

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年2月7日提出
【計算期間】	第31期(自 2017年11月8日至 2018年11月7日)
【ファンド名】	インデックスポートフォリオ バランスポートフォリオ
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

インデックスポートフォリオ	TOPIX（東証株価指数）の動きに連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
バランスポートフォリオ	TOPIX（東証株価指数）の動きに連動した投資成果に、内外公社債への投資による安定性を加味した運用を行ない、信託財産の長期的成長と安定した収益の確保をはかることをめざします。

ファンドの基本的性格

<インデックスポートフォリオ>

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
	海外	債券 不動産投信	
追加型投信	内外	その他資産 () 資産複合	特殊型

(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5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		
不動産投信	日々	中南米		
	その他	アフリカ	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))	()	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。

< バランスポートフォリオ >

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)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	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。

資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする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
株式	年1回	グローバル	
一般			
大型株	年2回	日本	
中小型株			
	年4回	北米	
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		
クレジット属性	(毎月)	オセアニア	
()			
	日々	中南米	
不動産投信			ファンド・オブ・ファンズ
	その他	アフリカ	
()			
その他資産		中近東	
(投資信託証券(資産複合 資産配分		(中東)	
固定型(株式、債券))			
		エマージング	
資産複合			
()			
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(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

年1回

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

日本

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

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. ミリオンには2つのポートフォリオがあり、皆様のニーズにあったポートフォリオをお選びいただけます。

「インデックスポートフォリオ」

主として「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に投資を行ない、TOPIX(東証株価指数)*の動きに連動する投資成果をめざします。

「バランスポートフォリオ」

主として「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に50%程度投資を行ないます。また残りの50%程度は内外の公社債を中心に組み入れます。

市況の急激な変化が生じたときなど、やむを得ない事情が発生した場合ならびに信託財産の規模によっては上記のような運用ができない場合があります。

*TOPIX(東証株価指数)は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄(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の高標は、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の高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. お買付けは、原則として給与天引きです。

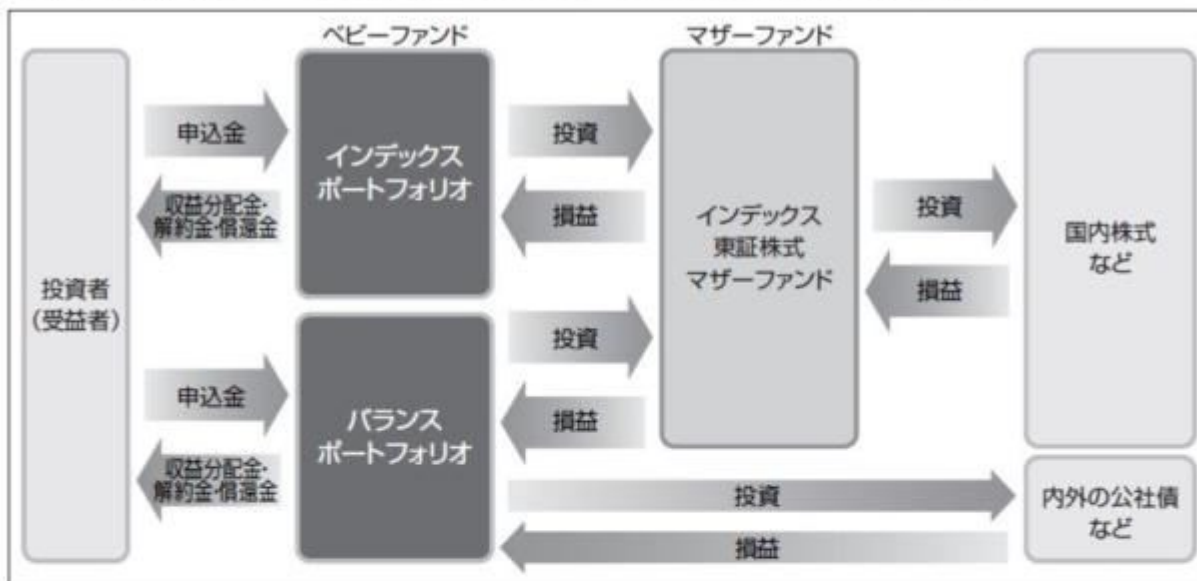
3. お買付けは、無手数料です。

4. ドル・コスト平均法の妙味を味わえます。

ドル・コスト平均法とは、一定の金額を継続して投資する方法で、価格が安いときは多くの口数を、高いときは少ない口数を買い付けることによって、一定量(口数)ずつ買い付けた場合に比べて、平均買付コストを低く抑えることが期待できます。長期にわたり定期的に継続して積み立てることにより、ドル・コスト平均法が活かされます。

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)

「インデックスポートフォリオ」

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」への投資割合には制限を設けません。
- ・外貨建資産への投資は行ないません。

「バランスポートフォリオ」

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- ・外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

(分配方針)

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」

- ・毎決算時に、利子・配当等収益を中心に安定的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なわないこともあります。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

- ・各ポートフォリオ毎に、2,000億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。

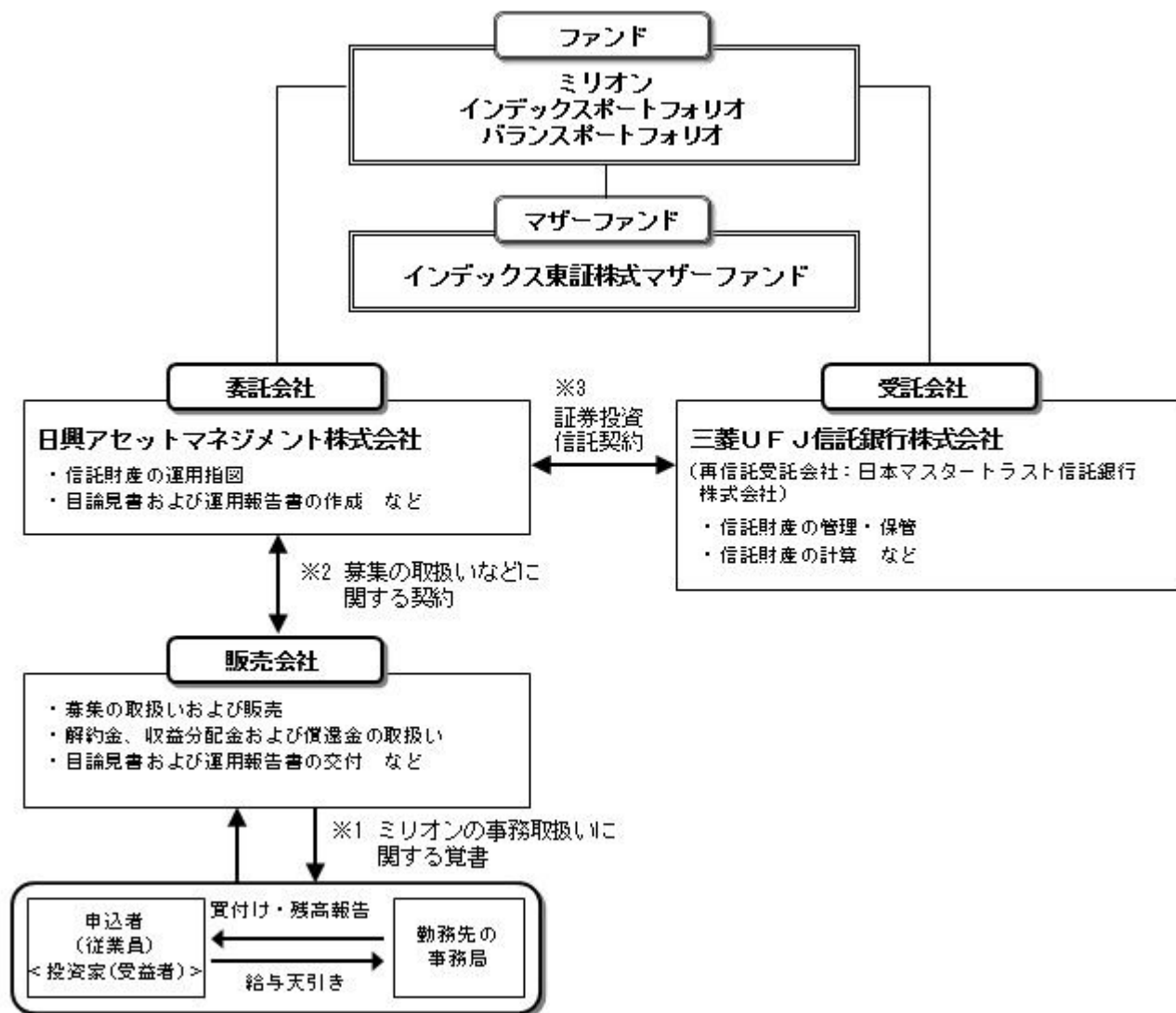
(2) 【ファンドの沿革】

1987年11月27日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 ミリオンの事務局と販売会社の間における、ミリオンの申込み・入金・換金などに関する手続きを規定しています。
- 2 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です。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。
- 3 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です。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11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】

<インデックスポートフォリオ>

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
- ・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。

<バランスポートフォリオ>

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。
- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券に投資することにより売買益を追求し、内外の公社債に投資することにより利息等収益の確保につとめます。
- ・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75%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】

<インデックスポートフォリオ>

「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券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) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

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

- 1) 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
- 2) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 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。）
- 4) 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) 資金の借入

<バランスポートフォリオ>

「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債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17条の2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「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、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。)に限ります。)
- 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 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。)
- 12) 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
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 有価証券の貸付
- 4) 外国為替予約取引
- 5) 資金の借入

<インデックス東証株式マザーファンド>

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13条の2および第13条の4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) 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。）
- 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) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 有価証券の貸付

投資対象とするマザーファンドの概要

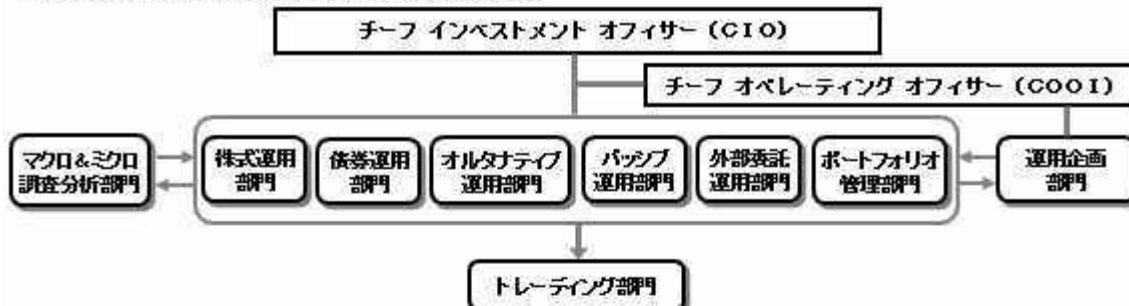
<インデックス東証株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期的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。
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せん。投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。 ・資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として買付の場合は時価比率の高い銘柄から順に、売却の場合は時価比率の低い銘柄から順番に行いません。 ・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"> ・株式への投資割合には制限を設けません ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

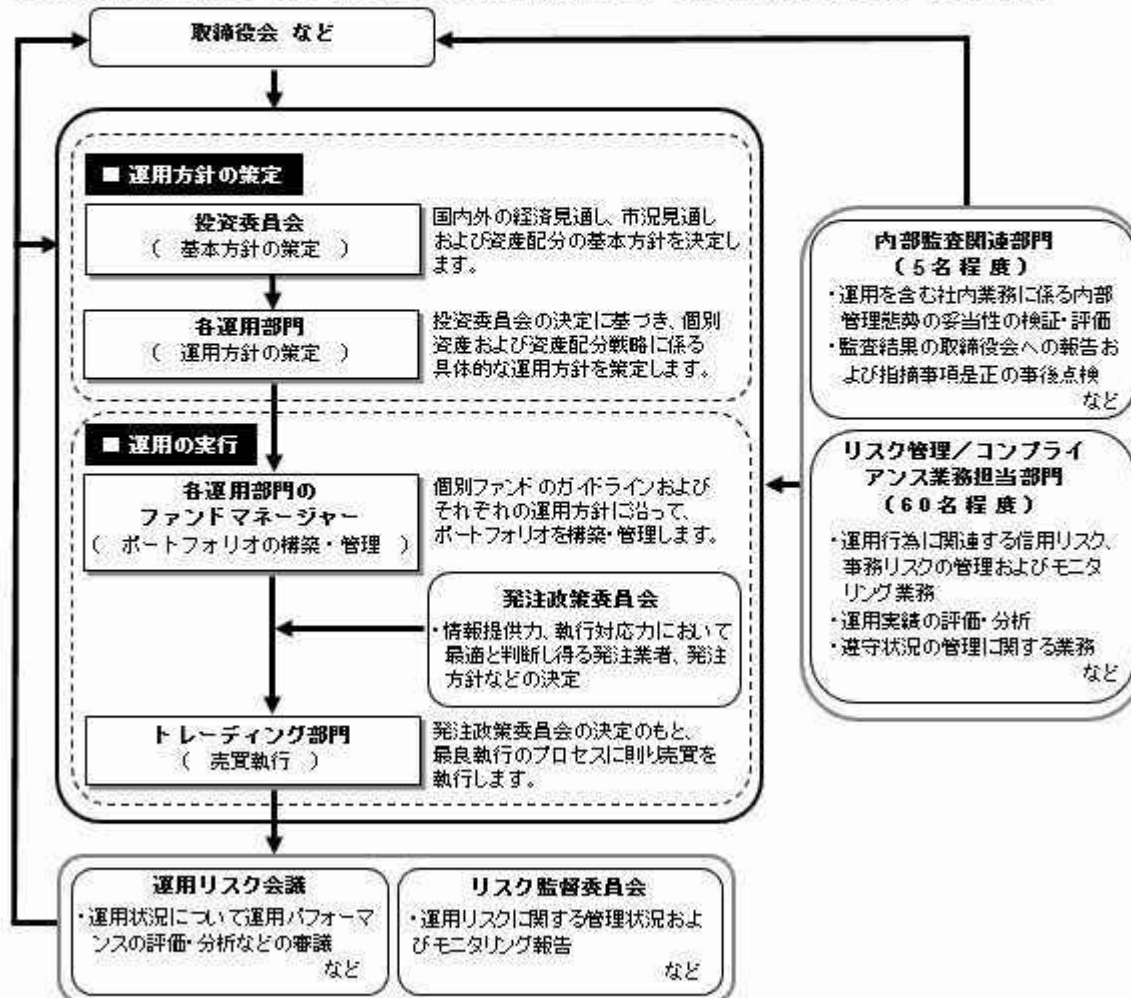
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
信託期間	無期限(1986年10月22日設定)
決算日	毎年10月21日(休業日の場合は翌営業日)

(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11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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ないます。

収益分配金の支払い

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。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

<インデックスポートフォリオ>

- 1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合には制限を設けません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) 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) 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
 - ニ) 解約に伴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。
- 4) 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。

<バランスポートフォリオ>

- 1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- 2) 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第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。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 4) 信託財産が運用対象とする有価証券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。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - 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、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」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、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ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14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、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。
- 5) 信託財産に属する資産の為替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通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション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、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産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、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- 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保有外貨建資産の時価総額の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。
- 6) 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14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14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(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- 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。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、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。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 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) 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

二) 解約に伴なう支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

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。

<インデックス東証株式マザーファンド>

1) 株式への投資割合には制限を設けません。

2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場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) 外貨建資産への投資は行ないません。

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

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、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」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、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受け取る組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ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10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、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。

5) 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10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10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。

- 6) 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。
- 7) 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。
- 8) 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。
- 9) 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

<インデックスポートフォリオ>

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) と基準価額の主な乖離要因 >

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。

< バランスポートフォリオ >

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

- ・投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券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。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により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。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

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。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト(債務不履行)が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落(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、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。

- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・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。

為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

<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出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

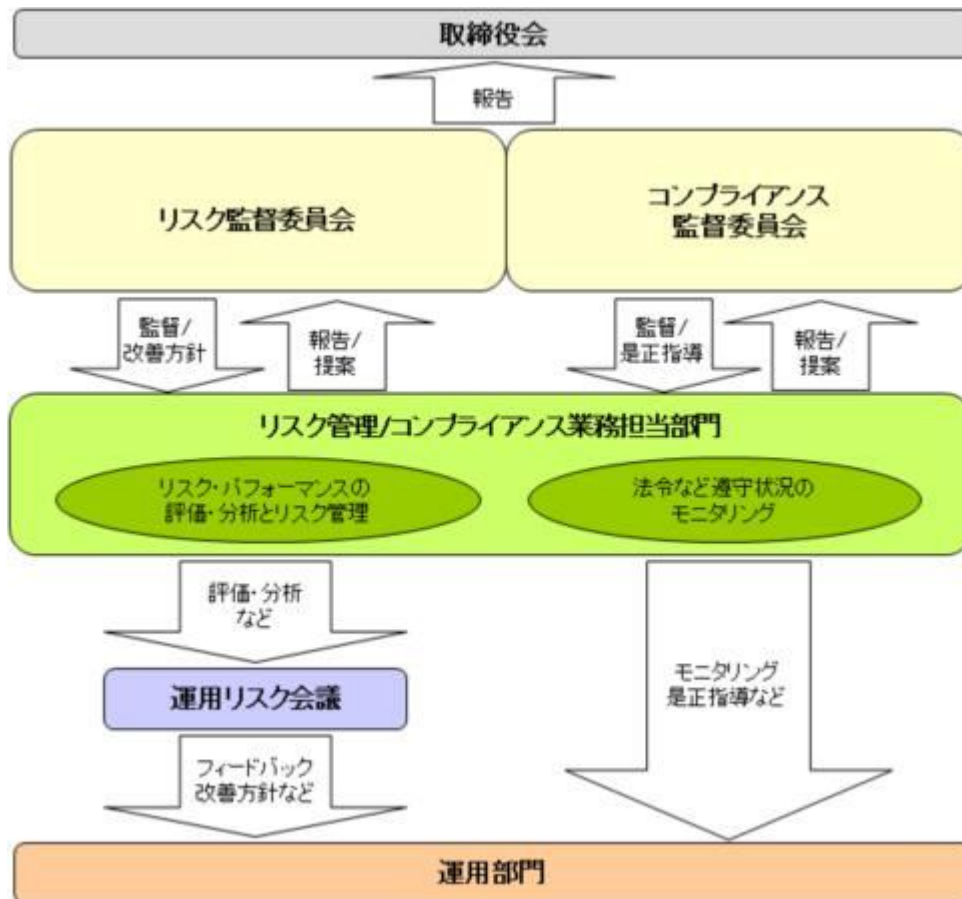
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

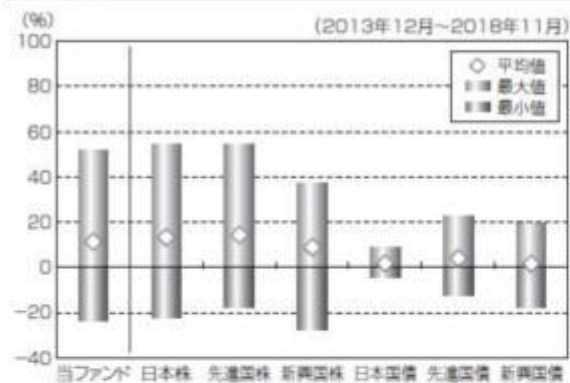
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2018年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

インデックスポートフォリオ

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(%))

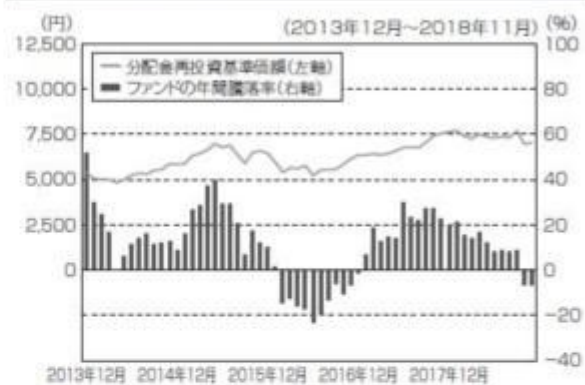
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	11.5%	13.4%	14.5%	9.1%	2.0%	4.3%	1.8%
最大値	51.7%	54.4%	54.8%	37.2%	9.3%	22.7%	19.3%
最小値	-23.2%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※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12月から2018年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大-最小-平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと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。

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



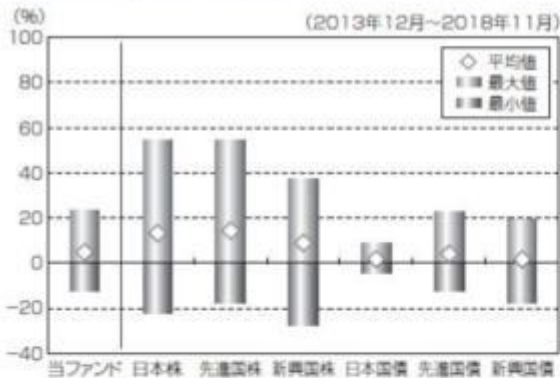
※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2013年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものと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。

バランスポートフォリオ

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	5.0%	13.4%	14.5%	9.1%	2.0%	4.3%	1.8%
最大値	23.4%	54.4%	54.8%	37.2%	9.3%	22.7%	19.3%
最小値	-12.1%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2013年12月から2018年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと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・レディバースィファイド(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。

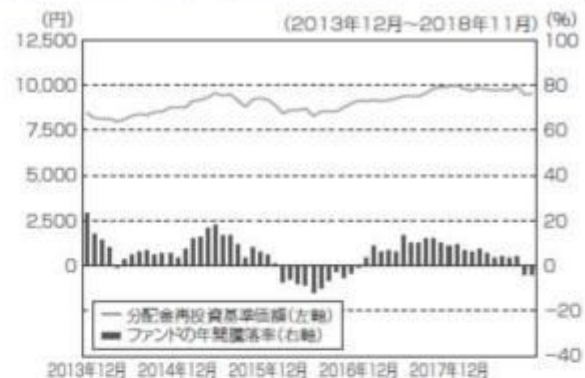
MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

