

【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8月30日提出
【計算期間】	第15期(自 2018年6月1日至 2019年5月31日)
【ファンド名】	年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）
【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

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

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

インデックス型

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

株式 一般

当ファンドは、株式に投資を行いません。「株式 一般」とは、大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。

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。

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 (<https://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

ファンドの特色

1. TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざします。

主として、TOPIX(東証株価指数)に採用されているわが国の株式に投資を行ない、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、株価指数先物取引(TOPIX先物取引)などを活用する場合があります。

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

2. 効率的な運用を行なうために、信託財産で保有する有価証券の貸付を行なう場合があります。

有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料の一部は信託財産の収益となります。

主な投資制限

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

分配方針

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

信託金限度額

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

(2)【ファンドの沿革】

2004年11月30日

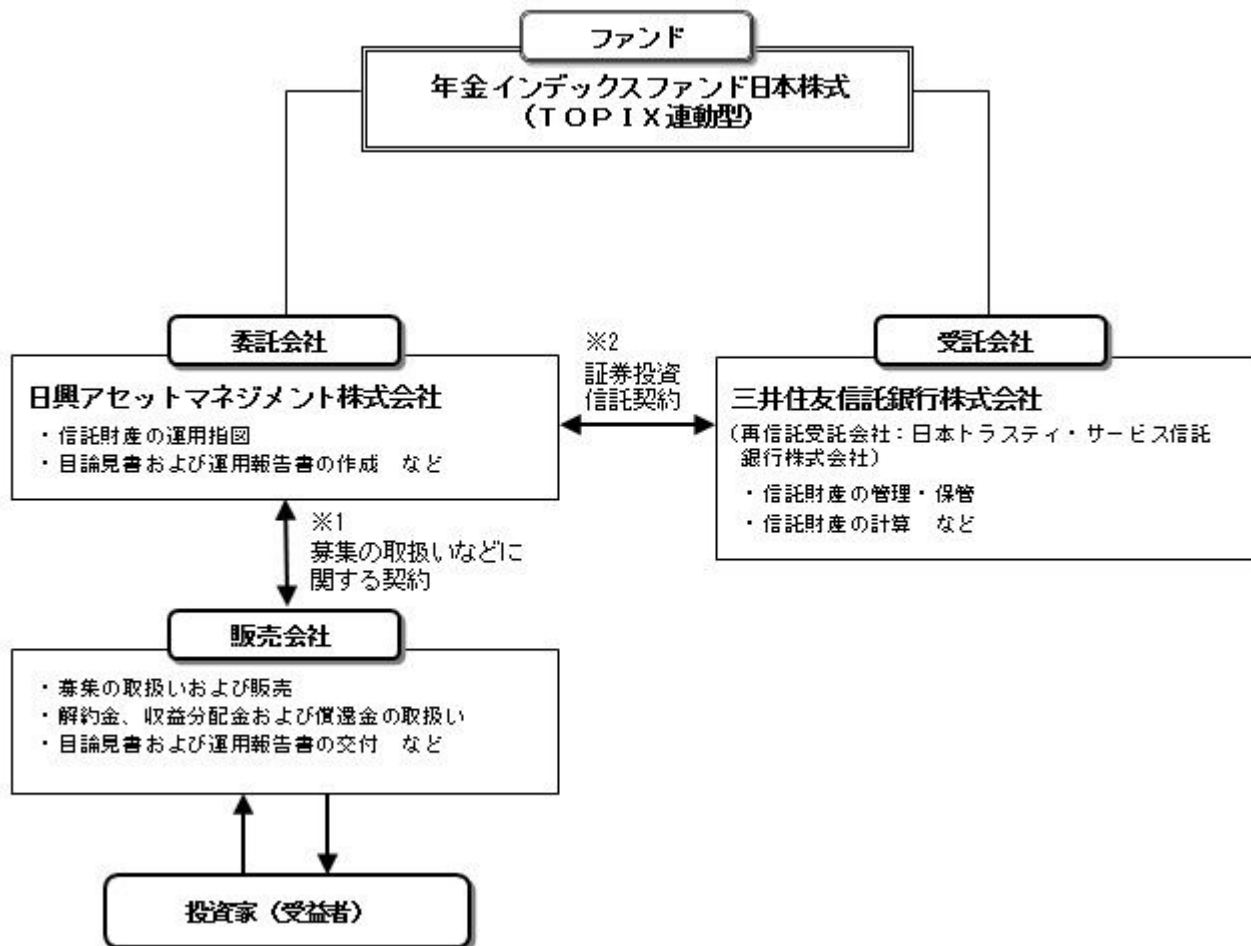
- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

2014年5月31日

- ・パナソニック ペンションファンドマネジメント株式会社からの投資助言による運用から、日興アセットマネジメント株式会社による直接運用に移行

(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6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】

- ・ 主として、TOPIX（東証株価指数）に採用されているわが国の株式に投資を行ない、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、株価指数先物取引など（TOPIX先物取引）を活用する場合があります。
- ・ 株式の実質組入比率は高位を保つことを原則とします。
- ・ 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入

総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

- ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資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21条、第22条および第23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本邦通貨表示の証券で、2)~8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資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。)
- 11) 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。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 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で投資法人債券に類する証券
- 13) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 14) 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。)
- 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

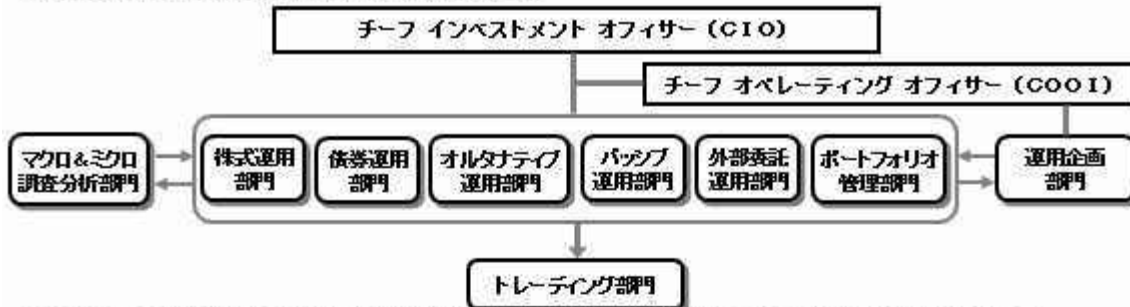
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。

- 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

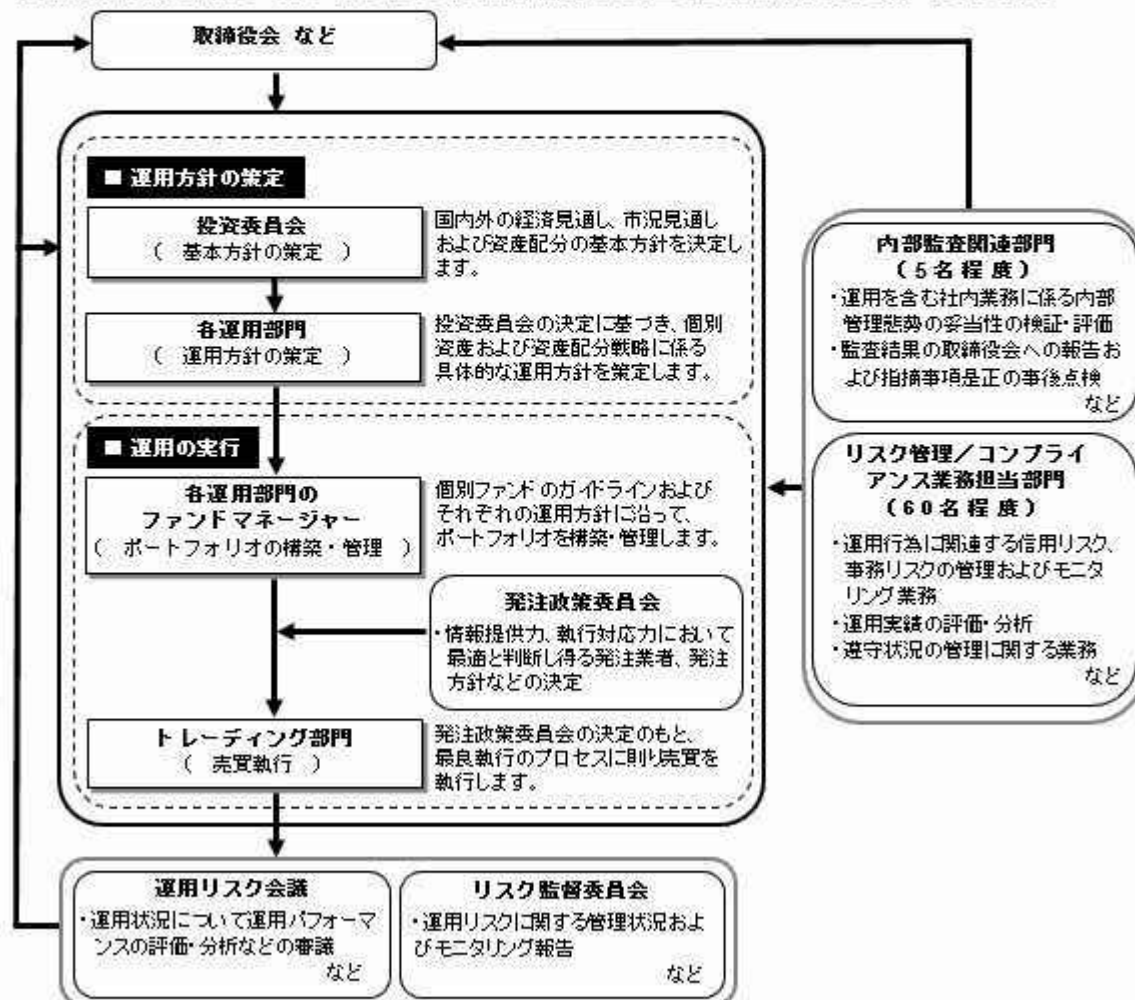
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡し取引
- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- 8) 資金の借入

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定高照合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6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) 【配分方針】

収益配分方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。

2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。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) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の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、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

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

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

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

10) 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を超えないものとします。

11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価

総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 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。
- 14) 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。
- 15) 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せん。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却

できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

信用リスク

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

有価証券の貸付などにおけるリスク

有価証券の貸付行為などにおいては、取引相手先リスク（取引の相手方の倒産などにより貸付契約が不履行になったり、契約が解除されたりするリスク）を伴ない、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。貸付契約が不履行や契約解除の事態を受けて、貸付契約に基づく担保金を用いて清算手続きを行なう場合においても、買戻しを行なう際に、市場の時価変動などにより調達コストが担保金を上回る可能性もあり、不足金額をファンドが負担することにより、その結果ファンドに損害が発生する恐れがあります。

< T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

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

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

< 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。

・ 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

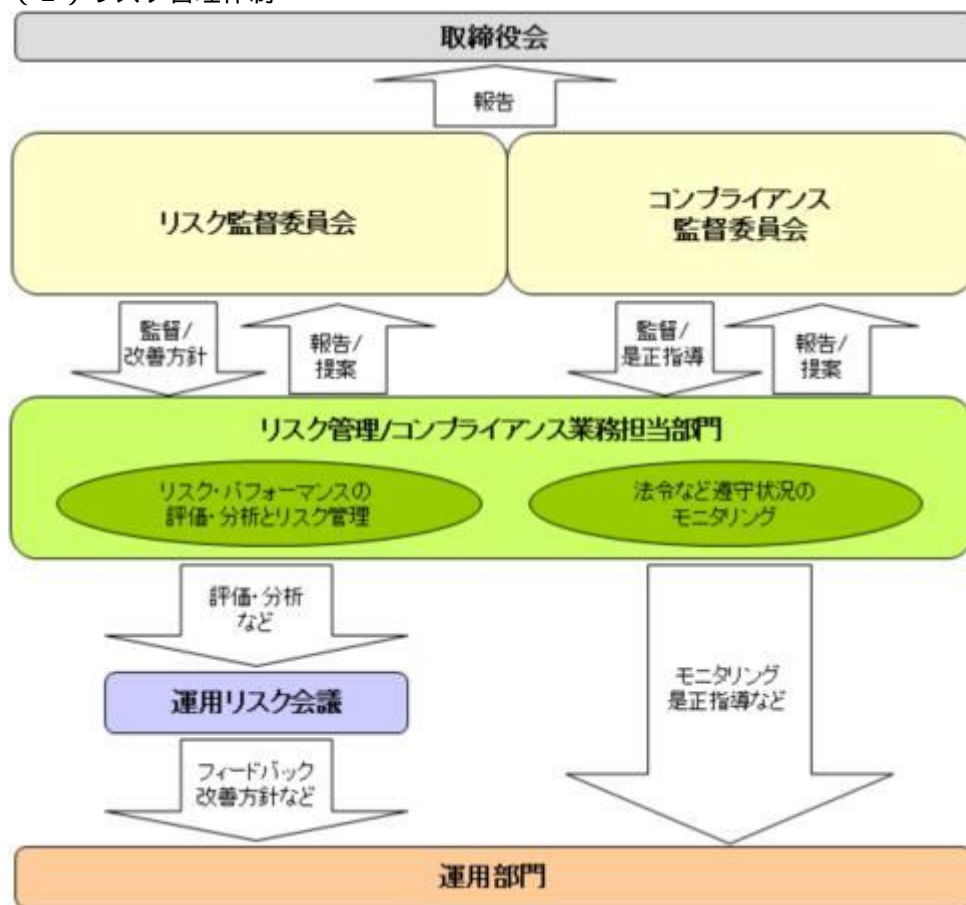
・ 運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



全社的なリスク管理

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

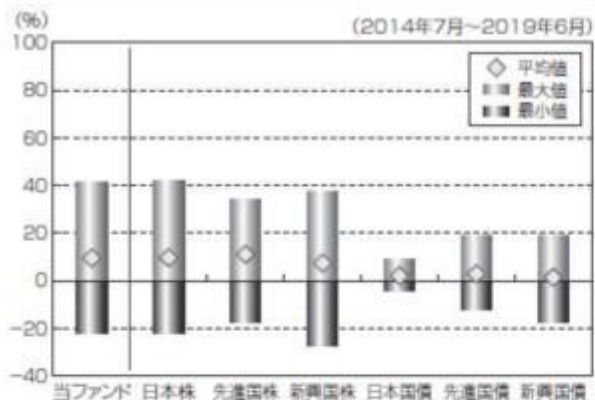
運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2019年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)**当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較****(当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%))**

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	9.5%	9.7%	11.0%	7.3%	2.0%	2.8%	1.4%
最大値	41.6%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	19.3%	19.3%
最小値	-22.1%	-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7月から2019年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2014年7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。

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。

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0.18252%^{*}(税抜0.169%)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、0.1859%となります。

信託報酬の配分

信託報酬の配分(年率)は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.169%	0.073%	0.068%	0.028%

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・報酬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、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。

有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品賃料に0.432^{*}(税抜0.4)を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は3:1とし、信託報酬と同時期に支払います。

*消費税率が10%になった場合は、0.44となります。

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5)【課税上の取扱い】

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

確定拠出年金の場合

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

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

厚生年金基金および企業年金基金の場合

これら所得税法別表第一に掲げられる公共法人である受益者に対しては、所得税および地方税はかかりません。

なお、企業年金基金については、企業年金基金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

規約型企業年金の場合

規約型企業年金を目的として、確定給付企業年金法の規定に基づく契約を締結した場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、規約型企業年金については規約型企業年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記以外の場合

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。

なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用があります。)のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。なお、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

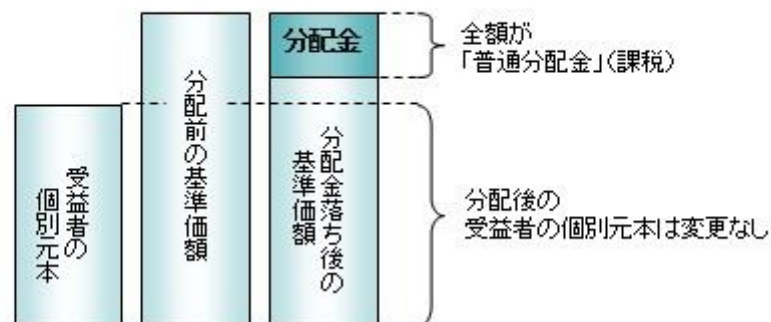
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

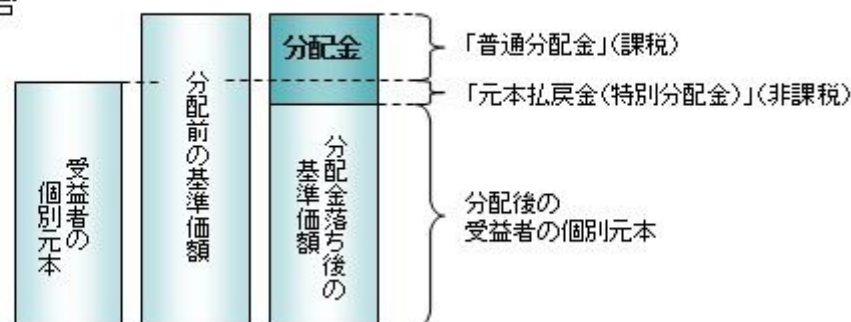
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2019年8月30日現在のものですので、税法、確定給付企業年金法および確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【年金インデックスファンド日本株式(TOPIX連動型)】

以下の運用状況は2019年6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(%)
株式	日本	41,063,797,050	97.39
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,098,448,281	2.61
合計(純資産総額)		42,162,245,331	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	1,101,210,000	2.61

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	205,800	6,384.91	1,314,014,800	6,688.00	1,376,390,400	3.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	151,400	5,120.45	775,237,600	5,165.00	781,981,000	1.85
日本	株式	ソニー	電気機器	123,900	5,256.14	651,236,600	5,648.00	699,787,200	1.66
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,253,800	501.08	628,260,410	512.00	641,945,600	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	123,900	4,866.35	602,941,900	5,017.00	621,606,300	1.47
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	161,200	3,668.42	591,349,800	3,823.00	616,267,600	1.46
日本	株式	キーエンス	電気機器	9,100	61,486.92	559,531,000	66,130.00	601,783,000	1.43
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	128,300	3,782.59	485,306,500	3,806.00	488,309,800	1.16
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	126,400	3,466.36	438,148,500	3,594.00	454,281,600	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	155,700	2,651.87	412,896,350	2,785.00	433,624,500	1.03
日本	株式	任天堂	その他製品	10,600	38,680.66	410,015,000	39,490.00	418,594,000	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	148,500	2,787.89	414,001,665	2,743.50	407,409,750	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,473,400	153.67	380,087,980	156.10	386,097,740	0.92

日本	株式	花王	化学	44,800	8,478.91	379,855,200	8,210.00	367,808,000	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	127,600	2,833.30	361,529,200	2,840.00	362,384,000	0.86
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	16,500	22,643.60	373,619,500	21,580.00	356,070,000	0.84
日本	株式	ダイキン工業	機械	25,200	13,227.71	333,338,500	14,065.00	354,438,000	0.84
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	65,100	5,401.24	351,620,900	5,399.00	351,474,900	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	17,500	18,472.48	323,268,500	19,930.00	348,775,000	0.83
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	32,800	10,310.16	338,173,500	10,080.00	330,624,000	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	83,100	3,687.25	306,410,700	3,949.00	328,161,900	0.78
日本	株式	日本電産	電気機器	22,200	13,588.82	301,672,000	14,725.00	326,895,000	0.78
日本	株式	信越化学工業	化学	31,900	9,047.13	288,603,600	10,035.00	320,116,500	0.76
日本	株式	キヤノン	電気機器	99,400	3,064.94	304,656,000	3,146.00	312,712,400	0.74
日本	株式	HOYA	精密機器	37,200	7,557.11	281,124,500	8,254.00	307,048,800	0.73
日本	株式	第一三共	医薬品	52,900	5,260.78	278,295,400	5,635.00	298,091,500	0.71
日本	株式	資生堂	化学	36,700	7,834.25	287,517,300	8,121.00	298,040,700	0.71
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	114,700	2,495.27	286,208,050	2,512.50	288,183,750	0.68
日本	株式	村田製作所	電気機器	58,100	4,702.85	273,236,100	4,840.00	281,204,000	0.67
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	20,900	13,246.84	276,859,000	13,340.00	278,806,000	0.66

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.27
		建設業	2.74
		食料品	4.01
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.20
		医薬品	5.35
		石油・石炭製品	0.61
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	0.84
		鉄鋼	0.89
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.54
		機械	5.04
		電気機器	13.23
		輸送用機器	7.63
		精密機器	2.08
		その他製品	2.11
		電気・ガス業	1.62
陸運業	4.60		
海運業	0.16		
空運業	0.53		

	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	8.67
	卸売業	4.83
	小売業	4.43
	銀行業	5.70
	証券、商品先物取引業	0.74
	保険業	2.23
	その他金融業	1.09
	不動産業	2.36
	サービス業	5.15
合 計		97.39

【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09月	買建	71	日本円	1,092,766,340	1,101,210,000	2.61

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第6計算期間末 (2010年 5月31日)	10,879	10,891	0.8606	0.8616
第7計算期間末 (2011年 5月31日)	11,800	11,814	0.8348	0.8358
第8計算期間末 (2012年 5月31日)	12,319	12,335	0.7308	0.7318
第9計算期間末 (2013年 5月31日)	18,870	18,886	1.1759	1.1769
第10計算期間末 (2014年 6月 2日)	18,195	18,210	1.2858	1.2868
第11計算期間末 (2015年 6月 1日)	27,517	27,532	1.7971	1.7981
第12計算期間末 (2016年 5月31日)	27,352	27,370	1.5035	1.5045
第13計算期間末 (2017年 5月31日)	33,130	33,149	1.7427	1.7437
第14計算期間末 (2018年 5月31日)	41,841	41,862	1.9775	1.9785
第15計算期間末 (2019年 5月31日)	40,637	40,661	1.7476	1.7486
2018年 6月末日	41,996		1.9610	
7月末日	42,834		1.9860	
8月末日	42,878		1.9659	

