

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2018年5月11日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスファンドTSP
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】**（１）【ファンドの名称】**

インデックスファンドTSP（以下「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。

- ・基準価額につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は2.16%（税抜2%）が上限となっております。

（６）【申込単位】

販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2018年5月12日から2019年5月10日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（９）【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信	
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

国内

目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

株式

目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

インデックス型

目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（株式 一般））

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1 TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

- ・主として、「インデックス マザーファンド TOPIX」への投資を通じて、東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資を行ない、日本株式市場全体の動きをとらえ、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ・中長期にわたって保有することで、日本経済の成長を享受することが期待できます。

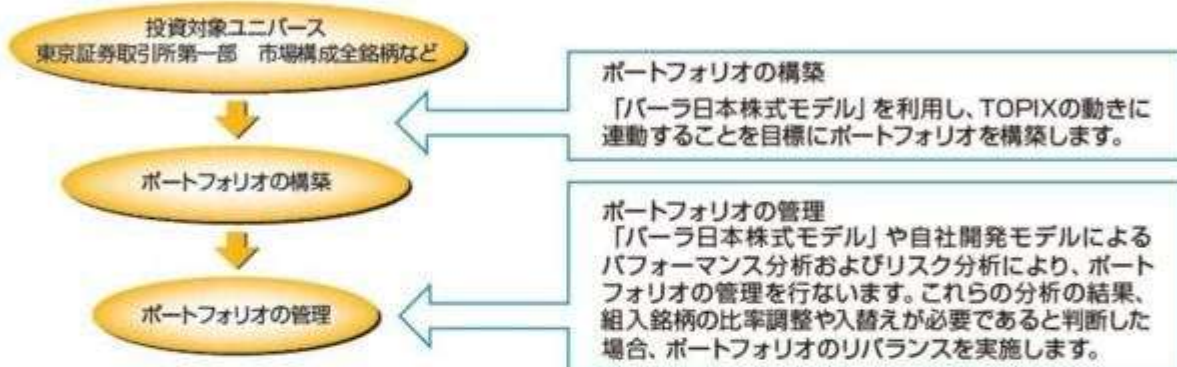
TOPIX（東証株価指数）とは

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

2 株式の実質組入比率は高位を保ちます。

株式組入比率（マザーファンドにおいて保有する株式を含みます。）は、原則として高位を維持します。したがって、基準価額は大きく変動することがあります。

<「インデックス マザーファンド TOPIX」の運用プロセス>



※上記は、2018年2月末現在のプロセスであり、将来変更となる場合があります。

なお、当ファンドの基準価額とTOPIX（東証株価指数）の動きのカイ離は、主として株式の配当金、信託報酬の費用負担、組入銘柄の選定に伴う影響などにより生じます。

バラ日本株式モデル

日本株式への投資から期待される収益（必然的にリスクを伴います。）の発生源を、①市場全体の動き、②財務・株式関連データから開発された個別銘柄の株価変動指標、③業種指標、④ポートフォリオ（または個別銘柄）固有の特性などからもたらされる部分に分解・分析し、数値化します。これらのデータをもとに、常に市場全体の株価変動の性格分析を行なうと同時に、検証を重ねつつ最適なポートフォリオを求めます。

ファンドの仕組み

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



（主な投資制限）・株式への実質投資割合には制限を設けません。
・外貨建資産への投資は行ないません。

（配分方針） 毎決算時に、利子・配当等収益を中心に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

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

（2）【ファンドの沿革】

1986年2月13日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

2001年10月26日

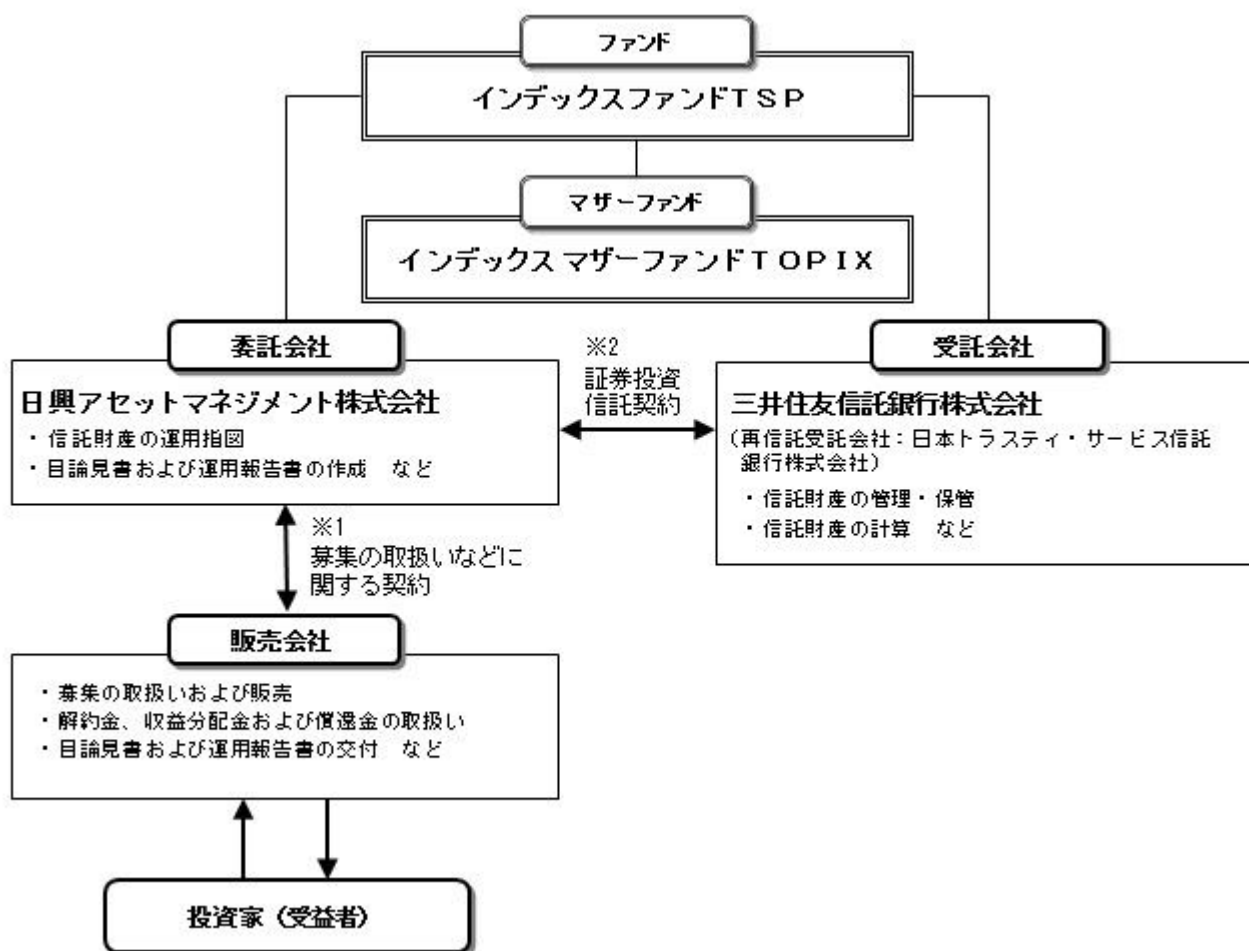
- ・ファミリーファンド方式の導入

2002年11月13日

- ・信託期間を無期限に変更

（３）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2018年2月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

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

2 【投資方針】

（１）【投資方針】

- ・「インデックス マザーファンド TOPIX」受益証券に投資を行なうとともに、わが国の金融商品取

引所上場株式に投資を行ない、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きに連動した投資成果をめざします。

- ・投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、株式（マザーファンドにおいて保有する株式を含みます。）への投資にあたっては、「パーラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行ないます。

東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行ないます。

資金の流出入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。

株式の組入比率は、高位を保ちます。

- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

<インデックスファンドＴＳＰ>

「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券ならびに東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条の2および第20条の6に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
- 2) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 3) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)の証券の性質を有するもの
- 4) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
- 5) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
- 6) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 7) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

次の取引ができます。

- 1) 信用取引

- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 有価証券の貸付
- 5) 資金の借入

<インデックス マザーファンド T O P I X >

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第18条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
- 2) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 3) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)の証券の性質を有するもの
- 4) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 5) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
- 6) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 7) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 有価証券の貸付

投資対象とするマザーファンドの概要

<インデックス マザーファンド T O P I X >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X（東証株価指数） [*] の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 投資成果をTOPIX（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、「バラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行います。 東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行ないます。 資金の流出入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。 株式の組入比率は、高位を保ちます。 株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

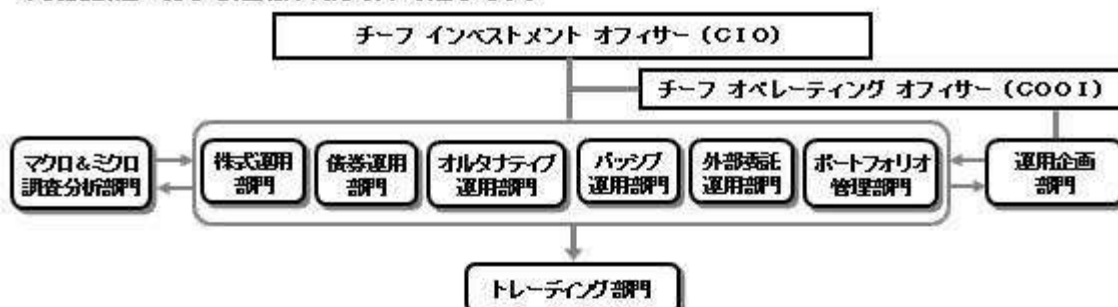
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
決算日	毎年2月12日（休業日の場合は翌営業日）

* TOPIX（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。

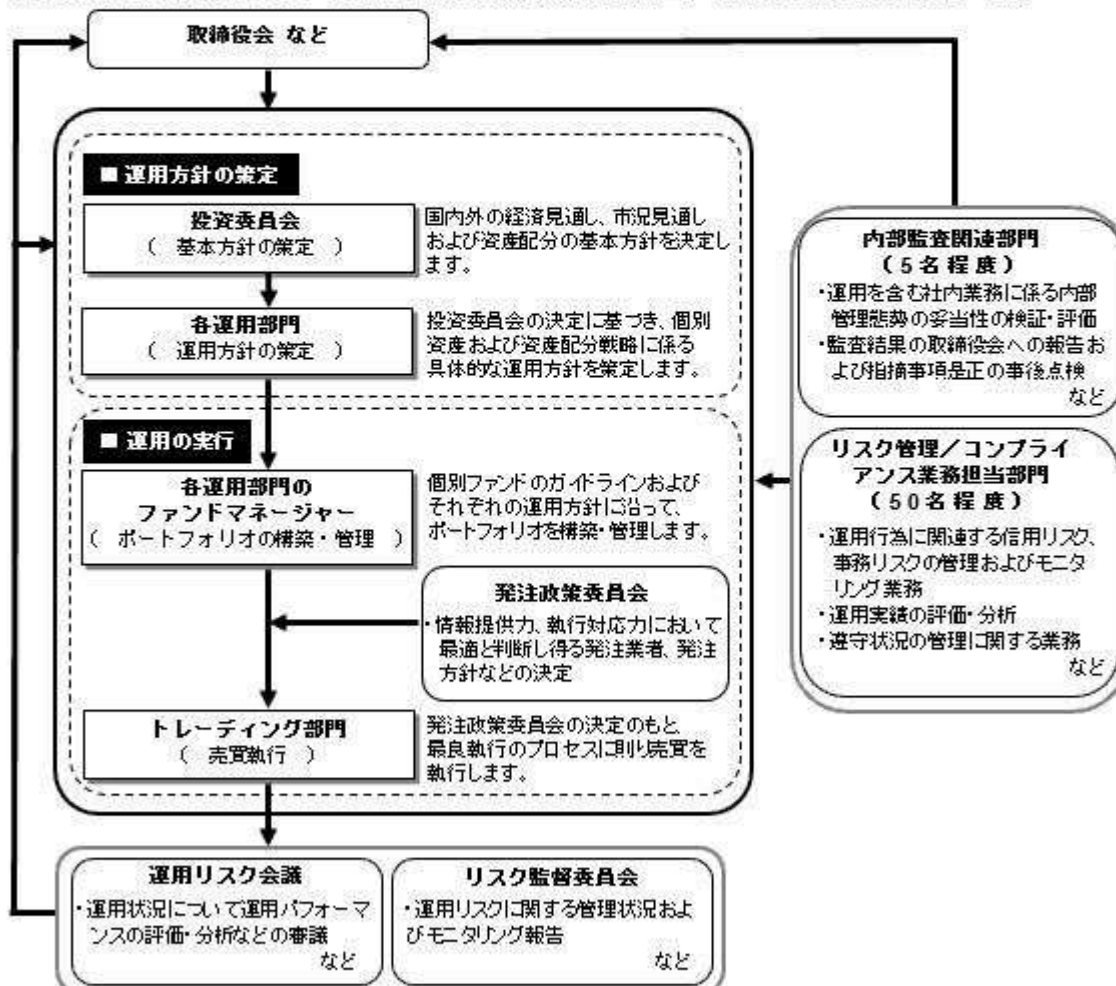
TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

（3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は2018年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針
利子・配当等収益を中心に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
- 3) 留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用

を行いません。

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

<分配金受取りコース>

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

<インデックスファンドTSP>

1) 株式への実質投資割合には制限を設けません。

2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

4) 外貨建資産への投資は行ないません。

5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

ロ) 株式分割により取得する株券

ハ) 有償増資により取得する株券

ニ) 売り出しにより取得する株券

ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使ならびに信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権ホ)に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

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

7) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第17条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 11) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 12) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<インデックス マザーファンド TOPIX>

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
- イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- ロ) 株式分割により取得する株券
- ハ) 有償増資により取得する株券
- ニ) 売り出しにより取得する株券
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げる

ものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号八に掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券指数等先物取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

- 7) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第13条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第13条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

- ・ 投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・ 当ファンドは、主に株式を実質的な投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

流動性リスク

市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

< T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主なカイ離要因 >

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

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

< その他の留意事項 >

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

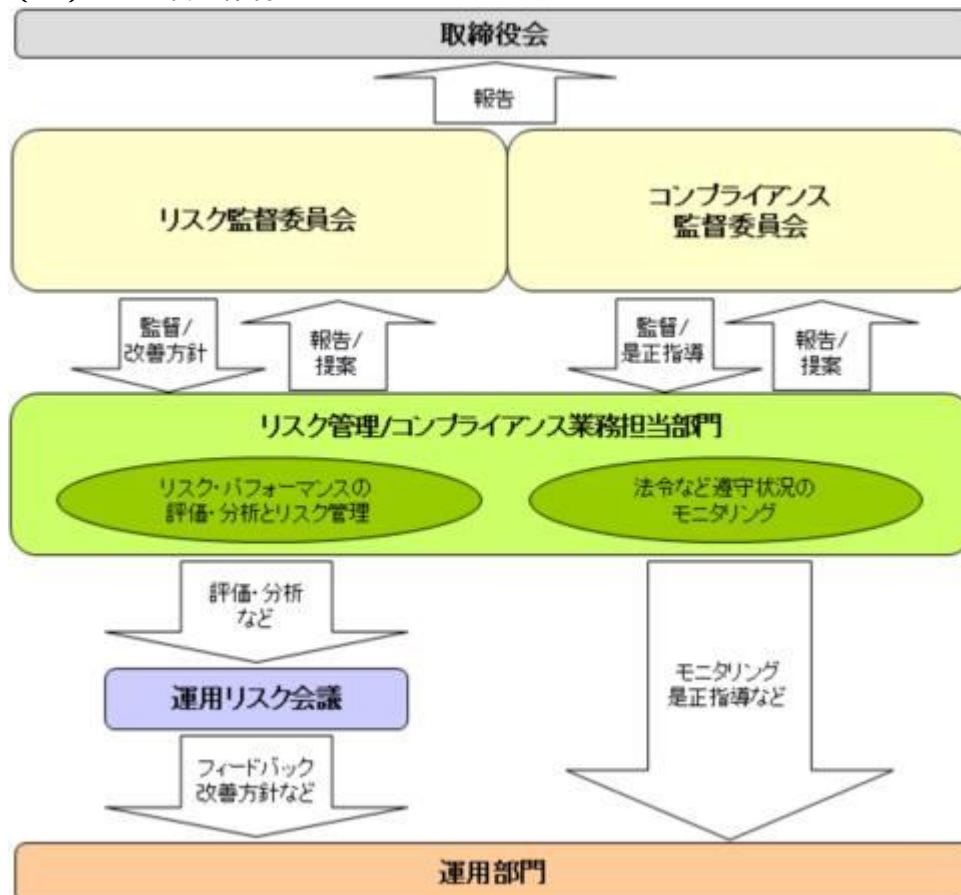
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



全社的なリスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

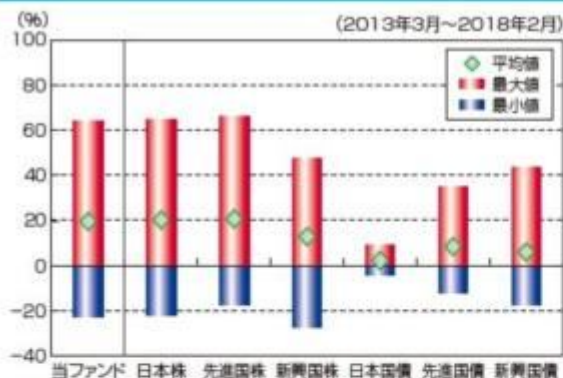
法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2018年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	19.5%	20.2%	20.6%	12.8%	2.3%	8.4%	6.0%
最大値	64.2%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	-22.4%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2013年3月から2018年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株 …… 東証株価指数 (TOPIX、配当込)

先進国株 …… MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース)

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

日本国債 …… NOMURA-BPI国債

先進国債 …… FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数 (TOPIX、配当込)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2013年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数は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GBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

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

4【手数料等及び税金】**（1）【申込手数料】**

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は2.16%（税抜2%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができます場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

（3）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.5616%（税抜0.52%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬（有価証券届出書提出日現在）の配分（年率）は、以下の通りとします。

販売会社毎の純資産総額	信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
1,000億円以下の部分	0.52%	0.22%	0.20%	0.10%
1,000億円超の部分		0.17%	0.25%	

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該

終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。)および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

(4) 【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

- ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
- ・信託事務の処理に要する諸費用
- ・信託財産に関する租税 など

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

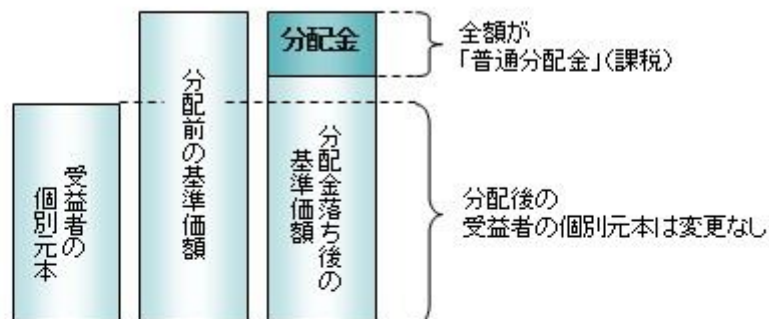
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

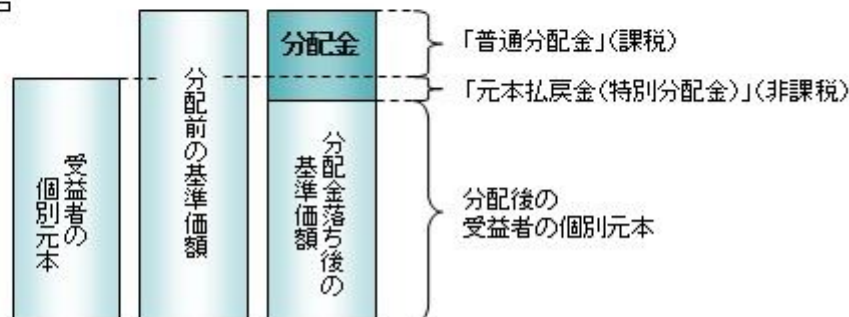
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2018年5月11日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【インデックスファンドTSP】