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12月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものと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。

負いません。

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・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

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1.6416%（税抜1.52%）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。

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
1.52%	0.34%	1.10%	0.08%

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、日々計上され、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。

組入る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、外貨建資産の保管などに要する費用（「バランスポートフォリオ」のみ）、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>

- ・組入る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。

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。

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。

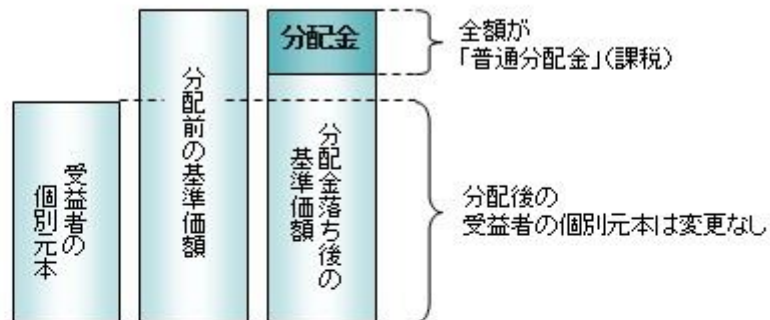
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から

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。

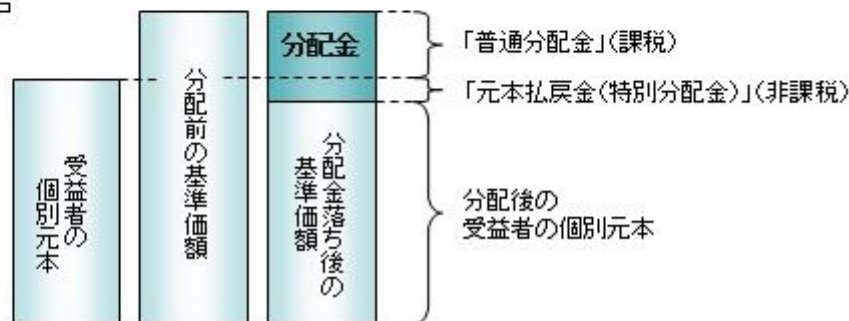
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2019年2月7日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【インデックスポートフォリオ】

以下の運用状況は2018年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	10,235,578,345	99.94
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		6,152,262	0.06
合計(純資産総額)		10,241,730,607	100.00

(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	インデックス東証株式マザーファンド	6,132,761,142	1.6530	10,137,454,168	1.6690	10,235,578,345	99.94

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.94
合計	99.94

【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】

該当事項はありません。

(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22計算期間末 (2009年11月 9日)	9,152	9,165	0.3557	0.3562
第23計算期間末 (2010年11月 8日)	8,949	8,962	0.3442	0.3447
第24計算期間末 (2011年11月 7日)	7,970	7,983	0.3088	0.3093
第25計算期間末 (2012年11月 7日)	7,945	7,958	0.3085	0.3090
第26計算期間末 (2013年11月 7日)	11,931	11,943	0.4906	0.4911
第27計算期間末 (2014年11月 7日)	12,764	12,776	0.5660	0.5665
第28計算期間末 (2015年11月 9日)	12,726	12,735	0.6615	0.6620
第29計算期間末 (2016年11月 7日)	10,507	10,516	0.5690	0.5695
第30計算期間末 (2017年11月 7日)	12,193	12,201	0.7599	0.7604
第31計算期間末 (2018年11月 7日)	10,188	10,195	0.6952	0.6957
2017年11月末日	11,830		0.7501	
12月末日	11,812		0.7606	
2018年 1月末日	11,685		0.7676	
2月末日	11,199		0.7381	
3月末日	10,941		0.7223	
4月末日	11,259		0.7468	
5月末日	11,013		0.7338	
6月末日	10,911		0.7269	

7月末日	11,000		0.7352
8月末日	10,848		0.7270
9月末日	11,369		0.7661
10月末日	10,171		0.6934
11月末日	10,241		0.7008

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.0005
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	0.0005
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0005
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.61
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	3.09
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	10.14
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.06
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	59.19
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	15.47
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	16.96
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	13.91
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	33.64
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	8.45

(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22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	1,338,588,106	1,023,299,271
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	1,177,644,536	908,226,822
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	1,083,821,347	1,275,668,411
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	1,098,402,396	1,156,956,048
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	726,814,196	2,160,223,460
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	540,447,887	2,308,575,579
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	397,656,514	3,710,414,810
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	404,194,947	1,174,901,250
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	324,013,392	2,744,057,822
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	240,808,421	1,634,396,234

【バランスポートフォリオ】

以下の運用状況は2018年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	20,050,200	9.16
地方債証券	日本	32,977,372	15.07
親投資信託受益証券	日本	110,343,728	50.42
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		55,482,995	25.35
合計(純資産総額)		218,854,295	100.00

(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)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	インデックス東証 株式マザーファン ド	66,113,678	1.6540	109,352,023	1.6690	110,343,728			50.42
日本	国債証券	第122回利付国 債(5年)	20,000,000	100.27	20,054,600	100.25	20,050,200	0.100	2019/12/20	9.16
日本	地方債証券	第29回兵庫民 債	20,000,000	99.97	19,994,360	99.97	19,994,360	0.190	2019/3/19	9.14
日本	地方債証券	平成26年度京 都安心づくりみ らい債	13,000,000	99.86	12,983,012	99.86	12,983,012	0.160	2019/9/2	5.93

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	9.16
地方債証券	15.07
親投資信託受益証券	50.42
合 計	74.65

【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】

該当事項はありません。

(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22計算期間末 (2009年11月 9日)	438	438	0.6884	0.6889
第23計算期間末 (2010年11月 8日)	424	424	0.6749	0.6754
第24計算期間末 (2011年11月 7日)	381	381	0.6403	0.6408
第25計算期間末 (2012年11月 7日)	366	366	0.6377	0.6382
第26計算期間末 (2013年11月 7日)	436	437	0.8067	0.8072
第27計算期間末 (2014年11月 7日)	382	382	0.8619	0.8624
第28計算期間末 (2015年11月 9日)	322	322	0.9300	0.9305
第29計算期間末 (2016年11月 7日)	271	271	0.8629	0.8634
第30計算期間末 (2017年11月 7日)	268	268	0.9920	0.9925
第31計算期間末 (2018年11月 7日)	218	218	0.9443	0.9448
2017年11月末日	259		0.9849	
12月末日	256		0.9913	
2018年 1月末日	257		0.9957	
2月末日	237		0.9769	
3月末日	235		0.9656	
4月末日	239		0.9815	
5月末日	237		0.9720	
6月末日	231		0.9671	
7月末日	233		0.9717	
8月末日	222		0.9656	
9月末日	228		0.9915	
10月末日	218		0.9434	
11月末日	218		0.9476	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.0005
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	0.0005
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0005
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	0.12
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	1.89
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	5.05
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.33
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	26.58
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	6.90
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	7.96
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	7.16
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	15.02
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	4.76

(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22期	2008年11月 8日～2009年11月 9日	29,474,951	37,415,222
第23期	2009年11月10日～2010年11月 8日	26,059,079	33,889,327
第24期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	24,624,836	57,559,266
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	21,493,518	42,290,225
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	14,701,201	47,759,106
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	11,634,468	109,900,290

第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	9,591,772	106,409,569
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	9,326,069	41,548,116
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	7,480,324	50,984,226
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	6,405,223	46,051,030

(参考)

インデックス東証株式マザーファンド

以下の運用状況は2018年11月30日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	10,129,756,620	97.89
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		218,571,851	2.11
合計(純資産総額)		10,348,328,471	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	183,480,000	1.77

(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	47,800	6,549.11	313,047,458	6,803.00	325,183,400	3.14
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	294,700	688.16	202,800,752	624.50	184,040,150	1.78
日本	株式	ソニー	電気機器	28,800	6,308.84	181,694,592	5,937.00	170,985,600	1.65
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	17,600	9,426.65	165,909,040	9,526.00	167,657,600	1.62
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	28,800	4,970.80	143,159,040	4,680.00	134,784,000	1.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,100	56,330.00	118,293,000	61,600.00	129,360,000	1.25
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	29,800	4,456.86	132,814,428	4,183.00	124,653,400	1.20
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	36,200	3,078.47	111,440,614	3,202.00	115,912,400	1.12
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	575,000	194.20	111,665,000	188.30	108,272,500	1.05

日本	株式	KDDI	情報・通信業	37,100	2,966.36	110,051,956	2,664.00	98,834,400	0.96
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	29,400	3,309.88	97,310,700	3,123.00	91,816,200	0.89
日本	株式	三菱商事	卸売業	29,700	3,375.48	100,251,756	3,062.00	90,941,400	0.88
日本	株式	任天堂	その他製品	2,600	38,050.00	98,930,000	34,610.00	89,986,000	0.87
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	3,800	22,014.61	83,655,518	23,325.00	88,635,000	0.86
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	17,700	4,836.53	85,606,581	4,943.00	87,491,100	0.85
日本	株式	花王	化学	10,400	8,200.06	85,280,624	8,358.00	86,923,200	0.84
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	15,300	5,542.28	84,796,884	5,605.00	85,756,500	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	4,100	19,265.00	78,986,500	19,390.00	79,499,000	0.77
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	30,200	2,884.98	87,126,396	2,628.50	79,380,700	0.77
日本	株式	日本電産	電気機器	5,200	14,450.00	75,140,000	15,120.00	78,624,000	0.76
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	7,600	9,848.00	74,844,800	10,320.00	78,432,000	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	4,500	16,565.00	74,542,500	17,315.00	77,917,500	0.75
日本	株式	信越化学工業	化学	7,400	8,934.16	66,112,800	10,135.00	74,999,000	0.72
日本	株式	ダイキン工業	機械	5,900	13,560.00	80,004,000	12,610.00	74,399,000	0.72
日本	株式	キヤノン	電気機器	23,100	3,567.65	82,412,715	3,220.00	74,382,000	0.72
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	16,900	4,594.01	77,638,769	4,255.00	71,909,500	0.69
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	24,900	2,954.25	73,560,825	2,823.50	70,305,150	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	39,600	1,859.46	73,634,616	1,744.50	69,082,200	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	42,900	1,404.09	60,235,461	1,498.00	64,264,200	0.62
日本	株式	日立製作所	電気機器	19,300	3,408.26	65,779,418	3,288.00	63,458,400	0.61

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	0.12
		鉱業	0.31
		建設業	2.91
		食料品	4.29
		繊維製品	0.66
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.18
		医薬品	5.12
		石油・石炭製品	0.74
		ゴム製品	0.81
		ガラス・土石製品	0.90
		鉄鋼	0.98
		非鉄金属	0.79
		金属製品	0.58
		機械	4.95
		電気機器	12.73
		輸送用機器	7.87
精密機器	1.80		

	その他製品	2.04
	電気・ガス業	1.86
	陸運業	4.49
	海運業	0.17
	空運業	0.58
	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	7.39
	卸売業	4.86
	小売業	5.18
	銀行業	6.56
	証券、商品先物取引業	0.91
	保険業	2.35
	その他金融業	1.18
	不動産業	2.38
	サービス業	4.75
合 計		97.89

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12月	買建	11	日本円	183,212,160	183,480,000	1.77

(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(インデックスポートフォリオ)

2018年11月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額7,008円

純資産総額 102.41億円

※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11月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したもとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2014年11月	2015年11月	2016年11月	2017年11月	2018年11月	設定未累計
5円	5円	5円	5円	5円	155円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	97.85%
株式先物	1.77%
債券	—
債券先物	—
現金その他	2.15%

※当ファンドの実質組入比率です。

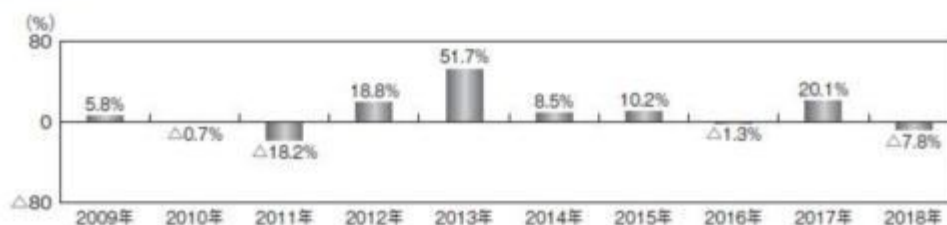
<組入上位10銘柄>

インデックス東証株式マザーファンド

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.14%
2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.78%
3 ソニー	電気機器	1.65%
4 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.62%
5 日本電信電話	情報・通信業	1.30%
6 キーエンス	電気機器	1.25%
7 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.20%
8 本田技研工業	輸送用機器	1.12%
9 みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.05%
10 KDDI	情報・通信業	0.96%

※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)を再投資したもとして計算しております。

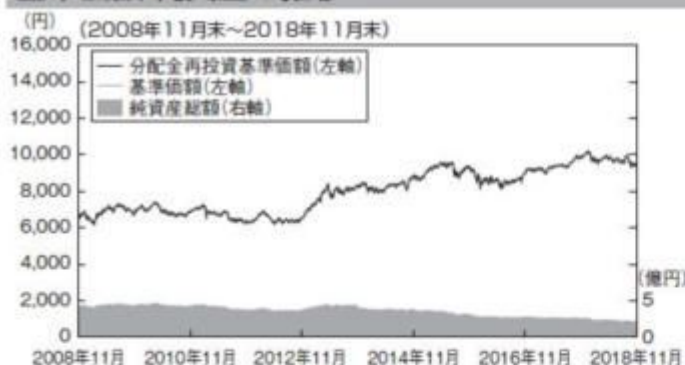
※2018年は、2018年11月末までの騰落率です。

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

運用実績(バランスポートフォリオ)

2018年11月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額9,476円

純資産総額2.18億円

※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11月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したもとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2014年11月	2015年11月	2016年11月	2017年11月	2018年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	155円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	49.37%
株式先物	0.89%
債券	24.23%
債券先物	0.00%
現金その他	26.41%

※当ファンドの実質組入比率です。

<組入上位銘柄>

当ファンド

	銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1	インデックス東証株式マザーファンド	新投資信託受益証券	—	—	50.42%
2	第122回利付国債(5年)	国債証券	0.100%	2019年12月20日	9.16%
3	第29回兵庫県民債	地方債証券	0.190%	2019年3月19日	9.14%
4	平成26年度京都安心づくりみらい債	地方債証券	0.160%	2019年9月2日	5.93%

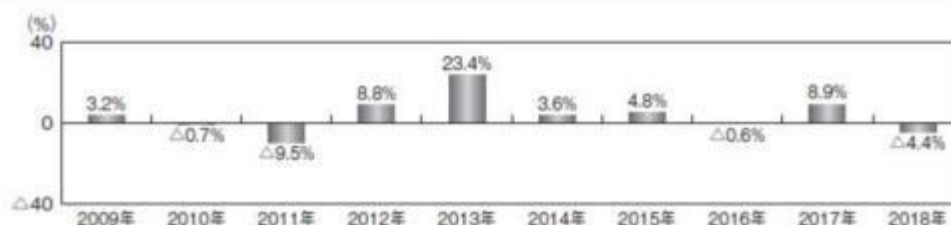
※当ファンドの対純資産総額比です。

インデックス東証株式マザーファンド

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.14%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.78%
3	ソニー	電気機器	1.65%
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.62%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.30%

※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)を再投資したもとして計算しております。

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2018年は、2018年11月までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

- ・原則として、勤務先の事務局を通じて、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・原則として、勤務先の事務局を通じて給与天引きで行なわれるため、販売会社に入金された日を取得申込受付日とします。

(2) 申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(3) 申込単位

勤務先の事務局、販売会社の照会先にお問い合わせください。

(4) 申込代金の支払い

原則として、勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

(5) 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号に規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金(解約)手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

(2) 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。

(3) 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 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。

(4) 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。

(5) 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、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

(6) 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。

(7) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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) 買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

(2) 買取制限

ファンドの規模および商品性格などにに基づき、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。

(3) 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。

(4) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(5) 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、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

(6) 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。

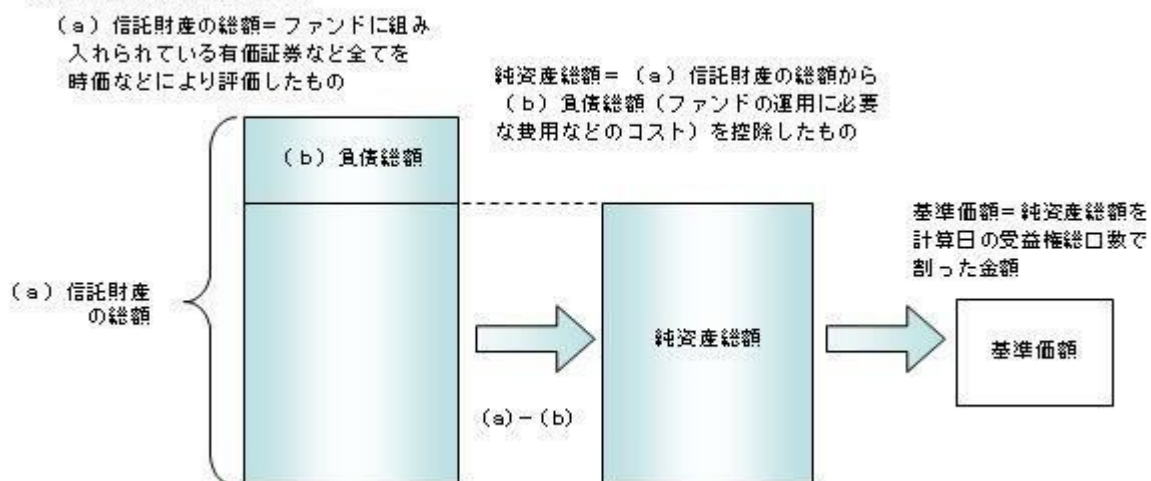
3【資産管理等の概要】

(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1万口当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 >

インデックスポートフォリオ	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。
バランスポートフォリオ	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。 公社債（国内・外国） 原則として、基準価額計算日 [*] における以下のいずれかの価額で評価します。 a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） b) 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。） c) 価格情報会社の提供する価額 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。 [*] 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

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 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（1987年11月27日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年11月8日から翌年11月7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。
 - <インデックスポートフォリオ>
 - イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ロ) 対象インデックスが改廃の場合
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
 - <バランスポートフォリオ>
 - イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 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。)
 - 二) 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。

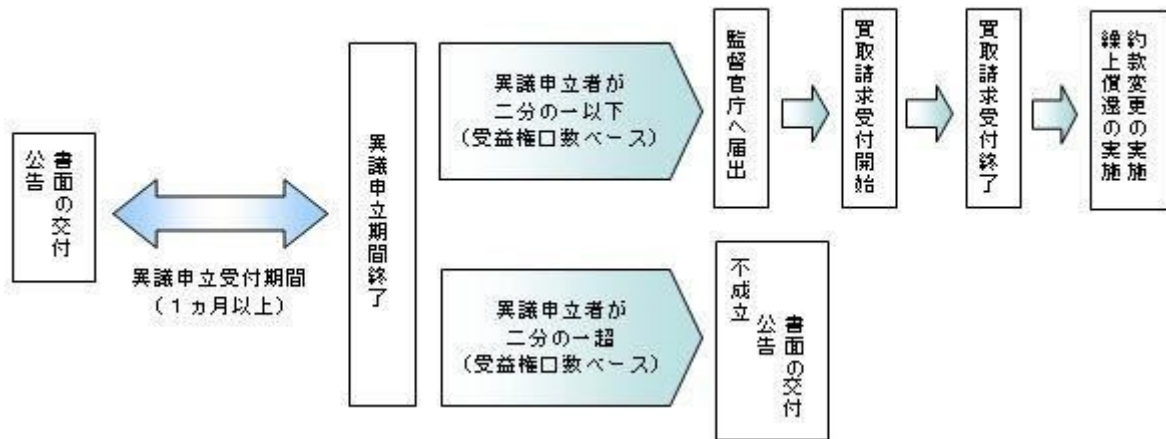
信託約款の変更

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

- ・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知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 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】

<インデックスポートフォリオ>

<バランスポートフォリオ>

- (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31期計算期間（平成29年11月 8日から平成30年11月 7日まで）の財務諸表について、P w C 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】

【インデックスポートフォリオ】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第30期 平成29年11月 7日現在	第31期 平成30年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	106,126,587	100,074,052
親投資信託受益証券	12,209,433,218	10,185,813,987
未収入金	33,463,641	9,717,885
流動資産合計	12,349,023,446	10,295,605,924
資産合計	12,349,023,446	10,295,605,924
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	8,023,828	7,327,034
未払解約金	50,852,940	9,761,091
未払受託者報酬	5,047,955	4,741,028
未払委託者報酬	90,864,321	85,339,716
未払利息	157	173
その他未払費用	309,127	290,325
流動負債合計	155,098,328	107,459,367
負債合計	155,098,328	107,459,367
純資産の部		
元本等		
元本	16,047,656,623	14,654,068,810
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	3,853,731,505	4,465,922,253
(分配準備積立金)	2,960,779,886	2,653,678,342
元本等合計	12,193,925,118	10,188,146,557
純資産合計	12,193,925,118	10,188,146,557
負債純資産合計	12,349,023,446	10,295,605,924

