
| 愛三工業           | 3,200  | 750.00    | 2,400,000   |
| 日本精機           | 2,000  | 1,847.00  | 3,694,000   |
| ヨロズ            | 1,400  | 1,413.00  | 1,978,200   |
| エフ・シー・シー       | 1,200  | 2,708.00  | 3,249,600   |
| シマノ            | 900    | 15,590.00 | 14,031,000  |
| テイ・エス テック      | 2,300  | 3,120.00  | 7,176,000   |
| テルモ            | 2,900  | 6,104.00  | 17,701,600  |
| 日機装            | 1,700  | 984.00    | 1,672,800   |
| 島津製作所          | 2,900  | 2,355.00  | 6,829,500   |
| ナカニシ           | 900    | 1,815.00  | 1,633,500   |
| 東京精密           | 900    | 2,859.00  | 2,573,100   |
| ニコン            | 9,000  | 1,661.00  | 14,949,000  |
| トプコン           | 1,400  | 1,513.00  | 2,118,200   |
| オリンパス          | 2,800  | 4,705.00  | 13,174,000  |
| タムロン           | 900    | 1,645.00  | 1,480,500   |

|                   |         |           |            |
|-------------------|---------|-----------|------------|
| HOYA              | 4,300   | 6,292.00  | 27,055,600 |
| 朝日インテック           | 300     | 4,640.00  | 1,392,000  |
| シチズン時計            | 11,500  | 572.00    | 6,578,000  |
| セイコーホールディングス      | 1,400   | 2,290.00  | 3,206,000  |
| ニプロ               | 4,000   | 1,400.00  | 5,600,000  |
| パラマウントベッドホールディングス | 500     | 4,485.00  | 2,242,500  |
| バンダイナムコホールディングス   | 2,800   | 4,650.00  | 13,020,000 |
| パイロットコーポレーション     | 400     | 5,170.00  | 2,068,000  |
| トッパン・フォームズ        | 3,900   | 914.00    | 3,564,600  |
| フジシールインターナショナル    | 500     | 3,775.00  | 1,887,500  |
| タカラトミー            | 1,300   | 1,114.00  | 1,448,200  |
| 凸版印刷              | 11,600  | 1,734.00  | 20,114,400 |
| 大日本印刷             | 8,500   | 2,477.00  | 21,054,500 |
| 共同印刷              | 500     | 2,422.00  | 1,211,000  |
| NISSHA            | 1,000   | 1,427.00  | 1,427,000  |
| アシックス             | 3,700   | 1,455.00  | 5,383,500  |
| ヤマハ               | 2,200   | 4,705.00  | 10,351,000 |
| クリナップ             | 1,600   | 622.00    | 995,200    |
| ビジョン              | 800     | 4,155.00  | 3,324,000  |
| リンテック             | 1,900   | 2,393.00  | 4,546,700  |
| 任天堂               | 800     | 31,730.00 | 25,384,000 |
| 三菱鉛筆              | 900     | 2,191.00  | 1,971,900  |
| タカラスタンダード         | 2,000   | 1,680.00  | 3,360,000  |
| コクヨ               | 2,300   | 1,646.00  | 3,785,800  |
| オカムラ              | 2,100   | 1,404.00  | 2,948,400  |
| 美津濃               | 600     | 2,423.00  | 1,453,800  |
| 東京電力ホールディングス      | 113,000 | 710.00    | 80,230,000 |
| 中部電力              | 25,500  | 1,738.00  | 44,319,000 |
| 関西電力              | 24,700  | 1,696.00  | 41,891,200 |
| 中国電力              | 12,500  | 1,476.00  | 18,450,000 |
| 北陸電力              | 9,900   | 987.00    | 9,771,300  |
| 東北電力              | 20,400  | 1,518.00  | 30,967,200 |
| 四国電力              | 6,500   | 1,371.00  | 8,911,500  |
| 九州電力              | 11,600  | 1,363.00  | 15,810,800 |
| 北海道電力             | 7,400   | 771.00    | 5,705,400  |

|                  |        |           |            |
|------------------|--------|-----------|------------|
| 沖縄電力             | 1,700  | 2,192.00  | 3,726,400  |
| 電源開発             | 7,600  | 2,709.00  | 20,588,400 |
| 東京瓦斯             | 13,400 | 2,870.50  | 38,464,700 |
| 大阪瓦斯             | 13,500 | 2,119.00  | 28,606,500 |
| 東邦瓦斯             | 1,900  | 4,795.00  | 9,110,500  |
| 北海道瓦斯            | 800    | 1,511.00  | 1,208,800  |
| 西部瓦斯             | 1,100  | 2,593.00  | 2,852,300  |
| 静岡ガス             | 2,400  | 904.00    | 2,169,600  |
| メタウォーター          | 500    | 3,010.00  | 1,505,000  |
| 東武鉄道             | 4,300  | 3,055.00  | 13,136,500 |
| 相鉄ホールディングス       | 1,600  | 3,325.00  | 5,320,000  |
| 東京急行電鉄           | 11,300 | 1,866.00  | 21,085,800 |
| 京浜急行電鉄           | 3,700  | 1,809.00  | 6,693,300  |
| 小田急電鉄            | 4,400  | 2,521.00  | 11,092,400 |
| 京王電鉄             | 1,400  | 6,350.00  | 8,890,000  |
| 京成電鉄             | 2,400  | 3,450.00  | 8,280,000  |
| 東日本旅客鉄道          | 9,200  | 9,952.00  | 91,558,400 |
| 西日本旅客鉄道          | 4,500  | 8,024.00  | 36,108,000 |
| 東海旅客鉄道           | 3,800  | 23,420.00 | 88,996,000 |
| 西武ホールディングス       | 6,500  | 1,901.00  | 12,356,500 |
| 鴻池運輸             | 1,500  | 1,610.00  | 2,415,000  |
| 西日本鉄道            | 1,600  | 2,796.00  | 4,473,600  |
| ハマキョウレックス        | 300    | 3,760.00  | 1,128,000  |
| サカイ引越センター        | 200    | 5,920.00  | 1,184,000  |
| 近鉄グループホールディングス   | 2,600  | 4,875.00  | 12,675,000 |
| 阪急阪神ホールディングス     | 5,600  | 3,830.00  | 21,448,000 |
| 南海電気鉄道           | 2,100  | 2,961.00  | 6,218,100  |
| 京阪ホールディングス       | 1,300  | 4,560.00  | 5,928,000  |
| 名古屋鉄道            | 3,300  | 2,866.00  | 9,457,800  |
| 日本通運             | 2,100  | 6,370.00  | 13,377,000 |
| ヤマトホールディングス      | 4,600  | 2,989.50  | 13,751,700 |
| 山九               | 900    | 5,170.00  | 4,653,000  |
| 丸全昭和運輸           | 500    | 2,599.00  | 1,299,500  |
| センコーグループホールディングス | 3,900  | 857.00    | 3,342,300  |
| トナミホールディングス      | 200    | 5,910.00  | 1,182,000  |
| ニッコンホールディングス     | 1,700  | 2,710.00  | 4,607,000  |

|                      |         |          |            |
|----------------------|---------|----------|------------|
| 福山通運                 | 1,000   | 4,355.00 | 4,355,000  |
| セイノーホールディングス         | 5,100   | 1,463.00 | 7,461,300  |
| 神奈川中央交通              | 300     | 3,710.00 | 1,113,000  |
| 日立物流                 | 1,700   | 3,165.00 | 5,380,500  |
| 九州旅客鉄道               | 1,700   | 3,695.00 | 6,281,500  |
| S Gホールディングス          | 3,500   | 3,005.00 | 10,517,500 |
| 日本郵船                 | 6,400   | 1,791.00 | 11,462,400 |
| 商船三井                 | 4,000   | 2,589.00 | 10,356,000 |
| 川崎汽船                 | 3,300   | 1,437.00 | 4,742,100  |
| N S ユナイテッド海運         | 800     | 2,947.00 | 2,357,600  |
| 飯野海運                 | 4,800   | 405.00   | 1,944,000  |
| 日本航空                 | 12,500  | 3,940.00 | 49,250,000 |
| A N A ホールディングス       | 8,000   | 3,952.00 | 31,616,000 |
| 日新                   | 700     | 1,882.00 | 1,317,400  |
| 三菱倉庫                 | 1,700   | 2,718.00 | 4,620,600  |
| 三井倉庫ホールディングス         | 600     | 1,891.00 | 1,134,600  |
| 住友倉庫                 | 2,600   | 1,400.00 | 3,640,000  |
| 日本トランスシティ            | 2,500   | 452.00   | 1,130,000  |
| 名港海運                 | 700     | 1,108.00 | 775,600    |
| 上組                   | 2,800   | 2,262.00 | 6,333,600  |
| 近鉄エクスプレス             | 1,800   | 1,599.00 | 2,878,200  |
| N E C ネットエスアイ        | 1,300   | 2,394.00 | 3,112,200  |
| 新日鉄住金ソリューションズ        | 1,400   | 2,647.00 | 3,705,800  |
| T I S                | 1,100   | 4,545.00 | 4,999,500  |
| グリー                  | 8,000   | 478.00   | 3,824,000  |
| コーエーテクモホールディングス      | 2,000   | 1,860.00 | 3,720,000  |
| ネクソン                 | 7,600   | 1,500.00 | 11,400,000 |
| コロプラ                 | 3,600   | 747.00   | 2,689,200  |
| ティーガイア               | 1,300   | 2,145.00 | 2,788,500  |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 35,200  | 217.00   | 7,638,400  |
| インターネットイニシアティブ       | 600     | 2,588.00 | 1,552,800  |
| L I N E              | 700     | 3,925.00 | 2,747,500  |
| フジ・メディア・ホールディングス     | 7,700   | 1,569.00 | 12,081,300 |
| オービック                | 700     | 8,960.00 | 6,272,000  |
| ヤフー                  | 134,100 | 298.00   | 39,961,800 |

|                      |        |           |             |
|----------------------|--------|-----------|-------------|
| トレンドマイクロ             | 1,600  | 6,200.00  | 9,920,000   |
| 日本オラクル               | 1,800  | 7,580.00  | 13,644,000  |
| オービックビジネスコンサルタント     | 600    | 4,240.00  | 2,544,000   |
| 伊藤忠テクノソリューションズ       | 3,100  | 2,207.00  | 6,841,700   |
| 大塚商会                 | 2,500  | 3,245.00  | 8,112,500   |
| 電通国際情報サービス           | 300    | 2,834.00  | 850,200     |
| 東映アニメーション            | 300    | 4,220.00  | 1,266,000   |
| WOWOW                | 600    | 3,015.00  | 1,809,000   |
| ネットワンシステムズ           | 900    | 2,031.00  | 1,827,900   |
| エイベックス               | 1,300  | 1,500.00  | 1,950,000   |
| 日本ユニシス               | 1,300  | 2,553.00  | 3,318,900   |
| 兼松エレクトロニクス           | 500    | 3,220.00  | 1,610,000   |
| 東京放送ホールディングス         | 4,500  | 1,834.00  | 8,253,000   |
| 日本テレビホールディングス        | 7,600  | 1,732.00  | 13,163,200  |
| 朝日放送グループホールディングス     | 1,600  | 720.00    | 1,152,000   |
| テレビ朝日ホールディングス        | 2,700  | 2,120.00  | 5,724,000   |
| スカパーJ S A Tホールディングス  | 11,200 | 479.00    | 5,364,800   |
| テレビ東京ホールディングス        | 700    | 2,367.00  | 1,656,900   |
| コネクシオ                | 1,400  | 1,366.00  | 1,912,400   |
| 日本電信電話               | 74,500 | 4,574.00  | 340,763,000 |
| K D D I              | 62,700 | 2,706.00  | 169,666,200 |
| 光通信                  | 400    | 17,590.00 | 7,036,000   |
| 沖縄セルラー電話             | 700    | 3,735.00  | 2,614,500   |
| N T T ドコモ            | 96,600 | 2,551.50  | 246,474,900 |
| G M O インターネット        | 2,200  | 1,490.00  | 3,278,000   |
| カドカワ                 | 1,800  | 1,168.00  | 2,102,400   |
| ゼンリン                 | 500    | 2,407.00  | 1,203,500   |
| 松竹                   | 100    | 10,030.00 | 1,003,000   |
| 東宝                   | 2,200  | 3,950.00  | 8,690,000   |
| 東映                   | 200    | 13,430.00 | 2,686,000   |
| エヌ・ティ・ティ・データ         | 22,100 | 1,287.00  | 28,442,700  |
| D T S                | 200    | 3,600.00  | 720,000     |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 1,600  | 3,340.00  | 5,344,000   |
| カプコン                 | 1,200  | 2,181.00  | 2,617,200   |
| S C S K              | 1,900  | 4,210.00  | 7,999,000   |

