

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年5月12日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスファンドTSP
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

**第一部【証券情報】****（１）【ファンドの名称】**

インデックスファンドTSP（以下「ファンド」といいます。）

**（２）【内国投資信託受益証券の形態等】**

- ・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
- ・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

**（３）【発行（売出）価額の総額】**

5兆円を上限とします。

**（４）【発行（売出）価格】**

取得申込受付日の基準価額とします。

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

**（５）【申込手数料】**

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

- ・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2%）が上限となっております。

**（６）【申込単位】**

販売会社の照会先にお問い合わせください。

**（７）【申込期間】**

2020年5月13日から2021年5月12日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

**（８）【申込取扱場所】**

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

**（ 9 ） 【 払込期日 】**

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

**（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】**

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

**（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】**

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

**（ 1 2 ） 【 その他 】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

ファンドの基本的性格

##### 1) 商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

インデックス型

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

##### 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（株式 一般））

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<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、「インデックス マザーファンド TOPIX」への投資を通じて、東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資を行ない、日本株式市場全体の動きをとらえ、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ・中長期にわたって保有することで、日本経済の成長を享受することが期待できます。

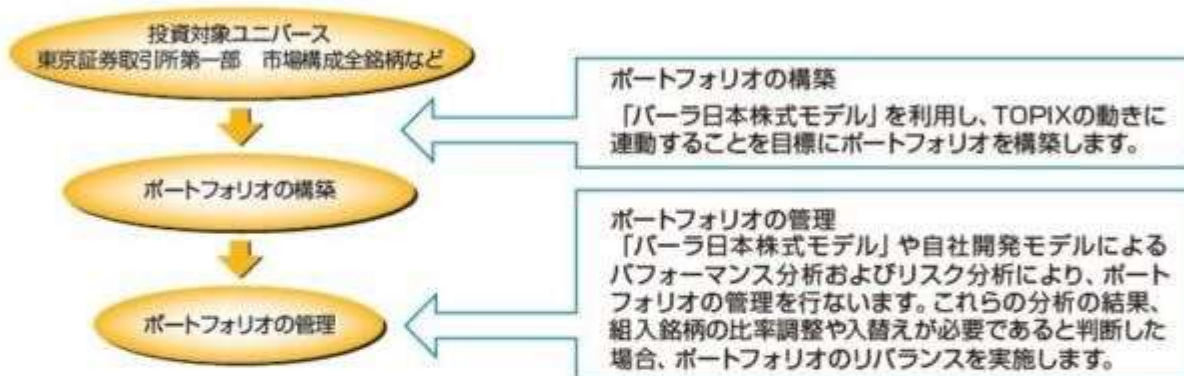
## TOPIX（東証株価指数）とは

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

# 2 株式の実質組入比率は高位を保ちます。

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

## <「インデックス マザーファンド TOPIX」の運用プロセス>



※上記は、2020年2月末現在のプロセスであり、将来変更となる場合があります。

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

## バラ日本株式モデル

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

## ファンドの仕組み

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



（主な投資制限） 株式への実質投資割合には制限を設けません。

・外貨建資産への投資は行ないません。

（分配方針） 毎決算時に、利子・配当等収益を中心に分配を行いますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 信託金限度額

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

## （2）【ファンドの沿革】

1986年2月13日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

2001年10月26日

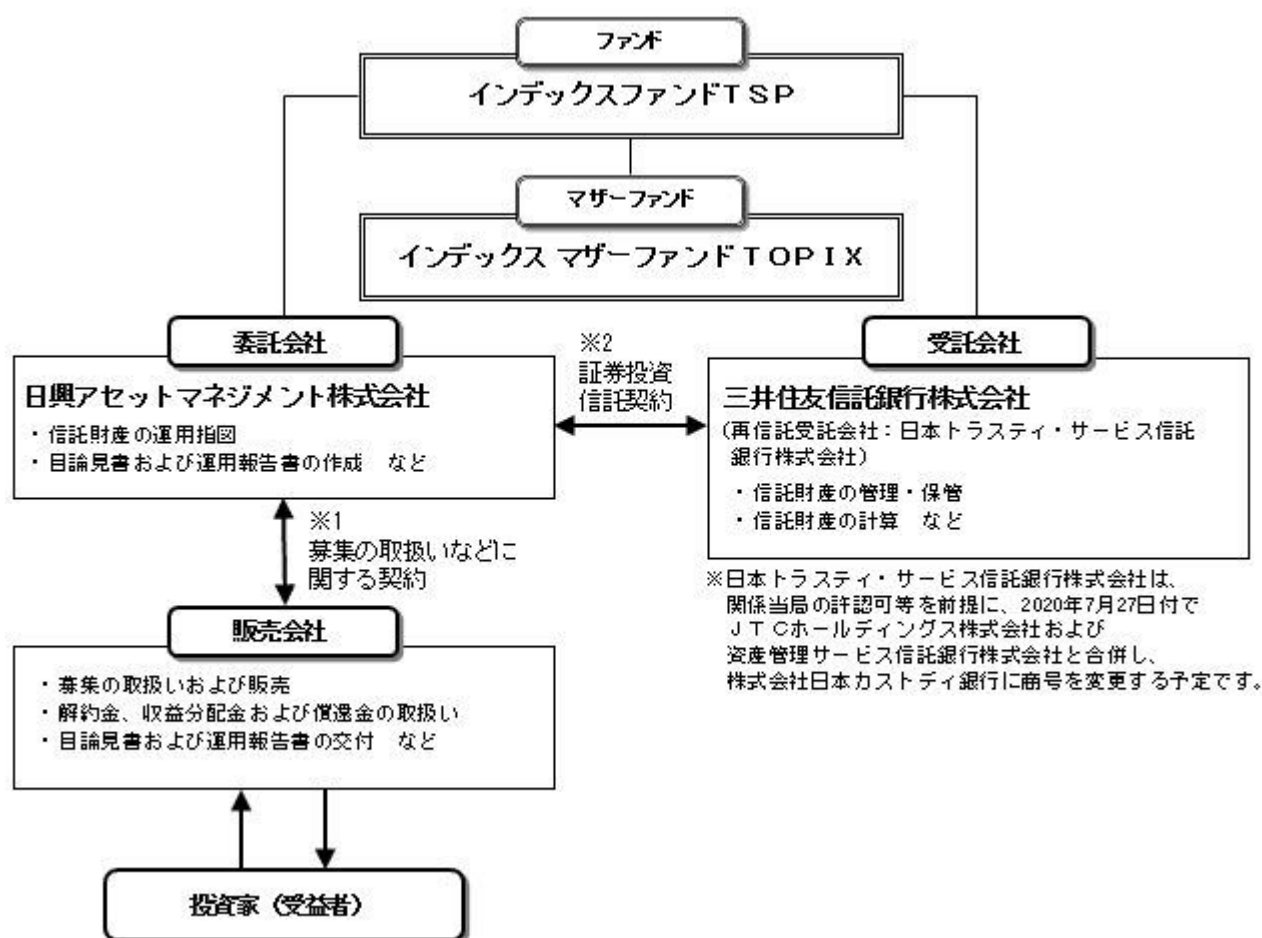
- ・ファミリーファンド方式の導入

2002年11月13日

- ・信託期間を無期限に変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（2020年2月末現在）

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

名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

## 2 【投資方針】

## (1) 【投資方針】

- ・「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券に投資を行なうとともに、わが国の金融商品取引所上場株式に投資を行ない、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動した投資成果をめざします。
- ・投資成果をT O P I X（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、株式（マザーファンドにおいて保有する株式を含みます。）への投資にあたっては、「パーラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行ないます。
  - 東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行ないます。
  - 資金の流出入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。
  - 株式の組入比率は、高位を保ちます。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### <インデックスファンドTSP>

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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



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

#### <インデックス マザーファンド T O P I X >

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

次の取引ができます。

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

投資対象とするマザーファンドの概要

#### <インデックス マザーファンド T O P I X >

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

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

### ファンドに係る費用

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

### その他

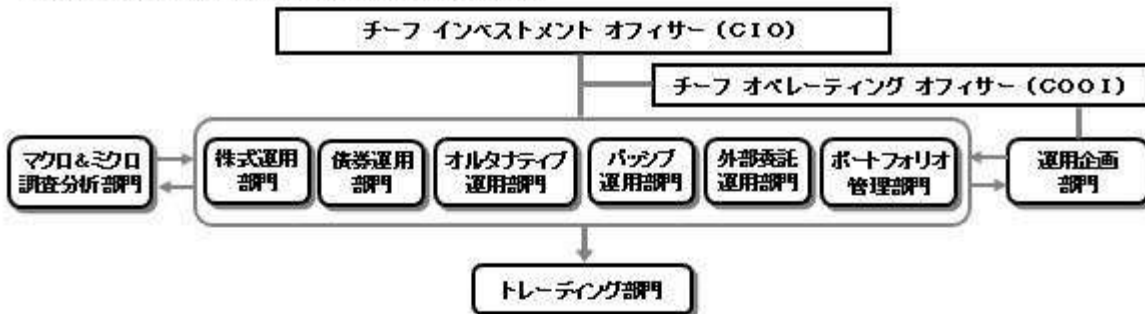
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
決算日	毎年2月12日（休業日の場合は翌営業日）

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

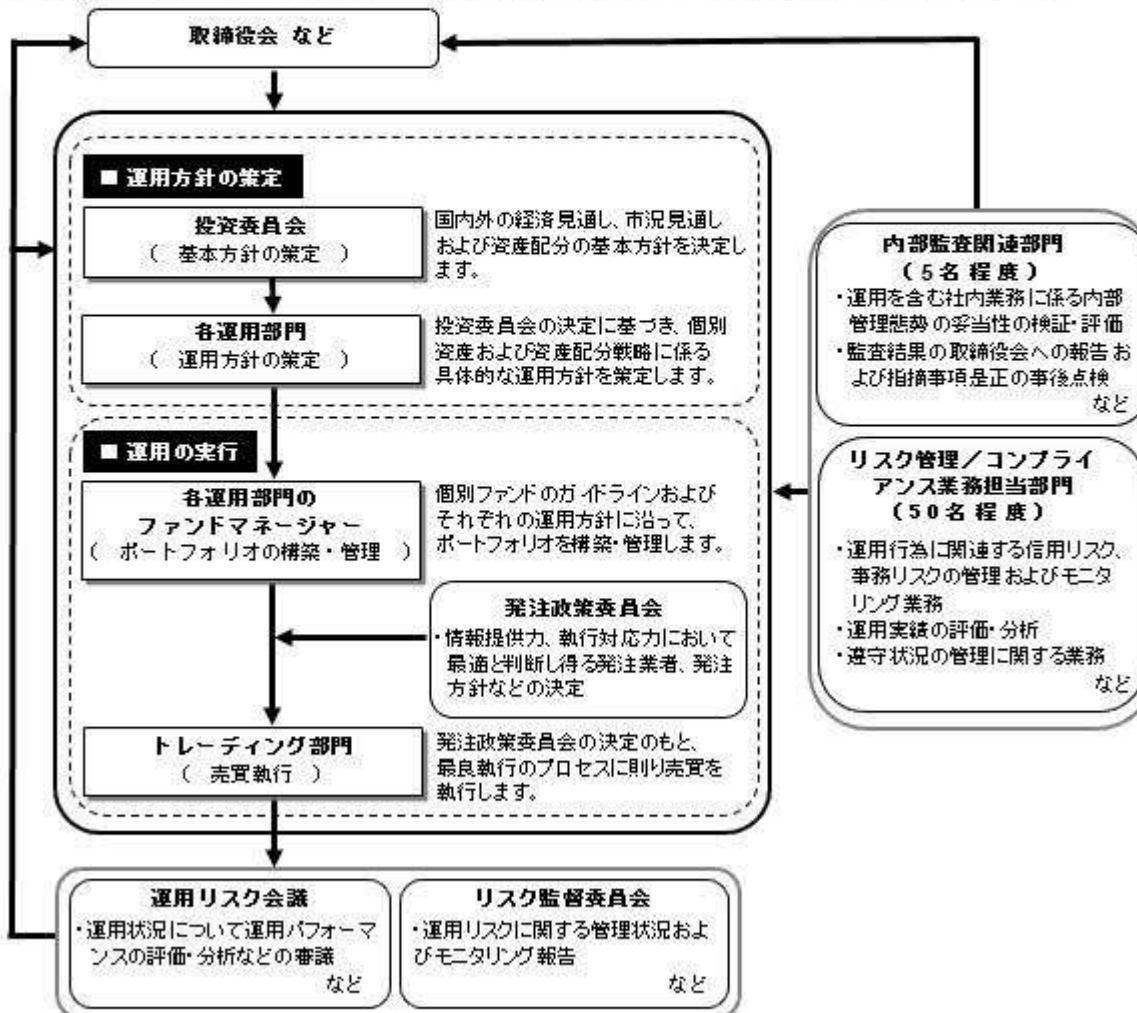
T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびT O P I Xの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

### （3）【運用体制】

## ◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



## 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残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2020年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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

を行ないます。

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

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

<分配金受取りコース>

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

## （５）【投資制限】

約款に定める投資制限

<インデックスファンド T S P >

- 1) 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5 % 以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができます。かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  - ロ) 株式分割により取得する株券
  - ハ) 有償増資により取得する株券
  - ニ) 売り出しにより取得する株券
- ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（会社法第236条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
- ヘ) 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使ならびに信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権ホ) に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券指数等先物取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
  - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が 1 年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第 17 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
  - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第 17 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
  - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の 5 % を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5 % を上回らない範囲内とします。

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

#### <インデックス マザーファンド TOPIX>

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

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

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

#### 法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

### 価格変動リスク

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

### 流動性リスク

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

### 信用リスク

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

### < T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

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。
- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項  
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項  
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項  
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取り扱いを停止する場合があります。



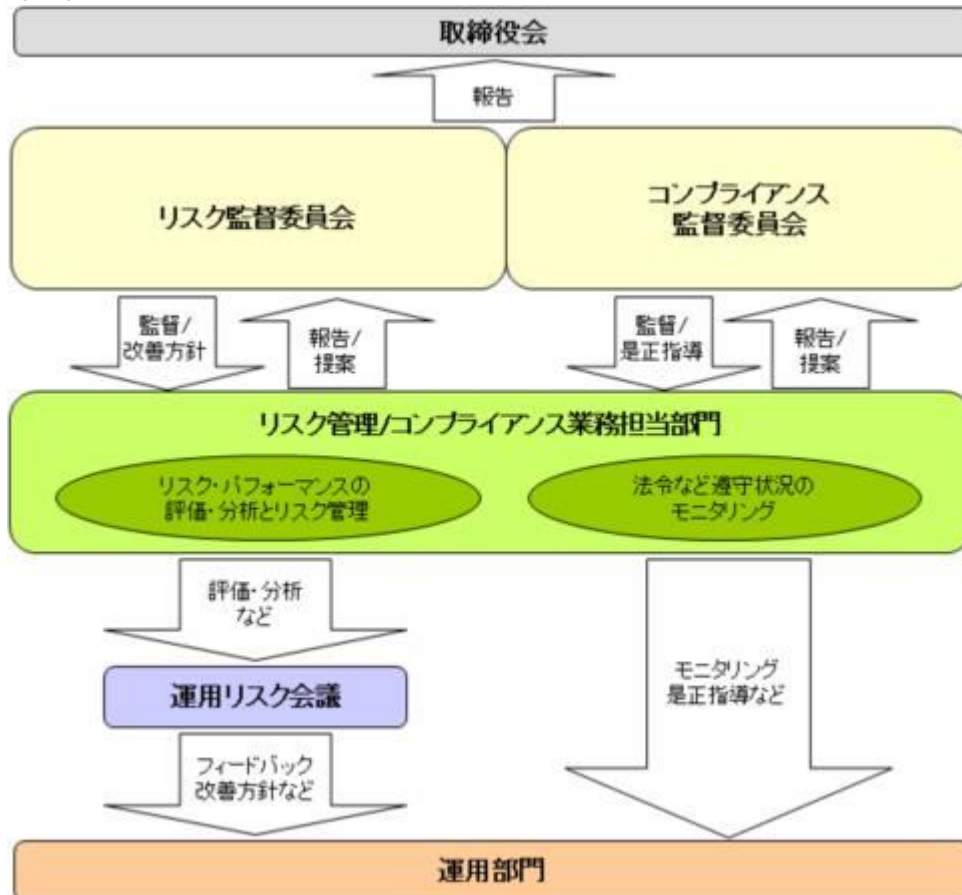
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

## (2) リスク管理体制



### 全社的なリスク管理

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

### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

### 法令など遵守状況のモニタリング

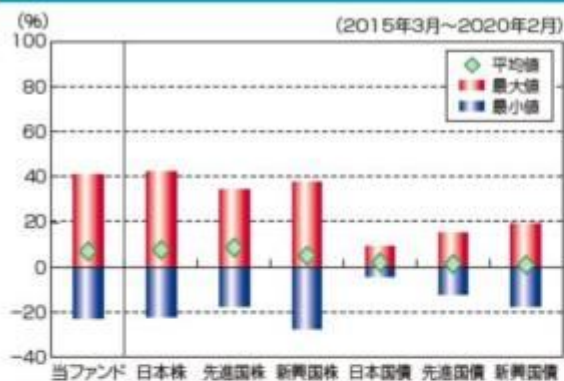
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2020年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。



## (参考情報)

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	6.9%	7.5%	8.6%	4.9%	2.0%	1.3%	0.8%
最大値	41.1%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	15.3%	19.3%
最小値	-22.4%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2015年3月から2020年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## &lt;各資産クラスの指数&gt;

日本株 …… 東証株価指数 (TOPIX、配当込)

先進国株 …… MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース)

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

日本国債 …… NOMURA-BPI国債

先進国債 …… FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

## 東証株価指数 (TOPIX、配当込)

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース)

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

## MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込、円ベース)

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

## NOMURA-BPI国債

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

## 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万円当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2015年3月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

**FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）**

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

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

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

**4【手数料等及び税金】****（１）【申込手数料】**

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

- ・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができます場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

**（２）【換金（解約）手数料】**

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

**（３）【信託報酬等】**

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.572%（税抜0.52%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬（有価証券届出書提出日現在）の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の6カ

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

#### (4)【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用(日々、計上されます。)

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

#### (5)【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

##### 1) 収益分配金に対する課税

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

##### 2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

## 法人受益者の場合

## 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

## 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

## 個別元本

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

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

## 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

## 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

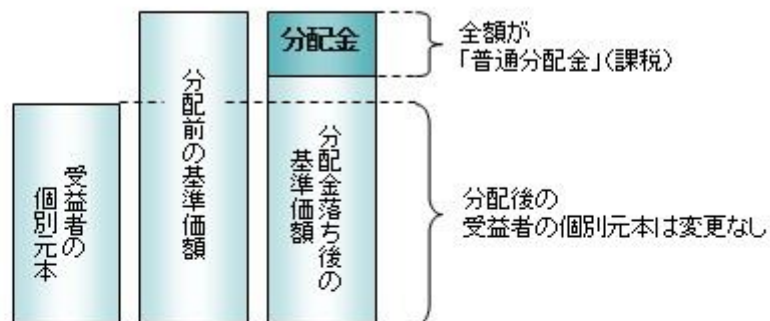
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

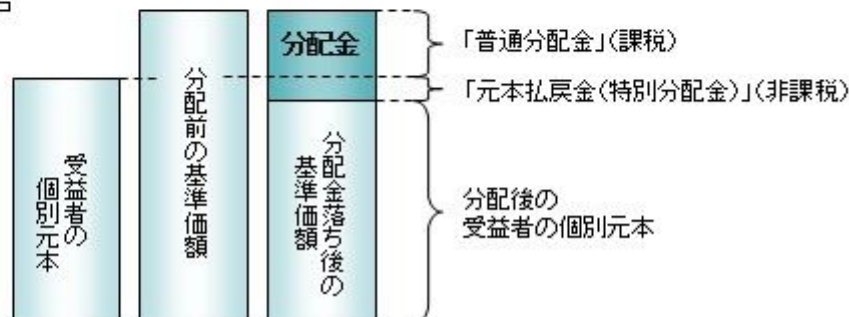
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

