

**【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4月26日提出
【計算期間】	第25期(自 2018年2月2日至 2019年2月4日)
【ファンド名】	財形株投(一般財形30) 財形株投(一般財形50) 財形株投(年金・住宅財形30)
【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 安倍 秀雄
【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

信託財産の成長と安定した収益の確保を目的として安定運用を行ないます。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株 式 債 券
	海外	不動産投信
追加型投信	内外	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 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	
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 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券)))		中近東 (中東)	
		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、「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. 「財形株投」は、財形貯蓄制度をご利用いただく勤労者の皆様専用のファンドです。

※財形貯蓄制度は、「勤労者財産形成促進法」に基づいて設けられた勤労者を対象とした制度で、勤労者財産形成貯蓄（財形貯蓄）、勤労者財産形成住宅貯蓄（財形住宅貯蓄）、勤労者財産形成年金貯蓄（財形年金貯蓄）があります。

# 2. 「財形株投」は、一般財形、年金財形、住宅財形の3つの財形貯蓄にご利用できるように、次の3本のファンドから構成されています。その中からご利用の皆様のニーズに応じて選択していただきます。

＜財形株投（一般財形 30）＞ 実質株式組入上限 30%

信託財産の純資産総額の30%を限度として株式に、残りの70%程度を公社債などに投資して信託財産の着実な成長をめざします。原則として、常時相当程度の組入比率を維持します。一般財形にご利用いただけます。

＜財形株投（一般財形 50）＞ 実質株式組入上限 50%

信託財産の純資産総額の50%を限度として株式に、残りの50%程度を公社債などに投資して信託財産の着実な成長をめざします。原則として、常時相当程度の組入比率を維持します。一般財形にご利用いただけます。

＜財形株投（年金・住宅財形 30）＞ 実質株式組入上限 30%

信託財産の純資産総額の30%を限度として株式に、残りの70%程度を公社債などに投資して信託財産の着実な成長をめざします。原則として、常時相当程度の組入比率を維持します。年金財形と住宅財形にご利用いただけます。

※ご選択によりそれぞれ「勤労者財産形成貯蓄契約」、「勤労者財産形成年金貯蓄契約」または「勤労者財産形成住宅貯蓄契約」を結んでいただきます。

一般財形 30 一般財形 50	勤労者財産形成貯蓄契約
年金・住宅財形 30	勤労者財産形成年金貯蓄契約 または 勤労者財産形成住宅貯蓄契約

○市況動向および資金動向などにより、上記のような運用ができない場合があります。

# 3. 信託財産の安定した成長をめざして安定運用を行ないます。

内外の公社債への投資により安定収益の確保を図るとともに、株式の運用部分については「バーラ日本株式モデル<sup>\*1</sup>」によりポートフォリオを構築してTOPIX（東証株価指数）<sup>\*2</sup>の動きに連動した投資効果をめざし、信託財産全体の安定した成長をめざします。

○市況動向および資金動向などにより、上記のような運用ができない場合があります。

## \*1 パーラ日本株式モデル

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

## \*2 TOPIX(東証株価指数)

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

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

## 4.

お買付けは無手数料で、給与天引きで行ないます。

給与からの天引きですので、毎月定期的に積立いただけます。

## 5.

財形貯蓄制度をご利用される方には、公的融資である財形持家融資を受けられる特典があります。

詳しくは、勤務先の事務局へお問い合わせください。

## 〈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

## 「財形株投(一般財形 30)」

## 「財形株投(年金・住宅財形 30)」

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

## 「財形株投(一般財形 50)」

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

## 分配方針

## 「財形株投(一般財形 30)」 「財形株投(一般財形 50)」 「財形株投(年金・住宅財形 30)」

- ・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

- ・各ファンド毎に、5,000億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】

1994年 2月 4日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

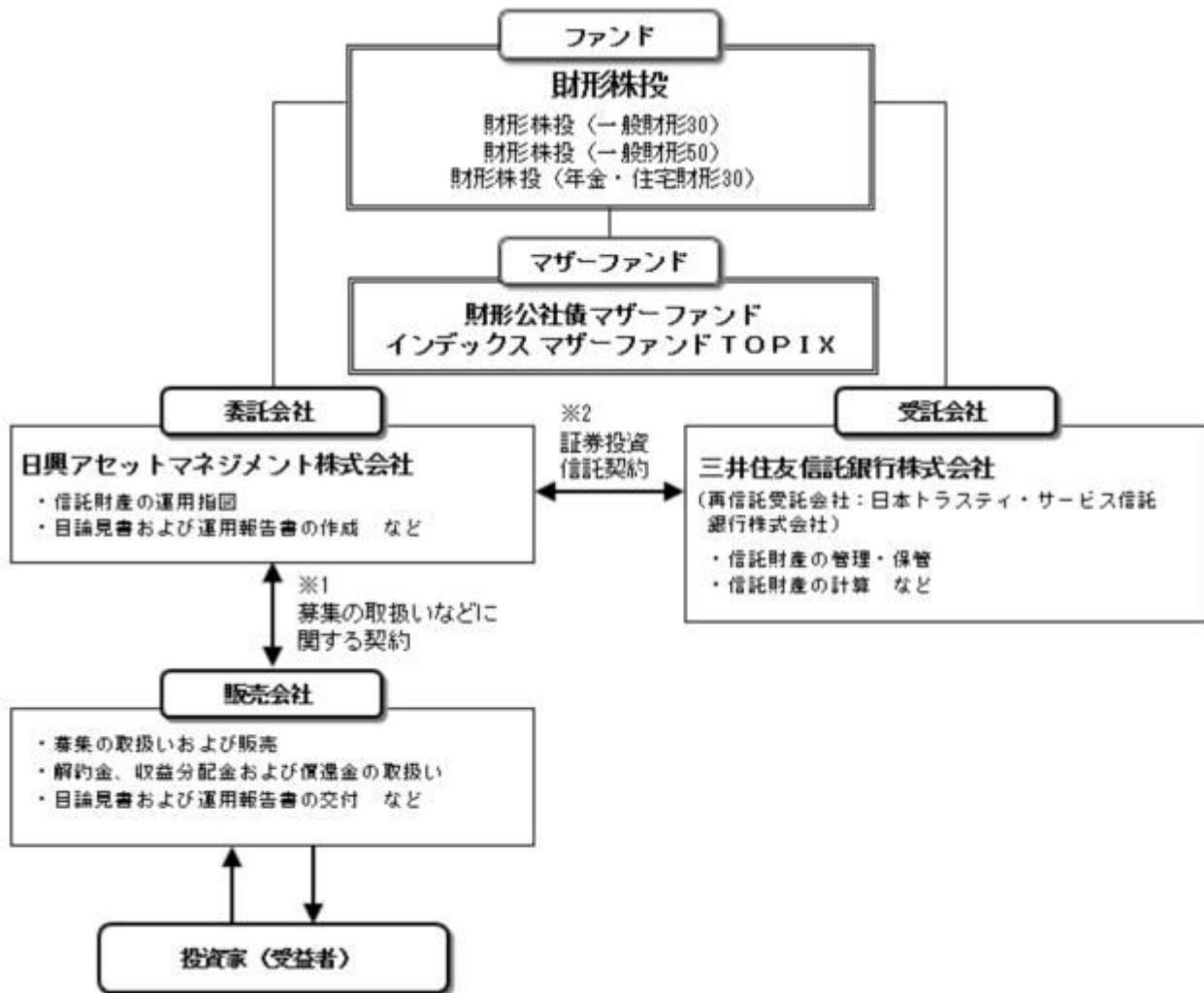


2018年3月20日

・投資対象ファンドに関する変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2019年2月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

## 3) 大株主の状況

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

## 2 【投資方針】

## （１）【投資方針】

< 財形株投（一般財形30） >

< 財形株投（年金・住宅財形30） >

・「財形公社債マザーファンド」受益証券および内外の公社債への投資により安定した収益の確保を図り、「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資により信託財産の成長をめざします。

・「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の30%とし、原則として常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

< 財形株投（一般財形50） >

・「財形公社債マザーファンド」受益証券および内外の公社債への投資により安定した収益の確保を図り、「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資により信託財産の成長をめざします。

・「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の50%とし、原則として常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

## （２）【投資対象】

< 財形株投（一般財形30） >

< 財形株投（一般財形50） >

< 財形株投（年金・住宅財形30） >

「財形公社債マザーファンド」受益証券および「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券ならびに内外の公社債およびわが国の株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第18条および第18条の2に定めるものに限り。）

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

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

1) 株券または新株引受権証券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7) コマーシャル・ペーパー

8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～8)の証券または証書の性質を有するもの

10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券

11) 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。）

12) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り。）

- 13) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 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。)
- 16) 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
- 17) 外国の者に対する権利で16)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) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 有価証券の貸付
- 5) 外国為替予約取引
- 6) 資金の借入

#### <インデックス マザーファンド T O P I X >

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形



5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの  
次の取引ができます。

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

#### < 財形公社債マザーファンド >

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（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
- 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条および第13条の2に定めるものに限りません。）
- 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) 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。）に限りません。）
- 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せん。）
- 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

## 投資対象とするマザーファンドの概要

## &lt; 財形公社債マザーファンド &gt;

運用の基本方針	
基本方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保を目的として安定運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保をはかります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 株式への投資は行ないません。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1994年2月4日設定）
決算日	毎年2月1日 （2月1日および2日のいずれかが休業日のときは、2月1日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち2月1日に最も近い日を決算日とします。）

## &lt; インデックス マザーファンド T O P I X &gt;

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X（東証株価指数） <sup>*</sup> 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"> <li>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、「バース日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行います。 東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行ないます。 資金の流入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。 株式の組入比率は、高位を保ちます。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</li> <li>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

### ファンドに係る費用

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

### その他

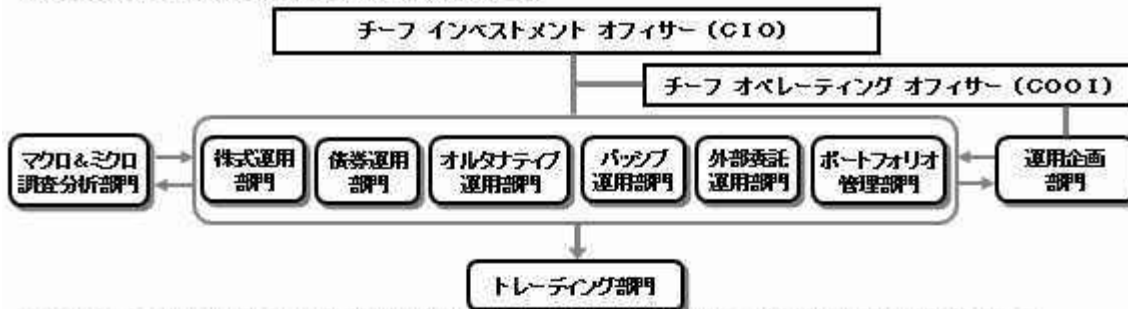
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
決算日	毎年2月12日（休業日の場合は翌営業日）

\* T O P I X（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。

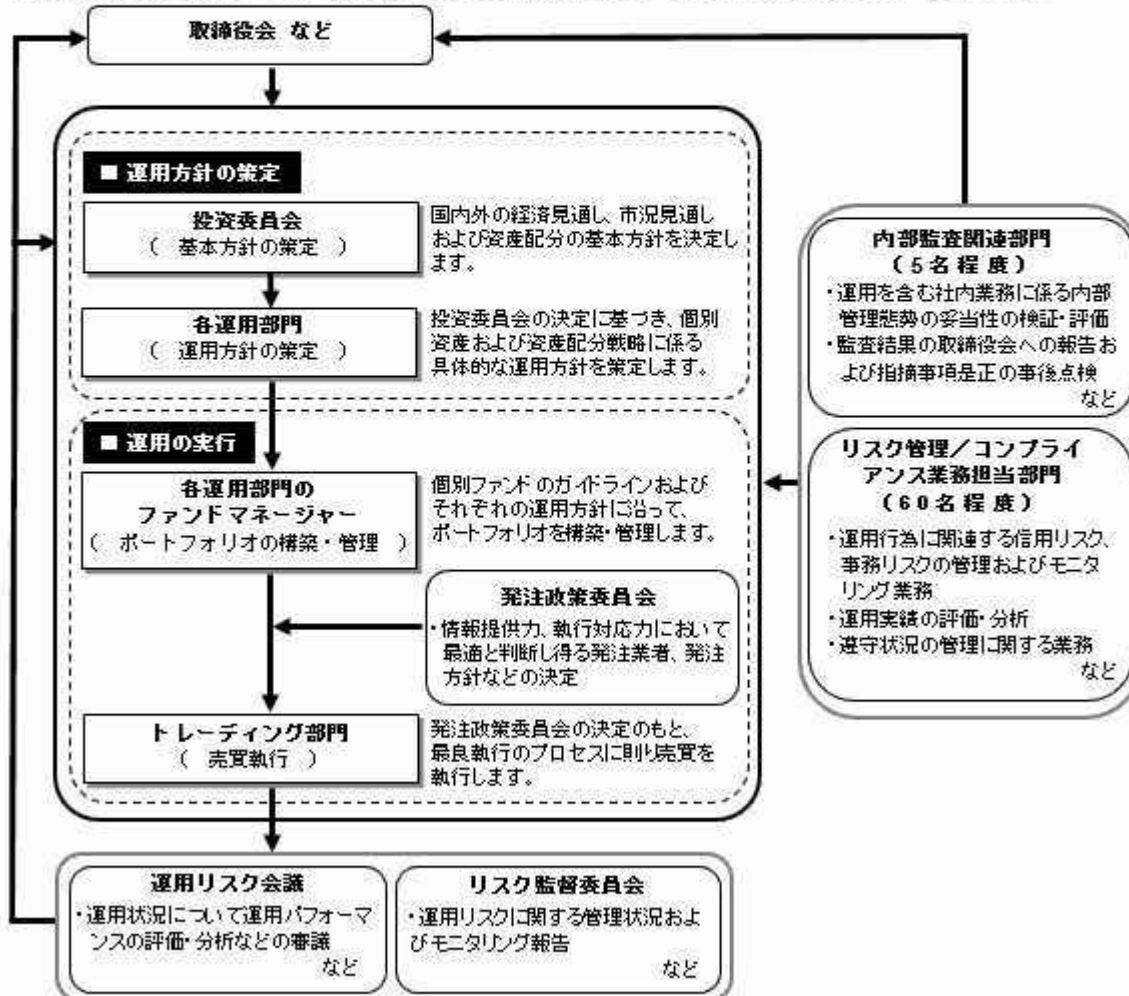
T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびT O P I Xの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

### （3）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



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

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

上記体制は2019年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲  
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針  
利子・配当等収益を中心に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わないこともあります。
- 3) 留保益の運用方針  
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用

を行いません。

収益分配金の支払い

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

< 財形株投（一般財形30） >

< 財形株投（一般財形50） >

< 財形株投（年金・住宅財形30） >

1 ) < 財形株投（一般財形30） >

< 財形株投（年金・住宅財形30） >

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

< 財形株投（一般財形50） >

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

2 ) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みません。以下同じ。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。

3 ) 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

4 ) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

5 ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

6 ) 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。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

7 ) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

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

イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

ロ) 株式分割により取得する株券

ハ) 有償増資により取得する株券

ニ) 売り出しにより取得する株券

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

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

9 ) 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て取り扱うものとします。

- 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。
- 10) 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。
- 11) 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係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。
- 12) 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。なお、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファン



ドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 14) 信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
  - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 16) 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。
- 17) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

#### <インデックス マザーファンド TOPIX>

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。

信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

- イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  - ロ) 株式分割により取得する株券
  - ハ) 有償増資により取得する株券
  - ニ) 売り出しにより取得する株券
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。))および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。))ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券指数等先物取引と類似の取

引を行なうことの指図をすることができます。

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

#### < 財形公社債マザーファンド >

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 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50%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て取り扱うものとします。
  - 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(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係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。
- 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を次に定める範囲内で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) 信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

## 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

## 3【投資リスク】

### （1）ファンドのリスク

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

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

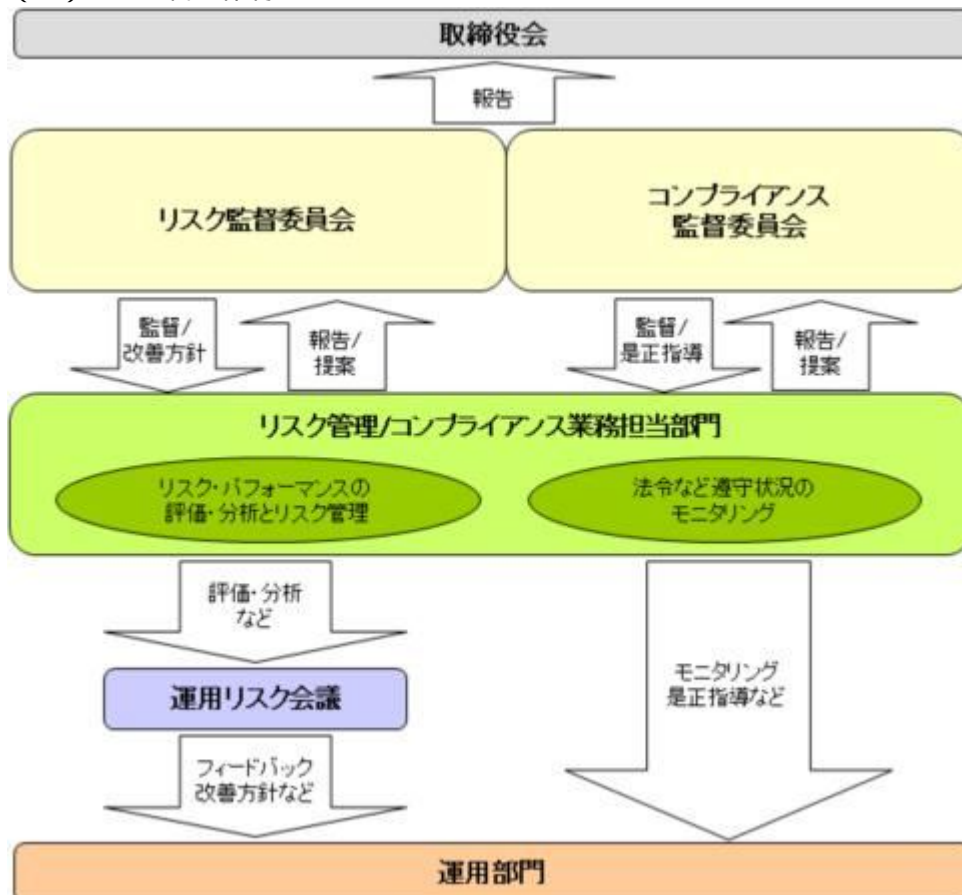
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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。

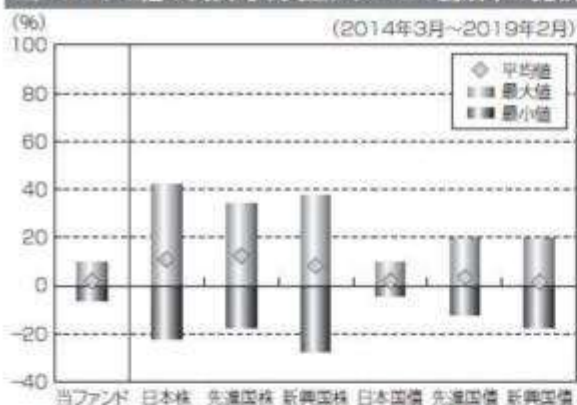
上記体制は2019年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。



## （参考情報）

### 「財形株投（一般財形 30）」

#### 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	2.0%	10.9%	12.3%	8.1%	2.0%	3.4%	1.5%
最大値	9.9%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	19.3%	19.3%
最小値	-6.4%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

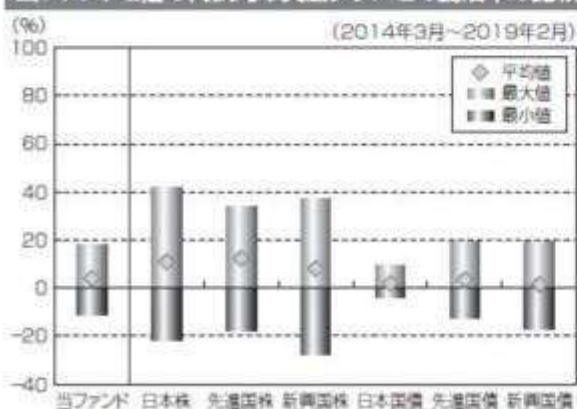
※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2014年3月から2019年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

### 「財形株投（一般財形 50）」

#### 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 (%)）

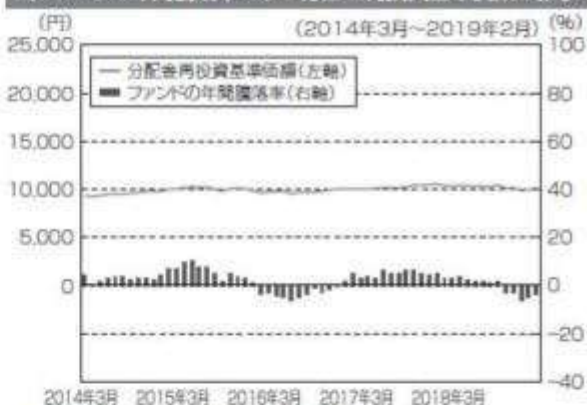
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	4.0%	10.9%	12.3%	8.1%	2.0%	3.4%	1.5%
最大値	17.7%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	19.3%	19.3%
最小値	-11.1%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※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2014年3月から2019年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

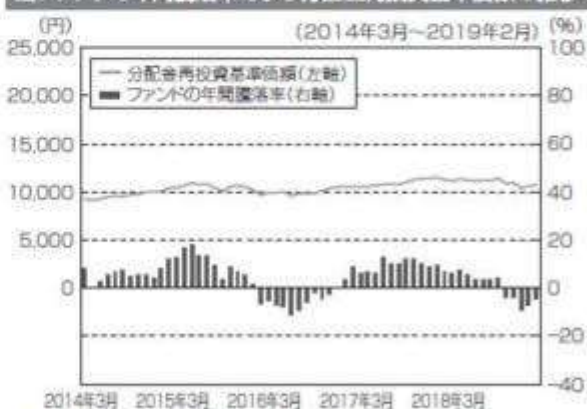
#### 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※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、2014年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

#### 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

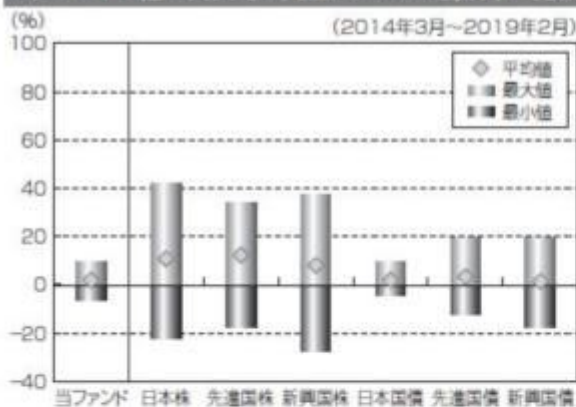


※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額は、2014年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