9月末日	45,221		2.0749
10月末日	41,616		1.8795
11月末日	42,943		1.9040
12月末日	38,844		1.7087
2019年 1月末日	41,233		1.7925
2月末日	42,447		1.8388
3月末日	42,556		1.8402
4月末日	42,785		1.8705
5月末日	40,637		1.7476
6月末日	42,162		1.7951

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第6期	2009年 6月 2日～2010年 5月31日	0.0010
第7期	2010年 6月 1日～2011年 5月31日	0.0010
第8期	2011年 6月 1日～2012年 5月31日	0.0010
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	0.0010
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	0.0010
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	0.0010
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	0.0010
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	0.0010
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	0.0010
第15期	2018年 6月 1日～2019年 5月31日	0.0010

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第6期	2009年 6月 2日～2010年 5月31日	1.88
第7期	2010年 6月 1日～2011年 5月31日	2.88
第8期	2011年 6月 1日～2012年 5月31日	12.34
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	61.04
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	9.43
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	39.84
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	16.28
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	15.98
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	13.53
第15期	2018年 6月 1日～2019年 5月31日	11.58

(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6期	2009年 6月 2日 ~ 2010年 5月31日	2,784,974,927	803,649,568
第7期	2010年 6月 1日 ~ 2011年 5月31日	2,416,667,454	921,766,695
第8期	2011年 6月 1日 ~ 2012年 5月31日	3,959,202,241	1,239,279,452
第9期	2012年 6月 1日 ~ 2013年 5月31日	4,667,083,142	5,475,394,820
第10期	2013年 6月 1日 ~ 2014年 6月 2日	5,541,023,939	7,437,910,957
第11期	2014年 6月 3日 ~ 2015年 6月 1日	6,052,501,542	4,891,151,568
第12期	2015年 6月 2日 ~ 2016年 5月31日	7,174,553,570	4,294,430,475
第13期	2016年 6月 1日 ~ 2017年 5月31日	5,730,325,471	4,911,678,612
第14期	2017年 6月 1日 ~ 2018年 5月31日	6,496,323,254	4,348,409,754
第15期	2018年 6月 1日 ~ 2019年 5月31日	6,092,908,576	3,998,730,448

参考情報

運用実績

2019年6月28日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額 …………… 17,951円
純資産総額 …………… 421.62億円

※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6月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2015年6月	2016年5月	2017年5月	2018年5月	2019年5月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	97.39%
株式先物	2.61%
現金その他	2.61%

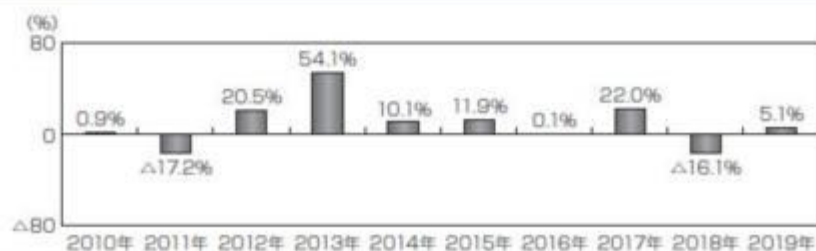
※対純資産総額比です。

<組入上位10銘柄>

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.26%
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.85%
3	ソニー	電気機器	1.66%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.52%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.47%
6	武田薬品工業	医薬品	1.46%
7	キーエンス	電気機器	1.43%
8	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.16%
9	リクルートホールディングス	サービス業	1.08%
10	本田技研工業	輸送用機器	1.03%

※対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※2019年は、2019年6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

販売会社所定の方法でお申し込みください。なお、確定拠出年金制度などによる取得申込みを行なう場

合は、当該規定に従うものとしします。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

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

(4) 申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(5) 申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。ただし、確定拠出年金制度などによる取得申込みを行なう場合は、1円以上1円単位とします。

(6) 申込代金の支払い

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

(7) 受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

確定給付企業年金法および確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関などでない場合、解約価額から所得税および地方税が差し引かれます。

税法または確定給付企業年金法および確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

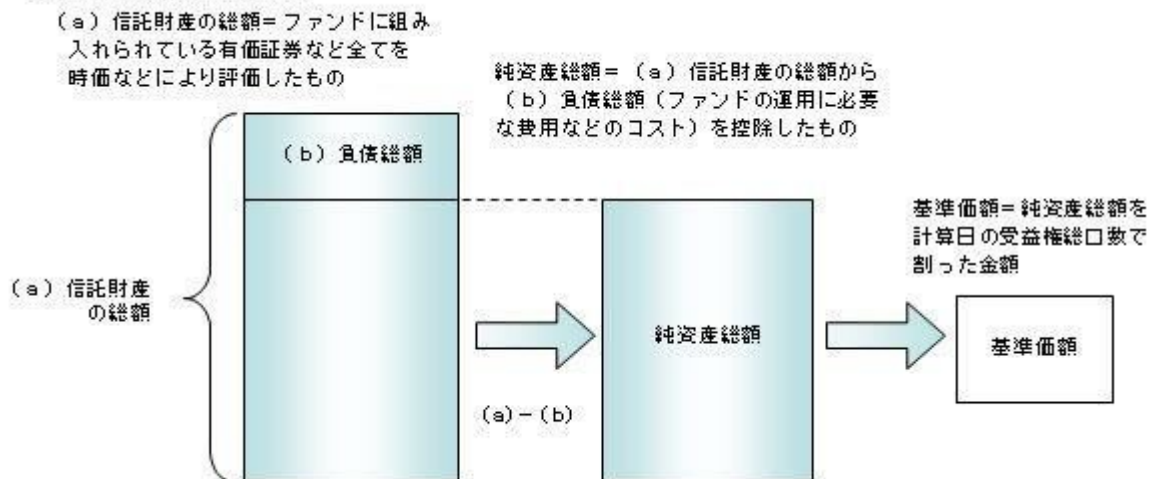
3【資産管理等の概要】

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

国内上場株式

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス 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(2004年11月30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6月1日から翌年5月31日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
 - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更

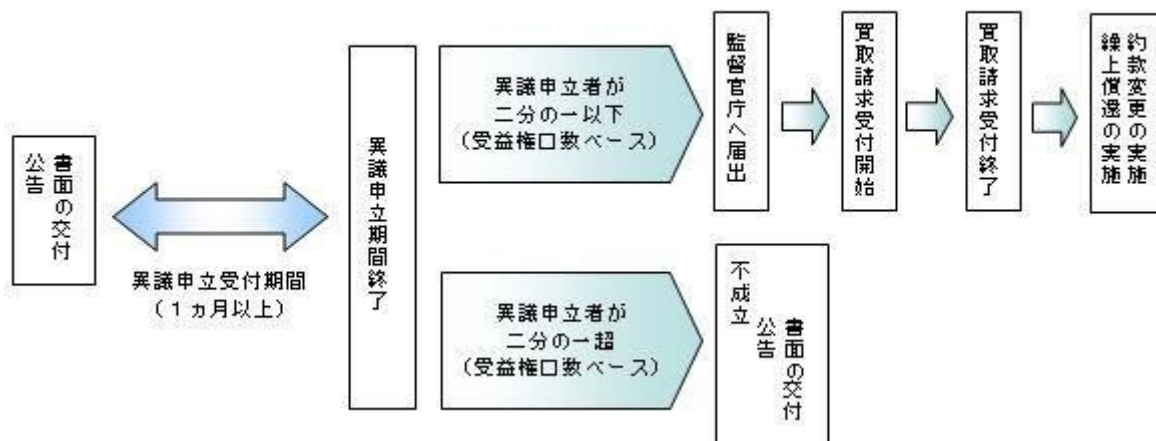
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4)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

異議の申立て

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

還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (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15期計算期間(2018年6月1日から2019年5月31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】

【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 2018年 5月31日現在	第15期 2019年 5月31日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	947,742,285	1,789,878,216
コール・ローン	696,568,270	749,048,347
株式	40,894,462,100	39,583,035,700
派生商品評価勘定	3,419,060	-
未収入金	8,920,700	611,000
未収配当金	341,057,000	421,106,951
前払金	14,930,000	38,510,000
その他未収収益	3,028,925	8,528,675
流動資産合計	42,910,128,340	42,590,718,889
資産合計		
	42,910,128,340	42,590,718,889
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,703,760	56,188,880
未払金	2,542,800	2,996,500
未払収益分配金	21,159,005	23,253,184
未払解約金	44,171,519	40,015,754
未払受託者報酬	6,411,018	6,722,157
未払委託者報酬	31,794,591	32,893,260
未払利息	1,102	1,103
受入担保金	947,742,285	1,789,878,216
その他未払費用	1,079,779	893,040
流動負債合計	1,068,605,859	1,952,842,094
負債合計		
	1,068,605,859	1,952,842,094
純資産の部		
元本等		
元本	21,159,005,884	23,253,184,012
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	20,682,516,597	17,384,692,783
（分配準備積立金）	8,750,298,525	8,140,757,959
元本等合計	41,841,522,481	40,637,876,795
純資産合計		
	41,841,522,481	40,637,876,795
負債純資産合計		
	42,910,128,340	42,590,718,889

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期		第15期	
	自 2017年 6月 1日	至 2018年 5月31日	自 2018年 6月 1日	至 2019年 5月31日
営業収益				
受取配当金		782,064,900		977,383,523
受取利息		2,249		2,606
有価証券売買等損益		3,689,209,626		5,905,394,374
派生商品取引等損益		86,447,420		75,084,860
その他収益		11,510,711		24,473,403
営業収益合計		4,569,234,906		4,978,619,702
営業費用				
支払利息		222,319		225,345
受託者報酬		12,060,751		13,626,929
委託者報酬		59,748,267		66,682,608
その他費用		3,420,923		3,722,183
営業費用合計		75,452,260		84,257,065
営業利益又は営業損失（ ）		4,493,782,646		5,062,876,767
経常利益又は経常損失（ ）		4,493,782,646		5,062,876,767
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,493,782,646		5,062,876,767
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（ ）		714,934,760		326,984,396
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		14,119,214,885		20,682,516,597
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,124,285,377		5,334,519,561
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		6,124,285,377		5,334,519,561
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,318,672,546		3,873,197,820
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,318,672,546		3,873,197,820
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		21,159,005		23,253,184
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		20,682,516,597		17,384,692,783

（ 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	<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 ）

		第14期 2018年 5月31日現在	第15期 2019年 5月31日現在
1.	期首元本額	19,011,092,384円	21,159,005,884円
	期中追加設定元本額	6,496,323,254円	6,092,908,576円
	期中一部解約元本額	4,348,409,754円	3,998,730,448円
2.	受益権の総数	21,159,005,884口	23,253,184,012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	121,657,280円	113,216,210円
4.	有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券は次のとおりであります。 株式	898,036,670円	1,677,699,880円

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第14期 自 2017年 6月 1日 至 2018年 5月31日		第15期 自 2018年 6月 1日 至 2019年 5月31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	721,935,846円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	850,086,870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	3,056,912,040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	21,779,451,949円	C 信託約款に定める収益調整金	26,338,581,611円
D 信託約款に定める分配準備積立金	4,992,609,644円	D 信託約款に定める分配準備積立金	7,313,924,273円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	30,550,909,479円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	34,502,592,754円
F 分配対象収益(1万口当たり)	14,438円	F 分配対象収益(1万口当たり)	14,837円
G 分配金額	21,159,005円	G 分配金額	23,253,184円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第14期 自 2017年 6月 1日 至 2018年 5月31日	第15期 自 2018年 6月 1日 至 2019年 5月31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14期 2018年 5月31日現在	第15期 2019年 5月31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。	(1)有価証券 同左

	(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。	(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14期（2018年 5月31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	3,517,534,971
合計	3,517,534,971

第15期（2019年 5月31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	5,697,336,994
合計	5,697,336,994

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

第14期（2018年 5月31日現在）

（単位：円）

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

	買建	969,730,000	-	959,475,000	10,255,000
	合計	969,730,000	-	959,475,000	10,255,000

第15期(2019年5月31日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,140,470,000	-	1,084,320,000	56,150,000
	合計	1,140,470,000	-	1,084,320,000	56,150,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第14期 2018年5月31日現在		第15期 2019年5月31日現在	
1口当たり純資産額	1.9775円	1口当たり純資産額	1.7476円
(1万口当たり純資産額)	(19,775円)	(1万口当たり純資産額)	(17,476円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	2,708.00	2,166,400	
日本水産	24,800	660.00	16,368,000	
マルハニチロ	3,600	3,305.00	11,898,000	

カネコ種苗	800	1,351.00	1,080,800	
サカタのタネ	3,000	3,300.00	9,900,000	
ホクト	2,100	1,788.00	3,754,800	
ホクリヨウ	300	596.00	178,800	
住石ホールディングス	5,500	114.00	627,000	貸付有価証券 3,600株
日鉄鉱業	600	4,275.00	2,565,000	
三井松島ホールディングス	1,000	1,210.00	1,210,000	
国際石油開発帝石	99,300	878.80	87,264,840	
石油資源開発	3,600	2,271.00	8,175,600	
K & O エナジーグループ	1,200	1,613.00	1,935,600	
ヒノキヤグループ	700	2,001.00	1,400,700	
ショーボンドホールディングス	1,800	7,530.00	13,554,000	
ミライト・ホールディングス	6,900	1,702.00	11,743,800	貸付有価証券 4,800株
タマホーム	1,200	1,002.00	1,202,400	貸付有価証券 800株
サンヨーホームズ	400	668.00	267,200	
日本アクア	800	454.00	363,200	貸付有価証券 500株
ファーストコーポレーション	800	765.00	612,000	
ベステラ	500	1,252.00	626,000	貸付有価証券 200株
T A T E R U	3,000	229.00	687,000	貸付有価証券 2,100株
スペースバリューホールディングス	3,200	539.00	1,724,800	
ダイセキ環境ソリューション	500	623.00	311,500	貸付有価証券 200株
第一カッター興業	300	1,665.00	499,500	
安藤・間	15,900	711.00	11,304,900	
東急建設	7,200	767.00	5,522,400	
コムシスホールディングス	8,800	2,609.00	22,959,200	
ミサワホーム	1,900	970.00	1,843,000	
ビーアールホールディングス	2,700	338.00	912,600	貸付有価証券 400株
高松コンストラクショングループ	1,500	2,326.00	3,489,000	
東建コーポレーション	800	6,330.00	5,064,000	
ソネック	300	736.00	220,800	
ヤマウラ	900	824.00	741,600	
大成建設	20,300	3,965.00	80,489,500	
大林組	61,300	998.00	61,177,400	
清水建設	62,500	885.00	55,312,500	
飛鳥建設	1,700	1,272.00	2,162,400	
長谷工コーポレーション	25,500	1,083.00	27,616,500	
松井建設	2,200	609.00	1,339,800	

銭高組	300	4,410.00	1,323,000	
鹿島建設	47,900	1,489.00	71,323,100	
不動テトラ	1,400	1,326.00	1,856,400	
大末建設	700	930.00	651,000	
鉄建建設	1,200	2,950.00	3,540,000	
西松建設	4,400	2,078.00	9,143,200	
三井住友建設	14,700	616.00	9,055,200	
大豊建設	1,400	2,752.00	3,852,800	
前田建設工業	14,500	883.00	12,803,500	
佐田建設	1,300	357.00	464,100	
ナカノフドー建設	1,500	433.00	649,500	
奥村組	3,400	3,325.00	11,305,000	
東鉄工業	2,500	2,988.00	7,470,000	
イチケン	400	1,677.00	670,800	
富士ピー・エス	900	444.00	399,600	貸付有価証券 300株
浅沼組	800	3,515.00	2,812,000	
戸田建設	23,700	599.00	14,196,300	
熊谷組	2,900	2,883.00	8,360,700	
青木あすなろ建設	1,000	802.00	802,000	
北野建設	400	2,692.00	1,076,800	
植木組	300	2,112.00	633,600	
矢作建設工業	2,800	719.00	2,013,200	
ピーエス三菱	2,100	620.00	1,302,000	
日本ハウスホールディングス	4,100	407.00	1,668,700	
大東建託	7,300	14,135.00	103,185,500	貸付有価証券 200株
新日本建設	2,400	881.00	2,114,400	
N I P P O	5,400	2,119.00	11,442,600	
東亜道路工業	400	3,015.00	1,206,000	
前田道路	6,400	2,185.00	13,984,000	
日本道路	600	6,090.00	3,654,000	
東亜建設工業	1,800	1,486.00	2,674,800	
日本国土開発	3,400	597.00	2,029,800	
若築建設	1,000	1,325.00	1,325,000	
東洋建設	7,400	401.00	2,967,400	
五洋建設	24,300	483.00	11,736,900	
世紀東急工業	3,100	616.00	1,909,600	
福田組	700	4,235.00	2,964,500	
住友林業	14,500	1,233.00	17,878,500	
日本基礎技術	2,100	363.00	762,300	
バコーポレーション	2,600	336.00	873,600	
大和ハウス工業	56,600	3,251.00	184,006,600	

ライト工業	3,900	1,333.00	5,198,700	
積水ハウス	62,600	1,741.50	109,017,900	貸付有価証券 43,600株
日特建設	1,700	597.00	1,014,900	
北陸電気工事	1,000	836.00	836,000	
ユアテック	3,300	720.00	2,376,000	
四電工	300	2,623.00	786,900	
中電工	2,600	2,208.00	5,740,800	
関電工	9,300	880.00	8,184,000	
きんでん	13,600	1,670.00	22,712,000	
東京エネシス	2,100	902.00	1,894,200	
トーエネック	600	2,982.00	1,789,200	
住友電設	1,400	1,638.00	2,293,200	
日本電設工業	3,500	2,293.00	8,025,500	
協和エクシオ	8,000	2,553.00	20,424,000	
新日本空調	1,600	1,707.00	2,731,200	
九電工	4,000	3,080.00	12,320,000	
三機工業	4,600	1,222.00	5,621,200	
日揮	17,600	1,450.00	25,520,000	
中外炉工業	600	1,638.00	982,800	
ヤマト	1,900	549.00	1,043,100	
太平電業	1,400	2,031.00	2,843,400	
高砂熱学工業	5,000	1,672.00	8,360,000	
三晃金属工業	300	2,455.00	736,500	
朝日工業社	400	2,421.00	968,400	
明星工業	3,700	658.00	2,434,600	
大気社	2,800	3,240.00	9,072,000	
ダイダン	1,400	2,144.00	3,001,600	
日比谷総合設備	1,800	1,850.00	3,330,000	
東芝プラントシステム	4,400	1,907.00	8,390,800	
OSJBホールディングス	8,900	277.00	2,465,300	
東洋エンジニアリング	2,400	444.00	1,065,600	貸付有価証券 1,400株
千代田化工建設	14,800	290.00	4,292,000	
新興プランテック	3,700	1,206.00	4,462,200	
日本製粉	5,800	1,781.00	10,329,800	
日清製粉グループ本社	20,700	2,524.00	52,246,800	
日東富士製粉	100	5,800.00	580,000	
昭和産業	1,700	3,035.00	5,159,500	
鳥越製粉	1,600	737.00	1,179,200	
中部飼料	2,200	1,141.00	2,510,200	
フィード・ワン	12,400	178.00	2,207,200	
東洋精糖	300	961.00	288,300	

日本甜菜製糖	1,000	1,875.00	1,875,000	
三井製糖	1,400	2,288.00	3,203,200	
塩水港精糖	2,000	207.00	414,000	
日新製糖	900	1,820.00	1,638,000	
森永製菓	4,600	4,910.00	22,586,000	
中村屋	500	4,290.00	2,145,000	
江崎グリコ	5,500	5,160.00	28,380,000	
名糖産業	900	1,433.00	1,289,700	
井村屋グループ	800	2,157.00	1,725,600	
不二家	1,000	1,937.00	1,937,000	
山崎製パン	15,000	1,631.00	24,465,000	
第一屋製パン	300	994.00	298,200	
モロゾフ	300	4,910.00	1,473,000	
亀田製菓	1,100	4,805.00	5,285,500	
寿スピリッツ	1,900	5,620.00	10,678,000	
カルビー	8,300	3,080.00	25,564,000	
森永乳業	3,700	3,945.00	14,596,500	
六甲バター	1,300	2,007.00	2,609,100	
ヤクルト本社	13,600	6,180.00	84,048,000	
明治ホールディングス	13,000	7,610.00	98,930,000	
雪印メグミルク	4,400	2,157.00	9,490,800	
プリマハム	2,600	2,122.00	5,517,200	
日本ハム	7,600	4,390.00	33,364,000	
林兼産業	600	597.00	358,200	
丸大食品	1,900	1,917.00	3,642,300	
S Foods	1,600	3,650.00	5,840,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,800	660.00	7,788,000	
サッポロホールディングス	6,700	2,258.00	15,128,600	貸付有価証券 4,600株
アサヒグループホールディングス	38,300	4,777.00	182,959,100	
キリンホールディングス	82,800	2,355.00	194,994,000	
宝ホールディングス	13,700	1,175.00	16,097,500	
オエノンホールディングス	5,200	364.00	1,892,800	
養命酒製造	600	2,030.00	1,218,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	14,000	2,468.00	34,552,000	貸付有価証券 200株
サントリー食品インターナショナル	12,200	4,515.00	55,083,000	
ダイドーグループホールディングス	1,000	4,500.00	4,500,000	
伊藤園	5,600	5,140.00	28,784,000	
キーコーヒー	1,800	2,097.00	3,774,600	
ユニカフェ	500	983.00	491,500	
ジャパンフーズ	300	1,150.00	345,000	
日清オイリオグループ	2,400	3,165.00	7,596,000	