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第30期		第31期	
	自	平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7日	自	平成29年11月 8日 至 平成30年11月 7日
営業収益				
受取利息		374		546
有価証券売買等損益		3,524,706,486		764,359,107
営業収益合計		3,524,706,860		764,358,561
営業費用				
支払利息		24,884		27,642
受託者報酬		9,940,028		9,651,247
委託者報酬		178,922,750		173,724,741
その他費用		608,711		593,021
営業費用合計		189,496,373		183,996,651
営業利益又は営業損失（ ）		3,335,210,487		948,355,212
経常利益又は経常損失（ ）		3,335,210,487		948,355,212
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,335,210,487		948,355,212
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（ ）		289,517,587		14,366,989
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		7,959,982,353		3,853,731,505
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,180,501,748		392,638,863
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,180,501,748		392,638,863
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		111,919,972		63,514,354
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		111,919,972		63,514,354
分配金		8,023,828		7,327,034
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,853,731,505		4,465,922,253

(3)【注記表】

(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	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。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

		第30期 平成29年11月 7日現在	第31期 平成30年11月 7日現在
1.	期首元本額	18,467,701,053円	16,047,656,623円
	期中追加設定元本額	324,013,392円	240,808,421円
	期中一部解約元本額	2,744,057,822円	1,634,396,234円
2.	受益権の総数	16,047,656,623口	14,654,068,810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	3,853,731,505円	4,465,922,253円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第30期 自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7日		第31期 自 平成29年11月 8日 至 平成30年11月 7日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 0円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 0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 1,628,026,218円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金 1,946,093,809円	C	信託約款に定める収益調整金 1,819,751,376円
D	信託約款に定める分配準備積立 金 1,340,777,496円	D	信託約款に定める分配準備積立 金 2,661,005,376円
E	分配対象収益(A+B+C+D) 4,914,897,523円	E	分配対象収益(A+B+C+D) 4,480,756,752円
F	分配対象収益(1万口当たり) 3,062円	F	分配対象収益(1万口当たり) 3,057円
G	分配金額 8,023,828円	G	分配金額 7,327,034円
H	分配金額(1万口当たり) 5円	H	分配金額(1万口当たり) 5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30期 自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7日	第31期 自 平成29年11月 8日 至 平成30年11月 7日

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

金融商品の時価等に関する事項

	第30期 平成29年11月 7日現在	第31期 平成30年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第30期（平成29年11月 7日現在）

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,222,410,904
合計	3,222,410,904

第31期(平成30年11月7日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	652,778,890
合計	652,778,890

(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30期 平成29年11月7日現在		第31期 平成30年11月7日現在	
1口当たり純資産額	0.7599円	1口当たり純資産額	0.6952円
(1万口当たり純資産額)	(7,599円)	(1万口当たり純資産額)	(6,952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	インデックス東証株式マザーファンド	6,158,291,407	10,185,813,987	
合計		6,158,291,407	10,185,813,987	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【バランスポートフォリオ】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第30期 平成29年11月 7日現在	第31期 平成30年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	65,060,566	58,015,057
国債証券	35,296,240	20,054,600
地方債証券	32,962,080	32,974,520
親投資信託受益証券	137,642,014	109,352,023
未収利息	119,812	16,352
流動資産合計	271,080,712	220,412,552
資産合計		
271,080,712		
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	135,459	115,636
未払受託者報酬	114,587	99,641
未払委託者報酬	2,063,768	1,794,596
未払利息	96	100
その他未払費用	6,955	6,043
流動負債合計	2,320,865	2,016,016
負債合計		
2,320,865		
純資産の部		
元本等		
元本	270,918,710	231,272,903
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	2,158,863	12,876,367
(分配準備積立金)	34,156,407	28,287,654
元本等合計	268,759,847	218,396,536
純資産合計		
268,759,847		
負債純資産合計		
271,080,712		

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第30期		第31期	
	自	平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7日	自	平成29年11月 8日 至 平成30年11月 7日
営業収益				
受取利息		353,394		245,872
有価証券売買等損益		41,814,465		7,237,358
営業収益合計		42,167,859		6,991,486
営業費用				
支払利息		27,108		27,212
受託者報酬		231,049		205,391
委託者報酬		4,161,221		3,699,199
その他費用		14,022		15,560
営業費用合計		4,433,400		3,947,362
営業利益又は営業損失()		37,734,459		10,938,848
経常利益又は経常損失()		37,734,459		10,938,848
当期純利益又は当期純損失()		37,734,459		10,938,848
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()		3,038,437		125,060
期首剰余金又は期首欠損金()		43,100,223		2,158,863
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,959,551		370,695
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,959,551		370,695
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		578,754		158,775
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		578,754		158,775
分配金		135,459		115,636
期末剰余金又は期末欠損金()		2,158,863		12,876,367

(3) 【注記表】

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

(貸借対照表に関する注記)

		第30期 平成29年11月 7日現在	第31期 平成30年11月 7日現在
1.	期首元本額	314,422,612円	270,918,710円
	期中追加設定元本額	7,480,324円	6,405,223円
	期中一部解約元本額	50,984,226円	46,051,030円
2.	受益権の総数	270,918,710口	231,272,903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	2,158,863円	12,876,367円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第30期 自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7日		第31期 自 平成29年11月 8日 至 平成30年11月 7日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	286,996円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 0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	17,307,187円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	38,370,747円	C 信託約款に定める収益調整金 33,510,573円

D 信託約款に定める分配準備積立金	16,697,683円	D 信託約款に定める分配準備積立金	28,403,290円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	72,662,613円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	61,913,863円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,682円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,677円
G 分配金額	135,459円	G 分配金額	115,636円
H 分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)	5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30期 自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7日	第31期 自 平成29年11月 8日 至 平成30年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第30期 平成29年11月 7日現在	第31期 平成30年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品	(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

	短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左
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30期（平成29年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	421,710
地方債証券	70,420
親投資信託受益証券	36,327,576
合計	35,835,446

第31期（平成30年11月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	64,000
地方債証券	12,440
親投資信託受益証券	7,478,262
合計	7,529,822

（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30期 平成29年11月 7日現在		第31期 平成30年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.9920円	1口当たり純資産額	0.9443円
(1万口当たり純資産額)	(9,920円)	(1万口当たり純資産額)	(9,443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
国債証券	第122回利付国債(5年)	20,000,000	20,054,600	
国債証券 合計		20,000,000	20,054,600	
地方債証券	平成26年度京都安心づくりみらい債	13,000,000	12,981,540	
	第29回兵庫県民債	20,000,000	19,992,980	
地方債証券 合計		33,000,000	32,974,520	
親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	66,113,678	109,352,023	
親投資信託受益証券 合計		66,113,678	109,352,023	
合計		119,113,678	162,381,143	

(注)親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」は、「インデックス東証株式マザーファン

ド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	平成29年11月 7日現在	平成30年11月 7日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	222,887	154,827
コール・ローン	60,704,420	135,169,863
株式	12,074,312,800	10,077,500,940
派生商品評価勘定	12,153,520	1,318,380
未収入金	146,556,910	-
未収配当金	94,640,725	93,672,074
前払金	-	10,305,000
流動資産合計	12,388,591,262	10,318,121,084
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	11,594,320
前受金	10,785,000	-
未払金	-	1,061,080
未払解約金	33,463,641	9,717,885
未払利息	90	234
流動負債合計	44,248,731	22,373,519
負債合計	44,248,731	22,373,519
純資産の部		
元本等		
元本	6,948,269,687	6,224,405,085
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,396,072,844	4,071,342,480
元本等合計	12,344,342,531	10,295,747,565
純資産合計	12,344,342,531	10,295,747,565
負債純資産合計	12,388,591,262	10,318,121,084

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p>
--------------------	---

	(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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

		平成29年11月 7日現在	平成30年11月 7日現在
1.	期首	平成28年11月 8日	平成29年11月 8日
	期首元本額	8,140,733,967円	6,948,269,687円
	期首からの追加設定元本額	35,347,294円	43,119,745円
	期首からの一部解約元本額	1,227,811,574円	766,984,347円
	元本の内訳		
	インデックスポートフォリオ	6,870,812,166円	6,158,291,407円
	バランスポートフォリオ	77,457,521円	66,113,678円
	計	6,948,269,687円	6,224,405,085円
2.	受益権の総数	6,948,269,687口	6,224,405,085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	108,799,250円	97,331,050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11月 8日 至 平成29年11月 7日	自 平成29年11月 8日 至 平成30年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年11月 7日現在	平成30年11月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
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11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	449,062,394
合計	449,062,394

(平成30年11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	253,972,870
合計	253,972,870

(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11月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	206,060,000	-	218,220,000	12,160,000
合計		206,060,000	-	218,220,000	12,160,000

(平成30年11月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	192,430,000	-	182,160,000	10,270,000
合計		192,430,000	-	182,160,000	10,270,000

(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11月 7日現在		平成30年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.777円	1口当たり純資産額	1.654円
(1千口当たり純資産額)	(1,777円)	(1千口当たり純資産額)	(1,654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	200	3,020.00	604,000	
日本水産	5,900	680.00	4,012,000	
マルハニチロ	900	4,070.00	3,663,000	
カネコ種苗	200	1,428.00	285,600	
サカタのタネ	700	3,670.00	2,569,000	
ホクト	500	2,034.00	1,017,000	
ホクリヨウ	100	747.00	74,700	
住石ホールディングス	1,500	123.00	184,500	
日鉄鉱業	100	5,250.00	525,000	
三井松島ホールディングス	300	1,772.00	531,600	
国際石油開発帝石	23,500	1,259.50	29,598,250	
石油資源開発	800	2,397.00	1,917,600	
K & O エナジーグループ	300	1,611.00	483,300	
ヒノキヤグループ	100	2,681.00	268,100	
ショーボンドホールディングス	500	8,080.00	4,040,000	
ミライト・ホールディングス	1,500	1,681.00	2,521,500	
タマホーム	400	1,109.00	443,600	
サンヨーホームズ	100	885.00	88,500	
日本アクア	100	339.00	33,900	
ファーストコーポレーション	100	1,098.00	109,800	
ベステラ	100	1,441.00	144,100	
T A T E R U	700	513.00	359,100	
スペースバリューホールディングス	700	1,018.00	712,600	
ダイセキ環境ソリューション	100	885.00	88,500	
第一カッター興業	100	2,291.00	229,100	
安藤・間	3,700	804.00	2,974,800	
東急建設	1,700	1,048.00	1,781,600	
コムシスホールディングス	2,100	2,904.00	6,098,400	
ミサワホーム	500	822.00	411,000	

ビーアールホールディングス	500	426.00	213,000	
高松コンストラクショングループ	400	2,904.00	1,161,600	
東建コーポレーション	200	7,490.00	1,498,000	
ヤマウラ	200	867.00	173,400	
大成建設	4,800	5,010.00	24,048,000	
大林組	14,500	1,029.00	14,920,500	
清水建設	14,700	925.00	13,597,500	
飛島建設	400	1,698.00	679,200	
長谷工コーポレーション	6,000	1,434.00	8,604,000	
松井建設	500	816.00	408,000	
銭高組	100	5,530.00	553,000	
鹿島建設	11,300	1,511.00	17,074,300	
不動テトラ	400	1,736.00	694,400	
大末建設	200	1,182.00	236,400	
鉄建建設	300	2,823.00	846,900	
西松建設	1,000	2,699.00	2,699,000	
三井住友建設	3,500	748.00	2,618,000	
大豊建設	300	3,505.00	1,051,500	
前田建設工業	3,400	1,264.00	4,297,600	
佐田建設	300	414.00	124,200	
ナカノフドー建設	400	645.00	258,000	
奥村組	800	3,655.00	2,924,000	
東鉄工業	600	2,819.00	1,691,400	
イチケン	100	2,226.00	222,600	
富士ピー・エス	100	559.00	55,900	
浅沼組	200	3,200.00	640,000	
戸田建設	5,600	774.00	4,334,400	
熊谷組	700	3,120.00	2,184,000	
青木あすなろ建設	200	1,004.00	200,800	
北野建設	100	3,830.00	383,000	
植木組	100	2,419.00	241,900	
矢作建設工業	600	750.00	450,000	
ピーエス三菱	500	665.00	332,500	
日本ハウスホールディングス	900	506.00	455,400	
大東建託	1,700	15,385.00	26,154,500	
新日本建設	600	1,103.00	661,800	
N I P P O	1,300	1,874.00	2,436,200	
東亜道路工業	100	3,555.00	355,500	
前田道路	1,500	2,231.00	3,346,500	
日本道路	100	6,000.00	600,000	
東亜建設工業	400	1,765.00	706,000	
若築建設	200	1,483.00	296,600	

東洋建設	1,700	444.00	754,800
五洋建設	5,700	667.00	3,801,900
世紀東急工業	700	661.00	462,700
福田組	200	4,590.00	918,000
住友林業	3,400	1,666.00	5,664,400
日本基礎技術	500	365.00	182,500
巴コーポレーション	600	420.00	252,000
大和ハウス工業	13,400	3,346.00	44,836,400
ライト工業	900	1,462.00	1,315,800
積水ハウス	14,800	1,656.00	24,508,800
日特建設	400	741.00	296,400
北陸電気工事	200	1,018.00	203,600
ユアテック	800	880.00	704,000
四電工	100	2,552.00	255,200
中電工	600	2,409.00	1,445,400
関電工	2,200	1,142.00	2,512,400
きんでん	3,200	1,879.00	6,012,800
東京エネシス	500	955.00	477,500
トーエネック	100	3,115.00	311,500
住友電設	300	1,837.00	551,100
日本電設工業	800	2,221.00	1,776,800
協和エクシオ	1,900	2,902.00	5,513,800
新日本空調	400	1,793.00	717,200
九電工	900	4,375.00	3,937,500
三機工業	1,100	1,148.00	1,262,800
日揮	4,200	2,063.00	8,664,600
中外炉工業	100	2,330.00	233,000
ヤマト	400	629.00	251,600
太平電業	300	2,753.00	825,900
高砂熱学工業	1,200	1,979.00	2,374,800
三晃金属工業	100	2,974.00	297,400
朝日工業社	100	3,280.00	328,000
明星工業	900	838.00	754,200
大気社	700	3,240.00	2,268,000
ダイダン	300	2,563.00	768,900
日比谷総合設備	500	1,835.00	917,500
東芝プラントシステム	1,000	2,319.00	2,319,000
OSJBホールディングス	2,100	282.00	592,200
東洋エンジニアリング	600	842.00	505,200
千代田化工建設	3,500	416.00	1,456,000
新興プランテック	900	1,120.00	1,008,000
日本製粉	1,400	1,848.00	2,587,200

日清製粉グループ本社	4,900	2,261.00	11,078,900
昭和産業	400	2,844.00	1,137,600
鳥越製粉	400	940.00	376,000
中部飼料	500	1,450.00	725,000
フィード・ワン	3,000	196.00	588,000
東洋精糖	100	1,190.00	119,000
日本甜菜製糖	300	1,937.00	581,100
三井製糖	300	3,050.00	915,000
塩水港精糖	500	246.00	123,000
日新製糖	200	2,285.00	457,000
森永製菓	1,100	4,520.00	4,972,000
中村屋	100	4,450.00	445,000
江崎グリコ	1,300	5,170.00	6,721,000
名糖産業	200	1,493.00	298,600
井村屋グループ	200	3,070.00	614,000
不二家	200	2,436.00	487,200
山崎製パン	3,500	2,189.00	7,661,500
第一屋製パン	100	1,105.00	110,500
モロゾフ	100	5,430.00	543,000
亀田製菓	300	5,330.00	1,599,000
寿スピリッツ	500	4,250.00	2,125,000
カルビー	2,000	3,610.00	7,220,000
森永乳業	900	3,005.00	2,704,500
六甲バター	300	2,392.00	717,600
ヤクルト本社	3,200	8,220.00	26,304,000
明治ホールディングス	3,100	7,710.00	23,901,000
雪印メグミルク	1,000	2,638.00	2,638,000
プリマハム	600	2,357.00	1,414,200
日本ハム	1,900	4,075.00	7,742,500
林兼産業	200	684.00	136,800
丸大食品	500	1,855.00	927,500
S Foods	400	4,605.00	1,842,000
伊藤ハム米久ホールディングス	2,800	737.00	2,063,600
サッポロホールディングス	1,600	2,376.00	3,801,600
アサヒグループホールディングス	9,000	4,977.00	44,793,000
キリンホールディングス	19,500	2,547.00	49,666,500
宝ホールディングス	3,200	1,402.00	4,486,400
オエノンホールディングス	1,300	395.00	513,500
養命酒製造	100	2,312.00	231,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	3,300	3,020.00	9,966,000
サントリー食品インターナショナル	2,900	4,440.00	12,876,000
ダイドーグループホールディングス	200	5,760.00	1,152,000

伊藤園	1,400	4,940.00	6,916,000
キーコーヒー	400	2,027.00	810,800
ユニカフェ	100	1,254.00	125,400
ジャパンフーズ	100	1,225.00	122,500
日清オイリオグループ	600	3,255.00	1,953,000
不二製油グループ本社	1,100	3,105.00	3,415,500
J・オイルミルズ	200	3,825.00	765,000
キッコーマン	2,900	6,020.00	17,458,000
味の素	9,900	1,889.00	18,701,100
キューピー	2,400	2,658.00	6,379,200
ハウス食品グループ本社	1,600	3,695.00	5,912,000
カゴメ	1,700	3,175.00	5,397,500
焼津水産化学工業	200	1,028.00	205,600
アリアケジャパン	400	10,090.00	4,036,000
ピエトロ	100	1,642.00	164,200
エバラ食品工業	100	2,145.00	214,500
ニチレイ	2,200	2,766.00	6,085,200
東洋水産	2,200	3,905.00	8,591,000
イトアンド	200	1,649.00	329,800
大冷	100	1,824.00	182,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	657.00	65,700
日清食品ホールディングス	1,800	7,560.00	13,608,000
永谷園ホールディングス	200	2,783.00	556,600
一正蒲鉾	200	983.00	196,600
フジッコ	500	2,390.00	1,195,000
ロック・フィールド	500	1,679.00	839,500
日本たばこ産業	25,000	2,801.00	70,025,000
ケンコーマヨネーズ	200	2,481.00	496,200
わらべや日洋ホールディングス	300	1,851.00	555,300
なとり	300	1,818.00	545,400
イフジ産業	100	718.00	71,800
ピックルスコーポレーション	100	2,153.00	215,300
北の達人コーポレーション	1,700	583.00	991,100
ユーグレナ	1,700	667.00	1,133,900
ミヨシ油脂	200	1,249.00	249,800
理研ビタミン	200	3,560.00	712,000
片倉工業	500	1,233.00	616,500
ゲンゼ	300	4,685.00	1,405,500
東洋紡	1,800	1,602.00	2,883,600
ユニチカ	1,200	581.00	697,200
富士紡ホールディングス	200	3,305.00	661,000
倉敷紡績	400	2,811.00	1,124,400

シキボウ	200	1,130.00	226,000
日本毛織	1,400	901.00	1,261,400
ダイトウボウ	800	95.00	76,000
トーア紡コーポレーション	200	537.00	107,400
ダイドーリミテッド	500	368.00	184,000
帝国繊維	500	2,554.00	1,277,000
帝人	3,400	1,946.00	6,616,400
東レ	32,700	813.30	26,594,910
サカイオーベックス	100	2,274.00	227,400
住江織物	100	2,652.00	265,200
日本フェルト	200	470.00	94,000
イチカワ	100	1,548.00	154,800
アツギ	400	1,045.00	418,000
ダイニック	200	845.00	169,000
セーレン	1,000	1,632.00	1,632,000
ソトー	200	972.00	194,400
東海染工	100	1,137.00	113,700
小松マテーレ	700	914.00	639,800
ワコールホールディングス	1,200	3,005.00	3,606,000
ホギメディカル	500	3,255.00	1,627,500
レナウン	1,100	116.00	127,600
クラウディアホールディングス	100	511.00	51,100
T S Iホールディングス	1,600	788.00	1,260,800
マツオカコーポレーション	100	3,225.00	322,500
ワールド	400	2,319.00	927,600
三陽商会	300	1,868.00	560,400
ナイガイ	200	492.00	98,400
オンワードホールディングス	2,600	682.00	1,773,200
ルックホールディングス	200	1,180.00	236,000
キムラタン	2,300	31.00	71,300
ゴールドウイン	400	9,900.00	3,960,000
デサント	1,000	2,669.00	2,669,000
キング	200	497.00	99,400
ヤマトインターナショナル	300	458.00	137,400
特種東海製紙	300	4,210.00	1,263,000
王子ホールディングス	19,000	736.00	13,984,000
日本製紙	2,000	1,988.00	3,976,000
三菱製紙	700	575.00	402,500
北越コーポレーション	2,800	550.00	1,540,000
中越パルプ工業	200	1,524.00	304,800
巴川製紙所	100	1,200.00	120,000
大王製紙	2,100	1,465.00	3,076,500

阿波製紙	100	565.00	56,500
レンゴー	4,300	892.00	3,835,600
トーモク	300	1,956.00	586,800
ザ・パック	300	3,380.00	1,014,000
クラレ	7,100	1,561.00	11,083,100
旭化成	30,000	1,233.50	37,005,000
共和レザー	300	843.00	252,900
昭和電工	2,800	5,150.00	14,420,000
住友化学	33,200	601.00	19,953,200
住友精化	200	5,120.00	1,024,000
日産化学	2,600	5,780.00	15,028,000
ラサ工業	100	1,878.00	187,800
クレハ	400	7,540.00	3,016,000
多木化学	100	8,470.00	847,000
テイカ	300	2,293.00	687,900
石原産業	800	1,340.00	1,072,000
片倉コープアグリ	100	1,218.00	121,800
日東エフシー	300	769.00	230,700
日本曹達	700	2,731.00	1,911,700
東ソー	6,500	1,524.00	9,906,000
トクヤマ	1,200	2,671.00	3,205,200
セントラル硝子	900	2,596.00	2,336,400
東亜合成	2,700	1,207.00	3,258,900
大阪ソーダ	500	2,773.00	1,386,500
関東電化工業	1,000	1,073.00	1,073,000
デンカ	1,700	3,480.00	5,916,000
信越化学工業	7,400	10,030.00	74,222,000
日本カーバイド工業	100	1,890.00	189,000
堺化学工業	300	2,596.00	778,800
第一稀元素化学工業	400	1,139.00	455,600
エア・ウォーター	3,500	1,823.00	6,380,500
大陽日酸	3,500	1,928.00	6,748,000
日本化学工業	100	3,115.00	311,500
東邦アセチレン	100	1,523.00	152,300
日本パーカライズン	2,300	1,412.00	3,247,600
高压ガス工業	700	845.00	591,500
四国化成工業	700	1,193.00	835,100
戸田工業	100	2,632.00	263,200
ステラ ケミファ	300	3,735.00	1,120,500
保土谷化学工業	200	2,791.00	558,200
日本触媒	700	6,960.00	4,872,000
大日精化工業	400	3,300.00	1,320,000