以下の運用状況は2018年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	23,804,838,502	97.03
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		728,761,583	2.97
合計（純資産総額）		24,533,600,085	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	724,880,000	2.95

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	11,182,805,704	2.0667	23,111,504,549	2.1287	23,804,838,502	97.03

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.03
合計	97.03

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2018年03月	買建	41	日本円	709,006,880	724,880,000	2.95

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第23計算期間末 (2009年 2月12日)	17,672	17,854	0.3881	0.3921
第24計算期間末 (2010年 2月12日)	22,199	22,491	0.4558	0.4618
第25計算期間末 (2011年 2月14日)	24,740	25,043	0.4909	0.4969
第26計算期間末 (2012年 2月13日)	20,778	21,089	0.4011	0.4071
第27計算期間末 (2013年 2月12日)	25,203	25,608	0.4980	0.5060
第28計算期間末 (2014年 2月12日)	26,006	26,338	0.6275	0.6355
第29計算期間末 (2015年 2月12日)	27,404	27,771	0.7464	0.7564
第30計算期間末 (2016年 2月12日)	20,550	20,885	0.6143	0.6243
第31計算期間末 (2017年 2月13日)	24,644	24,951	0.8013	0.8113
第32計算期間末 (2018年 2月13日)	23,554	23,873	0.8864	0.8984
2017年 2月末日	24,371		0.7917	
3月末日	24,545		0.7866	
4月末日	24,683		0.7964	
5月末日	24,376		0.8156	
6月末日	24,490		0.8387	
7月末日	24,276		0.8417	
8月末日	24,132		0.8409	
9月末日	24,658		0.8770	
10月末日	25,068		0.9244	
11月末日	25,217		0.9379	
12月末日	25,362		0.9518	
2018年 1月末日	25,446		0.9615	
2月末日	24,533		0.9131	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第23期	2008年 2月13日～2009年 2月12日	0.0040
第24期	2009年 2月13日～2010年 2月12日	0.0060
第25期	2010年 2月13日～2011年 2月14日	0.0060
第26期	2011年 2月15日～2012年 2月13日	0.0060
第27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	0.0080
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	0.0080

第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	0.0100
第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	0.0100
第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	0.0100
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	0.0120

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第23期	2008年 2月13日～2009年 2月12日	40.10
第24期	2009年 2月13日～2010年 2月12日	18.99
第25期	2010年 2月13日～2011年 2月14日	9.02
第26期	2011年 2月15日～2012年 2月13日	17.07
第27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	26.15
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	27.61
第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	20.54
第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	16.36
第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	32.07
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	12.12

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第23期	2008年 2月13日～2009年 2月12日	15,064,274,334	6,020,886,388
第24期	2009年 2月13日～2010年 2月12日	10,539,361,357	7,372,791,814
第25期	2010年 2月13日～2011年 2月14日	8,326,706,473	6,627,979,535
第26期	2011年 2月15日～2012年 2月13日	8,796,604,597	7,398,051,340
第27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	9,449,720,873	10,636,174,809
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	13,799,258,867	22,968,753,955
第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	6,408,687,971	11,137,684,985
第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	6,211,940,096	9,472,751,226
第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	3,331,269,772	6,027,353,049
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	6,031,038,498	10,213,544,441

（参考）

インデックス マザーファンド T O P I X

以下の運用状況は2018年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	41,623,987,290	99.71
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		121,527,990	0.29
合計（純資産総額）		41,745,515,280	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	123,760,000	0.30

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	200,200	7,276.10	1,456,676,200	7,235.00	1,448,447,000	3.47
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,137,700	767.52	873,207,504	762.30	867,268,710	2.08
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	73,200	8,991.52	658,179,400	8,895.00	651,114,000	1.56
日本	株式	ソニー	電気機器	110,100	5,100.74	561,592,315	5,442.00	599,164,200	1.44
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	116,000	4,690.72	544,124,000	4,982.00	577,912,000	1.38
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	123,000	4,684.65	576,212,100	4,686.00	576,378,000	1.38
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	148,200	3,730.40	552,846,500	3,885.00	575,757,000	1.38
日本	株式	キーエンス	電気機器	8,100	63,452.83	513,968,000	65,270.00	528,687,000	1.27
日本	株式	任天堂	その他製品	10,100	44,400.00	448,440,000	49,080.00	495,708,000	1.19
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,207,100	195.94	432,459,810	199.40	440,095,740	1.05
日本	株式	ファナック	電気機器	15,600	26,815.00	418,314,000	27,310.00	426,036,000	1.02
日本	株式	KDDI	情報・通信業	145,500	2,597.78	377,978,250	2,635.50	383,465,250	0.92
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	60,700	5,900.08	358,135,000	6,112.00	370,998,400	0.89
日本	株式	キヤノン	電気機器	88,700	3,935.14	349,047,100	4,096.00	363,315,200	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	113,800	2,921.93	332,516,200	3,016.00	343,220,800	0.82
日本	株式	日本電産	電気機器	19,800	16,662.92	329,926,000	17,260.00	341,748,000	0.82
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	119,600	2,650.05	316,947,000	2,745.00	328,302,000	0.79
日本	株式	信越化学工業	化学	28,700	11,166.08	320,466,500	11,375.00	326,462,500	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	396,000	807.96	319,956,000	818.00	323,928,000	0.78

日本	株式	花王	化学	40,500	7,848.30	317,856,300	7,852.00	318,006,000	0.76
日本	株式	パナソニック	電気機器	188,200	1,593.93	299,977,900	1,677.50	315,705,500	0.76
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	121,400	2,424.00	294,274,700	2,592.00	314,668,800	0.75
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	102,300	3,126.10	319,801,000	3,048.00	311,810,400	0.75
日本	株式	小松製作所	機械	79,500	3,833.09	304,731,000	3,916.00	311,322,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	61,200	4,866.13	297,807,200	4,966.00	303,919,200	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	68,000	4,444.41	302,220,000	4,461.00	303,348,000	0.73
日本	株式	三菱電機	電気機器	164,700	1,840.91	303,198,900	1,817.00	299,259,900	0.72
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	29,600	10,201.18	301,955,000	10,060.00	297,776,000	0.71
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	14,800	19,675.94	291,204,000	19,950.00	295,260,000	0.71
日本	株式	ダイキン工業	機械	22,500	12,174.62	273,929,000	12,650.00	284,625,000	0.68

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.32
		建設業	3.09
		食料品	4.18
		繊維製品	0.70
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.25
		医薬品	4.64
		石油・石炭製品	0.67
		ゴム製品	0.88
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.13
		非鉄金属	0.95
		金属製品	0.68
		機械	5.63
		電気機器	14.06
		輸送用機器	8.99
		精密機器	1.65
		その他製品	2.23
		電気・ガス業	1.52
		陸運業	3.88
		海運業	0.22
		空運業	0.60
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	7.27		
卸売業	4.76		
小売業	4.70		
銀行業	7.23		

	証券、商品先物取引業	1.00
	保険業	2.18
	その他金融業	1.21
	不動産業	2.32
	サービス業	4.22
合 計		99.71

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2018年03月	買建		7日本円	119,560,000	123,760,000	0.30

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

参考情報

運用実績

2018年2月28日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額..... 9,131円
純資産総額..... 245.33億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2008年2月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2014年2月	2015年2月	2016年2月	2017年2月	2018年2月	設定来累計
80円	100円	100円	100円	120円	4,300円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	100.0%
うち先物	3.2%
CB	0.0%
公社債	0.0%
現金その他	3.3%
外貨建資産	0.0%

※当ファンドの実質組入比率です。

<株式組入上位5業種>

	業種	比率
1	電気機器	14.1%
2	輸送用機器	9.0%
3	情報・通信業	7.3%
4	化学	7.3%
5	銀行業	7.2%

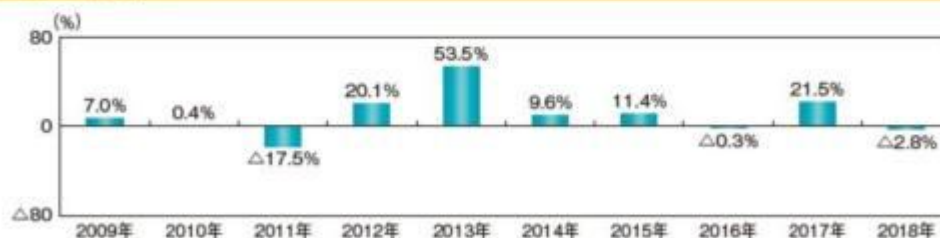
※マザーファンドの対組入株式時価総額比です。

<株式組入上位10銘柄> (銘柄数:2,028銘柄)

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.47%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.08%
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.56%
4	ソニー	電気機器	1.44%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.38%
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.38%
7	本田技研工業	輸送用機器	1.38%
8	キーエンス	電気機器	1.27%
9	任天堂	その他製品	1.19%
10	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.05%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
※2018年は、2018年2月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、<分配金再投資コース>と<分配金受取りコース>の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

<分配金再投資コース>

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

<分配金受取りコース>

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(5) 申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

(6) 申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(7) 申込代金の支払い

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

(8) 受付の中止および取消

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

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

(9) 償還乗換

・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(10) 乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

< 買取請求による換金 >

(1) 買取りの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(3) 買取制限

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

(4) 買取価額

買取請求受付日の基準価額から、当該買取りを行なう販売会社に係る源泉徴収税額に相当する金額を控除した価額となります。なお、一定の要件の下では、買取請求受付日の基準価額となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(6) 買取単位

1口単位

販売会社によっては、買取単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(7) 受付の中止および取消

- ・販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて買取りを中止すること、および既に受け付けた買取りを取り消すことができます。
- ・買取請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

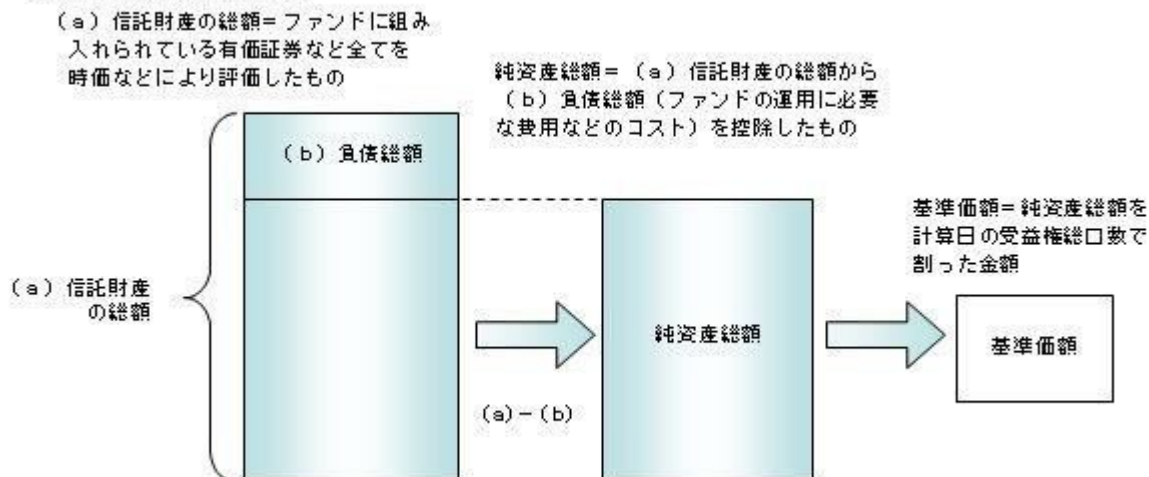
(1)【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を評価して得た信託財

産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（1986年2月13日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年2月13日から翌年2月12日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) 対象インデックスが改廃の場合

ニ) やむを得ない事情が発生したとき

- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
 - 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
 - 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
 - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

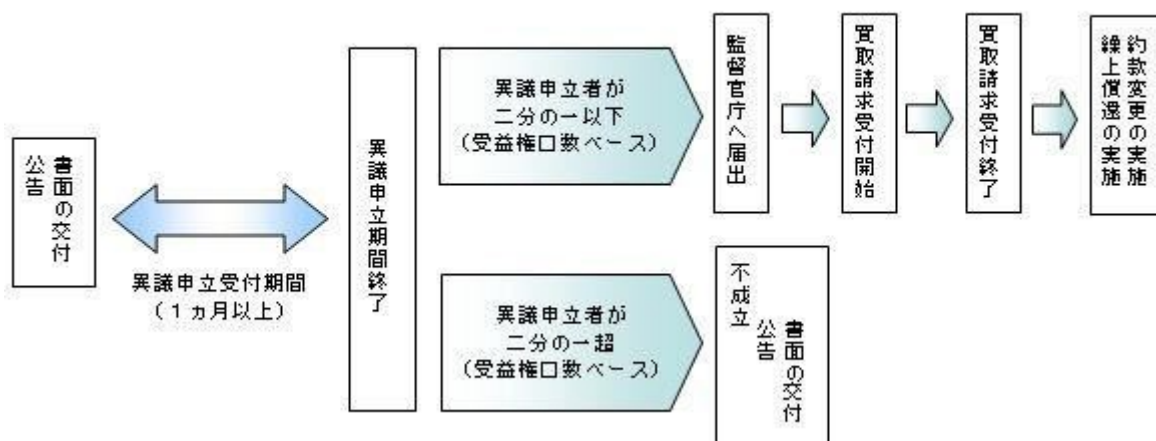
信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行いません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期計算期間（平成29年 2月14日から平成30年 2月13日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【インデックスファンドTSP】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第31期 平成29年 2月13日現在	第32期 平成30年 2月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	572,601,574	581,432,186
親投資信託受益証券	24,432,401,013	23,247,963,661
派生商品評価勘定	9,165,960	-
未収入金	27,819,600	117,000,000
前払金	-	34,010,000
差入委託証拠金	19,065,000	20,520,000
流動資産合計	25,061,053,147	24,000,925,847
資産合計	25,061,053,147	24,000,925,847
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	101,080	38,488,360
前受金	9,765,000	-
未払金	-	1,939,320
未払収益分配金	307,563,450	318,886,069
未払解約金	30,658,986	15,664,445
未払受託者報酬	13,109,566	13,538,501
未払委託者報酬	55,060,455	56,861,970
未払利息	500	494
その他未払費用	642,307	663,329
流動負債合計	416,901,344	446,042,488
負債合計	416,901,344	446,042,488
純資産の部		
元本等		
元本	30,756,345,067	26,573,839,124
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,112,193,264	3,018,955,765
（分配準備積立金）	5,441,752,798	5,855,288,014
元本等合計	24,644,151,803	23,554,883,359
純資産合計	24,644,151,803	23,554,883,359
負債純資産合計	25,061,053,147	24,000,925,847

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第31期		第32期	
	自	平成28年 2月13日 至 平成29年 2月13日	自	平成29年 2月14日 至 平成30年 2月13日
営業収益				
受取利息		4,472		1,745
有価証券売買等損益		6,480,499,174		2,961,562,648
派生商品取引等損益		169,251,460		32,886,160
営業収益合計		6,649,755,106		2,994,450,553
営業費用				
支払利息		150,627		244,699
受託者報酬		25,430,983		26,702,020
委託者報酬		106,810,689		112,149,014
その他費用		1,247,715		1,309,092
営業費用合計		133,640,014		140,404,825
営業利益又は営業損失（ ）		6,516,115,092		2,854,045,728
経常利益又は経常損失（ ）		6,516,115,092		2,854,045,728
当期純利益又は当期純損失（ ）		6,516,115,092		2,854,045,728
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（ ）		737,288,474		507,787,084
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		12,901,751,733		6,112,193,264
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,301,857,922		2,014,240,836
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,301,857,922		2,014,240,836
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		983,562,621		948,375,912
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		983,562,621		948,375,912
分配金		307,563,450		318,886,069
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,112,193,264		3,018,955,765

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月13日から翌年2月12日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものとしたしますので、当計算期間は平成29年 2月14日から平成30年 2月13日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第31期 平成29年 2月13日現在	第32期 平成30年 2月13日現在
1.	期首元本額	33,452,428,344円	30,756,345,067円
	期中追加設定元本額	3,331,269,772円	6,031,038,498円
	期中一部解約元本額	6,027,353,049円	10,213,544,441円
2.	受益権の総数	30,756,345,067口	26,573,839,124口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	6,112,193,264円	3,018,955,765円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第31期 自 平成28年 2月13日 至 平成29年 2月13日		第32期 自 平成29年 2月14日 至 平成30年 2月13日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 458,905,043円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 438,871,779円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 1,410,185,892円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 1,907,386,865円
C	信託約款に定める収益調整金 13,411,078,123円	C	信託約款に定める収益調整金 12,474,080,283円
D	信託約款に定める分配準備積立 金 3,880,225,313円	D	信託約款に定める分配準備積立 金 3,827,915,439円
E	分配対象収益 (A+B+C+D) 19,160,394,371円	E	分配対象収益 (A+B+C+D) 18,648,254,366円
F	分配対象収益(1万口当たり) 6,229円	F	分配対象収益(1万口当たり) 7,017円
G	分配金額 307,563,450円	G	分配金額 318,886,069円
H	分配金額(1万口当たり) 100円	H	分配金額(1万口当たり) 120円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第31期 自 平成28年 2月13日 至 平成29年 2月13日	第32期 自 平成29年 2月14日 至 平成30年 2月13日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第31期 平成29年 2月13日現在	第32期 平成30年 2月13日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

	第31期 平成29年 2月13日現在	第32期 平成30年 2月13日現在
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

第31期（平成29年 2月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	5,804,345,717
合計	5,804,345,717

第32期（平成30年 2月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,495,715,763
合計	2,495,715,763

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

第31期（平成29年 2月13日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	425,900,000	-	434,980,000	9,080,000
	合計	425,900,000	-	434,980,000	9,080,000

第32期（平成30年 2月13日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	619,190,000	-	580,720,000	38,470,000
	合計	619,190,000	-	580,720,000	38,470,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第31期 平成29年 2月13日現在		第32期 平成30年 2月13日現在	
1口当たり純資産額	0.8013円	1口当たり純資産額	0.8864円
(1万口当たり純資産額)	(8,013円)	(1万口当たり純資産額)	(8,864円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド TOPIX	11,252,099,928	23,247,963,661	
	合計	11,252,099,928	23,247,963,661	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

（参考）

インデックス マザーファンド T O P I X

貸借対照表

（単位：円）		
	平成29年 2月13日現在	平成30年 2月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	81,513,655	171,760,788
株式	39,735,915,550	40,156,024,100
派生商品評価勘定	3,345,680	-
未収入金	1,430,092	-
未収配当金	57,715,137	56,464,087
前払金	-	4,675,000
流動資産合計	39,879,920,114	40,388,923,975
資産合計	39,879,920,114	40,388,923,975
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	5,938,780
前受金	3,030,000	-
未払解約金	26,143,835	117,000,000
未払利息	71	146
流動負債合計	29,173,906	122,938,926
負債合計	29,173,906	122,938,926
純資産の部		
元本等		
元本	21,754,017,768	19,489,325,256
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	18,096,728,440	20,776,659,793
元本等合計	39,850,746,208	40,265,985,049
純資産合計	39,850,746,208	40,265,985,049
負債純資産合計	39,879,920,114	40,388,923,975

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p>
--------------------	--

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成29年 2月13日現在	平成30年 2月13日現在
1.	期首	平成28年 2月13日	平成29年 2月14日
	期首元本額	23,266,353,259円	21,754,017,768円
	期首からの追加設定元本額	2,231,142,408円	2,186,701,894円
	期首からの一部解約元本額	3,743,477,899円	4,451,394,406円
	元本の内訳		
	インデックスファンドTSP	13,337,191,448円	11,252,099,928円
	インデックスファンドTOPIX（日本株式）	7,770,505,645円	7,606,555,954円
	TOPIXインデックスファンド（個人型年金向け）	501,436,109円	434,528,550円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	41,975,830円	40,301,147円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-08	44,235,688円	29,471,220円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	23,470,438円	37,606,958円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-11	35,202,610円	41,976,298円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	- 円	18,587,439円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	- 円	28,197,762円
	計	21,754,017,768円	19,489,325,256円
2.	受益権の総数	21,754,017,768口	19,489,325,256口
3.	担保資産		
	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
	株式	285,030,000円	304,980,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成28年 2月13日 至 平成29年 2月13日	自 平成29年 2月14日 至 平成30年 2月13日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 2月13日現在	平成30年 2月13日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