|                     |        |          |             |
|---------------------|--------|----------|-------------|
| T K C               | 400    | 4,045.00 | 1,618,000   |
| 富士ソフト               | 400    | 4,290.00 | 1,716,000   |
| N S D               | 700    | 2,159.00 | 1,511,300   |
| コナミホールディングス         | 1,400  | 4,970.00 | 6,958,000   |
| ソフトバンクグループ          | 23,500 | 7,709.00 | 181,161,500 |
| 伊藤忠食品               | 200    | 4,710.00 | 942,000     |
| あらた                 | 400    | 4,275.00 | 1,710,000   |
| 双日                  | 32,900 | 412.00   | 13,554,800  |
| アルフレッサ ホールディングス     | 3,100  | 3,060.00 | 9,486,000   |
| 横浜冷凍                | 1,200  | 949.00   | 1,138,800   |
| あい ホールディングス         | 700    | 1,971.00 | 1,379,700   |
| ダイワボウホールディングス       | 300    | 5,170.00 | 1,551,000   |
| マクニカ・富士エレホールディングス   | 1,400  | 1,455.00 | 2,037,000   |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 1,400  | 1,133.00 | 1,586,200   |
| T O K A Iホールディングス   | 3,100  | 890.00   | 2,759,000   |
| シップヘルスケアホールディングス    | 700    | 4,140.00 | 2,898,000   |
| 小野建                 | 500    | 1,632.00 | 816,000     |
| ナガイレーベン             | 500    | 2,328.00 | 1,164,000   |
| 三菱食品                | 1,300  | 2,857.00 | 3,714,100   |
| 第一興商                | 1,000  | 5,190.00 | 5,190,000   |
| メディバルホールディングス       | 4,200  | 2,468.00 | 10,365,600  |
| アズワン                | 200    | 7,280.00 | 1,456,000   |
| ドウシシャ               | 1,000  | 1,685.00 | 1,685,000   |
| 岡谷鋼機                | 300    | 9,300.00 | 2,790,000   |
| I D O M             | 2,000  | 440.00   | 880,000     |
| シークス                | 1,000  | 1,427.00 | 1,427,000   |
| 伊藤忠商事               | 49,400 | 1,937.50 | 95,712,500  |
| 丸紅                  | 66,300 | 800.40   | 53,066,520  |
| 長瀬産業                | 3,600  | 1,540.00 | 5,544,000   |
| 蝶理                  | 800    | 1,662.00 | 1,329,600   |
| 豊田通商                | 9,400  | 3,370.00 | 31,678,000  |
| 兼松                  | 2,500  | 1,317.00 | 3,292,500   |
| 三井物産                | 65,700 | 1,751.50 | 115,073,550 |
| 日本紙パルプ商事            | 400    | 4,110.00 | 1,644,000   |
| 日立ハイテクノロジーズ         | 2,800  | 3,655.00 | 10,234,000  |



|                   |        |          |             |
|-------------------|--------|----------|-------------|
| カメイ               | 1,800  | 1,239.00 | 2,230,200   |
| 山善                | 2,300  | 1,104.00 | 2,539,200   |
| 住友商事              | 43,300 | 1,620.00 | 70,146,000  |
| 三菱商事              | 44,400 | 3,121.00 | 138,572,400 |
| キヤノンマーケティングジャパン   | 3,500  | 1,979.00 | 6,926,500   |
| 三谷商事              | 300    | 5,260.00 | 1,578,000   |
| ユアサ商事             | 700    | 3,165.00 | 2,215,500   |
| 阪和興業              | 1,400  | 3,005.00 | 4,207,000   |
| 菱電商事              | 700    | 1,391.00 | 973,700     |
| 岩谷産業              | 1,200  | 3,745.00 | 4,494,000   |
| 三愛石油              | 2,000  | 1,008.00 | 2,016,000   |
| 稲畑産業              | 1,900  | 1,476.00 | 2,804,400   |
| ワキタ               | 1,700  | 1,112.00 | 1,890,400   |
| 東邦ホールディングス        | 1,500  | 2,758.00 | 4,137,000   |
| サンゲツ              | 1,300  | 2,070.00 | 2,691,000   |
| ミツウロコグループホールディングス | 1,900  | 798.00   | 1,516,200   |
| シナノンホールディングス      | 300    | 2,380.00 | 714,000     |
| 伊藤忠エネクス           | 3,900  | 978.00   | 3,814,200   |
| サンリオ              | 1,800  | 2,173.00 | 3,911,400   |
| リョーサン             | 600    | 2,944.00 | 1,766,400   |
| 加賀電子              | 900    | 2,011.00 | 1,809,900   |
| PALTA C           | 800    | 5,060.00 | 4,048,000   |
| 日鉄住金物産            | 1,000  | 4,635.00 | 4,635,000   |
| トラスコ中山            | 800    | 2,921.00 | 2,336,800   |
| オートバックスセブン        | 2,000  | 1,838.00 | 3,676,000   |
| 加藤産業              | 800    | 3,180.00 | 2,544,000   |
| イエローハット           | 700    | 2,624.00 | 1,836,800   |
| 日伝                | 500    | 1,610.00 | 805,000     |
| 因幡電機産業            | 700    | 4,235.00 | 2,964,500   |
| ミスミグループ本社         | 2,100  | 2,508.00 | 5,266,800   |
| スズケン              | 1,400  | 5,760.00 | 8,064,000   |
| ジェコス              | 1,300  | 1,034.00 | 1,344,200   |
| ローソン              | 2,700  | 6,720.00 | 18,144,000  |
| サンエー              | 500    | 4,440.00 | 2,220,000   |
| カワチ薬品             | 800    | 1,906.00 | 1,524,800   |

|                      |        |           |            |
|----------------------|--------|-----------|------------|
| エービーシー・マート           | 1,300  | 6,110.00  | 7,943,000  |
| アスクル                 | 800    | 2,201.00  | 1,760,800  |
| ゲオホールディングス           | 1,500  | 1,580.00  | 2,370,000  |
| アダストリア               | 1,000  | 2,134.00  | 2,134,000  |
| 日本マクドナルドホールディングス     | 500    | 4,735.00  | 2,367,500  |
| パルグループホールディングス       | 300    | 3,105.00  | 931,500    |
| エディオン                | 3,500  | 1,083.00  | 3,790,500  |
| セリア                  | 600    | 3,160.00  | 1,896,000  |
| ナフコ                  | 900    | 1,695.00  | 1,525,500  |
| アルペン                 | 1,100  | 1,706.00  | 1,876,600  |
| ビックカメラ               | 2,300  | 1,395.00  | 3,208,500  |
| D C Mホールディングス        | 3,700  | 1,159.00  | 4,288,300  |
| J . フロント リテイリング      | 7,600  | 1,279.00  | 9,720,400  |
| ドトール・日レスホールディングス     | 1,000  | 2,046.00  | 2,046,000  |
| マツモトキヨシホールディングス      | 1,600  | 3,410.00  | 5,456,000  |
| Z O Z O              | 1,700  | 2,271.00  | 3,860,700  |
| ココカラファイン             | 400    | 5,320.00  | 2,128,000  |
| 三越伊勢丹ホールディングス        | 8,200  | 1,208.00  | 9,905,600  |
| ウエルシアホールディングス        | 900    | 4,280.00  | 3,852,000  |
| クリエイトSDホールディングス      | 800    | 2,690.00  | 2,152,000  |
| ジョイフル本田              | 1,700  | 1,428.00  | 2,427,600  |
| すかいらーくホールディングス       | 3,900  | 1,804.00  | 7,035,600  |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 2,600  | 1,192.00  | 3,099,200  |
| 日本調剤                 | 300    | 3,330.00  | 999,000    |
| コスモス薬品               | 100    | 19,270.00 | 1,927,000  |
| セブン&アイ・ホールディングス      | 16,800 | 4,721.00  | 79,312,800 |
| ツルハホールディングス          | 600    | 9,520.00  | 5,712,000  |
| サンマルクホールディングス        | 600    | 2,525.00  | 1,515,000  |
| トリドールホールディングス        | 600    | 1,874.00  | 1,124,400  |
| クスリのアオキホールディングス      | 200    | 6,800.00  | 1,360,000  |
| スシローグローバルホールディングス    | 200    | 5,830.00  | 1,166,000  |
| L I X I L ビバ         | 1,400  | 1,676.00  | 2,346,400  |
| ノジマ                  | 1,100  | 2,215.00  | 2,436,500  |
| 良品計画                 | 200    | 23,430.00 | 4,686,000  |
| コーナン商事               | 900    | 2,700.00  | 2,430,000  |