カネカ	1,100	4,740.00	5,214,000
三菱瓦斯化学	4,300	1,793.00	7,709,900
三井化学	3,800	2,752.00	10,457,600
J S R	4,200	1,774.00	7,450,800
東京応化工業	700	3,125.00	2,187,500
大阪有機化学工業	400	1,410.00	564,000
三菱ケミカルホールディングス	28,200	930.60	26,242,920
K Hネオケム	600	3,320.00	1,992,000
ダイセル	6,600	1,265.00	8,349,000
住友ベークライト	700	4,165.00	2,915,500
積水化学工業	9,200	1,795.00	16,514,000
日本ゼオン	3,800	1,147.00	4,358,600
アイカ工業	1,300	3,345.00	4,348,500
宇部興産	2,100	2,480.00	5,208,000
積水樹脂	700	2,026.00	1,418,200
タキロンシーアイ	900	589.00	530,100
旭有機材	300	2,024.00	607,200
日立化成	2,000	1,795.00	3,590,000
ニチバン	200	2,213.00	442,600
リケンテクノス	1,100	516.00	567,600
大倉工業	200	2,086.00	417,200
積水化成成品工業	600	978.00	586,800
群栄化学工業	100	3,140.00	314,000
タイガースポリマー	200	691.00	138,200
ミライアル	100	1,047.00	104,700
ダイキアクシス	100	1,353.00	135,300
ダイキョーニシカワ	900	1,083.00	974,700
竹本容器	100	2,868.00	286,800
森六ホールディングス	200	2,916.00	583,200
日本化薬	2,700	1,387.00	3,744,900
カーリットホールディングス	500	940.00	470,000
日本精化	300	1,102.00	330,600
扶桑化学工業	400	2,399.00	959,600
トリケミカル研究所	100	4,680.00	468,000
A D E K A	2,100	1,701.00	3,572,100
日油	1,600	3,590.00	5,744,000
新日本理化	700	206.00	144,200
ハリマ化成グループ	400	984.00	393,600
花王	10,500	7,716.00	81,018,000
第一工業製薬	200	2,482.00	496,400
石原ケミカル	100	2,077.00	207,700
日華化学	100	1,141.00	114,100

ニイタカ	100	1,730.00	173,000
三洋化成工業	300	5,250.00	1,575,000
有機合成薬品工業	300	258.00	77,400
大日本塗料	500	1,119.00	559,500
日本ペイントホールディングス	3,500	3,685.00	12,897,500
関西ペイント	4,700	1,688.00	7,933,600
神東塗料	400	193.00	77,200
中国塗料	1,400	938.00	1,313,200
日本特殊塗料	300	2,236.00	670,800
藤倉化成	600	628.00	376,800
太陽ホールディングス	300	3,895.00	1,168,500
D I C	1,900	3,290.00	6,251,000
サカタインクス	900	1,132.00	1,018,800
東洋インキS Cホールディングス	900	2,681.00	2,412,900
T & K T O K A	300	1,063.00	318,900
富士フィルムホールディングス	8,900	4,773.00	42,479,700
資生堂	8,600	7,509.00	64,577,400
ライオン	6,000	2,069.00	12,414,000
高砂香料工業	300	3,595.00	1,078,500
マンダム	1,000	3,180.00	3,180,000
ミルボン	500	4,110.00	2,055,000
ファンケル	1,000	5,190.00	5,190,000
コーセー	700	17,560.00	12,292,000
コタ	200	1,484.00	296,800
シーズ・ホールディングス	500	5,860.00	2,930,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,800	3,150.00	5,670,000
ノエビアホールディングス	300	5,070.00	1,521,000
アジュバンコスメジャパン	100	981.00	98,100
エステー	300	1,997.00	599,100
アグロ カネショウ	200	2,295.00	459,000
コニシ	800	1,635.00	1,308,000
長谷川香料	500	2,127.00	1,063,500
星光P M C	300	929.00	278,700
小林製薬	1,200	7,420.00	8,904,000
荒川化学工業	400	1,560.00	624,000
メック	300	1,435.00	430,500
日本高純度化学	100	2,302.00	230,200
タカラバイオ	1,100	2,669.00	2,935,900
J C U	600	2,115.00	1,269,000
新田ゼラチン	300	776.00	232,800
O A T アグリオ	100	2,760.00	276,000
デクセリアルズ	1,100	1,047.00	1,151,700

アース製薬	300	5,400.00	1,620,000
北興化学工業	400	570.00	228,000
大成ラミック	100	2,971.00	297,100
クミアイ化学工業	1,800	692.00	1,245,600
日本農薬	1,000	602.00	602,000
アキレス	300	2,252.00	675,600
有沢製作所	700	936.00	655,200
日東電工	3,300	6,085.00	20,080,500
レック	500	2,205.00	1,102,500
三光合成	300	401.00	120,300
きもと	700	228.00	159,600
藤森工業	400	3,315.00	1,326,000
前澤化成工業	300	1,090.00	327,000
ウェーブロックホールディングス	100	881.00	88,100
JSP	200	2,312.00	462,400
エフピコ	400	6,280.00	2,512,000
天馬	300	2,044.00	613,200
信越ポリマー	800	882.00	705,600
東リ	1,100	307.00	337,700
ニフコ	1,700	2,747.00	4,669,900
バルカー	400	2,656.00	1,062,400
ユニ・チャーム	9,100	3,076.00	27,991,600
協和発酵キリン	5,400	2,235.00	12,069,000
武田薬品工業	17,000	4,647.00	78,999,000
アステラス製薬	39,700	1,678.50	66,636,450
大日本住友製薬	3,200	2,829.00	9,052,800
塩野義製薬	5,600	7,302.00	40,891,200
田辺三菱製薬	4,500	1,673.00	7,528,500
わかもと製薬	400	288.00	115,200
あすか製薬	500	1,200.00	600,000
日本新薬	1,100	6,590.00	7,249,000
バイオフェルミン製薬	100	2,838.00	283,800
中外製薬	4,500	6,770.00	30,465,000
科研製薬	800	5,720.00	4,576,000
エーザイ	5,100	9,894.00	50,459,400
ロート製薬	2,200	3,570.00	7,854,000
小野薬品工業	10,200	2,664.50	27,177,900
久光製薬	1,300	6,700.00	8,710,000
持田製薬	300	9,120.00	2,736,000
参天製薬	8,100	1,703.00	13,794,300
扶桑薬品工業	100	2,762.00	276,200
日本ケミファ	100	4,065.00	406,500

ツムラ	1,300	3,490.00	4,537,000
日医工	1,000	1,589.00	1,589,000
キッセイ薬品工業	800	3,275.00	2,620,000
生化学工業	800	1,679.00	1,343,200
栄研化学	700	2,493.00	1,745,100
日水製薬	200	1,241.00	248,200
鳥居薬品	200	2,376.00	475,200
JCRファーマ	300	5,570.00	1,671,000
東和薬品	200	9,000.00	1,800,000
富士製薬工業	300	1,734.00	520,200
沢井製薬	900	5,820.00	5,238,000
ゼリア新薬工業	800	2,027.00	1,621,600
第一三共	12,300	4,283.00	52,680,900
キョーリン製薬ホールディングス	1,100	2,676.00	2,943,600
大幸薬品	200	1,921.00	384,200
ダイト	200	3,475.00	695,000
大塚ホールディングス	8,200	5,488.00	45,001,600
大正製薬ホールディングス	1,000	12,030.00	12,030,000
ペプチドリーム	2,000	4,135.00	8,270,000
日本コークス工業	4,100	109.00	446,900
昭和シェル石油	4,000	2,033.00	8,132,000
ニチレキ	600	1,059.00	635,400
ユシロ化学工業	300	1,428.00	428,400
ビーピー・カストロール	200	1,467.00	293,400
富士石油	1,100	417.00	458,700
MORESCO	200	1,608.00	321,600
出光興産	3,300	4,840.00	15,972,000
JXTGホールディングス	73,300	735.60	53,919,480
コスモエネルギーホールディングス	1,200	4,195.00	5,034,000
横浜ゴム	2,500	2,301.00	5,752,500
東洋ゴム工業	2,200	1,667.00	3,667,400
ブリヂストン	13,200	4,335.00	57,222,000
住友ゴム工業	3,900	1,643.00	6,407,700
藤倉ゴム工業	300	540.00	162,000
オカモト	300	5,200.00	1,560,000
フコク	200	947.00	189,400
ニッタ	500	3,960.00	1,980,000
住友理工	800	1,070.00	856,000
三ツ星ベルト	600	2,581.00	1,548,600
バンドー化学	800	1,309.00	1,047,200
日東紡績	600	2,350.00	1,410,000
AGC	4,300	3,715.00	15,974,500

日本板硝子	2,000	1,037.00	2,074,000
石塚硝子	100	2,214.00	221,400
日本山村硝子	200	1,711.00	342,200
日本電気硝子	1,900	2,955.00	5,614,500
オハラ	200	2,499.00	499,800
住友大阪セメント	900	4,470.00	4,023,000
太平洋セメント	2,700	3,400.00	9,180,000
日本ヒューム	400	905.00	362,000
日本コンクリート工業	900	305.00	274,500
三谷セキサン	200	2,606.00	521,200
アジアパイルホールディングス	600	636.00	381,600
東海カーボン	3,900	1,913.00	7,460,700
日本カーボン	200	7,050.00	1,410,000
東洋炭素	300	2,910.00	873,000
ノリタケカンパニーリミテド	300	5,750.00	1,725,000
TOTO	3,300	4,145.00	13,678,500
日本碍子	5,300	1,672.00	8,861,600
日本特殊陶業	3,600	2,536.00	9,129,600
ダントーホールディングス	300	128.00	38,400
MARUWA	100	6,740.00	674,000
品川リフラクトリーズ	100	4,145.00	414,500
黒崎播磨	100	7,250.00	725,000
ヨータイ	400	759.00	303,600
イソライト工業	200	496.00	99,200
東京窯業	500	416.00	208,000
ニッカトー	200	1,034.00	206,800
フジインコーポレーテッド	400	2,535.00	1,014,000
クニミネ工業	100	997.00	99,700
エーアンドエーマテリアル	100	1,043.00	104,300
ニチアス	1,200	2,329.00	2,794,800
ニチハ	600	2,494.00	1,496,400
新日鐵住金	19,100	2,166.00	41,370,600
神戸製鋼所	7,800	989.00	7,714,200
中山製鋼所	600	588.00	352,800
合同製鐵	200	2,102.00	420,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	11,500	2,181.50	25,087,250
日新製鋼	1,000	1,529.00	1,529,000
東京製鐵	2,300	884.00	2,033,200
共英製鋼	500	2,365.00	1,182,500
大和工業	900	3,110.00	2,799,000
東京鐵鋼	200	1,467.00	293,400
大阪製鐵	300	1,918.00	575,400

淀川製鋼所	600	2,385.00	1,431,000
丸一鋼管	1,500	3,375.00	5,062,500
モリ工業	100	3,130.00	313,000
大同特殊鋼	700	4,565.00	3,195,500
日本高周波鋼業	100	692.00	69,200
日本冶金工業	3,600	307.00	1,105,200
山陽特殊製鋼	500	2,756.00	1,378,000
愛知製鋼	200	4,080.00	816,000
日立金属	4,600	1,376.00	6,329,600
日本金属	100	1,513.00	151,300
大太平洋金属	300	3,350.00	1,005,000
新日本電工	2,600	274.00	712,400
栗本鐵工所	200	1,633.00	326,600
虹技	100	1,671.00	167,100
三菱製鋼	300	1,936.00	580,800
日亜鋼業	600	327.00	196,200
日本精線	100	3,590.00	359,000
エンビプロ・ホールディングス	100	679.00	67,900
シンニッタン	700	368.00	257,600
新家工業	100	1,742.00	174,200
大紀アルミニウム工業所	700	675.00	472,500
日本軽金属ホールディングス	11,700	249.00	2,913,300
三井金属鉱業	1,200	3,160.00	3,792,000
東邦亜鉛	200	3,860.00	772,000
三菱マテリアル	2,800	2,970.00	8,316,000
住友金属鉱山	5,800	3,736.00	21,668,800
DOWAホールディングス	1,000	3,500.00	3,500,000
古河機械金属	700	1,411.00	987,700
エス・サイエンス	1,800	75.00	135,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	500	2,082.00	1,041,000
東邦チタニウム	800	1,397.00	1,117,600
UACJ	700	2,368.00	1,657,600
CKサンエツ	100	2,916.00	291,600
古河電気工業	1,200	3,150.00	3,780,000
住友電気工業	15,900	1,582.50	25,161,750
フジクラ	5,200	493.00	2,563,600
昭和電線ホールディングス	500	678.00	339,000
東京特殊電線	100	2,011.00	201,100
タツタ電線	900	568.00	511,200
カナレ電気	100	2,014.00	201,400
平河ヒューテック	200	1,381.00	276,200
リョービ	500	3,290.00	1,645,000

アーレスティ	600	732.00	439,200
アサヒホールディングス	800	2,395.00	1,916,000
稲葉製作所	200	1,373.00	274,600
宮地エンジニアリンググループ	100	2,742.00	274,200
トーカロ	1,100	996.00	1,095,600
アルファC o	100	1,357.00	135,700
SUMCO	4,700	1,631.00	7,665,700
川田テクノロジーズ	100	6,410.00	641,000
RS Technologies	100	4,800.00	480,000
東洋製罐グループホールディングス	2,700	2,293.00	6,191,100
ホッカンホールディングス	200	1,747.00	349,400
コロナ	200	1,124.00	224,800
横河ブリッジホールディングス	800	1,882.00	1,505,600
駒井ハルテック	100	2,154.00	215,400
三和ホールディングス	4,400	1,300.00	5,720,000
文化シャッター	1,300	780.00	1,014,000
三協立山	600	1,285.00	771,000
アルインコ	300	1,040.00	312,000
東洋シャッター	100	625.00	62,500
LIXILグループ	6,300	1,448.00	9,122,400
日本フィルコン	300	584.00	175,200
ノーリツ	1,000	1,667.00	1,667,000
長府製作所	400	2,329.00	931,600
リンナイ	800	7,770.00	6,216,000
ダイニチ工業	200	734.00	146,800
日東精工	600	633.00	379,800
岡部	900	972.00	874,800
ジーテクト	500	1,616.00	808,000
中国工業	100	589.00	58,900
東プレ	800	2,351.00	1,880,800
高周波熱錬	800	940.00	752,000
東京製綱	300	1,269.00	380,700
サンコール	200	732.00	146,400
モリテック スチール	300	506.00	151,800
パイオラックス	700	2,546.00	1,782,200
エイチワン	400	1,136.00	454,400
日本発條	4,200	1,016.00	4,267,200
アドバネクス	100	1,899.00	189,900
立川ブラインド工業	200	1,127.00	225,400
三益半導体工業	300	1,526.00	457,800
日本ドライケミカル	100	1,252.00	125,200
日本製鋼所	1,300	2,586.00	3,361,800

三浦工業	1,800	2,729.00	4,912,200
タクマ	1,500	1,402.00	2,103,000
ツガミ	900	1,088.00	979,200
オークマ	500	5,900.00	2,950,000
東芝機械	500	2,206.00	1,103,000
アマダホールディングス	6,600	1,109.00	7,319,400
アイダエンジニアリング	1,200	978.00	1,173,600
滝澤鉄工所	100	1,618.00	161,800
F U J I	1,300	1,616.00	2,100,800
牧野フライス製作所	500	4,760.00	2,380,000
オーエスジー	2,100	2,354.00	4,943,400
旭ダイヤモンド工業	1,100	756.00	831,600
D M G 森精機	2,700	1,712.00	4,622,400
ソディック	900	901.00	810,900
ディスコ	600	18,010.00	10,806,000
日東工器	200	2,588.00	517,600
日進工具	100	2,420.00	242,000
パンチ工業	300	700.00	210,000
富士ダイス	200	811.00	162,200
豊和工業	200	910.00	182,000
O K K	200	1,098.00	219,600
石川製作所	100	1,504.00	150,400
東洋機械金属	300	631.00	189,300
津田駒工業	100	2,062.00	206,200
エンシュウ	100	1,512.00	151,200
島精機製作所	600	3,350.00	2,010,000
オプトラン	400	2,341.00	936,400
N C ホールディングス	100	610.00	61,000
フリュー	300	916.00	274,800
ヤマシンフィルタ	700	798.00	558,600
日阪製作所	500	1,067.00	533,500
やまびこ	800	1,263.00	1,010,400
平田機工	200	7,470.00	1,494,000
ペガサスミシン製造	400	924.00	369,600
タツモ	100	1,110.00	111,000
ナプテスコ	2,300	2,782.00	6,398,600
三井海洋開発	400	3,150.00	1,260,000
レオン自動機	400	1,980.00	792,000
S M C	1,300	37,170.00	48,321,000
新川	300	535.00	160,500
ホソカワミクロン	100	5,520.00	552,000
ユニオンツール	200	3,890.00	778,000

オイレス工業	600	1,934.00	1,160,400
日精エー・エス・ピー機械	100	4,115.00	411,500
サトーホールディングス	500	3,010.00	1,505,000
技研製作所	300	3,950.00	1,185,000
日本エアータック	100	718.00	71,800
カワタ	100	1,745.00	174,500
日精樹脂工業	300	1,062.00	318,600
オカダアイヨン	100	1,629.00	162,900
ワイエイシーホールディングス	100	794.00	79,400
小松製作所	19,500	3,127.00	60,976,500
住友重機械工業	2,500	3,545.00	8,862,500
日立建機	1,700	3,125.00	5,312,500
日工	100	2,438.00	243,800
巴工業	200	2,271.00	454,200
井関農機	400	1,972.00	788,800
TOWA	400	823.00	329,200
丸山製作所	100	1,621.00	162,100
北川鉄工所	200	2,676.00	535,200
ローツェ	200	1,904.00	380,800
タカキタ	100	681.00	68,100
クボタ	23,100	1,844.50	42,607,950
荏原実業	100	1,841.00	184,100
三菱化工機	100	1,714.00	171,400
月島機械	800	1,257.00	1,005,600
帝国電機製作所	300	1,558.00	467,400
東京機械製作所	100	408.00	40,800
新東工業	1,000	991.00	991,000
澁谷工業	400	3,855.00	1,542,000
アイチ コーポレーション	700	656.00	459,200
小森コーポレーション	1,200	1,235.00	1,482,000
鶴見製作所	300	1,988.00	596,400
住友精密工業	100	3,430.00	343,000
酒井重工業	100	3,365.00	336,500
荏原製作所	1,900	3,315.00	6,298,500
西島製作所	400	922.00	368,800
北越工業	400	1,252.00	500,800
ダイキン工業	5,900	12,465.00	73,543,500
オルガノ	100	3,130.00	313,000
トーヨーカネツ	200	2,569.00	513,800
栗田工業	2,300	2,868.00	6,596,400
椿本チエイン	600	4,270.00	2,562,000
大同工業	200	1,056.00	211,200

木村化工機	300	400.00	120,000
アネスト岩田	700	1,105.00	773,500
ダイフク	2,400	5,070.00	12,168,000
サムコ	100	1,142.00	114,200
加藤製作所	200	3,390.00	678,000
油研工業	100	2,125.00	212,500
タダノ	2,100	1,269.00	2,664,900
フジテック	1,500	1,347.00	2,020,500
C K D	1,200	1,343.00	1,611,600
キトー	300	1,938.00	581,400
平和	1,200	2,601.00	3,121,200
理想科学工業	400	2,087.00	834,800
S A N K Y O	1,100	4,250.00	4,675,000
日本金銭機械	500	1,095.00	547,500
マースグループホールディングス	300	2,269.00	680,700
福島工業	300	5,320.00	1,596,000
オーイズミ	100	502.00	50,200
ダイコク電機	200	1,609.00	321,800
竹内製作所	700	2,415.00	1,690,500
アマノ	1,200	2,332.00	2,798,400
J U K I	600	1,590.00	954,000
サンデンホールディングス	500	1,282.00	641,000
蛇の目ミシン工業	400	593.00	237,200
マックス	700	1,520.00	1,064,000
グローリー	1,200	3,060.00	3,672,000
新晃工業	400	1,573.00	629,200
大和冷機工業	600	1,224.00	734,400
セガサミーホールディングス	4,300	1,606.00	6,905,800
日本ピストンリング	100	2,118.00	211,800
リケン	200	5,680.00	1,136,000
T P R	600	2,641.00	1,584,600
ツバキ・ナカシマ	600	2,024.00	1,214,400
ホシザキ	1,300	9,050.00	11,765,000
大豊工業	300	1,081.00	324,300
日本精工	8,800	1,095.00	9,636,000
N T N	9,200	374.00	3,440,800
ジェイテクト	4,100	1,367.00	5,604,700
不二越	400	4,745.00	1,898,000
日本トムソン	1,300	687.00	893,100
T H K	2,700	2,603.00	7,028,100
ユーシン精機	300	1,291.00	387,300
前澤給装工業	200	1,827.00	365,400