## イ) の場合



## ロ)、ハ) の場合



外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2020年5月12日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【インデックスファンドTSP】

以下の運用状況は2020年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	19,315,987,115	98.97
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		201,348,193	1.03
合計（純資産総額）		19,517,335,308	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	194,935,000	1.00

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	10,133,774,259	2.1671	21,961,504,220	1.9061	19,315,987,115	98.97

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.97
合計	98.97

## 【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 2020年03月	買建	13	日本円	223,285,550	194,935,000	1.00

(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25計算期間末 (2011年 2月14日)	24,740	25,043	0.4909	0.4969
第26計算期間末 (2012年 2月13日)	20,778	21,089	0.4011	0.4071
第27計算期間末 (2013年 2月12日)	25,203	25,608	0.4980	0.5060
第28計算期間末 (2014年 2月12日)	26,006	26,338	0.6275	0.6355
第29計算期間末 (2015年 2月12日)	27,404	27,771	0.7464	0.7564
第30計算期間末 (2016年 2月12日)	20,550	20,885	0.6143	0.6243
第31計算期間末 (2017年 2月13日)	24,644	24,951	0.8013	0.8113
第32計算期間末 (2018年 2月13日)	23,554	23,873	0.8864	0.8984
第33計算期間末 (2019年 2月12日)	21,725	22,046	0.8132	0.8252
第34計算期間末 (2020年 2月12日)	21,993	22,338	0.8920	0.9060
2019年 2月末日	22,385		0.8314	
3月末日	22,357		0.8317	
4月末日	22,474		0.8451	
5月末日	21,010		0.7897	
6月末日	21,565		0.8109	
7月末日	21,863		0.8179	
8月末日	21,132		0.7899	
9月末日	22,048		0.8371	
10月末日	22,943		0.8786	
11月末日	23,033		0.8952	
12月末日	22,811		0.9077	
2020年 1月末日	21,940		0.8879	
2月末日	19,517		0.7840	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第25期	2010年 2月13日～2011年 2月14日	0.0060
第26期	2011年 2月15日～2012年 2月13日	0.0060
第27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	0.0080
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	0.0080
第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	0.0100
第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	0.0100

第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	0.0100
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	0.0120
第33期	2018年 2月14日～2019年 2月12日	0.0120
第34期	2019年 2月13日～2020年 2月12日	0.0140

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第25期	2010年 2月13日～2011年 2月14日	9.02
第26期	2011年 2月15日～2012年 2月13日	17.07
第27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	26.15
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	27.61
第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	20.54
第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	16.36
第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	32.07
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	12.12
第33期	2018年 2月14日～2019年 2月12日	6.90
第34期	2019年 2月13日～2020年 2月12日	11.41

(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25期	2010年 2月13日～2011年 2月14日	8,326,706,473	6,627,979,535
第26期	2011年 2月15日～2012年 2月13日	8,796,604,597	7,398,051,340
第27期	2012年 2月14日～2013年 2月12日	9,449,720,873	10,636,174,809
第28期	2013年 2月13日～2014年 2月12日	13,799,258,867	22,968,753,955
第29期	2014年 2月13日～2015年 2月12日	6,408,687,971	11,137,684,985
第30期	2015年 2月13日～2016年 2月12日	6,211,940,096	9,472,751,226
第31期	2016年 2月13日～2017年 2月13日	3,331,269,772	6,027,353,049
第32期	2017年 2月14日～2018年 2月13日	6,031,038,498	10,213,544,441
第33期	2018年 2月14日～2019年 2月12日	3,915,213,807	3,773,318,387
第34期	2019年 2月13日～2020年 2月12日	2,511,981,095	4,570,922,254

(参考)

インデックス マザーファンド T O P I X

以下の運用状況は2020年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	35,468,416,590	99.76
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		86,008,062	0.24
合計（純資産総額）		35,554,424,652	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	104,965,000	0.30

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	186,000	7,794.00	1,449,684,000	7,127.00	1,325,622,000	3.73
日本	株式	ソニー	電気機器	105,400	7,717.00	813,371,800	6,611.00	696,799,400	1.96
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	129,800	5,751.00	746,479,800	5,013.00	650,687,400	1.83
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,125,000	572.50	644,062,500	531.90	598,387,500	1.68
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	218,800	2,820.50	617,125,400	2,529.50	553,454,600	1.56
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	138,600	4,396.00	609,285,600	3,763.00	521,551,800	1.47
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,100	38,700.00	584,370,000	34,410.00	519,591,000	1.46
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	114,100	4,525.00	516,302,500	3,758.00	428,787,800	1.21
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	113,700	3,928.00	446,613,600	3,484.00	396,130,800	1.11
日本	株式	KDDI	情報・通信業	122,000	3,440.00	419,680,000	3,058.00	373,076,000	1.05
日本	株式	任天堂	その他製品	10,200	40,560.00	413,712,000	36,270.00	369,954,000	1.04
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	131,200	2,958.00	388,089,600	2,799.50	367,294,400	1.03
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	121,000	3,140.00	379,940,000	2,927.50	354,227,500	1.00
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	58,800	6,137.00	360,855,600	5,801.00	341,098,800	0.96
日本	株式	信越化学工業	化学	28,000	13,315.00	372,820,000	12,145.00	340,060,000	0.96
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,233,000	162.50	362,862,500	147.60	329,590,800	0.93
日本	株式	HOYA	精密機器	33,300	10,245.00	341,158,500	9,609.00	319,979,700	0.90
日本	株式	第一三共	医薬品	47,700	8,027.00	382,887,900	6,590.00	314,343,000	0.88



日本	株式	花王	化学	39,900	8,530.00	340,347,000	7,868.00	313,933,200	0.88
日本	株式	ダイキン工業	機械	21,200	16,070.00	340,684,000	14,725.00	312,170,000	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	115,200	2,889.00	332,812,800	2,690.00	309,888,000	0.87
日本	株式	日立製作所	電気機器	80,100	4,265.00	341,626,500	3,637.00	291,323,700	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	15,800	20,900.00	330,220,000	17,970.00	283,926,000	0.80
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	114,800	2,619.00	300,661,200	2,461.50	282,580,200	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	49,000	6,624.00	324,576,000	5,721.00	280,329,000	0.79
日本	株式	三井物産	卸売業	144,200	1,952.00	281,478,400	1,783.50	257,180,700	0.72
日本	株式	日本電産	電気機器	20,100	14,540.00	292,254,000	12,780.00	256,878,000	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	146,600	1,945.00	285,137,000	1,699.00	249,073,400	0.70
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	11,100	25,175.00	279,442,500	22,325.00	247,807,500	0.70
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	13,900	22,090.00	307,051,000	17,780.00	247,142,000	0.70

## 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	0.09
		鉱業	0.27
		建設業	2.77
		食料品	3.80
		繊維製品	0.56
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.16
		医薬品	6.10
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.81
		鉄鋼	0.68
		非鉄金属	0.70
		金属製品	0.57
		機械	5.03
		電気機器	14.42
		輸送用機器	7.84
		精密機器	2.49
		その他製品	2.19
		電気・ガス業	1.53
		陸運業	4.09
		海運業	0.15
		空運業	0.45
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	9.30		
卸売業	5.12		
小売業	4.46		
銀行業	5.73		

	証券、商品先物取引業	0.81
	保険業	2.39
	その他金融業	1.23
	不動産業	2.41
	サービス業	5.01
合 計		99.76

#### 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 2020年03月	買建	7	日本円	118,165,550	104,965,000	0.30

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

#### 参考情報

## 運用実績

2020年2月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 7,840円  
純資産総額…………… 195.17億円

※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、2010年2月末の基準価額を起点として指数化しています。  
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2016年2月	2017年2月	2018年2月	2019年2月	2020年2月	設定来累計
100円	100円	120円	120円	140円	4,560円

## 主要な資産の状況

## &lt;資産構成比率&gt;

組入資産	比率
株式	100.0%
うち先物	1.3%
CB	0.0%
公社債	0.0%
現金その他	1.3%
外貨建資産	0.0%

※当ファンドの実質組入比率です。

## &lt;株式組入上位5業種&gt;

	業種	比率
1	電気機器	14.5%
2	情報・通信業	9.3%
3	輸送用機器	7.9%
4	化学	7.2%
5	医薬品	6.1%

※マザーファンドの対組入株式時価総額比です。

## &lt;株式組入上位10銘柄&gt; (銘柄数:2,123銘柄)

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.73%
2	ソニー	電気機器	1.96%
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.83%
4	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.68%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.56%
6	武田薬品工業	医薬品	1.47%
7	キーエンス	電気機器	1.46%
8	リクルートホールディングス	サービス業	1.21%
9	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.11%
10	KDDI	情報・通信業	1.05%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
※2020年は、2020年2月末までの騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## (1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

## (2) コースの選択

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

### ＜分配金再投資コース＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

### ＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

## (3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

## (4) 取扱時間

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

## (5) 申込金額

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

## (6) 申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。

## (7) 申込代金の支払い

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

## (8) 受付の中止および取消

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

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

## (9) 償還乗換

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

## (10) 乗換優遇

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

## 2【換金（解約）手続等】

### ＜解約請求による換金＞

#### (1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

#### (2) 取扱時間

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

#### (3) 解約制限

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

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

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

<買取請求による換金>

(1) 買取りの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 買取制限

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

(4) 買取価額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(6) 買取単位

1口単位

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

(7) 受付の中止および取消

- ・販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて買取りを中止すること、および既に受け付けた買取りを取り消すことができます。
- ・買取請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の買取請求を撤回できます。ただ

し、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとして取り扱います。

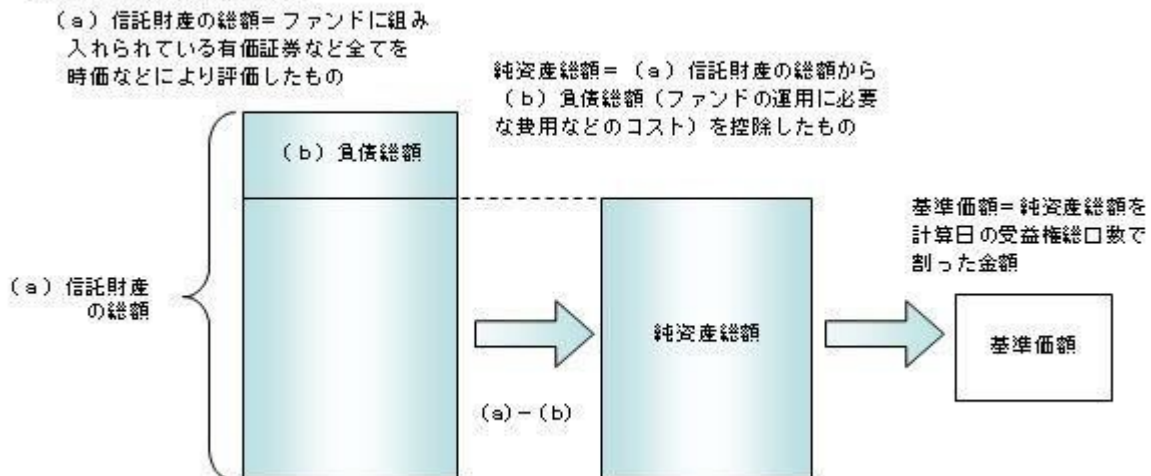
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

##### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

##### 国内上場株式

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

##### 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

##### <委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

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

#### (4)【計算期間】

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

#### (5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回る事となった場合
  - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
  - ハ) 対象インデックスが改廃の場合
- 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。)
- 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することができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
  - 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

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



<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス [www.nikkoam.com/](http://www.nikkoam.com/)

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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



### 第3【ファンドの経理状況】

- (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34期計算期間（2019年 2月13日から2020年 2月12日まで）の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【インデックスファンドTSP】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第33期 2019年 2月12日現在	第34期 2020年 2月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	558,294,282	463,942,861
親投資信託受益証券	21,517,823,979	21,936,473,375
派生商品評価勘定	9,152,440	1,316,700
未収入金	21,481,760	13,000,000
前払金	130,000	2,510,000
差入委託証拠金	15,345,000	11,040,000
流動資産合計	22,122,227,461	22,428,282,936
資産合計		
	22,122,227,461	22,428,282,936
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	908,100	2,542,150
未払金	146,080	844,400
未払収益分配金	320,588,814	345,195,107
未払解約金	9,855,090	21,910,322
未払受託者報酬	12,421,734	12,317,916
未払委託者報酬	52,171,552	51,735,498
未払利息	552	52
その他未払費用	496,811	492,655
流動負債合計	396,588,733	435,038,100
負債合計		
	396,588,733	435,038,100
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	26,715,734,544	24,656,793,385
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,990,095,816	2,663,548,549
（分配準備積立金）	5,146,501,585	4,506,281,875
元本等合計	21,725,638,728	21,993,244,836
純資産合計		
	21,725,638,728	21,993,244,836
負債純資産合計		
	22,122,227,461	22,428,282,936

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第33期		第34期	
	自 2018年 2月14日	至 2019年 2月12日	自 2019年 2月13日	至 2020年 2月12日
<b>営業収益</b>				
受取利息		1,501		439
有価証券売買等損益		1,470,139,682		2,544,649,396
派生商品取引等損益		2,222,100		40,174,070
<b>営業収益合計</b>		<b>1,472,360,281</b>		<b>2,584,823,905</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		262,821		148,765
受託者報酬		25,479,754		24,133,788
委託者報酬		107,015,510		101,362,434
その他費用		1,064,064		979,180
<b>営業費用合計</b>		<b>133,822,149</b>		<b>126,624,167</b>
営業利益又は営業損失（ ）		1,606,182,430		2,458,199,738
経常利益又は経常損失（ ）		1,606,182,430		2,458,199,738
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,606,182,430		2,458,199,738
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（ ）		41,864,439		223,228,445
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,018,955,765		4,990,095,816
剰余金増加額又は欠損金減少額		424,434,528		851,168,871
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		424,434,528		851,168,871
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		426,938,896		414,397,790
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		426,938,896		414,397,790
分配金		320,588,814		345,195,107
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,990,095,816		2,663,548,549

## （ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		第33期 2019年 2月12日現在	第34期 2020年 2月12日現在
1.	期首元本額	26,573,839,124円	26,715,734,544円
	期中追加設定元本額	3,915,213,807円	2,511,981,095円
	期中一部解約元本額	3,773,318,387円	4,570,922,254円
2.	受益権の総数	26,715,734,544口	24,656,793,385口
3.	元本の欠損		
	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	4,990,095,816円	2,663,548,549円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第33期 自 2018年 2月14日 至 2019年 2月12日		第34期 自 2019年 2月13日 至 2020年 2月12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 380,183,788円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 486,756,646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	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 46,349,351円
C	信託約款に定める収益調整金 13,346,211,879円	C	信託約款に定める収益調整金 12,753,056,669円
D	信託約款に定める分配準備積立 金 5,086,906,611円	D	信託約款に定める分配準備積立 金 4,318,370,985円
E	分配対象収益 ( A+B+C+D ) 18,813,302,278円	E	分配対象収益 ( A+B+C+D ) 17,604,533,651円
F	分配対象収益(1万口当たり) 7,042円	F	分配対象収益(1万口当たり) 7,139円
G	分配金額 320,588,814円	G	分配金額 345,195,107円
H	分配金額(1万口当たり) 120円	H	分配金額(1万口当たり) 140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33期 自 2018年 2月14日 至 2019年 2月12日	第34期 自 2019年 2月13日 至 2020年 2月12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33期 2019年 2月12日現在	第34期 2020年 2月12日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第33期(2019年 2月12日現在)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,415,982,938
合計	1,415,982,938

第34期（2020年 2月12日現在）

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,327,423,597
合計	2,327,423,597

(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33期（2019年 2月12日現在）

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	448,635,000	-	456,895,000	8,260,000
合計		448,635,000	-	456,895,000	8,260,000

第34期（2020年 2月12日現在）

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	327,825,000	-	326,610,000	1,215,000
合計		327,825,000	-	326,610,000	1,215,000

(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33期 2019年 2月12日現在		第34期 2020年 2月12日現在	
1口当たり純資産額	0.8132円	1口当たり純資産額	0.8920円
(1万口当たり純資産額)	(8,132円)	(1万口当たり純資産額)	(8,920円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	10,119,233,036	21,936,473,375	
合計		10,119,233,036	21,936,473,375	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

（参考）

## インデックス マザーファンド TOPIX

### 貸借対照表

	（単位：円）	
	2019年 2月12日現在	2020年 2月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	105,801,622	62,357,798
株式	38,645,266,100	40,370,774,260
派生商品評価勘定	1,944,600	38,900
未収配当金	63,631,347	65,320,891
前払金	1,950,000	390,000
流動資産合計	38,818,593,669	40,498,881,849
<b>資産合計</b>		
38,818,593,669		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	282,200
未払解約金	28,420,692	37,969,495
未払利息	104	7
流動負債合計	28,420,796	38,251,702
<b>負債合計</b>		
28,420,796		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	20,051,564,010	18,664,275,035
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	18,738,608,863	21,796,355,112
元本等合計	38,790,172,873	40,460,630,147
<b>純資産合計</b>		
38,790,172,873		
<b>負債純資産合計</b>		
38,818,593,669		
40,498,881,849		

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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



	(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

		2019年 2月12日現在	2020年 2月12日現在
1.	期首	2018年 2月14日	2019年 2月13日
	期首元本額	19,489,325,256円	20,051,564,010円
	期首からの追加設定元本額	3,188,930,338円	1,626,166,247円
	期首からの一部解約元本額	2,626,691,584円	3,013,455,222円
	元本の内訳		
	インデックスファンドT S P	11,123,196,681円	10,119,233,036円
	財形株投（一般財形30）	14,199,854円	13,739,467円
	財形株投（一般財形50）	57,283,497円	48,226,582円
	財形株投（年金・住宅財形30）	31,107,299円	27,278,156円
	インデックスファンドT O P I X（日本株式）	8,210,517,711円	7,882,311,349円
	T O P I Xインデックスファンド（個人型年金向け）	466,864,771円	461,549,833円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	34,137,961円	30,022,653円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-08	26,299,760円	16,425,193円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	17,168,805円	11,826,344円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2016-11	31,065,212円	24,743,151円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	16,027,870円	10,027,835円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	23,694,589円	18,891,436円
	計	20,051,564,010円	18,664,275,035円
2.	受益権の総数	20,051,564,010口	18,664,275,035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	261,108,000円	287,576,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2018年 2月14日 至 2019年 2月12日	自 2019年 2月13日 至 2020年 2月12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

	2019年 2月12日現在	2020年 2月12日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品            短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券            同左</p> <p>(2)デリバティブ取引            同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品            同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2019年 2月12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	3,436,676,618
合計	3,436,676,618

（2020年 2月12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	3,395,585,100
合計	3,395,585,100

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2019年 2月12日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	155,600,000	-	157,550,000	1,950,000
合計		155,600,000	-	157,550,000	1,950,000

（2020年 2月12日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	103,380,000	-	103,140,000	240,000
合計		103,380,000	-	103,140,000	240,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