|                      |        |           |            |
|----------------------|--------|-----------|------------|
| ドンキホーテホールディングス       | 500    | 6,320.00  | 3,160,000  |
| 西松屋チェーン              | 1,800  | 894.00    | 1,609,200  |
| ゼンショーホールディングス        | 1,000  | 2,540.00  | 2,540,000  |
| ワークマン                | 200    | 7,950.00  | 1,590,000  |
| サイゼリヤ                | 900    | 1,992.00  | 1,792,800  |
| V Tホールディングス          | 4,400  | 415.00    | 1,826,000  |
| ユナイテッドアローズ           | 500    | 3,695.00  | 1,847,500  |
| スギホールディングス           | 1,000  | 4,490.00  | 4,490,000  |
| ヨンドシーホールディングス        | 600    | 2,046.00  | 1,227,600  |
| ユニー・ファミリーマートホールディングス | 1,100  | 12,910.00 | 14,201,000 |
| 上新電機                 | 700    | 2,475.00  | 1,732,500  |
| 日本瓦斯                 | 600    | 3,950.00  | 2,370,000  |
| 島忠                   | 1,200  | 3,055.00  | 3,666,000  |
| チヨダ                  | 1,100  | 1,809.00  | 1,989,900  |
| ライフコーポレーション          | 1,000  | 2,414.00  | 2,414,000  |
| A O K Iホールディングス      | 3,000  | 1,268.00  | 3,804,000  |
| オークワ                 | 1,300  | 1,045.00  | 1,358,500  |
| コメリ                  | 1,500  | 2,491.00  | 3,736,500  |
| 青山商事                 | 2,100  | 2,708.00  | 5,686,800  |
| しまむら                 | 1,000  | 8,730.00  | 8,730,000  |
| 高島屋                  | 5,600  | 1,482.00  | 8,299,200  |
| エイチ・ツー・オー リテイリング     | 3,600  | 1,623.00  | 5,842,800  |
| パルコ                  | 2,700  | 1,080.00  | 2,916,000  |
| 丸井グループ               | 2,500  | 2,205.00  | 5,512,500  |
| アクシアル リテイリング         | 400    | 3,645.00  | 1,458,000  |
| イオン                  | 16,700 | 2,138.00  | 35,704,600 |
| イズミ                  | 1,100  | 5,460.00  | 6,006,000  |
| 平和堂                  | 1,400  | 2,511.00  | 3,515,400  |
| フジ                   | 800    | 1,909.00  | 1,527,200  |
| ヤオコー                 | 400    | 6,020.00  | 2,408,000  |
| ゼビオホールディングス          | 1,500  | 1,287.00  | 1,930,500  |
| ケーズホールディングス          | 6,000  | 1,095.00  | 6,570,000  |
| A Tグループ              | 1,300  | 2,400.00  | 3,120,000  |
| アインホールディングス          | 300    | 7,890.00  | 2,367,000  |
| ヤマダ電機                | 20,100 | 528.00    | 10,612,800 |

|                     |         |           |             |
|---------------------|---------|-----------|-------------|
| アークランドサカモト          | 1,200   | 1,363.00  | 1,635,600   |
| ニトリホールディングス         | 900     | 14,450.00 | 13,005,000  |
| 吉野家ホールディングス         | 700     | 1,743.00  | 1,220,100   |
| 王将フードサービス           | 200     | 7,100.00  | 1,420,000   |
| ブレナス                | 1,100   | 1,818.00  | 1,999,800   |
| ミニストップ              | 600     | 1,998.00  | 1,198,800   |
| アークス                | 1,300   | 2,548.00  | 3,312,400   |
| パローホールディングス         | 1,300   | 2,643.00  | 3,435,900   |
| ベルク                 | 300     | 4,950.00  | 1,485,000   |
| ファーストリテイリング         | 500     | 53,330.00 | 26,665,000  |
| サンドラッグ              | 1,700   | 3,575.00  | 6,077,500   |
| ペルーナ                | 2,100   | 970.00    | 2,037,000   |
| めぶきフィナンシャルグループ      | 54,300  | 302.00    | 16,398,600  |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ   | 3,600   | 1,647.00  | 5,929,200   |
| 九州フィナンシャルグループ       | 31,700  | 419.00    | 13,282,300  |
| ゆうちょ銀行              | 14,600  | 1,251.00  | 18,264,600  |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 59,700  | 441.00    | 26,327,700  |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | 9,100   | 992.00    | 9,027,200   |
| 関西みらいフィナンシャルグループ    | 10,000  | 845.00    | 8,450,000   |
| 三十三フィナンシャルグループ      | 2,200   | 1,662.00  | 3,656,400   |
| 第四北越フィナンシャルグループ     | 1,600   | 3,185.00  | 5,096,000   |
| 新生銀行                | 10,600  | 1,445.00  | 15,317,000  |
| あおぞら銀行              | 6,400   | 3,320.00  | 21,248,000  |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ   | 657,400 | 571.30    | 375,572,620 |
| りそなホールディングス         | 122,800 | 552.40    | 67,834,720  |
| 三井住友トラスト・ホールディングス   | 13,800  | 4,205.00  | 58,029,000  |
| 三井住友フィナンシャルグループ     | 70,100  | 3,882.00  | 272,128,200 |
| 千葉銀行                | 28,700  | 649.00    | 18,626,300  |
| 群馬銀行                | 20,300  | 469.00    | 9,520,700   |
| 武蔵野銀行               | 1,700   | 2,579.00  | 4,384,300   |
| 千葉興業銀行              | 6,700   | 369.00    | 2,472,300   |
| 筑波銀行                | 6,400   | 234.00    | 1,497,600   |
| 七十七銀行               | 3,500   | 1,974.00  | 6,909,000   |

|                 |        |          |            |
|-----------------|--------|----------|------------|
| 青森銀行            | 700    | 2,807.00 | 1,964,900  |
| 秋田銀行            | 1,100  | 2,222.00 | 2,444,200  |
| 山形銀行            | 1,100  | 2,157.00 | 2,372,700  |
| 岩手銀行            | 800    | 3,415.00 | 2,732,000  |
| 東邦銀行            | 11,700 | 317.00   | 3,708,900  |
| みちのく銀行          | 800    | 1,751.00 | 1,400,800  |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 5,900  | 2,383.00 | 14,059,700 |
| 静岡銀行            | 20,000 | 889.00   | 17,780,000 |
| 十六銀行            | 2,400  | 2,327.00 | 5,584,800  |
| スルガ銀行           | 19,400 | 444.00   | 8,613,600  |
| 八十二銀行           | 25,400 | 463.00   | 11,760,200 |
| 山梨中央銀行          | 2,200  | 1,417.00 | 3,117,400  |
| 大垣共立銀行          | 2,100  | 2,270.00 | 4,767,000  |
| 福井銀行            | 1,200  | 1,658.00 | 1,989,600  |
| 北國銀行            | 1,100  | 3,565.00 | 3,921,500  |
| 清水銀行            | 700    | 1,655.00 | 1,158,500  |
| 滋賀銀行            | 2,200  | 2,574.00 | 5,662,800  |
| 南都銀行            | 1,900  | 2,266.00 | 4,305,400  |
| 百五銀行            | 12,500 | 396.00   | 4,950,000  |
| 京都銀行            | 2,400  | 4,500.00 | 10,800,000 |
| 紀陽銀行            | 2,800  | 1,556.00 | 4,356,800  |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 8,400  | 1,258.00 | 10,567,200 |
| 広島銀行            | 15,300 | 623.00   | 9,531,900  |
| 山陰合同銀行          | 6,700  | 773.00   | 5,179,100  |
| 中国銀行            | 9,000  | 963.00   | 8,667,000  |
| 伊予銀行            | 15,800 | 596.00   | 9,416,800  |
| 百十四銀行           | 1,600  | 2,659.00 | 4,254,400  |
| 四国銀行            | 2,200  | 1,133.00 | 2,492,600  |
| 阿波銀行            | 1,400  | 2,947.00 | 4,125,800  |
| 大分銀行            | 900    | 3,495.00 | 3,145,500  |
| 宮崎銀行            | 900    | 2,944.00 | 2,649,600  |
| 佐賀銀行            | 1,000  | 1,822.00 | 1,822,000  |
| 十八銀行            | 900    | 2,626.00 | 2,363,400  |
| 沖縄銀行            | 800    | 3,265.00 | 2,612,000  |
| 琉球銀行            | 2,100  | 1,149.00 | 2,412,900  |
| セブン銀行           | 29,000 | 318.00   | 9,222,000  |

|                          |           |          |             |
|--------------------------|-----------|----------|-------------|
| みずほフィナンシャルグループ           | 1,381,400 | 174.90   | 241,606,860 |
| 山口フィナンシャルグループ            | 10,100    | 1,092.00 | 11,029,200  |
| 名古屋銀行                    | 900       | 3,305.00 | 2,974,500   |
| 北洋銀行                     | 31,000    | 296.00   | 9,176,000   |
| 愛知銀行                     | 700       | 3,775.00 | 2,642,500   |
| 中京銀行                     | 700       | 2,129.00 | 1,490,300   |
| 大光銀行                     | 600       | 1,817.00 | 1,090,200   |
| 愛媛銀行                     | 1,900     | 1,069.00 | 2,031,100   |
| 京葉銀行                     | 7,400     | 705.00   | 5,217,000   |
| 栃木銀行                     | 11,700    | 243.00   | 2,843,100   |
| 東和銀行                     | 3,700     | 778.00   | 2,878,600   |
| トモニホールディングス              | 9,200     | 409.00   | 3,762,800   |
| フィデアホールディングス             | 15,700    | 136.00   | 2,135,200   |
| 池田泉州ホールディングス             | 18,800    | 306.00   | 5,752,800   |
| F P G                    | 1,100     | 1,154.00 | 1,269,400   |
| S B Iホールディングス            | 4,500     | 2,260.00 | 10,170,000  |
| ジャフコ                     | 1,200     | 3,600.00 | 4,320,000   |
| 大和証券グループ本社               | 80,300    | 584.80   | 46,959,440  |
| 岡三証券グループ                 | 8,200     | 517.00   | 4,239,400   |
| 丸三証券                     | 2,500     | 796.00   | 1,990,000   |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス     | 12,100    | 484.00   | 5,856,400   |
| いちよし証券                   | 1,700     | 866.00   | 1,472,200   |
| 松井証券                     | 5,000     | 1,174.00 | 5,870,000   |
| マネックスグループ                | 5,100     | 398.00   | 2,029,800   |
| カブドットコム証券                | 6,200     | 379.00   | 2,349,800   |
| 極東証券                     | 1,400     | 1,216.00 | 1,702,400   |
| 岩井コスモホールディングス            | 1,100     | 1,241.00 | 1,365,100   |
| かんぽ生命保険                  | 1,400     | 2,592.00 | 3,628,800   |
| S O M P Oホールディングス        | 11,000    | 3,925.00 | 43,175,000  |
| M S & A Dインシュアランスグループホール | 19,900    | 3,206.00 | 63,799,400  |
| ソニーフィナンシャルホールディングス       | 8,500     | 2,094.00 | 17,799,000  |
| 第一生命ホールディングス             | 39,300    | 1,766.50 | 69,423,450  |
| 東京海上ホールディングス             | 18,300    | 5,219.00 | 95,507,700  |
| T & Dホールディングス            | 19,900    | 1,367.50 | 27,213,250  |

|                 |        |          |            |
|-----------------|--------|----------|------------|
| 全国保証            | 1,000  | 3,615.00 | 3,615,000  |
| アルヒ             | 600    | 2,275.00 | 1,365,000  |
| クレディセゾン         | 6,400  | 1,384.00 | 8,857,600  |
| 芙蓉総合リース         | 700    | 5,630.00 | 3,941,000  |
| 興銀リース           | 1,200  | 2,477.00 | 2,972,400  |
| 東京センチュリー        | 1,900  | 4,795.00 | 9,110,500  |
| Jトラスト           | 4,000  | 416.00   | 1,664,000  |
| 日本証券金融          | 15,900 | 577.00   | 9,174,300  |
| リコーリース          | 800    | 3,335.00 | 2,668,000  |
| イオンフィナンシャルサービス  | 6,000  | 2,042.00 | 12,252,000 |
| アコム             | 11,100 | 373.00   | 4,140,300  |
| ジャックス           | 1,600  | 1,864.00 | 2,982,400  |
| オリエントコーポレーション   | 42,500 | 131.00   | 5,567,500  |
| 日立キャピタル         | 3,600  | 2,444.00 | 8,798,400  |
| アプラスフィナンシャル     | 22,900 | 82.00    | 1,877,800  |
| オリックス           | 47,900 | 1,684.00 | 80,663,600 |
| 三菱UFJリース        | 44,200 | 546.00   | 24,133,200 |
| 日本取引所グループ       | 7,400  | 1,889.00 | 13,978,600 |
| NECキャピタルソリューション | 900    | 1,584.00 | 1,425,600  |
| いちご             | 5,800  | 364.00   | 2,111,200  |
| ヒューリック          | 11,400 | 971.00   | 11,069,400 |
| プレサンスコーポレーション   | 1,200  | 1,415.00 | 1,698,000  |
| ユニゾホールディングス     | 1,100  | 2,049.00 | 2,253,900  |
| オープンハウス         | 600    | 4,160.00 | 2,496,000  |
| 東急不動産ホールディングス   | 16,900 | 563.00   | 9,514,700  |
| 飯田グループホールディングス  | 8,000  | 1,931.00 | 15,448,000 |
| パーク24           | 2,200  | 2,640.00 | 5,808,000  |
| 三井不動産           | 16,000 | 2,561.00 | 40,976,000 |
| 三菱地所            | 22,700 | 1,825.50 | 41,438,850 |
| 平和不動産           | 1,100  | 1,832.00 | 2,015,200  |
| 東京建物            | 6,300  | 1,157.00 | 7,289,100  |
| ダイビル            | 2,800  | 1,049.00 | 2,937,200  |
| 住友不動産           | 6,400  | 4,060.00 | 25,984,000 |
| テーオーシー          | 2,700  | 780.00   | 2,106,000  |
| レオパレス21         | 9,700  | 474.00   | 4,597,800  |
| スターツコーポレーション    | 1,300  | 2,393.00 | 3,110,900  |