イーグル工業	500	1,369.00	684,500
前澤工業	200	394.00	78,800
日本ピラー工業	400	1,580.00	632,000
キット	1,700	904.00	1,536,800
マキタ	5,200	4,300.00	22,360,000
日立造船	3,400	407.00	1,383,800
三菱重工業	7,200	4,248.00	30,585,600
I H I	3,300	3,960.00	13,068,000
スター精密	700	1,657.00	1,159,900
日清紡ホールディングス	2,400	1,125.00	2,700,000
イビデン	2,600	1,698.00	4,414,800
コニカミノルタ	9,400	1,074.00	10,095,600
ブラザー工業	5,600	1,921.00	10,757,600
ミネベアミツミ	8,000	1,709.00	13,672,000
日立製作所	19,400	3,522.00	68,326,800
三菱電機	43,000	1,442.50	62,027,500
富士電機	2,800	3,595.00	10,066,000
東洋電機製造	200	1,596.00	319,200
安川電機	5,000	3,480.00	17,400,000
シンフォニアテクノロジー	600	1,668.00	1,000,800
明電舎	900	1,635.00	1,471,500
オリジン電気	100	1,627.00	162,700
山洋電気	200	4,545.00	909,000
デンヨー	400	1,732.00	692,800
東芝テック	500	3,395.00	1,697,500
芝浦メカトロニクス	100	4,055.00	405,500
マブチモーター	1,200	4,045.00	4,854,000
日本電産	5,200	14,255.00	74,126,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	2,204.00	440,800
トレックス・セミコンダクター	100	1,566.00	156,600
東光高岳	200	1,646.00	329,200
ダブル・スコープ	600	1,082.00	649,200
宮越ホールディングス	100	894.00	89,400
ダイヘン	500	2,749.00	1,374,500
ヤーマン	600	1,973.00	1,183,800
JVCケンウッド	3,200	324.00	1,036,800
ミマキエンジニアリング	400	992.00	396,800
第一精工	200	1,488.00	297,600
日新電機	1,000	876.00	876,000
大崎電気工業	900	784.00	705,600
オムロン	4,600	4,740.00	21,804,000
日東工業	700	2,024.00	1,416,800

I D E C	600	2,505.00	1,503,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,500	2,417.00	3,625,500
サクサホールディングス	100	2,027.00	202,700
メルコホールディングス	200	3,900.00	780,000
テクノメディカ	100	2,044.00	204,400
日本電気	5,600	3,430.00	19,208,000
富士通	4,100	6,959.00	28,531,900
沖電気工業	1,900	1,511.00	2,870,900
岩崎通信機	200	781.00	156,200
電気興業	200	2,798.00	559,600
サンケン電気	500	2,751.00	1,375,500
ナカヨ	100	1,533.00	153,300
アイホン	200	1,575.00	315,000
ルネサスエレクトロニクス	4,400	641.00	2,820,400
セイコーエプソン	5,300	1,864.00	9,879,200
ワコム	3,100	601.00	1,863,100
アルバック	1,000	4,000.00	4,000,000
アクセル	200	626.00	125,200
E I Z O	400	3,995.00	1,598,000
ジャパンディスプレイ	10,100	104.00	1,050,400
日本信号	1,100	1,057.00	1,162,700
京三製作所	900	532.00	478,800
能美防災	600	2,261.00	1,356,600
ホーチキ	300	1,295.00	388,500
星和電機	200	477.00	95,400
エレコム	400	2,853.00	1,141,200
パナソニック	49,200	1,181.00	58,105,200
シャープ	4,300	1,789.00	7,692,700
アンリツ	2,800	1,847.00	5,171,600
富士通ゼネラル	1,300	1,616.00	2,100,800
ソニー	28,900	6,105.00	176,434,500
T D K	2,300	10,120.00	23,276,000
帝国通信工業	200	1,216.00	243,200
タムラ製作所	1,700	613.00	1,042,100
アルプス電気	4,000	2,668.00	10,672,000
池上通信機	100	1,283.00	128,300
パイオニア	7,100	97.00	688,700
日本電波工業	400	524.00	209,600
鈴木	200	763.00	152,600
日本トリム	100	6,040.00	604,000
ローランド ディー . ジー .	200	2,356.00	471,200
フォスター電機	500	1,647.00	823,500

クラリオン	400	2,476.00	990,400
S M K	100	2,608.00	260,800
ヨコオ	300	1,284.00	385,200
ティアック	300	280.00	84,000
ホシデン	1,300	920.00	1,196,000
ヒロセ電機	600	11,960.00	7,176,000
日本航空電子工業	1,000	1,494.00	1,494,000
T O A	500	1,148.00	574,000
マクセルホールディングス	900	1,577.00	1,419,300
古野電気	600	1,320.00	792,000
ユニデンホールディングス	100	2,647.00	264,700
アルパイン	700	1,928.00	1,349,600
スミダコーポレーション	400	1,451.00	580,400
アイコム	200	2,415.00	483,000
リオン	200	2,196.00	439,200
本多通信工業	400	632.00	252,800
船井電機	400	617.00	246,800
横河電機	4,300	2,335.00	10,040,500
新電元工業	200	4,500.00	900,000
アズビル	2,800	2,255.00	6,314,000
東亜ディーケーケー	200	1,048.00	209,600
日本光電工業	1,900	3,345.00	6,355,500
チノー	100	1,298.00	129,800
共和電業	400	414.00	165,600
日本電子材料	200	880.00	176,000
堀場製作所	800	5,440.00	4,352,000
アドバンテスト	2,900	2,474.00	7,174,600
小野測器	200	745.00	149,000
エスベック	400	2,032.00	812,800
キーエンス	2,100	62,100.00	130,410,000
日置電機	200	4,230.00	846,000
シスメックス	3,400	7,849.00	26,686,600
日本マイクロニクス	700	764.00	534,800
メガチップス	300	2,452.00	735,600
O B A R A G R O U P	200	4,655.00	931,000
原田工業	100	858.00	85,800
コーセル	600	1,190.00	714,000
イリソ電子工業	400	4,910.00	1,964,000
オブテックスグループ	800	2,240.00	1,792,000
千代田インテグレ	200	2,263.00	452,600
アイ・オー・データ機器	200	1,265.00	253,000
レーザーテック	900	3,485.00	3,136,500

スタンレー電気	3,000	3,350.00	10,050,000
岩崎電気	200	1,543.00	308,600
ウシオ電機	2,600	1,310.00	3,406,000
岡谷電機産業	300	471.00	141,300
ハリオス テクノ ホールディング	400	801.00	320,400
日本セラミック	400	3,030.00	1,212,000
遠藤照明	200	821.00	164,200
古河電池	300	817.00	245,100
双信電機	200	449.00	89,800
山一電機	300	1,323.00	396,900
図研	300	1,781.00	534,300
日本電子	800	2,045.00	1,636,000
カシオ計算機	3,800	1,669.00	6,342,200
ファナック	4,100	20,875.00	85,587,500
日本シイエムケイ	1,100	866.00	952,600
エンプラス	200	3,140.00	628,000
大真空	200	1,180.00	236,000
ローム	2,100	8,170.00	17,157,000
浜松ホトニクス	3,100	3,825.00	11,857,500
三井ハイテック	500	1,263.00	631,500
新光電気工業	1,400	827.00	1,157,800
京セラ	6,600	6,071.00	40,068,600
太陽誘電	1,900	2,610.00	4,959,000
村田製作所	4,500	19,020.00	85,590,000
ユーシン	700	867.00	606,900
双葉電子工業	700	1,719.00	1,203,300
北陸電気工業	200	1,168.00	233,600
ニチコン	1,300	901.00	1,171,300
日本ケミコン	300	2,617.00	785,100
K O A	700	1,668.00	1,167,600
市光工業	600	845.00	507,000
小糸製作所	2,600	5,590.00	14,534,000
ミツバ	800	964.00	771,200
S C R E E Nホールディングス	700	6,200.00	4,340,000
キャノン電子	400	2,127.00	850,800
キャノン	23,200	3,208.00	74,425,600
リコー	12,900	1,116.00	14,396,400
象印マホービン	800	1,205.00	964,000
M U T O Hホールディングス	100	2,252.00	225,200
東京エレクトロン	2,900	15,445.00	44,790,500
トヨタ紡織	1,500	1,887.00	2,830,500
芦森工業	100	1,935.00	193,500

ユニプレス	800	2,265.00	1,812,000	
豊田自動織機	3,500	5,570.00	19,495,000	
モリタホールディングス	800	2,090.00	1,672,000	
三櫻工業	600	670.00	402,000	
デンソー	9,500	5,161.00	49,029,500	
東海理化電機製作所	1,100	2,152.00	2,367,200	
三井E & Sホールディングス	1,600	1,379.00	2,206,400	
川崎重工業	3,300	2,674.00	8,824,200	
名村造船所	1,300	563.00	731,900	
サノヤスホールディングス	500	223.00	111,500	
日本車輛製造	200	2,556.00	511,200	
三菱ロジスネクスト	500	1,262.00	631,000	
近畿車輛	100	2,314.00	231,400	
日産自動車	50,800	1,021.00	51,866,800	
いすゞ自動車	13,600	1,571.50	21,372,400	
トヨタ自動車	48,000	6,639.00	318,672,000	代用有価証券 2,300株
日野自動車	5,400	1,077.00	5,815,800	
三菱自動車工業	15,900	744.00	11,829,600	
エフテック	300	1,135.00	340,500	
レシップホールディングス	100	723.00	72,300	
G M B	100	1,146.00	114,600	
ファルテック	100	993.00	99,300	
武蔵精密工業	1,000	1,729.00	1,729,000	
日産車体	800	954.00	763,200	
新明和工業	2,000	1,430.00	2,860,000	
極東開発工業	900	1,556.00	1,400,400	
日信工業	800	1,541.00	1,232,800	
トピー工業	400	2,648.00	1,059,200	
ティラド	200	2,656.00	531,200	
曙ブレーキ工業	2,400	230.00	552,000	
タチエス	700	1,607.00	1,124,900	
N O K	2,300	1,695.00	3,898,500	
フタバ産業	1,200	663.00	795,600	
K Y B	400	2,877.00	1,150,800	
大同メタル工業	700	880.00	616,000	
プレス工業	2,100	525.00	1,102,500	
ミクニ	600	640.00	384,000	
太平洋工業	900	1,601.00	1,440,900	
ケーヒン	1,000	2,082.00	2,082,000	
河西工業	500	981.00	490,500	
アイシン精機	3,500	4,320.00	15,120,000	
マツダ	13,500	1,220.00	16,470,000	

今仙電機製作所	400	1,035.00	414,000	
本田技研工業	36,300	3,229.00	117,212,700	代用有価証券 4,700株
スズキ	7,900	5,478.00	43,276,200	
S U B A R U	13,400	2,886.00	38,672,400	
安永	200	1,854.00	370,800	
ヤマハ発動機	6,100	2,311.00	14,097,100	
ショーワ	1,000	1,538.00	1,538,000	
T B K	500	454.00	227,000	
エクセディ	600	2,870.00	1,722,000	
豊田合成	1,400	2,367.00	3,313,800	
愛三工業	700	853.00	597,100	
盟和産業	100	1,155.00	115,500	
日本プラスト	300	903.00	270,900	
ヨロズ	400	1,612.00	644,800	
エフ・シー・シー	800	2,989.00	2,391,200	
シマノ	1,700	14,830.00	25,211,000	
テイ・エス テック	1,000	3,410.00	3,410,000	
ジャムコ	200	2,922.00	584,400	
テルモ	6,100	6,350.00	38,735,000	
クリエートメディック	100	1,123.00	112,300	
日機装	1,400	1,327.00	1,857,800	
島津製作所	5,500	2,704.00	14,872,000	
J M S	400	573.00	229,200	
クボテック	100	329.00	32,900	
長野計器	300	962.00	288,600	
ブイ・テクノロジー	100	14,960.00	1,496,000	
東京計器	300	1,051.00	315,300	
愛知時計電機	100	3,905.00	390,500	
インターアクション	200	2,211.00	442,200	
オーバル	400	272.00	108,800	
東京精密	800	2,879.00	2,303,200	
マニー	500	5,120.00	2,560,000	
ニコン	7,500	1,988.00	14,910,000	
トプコン	2,300	1,629.00	3,746,700	
オリンパス	6,400	3,590.00	22,976,000	
理研計器	400	2,300.00	920,000	
タムロン	400	1,874.00	749,600	
H O Y A	8,700	6,718.00	58,446,600	
シード	200	1,722.00	344,400	
ノーリツ鋼機	300	2,133.00	639,900	
エー・アンド・デイ	400	980.00	392,000	
朝日インテック	1,600	4,835.00	7,736,000	

シチズン時計	4,700	669.00	3,144,300
リズム時計工業	100	1,971.00	197,100
大研医器	300	773.00	231,900
メニコン	600	2,524.00	1,514,400
シンシア	100	537.00	53,700
松風	200	1,251.00	250,200
セイコーホールディングス	700	2,813.00	1,969,100
ニプロ	3,000	1,490.00	4,470,000
中本パックス	100	1,805.00	180,500
スノーピーク	200	1,485.00	297,000
パラマウントベッドホールディングス	500	4,680.00	2,340,000
トランザクション	300	839.00	251,700
S H O - B I	200	393.00	78,600
ニホンフラッシュ	200	2,097.00	419,400
前田工織	500	2,442.00	1,221,000
永大産業	600	444.00	266,400
アートネイチャー	500	675.00	337,500
バンダイナムコホールディングス	4,400	4,135.00	18,194,000
アイフィスジャパン	100	744.00	74,400
共立印刷	800	267.00	213,600
S H O E I	200	4,790.00	958,000
フランスベッドホールディングス	600	952.00	571,200
パイロットコーポレーション	800	5,530.00	4,424,000
萩原工業	300	1,682.00	504,600
トッパン・フォームズ	1,000	988.00	988,000
フジシールインターナショナル	1,000	3,340.00	3,340,000
タカラトミー	1,800	1,302.00	2,343,600
廣濟堂	500	451.00	225,500
エステールホールディングス	200	705.00	141,000
アーク	2,000	99.00	198,000
タカノ	200	893.00	178,600
プロネクサス	400	1,062.00	424,800
ホクシン	500	152.00	76,000
ウッドワン	200	1,210.00	242,000
大建工業	300	2,075.00	622,500
凸版印刷	6,100	1,610.00	9,821,000
大日本印刷	6,100	2,545.00	15,524,500
図書印刷	400	821.00	328,400
共同印刷	100	2,603.00	260,300
N I S S H A	900	1,882.00	1,693,800
光村印刷	100	2,258.00	225,800
宝印刷	300	1,794.00	538,200

アシックス	4,300	1,473.00	6,333,900
ツツミ	100	2,134.00	213,400
小松ウオール工業	100	2,125.00	212,500
ヤマハ	2,600	5,250.00	13,650,000
河合楽器製作所	100	4,140.00	414,000
クリナップ	400	656.00	262,400
ピジョン	2,600	5,110.00	13,286,000
キングジム	400	895.00	358,000
リンテック	1,000	2,707.00	2,707,000
イトーキ	900	592.00	532,800
任天堂	2,600	35,990.00	93,574,000
三菱鉛筆	700	2,028.00	1,419,600
タカラスタンダード	900	1,739.00	1,565,100
コクヨ	2,100	1,755.00	3,685,500
ナカバヤシ	500	585.00	292,500
グローブライド	200	2,494.00	498,800
オカムラ	1,500	1,612.00	2,418,000
美津濃	400	2,639.00	1,055,600
東京電力ホールディングス	34,400	568.00	19,539,200
中部電力	13,200	1,553.50	20,506,200
関西電力	17,600	1,724.50	30,351,200
中国電力	5,900	1,367.00	8,065,300
北陸電力	4,200	967.00	4,061,400
東北電力	10,100	1,399.00	14,129,900
四国電力	3,900	1,275.00	4,972,500
九州電力	8,900	1,316.00	11,712,400
北海道電力	4,100	664.00	2,722,400
沖縄電力	800	2,007.00	1,605,600
電源開発	3,400	2,833.00	9,632,200
エフオン	300	1,074.00	322,200
イーレックス	800	960.00	768,000
レノバ	500	1,343.00	671,500
東京瓦斯	8,400	2,703.50	22,709,400
大阪瓦斯	8,400	2,041.00	17,144,400
東邦瓦斯	2,100	4,005.00	8,410,500
北海道瓦斯	300	1,418.00	425,400
広島ガス	1,000	352.00	352,000
西部瓦斯	500	2,427.00	1,213,500
静岡ガス	1,300	959.00	1,246,700
メタウォーター	200	3,025.00	605,000
SBSホールディングス	500	1,430.00	715,000
東武鉄道	4,500	3,125.00	14,062,500

相鉄ホールディングス	1,500	3,415.00	5,122,500
東京急行電鉄	11,700	1,828.00	21,387,600
京浜急行電鉄	5,900	1,674.00	9,876,600
小田急電鉄	6,900	2,353.00	16,235,700
京王電鉄	2,400	6,030.00	14,472,000
京成電鉄	3,200	3,450.00	11,040,000
富士急行	600	3,010.00	1,806,000
新京成電鉄	100	2,140.00	214,000
東日本旅客鉄道	7,600	9,860.00	74,936,000
西日本旅客鉄道	3,900	7,538.00	29,398,200
東海旅客鉄道	3,900	21,435.00	83,596,500
西武ホールディングス	5,500	2,016.00	11,088,000
鴻池運輸	700	1,732.00	1,212,400
西日本鉄道	1,200	2,818.00	3,381,600
ハマキョウレックス	300	3,660.00	1,098,000
サカイ引越センター	200	5,900.00	1,180,000
近鉄グループホールディングス	4,100	4,340.00	17,794,000
阪急阪神ホールディングス	5,400	3,760.00	20,304,000
南海電気鉄道	1,800	2,685.00	4,833,000
京阪ホールディングス	1,800	4,400.00	7,920,000
神戸電鉄	100	3,950.00	395,000
名古屋鉄道	3,300	2,710.00	8,943,000
山陽電気鉄道	300	2,360.00	708,000
日本通運	1,600	7,060.00	11,296,000
ヤマトホールディングス	7,100	2,860.00	20,306,000
山九	1,100	5,570.00	6,127,000
丸運	400	315.00	126,000
丸全昭和運輸	300	2,925.00	877,500
センコーグループホールディングス	2,300	878.00	2,019,400
トナミホールディングス	100	6,400.00	640,000
ニッコンホールディングス	1,600	2,868.00	4,588,800
日本石油輸送	100	2,741.00	274,100
福山通運	500	4,405.00	2,202,500
セイノーホールディングス	3,100	1,594.00	4,941,400
エスライン	200	1,238.00	247,600
神奈川中央交通	100	3,745.00	374,500
日立物流	900	2,927.00	2,634,300
丸和運輸機関	200	3,685.00	737,000
C & F ロジホールディングス	500	1,301.00	650,500
九州旅客鉄道	3,400	3,460.00	11,764,000
S Gホールディングス	3,800	2,715.00	10,317,000
日本郵船	3,400	1,919.00	6,524,600

商船三井	2,400	2,765.00	6,636,000
川崎汽船	1,300	1,671.00	2,172,300
N Sユニテッド海運	200	2,925.00	585,000
明治海運	400	394.00	157,600
飯野海運	2,000	506.00	1,012,000
乾汽船	400	1,006.00	402,400
日本航空	7,500	3,963.00	29,722,500
A N Aホールディングス	7,400	3,844.00	28,445,600
パスコ	100	1,206.00	120,600
ランコム	100	6,380.00	638,000
日新	400	1,995.00	798,000
三菱倉庫	1,400	2,658.00	3,721,200
三井倉庫ホールディングス	500	2,027.00	1,013,500
住友倉庫	1,500	1,380.00	2,070,000
澁澤倉庫	200	1,593.00	318,600
東陽倉庫	800	308.00	246,400
日本トランスシティ	900	469.00	422,100
ケイヒン	100	1,404.00	140,400
中央倉庫	300	1,053.00	315,900
川西倉庫	100	1,644.00	164,400
安田倉庫	300	872.00	261,600
東洋埠頭	100	1,532.00	153,200
宇徳	400	529.00	211,600
上組	2,500	2,314.00	5,785,000
サンリツ	100	696.00	69,600
キムラユニティー	100	1,121.00	112,100
キューソー流通システム	100	2,553.00	255,300
近鉄エクスプレス	800	1,788.00	1,430,400
東海運	300	302.00	90,600
エーアイティー	300	1,061.00	318,300
内外トランスライン	100	1,680.00	168,000
日本コンセプト	100	1,104.00	110,400
N E C ネットズエスアイ	500	2,533.00	1,266,500
システナ	1,500	1,411.00	2,116,500
デジタルアーツ	200	5,850.00	1,170,000
新日鉄住金ソリューションズ	600	3,265.00	1,959,000
キューブシステム	200	828.00	165,600
エイジア	100	1,363.00	136,300
コア	200	1,380.00	276,000
ソリトンシステムズ	200	1,028.00	205,600
ソフトクリエイトホールディングス	200	1,642.00	328,400
T I S	1,400	5,270.00	7,378,000