## 「財形株投(年金・住宅財形 30)」

## 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	2.0%	10.9%	12.3%	8.1%	2.0%	3.4%	1.5%
最大値	9.9%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	19.3%	19.3%
最小値	-6.4%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2014年3月から2019年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## &lt;各資産クラスの指数&gt;

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ファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

## 東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

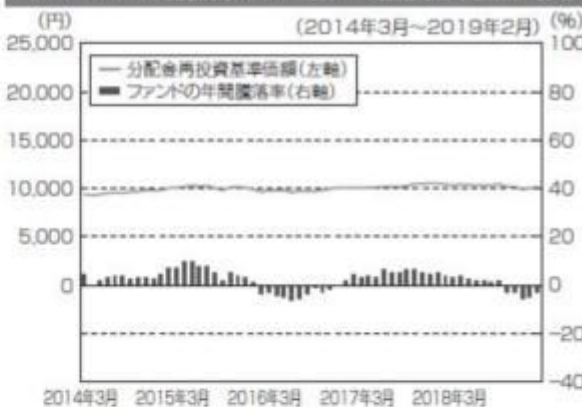
## MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

## NOMURA-BPI国債

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

## 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2014年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

**FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）**

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

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

**4【手数料等及び税金】****(1)【申込手数料】**

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1.5876%<sup>\*</sup>（税抜1.47%）以内の率を乗じて得た額とします。

\*消費税率が10%になった場合は、1.617%となります。

信託報酬の配分

当ファンドの信託報酬が税抜1.47%（有価証券届出書提出日現在）の場合の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.47%	0.37%	1.05%	0.05%

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、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

## (5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

<一般財形の場合>

収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、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(配当控除の適用はありません。)のいずれかを選択することもできます。

確定申告等により、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。

<年金・住宅財形の場合>

- ・個人が受け取る収益分配金ならびに償還金および解約金には税金はかかりません。
- ・ただし、積み立てられた元金および収益分配金の累計額が、限度額(年金財形・住宅財形の合計で550万円)を超える場合には、非課税の特典を失い課税されます。この場合、収益分配金、解約金および償還金に対する課税は、一般財形の場合と同様の取扱いとなります。

(目的外解約)

年金・住宅財形の場合、年金受取り、自宅用住宅取得など以外の目的で解約請求するときには、家屋が災害などによる被害を受けた場合など法令で定められた事由がある場合を除き、非課税の特典を失い課税されます。この場合、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収となります。また、過去5年間にさかのぼり、その間に支払われた普通分配金に対しても課税が行なわれます。詳しくは、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。

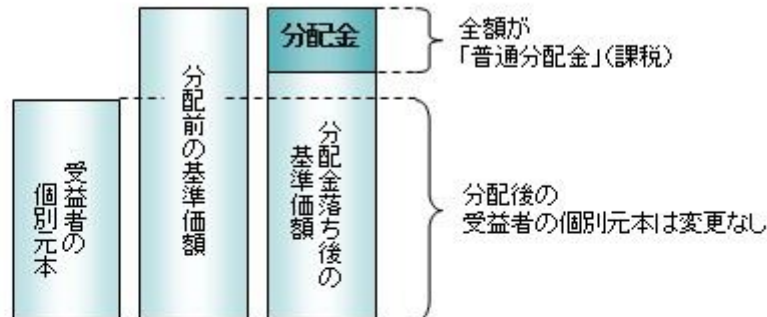


## 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

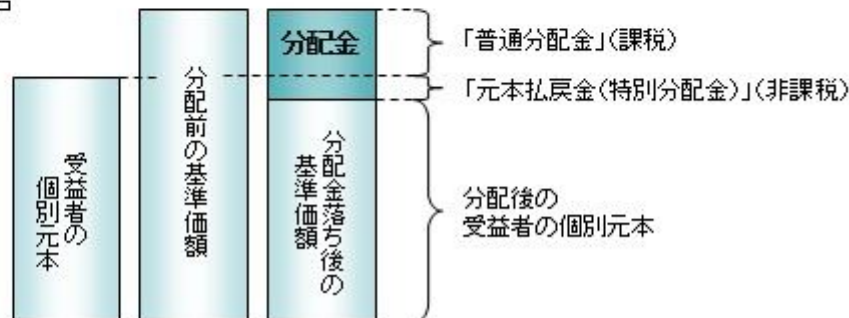
- イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

## イ) の場合



## ロ)、ハ) の場合



上記は2019年4月26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】

## 【財形株投（一般財形30）】

以下の運用状況は2019年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	93,449,389	97.50
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,396,235	2.50
合計(純資産総額)		95,845,624	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	財形公社債マザーファンド	51,234,140	1.2800	65,580,239	1.2800	65,579,699	68.42
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	14,087,697	1.9461	27,416,549	1.9783	27,869,690	29.08

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.50
合 計	97.50

## 【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16計算期間末 (2010年 2月 1日)	59	59	0.8666	0.8671
第17計算期間末 (2011年 2月 1日)	67	67	0.8673	0.8678
第18計算期間末 (2012年 2月 1日)	66	66	0.8241	0.8246
第19計算期間末 (2013年 2月 4日)	73	74	0.8775	0.8780
第20計算期間末 (2014年 2月 3日)	76	76	0.9341	0.9346
第21計算期間末 (2015年 2月 2日)	76	76	0.9788	0.9793
第22計算期間末 (2016年 2月 1日)	74	74	0.9931	0.9936
第23計算期間末 (2017年 2月 1日)	74	74	1.0043	1.0048
第24計算期間末 (2018年 2月 1日)	96	96	1.0543	1.0548
第25計算期間末 (2019年 2月 4日)	92	92	0.9991	0.9996
2018年 2月末日	95		1.0379	
3月末日	95		1.0301	
4月末日	96		1.0391	



5月末日	95	1.0333
6月末日	95	1.0295
7月末日	99	1.0317
8月末日	99	1.0268
9月末日	101	1.0419
10月末日	98	1.0116
11月末日	99	1.0147
12月末日	90	0.9846
2019年 1月末日	92	0.9972
2月末日	95	1.0031

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第16期	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	0.0005
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.0005
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	0.0005
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第16期	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	4.31
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.14
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	4.92
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	6.54
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.51
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.84
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.51
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.18
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	5.03
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	5.19

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第16期	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	9,372,352	2,808,991
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	9,715,295	447,586
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	9,162,753	6,529,292
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	7,267,816	3,692,263
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	5,310,568	7,297,643
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	7,771,084	11,906,050
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	10,650,522	13,562,169
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	9,441,348	10,877,640
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	19,263,657	1,878,188
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	12,037,575	10,950,460

## 【財形株投（一般財形50）】

以下の運用状況は2019年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	222,512,933	97.45
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		5,822,559	2.55
合計(純資産総額)		228,335,492	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 マザーファンド T O P I X	56,700,845	1.9451	110,288,814	1.9783	112,171,281	49.13
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	86,204,416	1.2799	110,341,651	1.2800	110,341,652	48.32

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.45

合 計	97.45
-----	-------

## 【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16計算期間末 (2010年 2月 1日)	137	138	0.7938	0.7943
第17計算期間末 (2011年 2月 1日)	147	147	0.7994	0.7999
第18計算期間末 (2012年 2月 1日)	147	147	0.7364	0.7369
第19計算期間末 (2013年 2月 4日)	180	180	0.8230	0.8235
第20計算期間末 (2014年 2月 3日)	169	169	0.9212	0.9217
第21計算期間末 (2015年 2月 2日)	183	183	0.9993	0.9998
第22計算期間末 (2016年 2月 1日)	187	187	1.0263	1.0268
第23計算期間末 (2017年 2月 1日)	207	207	1.0525	1.0530
第24計算期間末 (2018年 2月 1日)	241	241	1.1549	1.1554
第25計算期間末 (2019年 2月 4日)	225	225	1.0635	1.0640
2018年 2月末日	231		1.1248	
3月末日	230		1.1113	
4月末日	235		1.1291	
5月末日	233		1.1189	
6月末日	226		1.1131	
7月末日	231		1.1185	
8月末日	230		1.1111	
9月末日	237		1.1396	
10月末日	226		1.0849	
11月末日	227		1.0910	
12月末日	218		1.0362	
2019年 1月末日	225		1.0596	
2月末日	228		1.0713	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第16期	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	0.0005
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.0005
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	0.0005
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第16期	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	7.37
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.77
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	7.82
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	11.83
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	11.99
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	8.53
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	2.75
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	2.60
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	9.78
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	7.87

(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16期	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	34,010,951	5,408,319
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	28,271,781	18,105,413
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	27,582,276	11,103,657
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	26,104,473	7,608,165
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	18,531,876	53,414,352
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	17,501,615	18,329,958
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	17,040,435	17,577,441
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	18,988,051	4,886,387
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	48,663,216	36,200,357

第25期	2018年 2月 2日 ~ 2019年 2月 4日	21,221,642	18,123,775
------	---------------------------	------------	------------

### 【財形株投（年金・住宅財形30）】

以下の運用状況は2019年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	200,514,294	97.34
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		5,479,433	2.66
合計(純資産総額)		205,993,727	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	財形公社債マザーファンド	109,972,588	1.2799	140,764,910	1.2800	140,764,912	68.33
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	30,202,387	1.9452	58,749,684	1.9783	59,749,382	29.01

##### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.34
合計	97.34

##### 【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16計算期間末 (2010年 2月 1日)	148	148	0.8685	0.8690
第17計算期間末 (2011年 2月 1日)	159	159	0.8692	0.8697
第18計算期間末 (2012年 2月 1日)	167	167	0.8257	0.8262
第19計算期間末 (2013年 2月 4日)	178	178	0.8795	0.8800
第20計算期間末 (2014年 2月 3日)	188	188	0.9360	0.9365
第21計算期間末 (2015年 2月 2日)	190	190	0.9807	0.9812
第22計算期間末 (2016年 2月 1日)	178	178	0.9949	0.9954
第23計算期間末 (2017年 2月 1日)	182	182	1.0057	1.0062
第24計算期間末 (2018年 2月 1日)	210	210	1.0558	1.0563
第25計算期間末 (2019年 2月 4日)	203	203	1.0016	1.0021
2018年 2月末日	208		1.0394	
3月末日	203		1.0317	
4月末日	200		1.0407	
5月末日	200		1.0349	
6月末日	201		1.0311	
7月末日	207		1.0333	
8月末日	207		1.0283	
9月末日	212		1.0433	
10月末日	201		1.0140	
11月末日	203		1.0171	
12月末日	199		0.9872	
2019年 1月末日	203		0.9997	
2月末日	205		1.0057	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第16期	2009年 2月 3日 ~ 2010年 2月 1日	0.0005
第17期	2010年 2月 2日 ~ 2011年 2月 1日	0.0005
第18期	2011年 2月 2日 ~ 2012年 2月 1日	0.0005
第19期	2012年 2月 2日 ~ 2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日 ~ 2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日 ~ 2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日 ~ 2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日 ~ 2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日 ~ 2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日 ~ 2019年 2月 4日	0.0005

## 【収益率の推移】



期	期間	収益率（％）
第16期	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	4.36
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.14
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	4.95
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	6.58
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.48
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.83
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.50
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.14
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	5.03
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	5.09

(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16期	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	29,969,632	23,559,309
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	24,955,206	12,293,357
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	23,698,329	4,235,525
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	20,751,257	20,707,336
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	17,559,108	18,995,836
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	20,521,555	27,814,502
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	20,768,810	35,315,828
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	22,112,907	19,936,078
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	34,698,129	17,021,386
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	22,034,865	18,046,134

（参考）

#### 財形公社債マザーファンド

以下の運用状況は2019年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	196,618,780	62.07
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		120,162,983	37.93
合計（純資産総額）		316,781,763	100.00

## 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	国債証券	第384回利付国債 (2年)	85,000,000	100.22	85,194,542	100.22	85,194,542	0.100	2020/1/15	26.89
日本	国債証券	第344回利付国債 (10年)	40,000,000	101.88	40,755,200	101.91	40,764,000	0.100	2026/9/20	12.87
日本	国債証券	第350回利付国債 (10年)	40,000,000	101.51	40,605,200	101.59	40,637,600	0.100	2028/3/20	12.83
日本	国債証券	第377回利付国債 (2年)	30,000,000	100.07	30,022,638	100.07	30,022,638	0.100	2019/6/15	9.48

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	62.07
合計	62.07

## 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。

## インデックス マザーファンド TOPIX

以下の運用状況は2019年 2月28日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	39,386,278,060	99.60
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		157,864,763	0.40
合計(純資産総額)		39,544,142,823	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	160,600,000	0.41
----------	----	----	-------------	------

(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	190,200	6,605.00	1,256,271,000	6,697.00	1,273,769,400	3.22
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	70,000	10,260.00	718,200,000	10,280.00	719,600,000	1.82
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,158,800	580.90	673,146,920	576.70	668,279,960	1.69
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	149,400	4,390.88	655,997,500	4,469.00	667,668,600	1.69
日本	株式	ソニー	電気機器	114,500	4,854.00	555,783,000	5,341.00	611,544,500	1.55
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	114,600	4,600.00	527,160,000	4,801.00	550,194,600	1.39
日本	株式	キーエンス	電気機器	8,400	61,940.00	520,296,000	64,930.00	545,412,000	1.38
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	118,600	3,931.00	466,216,600	3,942.00	467,521,200	1.18
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	144,000	2,950.00	424,800,000	3,153.00	454,032,000	1.15
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,287,500	173.40	396,652,500	175.20	400,770,000	1.01
日本	株式	KDDI	情報・通信業	147,700	2,671.00	394,506,700	2,688.50	397,091,450	1.00
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	15,300	23,995.00	367,123,500	24,975.00	382,117,500	0.97
日本	株式	三菱商事	卸売業	118,000	3,120.00	368,160,000	3,139.00	370,402,000	0.94
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	116,800	2,959.00	345,611,200	3,114.00	363,715,200	0.92
日本	株式	花王	化学	41,400	8,038.00	332,773,200	8,424.00	348,753,600	0.88
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	70,400	4,843.00	340,947,200	4,894.00	344,537,600	0.87
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	61,000	5,349.00	326,289,000	5,426.00	330,986,000	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	30,300	10,165.00	307,999,500	10,660.00	322,998,000	0.82
日本	株式	任天堂	その他製品	10,500	29,235.00	306,967,500	30,440.00	319,620,000	0.81
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	120,400	2,563.00	308,585,200	2,591.50	312,016,600	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	17,900	17,730.00	317,367,000	17,325.00	310,117,500	0.78
日本	株式	ファナック	電気機器	16,200	18,835.00	305,127,000	18,440.00	298,728,000	0.76
日本	株式	キャノン	電気機器	91,900	3,170.00	291,323,000	3,201.00	294,171,900	0.74
日本	株式	ダイキン工業	機械	23,300	11,810.00	275,173,000	12,090.00	281,697,000	0.71
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	98,900	2,752.50	272,222,250	2,833.00	280,183,700	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	20,500	13,305.00	272,752,500	13,475.00	276,237,500	0.70
日本	株式	信越化学工業	化学	29,500	9,262.00	273,229,000	9,271.00	273,494,500	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	157,400	1,672.00	263,172,800	1,718.50	270,491,900	0.68
日本	株式	日立製作所	電気機器	76,900	3,424.00	263,305,600	3,335.00	256,461,500	0.65
日本	株式	資生堂	化学	33,900	6,912.00	234,316,800	7,348.00	249,097,200	0.63

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.12
		鉱業	0.29
		建設業	2.96
		食料品	4.24
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.29
		化学	7.26
		医薬品	5.94
		石油・石炭製品	0.63
		ゴム製品	0.80
		ガラス・土石製品	0.91
		鉄鋼	0.98
		非鉄金属	0.79
		金属製品	0.58
		機械	4.80
		電気機器	12.80
		輸送用機器	8.08
		精密機器	1.98
		その他製品	1.98
		電気・ガス業	1.96
		陸運業	4.82
		海運業	0.16
		空運業	0.61
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	8.35
		卸売業	4.95
		小売業	4.84
		銀行業	6.22
		証券、商品先物取引業	0.83
		保険業	2.23
その他金融業	1.14		
不動産業	2.37		
サービス業	4.86		
合 計			99.60

## 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 2019年03月	買建	10	日本円	161,655,400	160,600,000	0.41

(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。

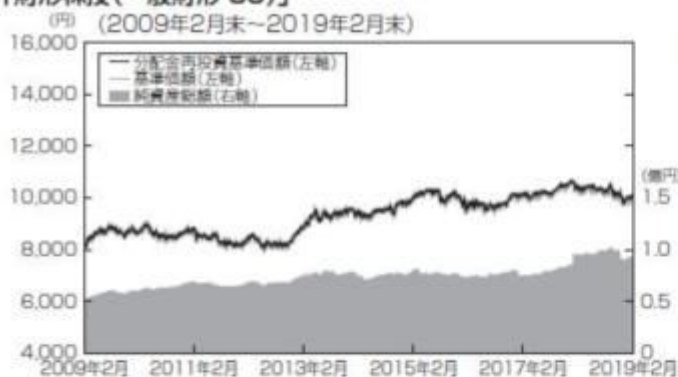
## 参考情報

## 運用実績

2019年2月28日現在

## 基準価額・純資産の推移

## 「財形株投（一般財形 30）」



基準価額……………10,031円  
純資産総額……………0.95億円

※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、2009年2月末の基準価額を起点として指数化しています。  
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

## 「財形株投（一般財形 50）」



基準価額……………10,713円  
純資産総額……………2.28億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
※分配金再投資基準価額は、2009年2月末の基準価額を起点として指数化しています。  
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

## 「財形株投（年金・住宅財形 30）」



基準価額……………10,057円  
純資産総額……………2.05億円

※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、2009年2月末の基準価額を起点として指数化しています。  
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

## 「財形株投（一般財形 30）」

2015年2月	2016年2月	2017年2月	2018年2月	2019年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	120円

## 「財形株投（一般財形 50）」

2015年2月	2016年2月	2017年2月	2018年2月	2019年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	120円

## 「財形株投（年金・住宅財形 30）」

2015年2月	2016年2月	2017年2月	2018年2月	2019年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	120円

## 主要な資産の状況

### <資産構成比率>

組入資産	財形株投 (一般財形 30)	財形株投 (一般財形 50)	財形株投 (年金・住宅財形 30)
財形公社債マザーファンド	68.42%	48.32%	68.33%
インデックス マザーファンド TOPIX	29.08%	49.13%	29.01%
現金その他	2.50%	2.55%	2.66%

※各ファンドの実質組入比率です。

### <組入上位銘柄>

#### 財形公社債マザーファンド

順位	銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1	第384回利付国債(2年)	国債証券	0.1%	2020年1月15日	26.89%
2	第344回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2026年9月20日	12.87%
3	第350回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2028年3月20日	12.83%

※財形公社債マザーファンドの対純資産総額比です。

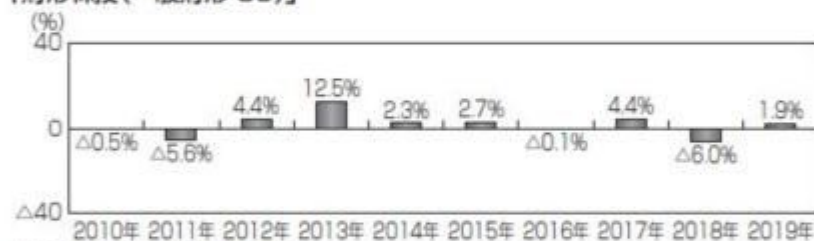
#### インデックス マザーファンド TOPIX

順位	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.22%
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.82%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.69%
4	武田薬品工業	医薬品	1.69%
5	ソニー	電気機器	1.55%

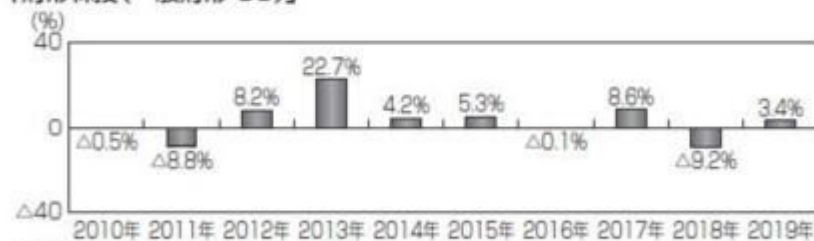
※インデックス マザーファンド TOPIXの対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移

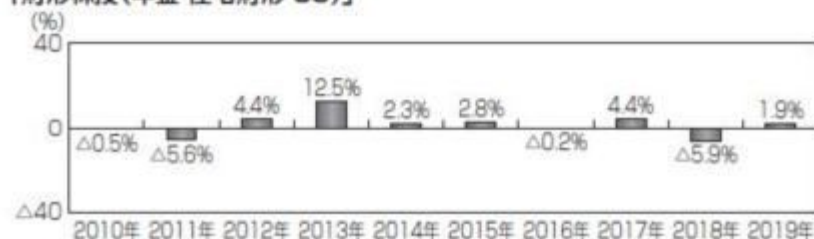
### 「財形株投(一般財形 30)」



### 「財形株投(一般財形 50)」



### 「財形株投(年金・住宅財形 30)」



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2019年は、2019年2月末までの騰落率です。

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

## 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。

- ・ご選択によりそれぞれ「勤労者財産形成貯蓄契約」、「勤労者財産形成年金貯蓄契約」または「勤労者財産形成住宅貯蓄契約」(以下「財形貯蓄に関する契約」といいます。)を結んでいただきます。

## (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。なお、「財形貯蓄に関する契約」で定める日(原則として、毎月10日、20日および月末を締切日とし、各締切日から起算して5営業日目)を取得申込受付日とします。

## (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、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

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

## 2【換金(解約)手続等】

### <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。

一般財形の場合( <一般財形30> <一般財形50> )

原則として、いつでも解約が可能です。

年金財形の場合( <年金・住宅財形30> )

- ・年金受取り以外の目的での解約は原則として認められません。
- ・年金受取り以外の目的で解約された場合には、財形年金口座そのものが全額解約されることになり、したがって、家屋が災害などによる被害を受けた場合など法令で定められた事由がある場合を除き、非課税の特典を失うこととなります。

住宅財形の場合( <年金・住宅財形30> )

- ・自宅用住宅の取得など以外の目的での解約は原則として認められません。
- ・自宅用住宅の取得など以外の目的で解約された場合には、住宅財形口座そのものが全額解約されることになり、したがって、家屋が災害などによる被害を受けた場合など法令で定められた事由がある場合を除き、非課税の特典を失うこととなります。

#### (2) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基つき、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/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (4) 手取額

一般財形の場合( <一般財形30> <一般財形50> )