2019年 2月12日現在		2020年 2月12日現在	
1口当たり純資産額	1.9345円	1口当たり純資産額	2.1678円
(1万口当たり純資産額)	(19,345円)	(1万口当たり純資産額)	(21,678円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	2,883.00	2,306,400	
日本水産	22,800	620.00	14,136,000	
マルハニチロ	3,300	2,579.00	8,510,700	
カネコ種苗	700	1,335.00	934,500	
サカタのタネ	2,700	3,425.00	9,247,500	
ホクト	1,700	1,990.00	3,383,000	
ホクリヨウ	400	780.00	312,000	
住石ホールディングス	4,700	139.00	653,300	
日鉄鉱業	500	4,485.00	2,242,500	
三井松島ホールディングス	900	1,171.00	1,053,900	
国際石油開発帝石	90,800	1,050.50	95,385,400	
石油資源開発	3,000	2,886.00	8,658,000	
K&Oエナジーグループ	1,100	1,840.00	2,024,000	
ヒノキヤグループ	600	2,111.00	1,266,600	
ショーボンドホールディングス	3,500	4,605.00	16,117,500	
ミライト・ホールディングス	6,700	1,609.00	10,780,300	

タマホーム	1,200	1,427.00	1,712,400
サンヨーホームズ	200	716.00	143,200
日本アクア	900	635.00	571,500
ファーストコーポレーション	700	603.00	422,100
ベステラ	400	1,181.00	472,400
キャンディル	200	806.00	161,200
スペースバリューホールディングス	2,900	563.00	1,632,700
ダイセキ環境ソリューション	500	1,088.00	544,000
第一カッター興業	300	1,732.00	519,600
明豊ファシリティワークス	600	791.00	474,600
安藤・間	13,500	864.00	11,664,000
東急建設	6,600	750.00	4,950,000
コムシスホールディングス	8,000	2,994.00	23,952,000
ビーアールホールディングス	2,500	476.00	1,190,000
高松コンストラクショングループ	1,400	2,684.00	3,757,600
東建コーポレーション	700	8,090.00	5,663,000
ソネック	200	795.00	159,000
ヤマウラ	1,000	951.00	951,000
大成建設	17,400	4,230.00	73,602,000
大林組	52,300	1,228.00	64,224,400
清水建設	53,100	1,121.00	59,525,100
飛鳥建設	1,600	1,467.00	2,347,200
長谷工コーポレーション	20,200	1,471.00	29,714,200
松井建設	2,100	750.00	1,575,000
銭高組	200	4,000.00	800,000
鹿島建設	41,000	1,359.00	55,719,000
不動テトラ	1,400	1,735.00	2,429,000
大末建設	600	998.00	598,800
鉄建建設	1,200	2,759.00	3,310,800
西松建設	4,100	2,474.00	10,143,400
三井住友建設	12,700	630.00	8,001,000
大豊建設	1,200	2,716.00	3,259,200
前田建設工業	13,100	1,109.00	14,527,900
ナカノフドー建設	1,500	494.00	741,000
奥村組	2,800	2,815.00	7,882,000
東鉄工業	2,200	3,260.00	7,172,000
イチケン	400	1,793.00	717,200
富士ピー・エス	800	551.00	440,800
浅沼組	600	5,250.00	3,150,000
戸田建設	21,700	738.00	16,014,600
熊谷組	2,400	3,155.00	7,572,000
北野建設	300	2,511.00	753,300

植木組	300	2,553.00	765,900
矢作建設工業	2,300	852.00	1,959,600
ピーエス三菱	1,800	693.00	1,247,400
日本ハウスホールディングス	3,700	464.00	1,716,800
大東建託	6,300	12,785.00	80,545,500
新日本建設	2,200	897.00	1,973,400
N I P P O	4,300	2,716.00	11,678,800
東亜道路工業	400	3,505.00	1,402,000
前田道路	5,600	3,680.00	20,608,000
日本道路	500	7,550.00	3,775,000
東亜建設工業	1,700	1,798.00	3,056,600
日本国土開発	3,800	617.00	2,344,600
若築建設	1,000	1,697.00	1,697,000
東洋建設	6,000	522.00	3,132,000
五洋建設	20,800	683.00	14,206,400
世紀東急工業	2,500	902.00	2,255,000
福田組	600	4,995.00	2,997,000
住友林業	13,300	1,717.00	22,836,100
日本基礎技術	1,800	404.00	727,200
巴コーポレーション	2,400	407.00	976,800
大和ハウス工業	51,700	3,507.00	181,311,900
ライト工業	3,000	1,511.00	4,533,000
積水ハウス	57,200	2,430.00	138,996,000
日特建設	1,400	870.00	1,218,000
北陸電気工事	900	1,134.00	1,020,600
ユアテック	3,000	656.00	1,968,000
四電工	300	2,692.00	807,600
中電工	2,100	2,485.00	5,218,500
関電工	7,400	1,036.00	7,666,400
きんでん	12,400	1,834.00	22,741,600
東京エネシス	1,700	863.00	1,467,100
トーエネック	500	3,690.00	1,845,000
住友電設	1,500	2,545.00	3,817,500
日本電設工業	2,900	2,278.00	6,606,200
協和エクシオ	7,900	2,683.00	21,195,700
新日本空調	1,400	2,068.00	2,895,200
九電工	3,700	3,170.00	11,729,000
三機工業	3,800	1,426.00	5,418,800
日揮ホールディングス	16,100	1,533.00	24,681,300
中外炉工業	600	1,777.00	1,066,200
ヤマト	1,700	800.00	1,360,000
太平電業	1,300	2,583.00	3,357,900

高砂熱学工業	4,500	1,852.00	8,334,000
三晃金属工業	200	2,614.00	522,800
朝日工業社	400	3,260.00	1,304,000
明星工業	3,400	820.00	2,788,000
大気社	2,500	3,660.00	9,150,000
ダイダン	1,300	2,902.00	3,772,600
日比谷総合設備	1,700	1,934.00	3,287,800
フィル・カンパニー	200	3,920.00	784,000
東洋エンジニアリング	2,300	598.00	1,375,400
レイズネクスト	2,800	1,325.00	3,710,000
日本製粉	4,900	1,667.00	8,168,300
日清製粉グループ本社	18,900	1,892.00	35,758,800
日東富士製粉	100	6,290.00	629,000
昭和産業	1,500	3,045.00	4,567,500
鳥越製粉	1,500	820.00	1,230,000
中部飼料	2,100	1,703.00	3,576,300
フィード・ワン	11,300	181.00	2,045,300
東洋精糖	300	1,210.00	363,000
日本甜菜製糖	900	1,893.00	1,703,700
三井製糖	1,500	2,173.00	3,259,500
塩水港精糖	1,900	236.00	448,400
日新製糖	800	2,046.00	1,636,800
森永製菓	3,900	5,050.00	19,695,000
中村屋	400	4,005.00	1,602,000
江崎グリコ	5,000	4,740.00	23,700,000
名糖産業	800	1,386.00	1,108,800
井村屋グループ	700	1,937.00	1,355,900
不二家	900	2,267.00	2,040,300
山崎製パン	12,500	2,089.00	26,112,500
第一屋製パン	300	931.00	279,300
モロゾフ	300	5,040.00	1,512,000
亀田製菓	900	4,945.00	4,450,500
寿スピリッツ	1,600	6,930.00	11,088,000
カルビー	7,600	3,235.00	24,586,000
森永乳業	3,100	4,390.00	13,609,000
六甲バター	1,100	1,612.00	1,773,200
ヤクルト本社	11,500	5,540.00	63,710,000
明治ホールディングス	11,000	7,220.00	79,420,000
雪印メグミルク	4,000	2,485.00	9,940,000
プリマハム	2,600	2,659.00	6,913,400
日本ハム	6,400	4,830.00	30,912,000
林兼産業	600	703.00	421,800

丸大食品	1,800	2,221.00	3,997,800
S Foods	1,300	2,724.00	3,541,200
柿安本店	600	3,125.00	1,875,000
伊藤ハム米久ホールディングス	10,600	696.00	7,377,600
サッポロホールディングス	5,700	2,725.00	15,532,500
アサヒグループホールディングス	35,000	5,195.00	181,825,000
キリンホールディングス	70,900	2,507.00	177,746,300
宝ホールディングス	12,600	989.00	12,461,400
オエノンホールディングス	4,600	401.00	1,844,600
養命酒製造	500	1,972.00	986,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,700	2,973.00	34,784,100
サントリー食品インターナショナル	11,200	4,570.00	51,184,000
ダイトーグループホールディングス	900	4,150.00	3,735,000
伊藤園	5,100	5,440.00	27,744,000
キーコーヒー	1,700	2,311.00	3,928,700
ユニカフェ	500	962.00	481,000
ジャパンフーズ	300	1,234.00	370,200
日清オイリオグループ	2,100	3,620.00	7,602,000
不二製油グループ本社	4,100	2,876.00	11,791,600
かどや製油	200	3,945.00	789,000
J - オイルミルズ	900	4,245.00	3,820,500
キッコーマン	12,100	5,790.00	70,059,000
味の素	37,000	1,985.00	73,445,000
キューピー	9,300	2,222.00	20,664,600
ハウス食品グループ本社	6,300	3,575.00	22,522,500
カゴメ	6,300	2,823.00	17,784,900
焼津水産化学工業	800	1,022.00	817,600
アリアケジャパン	1,500	7,870.00	11,805,000
ピエトロ	200	1,648.00	329,600
エバラ食品工業	400	2,164.00	865,600
やまみ	100	2,191.00	219,100
ニチレイ	7,900	2,792.00	22,056,800
東洋水産	8,600	4,635.00	39,861,000
イトアンド	600	1,888.00	1,132,800
大冷	200	1,996.00	399,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	1,183.00	1,183,000
日清食品ホールディングス	7,100	9,220.00	65,462,000
永谷園ホールディングス	800	2,209.00	1,767,200
一正蒲鉾	700	976.00	683,200
フジッコ	1,800	1,927.00	3,468,600
ロック・フィールド	1,800	1,470.00	2,646,000
日本たばこ産業	96,500	2,307.00	222,625,500



ケンコーマヨネーズ	900	2,401.00	2,160,900
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,937.00	2,130,700
なとり	900	1,730.00	1,557,000
イフジ産業	300	750.00	225,000
ピクルスコーポレーション	400	2,876.00	1,150,400
北の達人コーポレーション	5,900	660.00	3,894,000
ユーグレナ	7,200	875.00	6,300,000
ミヨシ油脂	600	1,198.00	718,800
理研ビタミン	800	4,015.00	3,212,000
片倉工業	2,400	1,252.00	3,004,800
ゲンゼ	1,200	4,335.00	5,202,000
東洋紡	6,500	1,555.00	10,107,500
ユニチカ	4,900	367.00	1,798,300
富士紡ホールディングス	800	3,660.00	2,928,000
倉敷紡績	1,600	2,324.00	3,718,400
シキボウ	900	1,309.00	1,178,100
日本毛織	5,300	1,060.00	5,618,000
ダイトウボウ	2,700	250.00	675,000
トーア紡コーポレーション	700	541.00	378,700
ダイドーリミテッド	2,200	270.00	594,000
帝国繊維	1,900	2,543.00	4,831,700
帝人	13,300	2,009.00	26,719,700
東レ	118,200	706.20	83,472,840
サカイオーベックス	400	1,811.00	724,400
住江織物	400	2,414.00	965,600
日本フェルト	900	495.00	445,500
日東製網	200	1,691.00	338,200
アツギ	1,400	768.00	1,075,200
ダイニック	600	801.00	480,600
セーレン	4,000	1,602.00	6,408,000
ソトー	500	970.00	485,000
東海染工	200	1,140.00	228,000
小松マテーレ	2,700	851.00	2,297,700
ワコールホールディングス	4,300	2,894.00	12,444,200
ホギメディカル	1,800	3,480.00	6,264,000
レナウン	4,300	104.00	447,200
クラウドディアホールディングス	400	478.00	191,200
T S Iホールディングス	5,500	531.00	2,920,500
マツオカコーポレーション	500	1,912.00	956,000
ワールド	2,300	2,494.00	5,736,200
三陽商会	900	1,403.00	1,262,700
ナイガイ	600	443.00	265,800

オンワードホールディングス	9,900	628.00	6,217,200
ルックホールディングス	600	1,045.00	627,000
キムラタン	8,800	28.00	246,400
ゴールドウイン	3,000	7,380.00	22,140,000
デサント	3,200	1,754.00	5,612,800
キング	800	573.00	458,400
ヤマトインターナショナル	900	415.00	373,500
特種東海製紙	1,000	4,110.00	4,110,000
王子ホールディングス	68,300	605.00	41,321,500
日本製紙	7,300	1,815.00	13,249,500
三菱製紙	1,900	454.00	862,600
北越コーポレーション	10,800	521.00	5,626,800
中越パルプ工業	700	1,547.00	1,082,900
巴川製紙所	500	920.00	460,000
大王製紙	7,200	1,484.00	10,684,800
阿波製紙	500	540.00	270,000
レンゴー	15,500	865.00	13,407,500
トモク	1,000	1,800.00	1,800,000
ザ・パック	1,200	4,110.00	4,932,000
クラレ	25,700	1,373.00	35,286,100
旭化成	108,200	1,058.00	114,475,600
共和レザー	900	782.00	703,800
昭和電工	11,600	2,751.00	31,911,600
住友化学	119,900	456.00	54,674,400
住友精化	700	3,165.00	2,215,500
日産化学	9,100	5,070.00	46,137,000
ラサ工業	600	1,455.00	873,000
クレハ	1,400	6,120.00	8,568,000
多木化学	500	4,640.00	2,320,000
テイカ	1,200	1,868.00	2,241,600
石原産業	3,000	953.00	2,859,000
片倉コープアグリ	400	1,246.00	498,400
日本曹達	2,400	3,340.00	8,016,000
東ソー	25,200	1,688.00	42,537,600
トクヤマ	4,700	2,751.00	12,929,700
セントラル硝子	3,300	2,362.00	7,794,600
東亜合成	10,200	1,289.00	13,147,800
大阪ソーダ	1,600	2,832.00	4,531,200
関東電化工業	3,900	1,023.00	3,989,700
デンカ	6,000	3,020.00	18,120,000
信越化学工業	28,000	13,315.00	372,820,000
日本カーバイド工業	600	1,352.00	811,200

堺化学工業	1,100	2,373.00	2,610,300
第一稀元素化学工業	1,800	934.00	1,681,200
エア・ウォーター	15,200	1,543.00	23,453,600
大陽日酸	15,700	2,292.00	35,984,400
日本化学工業	500	2,898.00	1,449,000
東邦アセチレン	200	1,342.00	268,400
日本パーカライジング	8,200	1,157.00	9,487,400
高圧ガス工業	2,600	820.00	2,132,000
四国化成工業	2,500	1,296.00	3,240,000
戸田工業	400	2,185.00	874,000
ステラ ケミファ	900	3,530.00	3,177,000
保土谷化学工業	600	4,465.00	2,679,000
日本触媒	2,500	6,220.00	15,550,000
大日精化工業	1,400	2,929.00	4,100,600
カネカ	4,200	3,445.00	14,469,000
三菱瓦斯化学	15,400	1,847.00	28,443,800
三井化学	14,800	2,614.00	38,687,200
J S R	15,200	2,141.00	32,543,200
東京応化工業	2,800	4,585.00	12,838,000
大阪有機化学工業	1,500	1,819.00	2,728,500
三菱ケミカルホールディングス	109,000	783.20	85,368,800
K Hネオケム	2,900	2,484.00	7,203,600
ダイセル	22,400	1,023.00	22,915,200
住友ベークライト	2,600	4,125.00	10,725,000
積水化学工業	35,100	1,847.00	64,829,700
日本ゼオン	14,700	1,222.00	17,963,400
アイカ工業	4,900	3,580.00	17,542,000
宇部興産	8,200	2,215.00	18,163,000
積水樹脂	3,000	2,499.00	7,497,000
タキロンシーアイ	3,500	670.00	2,345,000
旭有機材	900	1,691.00	1,521,900
日立化成	7,500	4,610.00	34,575,000
ニチバン	900	1,674.00	1,506,600
リケンテクノス	4,100	481.00	1,972,100
大倉工業	800	1,721.00	1,376,800
積水化成成品工業	2,200	711.00	1,564,200
群栄化学工業	400	2,479.00	991,600
タイガースポリマー	800	569.00	455,200
ミライアル	600	1,247.00	748,200
ダイキアクシス	600	853.00	511,800
ダイキョーニシカワ	3,400	775.00	2,635,000
竹本容器	600	882.00	529,200

森六ホールディングス	900	2,212.00	1,990,800
日本化薬	10,100	1,322.00	13,352,200
カーリットホールディングス	1,800	579.00	1,042,200
日本精化	1,300	1,431.00	1,860,300
扶桑化学工業	1,700	3,620.00	6,154,000
トリケミカル研究所	400	11,070.00	4,428,000
A D E K A	7,500	1,612.00	12,090,000
日油	6,100	4,040.00	24,644,000
新日本理化	2,800	208.00	582,400
ハリマ化成グループ	1,400	1,124.00	1,573,600
花王	39,900	8,530.00	340,347,000
第一工業製薬	600	4,730.00	2,838,000
石原ケミカル	400	1,854.00	741,600
日華化学	500	839.00	419,500
三洋化成工業	1,000	4,925.00	4,925,000
有機合成薬品工業	1,300	265.00	344,500
大日本塗料	1,800	1,078.00	1,940,400
日本ペイントホールディングス	13,500	5,440.00	73,440,000
関西ペイント	18,300	2,623.00	48,000,900
神東塗料	1,300	204.00	265,200
中国塗料	4,700	1,002.00	4,709,400
日本特殊塗料	1,200	1,315.00	1,578,000
藤倉化成	2,100	568.00	1,192,800
太陽ホールディングス	1,200	5,060.00	6,072,000
D I C	6,900	2,942.00	20,299,800
サカタインクス	3,600	1,234.00	4,442,400
東洋インキＳＣホールディングス	3,400	2,523.00	8,578,200
T & K T O K A	1,200	986.00	1,183,200
富士フイルムホールディングス	32,000	5,343.00	170,976,000
資生堂	33,100	7,089.00	234,645,900
ライオン	21,700	2,046.00	44,398,200
高砂香料工業	1,100	2,415.00	2,656,500
マンダム	3,800	2,625.00	9,975,000
ミルボン	2,200	5,800.00	12,760,000
ファンケル	6,700	3,210.00	21,507,000
コーセー	3,100	14,900.00	46,190,000
コタ	900	1,495.00	1,345,500
シーボン	200	2,476.00	495,200
ポーラ・オルビスホールディングス	7,100	2,366.00	16,798,600
ノエビアホールディングス	1,600	5,200.00	8,320,000
アジュバンコスメジャパン	400	991.00	396,400
エステー	1,100	1,644.00	1,808,400

アグロ カネショウ	500	1,435.00	717,500
コニシ	2,700	1,600.00	4,320,000
長谷川香料	2,200	2,319.00	5,101,800
星光PMC	1,000	936.00	936,000
小林製薬	4,700	8,860.00	41,642,000
荒川化学工業	1,500	1,558.00	2,337,000
メック	1,200	1,705.00	2,046,000
日本高純度化学	500	2,701.00	1,350,500
タカラバイオ	4,400	2,371.00	10,432,400
JCU	2,000	3,095.00	6,190,000
新田ゼラチン	1,100	665.00	731,500
OATアグリオ	300	1,496.00	448,800
デクセリアルズ	4,300	931.00	4,003,300
アース製薬	1,300	5,920.00	7,696,000
北興化学工業	1,700	652.00	1,108,400
大成ラミック	600	2,843.00	1,705,800
クミアイ化学工業	6,900	870.00	6,003,000
日本農薬	3,100	572.00	1,773,200
アキレス	1,200	1,760.00	2,112,000
有沢製作所	2,700	1,008.00	2,721,600
日東電工	11,500	6,200.00	71,300,000
レック	1,800	1,124.00	2,023,200
三光合成	2,000	352.00	704,000
きもと	2,900	171.00	495,900
藤森工業	1,500	3,470.00	5,205,000
前澤化成工業	1,100	1,160.00	1,276,000
未来工業	900	2,117.00	1,905,300
ウェーブロックホールディングス	600	725.00	435,000
JSP	1,000	1,923.00	1,923,000
エフピコ	1,800	6,810.00	12,258,000
天馬	1,100	2,030.00	2,233,000
信越ポリマー	3,000	991.00	2,973,000
東リ	4,200	300.00	1,260,000
ニフコ	6,100	2,898.00	17,677,800
バルカー	1,400	2,463.00	3,448,200
ユニ・チャーム	32,100	3,677.00	118,031,700
ショーエイコーポレーション	200	864.00	172,800
協和キリン	16,800	2,768.00	46,502,400
武田薬品工業	138,600	4,396.00	609,285,600
アステラス製薬	146,600	1,945.00	285,137,000
大日本住友製薬	12,300	1,839.00	22,619,700
塩野義製薬	21,300	6,510.00	138,663,000