ネオス	100	1,256.00	125,600
電算システム	200	2,321.00	464,200
グリー	2,300	487.00	1,120,100
コーエーテクモホールディングス	900	1,824.00	1,641,600
三菱総合研究所	200	3,815.00	763,000
ボルテージ	100	661.00	66,100
A G S	200	774.00	154,800
ファインデックス	300	693.00	207,900
ヒト・コミュニケーションズ	100	1,914.00	191,400
ブレインパッド	100	5,250.00	525,000
K L a b	800	1,078.00	862,400
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	300	2,437.00	731,100
イーブুকイニシアティブジャパン	100	1,744.00	174,400
ネクソン	10,800	1,332.00	14,385,600
アイスタイル	1,100	1,013.00	1,114,300
エムアップ	100	2,377.00	237,700
エイチーム	300	1,960.00	588,000
テクノスジャパン	400	932.00	372,800
e n i s h	100	554.00	55,400
コロプラ	1,200	729.00	874,800
オルトプラス	200	463.00	92,600
ブロードリーフ	2,100	670.00	1,407,000
クロス・マーケティンググループ	100	478.00	47,800
デジタルハーツホールディングス	200	1,427.00	285,400
メディアドゥホールディングス	100	2,471.00	247,100
じげん	400	717.00	286,800
ブイキューブ	200	530.00	106,000
サイバーリンクス	100	1,069.00	106,900
ディー・エル・イー	200	298.00	59,600
フィックスターズ	400	1,272.00	508,800
VOYAGE GROUP	200	1,524.00	304,800
オブティム	100	3,670.00	367,000
セレス	100	2,088.00	208,800
ティーガイア	400	2,449.00	979,600
セック	100	4,875.00	487,500
日本アジアグループ	400	397.00	158,800
豆蔵ホールディングス	300	1,006.00	301,800
テクマトリックス	300	1,891.00	567,300
プロシップ	100	2,535.00	253,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	10,200	241.00	2,458,200
GMOペイメントゲートウェイ	700	5,780.00	4,046,000
ザッパラス	200	387.00	77,400

システムリサーチ	100	3,730.00	373,000
インターネットイニシアティブ	700	2,495.00	1,746,500
さくらインターネット	500	557.00	278,500
ヴィンクス	100	1,373.00	137,300
GMOクラウド	100	3,160.00	316,000
SRAホールディングス	200	3,120.00	624,000
Minorityソリューションズ	100	1,567.00	156,700
システムインテグレータ	100	2,164.00	216,400
朝日ネット	300	510.00	153,000
eBASE	100	1,556.00	155,600
アバント	100	1,382.00	138,200
アドソル日進	100	2,018.00	201,800
フリービット	300	882.00	264,600
コムチュア	200	3,450.00	690,000
サイバーコム	100	1,763.00	176,300
アステリア	200	947.00	189,400
マークラインズ	100	1,683.00	168,300
メディカル・データ・ビジョン	400	1,712.00	684,800
gumi	500	667.00	333,500
ショーケース・ティービー	100	1,019.00	101,900
モバイルファクトリー	100	1,399.00	139,900
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	200	1,407.00	281,400
PCIホールディングス	100	2,975.00	297,500
パイプドHD	100	1,029.00	102,900
アイビーシー	100	1,316.00	131,600
ネオジャパン	100	926.00	92,600
オープンドア	200	2,717.00	543,400
マイネット	100	1,102.00	110,200
アカツキ	100	5,510.00	551,000
Ubicomホールディングス	100	1,027.00	102,700
LINE	1,300	3,545.00	4,608,500
カナミックネットワーク	100	2,067.00	206,700
シンクロ・フード	200	766.00	153,200
オークネット	200	1,186.00	237,200
AOI TYO Holdings	500	1,256.00	628,000
マクロミル	500	2,206.00	1,103,000
ビーグリー	100	1,356.00	135,600
ソルクシーズ	200	861.00	172,200
フェイス	200	1,267.00	253,400
野村総合研究所	2,700	5,140.00	13,878,000
サイバネットシステム	300	675.00	202,500
CEホールディングス	100	777.00	77,700

日本システム技術	100	1,971.00	197,100
インテージホールディングス	600	996.00	597,600
東邦システムサイエンス	100	852.00	85,200
ソースネクスト	800	1,206.00	964,800
F I G	400	441.00	176,400
フォーカスシステムズ	300	935.00	280,500
クレスコ	100	3,835.00	383,500
フジ・メディア・ホールディングス	4,400	1,727.00	7,598,800
オービック	1,500	10,170.00	15,255,000
ジャストシステム	600	2,340.00	1,404,000
T D C ソフト	400	1,015.00	406,000
ヤフー	27,600	330.00	9,108,000
トレンドマイクロ	2,300	6,710.00	15,433,000
インフォメーション・ディベロプメント	100	1,544.00	154,400
日本オラクル	700	7,540.00	5,278,000
アルファシステムズ	100	2,731.00	273,100
フューチャー	600	1,704.00	1,022,400
C A C H o l d i n g s	300	1,021.00	306,300
ソフトバンク・テクノロジー	200	2,082.00	416,400
トーセ	100	966.00	96,600
オービックビジネスコンサルタント	200	9,810.00	1,962,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,900	1,994.00	3,788,600
アイティフォー	500	824.00	412,000
東計電算	100	3,330.00	333,000
エクスネット	100	945.00	94,500
大塚商会	2,300	4,050.00	9,315,000
サイボウズ	500	720.00	360,000
ソフトブレーン	300	566.00	169,800
電通国際情報サービス	300	4,155.00	1,246,500
デジタルガレージ	800	3,255.00	2,604,000
E M システムズ	300	1,216.00	364,800
ウェザーニューズ	100	3,400.00	340,000
C I J	300	757.00	227,100
日本エンタープライズ	400	233.00	93,200
WOWOW	200	3,300.00	660,000
スカラ	300	955.00	286,500
I M A G I C A G R O U P	400	602.00	240,800
ネットワンシステムズ	1,500	2,422.00	3,633,000
システムソフト	900	125.00	112,500
アルゴグラフィックス	200	4,235.00	847,000
マーベラス	600	924.00	554,400
エイベックス	700	1,540.00	1,078,000

日本ユニシス	1,300	2,652.00	3,447,600
兼松エレクトロニクス	200	3,795.00	759,000
東京放送ホールディングス	2,800	2,054.00	5,751,200
日本テレビホールディングス	3,900	1,802.00	7,027,800
朝日放送グループホールディングス	400	768.00	307,200
テレビ朝日ホールディングス	1,200	2,320.00	2,784,000
スカパーJ S A Tホールディングス	3,200	514.00	1,644,800
テレビ東京ホールディングス	400	2,634.00	1,053,600
日本BS放送	100	1,231.00	123,100
ビジョン	100	3,840.00	384,000
USEN-NEXT HOLDINGS	200	1,077.00	215,400
ワイヤレスゲート	200	588.00	117,600
コネクシオ	300	1,606.00	481,800
クロップス	100	803.00	80,300
日本電信電話	28,900	4,496.00	129,934,400
KDDI	37,200	2,443.00	90,879,600
光通信	500	18,930.00	9,465,000
NTTドコモ	30,300	2,495.00	75,598,500
エムティーアイ	500	596.00	298,000
GMOインターネット	1,500	1,666.00	2,499,000
アイドママーケティングコミュニケーション	100	559.00	55,900
カドカワ	1,200	1,146.00	1,375,200
学研ホールディングス	100	5,990.00	599,000
ゼンリン	800	2,806.00	2,244,800
昭文社	200	555.00	111,000
インプレスホールディングス	400	172.00	68,800
アイネット	200	1,604.00	320,800
松竹	300	11,060.00	3,318,000
東宝	2,800	3,625.00	10,150,000
東映	200	12,370.00	2,474,000
エヌ・ティ・ティ・データ	11,300	1,388.00	15,684,400
ビジネスブレイン太田昭和	100	2,200.00	220,000
D T S	500	4,235.00	2,117,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,000	4,045.00	8,090,000
シーイーシー	500	2,458.00	1,229,000
カブコン	1,800	2,433.00	4,379,400
アイ・エス・ビー	100	2,354.00	235,400
ジャステック	300	1,098.00	329,400
S C S K	1,100	4,760.00	5,236,000
日本システムウエア	100	2,321.00	232,100
アイネス	500	1,279.00	639,500
T K C	400	4,025.00	1,610,000

富士ソフト	600	5,060.00	3,036,000	
N S D	700	2,379.00	1,665,300	
コナミホールディングス	1,700	4,910.00	8,347,000	
福井コンピュータホールディングス	100	1,773.00	177,300	
J B C Cホールディングス	300	1,576.00	472,800	
ミロク情報サービス	400	2,450.00	980,000	
ソフトバンクグループ	17,700	8,557.00	151,458,900	代用有価証券 2,700株
高千穂交易	200	1,076.00	215,200	
伊藤忠食品	100	5,070.00	507,000	
エレマテック	200	2,294.00	458,800	
J A L U X	100	2,728.00	272,800	
あらた	200	4,500.00	900,000	
トーメンデバイス	100	2,514.00	251,400	
東京エレクトロン デバイス	200	2,053.00	410,600	
フィールズ	400	948.00	379,200	
双日	23,400	409.00	9,570,600	
アルフレッサ ホールディングス	4,700	3,055.00	14,358,500	
横浜冷凍	1,100	925.00	1,017,500	
神栄	100	1,093.00	109,300	
ラサ商事	200	954.00	190,800	
ラクーンホールディングス	200	618.00	123,600	
アルコニックス	400	1,309.00	523,600	
神戸物産	600	2,955.00	1,773,000	
あい ホールディングス	700	2,196.00	1,537,200	
ディーブイエックス	200	1,272.00	254,400	
ダイワボウホールディングス	400	6,490.00	2,596,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	1,200	1,685.00	2,022,000	
ラクト・ジャパン	100	6,850.00	685,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	800	1,215.00	972,000	
八洲電機	300	810.00	243,000	
メディアスホールディングス	200	874.00	174,800	
U K Cホールディングス	300	2,240.00	672,000	
ジュテックホールディングス	100	1,038.00	103,800	
大光	100	705.00	70,500	
O C H Iホールディングス	100	1,235.00	123,500	
T O K A Iホールディングス	2,200	943.00	2,074,600	
黒谷	100	502.00	50,200	
C o m i n i x	100	843.00	84,300	
三洋貿易	200	1,968.00	393,600	
ビューティガレージ	100	1,725.00	172,500	
ウイン・パートナーズ	300	1,249.00	374,700	
ミタチ産業	100	792.00	79,200	

シップヘルスケアホールディングス	900	4,150.00	3,735,000	
明治電機工業	100	2,201.00	220,100	
デリカフーズホールディングス	100	1,490.00	149,000	
スターティアホールディングス	100	634.00	63,400	
コメダホールディングス	1,000	2,204.00	2,204,000	
富士興産	200	611.00	122,200	
小野建	400	1,660.00	664,000	
佐島電機	300	1,016.00	304,800	
エコートレーディング	100	645.00	64,500	
伯東	300	1,347.00	404,100	
コンドーテック	300	1,040.00	312,000	
中山福	200	562.00	112,400	
ナガイレーベン	600	2,596.00	1,557,600	
三菱食品	500	2,989.00	1,494,500	
松田産業	300	1,422.00	426,600	
第一興商	600	5,220.00	3,132,000	
メディパルホールディングス	4,600	2,538.00	11,674,800	
S P K	100	2,355.00	235,500	
萩原電気ホールディングス	200	3,015.00	603,000	
アズワン	300	8,520.00	2,556,000	
スズデン	100	1,369.00	136,900	
尾家産業	100	1,389.00	138,900	
シモジマ	300	1,040.00	312,000	
ドウシシャ	400	1,997.00	798,800	
小津産業	100	1,928.00	192,800	
高速	300	1,105.00	331,500	
たけびし	100	1,549.00	154,900	
リックス	100	1,620.00	162,000	
丸文	400	774.00	309,600	
ハビネット	400	1,783.00	713,200	
橋本総業ホールディングス	100	1,418.00	141,800	
日本ライフライン	1,300	1,666.00	2,165,800	
タカショー	200	478.00	95,600	
エクセル	200	1,934.00	386,800	
マルカキカイ	100	2,341.00	234,100	
I D O M	1,400	378.00	529,200	
日本エム・ディ・エム	300	1,429.00	428,700	
進和	200	2,293.00	458,600	
エスケイジャパン	100	954.00	95,400	
ダイトロン	200	1,678.00	335,600	
シークス	500	1,620.00	810,000	
田中商事	100	653.00	65,300	

オーハシテクニカ	200	1,411.00	282,200
白銅	100	1,807.00	180,700
伊藤忠商事	31,100	2,030.00	63,133,000
丸紅	41,800	867.00	36,240,600
高島	100	1,951.00	195,100
長瀬産業	2,400	1,665.00	3,996,000
蝶理	300	1,902.00	570,600
豊田通商	4,700	3,955.00	18,588,500
三共生興	700	444.00	310,800
兼松	1,700	1,468.00	2,495,600
ツカモトコーポレーション	100	1,155.00	115,500
三井物産	34,900	1,856.00	64,774,400
日本紙パルプ商事	200	4,325.00	865,000
日立ハイテクノロジーズ	1,300	4,130.00	5,369,000
カメイ	600	1,323.00	793,800
東都水産	100	2,056.00	205,600
OUGホールディングス	100	2,621.00	262,100
スターゼン	200	4,400.00	880,000
山善	1,700	1,136.00	1,931,200
椿本興業	100	3,505.00	350,500
住友商事	25,100	1,736.50	43,586,150
内田洋行	200	2,682.00	536,400
三菱商事	29,800	3,111.00	92,707,800
第一実業	200	3,875.00	775,000
キャノンマーケティングジャパン	1,200	2,133.00	2,559,600
西華産業	200	1,788.00	357,600
佐藤商事	400	1,047.00	418,800
菱洋エレクトロ	400	1,672.00	668,800
東京産業	400	619.00	247,600
ユアサ商事	400	3,540.00	1,416,000
神鋼商事	100	2,844.00	284,400
小林産業	200	308.00	61,600
阪和興業	700	3,700.00	2,590,000
正栄食品工業	200	4,350.00	870,000
カナデン	400	1,245.00	498,000
菱電商事	300	1,565.00	469,500
フルサト工業	200	1,875.00	375,000
岩谷産業	900	3,875.00	3,487,500
すてきナイスグループ	200	1,157.00	231,400
昭光通商	100	827.00	82,700
ニチモウ	100	1,578.00	157,800
極東貿易	100	1,958.00	195,800

イワキ	500	533.00	266,500
三愛石油	1,100	1,208.00	1,328,800
稲畑産業	1,000	1,600.00	1,600,000
G S Iクレオス	100	1,483.00	148,300
明和産業	400	434.00	173,600
ワキタ	900	1,245.00	1,120,500
東邦ホールディングス	1,300	3,105.00	4,036,500
サンゲツ	1,300	2,179.00	2,832,700
ミツウロコグループホールディングス	600	716.00	429,600
シナネンホールディングス	200	2,616.00	523,200
伊藤忠エネクス	1,000	1,059.00	1,059,000
サンリオ	1,300	2,183.00	2,837,900
サンワテクノス	300	1,335.00	400,500
リョーサン	500	3,510.00	1,755,000
新光商事	400	1,735.00	694,000
トーヨー	200	2,326.00	465,200
三信電気	400	2,034.00	813,600
東陽テクニカ	500	923.00	461,500
モスフードサービス	600	3,060.00	1,836,000
加賀電子	400	2,261.00	904,400
ソーダニッカ	400	666.00	266,400
立花エレテック	300	1,832.00	549,600
フォーバル	200	1,057.00	211,400
P A L T A C	800	5,550.00	4,440,000
三谷産業	500	323.00	161,500
太平洋興発	200	899.00	179,800
西本Wismettacホールディングス	100	5,050.00	505,000
国際紙パルプ商事	800	332.00	265,600
ヤマタネ	200	1,813.00	362,600
日鉄住金物産	300	5,240.00	1,572,000
泉州電業	100	2,528.00	252,800
トラスコ中山	900	2,842.00	2,557,800
オートバックスセブン	1,700	1,764.00	2,998,800
モリト	300	842.00	252,600
加藤産業	700	3,545.00	2,481,500
イノテック	300	1,283.00	384,900
イエローハット	400	2,821.00	1,128,400
J Kホールディングス	400	680.00	272,000
日伝	300	1,790.00	537,000
北沢産業	300	250.00	75,000
杉本商事	200	1,870.00	374,000
因幡電機産業	600	4,625.00	2,775,000

バイテックホールディングス	200	2,229.00	445,800
東テク	100	2,775.00	277,500
ミスミグループ本社	5,300	2,364.00	12,529,200
アルテック	300	271.00	81,300
タキヒヨー	100	1,933.00	193,300
蔵王産業	100	1,464.00	146,400
スズケン	1,900	6,070.00	11,533,000
ジェコス	300	1,094.00	328,200
ルネサスイーストン	400	460.00	184,000
ローソン	1,100	7,370.00	8,107,000
サンエー	300	4,665.00	1,399,500
カワチ薬品	300	2,116.00	634,800
エービーシー・マート	700	6,370.00	4,459,000
ハードオフコーポレーション	200	938.00	187,600
アスクル	400	3,035.00	1,214,000
ゲオホールディングス	600	1,636.00	981,600
アダストリア	600	1,941.00	1,164,600
ジーフット	200	750.00	150,000
くらコーポレーション	200	6,800.00	1,360,000
キャンドウ	200	1,698.00	339,600
パルグループホールディングス	200	3,300.00	660,000
エディオン	1,800	1,130.00	2,034,000
サーラコーポレーション	800	661.00	528,800
ワッツ	100	841.00	84,100
ハローズ	200	2,561.00	512,200
あみやき亭	100	4,035.00	403,500
ひらまつ	800	471.00	376,800
大黒天物産	100	4,310.00	431,000
ハニーズホールディングス	400	909.00	363,600
ファーマライズホールディングス	100	632.00	63,200
アルペン	300	1,951.00	585,300
ハブ	100	912.00	91,200
クオールホールディングス	600	2,055.00	1,233,000
ジーンズ	300	6,720.00	2,016,000
ビックカメラ	2,300	1,506.00	3,463,800
D C Mホールディングス	2,300	1,095.00	2,518,500
ペッパーフードサービス	300	3,280.00	984,000
Monotaro	2,700	2,678.00	7,230,600
東京一番フーズ	100	622.00	62,200
D Dホールディングス	100	2,387.00	238,700
きちり	100	802.00	80,200
アークランドサービスホールディングス	300	2,303.00	690,900

J・フロント リテイリング	5,400	1,560.00	8,424,000
ドトール・日レスホールディングス	700	2,079.00	1,455,300
マツモトキヨシホールディングス	1,800	4,265.00	7,677,000
ブロンコピリー	200	2,966.00	593,200
Z O Z O	4,600	2,720.00	12,512,000
トレジャー・ファクトリー	100	693.00	69,300
物語コーポレーション	100	9,980.00	998,000
ココカラファイン	500	6,590.00	3,295,000
三越伊勢丹ホールディングス	7,900	1,390.00	10,981,000
H a m e e	100	1,709.00	170,900
ウエルシアホールディングス	1,100	5,950.00	6,545,000
クリエイトSDホールディングス	600	2,908.00	1,744,800
丸善CHIホールディングス	500	350.00	175,000
ミサワ	100	465.00	46,500
エー・ピーカンパニー	100	661.00	66,100
チムニー	100	2,804.00	280,400
シュッピン	300	1,166.00	349,800
ネクステージ	600	1,077.00	646,200
ジョイフル本田	1,200	1,576.00	1,891,200
鳥貴族	100	2,176.00	217,600
キリン堂ホールディングス	200	1,575.00	315,000
ホットランド	200	1,442.00	288,400
すかいらーくホールディングス	4,000	1,775.00	7,100,000
綿半ホールディングス	200	2,485.00	497,000
ヨシックス	100	2,583.00	258,300
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,200	1,254.00	1,504,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	900.00	180,000
B E E N O S	100	1,522.00	152,200
あさひ	400	1,389.00	555,600
日本調剤	100	3,290.00	329,000
コスモス薬品	200	23,080.00	4,616,000
トーエル	200	872.00	174,400
一六堂	100	512.00	51,200
オンリー	100	1,121.00	112,100
セブン&アイ・ホールディングス	17,800	4,928.00	87,718,400
薬王堂	200	3,455.00	691,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,100	1,210.00	1,331,000
ツルハホールディングス	900	12,260.00	11,034,000
サンマルクホールディングス	300	2,694.00	808,200
フェリシモ	100	1,289.00	128,900
トリドールホールディングス	500	2,110.00	1,055,000

TOKYO BASE	400	636.00	254,400
ジャパンミート	200	2,078.00	415,600
サツドラホールディングス	100	2,003.00	200,300
ダイユー・リックホールディングス	200	1,045.00	209,000
パロックジャパンリミテッド	300	1,018.00	305,400
クスリのアオキホールディングス	300	8,300.00	2,490,000
力の源ホールディングス	100	970.00	97,000
スシローグローバルホールディングス	500	6,130.00	3,065,000
LIXILピバ	300	1,780.00	534,000
メディカルシステムネットワーク	400	489.00	195,600
はるやまホールディングス	200	905.00	181,000
ノジマ	700	2,597.00	1,817,900
カップ・クリエイト	600	1,442.00	865,200
ライトオン	300	948.00	284,400
ジーンズメイト	100	610.00	61,000
良品計画	600	29,990.00	17,994,000
三城ホールディングス	500	486.00	243,000
アドヴァン	600	1,064.00	638,400
アルビス	200	2,995.00	599,000
コナカ	500	505.00	252,500
G-7ホールディングス	100	2,505.00	250,500
イオン北海道	400	798.00	319,200
コジマ	600	478.00	286,800
ヒマラヤ	100	976.00	97,600
コーナン商事	600	2,729.00	1,637,400
エコス	200	1,987.00	397,400
ワタミ	500	1,386.00	693,000
マルシェ	100	800.00	80,000
ドンキホーテホールディングス	2,700	6,960.00	18,792,000
西松屋チェーン	900	1,019.00	917,100
ゼンショーホールディングス	2,000	2,339.00	4,678,000
幸楽苑ホールディングス	300	1,950.00	585,000
ハークスレイ	100	1,062.00	106,200
サイゼリヤ	700	2,200.00	1,540,000
V Tホールディングス	1,400	484.00	677,600
魚力	100	1,438.00	143,800
ポブラ	100	589.00	58,900
フジ・コーポレーション	100	2,018.00	201,800
ユナイテッドアローズ	500	4,120.00	2,060,000
ハイデイ日高	600	2,271.00	1,362,600
京都きもの友禅	200	468.00	93,600
コロワイド	1,400	2,837.00	3,971,800