|                  |        |           |            |
|------------------|--------|-----------|------------|
| ゴールドクレスト         | 1,200  | 1,642.00  | 1,970,400  |
| タカラレーベン          | 5,400  | 318.00    | 1,717,200  |
| イオンモール           | 5,900  | 1,758.00  | 10,372,200 |
| 日本空港ビルデング        | 800    | 3,745.00  | 2,996,000  |
| ミクシィ             | 3,500  | 2,654.00  | 9,289,000  |
| 日本M & Aセンター      | 600    | 2,566.00  | 1,539,600  |
| パーソルホールディングス     | 2,400  | 1,887.00  | 4,528,800  |
| 総合警備保障           | 1,200  | 4,935.00  | 5,922,000  |
| カカクコム            | 1,900  | 1,857.00  | 3,528,300  |
| エムスリー            | 1,900  | 1,701.00  | 3,231,900  |
| ツカダ・グローバルホールディング | 1,100  | 591.00    | 650,100    |
| ディー・エヌ・エー        | 3,600  | 1,918.00  | 6,904,800  |
| 博報堂D Yホールディングス   | 5,300  | 1,563.00  | 8,283,900  |
| ぐるなび             | 1,800  | 711.00    | 1,279,800  |
| ケネディクス           | 3,100  | 497.00    | 1,540,700  |
| 電通               | 5,400  | 5,000.00  | 27,000,000 |
| みらかホールディングス      | 1,800  | 2,609.00  | 4,696,200  |
| オリエンタルランド        | 2,000  | 10,945.00 | 21,890,000 |
| ダスキン             | 1,100  | 2,430.00  | 2,673,000  |
| ラウンドワン           | 1,900  | 1,079.00  | 2,050,100  |
| リゾートトラスト         | 2,600  | 1,606.00  | 4,175,600  |
| ビー・エム・エル         | 700    | 2,886.00  | 2,020,200  |
| りらいあコミュニケーションズ   | 1,600  | 957.00    | 1,531,200  |
| ユー・エス・エス         | 4,400  | 1,858.00  | 8,175,200  |
| サイバーエージェント       | 800    | 4,260.00  | 3,408,000  |
| 楽天               | 19,300 | 845.00    | 16,308,500 |
| テクノプロ・ホールディングス   | 400    | 5,220.00  | 2,088,000  |
| リクルートホールディングス    | 10,800 | 2,871.00  | 31,006,800 |
| 日本郵政             | 36,900 | 1,336.00  | 49,298,400 |
| ベルシステム24ホールディングス | 5,400  | 1,353.00  | 7,306,200  |
| リログループ           | 600    | 2,787.00  | 1,672,200  |
| エイチ・アイ・エス        | 600    | 3,990.00  | 2,394,000  |
| 共立メンテナンス         | 400    | 4,700.00  | 1,880,000  |
| 東京都競馬            | 300    | 2,775.00  | 832,500    |
| カナモト             | 1,100  | 2,976.00  | 3,273,600  |
| 東京ドーム            | 2,900  | 927.00    | 2,688,300  |



|  |              |       |          |                |  |
|--|--------------|-------|----------|----------------|--|
|  | 西尾レントオール     | 600   | 3,425.00 | 2,055,000      |  |
|  | 帝国ホテル        | 600   | 1,952.00 | 1,171,200      |  |
|  | トランス・コスモス    | 900   | 2,192.00 | 1,972,800      |  |
|  | トーカイ         | 400   | 2,750.00 | 1,100,000      |  |
|  | セコム          | 3,400 | 9,117.00 | 30,997,800     |  |
|  | メイテック        | 500   | 4,720.00 | 2,360,000      |  |
|  | ベネッセホールディングス | 2,200 | 2,749.00 | 6,047,800      |  |
|  | イオンディライト     | 800   | 4,035.00 | 3,228,000      |  |
|  | ニチイ学館        | 1,100 | 995.00   | 1,094,500      |  |
|  | ダイセキ         | 600   | 2,300.00 | 1,380,000      |  |
|  | 小計 銘柄数：985   |       |          | 12,220,231,728 |  |
|  | 組入時価比率：97.9% |       |          | 100.0%         |  |
|  | 合計           |       |          | 12,220,231,728 |  |

(注1)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券(2019年1月15日現在)

該当事項はありません。

## 第2 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

| 種類       | 2019年 1月15日現在 |       |             |           |
|----------|---------------|-------|-------------|-----------|
|          | 契約額等(円)       |       | 時価(円)       | 評価損益(円)   |
|          |               | うち1年超 |             |           |
| 市場取引     |               |       |             |           |
| 株価指数先物取引 |               |       |             |           |
| 買建       | 182,580,000   | -     | 184,920,000 | 2,334,168 |
| 合計       | 182,580,000   | -     | 184,920,000 | 2,334,168 |

(注)時価の算定方法

### 1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 2 ファンドの現況

## 純資産額計算書

## 野村 R A F I ( R ) 日本株投信

2019年2月28日現在

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 2,368,340,423円 |
| 負債総額           | 3,053,202円     |
| 純資産総額( - )     | 2,365,287,221円 |
| 発行済口数          | 1,991,604,989口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.1876円        |

## (参考) 野村 R A F I ( R ) 日本株投信マザーファンド

2019年2月28日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 20,228,984,975円 |
| 負債総額           | 200,169円        |
| 純資産総額( - )     | 20,228,784,806円 |
| 発行済口数          | 14,441,019,915口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 1.4008円         |

## 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

< 更新後 >

##### (1) 資本金の額

2019年2月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

###### (a) 会社の意思決定機構

当社は監査等委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表取締役および監査等委員会を設けております。各機関の権限は以下のとおりです。

###### 株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

###### 取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また代表取締役等を選任し、取締役の職務の執行を監督します。

###### 代表取締役・業務執行取締役

代表取締役を含む各業務執行取締役は、当社の業務の執行を行います。代表取締役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表取締役を含む業務執行取締役で構成される経営会議が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役員が含まれます。

###### 監査等委員会

監査等委員である取締役3名以上（但し、過半数は社外取締役）で構成され、取締役の職務執行の適法性および妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容や監査等委員である取締役以外の取締役の選任・解任・辞任および報酬等についての監査等委員会としての意見を決定します。

## (b)投資信託の運用体制



## 2 事業の内容及び営業の概況

## &lt; 更新後 &gt;

「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者は、証券投資信託の設定を行うとともに「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）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は2019年1月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

| 種類         | 本数    | 純資産総額(百万円) |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託  | 1,023 | 26,947,656 |
| 単位型株式投資信託  | 141   | 718,198    |
| 追加型公社債投資信託 | 14    | 5,129,412  |
| 単位型公社債投資信託 | 409   | 1,742,040  |
| 合計         | 1,587 | 34,537,305 |

### 3 委託会社等の経理状況

#### < 更新後 >

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)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)、ならびに同規則第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)により作成しております。

委託会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、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57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)により作成しております。

2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2017年4月1日から2018年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2018年4月1日から2018年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けている新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日に名称を変更し、EY新日本有限責任監査法人となりました。

#### (1) 貸借対照表

| 区分     | 注記<br>番号 | 前事業年度        | 当事業年度        |
|--------|----------|--------------|--------------|
|        |          | (2017年3月31日) | (2018年3月31日) |
|        |          | 金額(百万円)      | 金額(百万円)      |
| (資産の部) |          |              |              |
| 流動資産   |          |              |              |
| 現金・預金  |          | 127          | 919          |
| 金銭の信託  |          | 52,247       | 47,936       |
| 有価証券   |          | 15,700       | 22,600       |
| 前払金    |          | 33           | 0            |
| 前払費用   |          | 2            | 26           |

|          |   |       |         |       |         |
|----------|---|-------|---------|-------|---------|
| 未収入金     |   |       | 495     |       | 464     |
| 未収委託者報酬  |   |       | 16,287  |       | 24,059  |
| 未収運用受託報酬 |   |       | 7,481   |       | 6,764   |
| 繰延税金資産   |   |       | 1,661   |       | 2,111   |
| その他      |   |       | 42      |       | 181     |
| 貸倒引当金    |   |       | 11      |       | 15      |
| 流動資産計    |   |       | 94,066  |       | 105,048 |
| 固定資産     |   |       |         |       |         |
| 有形固定資産   |   |       | 1,001   |       | 874     |
| 建物       | 2 | 377   |         | 348   |         |
| 器具備品     | 2 | 624   |         | 525   |         |
| 無形固定資産   |   |       | 7,185   |       | 7,157   |
| ソフトウェア   |   | 7,184 |         | 7,156 |         |
| その他      |   | 0     |         | 0     |         |
| 投資その他の資産 |   |       | 13,165  |       | 13,825  |
| 投資有価証券   |   | 1,233 |         | 1,184 |         |
| 関係会社株式   |   | 8,124 |         | 9,033 |         |
| 従業員長期貸付金 |   | -     |         | 36    |         |
| 長期差入保証金  |   | 44    |         | 54    |         |
| 長期前払費用   |   | 37    |         | 36    |         |
| 前払年金費用   |   | 2,594 |         | 2,350 |         |
| 繰延税金資産   |   | 960   |         | 962   |         |
| その他      |   | 170   |         | 168   |         |
| 貸倒引当金    |   | -     |         | 0     |         |
| 固定資産計    |   |       | 21,353  |       | 21,857  |
| 資産合計     |   |       | 115,419 |       | 126,906 |