わかもと製薬	2,100	264.00	554,400
あすか製薬	1,900	1,177.00	2,236,300
日本新薬	4,400	9,540.00	41,976,000
ピオフェルミン製薬	300	2,399.00	719,700
中外製薬	17,400	12,055.00	209,757,000
科研製薬	2,900	5,940.00	17,226,000
エーザイ	20,000	9,082.00	181,640,000
ロート製薬	8,600	3,160.00	27,176,000
小野薬品工業	38,300	2,651.00	101,533,300
久光製薬	4,400	5,730.00	25,212,000
持田製薬	2,300	4,250.00	9,775,000
参天製薬	31,000	2,067.00	64,077,000
扶桑薬品工業	600	1,971.00	1,182,600
日本ケミファ	200	2,658.00	531,600
ツムラ	5,100	3,085.00	15,733,500
日医工	4,700	1,334.00	6,269,800
キッセイ薬品工業	2,900	2,988.00	8,665,200
生化学工業	3,200	1,238.00	3,961,600
栄研化学	2,900	2,372.00	6,878,800
日水製薬	700	1,323.00	926,100
鳥居薬品	1,000	3,560.00	3,560,000
JCRファーマ	1,200	10,050.00	12,060,000
東和薬品	2,100	2,577.00	5,411,700
富士製薬工業	1,100	1,338.00	1,471,800
沢井製薬	3,400	7,260.00	24,684,000
ゼリア新薬工業	3,000	2,055.00	6,165,000
第一三共	47,700	8,027.00	382,887,900
キョーリン製薬ホールディングス	3,700	2,154.00	7,969,800
大幸薬品	700	4,545.00	3,181,500
ダイト	1,000	3,695.00	3,695,000
大塚ホールディングス	31,800	4,934.00	156,901,200
大正製薬ホールディングス	3,500	7,980.00	27,930,000
ペプチドリーム	8,400	5,520.00	46,368,000
日本コークス工業	13,800	77.00	1,062,600
ニチレキ	2,000	1,369.00	2,738,000
ユシロ化学工業	900	1,395.00	1,255,500
ビーピー・カストロール	600	1,403.00	841,800
富士石油	4,600	233.00	1,071,800
MORESCO	600	1,410.00	846,000
出光興産	18,800	2,814.00	52,903,200
JXTGホールディングス	250,700	475.70	119,257,990
コスモエネルギーホールディングス	4,800	2,131.00	10,228,800

横浜ゴム	9,700	1,853.00	17,974,100
TOYO TIRE	9,600	1,379.00	13,238,400
ブリヂストン	51,200	3,859.00	197,580,800
住友ゴム工業	15,000	1,207.00	18,105,000
藤倉コンポジット	1,500	442.00	663,000
オカモト	1,000	3,890.00	3,890,000
フコク	800	704.00	563,200
ニッタ	1,900	3,095.00	5,880,500
住友理工	3,300	856.00	2,824,800
三ツ星ベルト	2,200	1,841.00	4,050,200
バンドー化学	2,900	818.00	2,372,200
日東紡績	2,500	5,200.00	13,000,000
A G C	16,500	3,490.00	57,585,000
日本板硝子	8,100	588.00	4,762,800
石塚硝子	300	2,666.00	799,800
日本山村硝子	700	1,173.00	821,100
日本電気硝子	6,700	2,097.00	14,049,900
オハラ	700	1,279.00	895,300
住友大阪セメント	3,200	4,255.00	13,616,000
太平洋セメント	10,500	3,030.00	31,815,000
日本ヒューム	1,700	799.00	1,358,300
日本コンクリート工業	3,700	277.00	1,024,900
三谷セキサン	800	3,800.00	3,040,000
アジアパイルホールディングス	2,500	549.00	1,372,500
東海カーボン	17,500	1,004.00	17,570,000
日本カーボン	900	3,810.00	3,429,000
東洋炭素	1,000	2,100.00	2,100,000
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,315.00	3,883,500
T O T O	11,900	4,940.00	58,786,000
日本碍子	20,300	1,919.00	38,955,700
日本特殊陶業	13,000	1,929.00	25,077,000
ダントーホールディングス	1,300	115.00	149,500
M A R U W A	600	8,100.00	4,860,000
品川リフラクトリーズ	400	3,070.00	1,228,000
黒崎播磨	300	6,580.00	1,974,000
ヨータイ	1,300	684.00	889,200
イソライト工業	900	600.00	540,000
東京窯業	2,000	319.00	638,000
ニッカトー	800	677.00	541,600
フジインコーポレーテッド	1,500	3,075.00	4,612,500
クニミネ工業	700	1,331.00	931,700
エーアンドエーマテリアル	300	1,546.00	463,800

ニチアス	4,600	2,541.00	11,688,600
ニチハ	2,300	2,684.00	6,173,200
日本製鉄	73,800	1,534.50	113,246,100
神戸製鋼所	30,400	499.00	15,169,600
合同製鐵	900	2,961.00	2,664,900
ジェイ エフ イー ホールディングス	44,600	1,330.00	59,318,000
東京製鐵	8,000	829.00	6,632,000
共英製鋼	1,900	1,886.00	3,583,400
大和工業	3,500	2,597.00	9,089,500
東京鐵鋼	700	1,471.00	1,029,700
大阪製鐵	900	1,624.00	1,461,600
淀川製鋼所	2,200	1,996.00	4,391,200
丸一鋼管	5,300	3,130.00	16,589,000
モリ工業	500	3,125.00	1,562,500
大同特殊鋼	2,700	4,380.00	11,826,000
日本高周波鋼業	600	429.00	257,400
日本冶金工業	1,400	2,115.00	2,961,000
山陽特殊製鋼	1,100	1,459.00	1,604,900
愛知製鋼	900	3,480.00	3,132,000
日立金属	17,800	1,775.00	31,595,000
日本金属	400	846.00	338,400
大平洋金属	1,200	2,391.00	2,869,200
新日本電工	10,900	180.00	1,962,000
栗本鐵工所	800	2,180.00	1,744,000
虹技	300	1,346.00	403,800
日本鑄鉄管	200	1,550.00	310,000
三菱製鋼	1,300	1,020.00	1,326,000
日亜鋼業	2,500	317.00	792,500
日本精線	300	3,735.00	1,120,500
エンビプロ・ホールディングス	700	720.00	504,000
シンニッタン	2,600	448.00	1,164,800
新家工業	400	1,426.00	570,400
大紀アルミニウム工業所	2,700	680.00	1,836,000
日本軽金属ホールディングス	41,700	215.00	8,965,500
三井金属鉱業	4,500	2,675.00	12,037,500
東邦亜鉛	900	1,952.00	1,756,800
三菱マテリアル	10,900	2,863.00	31,206,700
住友金属鉱山	21,100	3,214.00	67,815,400
DOWAホールディングス	4,200	3,990.00	16,758,000
古河機械金属	3,000	1,353.00	4,059,000
エス・サイエンス	7,500	47.00	352,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	1,375.00	2,475,000



東邦チタニウム	3,000	857.00	2,571,000
U A C J	2,500	2,264.00	5,660,000
C Kサンエツ	400	3,250.00	1,300,000
古河電気工業	5,100	2,591.00	13,214,100
住友電気工業	61,600	1,492.50	91,938,000
フジクラ	20,100	390.00	7,839,000
昭和電線ホールディングス	2,000	1,363.00	2,726,000
タツタ電線	3,300	589.00	1,943,700
カナレ電気	300	1,827.00	548,100
平河ヒューテック	600	1,450.00	870,000
リョービ	2,000	1,781.00	3,562,000
アーレスティ	2,200	514.00	1,130,800
アサヒホールディングス	2,900	2,671.00	7,745,900
稲葉製作所	1,000	1,372.00	1,372,000
宮地エンジニアリンググループ	500	2,118.00	1,059,000
トーカロ	4,600	1,235.00	5,681,000
アルファC o	600	1,301.00	780,600
S U M C O	19,700	1,770.00	34,869,000
川田テクノロジーズ	300	6,430.00	1,929,000
R S Technologies	500	2,957.00	1,478,500
信和	700	1,125.00	787,500
東洋製罐グループホールディングス	10,500	1,983.00	20,821,500
ホッカンホールディングス	900	1,879.00	1,691,100
コロナ	1,000	1,022.00	1,022,000
横河ブリッジホールディングス	3,100	2,192.00	6,795,200
駒井ハルテック	300	1,845.00	553,500
高田機工	200	2,805.00	561,000
三和ホールディングス	15,900	1,167.00	18,555,300
文化シャッター	4,800	860.00	4,128,000
三協立山	2,100	1,431.00	3,005,100
アルインコ	1,200	1,154.00	1,384,800
東洋シャッター	400	662.00	264,800
L I X I Lグループ	24,400	1,919.00	46,823,600
日本ファイルコン	1,300	528.00	686,400
ノーリツ	3,400	1,371.00	4,661,400
長府製作所	1,700	2,326.00	3,954,200
リンナイ	3,200	7,700.00	24,640,000
ダイニチ工業	900	688.00	619,200
日東精工	2,300	617.00	1,419,100
三洋工業	200	1,990.00	398,000
岡部	3,400	864.00	2,937,600
ジーテクト	2,100	1,518.00	3,187,800

東プレ	3,100	1,689.00	5,235,900
高周波熱錬	3,200	863.00	2,761,600
東京製綱	1,200	971.00	1,165,200
サンコール	900	560.00	504,000
モリテック スチール	1,300	356.00	462,800
パイオラックス	2,400	1,907.00	4,576,800
エイチワン	1,700	688.00	1,169,600
日本発條	17,700	923.00	16,337,100
中央発條	200	2,940.00	588,000
アドバネクス	300	1,581.00	474,300
立川ブラインド工業	800	1,299.00	1,039,200
三益半導体工業	1,300	2,408.00	3,130,400
日本ドライケミカル	400	1,898.00	759,200
日本製鋼所	5,000	1,926.00	9,630,000
三浦工業	7,100	4,195.00	29,784,500
タクマ	5,600	1,226.00	6,865,600
ツガミ	3,500	1,031.00	3,608,500
オークマ	1,900	5,130.00	9,747,000
東芝機械	1,900	3,410.00	6,479,000
アマダホールディングス	20,900	1,130.00	23,617,000
アイダエンジニアリング	4,300	905.00	3,891,500
滝澤鉄工所	500	1,335.00	667,500
F U J I	7,100	1,832.00	13,007,200
牧野フライス製作所	2,000	4,280.00	8,560,000
オーエスジー	7,600	1,875.00	14,250,000
ダイジェット工業	200	1,396.00	279,200
旭ダイヤモンド工業	4,400	602.00	2,648,800
D M G 森精機	10,500	1,629.00	17,104,500
ソディック	3,900	856.00	3,338,400
ディスコ	2,200	27,050.00	59,510,000
日東工器	900	2,487.00	2,238,300
日進工具	500	2,971.00	1,485,500
パンチ工業	1,600	453.00	724,800
富士ダイス	800	702.00	561,600
豊和工業	1,000	815.00	815,000
O K K	700	624.00	436,800
東洋機械金属	1,200	517.00	620,400
津田駒工業	300	1,104.00	331,200
島精機製作所	2,700	2,094.00	5,653,800
オプトラン	1,800	3,025.00	5,445,000
N C ホールディングス	500	672.00	336,000
イワキポンプ	800	1,241.00	992,800

フリーー	1,600	1,210.00	1,936,000
ヤマシンフィルタ	3,600	797.00	2,869,200
日阪製作所	2,000	948.00	1,896,000
やまびこ	3,200	1,110.00	3,552,000
平田機工	800	6,450.00	5,160,000
ペガサスミシン製造	1,700	470.00	799,000
マルマエ	700	999.00	699,300
タツモ	800	1,278.00	1,022,400
ナブテスコ	9,700	3,530.00	34,241,000
三井海洋開発	1,800	2,020.00	3,636,000
レオン自動機	1,600	1,411.00	2,257,600
S M C	5,200	51,000.00	265,200,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	1,500	519.00	778,500
ホソカワミクロン	600	5,540.00	3,324,000
ユニオンツール	600	3,255.00	1,953,000
オイレス工業	2,100	1,599.00	3,357,900
日精エー・エス・ビー機械	600	4,565.00	2,739,000
サトーホールディングス	2,400	2,933.00	7,039,200
技研製作所	1,500	4,850.00	7,275,000
日本エアーテック	500	1,022.00	511,000
カワタ	500	997.00	498,500
日精樹脂工業	1,400	975.00	1,365,000
オカダアイヨン	600	1,234.00	740,400
ワイエイシイホールディングス	700	648.00	453,600
小松製作所	75,500	2,356.00	177,878,000
住友重機械工業	9,500	2,774.00	26,353,000
日立建機	6,700	3,060.00	20,502,000
日工	2,300	823.00	1,892,900
巴工業	700	2,207.00	1,544,900
井関農機	1,700	1,475.00	2,507,500
T O W A	1,700	1,194.00	2,029,800
丸山製作所	400	1,669.00	667,600
北川鉄工所	700	2,163.00	1,514,100
ローツェ	700	4,260.00	2,982,000
タカキタ	600	546.00	327,600
クボタ	88,400	1,768.50	156,335,400
荏原実業	400	2,054.00	821,600
三菱化工機	600	2,010.00	1,206,000
月島機械	3,100	1,430.00	4,433,000
帝国電機製作所	1,400	1,513.00	2,118,200
新東工業	3,900	918.00	3,580,200
澁谷工業	1,400	2,896.00	4,054,400

アイチ コーポレーション	2,800	720.00	2,016,000
小森コーポレーション	4,200	967.00	4,061,400
鶴見製作所	1,300	1,816.00	2,360,800
住友精密工業	200	3,205.00	641,000
日本ギア工業	500	401.00	200,500
酒井重工業	300	2,692.00	807,600
荏原製作所	6,900	3,410.00	23,529,000
石井鐵工所	200	2,846.00	569,200
西島製作所	1,700	889.00	1,511,300
北越工業	1,700	1,307.00	2,221,900
ダイキン工業	21,200	16,070.00	340,684,000
オルガノ	600	7,490.00	4,494,000
トーヨーカネツ	800	2,194.00	1,755,200
栗田工業	9,000	3,280.00	29,520,000
椿本チエイン	2,400	3,375.00	8,100,000
大同工業	800	810.00	648,000
木村化工機	1,400	597.00	835,800
アネスト岩田	2,600	1,040.00	2,704,000
ダイフク	8,500	7,130.00	60,605,000
サムコ	500	2,069.00	1,034,500
加藤製作所	900	1,680.00	1,512,000
油研工業	300	1,701.00	510,300
タダノ	8,100	1,070.00	8,667,000
フジテック	6,100	1,776.00	10,833,600
C K D	4,700	1,905.00	8,953,500
キトー	1,300	1,710.00	2,223,000
平和	4,700	2,264.00	10,640,800
理想科学工業	1,500	1,959.00	2,938,500
S A N K Y O	3,700	3,800.00	14,060,000
日本金銭機械	1,900	828.00	1,573,200
マースグループホールディングス	1,100	1,968.00	2,164,800
フクシマガリレイ	1,000	3,985.00	3,985,000
オーイズミ	700	605.00	423,500
ダイコク電機	800	1,561.00	1,248,800
竹内製作所	2,800	1,998.00	5,594,400
アマノ	4,400	3,035.00	13,354,000
J U K I	2,400	788.00	1,891,200
サンデンホールディングス	2,300	650.00	1,495,000
蛇の目ミシン工業	1,600	399.00	638,400
マックス	2,600	2,079.00	5,405,400
グローリー	4,300	3,235.00	13,910,500
新晃工業	1,600	1,701.00	2,721,600

大和冷機工業	2,400	1,159.00	2,781,600
セガサミーホールディングス	16,600	1,585.00	26,311,000
日本ピストンリング	600	1,424.00	854,400
リケン	800	3,600.00	2,880,000
T P R	2,200	1,837.00	4,041,400
ツバキ・ナカシマ	3,400	1,330.00	4,522,000
ホシザキ	4,900	10,530.00	51,597,000
大豊工業	1,400	707.00	989,800
日本精工	31,500	936.00	29,484,000
N T N	38,900	302.00	11,747,800
ジェイテクト	16,000	1,180.00	18,880,000
不二越	1,600	4,175.00	6,680,000
日本トムソン	5,100	467.00	2,381,700
T H K	9,700	2,904.00	28,168,800
ユーシン精機	1,300	939.00	1,220,700
前澤給装工業	600	2,273.00	1,363,800
イーグル工業	2,100	976.00	2,049,600
前澤工業	1,100	396.00	435,600
日本ピラー工業	1,700	1,623.00	2,759,100
キッツ	6,700	766.00	5,132,200
マキタ	21,700	4,305.00	93,418,500
日立造船	13,400	423.00	5,668,200
三菱重工業	27,900	3,934.00	109,758,600
I H I	12,000	2,835.00	34,020,000
スター精密	2,500	1,396.00	3,490,000
日清紡ホールディングス	11,100	1,015.00	11,266,500
イビデン	10,200	2,811.00	28,672,200
コニカミノルタ	36,600	676.00	24,741,600
ブラザー工業	20,400	2,233.00	45,553,200
ミネベアミツミ	30,900	2,220.00	68,598,000
日立製作所	80,100	4,265.00	341,626,500
三菱電機	166,700	1,604.50	267,470,150
富士電機	10,000	3,510.00	35,100,000
東洋電機製造	600	1,481.00	888,600
安川電機	18,000	3,925.00	70,650,000
シンフォニアテクノロジー	2,200	1,255.00	2,761,000
明電舎	3,100	2,081.00	6,451,100
オリジン	500	1,534.00	767,000
山洋電気	800	5,450.00	4,360,000
デンヨー	1,400	2,180.00	3,052,000
東芝テック	2,100	4,350.00	9,135,000
芝浦メカトロニクス	300	3,645.00	1,093,500

マブチモーター	4,600	3,880.00	17,848,000
日本電産	20,100	14,540.00	292,254,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	415.00	415,000
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,493.00	1,493,000
東光高岳	1,000	1,182.00	1,182,000
ダブル・スコープ	2,700	787.00	2,124,900
ダイヘン	1,800	3,530.00	6,354,000
ヤーマン	2,700	676.00	1,825,200
JVCケンウッド	14,000	254.00	3,556,000
ミマキエンジニアリング	1,600	523.00	836,800
第一精工	600	2,599.00	1,559,400
日新電機	3,900	1,191.00	4,644,900
大崎電気工業	3,300	623.00	2,055,900
オムロン	15,000	6,820.00	102,300,000
日東工業	2,400	2,315.00	5,556,000
I D E C	2,400	1,972.00	4,732,800
正興電機製作所	400	1,108.00	443,200
不二電機工業	200	1,248.00	249,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,600	2,228.00	12,476,800
サクサホールディングス	400	1,908.00	763,200
メルコホールディングス	600	2,672.00	1,603,200
テクノメディカ	400	2,054.00	821,600
日本電気	20,200	5,020.00	101,404,000
富士通	16,100	12,695.00	204,389,500
沖電気工業	6,800	1,374.00	9,343,200
岩崎通信機	700	833.00	583,100
電気興業	800	3,525.00	2,820,000
サンケン電気	1,800	2,966.00	5,338,800
ナカヨ	300	1,656.00	496,800
アイホン	1,000	1,734.00	1,734,000
ルネサスエレクトロニクス	79,600	732.00	58,267,200
セイコーエプソン	20,800	1,677.00	34,881,600
ワコム	11,300	399.00	4,508,700
アルバック	3,100	4,110.00	12,741,000
アクセル	700	964.00	674,800
E I Z O	1,300	3,890.00	5,057,000
日本信号	4,300	1,446.00	6,217,800
京三製作所	3,900	615.00	2,398,500
能美防災	2,200	2,495.00	5,489,000
ホーチキ	1,200	1,465.00	1,758,000
星和電機	900	590.00	531,000
エレコム	1,800	4,080.00	7,344,000