1口当りの手取額は、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。



## 年金財形の場合（＜年金・住宅財形30＞）

## 1）年金受取りを目的として解約される場合

積み立てられた元金および収益分配金の累計額が限度額（住宅財形と年金財形の合計で550万円）以下である場合は、年金の受取りが終了するまで非課税扱いです。したがって、1口当たりの手取額は、解約価額となります。

## 2）年金受取り以外の目的で解約される場合

非課税の特典を失い（家屋が災害などによる被害を受けた場合など法令で定められた事由がある場合を除きます。）、財形年金口座そのものが全額解約されることとなります。1口につき、解約価額から、所得税および地方税が差し引かれるほか、過去5年間にさかのぼり、その間に支払われた普通分配金に対しても課税が行なわれます。（加入者の死亡・重度障害などの場合には、上記と取扱いが異なります。詳しくは、勤務先の事務局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。

## 住宅財形の場合（＜年金・住宅財形30＞）

## 1）自宅用住宅の取得などを目的として解約される場合

積み立てられた元金および収益分配金の累計額が限度額（住宅財形と年金財形の合計で550万円）以下である場合は、非課税扱いです。したがって、1口当たりの手取額は、解約価額となります。

## 2）自宅用住宅の取得など以外の目的で解約される場合

非課税の特典を失い（家屋が災害などによる被害を受けた場合など法令で定められた事由がある場合を除きます。）、住宅財形口座そのものが全額解約されることとなります。1口につき、解約価額から、所得税および地方税が差し引かれるほか、過去5年間にさかのぼり、その間に支払われた普通分配金に対しても課税が行なわれます。（加入者の死亡・重度障害などの場合には、上記と取扱いが異なります。詳しくは、勤務先の事務局にお問い合わせください。）

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

## （5）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、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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。

## &lt; 買取請求による換金 &gt;

## （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、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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。

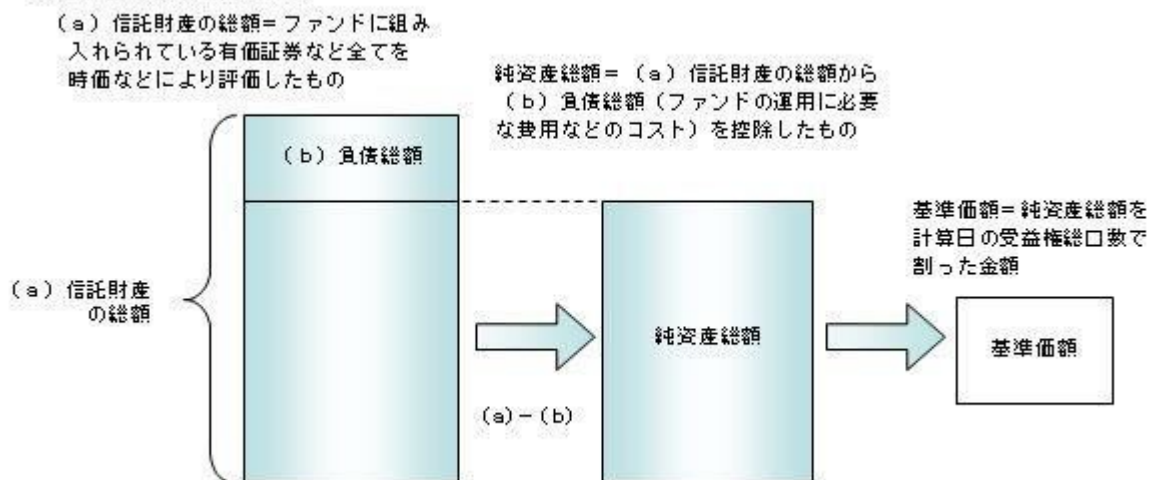
### 3【資産管理等の概要】

#### (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>

##### 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。

##### 国内公社債

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。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)
- ・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。)
- ・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/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

無期限とします(1994年2月4日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

## (4)【計算期間】

毎年2月2日から翌年2月1日(2月1日および2日のいずれかが休業日のときは、2月1日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち、2月1日に最も近い日)までとし、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) 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。)に異議を述べるすることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
  - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
  - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
  - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

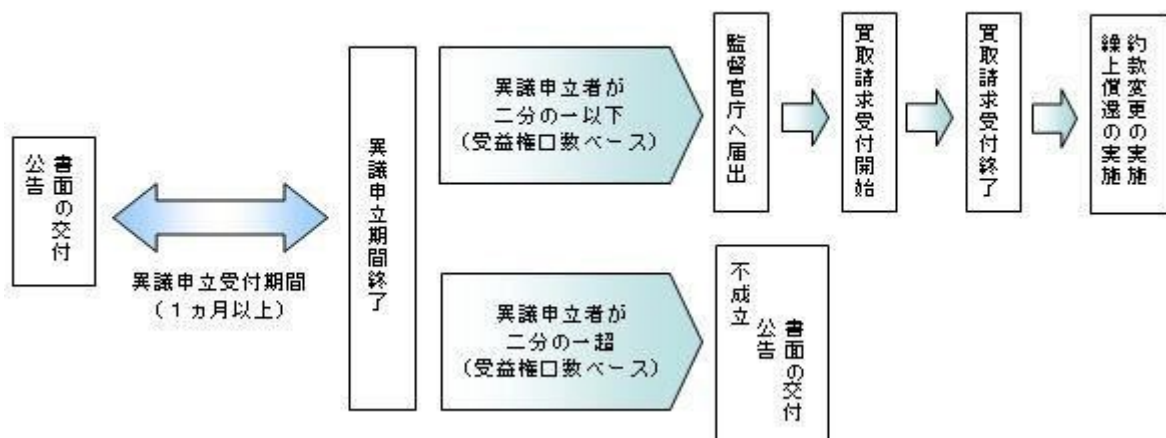
信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、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ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



#### 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/](http://www.nikkoam.com/)

#### 関係法人との契約について

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### (1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。

- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- < 財形株投（一般財形30） >
- < 財形株投（一般財形50） >
- < 財形株投（年金・住宅財形30） >

- (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25期計算期間（平成30年 2月 2日から平成31年 2月 4日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【財形株投（一般財形30）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第24期 平成30年 2月 1日現在	第25期 平成31年 2月 4日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,070,801	2,986,497
親投資信託受益証券	94,786,440	90,051,961
未収利息	-	1
流動資産合計	96,857,241	93,038,459
資産合計	96,857,241	93,038,459
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	45,598	46,142
未払受託者報酬	22,386	26,730
未払委託者報酬	637,630	760,848
未払利息	2	-
その他未払費用	2,139	2,064
流動負債合計	707,755	835,784
負債合計	707,755	835,784
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	91,197,638	92,284,753
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,951,848	82,078
（分配準備積立金）	8,828,712	7,813,081
元本等合計	96,149,486	92,202,675
純資産合計	96,149,486	92,202,675
負債純資産合計	96,857,241	93,038,459

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第24期		第25期	
	自	平成29年 2月 2日 至 平成30年 2月 1日	自	平成30年 2月 2日 至 平成31年 2月 4日
営業収益				
受取利息		4		4
有価証券売買等損益		5,194,042		3,481,151
営業収益合計		5,194,046		3,481,147
営業費用				
支払利息		748		1,167
受託者報酬		42,663		52,376
委託者報酬		1,215,300		1,490,905
その他費用		4,069		4,239
営業費用合計		1,262,780		1,548,687
営業利益又は営業損失（ ）		3,931,266		5,029,834
経常利益又は経常損失（ ）		3,931,266		5,029,834
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,931,266		5,029,834
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（ ）		21,963		346,849
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		317,677		4,951,848
剰余金増加額又は欠損金減少額		779,032		264,124
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		779,032		264,124
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,566		568,923
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,566		568,923
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		45,598		46,142
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,951,848		82,078



## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月2日から翌年2月1日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）もしくはその翌日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当計算期間は平成30年 2月 2日から平成31年 2月 4日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

		第24期 平成30年 2月 1日現在	第25期 平成31年 2月 4日現在
1.	期首元本額	73,812,169円	91,197,638円
	期中追加設定元本額	19,263,657円	12,037,575円
	期中一部解約元本額	1,878,188円	10,950,460円
2.	受益権の総数	91,197,638口	92,284,753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	- 円	82,078円

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第24期 自 平成29年 2月 2日 至 平成30年 2月 1日		第25期 自 平成30年 2月 2日 至 平成31年 2月 4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 3,909,499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 9,900,631円	C	信託約款に定める収益調整金 11,093,393円
D	信託約款に定める分配準備積立 金 4,964,811円	D	信託約款に定める分配準備積立 金 7,859,223円
E	分配対象収益 ( A+B+C+D ) 18,774,941円	E	分配対象収益 ( A+B+C+D ) 18,952,616円
F	分配対象収益(1万口当たり) 2,058円	F	分配対象収益(1万口当たり) 2,053円
G	分配金額 45,598円	G	分配金額 46,142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24期 自 平成29年 2月 2日 至 平成30年 2月 1日	第25期 自 平成30年 2月 2日 至 平成31年 2月 4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24期 平成30年 2月 1日現在	第25期 平成31年 2月 4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ぬ。	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24期（平成30年 2月 1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	4,823,297
合計	4,823,297

第25期（平成31年 2月 4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	1,438,208
合計	1,438,208

（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24期 平成30年 2月 1日現在		第25期 平成31年 2月 4日現在	
1口当たり純資産額	1.0543円	1口当たり純資産額	0.9991円
(1万口当たり純資産額)	(10,543円)	(1万口当たり純資産額)	(9,991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	財形公社債マザーファンド	48,773,754	62,430,405	
	インデックス マザーファンド TOPIX	14,199,854	27,621,556	
合計		62,973,608	90,051,961	

(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。

## 【財形株投（一般財形50）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第24期 平成30年 2月 1日現在	第25期 平成31年 2月 4日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	5,095,762	7,309,522
親投資信託受益証券	238,295,078	220,505,943
未収利息	-	2
流動資産合計	243,390,840	227,815,467
<b>資産合計</b>	243,390,840	227,815,467
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	104,633	106,182
未払受託者報酬	54,063	62,906
未払委託者報酬	1,537,294	1,788,067
未払利息	6	-
その他未払費用	5,238	4,972
流動負債合計	1,701,234	1,962,127
<b>負債合計</b>	1,701,234	1,962,127
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	209,267,303	212,365,170
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	32,422,303	13,488,170
（分配準備積立金）	42,886,932	39,200,153
元本等合計	241,689,606	225,853,340
<b>純資産合計</b>	241,689,606	225,853,340
<b>負債純資産合計</b>	243,390,840	227,815,467

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第24期		第25期	
	自	平成29年 2月 2日 至 平成30年 2月 1日	自	平成30年 2月 2日 至 平成31年 2月 4日
営業収益				
受取利息		15		17
有価証券売買等損益		21,481,871		15,086,345
営業収益合計		21,481,886		15,086,328
営業費用				
支払利息		2,176		2,966
受託者報酬		107,758		125,122
委託者報酬		3,063,980		3,556,685
その他費用		10,450		10,378
営業費用合計		3,184,364		3,695,151
営業利益又は営業損失( )		18,297,522		18,781,479
経常利益又は経常損失( )		18,297,522		18,781,479
当期純利益又は当期純損失( )		18,297,522		18,781,479
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( )		821,773		588,128
期首剰余金又は期首欠損金( )		10,331,386		32,422,303
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,638,910		2,146,539
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,638,910		2,146,539
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,919,109		2,781,139
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,919,109		2,781,139
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		104,633		106,182
期末剰余金又は期末欠損金( )		32,422,303		13,488,170

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月2日から翌年2月1日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）もしくはその翌日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当計算期間は平成30年 2月 2日から平成31年 2月 4日までとなっております。

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

		第24期 平成30年 2月 1日現在	第25期 平成31年 2月 4日現在
1.	期首元本額	196,804,444円	209,267,303円
	期中追加設定元本額	48,663,216円	21,221,642円
	期中一部解約元本額	36,200,357円	18,123,775円
2.	受益権の総数	209,267,303口	212,365,170口

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第24期 自 平成29年 2月 2日 至 平成30年 2月 1日		第25期 自 平成30年 2月 2日 至 平成31年 2月 4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	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	17,476,401円	0円
C	信託約款に定める収益調整金	41,054,852円	45,878,000円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	25,515,164円	39,306,335円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	84,046,417円	85,184,335円
F	分配対象収益(1万口当たり)	4,016円	4,011円
G	分配金額	104,633円	106,182円
H	分配金額(1万口当たり)	5円	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24期 自 平成29年 2月 2日 至 平成30年 2月 1日	第25期 自 平成30年 2月 2日 至 平成31年 2月 4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24期 平成30年 2月 1日現在	第25期 平成31年 2月 4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ぬ。	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24期（平成30年 2月 1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	19,811,505
合計	19,811,505

第25期（平成31年 2月 4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	6,190,463
合計	6,190,463

（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24期 平成30年 2月 1日現在		第25期 平成31年 2月 4日現在	
1口当たり純資産額	1.1549円	1口当たり純資産額	1.0635円
(1万口当たり純資産額)	(11,549円)	(1万口当たり純資産額)	(10,635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	財形公社債マザーファンド	84,015,101	107,539,329	
	インデックス マザーファンド TOPIX	58,074,550	112,966,614	
合計		142,089,651	220,505,943	

(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。

## 【財形株投(年金・住宅財形30)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第24期 平成30年 2月 1日現在	第25期 平成31年 2月 4日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,797,882	6,961,942
親投資信託受益証券	207,214,922	198,384,613
未収利息	-	2
流動資産合計	212,012,804	205,346,557
資産合計	212,012,804	205,346,557
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	99,626	101,621
未払受託者報酬	52,301	56,608
未払委託者報酬	1,487,182	1,609,412
未払利息	6	-
その他未払費用	5,072	4,467
流動負債合計	1,644,187	1,772,108
負債合計	1,644,187	1,772,108
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	199,253,276	203,242,007
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	11,115,341	332,442
(分配準備積立金)	21,325,608	19,368,927
元本等合計	210,368,617	203,574,449
純資産合計	210,368,617	203,574,449
負債純資産合計	212,012,804	205,346,557

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第24期		第25期	
	自	平成29年 2月 2日 至 平成30年 2月 1日	自	平成30年 2月 2日 至 平成31年 2月 4日
営業収益				
受取利息		13		15
有価証券売買等損益		12,243,101		7,582,899
営業収益合計		12,243,114		7,582,884
営業費用				
支払利息		1,937		2,652
受託者報酬		101,470		111,090
委託者報酬		2,885,522		3,158,361
その他費用		9,841		9,162
営業費用合計		2,998,770		3,281,265
営業利益又は営業損失（ ）		9,244,344		10,864,149
経常利益又は経常損失（ ）		9,244,344		10,864,149
当期純利益又は当期純損失（ ）		9,244,344		10,864,149
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（ ）		325,007		645,507
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,043,850		11,115,341
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,358,390		525,745
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,358,390		525,745
剰余金減少額又は欠損金増加額		106,610		988,381
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		106,610		988,381
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		99,626		101,621
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		11,115,341		332,442

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月2日から翌年2月1日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）もしくはその翌日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当計算期間は平成30年 2月 2日から平成31年 2月 4日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

		第24期 平成30年 2月 1日現在	第25期 平成31年 2月 4日現在
1.	期首元本額	181,576,533円	199,253,276円
	期中追加設定元本額	34,698,129円	22,034,865円
	期中一部解約元本額	17,021,386円	18,046,134円
2.	受益権の総数	199,253,276口	203,242,007口

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第24期 自 平成29年 2月 2日 至 平成30年 2月 1日		第25期 自 平成30年 2月 2日 至 平成31年 2月 4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	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	8,919,810円	0円
C	信託約款に定める収益調整金	27,692,848円	30,529,151円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	12,505,424円	19,470,548円
E	分配対象収益 ( A+B+C+D )	49,118,082円	49,999,699円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,465円	2,460円
G	分配金額	99,626円	101,621円
H	分配金額(1万口当たり)	5円	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24期 自 平成29年 2月 2日 至 平成30年 2月 1日	第25期 自 平成30年 2月 2日 至 平成31年 2月 4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24期 平成30年 2月 1日現在	第25期 平成31年 2月 4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ぬ。	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24期(平成30年 2月 1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	11,245,934
合計	11,245,934

第25期(平成31年 2月 4日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,883,617
合計	2,883,617

(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24期 平成30年 2月 1日現在		第25期 平成31年 2月 4日現在	
1口当たり純資産額	1.0558円	1口当たり純資産額	1.0016円
(1万口当たり純資産額)	(10,558円)	(1万口当たり純資産額)	(10,016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	財形公社債マザーファンド	107,714,606	137,874,695	
	インデックス マザーファンド T O P I X	31,107,299	60,509,918	
合計		138,821,905	198,384,613	

(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。

「財形株投（一般財形30）」「財形株投（一般財形50）」「財形株投（年金・住宅財形30）」は、「財形公社債マザーファンド」「インデックス マザーファンド T O P I X」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

(参考)

### 財形公社債マザーファンド

#### 貸借対照表

	(単位：円)	
	平成30年 2月 1日現在	平成31年 2月 4日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	138,108,385	111,272,131
国債証券	195,752,750	196,596,084
未収利息	23,539	38,726
前払費用	4,232	-
流動資産合計	333,888,906	307,906,941
資産合計	333,888,906	307,906,941
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払利息	176	-
流動負債合計	176	-
負債合計	176	-
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	261,514,898	240,503,461

	平成30年 2月 1日現在	平成31年 2月 4日現在
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	72,373,832	67,403,480
元本等合計	333,888,730	307,906,941
純資産合計	333,888,730	307,906,941
負債純資産合計	333,888,906	307,906,941

## 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>
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

		平成30年 2月 1日現在	平成31年 2月 4日現在
1.	期首	平成29年 2月 2日	平成30年 2月 2日
	期首元本額	216,864,894円	261,514,898円
	期首からの追加設定元本額	74,037,807円	29,706,668円
	期首からの一部解約元本額	29,387,803円	50,718,105円
	元本の内訳		
	財形株投（一般財形30）	52,465,507円	48,773,754円
	財形株投（一般財形50）	94,382,075円	84,015,101円
	財形株投（年金・住宅財形30）	114,667,316円	107,714,606円
	計	261,514,898円	240,503,461円
2.	受益権の総数	261,514,898口	240,503,461口

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29年 2月 2日 至 平成30年 2月 1日	自 平成30年 2月 2日 至 平成31年 2月 4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30年 2月 1日現在	平成31年 2月 4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)

(平成30年 2月 1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	7,100
合計	7,100

(平成31年 2月 4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	759,534
合計	759,534

(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。

(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30年 2月 1日現在		平成31年 2月 4日現在	
1口当たり純資産額	1.277円	1口当たり純資産額	1.280円
(1千口当たり純資産額)	(1,277円)	(1千口当たり純資産額)	(1,280円)

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377回利付国債(2年)	30,000,000	30,027,174	
	第384回利付国債(2年)	85,000,000	85,208,510	
	第344回利付国債(10年)	40,000,000	40,755,200	
	第350回利付国債(10年)	40,000,000	40,605,200	
	合計	195,000,000	196,596,084	

## 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 マザーファンド TOPIX

### 貸借対照表

(単位:円)

平成31年 2月 4日現在

資産の部		
流動資産		
コール・ローン		523,094,773
株式		39,111,235,220
派生商品評価勘定		2,444,600
未収配当金		63,372,197
未収利息		179
流動資産合計		39,700,146,969
資産合計		39,700,146,969
負債の部		
流動負債		
前受金		550,000
未払金		410,009,323
未払解約金		22,386,743
流動負債合計		432,946,066
負債合計		432,946,066
純資産の部		
元本等		
元本		20,186,693,914
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		19,080,506,989
元本等合計		39,267,200,903
純資産合計		39,267,200,903
負債純資産合計		39,700,146,969

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		平成31年 2月 4日現在
1.	期首	平成30年 2月 2日
	期首元本額	19,493,872,454円
	期首からの追加設定元本額	3,273,462,447円
	期首からの一部解約元本額	2,580,640,987円
	元本の内訳	
	インデックスファンドT S P	11,246,584,240円
	財形株投（一般財形30）	14,199,854円
	財形株投（一般財形50）	58,074,550円
	財形株投（年金・住宅財形30）	31,107,299円
	インデックスファンドT O P I X（日本株式）	8,223,160,610円
	T O P I Xインデックスファンド（個人型年金向け）	464,708,380円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016 - 08	34,137,961円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016 - 08	26,437,958円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016 - 11	17,168,805円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016 - 11	31,065,212円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017 - 02	16,142,481円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2017 - 02	23,906,564円
	計	20,186,693,914円
2.	受益権の総数	20,186,693,914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	264,357,000円
----	--------------

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成30年 2月 2日 至 平成31年 2月 4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。
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。
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。

金融商品の時価等に関する事項

	平成31年 2月 4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。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
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。

（有価証券に関する注記）

（平成31年 2月 4日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
----	-------------------

株式	3,243,318,401
合計	3,243,318,401

(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31年 2月 4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	155,600,000	-	158,050,000	2,450,000
	合計	155,600,000	-	158,050,000	2,450,000

(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31年 2月 4日現在	
1口当たり純資産額	1.9452円
(1万口当たり純資産額)	(19,452円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式



銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	2,799.00	2,239,200	
日本水産	23,600	673.00	15,882,800	
マルハニチロ	3,400	3,740.00	12,716,000	
カネコ種苗	700	1,285.00	899,500	
サカタのタネ	2,900	3,670.00	10,643,000	
ホクト	2,000	1,982.00	3,964,000	
ホクリヨウ	300	613.00	183,900	
住石ホールディングス	5,400	100.00	540,000	
日鉄鉱業	500	4,650.00	2,325,000	
三井松島ホールディングス	1,000	1,392.00	1,392,000	
国際石油開発帝石	94,300	1,046.00	98,637,800	
石油資源開発	3,400	2,107.00	7,163,800	
K & O エナジーグループ	1,100	1,440.00	1,584,000	
ヒノキヤグループ	500	2,018.00	1,009,000	
ショーボンドホールディングス	1,700	7,860.00	13,362,000	
ミライト・ホールディングス	6,600	1,617.00	10,672,200	
サンヨーホームズ	400	827.00	330,800	
日本アクア	600	414.00	248,400	
ファーストコーポレーション	700	769.00	538,300	
ベステラ	500	1,378.00	689,000	
T A T E R U	2,900	310.00	899,000	
スペースバリューホールディングス	2,800	926.00	2,592,800	
ダイセキ環境ソリューション	500	651.00	325,500	
第一カッター興業	300	1,836.00	550,800	
安藤・間	15,100	741.00	11,189,100	
東急建設	6,900	1,037.00	7,155,300	
コムシスホールディングス	8,300	2,871.00	23,829,300	
ミサワホーム	1,900	756.00	1,436,400	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,825.00	4,237,500	
東建コーポレーション	700	6,550.00	4,585,000	
ソネック	300	689.00	206,700	
ヤマウラ	1,000	960.00	960,000	