| 区分        | 注記<br>番号 | 前事業年度<br>(2017年3月31日) |        | 当事業年度<br>(2018年3月31日) |        |
|-----------|----------|-----------------------|--------|-----------------------|--------|
|           |          | 金額(百万円)               |        | 金額(百万円)               |        |
| (負債の部)    |          |                       |        |                       |        |
| 流動負債      |          |                       |        |                       |        |
| 預り金       |          |                       | 98     |                       | 133    |
| 未払金       | 1        |                       | 10,401 |                       | 17,853 |
| 未払収益分配金   |          | 1                     |        | 1                     |        |
| 未払償還金     |          | 31                    |        | 31                    |        |
| 未払手数料     |          | 5,242                 |        | 7,884                 |        |
| 関係会社未払金   |          | 4,438                 |        | 7,930                 |        |
| その他未払金    |          | 687                   |        | 2,005                 |        |
| 未払費用      | 1        |                       | 9,461  |                       | 12,441 |
| 未払法人税等    |          |                       | 714    |                       | 2,241  |
| 前受収益      |          |                       | 39     |                       | 33     |
| 賞与引当金     |          |                       | 4,339  |                       | 4,626  |
| 流動負債計     |          |                       | 25,055 |                       | 37,329 |
| 固定負債      |          |                       |        |                       |        |
| 退職給付引当金   |          |                       | 2,947  |                       | 2,938  |
| 時効後支払損引当金 |          |                       | 538    |                       | 548    |
| 固定負債計     |          |                       | 3,485  |                       | 3,486  |
| 負債合計      |          |                       | 28,540 |                       | 40,816 |
| (純資産の部)   |          |                       |        |                       |        |

|              |  |        |         |        |         |
|--------------|--|--------|---------|--------|---------|
| 株主資本         |  |        | 86,837  |        | 86,078  |
| 資本金          |  |        | 17,180  |        | 17,180  |
| 資本剰余金        |  |        | 13,729  |        | 13,729  |
| 資本準備金        |  | 11,729 |         | 11,729 |         |
| その他資本剰余金     |  | 2,000  |         | 2,000  |         |
| 利益剰余金        |  |        | 55,927  |        | 55,168  |
| 利益準備金        |  | 685    |         | 685    |         |
| その他利益剰余金     |  | 55,242 |         | 54,483 |         |
| 別途積立金        |  | 24,606 |         | 24,606 |         |
| 繰越利益剰余金      |  | 30,635 |         | 29,876 |         |
| 評価・換算差額等     |  |        | 41      |        | 11      |
| その他有価証券評価差額金 |  |        | 41      |        | 11      |
| 純資産合計        |  |        | 86,878  |        | 86,090  |
| 負債・純資産合計     |  |        | 115,419 |        | 126,906 |

## (2) 損益計算書

| 区分      | 注記<br>番号 | 前事業年度<br>(自 2016年4月1日<br>至 2017年3月31日) |         | 当事業年度<br>(自 2017年4月1日<br>至 2018年3月31日) |         |
|---------|----------|--|---------|--|---------|
|         |          | 金額(百万円)                                |         | 金額(百万円)                                |         |
| 営業収益    |          |  |         |  |         |
| 委託者報酬   |          |  | 96,594  |  | 115,907 |
| 運用受託報酬  |          |  | 28,466  |  | 26,200  |
| その他営業収益 |          |  | 266     |  | 338     |
| 営業収益計   |          |  | 125,327 |  | 142,447 |
| 営業費用    |          |  |         |  |         |
| 支払手数料   |          |  | 39,785  |  | 45,252  |
| 広告宣伝費   |          |  | 1,011   |  | 1,079   |
| 公告費     |          |  | 0       |  | 0       |
| 調査費     |          |  | 26,758  |  | 30,516  |
| 調査費     |          | 5,095                                  |         | 5,830                                  |         |
| 委託調査費   |          | 21,662                                 |         | 24,685                                 |         |
| 委託計算費   |          |  | 1,290   |  | 1,376   |
| 営業雑経費   |          |  | 4,408   |  | 5,464   |
| 通信費     |          | 162                                    |         | 125                                    |         |
| 印刷費     |          | 940                                    |         | 966                                    |         |
| 協会費     |          | 76                                     |         | 79                                     |         |
| 諸経費     |          | 3,228                                  |         | 4,293                                  |         |
| 営業費用計   |          |  | 73,254  |  | 83,689  |
| 一般管理費   |          |  |         |  |         |
| 給料      |          |  | 11,269  |  | 11,716  |
| 役員報酬    | 2        | 301                                    |         | 425                                    |         |
| 給料・手当   |          | 6,923                                  |         | 6,856                                  |         |
| 賞与      |          | 4,044                                  |         | 4,433                                  |         |
| 交際費     |          |  | 126     |  | 132     |
| 旅費交通費   |          |  | 469     |  | 482     |
| 租税公課    |          |  | 898     |  | 1,107   |

|           |  |        |        |
|-----------|--|--------|--------|
| 不動産賃借料    |  | 1,222  | 1,221  |
| 退職給付費用    |  | 1,223  | 1,119  |
| 固定資産減価償却費 |  | 2,730  | 2,706  |
| 諸経費       |  | 8,118  | 9,122  |
| 一般管理費計    |  | 26,059 | 27,609 |
| 営業利益      |  | 26,012 | 31,148 |

| 区分           | 注記<br>番号 | 前事業年度<br>(自 2016年4月1日<br>至 2017年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2017年4月1日<br>至 2018年3月31日) |
|--------------|----------|--|--|
|              |          | 金額(百万円)                                | 金額(百万円)                                |
| 営業外収益        |          |  |  |
| 受取配当金        | 1        | 7,397                                  | 4,031                                  |
| 受取利息         |          | 0                                      | 4                                      |
| 金銭の信託運用益     |          | 684                                    | -                                      |
| その他          |          | 379                                    | 362                                    |
| 営業外収益計       |          | 8,461                                  | 4,398                                  |
| 営業外費用        |          |  |  |
| 支払利息         |          | 17                                     | 2                                      |
| 金銭の信託運用損     |          | -                                      | 312                                    |
| 時効後支払損引当金繰入額 |          | 16                                     | 13                                     |
| 為替差損         |          | 33                                     | 46                                     |
| その他          |          | 9                                      | 31                                     |
| 営業外費用計       |          | 77                                     | 405                                    |
| 経常利益         |          | 34,397                                 | 35,141                                 |
| 特別利益         |          |  |  |
| 投資有価証券等売却益   |          | 26                                     | 20                                     |
| 関係会社清算益      |          | 41                                     | -                                      |
| 株式報酬受入益      |          | 59                                     | 75                                     |
| 特別利益計        |          | 126                                    | 95                                     |
| 特別損失         |          |  |  |
| 投資有価証券等評価損   |          | 6                                      | 2                                      |
| 固定資産除却損      | 3        | 9                                      | 58                                     |
| 特別損失計        |          | 15                                     | 60                                     |
| 税引前当期純利益     |          | 34,507                                 | 35,176                                 |
| 法人税、住民税及び事業税 |          | 7,147                                  | 10,775                                 |
| 法人税等調整額      |          | 1,722                                  | 439                                    |
| 当期純利益        |          | 25,637                                 | 24,840                                 |

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

(単位：百万円)

|  | 株主資本  |  |          |  |
|--|-------|--|----------|--|
|  | 資本剰余金 |  | 利益剰余金    |  |
|  |       |  | その他利益剰余金 |  |
|  |       |  |          |  |



|                     | 資本金    | 資本準備金  | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | 別途積立金  | 繰越利益剰余金 | 利益剰余金合計 | 株主資本合計 |
|---------------------|--------|--------|----------|---------|-------|--------|---------|---------|--------|
| 当期首残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606 | 43,405  | 68,696  | 99,606 |
| 当期変動額               |        |        |          |         |       |        |         |         |        |
| 剰余金の配当              |        |        |          |         |       |        | 38,407  | 38,407  | 38,407 |
| 当期純利益               |        |        |          |         |       |        | 25,637  | 25,637  | 25,637 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） |        |        |          |         |       |        |         |         |        |
| 当期変動額合計             | -      | -      | -        | -       | -     | -      | 12,769  | 12,769  | 12,769 |
| 当期末残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606 | 30,635  | 55,927  | 86,837 |

(単位：百万円)

|                     | 評価・換算差額等     |            | 純資産合計   |
|---------------------|--------------|------------|---------|
|                     | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 |         |
| 当期首残高               | 5,349        | 5,349      | 104,956 |
| 当期変動額               |              |            |         |
| 剰余金の配当              |              |            | 38,407  |
| 当期純利益               |              |            | 25,637  |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 5,308        | 5,308      | 5,308   |
| 当期変動額合計             | 5,308        | 5,308      | 18,078  |
| 当期末残高               | 41           | 41         | 86,878  |

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

|        | 株主資本   |        |          |         |       |          |         |         | 株主資本合計 |
|--------|--------|--------|----------|---------|-------|----------|---------|---------|--------|
|        | 資本金    | 資本剰余金  |          |         | 利益準備金 | 利益剰余金    |         |         |        |
|        |        | 資本準備金  | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |       | その他利益剰余金 |         | 利益剰余金合計 |        |
|        |        |        |          |         |       | 別途積立金    | 繰越利益剰余金 |         |        |
| 当期首残高  | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606   | 30,635  | 55,927  | 86,837 |
| 当期変動額  |        |        |          |         |       |          |         |         |        |
| 剰余金の配当 |        |        |          |         |       |          | 25,598  | 25,598  | 25,598 |
| 当期純利益  |        |        |          |         |       |          | 24,840  | 24,840  | 24,840 |

|                     |        |        |       |        |     |        |        |        |        |
|---------------------|--------|--------|-------|--------|-----|--------|--------|--------|--------|
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） |        |        |       |        |     |        |        |        |        |
| 当期変動額合計             | -      | -      | -     | -      | -   | -      | 758    | 758    | 758    |
| 当期末残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000 | 13,729 | 685 | 24,606 | 29,876 | 55,168 | 86,078 |

(単位：百万円)

|                     | 評価・換算差額等     |            | 純資産合計  |
|---------------------|--------------|------------|--------|
|                     | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 |        |
| 当期首残高               | 41           | 41         | 86,878 |
| 当期変動額               |              |            |        |
| 剰余金の配当              |              |            | 25,598 |
| 当期純利益               |              |            | 24,840 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 29           | 29         | 29     |
| 当期変動額合計             | 29           | 29         | 788    |
| 当期末残高               | 11           | 11         | 86,090 |

## [重要な会計方針]

|                     |   |
|---------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法  | (1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法<br>(2) その他有価証券<br>時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法<br>(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。)<br>時価のないもの ... 移動平均法による原価法   |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法   |
| 3. 固定資産の減価償却の方法     | (1) 有形固定資産<br>定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016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。<br>主な耐用年数は以下の通りであります。<br>建物 38～50年<br>附属設備 8～15年<br>構築物 20年<br>器具備品 4～15年<br>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産<br>定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、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。 |

|                |  |
|----------------|--|
| 4. 引当金の計上基準    | <p>(1) 貸倒引当金<br/>一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金<br/>賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金<br/>従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、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。<br/>退職給付見込額の期間帰属方法<br/>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。<br/>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法<br/>確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。<br/>退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金<br/>時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> |
| 5. 消費税等の会計処理方法 | 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理していません。  |
| 6. 連結納税制度の適用   | 連結納税制度を適用しております。   |

#### 【未適用の会計基準等】

- ・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16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30年2月16日）

日）

##### (1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異の取扱いが見直され、また（分類1）に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

##### (2) 適用予定日

2019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、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

##### (1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022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、当財務諸表の作成時において評価中であります。

**[ 表示方法の変更に関する注記 ]**

(貸借対照表)

前事業年度において、流動負債の「その他未払金」に含めて表示していた「関係会社未払金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より区分掲記しております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「その他未払金」に表示していた4,438百万円は、「関係会社未払金」4,438百万円として組み替えております。