パナソニック	190,500	1,233.00	234,886,500
シャープ	19,400	1,526.00	29,604,400
アンリツ	10,800	2,146.00	23,176,800
富士通ゼネラル	4,600	2,497.00	11,486,200
ソニー	105,400	7,717.00	813,371,800
T D K	8,100	12,070.00	97,767,000
帝国通信工業	700	1,241.00	868,700
タムラ製作所	5,600	608.00	3,404,800
アルプスアルパイン	14,800	1,922.00	28,445,600
池上通信機	600	1,100.00	660,000
日本電波工業	1,600	502.00	803,200
鈴木	900	845.00	760,500
日本トリム	200	4,310.00	862,000
ローランド ディー . ジー .	900	2,021.00	1,818,900
フォスター電機	1,800	1,639.00	2,950,200
S M K	400	3,045.00	1,218,000
ヨコオ	1,100	3,230.00	3,553,000
ホシデン	4,600	1,144.00	5,262,400
ヒロセ電機	2,600	13,730.00	35,698,000
日本航空電子工業	3,800	2,035.00	7,733,000
T O A	1,800	1,065.00	1,917,000
マクセルホールディングス	3,600	1,447.00	5,209,200
古野電気	2,200	1,086.00	2,389,200
ユニデンホールディングス	500	2,131.00	1,065,500
スミダコーポレーション	1,300	1,196.00	1,554,800
アイコム	900	2,608.00	2,347,200
リオン	700	3,255.00	2,278,500
本多通信工業	1,500	532.00	798,000
船井電機	1,800	750.00	1,350,000
横河電機	15,300	1,937.00	29,636,100
新電元工業	600	3,580.00	2,148,000
アズビル	10,500	2,983.00	31,321,500
東亜ディーケーケー	900	1,018.00	916,200
日本光電工業	6,900	3,500.00	24,150,000
チノー	600	1,330.00	798,000
共和電業	1,600	447.00	715,200
日本電子材料	700	1,086.00	760,200
堀場製作所	3,300	7,200.00	23,760,000
アドバンテスト	12,400	5,800.00	71,920,000
小野測器	600	607.00	364,200
エスベック	1,500	2,284.00	3,426,000
キーエンス	15,100	38,700.00	584,370,000

日置電機	900	4,085.00	3,676,500
シスメックス	11,900	7,933.00	94,402,700
日本マイクロニクス	2,900	1,293.00	3,749,700
メガチップス	1,600	1,873.00	2,996,800
O B A R A G R O U P	900	3,635.00	3,271,500
澤藤電機	200	2,068.00	413,600
原田工業	800	992.00	793,600
コーセル	2,200	1,180.00	2,596,000
イリソ電子工業	1,400	4,230.00	5,922,000
オブテックスグループ	2,700	1,479.00	3,993,300
千代田インテグレ	800	2,144.00	1,715,200
アイ・オー・データ機器	600	1,024.00	614,400
レーザーテック	7,300	5,800.00	42,340,000
スタンレー電気	11,700	2,958.00	34,608,600
岩崎電気	700	1,645.00	1,151,500
ウシオ電機	9,700	1,528.00	14,821,600
岡谷電機産業	1,400	376.00	526,400
ヘリオス テクノ ホールディング	1,600	429.00	686,400
エノモト	500	1,288.00	644,000
日本セラミック	1,700	2,462.00	4,185,400
遠藤照明	800	705.00	564,000
古河電池	1,200	731.00	877,200
双信電機	900	430.00	387,000
山一電機	1,200	1,909.00	2,290,800
図研	1,100	2,659.00	2,924,900
日本電子	3,300	3,550.00	11,715,000
カシオ計算機	14,800	2,099.00	31,065,200
ファナック	15,800	20,900.00	330,220,000
日本シイエムケイ	3,900	567.00	2,211,300
エンプラス	900	3,040.00	2,736,000
大真空	600	1,673.00	1,003,800
ローム	7,400	8,630.00	63,862,000
浜松ホトニクス	12,000	4,670.00	56,040,000
三井ハイテック	1,900	1,660.00	3,154,000
新光電気工業	5,600	1,373.00	7,688,800
京セラ	23,400	7,396.00	173,066,400
太陽誘電	7,400	3,500.00	25,900,000
村田製作所	49,000	6,624.00	324,576,000
双葉電子工業	2,700	1,290.00	3,483,000
北陸電気工業	700	1,173.00	821,100
ニチコン	5,700	939.00	5,352,300
日本ケミコン	1,300	1,778.00	2,311,400



K O A	2,500	1,243.00	3,107,500	
市光工業	2,500	673.00	1,682,500	
小糸製作所	10,000	4,725.00	47,250,000	
ミツバ	3,200	774.00	2,476,800	
S C R E E Nホールディングス	2,900	6,720.00	19,488,000	
キャノン電子	1,700	2,024.00	3,440,800	
キャノン	89,700	2,841.00	254,837,700	
リコー	42,600	1,196.00	50,949,600	
象印マホービン	4,900	2,242.00	10,985,800	
M U T O Hホールディングス	300	1,730.00	519,000	
東京エレクトロン	11,100	25,175.00	279,442,500	
トヨタ紡織	4,900	1,636.00	8,016,400	
芦森工業	400	1,364.00	545,600	
ユニプレス	3,300	1,429.00	4,715,700	
豊田自動織機	13,500	6,200.00	83,700,000	
モリタホールディングス	2,900	1,760.00	5,104,000	
三櫻工業	2,200	1,056.00	2,323,200	
デンソー	36,700	4,463.00	163,792,100	
東海理化電機製作所	4,400	1,872.00	8,236,800	
三井E & Sホールディングス	6,200	969.00	6,007,800	
川崎重工業	13,000	2,261.00	29,393,000	
名村造船所	5,500	249.00	1,369,500	
サノヤスホールディングス	2,100	176.00	369,600	
日本車輛製造	600	2,990.00	1,794,000	
三菱ロジスネクスト	2,200	1,692.00	3,722,400	
近畿車輛	300	1,474.00	442,200	
日産自動車	196,500	577.40	113,459,100	
いすゞ自動車	48,300	1,130.00	54,579,000	
トヨタ自動車	186,000	7,794.00	1,449,684,000	代用有価証券 23,000株
日野自動車	20,800	1,041.00	21,652,800	
三菱自動車工業	61,700	424.00	26,160,800	
エフテック	1,200	715.00	858,000	
レシップホールディングス	700	668.00	467,600	
G M B	300	807.00	242,100	
ファルテック	300	1,042.00	312,600	
武蔵精密工業	3,700	1,394.00	5,157,800	
日産車体	3,300	1,052.00	3,471,600	
新明和工業	4,500	1,321.00	5,944,500	
極東開発工業	3,100	1,419.00	4,398,900	
日信工業	3,400	2,240.00	7,616,000	
トピー工業	1,400	1,756.00	2,458,400	
ティラド	600	1,802.00	1,081,200	

タチエス	2,800	1,340.00	3,752,000
N O K	9,000	1,546.00	13,914,000
フタバ産業	4,700	640.00	3,008,000
K Y B	1,900	3,055.00	5,804,500
大同メタル工業	3,200	673.00	2,153,600
プレス工業	8,300	359.00	2,979,700
ミクニ	2,200	328.00	721,600
太平洋工業	3,500	1,324.00	4,634,000
ケーヒン	3,900	2,584.00	10,077,600
河西工業	2,300	781.00	1,796,300
アイシン精機	13,700	3,690.00	50,553,000
マツダ	49,200	898.00	44,181,600
今仙電機製作所	1,500	868.00	1,302,000
本田技研工業	131,200	2,958.00	388,089,600
スズキ	33,000	4,989.00	164,637,000
S U B A R U	51,700	2,840.50	146,853,850
安永	800	1,200.00	960,000
ヤマハ発動機	21,700	2,052.00	44,528,400
ショーワ	4,000	2,286.00	9,144,000
T B K	1,900	460.00	874,000
エクセディ	2,300	2,270.00	5,221,000
豊田合成	5,400	2,453.00	13,246,200
愛三工業	2,700	694.00	1,873,800
盟和産業	300	1,091.00	327,300
日本プラスト	1,400	673.00	942,200
ヨロズ	1,600	1,408.00	2,252,800
エフ・シー・シー	2,700	2,204.00	5,950,800
シマノ	6,300	17,730.00	111,699,000
テイ・エス テック	3,900	3,080.00	12,012,000
ジャムコ	900	1,405.00	1,264,500
テルモ	47,200	3,908.00	184,457,600
クリエートメディック	500	1,108.00	554,000
日機装	5,000	1,324.00	6,620,000
日本エム・ディ・エム	1,000	2,011.00	2,011,000
島津製作所	19,900	2,984.00	59,381,600
J M S	1,400	919.00	1,286,600
長野計器	1,200	938.00	1,125,600
ブイ・テクノロジー	800	4,800.00	3,840,000
東京計器	1,100	1,000.00	1,100,000
愛知時計電機	200	4,285.00	857,000
インターアクション	900	2,749.00	2,474,100
オーバル	1,500	245.00	367,500

東京精密	3,000	4,060.00	12,180,000
マニー	6,600	2,838.00	18,730,800
ニコン	27,000	1,243.00	33,561,000
トプコン	8,400	1,308.00	10,987,200
オリンパス	92,300	2,051.50	189,353,450
理研計器	1,500	2,300.00	3,450,000
タムロン	1,400	2,652.00	3,712,800
H O Y A	33,300	10,245.00	341,158,500
シード	700	997.00	697,900
ノーリツ鋼機	1,200	1,547.00	1,856,400
エー・アンド・デイ	1,600	1,013.00	1,620,800
朝日インテック	14,200	3,090.00	43,878,000
シチズン時計	19,700	544.00	10,716,800
リズム時計工業	600	900.00	540,000
大研医器	1,200	680.00	816,000
メニコン	2,300	5,180.00	11,914,000
シンシア	200	693.00	138,600
松風	800	1,950.00	1,560,000
セイコーホールディングス	2,400	2,648.00	6,355,200
ニプロ	11,500	1,288.00	14,812,000
中本パックス	400	1,654.00	661,600
スノーピーク	800	1,071.00	856,800
パラマウントベッドホールディングス	1,700	4,565.00	7,760,500
トランザクション	1,100	1,136.00	1,249,600
粧美堂	500	396.00	198,000
ニホンフラッシュ	800	2,718.00	2,174,400
前田工織	1,800	2,252.00	4,053,600
永大産業	2,300	335.00	770,500
アートネイチャー	1,800	728.00	1,310,400
バンダイナムコホールディングス	17,200	5,972.00	102,718,400
アイフィスジャパン	500	730.00	365,000
共立印刷	2,900	168.00	487,200
S H O E I	800	5,360.00	4,288,000
フランスベッドホールディングス	2,400	933.00	2,239,200
パイロットコーポレーション	2,700	4,295.00	11,596,500
萩原工業	900	1,641.00	1,476,900
トッパン・フォームズ	3,600	1,203.00	4,330,800
フジシールインターナショナル	3,700	2,183.00	8,077,100
タカラトミー	7,500	1,163.00	8,722,500
廣済堂	1,200	1,005.00	1,206,000
エステールホールディングス	500	691.00	345,500
アーケ	6,600	91.00	600,600

タカノ	600	776.00	465,600
プロネクサス	1,400	1,186.00	1,660,400
ホクシン	1,100	153.00	168,300
ウッドワン	600	1,127.00	676,200
大建工業	1,100	1,970.00	2,167,000
凸版印刷	23,500	2,209.00	51,911,500
大日本印刷	21,800	3,025.00	65,945,000
共同印刷	500	2,847.00	1,423,500
N I S S H A	3,500	1,042.00	3,647,000
光村印刷	200	1,659.00	331,800
TAKARA & COMPANY	800	1,707.00	1,365,600
アシックス	13,800	1,453.00	20,051,400
ツツミ	600	2,117.00	1,270,200
小松ウオール工業	500	2,150.00	1,075,000
ヤマハ	9,900	5,810.00	57,519,000
河合楽器製作所	500	3,355.00	1,677,500
クリナップ	1,600	670.00	1,072,000
ピジョン	10,100	3,815.00	38,531,500
オリバー	400	3,880.00	1,552,000
兼松サステック	100	1,856.00	185,600
キングジム	1,400	879.00	1,230,600
リンテック	3,900	2,594.00	10,116,600
イトーキ	3,600	481.00	1,731,600
任天堂	10,200	40,560.00	413,712,000
三菱鉛筆	2,700	1,652.00	4,460,400
タカラスタンダード	3,400	1,808.00	6,147,200
コクヨ	8,000	1,627.00	13,016,000
ナカバヤシ	1,600	614.00	982,400
オカムラ	5,800	1,073.00	6,223,400
美津濃	1,500	2,595.00	3,892,500
東京電力ホールディングス	133,100	441.00	58,697,100
中部電力	50,900	1,529.00	77,826,100
関西電力	63,200	1,278.00	80,769,600
中国電力	23,000	1,470.00	33,810,000
北陸電力	15,300	888.00	13,586,400
東北電力	41,600	1,035.00	43,056,000
四国電力	15,000	898.00	13,470,000
九州電力	34,400	889.00	30,581,600
北海道電力	15,700	511.00	8,022,700
沖縄電力	3,100	2,028.00	6,286,800
電源開発	13,300	2,524.00	33,569,200
エフオン	800	767.00	613,600

イーレックス	2,400	1,593.00	3,823,200
レノバ	2,800	1,140.00	3,192,000
東京瓦斯	32,000	2,418.00	77,376,000
大阪瓦斯	32,300	1,884.00	60,853,200
東邦瓦斯	8,200	4,140.00	33,948,000
北海道瓦斯	900	1,608.00	1,447,200
広島ガス	3,300	357.00	1,178,100
西部瓦斯	1,900	2,419.00	4,596,100
静岡ガス	4,700	951.00	4,469,700
メタウォーター	800	4,285.00	3,428,000
SBSホールディングス	1,400	2,000.00	2,800,000
東武鉄道	17,600	3,730.00	65,648,000
相鉄ホールディングス	5,300	2,857.00	15,142,100
東急	42,000	1,926.00	80,892,000
京浜急行電鉄	21,500	2,039.00	43,838,500
小田急電鉄	24,800	2,410.00	59,768,000
京王電鉄	8,700	6,100.00	53,070,000
京成電鉄	11,600	4,140.00	48,024,000
富士急行	2,300	3,600.00	8,280,000
東日本旅客鉄道	29,300	9,559.00	280,078,700
西日本旅客鉄道	14,900	9,120.00	135,888,000
東海旅客鉄道	13,900	22,090.00	307,051,000
西武ホールディングス	22,400	1,758.00	39,379,200
鴻池運輸	2,600	1,557.00	4,048,200
西日本鉄道	4,600	2,713.00	12,479,800
ハマキョウレックス	1,300	3,435.00	4,465,500
サカイ引越センター	900	6,260.00	5,634,000
近鉄グループホールディングス	15,800	5,660.00	89,428,000
阪急阪神ホールディングス	21,100	4,235.00	89,358,500
南海電気鉄道	7,500	2,809.00	21,067,500
京阪ホールディングス	7,000	4,905.00	34,335,000
神戸電鉄	400	3,970.00	1,588,000
名古屋鉄道	13,000	3,225.00	41,925,000
山陽電気鉄道	1,200	2,121.00	2,545,200
日本通運	5,600	6,020.00	33,712,000
ヤマトホールディングス	27,700	1,968.00	54,513,600
山九	4,400	5,430.00	23,892,000
丸運	500	316.00	158,000
丸全昭和運輸	1,300	2,862.00	3,720,600
センコーグループホールディングス	8,600	891.00	7,662,600
トナミホールディングス	400	5,030.00	2,012,000
ニッコンホールディングス	5,600	2,513.00	14,072,800

日本石油輸送	200	3,075.00	615,000
福山通運	2,000	3,760.00	7,520,000
セイノーホールディングス	11,800	1,441.00	17,003,800
エスライン	400	1,032.00	412,800
神奈川中央交通	400	4,010.00	1,604,000
日立物流	2,900	3,240.00	9,396,000
丸和運輸機関	1,700	2,293.00	3,898,100
C & F ロジホールディングス	1,600	1,296.00	2,073,600
九州旅客鉄道	14,100	3,630.00	51,183,000
S Gホールディングス	16,500	2,363.00	38,989,500
日本郵船	13,200	1,764.00	23,284,800
商船三井	10,000	2,567.00	25,670,000
川崎汽船	4,900	1,475.00	7,227,500
N S ユナイテッド海運	900	1,971.00	1,773,900
明治海運	1,700	356.00	605,200
飯野海運	7,700	367.00	2,825,900
共栄タンカー	300	940.00	282,000
乾汽船	1,000	1,239.00	1,239,000
日本航空	28,400	3,087.00	87,670,800
A N Aホールディングス	28,900	3,412.00	98,606,800
パスコ	300	2,184.00	655,200
トランコム	400	8,130.00	3,252,000
日新	1,300	1,694.00	2,202,200
三菱倉庫	5,000	2,913.00	14,565,000
三井倉庫ホールディングス	1,800	1,836.00	3,304,800
住友倉庫	5,800	1,502.00	8,711,600
澁澤倉庫	900	2,153.00	1,937,700
東陽倉庫	2,800	315.00	882,000
日本トランスシティ	3,500	484.00	1,694,000
ケイヒン	300	1,329.00	398,700
中央倉庫	1,000	1,175.00	1,175,000
川西倉庫	300	1,036.00	310,800
安田倉庫	1,300	1,070.00	1,391,000
ファイズホールディングス	300	645.00	193,500
東洋埠頭	400	1,400.00	560,000
宇徳	1,300	530.00	689,000
上組	9,000	2,386.00	21,474,000
サンリツ	400	684.00	273,600
キムラユニティー	400	1,130.00	452,000
キューソー流通システム	400	1,936.00	774,400
近鉄エクスプレス	3,400	1,918.00	6,521,200
東海運	900	286.00	257,400

エーアイティー	1,100	989.00	1,087,900
内外トランスライン	600	1,210.00	726,000
日本コンセプト	500	1,577.00	788,500
NEC ネットエスアイ	1,600	4,235.00	6,776,000
クロスキャット	400	1,193.00	477,200
システナ	5,800	1,679.00	9,738,200
デジタルアーツ	800	5,690.00	4,552,000
日鉄ソリューションズ	2,400	3,250.00	7,800,000
キューブシステム	900	767.00	690,300
エイジア	300	1,604.00	481,200
コア	700	1,397.00	977,900
ソリトンシステムズ	700	1,288.00	901,600
ソフトクリエイトホールディングス	700	1,778.00	1,244,600
T I S	5,400	7,150.00	38,610,000
ネオス	700	712.00	498,400
電算システム	600	2,744.00	1,646,400
グリー	10,000	476.00	4,760,000
コーエーテクモホールディングス	3,300	3,120.00	10,296,000
三菱総合研究所	700	4,390.00	3,073,000
ボルテージ	300	511.00	153,300
電算	200	2,226.00	445,200
A G S	900	813.00	731,700
ファインデックス	1,400	1,258.00	1,761,200
ブレインパッド	400	5,290.00	2,116,000
K L a b	3,200	792.00	2,534,400
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,000	985.00	1,970,000
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,688.00	506,400
ネクソン	46,600	1,691.00	78,800,600
アイスタイル	4,600	370.00	1,702,000
エムアップ	500	3,020.00	1,510,000
エイチーム	1,200	943.00	1,131,600
エニグモ	1,200	898.00	1,077,600
テクノスジャパン	1,300	510.00	663,000
e n i s h	800	556.00	444,800
コロブラ	5,400	967.00	5,221,800
ブロードリーフ	8,200	621.00	5,092,200
クロス・マーケティンググループ	800	357.00	285,600
デジタルハーツホールディングス	900	973.00	875,700
システム情報	900	1,007.00	906,300
メディアドゥホールディングス	500	3,210.00	1,605,000
じげん	4,100	504.00	2,066,400
バイキューブ	1,100	675.00	742,500