（平成29年 2月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	8,925,010,118
合計	8,925,010,118

（平成30年 2月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,686,550,888
合計	3,686,550,888

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成29年 2月13日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	120,930,000	-	124,280,000	3,350,000
	合計	120,930,000	-	124,280,000	3,350,000

（平成30年 2月13日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	125,495,000	-	119,560,000	5,935,000

合計	125,495,000	-	119,560,000	5,935,000
----	-------------	---	-------------	-----------

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成29年 2月13日現在		平成30年 2月13日現在	
1口当たり純資産額	1.8319円	1口当たり純資産額	2.0661円
(1万口当たり純資産額)	(18,319円)	(1万口当たり純資産額)	(20,661円)

附属明細表

第1 有価証券明細表
(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	700	3,695.00	2,586,500	
日本水産	20,700	523.00	10,826,100	
マルハニチロ	3,500	3,210.00	11,235,000	
カネコ種苗	600	1,552.00	931,200	
サカタのタネ	2,700	3,500.00	9,450,000	
ホクト	1,900	1,979.00	3,760,100	
ホクリヨウ	300	1,442.00	432,600	
住石ホールディングス	4,900	150.00	735,000	
日鉄鉱業	500	6,550.00	3,275,000	
三井松島産業	1,000	1,467.00	1,467,000	
国際石油開発帝石	89,100	1,301.00	115,919,100	
日本海洋掘削	700	2,167.00	1,516,900	
石油資源開発	2,900	2,515.00	7,293,500	
K&Oエナジーグループ	1,100	1,689.00	1,857,900	
ショーボンドホールディングス	1,700	7,530.00	12,801,000	
ミライト・ホールディングス	5,700	1,577.00	8,988,900	

サンヨーホームズ	400	816.00	326,400
ファーストコーポレーション	600	1,399.00	839,400
ベステラ	300	1,795.00	538,500
インベスターズクラウド	1,500	1,622.00	2,433,000
ダイセキ環境ソリューション	400	1,122.00	448,800
第一カッター興業	200	1,859.00	371,800
安藤・間	14,200	753.00	10,692,600
東急建設	7,100	1,158.00	8,221,800
コムシスホールディングス	6,500	2,669.00	17,348,500
ミサワホーム	1,500	819.00	1,228,500
高松コンストラクショングループ	1,200	2,980.00	3,576,000
東建コーポレーション	700	11,340.00	7,938,000
ソネック	300	783.00	234,900
ヤマウラ	900	913.00	821,700
大成建設	18,200	5,050.00	91,910,000
大林組	55,000	1,168.00	64,240,000
清水建設	56,100	970.00	54,417,000
飛鳥建設	16,900	169.00	2,856,100
長谷工コーポレーション	21,400	1,524.00	32,613,600
松井建設	2,000	821.00	1,642,000
銭高組	300	5,340.00	1,602,000
鹿島建設	81,000	991.00	80,271,000
不動テトラ	14,400	183.00	2,635,200
大末建設	600	1,026.00	615,600
鉄建建設	1,100	2,890.00	3,179,000
西松建設	4,200	2,661.00	11,176,200
三井住友建設	13,300	601.00	7,993,300
大豊建設	7,000	532.00	3,724,000
前田建設工業	13,100	1,286.00	16,846,600
ナカノフドー建設	1,400	587.00	821,800
奥村組	3,000	4,485.00	13,455,000
東鉄工業	2,200	3,210.00	7,062,000
イチケン	300	2,412.00	723,600
浅沼組	7,000	441.00	3,087,000
戸田建設	21,000	784.00	16,464,000
熊谷組	2,900	3,025.00	8,772,500
青木あすなろ建設	1,200	968.00	1,161,600
北野建設	4,000	438.00	1,752,000
植木組	200	2,670.00	534,000
三井ホーム	2,000	643.00	1,286,000
矢作建設工業	2,500	834.00	2,085,000
ピーエス三菱	2,200	805.00	1,771,000

日本ハウスホールディングス	3,600	617.00	2,221,200
大東建託	6,600	17,915.00	118,239,000
新日本建設	2,200	970.00	2,134,000
N I P P O	4,000	2,563.00	10,252,000
東亜道路工業	400	3,980.00	1,592,000
前田道路	6,000	2,201.00	13,206,000
日本道路	500	5,900.00	2,950,000
東亜建設工業	1,500	2,257.00	3,385,500
若築建設	1,000	1,662.00	1,662,000
東洋建設	5,800	520.00	3,016,000
五洋建設	21,800	758.00	16,524,400
世紀東急工業	2,600	658.00	1,710,800
福田組	600	6,140.00	3,684,000
住友林業	11,700	1,771.00	20,720,700
日本基礎技術	2,100	376.00	789,600
日成ビルド工業	2,700	1,149.00	3,102,300
ヤマダ・エスバイエルホーム	9,000	79.00	711,000
巴コーポレーション	2,300	544.00	1,251,200
大和ハウス工業	54,100	3,866.00	209,150,600
ライト工業	3,600	1,129.00	4,064,400
積水ハウス	59,600	1,836.00	109,425,600
日特建設	1,700	637.00	1,082,900
北陸電気工事	1,000	1,071.00	1,071,000
ユアテック	2,900	838.00	2,430,200
西部電気工業	300	2,500.00	750,000
四電工	300	2,753.00	825,900
中電工	2,400	2,923.00	7,015,200
関電工	7,300	1,169.00	8,533,700
きんでん	12,200	1,699.00	20,727,800
東京エネシス	2,100	1,158.00	2,431,800
トーエネック	500	3,015.00	1,507,500
住友電設	1,500	2,230.00	3,345,000
日本電設工業	2,800	2,133.00	5,972,400
協和エクシオ	6,600	2,671.00	17,628,600
新日本空調	1,400	1,517.00	2,123,800
N D S	300	4,350.00	1,305,000
九電工	3,600	4,790.00	17,244,000
三機工業	3,900	1,060.00	4,134,000
日揮	15,800	2,271.00	35,881,800
中外炉工業	600	2,323.00	1,393,800
ヤマト	1,600	843.00	1,348,800
太平電業	1,200	2,278.00	2,733,600

高砂熱学工業	5,100	1,921.00	9,797,100
三晃金属工業	200	4,030.00	806,000
朝日工業社	400	3,450.00	1,380,000
明星工業	3,400	738.00	2,509,200
大気社	2,400	3,830.00	9,192,000
ダイダン	1,200	2,354.00	2,824,800
日比谷総合設備	2,100	1,986.00	4,170,600
東芝プラントシステム	3,900	2,154.00	8,400,600
東洋エンジニアリング	2,200	999.00	2,197,800
千代田化工建設	11,900	1,053.00	12,530,700
新興プランテック	3,500	966.00	3,381,000
日本製粉	5,400	1,599.00	8,634,600
日清製粉グループ本社	20,100	2,045.00	41,104,500
日東富士製粉	100	4,745.00	474,500
昭和産業	1,500	2,735.00	4,102,500
鳥越製粉	1,500	992.00	1,488,000
中部飼料	2,000	1,957.00	3,914,000
フィード・ワン	11,100	223.00	2,475,300
東洋精糖	300	1,200.00	360,000
日本甜菜製糖	900	2,301.00	2,070,900
三井製糖	1,300	4,170.00	5,421,000
塩水港精糖	2,100	264.00	554,400
日新製糖	800	2,083.00	1,666,400
森永製菓	3,900	4,910.00	19,149,000
中村屋	400	4,680.00	1,872,000
江崎グリコ	4,600	5,280.00	24,288,000
名糖産業	800	1,511.00	1,208,800
井村屋グループ	600	4,140.00	2,484,000
不二家	1,000	2,454.00	2,454,000
山崎製パン	13,400	2,061.00	27,617,400
第一屋製パン	300	1,151.00	345,300
モロゾフ	300	6,900.00	2,070,000
亀田製菓	1,000	5,130.00	5,130,000
寿スピリッツ	1,600	5,730.00	9,168,000
カルビー	7,500	3,550.00	26,625,000
森永乳業	3,300	4,300.00	14,190,000
六甲バター	800	2,302.00	1,841,600
ヤクルト本社	9,800	8,120.00	79,576,000
明治ホールディングス	10,800	8,020.00	86,616,000
雪印メグミルク	3,900	2,722.00	10,615,800
プリマハム	11,000	623.00	6,853,000
日本ハム	14,000	2,398.00	33,572,000

林兼産業	600	810.00	486,000
丸大食品	9,000	486.00	4,374,000
S Foods	1,100	4,335.00	4,768,500
伊藤ハム米久ホールディングス	10,500	898.00	9,429,000
サッポロホールディングス	6,000	3,075.00	18,450,000
アサヒグループホールディングス	34,400	5,405.00	185,932,000
キリンホールディングス	78,900	2,505.50	197,683,950
宝ホールディングス	12,300	1,237.00	15,215,100
オエノンホールディングス	4,700	394.00	1,851,800
養命酒製造	500	2,211.00	1,105,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,500	3,685.00	42,377,500
サントリー食品インターナショナル	12,500	5,020.00	62,750,000
ダイトーグループホールディングス	800	6,470.00	5,176,000
伊藤園	5,400	4,380.00	23,652,000
キーコーヒー	1,600	2,124.00	3,398,400
ユニカフェ	500	1,085.00	542,500
ジャパンフーズ	300	1,487.00	446,100
日清オイリオグループ	2,000	2,912.00	5,824,000
不二製油グループ本社	4,400	3,165.00	13,926,000
かどや製油	200	6,890.00	1,378,000
J - オイルミルズ	900	3,620.00	3,258,000
キッコーマン	12,800	4,080.00	52,224,000
味の素	37,700	1,939.50	73,119,150
キューピー	9,100	3,015.00	27,436,500
ハウス食品グループ本社	6,300	3,540.00	22,302,000
カゴメ	6,600	3,600.00	23,760,000
焼津水産化学工業	800	1,193.00	954,400
アリアケジャパン	1,500	8,150.00	12,225,000
ピエトロ	200	1,670.00	334,000
エバラ食品工業	400	2,104.00	841,600
ニチレイ	7,800	2,541.00	19,819,800
東洋水産	9,000	4,100.00	36,900,000
イトアンド	400	2,126.00	850,400
大冷	200	2,216.00	443,200
日清食品ホールディングス	7,200	7,420.00	53,424,000
永谷園ホールディングス	2,000	1,491.00	2,982,000
一正蒲鉾	600	1,105.00	663,000
フジッコ	1,800	2,288.00	4,118,400
ロック・フィールド	1,800	2,051.00	3,691,800
日本たばこ産業	101,500	3,126.00	317,289,000
ケンコーマヨネーズ	1,100	4,035.00	4,438,500
わらべや日洋ホールディングス	1,100	2,539.00	2,792,900

なとり	900	1,931.00	1,737,900
イフジ産業	300	750.00	225,000
ピクルスコーポレーション	200	1,750.00	350,000
北の達人コーポレーション	4,800	762.00	3,657,600
ユーグレナ	6,300	974.00	6,136,200
ミヨシ油脂	600	1,370.00	822,000
理研ビタミン	600	4,010.00	2,406,000
片倉工業	2,000	1,354.00	2,708,000
ゲンゼ	1,300	6,030.00	7,839,000
東洋紡	6,300	2,040.00	12,852,000
ユニチカ	5,000	692.00	3,460,000
富士紡ホールディングス	1,000	4,130.00	4,130,000
倉敷紡績	17,000	327.00	5,559,000
シキボウ	900	1,360.00	1,224,000
日本毛織	4,800	1,089.00	5,227,200
ダイトウボウ	3,100	105.00	325,500
トーア紡コーポレーション	700	565.00	395,500
ダイドーリミテッド	2,000	453.00	906,000
帝国繊維	1,800	2,013.00	3,623,400
帝人	14,000	2,136.00	29,904,000
東レ	124,200	1,062.00	131,900,400
サカイオーベックス	500	2,650.00	1,325,000
住江織物	400	2,959.00	1,183,600
日本フェルト	900	508.00	457,200
日東製網	200	1,730.00	346,000
アツギ	1,100	1,200.00	1,320,000
ダイニック	700	990.00	693,000
セーレン	3,900	2,000.00	7,800,000
ソトー	600	1,089.00	653,400
東海染工	300	1,534.00	460,200
小松精練	2,600	869.00	2,259,400
ワコールホールディングス	4,700	3,115.00	14,640,500
ホギメディカル	1,100	8,260.00	9,086,000
レナウン	4,800	175.00	840,000
クラウディアホールディングス	400	551.00	220,400
T S Iホールディングス	6,500	740.00	4,810,000
マツオカコーポレーション	300	4,300.00	1,290,000
三陽商会	900	2,097.00	1,887,300
ナイガイ	700	535.00	374,500
オンワードホールディングス	10,200	942.00	9,608,400
ルックホールディングス	3,000	352.00	1,056,000
キムラタン	8,100	44.00	356,400

ゴールドウイン	500	12,700.00	6,350,000
デサント	3,900	1,684.00	6,567,600
キング	900	644.00	579,600
ヤマトインターナショナル	1,200	455.00	546,000
特種東海製紙	900	4,010.00	3,609,000
王子ホールディングス	72,000	675.00	48,600,000
日本製紙	7,700	2,064.00	15,892,800
三菱製紙	2,500	664.00	1,660,000
北越紀州製紙	9,600	631.00	6,057,600
中越パルプ工業	700	1,858.00	1,300,600
巴川製紙所	3,000	286.00	858,000
大王製紙	6,800	1,433.00	9,744,400
阿波製紙	400	633.00	253,200
レンゴー	16,500	856.00	14,124,000
トーモク	1,000	2,071.00	2,071,000
ザ・パック	1,200	3,405.00	4,086,000
クラレ	28,800	1,861.00	53,596,800
旭化成	106,800	1,302.50	139,107,000
共和レザー	1,000	943.00	943,000
昭和電工	11,400	4,465.00	50,901,000
住友化学	126,000	656.00	82,656,000
住友精化	700	5,250.00	3,675,000
日産化学工業	10,000	3,795.00	37,950,000
ラサ工業	600	2,256.00	1,353,600
クレハ	1,500	7,010.00	10,515,000
多木化学	300	5,160.00	1,548,000
テイカ	1,300	2,527.00	3,285,100
石原産業	3,100	1,418.00	4,395,800
片倉コープアグリ	400	1,260.00	504,000
日東エフシー	1,000	775.00	775,000
日本曹達	12,000	631.00	7,572,000
東ソー	24,800	2,191.00	54,336,800
トクヤマ	5,000	2,914.00	14,570,000
セントラル硝子	3,500	2,346.00	8,211,000
東亜合成	10,000	1,216.00	12,160,000
大阪ソーダ	1,500	2,768.00	4,152,000
関東電化工業	4,100	1,110.00	4,551,000
デンカ	6,300	3,970.00	25,011,000
信越化学工業	28,500	11,165.00	318,202,500
日本カーバイド工業	600	2,134.00	1,280,400
堺化学工業	1,200	2,831.00	3,397,200
エア・ウォーター	14,100	2,046.00	28,848,600

大陽日酸	13,200	1,514.00	19,984,800
日本化学工業	700	2,911.00	2,037,700
東邦アセチレン	300	1,433.00	429,900
日本パーカラライジング	8,700	1,811.00	15,755,700
高压ガス工業	2,500	855.00	2,137,500
四国化成工業	2,500	1,552.00	3,880,000
戸田工業	400	3,640.00	1,456,000
ステラ ケミファ	900	2,866.00	2,579,400
保土谷化学工業	500	4,900.00	2,450,000
日本触媒	2,700	7,440.00	20,088,000
大日精化工業	1,300	4,575.00	5,947,500
カネカ	23,000	1,043.00	23,989,000
三菱瓦斯化学	14,100	2,594.00	36,575,400
三井化学	15,600	3,200.00	49,920,000
J S R	17,200	2,375.00	40,850,000
東京応化工業	3,000	4,440.00	13,320,000
大阪有機化学工業	1,100	1,544.00	1,698,400
三菱ケミカルホールディングス	114,700	1,050.00	120,435,000
K Hネオケム	2,600	2,821.00	7,334,600
ダイセル	23,100	1,183.00	27,327,300
住友ベークライト	14,000	846.00	11,844,000
積水化学工業	35,600	1,928.00	68,636,800
日本ゼオン	14,400	1,504.00	21,657,600
アイカ工業	4,800	3,845.00	18,456,000
宇部興産	8,600	3,225.00	27,735,000
積水樹脂	2,600	2,401.00	6,242,600
タキロンシーアイ	3,500	718.00	2,513,000
旭有機材	1,000	2,010.00	2,010,000
日立化成	8,400	2,391.00	20,084,400
ニチバン	900	3,130.00	2,817,000
リケンテクノス	3,700	519.00	1,920,300
大倉工業	4,000	565.00	2,260,000
積水化成成品工業	2,200	1,047.00	2,303,400
群栄化学工業	400	3,495.00	1,398,000
タイガースポリマー	900	802.00	721,800
ミライアル	600	1,896.00	1,137,600
ダイキアクシス	600	1,421.00	852,600
ダイキョーニシカワ	3,400	1,663.00	5,654,200
竹本容器	200	2,351.00	470,200
森六ホールディングス	600	2,850.00	1,710,000
日本化薬	11,100	1,356.00	15,051,600
カーリットホールディングス	1,600	1,113.00	1,780,800

日本精化	1,400	1,207.00	1,689,800
扶桑化学工業	1,200	2,886.00	3,463,200
A D E K A	7,400	1,923.00	14,230,200
日油	6,600	2,855.00	18,843,000
新日本理化	2,800	264.00	739,200
ハリマ化成グループ	1,300	864.00	1,123,200
花王	40,200	7,848.00	315,489,600
第一工業製薬	3,000	758.00	2,274,000
日華化学	600	1,166.00	699,600
三洋化成工業	1,100	5,180.00	5,698,000
有機合成薬品工業	1,200	287.00	344,400
大日本塗料	2,000	1,551.00	3,102,000
日本ペイントホールディングス	13,200	3,480.00	45,936,000
関西ペイント	18,000	2,470.00	44,460,000
神東塗料	1,300	249.00	323,700
中国塗料	4,900	941.00	4,610,900
日本特殊塗料	1,100	1,977.00	2,174,700
藤倉化成	2,100	654.00	1,373,400
太陽ホールディングス	1,300	4,840.00	6,292,000
D I C	6,800	3,855.00	26,214,000
サカタインクス	3,500	1,780.00	6,230,000
東洋インキS Cホールディングス	17,000	621.00	10,557,000
T & K T O K A	1,100	1,355.00	1,490,500
富士フィルムホールディングス	34,000	4,316.00	146,744,000
資生堂	30,500	6,177.00	188,398,500
ライオン	22,800	2,119.00	48,313,200
高砂香料工業	1,000	3,135.00	3,135,000
マンダム	3,200	3,690.00	11,808,000
ミルボン	2,200	3,575.00	7,865,000
ファンケル	4,000	3,275.00	13,100,000
コーセー	2,800	19,540.00	54,712,000
コタ	700	1,851.00	1,295,700
シーズ・ホールディングス	2,200	5,700.00	12,540,000
シーボン	200	3,235.00	647,000
ポーラ・オルビスホールディングス	7,000	4,255.00	29,785,000
ノエビアホールディングス	1,000	7,660.00	7,660,000
アジュバンコスメジャパン	400	1,051.00	420,400
エステー	1,200	2,074.00	2,488,800
アグロ カネショウ	700	2,385.00	1,669,500
コニシ	2,700	1,824.00	4,924,800
長谷川香料	2,200	1,934.00	4,254,800
星光P M C	1,000	1,050.00	1,050,000