[注記事項]

貸借対照表関係

| 前事業年度末<br>(2017年3月31日)  | 当事業年度末<br>(2018年3月31日)  |
|---|---|
| 1. 関係会社に対する資産及び負債<br>区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている<br>ものは、次のとおりであります。<br>未払費用 938百万円 | 1. 関係会社に対する資産及び負債<br>区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている<br>ものは、次のとおりであります。<br>未払費用 1,781百万円 |
| 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額<br>建物 681百万円<br>器具備品 3,331<br>合計 4,013                 | 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額<br>建物 708百万円<br>器具備品 3,491<br>合計 4,200                   |

損益計算書関係

| 前事業年度<br>(自 2016年4月1日<br>至 2017年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2017年4月1日<br>至 2018年3月31日) |
|--|--|
|  |  |

|   |  |
|---|--|
| <p>1. 関係会社に係る注記<br/>区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 5,252百万円<br/>支払利息 17</p> <p>2. 役員報酬の範囲額<br/>役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されております。</p> <p>3. 固定資産除却損</p> <p>建物 -百万円<br/>器具備品 0<br/>ソフトウェア 9<br/>ア<br/>合計 9</p> | <p>1. 関係会社に係る注記<br/>区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 4,026百万円<br/>支払利息 2</p> <p>2. 役員報酬の範囲額<br/>(同左)</p> <p>3. 固定資産除却損</p> <p>建物 4百万円<br/>器具備品 0<br/>ソフトウェア 53<br/>ア<br/>合計 58</p> |
|---|--|

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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 | 当事業年度期首株式数 | 当事業年度増加株式数 | 当事業年度減少株式数 | 当事業年度末株式数  |
|-------|------------|------------|------------|------------|
| 普通株式  | 5,150,693株 | -          | -          | 5,150,693株 |

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2016年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

|          |            |
|----------|------------|
| 配当金の総額   | 34,973百万円  |
| 配当の原資    | 利益剰余金      |
| 1株当たり配当額 | 6,790円     |
| 基準日      | 2016年3月31日 |
| 効力発生日    | 2016年6月24日 |

配当財産が金銭以外である場合における当該財産の総額

2016年10月27日開催の臨時株主総会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当財産の種類 株式会社野村総合研究所の株式

|           |             |
|-----------|-------------|
| 配当財産の帳簿価額 | 3,064百万円    |
| 1株当たり配当額  | 594円87銭     |
| 効力発生日     | 2016年10月27日 |

配当財産の種類 株式会社ジャフコの株式

|           |             |
|-----------|-------------|
| 配当財産の帳簿価額 | 282百万円      |
| 1株当たり配当額  | 54円93銭      |
| 効力発生日     | 2016年10月27日 |

配当財産の種類 朝日火災海上保険株式会社の株式

|           |             |
|-----------|-------------|
| 配当財産の帳簿価額 | 87百万円       |
| 1株当たり配当額  | 16円89銭      |
| 効力発生日     | 2016年10月27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

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

|               |            |
|---------------|------------|
| 普通株式の配当に関する事項 |            |
| 配当金の総額        | 25,598百万円  |
| 配当の原資         | 利益剰余金      |
| 1株当たり配当額      | 4,970円     |
| 基準日           | 2017年3月31日 |
| 効力発生日         | 2017年6月23日 |

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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 | 当事業年度期首株式数 | 当事業年度増加株式数 | 当事業年度減少株式数 | 当事業年度末株式数  |
|-------|------------|------------|------------|------------|
| 普通株式  | 5,150,693株 | -          | -          | 5,150,693株 |

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

|               |            |
|---------------|------------|
| 普通株式の配当に関する事項 |            |
| 配当金の総額        | 25,598百万円  |
| 配当の原資         | 利益剰余金      |
| 1株当たり配当額      | 4,970円     |
| 基準日           | 2017年3月31日 |
| 効力発生日         | 2017年6月23日 |

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

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

|               |            |
|---------------|------------|
| 普通株式の配当に関する事項 |            |
| 配当金の総額        | 24,826百万円  |
| 配当の原資         | 利益剰余金      |
| 1株当たり配当額      | 4,820円     |
| 基準日           | 2018年3月31日 |
| 効力発生日         | 2018年6月25日 |

## 金融商品関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

して、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ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かか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、投資信託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。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

## （２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

## ２．金融商品の時価等に関する事項

2017年3月31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す。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

|                 | 貸借対照表計上額 | 時価     | 差額 |
|-----------------|----------|--------|----|
| (1)現金・預金        | 127      | 127    | -  |
| (2)金銭の信託        | 52,247   | 52,247 | -  |
| (3)未収委託者報酬      | 16,287   | 16,287 | -  |
| (4)未収運用受託報酬     | 7,481    | 7,481  | -  |
| (5)有価証券及び投資有価証券 | 15,700   | 15,700 | -  |
| その他有価証券         | 15,700   | 15,700 | -  |
| 資産計             | 91,843   | 91,843 | -  |
| (6)未払金          | 10,401   | 10,401 | -  |

|           |        |        |   |
|-----------|--------|--------|---|
| 未払収益分配金   | 1      | 1      | - |
| 未払償還金     | 31     | 31     | - |
| 未払手数料     | 5,242  | 5,242  | - |
| 関係会社未払金   | 4,438  | 4,438  | - |
| その他未払金    | 687    | 687    | - |
| (7)未払費用   | 9,461  | 9,461  | - |
| (8)未払法人税等 | 714    | 714    | - |
| 負債計       | 20,578 | 20,578 | - |

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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。

(2) 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・委託証拠金等）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取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ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。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これら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。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

譲渡性預金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。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これら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。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,233百万円、関係会社株式8,124百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：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<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|--------------|--------|-------------|--------------|------|
| 預金           | 127    | -           | -            | -    |
| 金銭の信託        | 52,247 | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬      | 16,287 | -           | -            | -    |
| 未収運用受託報酬     | 7,481  | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券 |        |             |              |      |
| その他有価証券      | 15,700 | -           | -            | -    |
| 合計           | 91,843 | -           | -            | -    |

当事業年度（自 2017年 4月 1日 至 2018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等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ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かか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、投資信託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。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

### （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合

は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2018年3月31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す。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

|                 | 貸借対照表計上額 | 時価      | 差額 |
|-----------------|----------|---------|----|
| (1)現金・預金        | 919      | 919     | -  |
| (2)金銭の信託        | 47,936   | 47,936  | -  |
| (3)未収委託者報酬      | 24,059   | 24,059  | -  |
| (4)未収運用受託報酬     | 6,764    | 6,764   | -  |
| (5)有価証券及び投資有価証券 | 22,600   | 22,600  | -  |
| その他有価証券         | 22,600   | 22,600  | -  |
| 資産計             | 102,279  | 102,279 | -  |
| (6)未払金          | 17,853   | 17,853  | -  |
| 未払収益分配金         | 1        | 1       | -  |
| 未払償還金           | 31       | 31      | -  |
| 未払手数料           | 7,884    | 7,884   | -  |
| 関係会社未払金         | 7,930    | 7,930   | -  |
| その他未払金          | 2,005    | 2,005   | -  |
| (7)未払費用         | 12,441   | 12,441  | -  |
| (8)未払法人税等       | 2,241    | 2,241   | -  |
| 負債計             | 32,536   | 32,536  | -  |

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

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。

### (2) 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・委託証拠金等）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取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ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。

### (3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これら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。

### (5) 有価証券及び投資有価証券

### その他有価証券

譲渡性預金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。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

### (6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これら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。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,184百万円、関係会社株式9,033百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

### 注3：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<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|--------------|---------|-------------|--------------|------|
| 預金           | 919     | -           | -            | -    |
| 金銭の信託        | 47,936  | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬      | 24,059  | -           | -            | -    |
| 未収運用受託報酬     | 6,764   | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券 |         |             |              |      |
| その他有価証券      | 22,600  | -           | -            | -    |
| 合計           | 102,279 | -           | -            | -    |

### 有価証券関係

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

#### 1．売買目的有価証券(2017年3月31日)

該当事項はありません。

#### 2．満期保有目的の債券(2017年3月31日)

該当事項はありません。

#### 3．子会社株式及び関連会社株式(2017年3月31日)

該当事項はありません。

#### 4．その他有価証券(2017年3月31日)

| 区分                   | 貸借対照表<br>計上額<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(百万円) |
|----------------------|-----------------------|---------------|-------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  |                       |               |             |
| 株式                   | -                     | -             | -           |
| 小計                   | -                     | -             | -           |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの |                       |               |             |
| 譲渡性預金                | 15,700                | 15,700        | -           |
| 小計                   | 15,700                | 15,700        | -           |
| 合計                   | 15,700                | 15,700        | -           |

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2016年 4月 1日 至 2017年 3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月31日）

1．売買目的有価証券(2018年 3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2018年 3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2018年 3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2018年 3月31日)

| 区分                   | 貸借対照表<br>計上額<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(百万円) |
|----------------------|-----------------------|---------------|-------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  |                       |               |             |
| 株式                   | -                     | -             | -           |
| 小計                   | -                     | -             | -           |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの |                       |               |             |
| 譲渡性預金                | 22,600                | 22,600        | -           |
| 小計                   | 22,600                | 22,600        | -           |
| 合計                   | 22,600                | 22,600        | -           |

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月31日）

該当事項はありません。

## 退職給付関係

| 前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)                                     |            |
|---|------------|
| 1. 採用している退職給付制度の概要  |            |
| 当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年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  |            |
| 退職給付債務の期首残高   | 18,692 百万円 |
| 勤務費用  | 889        |
| 利息費用  | 125        |
| 数理計算上の差異の発生額  | 464        |
| 退職給付の支払額  | 634        |
| その他   | 8          |
| 退職給付債務の期末残高   | 19,546     |
| (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表  |            |
| 年金資産の期首残高   | 15,764 百万円 |
| 期待運用収益  | 394        |
| 数理計算上の差異の発生額  | 468        |
| 事業主からの拠出額   | 507        |
| 退職給付の支払額  | 562        |
| 年金資産の期末残高   | 16,572     |
| (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表                |            |
| 積立型制度の退職給付債務  | 16,578 百万円 |
| 年金資産  | 16,572     |
|   | 5          |
| 非積立型制度の退職給付債務   | 2,967      |
| 未積立退職給付債務   | 2,973      |
| 未認識数理計算上の差異   | 2,992      |
| 未認識過去勤務費用   | 371        |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額  | 352        |
| 退職給付引当金   | 2,947      |
| 前払年金費用  | 2,594      |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額  | 352        |
| (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額   |            |
| 勤務費用  | 889 百万円    |
| 利息費用  | 125        |
| 期待運用収益  | 394        |
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 412        |
| 過去勤務費用の費用処理額  | 40         |
| 確定給付制度に係る退職給付費用   | 993        |
| (5) 年金資産に関する事項  |            |
| 年金資産の主な内容   |            |
| 年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。   |            |
| 債券  | 49%        |
| 株式  | 39%        |
| 生保一般勘定  | 12%        |
| その他   | 0%         |
| 合計  | 100%       |

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6) 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

|                 |      |
|-----------------|------|
| 確定給付型企業年金制度の割引率 | 0.9% |
| 退職一時金制度の割引率     | 0.6% |
| 長期期待運用収益率       | 2.5% |