エンカレッジ・テクノロジー	300	915.00	274,500
サイバーリンクス	300	1,127.00	338,100
フィックスターズ	1,800	1,481.00	2,665,800
CARTA HOLDINGS	800	1,088.00	870,400
オブティム	400	4,650.00	1,860,000
セレス	600	1,207.00	724,200
SHIFT	400	8,030.00	3,212,000
ティーガイア	1,400	2,497.00	3,495,800
セック	300	3,920.00	1,176,000
日本アジアグループ	1,800	371.00	667,800
豆蔵ホールディングス	1,100	1,881.00	2,069,100
テクマトリックス	1,200	2,928.00	3,513,600
プロシップ	500	1,354.00	677,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	2,026.00	8,104,000
GMOペイメントゲートウェイ	2,700	7,240.00	19,548,000
ザッパラス	900	386.00	347,400
システムリサーチ	500	2,076.00	1,038,000
インターネットイニシアティブ	2,400	3,400.00	8,160,000
さくらインターネット	1,800	652.00	1,173,600
ヴィンクス	500	1,143.00	571,500
GMOクラウド	300	2,583.00	774,900
SRAホールディングス	800	2,740.00	2,192,000
システムインテグレータ	600	942.00	565,200
朝日ネット	1,200	688.00	825,600
eBASE	1,000	1,807.00	1,807,000
アバント	1,200	1,027.00	1,232,400
アドソル日進	600	2,584.00	1,550,400
フリービット	800	857.00	685,600
コムチュア	1,800	2,456.00	4,420,800
サイバーコム	300	2,141.00	642,300
アステリア	1,000	589.00	589,000
アイル	600	1,988.00	1,192,800
マークライنز	800	2,033.00	1,626,400
メディカル・データ・ビジョン	1,300	1,008.00	1,310,400
gumi	2,200	736.00	1,619,200
ショーケース	400	709.00	283,600
モバイルファクトリー	400	1,741.00	696,400
テラスカイ	600	3,440.00	2,064,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,703.00	1,021,800
PCIホールディングス	300	2,422.00	726,600
パイブドHD	200	1,842.00	368,400
アイビーシー	300	1,478.00	443,400



ネオジャパン	300	1,301.00	390,300
P R T I M E S	200	2,636.00	527,200
ランドコンピュータ	200	1,200.00	240,000
ダブルスタンダード	200	4,300.00	860,000
オープンドア	800	1,353.00	1,082,400
マイネット	600	725.00	435,000
アカツキ	600	4,895.00	2,937,000
ベネフィットジャパン	100	1,856.00	185,600
U b i c o mホールディングス	400	1,496.00	598,400
L I N E	3,700	5,370.00	19,869,000
カナミックネットワーク	1,000	706.00	706,000
ノムラシステムコーポレーション	400	543.00	217,200
チェンジ	400	3,750.00	1,500,000
シンクロ・フード	700	558.00	390,600
オークネット	1,000	1,248.00	1,248,000
セグエグループ	300	912.00	273,600
エイトレッド	200	1,414.00	282,800
A O I T Y O H o l d i n g s	1,700	710.00	1,207,000
マクロミル	3,300	987.00	3,257,100
ビーグリー	300	1,291.00	387,300
オロ	500	3,430.00	1,715,000
ユーザーローカル	100	3,115.00	311,500
ニーズウェル	200	784.00	156,800
サインポスト	300	2,018.00	605,400
ソルクシーズ	700	910.00	637,000
フェイス	600	793.00	475,800
プロトコーポレーション	1,500	1,414.00	2,121,000
ハイマックス	200	1,972.00	394,400
野村総合研究所	23,200	2,718.00	63,057,600
サイバネットシステム	1,200	826.00	991,200
C Eホールディングス	1,000	502.00	502,000
日本システム技術	300	1,372.00	411,600
インテージホールディングス	2,000	894.00	1,788,000
東邦システムサイエンス	400	904.00	361,600
ソースネクスト	7,900	501.00	3,957,900
インフォコム	1,800	3,010.00	5,418,000
H E R O Z	200	5,240.00	1,048,000
ラクスル	900	3,800.00	3,420,000
F I G	1,800	290.00	522,000
システムサポート	200	2,735.00	547,000
イーソル	600	2,321.00	1,392,600
アルテリア・ネットワークス	1,800	1,941.00	3,493,800

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,671.00	668,400
フォーカスシステムズ	1,000	964.00	964,000
クレスコ	1,000	1,902.00	1,902,000
フジ・メディア・ホールディングス	15,700	1,506.00	23,644,200
オービック	5,700	15,260.00	86,982,000
ジャストシステム	2,700	5,790.00	15,633,000
TDCソフト	1,400	985.00	1,379,000
Zホールディングス	224,600	450.00	101,070,000
トレンドマイクロ	7,300	5,980.00	43,654,000
IDホールディングス	600	1,581.00	948,600
日本オラクル	3,300	9,600.00	31,680,000
アルファシステムズ	500	2,950.00	1,475,000
フューチャー	2,000	1,867.00	3,734,000
CAC Holdings	1,100	1,489.00	1,637,900
S Bテクノロジー	600	2,433.00	1,459,800
トーセ	500	930.00	465,000
オービックビジネスコンサルタント	1,700	4,205.00	7,148,500
伊藤忠テクノソリューションズ	7,400	3,355.00	24,827,000
アイティフォー	2,000	788.00	1,576,000
東計電算	200	4,160.00	832,000
エクスネット	200	952.00	190,400
大塚商会	8,800	5,200.00	45,760,000
サイボウズ	1,900	2,003.00	3,805,700
ソフトブレーン	1,000	544.00	544,000
電通国際情報サービス	1,000	5,120.00	5,120,000
デジタルガレージ	2,900	4,430.00	12,847,000
EMシステムズ	2,300	929.00	2,136,700
ウェザーニューズ	600	3,905.00	2,343,000
C I J	1,200	858.00	1,029,600
ビジネスエンジニアリング	200	3,350.00	670,000
日本エンタープライズ	1,700	272.00	462,400
WOWOW	800	2,734.00	2,187,200
スカラ	1,200	751.00	901,200
インテリジェント ウェイブ	700	769.00	538,300
I M A G I C A G R O U P	1,400	490.00	686,000
ネットワンシステムズ	6,200	1,998.00	12,387,600
システムソフト	4,000	97.00	388,000
アルゴグラフィックス	1,400	3,875.00	5,425,000
マーベラス	2,500	698.00	1,745,000
エイベックス	2,800	1,331.00	3,726,800
日本ユニシス	5,100	3,810.00	19,431,000
兼松エレクトロニクス	900	3,540.00	3,186,000

東京放送ホールディングス	9,900	2,030.00	20,097,000
日本テレビホールディングス	13,600	1,516.00	20,617,600
朝日放送グループホールディングス	1,500	733.00	1,099,500
テレビ朝日ホールディングス	4,500	2,138.00	9,621,000
スカパーJ S A Tホールディングス	10,500	474.00	4,977,000
テレビ東京ホールディングス	1,300	2,418.00	3,143,400
日本BS放送	500	1,243.00	621,500
ビジョン	1,500	1,398.00	2,097,000
スマートバリュー	500	813.00	406,500
USEN-NEXT HOLDINGS	700	1,772.00	1,240,400
コネクシオ	1,000	1,573.00	1,573,000
クロップス	300	793.00	237,900
日本電信電話	218,800	2,820.50	617,125,400
KDDI	122,000	3,440.00	419,680,000
ソフトバンク	148,900	1,505.00	224,094,500
光通信	1,700	26,700.00	45,390,000
NTTドコモ	121,000	3,140.00	379,940,000
エムティーアイ	1,600	697.00	1,115,200
GMOインターネット	6,400	2,179.00	13,945,600
ファイバーゲート	400	1,295.00	518,000
アйдママーケティングコミュニケーション	500	590.00	295,000
KADOKAWA	4,400	1,829.00	8,047,600
学研ホールディングス	600	6,980.00	4,188,000
ゼンリン	3,300	1,569.00	5,177,700
昭文社	800	371.00	296,800
インプレスホールディングス	1,400	177.00	247,800
アイネット	800	1,566.00	1,252,800
松竹	1,100	15,080.00	16,588,000
東宝	9,800	4,145.00	40,621,000
東映	600	15,460.00	9,276,000
エヌ・ティ・ティ・データ	43,500	1,438.00	62,553,000
ピー・シー・エー	200	4,340.00	868,000
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,885.00	865,500
DTS	3,600	2,285.00	8,226,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,000	5,000.00	35,000,000
シーイーシー	1,700	2,126.00	3,614,200
カブコン	7,700	3,275.00	25,217,500
アイ・エス・ビー	300	1,983.00	594,900
ジャステック	1,000	1,064.00	1,064,000
SCSK	3,800	6,140.00	23,332,000
日本システムウエア	500	2,483.00	1,241,500
アイネス	1,600	1,780.00	2,848,000

T K C	1,400	5,470.00	7,658,000
富士ソフト	2,100	4,495.00	9,439,500
N S D	5,300	1,889.00	10,011,700
コナミホールディングス	5,900	4,290.00	25,311,000
福井コンピュータホールディングス	600	3,140.00	1,884,000
J B C Cホールディングス	1,100	2,027.00	2,229,700
ミロク情報サービス	1,400	2,818.00	3,945,200
ソフトバンクグループ	129,800	5,751.00	746,479,800
ハウスイ	200	923.00	184,600
高千穂交易	600	1,161.00	696,600
伊藤忠食品	400	5,100.00	2,040,000
エレマテック	1,500	1,023.00	1,534,500
J A L U X	500	2,330.00	1,165,000
あらた	1,300	4,605.00	5,986,500
トーメンデバイス	200	4,015.00	803,000
東京エレクトロン デバイス	600	2,639.00	1,583,400
フィールズ	1,300	548.00	712,400
双日	90,900	349.00	31,724,100
アルフレッサ ホールディングス	18,200	2,152.00	39,166,400
横浜冷凍	4,600	966.00	4,443,600
神栄	300	786.00	235,800
ラサ商事	900	931.00	837,900
ラクーンホールディングス	800	827.00	661,600
アルコニックス	1,800	1,323.00	2,381,400
神戸物産	5,700	4,570.00	26,049,000
あい ホールディングス	2,400	1,855.00	4,452,000
ディーブイエックス	600	945.00	567,000
ダイワボウホールディングス	1,400	6,200.00	8,680,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,900	1,782.00	6,949,800
ラクト・ジャパン	600	4,465.00	2,679,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,100	1,046.00	3,242,600
八洲電機	1,300	906.00	1,177,800
メディアスホールディングス	900	806.00	725,400
レスターホールディングス	1,700	1,901.00	3,231,700
ジューテックホールディングス	400	1,169.00	467,600
大光	700	670.00	469,000
O C H Iホールディングス	500	1,462.00	731,000
T O K A Iホールディングス	8,600	1,007.00	8,660,200
黒谷	400	501.00	200,400
C o m i n i x	300	824.00	247,200
三洋貿易	1,600	1,240.00	1,984,000
ビューティガレージ	300	2,122.00	636,600

ウイン・パートナーズ	1,200	1,116.00	1,339,200
ミタチ産業	400	720.00	288,000
シップヘルスケアホールディングス	2,600	4,955.00	12,883,000
明治電機工業	500	1,511.00	755,500
デリカフーズホールディングス	600	710.00	426,000
スターティアホールディングス	400	788.00	315,200
コメダホールディングス	3,600	2,205.00	7,938,000
ピーバンドットコム	100	1,163.00	116,300
アセンテック	200	2,643.00	528,600
富士興産	500	691.00	345,500
協栄産業	200	1,440.00	288,000
小野建	1,500	1,340.00	2,010,000
南陽	400	1,842.00	736,800
佐島電機	1,200	884.00	1,060,800
エコートレーディング	400	579.00	231,600
伯東	1,000	1,283.00	1,283,000
コンドーテック	1,300	1,163.00	1,511,900
中山福	1,000	520.00	520,000
ナガイレーベン	2,400	2,336.00	5,606,400
三菱食品	1,800	3,150.00	5,670,000
松田産業	1,200	1,561.00	1,873,200
第一興商	2,400	5,060.00	12,144,000
メディバルホールディングス	17,700	2,321.00	41,081,700
S P K	400	2,721.00	1,088,400
萩原電気ホールディングス	600	2,530.00	1,518,000
アズワン	1,100	9,450.00	10,395,000
スズデン	600	1,430.00	858,000
シモジマ	1,000	1,145.00	1,145,000
ドウシシャ	1,600	1,668.00	2,668,800
小津産業	400	1,821.00	728,400
高速	1,000	1,235.00	1,235,000
たけびし	600	1,475.00	885,000
リックス	400	1,692.00	676,800
丸文	1,400	641.00	897,400
ハピネット	1,400	1,347.00	1,885,800
橋本総業ホールディングス	400	1,773.00	709,200
日本ライフライン	4,800	1,451.00	6,964,800
タカショー	800	466.00	372,800
エクセル	500	1,597.00	798,500
マルカ	600	2,147.00	1,288,200
I D O M	4,500	590.00	2,655,000
進和	900	2,245.00	2,020,500

エスケイジャパン	400	440.00	176,000	
ダイترون	700	1,997.00	1,397,900	
シークス	2,100	1,280.00	2,688,000	
田中商事	500	730.00	365,000	
オーハシテクニカ	900	1,589.00	1,430,100	
白銅	600	1,516.00	909,600	
伊藤忠商事	114,800	2,619.00	300,661,200	
丸紅	170,900	792.40	135,421,160	
高島	200	1,953.00	390,600	
長瀬産業	9,200	1,500.00	13,800,000	
蝶理	1,000	2,230.00	2,230,000	
豊田通商	18,300	3,765.00	68,899,500	
三共生興	2,500	581.00	1,452,500	
兼松	6,100	1,337.00	8,155,700	
ツカモトコーポレーション	300	1,163.00	348,900	
三井物産	144,200	1,952.00	281,478,400	
日本紙パルプ商事	900	4,015.00	3,613,500	
日立ハイテク	5,700	8,030.00	45,771,000	
カメイ	2,100	1,168.00	2,452,800	
東都水産	200	2,937.00	587,400	
OUGホールディングス	300	2,636.00	790,800	
スターゼン	600	4,445.00	2,667,000	
山善	6,400	1,024.00	6,553,600	
椿本興業	300	4,150.00	1,245,000	
住友商事	103,600	1,687.50	174,825,000	
内田洋行	700	6,820.00	4,774,000	
三菱商事	115,200	2,889.00	332,812,800	
第一実業	800	3,640.00	2,912,000	
キャノンマーケティングジャパン	4,700	2,781.00	13,070,700	
西華産業	900	1,347.00	1,212,300	
佐藤商事	1,300	941.00	1,223,300	
菱洋エレクトロ	1,700	1,899.00	3,228,300	
東京産業	1,500	611.00	916,500	
ユアサ商事	1,500	3,470.00	5,205,000	
神鋼商事	400	2,452.00	980,800	
小林産業	1,000	285.00	285,000	
阪和興業	3,100	2,527.00	7,833,700	
正栄食品工業	1,100	3,850.00	4,235,000	
カナデン	1,300	1,328.00	1,726,400	
菱電商事	1,200	1,678.00	2,013,600	
フルサト工業	900	1,728.00	1,555,200	
岩谷産業	3,700	3,635.00	13,449,500	

すてきナイスグループ	700	1,263.00	884,100
昭光通商	600	710.00	426,000
ニチモウ	300	2,004.00	601,200
極東貿易	500	2,033.00	1,016,500
イワキ	2,200	519.00	1,141,800
三愛石油	4,000	1,164.00	4,656,000
稲畑産業	3,600	1,518.00	5,464,800
G S Iクレオス	400	1,235.00	494,000
明和産業	1,600	554.00	886,400
クワザワ	600	665.00	399,000
ワキタ	3,500	1,037.00	3,629,500
東邦ホールディングス	5,300	2,259.00	11,972,700
サンゲツ	4,500	1,874.00	8,433,000
ミツウロコグループホールディングス	2,400	1,173.00	2,815,200
シナネンホールディングス	700	2,151.00	1,505,700
伊藤忠エネクス	3,500	947.00	3,314,500
サンリオ	4,700	2,220.00	10,434,000
サンワテクノス	1,200	926.00	1,111,200
リョーサン	1,800	2,491.00	4,483,800
新光商事	2,500	845.00	2,112,500
トーヨー	800	1,806.00	1,444,800
三信電気	900	1,692.00	1,522,800
東陽テクニカ	1,900	1,081.00	2,053,900
モスフードサービス	2,200	3,030.00	6,666,000
加賀電子	1,600	2,405.00	3,848,000
ソーダニッカ	1,700	641.00	1,089,700
立花エレテック	1,200	1,784.00	2,140,800
フォーバル	700	1,126.00	788,200
P A L T A C	2,600	5,240.00	13,624,000
三谷産業	2,100	352.00	739,200
太平洋興発	700	789.00	552,300
西本Wismettacホールディングス	300	3,520.00	1,056,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,342.00	468,400
国際紙パルプ商事	4,000	282.00	1,128,000
ヤマタネ	900	1,524.00	1,371,600
丸紅建材リース	200	1,914.00	382,800
日鉄物産	1,100	4,700.00	5,170,000
泉州電業	500	3,020.00	1,510,000
トラスコ中山	3,400	2,527.00	8,591,800
オートバックスセブン	6,100	1,600.00	9,760,000
モリト	1,100	793.00	872,300
加藤産業	2,600	3,470.00	9,022,000

北恵	300	964.00	289,200
イノテック	1,000	1,128.00	1,128,000
イエローハット	3,100	1,736.00	5,381,600
J Kホールディングス	1,500	771.00	1,156,500
日伝	1,500	2,000.00	3,000,000
北沢産業	1,300	274.00	356,200
杉本商事	900	1,959.00	1,763,100
因幡電機産業	4,700	2,706.00	12,718,200
東テク	600	2,681.00	1,608,600
ミスミグループ本社	20,600	2,903.00	59,801,800
アルテック	1,400	303.00	424,200
タキヒヨー	500	1,905.00	952,500
蔵王産業	300	1,481.00	444,300
スズケン	7,000	4,100.00	28,700,000
ジェコス	1,100	1,073.00	1,180,300
グローセル	1,500	456.00	684,000
ローソン	4,200	6,290.00	26,418,000
サンエー	1,300	4,640.00	6,032,000
カワチ薬品	1,300	2,195.00	2,853,500
エービーシー・マート	2,600	7,100.00	18,460,000
ハードオフコーポレーション	600	816.00	489,600
アスクル	1,700	3,535.00	6,009,500
ゲオホールディングス	3,000	1,215.00	3,645,000
アダストリア	2,300	2,156.00	4,958,800
ジーフット	900	628.00	565,200
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	671.00	201,300
くら寿司	900	5,690.00	5,121,000
キャンドウ	800	1,669.00	1,335,200
パルグループホールディングス	900	3,340.00	3,006,000
エディオン	7,500	1,065.00	7,987,500
サーラコーポレーション	3,300	627.00	2,069,100
ワッツ	800	628.00	502,400
ハローズ	600	2,801.00	1,680,600
フジオフードシステム	1,400	1,820.00	2,548,000
あみやき亭	400	3,545.00	1,418,000
ひらまつ	3,100	268.00	830,800
大黒天物産	400	3,560.00	1,424,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,385.00	2,077,500
ファーマライズホールディングス	400	660.00	264,000
アルペン	1,300	1,955.00	2,541,500
ハブ	500	1,051.00	525,500
クオールホールディングス	2,400	1,429.00	3,429,600