不二製油グループ本社	4,500	3,290.00	14,805,000	
かどや製油	200	4,235.00	847,000	
J・オイルミルズ	1,000	3,965.00	3,965,000	
キッコーマン	12,100	4,505.00	54,510,500	貸付有価証券 300株
味の素	40,400	1,847.00	74,618,800	貸付有価証券 400株
キューピー	10,200	2,431.00	24,796,200	
ハウス食品グループ本社	6,900	4,425.00	30,532,500	
カゴメ	7,300	2,539.00	18,534,700	貸付有価証券 100株
焼津水産化学工業	900	1,090.00	981,000	
アリアケジャパン	1,700	7,030.00	11,951,000	
ピエトロ	200	1,599.00	319,800	
エバラ食品工業	500	2,108.00	1,054,000	
ニチレイ	9,500	2,654.00	25,213,000	
東洋水産	9,400	4,240.00	39,856,000	
イートアンド	600	1,618.00	970,800	
大冷	200	1,785.00	357,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	500	869.00	434,500	貸付有価証券 300株
日清食品ホールディングス	7,800	6,580.00	51,324,000	
永谷園ホールディングス	1,000	2,143.00	2,143,000	
一正蒲鉾	700	1,116.00	781,200	貸付有価証券 400株
フジッコ	2,000	2,140.00	4,280,000	
ロック・フィールド	2,000	1,584.00	3,168,000	
日本たばこ産業	105,700	2,492.50	263,457,250	
ケンコーマヨネーズ	1,000	2,371.00	2,371,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,200	1,639.00	1,966,800	
なとり	1,000	1,552.00	1,552,000	
イフジ産業	300	661.00	198,300	
ピクルスコーポレーション	400	1,912.00	764,800	
北の達人コーポレーション	7,200	570.00	4,104,000	貸付有価証券 5,000株
ユーグレナ	7,800	843.00	6,575,400	貸付有価証券 5,400株
ミヨシ油脂	700	1,119.00	783,300	
理研ビタミン	900	3,470.00	3,123,000	
片倉工業	2,200	1,201.00	2,642,200	
ゲンゼ	1,200	4,545.00	5,454,000	
東洋紡	7,600	1,174.00	8,922,400	
ユニチカ	5,200	346.00	1,799,200	
富士紡ホールディングス	900	2,281.00	2,052,900	
倉敷紡績	1,700	1,906.00	3,240,200	

シキボウ	900	928.00	835,200	
日本毛織	5,900	830.00	4,897,000	
ダイトウボウ	3,100	82.00	254,200	貸付有価証券 700株
トーア紡コーポレーション	800	440.00	352,000	
ダイドーリミテッド	2,200	312.00	686,400	
帝国繊維	2,000	2,210.00	4,420,000	
帝人	14,600	1,773.00	25,885,800	貸付有価証券 100株
東レ	138,500	746.90	103,445,650	
サカイオーベックス	400	1,644.00	657,600	
住江織物	500	2,774.00	1,387,000	
日本フェルト	1,000	455.00	455,000	
イチカワ	300	1,311.00	393,300	
日東製網	200	1,307.00	261,400	
アツギ	1,500	910.00	1,365,000	
ダイニック	700	725.00	507,500	
セーレン	4,400	1,376.00	6,054,400	
ソトー	700	952.00	666,400	
東海染工	300	1,120.00	336,000	
小松マテーレ	3,000	763.00	2,289,000	
ワコールホールディングス	5,200	2,702.00	14,050,400	
ホギメディカル	2,200	3,435.00	7,557,000	
レナウン	5,200	97.00	504,400	貸付有価証券 3,200株
T S Iホールディングス	6,600	621.00	4,098,600	
マツオカコーポレーション	600	2,657.00	1,594,200	
ワールド	2,300	2,205.00	5,071,500	貸付有価証券 200株
三陽商会	1,100	1,755.00	1,930,500	
ナイガイ	700	498.00	348,600	
オンワードホールディングス	10,700	572.00	6,120,400	
ルックホールディングス	700	1,345.00	941,500	
キムラタン	9,500	35.00	332,500	貸付有価証券 4,900株
ゴールドウイン	1,600	13,840.00	22,144,000	貸付有価証券 1,100株
デサント	4,400	1,833.00	8,065,200	貸付有価証券 3,000株
キング	1,000	614.00	614,000	
ヤマトインターナショナル	1,100	406.00	446,600	
特種東海製紙	1,100	3,620.00	3,982,000	
王子ホールディングス	80,500	564.00	45,402,000	
日本製紙	8,500	1,862.00	15,827,000	貸付有価証券 100株

三菱製紙	2,900	559.00	1,621,100	
北越コーポレーション	11,800	537.00	6,336,600	
中越パルプ工業	800	1,410.00	1,128,000	
巴川製紙所	600	916.00	549,600	
大王製紙	8,700	1,254.00	10,909,800	貸付有価証券 6,000株
阿波製紙	500	427.00	213,500	
レンゴー	18,400	866.00	15,934,400	
トモク	1,100	1,759.00	1,934,900	
ザ・パック	1,400	3,115.00	4,361,000	
クラレ	30,200	1,246.00	37,629,200	
旭化成	127,100	1,119.00	142,224,900	
共和レザー	1,100	784.00	862,400	
昭和電工	11,900	2,987.00	35,545,300	
住友化学	140,500	470.00	66,035,000	
住友精化	900	3,355.00	3,019,500	
日産化学	11,000	4,610.00	50,710,000	
ラサ工業	600	1,301.00	780,600	
クレハ	1,700	6,900.00	11,730,000	
多木化学	500	4,405.00	2,202,500	貸付有価証券 300株
テイカ	1,500	2,263.00	3,394,500	
石原産業	3,400	1,013.00	3,444,200	
片倉コープアグリ	500	1,098.00	549,000	
日東エフシー	1,200	1,199.00	1,438,800	
日本曹達	2,800	2,600.00	7,280,000	
東ソー	27,600	1,378.00	38,032,800	
トクヤマ	5,100	2,420.00	12,342,000	
セントラル硝子	3,900	2,391.00	9,324,900	貸付有価証券 200株
東亜合成	11,200	1,172.00	13,126,400	
大阪ソーダ	1,900	2,609.00	4,957,100	
関東電化工業	4,200	704.00	2,956,800	
デンカ	7,000	3,110.00	21,770,000	
信越化学工業	31,500	9,047.00	284,980,500	
日本カーバイド工業	600	1,313.00	787,800	
堺化学工業	1,200	2,481.00	2,977,200	
第一稀元素化学工業	2,000	788.00	1,576,000	
エア・ウォーター	14,600	1,618.00	23,622,800	
大陽日酸	14,700	2,036.00	29,929,200	
日本化学工業	600	1,721.00	1,032,600	
日本パーカラライジング	9,700	1,202.00	11,659,400	
高圧ガス工業	2,800	808.00	2,262,400	

四国化成工業	3,000	1,008.00	3,024,000	
戸田工業	400	2,067.00	826,800	
ステラ ケミファ	1,000	2,666.00	2,666,000	貸付有価証券 100株
保土谷化学工業	600	2,550.00	1,530,000	
日本触媒	3,000	6,520.00	19,560,000	
大日精化工業	1,500	2,860.00	4,290,000	
カネカ	4,600	3,750.00	17,250,000	
三菱瓦斯化学	18,400	1,355.00	24,932,000	
三井化学	16,200	2,387.00	38,669,400	
J S R	17,900	1,545.00	27,655,500	
東京応化工業	3,100	3,150.00	9,765,000	
大阪有機化学工業	1,600	947.00	1,515,200	
三菱ケミカルホールディングス	119,400	711.30	84,929,220	
K Hネオケム	2,700	2,908.00	7,851,600	貸付有価証券 100株
ダイセル	26,300	925.00	24,327,500	
住友ベークライト	3,100	3,730.00	11,563,000	
積水化学工業	39,000	1,597.00	62,283,000	
日本ゼオン	16,100	1,026.00	16,518,600	貸付有価証券 100株
アイカ工業	5,400	3,595.00	19,413,000	
宇部興産	9,000	2,081.00	18,729,000	
積水樹脂	2,900	2,039.00	5,913,100	
タキロンシーアイ	3,900	633.00	2,468,700	
旭有機材	1,200	1,387.00	1,664,400	
日立化成	8,300	2,906.00	24,119,800	貸付有価証券 5,700株
ニチバン	900	2,334.00	2,100,600	
リケンテクノス	4,900	476.00	2,332,400	
大倉工業	900	1,717.00	1,545,300	
積水化成品工業	2,600	706.00	1,835,600	
群栄化学工業	500	2,386.00	1,193,000	
タイガースポリマー	900	572.00	514,800	
ミライアル	500	1,053.00	526,500	貸付有価証券 300株
ダイキアクシス	600	814.00	488,400	
ダイキョーニシカワ	3,800	809.00	3,074,200	
竹本容器	600	1,099.00	659,400	
森六ホールディングス	1,000	2,343.00	2,343,000	
日本化薬	11,300	1,252.00	14,147,600	
カーリットホールディングス	1,900	643.00	1,221,700	
日本精化	1,400	1,259.00	1,762,600	
扶桑化学工業	1,800	1,969.00	3,544,200	

トリケミカル研究所	400	4,905.00	1,962,000	貸付有価証券 200株
A D E K A	8,800	1,519.00	13,367,200	
日油	6,700	3,915.00	26,230,500	
新日本理化	3,300	192.00	633,600	貸付有価証券 600株
ハリマ化成グループ	1,500	980.00	1,470,000	
花王	44,300	8,480.00	375,664,000	
第一工業製薬	700	2,886.00	2,020,200	
石原ケミカル	500	1,460.00	730,000	
日華化学	600	911.00	546,600	
ニイタカ	300	1,427.00	428,100	
三洋化成工業	1,200	5,580.00	6,696,000	
有機合成薬品工業	1,500	235.00	352,500	
大日本塗料	2,000	963.00	1,926,000	
日本ペイントホールディングス	14,700	4,300.00	63,210,000	貸付有価証券 900株
関西ペイント	20,100	2,057.00	41,345,700	
中国塗料	5,900	936.00	5,522,400	
日本特殊塗料	1,300	1,168.00	1,518,400	
藤倉化成	2,400	559.00	1,341,600	
太陽ホールディングス	1,500	3,310.00	4,965,000	
D I C	8,100	2,645.00	21,424,500	
サカタインクス	3,900	954.00	3,720,600	
東洋インキ S C ホールディングス	3,800	2,262.00	8,595,600	
T & K T O K A	1,400	922.00	1,290,800	
富士フイルムホールディングス	37,900	5,199.00	197,042,100	
資生堂	36,300	7,833.00	284,337,900	
ライオン	25,400	2,104.00	53,441,600	
高砂香料工業	1,300	3,080.00	4,004,000	
マンダム	4,100	2,664.00	10,922,400	
ミルボン	2,200	5,140.00	11,308,000	
ファンケル	8,100	2,936.00	23,781,600	
コーセー	3,100	17,170.00	53,227,000	
コタ	1,000	1,158.00	1,158,000	
シーボン	200	2,390.00	478,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,800	3,005.00	23,439,000	貸付有価証券 5,400株
ノエビアホールディングス	1,700	5,660.00	9,622,000	
アジュバンコスメジャパン	400	911.00	364,400	
エステー	1,300	1,716.00	2,230,800	
アグロ カネショウ	700	2,074.00	1,451,800	
コニシ	3,200	1,571.00	5,027,200	
長谷川香料	2,400	1,796.00	4,310,400	

星光PMC	1,300	729.00	947,700	貸付有価証券 100株
小林製薬	5,100	8,080.00	41,208,000	
荒川化学工業	1,600	1,231.00	1,969,600	
メック	1,300	1,029.00	1,337,700	
日本高純度化学	500	2,325.00	1,162,500	
タカラバイオ	4,800	2,324.00	11,155,200	
JCU	2,400	1,980.00	4,752,000	
新田ゼラチン	1,100	704.00	774,400	
OATアグリオ	300	1,256.00	376,800	
デクセリアルズ	4,700	690.00	3,243,000	貸付有価証券 3,200株
アース製薬	1,400	4,985.00	6,979,000	
北興化学工業	1,900	480.00	912,000	
大成ラミック	600	2,827.00	1,696,200	
クミアイ化学工業	7,600	742.00	5,639,200	
日本農薬	3,200	406.00	1,299,200	
アキレス	1,300	1,957.00	2,544,100	
有沢製作所	2,900	766.00	2,221,400	
日東電工	12,600	4,750.00	59,850,000	
レック	1,900	1,212.00	2,302,800	貸付有価証券 100株
三光合成	2,200	324.00	712,800	
きもと	3,100	150.00	465,000	
藤森工業	1,700	2,774.00	4,715,800	
前澤化成工業	1,200	1,023.00	1,227,600	
未来工業	1,000	2,069.00	2,069,000	貸付有価証券 400株
ウェーブロックホールディングス	500	645.00	322,500	
JSP	1,100	1,967.00	2,163,700	
エフピコ	2,000	6,350.00	12,700,000	
天馬	1,300	1,785.00	2,320,500	
信越ポリマー	3,300	741.00	2,445,300	
東リ	4,500	251.00	1,129,500	
ニフコ	7,300	2,725.00	19,892,500	
バルカー	1,500	2,060.00	3,090,000	
ユニ・チャーム	38,700	3,259.00	126,123,300	
ショーエイコーポレーション	100	746.00	74,600	
協和発酵キリン	21,400	2,050.00	43,870,000	
武田薬品工業	159,200	3,669.00	584,104,800	
アステラス製薬	168,100	1,462.50	245,846,250	
大日本住友製薬	13,500	2,229.00	30,091,500	
塩野義製薬	23,300	5,940.00	138,402,000	
田辺三菱製薬	19,100	1,283.00	24,505,300	

わかもと製薬	2,300	265.00	609,500	
あすか製薬	2,300	1,168.00	2,686,400	
日本新薬	4,800	7,520.00	36,096,000	
ピオフェルミン製薬	300	2,282.00	684,600	
中外製薬	19,000	7,240.00	137,560,000	
科研製薬	3,300	5,140.00	16,962,000	
エーザイ	21,800	6,383.00	139,149,400	
ロート製薬	9,400	2,960.00	27,824,000	
小野薬品工業	43,100	1,920.00	82,752,000	
久光製薬	5,400	4,360.00	23,544,000	
持田製薬	2,700	4,960.00	13,392,000	
参天製薬	34,000	1,563.00	53,142,000	
扶桑薬品工業	600	1,994.00	1,196,400	
日本ケミファ	200	2,878.00	575,600	
ツムラ	5,700	3,025.00	17,242,500	
日医工	4,800	1,229.00	5,899,200	
キッセイ薬品工業	3,200	2,545.00	8,144,000	
生化学工業	3,500	1,245.00	4,357,500	
栄研化学	3,200	1,915.00	6,128,000	
日水製薬	800	1,186.00	948,800	
鳥居薬品	1,000	2,361.00	2,361,000	
JCRファーマ	1,300	6,800.00	8,840,000	
東和薬品	2,600	2,602.00	6,765,200	貸付有価証券 1,800株
富士製薬工業	1,200	1,438.00	1,725,600	
沢井製薬	3,700	5,590.00	20,683,000	
ゼリア新薬工業	3,600	2,028.00	7,300,800	
第一三共	52,200	5,255.00	274,311,000	
キョーリン製薬ホールディングス	4,000	1,897.00	7,588,000	貸付有価証券 100株
大幸薬品	800	2,011.00	1,608,800	
ダイト	1,100	3,365.00	3,701,500	
大塚ホールディングス	34,700	3,646.00	126,516,200	
大正製薬ホールディングス	4,100	8,890.00	36,449,000	
ペプチドリーム	9,100	5,410.00	49,231,000	貸付有価証券 6,300株
日本コークス工業	15,400	93.00	1,432,200	
ニチレキ	2,300	1,011.00	2,325,300	
ユシロ化学工業	900	1,280.00	1,152,000	
ビービー・カストロール	700	1,459.00	1,021,300	
富士石油	4,400	260.00	1,144,000	
MORESCO	700	1,393.00	975,100	
出光興産	21,000	3,075.00	64,575,000	

J X T Gホールディングス	306,700	518.50	159,023,950	
コスモエネルギーホールディングス	5,300	2,138.00	11,331,400	
横浜ゴム	10,600	1,814.00	19,228,400	
TOYO TIRE	9,400	1,355.00	12,737,000	
ブリヂストン	56,000	4,059.00	227,304,000	
住友ゴム工業	16,400	1,204.00	19,745,600	貸付有価証券 7,400株
藤倉コンポジット	1,600	377.00	603,200	
オカモト	1,300	4,830.00	6,279,000	
フコク	800	696.00	556,800	
ニッタ	2,100	3,035.00	6,373,500	
住友理工	3,500	777.00	2,719,500	
三ツ星ベルト	2,400	1,972.00	4,732,800	
バンドー化学	3,500	914.00	3,199,000	
日東紡績	2,700	1,972.00	5,324,400	
A G C	18,000	3,495.00	62,910,000	
日本板硝子	8,700	712.00	6,194,400	貸付有価証券 1,100株
石塚硝子	300	2,258.00	677,400	
日本山村硝子	800	1,446.00	1,156,800	
日本電気硝子	7,900	2,614.00	20,650,600	
オハラ	700	1,300.00	910,000	貸付有価証券 400株
住友大阪セメント	3,700	4,220.00	15,614,000	
太平洋セメント	11,500	3,210.00	36,915,000	
日本ヒューム	1,800	688.00	1,238,400	
日本コンクリート工業	3,900	286.00	1,115,400	
三谷セキサン	800	2,840.00	2,272,000	
アジアパイルホールディングス	2,600	615.00	1,599,000	
東海カーボン	16,600	1,043.00	17,313,800	貸付有価証券 11,600株
日本カーボン	900	3,960.00	3,564,000	貸付有価証券 600株
東洋炭素	1,100	2,014.00	2,215,400	
ノリタケカンパニーリミテド	1,100	4,580.00	5,038,000	
T O T O	14,000	4,045.00	56,630,000	
日本碍子	22,300	1,474.00	32,870,200	
日本特殊陶業	15,400	1,911.00	29,429,400	
ダントーホールディングス	1,600	102.00	163,200	
M A R U W A	600	5,020.00	3,012,000	
品川リフラクトリーズ	500	2,919.00	1,459,500	
黒崎播磨	400	6,020.00	2,408,000	
ヨータイ	1,600	535.00	856,000	
イソライト工業	900	460.00	414,000	貸付有価証券 700株

東京窯業	2,300	296.00	680,800	
ニッカトー	800	663.00	530,400	
フジインコーポレーテッド	1,600	2,049.00	3,278,400	
クニミネ工業	800	805.00	644,000	
エーアンドエーマテリアル	400	981.00	392,400	
ニチアス	5,000	1,820.00	9,100,000	貸付有価証券 100株
ニチハ	2,500	2,851.00	7,127,500	
日本製鉄	83,800	1,806.50	151,384,700	
神戸製鋼所	33,000	673.00	22,209,000	
中山製鋼所	2,500	473.00	1,182,500	
合同製鐵	900	2,030.00	1,827,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	48,700	1,508.00	73,439,600	
東京製鐵	9,700	831.00	8,060,700	
共英製鋼	2,000	1,798.00	3,596,000	
大和工業	3,800	2,987.00	11,350,600	
東京鐵鋼	700	1,146.00	802,200	
大阪製鐵	1,200	1,703.00	2,043,600	
淀川製鋼所	2,400	1,960.00	4,704,000	
丸一鋼管	6,400	2,845.00	18,208,000	
モリ工業	500	1,810.00	905,000	
大同特殊鋼	2,900	3,825.00	11,092,500	貸付有価証券 500株
日本高周波鋼業	700	458.00	320,600	
日本冶金工業	15,000	205.00	3,075,000	
山陽特殊製鋼	2,300	1,475.00	3,392,500	
愛知製鋼	1,000	3,175.00	3,175,000	
日立金属	19,400	1,082.00	20,990,800	
日本金属	400	840.00	336,000	
大平洋金属	1,200	2,215.00	2,658,000	
新日本電工	10,800	191.00	2,062,800	
栗本鐵工所	900	1,318.00	1,186,200	
虹技	300	1,233.00	369,900	
日本鑄鐵管	200	606.00	121,200	
三菱製鋼	1,300	1,118.00	1,453,400	
日亜鋼業	2,800	318.00	890,400	
日本精線	300	2,530.00	759,000	
エンビプロ・ホールディングス	700	569.00	398,300	貸付有価証券 400株
シンニッタン	2,800	345.00	966,000	
新家工業	400	1,375.00	550,000	
大紀アルミニウム工業所	2,900	676.00	1,960,400	
日本輕金属ホールディングス	49,200	230.00	11,316,000	

三井金属鉱業	4,900	2,300.00	11,270,000	
東邦亜鉛	1,000	2,326.00	2,326,000	
三菱マテリアル	11,900	2,833.00	33,712,700	
住友金属鉱山	24,700	2,862.00	70,691,400	
DOWAホールディングス	4,200	3,390.00	14,238,000	
古河機械金属	3,000	1,317.00	3,951,000	
エス・サイエンス	8,000	61.00	488,000	貸付有価証券 5,700株
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,100	1,606.00	3,372,600	貸付有価証券 400株
東邦チタニウム	3,200	1,079.00	3,452,800	
UACJ	2,700	1,724.00	4,654,800	貸付有価証券 1,600株
CKサンエツ	300	2,740.00	822,000	
古河電気工業	5,200	2,904.00	15,100,800	
住友電気工業	67,400	1,311.50	88,395,100	
フジクラ	21,800	358.00	7,804,400	
昭和電線ホールディングス	2,100	745.00	1,564,500	
東京特殊電線	200	1,582.00	316,400	
タツタ電線	3,800	437.00	1,660,600	
カナレ電気	300	1,860.00	558,000	貸付有価証券 200株
平河ヒューテック	700	1,160.00	812,000	
リョービ	2,200	1,984.00	4,364,800	
アーレスティ	2,200	520.00	1,144,000	
アサヒホールディングス	3,400	2,103.00	7,150,200	
稲葉製作所	1,000	1,391.00	1,391,000	
宮地エンジニアリンググループ	500	1,685.00	842,500	
トーカロ	4,700	709.00	3,332,300	
アルファC o	600	1,182.00	709,200	
SUMCO	19,900	1,203.00	23,939,700	
川田テクノロジーズ	400	8,060.00	3,224,000	
RS Technologies	400	2,346.00	938,400	
信和	1,000	988.00	988,000	
東洋製罐グループホールディングス	11,500	2,056.00	23,644,000	
ホッカンホールディングス	900	1,706.00	1,535,400	
コロナ	1,000	994.00	994,000	
横河ブリッジホールディングス	3,400	1,554.00	5,283,600	貸付有価証券 100株
駒井ハルテック	300	1,601.00	480,300	
高田機工	200	2,510.00	502,000	
三和ホールディングス	18,600	1,085.00	20,181,000	
文化シャッター	5,300	824.00	4,367,200	
三協立山	2,500	1,139.00	2,847,500	