小林製薬	4,600	6,850.00	31,510,000
荒川化学工業	1,500	1,893.00	2,839,500
メック	1,100	2,001.00	2,201,100
日本高純度化学	500	2,491.00	1,245,500
タカラバイオ	4,300	1,891.00	8,131,300
J C U	1,000	4,585.00	4,585,000
新田ゼラチン	1,200	758.00	909,600
O A T アグリオ	300	2,597.00	779,100
デクセリアルズ	4,200	1,329.00	5,581,800
アース製薬	1,200	5,340.00	6,408,000
北興化学工業	1,700	703.00	1,195,100
大成ラミック	500	3,080.00	1,540,000
クミアイ化学工業	7,400	640.00	4,736,000
日本農薬	4,300	589.00	2,532,700
アキレス	1,200	2,037.00	2,444,400
有沢製作所	2,700	938.00	2,532,600
日東電工	12,300	8,346.00	102,655,800
レック	1,000	2,973.00	2,973,000
きもと	2,900	375.00	1,087,500
藤森工業	1,400	3,640.00	5,096,000
前澤化成工業	1,100	1,149.00	1,263,900
J S P	1,000	3,240.00	3,240,000
エフピコ	1,300	5,960.00	7,748,000
天馬	1,300	2,080.00	2,704,000
信越ポリマー	3,400	1,273.00	4,328,200
東リ	4,100	370.00	1,517,000
ニフコ	3,000	7,480.00	22,440,000
日本バルカー工業	1,300	3,035.00	3,945,500
ユニ・チャーム	34,700	2,834.50	98,357,150
協和発酵キリン	20,500	2,163.00	44,341,500
武田薬品工業	60,200	5,900.00	355,180,000
アステラス製薬	168,000	1,456.50	244,692,000
大日本住友製薬	12,100	1,467.00	17,750,700
塩野義製薬	23,400	5,445.00	127,413,000
田辺三菱製薬	19,900	2,230.00	44,377,000
わかもと製薬	2,000	256.00	512,000
あすか製薬	1,900	1,985.00	3,771,500
日本新薬	4,300	6,260.00	26,918,000
バイオフェルミン製薬	300	2,844.00	853,200
中外製薬	17,100	5,220.00	89,262,000
科研製薬	2,900	5,500.00	15,950,000
エーザイ	19,600	5,793.00	113,542,800

ロート製薬	9,000	2,827.00	25,443,000
小野薬品工業	38,600	2,917.00	112,596,200
久光製薬	4,800	7,100.00	34,080,000
持田製薬	1,200	7,650.00	9,180,000
参天製薬	31,000	1,613.00	50,003,000
扶桑薬品工業	600	2,724.00	1,634,400
日本ケミファ	200	4,390.00	878,000
ツムラ	5,800	3,450.00	20,010,000
日医工	4,300	1,680.00	7,224,000
キッセイ薬品工業	3,000	2,791.00	8,373,000
生化学工業	3,200	1,738.00	5,561,600
栄研化学	1,300	4,625.00	6,012,500
日水製薬	700	1,371.00	959,700
鳥居薬品	1,000	2,770.00	2,770,000
JCRファーマ	1,200	5,180.00	6,216,000
東和薬品	800	6,080.00	4,864,000
富士製薬工業	600	4,295.00	2,577,000
沢井製薬	3,300	4,755.00	15,691,500
ゼリア新薬工業	3,500	2,065.00	7,227,500
第一三共	46,800	3,838.00	179,618,400
キョーリン製薬ホールディングス	4,600	2,009.00	9,241,400
大幸薬品	900	2,118.00	1,906,200
ダイト	1,000	3,440.00	3,440,000
大塚ホールディングス	34,000	4,542.00	154,428,000
大正製薬ホールディングス	3,700	9,320.00	34,484,000
ペプチドリーム	7,300	4,105.00	29,966,500
日本コークス工業	14,000	108.00	1,512,000
昭和シェル石油	15,300	1,408.00	21,542,400
ニチレキ	2,100	1,294.00	2,717,400
ユシロ化学工業	900	1,840.00	1,656,000
ビーピー・カストロール	700	1,724.00	1,206,800
富士石油	4,000	458.00	1,832,000
MORESCO	600	1,843.00	1,105,800
出光興産	13,700	3,780.00	51,786,000
JXTGホールディングス	261,000	646.20	168,658,200
コスモエネルギーホールディングス	4,700	3,650.00	17,155,000
横浜ゴム	9,500	2,494.00	23,693,000
東洋ゴム工業	9,700	2,121.00	20,573,700
ブリヂストン	57,800	4,831.00	279,231,800
住友ゴム工業	16,800	1,986.00	33,364,800
藤倉ゴム工業	1,500	825.00	1,237,500
オカモト	6,000	1,129.00	6,774,000

フコク	700	1,010.00	707,000
ニッタ	1,700	4,080.00	6,936,000
住友理工	3,100	1,047.00	3,245,700
三ツ星ベルト	4,000	1,246.00	4,984,000
バンドー化学	3,100	1,185.00	3,673,500
日東紡績	2,400	2,424.00	5,817,600
旭硝子	16,700	4,465.00	74,565,500
日本板硝子	8,300	839.00	6,963,700
石塚硝子	200	2,547.00	509,400
日本山村硝子	7,000	175.00	1,225,000
日本電気硝子	7,100	3,295.00	23,394,500
オハラ	700	3,095.00	2,166,500
住友大阪セメント	32,000	466.00	14,912,000
太平洋セメント	10,300	3,985.00	41,045,500
日本ヒューム	1,700	795.00	1,351,500
日本コンクリート工業	3,600	445.00	1,602,000
三谷セキサン	900	2,214.00	1,992,600
アジアパイルホールディングス	2,100	642.00	1,348,200
東海カーボン	14,900	1,502.00	22,379,800
日本カーボン	800	5,390.00	4,312,000
東洋炭素	1,000	3,205.00	3,205,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	5,320.00	5,320,000
TOTO	12,600	5,360.00	67,536,000
日本碍子	20,000	1,946.00	38,920,000
日本特殊陶業	14,000	2,665.00	37,310,000
ダントーホールディングス	1,000	140.00	140,000
MARUWA	600	8,410.00	5,046,000
品川リフラクトリーズ	400	2,855.00	1,142,000
黒崎播磨	300	5,070.00	1,521,000
ヨータイ	1,000	845.00	845,000
イソライト工業	800	908.00	726,400
東京窯業	2,100	417.00	875,700
ニッカトー	600	1,022.00	613,200
フジミインコーポレーテッド	1,500	2,666.00	3,999,000
エーアンドエーマテリアル	400	1,218.00	487,200
ニチアス	9,000	1,245.00	11,205,000
ニチハ	2,500	4,095.00	10,237,500
新日鐵住金	72,400	2,528.50	183,063,400
神戸製鋼所	29,700	1,098.00	32,610,600
合同製鐵	900	1,953.00	1,757,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	43,700	2,480.00	108,376,000
日新製鋼	4,500	1,480.00	6,660,000

東京製鐵	8,700	865.00	7,525,500
共英製鋼	1,800	1,926.00	3,466,800
大和工業	3,400	2,999.00	10,196,600
東京鐵鋼	700	1,658.00	1,160,600
大阪製鐵	1,100	1,945.00	2,139,500
淀川製鋼所	2,400	3,050.00	7,320,000
東洋鋼鈹	4,200	713.00	2,994,600
丸一鋼管	5,700	3,335.00	19,009,500
モリ工業	500	3,990.00	1,995,000
大同特殊鋼	2,900	5,780.00	16,762,000
日本高周波鋼業	600	798.00	478,800
日本冶金工業	13,600	294.00	3,998,400
山陽特殊製鋼	1,900	2,373.00	4,508,700
愛知製鋼	900	4,660.00	4,194,000
日立金属	17,400	1,402.00	24,394,800
日本金属	400	2,691.00	1,076,400
大平洋金属	1,000	3,235.00	3,235,000
新日本電工	9,800	383.00	3,753,400
栗本鐵工所	800	2,075.00	1,660,000
虹技	300	1,980.00	594,000
日本鑄鉄管	2,000	163.00	326,000
三菱製鋼	1,200	2,648.00	3,177,600
日亜鋼業	2,500	349.00	872,500
日本精線	300	4,730.00	1,419,000
シンニッタン	1,300	788.00	1,024,400
新家工業	400	2,468.00	987,200
大紀アルミニウム工業所	2,700	752.00	2,030,400
日本軽金属ホールディングス	47,300	277.00	13,102,100
三井金属鉱業	4,400	5,490.00	24,156,000
東邦亜鉛	900	5,480.00	4,932,000
三菱マテリアル	10,700	3,575.00	38,252,500
住友金属鉱山	20,700	4,770.00	98,739,000
D O W A ホールディングス	4,100	3,870.00	15,867,000
古河機械金属	2,700	2,176.00	5,875,200
エス・サイエンス	7,800	77.00	600,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,700	2,877.00	4,890,900
東邦チタニウム	2,900	1,501.00	4,352,900
U A C J	2,500	2,450.00	6,125,000
古河電気工業	5,400	5,540.00	29,916,000
住友電気工業	60,400	1,638.00	98,935,200
フジクラ	19,600	788.00	15,444,800
昭和電線ホールディングス	2,100	901.00	1,892,100

タツタ電線	3,200	696.00	2,227,200
カナレ電気	300	2,136.00	640,800
平河ヒューテック	800	1,058.00	846,400
リョービ	2,000	2,891.00	5,782,000
アーレスティ	2,000	823.00	1,646,000
アサヒホールディングス	2,600	1,891.00	4,916,600
稲葉製作所	900	1,322.00	1,189,800
宮地エンジニアリンググループ	500	2,357.00	1,178,500
トーカロ	1,100	5,410.00	5,951,000
アルファC o	600	1,799.00	1,079,400
SUMCO	14,900	2,668.00	39,753,200
川田テクノロジーズ	300	5,760.00	1,728,000
RS Technologies	200	6,080.00	1,216,000
東洋製罐グループホールディングス	11,100	1,532.00	17,005,200
ホッカカンホールディングス	4,000	393.00	1,572,000
コロナ	900	1,317.00	1,185,300
横河ブリッジホールディングス	3,000	2,411.00	7,233,000
駒井ハルテック	400	2,556.00	1,022,400
高田機工	200	4,395.00	879,000
三和ホールディングス	15,500	1,408.00	21,824,000
文化シャッター	4,800	966.00	4,636,800
三協立山	2,200	1,488.00	3,273,600
アルインコ	1,200	1,126.00	1,351,200
東洋シャッター	400	600.00	240,000
LIXILグループ	23,900	2,610.00	62,379,000
日本フィルコン	1,300	611.00	794,300
ノーリツ	3,600	2,041.00	7,347,600
長府製作所	1,800	2,491.00	4,483,800
リンナイ	2,900	9,800.00	28,420,000
ダイニチ工業	900	839.00	755,100
日東精工	2,300	568.00	1,306,400
三洋工業	200	2,075.00	415,000
岡部	3,300	1,048.00	3,458,400
ジーテクト	1,800	2,061.00	3,709,800
中国工業	300	756.00	226,800
東プレ	3,000	3,050.00	9,150,000
高周波熱錬	3,100	1,015.00	3,146,500
東京製綱	1,200	1,900.00	2,280,000
サンコール	900	732.00	658,800
モリテック スチール	1,000	902.00	902,000
パイオラックス	2,400	2,945.00	7,068,000
エイチワン	1,200	1,372.00	1,646,400

日本発條	16,100	1,020.00	16,422,000
中央発條	200	3,525.00	705,000
アドバネクス	300	3,900.00	1,170,000
立川ブラインド工業	700	1,358.00	950,600
三益半導体工業	1,300	1,889.00	2,455,700
日本ドライケミカル	200	2,480.00	496,000
日本製鋼所	5,300	2,977.00	15,778,100
三浦工業	7,000	2,874.00	20,118,000
タクマ	5,500	1,335.00	7,342,500
ツガミ	4,000	1,446.00	5,784,000
オークマ	1,900	6,400.00	12,160,000
東芝機械	9,000	727.00	6,543,000
アマダホールディングス	25,000	1,389.00	34,725,000
アイダエンジニアリング	4,100	1,372.00	5,625,200
滝澤鉄工所	500	2,102.00	1,051,000
富士機械製造	4,800	2,228.00	10,694,400
牧野フライス製作所	8,000	1,044.00	8,352,000
オーエスジー	7,500	2,443.00	18,322,500
ダイジェット工業	200	2,046.00	409,200
旭ダイヤモンド工業	4,800	1,257.00	6,033,600
D M G 森精機	9,000	2,036.00	18,324,000
ソディック	3,500	1,377.00	4,819,500
ディスコ	2,200	22,910.00	50,402,000
日東工器	1,000	2,836.00	2,836,000
日進工具	400	3,590.00	1,436,000
パンチ工業	1,400	1,277.00	1,787,800
富士ダイス	600	1,095.00	657,000
豊和工業	900	1,432.00	1,288,800
O K K	600	1,136.00	681,600
東洋機械金属	1,300	916.00	1,190,800
津田駒工業	4,000	252.00	1,008,000
島精機製作所	2,000	6,430.00	12,860,000
オプトラン	1,200	3,420.00	4,104,000
N C ホールディングス	500	777.00	388,500
フリュー	1,200	1,063.00	1,275,600
ヤマシンフィルタ	2,200	1,206.00	2,653,200
日阪製作所	2,300	1,073.00	2,467,900
やまびこ	3,100	1,590.00	4,929,000
平田機工	500	10,500.00	5,250,000
ペガサスミシン製造	1,500	692.00	1,038,000
ナブテスコ	8,900	4,410.00	39,249,000
三井海洋開発	1,700	2,566.00	4,362,200

レオン自動機	1,500	2,290.00	3,435,000
S M C	5,100	44,610.00	227,511,000
新川	1,300	956.00	1,242,800
ホソカワミクロン	600	8,150.00	4,890,000
ユニオンツール	800	3,825.00	3,060,000
オイレス工業	2,100	2,349.00	4,932,900
日精エー・エス・ビー機械	600	6,970.00	4,182,000
サトーホールディングス	2,100	3,460.00	7,266,000
技研製作所	800	2,744.00	2,195,200
日本エアーテック	600	951.00	570,600
日精樹脂工業	1,400	1,557.00	2,179,800
オカダアイヨン	500	1,627.00	813,500
ワイエイシイホールディングス	600	848.00	508,800
小松製作所	79,000	3,832.00	302,728,000
住友重機械工業	9,400	4,225.00	39,715,000
日立建機	7,600	4,205.00	31,958,000
日工	400	2,500.00	1,000,000
巴工業	700	1,902.00	1,331,400
井関農機	1,600	2,455.00	3,928,000
T O W A	1,300	1,516.00	1,970,800
丸山製作所	400	1,774.00	709,600
北川鉄工所	800	2,724.00	2,179,200
ローツェ	800	2,351.00	1,880,800
タカキタ	600	800.00	480,000
クボタ	87,500	2,039.00	178,412,500
荏原実業	500	2,053.00	1,026,500
三菱化工機	600	2,141.00	1,284,600
月島機械	3,200	1,319.00	4,220,800
帝国電機製作所	1,100	1,577.00	1,734,700
新東工業	3,900	1,208.00	4,711,200
澁谷工業	1,400	4,135.00	5,789,000
アイチ コーポレーション	2,800	696.00	1,948,800
小森コーポレーション	4,100	1,351.00	5,539,100
鶴見製作所	1,400	1,767.00	2,473,800
住友精密工業	3,000	381.00	1,143,000
酒井重工業	300	4,170.00	1,251,000
荏原製作所	6,700	3,955.00	26,498,500
石井鐵工所	300	1,921.00	576,300
西島製作所	1,700	997.00	1,694,900
北越工業	1,900	1,137.00	2,160,300
ダイキン工業	22,300	12,170.00	271,391,000
オルガノ	600	3,225.00	1,935,000

トーヨーカネツ	700	3,740.00	2,618,000
栗田工業	8,900	3,145.00	27,990,500
椿本チエイン	10,000	863.00	8,630,000
大同工業	600	1,480.00	888,000
木村化工機	1,400	486.00	680,400
アネスト岩田	2,800	1,087.00	3,043,600
ダイフク	8,200	6,230.00	51,086,000
サムコ	500	1,196.00	598,000
加藤製作所	800	2,647.00	2,117,600
油研工業	300	2,966.00	889,800
タダノ	7,900	1,662.00	13,129,800
フジテック	5,200	1,422.00	7,394,400
C K D	4,500	2,431.00	10,939,500
キトー	1,300	1,606.00	2,087,800
平和	5,100	2,167.00	11,051,700
理想科学工業	1,600	2,025.00	3,240,000
S A N K Y O	4,100	3,775.00	15,477,500
日本金銭機械	1,500	1,069.00	1,603,500
マースエンジニアリング	1,000	2,410.00	2,410,000
福島工業	1,000	4,460.00	4,460,000
オーイズミ	700	503.00	352,100
ダイコク電機	800	1,675.00	1,340,000
竹内製作所	2,700	2,524.00	6,814,800
アマノ	5,100	2,772.00	14,137,200
J U K I	2,500	1,587.00	3,967,500
サンデンホールディングス	2,000	1,683.00	3,366,000
蛇の目ミシン工業	1,500	702.00	1,053,000
マックス	2,500	1,430.00	3,575,000
グローリー	4,900	3,875.00	18,987,500
新晃工業	1,700	1,800.00	3,060,000
大和冷機工業	2,600	1,230.00	3,198,000
セガサミーホールディングス	16,200	1,568.00	25,401,600
日本ピストンリング	600	2,314.00	1,388,400
リケン	800	6,040.00	4,832,000
T P R	1,800	3,070.00	5,526,000
ツバキ・ナカシマ	1,600	2,916.00	4,665,600
ホシザキ	5,200	9,960.00	51,792,000
大豊工業	1,300	1,517.00	1,972,100
日本精工	33,600	1,549.00	52,046,400
N T N	37,900	463.00	17,547,700
ジェイテクト	17,400	1,655.00	28,797,000
不二越	15,000	648.00	9,720,000

日本トムソン	5,200	693.00	3,603,600
THK	10,200	4,080.00	41,616,000
ユーシン精機	700	3,335.00	2,334,500
前澤給装工業	700	1,832.00	1,282,400
イーグル工業	2,000	1,920.00	3,840,000
前澤工業	1,200	391.00	469,200
日本ピラー工業	1,700	1,714.00	2,913,800
キッツ	7,300	841.00	6,139,300
マキタ	21,300	4,950.00	105,435,000
日立造船	13,000	544.00	7,072,000
三菱重工業	27,400	4,219.00	115,600,600
IHI	12,600	3,460.00	43,596,000
スター精密	2,600	2,070.00	5,382,000
日清紡ホールディングス	10,000	1,527.00	15,270,000
イビデン	10,000	1,780.00	17,800,000
コニカミノルタ	38,300	937.00	35,887,100
ブラザー工業	20,000	2,513.00	50,260,000
ミネベアミツミ	30,400	2,365.00	71,896,000
日立製作所	393,000	807.80	317,465,400
三菱電機	163,500	1,841.00	301,003,500
富士電機	49,000	765.00	37,485,000
東洋電機製造	600	1,649.00	989,400
安川電機	19,000	4,815.00	91,485,000
シンフォニアテクノロジー	11,000	345.00	3,795,000
明電舎	14,000	388.00	5,432,000
オリジン電気	500	1,824.00	912,000
山洋電気	800	7,750.00	6,200,000
デンヨー	1,500	1,794.00	2,691,000
東芝テック	12,000	613.00	7,356,000
芝浦メカトロニクス	3,000	432.00	1,296,000
マブチモーター	4,500	5,830.00	26,235,000
日本電産	19,700	16,665.00	328,300,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	600	2,615.00	1,569,000
東光高岳	800	1,542.00	1,233,600
ダブル・スコープ	2,400	1,808.00	4,339,200
ダイヘン	9,000	801.00	7,209,000
田淵電機	2,400	283.00	679,200
ヤーマン	2,400	1,633.00	3,919,200
JVCケンウッド	12,100	349.00	4,222,900
ミマキエンジニアリング	1,500	919.00	1,378,500
第一精工	800	2,908.00	2,326,400
日新電機	3,800	1,045.00	3,971,000