ピーシーデポコーポレーション	500	548.00	274,000
壱番屋	300	4,290.00	1,287,000
P L A N T	100	1,147.00	114,700
スギホールディングス	900	5,230.00	4,707,000
ヴィア・ホールディングス	500	722.00	361,000
スクロール	600	473.00	283,800
ヨンドシーホールディングス	500	2,368.00	1,184,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	1,200	14,300.00	17,160,000
木曽路	500	2,577.00	1,288,500
S R Sホールディングス	500	994.00	497,000
千趣会	700	310.00	217,000
タカキュー	300	194.00	58,200
ケーヨー	800	560.00	448,000
上新電機	500	2,698.00	1,349,000
日本瓦斯	800	3,575.00	2,860,000
ロイヤルホールディングス	700	2,636.00	1,845,200
いなげや	500	1,535.00	767,500
島忠	1,000	2,983.00	2,983,000
チヨダ	400	2,031.00	812,400
ライフコーポレーション	300	2,738.00	821,400
リンガーハット	500	2,327.00	1,163,500
M r M a x H D	600	513.00	307,800
テンアライド	400	429.00	171,600
A O K Iホールディングス	900	1,534.00	1,380,600
オークワ	600	1,118.00	670,800
コメリ	700	2,941.00	2,058,700
青山商事	800	3,545.00	2,836,000
しまむら	500	9,510.00	4,755,000
はせがわ	200	471.00	94,200
高島屋	3,300	1,828.00	6,032,400
松屋	900	1,085.00	976,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,200	1,830.00	4,026,000
近鉄百貨店	200	3,485.00	697,000
パルコ	400	1,225.00	490,000
丸井グループ	3,600	2,421.00	8,715,600
アクシアル リテイリング	400	3,875.00	1,550,000
井筒屋	200	255.00	51,000
イオン	16,300	2,663.50	43,415,050
イズミ	900	6,280.00	5,652,000
平和堂	900	2,891.00	2,601,900
フジ	500	2,108.00	1,054,000
ヤオコー	500	6,140.00	3,070,000

ゼビオホールディングス	500	1,534.00	767,000
ケーズホールディングス	4,400	1,137.00	5,002,800
Olympicグループ	200	746.00	149,200
日産東京販売ホールディングス	600	348.00	208,800
Genky DrugStores	200	3,500.00	700,000
総合メディカルホールディングス	400	2,581.00	1,032,400
ブックオフグループホールディングス	200	742.00	148,400
アインホールディングス	600	8,810.00	5,286,000
元気寿司	100	5,390.00	539,000
ヤマダ電機	12,900	535.00	6,901,500
アークランドサカモト	700	1,471.00	1,029,700
ニトリホールディングス	1,800	14,730.00	26,514,000
グルメ杵屋	300	1,213.00	363,900
愛眼	300	317.00	95,100
ケーユーホールディングス	200	924.00	184,800
吉野家ホールディングス	1,500	1,841.00	2,761,500
松屋フーズホールディングス	200	3,670.00	734,000
サガミホールディングス	600	1,361.00	816,600
関西スーパーマーケット	300	1,022.00	306,600
王将フードサービス	300	7,160.00	2,148,000
プレナス	500	1,799.00	899,500
ミニストップ	300	2,078.00	623,400
アークス	800	2,734.00	2,187,200
パローホールディングス	900	2,492.00	2,242,800
ベルク	200	5,890.00	1,178,000
大庄	200	1,703.00	340,600
ファーストリテイリング	600	60,450.00	36,270,000
サンドラッグ	1,600	4,100.00	6,560,000
サックスパーホールディングス	400	1,092.00	436,800
ヤマザワ	100	1,616.00	161,600
やまや	100	2,647.00	264,700
ベルーナ	1,000	1,135.00	1,135,000
島根銀行	100	1,180.00	118,000
じもとホールディングス	2,900	150.00	435,000
めぶきフィナンシャルグループ	22,100	343.00	7,580,300
東京きらぼしフィナンシャルグループ	600	1,935.00	1,161,000
九州フィナンシャルグループ	7,000	515.00	3,605,000
ゆうちょ銀行	12,000	1,316.00	15,792,000
富山第一銀行	1,000	435.00	435,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	27,100	525.00	14,227,500
西日本フィナンシャルホールディングス	2,700	1,143.00	3,086,100
関西みらいフィナンシャルグループ	2,000	894.00	1,788,000

三十三フィナンシャルグループ	400	1,986.00	794,400	
第四北越フィナンシャルグループ	700	4,105.00	2,873,500	
新生銀行	3,100	1,757.00	5,446,700	
あおぞら銀行	2,400	3,915.00	9,396,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	295,700	673.50	199,153,950	代用有価証券 21,400株
りそなホールディングス	46,600	607.20	28,295,520	
三井住友トラスト・ホールディングス	8,300	4,554.00	37,798,200	
三井住友フィナンシャルグループ	29,900	4,438.00	132,696,200	代用有価証券 3,500株
千葉銀行	15,100	735.00	11,098,500	
群馬銀行	8,500	546.00	4,641,000	
武蔵野銀行	600	3,095.00	1,857,000	
千葉興業銀行	1,200	456.00	547,200	
筑波銀行	1,800	254.00	457,200	
七十七銀行	1,300	2,398.00	3,117,400	
青森銀行	300	3,105.00	931,500	
秋田銀行	300	2,599.00	779,700	
山形銀行	500	2,366.00	1,183,000	
岩手銀行	300	4,330.00	1,299,000	
東邦銀行	3,800	411.00	1,561,800	
東北銀行	200	1,277.00	255,400	
みちのく銀行	300	1,776.00	532,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	3,400	2,858.00	9,717,200	
静岡銀行	10,700	1,030.00	11,021,000	
十六銀行	600	2,640.00	1,584,000	
スルガ銀行	4,300	510.00	2,193,000	
八十二銀行	7,700	497.00	3,826,900	
山梨中央銀行	500	1,740.00	870,000	
大垣共立銀行	700	2,569.00	1,798,300	
福井銀行	400	2,034.00	813,600	
北國銀行	500	4,190.00	2,095,000	
清水銀行	200	1,940.00	388,000	
富山銀行	100	3,740.00	374,000	
滋賀銀行	800	2,695.00	2,156,000	
南都銀行	500	2,595.00	1,297,500	
百五銀行	3,800	415.00	1,577,000	
京都銀行	1,500	5,270.00	7,905,000	
紀陽銀行	1,500	1,710.00	2,565,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	2,800	1,456.00	4,076,800	
広島銀行	6,300	715.00	4,504,500	
山陰合同銀行	2,500	910.00	2,275,000	
中国銀行	2,800	1,029.00	2,881,200	

鳥取銀行	100	1,581.00	158,100	
伊予銀行	5,600	683.00	3,824,800	
百十四銀行	500	2,984.00	1,492,000	
四国銀行	600	1,272.00	763,200	
阿波銀行	700	3,130.00	2,191,000	
大分銀行	300	3,690.00	1,107,000	
宮崎銀行	300	2,995.00	898,500	
佐賀銀行	300	2,141.00	642,300	
十八銀行	300	3,150.00	945,000	
沖縄銀行	400	3,905.00	1,562,000	
琉球銀行	1,000	1,314.00	1,314,000	
セブン銀行	14,300	366.00	5,233,800	
みずほフィナンシャルグループ	577,000	193.50	111,649,500	代用有価証券 71,500株
高知銀行	100	979.00	97,900	
山口フィナンシャルグループ	5,300	1,198.00	6,349,400	
長野銀行	100	1,688.00	168,800	
名古屋銀行	300	3,630.00	1,089,000	
北洋銀行	6,400	345.00	2,208,000	
愛知銀行	200	4,465.00	893,000	
中京銀行	200	2,277.00	455,400	
大光銀行	100	2,062.00	206,200	
愛媛銀行	600	1,183.00	709,800	
トマト銀行	200	1,337.00	267,400	
京葉銀行	1,900	813.00	1,544,700	
栃木銀行	2,200	328.00	721,600	
北日本銀行	100	2,508.00	250,800	
東和銀行	700	940.00	658,000	
福島銀行	400	610.00	244,000	
大東銀行	200	920.00	184,000	
トモニホールディングス	3,300	447.00	1,475,100	
フィデアホールディングス	4,100	146.00	598,600	
池田泉州ホールディングス	4,500	355.00	1,597,500	
F P G	1,400	1,270.00	1,778,000	
マーキュリアインベストメント	100	856.00	85,600	
S B Iホールディングス	5,100	3,190.00	16,269,000	
日本アジア投資	300	278.00	83,400	
ジャフコ	700	4,410.00	3,087,000	
大和証券グループ本社	34,000	638.80	21,719,200	
野村ホールディングス	77,900	524.40	40,850,760	
岡三証券グループ	3,600	566.00	2,037,600	
丸三証券	1,300	897.00	1,166,100	
東洋証券	1,500	225.00	337,500	

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	5,000	617.00	3,085,000
光世証券	100	1,076.00	107,600
水戸証券	1,300	333.00	432,900
いちよし証券	900	967.00	870,300
松井証券	2,100	1,211.00	2,543,100
だいこう証券ビジネス	200	517.00	103,400
マネックスグループ	3,900	510.00	1,989,000
カブドットコム証券	3,200	416.00	1,331,200
極東証券	600	1,345.00	807,000
岩井コスモホールディングス	400	1,452.00	580,800
藍澤証券	800	734.00	587,200
マネーパートナーズグループ	500	383.00	191,500
小林洋行	100	278.00	27,800
かんぽ生命保険	1,600	2,748.00	4,396,800
S O M P Oホールディングス	8,300	4,816.00	39,972,800
アニコム ホールディングス	300	3,675.00	1,102,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	11,100	3,441.00	38,195,100
ソニーフィナンシャルホールディングス	3,500	2,651.00	9,278,500
第一生命ホールディングス	24,000	2,182.50	52,380,000
東京海上ホールディングス	15,400	5,425.00	83,545,000
T & Dホールディングス	13,200	1,848.00	24,393,600
アドバンスクリエイト	100	2,023.00	202,300
全国保証	1,200	4,235.00	5,082,000
ジェイリース	100	633.00	63,300
イントラスト	100	446.00	44,600
日本モーゲージサービス	100	1,277.00	127,700
アルヒ	400	1,847.00	738,800
クレディセゾン	3,000	1,801.00	5,403,000
アクリーティブ	200	413.00	82,600
芙蓉総合リース	500	6,290.00	3,145,000
興銀リース	800	2,765.00	2,212,000
東京センチュリー	900	5,540.00	4,986,000
日本証券金融	1,900	655.00	1,244,500
アイフル	6,400	304.00	1,945,600
リコーリース	300	3,590.00	1,077,000
イオンフィナンシャルサービス	2,700	2,224.00	6,004,800
アコム	8,500	430.00	3,655,000
ジャックス	500	2,220.00	1,110,000
オリエントコーポレーション	11,400	174.00	1,983,600
日立キャピタル	1,000	2,894.00	2,894,000
アプラスフィナンシャル	2,000	102.00	204,000
オリックス	28,300	1,801.50	50,982,450

三菱UFJリース	9,500	580.00	5,510,000
九州リースサービス	200	709.00	141,800
日本取引所グループ	11,500	2,080.00	23,920,000
イー・ギャランティ	400	971.00	388,400
アサックス	200	578.00	115,600
NECキャピタルソリューション	200	1,744.00	348,800
いちご	5,400	395.00	2,133,000
日本駐車場開発	5,100	158.00	805,800
ヒューリック	8,900	1,031.00	9,175,900
三栄建築設計	200	1,622.00	324,400
スター・マイカ	200	1,645.00	329,000
野村不動産ホールディングス	2,800	2,195.00	6,146,000
三重交通グループホールディングス	900	543.00	488,700
サムティ	600	1,618.00	970,800
ディア・ライフ	500	551.00	275,500
コーセーアールイー	100	859.00	85,900
エー・ディー・ワークス	6,200	38.00	235,600
日本商業開発	300	1,726.00	517,800
プレサンスコーポレーション	700	1,372.00	960,400
ユニゾホールディングス	600	2,325.00	1,395,000
THEグローバル社	200	659.00	131,800
日本管理センター	300	1,245.00	373,500
サンセイランディック	100	1,161.00	116,100
エストラスト	100	782.00	78,200
フージャースホールディングス	1,000	678.00	678,000
オープンハウス	700	4,560.00	3,192,000
東急不動産ホールディングス	11,400	647.00	7,375,800
飯田グループホールディングス	3,500	2,054.00	7,189,000
イーランド	100	720.00	72,000
ムゲンエステート	300	697.00	209,100
ビーロッド	100	1,208.00	120,800
ファーストブラザーズ	100	1,312.00	131,200
ハウズドゥ	200	1,380.00	276,000
シーアールイー	100	997.00	99,700
ケイアイスター不動産	100	1,994.00	199,400
アグレ都市デザイン	100	714.00	71,400
グッドコムアセット	100	1,517.00	151,700
パーク24	2,500	2,958.00	7,395,000
バラカ	100	1,917.00	191,700
三井不動産	22,500	2,602.00	58,545,000
三菱地所	29,700	1,846.00	54,826,200
平和不動産	800	2,007.00	1,605,600

東京建物	4,600	1,239.00	5,699,400
ダイビル	1,300	1,136.00	1,476,800
京阪神ビルディング	800	895.00	716,000
住友不動産	9,500	4,028.00	38,266,000
大京	700	2,963.00	2,074,100
テーオーシー	1,000	887.00	887,000
東京楽天地	100	4,955.00	495,500
レオパレス21	5,400	504.00	2,721,600
スターツコーポレーション	600	2,420.00	1,452,000
フジ住宅	600	871.00	522,600
空港施設	500	587.00	293,500
明和地所	200	624.00	124,800
ゴールドクレスト	300	1,858.00	557,400
日本エスリード	200	1,510.00	302,000
日神不動産	600	525.00	315,000
日本エスコン	800	694.00	555,200
タカラレーベン	2,000	327.00	654,000
サンヨーハウジング名古屋	200	1,011.00	202,200
イオンモール	2,100	2,101.00	4,412,100
ファースト住建	200	1,209.00	241,800
カチタス	500	3,205.00	1,602,500
トーセイ	600	1,060.00	636,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	2,600	1,679.00	4,365,400
サンフロンティア不動産	600	1,165.00	699,000
エフ・ジェー・ネクスト	400	905.00	362,000
インテリックス	100	805.00	80,500
ランドビジネス	200	561.00	112,200
グランディハウス	400	436.00	174,400
日本空港ビルデング	1,400	4,415.00	6,181,000
日本工営	300	2,639.00	791,700
LIFULL	1,400	797.00	1,115,800
ジェイエイシーリクルートメント	300	2,114.00	634,200
日本M&Aセンター	3,100	2,826.00	8,760,600
メンバーズ	100	1,078.00	107,800
中広	100	791.00	79,100
タケエイ	400	837.00	334,800
E・Jホールディングス	100	1,264.00	126,400
トラスト・テック	200	3,495.00	699,000
コシダカホールディングス	1,100	1,355.00	1,490,500
アルトナー	100	825.00	82,500
パソナグループ	400	1,364.00	545,600
CDS	100	1,265.00	126,500

リンクアンドモチベーション	800	1,094.00	875,200
G C A	400	914.00	365,600
エス・エム・エス	1,500	2,031.00	3,046,500
パーソルホールディングス	4,100	2,193.00	8,991,300
リニカル	200	1,633.00	326,600
クックパッド	1,300	413.00	536,900
エスクリ	100	731.00	73,100
アイ・ケイ・ケイ	200	711.00	142,200
学情	200	1,454.00	290,800
スタジオアリス	200	2,547.00	509,400
シミックホールディングス	200	2,284.00	456,800
N J S	100	1,744.00	174,400
総合警備保障	1,600	4,825.00	7,720,000
カカコム	3,100	2,105.00	6,525,500
アイロムグループ	200	1,942.00	388,400
セントケア・ホールディング	200	612.00	122,400
サイネックス	100	751.00	75,100
ルネサンス	200	2,294.00	458,800
ディップ	700	2,484.00	1,738,800
オプトホールディング	300	2,441.00	732,300
新日本科学	600	518.00	310,800
ツクイ	1,000	981.00	981,000
キャリアデザインセンター	100	1,573.00	157,300
エムスリー	8,600	1,925.00	16,555,000
ツカダ・グローバルホールディング	300	615.00	184,500
アウトソーシング	2,200	1,507.00	3,315,400
ウェルネット	400	1,137.00	454,800
ワールドホールディングス	100	2,863.00	286,300
ディー・エヌ・エー	2,200	2,062.00	4,536,400
博報堂D Yホールディングス	5,700	1,870.00	10,659,000
ぐるなび	600	919.00	551,400
エスアールジータカミヤ	400	667.00	266,800
ジャパンベストレスキューシステム	300	1,051.00	315,300
ファンコミュニケーションズ	1,100	655.00	720,500
ライク	200	1,678.00	335,600
ビジネス・ブレークスルー	200	397.00	79,400
W D Bホールディングス	200	3,220.00	644,000
ティア	200	812.00	162,400
バリューコマース	300	1,610.00	483,000
インフォマート	2,200	1,462.00	3,216,400
J Pホールディングス	1,200	291.00	349,200
エコナックホールディングス	700	114.00	79,800

E P Sホールディングス	600	2,211.00	1,326,600
レッグス	100	1,132.00	113,200
プレステージ・インターナショナル	800	1,286.00	1,028,800
アミューズ	300	2,929.00	878,700
ドリームインキュベータ	100	1,906.00	190,600
クイック	300	1,566.00	469,800
T A C	200	257.00	51,400
ケネディクス	3,800	615.00	2,337,000
電通	5,000	5,410.00	27,050,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	200	1,696.00	339,200
ぴあ	100	5,270.00	527,000
イオンファンタジー	100	3,665.00	366,500
シーティーエス	500	746.00	373,000
ネクシィーズグループ	100	2,014.00	201,400
みらかホールディングス	1,100	2,947.00	3,241,700
アルプス技研	400	2,275.00	910,000
サニックス	700	238.00	166,600
ダイオーズ	100	1,325.00	132,500
日本空調サービス	500	768.00	384,000
オリエンタルランド	4,800	10,745.00	51,576,000
ダスキン	1,100	2,396.00	2,635,600
明光ネットワークジャパン	500	1,032.00	516,000
ファルコホールディングス	200	1,687.00	337,400
秀英予備校	100	486.00	48,600
田谷	100	648.00	64,800
ラウンドワン	1,300	1,322.00	1,718,600
リゾートトラスト	1,700	1,791.00	3,044,700
ビー・エム・エル	500	3,030.00	1,515,000
ワタベウェディング	100	749.00	74,900
りらいあコミュニケーションズ	800	1,055.00	844,000
リソー教育	700	1,278.00	894,600
早稲田アカデミー	100	2,320.00	232,000
ユー・エス・エス	5,000	2,023.00	10,115,000
東京個別指導学院	100	1,455.00	145,500
サイバーエージェント	2,500	5,140.00	12,850,000
楽天	19,100	883.00	16,865,300
クリーク・アンド・リバー社	200	996.00	199,200
テー・オー・ダブリュー	400	843.00	337,200
セントラルスポーツ	200	3,895.00	779,000
フルキャストホールディングス	400	2,116.00	846,400
エン・ジャパン	400	4,400.00	1,760,000
テクノプロ・ホールディングス	800	5,920.00	4,736,000

アトラ	100	514.00	51,400
インターワークス	100	821.00	82,100
アイ・アールジャパンホールディングス	100	1,311.00	131,100
K e e P e r 技研	100	1,097.00	109,700
ファーストロジック	100	852.00	85,200
三機サービス	100	1,936.00	193,600
G u n o s y	300	2,982.00	894,600
デザインワン・ジャパン	100	498.00	49,800
イー・ガーディアン	200	2,759.00	551,800
リブセンス	200	351.00	70,200
ジャパンマテリアル	1,100	1,364.00	1,500,400
ベクトル	500	2,046.00	1,023,000
ウチヤマホールディングス	200	482.00	96,400
ライクキッズネクスト	100	1,137.00	113,700
キャリアリンク	200	429.00	85,800
I B J	300	618.00	185,400
アサンテ	200	2,242.00	448,400
N・フィールド	300	1,740.00	522,000
バリューHR	100	2,188.00	218,800
M&Aキャピタルパートナーズ	100	4,750.00	475,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	200	1,333.00	266,600
E R Iホールディングス	100	952.00	95,200
アビスト	100	3,715.00	371,500
シグマクシス	200	1,198.00	239,600
ウィルグループ	300	1,118.00	335,400
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	600	477.00	286,200
日本ビューホテル	100	1,273.00	127,300
リクルートホールディングス	29,400	3,016.00	88,670,400
エラン	100	2,802.00	280,200
土木管理総合試験所	200	619.00	123,800
日本郵政	33,600	1,339.00	44,990,400
ベルシステム24ホールディングス	700	1,549.00	1,084,300
鎌倉新書	300	1,085.00	325,500
一蔵	100	721.00	72,100
L I T A L I C O	100	2,142.00	214,200
グローバルグループ	100	1,400.00	140,000
エボラブルアジア	100	2,241.00	224,100
アトラエ	100	2,141.00	214,100
ストライク	100	3,055.00	305,500
ソラスト	1,000	1,172.00	1,172,000
セラク	100	787.00	78,700
インソース	100	2,064.00	206,400