アルインコ	1,400	960.00	1,344,000	
東洋シャッター	500	537.00	268,500	
L I X I Lグループ	26,600	1,392.00	37,027,200	
日本フィルコン	1,400	500.00	700,000	
ノーリツ	4,000	1,372.00	5,488,000	
長府製作所	1,800	2,150.00	3,870,000	
リンナイ	3,200	7,120.00	22,784,000	
ダイニチ工業	1,000	623.00	623,000	
日東精工	2,500	550.00	1,375,000	
三洋工業	200	1,765.00	353,000	
岡部	3,700	962.00	3,559,400	
ジーテクト	2,000	1,476.00	2,952,000	
中国工業	300	517.00	155,100	
東プレ	3,400	1,722.00	5,854,800	
高周波熱錬	3,500	819.00	2,866,500	
東京製綱	1,100	971.00	1,068,100	貸付有価証券 700株
サンコール	1,000	500.00	500,000	
モリテック スチール	1,400	338.00	473,200	貸付有価証券 600株
パイオラックス	2,900	1,787.00	5,182,300	
エイチワン	1,800	709.00	1,276,200	
日本発條	18,000	798.00	14,364,000	貸付有価証券 100株
中央発條	200	2,810.00	562,000	
アドバネクス	200	1,677.00	335,400	
立川ブラインド工業	800	1,199.00	959,200	
三益半導体工業	1,600	1,477.00	2,363,200	
日本ドライケミカル	500	1,096.00	548,000	
日本製鋼所	5,500	1,650.00	9,075,000	
三浦工業	7,800	3,375.00	26,325,000	
タクマ	6,600	1,420.00	9,372,000	
ツガミ	4,000	864.00	3,456,000	貸付有価証券 2,800株
オークマ	2,300	5,310.00	12,213,000	
東芝機械	2,000	2,283.00	4,566,000	
アマダホールディングス	27,100	1,120.00	30,352,000	
アイダエンジニアリング	4,900	723.00	3,542,700	
滝澤鉄工所	600	1,396.00	837,600	
F U J I	7,200	1,193.00	8,589,600	
牧野フライス製作所	2,100	3,760.00	7,896,000	
オーエスジー	8,900	2,055.00	18,289,500	
ダイジェット工業	200	1,250.00	250,000	
旭ダイヤモンド工業	4,700	647.00	3,040,900	

D M G 森精機	11,400	1,352.00	15,412,800	
ソディック	4,000	939.00	3,756,000	貸付有価証券 200株
ディスコ	2,400	15,170.00	36,408,000	貸付有価証券 1,600株
日東工器	1,000	2,081.00	2,081,000	
日進工具	500	2,158.00	1,079,000	
パンチ工業	1,300	485.00	630,500	
富士ダイス	800	570.00	456,000	
豊和工業	1,000	821.00	821,000	
O K K	800	729.00	583,200	
石川製作所	400	1,400.00	560,000	貸付有価証券 200株
東洋機械金属	1,300	574.00	746,200	
津田駒工業	400	1,505.00	602,000	
エンシュウ	500	1,119.00	559,500	貸付有価証券 200株
島精機製作所	2,500	2,992.00	7,480,000	
オプトラン	1,800	2,329.00	4,192,200	貸付有価証券 100株
N C ホールディングス	600	475.00	285,000	
イワキポンプ	700	969.00	678,300	
フリー	1,400	1,023.00	1,432,200	
ヤマシンフィルタ	3,200	530.00	1,696,000	貸付有価証券 2,200株
日阪製作所	2,200	902.00	1,984,400	
やまびこ	3,500	919.00	3,216,500	
平田機工	900	5,200.00	4,680,000	
ペガサスマシン製造	1,700	530.00	901,000	
マルマエ	800	723.00	578,400	貸付有価証券 500株
タツモ	800	770.00	616,000	
ナプテスコ	9,900	2,745.00	27,175,500	貸付有価証券 6,900株
三井海洋開発	1,900	2,736.00	5,198,400	
レオン自動機	1,800	1,582.00	2,847,600	
S M C	5,300	35,770.00	189,581,000	
新川	1,400	344.00	481,600	貸付有価証券 900株
ホソカワミクロン	600	4,650.00	2,790,000	
ユニオンツール	800	2,640.00	2,112,000	
オイレス工業	2,500	1,466.00	3,665,000	
日精エー・エス・ピー機械	600	2,920.00	1,752,000	貸付有価証券 300株
サトーホールディングス	2,200	2,710.00	5,962,000	
技研製作所	1,600	3,210.00	5,136,000	

日本エアーテック	600	580.00	348,000	
カワタ	500	1,068.00	534,000	
日精樹脂工業	1,500	890.00	1,335,000	
オカダアイヨン	600	1,280.00	768,000	
ワイエイシイホールディングス	700	784.00	548,800	
小松製作所	82,600	2,416.50	199,602,900	
住友重機械工業	10,400	3,445.00	35,828,000	
日立建機	7,300	2,531.00	18,476,300	
日工	500	2,589.00	1,294,500	
巴工業	800	2,237.00	1,789,600	
井関農機	1,800	1,440.00	2,592,000	
TOWA	1,600	761.00	1,217,600	貸付有価証券 1,100株
丸山製作所	400	1,111.00	444,400	
北川鉄工所	800	2,042.00	1,633,600	
ローツェ	800	2,130.00	1,704,000	貸付有価証券 500株
タカキタ	700	528.00	369,600	
クボタ	97,700	1,660.50	162,230,850	
荏原実業	500	1,897.00	948,500	
三菱化工機	600	1,521.00	912,600	
月島機械	3,600	1,310.00	4,716,000	
帝国電機製作所	1,300	1,190.00	1,547,000	
東京機械製作所	700	414.00	289,800	
新東工業	4,300	915.00	3,934,500	
澁谷工業	1,600	2,886.00	4,617,600	
アイチ コーポレーション	3,100	652.00	2,021,200	
小森コーポレーション	4,600	1,115.00	5,129,000	
鶴見製作所	1,400	1,916.00	2,682,400	
住友精密工業	300	2,774.00	832,200	
酒井重工業	300	2,602.00	780,600	貸付有価証券 100株
荏原製作所	8,100	2,776.00	22,485,600	
石井鐵工所	300	1,950.00	585,000	
西島製作所	1,900	1,007.00	1,913,300	
北越工業	1,900	1,212.00	2,302,800	
ダイキン工業	24,900	13,230.00	329,427,000	
オルガノ	700	3,245.00	2,271,500	
トーヨーカネツ	700	2,063.00	1,444,100	
栗田工業	9,900	2,609.00	25,829,100	
椿本チエイン	2,400	3,260.00	7,824,000	
大同工業	900	814.00	732,600	
木村化工機	1,500	324.00	486,000	

アネスト岩田	2,800	953.00	2,668,400	
ダイフク	10,000	5,470.00	54,700,000	
サムコ	500	768.00	384,000	
加藤製作所	900	1,920.00	1,728,000	
油研工業	300	1,610.00	483,000	
タダノ	8,800	1,052.00	9,257,600	
フジテック	6,600	1,418.00	9,358,800	
C K D	5,000	967.00	4,835,000	
キトー	1,400	1,539.00	2,154,600	
平和	5,100	2,225.00	11,347,500	
理想科学工業	1,600	1,749.00	2,798,400	
S A N K Y O	4,600	4,150.00	19,090,000	
日本金銭機械	2,000	1,087.00	2,174,000	
マースグループホールディングス	1,200	2,061.00	2,473,200	
福島工業	1,100	3,550.00	3,905,000	
オーイズミ	800	377.00	301,600	
ダイコク電機	800	1,287.00	1,029,600	
竹内製作所	3,000	1,792.00	5,376,000	貸付有価証券 100株
アマノ	5,200	2,820.00	14,664,000	
J U K I	2,500	919.00	2,297,500	
サンデンホールディングス	2,200	504.00	1,108,800	貸付有価証券 400株
蛇の目マシン工業	1,700	427.00	725,900	
マックス	2,800	1,497.00	4,191,600	
グローリー	5,000	2,684.00	13,420,000	
新晃工業	1,700	1,597.00	2,714,900	
大和冷機工業	2,600	1,195.00	3,107,000	
セガサミーホールディングス	18,100	1,288.00	23,312,800	
日本ピストンリング	700	1,339.00	937,300	
リケン	800	4,310.00	3,448,000	
T P R	2,500	1,767.00	4,417,500	
ツバキ・ナカシマ	2,800	1,684.00	4,715,200	
ホシザキ	5,300	8,220.00	43,566,000	
大豊工業	1,500	799.00	1,198,500	
日本精工	37,500	873.00	32,737,500	
N T N	39,100	286.00	11,182,600	
ジェイテクト	17,500	1,152.00	20,160,000	
不二越	1,700	4,140.00	7,038,000	貸付有価証券 100株
日本トムソン	5,400	434.00	2,343,600	
T H K	11,300	2,227.00	25,165,100	
ユーシン精機	1,500	1,057.00	1,585,500	

前澤給装工業	700	1,925.00	1,347,500	
イーグル工業	2,300	1,010.00	2,323,000	
前澤工業	1,200	341.00	409,200	
日本ピラー工業	1,800	1,074.00	1,933,200	
キッツ	7,400	715.00	5,291,000	
マキタ	22,200	3,810.00	84,582,000	
日立造船	14,400	357.00	5,140,800	貸付有価証券 200株
三菱重工業	30,600	4,763.00	145,747,800	
I H I	14,000	2,423.00	33,922,000	
スター精密	3,100	1,324.00	4,104,400	
日清紡ホールディングス	10,100	754.00	7,615,400	
イビデン	11,200	1,687.00	18,894,400	
コニカミノルタ	39,900	958.00	38,224,200	
ブラザー工業	23,800	1,863.00	44,339,400	
ミネベアミツミ	33,800	1,596.00	53,944,800	
日立製作所	82,100	3,686.00	302,620,600	
三菱電機	182,300	1,360.50	248,019,150	
富士電機	11,800	3,630.00	42,834,000	
東洋電機製造	700	1,237.00	865,900	
安川電機	21,100	3,150.00	66,465,000	貸付有価証券 10,700株
シンフォニアテクノロジー	2,500	1,175.00	2,937,500	
明電舎	3,600	1,508.00	5,428,800	
オリジン	500	1,413.00	706,500	
山洋電気	900	3,800.00	3,420,000	
デンヨー	1,700	1,327.00	2,255,900	
東芝テック	2,300	2,680.00	6,164,000	
芝浦メカトロニクス	300	2,583.00	774,900	
マブチモーター	5,000	3,630.00	18,150,000	貸付有価証券 100株
日本電産	22,000	13,590.00	298,980,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	1,099.00	1,099,000	
トレックス・セミコンダクター	800	1,117.00	893,600	
東光高岳	900	1,127.00	1,014,300	
ダブル・スコープ	2,700	1,425.00	3,847,500	
ダイヘン	2,000	2,838.00	5,676,000	
ヤーマン	2,600	953.00	2,477,800	貸付有価証券 1,800株
JVCケンウッド	13,800	231.00	3,187,800	
ミマキエンジニアリング	1,600	580.00	928,000	
第一精工	800	1,418.00	1,134,400	
日新電機	4,300	1,052.00	4,523,600	
大崎電気工業	3,600	636.00	2,289,600	

オムロン	19,400	5,160.00	100,104,000	
日東工業	2,900	1,858.00	5,388,200	
I D E C	2,400	1,910.00	4,584,000	
正興電機製作所	300	746.00	223,800	
不二電機工業	200	1,296.00	259,200	貸付有価証券 100株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,500	1,941.00	12,616,500	
サクサホールディングス	500	1,838.00	919,000	
メルコホールディングス	800	3,055.00	2,444,000	
テクノメディカ	400	2,114.00	845,600	
日本電気	23,600	4,025.00	94,990,000	
富士通	17,600	7,355.00	129,448,000	
沖電気工業	7,900	1,337.00	10,562,300	
岩崎通信機	900	774.00	696,600	
電気興業	900	2,580.00	2,322,000	
サンケン電気	2,100	2,177.00	4,571,700	
ナカヨ	400	1,491.00	596,400	
アイホン	1,000	1,613.00	1,613,000	
ルネサスエレクトロニクス	19,100	495.00	9,454,500	
セイコーエプソン	22,700	1,600.00	36,320,000	
ワコム	13,100	335.00	4,388,500	
アルバック	3,600	3,115.00	11,214,000	
アクセル	800	553.00	442,400	
E I Z O	1,700	3,965.00	6,740,500	
ジャパンディスプレイ	43,300	64.00	2,771,200	貸付有価証券 30,300株
日本信号	4,600	1,108.00	5,096,800	
京三製作所	4,000	352.00	1,408,000	
能美防災	2,400	2,056.00	4,934,400	
ホーチキ	1,200	1,138.00	1,365,600	
星和電機	1,000	508.00	508,000	
エレコム	1,700	3,520.00	5,984,000	
パナソニック	208,500	864.80	180,310,800	
シャープ	18,100	988.00	17,882,800	貸付有価証券 12,600株
アンリツ	11,700	1,738.00	20,334,600	貸付有価証券 8,200株
富士通ゼネラル	5,600	1,542.00	8,635,200	
ソニー	122,300	5,257.00	642,931,100	
T D K	9,500	7,400.00	70,300,000	
帝国通信工業	800	1,159.00	927,200	
タムラ製作所	7,000	525.00	3,675,000	
アルプスアルパイン	19,000	1,800.00	34,200,000	
池上通信機	600	1,095.00	657,000	

日本電波工業	1,700	431.00	732,700	貸付有価証券 1,000株
鈴木	1,000	612.00	612,000	
日本トリム	300	5,120.00	1,536,000	
ローランド ディー.ジー.	900	2,430.00	2,187,000	
フォスター電機	2,100	1,530.00	3,213,000	
S M K	500	2,562.00	1,281,000	
ヨコオ	1,300	2,058.00	2,675,400	貸付有価証券 600株
ホシデン	5,400	1,100.00	5,940,000	
ヒロセ電機	2,600	11,900.00	30,940,000	
日本航空電子工業	4,200	1,518.00	6,375,600	
T O A	2,000	1,295.00	2,590,000	
マクセルホールディングス	3,900	1,809.00	7,055,100	
古野電気	2,400	928.00	2,227,200	
ユニデンホールディングス	500	1,766.00	883,000	
スミダコーポレーション	1,500	1,117.00	1,675,500	貸付有価証券 1,000株
アイコム	1,000	2,195.00	2,195,000	
リオン	900	2,097.00	1,887,300	
本多通信工業	1,500	479.00	718,500	
船井電機	1,800	700.00	1,260,000	貸付有価証券 1,200株
横河電機	18,300	2,113.00	38,667,900	
新電元工業	600	3,450.00	2,070,000	
アズビル	11,800	2,552.00	30,113,600	
東亜ディーケーケー	900	813.00	731,700	
日本光電工業	8,000	3,125.00	25,000,000	
チノー	600	1,137.00	682,200	
共和電業	1,900	412.00	782,800	
日本電子材料	700	506.00	354,200	貸付有価証券 300株
堀場製作所	3,600	5,070.00	18,252,000	
アドバンテスト	12,400	2,551.00	31,632,400	
小野測器	800	578.00	462,400	
エスベック	1,600	2,234.00	3,574,400	
キーエンス	8,900	61,510.00	547,439,000	
日置電機	1,000	3,510.00	3,510,000	
シスメックス	14,200	7,529.00	106,911,800	
日本マイクロニクス	3,100	905.00	2,805,500	
メガチップス	1,400	1,242.00	1,738,800	貸付有価証券 900株
O B A R A G R O U P	1,000	3,555.00	3,555,000	
澤藤電機	200	1,628.00	325,600	

原田工業	800	729.00	583,200	貸付有価証券 300株
コーセル	2,300	1,033.00	2,375,900	
イリソ電子工業	1,700	4,940.00	8,398,000	
オブテックスグループ	3,200	1,293.00	4,137,600	
千代田インテグレ	800	2,009.00	1,607,200	
アイ・オー・データ機器	700	1,025.00	717,500	
レーザーテック	3,700	3,800.00	14,060,000	
スタンレー電気	12,900	2,486.00	32,069,400	
岩崎電気	700	1,318.00	922,600	
ウシオ電機	10,600	1,364.00	14,458,400	
岡谷電機産業	1,300	376.00	488,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,700	591.00	1,004,700	
エノモト	500	722.00	361,000	
日本セラミック	1,800	2,864.00	5,155,200	
遠藤照明	900	724.00	651,600	
古河電池	1,400	616.00	862,400	
双信電機	900	436.00	392,400	貸付有価証券 600株
山一電機	1,400	896.00	1,254,400	
図研	1,300	1,505.00	1,956,500	
日本電子	3,600	2,315.00	8,334,000	
カシオ計算機	16,200	1,211.00	19,618,200	
ファナック	17,300	18,475.00	319,617,500	
日本シイエムケイ	4,600	646.00	2,971,600	
エンプラス	800	3,030.00	2,424,000	
大真空	700	1,004.00	702,800	
ローム	8,700	6,740.00	58,638,000	
浜松ホトニクス	13,100	3,900.00	51,090,000	
三井ハイテック	2,000	1,027.00	2,054,000	貸付有価証券 1,500株
新光電気工業	6,100	872.00	5,319,200	
京セラ	27,800	6,624.00	184,147,200	
太陽誘電	8,100	1,996.00	16,167,600	貸付有価証券 5,600株
村田製作所	57,400	4,705.00	270,067,000	
双葉電子工業	3,000	1,379.00	4,137,000	
北陸電気工業	700	929.00	650,300	
ニチコン	5,700	798.00	4,548,600	
日本ケミコン	1,300	1,564.00	2,033,200	
K O A	2,700	1,261.00	3,404,700	
市光工業	2,700	571.00	1,541,700	
小糸製作所	10,900	5,040.00	54,936,000	
ミツバ	3,400	521.00	1,771,400	

SCREENホールディングス	3,200	3,740.00	11,968,000	
キャノン電子	1,700	1,741.00	2,959,700	
キャノン	98,200	3,065.00	300,983,000	
リコー	54,800	1,054.00	57,759,200	
象印マホービン	4,500	1,150.00	5,175,000	貸付有価証券 3,100株
MUTOHホールディングス	300	1,640.00	492,000	
東京エレクトロン	12,200	14,790.00	180,438,000	
トヨタ紡織	6,400	1,332.00	8,524,800	
芦森工業	400	1,604.00	641,600	
ユニプレス	3,500	1,714.00	5,999,000	
豊田自動織機	14,800	5,590.00	82,732,000	
モリタホールディングス	3,200	1,899.00	6,076,800	
三櫻工業	2,300	387.00	890,100	
デンソー	40,200	4,202.00	168,920,400	
東海理化電機製作所	4,800	1,658.00	7,958,400	
三井E & Sホールディングス	6,600	868.00	5,728,800	
川崎重工業	14,200	2,433.00	34,548,600	
名村造船所	5,500	292.00	1,606,000	
サノヤスホールディングス	2,500	205.00	512,500	貸付有価証券 1,700株
日本車輛製造	700	2,512.00	1,758,400	
三菱ロジスネクスト	2,200	1,146.00	2,521,200	
近畿車輛	300	1,719.00	515,700	
日産自動車	215,100	734.60	158,012,460	
いすゞ自動車	57,600	1,200.00	69,120,000	
トヨタ自動車	203,200	6,384.00	1,297,228,800	代用有価証券 2,900株
日野自動車	22,800	861.00	19,630,800	
三菱自動車工業	67,600	512.00	34,611,200	
エフテック	1,300	711.00	924,300	
レシップホールディングス	700	732.00	512,400	貸付有価証券 300株
GMB	400	779.00	311,600	
ファルテック	300	742.00	222,600	
武蔵精密工業	4,400	1,343.00	5,909,200	
日産車体	3,500	985.00	3,447,500	貸付有価証券 200株
新明和工業	7,600	1,297.00	9,857,200	
極東開発工業	3,600	1,316.00	4,737,600	
日信工業	3,300	1,359.00	4,484,700	
トピー工業	1,500	2,199.00	3,298,500	
ティラド	700	1,841.00	1,288,700	
曙ブレーキ工業	9,900	104.00	1,029,600	貸付有価証券 7,000株