大崎電気工業	3,500	748.00	2,618,000
オムロン	17,400	6,080.00	105,792,000
日東工業	2,600	1,742.00	4,529,200
I D E C	2,000	2,731.00	5,462,000
不二電機工業	200	1,326.00	265,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	29,000	568.00	16,472,000
サクサホールディングス	400	1,941.00	776,400
メルコホールディングス	800	3,410.00	2,728,000
テクノメディカ	400	1,944.00	777,600
日本電気	21,200	3,115.00	66,038,000
富士通	168,000	639.20	107,385,600
沖電気工業	6,600	1,408.00	9,292,800
岩崎通信機	700	765.00	535,500
電気興業	900	3,075.00	2,767,500
サンケン電気	9,000	762.00	6,858,000
ナカヨ	300	2,117.00	635,100
アイホン	900	1,720.00	1,548,000
ルネサスエレクトロニクス	8,400	1,133.00	9,517,200
セイコーエプソン	24,400	2,064.00	50,361,600
ワコム	12,700	531.00	6,743,700
アルバック	3,800	6,130.00	23,294,000
アクセル	700	797.00	557,900
E I Z O	1,500	4,965.00	7,447,500
ジャパンディスプレイ	33,700	214.00	7,211,800
日本信号	4,500	1,047.00	4,711,500
京三製作所	4,000	720.00	2,880,000
能美防災	2,200	2,251.00	4,952,200
ホーチキ	1,200	1,942.00	2,330,400
エレコム	1,400	2,294.00	3,211,600
パナソニック	186,800	1,593.50	297,665,800
シャープ	11,400	3,430.00	39,102,000
アンリツ	12,000	1,244.00	14,928,000
富士通ゼネラル	5,000	2,043.00	10,215,000
日立国際電気	2,700	3,110.00	8,397,000
ソニー	109,200	5,099.00	556,810,800
T D K	8,600	9,140.00	78,604,000
帝国通信工業	700	1,264.00	884,800
タムラ製作所	6,300	725.00	4,567,500
アルプス電気	14,100	2,769.00	39,042,900
池上通信機	5,000	156.00	780,000
パイオニア	27,400	198.00	5,425,200
日本電波工業	1,500	681.00	1,021,500

鈴木	700	999.00	699,300
日本トリム	300	5,470.00	1,641,000
ローランド ディー・ジー・	900	2,666.00	2,399,400
フォスター電機	1,900	2,793.00	5,306,700
クラリオン	9,000	344.00	3,096,000
S M K	4,000	439.00	1,756,000
ヨコオ	1,100	1,932.00	2,125,200
ホシデン	4,100	1,478.00	6,059,800
ヒロセ電機	2,600	15,070.00	39,182,000
日本航空電子工業	4,000	1,564.00	6,256,000
T O A	1,800	1,383.00	2,489,400
マクセルホールディングス	3,300	2,145.00	7,078,500
古野電気	2,000	726.00	1,452,000
ユニデンホールディングス	5,000	281.00	1,405,000
アルパイン	3,900	2,215.00	8,638,500
スミダコーポレーション	1,700	1,715.00	2,915,500
アイコム	900	2,741.00	2,466,900
リオン	700	2,738.00	1,916,600
本多通信工業	1,300	1,190.00	1,547,000
船井電機	1,700	759.00	1,290,300
横河電機	16,400	2,106.00	34,538,400
新電元工業	600	8,090.00	4,854,000
アズビル	4,900	4,595.00	22,515,500
東亜ディーケーケー	800	1,036.00	828,800
日本光電工業	6,800	2,978.00	20,250,400
チノー	600	1,585.00	951,000
共和電業	1,900	452.00	858,800
日本電子材料	700	689.00	482,300
堀場製作所	3,200	6,680.00	21,376,000
アドバンテスト	9,100	2,093.00	19,046,300
小野測器	700	798.00	558,600
エスベック	1,400	2,517.00	3,523,800
キーエンス	8,000	63,460.00	507,680,000
日置電機	900	3,395.00	3,055,500
シスメックス	12,700	8,560.00	108,712,000
日本マイクロニクス	2,800	1,036.00	2,900,800
メガチップス	1,300	3,465.00	4,504,500
O B A R A G R O U P	1,000	6,550.00	6,550,000
澤藤電機	200	2,204.00	440,800
コーセル	2,300	1,574.00	3,620,200
イリソ電子工業	1,400	6,860.00	9,604,000
新日本無線	1,000	810.00	810,000

オブテックスグループ	1,300	6,210.00	8,073,000
千代田インテグレ	800	2,327.00	1,861,600
アイ・オー・データ機器	700	1,017.00	711,900
レーザーテック	3,300	3,905.00	12,886,500
スタンレー電気	12,500	3,980.00	49,750,000
岩崎電気	600	1,571.00	942,600
ウシオ電機	9,900	1,442.00	14,275,800
岡谷電機産業	900	667.00	600,300
ハリオス テクノ ホールディング	1,400	933.00	1,306,200
日本セラミック	1,600	2,817.00	4,507,200
遠藤照明	800	1,066.00	852,800
古河電池	1,200	1,021.00	1,225,200
双信電機	700	673.00	471,100
山一電機	1,200	1,760.00	2,112,000
図研	1,100	1,714.00	1,885,400
日本電子	6,000	709.00	4,254,000
カシオ計算機	13,200	1,453.00	19,179,600
ファナック	15,600	26,815.00	418,314,000
日本シイエムケイ	2,900	1,004.00	2,911,600
エンプラス	700	3,585.00	2,509,500
大真空	600	1,522.00	913,200
ローム	7,300	10,810.00	78,913,000
浜松ホトニクス	11,900	4,145.00	49,325,500
三井ハイテック	2,200	1,866.00	4,105,200
新光電気工業	6,200	882.00	5,468,400
京セラ	26,800	6,083.00	163,024,400
太陽誘電	7,300	1,798.00	13,125,400
村田製作所	17,200	15,060.00	259,032,000
ユーシン	2,500	708.00	1,770,000
双葉電子工業	2,700	2,148.00	5,799,600
北陸電気工業	600	1,665.00	999,000
ニチコン	5,200	1,261.00	6,557,200
日本ケミコン	1,300	2,764.00	3,593,200
K O A	2,300	2,254.00	5,184,200
市光工業	2,400	897.00	2,152,800
小糸製作所	9,800	7,350.00	72,030,000
ミツバ	3,000	1,288.00	3,864,000
S C R E E Nホールディングス	3,100	8,050.00	24,955,000
キャノン電子	1,500	2,541.00	3,811,500
キャノン	88,000	3,935.00	346,280,000
リコー	49,200	1,080.00	53,136,000
M U T O Hホールディングス	200	2,407.00	481,400

東京エレクトロン	10,900	18,410.00	200,669,000	
トヨタ紡織	4,800	2,268.00	10,886,400	
芦森工業	400	2,553.00	1,021,200	
ユニプレス	3,200	2,548.00	8,153,600	
豊田自動織機	13,200	6,740.00	88,968,000	
モリタホールディングス	2,600	1,941.00	5,046,600	
三櫻工業	2,100	755.00	1,585,500	
デンソー	36,300	6,331.00	229,815,300	
東海理化電機製作所	4,300	2,208.00	9,494,400	
三井造船	5,900	1,885.00	11,121,500	
川崎重工業	12,700	4,030.00	51,181,000	
名村造船所	4,900	588.00	2,881,200	
サノヤスホールディングス	2,000	238.00	476,000	
日本車輛製造	6,000	292.00	1,752,000	
三菱ロジスネクスト	1,900	919.00	1,746,100	
近畿車輛	300	2,705.00	811,500	
日産自動車	192,800	1,117.50	215,454,000	
いすゞ自動車	47,400	1,682.50	79,750,500	
トヨタ自動車	198,800	7,276.00	1,446,468,800	代用有価証券 23,000株
日野自動車	23,300	1,463.00	34,087,900	
三菱自動車工業	60,600	835.00	50,601,000	
エフテック	1,000	1,301.00	1,301,000	
レシップホールディングス	600	926.00	555,600	
G M B	300	1,718.00	515,400	
ファルテック	300	1,432.00	429,600	
武蔵精密工業	1,700	3,810.00	6,477,000	
日産車体	6,400	1,050.00	6,720,000	
新明和工業	7,100	886.00	6,290,600	
極東開発工業	3,000	1,641.00	4,923,000	
日信工業	3,300	1,889.00	6,233,700	
トピー工業	1,300	3,245.00	4,218,500	
ティラド	600	3,880.00	2,328,000	
曙ブレーキ工業	7,700	300.00	2,310,000	
タチエス	2,800	1,844.00	5,163,200	
N O K	8,800	2,279.00	20,055,200	
フタバ産業	5,000	933.00	4,665,000	
K Y B	1,700	5,320.00	9,044,000	
大同メタル工業	2,100	1,168.00	2,452,800	
プレス工業	8,700	629.00	5,472,300	
ミクニ	2,100	678.00	1,423,800	
太平洋工業	3,400	1,427.00	4,851,800	
ケーヒン	3,700	2,158.00	7,984,600	

河西工業	2,000	1,475.00	2,950,000
アイシン精機	13,500	6,150.00	83,025,000
マツダ	51,300	1,515.00	77,719,500
今仙電機製作所	1,500	1,157.00	1,735,500
本田技研工業	147,100	3,730.00	548,683,000
スズキ	32,400	5,976.00	193,622,400
S U B A R U	50,800	3,748.00	190,398,400
安永	800	2,338.00	1,870,400
ヤマハ発動機	23,100	3,465.00	80,041,500
ショーワ	4,300	1,494.00	6,424,200
T B K	2,000	516.00	1,032,000
エクセディ	2,000	3,360.00	6,720,000
豊田合成	5,900	2,428.00	14,325,200
愛三工業	2,900	1,244.00	3,607,600
盟和産業	300	1,338.00	401,400
日本プラスト	700	860.00	602,000
ヨロズ	1,600	1,718.00	2,748,800
エフ・シー・シー	2,700	3,090.00	8,343,000
シマノ	6,600	15,970.00	105,402,000
テイ・エス テック	3,800	4,075.00	15,485,000
ジャムコ	800	2,241.00	1,792,800
テルモ	25,100	5,380.00	135,038,000
クリエートメディック	600	1,178.00	706,800
日機装	5,700	1,163.00	6,629,100
島津製作所	19,500	2,633.00	51,343,500
J M S	1,500	621.00	931,500
長野計器	1,300	1,157.00	1,504,100
ブイ・テクノロジー	400	19,510.00	7,804,000
東京計器	1,100	1,130.00	1,243,000
愛知時計電機	200	4,320.00	864,000
インターアクション	600	873.00	523,800
オーバル	1,700	286.00	486,200
東京精密	2,900	4,230.00	12,267,000
マニー	2,000	3,705.00	7,410,000
ニコン	28,500	2,062.00	58,767,000
トプコン	8,800	2,384.00	20,979,200
オリンパス	24,400	4,130.00	100,772,000
理研計器	1,600	2,095.00	3,352,000
タムロン	1,300	2,227.00	2,895,100
H O Y A	33,300	5,421.00	180,519,300
シード	200	4,460.00	892,000
ノーリツ鋼機	1,600	2,059.00	3,294,400

エー・アンド・デイ	1,500	615.00	922,500
シチズン時計	19,500	805.00	15,697,500
リズム時計工業	600	2,106.00	1,263,600
大研医器	1,400	754.00	1,055,600
メニコン	2,200	2,538.00	5,583,600
シンシア	100	828.00	82,800
松風	800	1,397.00	1,117,600
セイコーホールディングス	2,500	2,971.00	7,427,500
ニプロ	11,300	1,552.00	17,537,600
中本パックス	200	4,610.00	922,000
スノーピーク	500	1,401.00	700,500
パラマウントベッドホールディングス	1,700	5,260.00	8,942,000
トランザクション	700	981.00	686,700
S H O - B I	600	407.00	244,200
ニホンフラッシュ	800	2,326.00	1,860,800
前田工織	1,700	1,903.00	3,235,100
永大産業	2,000	543.00	1,086,000
アートネイチャー	1,700	729.00	1,239,300
バンダイナムコホールディングス	16,900	3,495.00	59,065,500
アイフィスジャパン	400	643.00	257,200
共立印刷	2,700	357.00	963,900
S H O E I	700	4,460.00	3,122,000
フランスベッドホールディングス	2,000	1,005.00	2,010,000
パイロットコーポレーション	2,900	5,000.00	14,500,000
萩原工業	900	1,830.00	1,647,000
トッパン・フォームズ	3,500	1,130.00	3,955,000
フジシールインターナショナル	3,700	3,445.00	12,746,500
タカラトミー	6,900	1,110.00	7,659,000
廣済堂	1,600	502.00	803,200
A s - m e エステール	500	872.00	436,000
アーク	7,000	119.00	833,000
タカノ	700	951.00	665,700
プロネクサス	1,500	1,317.00	1,975,500
ホクシン	1,300	185.00	240,500
ウッドワン	600	1,419.00	851,400
大建工業	1,300	2,325.00	3,022,500
凸版印刷	46,000	917.00	42,182,000
大日本印刷	21,400	2,202.00	47,122,800
図書印刷	1,100	822.00	904,200
共同印刷	500	3,140.00	1,570,000
N I S S H A	3,400	2,515.00	8,551,000
光村印刷	200	2,356.00	471,200

宝印刷	900	1,740.00	1,566,000
アシックス	16,300	1,734.00	28,264,200
ツツミ	500	2,088.00	1,044,000
小松ウオール工業	600	2,409.00	1,445,400
ヤマハ	11,000	4,265.00	46,915,000
河合楽器製作所	600	3,705.00	2,223,000
クリナップ	1,500	823.00	1,234,500
ピジョン	9,900	4,265.00	42,223,500
兼松サステック	100	1,962.00	196,200
キングジム	1,400	977.00	1,367,800
リンテック	3,900	3,035.00	11,836,500
イトーキ	3,500	700.00	2,450,000
任天堂	10,100	44,400.00	448,440,000
三菱鉛筆	2,700	2,494.00	6,733,800
タカラスタANDARD	3,400	1,773.00	6,028,200
コクヨ	7,800	1,839.00	14,344,200
ナカバヤシ	1,600	612.00	979,200
岡村製作所	5,700	1,354.00	7,717,800
美津濃	1,600	3,065.00	4,904,000
東京電力ホールディングス	130,600	395.00	51,587,000
中部電力	50,000	1,308.00	65,400,000
関西電力	66,700	1,246.50	83,141,550
中国電力	22,600	1,199.00	27,097,400
北陸電力	16,100	808.00	13,008,800
東北電力	38,300	1,333.00	51,053,900
四国電力	14,700	1,152.00	16,934,400
九州電力	36,100	1,150.00	41,515,000
北海道電力	16,400	636.00	10,430,400
沖縄電力	2,700	2,815.00	7,600,500
電源開発	13,000	2,789.00	36,257,000
エフオン	800	1,105.00	884,000
イーレックス	2,600	754.00	1,960,400
東京瓦斯	34,900	2,609.00	91,054,100
大阪瓦斯	31,700	2,103.00	66,665,100
東邦瓦斯	8,100	3,150.00	25,515,000
北海道瓦斯	5,000	294.00	1,470,000
広島ガス	3,400	379.00	1,288,600
西部瓦斯	2,000	2,704.00	5,408,000
静岡ガス	4,600	905.00	4,163,000
メタウォーター	900	2,922.00	2,629,800
SBSホールディングス	1,600	1,134.00	1,814,400
東武鉄道	17,500	3,335.00	58,362,500

相鉄ホールディングス	5,200	2,803.00	14,575,600
東京急行電鉄	44,400	1,711.00	75,968,400
京浜急行電鉄	22,400	1,936.00	43,366,400
小田急電鉄	24,300	2,178.00	52,925,400
京王電鉄	9,200	4,665.00	42,918,000
京成電鉄	11,400	3,385.00	38,589,000
富士急行	2,200	2,688.00	5,913,600
東日本旅客鉄道	29,400	10,200.00	299,880,000
西日本旅客鉄道	14,700	7,732.00	113,660,400
東海旅客鉄道	14,600	19,670.00	287,182,000
西武ホールディングス	20,900	1,863.00	38,936,700
鴻池運輸	2,300	1,809.00	4,160,700
西日本鉄道	4,500	2,910.00	13,095,000
ハマキョウレックス	1,200	3,360.00	4,032,000
サカイ引越センター	900	4,730.00	4,257,000
近鉄グループホールディングス	15,500	4,115.00	63,782,500
阪急阪神ホールディングス	20,700	3,945.00	81,661,500
南海電気鉄道	7,400	2,729.00	20,194,600
京阪ホールディングス	6,900	3,365.00	23,218,500
神戸電鉄	400	3,850.00	1,540,000
名古屋鉄道	12,000	2,700.00	32,400,000
山陽電気鉄道	1,200	2,721.00	3,265,200
日本通運	6,100	6,990.00	42,639,000
ヤマトホールディングス	27,200	2,687.50	73,100,000
山九	4,000	5,130.00	20,520,000
丸運	900	336.00	302,400
丸全昭和運輸	5,000	501.00	2,505,000
センコーグループホールディングス	9,300	702.00	6,528,600
トナミホールディングス	400	4,910.00	1,964,000
ニッコンホールディングス	5,900	2,682.00	15,823,800
日本石油輸送	200	3,095.00	619,000
福山通運	2,200	3,820.00	8,404,000
セイノーホールディングス	11,600	1,695.00	19,662,000
神奈川中央交通	400	3,640.00	1,456,000
日立物流	3,400	2,564.00	8,717,600
丸和運輸機関	800	3,645.00	2,916,000
C & F ロジホールディングス	1,700	1,423.00	2,419,100
九州旅客鉄道	13,000	3,300.00	42,900,000
S Gホールディングス	10,900	2,227.00	24,274,300
日本郵船	13,000	2,347.00	30,511,000
商船三井	9,800	3,315.00	32,487,000
川崎汽船	7,200	2,669.00	19,216,800

N S ユナイテッド海運	700	2,235.00	1,564,500
明治海運	1,700	420.00	714,000
飯野海運	7,900	547.00	4,321,300
共栄タンカー	100	1,860.00	186,000
乾汽船	1,200	786.00	943,200
日本航空	28,800	3,872.00	111,513,600
A N A ホールディングス	30,400	4,151.00	126,190,400
パスコ	2,000	316.00	632,000
トランコム	400	6,900.00	2,760,000
日新	1,300	2,737.00	3,558,100
三菱倉庫	5,400	2,491.00	13,451,400
三井倉庫ホールディングス	9,000	332.00	2,988,000
住友倉庫	11,000	723.00	7,953,000
澁澤倉庫	900	1,789.00	1,610,100
東陽倉庫	2,900	338.00	980,200
日本トランスシティ	4,000	416.00	1,664,000
ケイヒン	300	1,707.00	512,100
中央倉庫	1,000	1,050.00	1,050,000
川西倉庫	300	1,979.00	593,700
安田倉庫	1,400	883.00	1,236,200
東洋埠頭	500	1,681.00	840,500
宇徳	1,300	467.00	607,100
上組	9,800	2,355.00	23,079,000
サンリツ	400	814.00	325,600
キムラユニティー	400	1,122.00	448,800
キューソー流通システム	500	2,533.00	1,266,500
近鉄エクスプレス	2,900	1,984.00	5,753,600
東海運	900	419.00	377,100
エーアイティー	1,100	1,141.00	1,255,100
内外トランスライン	600	1,822.00	1,093,200
日本コンセプト	300	1,387.00	416,100
N E C ネットエスアイ	1,800	2,676.00	4,816,800
システナ	1,300	4,275.00	5,557,500
デジタルアーツ	800	3,360.00	2,688,000
新日鉄住金ソリューションズ	2,500	2,734.00	6,835,000
キューブシステム	900	781.00	702,900
エイジア	200	1,370.00	274,000
コア	700	1,264.00	884,800
ソリトンシステムズ	500	1,415.00	707,500
ソフトクリエイティブホールディングス	800	1,500.00	1,200,000
T I S	5,300	3,775.00	20,007,500
ネオス	500	419.00	209,500