大成建設	19,300	5,200.00	100,360,000
大林組	58,200	1,053.00	61,284,600
清水建設	59,300	950.00	56,335,000
飛島建設	1,700	1,463.00	2,487,100
長谷工コーポレーション	24,300	1,218.00	29,597,400
松井建設	2,200	731.00	1,608,200
銭高組	300	5,070.00	1,521,000
鹿島建設	45,400	1,567.00	71,141,800
不動テトラ	1,400	1,691.00	2,367,400
大末建設	700	965.00	675,500
鉄建建設	1,200	2,675.00	3,210,000
西松建設	4,200	2,567.00	10,781,400
三井住友建設	14,100	701.00	9,884,100
大豊建設	1,300	3,500.00	4,550,000
前田建設工業	13,900	1,112.00	15,456,800
ナカノフドー建設	1,600	532.00	851,200
奥村組	3,200	3,545.00	11,344,000
東鉄工業	2,300	2,979.00	6,851,700
イチケン	400	1,997.00	798,800
富士ピー・エス	700	474.00	331,800
浅沼組	700	3,010.00	2,107,000
戸田建設	22,600	717.00	16,204,200
熊谷組	2,800	3,505.00	9,814,000
青木あすなる建設	1,000	1,000.00	1,000,000
北野建設	400	3,245.00	1,298,000
植木組	300	2,222.00	666,600
矢作建設工業	2,700	708.00	1,911,600
ピーエス三菱	2,100	588.00	1,234,800
日本ハウスホールディングス	3,800	441.00	1,675,800
大東建託	6,900	15,055.00	103,879,500
新日本建設	2,300	1,060.00	2,438,000
N I P P O	5,200	2,119.00	11,018,800
東亜道路工業	400	3,110.00	1,244,000
前田道路	6,100	2,184.00	13,322,400
日本道路	500	6,450.00	3,225,000
東亜建設工業	1,700	1,401.00	2,381,700

若築建設	1,000	1,505.00	1,505,000	
東洋建設	7,200	429.00	3,088,800	
五洋建設	23,100	641.00	14,807,100	
世紀東急工業	3,000	625.00	1,875,000	
福田組	600	4,210.00	2,526,000	
住友林業	13,700	1,437.00	19,686,900	
日本基礎技術	2,100	339.00	711,900	
巴コーポレーション	2,500	398.00	995,000	
大和ハウス工業	53,700	3,447.00	185,103,900	
ライト工業	3,800	1,357.00	5,156,600	
積水ハウス	59,400	1,626.50	96,614,100	
日特建設	1,800	637.00	1,146,600	
北陸電気工事	1,000	915.00	915,000	
ユアテック	3,200	916.00	2,931,200	
四電工	300	2,645.00	793,500	
中電工	2,500	2,314.00	5,785,000	
関電工	8,900	1,027.00	9,140,300	
きんでん	12,900	1,812.00	23,374,800	
東京エネシス	2,000	1,090.00	2,180,000	
トーエネック	600	3,235.00	1,941,000	
住友電設	1,400	1,840.00	2,576,000	
日本電設工業	3,300	2,337.00	7,712,100	
協和エクシオ	7,600	2,737.00	20,801,200	
新日本空調	1,600	1,727.00	2,763,200	
九電工	3,800	3,945.00	14,991,000	
三機工業	4,400	1,155.00	5,082,000	
日揮	16,700	1,641.00	27,404,700	
中外炉工業	600	2,060.00	1,236,000	
ヤマト	1,800	475.00	855,000	
太平電業	1,300	2,515.00	3,269,500	
高砂熱学工業	4,900	1,761.00	8,628,900	
三晃金属工業	300	2,927.00	878,100	
朝日工業社	400	3,010.00	1,204,000	
明星工業	3,600	691.00	2,487,600	
大気社	2,700	2,876.00	7,765,200	
ダイダン	1,300	2,431.00	3,160,300	

日比谷総合設備	1,900	1,754.00	3,332,600
東芝プラントシステム	4,200	2,033.00	8,538,600
東洋エンジニアリング	2,300	755.00	1,736,500
千代田化工建設	14,100	345.00	4,864,500
新興プランテック	3,500	1,251.00	4,378,500
日本製粉	5,800	1,833.00	10,631,400
日清製粉グループ本社	19,600	2,224.00	43,590,400
日東富士製粉	100	5,870.00	587,000
昭和産業	1,600	2,950.00	4,720,000
鳥越製粉	1,600	791.00	1,265,600
中部飼料	2,100	1,133.00	2,379,300
フィード・ワン	11,700	180.00	2,106,000
東洋精糖	300	1,050.00	315,000
日本甜菜製糖	1,000	1,754.00	1,754,000
三井製糖	1,400	2,916.00	4,082,400
塩水港精糖	2,100	226.00	474,600
日新製糖	800	2,052.00	1,641,600
森永製菓	4,400	4,520.00	19,888,000
中村屋	500	4,145.00	2,072,500
江崎グリコ	5,200	5,430.00	28,236,000
名糖産業	900	1,325.00	1,192,500
井村屋グループ	800	2,458.00	1,966,400
不二家	1,000	2,284.00	2,284,000
山崎製パン	14,200	2,166.00	30,757,200
第一屋製パン	400	993.00	397,200
モロゾフ	300	4,855.00	1,456,500
亀田製菓	1,100	5,050.00	5,555,000
寿スピリッツ	1,800	4,110.00	7,398,000
カルビー	7,900	3,465.00	27,373,500
森永乳業	3,500	3,105.00	10,867,500
六甲バター	1,300	2,039.00	2,650,700
ヤクルト本社	12,900	7,280.00	93,912,000
明治ホールディングス	12,300	8,480.00	104,304,000
雪印メグミルク	4,200	2,897.00	12,167,400
プリマハム	2,500	2,099.00	5,247,500
日本ハム	7,500	4,235.00	31,762,500

林兼産業	600	564.00	338,400
丸大食品	1,900	1,814.00	3,446,600
S Foods	1,600	3,970.00	6,352,000
伊藤ハム米久ホールディングス	11,100	680.00	7,548,000
サッポロホールディングス	6,400	2,507.00	16,044,800
アサヒグループホールディングス	36,400	4,604.00	167,585,600
キリンホールディングス	78,600	2,675.00	210,255,000
宝ホールディングス	13,000	1,244.00	16,172,000
オエノンホールディングス	5,100	360.00	1,836,000
養命酒製造	500	2,043.00	1,021,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	13,300	3,455.00	45,951,500
サントリー食品インターナショナル	11,600	4,935.00	57,246,000
ダイドーグループホールディングス	1,000	5,260.00	5,260,000
伊藤園	5,300	5,060.00	26,818,000
キーコーヒー	1,700	2,040.00	3,468,000
ユニカフェ	600	1,010.00	606,000
ジャパンフーズ	300	1,188.00	356,400
日清オイリオグループ	2,200	3,185.00	7,007,000
不二製油グループ本社	4,200	3,500.00	14,700,000
かどや製油	200	5,210.00	1,042,000
J - オイルミルズ	900	3,885.00	3,496,500
キッコーマン	11,500	5,500.00	63,250,000
味の素	38,400	1,673.50	64,262,400
キューピー	9,700	2,477.00	24,026,900
ハウス食品グループ本社	6,600	4,085.00	26,961,000
カゴメ	6,900	2,920.00	20,148,000
焼津水産化学工業	900	1,052.00	946,800
アリアケジャパン	1,600	6,760.00	10,816,000
ピエトロ	300	1,615.00	484,500
エバラ食品工業	400	2,161.00	864,400
ニチレイ	9,000	2,911.00	26,199,000
東洋水産	8,900	3,910.00	34,799,000
イトアンド	600	1,603.00	961,800
大冷	200	1,705.00	341,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	500	541.00	270,500

日清食品ホールディングス	7,400	7,040.00	52,096,000
永谷園ホールディングス	900	2,367.00	2,130,300
一正蒲鉾	700	996.00	697,200
フジッコ	1,900	2,241.00	4,257,900
ロック・フィールド	1,900	1,555.00	2,954,500
日本たばこ産業	100,300	2,754.00	276,226,200
ケンコーマヨネーズ	1,000	2,110.00	2,110,000
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,820.00	2,002,000
なとり	1,000	1,570.00	1,570,000
イフジ産業	300	646.00	193,800
ピックルスコーポレーション	400	1,954.00	781,600
北の達人コーポレーション	6,800	435.00	2,958,000
ユーグレナ	7,400	603.00	4,462,200
ミヨシ油脂	700	1,034.00	723,800
理研ビタミン	800	3,550.00	2,840,000
片倉工業	2,100	1,163.00	2,442,300
ゲンゼ	1,100	4,735.00	5,208,500
東洋紡	7,200	1,633.00	11,757,600
ユニチカ	5,000	519.00	2,595,000
富士紡ホールディングス	900	2,731.00	2,457,900
倉敷紡績	1,600	2,369.00	3,790,400
シキボウ	900	1,051.00	945,900
日本毛織	5,600	885.00	4,956,000
ダイトウボウ	3,600	84.00	302,400
トーア紡コーポレーション	700	444.00	310,800
ダイドーリミテッド	2,100	334.00	701,400
帝国繊維	1,900	2,278.00	4,328,200
帝人	13,800	1,844.00	25,447,200
東レ	131,500	802.10	105,476,150
サカイオーベックス	400	1,980.00	792,000
住江織物	500	2,427.00	1,213,500
日本フェルト	1,000	445.00	445,000
日東製網	200	1,282.00	256,400
アツギ	1,400	990.00	1,386,000
ダイニック	700	733.00	513,100
セーレン	4,200	1,857.00	7,799,400

ソトー	700	934.00	653,800	
東海染工	200	996.00	199,200	
小松マテーレ	2,800	762.00	2,133,600	
ワコールホールディングス	4,900	2,801.00	13,724,900	
ホギメディカル	2,100	3,725.00	7,822,500	
レナウン	5,000	100.00	500,000	
クラウドシアホールディングス	500	456.00	228,000	
T S Iホールディングス	6,300	728.00	4,586,400	
マツオカコーポレーション	500	2,743.00	1,371,500	
ワールド	1,700	1,650.00	2,805,000	
三陽商会	1,000	1,804.00	1,804,000	
ナイガイ	600	521.00	312,600	
オンワードホールディングス	10,200	642.00	6,548,400	
ルックホールディングス	600	1,127.00	676,200	
キムラタン	9,100	24.00	218,400	
ゴールドウイン	1,500	10,920.00	16,380,000	
デサント	4,100	2,605.00	10,680,500	
キング	900	490.00	441,000	
ヤマトインターナショナル	1,200	411.00	493,200	
特種東海製紙	1,100	3,915.00	4,306,500	
王子ホールディングス	76,400	630.00	48,132,000	
日本製紙	8,200	2,140.00	17,548,000	
三菱製紙	2,800	536.00	1,500,800	
北越コーポレーション	11,300	607.00	6,859,100	
中越パルプ工業	700	1,325.00	927,500	
巴川製紙所	600	1,084.00	650,400	
大王製紙	8,300	1,414.00	11,736,200	
阿波製紙	500	483.00	241,500	
レンゴー	17,500	956.00	16,730,000	
トーモク	1,100	1,596.00	1,755,600	
ザ・パック	1,300	2,917.00	3,792,100	
クラレ	28,600	1,686.00	48,219,600	
旭化成	120,600	1,206.50	145,503,900	
共和レザー	1,100	762.00	838,200	
昭和電工	11,300	3,750.00	42,375,000	
住友化学	133,400	559.00	74,570,600	

住友精化	800	4,315.00	3,452,000	
日産化学	10,400	5,720.00	59,488,000	
ラサ工業	600	1,396.00	837,600	
クレハ	1,600	6,800.00	10,880,000	
多木化学	500	5,480.00	2,740,000	
テイカ	1,400	1,881.00	2,633,400	
石原産業	3,300	1,106.00	3,649,800	
片倉コープアグリ	500	1,166.00	583,000	
日東エフシー	1,100	744.00	818,400	
日本曹達	2,700	2,772.00	7,484,400	
東ソー	26,200	1,591.00	41,684,200	
トクヤマ	4,900	2,645.00	12,960,500	
セントラル硝子	3,700	2,523.00	9,335,100	
東亜合成	10,600	1,274.00	13,504,400	
大阪ソーダ	1,800	2,512.00	4,521,600	
関東電化工業	4,000	908.00	3,632,000	
デンカ	6,700	3,455.00	23,148,500	
信越化学工業	29,900	9,202.00	275,139,800	
日本カーバイド工業	600	1,692.00	1,015,200	
堺化学工業	1,100	2,331.00	2,564,100	
第一稀元素化学工業	1,400	908.00	1,271,200	
エア・ウォーター	13,900	1,851.00	25,728,900	
大陽日酸	14,000	1,745.00	24,430,000	
日本化学工業	600	2,540.00	1,524,000	
東邦アセチレン	300	1,359.00	407,700	
日本パーカライジング	9,300	1,311.00	12,192,300	
高压ガス工業	2,700	768.00	2,073,600	
四国化成工業	2,800	1,276.00	3,572,800	
戸田工業	400	2,280.00	912,000	
ステラ ケミファ	1,000	2,926.00	2,926,000	
保土谷化学工業	600	2,814.00	1,688,400	
日本触媒	2,900	7,230.00	20,967,000	
大日精化工業	1,400	2,951.00	4,131,400	
カネカ	4,500	4,275.00	19,237,500	
三菱瓦斯化学	17,400	1,731.00	30,119,400	
三井化学	15,400	2,719.00	41,872,600	



J S R	17,000	1,798.00	30,566,000	
東京応化工業	2,900	3,185.00	9,236,500	
大阪有機化学工業	1,600	1,175.00	1,880,000	
三菱ケミカルホールディングス	113,300	933.50	105,765,550	
K Hネオケム	2,600	2,550.00	6,630,000	
ダイセル	26,300	1,095.00	28,798,500	
住友ベークライト	2,900	4,080.00	11,832,000	
積水化学工業	37,000	1,709.00	63,233,000	
日本ゼオン	15,300	1,140.00	17,442,000	
アイカ工業	5,100	3,895.00	19,864,500	
宇部興産	8,600	2,449.00	21,061,400	
積水樹脂	2,800	2,038.00	5,706,400	
タキロンシーアイ	3,600	615.00	2,214,000	
旭有機材	1,200	1,705.00	2,046,000	
日立化成	7,800	1,946.00	15,178,800	
ニチバン	900	2,077.00	1,869,300	
リケンテクノス	4,600	459.00	2,111,400	
大倉工業	900	1,804.00	1,623,600	
積水化成成品工業	2,500	949.00	2,372,500	
群栄化学工業	400	2,591.00	1,036,400	
タイガースポリマー	900	591.00	531,900	
ミライアル	500	1,122.00	561,000	
ダイキアクシス	600	922.00	553,200	
ダイキョーニシカワ	3,600	1,150.00	4,140,000	
竹本容器	600	1,402.00	841,200	
森六ホールディングス	900	2,585.00	2,326,500	
日本化薬	10,800	1,300.00	14,040,000	
カーリットホールディングス	1,800	854.00	1,537,200	
日本精化	1,400	1,122.00	1,570,800	
扶桑化学工業	1,700	2,155.00	3,663,500	
トリケミカル研究所	400	4,740.00	1,896,000	
A D E K A	8,400	1,734.00	14,565,600	
日油	6,500	3,725.00	24,212,500	
新日本理化	3,300	180.00	594,000	
ハリマ化成グループ	1,400	1,120.00	1,568,000	
花王	42,000	7,720.00	324,240,000	

第一工業製薬	600	2,721.00	1,632,600
石原ケミカル	400	1,712.00	684,800
日華化学	600	941.00	564,600
三洋化成工業	1,100	5,300.00	5,830,000
有機合成薬品工業	1,400	210.00	294,000
大日本塗料	1,900	1,049.00	1,993,100
日本ペイントホールディングス	14,000	3,690.00	51,660,000
関西ペイント	19,100	1,918.00	36,633,800
神東塗料	1,500	173.00	259,500
中国塗料	5,600	982.00	5,499,200
日本特殊塗料	1,300	1,335.00	1,735,500
藤倉化成	2,300	575.00	1,322,500
太陽ホールディングス	1,400	3,445.00	4,823,000
D I C	7,700	3,495.00	26,911,500
サカタインクス	3,700	1,236.00	4,573,200
東洋インキＳＣホールディングス	3,600	2,490.00	8,964,000
T & K T O K A	1,300	996.00	1,294,800
富士フイルムホールディングス	36,000	4,622.00	166,392,000
資生堂	34,400	6,731.00	231,546,400
ライオン	24,100	2,335.00	56,273,500
高砂香料工業	1,200	3,540.00	4,248,000
マンダム	3,900	2,619.00	10,214,100
ミルボン	2,100	4,585.00	9,628,500
ファンケル	7,700	2,467.00	18,995,900
コーセー	2,900	16,420.00	47,618,000
コタ	800	1,510.00	1,208,000
シーボン	200	2,635.00	527,000
ポーラ・オルビスホールディングス	7,400	3,285.00	24,309,000
ノエビアホールディングス	1,100	4,910.00	5,401,000
アジュバンコスメジャパン	400	946.00	378,400
エステー	1,300	1,828.00	2,376,400
アグロ カネショウ	700	2,093.00	1,465,100
コニシ	3,100	1,748.00	5,418,800
長谷川香料	2,100	1,612.00	3,385,200
星光P M C	1,200	799.00	958,800
小林製薬	4,800	8,230.00	39,504,000

荒川化学工業	1,600	1,371.00	2,193,600
メック	1,200	1,072.00	1,286,400
日本高純度化学	500	2,243.00	1,121,500
タカラバイオ	4,500	2,450.00	11,025,000
J C U	2,200	1,595.00	3,509,000
新田ゼラチン	1,100	682.00	750,200
O A T アグリオ	300	2,075.00	622,500
デクセリアルズ	4,500	781.00	3,514,500
アース製薬	1,300	5,230.00	6,799,000
北興化学工業	1,800	543.00	977,400
大成ラミック	600	2,793.00	1,675,800
クミアイ化学工業	7,200	675.00	4,860,000
日本農薬	4,200	504.00	2,116,800
アキレス	1,300	2,051.00	2,666,300
有沢製作所	2,700	837.00	2,259,900
日東電工	13,100	6,054.00	79,307,400
レック	1,800	1,665.00	2,997,000
三光合成	1,400	359.00	502,600
きもと	3,100	193.00	598,300
藤森工業	1,600	2,896.00	4,633,600
前澤化成工業	1,200	1,057.00	1,268,400
未来工業	900	2,446.00	2,201,400
ウェーブロックホールディングス	400	765.00	306,000
J S P	1,000	2,405.00	2,405,000
エフピコ	1,400	6,170.00	8,638,000
天馬	1,200	1,755.00	2,106,000
信越ポリマー	3,100	810.00	2,511,000
東リ	4,400	248.00	1,091,200
ニフコ	6,900	2,815.00	19,423,500
バルカー	1,400	2,284.00	3,197,600
ユニ・チャーム	36,700	3,371.00	123,715,700
協和発酵キリン	21,700	2,113.00	45,852,100
武田薬品工業	109,900	4,453.00	489,384,700
アステラス製薬	159,600	1,750.00	279,300,000
大日本住友製薬	12,800	2,680.00	34,304,000
塩野義製薬	22,700	6,858.00	155,676,600

田辺三菱製薬	18,100	1,733.00	31,367,300	
わかもと製薬	2,200	274.00	602,800	
あすか製薬	2,200	1,182.00	2,600,400	
日本新薬	4,500	7,300.00	32,850,000	
ピオフェルミン製薬	300	2,354.00	706,200	
中外製薬	18,000	6,850.00	123,300,000	
科研製薬	3,100	5,400.00	16,740,000	
エーザイ	20,700	8,876.00	183,733,200	
ロート製薬	8,900	3,015.00	26,833,500	
小野薬品工業	40,900	2,337.50	95,603,750	
久光製薬	5,100	5,730.00	29,223,000	
持田製薬	1,300	9,800.00	12,740,000	
参天製薬	32,800	1,541.00	50,544,800	
扶桑薬品工業	600	2,487.00	1,492,200	
日本ケミファ	200	3,105.00	621,000	
ツムラ	5,400	3,255.00	17,577,000	
日医工	4,400	1,676.00	7,374,400	
キッセイ薬品工業	3,100	3,055.00	9,470,500	
生化学工業	3,400	1,255.00	4,267,000	
栄研化学	3,000	2,522.00	7,566,000	
日水製薬	700	1,184.00	828,800	
鳥居薬品	900	2,506.00	2,255,400	
JCRファーマ	1,200	5,960.00	7,152,000	
東和薬品	800	7,960.00	6,368,000	
富士製薬工業	1,200	1,845.00	2,214,000	
沢井製薬	3,500	5,630.00	19,705,000	
ゼリア新薬工業	3,400	1,848.00	6,283,200	
第一三共	49,500	3,948.00	195,426,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,800	2,330.00	8,854,000	
大幸薬品	800	1,757.00	1,405,600	
ダイト	1,000	2,928.00	2,928,000	
大塚ホールディングス	33,000	4,557.00	150,381,000	
大正製薬ホールディングス	3,900	11,500.00	44,850,000	
ペプチドリーム	8,700	4,730.00	41,151,000	
日本コークス工業	14,700	101.00	1,484,700	
昭和シェル石油	16,000	1,660.00	26,560,000	

ニチレキ	2,300	998.00	2,295,400
ユシロ化学工業	900	1,192.00	1,072,800
ピーピー・カストロール	600	1,346.00	807,600
富士石油	4,300	312.00	1,341,600
MORESCO	600	1,599.00	959,400
出光興産	13,400	3,920.00	52,528,000
JXTGホールディングス	291,200	595.40	173,380,480
コスモエネルギーホールディングス	5,000	2,529.00	12,645,000
横浜ゴム	10,000	2,335.00	23,350,000
TOYO TIRE	8,900	1,531.00	13,625,900
ブリヂストン	53,200	4,236.00	225,355,200
住友ゴム工業	15,600	1,506.00	23,493,600
藤倉ゴム工業	1,500	456.00	684,000
オカモト	1,200	5,740.00	6,888,000
フコク	800	855.00	684,000
ニッタ	2,000	3,705.00	7,410,000
住友理工	3,300	1,004.00	3,313,200
三ツ星ベルト	2,300	2,128.00	4,894,400
バンドー化学	3,300	1,123.00	3,705,900
日東紡績	2,600	1,869.00	4,859,400
AGC	17,100	3,715.00	63,526,500
日本板硝子	8,300	921.00	7,644,300
石塚硝子	300	1,961.00	588,300
日本山村硝子	700	1,508.00	1,055,600
日本電気硝子	7,500	2,981.00	22,357,500
オハラ	700	1,684.00	1,178,800
住友大阪セメント	3,500	4,850.00	16,975,000
太平洋セメント	10,900	3,790.00	41,311,000
日本ヒューム	1,800	794.00	1,429,200
日本コンクリート工業	3,900	278.00	1,084,200
三谷セキサン	800	2,581.00	2,064,800
アジアパイルホールディングス	2,500	649.00	1,622,500
東海カーボン	15,700	1,545.00	24,256,500
日本カーボン	800	4,385.00	3,508,000
東洋炭素	1,000	2,339.00	2,339,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	5,200.00	5,200,000