タチエス	3,000	1,292.00	3,876,000	
N O K	9,800	1,395.00	13,671,000	
フタバ産業	5,000	537.00	2,685,000	
K Y B	1,900	2,804.00	5,327,600	
大同メタル工業	3,000	662.00	1,986,000	貸付有価証券 100株
プレス工業	9,000	464.00	4,176,000	
ミクニ	2,300	371.00	853,300	
太平洋工業	3,800	1,426.00	5,418,800	
ケーヒン	4,200	1,411.00	5,926,200	
河西工業	2,200	746.00	1,641,200	
アイシン精機	15,000	3,605.00	54,075,000	
マツダ	57,200	1,061.50	60,717,800	
今仙電機製作所	1,800	867.00	1,560,600	
本田技研工業	153,900	2,651.00	407,988,900	代用有価証券 5,900株 貸付有価証券 100株
スズキ	33,400	5,158.00	172,277,200	貸付有価証券 300株
S U B A R U	56,600	2,522.00	142,745,200	
安永	900	1,471.00	1,323,900	貸付有価証券 600株
ヤマハ発動機	25,800	1,863.00	48,065,400	
ショーワ	4,300	1,331.00	5,723,300	
T B K	2,200	381.00	838,200	
エクセディ	2,500	2,137.00	5,342,500	
豊田合成	5,900	1,899.00	11,204,100	
愛三工業	2,900	673.00	1,951,700	
盟和産業	300	1,025.00	307,500	
日本プラスト	1,400	671.00	939,400	
ヨロズ	1,700	1,295.00	2,201,500	
エフ・シー・シー	3,300	2,185.00	7,210,500	
シマノ	7,300	16,640.00	121,472,000	
テイ・エス テック	4,200	2,657.00	11,159,400	
ジャムコ	900	2,151.00	1,935,900	
テルモ	51,600	3,088.00	159,340,800	
クリエートメディック	600	918.00	550,800	
日機装	5,900	1,399.00	8,254,100	
島津製作所	23,500	2,721.00	63,943,500	
J M S	1,700	641.00	1,089,700	
クボテック	400	342.00	136,800	貸付有価証券 200株
長野計器	1,400	681.00	953,400	
ブイ・テクノロジー	800	4,615.00	3,692,000	

東京計器	1,200	899.00	1,078,800	
愛知時計電機	200	3,995.00	799,000	
インターアクション	1,000	1,347.00	1,347,000	貸付有価証券 700株
オーバル	1,700	230.00	391,000	
東京精密	3,300	2,512.00	8,289,600	
マニー	2,400	6,780.00	16,272,000	
ニコン	31,800	1,486.00	47,254,800	
トプコン	9,800	1,389.00	13,612,200	
オリンパス	108,600	1,285.00	139,551,000	貸付有価証券 8,000株
理研計器	1,600	1,924.00	3,078,400	
タムロン	1,600	2,198.00	3,516,800	
H O Y A	36,700	7,558.00	277,378,600	
シード	800	1,061.00	848,800	貸付有価証券 400株
ノーリツ鋼機	1,400	1,708.00	2,391,200	貸付有価証券 900株
エー・アンド・デイ	1,600	760.00	1,216,000	
朝日インテック	7,700	5,560.00	42,812,000	
シチズン時計	20,000	501.00	10,020,000	
リズム時計工業	600	1,206.00	723,600	
大研医器	1,400	618.00	865,200	
メニコン	2,500	3,680.00	9,200,000	
シンシア	300	579.00	173,700	
松風	900	1,273.00	1,145,700	
セイコーホールディングス	2,800	2,022.00	5,661,600	
ニプロ	12,600	1,201.00	15,132,600	
中本パックス	500	1,440.00	720,000	
スノーピーク	700	1,395.00	976,500	
パラマウントベッドホールディングス	2,100	4,140.00	8,694,000	
トランザクション	1,200	807.00	968,400	貸付有価証券 400株
S H O - B I	600	367.00	220,200	
ニホンフラッシュ	800	2,466.00	1,972,800	
前田工織	2,000	1,906.00	3,812,000	貸付有価証券 400株
永大産業	2,400	333.00	799,200	
アートネイチャー	2,000	621.00	1,242,000	
バンダイナムコホールディングス	18,800	5,340.00	100,392,000	
アイフィスジャパン	400	594.00	237,600	
共立印刷	3,200	175.00	560,000	
S H O E I	900	4,315.00	3,883,500	
フランスベッドホールディングス	2,600	984.00	2,558,400	貸付有価証券 100株

パイロットコーポレーション	3,200	4,065.00	13,008,000	
萩原工業	1,000	1,320.00	1,320,000	
トッパン・フォームズ	3,900	874.00	3,408,600	
フジシールインターナショナル	4,100	3,775.00	15,477,500	
タカラトミー	7,600	1,295.00	9,842,000	
廣濟堂	1,700	631.00	1,072,700	
エステールホールディングス	500	601.00	300,500	
アーク	6,900	101.00	696,900	貸付有価証券 2,500株
タカノ	700	741.00	518,700	
プロネクサス	1,600	1,204.00	1,926,400	
ホクシン	1,200	123.00	147,600	
ウッドワン	600	1,000.00	600,000	
大建工業	1,400	2,197.00	3,075,800	
凸版印刷	25,800	1,586.00	40,918,800	
大日本印刷	25,700	2,355.00	60,523,500	
図書印刷	1,800	1,261.00	2,269,800	貸付有価証券 100株
共同印刷	600	2,716.00	1,629,600	
N I S S H A	3,700	1,013.00	3,748,100	貸付有価証券 2,500株
光村印刷	200	1,915.00	383,000	
宝印刷	900	1,617.00	1,455,300	貸付有価証券 600株
アシックス	17,200	1,198.00	20,605,600	
ツツミ	600	2,001.00	1,200,600	
小松ウオール工業	600	1,814.00	1,088,400	
ヤマハ	10,800	4,885.00	52,758,000	
河合楽器製作所	600	2,668.00	1,600,800	
クリナップ	1,700	534.00	907,800	
ビジョン	11,000	4,135.00	45,485,000	貸付有価証券 7,700株
兼松サステック	100	1,593.00	159,300	
キングジム	1,500	863.00	1,294,500	貸付有価証券 1,000株
リンテック	4,300	2,148.00	9,236,400	
イトーキ	3,300	411.00	1,356,300	
任天堂	10,400	38,700.00	402,480,000	
三菱鉛筆	3,000	1,934.00	5,802,000	
タカラスタANDARD	3,800	1,635.00	6,213,000	
コクヨ	8,700	1,431.00	12,449,700	
ナカバヤシ	1,900	499.00	948,100	
グローブライド	900	3,260.00	2,934,000	
オカムラ	6,400	1,065.00	6,816,000	
美津濃	1,800	2,401.00	4,321,800	

東京電力ホールディングス	145,500	558.00	81,189,000	
中部電力	55,800	1,481.50	82,667,700	
関西電力	74,400	1,265.50	94,153,200	
中国電力	25,200	1,359.00	34,246,800	貸付有価証券 17,700株
北陸電力	17,800	785.00	13,973,000	貸付有価証券 6,100株
東北電力	42,700	1,108.00	47,311,600	
四国電力	16,400	989.00	16,219,600	
九州電力	37,700	1,071.00	40,376,700	
北海道電力	17,100	587.00	10,037,700	
沖縄電力	3,400	1,649.00	5,606,600	
電源開発	14,500	2,381.00	34,524,500	
エフオン	900	747.00	672,300	
イーレックス	3,100	1,294.00	4,011,400	貸付有価証券 2,100株
レノバ	3,000	862.00	2,586,000	貸付有価証券 1,200株
東京瓦斯	35,800	2,697.50	96,570,500	
大阪瓦斯	35,400	1,927.00	68,215,800	
東邦瓦斯	9,000	4,230.00	38,070,000	
北海道瓦斯	1,000	1,489.00	1,489,000	
広島ガス	3,700	337.00	1,246,900	
西部瓦斯	2,000	2,277.00	4,554,000	
静岡ガス	5,600	823.00	4,608,800	
メタウォーター	900	3,250.00	2,925,000	
SBSホールディングス	1,800	1,693.00	3,047,400	
東武鉄道	19,200	3,160.00	60,672,000	
相鉄ホールディングス	6,300	3,020.00	19,026,000	
東京急行電鉄	49,500	1,926.00	95,337,000	貸付有価証券 1,800株
京浜急行電鉄	25,000	1,839.00	45,975,000	
小田急電鉄	29,200	2,680.00	78,256,000	
京王電鉄	10,200	7,240.00	73,848,000	
京成電鉄	13,700	4,060.00	55,622,000	
富士急行	2,500	3,940.00	9,850,000	貸付有価証券 300株
新京成電鉄	500	2,080.00	1,040,000	
東日本旅客鉄道	32,400	10,310.00	334,044,000	貸付有価証券 16,100株
西日本旅客鉄道	16,300	8,500.00	138,550,000	
東海旅客鉄道	16,300	22,645.00	369,113,500	貸付有価証券 700株
西武ホールディングス	22,600	1,818.00	41,086,800	
鴻池運輸	2,900	1,659.00	4,811,100	

西日本鉄道	5,000	2,371.00	11,855,000	
ハマキョウレックス	1,400	3,615.00	5,061,000	
サカイ引越センター	1,000	6,430.00	6,430,000	
近鉄グループホールディングス	17,300	5,200.00	89,960,000	
阪急阪神ホールディングス	23,000	3,910.00	89,930,000	
南海電気鉄道	7,700	2,838.00	21,852,600	
京阪ホールディングス	7,700	4,685.00	36,074,500	
神戸電鉄	500	4,000.00	2,000,000	
名古屋鉄道	14,200	2,998.00	42,571,600	
山陽電気鉄道	1,300	2,244.00	2,917,200	
日本通運	6,700	5,790.00	38,793,000	
ヤマトホールディングス	30,300	2,201.00	66,690,300	
山九	4,800	5,500.00	26,400,000	
丸運	1,000	285.00	285,000	
丸全昭和運輸	1,400	3,290.00	4,606,000	
センコーグループホールディングス	9,500	877.00	8,331,500	
トナミホールディングス	400	5,640.00	2,256,000	
ニッコンホールディングス	6,600	2,467.00	16,282,200	
日本石油輸送	200	2,819.00	563,800	
福山通運	2,200	3,880.00	8,536,000	貸付有価証券 100株
セイノーホールディングス	12,900	1,382.00	17,827,800	
エスライン	500	949.00	474,500	貸付有価証券 200株
神奈川中央交通	400	3,855.00	1,542,000	
日立物流	3,800	3,225.00	12,255,000	
丸和運輸機関	900	4,070.00	3,663,000	
C & F ロジホールディングス	1,700	1,364.00	2,318,800	
九州旅客鉄道	14,500	3,240.00	46,980,000	
S Gホールディングス	16,300	2,941.00	47,938,300	
日本郵船	14,500	1,643.00	23,823,500	貸付有価証券 100株
商船三井	10,300	2,316.00	23,854,800	
川崎汽船	5,300	1,227.00	6,503,100	貸付有価証券 3,700株
N S ユナイテッド海運	900	2,267.00	2,040,300	
明治海運	1,900	304.00	577,600	
飯野海運	8,100	348.00	2,818,800	
共栄タンカー	200	1,485.00	297,000	
乾汽船	1,500	746.00	1,119,000	
日本航空	31,600	3,413.00	107,850,800	
A N Aホールディングス	31,600	3,636.00	114,897,600	貸付有価証券 500株
パスコ	300	826.00	247,800	

トランコム	500	6,560.00	3,280,000	
日新	1,500	1,749.00	2,623,500	
三菱倉庫	6,000	2,904.00	17,424,000	
三井倉庫ホールディングス	2,100	1,614.00	3,389,400	
住友倉庫	6,400	1,377.00	8,812,800	
澁澤倉庫	1,000	1,775.00	1,775,000	
東陽倉庫	3,100	308.00	954,800	
日本トランスシティ	3,800	443.00	1,683,400	
ケイヒン	400	1,192.00	476,800	
中央倉庫	1,100	1,002.00	1,102,200	
安田倉庫	1,400	882.00	1,234,800	
ファイズ	400	732.00	292,800	
東洋埠頭	600	1,362.00	817,200	
宇徳	1,500	506.00	759,000	
上組	10,600	2,564.00	27,178,400	
キムラユニティー	500	1,029.00	514,500	
キューソー流通システム	400	1,969.00	787,600	
近鉄エクスプレス	3,300	1,416.00	4,672,800	
東海運	1,100	248.00	272,800	
エーアイティー	1,100	999.00	1,098,900	
内外トランスライン	600	1,185.00	711,000	
日本コンセプト	700	1,176.00	823,200	
NEC ネットエスアイ	2,000	2,732.00	5,464,000	
クロスキャット	500	1,010.00	505,000	貸付有価証券 100株
システナ	6,400	1,574.00	10,073,600	
デジタルアーツ	1,000	8,890.00	8,890,000	貸付有価証券 700株
日鉄ソリューションズ	2,700	3,385.00	9,139,500	
キューブシステム	1,000	913.00	913,000	
エイジア	400	1,080.00	432,000	貸付有価証券 200株
コア	800	1,496.00	1,196,800	
ソリトンシステムズ	1,000	949.00	949,000	
ソフトクリエイトホールディングス	800	1,521.00	1,216,800	
T I S	6,000	5,400.00	32,400,000	
ネオス	700	790.00	553,000	貸付有価証券 400株
電算システム	700	3,980.00	2,786,000	
グリー	12,400	492.00	6,100,800	
コーエーテクモホールディングス	3,700	1,979.00	7,322,300	
三菱総合研究所	800	3,235.00	2,588,000	
ボルテージ	400	541.00	216,400	貸付有価証券 200株

電算	200	1,911.00	382,200	
A G S	1,000	674.00	674,000	
ファインデックス	1,500	854.00	1,281,000	
ブレインパッド	300	7,760.00	2,328,000	貸付有価証券 200株
K L a b	3,200	810.00	2,592,000	貸付有価証券 2,200株
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,300	1,057.00	2,431,100	貸付有価証券 900株
イーブックイニシアティブジャパン	300	2,150.00	645,000	貸付有価証券 200株
ネクソン	45,600	1,617.00	73,735,200	貸付有価証券 31,900株
アイスタイル	4,600	791.00	3,638,600	貸付有価証券 3,200株
エムアップ	600	2,061.00	1,236,600	貸付有価証券 400株
エイチーム	1,200	1,506.00	1,807,200	
エニグモ	600	3,185.00	1,911,000	
テクノスジャパン	1,500	565.00	847,500	
コロプラ	5,800	753.00	4,367,400	
ブロードリーフ	8,900	556.00	4,948,400	
クロス・マーケティンググループ	800	349.00	279,200	貸付有価証券 300株
デジタルハーツホールディングス	800	1,012.00	809,600	貸付有価証券 500株
システム情報	900	826.00	743,400	
メディアドゥホールディングス	600	3,300.00	1,980,000	
じげん	2,500	711.00	1,777,500	貸付有価証券 1,700株
ブイキューブ	1,000	514.00	514,000	
エンカレッジ・テクノロジー	200	881.00	176,200	
サイバーリンクス	300	1,110.00	333,000	
フィックスターズ	1,900	1,810.00	3,439,000	貸付有価証券 200株
C A R T A H O L D I N G S	900	1,663.00	1,496,700	
オブティム	800	2,593.00	2,074,400	貸付有価証券 500株
セレス	600	1,739.00	1,043,400	貸付有価証券 400株
ティーガイア	1,800	1,754.00	3,157,200	
セック	300	3,275.00	982,500	
日本アジアグループ	2,000	350.00	700,000	
豆蔵ホールディングス	1,200	1,256.00	1,507,200	
テクマトリックス	1,300	1,891.00	2,458,300	
プロシップ	500	1,161.00	580,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	42,900	336.00	14,414,400	

GMOペイメントゲートウェイ	2,900	7,300.00	21,170,000	
ザッパラス	1,000	380.00	380,000	
システムリサーチ	200	2,868.00	573,600	
インターネットイニシアティブ	2,900	2,083.00	6,040,700	
さくらインターネット	2,100	502.00	1,054,200	
ヴィンクス	600	1,301.00	780,600	貸付有価証券 400株
GMOクラウド	400	3,235.00	1,294,000	貸付有価証券 200株
SRAホールディングス	900	2,424.00	2,181,600	
Minor iソリューションズ	400	1,625.00	650,000	
システムインテグレータ	500	665.00	332,500	貸付有価証券 400株
朝日ネット	1,400	580.00	812,000	
eBASE	1,100	1,048.00	1,152,800	
アバント	600	1,911.00	1,146,600	
アドソル日進	600	1,650.00	990,000	
フリービット	1,100	1,015.00	1,116,500	貸付有価証券 700株
コムチュア	1,000	4,365.00	4,365,000	貸付有価証券 700株
サイバーコム	300	1,949.00	584,700	
アステリア	1,200	1,099.00	1,318,800	貸付有価証券 100株
マークラインズ	800	1,939.00	1,551,200	
メディカル・データ・ビジョン	1,600	1,452.00	2,323,200	貸付有価証券 1,100株
gumi	2,300	564.00	1,297,200	
ショーケース	400	549.00	219,600	貸付有価証券 200株
モバイルファクトリー	500	1,443.00	721,500	貸付有価証券 300株
テラスカイ	300	1,454.00	436,200	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,803.00	1,442,400	貸付有価証券 100株
PCIホールディングス	400	1,990.00	796,000	
パイブドHD	300	1,052.00	315,600	貸付有価証券 200株
アイビーシー	300	1,327.00	398,100	貸付有価証券 200株
ネオジャパン	400	930.00	372,000	貸付有価証券 200株
PR TIMES	200	2,814.00	562,800	
ランドコンピュータ	300	1,179.00	353,700	
ダブルスタンダード	200	4,815.00	963,000	
オープンドア	900	3,020.00	2,718,000	
マイネット	600	770.00	462,000	

アカツキ	600	5,880.00	3,528,000	貸付有価証券 400株
ベネフィットジャパン	200	858.00	171,600	
Ubicomホールディングス	300	1,584.00	475,200	
LINE	5,400	3,170.00	17,118,000	貸付有価証券 3,700株
カナミックネットワーク	400	2,180.00	872,000	
ノムラシステムコーポレーション	200	742.00	148,400	
チェンジ	300	2,610.00	783,000	貸付有価証券 200株
シンクロ・フード	800	574.00	459,200	
オークネット	900	1,274.00	1,146,600	
エイトレッド	200	1,844.00	368,800	
AOI TYO Holdings	1,900	736.00	1,398,400	貸付有価証券 1,300株
マクロミル	3,200	1,238.00	3,961,600	
ビーグリー	500	863.00	431,500	
オロ	400	2,868.00	1,147,200	貸付有価証券 200株
テモナ	200	429.00	85,800	
ソルクシーズ	800	759.00	607,200	
フェイス	700	786.00	550,200	
プロトコーポレーション	900	1,794.00	1,614,600	
ハイマックス	200	1,759.00	351,800	
野村総合研究所	11,400	5,310.00	60,534,000	
サイバネットシステム	1,500	660.00	990,000	
CEホールディングス	500	973.00	486,500	
日本システム技術	300	1,469.00	440,700	
インテージホールディングス	2,300	1,010.00	2,323,000	
東邦システムサイエンス	600	912.00	547,200	
ソースネクスト	6,900	451.00	3,111,900	貸付有価証券 4,900株
インフォコム	1,900	2,362.00	4,487,800	
FIG	1,700	305.00	518,500	
アルテリア・ネットワークス	2,000	1,131.00	2,262,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,648.00	659,200	
フォーカスシステムズ	1,200	844.00	1,012,800	
クレスコ	500	3,410.00	1,705,000	
フジ・メディア・ホールディングス	18,600	1,475.00	27,435,000	
オービック	6,200	13,130.00	81,406,000	
ジャストシステム	2,500	3,400.00	8,500,000	
TDCソフト	1,600	791.00	1,265,600	
ヤフー	116,600	313.00	36,495,800	
トレンドマイクロ	9,500	4,875.00	46,312,500	

I Dホールディングス	700	1,065.00	745,500	
日本オラクル	3,600	7,590.00	27,324,000	
アルファシステムズ	500	2,753.00	1,376,500	
フューチャー	2,400	1,929.00	4,629,600	
C A C Holdings	1,300	1,691.00	2,198,300	
ソフトバンク・テクノロジー	800	2,340.00	1,872,000	
トーセ	500	829.00	414,500	
オービックビジネスコンサルタント	1,800	4,870.00	8,766,000	貸付有価証券 1,200株
伊藤忠テクノソリューションズ	8,200	2,696.00	22,107,200	
アイティフォー	2,200	835.00	1,837,000	
東計電算	300	2,998.00	899,400	
エクスネット	400	914.00	365,600	
大塚商会	9,700	4,215.00	40,885,500	
サイボウズ	2,100	1,183.00	2,484,300	
ソフトブレーン	1,500	472.00	708,000	
電通国際情報サービス	1,100	3,390.00	3,729,000	
デジタルガレージ	3,500	3,535.00	12,372,500	
E Mシステムズ	1,500	1,472.00	2,208,000	
ウェザーニューズ	600	3,210.00	1,926,000	
C I J	1,400	993.00	1,390,200	
東洋ビジネスエンジニアリング	200	2,150.00	430,000	
日本エンタープライズ	2,000	159.00	318,000	
WOWOW	900	2,642.00	2,377,800	
スカラ	1,200	830.00	996,000	
インテリジェント ウェイブ	700	811.00	567,700	貸付有価証券 200株
I M A G I C A GROUP	1,500	520.00	780,000	貸付有価証券 900株
ネットワンシステムズ	6,300	2,913.00	18,351,900	
システムソフト	4,500	95.00	427,500	
アルゴグラフィックス	1,500	2,307.00	3,460,500	
マーベラス	2,700	804.00	2,170,800	貸付有価証券 1,800株
エイベックス	3,100	1,343.00	4,163,300	
日本ユニシス	5,600	3,545.00	19,852,000	
兼松エレクトロニクス	1,000	3,120.00	3,120,000	
東京放送ホールディングス	11,900	1,806.00	21,491,400	
日本テレビホールディングス	16,500	1,559.00	25,723,500	
朝日放送グループホールディングス	1,700	721.00	1,225,700	
テレビ朝日ホールディングス	4,900	1,735.00	8,501,500	
スカパーJ S A Tホールディングス	13,700	413.00	5,658,100	
テレビ東京ホールディングス	1,500	2,254.00	3,381,000	