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

## 当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年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

|              |            |
|--------------|------------|
| 退職給付債務の期首残高  | 19,546 百万円 |
| 勤務費用         | 929        |
| 利息費用         | 167        |
| 数理計算上の差異の発生額 | 1,415      |
| 退職給付の支払額     | 660        |
| その他          | 0          |
| 退職給付債務の期末残高  | 21,398     |

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

|              |            |
|--------------|------------|
| 年金資産の期首残高    | 16,572 百万円 |
| 期待運用収益       | 414        |
| 数理計算上の差異の発生額 | 395        |
| 事業主からの拠出額    | 510        |
| 退職給付の支払額     | 518        |
| 年金資産の期末残高    | 17,373     |

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

|                      |            |
|----------------------|------------|
| 積立型制度の退職給付債務         | 18,163 百万円 |
| 年金資産                 | 17,373     |
|                      | 790        |
| 非積立型制度の退職給付債務        | 3,235      |
| 未積立退職給付債務            | 4,025      |
| 未認識数理計算上の差異          | 3,768      |
| 未認識過去勤務費用            | 331        |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額 | 588        |
| 退職給付引当金              | 2,938      |
| 前払年金費用               | 2,350      |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額 | 588        |

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

|                 |         |
|-----------------|---------|
| 勤務費用            | 929 百万円 |
| 利息費用            | 167     |
| 期待運用収益          | 414     |
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 244     |
| 過去勤務費用の費用処理額    | 40      |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 887     |

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

|        |      |
|--------|------|
| 債券     | 47%  |
| 株式     | 41%  |
| 生保一般勘定 | 12%  |
| その他    | 0%   |
| 合計     | 100% |

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6) 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

|                 |      |
|-----------------|------|
| 確定給付型企業年金制度の割引率 | 0.9% |
| 退職一時金制度の割引率     | 0.5% |
| 長期期待運用収益率       | 2.5% |

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

## 税効果会計関係

|                        |                        |
|------------------------|------------------------|
| 前事業年度末<br>(2017年3月31日) | 当事業年度末<br>(2018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                  |       |
| 繰延税金資産   | 百万円   | 繰延税金資産   | 百万円   |
| 賞与引当金  | 1,345 | 賞与引当金  | 1,434 |
| 退職給付引当金  | 913   | 退職給付引当金  | 910   |
| 投資有価証券評価減                                      | 417   | 投資有価証券評価減                                      | 417   |
| 未払事業税  | 110   | 未払事業税  | 409   |
| 関係会社株式評価減                                      | 247   | 関係会社株式評価減                                      | 247   |
| ゴルフ会員権評価減                                      | 212   | ゴルフ会員権評価減                                      | 207   |
| 減価償却超過額  | 171   | 減価償却超過額  | 171   |
| 時効後支払損引当金                                      | 166   | 時効後支払損引当金                                      | 169   |
| 子会社株式売却損                                       | 148   | 子会社株式売却損                                       | 148   |
| 未払子会社役務提供費用                                    | -     | 未払子会社役務提供費用                                    | 121   |
| 未払社会保険料  | 85    | 未払社会保険料  | 107   |
| 関係会社株式譲渡益                                      | 88    | 関係会社株式譲渡益                                      | -     |
| その他  | 274   | その他  | 197   |
| 繰延税金資産小計                                       | 4,183 | 繰延税金資産小計                                       | 4,543 |
| 評価性引当額   | 739   | 評価性引当額   | 735   |
| 繰延税金資産合計                                       | 3,444 | 繰延税金資産合計                                       | 3,808 |
| 繰延税金負債   |       | 繰延税金負債   |       |
| その他有価証券評価差額金                                   | 18    | その他有価証券評価差額金                                   | 5     |
| 前払年金費用   | 804   | 前払年金費用   | 728   |
| 繰延税金負債合計                                       | 822   | 繰延税金負債合計                                       | 733   |
| 繰延税金資産の純額                                      | 2,621 | 繰延税金資産の純額                                      | 3,074 |
| 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差異の原因となった主な項目別の内訳 |       | 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差異の原因となった主な項目別の内訳 |       |
| 法定実効税率   | 31.0% | 法定実効税率   | 31.0% |
| (調整)   |       | (調整)   |       |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目                             | 0.1%  | 交際費等永久に損金に算入されない項目                             | 0.2%  |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目                           | 6.2%  | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目                           | 3.4%  |
| タックスヘイブン税制                                     | 0.7%  | タックスヘイブン税制                                     | 1.8%  |
| 外国税額控除   | 0.2%  | 外国税額控除   | 0.2%  |
| 外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税                           | 0.5%  | 外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税                           | 0.3%  |
| その他  | 0.2%  | その他  | 0.4%  |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率                              | 25.7% | 税効果会計適用後の法人税等の負担率                              | 29.3% |

## セグメント情報等

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域



ごとの営業収益の記載を省略しております。

#### 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

### (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

### (1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

### (2) 地域ごとの情報

#### 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

#### 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

### (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 関連当事者情報

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### (ア) 親会社及び法人主要株主等

| 種類  | 会社等の名称         | 所在地    | 資本金              | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)割合  | 関連当事者との<br>関係                | 取引の内容         | 取引<br>金額<br>(百万円) | 科目    | 期末<br>残高<br>(百万円) |
|-----|----------------|--------|------------------|-------|---------------------|------------------------------|---------------|-------------------|-------|-------------------|
| 親会社 | 野村ホールディングス株式会社 | 東京都中央区 | 594,492<br>(百万円) | 持株会社  | (被所有)<br>直接<br>100% | 資産の賃貸借<br>及び購入等<br><br>役員の兼任 | 資金の借入<br>(*1) | 24,500            | 短期借入金 | -                 |
|     |                |        |                  |       |                     |                              | 資金の返済         | 24,500            |       |                   |
|     |                |        |                  |       |                     |                              | 借入金利息<br>の支払  | 17                | 未払費用  | -                 |

### (イ) 子会社等

| 種類   | 会社等の名称      | 所在地     | 資本金             | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係  | 取引の内容                | 取引金額<br>(百万円) | 科目   | 期末残高<br>(百万円) |
|------|-------------|---------|-----------------|---------|--------------------|------------|----------------------|---------------|------|---------------|
| 関連会社 | 株式会社野村総合研究所 | 東京都千代田区 | 18,600<br>(百万円) | 情報サービス業 | -                  | サービス・製品の購入 | 自社利用ソフトウェア開発の委託等(*2) | 787           | 未払費用 | -             |

## (ウ) 兄弟会社等

| 種類      | 会社等の名称   | 所在地    | 資本金             | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係                                       | 取引の内容                 | 取引金額<br>(百万円) | 科目    | 期末残高<br>(百万円) |
|---------|----------|--------|-----------------|-------|--------------------|---|-----------------------|---------------|-------|---------------|
| 親会社の子会社 | 野村証券株式会社 | 東京都中央区 | 10,000<br>(百万円) | 証券業   | -                  | 当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等<br>役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*3) | 33,019        | 未払手数料 | 4,486         |

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

(\*2) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。なお、株式会社野村総合研究所は、2016年10月27日より関連当事者に該当しないこととなったため、取引金額は関連当事者であった期間について、期末残高は関連当事者でなくなった時点について記載しております。

(\*3) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

## 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

野村ホールディングス(株)(東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(百万円) | 科目 | 期末残高<br>(百万円) |
|----|--------|-----|-----|-------|--------------------|-----------|-------|---------------|----|---------------|
|----|--------|-----|-----|-------|--------------------|-----------|-------|---------------|----|---------------|

|     |                |        |                  |      |                     |                              |               |       |       |   |
|-----|----------------|--------|------------------|------|---------------------|------------------------------|---------------|-------|-------|---|
| 親会社 | 野村ホールディングス株式会社 | 東京都中央区 | 594,492<br>(百万円) | 持株会社 | (被所有)<br>直接<br>100% | 資産の賃貸借<br>及び購入等<br><br>役員の兼任 | 資金の借入<br>(*1) | 3,000 | 短期借入金 | - |
|     |                |        |                  |      |                     |                              | 資金の返済         | 3,000 |       |   |
|     |                |        |                  |      |                     |                              | 借入金利息<br>の支払  | 2     | 未払費用  | - |

(イ) 子会社等  
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

| 種類      | 会社等の<br>名称 | 所在地    | 資本金             | 事業の内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)割合 | 関連当事者との<br>関係                                   | 取引の内容                 | 取引<br>金額<br>(百万円) | 科目    | 期末<br>残高<br>(百万円) |
|---------|------------|--------|-----------------|-------|------------------------|---|-----------------------|-------------------|-------|-------------------|
| 親会社の子会社 | 野村証券株式会社   | 東京都中央区 | 10,000<br>(百万円) | 証券業   | -                      | 当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等<br>役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2) | 37,482            | 未払手数料 | 6,691             |

(エ) 役員及び個人主要株主等  
該当はありません。

- (注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。  
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等  
(\*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。  
(\*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

## 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

野村ホールディングス(株)(東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、  
ニューヨーク証券取引所に上場)

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## 1 株当たり情報

| 前事業年度<br>(自 2016年4月1日<br>至 2017年3月31日) |            | 当事業年度<br>(自 2017年4月1日<br>至 2018年3月31日) |            |
|--|------------|--|------------|
| 1株当たり純資産額                              | 16,867円41銭 | 1株当たり純資産額                              | 16,714円33銭 |
| 1株当たり当期純利益                             | 4,977円49銭  | 1株当たり当期純利益                             | 4,822円68銭  |

|   |   |
|---|---|
| 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 | 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 |
| 1株当たり当期純利益の算定上の基礎                             | 1株当たり当期純利益の算定上の基礎                             |
| 損益計算書上の当期純利益 25,637百万円                        | 損益計算書上の当期純利益 24,840百万円                        |
| 普通株式に係る当期純利益 25,637百万円                        | 普通株式に係る当期純利益 24,840百万円                        |
| 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳<br>該当事項はありません。             | 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳<br>該当事項はありません。             |
| 普通株式の期中平均株式数 5,150,693株                       | 普通株式の期中平均株式数 5,150,693株                       |

## 【重要な後発事象】

当社は、2018年4月6日付で、香港の金融持株会社である8 Limited(エイト・リミテッド、以下「エイト・リミテッド」)の株式の14.9%を取得するとともに、同社の子会社であったエイト証券株式会社(以下「エイト証券」)の株式の78.3%を取得しました。当社のエイト・リミテッド及びエイト証券に対する出資額は、それぞれ約11億円及び約16億円であり、いずれも4月上旬に払込みを行っております。