TOTO	13,300	4,245.00	56,458,500	
日本碍子	21,100	1,648.00	34,772,800	
日本特殊陶業	14,600	2,288.00	33,404,800	
ダントーホールディングス	2,200	121.00	266,200	
MARUWA	600	5,840.00	3,504,000	
品川リフラクトリーズ	500	3,710.00	1,855,000	
黒崎播磨	400	5,550.00	2,220,000	
ヨータイ	1,600	693.00	1,108,800	
イソライト工業	900	578.00	520,200	
東京窯業	2,200	386.00	849,200	
ニッカトー	800	1,087.00	869,600	
フジインコーポレーテッド	1,500	2,290.00	3,435,000	
クニミネ工業	600	818.00	490,800	
エーアンドエーマテリアル	300	1,026.00	307,800	
ニチアス	4,800	1,958.00	9,398,400	
ニチハ	2,400	3,170.00	7,608,000	
新日鐵住金	79,500	2,010.50	159,834,750	
神戸製鋼所	31,400	869.00	27,286,600	
合同製鐵	900	1,817.00	1,635,300	
ジェイ エフ イー ホールディングス	46,200	1,940.00	89,628,000	
東京製鐵	9,200	921.00	8,473,200	
共英製鋼	2,000	1,703.00	3,406,000	
大和工業	3,700	2,900.00	10,730,000	
東京鐵鋼	700	1,234.00	863,800	
大阪製鐵	1,100	1,933.00	2,126,300	
淀川製鋼所	2,300	2,319.00	5,333,700	
丸一鋼管	6,100	3,500.00	21,350,000	
モリ工業	500	2,402.00	1,201,000	
大同特殊鋼	2,800	4,475.00	12,530,000	
日本高周波鋼業	700	532.00	372,400	
日本冶金工業	14,300	254.00	3,632,200	
山陽特殊製鋼	2,200	2,282.00	5,020,400	
愛知製鋼	1,000	3,435.00	3,435,000	
日立金属	18,400	1,087.00	20,000,800	
日本金属	400	1,230.00	492,000	
大平洋金属	1,200	2,799.00	3,358,800	

新日本電工	10,400	229.00	2,381,600	
栗本鐵工所	900	1,429.00	1,286,100	
虹技	300	1,360.00	408,000	
日本鑄鉄管	200	967.00	193,400	
三菱製鋼	1,300	1,700.00	2,210,000	
日亜鋼業	2,600	285.00	741,000	
日本精線	200	3,315.00	663,000	
エンビプロ・ホールディングス	400	505.00	202,000	
シンニッタン	2,700	330.00	891,000	
新家工業	400	1,550.00	620,000	
大紀アルミニウム工業所	2,900	602.00	1,745,800	
日本軽金属ホールディングス	46,800	239.00	11,185,200	
三井金属鉱業	4,600	2,555.00	11,753,000	
東邦亜鉛	900	3,425.00	3,082,500	
三菱マテリアル	11,300	3,075.00	34,747,500	
住友金属鉱山	23,400	3,126.00	73,148,400	
D O W Aホールディングス	4,000	3,475.00	13,900,000	
古河機械金属	2,800	1,372.00	3,841,600	
エス・サイエンス	8,100	57.00	461,700	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,000	1,670.00	3,340,000	
東邦チタニウム	3,100	933.00	2,892,300	
U A C J	2,600	2,299.00	5,977,400	
C Kサンエツ	300	2,440.00	732,000	
古河電気工業	5,000	3,260.00	16,300,000	
住友電気工業	64,000	1,555.00	99,520,000	
フジクラ	20,700	469.00	9,708,300	
昭和電線ホールディングス	2,100	644.00	1,352,400	
タツタ電線	3,400	508.00	1,727,200	
カナレ電気	300	1,814.00	544,200	
平河ヒューテック	700	1,247.00	872,900	
リョービ	2,100	2,916.00	6,123,600	
アーレスティ	2,200	662.00	1,456,400	
アサヒホールディングス	3,200	2,127.00	6,806,400	
稲葉製作所	1,000	1,249.00	1,249,000	
宮地エンジニアリンググループ	500	2,033.00	1,016,500	
トーカロ	4,400	946.00	4,162,400	

アルファC o	600	1,286.00	771,600	
SUMCO	18,900	1,507.00	28,482,300	
川田テクノロジーズ	400	6,900.00	2,760,000	
RS Technologies	300	3,065.00	919,500	
東洋製罐グループホールディングス	10,900	2,465.00	26,868,500	
ホッカンホールディングス	900	1,692.00	1,522,800	
コロナ	900	1,010.00	909,000	
横河ブリッジホールディングス	3,200	2,043.00	6,537,600	
駒井ハルテック	400	1,889.00	755,600	
高田機工	200	2,728.00	545,600	
三和ホールディングス	17,700	1,291.00	22,850,700	
文化シャッター	5,000	764.00	3,820,000	
三協立山	2,400	1,405.00	3,372,000	
アルインコ	1,400	967.00	1,353,800	
東洋シャッター	500	718.00	359,000	
LIXILグループ	25,300	1,628.00	41,188,400	
日本フィルコン	1,300	535.00	695,500	
ノーリツ	3,800	1,521.00	5,779,800	
長府製作所	1,700	2,059.00	3,500,300	
リンナイ	3,100	7,380.00	22,878,000	
ダイニチ工業	1,000	711.00	711,000	
日東精工	2,400	545.00	1,308,000	
三洋工業	300	1,801.00	540,300	
岡部	3,500	866.00	3,031,000	
ジーテクト	1,900	1,623.00	3,083,700	
中国工業	300	554.00	166,200	
東プレ	3,200	2,425.00	7,760,000	
高周波熱錬	3,300	871.00	2,874,300	
東京製綱	1,100	972.00	1,069,200	
サンコール	1,000	639.00	639,000	
モリテック スチール	1,400	415.00	581,000	
パイオラックス	2,800	2,246.00	6,288,800	
エイチワン	1,700	1,145.00	1,946,500	
日本発條	17,000	1,039.00	17,663,000	
中央発條	200	2,914.00	582,800	
アドバネクス	200	1,526.00	305,200	



立川ブラインド工業	800	979.00	783,200	
三益半導体工業	1,500	1,414.00	2,121,000	
日本ドライケミカル	500	1,131.00	565,500	
日本製鋼所	5,200	2,070.00	10,764,000	
三浦工業	7,400	2,736.00	20,246,400	
タクマ	6,300	1,402.00	8,832,600	
ツガミ	3,900	712.00	2,776,800	
オークマ	2,200	5,900.00	12,980,000	
東芝機械	1,900	2,216.00	4,210,400	
アマダホールディングス	26,400	1,097.00	28,960,800	
アイダエンジニアリング	4,700	794.00	3,731,800	
滝澤鉄工所	500	1,510.00	755,000	
F U J I	5,100	1,438.00	7,333,800	
牧野フライス製作所	2,000	4,355.00	8,710,000	
オーエスジー	8,400	2,270.00	19,068,000	
ダイジェット工業	200	1,613.00	322,600	
旭ダイヤモンド工業	4,600	737.00	3,390,200	
D M G 森精機	10,900	1,494.00	16,284,600	
ソディック	3,800	829.00	3,150,200	
ディスコ	2,300	15,970.00	36,731,000	
日東工器	900	2,204.00	1,983,600	
日進工具	500	2,543.00	1,271,500	
パンチ工業	1,200	542.00	650,400	
富士ダイス	800	646.00	516,800	
豊和工業	1,000	822.00	822,000	
O K K	700	819.00	573,300	
東洋機械金属	1,200	580.00	696,000	
津田駒工業	400	1,859.00	743,600	
島精機製作所	2,400	3,690.00	8,856,000	
オプトラン	1,700	1,935.00	3,289,500	
N C ホールディングス	600	493.00	295,800	
フリュー	1,400	1,032.00	1,444,800	
ヤマシンフィルタ	3,000	680.00	2,040,000	
日阪製作所	2,100	839.00	1,761,900	
やまびこ	3,300	1,139.00	3,758,700	
平田機工	800	6,420.00	5,136,000	

ベガサスミシン製造	1,600	652.00	1,043,200
マルマエ	500	726.00	363,000
タツモ	500	799.00	399,500
ナブテスコ	9,400	2,892.00	27,184,800
三井海洋開発	1,800	2,530.00	4,554,000
レオン自動機	1,700	1,396.00	2,373,200
S M C	5,100	36,700.00	187,170,000
新川	1,300	405.00	526,500
ホソカワミクロン	600	4,470.00	2,682,000
ユニオンツール	800	3,105.00	2,484,000
オイレス工業	2,400	1,867.00	4,480,800
日精エー・エス・ピー機械	500	3,835.00	1,917,500
サトーホールディングス	2,100	2,573.00	5,403,300
技研製作所	1,200	3,275.00	3,930,000
日本エアージェット	600	569.00	341,400
カワタ	400	1,341.00	536,400
日精樹脂工業	1,500	923.00	1,384,500
オカダアイヨン	600	1,468.00	880,800
ワイエイシイホールディングス	700	659.00	461,300
小松製作所	78,400	2,745.00	215,208,000
住友重機械工業	9,900	3,755.00	37,174,500
日立建機	6,900	2,804.00	19,347,600
日工	500	2,243.00	1,121,500
巴工業	700	2,393.00	1,675,100
井関農機	1,700	1,665.00	2,830,500
T O W A	1,500	684.00	1,026,000
丸山製作所	400	1,321.00	528,400
北川鉄工所	800	2,321.00	1,856,800
ローツェ	800	1,672.00	1,337,600
タカキタ	600	597.00	358,200
クボタ	92,700	1,728.50	160,231,950
荏原実業	500	2,132.00	1,066,000
三菱化工機	600	1,548.00	928,800
月島機械	3,400	1,416.00	4,814,400
帝国電機製作所	1,200	1,215.00	1,458,000
新東工業	4,100	956.00	3,919,600

澁谷工業	1,500	3,725.00	5,587,500	
アイチ コーポレーション	3,000	693.00	2,079,000	
小森コーポレーション	4,700	1,189.00	5,588,300	
鶴見製作所	1,400	1,812.00	2,536,800	
住友精密工業	300	2,895.00	868,500	
酒井重工業	300	2,375.00	712,500	
荏原製作所	7,700	3,045.00	23,446,500	
石井鐵工所	300	1,802.00	540,600	
西島製作所	1,800	930.00	1,674,000	
北越工業	1,800	1,156.00	2,080,800	
ダイキン工業	23,600	11,690.00	275,884,000	
オルガノ	600	2,674.00	1,604,400	
トーヨーカネツ	700	2,386.00	1,670,200	
栗田工業	9,400	2,794.00	26,263,600	
椿本チエイン	2,300	4,095.00	9,418,500	
大同工業	800	881.00	704,800	
木村化工機	1,400	366.00	512,400	
アネスト岩田	2,700	965.00	2,605,500	
ダイフク	9,500	5,570.00	52,915,000	
サムコ	500	946.00	473,000	
加藤製作所	900	2,743.00	2,468,700	
油研工業	300	1,989.00	596,700	
タダノ	8,400	1,180.00	9,912,000	
フジテック	6,300	1,199.00	7,553,700	
C K D	4,800	1,028.00	4,934,400	
キトー	1,300	1,697.00	2,206,100	
平和	4,800	2,347.00	11,265,600	
理想科学工業	1,600	1,687.00	2,699,200	
S A N K Y O	4,300	4,270.00	18,361,000	
日本金銭機械	1,900	998.00	1,896,200	
マースグループホールディングス	1,100	2,241.00	2,465,100	
福島工業	1,100	3,910.00	4,301,000	
オーイズミ	800	350.00	280,000	
ダイコク電機	800	1,497.00	1,197,600	
竹内製作所	2,900	1,980.00	5,742,000	
アマノ	5,000	2,308.00	11,540,000	

J U K I	2,400	1,184.00	2,841,600	
サンデンホールディングス	2,200	832.00	1,830,400	
蛇の目マシン工業	1,600	489.00	782,400	
マックス	2,700	1,495.00	4,036,500	
グローリー	4,800	2,689.00	12,907,200	
新晃工業	1,600	1,408.00	2,252,800	
大和冷機工業	2,500	1,163.00	2,907,500	
セガサミーホールディングス	17,200	1,552.00	26,694,400	
日本ピストンリング	600	1,788.00	1,072,800	
リケン	800	5,090.00	4,072,000	
T P R	2,300	2,381.00	5,476,300	
ツバキ・ナカシマ	2,600	1,747.00	4,542,200	
ホシザキ	5,100	7,780.00	39,678,000	
大豊工業	1,400	1,031.00	1,443,400	
日本精工	35,500	1,072.00	38,056,000	
N T N	37,300	340.00	12,682,000	
ジェイテクト	16,600	1,374.00	22,808,400	
不二越	1,600	4,330.00	6,928,000	
日本トムソン	5,200	575.00	2,990,000	
T H K	10,800	2,655.00	28,674,000	
ユーシン精機	1,400	969.00	1,356,600	
前澤給装工業	700	1,813.00	1,269,100	
イーグル工業	2,100	1,345.00	2,824,500	
前澤工業	1,400	361.00	505,400	
日本ピラー工業	1,800	1,361.00	2,449,800	
キッツ	7,000	906.00	6,342,000	
マキタ	21,100	3,980.00	83,978,000	
日立造船	13,800	362.00	4,995,600	
三菱重工業	29,000	4,234.00	122,786,000	
I H I	13,300	3,420.00	45,486,000	
スター精密	3,000	1,594.00	4,782,000	
日清紡ホールディングス	9,600	949.00	9,110,400	
イビデン	10,600	1,594.00	16,896,400	
コニカミノルタ	37,800	1,009.00	38,140,200	
ブラザー工業	22,600	1,895.00	42,827,000	
ミネベアミツミ	32,100	1,779.00	57,105,900	

日立製作所	77,900	3,525.00	274,597,500
三菱電機	173,100	1,406.50	243,465,150
富士電機	11,200	3,365.00	37,688,000
東洋電機製造	700	1,337.00	935,900
安川電機	20,100	3,080.00	61,908,000
シンフォニアテクノロジー	2,400	1,410.00	3,384,000
明電舎	3,400	1,636.00	5,562,400
オリジン電気	500	1,796.00	898,000
山洋電気	800	4,025.00	3,220,000
デンヨー	1,600	1,383.00	2,212,800
東芝テック	2,200	2,647.00	5,823,400
芝浦メカトロニクス	300	3,505.00	1,051,500
マブチモーター	4,800	3,880.00	18,624,000
日本電産	20,800	13,025.00	270,920,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	1,693.00	1,523,700
トレックス・セミコンダクター	600	1,279.00	767,400
東光高岳	900	1,503.00	1,352,700
ダブル・スコープ	2,500	1,147.00	2,867,500
ダイヘン	1,900	2,557.00	4,858,300
ヤーマン	2,500	1,399.00	3,497,500
JVCケンウッド	13,400	286.00	3,832,400
ミマキエンジニアリング	1,600	804.00	1,286,400
第一精工	700	1,243.00	870,100
日新電機	4,000	958.00	3,832,000
大崎電気工業	3,500	744.00	2,604,000
オムロン	18,400	4,675.00	86,020,000
日東工業	2,800	2,237.00	6,263,600
I D E C	2,300	1,959.00	4,505,700
正興電機製作所	300	863.00	258,900
不二電機工業	200	1,281.00	256,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,200	2,308.00	14,309,600
サクサホールディングス	400	1,777.00	710,800
メルコホールディングス	700	3,820.00	2,674,000
テクノメディカ	400	2,055.00	822,000
日本電気	22,400	3,760.00	84,224,000
富士通	16,700	7,504.00	125,316,800

沖電気工業	7,500	1,272.00	9,540,000
岩崎通信機	900	774.00	696,600
電気興業	900	2,576.00	2,318,400
サンケン電気	2,000	2,305.00	4,610,000
ナカヨ	300	1,424.00	427,200
アイホン	1,000	1,690.00	1,690,000
ルネサスエレクトロニクス	17,900	637.00	11,402,300
セイコーエプソン	21,500	1,648.00	35,432,000
ワコム	12,500	485.00	6,062,500
アルバック	3,500	3,625.00	12,687,500
アクセル	800	491.00	392,800
E I Z O	1,600	4,670.00	7,472,000
ジャパンディスプレイ	41,300	74.00	3,056,200
日本信号	4,400	972.00	4,276,800
京三製作所	3,700	429.00	1,587,300
能美防災	2,300	1,845.00	4,243,500
ホーチキ	1,100	1,107.00	1,217,700
星和電機	800	409.00	327,200
エレコム	1,600	3,075.00	4,920,000
パナソニック	197,800	1,061.00	209,865,800
シャープ	17,200	1,314.00	22,600,800
アンリツ	11,200	2,097.00	23,486,400
富士通ゼネラル	5,300	1,451.00	7,690,300
ソニー	116,100	5,055.00	586,885,500
T D K	9,000	8,570.00	77,130,000
帝国通信工業	800	1,174.00	939,200
タムラ製作所	6,700	610.00	4,087,000
アルプスアルパイン	18,000	2,285.00	41,130,000
池上通信機	600	1,214.00	728,400
パイオニア	29,500	65.00	1,917,500
日本電波工業	1,600	382.00	611,200
鈴木	900	660.00	594,000
日本トリム	300	5,460.00	1,638,000
ローランド ディー . ジー .	900	2,154.00	1,938,600
フォスター電機	2,000	1,663.00	3,326,000
クラリオン	1,500	2,497.00	3,745,500

S M K	500	2,559.00	1,279,500	
ヨコオ	1,300	1,592.00	2,069,600	
ホシデン	5,100	801.00	4,085,100	
ヒロセ電機	2,500	11,820.00	29,550,000	
日本航空電子工業	4,000	1,431.00	5,724,000	
T O A	1,900	981.00	1,863,900	
マクセルホールディングス	3,700	1,581.00	5,849,700	
古野電気	2,300	932.00	2,143,600	
ユニデンホールディングス	500	2,155.00	1,077,500	
スミダコーポレーション	1,500	1,228.00	1,842,000	
アイコム	1,000	2,167.00	2,167,000	
リオン	800	1,788.00	1,430,400	
本多通信工業	1,500	551.00	826,500	
船井電機	1,800	596.00	1,072,800	
横河電機	17,300	2,046.00	35,395,800	
新電元工業	600	4,395.00	2,637,000	
アズビル	11,200	2,350.00	26,320,000	
東亜ディーケーケー	900	851.00	765,900	
日本光電工業	7,600	3,570.00	27,132,000	
チノー	600	1,250.00	750,000	
共和電業	1,800	367.00	660,600	
日本電子材料	700	761.00	532,700	
堀場製作所	3,400	5,410.00	18,394,000	
アドバンテスト	11,800	2,505.00	29,559,000	
小野測器	900	605.00	544,500	
エスベック	1,500	2,005.00	3,007,500	
キーエンス	8,500	60,100.00	510,850,000	
日置電機	900	4,280.00	3,852,000	
シスメックス	13,500	6,257.00	84,469,500	
日本マイクロニクス	2,800	818.00	2,290,400	
メガチップス	1,400	2,179.00	3,050,600	
O B A R A G R O U P	1,000	3,590.00	3,590,000	
澤藤電機	200	1,664.00	332,800	
原田工業	600	897.00	538,200	
コーセル	2,200	1,120.00	2,464,000	
イリソ電子工業	1,600	4,595.00	7,352,000	

オブテックスグループ	3,100	1,975.00	6,122,500	
千代田インテグレ	700	1,940.00	1,358,000	
アイ・オー・データ機器	600	1,292.00	775,200	
レーザーテック	3,600	3,640.00	13,104,000	
スタンレー電気	12,200	3,240.00	39,528,000	
岩崎電気	700	1,310.00	917,000	
ウシオ電機	10,500	1,275.00	13,387,500	
岡谷電機産業	1,300	375.00	487,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,600	710.00	1,136,000	
エノモト	300	832.00	249,600	
日本セラミック	1,800	2,603.00	4,685,400	
遠藤照明	900	715.00	643,500	
古河電池	1,300	701.00	911,300	
双信電機	800	351.00	280,800	
山一電機	1,300	1,228.00	1,596,400	
図研	1,100	1,567.00	1,723,700	
日本電子	3,400	1,886.00	6,412,400	
カシオ計算機	15,300	1,500.00	22,950,000	
ファナック	16,400	18,615.00	305,286,000	
日本シイエムケイ	4,400	700.00	3,080,000	
エンプラス	800	2,990.00	2,392,000	
大真空	600	985.00	591,000	
ローム	8,400	7,330.00	61,572,000	
浜松ホトニクス	12,400	3,895.00	48,298,000	
三井ハイテック	1,900	946.00	1,797,400	
新光電気工業	5,800	748.00	4,338,400	
京セラ	26,400	5,912.00	156,076,800	
太陽誘電	7,700	2,066.00	15,908,200	
村田製作所	18,200	16,780.00	305,396,000	
ユーシン	2,800	983.00	2,752,400	
双葉電子工業	2,800	1,735.00	4,858,000	
北陸電気工業	700	965.00	675,500	
ニチコン	5,400	889.00	4,800,600	
日本ケミコン	1,200	2,244.00	2,692,800	
K O A	2,600	1,615.00	4,199,000	
市光工業	2,600	634.00	1,648,400	



小糸製作所	10,400	6,480.00	67,392,000	
ミツバ	3,200	681.00	2,179,200	
S C R E E Nホールディングス	3,000	4,460.00	13,380,000	
キャノン電子	1,600	1,806.00	2,889,600	
キャノン	93,200	3,173.00	295,723,600	
リコー	52,100	1,150.00	59,915,000	
象印マホービン	3,200	1,170.00	3,744,000	
M U T O Hホールディングス	300	1,823.00	546,900	
東京エレクトロン	11,500	15,730.00	180,895,000	
トヨタ紡織	6,100	1,764.00	10,760,400	
芦森工業	400	1,513.00	605,200	
ユニプレス	3,400	2,111.00	7,177,400	
豊田自動織機	14,000	5,620.00	78,680,000	
モリタホールディングス	3,000	1,841.00	5,523,000	
三櫻工業	2,200	597.00	1,313,400	
デンソー	38,100	4,818.00	183,565,800	
東海理化電機製作所	4,600	1,935.00	8,901,000	
三井E & Sホールディングス	6,300	1,248.00	7,862,400	
川崎重工業	13,500	2,736.00	36,936,000	
名村造船所	5,200	444.00	2,308,800	
サノヤスホールディングス	2,400	173.00	415,200	
日本車輛製造	700	2,508.00	1,755,600	
三菱ロジスネクスト	2,100	1,227.00	2,576,700	
近畿車輛	300	1,986.00	595,800	
日産自動車	204,100	933.30	190,486,530	
いすゞ自動車	54,700	1,589.00	86,918,300	
トヨタ自動車	192,900	6,726.00	1,297,445,400	代用有価証券 23,000株
日野自動車	21,600	1,035.00	22,356,000	
三菱自動車工業	64,100	651.00	41,729,100	
エフテック	1,200	965.00	1,158,000	
レシップホールディングス	700	697.00	487,900	
G M B	400	947.00	378,800	
ファルテック	300	794.00	238,200	
武蔵精密工業	4,200	1,543.00	6,480,600	
日産車体	3,400	999.00	3,396,600	