日本BS放送	600	1,058.00	634,800	貸付有価証券 400株
ビジョン	600	5,630.00	3,378,000	貸付有価証券 400株
スマートバリュー	600	708.00	424,800	
USEN-NEXT HOLDINGS	700	749.00	524,300	
コネクシオ	1,400	1,285.00	1,799,000	
クロップス	400	622.00	248,800	
日本電信電話	122,400	4,866.00	595,598,400	
KDDI	157,700	2,788.50	439,746,450	
ソフトバンク	189,700	1,410.00	267,477,000	貸付有価証券 127,800株
光通信	2,100	22,020.00	46,242,000	
NTTドコモ	113,300	2,495.50	282,740,150	
エムティーアイ	1,700	663.00	1,127,100	
GMOインターネット	6,500	1,691.00	10,991,500	貸付有価証券 4,500株
アイドママーケティングコミュニケーション	400	631.00	252,400	
カドカワ	5,200	1,442.00	7,498,400	
学研ホールディングス	600	4,535.00	2,721,000	
ゼンリン	3,600	2,053.00	7,390,800	
昭文社	900	374.00	336,600	
インプレスホールディングス	1,600	130.00	208,000	
アイネット	1,000	1,243.00	1,243,000	
松竹	1,200	12,710.00	15,252,000	
東宝	11,800	4,660.00	54,988,000	貸付有価証券 8,100株
東映	700	14,600.00	10,220,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	47,600	1,300.00	61,880,000	
ピー・シー・エー	200	3,580.00	716,000	
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,015.00	604,500	
DTS	2,000	4,415.00	8,830,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,300	3,825.00	31,747,500	
シーイーシー	1,900	1,930.00	3,667,000	
カブコン	7,700	2,234.00	17,201,800	
アイ・エス・ピー	400	1,603.00	641,200	
ジャステック	1,000	902.00	902,000	
SCSK	4,700	5,250.00	24,675,000	
日本システムウエア	600	2,456.00	1,473,600	
アイネス	2,300	1,184.00	2,723,200	
TKC	1,500	4,405.00	6,607,500	
富士ソフト	2,700	4,635.00	12,514,500	
NSD	2,900	3,025.00	8,772,500	
コナミホールディングス	7,300	5,120.00	37,376,000	

福井コンピュータホールディングス	600	2,422.00	1,453,200	
J B C Cホールディングス	1,400	1,273.00	1,782,200	
ミロク情報サービス	1,800	3,225.00	5,805,000	貸付有価証券 1,200株
ソフトバンクグループ	74,800	10,250.00	766,700,000	代用有価証券 3,400株
ハウスイ	200	807.00	161,400	
高千穂交易	700	977.00	683,900	
伊藤忠食品	400	4,385.00	1,754,000	
エレマテック	1,600	975.00	1,560,000	
J A L U X	500	2,828.00	1,414,000	
あらた	1,300	3,760.00	4,888,000	
トーメンデバイス	300	2,258.00	677,400	
東京エレクトロン デバイス	600	1,816.00	1,089,600	
フィールズ	1,600	535.00	856,000	
双日	99,200	349.00	34,620,800	
アルフレッサ ホールディングス	20,000	2,735.00	54,700,000	
横浜冷凍	5,000	948.00	4,740,000	
神栄	300	744.00	223,200	
ラサ商事	900	769.00	692,100	
ラクーンホールディングス	900	639.00	575,100	
アルコニックス	1,900	1,348.00	2,561,200	
神戸物産	2,700	4,995.00	13,486,500	
あい ホールディングス	2,600	1,696.00	4,409,600	
ディーブイエックス	700	793.00	555,100	
ダイワボウホールディングス	1,600	4,555.00	7,288,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	5,000	1,274.00	6,370,000	
ラクト・ジャパン	800	4,110.00	3,288,000	貸付有価証券 500株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,400	1,040.00	3,536,000	
八洲電機	1,400	798.00	1,117,200	
メディアスホールディングス	1,000	720.00	720,000	
レスターホールディングス	2,000	1,494.00	2,988,000	
ジューテックホールディングス	400	918.00	367,200	
大光	800	637.00	509,600	貸付有価証券 100株
O C H Iホールディングス	500	1,116.00	558,000	
T O K A Iホールディングス	9,500	885.00	8,407,500	
黒谷	400	442.00	176,800	貸付有価証券 200株
C o m i n i x	300	848.00	254,400	
三洋貿易	900	2,201.00	1,980,900	
ビューティガレージ	300	1,273.00	381,900	貸付有価証券 200株
ウイン・パートナーズ	1,200	1,050.00	1,260,000	

ミタチ産業	600	692.00	415,200	
シップヘルスケアホールディングス	3,700	4,620.00	17,094,000	
明治電機工業	600	1,305.00	783,000	
デリカフーズホールディングス	300	1,478.00	443,400	
スターティアホールディングス	400	525.00	210,000	
コメダホールディングス	4,200	2,063.00	8,664,600	
富士興産	700	701.00	490,700	
協栄産業	200	1,476.00	295,200	
小野建	1,600	1,366.00	2,185,600	
南陽	400	1,529.00	611,600	
佐島電機	1,300	869.00	1,129,700	
エコートレーディング	400	541.00	216,400	
伯東	1,200	1,147.00	1,376,400	
コンドーテック	1,400	916.00	1,282,400	
中山福	1,000	517.00	517,000	
ナガイレーベン	2,600	2,396.00	6,229,600	
三菱食品	2,000	2,840.00	5,680,000	
松田産業	1,300	1,450.00	1,885,000	
第一興商	2,700	4,995.00	13,486,500	
メディバルホールディングス	19,400	2,351.00	45,609,400	
S P K	400	2,390.00	956,000	
萩原電気ホールディングス	700	2,609.00	1,826,300	
アズワン	1,300	9,750.00	12,675,000	
スズデン	600	1,354.00	812,400	
尾家産業	600	1,249.00	749,400	
シモジマ	1,100	1,030.00	1,133,000	
ドウシシャ	1,700	1,703.00	2,895,100	
小津産業	400	1,691.00	676,400	貸付有価証券 200株
高速	1,100	1,118.00	1,229,800	
たけびし	600	1,259.00	755,400	
リックス	400	1,453.00	581,200	
丸文	1,600	537.00	859,200	
ハピネット	1,500	1,339.00	2,008,500	
橋本総業ホールディングス	400	1,405.00	562,000	
日本ライフライン	5,600	1,734.00	9,710,400	貸付有価証券 3,900株
タカショー	900	462.00	415,800	貸付有価証券 100株
エクセル	700	1,631.00	1,141,700	
マルカ	600	1,865.00	1,119,000	
I D O M	6,100	271.00	1,653,100	貸付有価証券 4,200株
日本エム・ディ・エム	1,000	1,440.00	1,440,000	

進和	1,100	2,136.00	2,349,600	貸付有価証券 700株
エスケイジャパン	500	517.00	258,500	貸付有価証券 300株
ダイトロン	800	1,148.00	918,400	
シークス	2,300	1,190.00	2,737,000	
田中商事	600	586.00	351,600	
オーハシテクニカ	1,000	1,385.00	1,385,000	
白銅	600	1,308.00	784,800	
伊藤忠商事	125,600	1,999.00	251,074,400	
丸紅	177,100	683.40	121,030,140	
高島	300	1,620.00	486,000	
長瀬産業	10,100	1,586.00	16,018,600	
蝶理	1,100	1,577.00	1,734,700	
豊田通商	20,000	3,135.00	62,700,000	
三共生興	3,000	517.00	1,551,000	
兼松	7,200	1,226.00	8,827,200	
ツカモトコーポレーション	300	994.00	298,200	
三井物産	147,900	1,677.50	248,102,250	
日本紙パルプ商事	1,000	3,790.00	3,790,000	
日立ハイテクノロジーズ	5,500	4,625.00	25,437,500	
カメイ	2,400	1,137.00	2,728,800	
東都水産	300	2,526.00	757,800	
OUGホールディングス	300	2,538.00	761,400	
スターゼン	700	4,025.00	2,817,500	
山善	7,000	1,009.00	7,063,000	
椿本興業	400	2,962.00	1,184,800	
住友商事	106,200	1,568.50	166,574,700	
内田洋行	800	3,540.00	2,832,000	
三菱商事	126,100	2,833.00	357,241,300	
第一実業	800	3,265.00	2,612,000	
キヤノンマーケティングジャパン	5,100	2,319.00	11,826,900	
西華産業	1,000	1,243.00	1,243,000	
佐藤商事	1,600	891.00	1,425,600	
菱洋エレクトロ	1,800	1,669.00	3,004,200	
東京産業	1,800	454.00	817,200	
ユアサ商事	1,800	2,949.00	5,308,200	
神鋼商事	400	2,264.00	905,600	
小林産業	1,200	312.00	374,400	
阪和興業	3,100	2,756.00	8,543,600	
正栄食品工業	1,300	3,035.00	3,945,500	貸付有価証券 300株
カナデン	1,600	1,289.00	2,062,400	

菱電商事	1,400	1,533.00	2,146,200	
フルサト工業	1,000	1,465.00	1,465,000	
岩谷産業	4,000	3,555.00	14,220,000	
すてきナイスグループ	800	591.00	472,800	貸付有価証券 100株
昭光通商	700	626.00	438,200	
ニチモウ	300	1,723.00	516,900	
極東貿易	500	1,479.00	739,500	
イワキ	2,200	442.00	972,400	
三愛石油	4,800	945.00	4,536,000	
稲畑産業	4,300	1,349.00	5,800,700	
G S Iクレオス	500	1,120.00	560,000	
明和産業	1,700	372.00	632,400	
クワザワ	600	517.00	310,200	
ワキタ	3,800	1,008.00	3,830,400	
東邦ホールディングス	5,300	2,429.00	12,873,700	貸付有価証券 400株
サンゲツ	5,400	2,076.00	11,210,400	
ミツウロコグループホールディングス	2,400	767.00	1,840,800	
シナネンホールディングス	700	1,848.00	1,293,600	
伊藤忠エネクス	4,000	839.00	3,356,000	
サンリオ	5,500	2,418.00	13,299,000	貸付有価証券 1,200株
サンワテクノス	1,100	788.00	866,800	
リョーサン	2,000	2,550.00	5,100,000	
新光商事	1,700	1,838.00	3,124,600	
トーホー	800	2,148.00	1,718,400	
三信電気	1,200	1,770.00	2,124,000	
東陽テクニカ	2,100	899.00	1,887,900	
モスフードサービス	2,400	2,377.00	5,704,800	貸付有価証券 600株
加賀電子	1,800	1,586.00	2,854,800	
ソーダニッカ	1,800	507.00	912,600	
立花エレテック	1,300	1,519.00	1,974,700	
フォーバル	800	940.00	752,000	
P A L T A C	3,200	5,600.00	17,920,000	
三谷産業	2,200	282.00	620,400	
太平洋興発	700	690.00	483,000	
西本W i s m e t t a cホールディングス	400	3,995.00	1,598,000	
国際紙バルブ商事	4,200	271.00	1,138,200	
ヤマタネ	900	1,332.00	1,198,800	
丸紅建材リース	200	1,677.00	335,400	
日鉄物産	1,300	4,185.00	5,440,500	
泉州電業	600	2,320.00	1,392,000	

トラスコ中山	3,700	2,410.00	8,917,000	
オートバックスセブン	7,100	1,688.00	11,984,800	
モリト	1,300	796.00	1,034,800	
加藤産業	2,800	3,375.00	9,450,000	
北恵	300	781.00	234,300	
イノテック	1,100	817.00	898,700	
イエローハット	3,400	1,394.00	4,739,600	
J Kホールディングス	1,600	548.00	876,800	
日伝	1,500	1,658.00	2,487,000	
北沢産業	1,400	286.00	400,400	貸付有価証券 1,100株
杉本商事	1,000	2,071.00	2,071,000	
因幡電機産業	2,600	4,310.00	11,206,000	
東テク	600	2,082.00	1,249,200	
ミスミグループ本社	22,500	2,561.00	57,622,500	貸付有価証券 15,600株
アルテック	1,300	205.00	266,500	
タキヒヨー	500	1,771.00	885,500	
蔵王産業	300	1,303.00	390,900	
スズケン	8,200	6,690.00	54,858,000	
ジェコス	1,200	948.00	1,137,600	貸付有価証券 100株
ルネサスイーストン	1,600	431.00	689,600	
ローソン	4,500	5,070.00	22,815,000	貸付有価証券 300株
サンエー	1,400	4,210.00	5,894,000	
カワチ薬品	1,400	1,843.00	2,580,200	貸付有価証券 900株
エービーシー・マート	2,800	6,780.00	18,984,000	
ハードオフコーポレーション	700	699.00	489,300	
アスクル	1,900	2,696.00	5,122,400	貸付有価証券 1,300株
ゲオホールディングス	2,700	1,367.00	3,690,900	
アダストリア	2,500	2,670.00	6,675,000	
ジーフット	1,100	639.00	702,900	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	687.00	206,100	
くら寿司	1,100	4,225.00	4,647,500	貸付有価証券 700株
キャンドウ	800	1,637.00	1,309,600	貸付有価証券 500株
パルグループホールディングス	900	3,290.00	2,961,000	
エディオン	7,600	946.00	7,189,600	
サーラコーポレーション	3,700	558.00	2,064,600	
ワッツ	800	681.00	544,800	
ハローズ	700	2,185.00	1,529,500	

フジオフードシステム	800	2,853.00	2,282,400	貸付有価証券 500株
あみやき亭	400	3,320.00	1,328,000	
ひらまつ	3,600	336.00	1,209,600	
大黒天物産	400	3,450.00	1,380,000	貸付有価証券 200株
ハニーズホールディングス	1,600	976.00	1,561,600	貸付有価証券 1,100株
ファーマライズホールディングス	500	513.00	256,500	貸付有価証券 300株
アルペン	1,400	1,619.00	2,266,600	貸付有価証券 900株
ハブ	600	1,273.00	763,800	
クオールホールディングス	2,700	1,441.00	3,890,700	
ジンズ	1,000	6,460.00	6,460,000	貸付有価証券 600株
ビックカメラ	10,600	1,132.00	11,999,200	
D C Mホールディングス	9,700	1,083.00	10,505,100	貸付有価証券 6,700株
ペッパーフードサービス	1,400	1,928.00	2,699,200	貸付有価証券 900株
MonotaRO	11,300	2,321.00	26,227,300	貸付有価証券 1,900株
東京一番フーズ	500	601.00	300,500	
DDホールディングス	400	1,903.00	761,200	
きちりホールディングス	500	741.00	370,500	
アークランドサービスホールディングス	1,300	1,917.00	2,492,100	貸付有価証券 900株
J.フロント リテイリング	23,000	1,135.00	26,105,000	
ドトール・日レスホールディングス	3,100	2,093.00	6,488,300	
マツモトキヨシホールディングス	7,400	3,205.00	23,717,000	
ブロンコビリー	900	2,204.00	1,983,600	貸付有価証券 600株
Z O Z O	19,500	1,868.00	36,426,000	
トレジャー・ファクトリー	500	679.00	339,500	
物語コーポレーション	400	8,650.00	3,460,000	
ココカラファイン	2,000	4,210.00	8,420,000	
三越伊勢丹ホールディングス	33,600	898.00	30,172,800	
Hamee	500	651.00	325,500	貸付有価証券 200株
ウエルシアホールディングス	4,800	3,810.00	18,288,000	
クリエイトSDホールディングス	2,600	2,351.00	6,112,600	
丸善CHIホールディングス	2,100	375.00	787,500	
ミサワ	400	405.00	162,000	
ティーライフ	200	855.00	171,000	
チムニー	500	2,480.00	1,240,000	
シュッピン	1,300	846.00	1,099,800	

ネクステージ	2,900	1,108.00	3,213,200	貸付有価証券 1,900株
ジョイフル本田	5,300	1,233.00	6,534,900	貸付有価証券 3,700株
鳥貴族	600	1,899.00	1,139,400	貸付有価証券 400株
麒麟堂ホールディングス	700	1,605.00	1,123,500	
ホットランド	900	1,565.00	1,408,500	貸付有価証券 600株
すかいらーくホールディングス	16,800	1,918.00	32,222,400	貸付有価証券 11,700株
SFPホールディングス	800	1,841.00	1,472,800	貸付有価証券 500株
綿半ホールディングス	700	2,334.00	1,633,800	
ヨシックス	300	2,406.00	721,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,200	933.00	4,851,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	684.00	478,800	貸付有価証券 400株
B E E N O S	600	1,961.00	1,176,600	
あさひ	1,500	1,314.00	1,971,000	
日本調剤	600	3,545.00	2,127,000	
コスモス薬品	800	17,160.00	13,728,000	貸付有価証券 500株
トーエル	900	679.00	611,100	
オンリー	300	799.00	239,700	
セブン&アイ・ホールディングス	75,300	3,666.00	276,049,800	貸付有価証券 52,500株
薬王堂	800	2,197.00	1,757,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,800	1,420.00	6,816,000	貸付有価証券 1,200株
ツルハホールディングス	3,900	8,710.00	33,969,000	
サンマルクホールディングス	1,400	2,361.00	3,305,400	
フェリシモ	400	936.00	374,400	
トリドールホールディングス	2,200	1,876.00	4,127,200	貸付有価証券 1,400株
T O K Y O B A S E	1,600	813.00	1,300,800	貸付有価証券 1,100株
ウイルプラスホールディングス	300	778.00	233,400	
ジャパンミート	900	1,690.00	1,521,000	
サツドラホールディングス	300	1,832.00	549,600	貸付有価証券 200株
デファクトスタンダード	200	347.00	69,400	
アレンザホールディングス	1,000	848.00	848,000	貸付有価証券 100株
パロックジャパンリミテッド	1,400	933.00	1,306,200	貸付有価証券 400株
クスリのアオキホールディングス	1,800	6,920.00	12,456,000	貸付有価証券 100株

力の源ホールディングス	700	705.00	493,500	
スシログローバルホールディングス	2,000	7,550.00	15,100,000	
L I X I L ビバ	1,500	1,215.00	1,822,500	
メディカルシステムネットワーク	1,900	487.00	925,300	
はるやまホールディングス	900	807.00	726,300	
ノジマ	3,200	1,830.00	5,856,000	
カッパ・クリエイト	2,500	1,374.00	3,435,000	貸付有価証券 100株
ライトオン	1,300	703.00	913,900	
ジーンズメイト	600	322.00	193,200	貸付有価証券 400株
良品計画	2,500	19,670.00	49,175,000	貸付有価証券 300株
三城ホールディングス	2,200	333.00	732,600	
アドヴァン	2,700	1,020.00	2,754,000	
アルビス	700	2,359.00	1,651,300	
コナカ	2,300	402.00	924,600	
ハウス オブ ローゼ	200	1,561.00	312,200	
G - 7ホールディングス	500	3,010.00	1,505,000	
イオン北海道	1,800	710.00	1,278,000	
コジマ	3,200	486.00	1,555,200	貸付有価証券 2,200株
ヒマラヤ	600	854.00	512,400	
コーナン商事	2,300	2,234.00	5,138,200	
エコス	700	1,399.00	979,300	
ワタミ	2,400	1,433.00	3,439,200	
マルシェ	500	774.00	387,000	貸付有価証券 300株
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	10,800	6,720.00	72,576,000	
西松屋チェーン	3,900	871.00	3,396,900	貸付有価証券 2,700株
ゼンショーホールディングス	8,500	2,255.00	19,167,500	
幸楽苑ホールディングス	1,100	2,918.00	3,209,800	
ハークスレイ	400	1,007.00	402,800	
サイゼリヤ	3,000	2,426.00	7,278,000	貸付有価証券 200株
V Tホールディングス	8,100	453.00	3,669,300	
魚力	500	1,472.00	736,000	
ポブラ	500	480.00	240,000	貸付有価証券 400株
フジ・コーポレーション	500	2,115.00	1,057,500	貸付有価証券 100株
ユナイテッドアローズ	2,000	3,605.00	7,210,000	
ハイデイ日高	2,600	2,020.00	5,252,000	貸付有価証券 1,800株

京都きもの友禅	1,100	347.00	381,700	貸付有価証券 700株
コロワイド	6,000	2,096.00	12,576,000	貸付有価証券 100株
ピーシーデポコーポレーション	2,400	391.00	938,400	
壱番屋	1,300	4,535.00	5,895,500	貸付有価証券 900株
P L A N T	500	778.00	389,000	
スギホールディングス	3,900	4,935.00	19,246,500	
ヴィア・ホールディングス	2,200	593.00	1,304,600	
スクロール	2,800	341.00	954,800	
ヨンドシーホールディングス	2,000	2,398.00	4,796,000	貸付有価証券 100株
ユニー・ファミリーマートホールディングス	20,100	2,616.00	52,581,600	貸付有価証券 3,600株
木曽路	2,200	2,511.00	5,524,200	貸付有価証券 1,500株
S R Sホールディングス	2,100	1,007.00	2,114,700	貸付有価証券 1,500株
千趣会	3,200	260.00	832,000	貸付有価証券 300株
タカキュー	1,500	171.00	256,500	
ケーヨー	3,300	496.00	1,636,800	
上新電機	2,100	2,190.00	4,599,000	
日本瓦斯	2,900	2,578.00	7,476,200	
ロイヤルホールディングス	3,100	2,695.00	8,354,500	貸付有価証券 2,100株
東天紅	100	1,201.00	120,100	
いなげや	2,000	1,339.00	2,678,000	
島忠	3,800	2,455.00	9,329,000	貸付有価証券 100株
チヨダ	1,900	1,625.00	3,087,500	
ライフコーポレーション	1,300	2,301.00	2,991,300	
リンガーハット	2,200	2,348.00	5,165,600	貸付有価証券 300株
M r M a x H D	2,500	448.00	1,120,000	
テンアライド	1,700	413.00	702,100	貸付有価証券 100株
A O K Iホールディングス	3,600	1,026.00	3,693,600	
オークワ	2,500	1,059.00	2,647,500	
コメリ	2,800	2,135.00	5,978,000	
青山商事	3,100	2,095.00	6,494,500	
しまむら	2,100	8,300.00	17,430,000	貸付有価証券 1,400株
はせがわ	1,000	393.00	393,000	
高島屋	14,100	1,151.00	16,229,100	貸付有価証券 6,400株
松屋	3,600	906.00	3,261,600	