ジンズホールディングス	900	7,860.00	7,074,000
ビックカメラ	9,700	1,208.00	11,717,600
D C Mホールディングス	8,800	1,059.00	9,319,200
M o n o t a R O	11,700	2,751.00	32,186,700
東京一番フーズ	400	620.00	248,000
D Dホールディングス	700	1,684.00	1,178,800
きちりホールディングス	500	733.00	366,500
アークランドサービスホールディングス	1,200	2,145.00	2,574,000
J . フロント リテイリング	19,600	1,364.00	26,734,400
ドトール・日レスホールディングス	2,600	2,107.00	5,478,200
マツモトキヨシホールディングス	6,800	4,245.00	28,866,000
ブロンコビリー	900	2,643.00	2,378,700
Z O Z O	11,300	1,792.00	20,249,600
トレジャー・ファクトリー	500	898.00	449,000
物語コーポレーション	400	8,890.00	3,556,000
ココカラファイン	1,700	5,600.00	9,520,000
三越伊勢丹ホールディングス	28,800	852.00	24,537,600
H a m e e	600	1,771.00	1,062,600
ウエルシアホールディングス	4,900	6,370.00	31,213,000
クリエイトSDホールディングス	2,800	2,901.00	8,122,800
丸善C H Iホールディングス	1,700	370.00	629,000
ミサワ	400	673.00	269,200
ティーライフ	200	913.00	182,600
エー・ピーカンパニー	300	629.00	188,700
チムニー	500	2,312.00	1,156,000
シュッピン	1,200	1,034.00	1,240,800
ネクステージ	2,400	1,074.00	2,577,600
ジョイフル本田	4,800	1,319.00	6,331,200
鳥貴族	600	2,668.00	1,600,800
キリン堂ホールディングス	700	1,772.00	1,240,400
ホットランド	1,100	1,307.00	1,437,700
すかいらーくホールディングス	18,400	2,031.00	37,370,400
S F Pホールディングス	700	2,292.00	1,604,400
綿半ホールディングス	600	1,925.00	1,155,000
ヨシックス	300	2,916.00	874,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,700	974.00	4,577,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	657.00	525,600
B E E N O S	600	1,188.00	712,800
あさひ	1,300	1,356.00	1,762,800
日本調剤	500	3,790.00	1,895,000
コスモス薬品	700	24,600.00	17,220,000
トーエル	800	865.00	692,000

オンリー	300	788.00	236,400
セブン&アイ・ホールディングス	64,200	4,333.00	278,178,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,400	2,331.00	10,256,400
ツルハホールディングス	3,600	13,280.00	47,808,000
サンマルクホールディングス	1,300	2,242.00	2,914,600
フェリシモ	400	988.00	395,200
トリドールホールディングス	2,000	2,715.00	5,430,000
T O K Y O B A S E	1,500	500.00	750,000
ウイルプラスホールディングス	300	812.00	243,600
J Mホールディングス	800	2,380.00	1,904,000
サツドラホールディングス	300	1,893.00	567,900
アレンザホールディングス	800	1,008.00	806,400
串カツ田中ホールディングス	300	2,369.00	710,700
パロックジャパンリミテッド	1,100	1,035.00	1,138,500
クスリのアオキホールディングス	1,500	6,820.00	10,230,000
力の源ホールディングス	800	998.00	798,400
スシローグローバルホールディングス	1,800	9,130.00	16,434,000
L I X I L ビバ	1,600	2,415.00	3,864,000
メディカルシステムネットワーク	1,600	495.00	792,000
はるやまホールディングス	700	876.00	613,200
ノジマ	2,900	2,287.00	6,632,300
kappa・クリエイト	2,300	1,481.00	3,406,300
ライトオン	1,300	597.00	776,100
ジーンズメイト	500	300.00	150,000
良品計画	21,800	1,858.00	40,504,400
三城ホールディングス	1,800	325.00	585,000
アドヴァン	2,500	1,273.00	3,182,500
アルビス	600	2,206.00	1,323,600
コナカ	2,000	406.00	812,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,697.00	339,400
G - 7ホールディングス	1,000	2,552.00	2,552,000
イオン北海道	1,400	835.00	1,169,000
コジマ	2,900	513.00	1,487,700
ヒマラヤ	600	831.00	498,600
コーナン商事	2,300	2,453.00	5,641,900
エコス	600	1,716.00	1,029,600
ワタミ	2,000	1,306.00	2,612,000
マルシェ	500	773.00	386,500
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	36,100	1,989.00	71,802,900
西松屋チェーン	3,600	962.00	3,463,200
ゼンショーホールディングス	7,900	2,393.00	18,904,700

幸楽苑ホールディングス	1,100	1,904.00	2,094,400
ハークスレイ	300	1,264.00	379,200
サイゼリヤ	2,700	2,523.00	6,812,100
V Tホールディングス	6,800	444.00	3,019,200
魚力	500	1,606.00	803,000
ポブラ	500	508.00	254,000
フジ・コーポレーション	400	2,105.00	842,000
ユナイテッドアローズ	1,700	2,731.00	4,642,700
ハイデイ日高	2,400	2,002.00	4,804,800
京都きもの友禅	1,100	328.00	360,800
コロワイド	5,500	2,342.00	12,881,000
ピーシーデポコーポレーション	2,200	545.00	1,199,000
壱番屋	1,100	5,820.00	6,402,000
P L A N T	400	560.00	224,000
スギホールディングス	3,300	5,540.00	18,282,000
薬王堂ホールディングス	700	2,248.00	1,573,600
ヴィア・ホールディングス	2,100	667.00	1,400,700
スクロール	2,600	356.00	925,600
ヨンドシーホールディングス	1,700	2,395.00	4,071,500
ファミリーマート	13,100	2,507.00	32,841,700
木曾路	2,100	2,976.00	6,249,600
S R Sホールディングス	1,900	1,050.00	1,995,000
千趣会	3,100	488.00	1,512,800
タカキュー	1,300	186.00	241,800
ケーヨー	3,400	554.00	1,883,600
上新電機	1,900	2,241.00	4,257,900
日本瓦斯	2,600	3,690.00	9,594,000
ロイヤルホールディングス	2,900	2,401.00	6,962,900
東天紅	100	1,267.00	126,700
いなげや	2,000	1,436.00	2,872,000
島忠	3,100	3,170.00	9,827,000
チヨダ	1,700	1,499.00	2,548,300
ライフコーポレーション	1,200	2,689.00	3,226,800
リンガーハット	2,000	2,516.00	5,032,000
M r M a x H D	2,200	480.00	1,056,000
テンアライド	1,600	444.00	710,400
A O K Iホールディングス	3,200	1,001.00	3,203,200
オークワ	2,600	1,490.00	3,874,000
コメリ	2,500	2,320.00	5,800,000
青山商事	3,400	1,362.00	4,630,800
しまむら	1,900	8,150.00	15,485,000
はせがわ	800	399.00	319,200

高島屋	12,000	1,192.00	14,304,000
松屋	3,400	796.00	2,706,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,800	1,000.00	7,800,000
近鉄百貨店	600	3,565.00	2,139,000
パルコ	1,600	1,848.00	2,956,800
丸井グループ	15,000	2,469.00	37,035,000
アクシアル リテイリング	1,300	3,800.00	4,940,000
イオン	63,200	2,303.50	145,581,200
イズミ	3,300	3,475.00	11,467,500
平和堂	3,300	1,952.00	6,441,600
フジ	2,000	1,860.00	3,720,000
ヤオコー	1,800	5,990.00	10,782,000
ゼビオホールディングス	2,000	1,137.00	2,274,000
ケーズホールディングス	15,800	1,388.00	21,930,400
Olympicグループ	900	609.00	548,100
日産東京販売ホールディングス	2,500	278.00	695,000
Genky DrugStores	700	2,037.00	1,425,900
ナルミヤ・インターナショナル	300	1,262.00	378,600
総合メディカルホールディングス	1,400	2,550.00	3,570,000
ブックオフグループホールディングス	1,000	1,007.00	1,007,000
アインホールディングス	2,000	7,060.00	14,120,000
元気寿司	400	3,085.00	1,234,000
ヤマダ電機	50,000	609.00	30,450,000
アークランドサカモト	2,500	1,214.00	3,035,000
ニトリホールディングス	7,100	17,415.00	123,646,500
愛眼	1,400	246.00	344,400
ケーユーホールディングス	800	910.00	728,000
吉野家ホールディングス	5,400	2,577.00	13,915,800
松屋フーズホールディングス	800	4,735.00	3,788,000
サガミホールディングス	2,200	1,377.00	3,029,400
関西スーパーマーケット	1,400	1,021.00	1,429,400
王将フードサービス	1,200	6,540.00	7,848,000
プレナス	1,800	2,009.00	3,616,200
ミニストップ	1,200	1,582.00	1,898,400
アークス	3,300	1,979.00	6,530,700
バローホールディングス	3,600	1,889.00	6,800,400
藤久	200	714.00	142,800
ベルク	800	6,120.00	4,896,000
大庄	900	1,676.00	1,508,400
ファーストリテイリング	2,200	59,180.00	130,196,000
サンドラッグ	6,200	3,455.00	21,421,000
サクスパー ホールディングス	1,400	846.00	1,184,400

ヤマザワ	400	1,685.00	674,000	
やまや	300	2,251.00	675,300	
ベルーナ	3,500	643.00	2,250,500	
島根銀行	400	658.00	263,200	
じもとホールディングス	11,300	104.00	1,175,200	
めぶきフィナンシャルグループ	84,900	248.00	21,055,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,251.00	2,877,300	
九州フィナンシャルグループ	26,900	460.00	12,374,000	
ゆうちょ銀行	46,400	1,038.00	48,163,200	
富山第一銀行	3,800	323.00	1,227,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	96,600	434.00	41,924,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	11,100	704.00	7,814,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	9,500	606.00	5,757,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,592.00	2,388,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,800	2,660.00	7,448,000	
新生銀行	12,100	1,728.00	20,908,800	
あおぞら銀行	9,800	3,090.00	30,282,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,131,400	572.50	647,726,500	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	180,400	467.60	84,355,040	
三井住友トラスト・ホールディングス	31,100	4,087.00	127,105,700	
三井住友フィナンシャルグループ	113,700	3,928.00	446,613,600	代用有価証券 13,000株
千葉銀行	56,500	599.00	33,843,500	
群馬銀行	32,300	360.00	11,628,000	
武蔵野銀行	2,400	1,753.00	4,207,200	
千葉興業銀行	4,600	357.00	1,642,200	
筑波銀行	7,100	209.00	1,483,900	
七十七銀行	5,600	1,653.00	9,256,800	
青森銀行	1,300	2,715.00	3,529,500	
秋田銀行	1,000	2,003.00	2,003,000	
山形銀行	1,900	1,453.00	2,760,700	
岩手銀行	1,100	2,552.00	2,807,200	
東邦銀行	14,700	254.00	3,733,800	
東北銀行	800	1,034.00	827,200	
みちのく銀行	1,100	1,391.00	1,530,100	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,800	1,948.00	26,882,400	
静岡銀行	40,600	777.00	31,546,200	
十六銀行	2,100	2,220.00	4,662,000	
スルガ銀行	17,100	441.00	7,541,100	
八十二銀行	39,700	424.00	16,832,800	
山梨中央銀行	1,900	1,000.00	1,900,000	
大垣共立銀行	3,300	2,313.00	7,632,900	

福井銀行	1,400	1,621.00	2,269,400
北國銀行	1,700	3,185.00	5,414,500
清水銀行	700	2,079.00	1,455,300
富山銀行	300	2,150.00	645,000
滋賀銀行	3,300	2,684.00	8,857,200
南都銀行	2,700	2,595.00	7,006,500
百五銀行	14,700	333.00	4,895,100
京都銀行	5,900	4,455.00	26,284,500
紀陽銀行	5,800	1,590.00	9,222,000
ほくほくフィナンシャルグループ	10,900	1,057.00	11,521,300
広島銀行	24,200	539.00	13,043,800
山陰合同銀行	9,700	627.00	6,081,900
中国銀行	14,200	1,016.00	14,427,200
鳥取銀行	500	1,297.00	648,500
伊予銀行	23,500	568.00	13,348,000
百十四銀行	1,700	2,055.00	3,493,500
四国銀行	2,500	952.00	2,380,000
阿波銀行	2,700	2,410.00	6,507,000
大分銀行	1,000	2,484.00	2,484,000
宮崎銀行	1,100	2,429.00	2,671,900
佐賀銀行	1,000	1,570.00	1,570,000
沖縄銀行	1,500	3,560.00	5,340,000
琉球銀行	3,800	1,094.00	4,157,200
セブン銀行	55,000	319.00	17,545,000
みずほフィナンシャルグループ	2,233,000	162.50	362,862,500
高知銀行	600	831.00	498,600
山口フィナンシャルグループ	20,500	673.00	13,796,500
長野銀行	500	1,530.00	765,000
名古屋銀行	1,300	3,400.00	4,420,000
北洋銀行	24,900	225.00	5,602,500
愛知銀行	600	3,360.00	2,016,000
中京銀行	700	2,230.00	1,561,000
大光銀行	600	1,640.00	984,000
愛媛銀行	2,300	1,119.00	2,573,700
トマト銀行	600	1,042.00	625,200
京葉銀行	6,900	590.00	4,071,000
栃木銀行	8,200	209.00	1,713,800
北日本銀行	500	2,167.00	1,083,500
東和銀行	2,900	794.00	2,302,600
福島銀行	1,600	234.00	374,400
大東銀行	900	628.00	565,200
トモニホールディングス	12,700	366.00	4,648,200

フィデアホールディングス	15,800	125.00	1,975,000
池田泉州ホールディングス	19,200	193.00	3,705,600
F P G	5,100	1,014.00	5,171,400
マーキュリアインベストメント	800	736.00	588,800
S B Iホールディングス	18,400	2,519.00	46,349,600
ジャフコ	2,500	4,960.00	12,400,000
大和証券グループ本社	131,900	570.00	75,183,000
野村ホールディングス	289,300	567.60	164,206,680
岡三証券グループ	14,100	411.00	5,795,100
丸三証券	5,000	532.00	2,660,000
東洋証券	6,100	152.00	927,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,000	347.00	6,593,000
光世証券	400	603.00	241,200
水戸証券	4,900	231.00	1,131,900
いちよし証券	3,000	625.00	1,875,000
松井証券	9,400	906.00	8,516,400
だいこう証券ビジネス	800	680.00	544,000
マネックスグループ	12,700	255.00	3,238,500
極東証券	2,300	776.00	1,784,800
岩井コスモホールディングス	1,500	1,308.00	1,962,000
藍澤證券	2,900	734.00	2,128,600
マネーパートナーズグループ	1,800	235.00	423,000
スパークス・グループ	5,600	283.00	1,584,800
かんぽ生命保険	5,900	1,859.00	10,968,100
S O M P Oホールディングス	30,900	4,237.00	130,923,300
アニコム ホールディングス	1,400	4,190.00	5,866,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	42,900	3,715.00	159,373,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,500	2,583.00	34,870,500
第一生命ホールディングス	93,100	1,766.00	164,414,600
東京海上ホールディングス	58,800	6,137.00	360,855,600
T & Dホールディングス	49,200	1,286.00	63,271,200
アドバンスクリエイト	400	1,825.00	730,000
全国保証	4,600	4,725.00	21,735,000
ジェイリース	500	416.00	208,000
イントラスト	600	824.00	494,400
日本モーゲージサービス	400	2,341.00	936,400
C a s a	600	1,567.00	940,200
アルヒ	2,600	1,719.00	4,469,400
プレミアグループ	900	2,113.00	1,901,700
クレディセゾン	11,500	1,894.00	21,781,000
芙蓉総合リース	1,700	7,070.00	12,019,000
みずほリース	2,500	3,360.00	8,400,000

東京センチュリー	3,300	5,420.00	17,886,000
日本証券金融	7,200	506.00	3,643,200
アイフル	25,500	333.00	8,491,500
リコーリース	1,300	4,330.00	5,629,000
イオンフィナンシャルサービス	10,000	1,814.00	18,140,000
アコム	33,000	540.00	17,820,000
ジャックス	1,800	2,540.00	4,572,000
オリエントコーポレーション	44,700	172.00	7,688,400
日立キャピタル	3,900	3,130.00	12,207,000
アプラスフィナンシャル	8,200	87.00	713,400
オリックス	102,800	1,950.00	200,460,000
三菱UFJリース	41,600	703.00	29,244,800
九州リースサービス	800	624.00	499,200
日本取引所グループ	47,200	2,042.00	96,382,400
イー・ギャランティ	1,800	1,402.00	2,523,600
アサックス	800	723.00	578,400
NECキャピタルソリューション	700	2,494.00	1,745,800
いちご	20,900	407.00	8,506,300
日本駐車場開発	18,200	149.00	2,711,800
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,697.00	1,527,300
ヒューリック	35,100	1,372.00	48,157,200
三栄建築設計	700	1,513.00	1,059,100
野村不動産ホールディングス	10,000	2,836.00	28,360,000
三重交通グループホールディングス	3,400	595.00	2,023,000
サムティ	2,300	1,875.00	4,312,500
ディア・ライフ	2,200	607.00	1,335,400
コーセーアールイー	500	617.00	308,500
エー・ディー・ワークス	31,500	29.00	913,500
日本商業開発	1,000	1,720.00	1,720,000
プレサンスコーポレーション	2,700	1,338.00	3,612,600
ユニゾホールディングス	2,500	5,800.00	14,500,000
THEグローバル社	900	466.00	419,400
ハウスコム	200	1,571.00	314,200
日本管理センター	1,100	1,416.00	1,557,600
サンセイランディック	500	891.00	445,500
エストラスト	300	875.00	262,500
フージャースホールディングス	3,300	704.00	2,323,200
オープンハウス	4,800	2,999.00	14,395,200
東急不動産ホールディングス	44,800	784.00	35,123,200
飯田グループホールディングス	13,700	1,661.00	22,755,700
イーランド	300	847.00	254,100
ムゲンエステート	1,200	696.00	835,200



ビーロット	400	1,828.00	731,200
ファーストブラザーズ	400	1,193.00	477,200
ハウストゥ	800	1,332.00	1,065,600
シーアールイー	400	1,155.00	462,000
プロパティエージェント	300	1,111.00	333,300
ケイアイスター不動産	500	1,786.00	893,000
アグレ都市デザイン	300	520.00	156,000
グッドコムアセット	400	2,061.00	824,400
ジェイ・エス・ビー	200	5,330.00	1,066,000
テンポイノベーション	400	949.00	379,600
グローバル・リンク・マネジメント	300	610.00	183,000
パーク24	8,800	2,760.00	24,288,000
パラカ	400	2,002.00	800,800
三井不動産	81,100	2,917.00	236,568,700
三菱地所	115,200	2,155.00	248,256,000
平和不動産	3,000	3,450.00	10,350,000
東京建物	18,000	1,729.00	31,122,000
ダイビル	4,300	1,432.00	6,157,600
京阪神ビルディング	2,700	1,546.00	4,174,200
住友不動産	37,000	4,222.00	156,214,000
テーオーシー	3,300	950.00	3,135,000
東京楽天地	300	6,010.00	1,803,000
レオパレス21	21,800	380.00	8,284,000
スターツコーポレーション	2,200	2,664.00	5,860,800
フジ住宅	1,900	668.00	1,269,200
空港施設	1,600	543.00	868,800
明和地所	900	644.00	579,600
ゴールドクレスト	1,300	1,923.00	2,499,900
エスリード	600	1,902.00	1,141,200
日神グループホールディングス	2,400	552.00	1,324,800
日本エスコン	3,000	920.00	2,760,000
タカラレーベン	7,600	499.00	3,792,400
A V A N T I A	1,000	990.00	990,000
イオンモール	8,300	1,900.00	15,770,000
毎日コムネット	400	952.00	380,800
ファースト住建	700	1,247.00	872,900
カチタス	2,000	4,520.00	9,040,000
トーセイ	2,300	1,392.00	3,201,600
穴吹興産	400	1,704.00	681,600
サンフロンティア不動産	2,300	1,340.00	3,082,000
エフ・ジェー・ネクスト	1,400	1,147.00	1,605,800
インテリックス	500	712.00	356,000