電算システム	600	1,878.00	1,126,800
グリー	8,600	666.00	5,727,600
コーエーテクモホールディングス	2,700	2,182.00	5,891,400
三菱総合研究所	700	3,320.00	2,324,000
ボルテージ	300	928.00	278,400
電算	200	2,488.00	497,600
A G S	900	812.00	730,800
ファインデックス	1,300	794.00	1,032,200
ヒト・コミュニケーションズ	400	1,822.00	728,800
ブレインパッド	400	2,402.00	960,800
K L a b	3,100	1,608.00	4,984,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,200	2,076.00	2,491,200
イーブুকイニシアティブジャパン	200	983.00	196,600
ネクソン	17,800	3,745.00	66,661,000
アイスタイル	4,000	1,394.00	5,576,000
エムアップ	500	1,068.00	534,000
エイチーム	1,100	2,369.00	2,605,900
テクノスジャパン	1,500	890.00	1,335,000
e n i s h	500	1,022.00	511,000
コロプラ	5,200	943.00	4,903,600
モバイルクリエイト	1,300	331.00	430,300
オルトプラス	800	848.00	678,400
ブロードリーフ	4,000	1,044.00	4,176,000
ハーツユナイテッドグループ	900	1,461.00	1,314,900
メディアドゥホールディングス	500	1,863.00	931,500
ブイキューブ	1,000	491.00	491,000
サイバーリンクス	300	1,233.00	369,900
ディー・エル・イー	1,000	359.00	359,000
フィックスターズ	300	6,330.00	1,899,000
VOYAGE GROUP	800	1,188.00	950,400
オブティム	300	2,218.00	665,400
セレス	500	1,669.00	834,500
ベリサーブ	200	3,160.00	632,000
ティーガイア	1,600	2,715.00	4,344,000
セック	200	3,020.00	604,000
日本アジアグループ	1,700	464.00	788,800
豆蔵ホールディングス	1,200	1,201.00	1,441,200
テクマトリックス	900	1,765.00	1,588,500
プロシップ	200	2,086.00	417,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	43,500	310.00	13,485,000
GMOペイメントゲートウェイ	1,100	8,430.00	9,273,000
ザッパラス	800	386.00	308,800

システムリサーチ	100	2,265.00	226,500
インターネットイニシアティブ	2,600	2,293.00	5,961,800
さくらインターネット	1,900	741.00	1,407,900
ヴィンクス	200	1,165.00	233,000
GMOクラウド	400	2,287.00	914,800
SRAホールディングス	900	3,255.00	2,929,500
Minorityソリューションズ	300	1,517.00	455,100
システムインテグレータ	200	951.00	190,200
朝日ネット	1,500	505.00	757,500
eBASE	300	1,054.00	316,200
アドソル日進	600	1,305.00	783,000
フリービット	1,100	884.00	972,400
コムチュア	800	3,520.00	2,816,000
サイバーコム	300	1,321.00	396,300
メディカル・データ・ビジョン	600	2,148.00	1,288,800
gumi	1,900	1,033.00	1,962,700
ショーケース・ティービー	300	1,278.00	383,400
モバイルファクトリー	300	1,204.00	361,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	300	3,015.00	904,500
PCIホールディングス	300	3,125.00	937,500
パイプドHD	300	1,314.00	394,200
アイビーシー	200	1,372.00	274,400
オープンドア	600	2,221.00	1,332,600
マイネット	300	1,428.00	428,400
アカツキ	300	6,140.00	1,842,000
Ubicomホールディングス	200	1,048.00	209,600
LINE	4,800	4,270.00	20,496,000
シンクロ・フード	100	4,025.00	402,500
オークネット	500	1,618.00	809,000
AOI TYO Holdings	1,300	1,199.00	1,558,700
マクロミル	1,500	2,685.00	4,027,500
ソルクシーズ	600	1,083.00	649,800
フェイス	600	1,198.00	718,800
ハイマックス	200	1,653.00	330,600
野村総合研究所	10,700	4,570.00	48,899,000
サイバネットシステム	1,300	748.00	972,400
CEホールディングス	500	842.00	421,000
日本システム技術	200	1,269.00	253,800
インテージホールディングス	1,900	1,165.00	2,213,500
東邦システムサイエンス	500	810.00	405,000
ソースネクスト	2,200	633.00	1,392,600
フォーカスシステムズ	900	899.00	809,100

クレスコ	400	3,590.00	1,436,000
フジ・メディア・ホールディングス	16,800	1,926.00	32,356,800
オービック	5,100	8,180.00	41,718,000
ジャストシステム	2,600	2,110.00	5,486,000
TDCソフト	700	1,152.00	806,400
ヤフー	115,600	500.00	57,800,000
トレンドマイクロ	7,800	5,170.00	40,326,000
インフォメーション・ディベロプメント	500	1,308.00	654,000
日本オラクル	2,600	8,260.00	21,476,000
アルファシステムズ	500	2,210.00	1,105,000
フューチャー	2,200	1,222.00	2,688,400
CAC Holdings	1,200	985.00	1,182,000
ソフトバンク・テクノロジー	700	1,911.00	1,337,700
トーセ	400	1,730.00	692,000
オービックビジネスコンサルタント	800	5,760.00	4,608,000
伊藤忠テクノソリューションズ	3,700	4,000.00	14,800,000
アイティフォー	1,900	697.00	1,324,300
東計電算	300	3,010.00	903,000
エクスネット	300	882.00	264,600
大塚商会	4,800	9,000.00	43,200,000
サイボウズ	2,200	505.00	1,111,000
ソフトブレーン	1,300	412.00	535,600
電通国際情報サービス	1,000	2,954.00	2,954,000
デジタルガレージ	2,900	2,912.00	8,444,800
EMシステムズ	600	2,449.00	1,469,400
ウェザーニューズ	500	3,185.00	1,592,500
C I J	1,200	669.00	802,800
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,730.00	173,000
日本エンタープライズ	1,700	218.00	370,600
WOWOW	800	3,230.00	2,584,000
スカラ	1,300	770.00	1,001,000
イマジカ・ロボットホールディングス	1,400	1,203.00	1,684,200
ネットワンシステムズ	6,600	1,539.00	10,157,400
システムソフト	3,900	132.00	514,800
アルゴグラフィックス	700	3,300.00	2,310,000
マーベラス	2,700	896.00	2,419,200
エイベックス	3,000	1,504.00	4,512,000
日本ユニシス	4,500	2,135.00	9,607,500
兼松エレクトロニクス	1,000	2,845.00	2,845,000
東京放送ホールディングス	9,700	2,341.00	22,707,700
日本テレビホールディングス	14,700	2,066.00	30,370,200
朝日放送	1,600	864.00	1,382,400

テレビ朝日ホールディングス	4,400	2,393.00	10,529,200
スカパーJ S A Tホールディングス	12,200	472.00	5,758,400
テレビ東京ホールディングス	1,300	2,718.00	3,533,400
日本BS放送	600	1,345.00	807,000
ビジョン	400	2,653.00	1,061,200
USEN-NEXT HOLDINGS	400	999.00	399,600
ワイヤレスゲート	800	1,234.00	987,200
コネクシオ	1,100	2,147.00	2,361,700
日本通信	14,800	110.00	1,628,000
クロップス	300	891.00	267,300
日本電信電話	115,200	4,690.00	540,288,000
KDDI	144,500	2,597.50	375,338,750
光通信	1,900	14,630.00	27,797,000
NTTドコモ	118,800	2,649.50	314,760,600
エムティーアイ	2,200	660.00	1,452,000
GMOインターネット	5,900	1,720.00	10,148,000
アйдママーケティングコミュニケーション	300	689.00	206,700
カドカワ	4,700	1,233.00	5,795,100
学研ホールディングス	500	5,730.00	2,865,000
ゼンリン	1,900	3,360.00	6,384,000
昭文社	800	742.00	593,600
インプレスホールディングス	1,500	195.00	292,500
アイネット	900	1,533.00	1,379,700
松竹	1,100	15,010.00	16,511,000
東宝	10,600	3,385.00	35,881,000
東映	600	10,590.00	6,354,000
エヌ・ティ・ティ・データ	49,800	1,126.00	56,074,800
ピー・シー・エー	300	1,730.00	519,000
ビジネスブレイン太田昭和	300	1,754.00	526,200
D T S	1,700	3,705.00	6,298,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,500	4,370.00	32,775,000
シーイーシー	1,000	3,025.00	3,025,000
カブコン	3,400	4,035.00	13,719,000
アイ・エス・ビー	300	1,237.00	371,100
ジャステック	900	1,205.00	1,084,500
S C S K	3,700	4,300.00	15,910,000
日本システムウエア	500	2,593.00	1,296,500
アイネス	2,000	1,058.00	2,116,000
T K C	1,500	4,070.00	6,105,000
富士ソフト	2,200	3,570.00	7,854,000
N S D	2,600	2,100.00	5,460,000
コナミホールディングス	6,600	5,520.00	36,432,000

福井コンピュータホールディングス	500	2,406.00	1,203,000
J B C Cホールディングス	1,300	1,035.00	1,345,500
ミロク情報サービス	1,400	3,130.00	4,382,000
ソフトバンクグループ	72,700	8,992.00	653,718,400
ハウスイ	100	1,149.00	114,900
高千穂交易	600	1,106.00	663,600
伊藤忠食品	400	6,040.00	2,416,000
エレマテック	800	2,289.00	1,831,200
J A L U X	500	2,901.00	1,450,500
あらた	800	4,535.00	3,628,000
トーメンデバイス	300	2,756.00	826,800
東京エレクトロン デバイス	600	2,204.00	1,322,400
フィールズ	1,200	1,205.00	1,446,000
双日	95,400	334.00	31,863,600
アルフレッサ ホールディングス	17,900	2,315.00	41,438,500
横浜冷凍	3,900	1,059.00	4,130,100
神栄	200	1,418.00	283,600
ラサ商事	700	915.00	640,500
ラクーン	900	682.00	613,800
アルコニックス	1,700	2,381.00	4,047,700
神戸物産	1,000	4,020.00	4,020,000
ペッパーフードサービス	900	4,520.00	4,068,000
あい ホールディングス	2,600	2,631.00	6,840,600
ディーブイエックス	600	1,220.00	732,000
ダイワボウホールディングス	1,400	4,080.00	5,712,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,000	3,065.00	9,195,000
ラクト・ジャパン	200	3,735.00	747,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,000	990.00	2,970,000
八洲電機	1,300	861.00	1,119,300
メディアスホールディングス	300	2,213.00	663,900
U K Cホールディングス	1,000	2,147.00	2,147,000
ジューテックホールディングス	400	1,271.00	508,400
大光	400	911.00	364,400
O C H Iホールディングス	500	1,351.00	675,500
T O K A Iホールディングス	8,500	1,081.00	9,188,500
大阪工機	300	1,042.00	312,600
三洋貿易	900	2,281.00	2,052,900
ビューティガレージ	200	1,906.00	381,200
ウイン・パートナーズ	1,200	1,550.00	1,860,000
ミタチ産業	400	1,520.00	608,000
シップヘルスケアホールディングス	3,400	3,525.00	11,985,000
明治電機工業	600	1,907.00	1,144,200

デリカフーズホールディングス	300	1,409.00	422,700
スターティア	400	972.00	388,800
コメダホールディングス	3,000	2,124.00	6,372,000
富士興産	700	632.00	442,400
協栄産業	200	1,948.00	389,600
小野建	1,400	1,916.00	2,682,400
佐島電機	1,200	1,008.00	1,209,600
エコートレーディング	400	760.00	304,000
伯東	1,000	1,658.00	1,658,000
コンドーテック	1,300	949.00	1,233,700
中山福	1,000	754.00	754,000
ナガイレーベン	2,100	2,794.00	5,867,400
三菱食品	1,800	3,080.00	5,544,000
松田産業	1,200	1,861.00	2,233,200
第一興商	2,400	5,330.00	12,792,000
メディバルホールディングス	16,100	2,059.00	33,149,900
S P K	400	2,919.00	1,167,600
萩原電気	500	3,280.00	1,640,000
アズワン	1,300	6,710.00	8,723,000
スズデン	600	1,735.00	1,041,000
シモジマ	1,000	1,108.00	1,108,000
ドウシシャ	1,700	2,399.00	4,078,300
小津産業	400	2,151.00	860,400
高速	1,000	1,217.00	1,217,000
たけびし	600	1,786.00	1,071,600
黒田電気	1,200	2,708.00	3,249,600
リックス	400	1,999.00	799,600
丸文	1,400	1,037.00	1,451,800
ハピネット	1,100	1,682.00	1,850,200
橋本総業ホールディングス	300	1,794.00	538,200
日本ライフライン	4,600	3,265.00	15,019,000
エクセル	700	2,488.00	1,741,600
マルカキカイ	500	2,132.00	1,066,000
I D O M	4,900	668.00	3,273,200
日本エム・ディ・エム	1,100	947.00	1,041,700
進和	1,000	2,262.00	2,262,000
エスケイジャパン	400	550.00	220,000
ダイトロン	700	2,285.00	1,599,500
シークス	1,000	4,500.00	4,500,000
田中商事	500	750.00	375,000
オーハシテクニカ	900	1,727.00	1,554,300
白銅	600	2,345.00	1,407,000

伊藤忠商事	118,200	2,011.50	237,759,300
丸紅	132,400	782.60	103,616,240
高島	300	2,133.00	639,900
長瀬産業	9,700	1,801.00	17,469,700
蝶理	1,000	1,893.00	1,893,000
豊田通商	18,000	3,930.00	70,740,000
三共生興	2,700	502.00	1,355,400
兼松	6,900	1,350.00	9,315,000
ツカモトコーポレーション	300	1,228.00	368,400
三井物産	136,800	1,867.50	255,474,000
日本紙パルプ商事	800	4,235.00	3,388,000
日立ハイテクノロジーズ	5,600	4,875.00	27,300,000
カメイ	2,100	1,553.00	3,261,300
東都水産	300	1,960.00	588,000
OUGホールディングス	300	2,700.00	810,000
スターゼン	600	4,870.00	2,922,000
山善	6,300	1,171.00	7,377,300
椿本興業	400	3,175.00	1,270,000
住友商事	101,600	1,801.50	183,032,400
内田洋行	800	3,145.00	2,516,000
三菱商事	113,000	2,921.00	330,073,000
第一実業	700	3,185.00	2,229,500
キャノンマーケティングジャパン	4,600	2,790.00	12,834,000
西華産業	1,000	2,251.00	2,251,000
佐藤商事	1,500	1,094.00	1,641,000
菱洋エレクトロ	1,500	1,739.00	2,608,500
東京産業	1,700	570.00	969,000
ユアサ商事	1,500	3,605.00	5,407,500
神鋼商事	400	3,560.00	1,424,000
小林産業	1,100	349.00	383,900
阪和興業	3,000	4,830.00	14,490,000
正栄食品工業	900	3,860.00	3,474,000
カナデン	1,500	1,326.00	1,989,000
菱電商事	1,200	1,821.00	2,185,200
フルサト工業	900	1,728.00	1,555,200
岩谷産業	3,600	3,915.00	14,094,000
すてきナイスグループ	700	1,385.00	969,500
昭光通商	6,000	122.00	732,000
ニチモウ	300	1,774.00	532,200
極東貿易	2,000	424.00	848,000
イワキ	2,000	401.00	802,000
三愛石油	4,300	1,451.00	6,239,300

稲畑産業	3,900	1,516.00	5,912,400
G S Iクレオス	400	1,833.00	733,200
明和産業	1,500	477.00	715,500
ワキタ	3,400	1,250.00	4,250,000
東邦ホールディングス	4,800	2,422.00	11,625,600
サンゲツ	5,400	2,185.00	11,799,000
ミツウロコグループホールディングス	2,300	742.00	1,706,600
シナネンホールディングス	800	2,512.00	2,009,600
伊藤忠エネクス	3,600	994.00	3,578,400
サンリオ	4,500	1,871.00	8,419,500
サンワテクノス	1,000	2,104.00	2,104,000
リョーサン	2,000	3,845.00	7,690,000
新光商事	1,800	1,835.00	3,303,000
トーヨー	700	2,353.00	1,647,100
三信電気	1,500	1,769.00	2,653,500
東陽テクニカ	1,900	954.00	1,812,600
モスフードサービス	2,100	3,225.00	6,772,500
加賀電子	1,500	2,672.00	4,008,000
ソーダニッカ	1,700	631.00	1,072,700
立花エレテック	1,100	2,209.00	2,429,900
フォーバル	700	897.00	627,900
P A L T A C	2,200	5,340.00	11,748,000
三谷産業	1,700	424.00	720,800
太平洋興発	700	1,049.00	734,300
西本Wismettacホールディングス	300	4,010.00	1,203,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,480.00	148,000
ヤマタネ	800	1,902.00	1,521,600
丸紅建材リース	2,000	228.00	456,000
日鉄住金物産	1,200	5,870.00	7,044,000
泉州電業	500	2,747.00	1,373,500
トラスコ中山	3,300	2,612.00	8,619,600
オートバックスセブン	6,400	2,037.00	13,036,800
モリト	1,300	935.00	1,215,500
加藤産業	2,500	3,620.00	9,050,000
イノテック	1,400	1,251.00	1,751,400
イエローハット	1,500	3,205.00	4,807,500
J Kホールディングス	1,600	836.00	1,337,600
日伝	1,300	2,248.00	2,922,400
北沢産業	1,400	266.00	372,400
杉本商事	900	1,803.00	1,622,700
因幡電機産業	2,100	4,935.00	10,363,500
バイテックホールディングス	700	1,635.00	1,144,500

東テク	500	2,326.00	1,163,000
ミスミグループ本社	18,700	2,885.00	53,949,500
アルテック	1,400	309.00	432,600
タキヒヨー	500	2,230.00	1,115,000
蔵王産業	300	1,821.00	546,300
スズケン	7,300	4,145.00	30,258,500
ジェコス	1,100	1,208.00	1,328,800
ルネサスイーストン	1,500	706.00	1,059,000
ローソン	4,100	7,260.00	29,766,000
サンエー	1,200	5,550.00	6,660,000
カワチ薬品	1,200	2,532.00	3,038,400
エービーシー・マート	2,900	6,630.00	19,227,000
ハードオフコーポレーション	700	1,140.00	798,000
アスクル	1,400	3,590.00	5,026,000
ゲオホールディングス	3,000	2,039.00	6,117,000
アダストリア	2,500	2,190.00	5,475,000
ジーフット	1,000	779.00	779,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	692.00	138,400
くらコーポレーション	1,000	6,290.00	6,290,000
キャンドウ	800	1,715.00	1,372,000
パルグループホールディングス	800	2,929.00	2,343,200
エディオン	6,200	1,315.00	8,153,000
サーラコーポレーション	2,800	661.00	1,850,800
ワッツ	700	1,048.00	733,600
ハローズ	600	2,415.00	1,449,000
あみやき亭	300	5,100.00	1,530,000
ひらまつ	2,300	540.00	1,242,000
大黒天物産	400	5,090.00	2,036,000
ハニーズホールディングス	1,600	997.00	1,595,200
ファーマライズホールディングス	400	586.00	234,400
アルペン	1,200	2,452.00	2,942,400
ハブ	300	1,224.00	367,200
クオール	1,800	2,173.00	3,911,400
ジーンズ	1,100	5,180.00	5,698,000
ビックカメラ	9,300	1,637.00	15,224,100
D C Mホールディングス	8,700	1,069.00	9,300,300
MonotaRO	5,700	3,420.00	19,494,000
東京一番フーズ	400	692.00	276,800
DDホールディングス	400	3,400.00	1,360,000
きちり	500	705.00	352,500
アーランドサービスホールディングス	1,300	2,120.00	2,756,000
J.フロント リテイリング	19,300	1,924.00	37,133,200