エイチ・ツー・オー リテイリング	9,200	1,175.00	10,810,000	
近鉄百貨店	700	3,300.00	2,310,000	
パルコ	1,700	1,068.00	1,815,600	
丸井グループ	15,200	2,264.00	34,412,800	
アクシアル リテイリング	1,500	3,975.00	5,962,500	
井筒屋	1,000	243.00	243,000	
イオン	69,100	1,877.50	129,735,250	
イズミ	3,700	4,640.00	17,168,000	
平和堂	3,600	1,911.00	6,879,600	
フジ	2,200	1,757.00	3,865,400	
ヤオコー	2,000	5,200.00	10,400,000	
ゼビオホールディングス	2,200	1,208.00	2,657,600	
ケーズホールディングス	18,600	1,033.00	19,213,800	
Olympicグループ	1,100	670.00	737,000	貸付有価証券 700株
日産東京販売ホールディングス	2,600	268.00	696,800	
Genky DrugStores	900	2,608.00	2,347,200	
総合メディカルホールディングス	1,600	1,740.00	2,784,000	
ブックオフグループホールディングス	900	874.00	786,600	貸付有価証券 600株
アインホールディングス	2,400	8,300.00	19,920,000	貸付有価証券 1,600株
元気寿司	500	3,770.00	1,885,000	
ヤマダ電機	54,800	508.00	27,838,400	貸付有価証券 28,100株
アークランドサカモト	3,100	1,329.00	4,119,900	
ニトリホールディングス	7,800	12,925.00	100,815,000	
グルメ杵屋	1,300	1,158.00	1,505,400	貸付有価証券 600株
愛眼	1,500	246.00	369,000	貸付有価証券 100株
ケーユーホールディングス	900	845.00	760,500	
吉野家ホールディングス	6,300	1,794.00	11,302,200	貸付有価証券 4,400株
松屋フーズホールディングス	900	3,320.00	2,988,000	
サガミホールディングス	2,400	1,320.00	3,168,000	貸付有価証券 100株
関西スーパーマーケット	1,400	1,041.00	1,457,400	
王将フードサービス	1,300	6,640.00	8,632,000	
プレナス	2,000	1,834.00	3,668,000	
ミニストップ	1,300	1,615.00	2,099,500	貸付有価証券 900株
アークス	3,400	2,119.00	7,204,600	貸付有価証券 100株
バローホールディングス	3,900	2,205.00	8,599,500	

藤久	200	735.00	147,000	貸付有価証券 100株
ベルク	900	5,150.00	4,635,000	
大庄	900	1,543.00	1,388,700	
ファーストリテイリング	2,400	62,770.00	150,648,000	
サンドラッグ	6,800	2,722.00	18,509,600	
サクスパー ホールディングス	1,600	999.00	1,598,400	
ヤマザワ	400	1,627.00	650,800	
やまや	300	2,000.00	600,000	
ペルーナ	4,400	762.00	3,352,800	
島根銀行	400	701.00	280,400	
じもとホールディングス	12,200	98.00	1,195,600	
めぶきフィナンシャルグループ	93,500	273.00	25,525,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,400	1,675.00	4,020,000	
九州フィナンシャルグループ	29,500	429.00	12,655,500	
ゆうちょ銀行	51,000	1,112.00	56,712,000	
富山第一銀行	4,300	305.00	1,311,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	112,900	416.00	46,966,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	11,300	795.00	8,983,500	
関西みらいフィナンシャルグループ	8,500	700.00	5,950,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,441.00	2,161,500	
第四北越フィナンシャルグループ	3,100	2,792.00	8,655,200	
新生銀行	13,200	1,543.00	20,367,600	
あおぞら銀行	10,100	2,639.00	26,653,900	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,237,800	501.10	620,261,580	代用有価証券 27,100株
りそなホールディングス	197,300	459.90	90,738,270	
三井住友トラスト・ホールディングス	35,400	3,985.00	141,069,000	
三井住友フィナンシャルグループ	126,800	3,783.00	479,684,400	代用有価証券 4,400株
千葉銀行	61,800	521.00	32,197,800	
群馬銀行	35,900	385.00	13,821,500	
武蔵野銀行	2,700	2,034.00	5,491,800	
千葉興業銀行	4,900	260.00	1,274,000	
筑波銀行	7,500	173.00	1,297,500	
七十七銀行	5,600	1,630.00	9,128,000	
青森銀行	1,400	2,797.00	3,915,800	
秋田銀行	1,200	2,112.00	2,534,400	
山形銀行	2,000	1,625.00	3,250,000	
岩手銀行	1,300	2,927.00	3,805,100	
東邦銀行	16,100	249.00	4,008,900	
東北銀行	1,000	1,070.00	1,070,000	
みちのく銀行	1,100	1,662.00	1,828,200	貸付有価証券 800株

ふくおかフィナンシャルグループ	15,900	1,861.00	29,589,900	
静岡銀行	45,300	860.00	38,958,000	
十六銀行	2,400	2,273.00	5,455,200	
スルガ銀行	18,400	436.00	8,022,400	貸付有価証券 12,800株
八十二銀行	43,400	453.00	19,660,200	
山梨中央銀行	2,200	1,209.00	2,659,800	
大垣共立銀行	3,800	2,406.00	9,142,800	
福井銀行	1,500	1,530.00	2,295,000	
北國銀行	1,900	3,010.00	5,719,000	
清水銀行	700	1,725.00	1,207,500	
富山銀行	300	2,482.00	744,600	
滋賀銀行	3,600	2,569.00	9,248,400	
南都銀行	2,800	2,175.00	6,090,000	
百五銀行	16,100	324.00	5,216,400	
京都銀行	6,400	4,250.00	27,200,000	
紀陽銀行	6,400	1,472.00	9,420,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,900	1,166.00	13,875,400	
広島銀行	26,400	557.00	14,704,800	
山陰合同銀行	10,700	698.00	7,468,600	
中国銀行	15,500	1,022.00	15,841,000	
鳥取銀行	600	1,350.00	810,000	
伊予銀行	23,800	559.00	13,304,200	
百十四銀行	1,900	2,212.00	4,202,800	
四国銀行	2,500	958.00	2,395,000	
阿波銀行	2,800	2,660.00	7,448,000	
大分銀行	1,100	3,160.00	3,476,000	
宮崎銀行	1,200	2,589.00	3,106,800	
佐賀銀行	1,100	1,581.00	1,739,100	
沖縄銀行	1,600	3,440.00	5,504,000	
琉球銀行	4,100	1,152.00	4,723,200	
セブン銀行	60,800	278.00	16,902,400	
みずほフィナンシャルグループ	2,444,800	153.70	375,765,760	代用有価証券 91,000株
高知銀行	700	725.00	507,500	
山口フィナンシャルグループ	22,400	805.00	18,032,000	
長野銀行	600	1,659.00	995,400	
名古屋銀行	1,400	3,525.00	4,935,000	貸付有価証券 900株
北洋銀行	27,000	254.00	6,858,000	
愛知銀行	600	3,590.00	2,154,000	
中京銀行	700	2,213.00	1,549,100	
大光銀行	600	1,575.00	945,000	

愛媛銀行	2,500	1,088.00	2,720,000	
トマト銀行	700	1,012.00	708,400	
京葉銀行	7,900	625.00	4,937,500	
栃木銀行	9,300	179.00	1,664,700	
北日本銀行	600	1,656.00	993,600	
東和銀行	3,200	726.00	2,323,200	
福島銀行	1,600	271.00	433,600	
大東銀行	900	574.00	516,600	
トモニホールディングス	13,900	344.00	4,781,600	
フィデアホールディングス	17,400	117.00	2,035,800	貸付有価証券 100株
池田泉州ホールディングス	19,000	213.00	4,047,000	
F P G	5,600	884.00	4,950,400	
マーキュリアインベストメント	700	666.00	466,200	
S B Iホールディングス	21,400	2,511.00	53,735,400	貸付有価証券 7,400株
ジャフコ	2,900	3,880.00	11,252,000	
大和証券グループ本社	144,200	474.40	68,408,480	貸付有価証券 2,200株
野村ホールディングス	316,500	342.30	108,337,950	
岡三証券グループ	15,300	387.00	5,921,100	
丸三証券	5,400	564.00	3,045,600	貸付有価証券 3,700株
東洋証券	6,200	121.00	750,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	21,400	334.00	7,147,600	
光世証券	400	655.00	262,000	
水戸証券	5,200	203.00	1,055,600	
いちよし証券	3,700	777.00	2,874,900	
松井証券	8,800	1,022.00	8,993,600	貸付有価証券 600株
だいこう証券ビジネス	800	413.00	330,400	
マネックスグループ	16,600	332.00	5,511,200	貸付有価証券 11,900株
カブドットコム証券	13,400	558.00	7,477,200	
極東証券	2,400	915.00	2,196,000	
岩井コスモホールディングス	1,800	1,132.00	2,037,600	
藍澤證券	3,200	691.00	2,211,200	
マネーパートナーズグループ	2,200	288.00	633,600	
スパークス・グループ	7,200	236.00	1,699,200	
小林洋行	600	245.00	147,000	
かんぽ生命保険	6,800	2,072.00	14,089,600	
S O M P Oホールディングス	31,700	4,112.00	130,350,400	
アニコム ホールディングス	1,500	3,535.00	5,302,500	貸付有価証券 100株

MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	47,000	3,446.00	161,962,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	14,800	2,408.00	35,638,400	
第一生命ホールディングス	101,700	1,574.00	160,075,800	
東京海上ホールディングス	64,400	5,401.00	347,824,400	
T & Dホールディングス	55,600	1,135.50	63,133,800	
アドバンスクリエイト	400	1,716.00	686,400	
全国保証	5,100	4,160.00	21,216,000	貸付有価証券 3,500株
ジェイリース	500	336.00	168,000	
イントラスト	500	469.00	234,500	
日本モーゲージサービス	300	1,113.00	333,900	貸付有価証券 100株
C a s a	800	1,057.00	845,600	
アルヒ	1,600	1,975.00	3,160,000	貸付有価証券 1,100株
プレミアグループ	1,000	1,900.00	1,900,000	
クレディセゾン	12,600	1,170.00	14,742,000	
芙蓉総合リース	2,100	5,290.00	11,109,000	
興銀リース	3,400	2,518.00	8,561,200	
東京センチュリー	3,600	4,400.00	15,840,000	
日本証券金融	7,900	556.00	4,392,400	
アイフル	27,400	210.00	5,754,000	
リコーリース	1,400	3,345.00	4,683,000	
イオンフィナンシャルサービス	11,500	1,737.00	19,975,500	
アコム	36,100	364.00	13,140,400	
ジャックス	2,000	1,897.00	3,794,000	
オリエントコーポレーション	48,500	112.00	5,432,000	
日立キャピタル	4,200	2,299.00	9,655,800	
アプラスフィナンシャル	8,400	73.00	613,200	
オリックス	120,000	1,535.00	184,200,000	
三菱UFJリース	40,700	542.00	22,059,400	
九州リースサービス	900	632.00	568,800	
日本取引所グループ	48,600	1,684.00	81,842,400	
イー・ギャランティ	1,700	1,344.00	2,284,800	貸付有価証券 1,100株
アサックス	800	549.00	439,200	
NECキャピタルソリューション	700	1,738.00	1,216,600	
いちご	22,900	328.00	7,511,200	
日本駐車場開発	19,600	173.00	3,390,800	
ヒューリック	37,500	862.00	32,325,000	貸付有価証券 26,300株
三栄建築設計	700	1,465.00	1,025,500	
スター・マイカ	800	1,264.00	1,011,200	貸付有価証券 500株

野村不動産ホールディングス	12,000	2,234.00	26,808,000	
三重交通グループホールディングス	3,600	591.00	2,127,600	貸付有価証券 300株
サムティ	2,500	1,423.00	3,557,500	貸付有価証券 1,700株
ディア・ライフ	2,300	418.00	961,400	貸付有価証券 1,200株
コーセーアールイー	600	755.00	453,000	貸付有価証券 100株
エー・ディー・ワークス	28,200	33.00	930,600	
日本商業開発	1,100	1,458.00	1,603,800	貸付有価証券 500株
プレサンスコーポレーション	2,800	1,365.00	3,822,000	
ユニゾホールディングス	2,700	1,857.00	5,013,900	
THEグローバル社	1,000	593.00	593,000	
日本管理センター	1,200	1,109.00	1,330,800	
サンセイランディック	500	713.00	356,500	
エストラスト	300	700.00	210,000	
フージャースホールディングス	3,900	592.00	2,308,800	
オープンハウス	2,600	4,485.00	11,661,000	貸付有価証券 200株
東急不動産ホールディングス	48,400	606.00	29,330,400	
飯田グループホールディングス	15,000	1,722.00	25,830,000	
イーランド	300	657.00	197,100	
ムゲンエステート	1,200	555.00	666,000	
ビーロッド	400	1,912.00	764,800	貸付有価証券 200株
ファーストブラザーズ	500	1,065.00	532,500	貸付有価証券 300株
ハウズドゥ	1,000	1,340.00	1,340,000	貸付有価証券 700株
シーアールイー	500	977.00	488,500	
プロパティエージェント	300	861.00	258,300	
ケイアイスター不動産	500	1,501.00	750,500	
アグレ都市デザイン	300	459.00	137,700	
グッドコムアセット	400	1,409.00	563,600	貸付有価証券 200株
ジェイ・エス・ビー	100	3,575.00	357,500	
テンポイノベーション	200	1,510.00	302,000	
グローバル・リンク・マネジメント	200	565.00	113,000	
パーク24	10,500	2,040.00	21,420,000	貸付有価証券 1,700株
パラカ	500	1,969.00	984,500	貸付有価証券 300株
三井不動産	95,400	2,631.50	251,045,100	
三菱地所	126,000	1,997.00	251,622,000	
平和不動産	3,400	2,102.00	7,146,800	

東京建物	19,700	1,133.00	22,320,100	
ダイビル	5,300	945.00	5,008,500	
京阪神ビルディング	3,100	994.00	3,081,400	
住友不動産	40,400	4,007.00	161,882,800	
テオオーシー	4,100	610.00	2,501,000	
東京楽天地	300	5,050.00	1,515,000	貸付有価証券 200株
レオパレス21	22,200	319.00	7,081,800	貸付有価証券 15,600株
スターツコーポレーション	2,400	2,555.00	6,132,000	
フジ住宅	2,300	757.00	1,741,100	
空港施設	2,100	511.00	1,073,100	
明和地所	1,000	518.00	518,000	
ゴールドクレスト	1,400	1,763.00	2,468,200	
日本エスリード	700	1,518.00	1,062,600	
日神不動産	2,600	432.00	1,123,200	
日本エスコン	3,300	682.00	2,250,600	貸付有価証券 2,300株
タカラレーベン	8,100	369.00	2,988,900	
サンヨーハウジング名古屋	1,000	869.00	869,000	
イオンモール	9,000	1,595.00	14,355,000	
毎日コムネット	400	718.00	287,200	貸付有価証券 200株
ファースト住建	700	1,103.00	772,100	
カチタス	2,000	3,905.00	7,810,000	貸付有価証券 1,400株
トーセイ	2,500	890.00	2,225,000	
穴吹興産	200	2,973.00	594,600	
サンフロンティア不動産	2,500	1,004.00	2,510,000	
エフ・ジェー・ネクスト	1,600	959.00	1,534,400	貸付有価証券 500株
インテリックス	500	654.00	327,000	
ランドビジネス	800	773.00	618,400	
グランディハウス	1,600	441.00	705,600	
日本空港ビルデング	5,700	4,120.00	23,484,000	貸付有価証券 200株
日本工営	1,200	2,405.00	2,886,000	
LIFULL	6,100	596.00	3,635,600	貸付有価証券 2,000株
ジェイエイシーリクルートメント	1,400	2,582.00	3,614,800	貸付有価証券 900株
日本M&Aセンター	13,000	2,703.00	35,139,000	
メンバーズ	600	1,893.00	1,135,800	
中広	200	552.00	110,400	
アイティメディア	300	491.00	147,300	
タケエイ	1,800	881.00	1,585,800	

E・Jホールディングス	200	1,073.00	214,600	
トラスト・テック	1,000	3,145.00	3,145,000	
コシダカホールディングス	4,200	1,424.00	5,980,800	
アルトナー	400	755.00	302,000	
パソナグループ	2,100	1,673.00	3,513,300	
CDS	400	1,299.00	519,600	
リンクアンドモチベーション	3,200	603.00	1,929,600	貸付有価証券 2,000株
GCA	1,800	722.00	1,299,600	貸付有価証券 400株
エス・エム・エス	6,400	2,628.00	16,819,200	
サニーサイドアップ	200	1,931.00	386,200	
パーソルホールディングス	17,400	2,312.00	40,228,800	
リニカル	1,000	1,176.00	1,176,000	
クックパッド	5,400	310.00	1,674,000	貸付有価証券 3,800株
エスクリ	500	739.00	369,500	
アイ・ケイ・ケイ	900	658.00	592,200	貸付有価証券 600株
学情	700	1,085.00	759,500	貸付有価証券 500株
スタジオアリス	900	2,024.00	1,821,600	
シミックホールディングス	1,000	2,010.00	2,010,000	
NJS	400	1,656.00	662,400	
総合警備保障	6,900	5,250.00	36,225,000	
カカクコム	13,000	2,202.00	28,626,000	
アイロムグループ	700	1,570.00	1,099,000	貸付有価証券 400株
セントケア・ホールディング	1,300	486.00	631,800	貸付有価証券 900株
サイネックス	300	645.00	193,500	
ルネサンス	1,000	1,918.00	1,918,000	
ディップ	2,800	1,638.00	4,586,400	貸付有価証券 1,900株
オプトホールディング	1,100	1,382.00	1,520,200	貸付有価証券 700株
新日本科学	2,400	726.00	1,742,400	
ツクイ	4,100	529.00	2,168,900	
キャリアデザインセンター	400	1,547.00	618,800	貸付有価証券 200株
ベネフィット・ワン	4,800	2,068.00	9,926,400	貸付有価証券 3,300株
エムスリー	36,700	2,052.00	75,308,400	
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	609.00	669,900	貸付有価証券 700株
プラス	200	620.00	124,000	

アウトソーシング	9,200	1,138.00	10,469,600	貸付有価証券 900株
ウェルネット	1,800	1,009.00	1,816,200	
ワールドホールディングス	500	1,592.00	796,000	
ディー・エヌ・エー	9,400	2,192.00	20,604,800	
博報堂D Yホールディングス	24,300	1,708.00	41,504,400	
ぐるなび	2,500	544.00	1,360,000	
タカミヤ	1,800	751.00	1,351,800	
ジャパンベストレスキューシステム	1,200	1,215.00	1,458,000	
ファンコミュニケーションズ	4,800	523.00	2,510,400	
ライク	700	1,235.00	864,500	貸付有価証券 400株
ビジネス・ブレークスルー	700	350.00	245,000	
W D Bホールディングス	800	2,667.00	2,133,600	貸付有価証券 500株
ティア	1,000	637.00	637,000	
C D G	200	1,246.00	249,200	
バリューコマース	1,200	2,558.00	3,069,600	
インフォマート	9,500	1,658.00	15,751,000	貸付有価証券 1,300株
J Pホールディングス	5,000	278.00	1,390,000	
エコナックホールディングス	3,300	123.00	405,900	
E P Sホールディングス	2,600	1,779.00	4,625,400	
レグス	400	1,323.00	529,200	
プレステージ・インターナショナル	3,300	1,502.00	4,956,600	
アミューズ	1,000	2,581.00	2,581,000	
ドリームインキュベータ	500	1,667.00	833,500	
クイック	1,100	1,669.00	1,835,900	
T A C	1,000	196.00	196,000	
ケネディクス	15,300	526.00	8,047,800	
電通	21,200	3,550.00	75,260,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,065.00	745,500	
ぴあ	500	4,835.00	2,417,500	貸付有価証券 300株
イオンファンタジー	600	2,273.00	1,363,800	貸付有価証券 400株
シーティーエス	2,000	687.00	1,374,000	
ネクシィーズグループ	600	2,488.00	1,492,800	
みらかホールディングス	4,900	2,476.00	12,132,400	
アルプス技研	1,500	1,834.00	2,751,000	
サニックス	3,100	209.00	647,900	貸付有価証券 1,900株
ダイオーズ	400	1,322.00	528,800	
日本空調サービス	1,900	668.00	1,269,200	
オリエンタルランド	20,600	13,250.00	272,950,000	

ダスキン	4,500	2,841.00	12,784,500	
明光ネットワークジャパン	2,000	958.00	1,916,000	
ファルコホールディングス	1,000	1,637.00	1,637,000	
秀英予備校	400	432.00	172,800	
田谷	300	597.00	179,100	
ラウンドワン	5,400	1,613.00	8,710,200	
リゾートトラスト	7,400	1,682.00	12,446,800	
ビー・エム・エル	2,200	3,075.00	6,765,000	
ワタベウェディング	300	559.00	167,700	
りらいあコミュニケーションズ	3,100	1,174.00	3,639,400	
リソー教育	8,800	437.00	3,845,600	貸付有価証券 2,000株
早稲田アカデミー	500	769.00	384,500	
ユー・エス・エス	21,300	2,063.00	43,941,900	
東京個別指導学院	600	918.00	550,800	
サイバーエージェント	10,000	4,180.00	41,800,000	貸付有価証券 4,900株
楽天	81,200	1,135.00	92,162,000	貸付有価証券 31,700株
クリーク・アンド・リバー社	1,000	1,205.00	1,205,000	
テー・オー・ダブリュー	1,500	756.00	1,134,000	
山田コンサルティンググループ	800	2,094.00	1,675,200	
セントラルスポーツ	700	3,280.00	2,296,000	
フルキャストホールディングス	1,700	2,092.00	3,556,400	
エン・ジャパン	2,500	3,845.00	9,612,500	貸付有価証券 300株
リソルホールディングス	200	3,905.00	781,000	
テクノプロ・ホールディングス	3,500	5,580.00	19,530,000	貸付有価証券 200株
アトラ	400	285.00	114,000	
インターワークス	400	594.00	237,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	700	2,550.00	1,785,000	貸付有価証券 400株
K e e P e r 技研	600	1,374.00	824,400	貸付有価証券 100株
ファーストロジック	400	536.00	214,400	貸付有価証券 200株
三機サービス	400	1,181.00	472,400	貸付有価証券 200株
G u n o s y	1,200	1,913.00	2,295,600	貸付有価証券 800株
デザインワン・ジャパン	400	289.00	115,600	貸付有価証券 200株
イー・ガーディアン	900	1,830.00	1,647,000	貸付有価証券 600株
リブセンス	900	253.00	227,700	