## 中間財務諸表

### 中間貸借対照表

|          |      | 2018年9月30日現在 |
|----------|------|--------------|
| 区分       | 注記番号 | 金額(百万円)      |
| (資産の部)   |      |              |
| 流動資産     |      |              |
| 現金・預金    |      | 948          |
| 金銭の信託    |      | 43,002       |
| 有価証券     |      | 6,700        |
| 未収委託者報酬  |      | 25,448       |
| 未収運用受託報酬 |      | 6,582        |
| その他      |      | 726          |
| 貸倒引当金    |      | 16           |
| 流動資産計    |      | 83,392       |
| 固定資産     |      |              |
| 有形固定資産   | 1    | 793          |
| 無形固定資産   |      | 6,661        |
| ソフトウェア   |      | 6,660        |
| その他      |      | 0            |
| 投資その他の資産 |      | 18,807       |
| 投資有価証券   |      | 2,582        |
| 関係会社株式   |      | 11,477       |
| 前払年金費用   |      | 2,191        |
| 繰延税金資産   |      | 2,108        |
| その他      |      | 448          |
| 固定資産計    |      | 26,262       |
| 資産合計     |      | 109,654      |

|         |      | 2018年9月30日現在 |
|---------|------|--------------|
| 区分      | 注記番号 | 金額(百万円)      |
| (負債の部)  |      |              |
| 流動負債    |      |              |
| 未払収益分配金 |      | 0            |
| 未払償還金   |      | 25           |
| 未払手数料   |      | 8,085        |
| その他未払金  | 2    | 4,704        |
| 未払費用    |      | 11,109       |

|              |  |         |
|--------------|--|---------|
| 未払法人税等       |  | 1,588   |
| 賞与引当金        |  | 2,349   |
| その他          |  | 149     |
| 流動負債計        |  | 28,014  |
| 固定負債         |  |         |
| 退職給付引当金      |  | 3,087   |
| 時効後支払損引当金    |  | 557     |
| 固定負債計        |  | 3,644   |
| 負債合計         |  | 31,658  |
| (純資産の部)      |  |         |
| 株主資本         |  | 77,899  |
| 資本金          |  | 17,180  |
| 資本剰余金        |  | 13,729  |
| 資本準備金        |  | 11,729  |
| その他資本剰余金     |  | 2,000   |
| 利益剰余金        |  | 46,989  |
| 利益準備金        |  | 685     |
| その他利益剰余金     |  | 46,303  |
| 別途積立金        |  | 24,606  |
| 繰越利益剰余金      |  | 21,697  |
| 評価・換算差額等     |  | 97      |
| その他有価証券評価差額金 |  | 97      |
| 純資産合計        |  | 77,996  |
| 負債・純資産合計     |  | 109,654 |

## 中間損益計算書

| 区分      | 注記<br>番号 | 自 2018年4月 1日<br>至 2018年9月30日<br>金額(百万円) |
|---------|----------|---|
| 営業収益    |          |   |
| 委託者報酬   |          | 60,780                                  |
| 運用受託報酬  |          | 11,904                                  |
| その他営業収益 |          | 172                                     |
| 営業収益計   |          | 72,858                                  |
| 営業費用    |          |   |
| 支払手数料   |          | 22,197                                  |
| 調査費     |          | 16,153                                  |
| その他営業費用 |          | 3,849                                   |
| 営業費用計   |          | 42,200                                  |
| 一般管理費   | 1        | 14,475                                  |
| 営業利益    |          | 16,181                                  |
| 営業外収益   | 2        | 6,812                                   |
| 営業外費用   | 3        | 183                                     |
| 経常利益    |          | 22,810                                  |
| 特別利益    | 4        | 38                                      |
| 特別損失    | 5        | 153                                     |

|              |  |        |
|--------------|--|--------|
| 税引前中間純利益     |  | 22,695 |
| 法人税、住民税及び事業税 |  | 5,121  |
| 法人税等調整額      |  | 927    |
| 中間純利益        |  | 16,646 |

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

(単位：百万円)

|                       | 株主資本   |        |          |         |       |          |         |         | 株主資本合計 |
|-----------------------|--------|--------|----------|---------|-------|----------|---------|---------|--------|
|                       | 資本金    | 資本剰余金  |          |         | 利益準備金 | その他利益剰余金 |         | 利益剰余金合計 |        |
|                       |        | 資本準備金  | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |       | 別途積立金    | 繰越利益剰余金 |         |        |
| 当期首残高                 | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606   | 29,876  | 55,168  | 86,078 |
| 当中間期変動額               |        |        |          |         |       |          |         |         |        |
| 剰余金の配当                |        |        |          |         |       |          | 24,826  | 24,826  | 24,826 |
| 中間純利益                 |        |        |          |         |       |          | 16,646  | 16,646  | 16,646 |
| 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             | -      | -      | -        | -       | -     | -        | 8,179   | 8,179   | 8,179  |
| 当中間期末残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606   | 21,697  | 46,989  | 77,899 |

(単位：百万円)

|                       | 評価・換算差額等     |            | 純資産合計  |
|-----------------------|--------------|------------|--------|
|                       | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 |        |
| 当期首残高                 | 11           | 11         | 86,090 |
| 当中間期変動額               |              |            |        |
| 剰余金の配当                |              |            | 24,826 |
| 中間純利益                 |              |            | 16,646 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額) | 85           | 85         | 85     |
| 当中間期変動額合計             | 85           | 85         | 8,094  |
| 当中間期末残高               | 97           | 97         | 77,996 |

## [重要な会計方針]

|                         |   |
|-------------------------|---|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法       | (1) 子会社株式及び関連会社株式...移動平均法による原価法<br>(2) その他有価証券<br>時価のあるもの... 中間決算日の市場価格等に基づく時価法<br>(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。)<br>時価のないもの... 移動平均法による原価法   |
| 2 運用目的の金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法によっております。  |
| 3 固定資産の減価償却の方法          | (1) 有形固定資産<br>定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016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、定額法によっております。<br><br>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産<br>定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、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。  |
| 4 引当金の計上基準              | (1) 貸倒引当金<br>一般債権については貸倒実績率等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。<br>(2) 賞与引当金<br>賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。<br>(3) 退職給付引当金<br>従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、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。<br>退職給付見込額の期間帰属方法<br>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。<br>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法<br>確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。<br>退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。<br>(4) 時効後支払損引当金<br>時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。 |
| 5 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、税抜き方式によっております。   |
| 6 連結納税制度の適用             | 連結納税制度を適用しております。  |

## [表示方法の変更]

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

[注記事項]

中間貸借対照表関係

| 2018年9月30日現在  |          |
|---|----------|
| 1 有形固定資産の減価償却累計額  | 3,847百万円 |
| 2 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、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。 |          |

中間損益計算書関係

|                 |  | 自 2018年4月 1日 | 至 2018年9月30日 |
|-----------------|--|--------------|--------------|
| 1 減価償却実施額       |  |              |              |
| 有形固定資産          |  | 80百万円        |              |
| 無形固定資産          |  | 1,318百万円     |              |
| 2 営業外収益のうち主要なもの |  |              |              |
| 受取配当金           |  | 6,538百万円     |              |
| 3 営業外費用のうち主要なもの |  |              |              |
| 支払利息            |  | 1百万円         |              |
| 金銭信託運用損         |  | 121百万円       |              |
| 時効後支払損引当金繰入     |  | 38百万円        |              |
| 為替差損            |  | 17百万円        |              |
| 4 特別利益の内訳       |  |              |              |
| 投資有価証券等売却益      |  | 0百万円         |              |
| 株式報酬受入益         |  | 37百万円        |              |
| 5 特別損失の内訳       |  |              |              |
| 固定資産除却損         |  | 153百万円       |              |

中間株主資本等変動計算書関係

|               |       | 自 2018年4月 1日 | 至 2018年9月30日 |    |            |  |
|---------------|-------|--------------|--------------|----|------------|--|
| 1 発行済株式に関する事項 |       |              |              |    |            |  |
|               | 株式の種類 | 当事業年度期首      | 増加           | 減少 | 当中間会計期間末   |  |
|               | 普通株式  | 5,150,693株   | -            | -  | 5,150,693株 |  |



## 2 配当に関する事項

## 配当金支払額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

|              |            |
|--------------|------------|
| (1) 配当金の総額   | 24,826百万円  |
| (2) 1株当たり配当額 | 4,820円     |
| (3) 基準日      | 2018年3月31日 |
| (4) 効力発生日    | 2018年6月25日 |

## 金融商品関係

当中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

2018年9月30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 | 時価     | 差額 |
|-----------------|------------|--------|----|
| (1)現金・預金        | 948        | 948    | -  |
| (2)金銭の信託        | 43,002     | 43,002 | -  |
| (3)未収委託者報酬      | 25,448     | 25,448 | -  |
| (4)未収運用受託報酬     | 6,582      | 6,582  | -  |
| (5)有価証券及び投資有価証券 |            |        |    |
| その他有価証券         | 6,700      | 6,700  | -  |
| 資産計             | 82,682     | 82,682 | -  |
| (6)未払金          | 12,817     | 12,817 | -  |
| 未払収益分配金         | 0          | 0      | -  |
| 未払償還金           | 25         | 25     | -  |
| 未払手数料           | 8,085      | 8,085  | -  |
| その他未払金          | 4,704      | 4,704  | -  |
| (7)未払費用         | 11,109     | 11,109 | -  |
| (8)未払法人税等       | 1,588      | 1,588  | -  |
| 負債計             | 25,515     | 25,515 | -  |

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金・預金

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。

## (2) 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・委託証拠金等）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取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ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。

## (3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

これら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。

## (5) 有価証券及び投資有価証券

## その他有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、譲渡性預金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。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

## (6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これら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。

注2：非上場株式等（中間貸借対照表計上額：投資有価証券2,582百万円、関係会社株式11,477百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、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」には含めておりません。

## 有価証券関係

当中間会計期間末（2018年9月30日）

## 1．満期保有目的の債券(2018年9月30日)

該当事項はありません。

## 2．子会社株式及び関連会社株式(2018年9月30日)

該当事項はありません。

## 3．その他有価証券(2018年9月30日)

| 区分                             | 中間貸借対照表<br>計上額<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(百万円) |
|--------------------------------|-------------------------|---------------|-------------|
| 中間貸借対照表計上額<br>が取得原価を超えない<br>もの |                         |               |             |
| 譲渡性預金                          | 6,700                   | 6,700         | -           |
| 小計                             | 6,700                   | 6,700         | -           |
| 合計                             | 6,700                   | 6,700         | -           |

## セグメント情報等

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 1 株当たり情報

|   | 自 2018年4月 1日<br>至 2018年9月30日 |
|---|------------------------------|
| 1 株当たり純資産額  | 15,142円86銭                   |
| 1 株当たり中間純利益   | 3,231円95銭                    |
| (注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。 |                              |
| 2. 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。                             |                              |
| 中間純利益   | 16,646百万円                    |
| 普通株主に帰属しない金額  | -                            |
| 普通株式に係る中間純利益  | 16,646百万円                    |
| 期中平均株式数   | 5,150千株                      |

## 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

< 更新後 >

## (1) 受託者

| (a) 名称     | (b) 資本金の額 <sup>*</sup> | (c) 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(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。 |

\* 2019年1月末現在

## (2)販売会社

| (a)名称    | (b)資本金の額 <sup>*</sup> | (c)事業の内容                        |
|----------|-----------------------|---------------------------------|
| 野村証券株式会社 | 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。 |

\* 2019年1月末現在

## 独立監査人の監査報告書

2019年3月8日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

|                    |       |      |
|--------------------|-------|------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 亀井純子 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 伊藤志保 |

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」に掲げられている野村RAFI(R)日本株投信の2018年7月14日から2019年1月15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、野村RAFI(R)日本株投信の2019年1月15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

野村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。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2018年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 森 重 俊 寛指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻 井 雄 一 郎指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 津 村 健 二 郎

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」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2017年4月1日から2018年3月31日までの第59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、野村アセットマネジメント株式会社の2018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。

#### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は2018年4月6日付でエイト・リミテッドの株式を取得するとともに、同社の子会社であったエイト証券株式会社の株式を取得している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

#### 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

2018年11月21日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 亀井純子指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井雄一郎指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 津村健二郎

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」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018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、分析的な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、野村アセットマネジメント株式会社の2018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（2018年4月1日から2018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。