ドトール・日レスホールディングス	2,800	2,532.00	7,089,600
マツモトキヨシホールディングス	6,600	4,245.00	28,017,000
ブロンコピラー	900	3,305.00	2,974,500
スタートトゥデイ	15,800	2,843.00	44,919,400
トレジャー・ファクトリー	500	852.00	426,000
物語コーポレーション	400	9,370.00	3,748,000
ココカラファイン	1,700	6,910.00	11,747,000
三越伊勢丹ホールディングス	30,100	1,263.00	38,016,300
H a m e e	400	1,733.00	693,200
ウエルシアホールディングス	4,300	4,560.00	19,608,000
クリエイティブSDホールディングス	2,400	2,631.00	6,314,400
丸善C H Iホールディングス	1,900	334.00	634,600
ミサワ	400	432.00	172,800
ティーライフ	200	1,207.00	241,400
エー・ピーカンパニー	300	793.00	237,900
チムニー	500	2,878.00	1,439,000
シュッピン	1,000	1,135.00	1,135,000
ネクステージ	1,700	1,002.00	1,703,400
ジョイフル本田	2,400	3,465.00	8,316,000
鳥貴族	600	2,982.00	1,789,200
キリン堂ホールディングス	600	1,780.00	1,068,000
ホットランド	900	1,388.00	1,249,200
すかいらーく	10,000	1,552.00	15,520,000
綿半ホールディングス	600	3,825.00	2,295,000
ヨシックス	300	3,460.00	1,038,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,300	1,084.00	5,745,200
ブックオフコーポレーション	1,000	833.00	833,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	1,049.00	734,300
B E E N O S	300	1,500.00	450,000
あさひ	1,200	1,331.00	1,597,200
日本調剤	600	3,800.00	2,280,000
コスモス薬品	800	19,280.00	15,424,000
トーエル	800	954.00	763,200
一六堂	400	441.00	176,400
オンリー	300	888.00	266,400
セブン&アイ・ホールディングス	67,500	4,444.00	299,970,000
薬王堂	700	3,535.00	2,474,500
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	4,300	1,204.00	5,177,200
ツルハホールディングス	3,500	14,790.00	51,765,000
サンマルクホールディングス	1,100	3,245.00	3,569,500
フェリシモ	400	1,262.00	504,800

トリドールホールディングス	2,000	3,565.00	7,130,000
TOKYO BASE	300	3,710.00	1,113,000
サツドラホールディングス	300	1,905.00	571,500
ダイユー・リックホールディングス	800	1,306.00	1,044,800
パロックジャパンリミテッド	1,300	901.00	1,171,300
クスリのアオキホールディングス	1,300	5,910.00	7,683,000
スシログローバルホールディングス	1,600	4,470.00	7,152,000
LIXILビバ	1,500	2,066.00	3,099,000
メディカルシステムネットワーク	1,900	571.00	1,084,900
総合メディカル	700	6,020.00	4,214,000
はるやまホールディングス	800	1,018.00	814,400
ノジマ	2,800	2,470.00	6,916,000
カッパ・クリエイト	2,100	1,237.00	2,597,700
ライトオン	1,400	922.00	1,290,800
ジーンズメイト	500	871.00	435,500
良品計画	2,100	34,500.00	72,450,000
三城ホールディングス	2,000	519.00	1,038,000
アドヴァン	1,600	1,025.00	1,640,000
アルビス	400	3,330.00	1,332,000
コナカ	2,100	564.00	1,184,400
ハウス オブ ローゼ	200	1,703.00	340,600
G-7ホールディングス	500	2,328.00	1,164,000
イオン北海道	1,600	813.00	1,300,800
コジマ	2,900	331.00	959,900
ヒマラヤ	500	1,230.00	615,000
コーナン商事	2,300	2,516.00	5,786,800
エコス	700	1,211.00	847,700
ワタミ	1,900	1,509.00	2,867,100
マルシェ	500	806.00	403,000
ドンキホーテホールディングス	10,500	5,790.00	60,795,000
西松屋チェーン	3,500	1,284.00	4,494,000
ゼンショーホールディングス	8,400	2,193.00	18,421,200
幸楽苑ホールディングス	1,000	1,861.00	1,861,000
ハークスレイ	400	1,050.00	420,000
サイゼリヤ	2,400	3,055.00	7,332,000
V Tホールディングス	5,500	512.00	2,816,000
魚力	500	1,202.00	601,000
ポプラ	400	847.00	338,800
フジ・コーポレーション	300	2,462.00	738,600
ユナイテッドアローズ	2,000	4,060.00	8,120,000
ハイデイ日高	1,800	3,230.00	5,814,000
京都きもの友禅	1,100	767.00	843,700

コロワイド	5,300	2,411.00	12,778,300
ピーシーデポコーポレーション	2,400	739.00	1,773,600
壱番屋	1,100	4,430.00	4,873,000
トップカルチャー	600	479.00	287,400
P L A N T	400	1,300.00	520,000
スギホールディングス	3,500	5,660.00	19,810,000
ヴィア・ホールディングス	1,500	682.00	1,023,000
スクロール	2,500	413.00	1,032,500
ヨンドシーホールディングス	1,600	2,744.00	4,390,400
ユニー・ファミリーマートホールディングス	5,200	7,290.00	37,908,000
木曽路	2,000	2,691.00	5,382,000
S R Sホールディングス	1,900	940.00	1,786,000
千趣会	3,000	624.00	1,872,000
タカキュー	1,400	220.00	308,000
ケーヨー	3,000	632.00	1,896,000
上新電機	1,900	3,465.00	6,583,500
日本瓦斯	3,000	4,255.00	12,765,000
ロイヤルホールディングス	2,900	2,938.00	8,520,200
東天紅	100	1,921.00	192,100
いなげや	1,800	1,767.00	3,180,600
島忠	3,900	3,425.00	13,357,500
チヨダ	1,900	2,754.00	5,232,600
ライフコーポレーション	1,200	2,759.00	3,310,800
リンガーハット	2,000	2,391.00	4,782,000
さが美グループホールディングス	2,000	116.00	232,000
M r M a x H D	2,000	715.00	1,430,000
テンアライド	1,600	461.00	737,600
A O K Iホールディングス	3,200	1,775.00	5,680,000
オークワ	2,000	1,072.00	2,144,000
コメリ	2,500	3,065.00	7,662,500
青山商事	3,100	4,415.00	13,686,500
しまむら	1,900	12,520.00	23,788,000
はせがわ	900	497.00	447,300
高島屋	25,000	1,091.00	27,275,000
松屋	3,200	1,487.00	4,758,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,600	2,077.00	15,785,200
近鉄百貨店	600	3,825.00	2,295,000
パルコ	1,600	1,477.00	2,363,200
丸井グループ	15,400	1,888.00	29,075,200
アクシアル リテイリング	1,300	4,160.00	5,408,000
イオン	62,000	1,804.50	111,879,000
イズミ	2,900	6,940.00	20,126,000

東武ストア	200	3,030.00	606,000
平和堂	3,300	2,283.00	7,533,900
フジ	1,900	2,176.00	4,134,400
ヤオコー	1,800	5,270.00	9,486,000
ゼビオホールディングス	2,200	2,313.00	5,088,600
ケーズホールディングス	6,800	2,940.00	19,992,000
Olympicグループ	1,000	583.00	583,000
日産東京販売ホールディングス	2,400	390.00	936,000
Genky DrugStores	600	3,500.00	2,100,000
アインホールディングス	2,200	6,830.00	15,026,000
元気寿司	400	2,755.00	1,102,000
ヤマダ電機	54,000	662.00	35,748,000
アークランドサカモト	2,700	1,805.00	4,873,500
ニトリホールディングス	6,400	17,000.00	108,800,000
愛眼	1,300	459.00	596,700
ケーユーホールディングス	900	1,080.00	972,000
吉野家ホールディングス	5,300	1,995.00	10,573,500
松屋フーズ	800	3,735.00	2,988,000
サガミチェーン	2,200	1,372.00	3,018,400
関西スーパーマーケット	1,200	1,121.00	1,345,200
王将フードサービス	1,200	4,985.00	5,982,000
プレナス	1,800	2,084.00	3,751,200
ミニストップ	1,200	2,146.00	2,575,200
アークス	3,000	2,580.00	7,740,000
パローホールディングス	3,700	2,948.00	10,907,600
藤久	100	1,684.00	168,400
ベルク	700	5,940.00	4,158,000
大庄	900	1,694.00	1,524,600
ファーストリテイリング	2,700	41,020.00	110,754,000
サンドラッグ	6,800	4,695.00	31,926,000
サックスパーホールディングス	1,500	1,156.00	1,734,000
ヤマザワ	300	1,735.00	520,500
やまや	300	3,325.00	997,500
ベルーナ	3,900	1,199.00	4,676,100
島根銀行	400	1,375.00	550,000
じもとホールディングス	10,900	183.00	1,994,700
めぶきフィナンシャルグループ	83,700	441.00	36,911,700
東京TYフィナンシャルグループ	2,200	2,623.00	5,770,600
九州フィナンシャルグループ	26,300	605.00	15,911,500
ゆうちょ銀行	45,700	1,428.00	65,259,600
富山第一銀行	4,100	488.00	2,000,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	98,100	594.00	58,271,400

西日本フィナンシャルホールディングス	10,900	1,319.00	14,377,100	
新生銀行	14,000	1,699.00	23,786,000	
あおぞら銀行	9,600	4,325.00	41,520,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,139,600	767.40	874,529,040	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	177,100	608.60	107,783,060	
三井住友トラスト・ホールディングス	31,800	4,294.00	136,549,200	
三井住友フィナンシャルグループ	122,100	4,684.00	571,916,400	代用有価証券 13,000株
第四銀行	2,000	4,805.00	9,610,000	
北越銀行	1,600	2,330.00	3,728,000	
千葉銀行	58,000	882.00	51,156,000	
群馬銀行	32,800	658.00	21,582,400	
武蔵野銀行	2,600	3,470.00	9,022,000	
千葉興業銀行	4,500	478.00	2,151,000	
筑波銀行	6,700	348.00	2,331,600	
七十七銀行	5,100	2,644.00	13,484,400	
青森銀行	1,200	3,395.00	4,074,000	
秋田銀行	1,000	2,894.00	2,894,000	
山形銀行	1,800	2,358.00	4,244,400	
岩手銀行	1,100	4,115.00	4,526,500	
東邦銀行	14,400	382.00	5,500,800	
東北銀行	800	1,438.00	1,150,400	
みちのく銀行	1,000	1,791.00	1,791,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	66,000	560.00	36,960,000	
静岡銀行	42,000	1,075.00	45,150,000	
十六銀行	2,200	2,852.00	6,274,400	
スルガ銀行	16,500	2,005.00	33,082,500	
八十二銀行	29,200	616.00	17,987,200	
山梨中央銀行	10,000	420.00	4,200,000	
大垣共立銀行	2,500	2,651.00	6,627,500	
福井銀行	1,400	2,472.00	3,460,800	
北國銀行	1,800	4,225.00	7,605,000	
清水銀行	600	2,919.00	1,751,400	
富山銀行	300	3,660.00	1,098,000	
滋賀銀行	15,000	553.00	8,295,000	
南都銀行	1,900	2,958.00	5,620,200	
百五銀行	15,500	515.00	7,982,500	
京都銀行	6,200	5,810.00	36,022,000	
紀陽銀行	6,100	1,691.00	10,315,100	
三重銀行	700	2,299.00	1,609,300	
ほくほくフィナンシャルグループ	10,700	1,524.00	16,306,800	
広島銀行	23,800	832.00	19,801,600	

山陰合同銀行	9,600	1,008.00	9,676,800
中国銀行	11,200	1,310.00	14,672,000
鳥取銀行	500	1,731.00	865,500
伊予銀行	23,000	842.00	19,366,000
百十四銀行	17,000	347.00	5,899,000
四国銀行	2,500	1,522.00	3,805,000
阿波銀行	13,000	646.00	8,398,000
大分銀行	900	4,110.00	3,699,000
宮崎銀行	1,100	3,470.00	3,817,000
佐賀銀行	1,000	2,444.00	2,444,000
十八銀行	10,000	273.00	2,730,000
沖縄銀行	1,600	4,285.00	6,856,000
琉球銀行	3,100	1,589.00	4,925,900
セブン銀行	60,500	366.00	22,143,000
みずほフィナンシャルグループ	2,191,500	195.90	429,314,850
高知銀行	600	1,289.00	773,400
山口フィナンシャルグループ	15,000	1,257.00	18,855,000
長野銀行	500	1,884.00	942,000
名古屋銀行	1,300	3,965.00	5,154,500
北洋銀行	24,300	352.00	8,553,600
愛知銀行	500	5,330.00	2,665,000
第三銀行	900	1,630.00	1,467,000
中京銀行	700	2,301.00	1,610,700
大光銀行	600	2,323.00	1,393,800
愛媛銀行	2,200	1,279.00	2,813,800
トマト銀行	600	1,500.00	900,000
みなと銀行	1,500	2,113.00	3,169,500
京葉銀行	14,000	485.00	6,790,000
関西アーバン銀行	2,200	1,427.00	3,139,400
栃木銀行	8,300	405.00	3,361,500
北日本銀行	500	2,939.00	1,469,500
東和銀行	2,800	1,333.00	3,732,400
福島銀行	1,500	772.00	1,158,000
大東銀行	800	1,407.00	1,125,600
トモニホールディングス	13,300	484.00	6,437,200
フィデアホールディングス	15,700	189.00	2,967,300
池田泉州ホールディングス	17,100	409.00	6,993,900
F P G	5,600	1,357.00	7,599,200
マーキュリアインベストメント	300	1,213.00	363,900
S B Iホールディングス	18,300	2,249.00	41,156,700
ジャフコ	2,300	5,310.00	12,213,000
大和証券グループ本社	138,000	706.60	97,510,800

野村ホールディングス	276,900	648.80	179,652,720
岡三証券グループ	14,000	654.00	9,156,000
丸三証券	5,100	984.00	5,018,400
東洋証券	6,000	302.00	1,812,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,900	743.00	13,299,700
光世証券	400	1,370.00	548,000
水戸証券	5,100	378.00	1,927,800
いちよし証券	3,400	1,248.00	4,243,200
松井証券	7,900	1,007.00	7,955,300
だいこう証券ビジネス	800	641.00	512,800
マネックスグループ	17,200	349.00	6,002,800
カブドットコム証券	10,200	365.00	3,723,000
極東証券	2,200	1,513.00	3,328,600
岩井コスモホールディングス	1,700	1,316.00	2,237,200
藍澤証券	3,000	718.00	2,154,000
マネーパートナーズグループ	2,100	364.00	764,400
かんぽ生命保険	6,100	2,728.00	16,640,800
S O M P Oホールディングス	31,600	4,030.00	127,348,000
アニコム ホールディングス	1,100	3,415.00	3,756,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	42,200	3,456.00	145,843,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,300	1,976.00	26,280,800
第一生命ホールディングス	91,300	2,105.50	192,232,150
東京海上ホールディングス	60,800	4,865.00	295,792,000
アドバンテッジリスクマネジメント	400	1,192.00	476,800
T & Dホールディングス	49,900	1,837.50	91,691,250
アドバンスクリエイト	400	1,937.00	774,800
全国保証	4,500	4,530.00	20,385,000
イントラスト	100	1,671.00	167,100
アルヒ	1,400	1,349.00	1,888,600
クレディセゾン	12,300	1,781.00	21,906,300
芙蓉総合リース	1,800	7,140.00	12,852,000
興銀リース	3,000	2,734.00	8,202,000
東京センチュリー	3,200	5,840.00	18,688,000
日本証券金融	6,600	615.00	4,059,000
アイフル	27,300	386.00	10,537,800
リコーリース	1,300	3,545.00	4,608,500
イオンフィナンシャルサービス	11,400	2,463.00	28,078,200
アコム	32,600	445.00	14,507,000
ジャックス	2,000	2,469.00	4,938,000
オリエントコーポレーション	35,400	169.00	5,982,600
日立キャピタル	4,400	2,764.00	12,161,600
アプラスフィナンシャル	8,500	100.00	850,000

オリックス	107,600	1,847.50	198,791,000
三菱UFJリース	41,000	647.00	26,527,000
九州リースサービス	700	821.00	574,700
日本取引所グループ	47,400	1,806.00	85,604,400
イー・ギャランティ	400	3,870.00	1,548,000
アサックス	200	1,858.00	371,600
NECキャピタルソリューション	700	2,072.00	1,450,400
いちご	23,000	434.00	9,982,000
日本駐車場開発	19,500	178.00	3,471,000
ヒューリック	33,700	1,222.00	41,181,400
三栄建築設計	700	2,044.00	1,430,800
スター・マイカ	600	1,750.00	1,050,000
野村不動産ホールディングス	10,700	2,471.00	26,439,700
三重交通グループホールディングス	3,300	483.00	1,593,900
サムティ	1,400	1,805.00	2,527,000
ディア・ライフ	1,600	511.00	817,600
コーセーアールイー	300	1,028.00	308,400
エー・ディー・ワークス	22,100	41.00	906,100
日本商業開発	900	1,768.00	1,591,200
プレサンスコーポレーション	2,200	1,620.00	3,564,000
ユニゾホールディングス	1,900	2,761.00	5,245,900
THEグローバル社	800	860.00	688,000
日本管理センター	1,100	1,524.00	1,676,400
サンセイランディック	500	1,232.00	616,000
エストラスト	200	987.00	197,400
フージャースホールディングス	3,900	701.00	2,733,900
オープンハウス	2,600	5,920.00	15,392,000
東急不動産ホールディングス	39,100	777.00	30,380,700
飯田グループホールディングス	13,400	2,002.00	26,826,800
イーランド	200	1,175.00	235,000
ムゲンエステート	1,000	1,065.00	1,065,000
ファーストブラザーズ	400	1,402.00	560,800
ハウズドゥ	300	2,503.00	750,900
シーアールイー	300	1,620.00	486,000
ケイアイスター不動産	600	2,645.00	1,587,000
パーク24	8,900	2,546.00	22,659,400
バラカ	500	2,337.00	1,168,500
三井不動産	80,600	2,601.00	209,640,600
三菱地所	120,100	1,832.50	220,083,250
平和不動産	2,900	1,968.00	5,707,200
東京建物	17,600	1,656.00	29,145,600
ダイビル	4,200	1,312.00	5,510,400

京阪神ビルディング	2,700	821.00	2,216,700
住友不動産	39,000	3,788.00	147,732,000
大京	2,600	2,137.00	5,556,200
テオーシー	5,600	838.00	4,692,800
東京楽天地	300	5,080.00	1,524,000
レオパレス21	19,300	810.00	15,633,000
スターツコーポレーション	2,200	2,715.00	5,973,000
フジ住宅	2,100	813.00	1,707,300
空港施設	1,700	617.00	1,048,900
明和地所	900	755.00	679,500
ゴールドクレスト	1,300	2,102.00	2,732,600
日本エスリード	600	2,125.00	1,275,000
日神不動産	2,100	761.00	1,598,100
日本エスコン	2,800	858.00	2,402,400
タカラレーベン	7,600	452.00	3,435,200
サンヨーハウジング名古屋	900	1,200.00	1,080,000
イオンモール	10,400	2,174.00	22,609,600
ファースト住建	600	1,722.00	1,033,200
カチタス	1,600	3,125.00	5,000,000
トーセイ	2,000	1,273.00	2,546,000
穴吹興産	200	2,929.00	585,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	10,000	1,278.00	12,780,000
サンフロンティア不動産	1,800	1,134.00	2,041,200
エフ・ジェー・ネクスト	1,300	855.00	1,111,500
インテリックス	400	1,044.00	417,600
ランドビジネス	1,100	330.00	363,000
グランディハウス	1,400	441.00	617,400
日本空港ビルデング	4,700	3,910.00	18,377,000
日本工営	1,000	3,270.00	3,270,000
LIFULL	5,400	871.00	4,703,400
ジェイエイシーリクルートメント	1,300	2,118.00	2,753,400
日本M&Aセンター	5,400	6,370.00	34,398,000
メンバーズ	400	793.00	317,200
中広	200	720.00	144,000
タケエイ	1,600	1,193.00	1,908,800
トラスト・テック	700	2,964.00	2,074,800
コシダカホールディングス	800	5,860.00	4,688,000
パソナグループ	1,500	2,192.00	3,288,000
CDS	500	1,253.00	626,500
リンクアンドモチベーション	2,900	873.00	2,531,700
GCA	1,800	946.00	1,702,800
エス・エム・エス	3,100	3,980.00	12,338,000