新明和工業	7,800	1,485.00	11,583,000	
極東開発工業	3,500	1,559.00	5,456,500	
日信工業	3,200	1,486.00	4,755,200	
トピー工業	1,400	2,435.00	3,409,000	
ティラド	600	2,313.00	1,387,800	
曙ブレーキ工業	9,800	167.00	1,636,600	
タチエス	2,900	1,527.00	4,428,300	
N O K	9,300	1,806.00	16,795,800	
フタバ産業	4,800	621.00	2,980,800	
K Y B	1,800	3,025.00	5,445,000	
大同メタル工業	2,800	791.00	2,214,800	
プレス工業	8,600	617.00	5,306,200	
ミクニ	2,200	495.00	1,089,000	
太平洋工業	3,600	1,765.00	6,354,000	
ケーヒン	4,000	1,977.00	7,908,000	
河西工業	2,100	878.00	1,843,800	
アイシン精機	14,200	4,350.00	61,770,000	
マツダ	54,300	1,219.00	66,191,700	
今仙電機製作所	1,600	1,031.00	1,649,600	
本田技研工業	146,000	3,132.00	457,272,000	
スズキ	31,700	5,714.00	181,133,800	
S U B A R U	53,700	2,552.50	137,069,250	
安永	900	1,384.00	1,245,600	
ヤマハ発動機	24,500	2,348.00	57,526,000	
ショーワ	4,100	1,633.00	6,695,300	
T B K	2,100	409.00	858,900	
エクセディ	2,300	2,783.00	6,400,900	
豊田合成	5,600	2,380.00	13,328,000	
愛三工業	2,700	770.00	2,079,000	
盟和産業	300	1,040.00	312,000	
日本プラスト	1,400	771.00	1,079,400	
ヨロズ	1,600	1,549.00	2,478,400	
エフ・シー・シー	3,100	2,562.00	7,942,200	
シマノ	7,000	15,520.00	108,640,000	
テイ・エス テック	4,000	3,410.00	13,640,000	
ジャムコ	900	2,642.00	2,377,800	

テルモ	24,500	6,230.00	152,635,000
クリエートメディック	600	941.00	564,600
日機装	5,600	1,011.00	5,661,600
島津製作所	22,300	2,524.00	56,285,200
JMS	1,600	569.00	910,400
長野計器	1,400	849.00	1,188,600
ブイ・テクノロジー	400	16,200.00	6,480,000
東京計器	1,100	927.00	1,019,700
愛知時計電機	200	3,780.00	756,000
インターアクション	800	2,361.00	1,888,800
オーバル	1,800	237.00	426,600
東京精密	3,100	3,210.00	9,951,000
マニー	2,100	4,855.00	10,195,500
ニコン	30,200	1,878.00	56,715,600
トプコン	9,300	1,549.00	14,405,700
オリンパス	25,800	4,580.00	118,164,000
理研計器	1,500	2,004.00	3,006,000
タムロン	1,600	1,787.00	2,859,200
H O Y A	34,900	6,568.00	229,223,200
シード	700	1,303.00	912,100
ノーリツ鋼機	1,400	1,853.00	2,594,200
エー・アンド・デイ	1,600	702.00	1,123,200
朝日インテック	7,400	4,990.00	36,926,000
シチズン時計	19,000	586.00	11,134,000
リズム時計工業	600	1,676.00	1,005,600
大研医器	1,400	604.00	845,600
メニコン	2,400	2,786.00	6,686,400
シンシア	300	496.00	148,800
松風	900	1,105.00	994,500
セイコーホールディングス	2,700	2,320.00	6,264,000
ニプロ	12,000	1,453.00	17,436,000
中本パックス	500	1,632.00	816,000
スノーピーク	700	1,263.00	884,100
パラマウントベッドホールディングス	2,000	4,650.00	9,300,000
トランザクション	900	738.00	664,200
S H O - B I	500	345.00	172,500

ニホンフラッシュ	800	1,874.00	1,499,200
前田工織	1,900	2,666.00	5,065,400
永大産業	2,300	431.00	991,300
アートネイチャー	1,900	621.00	1,179,900
バンダイナムコホールディングス	17,900	4,875.00	87,262,500
アイフィスジャパン	400	622.00	248,800
共立印刷	2,900	214.00	620,600
S H O E I	800	3,875.00	3,100,000
フランスベッドホールディングス	2,500	885.00	2,212,500
パイロットコーポレーション	3,000	5,390.00	16,170,000
萩原工業	1,000	1,580.00	1,580,000
トッパン・フォームズ	3,700	933.00	3,452,100
フジシールインターナショナル	3,900	3,785.00	14,761,500
タカラトミー	7,300	1,172.00	8,555,600
廣済堂	1,700	707.00	1,201,900
エステールホールディングス	600	657.00	394,200
アーク	7,100	89.00	631,900
タカノ	700	822.00	575,400
プロネクサス	1,500	1,155.00	1,732,500
ホクシン	1,300	140.00	182,000
ウッドワン	600	1,027.00	616,200
大建工業	1,300	1,917.00	2,492,100
凸版印刷	24,400	1,803.00	43,993,200
大日本印刷	24,400	2,546.00	62,122,400
図書印刷	1,600	964.00	1,542,400
共同印刷	500	2,380.00	1,190,000
N I S S H A	3,600	1,456.00	5,241,600
光村印刷	200	1,961.00	392,200
宝印刷	800	1,638.00	1,310,400
アシックス	17,200	1,595.00	27,434,000
ツツミ	600	1,897.00	1,138,200
小松ウオール工業	600	1,882.00	1,129,200
ヤマハ	10,300	4,805.00	49,491,500
河合楽器製作所	600	3,185.00	1,911,000
クリナップ	1,600	604.00	966,400
ピジョン	10,500	4,340.00	45,570,000

兼松サステック	200	1,576.00	315,200
キングジム	1,500	779.00	1,168,500
リンテック	4,100	2,438.00	9,995,800
イトーキ	3,300	576.00	1,900,800
任天堂	10,700	32,260.00	345,182,000
三菱鉛筆	2,900	2,265.00	6,568,500
タカラスタンダード	3,600	1,690.00	6,084,000
コクヨ	8,300	1,645.00	13,653,500
ナカバヤシ	1,700	546.00	928,200
オカムラ	6,100	1,439.00	8,777,900
美津濃	1,700	2,601.00	4,421,700
東京電力ホールディングス	138,300	680.00	94,044,000
中部電力	52,900	1,644.00	86,967,600
関西電力	70,600	1,599.50	112,924,700
中国電力	23,900	1,467.00	35,061,300
北陸電力	17,000	895.00	15,215,000
東北電力	40,500	1,436.00	58,158,000
四国電力	15,600	1,369.00	21,356,400
九州電力	35,700	1,307.00	46,659,900
北海道電力	16,200	774.00	12,538,800
沖縄電力	3,200	2,004.00	6,412,800
電源開発	13,800	2,749.00	37,936,200
エフオン	800	916.00	732,800
イーレックス	3,000	654.00	1,962,000
レノバ	2,100	1,121.00	2,354,100
東京瓦斯	34,000	2,930.00	99,620,000
大阪瓦斯	33,600	2,134.00	71,702,400
東邦瓦斯	8,600	4,655.00	40,033,000
北海道瓦斯	900	1,463.00	1,316,700
広島ガス	3,600	338.00	1,216,800
西部瓦斯	1,900	2,515.00	4,778,500
静岡ガス	5,300	930.00	4,929,000
メタウォーター	800	3,085.00	2,468,000
SBSホールディングス	1,700	1,592.00	2,706,400
東武鉄道	18,300	3,080.00	56,364,000
相鉄ホールディングス	5,900	3,305.00	19,499,500

東京急行電鉄	47,000	1,863.00	87,561,000
京浜急行電鉄	23,700	1,841.00	43,631,700
小田急電鉄	27,800	2,453.00	68,193,400
京王電鉄	9,700	6,190.00	60,043,000
京成電鉄	13,000	3,510.00	45,630,000
富士急行	2,400	3,500.00	8,400,000
東日本旅客鉄道	30,800	10,280.00	316,624,000
西日本旅客鉄道	15,500	8,045.00	124,697,500
東海旅客鉄道	15,500	23,980.00	371,690,000
西武ホールディングス	22,100	1,945.00	42,984,500
鴻池運輸	2,700	1,676.00	4,525,200
西日本鉄道	4,800	2,793.00	13,406,400
ハマキョウレックス	1,300	3,800.00	4,940,000
サカイ引越センター	900	6,100.00	5,490,000
近鉄グループホールディングス	16,400	4,780.00	78,392,000
阪急阪神ホールディングス	21,900	3,875.00	84,862,500
南海電気鉄道	7,300	2,981.00	21,761,300
京阪ホールディングス	7,300	4,515.00	32,959,500
神戸電鉄	500	3,870.00	1,935,000
名古屋鉄道	13,100	2,917.00	38,212,700
山陽電気鉄道	1,300	2,085.00	2,710,500
日本通運	6,400	6,770.00	43,328,000
ヤマトホールディングス	28,700	2,852.50	81,866,750
山九	4,500	5,080.00	22,860,000
丸運	900	297.00	267,300
丸全昭和運輸	1,300	2,745.00	3,568,500
センコーグループホールディングス	9,000	879.00	7,911,000
トナミホールディングス	400	6,020.00	2,408,000
ニッコンホールディングス	6,200	2,767.00	17,155,400
日本石油輸送	200	2,851.00	570,200
福山通運	2,100	4,505.00	9,460,500
セイノーホールディングス	12,300	1,535.00	18,880,500
エスライン	500	1,080.00	540,000
神奈川中央交通	400	3,670.00	1,468,000
日立物流	3,600	3,225.00	11,610,000
丸和運輸機関	900	3,655.00	3,289,500

C & F ロジホールディングス	1,600	1,172.00	1,875,200
九州旅客鉄道	13,800	3,690.00	50,922,000
S Gホールディングス	15,500	2,992.00	46,376,000
日本郵船	13,800	1,782.00	24,591,600
商船三井	9,700	2,595.00	25,171,500
川崎汽船	5,100	1,382.00	7,048,200
N S ユナイテッド海運	900	2,687.00	2,418,300
明治海運	1,800	354.00	637,200
飯野海運	7,800	396.00	3,088,800
共栄タンカー	200	1,516.00	303,200
乾汽船	1,500	718.00	1,077,000
日本航空	30,000	4,084.00	122,520,000
A N A ホールディングス	30,000	4,058.00	121,740,000
パスコ	400	817.00	326,800
トランコム	400	6,620.00	2,648,000
日新	1,400	1,808.00	2,531,200
三菱倉庫	5,700	2,744.00	15,640,800
三井倉庫ホールディングス	2,000	1,964.00	3,928,000
住友倉庫	6,200	1,405.00	8,711,000
澁澤倉庫	900	1,534.00	1,380,600
東陽倉庫	3,000	283.00	849,000
日本トランスシティ	3,600	434.00	1,562,400
ケイヒン	300	1,266.00	379,800
中央倉庫	1,000	1,002.00	1,002,000
川西倉庫	300	1,189.00	356,700
安田倉庫	1,400	835.00	1,169,000
ファイズ	200	1,044.00	208,800
東洋埠頭	500	1,426.00	713,000
宇徳	1,400	546.00	764,400
上組	10,100	2,427.00	24,512,700
サンリツ	400	677.00	270,800
キムラユニティー	500	1,101.00	550,500
キューソー流通システム	400	2,095.00	838,000
近鉄エクスプレス	3,100	1,647.00	5,105,700
東海運	1,000	279.00	279,000
エーアイティー	1,100	1,016.00	1,117,600

内外トランスライン	500	1,396.00	698,000
日本コンセプト	500	995.00	497,500
N E C ネットエスアイ	1,900	2,599.00	4,938,100
クロスキャット	300	1,093.00	327,900
システナ	6,000	1,313.00	7,878,000
デジタルアーツ	900	7,830.00	7,047,000
新日鉄住金ソリューションズ	2,500	3,150.00	7,875,000
キューブシステム	900	760.00	684,000
エイジア	400	1,186.00	474,400
コア	700	1,221.00	854,700
ソリトンシステムズ	1,000	861.00	861,000
ソフトクリエイティブホールディングス	700	1,442.00	1,009,400
T I S	5,700	5,150.00	29,355,000
ネオス	600	1,107.00	664,200
電算システム	700	2,260.00	1,582,000
グリー	11,800	495.00	5,841,000
コーエーテックホールディングス	3,500	1,856.00	6,496,000
三菱総合研究所	700	3,270.00	2,289,000
ボルテージ	400	569.00	227,600
電算	200	2,155.00	431,000
A G S	900	666.00	599,400
ファインデックス	1,400	614.00	859,600
ヒト・コミュニケーションズ	400	1,602.00	640,800
ブレインパッド	300	5,460.00	1,638,000
K L a b	3,100	943.00	2,923,300
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	2,300	905.00	2,081,500
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,537.00	461,100
ネクソン	43,200	1,713.00	74,001,600
アイスタイル	4,400	865.00	3,806,000
エムアップ	600	1,834.00	1,100,400
エイチーム	1,100	1,827.00	2,009,700
テクノスジャパン	1,500	800.00	1,200,000
コロプラ	4,900	789.00	3,866,100
オルトプラス	1,100	342.00	376,200
ブロードリーフ	8,500	574.00	4,879,000



クロス・マーケティンググループ	500	364.00	182,000	
デジタルハーツホールディングス	800	1,428.00	1,142,400	
メディアドゥホールディングス	500	2,344.00	1,172,000	
じげん	1,800	595.00	1,071,000	
ブイキューブ	900	382.00	343,800	
サイバーリンクス	200	1,013.00	202,600	
フィックスターズ	1,600	1,459.00	2,334,400	
CARTA HOLDINGS	900	1,113.00	1,001,700	
オブティム	400	4,580.00	1,832,000	
セレス	500	1,502.00	751,000	
ベリサーブ	200	6,660.00	1,332,000	
ティーガイア	1,700	2,162.00	3,675,400	
セック	300	3,655.00	1,096,500	
日本アジアグループ	1,900	372.00	706,800	
豆蔵ホールディングス	1,100	1,046.00	1,150,600	
テクマトリックス	1,200	2,030.00	2,436,000	
プロシップ	400	1,318.00	527,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,100	317.00	13,028,700	
GMOペイメントゲートウェイ	2,800	5,660.00	15,848,000	
ザッパラス	900	364.00	327,600	
システムリサーチ	200	3,200.00	640,000	
インターネットイニシアティブ	2,800	2,624.00	7,347,200	
さくらインターネット	2,100	485.00	1,018,500	
ヴィンクス	600	1,339.00	803,400	
GMOクラウド	400	3,435.00	1,374,000	
SRAホールディングス	900	2,608.00	2,347,200	
Minorityソリューションズ	300	1,638.00	491,400	
システムインテグレータ	500	760.00	380,000	
朝日ネット	1,400	513.00	718,200	
eBASE	500	1,762.00	881,000	
アバント	600	1,365.00	819,000	
アドソル日進	600	1,649.00	989,400	
フリービット	1,000	893.00	893,000	
コムチュア	1,000	3,035.00	3,035,000	
サイバーコム	300	2,424.00	727,200	
アステリア	800	867.00	693,600	

マークラインズ	600	1,380.00	828,000
メディカル・データ・ビジョン	1,500	970.00	1,455,000
g u m i	2,200	642.00	1,412,400
ショーケース・ティービー	400	703.00	281,200
モバイルファクトリー	500	1,581.00	790,500
テラスカイ	100	3,790.00	379,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,336.00	935,200
P C Iホールディングス	300	2,567.00	770,100
パイプドHD	300	893.00	267,900
アイビーシー	300	1,338.00	401,400
ネオジャパン	300	923.00	276,900
P R T I M E S	100	2,467.00	246,700
ランドコンピュータ	200	1,025.00	205,000
ダブルスタンダード	100	3,810.00	381,000
オープンドア	900	2,923.00	2,630,700
マイネット	600	1,755.00	1,053,000
アカツキ	600	5,010.00	3,006,000
ベネフィットジャパン	100	748.00	74,800
U b i c o mホールディングス	300	1,256.00	376,800
L I N E	5,200	3,970.00	20,644,000
カナミックネットワーク	300	1,805.00	541,500
ノムラシステムコーポレーション	100	752.00	75,200
チェンジ	200	4,420.00	884,000
シンクロ・フード	700	676.00	473,200
オークネット	900	903.00	812,700
A O I T Y O H o l d i n g s	1,900	860.00	1,634,000
マクロミル	3,000	1,600.00	4,800,000
ビーグリー	400	884.00	353,600
オロ	200	4,845.00	969,000
ソルクシーズ	700	692.00	484,400
フェイス	700	841.00	588,700
ハイマックス	200	1,807.00	361,400
野村総合研究所	10,800	4,415.00	47,682,000
サイバネットシステム	1,400	603.00	844,200
C Eホールディングス	400	751.00	300,400

日本システム技術	300	1,479.00	443,700
インテージホールディングス	2,200	911.00	2,004,200
東邦システムサイエンス	500	910.00	455,000
ソースネクスト	6,600	589.00	3,887,400
インフォコム	700	4,160.00	2,912,000
F I G	1,600	337.00	539,200
アルテリア・ネットワークス	1,400	1,309.00	1,832,600
フォーカスシステムズ	1,100	1,033.00	1,136,300
クレスコ	500	3,170.00	1,585,000
フジ・メディア・ホールディングス	17,600	1,596.00	28,089,600
オービック	5,900	10,440.00	61,596,000
ジャストシステム	2,400	2,330.00	5,592,000
T D C ソフト	1,500	891.00	1,336,500
ヤフー	110,600	294.00	32,516,400
トレンドマイクロ	9,000	5,820.00	52,380,000
インフォメーション・ディベロプメント	500	1,475.00	737,500
日本オラクル	3,400	8,090.00	27,506,000
アルファシステムズ	500	2,719.00	1,359,500
フューチャー	2,300	1,595.00	3,668,500
C A C H o l d i n g s	1,300	961.00	1,249,300
ソフトバンク・テクノロジー	700	2,070.00	1,449,000
トーセ	500	817.00	408,500
オービックビジネスコンサルタント	1,700	4,285.00	7,284,500
伊藤忠テクノソリューションズ	7,700	2,636.00	20,297,200
アイティフォー	2,100	838.00	1,759,800
東計電算	300	3,105.00	931,500
エクスネット	300	852.00	255,600
大塚商会	9,200	4,240.00	39,008,000
サイボウズ	2,000	667.00	1,334,000
ソフトブレーン	1,400	533.00	746,200
電通国際情報サービス	1,000	3,130.00	3,130,000
デジタルガレージ	3,300	2,609.00	8,609,700
E M システムズ	1,400	1,125.00	1,575,000
ウェザーニューズ	600	3,010.00	1,806,000
C I J	1,300	833.00	1,082,900
東洋ビジネスエンジニアリング	200	1,914.00	382,800

日本エンタープライズ	1,900	183.00	347,700
WOWOW	800	2,826.00	2,260,800
スカラ	1,200	789.00	946,800
I M A G I C A G R O U P	1,400	550.00	770,000
ネットワンシステムズ	6,000	2,526.00	15,156,000
システムソフト	4,200	100.00	420,000
アルゴグラフィックス	700	4,535.00	3,174,500
マーベラス	2,600	945.00	2,457,000
エイベックス	2,900	1,496.00	4,338,400
日本ユニシス	5,300	2,911.00	15,428,300
兼松エレクトロニクス	900	3,280.00	2,952,000
東京放送ホールディングス	11,300	1,936.00	21,876,800
日本テレビホールディングス	15,600	1,729.00	26,972,400
朝日放送グループホールディングス	1,700	716.00	1,217,200
テレビ朝日ホールディングス	4,700	2,049.00	9,630,300
スカパーJ S A Tホールディングス	12,900	484.00	6,243,600
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,375.00	3,325,000
日本BS放送	600	1,049.00	629,400
ビジョン	500	4,270.00	2,135,000
スマートパリュー	400	792.00	316,800
U S E N - N E X T H O L D I N G S	700	955.00	668,500
ワイヤレスゲート	800	557.00	445,600
コネクシオ	1,300	1,425.00	1,852,500
クロップス	400	675.00	270,000
日本電信電話	116,200	4,745.00	551,369,000
K D D I	149,800	2,686.00	402,362,800
ソフトバンク	135,800	1,353.00	183,737,400
光通信	2,000	17,900.00	35,800,000
N T T ドコモ	122,100	2,605.00	318,070,500
エムティーアイ	2,000	627.00	1,254,000
G M O インターネット	6,200	1,530.00	9,486,000
アイドママーケティングコミュニケーション	400	515.00	206,000
カドカワ	5,000	1,191.00	5,955,000
学研ホールディングス	600	4,095.00	2,457,000
ゼンリン	3,400	2,818.00	9,581,200
昭文社	800	443.00	354,400

インプレスホールディングス	1,600	147.00	235,200
アイネット	1,000	1,393.00	1,393,000
松竹	1,100	11,090.00	12,199,000
東宝	11,200	4,055.00	45,416,000
東映	700	13,760.00	9,632,000
エヌ・ティ・ティ・データ	45,200	1,323.00	59,799,600
ピー・シー・エー	200	2,032.00	406,400
ビジネスブレイン太田昭和	300	1,985.00	595,500
D T S	1,900	4,425.00	8,407,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,900	3,625.00	28,637,500
シーイーシー	1,800	2,017.00	3,630,600
カプコン	7,300	2,364.00	17,257,200
アイ・エス・ビー	300	2,001.00	600,300
ジャステック	1,000	951.00	951,000
S C S K	4,500	4,810.00	21,645,000
日本システムウエア	600	2,043.00	1,225,800
アイネス	2,200	1,325.00	2,915,000
T K C	1,400	4,010.00	5,614,000
富士ソフト	2,500	4,575.00	11,437,500
N S D	2,800	2,408.00	6,742,400
コナミホールディングス	7,000	4,590.00	32,130,000
福井コンピュータホールディングス	600	1,723.00	1,033,800
J B C Cホールディングス	1,400	1,722.00	2,410,800
ミロク情報サービス	1,700	2,644.00	4,494,800
ソフトバンクグループ	71,000	8,452.00	600,092,000
ハウスイ	100	870.00	87,000
高千穂交易	700	977.00	683,900
伊藤忠食品	400	4,630.00	1,852,000
エレマテック	800	1,830.00	1,464,000
J A L U X	500	2,475.00	1,237,500
あらた	900	4,305.00	3,874,500
トーメンデバイス	300	2,368.00	710,400
東京エレクトロン デバイス	600	1,816.00	1,089,600
フィールズ	1,500	761.00	1,141,500
双日	94,300	419.00	39,511,700
アルフレッサ ホールディングス	19,000	3,040.00	57,760,000