ジャパンマテリアル	4,800	1,368.00	6,566,400	貸付有価証券 3,300株
ベクトル	2,100	1,115.00	2,341,500	
ウチヤマホールディングス	900	523.00	470,700	
チャーム・ケア・コーポレーション	600	1,653.00	991,800	
ライクキッズネクスト	400	879.00	351,600	
キャリアリンク	600	423.00	253,800	
I B J	1,200	899.00	1,078,800	
アサンテ	700	2,112.00	1,478,400	
N・フィールド	1,100	725.00	797,500	
バリューHR	400	3,180.00	1,272,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	600	6,250.00	3,750,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,194.00	835,800	貸付有価証券 400株
E R Iホールディングス	500	898.00	449,000	
アピスト	300	2,470.00	741,000	
シグマクシス	800	1,322.00	1,057,600	
ウィルグループ	1,100	889.00	977,900	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,400	268.00	643,200	
日本ビューホテル	600	1,130.00	678,000	貸付有価証券 100株
リクルートホールディングス	124,900	3,468.00	433,153,200	
エラン	1,200	1,856.00	2,227,200	
土木管理総合試験所	800	430.00	344,000	
ネットマーケティング	600	451.00	270,600	
日本郵政	142,800	1,202.00	171,645,600	
ベルシステム24ホールディングス	2,900	1,565.00	4,538,500	
鎌倉新書	1,300	1,518.00	1,973,400	貸付有価証券 900株
ソネット・メディア・ネットワークス	200	787.00	157,400	
一蔵	200	617.00	123,400	
L I T A L I C O	400	1,614.00	645,600	
グローバルキッズCOMPANY	300	884.00	265,200	
エポラブルアジア	800	2,157.00	1,725,600	貸付有価証券 300株
アトラエ	500	3,255.00	1,627,500	
ストライク	700	1,922.00	1,345,400	貸付有価証券 300株
ソラスト	4,300	960.00	4,128,000	
セラク	600	599.00	359,400	貸付有価証券 200株
インソース	700	2,776.00	1,943,200	貸付有価証券 400株
ベイカレント・コンサルティング	1,200	3,645.00	4,374,000	
Orchestra Holdings	300	1,250.00	375,000	

アイモバイル	600	841.00	504,600	貸付有価証券 400株
キャリアインデックス	600	777.00	466,200	貸付有価証券 400株
MS - Japan	700	1,528.00	1,069,600	貸付有価証券 400株
船場	300	915.00	274,500	
グレイステクノロジー	600	2,621.00	1,572,600	貸付有価証券 400株
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,400	2,193.00	3,070,200	貸付有価証券 500株
フルテック	200	1,163.00	232,600	貸付有価証券 100株
グリーンズ	700	1,555.00	1,088,500	
ツナググループ・ホールディングス	200	530.00	106,000	
ソウルドアウト	200	2,246.00	449,200	貸付有価証券 100株
MS & Consulting	300	1,036.00	310,800	
日総工産	1,200	1,430.00	1,716,000	
キュービーネットホールディングス	1,000	2,274.00	2,274,000	
RPAホールディングス	400	5,620.00	2,248,000	貸付有価証券 200株
スプリックス	600	1,862.00	1,117,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	700	699.00	489,300	貸付有価証券 400株
リログループ	9,500	2,910.00	27,645,000	
東祥	1,100	2,955.00	3,250,500	
エイチ・アイ・エス	3,100	3,180.00	9,858,000	貸付有価証券 2,100株
ラックランド	300	2,264.00	679,200	
共立メンテナンス	2,700	5,440.00	14,688,000	貸付有価証券 1,800株
イチネンホールディングス	1,800	1,087.00	1,956,600	
建設技術研究所	1,200	1,480.00	1,776,000	
スペース	1,100	1,160.00	1,276,000	
長大	700	706.00	494,200	
燦ホールディングス	400	2,256.00	902,400	
スバル興業	100	5,390.00	539,000	
東京テアトル	700	1,317.00	921,900	
タナベ経営	300	1,197.00	359,100	
ナガワ	500	5,750.00	2,875,000	
よみうりランド	400	5,010.00	2,004,000	
東京都競馬	1,100	3,235.00	3,558,500	
常磐興産	700	1,629.00	1,140,300	
カナモト	2,600	2,411.00	6,268,600	
東京ドーム	6,500	1,064.00	6,916,000	貸付有価証券 4,500株

西尾レントオール	1,800	2,817.00	5,070,600	
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	9,900	34.00	336,600	
トランス・コスモス	1,900	2,395.00	4,550,500	
乃村工藝社	8,200	1,373.00	11,258,600	
藤田観光	700	2,617.00	1,831,900	
KNT-CTホールディングス	900	1,464.00	1,317,600	
日本管財	1,900	1,818.00	3,454,200	
トーカイ	1,700	2,399.00	4,078,300	
白洋舎	200	2,835.00	567,000	
セコム	18,500	9,289.00	171,846,500	
セントラル警備保障	800	5,550.00	4,440,000	
丹青社	3,300	1,124.00	3,709,200	
メイテック	2,200	5,170.00	11,374,000	
応用地質	1,900	1,056.00	2,006,400	
船井総研ホールディングス	3,600	2,624.00	9,446,400	
進学会ホールディングス	800	614.00	491,200	
オオバ	1,400	618.00	865,200	貸付有価証券 900株
いであ	400	1,149.00	459,600	
学究社	500	1,278.00	639,000	
ベネッセホールディングス	6,400	2,528.00	16,179,200	
イオンディライト	2,100	3,135.00	6,583,500	
ナック	1,100	923.00	1,015,300	
ニチイ学館	2,500	1,406.00	3,515,000	
ダイセキ	2,900	2,700.00	7,830,000	
ステップ	700	1,415.00	990,500	
合計	21,337,300		39,583,035,700	

(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 6月28日現在です。

【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

【純資産額計算書】

資産総額	43,966,348,397円
負債総額	1,804,103,066円
純資産総額（ - ）	42,162,245,331円
発行済口数	23,487,416,357口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7951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6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6月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締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。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）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、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後2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。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

(3) 運用の意思決定プロセス（2019年6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6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	826	181,845
株式投資信託	779	155,354
単位型	250	9,219
追加型	529	146,135
公社債投資信託	47	26,490
単位型	33	833
追加型	14	25,657

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。
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60期事業年度（2018年4月1日から2019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。

（1）【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	14,024	3	20,680
有価証券		19		1
前払費用		551		495
未収入金		73		38
未収委託者報酬		15,873		16,867
未収収益	3	3,174	3	618
関係会社短期貸付金		1,128		2,408
立替金		2,776		791
その他	2,3	4,179	2	869
流動資産合計		41,800		42,769
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	68	1	136
器具備品	1	122	1	137
有形固定資産合計		191		274
無形固定資産				
ソフトウェア		99		107
無形固定資産合計		99		107
投資その他の資産				
投資有価証券		14,103		16,755
関係会社株式		25,769		25,769
長期差入保証金		490		447
長期前払費用		0		-

繰延税金資産		1,504		1,913
投資その他の資産合計		41,868		44,886
固定資産合計		42,159		45,268
資産合計		83,959		88,038

(単位：百万円)

		第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)
負債の部				
流動負債				
預り金	3	3,804		354
未払金		5,874		6,112
未払収益分配金		7		7
未払償還金		91		71
未払手数料	3	5,124	3	5,299
その他未払金		651		734
未払費用	3	4,634	3	3,897
未払法人税等		2,185		2,382
未払消費税等	4	788	4	621
賞与引当金		2,286		2,680
役員賞与引当金		198		210
その他		41	3	172
流動負債合計		19,813		16,431
固定負債				
退職給付引当金		1,316		1,405
その他		318		629
固定負債合計		1,634		2,035
負債合計		21,448		18,466
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		39,959		47,142
利益剰余金合計		39,959		47,142
自己株式		786		833
株主資本合計		61,756		68,891
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		408		493
繰延ヘッジ損益		346		185
評価・換算差額等合計		754		679
純資産合計		62,511		69,571
負債純資産合計		83,959		88,038

(2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第59期 (自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月31日)	第60期 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	70,609	77,264
その他営業収益	5,398	3,063
営業収益合計	76,008	80,328
営業費用		
支払手数料	30,448	32,834
広告宣伝費	973	960
公告費	2	2
調査費	18,132	18,251
調査費	862	890
委託調査費	17,241	17,333
図書費	28	27
委託計算費	520	541
営業雑経費	740	794
通信費	173	128
印刷費	348	334
協会費	68	69
諸会費	24	19
その他	125	243
営業費用計	50,817	53,385
一般管理費		
給料	9,096	9,783
役員報酬	507	241
役員賞与引当金繰入額	198	210
給料・手当	6,083	6,589
賞与	20	61
賞与引当金繰入額	2,286	2,680
交際費	99	92
寄付金	16	13
旅費交通費	455	476
租税公課	424	428
不動産賃借料	890	888
退職給付費用	355	378
退職金	24	52
固定資産減価償却費	152	108
福利費	974	1,071
諸経費	3,175	3,106
一般管理費計	15,664	16,401
営業利益	9,526	10,540

	(単位：百万円)	
	第59期 (自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月31日)	第60期 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)
営業外収益		
受取利息	26	37
受取配当金	1	1,865
有価証券償還益	1	1

デリバティブ収益	-	1	142	
時効成立分配金・償還金	1		21	
為替差益	79		58	
その他	41		48	
営業外収益合計	1,272		2,176	
営業外費用				
支払利息	1	223	1	286
デリバティブ費用	1	295		-
時効成立後支払分配金・償還金		0		78
長期差入保証金償却額		212		-
その他		34		24
営業外費用合計		767		388
経常利益		10,030		12,328
特別利益				
投資有価証券売却益		199		218
特別利益合計		199		218
特別損失				
投資有価証券売却損		133		176
固定資産処分損		7		0
役員退職一時金		117		180
損害賠償損失		81		-
特別損失合計		340		357
税引前当期純利益		9,890		12,189
法人税、住民税及び事業税		3,217		3,741
法人税等調整額		307		375
法人税等合計		2,910		3,366
当期純利益		6,979		8,823

(3) 【株主資本等変動計算書】

第59期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：百万円）

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

	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額等 合計	純資産合計
当期首残高	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

第60期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756
当期変動額							
剰余金の配当				1,640	1,640		1,640
当期純利益				8,823	8,823		8,823
自己株式の取得						47	47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	7,182	7,182	47	7,135
当期末残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891

	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
当期変動額				
剰余金の配当				1,640
当期純利益				8,823
自己株式の取得				47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	85	160	75	75
当期変動額合計	85	160	75	7,060
当期末残高	493	185	679	69,571

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定） 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="528 835 1031 904"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	4年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	4年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>				
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>				

5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。
---------------------------	--

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

- ステップ1：顧客との契約を識別する。
 ステップ2：契約における履行義務を識別する。
 ステップ3：取引価格を算定する。
 ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。
 ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更) 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、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しております。 この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」1,014百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,504百万円に含めて表示しております。

(貸借対照表関係)

第59期 (2018年3月31日)	第60期 (2019年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,260百万円 器具備品 612百万円	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,281百万円 器具備品 655百万円
2 信託資産 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。	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。
3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 3,189百万円 未収収益 592百万円 その他 345百万円 (流動負債) 預り金 419百万円 未払手数料 376百万円 未払費用 677百万円	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 1,347百万円 未収収益 127百万円 (流動負債) 未払手数料 350百万円 未払費用 767百万円 その他 162百万円

<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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>	<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務468百万円に対して保証を行っております。</p>
--	---

(損益計算書関係)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)												
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">979百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ収益</td> <td style="text-align: right;">407百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">213百万円</td> </tr> </table>	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	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">1,831百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ収益</td> <td style="text-align: right;">54百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">75百万円</td> </tr> </table>	受取配当金	1,831百万円	デリバティブ収益	54百万円	支払利息	75百万円
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												
受取配当金	1,831百万円												
デリバティブ収益	54百万円												
支払利息	75百万円												

(株主資本等変動計算書関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	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	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,689,600	-	194,700	1,494,900	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	204,600	2,686,200	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	786,000	3,618,000	-
2016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 2016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、新株予約権の失効等によるものであります。

- 3 2009年度ストックオプション(1)1,494,900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)2,686,200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、2016年度ストックオプション(1)及び2016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
2017年5月25日 取締役会	普通株式	1,036	5.29	2017年3月31日	2017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
2018年5月31日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,640	8.38	2018年3月31日	2018年6月23日

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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)	1,301,700	64,000	-	1,365,700

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	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,494,900	-	323,400	1,171,500	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	108,900	-	33,000	75,900	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,686,200	-	630,300	2,055,900	-
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	-	66,000	3,811,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,422,000	66,000	4,356,000	-
合計		11,785,000	4,422,000	1,118,700	15,088,300	-

(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 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

3 2009年度ストックオプション(1)1,171,500株、2009年度ストックオプション(2)75,900株、2011年度ストックオプション(1)2,055,900株及び2016年度ストックオプション(1)1,206,000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、2016年度ストックオプション(1)2,412,000株、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
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
2019年5月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	3,212	16.42	2019年3月31日	2019年6月24日

(リース取引関係)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第60期 (自 2018年4月1日 至 2019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	866百万円	1年内	853百万円
1年超	923百万円	1年超	6,704百万円
合計	1,790百万円	合計	7,558百万円

(金融商品関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

2018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せん。

- 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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約
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-スで為替変動リスクを測定し、
モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替
変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞ
れの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損
益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融
商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ-・アット・リスクを用いた市場リスク管理を
週次ベ-スで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金及び借入金に関しては、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

2019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	20,680	20,680	-
(2) 未収委託者報酬	16,867	16,867	-
(3) 未収収益	618	618	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,408	2,408	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	16,740	16,740	-
(6) 未払金	(6,112)	(6,112)	-
(7) 未払費用	(3,897)	(3,897)	-
(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	(31)	(31)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(127)	(127)	-
デリバティブ取引計	(158)	(158)	-

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち3百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、35百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち0百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、127百万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、「(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(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	20,680	-	-	-
未収委託者報酬	16,867	-	-	-
未収収益	618	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	163	6,929	1,363
合計	38,167	163	6,929	1,363

(有価証券関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018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	投資信託	8,544	7,535	1,008

が取得原価を超えるもの	小計	8,544	7,535	1,008
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	投資信託	5,561	5,982	420
	小計	5,561	5,982	420
合計		14,106	13,518	588

- (注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。
- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	2,792	199	133
合計	2,792	199	133

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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	9,340	8,440	900
	小計	9,340	8,440	900
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	投資信託	7,400	7,589	188
	小計	7,400	7,589	188
合計		16,740	16,029	711

- (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	4,189	218	176
合計	4,189	218	176

(デリバティブ取引関係)

第59期(2018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
株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		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。

第60期(2019年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,407	-	3	3
	買建	-	-	-	-
合計		2,407	-	3	3

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,792	-	35	35
合計		1,792	-	35	35

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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	投資有価証券	2,251	-	42
	豪ドル		63	-	0
	シンガポール ドル		975	-	18
	香港ドル		518	-	8
	人民元		2,149	-	58
	ユーロ		81	-	0
	合計		6,040	-	127

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019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 3,008	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,409	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,668
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,827	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,704

(退職給付関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定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。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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	1,313
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	59
退職給付債務の期末残高	1,411

(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	1,411
未積立退職給付債務	1,411
未認識数理計算上の差異	6
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

退職給付引当金	1,405
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	148

(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、230百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018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

	2009年度ストックオプション(1)	2009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	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012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	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

	2011年度ストックオプション(1)	2016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	2011年10月7日	2016年7月15日

権利確定条件	2013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。	2018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	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016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	2017年4月27日
権利確定条件	2019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	2019年4月27日から 2027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tock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

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010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	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016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	-	-

	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2017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

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010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

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016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

	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2017年4月27日
権利行使価格(円)	553
付与日における公正な評価単価(円)(注)1	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,149百万円
- 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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

	2009年度ストックオプション(1)	2009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	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012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	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

	2011年度ストックオプション(1)	2016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	2011年10月7日	2016年7月15日

権利確定条件	2013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。	2018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	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)	2017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 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36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	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019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。	2020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	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	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028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tock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

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,494,900	108,900
付与	0	0
失効	323,400	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,171,500	75,900
権利確定後(株)		
期首	-	-

権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,686,200	3,618,000
付与	0	0
失効	630,300	0
権利確定	0	0
権利未確定残	2,055,900	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	-	-

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	3,877,000	-
付与	0	4,422,000
失効	66,000	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	3,811,000	4,356,000
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

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010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

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
--	--------------------	--------------------

付与日	2011年10月7日	2016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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
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 2,128百万円
- 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59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019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		繰延税金資産
	賞与引当金 700		賞与引当金 820
	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 402		退職給付引当金 430
	固定資産減価償却費 111		固定資産減価償却費 103
	その他 526		その他 761
	繰延税金資産小計 3,268		繰延税金資産小計 3,643
	評価性引当金 1,430		評価性引当金 1,430
	繰延税金資産合計 1,838		繰延税金資産合計 2,212
	繰延税金負債		繰延税金負債
	その他有価証券評価差額金 180		その他有価証券評価差額金 217
	繰延ヘッジ利益 152		繰延ヘッジ利益 81
	繰延税金負債合計 333		繰延税金負債合計 299
	繰延税金資産の純額 1,504		繰延税金資産の純額 1,913

<p>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</p> <p>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。</p>	<p>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</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">30.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">0.8%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に参入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">4.4%</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right;">27.6%</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	30.6%	交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.8%	受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	4.4%	その他	0.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%
法定実効税率 (調整)	30.6%										
交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.8%										
受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	4.4%										
その他	0.6%										
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%										

(関連当事者情報)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018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	日本インステイ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。

- 3 融資枠5,000百万円、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 Nikko Asset Management 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2017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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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	資金の貸付の返済 (シンガポールドル貨建) (注1)	554 (SGD 6,800 千) (注2)	-	-
							貸付金利息 (シンガポールドル貨建) (注1)	8 (SGD 104 千)	-	-
							資金の貸付 (米国ドル貨建) (注3)	1,807 (USD 16,500 千) (注4)	関係会社 短期貸付金	1,830 (USD 16,500 千)

							貸付金利息 (米国ドル 貨建) (注3)	17 (USD 209千)	未収収益	17 (USD 209千)
							資金の貸付 (円貨建) (注3)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注3)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注5)	アセット マネジメ ント業	直接 100.00	-	配当の受取	1,021 (USD 9,000千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	米国	181,542 (USD千) (注5)	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 (米国ドル 貨建) (注6)	5,364 (USD 50,000千) (注7)	-	-
							資金の借入 の返済 (米国ドル 貨建) (注6)	5,526 (USD 50,000千) (注7)	-	-
							借入金利息 (米国ドル 貨建) (注6)	65 (USD 593千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 取引金額554百万円 (SGD6,800千) の内訳は、貸付の返済554百万円 (SGD6,800千) であります。
- 3 融資枠5,000百万円 (若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 4 取引金額1,807百万円 (USD16,500千) の内訳は、貸付1,807百万円 (USD16,500千) であります。
- 5 Nikko AM Americas Holding Co., Inc.及びNikko Asset Management Americas, Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- 6 借入枠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。
- 7 取引金額5,364百万円 (USD50,000千) 及び5,526百万円 (USD50,000千) の内訳は、借入5,364百万円 (USD50,000千) 及び借入の返済5,526百万円 (USD50,000千) 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2018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場で円貨に換算したものであります。

資産合計 26,768百万円
負債合計 5,586百万円

純資産合計	21,181百万円
営業収益	14,075百万円
税引前当期純利益	3,894百万円
当期純利益	2,730百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018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60期(自 2018年4月1日 至 2019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59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019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59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	319円40銭	355円59銭
1株当たり当期純利益金額	35円64銭	45円08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59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	6,979	8,823
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)	6,979	8,823
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,794	195,677
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	2009年度ストックオプション(1) 1,494,900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) 2,686,200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	2009年度ストックオプション(1) 1,171,500株、2009年度ストックオプション(2) 75,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,055,900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) 3,811,000株、2017年度ストックオプション(1) 4,356,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期 (2018年3月31日)	第60期 (2019年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	62,511	69,571

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）	62,511	69,571
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）	195,711	195,647

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2019年3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（2019年3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 (2019年3月末現在)	事業の内容
株式会社京都銀行	42,103百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社北國銀行	26,673百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	
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。
株式会社りそな銀行	279,928百万円	
住友生命保険相互会社	50,000百万円 (基金の総額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
ソニ - 生命保険株式会社	70,000百万円	
第一生命保険株式会社	60,000百万円	
富国生命保険相互会社	10,000百万円 (基金の総額)	
信金中央金庫	690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

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。(2019年3月末現在)

(2) 販売会社

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。(2019年3月末現在)

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 8月31日	有価証券届出書
2018年 8月31日	有価証券報告書
2019年 2月28日	有価証券届出書の訂正届出書
2019年 2月28日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2019年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の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2019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

2019年7月10日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w Cあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2018年6月1日から2019年5月31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、年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2019年5月31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。