パーソルホールディングス	14,400	2,609.00	37,569,600
リニカル	1,000	1,515.00	1,515,000
クックパッド	4,900	585.00	2,866,500
エスクリ	600	1,013.00	607,800
アイ・ケイ・ケイ	900	723.00	650,700
学情	700	1,520.00	1,064,000
スタジオアリス	800	2,695.00	2,156,000
シミックホールディングス	900	2,601.00	2,340,900
N J S	400	1,569.00	627,600
総合警備保障	6,200	4,960.00	30,752,000
カカクコム	12,000	1,795.00	21,540,000
アイロムグループ	600	2,215.00	1,329,000
セントケア・ホールディング	700	717.00	501,900
サイネックス	200	850.00	170,000
ルネサンス	800	1,768.00	1,414,400
ディップ	2,200	3,235.00	7,117,000
オプトホールディング	1,100	1,023.00	1,125,300
新日本科学	2,000	511.00	1,022,000
ツクイ	3,700	826.00	3,056,200
キャリアデザインセンター	400	2,040.00	816,000
エムスリー	16,500	3,920.00	64,680,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,200	600.00	720,000
プラス	100	963.00	96,300
アウトソーシング	4,700	1,853.00	8,709,100
ウェルネット	1,600	1,108.00	1,772,800
ワールドホールディングス	500	3,225.00	1,612,500
ディー・エヌ・エー	8,400	1,945.00	16,338,000
博報堂D Yホールディングス	21,700	1,546.00	33,548,200
ぐるなび	2,500	1,380.00	3,450,000
エスアールジータカミヤ	1,900	636.00	1,208,400
ジャパンベストレスキューシステム	2,000	768.00	1,536,000
ファンコミュニケーションズ	4,400	716.00	3,150,400
ライク	600	1,888.00	1,132,800
ビジネス・ブレークスルー	800	444.00	355,200
W D Bホールディングス	700	3,750.00	2,625,000
ティア	800	1,035.00	828,000
C D G	200	1,797.00	359,400
バリューコマース	1,400	1,198.00	1,677,200
インフォマート	7,900	796.00	6,288,400
J Pホールディングス	4,900	294.00	1,440,600
エコナックホールディングス	3,300	123.00	405,900
E P Sホールディングス	2,300	2,270.00	5,221,000

レグス	400	782.00	312,800
プレステージ・インターナショナル	3,200	1,290.00	4,128,000
アミューズ	1,000	3,220.00	3,220,000
ドリームインキュベータ	500	2,406.00	1,203,000
クイック	1,000	1,820.00	1,820,000
T A C	1,000	304.00	304,000
ケネディクス	20,600	655.00	13,493,000
電通	19,000	4,605.00	87,495,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	900.00	720,000
ぴあ	500	6,360.00	3,180,000
イオンファンタジー	500	4,965.00	2,482,500
シーティーエス	1,600	698.00	1,116,800
みらかホールディングス	4,700	4,260.00	20,022,000
アルプス技研	1,400	1,990.00	2,786,000
日本空調サービス	1,700	730.00	1,241,000
オリエンタルランド	18,500	10,315.00	190,827,500
ダスキン	4,200	2,616.00	10,987,200
明光ネットワークジャパン	2,000	1,278.00	2,556,000
ファルコホールディングス	800	1,675.00	1,340,000
秀英予備校	400	480.00	192,000
田谷	300	667.00	200,100
ラウンドワン	4,800	1,683.00	8,078,400
リゾートトラスト	6,600	2,421.00	15,978,600
ビー・エム・エル	2,000	2,565.00	5,130,000
ワタベウェディング	300	608.00	182,400
りらいあコミュニケーションズ	2,500	1,370.00	3,425,000
リソー教育	2,700	796.00	2,149,200
早稲田アカデミー	200	1,729.00	345,800
ユー・エス・エス	19,100	2,177.00	41,580,700
東京個別指導学院	600	1,296.00	777,600
サイバーエージェント	10,300	4,240.00	43,672,000
楽天	80,100	934.90	74,885,490
クリーク・アンド・リバー社	800	981.00	784,800
テー・オー・ダブリュー	1,500	871.00	1,306,500
セントラルスポーツ	600	3,870.00	2,322,000
フルキャストホールディングス	1,400	2,146.00	3,004,400
リソルホールディングス	200	4,015.00	803,000
テクノプロ・ホールディングス	2,800	5,710.00	15,988,000
アトラ	300	804.00	241,200
インターワークス	400	1,078.00	431,200
K e e P e r 技研	500	1,221.00	610,500
ファーストロジック	200	869.00	173,800

三機サービス	200	1,822.00	364,400
Gunosy	700	2,387.00	1,670,900
デザインワン・ジャパン	300	1,192.00	357,600
イー・ガーディアン	800	2,965.00	2,372,000
リブセンス	1,000	568.00	568,000
ジャパンマテリアル	1,400	4,140.00	5,796,000
ベクトル	1,900	2,228.00	4,233,200
ウチヤマホールディングス	800	580.00	464,000
ライクキッズネクスト	200	1,855.00	371,000
キャリアリンク	500	563.00	281,500
I B J	1,200	980.00	1,176,000
アサンテ	600	1,797.00	1,078,200
N・フィールド	900	1,894.00	1,704,600
バリューHR	400	2,141.00	856,400
M&Aキャピタルパートナーズ	300	7,650.00	2,295,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,018.00	610,800
E R Iホールディングス	500	935.00	467,500
アビスト	200	4,715.00	943,000
シグマクシス	600	1,424.00	854,400
ウィルグループ	700	1,481.00	1,036,700
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,100	444.00	932,400
日本ビューホテル	500	1,463.00	731,500
リクルートホールディングス	120,600	2,422.50	292,153,500
エラン	400	1,275.00	510,000
土木管理総合試験所	500	576.00	288,000
日本郵政	88,600	1,262.00	111,813,200
ベルシステム24ホールディングス	2,600	1,446.00	3,759,600
鎌倉新書	200	2,104.00	420,800
一蔵	200	1,051.00	210,200
L I T A L I C O	300	2,083.00	624,900
グローバルグループ	200	1,442.00	288,400
エボラブルアジア	300	2,334.00	700,200
ストライク	200	5,630.00	1,126,000
ソラスト	900	2,564.00	2,307,600
セラク	300	714.00	214,200
インソース	200	3,370.00	674,000
キャリアインデックス	200	2,051.00	410,200
M S - J a p a n	100	5,810.00	581,000
船場	200	1,212.00	242,400
リログループ	8,600	2,942.00	25,301,200
東祥	1,000	3,585.00	3,585,000
エイチ・アイ・エス	2,400	3,750.00	9,000,000

ラックランド	300	2,084.00	625,200
共立メンテナンス	2,800	4,415.00	12,362,000
イチネンホールディングス	1,700	1,487.00	2,527,900
建設技術研究所	1,100	1,190.00	1,309,000
スペース	900	1,302.00	1,171,800
長大	500	779.00	389,500
燦ホールディングス	400	2,680.00	1,072,000
スバル興業	100	6,550.00	655,000
東京テアトル	700	1,418.00	992,600
タナベ経営	300	1,834.00	550,200
ナガワ	300	4,340.00	1,302,000
よみうりランド	300	4,610.00	1,383,000
東京都競馬	1,200	3,815.00	4,578,000
常磐興産	600	1,818.00	1,090,800
カナモト	2,400	3,295.00	7,908,000
東京ドーム	6,300	965.00	6,079,500
西尾レントオール	1,400	3,965.00	5,551,000
トランス・コスモス	1,700	2,843.00	4,833,100
乃村工藝社	3,700	2,133.00	7,892,100
藤田観光	600	3,360.00	2,016,000
KNT-CTホールディングス	1,000	1,688.00	1,688,000
日本管財	1,700	2,019.00	3,432,300
トーカイ	1,400	2,542.00	3,558,800
白洋舎	200	3,680.00	736,000
セコム	16,600	7,591.00	126,010,600
セントラル警備保障	800	2,373.00	1,898,400
丹青社	3,200	1,019.00	3,260,800
メイテック	1,800	5,950.00	10,710,000
応用地質	1,800	1,332.00	2,397,600
船井総研ホールディングス	3,300	2,129.00	7,025,700
進学会ホールディングス	700	567.00	396,900
オオバ	1,200	551.00	661,200
いであ	300	1,092.00	327,600
学究社	400	1,636.00	654,400
ベネッセホールディングス	5,700	3,880.00	22,116,000
イオンディライト	1,900	3,740.00	7,106,000
ナック	1,100	882.00	970,200
ニチイ学館	3,000	1,192.00	3,576,000
ダイセキ	2,600	3,005.00	7,813,000
ステップ	600	1,791.00	1,074,600
合 計	19,760,900		40,156,024,100

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2018年 2月28日現在です。

【インデックスファンドTSP】

【純資産額計算書】

資産総額	24,579,301,872円
負債総額	45,701,787円
純資産総額（ - ）	24,533,600,085円
発行済口数	26,867,816,632口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9131円

（参考）

インデックス マザーファンド TOPIX

純資産額計算書

資産総額	41,829,695,953円
負債総額	84,180,673円
純資産総額（ - ）	41,745,515,280円
発行済口数	19,610,577,989口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1287円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている

振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2018年2月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2018年2月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2018年2月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2018年2月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	795	170,112

株式投資信託	751	141,795
単位型	220	8,329
追加型	531	133,466
公社債投資信託	44	28,316
単位型	30	456
追加型	14	27,859

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第58期事業年度(平成28年4月1日から平成29年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第59期中間会計期間(平成29年4月1日から平成29年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

無形固定資産		
ソフトウェア	140	138
無形固定資産合計	140	138
投資その他の資産		
投資有価証券	12,195	11,783
関係会社株式	21,702	23,203
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	781	782
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	425	423
投資その他の資産合計	35,165	36,253
固定資産合計	35,662	36,674
資産合計	71,905	71,252

(単位：百万円)

	第57期 (平成28年3月31日)		第58期 (平成29年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金	410	3	589	
未払金	3,841		4,043	
未払収益分配金	6		7	
未払償還金	112		91	
未払手数料	3	3,269	3	3,499
その他未払金		453		445
未払費用	3	4,920	3	4,229
未払法人税等		354		1,808
未払消費税等	4	649	4	538
関係会社短期借入金		5,631		-
賞与引当金		2,080		2,077
役員賞与引当金		145		168
その他	3	278	3	62
流動負債合計		18,312		13,517
固定負債				
退職給付引当金		1,154		1,259
固定負債合計		1,154		1,259
負債合計		19,466		14,777
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		29,948		34,015

利益剰余金合計	29,948	34,015
自己株式	502	672
株主資本合計	52,028	55,926
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	151	282
繰延ヘッジ損益	258	266
評価・換算差額等合計	410	548
純資産合計	52,438	56,475
負債純資産合計	71,905	71,252

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

諸経費		2,952		2,791
一般管理費計		14,577		14,394
営業利益		5,817		6,380

(単位：百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351
当期変動額							
剰余金の配当				850	850		850
当期純利益				4,962	4,962		4,962
自己株式の取得						434	434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,111	4,111	434	3,676
当期末残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028

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

第58期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算差額 等合計	
当期首残高	151	258	410	52,438
当期変動額				
剰余金の配当				1,495
当期純利益				5,562
自己株式の取得				170
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	130	7	138	138
当期変動額合計	130	7	138	4,036
当期末残高	282	266	548	56,475

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 5年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p>

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

(会計方針の変更)

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

(追加情報)

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

(貸借対照表関係)

第57期 (平成28年3月31日)	第58期 (平成29年3月31日)								
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">1,170百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">653百万円</td> </tr> </table>	建物	1,170百万円	器具備品	653百万円	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">1,222百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">603百万円</td> </tr> </table>	建物	1,222百万円	器具備品	603百万円
建物	1,170百万円								
器具備品	653百万円								
建物	1,222百万円								
器具備品	603百万円								
<p>2 信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託してあります。</p>	<p>2 信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託してあります。</p>								

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

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第57期 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第58期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

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

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用並びに(8) 関係会社短期借入金

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

(9) デリバティブ取引

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

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

(有価証券関係)

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,310
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(デリバティブ取引関係)

第57期(平成28年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第58期(平成29年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

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

(退職給付関係)

第57期(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、209百万円でありました。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、213百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

第58期(自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

(税効果会計関係)

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

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

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

（関連当事者情報）

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	312,000 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付 (シンガポールドル貸建) (注1)	65 (SGD 800 千) (注2)	関係会社短期貸付金	385 (SGD 4,800 千)
							貸付金利息 (シンガポールドル貸建) (注1)	13 (SGD 177 千)	未収収益	8 (SGD 105 千)
							資金の貸付 (円貸建) (注3)	4,422 (注4)	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注3)	3	未収収益	3

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

関連情報

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

新株予約権(ストックオプション)の付与

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

名に付与いたしました。

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

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第59期中間会計期間 (平成29年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		16,734
有価証券		17
未収委託者報酬		9,940
未収収益		2,241
関係会社短期貸付金		976
繰延税金資産		866
その他	2	2,935
流動資産合計		33,712
固定資産		
有形固定資産	1	243
無形固定資産		118
投資その他の資産		
投資有価証券		14,687
関係会社株式		23,203
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		784
繰延税金資産		298
長期前払費用		0
投資その他の資産合計		39,035
固定資産合計		39,397
資産合計		73,109

(単位：百万円)

		第59期中間会計期間 (平成29年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		4,545
未払費用		4,058
未払法人税等		1,473
未払消費税等	3	495
賞与引当金		1,207

役員賞与引当金		60
その他		943
流動負債合計		12,784
固定負債		
退職給付引当金		1,305
その他		43
固定負債合計		1,348
負債合計		14,133
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		36,351
利益剰余金合計		36,351
自己株式		786
株主資本合計		58,148
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		716
繰延ヘッジ損益		111
評価・換算差額等合計		827
純資産合計		58,976
負債純資産合計		73,109

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		33,067
その他営業収益		2,422
営業収益合計		35,490
営業費用及び一般管理費	1	31,576
営業利益		3,913
営業外収益	2	1,051
営業外費用	3	431
経常利益		4,533
特別利益	4	174
特別損失	5	124
税引前中間純利益		4,582
法人税等	6	1,211
中間純利益		3,371

(3) 中間株主資本等変動計算書

第59期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益剰 余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926
当中間期変動額							
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036
中間純利益				3,371	3,371		3,371
自己株式の取得						113	113
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				2,335	2,335	113	2,221
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	36,351	36,351	786	58,148

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	282	266	548	56,475
当中間期変動額				
剰余金の配当				1,036
中間純利益				3,371
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	434	155	279	279
当中間期変動額合計	434	155	279	2,501
当中間期末残高	716	111	827	58,976

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他の有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部 純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>

2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当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。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

第59期中間会計期間
(平成29年9月30日)

1	有形固定資産の減価償却累計額 1,819百万円
2	信託資産 流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4	保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務599百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務476百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 55百万円 無形固定資産 21百万円
2	営業外収益のうち主要なもの 受取利息 13百万円 受取配当金 1,005百万円
3	営業外費用のうち主要なもの 支払利息 104百万円 支払源泉所得税 97百万円 デリバティブ費用 205百万円
4	特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益 174百万円
5	特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損 119百万円
6	中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。

(中間株主資本等変動計算書関係)

第59期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,119,100	182,600	-	1,301,700

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,689,600	-	9,900	1,679,700	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	198,000	2,692,800	-
平成28年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	-	4,404,000	-
平成28年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	-	4,409,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	273,900	13,294,400	-

(注) 1 平成28年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 平成21年度ストックオプション(1)1,679,700株、平成21年度ストックオプション(2)108,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,692,800株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)及び平成28年度ストックオプション(2)は権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	865百万円
1年超	1,355百万円
合計	2,220百万円

(金融商品関係)

第59期中間会計期間(平成29年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日（当中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金及び預金	16,734	16,734	-
(2) 未収委託者報酬	9,940	9,940	-
(3) 未収収益	2,241	2,241	-
(4) 関係会社短期貸付金	976	976	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,688	14,688	-
(6) 未払金	(4,545)	(4,545)	-
(7) 未払費用	(4,058)	(4,058)	-
(8) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(263)	(263)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(52)	(52)	-
デリバティブ取引計	(316)	(316)	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

- (1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によつております。
- (5) 有価証券及び投資有価証券
投資信託は基準価額によつております。
- (6) 未払金及び(7) 未払費用
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によつております。
- (8) デリバティブ取引
(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないものは、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。またヘッジ会計が適用されているもののうち14百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、66百万円は、流動負債のその他に含まれております。

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

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

(有価証券関係)

第59期中間会計期間(平成29年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	20,310
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	11,892	10,815	1,077
	小計	11,892	10,815	1,077
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	2,796	2,841	44
	小計	2,796	2,841	44
合計		14,688	13,656	1,032

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

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

(デリバティブ取引関係)

第59期中間会計期間(平成29年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年 超 (百万円)	時 価 (百万円)	評価損 益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	5,080	-	263	263
	合計	5,080	-	263	263

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会 計 の 方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ 対象	契約額 等 (百万円)	契約額等のうち1年 超 (百万円)	時 価 (百万円)
	為替予約取引				

原則的 処理方法	売建	投資有価証 券			
	米ドル		4,855	-	13
	豪ドル		140	-	1
	シンガ ポー ルドル		1,616	-	17
	ユーロ		167	-	3
	香港ドル		541	-	1
	人民元		2,050	-	43
	合計		9,372	-	52

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,036百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,571百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	835百万円

(ストックオプション等関係)

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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

[関連情報]

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第59期中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1株当たり純資産額	301円34銭
1株当たり中間純利益金額	17円21銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
中間純利益(百万円)	3,371
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	3,371
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,877
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 1,679,700株、平成21年度ストックオプション(2) 108,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,692,800株、平成28年度ストックオプション(1) 4,404,000株、平成28年度ストックオプション(2) 4,409,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期中間会計期間 (平成29年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	58,976
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	58,976

1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	195,711
--------------------------------------	---------

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

（1）定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（2）訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

名 称	資本金の額 (2017年9月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額 : 51,000百万円（2017年9月末現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2017年9月末現在)	事業の内容
あかつき証券株式会社	3,067百万円	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。
池田泉州T T証券株式会社	1,250百万円	
エース証券株式会社	8,831百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社S B I証券	48,323百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
光世証券株式会社	12,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
高木証券株式会社	11,069百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
東武証券株式会社	420百万円	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	
東洋証券株式会社 1	13,494百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	
西日本シティT T証券株式会社	3,000百万円	
日本アジア証券株式会社	4,400百万円	
浜銀T T証券株式会社 1	3,307百万円	
ばんせい証券株式会社	1,558百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
丸三証券株式会社	10,000百万円	
みずほ証券株式会社 2	125,167百万円	
三菱U F J モルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
明和証券株式会社 1	511百万円	
山和証券株式会社	585百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	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。
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社沖縄銀行	22,725百万円	
株式会社神奈川銀行	5,191百万円	
株式会社京都銀行	42,103百万円	
株式会社きらぼし銀行	43,734百万円	
株式会社京葉銀行	49,759百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社四国銀行	25,000百万円	

株式会社ジャパンネット銀行	37,250百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社十六銀行	36,839百万円	
ソニー銀行株式会社	31,000百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社東北銀行	13,233百万円	
株式会社徳島銀行	11,036百万円	
株式会社栃木銀行	27,408百万円	
株式会社トマト銀行	17,810百万円	
株式会社富山銀行	6,730百万円	
株式会社富山第一銀行	10,182百万円	
株式会社三井住友銀行 1	1,770,996百万円	
株式会社みなと銀行	27,484百万円	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
株式会社山梨中央銀行	15,400百万円	
株式会社S M B C信託銀行	87,550百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
全国信用協同組合連合会	62,275百万円 (出資の総額)	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

1 募集の取扱いを行いません。

2 2018年5月12日より募集の取扱いは行なわない予定です。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行いません。

3【資本関係】

(1) 受託会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(2017年9月末現在)

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」という名称を使用します。

(2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

(3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。

請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。

(4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

(5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。

(6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。

(7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独立監査人の監査報告書

平成29年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年3月22日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスファンドTSPの平成29年2月14日から平成30年2月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスファンドTSPの平成30年2月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。