横浜冷凍	4,400	929.00	4,087,600	
神栄	200	761.00	152,200	
ラサ商事	900	864.00	777,600	
ラクーンホールディングス	800	689.00	551,200	
アルコニックス	1,800	1,144.00	2,059,200	
神戸物産	2,600	3,480.00	9,048,000	
あい ホールディングス	2,400	1,957.00	4,696,800	
ディーブイエックス	600	1,105.00	663,000	
ダイワボウホールディングス	1,600	5,950.00	9,520,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	4,700	1,503.00	7,064,100	
ラクト・ジャパン	400	8,370.00	3,348,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,200	1,112.00	3,558,400	
八洲電機	1,300	820.00	1,066,000	
メディアスホールディングス	900	693.00	623,700	
U K C ホールディングス	1,100	1,995.00	2,194,500	
ジューテックホールディングス	400	993.00	397,200	
大光	400	569.00	227,600	
O C H I ホールディングス	500	1,130.00	565,000	
T O K A I ホールディングス	9,000	903.00	8,127,000	
黒谷	300	477.00	143,100	
C o m i n i x	300	808.00	242,400	
三洋貿易	900	1,812.00	1,630,800	
ビューティガレージ	300	1,576.00	472,800	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,035.00	1,138,500	
ミタチ産業	400	746.00	298,400	
シップヘルスケアホールディングス	3,600	4,130.00	14,868,000	
明治電機工業	600	1,813.00	1,087,800	
デリカフーズホールディングス	300	1,353.00	405,900	
スターティアホールディングス	300	604.00	181,200	
コメダホールディングス	3,900	2,100.00	8,190,000	
富士興産	700	634.00	443,800	
協栄産業	200	1,487.00	297,400	
小野建	1,500	1,681.00	2,521,500	
南陽	300	2,301.00	690,300	
佐島電機	1,300	922.00	1,198,600	
エコートレーディング	400	578.00	231,200	

伯東	1,200	1,171.00	1,405,200	
コンドーテック	1,400	962.00	1,346,800	
中山福	1,000	519.00	519,000	
ナガイレーベン	2,500	2,235.00	5,587,500	
三菱食品	1,900	2,936.00	5,578,400	
松田産業	1,200	1,455.00	1,746,000	
第一興商	2,500	5,270.00	13,175,000	
メディパルホールディングス	18,400	2,608.00	47,987,200	
S P K	400	2,295.00	918,000	
萩原電気ホールディングス	600	2,826.00	1,695,600	
アズワン	1,200	7,950.00	9,540,000	
スズデン	600	1,530.00	918,000	
シモジマ	1,000	1,087.00	1,087,000	
ドウシシャ	1,600	1,645.00	2,632,000	
小津産業	400	1,852.00	740,800	
高速	1,000	1,055.00	1,055,000	
たけびし	600	1,400.00	840,000	
リックス	400	1,472.00	588,800	
丸文	1,500	737.00	1,105,500	
ハビネット	1,400	1,567.00	2,193,800	
橋本総業ホールディングス	300	1,397.00	419,100	
日本ライフライン	5,400	1,642.00	8,866,800	
タカショー	1,000	418.00	418,000	
エクセル	600	1,982.00	1,189,200	
マルカキカイ	600	2,037.00	1,222,200	
I D O M	5,800	420.00	2,436,000	
日本エム・ディ・エム	1,000	1,095.00	1,095,000	
進和	1,000	2,084.00	2,084,000	
エスケイジャパン	400	694.00	277,600	
ダイترون	800	1,335.00	1,068,000	
シークス	2,200	1,556.00	3,423,200	
田中商事	600	547.00	328,200	
オーハシテクニカ	1,000	1,279.00	1,279,000	
白銅	500	1,658.00	829,000	
伊藤忠商事	119,200	1,982.00	236,254,400	
丸紅	168,100	843.10	141,725,110	

高島	300	1,746.00	523,800
長瀬産業	9,600	1,610.00	15,456,000
蝶理	1,100	1,572.00	1,729,200
豊田通商	19,000	3,470.00	65,930,000
三共生興	2,900	404.00	1,171,600
兼松	6,800	1,337.00	9,091,600
ツカモトコーポレーション	300	1,009.00	302,700
三井物産	140,500	1,759.50	247,209,750
日本紙パルプ商事	1,000	3,995.00	3,995,000
日立ハイテクノロジーズ	5,200	4,100.00	21,320,000
カメイ	2,200	1,164.00	2,560,800
東都水産	300	2,390.00	717,000
OUGホールディングス	300	2,453.00	735,900
スターゼン	600	3,635.00	2,181,000
山善	6,600	1,130.00	7,458,000
椿本興業	400	3,735.00	1,494,000
住友商事	100,800	1,684.50	169,797,600
内田洋行	800	2,228.00	1,782,400
三菱商事	119,700	3,126.00	374,182,200
第一実業	800	3,455.00	2,764,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,900	2,063.00	10,108,700
西華産業	1,000	1,483.00	1,483,000
佐藤商事	1,500	924.00	1,386,000
菱洋エレクトロ	1,700	1,514.00	2,573,800
東京産業	1,700	526.00	894,200
ユアサ商事	1,700	3,335.00	5,669,500
神鋼商事	400	2,612.00	1,044,800
小林産業	1,100	271.00	298,100
阪和興業	2,900	3,065.00	8,888,500
正栄食品工業	900	2,797.00	2,517,300
カナデン	1,600	1,227.00	1,963,200
菱電商事	1,400	1,368.00	1,915,200
フルサト工業	1,000	1,645.00	1,645,000
岩谷産業	3,800	3,740.00	14,212,000
すてきナイスグループ	700	846.00	592,200
昭光通商	700	640.00	448,000



ニチモウ	300	1,832.00	549,600	
極東貿易	500	1,624.00	812,000	
イワキ	2,100	405.00	850,500	
三愛石油	4,600	979.00	4,503,400	
稲畑産業	4,100	1,489.00	6,104,900	
G S I クレオス	500	1,242.00	621,000	
明和産業	1,600	425.00	680,000	
ワキタ	3,600	1,162.00	4,183,200	
東邦ホールディングス	5,100	2,705.00	13,795,500	
サンゲツ	5,100	2,077.00	10,592,700	
ミツウロコグループホールディングス	2,500	781.00	1,952,500	
シナネンホールディングス	700	2,243.00	1,570,100	
伊藤忠エネクス	3,700	938.00	3,470,600	
サンリオ	5,300	2,265.00	12,004,500	
サンワテクノス	1,000	980.00	980,000	
リョーサン	1,900	3,030.00	5,757,000	
新光商事	1,600	1,819.00	2,910,400	
トーホー	800	2,031.00	1,624,800	
三信電気	1,400	1,721.00	2,409,400	
東陽テクニカ	2,000	843.00	1,686,000	
モスフードサービス	2,200	2,765.00	6,083,000	
加賀電子	1,700	2,073.00	3,524,100	
ソーダニッカ	1,800	532.00	957,600	
立花エレテック	1,300	1,573.00	2,044,900	
フォーバル	800	840.00	672,000	
P A L T A C	3,100	5,300.00	16,430,000	
三谷産業	2,000	276.00	552,000	
太平洋興発	700	729.00	510,300	
西本W i s m e t t a cホールディングス	400	4,655.00	1,862,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,130.00	113,000	
国際紙パルプ商事	3,100	268.00	830,800	
ヤマタネ	900	1,690.00	1,521,000	
丸紅建材リース	200	1,885.00	377,000	
日鉄住金物産	1,200	4,615.00	5,538,000	
泉州電業	600	2,544.00	1,526,400	
トラスコ中山	3,500	2,965.00	10,377,500	

オートバックスセブン	6,800	1,868.00	12,702,400
モリト	1,200	721.00	865,200
加藤産業	2,700	3,245.00	8,761,500
北恵	400	925.00	370,000
イノテック	1,100	1,028.00	1,130,800
イエローハット	1,600	2,667.00	4,267,200
J Kホールディングス	1,500	551.00	826,500
日伝	1,400	1,586.00	2,220,400
北沢産業	1,400	280.00	392,000
杉本商事	900	1,718.00	1,546,200
因幡電機産業	2,400	4,600.00	11,040,000
バイテックホールディングス	800	1,974.00	1,579,200
東テク	600	2,319.00	1,391,400
ミスミグループ本社	21,300	2,586.00	55,081,800
アルテック	1,400	226.00	316,400
タキヒヨー	500	1,763.00	881,500
蔵王産業	300	1,282.00	384,600
スズケン	7,800	5,800.00	45,240,000
ジェコス	1,200	1,044.00	1,252,800
ルネサスイーストン	1,600	427.00	683,200
ローソン	4,300	6,750.00	29,025,000
サンエー	1,300	4,365.00	5,674,500
カワチ薬品	1,300	2,190.00	2,847,000
エービーシー・マート	2,700	6,360.00	17,172,000
ハードオフコーポレーション	700	809.00	566,300
アスクル	1,800	2,168.00	3,902,400
ゲオホールディングス	2,600	1,672.00	4,347,200
アダストリア	2,400	2,040.00	4,896,000
ジーフット	1,000	667.00	667,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	750.00	225,000
くらコーポレーション	1,000	5,630.00	5,630,000
キャンドウ	800	1,535.00	1,228,000
パルグループホールディングス	900	3,055.00	2,749,500
エディオン	7,200	1,013.00	7,293,600
サーラコーポレーション	3,500	578.00	2,023,000
ワッツ	600	727.00	436,200

ハローズ	700	2,150.00	1,505,000
あみやき亭	400	3,595.00	1,438,000
ひらまつ	3,400	336.00	1,142,400
大黒天物産	400	4,070.00	1,628,000
ハニーズホールディングス	1,500	948.00	1,422,000
ファーマライズホールディングス	400	565.00	226,000
アルペン	1,300	1,656.00	2,152,800
ハブ	600	947.00	568,200
クオールホールディングス	2,500	1,505.00	3,762,500
ジーンズ	1,200	5,590.00	6,708,000
ビックカメラ	9,100	1,288.00	11,720,800
D C Mホールディングス	9,200	1,110.00	10,212,000
ペッパーフードサービス	1,400	2,691.00	3,767,400
MonotaRO	10,800	2,513.00	27,140,400
東京一番フーズ	500	583.00	291,500
D Dホールディングス	400	2,132.00	852,800
きちりホールディングス	500	692.00	346,000
アークランドサービスホールディングス	1,300	2,064.00	2,683,200
J . フロント リテイリング	21,800	1,263.00	27,533,400
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,113.00	6,339,000
マツモトキヨシホールディングス	7,100	3,470.00	24,637,000
ブロンコピリー	900	2,612.00	2,350,800
Z O Z O	18,400	2,030.00	37,352,000
トレジャー・ファクトリー	500	811.00	405,500
物語コーポレーション	400	9,560.00	3,824,000
ココカラファイン	1,900	5,010.00	9,519,000
三越伊勢丹ホールディングス	31,900	1,104.00	35,217,600
H a m e e	500	889.00	444,500
ウエルシアホールディングス	4,500	4,155.00	18,697,500
クリエイトSDホールディングス	2,500	2,840.00	7,100,000
丸善C H I ホールディングス	2,000	316.00	632,000
ミサワ	400	417.00	166,800
ティーライフ	200	900.00	180,000
エー・ピーカンパニー	400	450.00	180,000
チムニー	500	2,537.00	1,268,500
シュッピン	1,200	715.00	858,000

ネクステージ	2,600	1,035.00	2,691,000	
ジョイフル本田	5,000	1,361.00	6,805,000	
鳥貴族	600	1,732.00	1,039,200	
キリン堂ホールディングス	700	1,406.00	984,200	
ホットランド	900	1,272.00	1,144,800	
すかいらーくホールディングス	15,900	1,830.00	29,097,000	
綿半ホールディングス	700	1,978.00	1,384,600	
ヨシックス	300	2,913.00	873,900	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,900	1,193.00	5,845,700	
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	677.00	473,900	
B E E N O S	400	1,285.00	514,000	
あさひ	1,400	1,482.00	2,074,800	
日本調剤	600	3,760.00	2,256,000	
コスモス薬品	700	21,000.00	14,700,000	
トーエル	800	698.00	558,400	
オンリー	300	1,013.00	303,900	
セブン&アイ・ホールディングス	71,400	4,776.00	341,006,400	
薬王堂	700	2,597.00	1,817,900	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,600	1,256.00	5,777,600	
ツルハホールディングス	3,700	10,160.00	37,592,000	
サンマルクホールディングス	1,300	2,514.00	3,268,200	
フェリシモ	400	1,087.00	434,800	
トリドールホールディングス	2,100	1,994.00	4,187,400	
T O K Y O B A S E	1,500	838.00	1,257,000	
ウイルプラスホールディングス	100	767.00	76,700	
ジャパンミート	700	1,702.00	1,191,400	
サツドラホールディングス	300	1,833.00	549,900	
デファクトスタンダード	100	399.00	39,900	
ダイユー・リックホールディングス	900	968.00	871,200	
パロックジャパンリミテッド	1,400	911.00	1,275,400	
クスリのアオキホールディングス	1,600	7,330.00	11,728,000	
力の源ホールディングス	500	808.00	404,000	
スシローグローバルホールディングス	1,900	6,680.00	12,692,000	
L I X I L ビバ	1,400	1,525.00	2,135,000	
メディカルシステムネットワーク	1,800	423.00	761,400	

はるやまホールディングス	800	837.00	669,600	
ノジマ	3,000	1,978.00	5,934,000	
カップ・クリエイト	2,400	1,371.00	3,290,400	
ライトオン	1,500	831.00	1,246,500	
ジーンズメイト	600	413.00	247,800	
良品計画	2,400	27,000.00	64,800,000	
三城ホールディングス	2,100	405.00	850,500	
アドヴァン	2,600	991.00	2,576,600	
アルビス	700	2,438.00	1,706,600	
コナカ	2,200	452.00	994,400	
ハウス オブ ローゼ	200	1,859.00	371,800	
G - 7ホールディングス	500	2,348.00	1,174,000	
イオン北海道	1,700	787.00	1,337,900	
コジマ	2,600	604.00	1,570,400	
ヒマラヤ	600	954.00	572,400	
コーナン商事	2,200	2,771.00	6,096,200	
エコス	600	1,664.00	998,400	
ワタミ	2,300	1,411.00	3,245,300	
マルシェ	500	760.00	380,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	10,200	6,460.00	65,892,000	
西松屋チェーン	3,700	898.00	3,322,600	
ゼンショーホールディングス	8,000	2,529.00	20,232,000	
幸楽苑ホールディングス	1,100	2,248.00	2,472,800	
ハークスレイ	400	1,079.00	431,600	
サイゼリヤ	2,800	2,087.00	5,843,600	
V Tホールディングス	5,800	436.00	2,528,800	
魚力	500	1,425.00	712,500	
ポプラ	500	593.00	296,500	
フジ・コーポレーション	300	2,072.00	621,600	
ユナイテッドアローズ	1,900	3,755.00	7,134,500	
ハイデイ日高	2,200	2,172.00	4,778,400	
京都きもの友禅	1,100	413.00	454,300	
コロワイド	5,700	2,397.00	13,662,900	
ピーシーデボコーポレーション	2,200	443.00	974,600	
壱番屋	1,200	4,615.00	5,538,000	
P L A N T	400	1,003.00	401,200	

スギホールディングス	3,700	4,615.00	17,075,500	
ヴィア・ホールディングス	2,100	669.00	1,404,900	
スクロール	2,700	395.00	1,066,500	
ヨンドシーホールディングス	1,900	2,218.00	4,214,200	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	4,800	13,350.00	64,080,000	
木曾路	2,100	2,485.00	5,218,500	
S R Sホールディングス	2,000	991.00	1,982,000	
千趣会	3,200	248.00	793,600	
タカキュー	1,500	180.00	270,000	
ケーヨー	3,200	529.00	1,692,800	
上新電機	2,000	2,320.00	4,640,000	
日本瓦斯	2,800	4,125.00	11,550,000	
ロイヤルホールディングス	3,000	2,670.00	8,010,000	
東天紅	100	1,310.00	131,000	
いなげや	1,900	1,300.00	2,470,000	
島忠	3,900	3,095.00	12,070,500	
チヨダ	1,800	1,850.00	3,330,000	
ライフコーポレーション	1,300	2,445.00	3,178,500	
リンガーハット	2,100	2,351.00	4,937,100	
MrMaxHD	2,300	502.00	1,154,600	
テンアライド	1,700	393.00	668,100	
AOKIホールディングス	3,400	1,284.00	4,365,600	
オークワ	2,500	1,046.00	2,615,000	
コメリ	2,600	2,646.00	6,879,600	
青山商事	3,000	2,720.00	8,160,000	
しまむら	2,000	9,490.00	18,980,000	
はせがわ	1,000	395.00	395,000	
高島屋	13,400	1,483.00	19,872,200	
松屋	3,400	1,069.00	3,634,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,700	1,604.00	13,954,800	
近鉄百貨店	600	3,360.00	2,016,000	
パルコ	1,600	1,067.00	1,707,200	
丸井グループ	14,500	2,214.00	32,103,000	
アクシアル リテイリング	1,400	3,390.00	4,746,000	
イオン	65,600	2,274.00	149,174,400	
イズミ	3,500	5,530.00	19,355,000	

平和堂	3,500	2,590.00	9,065,000
フジ	2,100	1,872.00	3,931,200
ヤオコー	1,900	5,840.00	11,096,000
ゼビオホールディングス	2,100	1,300.00	2,730,000
ケーズホールディングス	17,700	1,106.00	19,576,200
Olympicグループ	1,000	684.00	684,000
日産東京販売ホールディングス	2,500	315.00	787,500
Genky DrugStores	800	2,659.00	2,127,200
総合メディカルホールディングス	1,500	1,876.00	2,814,000
ブックオフグループホールディングス	900	752.00	676,800
アインホールディングス	2,300	7,860.00	18,078,000
元気寿司	500	3,705.00	1,852,500
ヤマダ電機	52,000	542.00	28,184,000
アークランドサカモト	2,900	1,450.00	4,205,000
ニトリホールディングス	7,400	14,755.00	109,187,000
愛眼	1,400	299.00	418,600
ケーユーホールディングス	800	773.00	618,400
吉野家ホールディングス	6,000	1,758.00	10,548,000
松屋フーズホールディングス	800	3,630.00	2,904,000
サガミホールディングス	2,300	1,325.00	3,047,500
関西スーパーマーケット	1,300	993.00	1,290,900
王将フードサービス	1,200	7,140.00	8,568,000
プレナス	1,900	1,846.00	3,507,400
ミニストップ	1,300	1,970.00	2,561,000
アークス	3,200	2,493.00	7,977,600
パローホールディングス	3,700	2,668.00	9,871,600
藤久	100	745.00	74,500
ベルク	800	4,810.00	3,848,000
大庄	900	1,534.00	1,380,600
ファーストリテイリング	2,300	50,540.00	116,242,000
サンドラッグ	6,400	3,565.00	22,816,000
サクスパー ホールディングス	1,500	1,110.00	1,665,000
ヤマザワ	300	1,740.00	522,000
やまや	300	2,218.00	665,400
ベルーナ	4,200	885.00	3,717,000
島根銀行	400	699.00	279,600

じもとホールディングス	11,600	121.00	1,403,600	
めぶきフィナンシャルグループ	88,500	303.00	26,815,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,542.00	3,546,600	
九州フィナンシャルグループ	28,000	442.00	12,376,000	
ゆうちょ銀行	48,200	1,260.00	60,732,000	
富山第一銀行	4,000	382.00	1,528,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	108,700	442.00	48,045,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,900	981.00	10,692,900	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,900	828.00	6,541,200	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,619.00	2,428,500	
第四北越フィナンシャルグループ	3,000	3,140.00	9,420,000	
新生銀行	12,600	1,455.00	18,333,000	
あおぞら銀行	9,600	3,120.00	29,952,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,189,100	578.80	688,251,080	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	187,400	534.80	100,221,520	
三井住友トラスト・ホールディングス	33,600	4,126.00	138,633,600	
三井住友フィナンシャルグループ	120,300	3,983.00	479,154,900	代用有価証券 13,000株
千葉銀行	60,500	661.00	39,990,500	
群馬銀行	34,200	478.00	16,347,600	
武蔵野銀行	2,500	2,433.00	6,082,500	
千葉興業銀行	4,800	345.00	1,656,000	
筑波銀行	7,200	227.00	1,634,400	
七十七銀行	5,400	1,875.00	10,125,000	
青森銀行	1,300	2,760.00	3,588,000	
秋田銀行	1,100	2,180.00	2,398,000	
山形銀行	1,900	1,907.00	3,623,300	
岩手銀行	1,200	3,240.00	3,888,000	
東邦銀行	15,300	311.00	4,758,300	
東北銀行	900	1,052.00	946,800	
みちのく銀行	1,100	1,626.00	1,788,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,900	2,309.00	32,095,100	
静岡銀行	43,000	880.00	37,840,000	
十六銀行	2,300	2,336.00	5,372,800	
スルガ銀行	17,500	476.00	8,330,000	
八十二銀行	30,900	467.00	14,430,300	



山梨中央銀行	2,100	1,376.00	2,889,600
大垣共立銀行	2,700	2,261.00	6,104,700
福井銀行	1,500	1,594.00	2,391,000
北國銀行	1,800	3,345.00	6,021,000
清水銀行	700	1,574.00	1,101,800
富山銀行	300	3,080.00	924,000
滋賀銀行	3,400	2,515.00	8,551,000
南都銀行	2,000	2,233.00	4,466,000
百五銀行	15,400	393.00	6,052,200
京都銀行	6,100	4,560.00	27,816,000
紀陽銀行	6,100	1,564.00	9,540,400
ほくほくフィナンシャルグループ	11,400	1,233.00	14,056,200
広島銀行	25,200	628.00	15,825,600
山陰合同銀行	10,100	783.00	7,908,300
中国銀行	11,000	995.00	10,945,000
鳥取銀行	600	1,349.00	809,400
伊予銀行	22,600	603.00	13,627,800
百十四銀行	1,800	2,487.00	4,476,600
四国銀行	2,500	1,038.00	2,595,000
阿波銀行	2,700	2,961.00	7,994,700
大分銀行	1,000	3,320.00	3,320,000
宮崎銀行	1,100	2,762.00	3,038,200
佐賀銀行	1,000	1,715.00	1,715,000
十八銀行	1,000	2,551.00	2,551,000
沖縄銀行	1,600	3,140.00	5,024,000
琉球銀行	3,900	1,122.00	4,375,800
セブン銀行	57,700	345.00	19,906,500
みずほフィナンシャルグループ	2,320,000	174.80	405,536,000
高知銀行	700	758.00	530,600
山口フィナンシャルグループ	21,300	1,117.00	23,792,100
長野銀行	600	1,527.00	916,200
名古屋銀行	1,400	3,180.00	4,452,000
北洋銀行	25,800	290.00	7,482,000
愛知銀行	600	3,510.00	2,106,000
中京銀行	700	2,128.00	1,489,600
大光銀行	600	1,652.00	991,200