アイモバイル	100	718.00	71,800
キャリアインデックス	100	1,450.00	145,000
MS - J a p a n	200	1,790.00	358,000
船場	100	1,038.00	103,800
グレイステクノロジー	100	2,773.00	277,300
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	200	1,700.00	340,000
グリーンズ	100	1,462.00	146,200
日総工産	100	2,331.00	233,100
キュービーネットホールディングス	200	2,067.00	413,400
スプリックス	100	2,665.00	266,500
アドバンテッジリスクマネジメント	200	1,059.00	211,800
リログループ	2,200	2,707.00	5,955,400
東祥	300	3,780.00	1,134,000
エイチ・アイ・エス	700	3,540.00	2,478,000
ラックランド	100	2,916.00	291,600
共立メンテナンス	600	5,040.00	3,024,000
イチネンホールディングス	400	1,491.00	596,400
建設技術研究所	300	1,537.00	461,100
スペース	300	1,252.00	375,600
長大	200	878.00	175,600
燦ホールディングス	100	2,571.00	257,100
東京テアトル	200	1,345.00	269,000
タナベ経営	100	1,746.00	174,600
ナガワ	100	5,610.00	561,000
よみうりランド	100	4,190.00	419,000
東京都競馬	300	3,495.00	1,048,500
常磐興産	200	1,668.00	333,600
カナモト	600	3,875.00	2,325,000
東京ドーム	1,500	990.00	1,485,000
西尾レントオール	400	3,710.00	1,484,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	2,500	29.00	72,500
トランス・コスモス	500	2,507.00	1,253,500
乃村工藝社	1,000	2,567.00	2,567,000
藤田観光	200	3,015.00	603,000
KNT - CTホールディングス	200	1,257.00	251,400
日本管財	400	2,074.00	829,600
トーカイ	400	2,517.00	1,006,800
セコム	4,400	8,917.00	39,234,800
セントラル警備保障	200	5,050.00	1,010,000
丹青社	800	1,131.00	904,800
メイテック	500	5,040.00	2,520,000
応用地質	400	1,278.00	511,200

船井総研ホールディングス	900	2,379.00	2,141,100	
進学会ホールディングス	200	558.00	111,600	
オオバ	300	689.00	206,700	
いであ	100	1,067.00	106,700	
学究社	100	1,708.00	170,800	
ベネッセホールディングス	1,500	3,190.00	4,785,000	
イオンディライト	500	3,910.00	1,955,000	
ナック	300	1,120.00	336,000	
ニチイ学館	600	1,107.00	664,200	
ダイセキ	700	2,782.00	1,947,400	
ステップ	200	1,626.00	325,200	
合 計	4,942,000		10,077,500,940	

(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11月30日現在です。

【インデックスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	10,264,577,241円
負債総額	22,846,634円
純資産総額（ - ）	10,241,730,607円
発行済口数	14,614,132,905口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7008円

【バランスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	219,080,320円
負債総額	226,025円
純資産総額（ - ）	218,854,295円
発行済口数	230,945,039口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9476円

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	10,365,778,968円
負債総額	17,450,497円
純資産総額（ - ）	10,348,328,471円
発行済口数	6,198,874,820口
1口当たり純資産額（ / ）	1.669円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

該当事項はありません。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2018年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2018年11月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2018年11月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2018年11月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	806	175,127

株式投資信託	762	149,406
単位型	246	8,740
追加型	516	140,665
公社債投資信託	44	25,721
単位型	30	543
追加型	14	25,177

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59期事業年度(平成29年4月1日から平成30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60期中間会計期間(2018年4月1日から2018年9月30日まで)の中間財務諸表について、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58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	16,761	3	14,024
金銭の信託	3	152		-
有価証券		10		19
前払費用		506		551
未収入金		136		73
未収委託者報酬		10,757		15,873
未収収益	3	2,799	3	3,174
関係会社短期貸付金		962		1,128
立替金		1,240		2,776
繰延税金資産		865		1,014
その他	2,3	385	2,3	4,179
流動資産合計		34,577		42,814
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	93	1	68
器具備品	1	190	1	122
有形固定資産合計		283		191
無形固定資産				
ソフトウェア		138		99

無形固定資産合計	138	99
投資その他の資産		
投資有価証券	11,783	14,103
関係会社株式	23,203	25,769
関係会社長期貸付金	60	-
長期差入保証金	782	490
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	423	489
投資その他の資産合計	36,253	40,854
固定資産合計	36,674	41,144
資産合計	71,252	83,959

(単位：百万円)

	第58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金	3	589	3	3,804
未払金		4,043		5,874
未払収益分配金		7		7
未払償還金		91		91
未払手数料	3	3,499	3	5,124
その他未払金		445		651
未払費用	3	4,229	3	4,634
未払法人税等		1,808		2,185
未払消費税等	4	538	4	788
賞与引当金		2,077		2,286
役員賞与引当金		168		198
その他	3	62		41
流動負債合計		13,517		19,813
固定負債				
退職給付引当金		1,259		1,316
その他		-		318
固定負債合計		1,259		1,634
負債合計		14,777		21,448
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		34,015		39,959
利益剰余金合計		34,015		39,959
自己株式		672		786

株主資本合計	55,926	61,756
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	282	408
繰延ヘッジ損益	266	346
評価・換算差額等合計	548	754
純資産合計	56,475	62,511
負債純資産合計	71,252	83,959

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	64,680	70,609
その他営業収益	4,218	5,398
営業収益合計	68,898	76,008
営業費用		
支払手数料	28,675	30,448
広告宣伝費	969	973
公告費	2	2
調査費	17,322	18,132
調査費	841	862
委託調査費	16,456	17,241
図書費	24	28
委託計算費	498	520
営業雑経費	656	740
通信費	185	173
印刷費	276	348
協会費	66	68
諸会費	17	24
その他	111	125
営業費用計	48,124	50,817
一般管理費		
給料	8,243	9,096
役員報酬	360	507
役員賞与引当金繰入額	168	198
給料・手当	5,576	6,083
賞与	61	20
賞与引当金繰入額	2,077	2,286
交際費	99	99
寄付金	17	16
旅費交通費	412	455
租税公課	375	424
不動産賃借料	889	890
退職給付費用	390	355
退職金	20	24
固定資産減価償却費	192	152
福利費	959	974
諸経費	2,791	3,175
一般管理費計	14,394	15,664

営業利益	6,380	9,526
------	-------	-------

(単位：百万円)

	第58期		第59期	
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		19		26
受取配当金	1	1,644	1	1,120
有価証券償還益		-		1
時効成立分配金・償還金		22		1
為替差益		177		79
その他		36		41
営業外収益合計		1,899		1,272
営業外費用				
支払利息	1	223	1	223
有価証券償還損		7		-
デリバティブ費用	1	146	1	295
時効成立後支払分配金・償還金		2		0
支払源泉所得税		155		-
長期差入保証金償却額		-		212
その他		73		34
営業外費用合計		608		767
経常利益		7,670		10,030
特別利益				
投資有価証券売却益		174		199
特別利益合計		174		199
特別損失				
投資有価証券売却損		120		133
固定資産処分損		13		7
役員退職一時金		-		117
損害賠償損失		-		81
特別損失合計		134		340
税引前当期純利益		7,710		9,890
法人税、住民税及び事業税		2,137		3,217
過年度法人税等	2	115		-
法人税等調整額		104		307
法人税等合計		2,147		2,910
当期純利益		5,562		6,979

(3) 【株主資本等変動計算書】

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	資本剰余	その他利益剰余金	利益剰余金		

		準備金	金合計	繰越利益 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

第59期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						自己株式	株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				
		資本 準備金	資本剰余 金合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926	
当期変動額								
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036	
当期純利益				6,979	6,979		6,979	
自己株式の取得						113	113	
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）								
当期変動額合計				5,943	5,943	113	5,830	
当期末残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756	

	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

当期変動額				
剰余金の配当				1,036
当期純利益				6,979
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	125	80	206	206
当期変動額合計	125	80	206	6,036
当期末残高	408	346	754	62,511

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 5年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>

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

(貸借対照表関係)

第58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,222百万円</p> <p>器具備品 603百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,260百万円</p> <p>器具備品 612百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち3,030百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>
<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,243百万円</p> <p>金銭の信託 152百万円</p> <p>未収収益 619百万円</p> <p>その他 20百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>預り金 177百万円</p> <p>未払手数料 144百万円</p> <p>未払費用 251百万円</p> <p>その他 61百万円</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,189百万円</p> <p>未収収益 592百万円</p> <p>その他 345百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>預り金 419百万円</p> <p>未払手数料 376百万円</p> <p>未払費用 677百万円</p>
<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>	<p>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>	<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553百万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103百万円に対して保証を行っております。</p>

(損益計算書関係)

第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
---------------------------------------	---------------------------------------

1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。	1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。
受取配当金 1,550百万円	受取配当金 979百万円
デリバティブ収益 347百万円	デリバティブ収益 407百万円
支払利息 58百万円	支払利息 213百万円
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。	

(株主資本等変動計算書関係)

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

第59期（自 平成29年4月1日 至 平成30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）	1,119,100	182,600	-	1,301,700

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	1,689,600	-	194,700	1,494,900	-
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	-	204,600	2,686,200	-
平成28年度ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	786,000	3,618,000	-
平成28年度ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	532,000	3,877,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	1,783,300	11,785,000	-

(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 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)1,494,900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)2,686,200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)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30年5月31日取締役会	普通株式	利益剰余金	1,640	8.38	平成30年3月31日	平成30年6月23日

(リース取引関係)

第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
オペレーティング・リース取引	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		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	866百万円
1年超	1,787百万円	1年超	923百万円
合計	2,653百万円	合計	1,790百万円

(金融商品関係)

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 - 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 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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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す。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネ・の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成30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	14,024	14,024	-
(2) 未収委託者報酬	15,873	15,873	-
(3) 未収収益	3,174	3,174	-
(4) 関係会社短期貸付金	1,128	1,128	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,106	14,106	-
(6) 未払金	(5,874)	(5,874)	-
(7) 未払費用	(4,634)	(4,634)	-
(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	(14)	(14)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	336	336	-
デリバティブ取引計	321	321	-

(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うち8百万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。また、ヘッジ会計が適用されているものは貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

- 2 非上場株式等（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22,876百万円）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	14,024	-	-	-
未収委託者報酬	15,873	-	-	-
未収収益	3,174	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	616	1,743	545
合計	33,090	616	1,743	545

（有価証券関係）

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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	22,876
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	8,544	7,535	1,008
	小計	8,544	7,535	1,008
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	投資信託	5,561	5,982	420
	小計	5,561	5,982	420
合計		14,106	13,518	588

- (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	2,792	199	133
合計	2,792	199	133

(デリバティブ取引関係)

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)
原則的 処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資	2,993	-	11
	豪ドル	有価証券	77	-	2
	シンガポールドル		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。

第59期(平成30年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,422	-	14	14
	買建	-	-	-	-
合計		2,422	-	14	14

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資 有価証券			
	米ドル		4,447	-	196
	豪ドル		109	-	10
	シンガポールドル		1,783	-	65
	香港ドル		541	-	25
	人民元		2,156	-	32
	ユーロ		154	-	6
	合計		9,192	-	336

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30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 3,030	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,008
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,455	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,409
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,092	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,827

(退職給付関係)

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
退職給付債務の期末残高	1,190

(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

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

(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
確定給付制度に係る退職給付費用	177

(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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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	1,190
勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	66
退職給付の支払額	76
退職給付債務の期末残高	1,313

(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	1,313
未積立退職給付債務	1,313
未認識数理計算上の差異	2
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

退職給付引当金	1,316
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	0
確定給付制度に係る退職給付費用	132

(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、222百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

	平成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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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

	平成28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	31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	4,409,000株
付与日	平成29年4月27日	
権利確定条件	平成31年4月27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	
権利行使期間	平成31年4月27日から 平成39年4月30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	1,689,600	174,900
付与	0	0
失効	194,700	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,494,900	108,900
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	2,890,800	4,404,000
付与	0	0
失効	204,600	786,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,686,200	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

平成28年度ストックオプション(2)	
付与日	平成29年4月27日
権利確定前(株)	
期首	-
付与	4,409,000
失効	532,000
権利確定	0
権利未確定残	3,877,000
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

平成28年度ストックオプション(2)	
付与日	平成29年4月27日
権利行使価格(円)	553
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	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tockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,149百万円
- 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に調整される。)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58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円)	1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円)
	繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)
	賞与引当金 641		賞与引当金 700
	その他 224		その他 314
	小計 865		小計 1,014
	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 385		退職給付引当金 402
	固定資産減価償却費 119		固定資産減価償却費 111
	その他 63		その他 211
	小計 2,095		小計 2,253
	繰延税金資産小計 2,961		繰延税金資産小計 3,268
	評価性引当金 1,430		評価性引当金 1,430
	繰延税金資産合計 1,530		繰延税金資産合計 1,838
	繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)
	その他有価証券評価差額金 0		その他有価証券評価差額金 -
	小計 0		小計 -
	繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(固定)
	その他有価証券評価差額金 123		その他有価証券評価差額金 180
	繰延ヘッジ利益 117		繰延ヘッジ利益 152
	小計 241		小計 333
	繰延税金負債合計 242		繰延税金負債合計 333
	繰延税金資産の純額 1,288		繰延税金資産の純額 1,504
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 30.9% (調整)		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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
	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 5.3%		
	過年度法人税等 1.5%		
	海外子会社の留保利益の影響額等 0.2%		
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 27.9%		

(関連当事者情報)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)

子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	312,000 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付 (シンガポールドル貨建) (注1)	65 (SGD 800 千) (注2)	関係会社 短期貸付 金	385 (SGD 4,800千)
							貸付金利息 (シンガポールドル貨建) (注1)	13 (SGD 177 千)	未収収益	8 (SGD 105千)
							資金の貸付 (円貨建) (注3)	4,422 (注4)	関係会社 短期貸付 金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注3)	3	未収収益	3
							-	増資の 引受 (注5)	1,501 (SGD 20,000 千)	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542 (USD 千) (注6)	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入 (米ドル貨建) (注7)	5,549 (USD 50,000 千) (注8)	関係会社 短期借入 金	-
							借入金利息 (米ドル貨建) (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

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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	342,369 (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)	159 (SGD 2,000千)(注2)	関係会社短期貸付金	550 (SGD 6,800千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	13 (SGD 162千)	未収収益	8 (SGD 110千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	-	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建)(注3)	12	未収収益	3
						-	増資の引受(注4)	2,466 (SGD 30,369千)	-	-
子会社	日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社	日本	100 (百万円)	金融商品取引業者として登録を受けるための準備会社	直接 100.00	-	増資の引受(注5)	100	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額159百万円(SGD2,000千)の内訳は、貸付159百万円(SGD2,000千)であります。
- 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。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った30,369,000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。
- 日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社の行った2,000株の新株発行を、1株につき50千円で当社が引受けたものであります。

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29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	27,012百万円
負債合計	5,141百万円
純資産合計	21,871百万円

営業収益	15,830百万円
税引前当期純利益	5,266百万円
当期純利益	3,594百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第58期(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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	288円29銭	319円40銭
1株当たり当期純利益金額	28円38銭	35円64銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(百万円)	5,562	6,979
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)	5,562	6,979
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,009	195,794
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) 1,689,600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	平成21年度ストックオプション(1) 1,494,900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) 2,686,200株、平成28年度ストックオプション(1) 3,618,000株、平成28年度ストックオプション(2) 3,877,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	56,475	62,511
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)	56,475	62,511
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)	195,893	195,711

(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30年3月15日付の臨時株主総会及び平成30年3月20日開催の取締役会の決議に基づき、平成30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36名に付与いたしました。

新株予約権の数	4,422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 4,422,000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694円
新株予約権の行使期間	平成32年4月27日から平成40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60期中間会計期間 (2018年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	24,039
有価証券	19
未収委託者報酬	14,192
未収収益	920
関係会社短期貸付金	743
その他	2
流動資産合計	42,379

固定資産		
有形固定資産	1	160
無形固定資産		96
投資その他の資産		
投資有価証券		11,639
関係会社株式		25,769
長期差入保証金		463
繰延税金資産		1,450
長期前払費用		0
投資その他の資産合計		39,324
固定資産合計		39,580
資産合計		81,960

(単位：百万円)

第60期中間会計期間
(2018年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		6,326
未払費用		3,919
未払法人税等		1,899
未払消費税等	3	627
賞与引当金		1,452
役員賞与引当金		60
その他		548
流動負債合計		14,835

固定負債

退職給付引当金		1,355
その他		450
固定負債合計		1,805

負債合計

16,640

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		42,692
利益剰余金合計		42,692

自己株式

833

株主資本合計

64,442

評価・換算差額等

其他有価証券評価差額金		729
繰延ヘッジ損益		147

評価・換算差額等合計	876
純資産合計	65,319
負債純資産合計	81,960

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第60期中間会計期間
(自 2018年4月1日
至 2018年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		40,168
その他営業収益		1,608
営業収益合計		41,776
営業費用及び一般管理費	1	36,000
営業利益		5,776
営業外収益	2	842
営業外費用	3	441
経常利益		6,177
特別利益	4	98
特別損失	5	144
税引前中間純利益		6,131
法人税等	6	1,758
中間純利益		4,373

(3) 中間株主資本等変動計算書

第60期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		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	39,959	39,959	786	61,756
当中間期変動額							
剰余金の配当				1,640	1,640		1,640
中間純利益				4,373	4,373		4,373
自己株式の取得						47	47
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				2,733	2,733	47	2,685
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	42,692	42,692	833	64,442

	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	408	346	754	62,511
当中間期変動額				
剰余金の配当				1,640
中間純利益				4,373
自己株式の取得				47
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	321	198	122	122
当中間期変動額合計	321	198	122	2,808
当中間期末残高	729	147	876	65,319

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018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、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</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。 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>4 ヘッジ会計の方法</p>	<p>数理計算上の差異の費用処理方法</p> <p>数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
<p>5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<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>

(表示方法の変更)

<p>第60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)</p>
<p>(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用) 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

<p>第60期中間会計期間 (2018年9月30日)</p>
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額 1,899百万円</p> <p>2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 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。</p>

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516百万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36百万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60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	34百万円
無形固定資産	19百万円
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	824百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	181百万円
デリバティブ費用	165百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	98百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	144百万円
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60期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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）	1,301,700	64,000	-	1,365,700

(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	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,494,900	-	108,900	1,386,000	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	108,900	-	-	108,900	-

2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,686,200	-	287,100	2,399,100	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	-	3,618,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	-	-	3,877,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,422,000	-	4,422,000	-
合計		11,785,000	4,422,000	396,000	15,811,000	-

(注) 1 2017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 2009年度ストックオプション(1)及び2011年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

3 2009年度ストックオプション(1)1,386,000株、2009年度ストックオプション(2)108,900株及び2011年度ストックオプション(1)2,399,100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、2016年度ストックオプション(1)、2016年度ストックオプション(2)及び2017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
2018年5月31日 取締役会	普通株式	1,640	8.38	2018年3月31日	2018年6月23日

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018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	866百万円
1年超	7,125百万円
合計	7,991百万円

(金融商品関係)

第60期中間会計期間(2018年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

2018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・預金	24,039	24,039	-
(2) 未収委託者報酬	14,192	14,192	-
(3) 未収収益	920	920	-
(4) 関係会社短期貸付金	743	743	-

(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	11,642	11,642	-
(6) 未払金	(6,326)	(6,326)	-
(7) 未払費用	(3,919)	(3,919)	-
(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	(190)	(190)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	29	29	-
デリバティブ取引計	(160)	(160)	-

(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37百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、8百万円は、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 其他有価証券」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22,876百万円)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60期中間会計期間(2018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	22,876
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 其他有価証券

(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	投資信託	8,029	6,865	1,163

取得原価を超えるもの	小計	8,029	6,865	1,163
中間貸借対照表計上額が	投資信託	3,612	3,725	113
取得原価を超えないもの	小計	3,612	3,725	113
合計		11,642	10,591	1,050

(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60期中間会計期間(2018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	2,572	-	190	190
	合計	2,572	-	190	190

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		2,752	-	2
	豪ドル		62	-	1
	シンガポールドル		955	-	5
	ユーロ		79	-	0
	香港ドル		586	-	7
	人民元		2,020	-	28
	合計		6,456	-	29

(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60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018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	3,011百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,743百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	848百万円

(ストックオプション等関係)

第60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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60期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
1株当たり純資産額	333円86銭
1株当たり中間純利益金額	22円34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60期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
中間純利益(百万円)	4,373
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)	4,373
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,706
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	2009年度ストックオプション(1)1,386,000株、 2009年度ストックオプション(2)108,900株、 2011年度ストックオプション(1)2,399,100株、 2016年度ストックオプション(1)3,618,000株、 2016年度ストックオプション(2)3,877,000株、 2017年度ストックオプション(1)4,422,000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60期中間会計期間 (2018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)	65,319
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)	65,319
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)	195,647

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当

該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であつて、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2018年9月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額 : 10,000百万円(2018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(日本マスタートラスト信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2018年9月末現在)	事業の内容
アーク証券株式会社	2,619百万円	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。
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2018年 2月 7日	有価証券届出書
2018年 2月 7日	有価証券報告書
2018年 8月 7日	有価証券届出書の訂正届出書
2018年 8月 7日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

平成30年6月15日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

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30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12月19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ポートフォリオの平成29年11月8日から平成30年11月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスポートフォリオの平成30年11月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. 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12月19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」に掲げられているバランスポートフォリオの平成29年11月8日から平成30年11月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランスポートフォリオの平成30年11月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. 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

2018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2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の中間会計期間(2018年4月1日から2018年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的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2018年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2018年4月1日から2018年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注)1. 上記は、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。