愛媛銀行	2,400	1,063.00	2,551,200
トマト銀行	600	1,058.00	634,800
京葉銀行	7,500	676.00	5,070,000
栃木銀行	8,900	233.00	2,073,700
北日本銀行	500	2,079.00	1,039,500
東和銀行	3,000	698.00	2,094,000
福島銀行	1,500	408.00	612,000
大東銀行	800	615.00	492,000
トモニホールディングス	13,200	404.00	5,332,800
フィデアホールディングス	16,600	137.00	2,274,200
池田泉州ホールディングス	18,100	298.00	5,393,800
F P G	5,400	1,057.00	5,707,800
マーキュリアインベストメント	700	706.00	494,200
S B Iホールディングス	20,400	2,197.00	44,818,800
ジャフコ	2,800	3,790.00	10,612,000
大和証券グループ本社	136,900	553.10	75,719,390
野村ホールディングス	300,300	442.20	132,792,660
岡三証券グループ	14,600	485.00	7,081,000
丸三証券	5,100	801.00	4,085,100
東洋証券	6,400	170.00	1,088,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20,300	487.00	9,886,100
光世証券	500	745.00	372,500
水戸証券	5,100	271.00	1,382,100
いちよし証券	3,600	879.00	3,164,400
松井証券	8,400	1,160.00	9,744,000
だいこう証券ビジネス	800	398.00	318,400
マネックスグループ	16,100	375.00	6,037,500
カブドットコム証券	12,800	541.00	6,924,800
極東証券	2,300	1,128.00	2,594,400
岩井コスモホールディングス	1,800	1,230.00	2,214,000
藍澤證券	3,300	650.00	2,145,000
マネーパートナーズグループ	2,100	290.00	609,000
かんぽ生命保険	6,500	2,521.00	16,386,500
S O M P Oホールディングス	30,100	4,124.00	124,132,400
アニコム ホールディングス	1,400	3,120.00	4,368,000

MS & ADインシュアランスグループホールディングス	44,600	3,264.00	145,574,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	14,100	2,116.00	29,835,600
第一生命ホールディングス	96,600	1,767.50	170,740,500
東京海上ホールディングス	61,900	5,392.00	333,764,800
T & Dホールディングス	52,800	1,386.50	73,207,200
アドバンスクリエイト	400	1,763.00	705,200
全国保証	4,800	3,860.00	18,528,000
ジェイリース	400	364.00	145,600
イントラスト	500	445.00	222,500
日本モーゲージサービス	300	1,308.00	392,400
C a s a	600	1,135.00	681,000
アルヒ	1,600	2,263.00	3,620,800
プレミアグループ	300	3,180.00	954,000
クレディセゾン	12,000	1,429.00	17,148,000
芙蓉総合リース	1,900	5,500.00	10,450,000
興銀リース	3,200	2,551.00	8,163,200
東京センチュリー	3,400	5,110.00	17,374,000
日本証券金融	7,600	612.00	4,651,200
アイフル	26,300	286.00	7,521,800
リコーリース	1,300	3,350.00	4,355,000
イオンフィナンシャルサービス	10,900	2,104.00	22,933,600
アコム	34,400	383.00	13,175,200
ジャックス	1,900	1,901.00	3,611,900
オリエントコーポレーション	46,300	125.00	5,787,500
日立キャピタル	4,000	2,450.00	9,800,000
アプラスフィナンシャル	8,500	85.00	722,500
オリックス	113,900	1,649.50	187,878,050
三菱UFJリース	38,500	560.00	21,560,000
九州リースサービス	900	671.00	603,900
日本取引所グループ	46,100	1,922.00	88,604,200
イー・ギャランティ	1,600	1,111.00	1,777,600
アサックス	700	549.00	384,300
NECキャピタルソリューション	700	1,611.00	1,127,700
いちご	21,700	375.00	8,137,500
日本駐車場開発	20,600	164.00	3,378,400

ヒューリック	35,600	1,005.00	35,778,000
三栄建築設計	700	1,669.00	1,168,300
スター・マイカ	800	1,475.00	1,180,000
野村不動産ホールディングス	11,400	2,104.00	23,985,600
三重交通グループホールディングス	3,500	621.00	2,173,500
サムティ	2,400	1,526.00	3,662,400
ディア・ライフ	2,200	450.00	990,000
コーセーアールイー	500	771.00	385,500
エー・ディー・ワークス	27,500	35.00	962,500
日本商業開発	1,100	1,518.00	1,669,800
プレサンスコーポレーション	2,700	1,517.00	4,095,900
ユニゾホールディングス	2,600	2,157.00	5,608,200
THEグローバル社	900	542.00	487,800
日本管理センター	1,100	858.00	943,800
サンセイランディック	500	796.00	398,000
エストラスト	300	770.00	231,000
フージャースホールディングス	3,700	670.00	2,479,000
オープンハウス	2,800	4,600.00	12,880,000
東急不動産ホールディングス	46,000	600.00	27,600,000
飯田グループホールディングス	14,200	2,018.00	28,655,600
イーランド	300	672.00	201,600
ムゲンエステート	1,200	589.00	706,800
ビーロット	300	1,296.00	388,800
ファーストブラザーズ	500	1,053.00	526,500
ハウスドゥ	900	1,246.00	1,121,400
シーアールイー	600	916.00	549,600
プロパティエージェント	200	1,002.00	200,400
ケイアイスター不動産	500	1,883.00	941,500
アグレ都市デザイン	200	622.00	124,400
グッドコムアセット	300	1,536.00	460,800
ジェイ・エス・ビー	100	3,835.00	383,500
テンポイノベーション	100	1,697.00	169,700
パーク24	10,000	2,671.00	26,710,000
バラカ	400	1,664.00	665,600
三井不動産	90,600	2,656.50	240,678,900
三菱地所	119,600	1,942.00	232,263,200

平和不動産	3,300	2,062.00	6,804,600
東京建物	18,700	1,318.00	24,646,600
ダイビル	5,100	1,103.00	5,625,300
京阪神ビルディング	3,100	876.00	2,715,600
住友不動産	38,400	4,160.00	159,744,000
テーオーシー	4,000	825.00	3,300,000
東京楽天地	200	4,655.00	931,000
レオパレス21	21,200	498.00	10,557,600
スターツコーポレーション	2,300	2,520.00	5,796,000
フジ住宅	2,200	851.00	1,872,200
空港施設	2,000	543.00	1,086,000
明和地所	1,000	603.00	603,000
ゴールドクレスト	1,400	1,642.00	2,298,800
日本エスリード	700	1,565.00	1,095,500
日神不動産	2,500	447.00	1,117,500
日本エスコン	3,100	824.00	2,554,400
タカラレーベン	8,000	349.00	2,792,000
サンヨーハウジング名古屋	1,000	915.00	915,000
イオンモール	8,600	1,871.00	16,090,600
毎日コムネット	300	747.00	224,100
ファースト住建	700	1,164.00	814,800
カチタス	1,900	3,210.00	6,099,000
トーセイ	2,400	1,017.00	2,440,800
穴吹興産	200	2,710.00	542,000
サンフロンティア不動産	2,400	1,219.00	2,925,600
エフ・ジェー・ネクスト	1,500	908.00	1,362,000
インテリックス	500	653.00	326,500
ランドビジネス	900	758.00	682,200
グランディハウス	1,600	414.00	662,400
日本空港ビルデング	5,400	4,400.00	23,760,000
日本工営	1,100	2,600.00	2,860,000
LIFULL	6,400	721.00	4,614,400
ジェイエイシーリクルートメント	1,300	2,224.00	2,891,200
日本M&Aセンター	12,300	2,718.00	33,431,400
メンバーズ	600	1,129.00	677,400
中広	200	545.00	109,000

タケエイ	1,700	769.00	1,307,300
E・Jホールディングス	200	1,057.00	211,400
トラスト・テック	900	3,320.00	2,988,000
コシダカホールディングス	4,400	1,603.00	7,053,200
アルトナー	300	910.00	273,000
パソナグループ	2,000	1,388.00	2,776,000
C D S	400	1,121.00	448,400
リンクアンドモチベーション	3,100	911.00	2,824,100
G C A	1,700	781.00	1,327,700
エス・エム・エス	6,100	1,821.00	11,108,100
サニーサイドアップ	200	1,335.00	267,000
パーソルホールディングス	16,500	1,997.00	32,950,500
リニカル	900	1,425.00	1,282,500
クックパッド	5,200	314.00	1,632,800
エスクリ	400	615.00	246,000
アイ・ケイ・ケイ	800	735.00	588,000
学情	700	1,299.00	909,300
スタジオアリス	800	2,437.00	1,949,600
シミックホールディングス	900	1,579.00	1,421,100
N J S	400	1,517.00	606,800
総合警備保障	6,600	4,870.00	32,142,000
カカクコム	12,400	1,908.00	23,659,200
アイロムグループ	600	1,585.00	951,000
セントケア・ホールディング	900	519.00	467,100
サイネックス	300	704.00	211,200
ルネサンス	900	1,950.00	1,755,000
ディップ	2,700	2,034.00	5,491,800
オプトホールディング	1,000	1,751.00	1,751,000
新日本科学	2,300	755.00	1,736,500
ツクイ	3,900	815.00	3,178,500
キャリアデザインセンター	500	1,228.00	614,000
ベネフィット・ワン	2,300	3,860.00	8,878,000
エムスリー	34,800	1,628.00	56,654,400
ツカダ・グローバルホールディング	1,000	616.00	616,000
プラス	100	563.00	56,300
アウトソーシング	8,700	1,287.00	11,196,900

ウェルネット	1,600	992.00	1,587,200
ワールドホールディングス	400	2,839.00	1,135,600
ディー・エヌ・エー	8,900	1,839.00	16,367,100
博報堂DYホールディングス	23,000	1,691.00	38,893,000
ぐるなび	2,400	745.00	1,788,000
エスアールジータカミヤ	1,700	707.00	1,201,900
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	1,355.00	1,761,500
ファンコミュニケーションズ	4,600	560.00	2,576,000
ライク	600	994.00	596,400
ビジネス・ブレークスルー	700	332.00	232,400
WDBホールディングス	800	2,674.00	2,139,200
ティア	800	612.00	489,600
CDG	100	1,298.00	129,800
バリューコマース	1,100	1,937.00	2,130,700
インフォマート	9,100	1,200.00	10,920,000
J Pホールディングス	4,800	286.00	1,372,800
エコナックホールディングス	3,300	118.00	389,400
E P Sホールディングス	2,500	1,700.00	4,250,000
レグス	400	954.00	381,600
プレステージ・インターナショナル	3,100	1,362.00	4,222,200
アミューズ	1,000	2,478.00	2,478,000
ドリームインキュベータ	500	1,473.00	736,500
クイック	1,000	1,607.00	1,607,000
T A C	1,000	237.00	237,000
ケネディクス	14,600	598.00	8,730,800
電通	20,100	5,260.00	105,726,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,972.00	1,380,400
ぴあ	500	3,740.00	1,870,000
イオンファンタジー	500	2,739.00	1,369,500
シーティーエス	1,900	655.00	1,244,500
みらかホールディングス	4,600	2,775.00	12,765,000
アルプス技研	1,500	1,740.00	2,610,000
日本空調サービス	1,900	671.00	1,274,900
オリエンタルランド	19,500	11,570.00	225,615,000
ダスキン	4,500	2,581.00	11,614,500
明光ネットワークジャパン	2,100	940.00	1,974,000

ファルコホールディングス	900	1,478.00	1,330,200
秀英予備校	400	488.00	195,200
田谷	300	624.00	187,200
ラウンドワン	5,200	1,306.00	6,791,200
リゾートトラスト	7,000	1,573.00	11,011,000
ビー・エム・エル	2,100	3,075.00	6,457,500
ワタベウェディング	300	718.00	215,400
りらいあコミュニケーションズ	3,000	947.00	2,841,000
リソー教育	8,400	460.00	3,864,000
早稲田アカデミー	300	1,862.00	558,600
ユー・エス・エス	20,200	1,946.00	39,309,200
東京個別指導学院	600	1,305.00	783,000
サイバーエージェント	10,200	3,450.00	35,190,000
楽天	77,100	809.00	62,373,900
クリーク・アンド・リバー社	1,000	1,161.00	1,161,000
テー・オー・ダブリュー	1,600	716.00	1,145,600
セントラルスポーツ	600	3,400.00	2,040,000
フルキャストホールディングス	1,600	1,969.00	3,150,400
エン・ジャパン	1,800	4,270.00	7,686,000
リソルホールディングス	200	4,070.00	814,000
テクノプロ・ホールディングス	3,300	6,200.00	20,460,000
アトラ	300	459.00	137,700
インターワークス	300	755.00	226,500
アイ・アールジャパンホールディングス	500	1,243.00	621,500
Keeper 技研	600	946.00	567,600
ファーストロジック	300	652.00	195,600
三機サービス	300	1,412.00	423,600
Gunosy	1,200	2,518.00	3,021,600
デザインワン・ジャパン	300	316.00	94,800
イー・ガーディアン	800	2,063.00	1,650,400
リブセンス	900	287.00	258,300
ジャパンマテリアル	4,500	1,292.00	5,814,000
ベクトル	2,000	1,378.00	2,756,000
ウチヤマホールディングス	800	448.00	358,400
チャーム・ケア・コーポレーション	400	1,511.00	604,400
ライクキッズネクスト	400	856.00	342,400



キャリアリンク	600	348.00	208,800
I B J	1,100	879.00	966,900
アサテ	700	2,084.00	1,458,800
N・フィールド	1,100	891.00	980,100
バリューHR	300	1,836.00	550,800
M&Aキャピタルパートナーズ	400	5,530.00	2,212,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,312.00	918,400
E R Iホールディングス	500	758.00	379,000
アピスト	300	3,190.00	957,000
シグマクシス	800	881.00	704,800
ウィルグループ	1,100	945.00	1,039,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,300	257.00	591,100
日本ビューホテル	500	1,107.00	553,500
リクルートホールディングス	118,500	2,969.50	351,885,750
エラン	1,200	1,311.00	1,573,200
土木管理総合試験所	800	524.00	419,200
日本郵政	135,500	1,348.00	182,654,000
ベルシステム24ホールディングス	2,800	1,459.00	4,085,200
鎌倉新書	1,200	1,462.00	1,754,400
一蔵	200	616.00	123,200
L I T A L I C O	400	2,081.00	832,400
グローバルグループ	200	950.00	190,000
エボラブルアジア	500	2,221.00	1,110,500
アトラエ	300	2,279.00	683,700
ストライク	400	2,092.00	836,800
ソラスト	4,000	1,069.00	4,276,000
セラク	400	653.00	261,200
インソース	600	2,259.00	1,355,400
ベイカレント・コンサルティング	900	3,360.00	3,024,000
Orchestra Holdings	200	923.00	184,600
アイモバイル	400	736.00	294,400
キャリアインデックス	600	1,242.00	745,200
MS - J a p a n	700	1,513.00	1,059,100
船場	300	832.00	249,600
グレイステクノロジー	500	2,052.00	1,026,000

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,000	1,808.00	1,808,000	
フルテック	200	1,081.00	216,200	
グリーンズ	500	1,452.00	726,000	
ツナグ・ソリューションズ	100	671.00	67,100	
日総工産	400	2,079.00	831,600	
キュービーネットホールディングス	800	1,902.00	1,521,600	
スプリックス	500	2,399.00	1,199,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	700	915.00	640,500	
リログループ	9,000	2,956.00	26,604,000	
東祥	1,000	3,255.00	3,255,000	
エイチ・アイ・エス	2,900	4,235.00	12,281,500	
ラックランド	300	2,018.00	605,400	
共立メンテナンス	2,500	5,170.00	12,925,000	
イチネンホールディングス	1,700	1,207.00	2,051,900	
建設技術研究所	1,200	1,398.00	1,677,600	
スペース	1,100	1,250.00	1,375,000	
長大	700	803.00	562,100	
燦ホールディングス	400	2,429.00	971,600	
スバル興業	100	5,490.00	549,000	
東京テアトル	700	1,240.00	868,000	
タナベ経営	300	1,280.00	384,000	
ナガワ	500	5,300.00	2,650,000	
よみうりランド	400	3,845.00	1,538,000	
東京都競馬	1,100	3,055.00	3,360,500	
常磐興産	700	1,560.00	1,092,000	
カナモト	2,500	3,045.00	7,612,500	
東京ドーム	6,200	945.00	5,859,000	
西尾レントオール	1,700	3,450.00	5,865,000	
トランス・コスモス	1,800	2,103.00	3,785,400	
乃村工藝社	3,900	3,075.00	11,992,500	
藤田観光	700	2,717.00	1,901,900	
KNT-CTホールディングス	900	1,274.00	1,146,600	
日本管財	1,800	1,904.00	3,427,200	
トーカイ	1,600	2,866.00	4,585,600	
白洋舎	200	2,681.00	536,200	

セコム	17,600	9,098.00	160,124,800	
セントラル警備保障	800	4,435.00	3,548,000	
丹青社	3,100	1,144.00	3,546,400	
メイテック	2,100	4,935.00	10,363,500	
応用地質	1,800	1,182.00	2,127,600	
船井総研ホールディングス	3,500	1,884.00	6,594,000	
進学会ホールディングス	800	585.00	468,000	
オオバ	1,400	625.00	875,000	
いであ	400	975.00	390,000	
学究社	600	1,334.00	800,400	
ベネッセホールディングス	6,100	2,917.00	17,793,700	
イオンディライト	2,000	4,055.00	8,110,000	
ナック	1,100	1,054.00	1,159,400	
ニチイ学館	2,400	1,207.00	2,896,800	
ダイセキ	2,800	2,599.00	7,277,200	
ステップ	600	1,345.00	807,000	
合 計	20,025,400		39,111,235,220	

## (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2019年 2月28日現在です。

## 【財形株投（一般財形30）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	95,943,118円
負債総額	97,494円
純資産総額（ - ）	95,845,624円
発行済口数	95,546,346口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0031円

## 【財形株投（一般財形50）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	228,573,653円
負債総額	238,161円
純資産総額（ - ）	228,335,492円
発行済口数	213,135,696口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0713円

## 【財形株投（年金・住宅財形30）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	206,208,145円
負債総額	214,418円
純資産総額（ - ）	205,993,727円
発行済口数	204,830,842口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0057円

（参考）

財形公社債マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	316,781,870円
負債総額	107円
純資産総額（ - ）	316,781,763円
発行済口数	247,411,144口
1口当たり純資産額（ / ）	1.280円

## インデックス マザーファンド TOPIX

### 純資産額計算書

資産総額	39,883,822,412円
負債総額	339,679,589円
純資産総額（ - ）	39,544,142,823円
発行済口数	19,988,599,755口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9783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なわないものとします。

#### （5）受益権の再分割

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

#### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解

約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

## 第二部【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

2019年2月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の意思決定機関（2019年2月末現在）

###### ・株主総会

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

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

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

###### ・監査役会

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

##### (3) 運用の意思決定プロセス（2019年2月末現在）

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

### 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2019年2月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	816	174,711

株式投資信託	772	148,744
単位型	250	8,575
追加型	522	140,169
公社債投資信託	44	25,966
単位型	30	562
追加型	14	25,404

### 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			
	資本剰余金	利益剰余金		

	資本金	資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金	利益剰余金合計	自己株式	株主資本合計
				繰越利益剰余金			
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						株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926
当期変動額							
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	繰延ヘッジ	評価・換算	

	評価差額金	損益	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</p> <p>  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</p> <p>  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。</p> <p>  なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>  建物 3年～15年</p> <p>  器具備品 5年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>  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</p> <p>  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</p> <p>  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</p> <p>  従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>  退職給付見込額の期間帰属方法   退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p>	

4 ヘッジ会計の方法	<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>
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理</p> <p>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。 受取配当金 1,550百万円 デリバティブ収益 347百万円 支払利息 58百万円	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 979百万円 デリバティブ収益 407百万円 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 解約不能のものに係る未経過リース料	オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料
1年内 865百万円	1年内 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ースで実施しております。さらに、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

#### 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額( 1)	時価( 1)	差額
(1) 現金・預金	16,761	16,761	-
(2) 未収委託者報酬	10,757	10,757	-
(3) 未収収益	2,799	2,799	-
(4) 関係会社短期貸付金	962	962	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	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、自ら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 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額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	投資信託	6,299	5,590	708

が取得原価を超えるもの	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

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)
株価指数先物取引				

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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

	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 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(シンガポールドル貸建)(注1)	65 (SGD 800 千) (注2)	関係会社短期貸付金	385 (SGD 4,800千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	13 (SGD 177 千)	未収収益	8 (SGD 105千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	4,422 (注4)	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建)(注3)	3	未収収益	3
						-	増資の引受(注5)	1,501 (SGD 20,000 千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542 (USD 千) (注6)	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入(米ドル貸建)(注7)	5,549 (USD 50,000 千) (注8)	関係会社短期借入金	-
							借入金利息(米ドル貸建)(注7)	48 (USD 453 千)	未払費用	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。

- 5 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、記載しておりません。

### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第58期(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	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)
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おりません。

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第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)
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	第59期
	(平成29年 3月31日)	(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	2,462
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	
その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						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	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 定額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。</p>

<p>4 ヘッジ会計の方法</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>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残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>(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>
---



## 3 消費税等の取扱い

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

## 4 保証債務

当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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 その他有価証券	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 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(中間貸借対照表計上額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 その他有価証券

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	8,029	6,865	1,163
	小計	8,029	6,865	1,163
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,612	3,725	113
	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) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当

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

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であつて、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
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### <再信託受託会社の概要>

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額 : 51,000百万円(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(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2018年9月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 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

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(2018年9月末現在)

(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23日	有価証券届出書の訂正届出書
2018年 5月 1日	有価証券届出書
2018年 5月 1日	有価証券報告書
2018年11月 1日	有価証券届出書の訂正届出書
2018年11月 1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31年3月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### P w Cあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（一般財形30）の平成30年2月2日から平成31年2月4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、財形株投（一般財形30）の平成31年2月4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31年3月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### P w Cあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（一般財形50）の平成30年2月2日から平成31年2月4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、財形株投（一般財形50）の平成31年2月4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31年3月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

## PWC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」に掲げられている財形株投（年金・住宅財形30）の平成30年2月2日から平成31年2月4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、財形株投（年金・住宅財形30）の平成31年2月4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。