ランドビジネス	700	735.00	514,500
日本社宅サービス	500	1,048.00	524,000
グランディハウス	1,300	469.00	609,700
日本空港ビルデング	5,200	5,590.00	29,068,000
日本工営	1,100	3,595.00	3,954,500
L I F U L L	5,600	565.00	3,164,000
ジェイエイシーリクルートメント	1,100	1,691.00	1,860,100
日本M&Aセンター	12,000	3,910.00	46,920,000
メンバーズ	500	1,706.00	853,000
中広	200	546.00	109,200
UTグループ	1,900	2,736.00	5,198,400
アイティメディア	500	1,043.00	521,500
タケエイ	1,600	1,063.00	1,700,800
E・Jホールディングス	300	1,720.00	516,000
ビーネックスグループ	2,000	1,106.00	2,212,000
コシダカホールディングス	3,800	1,593.00	6,053,400
アルトナー	400	891.00	356,400
パソナグループ	1,700	1,411.00	2,398,700
C D S	400	1,506.00	602,400
リンクアンドモチベーション	3,600	561.00	2,019,600
G C A	2,000	916.00	1,832,000
エス・エム・エス	5,000	2,347.00	11,735,000
サニーサイドアップグループ	400	1,049.00	419,600
パーソルホールディングス	15,900	2,145.00	34,105,500
リニカル	800	1,106.00	884,800
クックパッド	5,700	324.00	1,846,800
エスクリ	500	806.00	403,000
アイ・ケイ・ケイ	700	740.00	518,000
学情	600	2,415.00	1,449,000
スタジオアリス	800	1,903.00	1,522,400
シミックホールディングス	900	1,676.00	1,508,400
エプコ	300	1,480.00	444,000
N J S	400	1,830.00	732,000
総合警備保障	6,300	5,750.00	36,225,000
カカクコム	11,900	2,966.00	35,295,400
アイロムグループ	600	1,602.00	961,200
セントケア・ホールディング	1,000	475.00	475,000
サイネックス	300	689.00	206,700
ルネサンス	900	1,783.00	1,604,700
ディップ	2,200	3,600.00	7,920,000
オプトホールディング	900	1,644.00	1,479,600
新日本科学	1,800	688.00	1,238,400

ツクイ	3,800	642.00	2,439,600
キャリアデザインセンター	400	1,199.00	479,600
ベネフィット・ワン	4,300	2,044.00	8,789,200
エムスリー	35,100	3,195.00	112,144,500
ツカダ・グローバルホールディング	900	579.00	521,100
プラス	200	776.00	155,200
アウトソーシング	9,100	1,007.00	9,163,700
ウェルネット	1,500	715.00	1,072,500
ワールドホールディングス	500	2,097.00	1,048,500
ディー・エヌ・エー	7,800	1,585.00	12,363,000
博報堂D Yホールディングス	22,100	1,581.00	34,940,100
ぐるなび	2,800	892.00	2,497,600
タカミヤ	1,700	623.00	1,059,100
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	894.00	983,400
ファンコミュニケーションズ	4,400	476.00	2,094,400
ライク	500	1,945.00	972,500
ビジネス・ブレークスルー	700	402.00	281,400
エスプール	3,100	881.00	2,731,100
WDBホールディングス	700	2,714.00	1,899,800
ティア	900	619.00	557,100
C D G	200	1,402.00	280,400
バリューコマース	900	2,697.00	2,427,300
インフォマート	17,500	894.00	15,645,000
J Pホールディングス	5,000	312.00	1,560,000
エコナックホールディングス	3,000	152.00	456,000
E P Sホールディングス	2,400	1,317.00	3,160,800
レグス	400	1,555.00	622,000
プレステージ・インターナショナル	6,000	1,049.00	6,294,000
アミューズ	900	2,801.00	2,520,900
ドリームインキュベータ	500	1,738.00	869,000
クイック	1,000	1,488.00	1,488,000
T A C	1,000	206.00	206,000
ケネディクス	14,800	596.00	8,820,800
電通グループ	16,400	3,615.00	59,286,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	1,156.00	693,600
ぴあ	500	4,480.00	2,240,000
イオンファンタジー	600	2,458.00	1,474,800
シーティーエス	1,800	701.00	1,261,800
ネクシィーズグループ	600	1,642.00	985,200
みらかホールディングス	4,500	2,870.00	12,915,000
アルプス技研	1,400	2,126.00	2,976,400
日本空調サービス	1,700	776.00	1,319,200

オリエンタルランド	16,900	14,580.00	246,402,000
ダスキン	4,100	3,065.00	12,566,500
明光ネットワークジャパン	1,900	937.00	1,780,300
ファルコホールディングス	900	2,038.00	1,834,200
秀英予備校	400	455.00	182,000
田谷	300	617.00	185,100
ラウンドワン	4,500	1,071.00	4,819,500
リゾートトラスト	7,300	1,695.00	12,373,500
ビー・エム・エル	2,000	3,100.00	6,200,000
ワタベウェディング	300	555.00	166,500
りらいあコミュニケーションズ	2,900	1,521.00	4,410,900
リソー教育	7,300	378.00	2,759,400
早稲田アカデミー	500	1,085.00	542,500
ユー・エス・エス	17,800	1,995.00	35,511,000
東京個別指導学院	600	694.00	416,400
サイバーエージェント	9,200	4,365.00	40,158,000
楽天	74,300	874.00	64,938,200
クリーク・アンド・リバー社	800	1,064.00	851,200
テー・オー・ダブリュー	1,300	906.00	1,177,800
山田コンサルティンググループ	800	1,505.00	1,204,000
セントラルスポーツ	600	3,070.00	1,842,000
フルキャストホールディングス	1,600	2,671.00	4,273,600
エン・ジャパン	2,800	4,625.00	12,950,000
リソルホールディングス	200	4,235.00	847,000
テクノプロ・ホールディングス	3,200	7,970.00	25,504,000
アトラ	400	300.00	120,000
インターワークス	300	549.00	164,700
アイ・アールジャパンホールディングス	700	6,290.00	4,403,000
Keeper 技研	600	1,157.00	694,200
ファーストロジック	400	596.00	238,400
三機サービス	400	1,054.00	421,600
Gunosy	1,000	1,239.00	1,239,000
デザインワン・ジャパン	300	305.00	91,500
イー・ガーディアン	800	2,130.00	1,704,000
リブセンス	1,100	287.00	315,700
ジャパンマテリアル	4,900	1,605.00	7,864,500
ベクトル	2,100	1,239.00	2,601,900
ウチヤマホールディングス	800	494.00	395,200
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	985.00	1,379,000
ライクキッズ	400	876.00	350,400
キャリアリンク	600	568.00	340,800
I B J	1,100	1,257.00	1,382,700

アサンテ	600	1,927.00	1,156,200
N・フィールド	1,100	603.00	663,300
バリューHR	300	3,260.00	978,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,100	4,040.00	4,444,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,842.00	1,105,200
E R Iホールディングス	500	790.00	395,000
アビスト	300	2,625.00	787,500
シグマクシス	1,100	1,809.00	1,989,900
ウィルグループ	1,100	1,128.00	1,240,800
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	2,300	216.00	496,800
リクルートホールディングス	114,100	4,525.00	516,302,500
エラン	1,000	1,710.00	1,710,000
土木管理総合試験所	700	448.00	313,600
ネットマーケティング	600	929.00	557,400
日本郵政	130,300	1,011.00	131,733,300
ベルシステム24ホールディングス	2,700	1,576.00	4,255,200
鎌倉新書	1,200	1,744.00	2,092,800
S MN	300	856.00	256,800
一蔵	200	672.00	134,400
L I T A L I C O	500	2,782.00	1,391,000
グローバルキッズCOMPANY	300	791.00	237,300
エアトリ	700	1,593.00	1,115,100
アトラエ	400	3,875.00	1,550,000
ストライク	600	5,320.00	3,192,000
ソラスト	4,400	1,100.00	4,840,000
セラク	500	1,234.00	617,000
インソース	800	3,130.00	2,504,000
ベイカレント・コンサルティング	1,000	8,130.00	8,130,000
Orchestra Holdings	300	1,188.00	356,400
アイモバイル	500	700.00	350,000
キャリアインデックス	700	367.00	256,900
MS - Japan	500	1,315.00	657,500
船場	300	1,021.00	306,300
グレイステクノロジー	700	3,215.00	2,250,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,700	2,273.00	3,864,100
フルテック	200	1,148.00	229,600
グリーンズ	400	939.00	375,600
ツナググループ・ホールディングス	200	835.00	167,000
GameWith	400	733.00	293,200
ソウルドアウト	300	1,875.00	562,500
MS&Consulting	200	1,153.00	230,600
ミダック	200	1,290.00	258,000

日総工産	1,100	921.00	1,013,100
キュービーネットホールディングス	700	2,398.00	1,678,600
RPAホールディングス	900	1,092.00	982,800
スプリックス	600	1,117.00	670,200
マネジメントソリューションズ	200	3,585.00	717,000
アドバンテッジリスクマネジメント	800	878.00	702,400
リログループ	8,700	2,830.00	24,621,000
東祥	1,000	2,101.00	2,101,000
エイチ・アイ・エス	2,500	2,657.00	6,642,500
ラックランド	300	2,174.00	652,200
共立メンテナンス	2,700	4,535.00	12,244,500
イチネンホールディングス	1,800	1,434.00	2,581,200
建設技術研究所	1,100	2,375.00	2,612,500
スペース	1,000	1,196.00	1,196,000
長大	600	1,232.00	739,200
燦ホールディングス	700	1,671.00	1,169,700
スバル興業	100	9,050.00	905,000
東京テアトル	700	1,357.00	949,900
タナベ経営	300	1,296.00	388,800
ナガワ	500	6,860.00	3,430,000
よみうりランド	400	4,360.00	1,744,000
東京都競馬	1,000	3,115.00	3,115,000
常磐興産	700	1,686.00	1,180,200
カナモト	2,600	2,763.00	7,183,800
東京ドーム	6,500	1,028.00	6,682,000
西尾レントオール	1,600	3,040.00	4,864,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	10,600	31.00	328,600
トランス・コスモス	1,500	2,817.00	4,225,500
乃村工藝社	6,800	1,304.00	8,867,200
藤田観光	700	2,696.00	1,887,200
KNT-CTホールディングス	1,000	1,265.00	1,265,000
日本管財	1,700	1,924.00	3,270,800
トーカイ	1,500	2,700.00	4,050,000
白洋舎	200	2,790.00	558,000
セコム	16,900	9,963.00	168,374,700
セントラル警備保障	800	5,900.00	4,720,000
丹青社	3,000	1,252.00	3,756,000
メイテック	2,000	6,040.00	12,080,000
応用地質	1,700	1,418.00	2,410,600
船井総研ホールディングス	3,300	3,225.00	10,642,500
進学会ホールディングス	600	513.00	307,800
オオバ	1,100	758.00	833,800

いであ	300	2,153.00	645,900	
学究社	500	1,420.00	710,000	
ベネッセホールディングス	5,300	3,185.00	16,880,500	
イオンディライト	1,900	3,760.00	7,144,000	
ナック	900	1,082.00	973,800	
ニチイ学館	2,300	1,467.00	3,374,100	
ダイセキ	2,700	3,000.00	8,100,000	
ステップ	600	1,737.00	1,042,200	
合 計	19,565,800		40,370,774,260	

## (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2020年 2月28日現在です。

### 【インデックスファンドTSP】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	19,577,162,646円
負債総額	59,827,338円
純資産総額（ - ）	19,517,335,308円
発行済口数	24,895,324,185口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7840円

（参考）

インデックス マザーファンド TOPIX

#### 純資産額計算書

資産総額	35,641,740,963円
負債総額	87,316,311円
純資産総額（ - ）	35,554,424,652円
発行済口数	18,653,136,522口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9061円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）名義書換

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

### （2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

### （3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

#### 受益権の譲渡

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



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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### (4) 受益証券の再発行

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

#### (5) 受益権の再分割

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

#### (6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

2020年2月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

###### (2) 会社の意思決定機関（2020年2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（2020年2月末現在）

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

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2020年2月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	835	196,499
株式投資信託	786	166,038
単位型	269	11,091
追加型	517	154,946
公社債投資信託	49	30,461
単位型	36	986
追加型	13	29,474

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第61期中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第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	1,120	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			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額等 合計	
当期首残高	282	266	548	56,475
当期変動額				
剰余金の配当				1,036
当期純利益				6,979
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	125	80	206	206
当期変動額合計	125	80	206	6,036
当期末残高	408	346	754	62,511

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						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756
当期変動額							
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</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法により償却しております。ただし、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"> <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</p> <p>定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	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</p> <p>従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金</p> <p>役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>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</p> <p>数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>				



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	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消 費税等は、当事業年度の費用として処理してあります。</p>

## (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)	
<p>(「『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。</p>	

## (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	1,260百万円	1,281百万円
	建物	612百万円	655百万円
	器具備品		

<p>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。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (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</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>2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 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> <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

	新株予約権の目的となる株式の数(株)
--	--------------------

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	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	当事業年度末残高(百万円)
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おりません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
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おりません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年5月31日 取締役会	普通株式	1,640	8.38	2018年3月31日	2018年6月23日

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主

に自己で設定した投資信託へのシ - ドマネ - の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日でありませぬ。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ぬ。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ぬ。

（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す。

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

3 子会社株式(貸借対照表計上額22,876百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,024	-	-	-
未収委託者報酬	15,873	-	-	-
未収収益	3,174	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	616	1,743	545
合計	33,090	616	1,743	545

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

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

(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	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 売建	投資有価証券			
	米ドル		4,447	-	196
	豪ドル		109	-	10
	シンガポール ドル		1,783	-	65
	香港ドル		541	-	25
	人民元		2,156	-	32
	ユーロ		154	-	6
合計			9,192	-	336

- (注) 1 時価の算定方法  
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

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	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		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) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況  
ストックオプション(新株予約権)の数

	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、記載していません。

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、記載していません。

### 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、記載していません。

#### 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、記載を省略していません。

##### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

#### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

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、記載していません。

#### 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、記載を省略していません。

##### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

#### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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。

## 中間財務諸表等

## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第61期中間会計期間 (2019年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		23,147
有価証券		10
未収委託者報酬		13,391
未収収益		845
関係会社短期貸付金		2,358
その他	2	2,563
流動資産合計		42,316
固定資産		
有形固定資産	1	268
無形固定資産		83
投資その他の資産		
投資有価証券		17,535
関係会社株式		25,769
長期差入保証金		498
繰延税金資産		1,879
投資その他の資産合計		45,684
固定資産合計		46,036
資産合計		88,353

(単位:百万円)

		第61期中間会計期間 (2019年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		5,950
未払費用		3,948
未払法人税等		1,788
未払消費税等	3	415
賞与引当金		1,432
役員賞与引当金		27
その他		559
流動負債合計		14,122

固定負債		
退職給付引当金		1,433
その他		494
固定負債合計		1,927
負債合計		16,050
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		49,870
利益剰余金合計		49,870
自己株式		905
株主資本合計		71,547
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		356
繰延ヘッジ損益		398
評価・換算差額等合計		755
純資産合計		72,302
負債純資産合計		88,353

## ( 2 ) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		37,324
その他営業収益		1,394
営業収益合計		38,718
営業費用及び一般管理費	1	33,922
営業利益		4,796
営業外収益	2	2,859
営業外費用	3	124
経常利益		7,530
特別利益	4	126
特別損失	5	4
税引前中間純利益		7,651
法人税等	6	1,711
中間純利益		5,940

## ( 3 ) 中間株主資本等変動計算書

第61期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

	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	47,142	47,142	833	68,891
当中間期変動額							
剰余金の配当				3,212	3,212		3,212
中間純利益				5,940	5,940		5,940
自己株式の取得						71	71
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計	-	-	-	2,727	2,727	71	2,655
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	49,870	49,870	905	71,547

	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	493	185	679	69,571
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,212
中間純利益				5,940
自己株式の取得				71
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	136	212	75	75
当中間期変動額合計	136	212	75	2,731
当中間期末残高	356	398	755	72,302

## 注記事項

（重要な会計方針）

項目	第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定）</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p>

<p>2 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(2) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
<p>3 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
<p>4 ヘッジ会計の方法</p>	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
<p>5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

第61期中間会計期間 (2019年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,977百万円
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 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4 保証債務	当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務396百万円に対して保証を行っております。

## (中間損益計算書関係)

第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	40百万円
無形固定資産	18百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	51百万円
受取配当金	2,711百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	91百万円
デリバティブ費用	2百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	126百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	4百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	1,365,700	88,800	-	1,454,500

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,171,500	-	1,171,500	-	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	75,900	-	75,900	-	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,055,900	-	442,200	1,613,700	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	1,533,000	2,085,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	-	1,018,000	2,793,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	-	1,018,000	3,338,000	-
合計		15,088,300	-	5,258,600	9,829,700	-

(注) 1 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)、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)、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)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 2011年度ストックオプション(1)1,613,700株、2016年度ストックオプション(1)1,251,000株及び2016年度ストックオプション(2)937,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)834,000株、2016年度ストックオプション(2)1,856,000株及び2017年度ストックオプション(1)3,338,000株は権利行使期間の初日が到来しておりません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年5月28日 取締役会	普通株式	3,212	16.42	2019年3月31日	2019年6月24日

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

該当事項はありません。

##### (リース取引関係)

第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	898百万円
1年超	6,604百万円
合計	7,503百万円

##### (金融商品関係)

##### 第61期中間会計期間(2019年9月30日)

##### 金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額( 1)	時価( 1)	差額
(1) 現金・預金	23,147	23,147	-
(2) 未収委託者報酬	13,391	13,391	-
(3) 未収収益	845	845	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,358	2,358	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	17,529	17,529	-
(6) 未払金	(5,950)	(5,950)	-
(7) 未払費用	(3,948)	(3,948)	-
(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	(64)	(64)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	75	75	-
デリバティブ取引計	11	11	-

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないものは、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。またヘッジ会計が適用されているもののうち86百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、10百万円は、流動負債のその他に含まれております。

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

3 子会社株式(中間貸借対照表計上額22,876百万円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

(有価証券関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額

中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	投資信託	12,130	11,325	805
	小計	12,130	11,325	805
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	投資信託	5,399	5,690	291
	小計	5,399	5,690	291
合計		17,529	17,015	513

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

## (デリバティブ取引関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	2,129	-	47	47
	合計	2,129	-	47	47

(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	1,760	-	17	17
	合計	1,760	-	17	17

(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

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	投資有価証券			
	米ドル		2,261	-	10
	豪ドル		71	-	2
	シンガポールドル		913	-	11



	ユーロ		72	-	2
	香港ドル		425	-	1
	人民元		2,091	-	68
	合計		5,834	-	75

## (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61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,004百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	10,509百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,047百万円

## (ストックオプション等関係)

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

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

## [関連情報]

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無い場合、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場合、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61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

項目	第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1株当たり純資産額	369円72銭
1株当たり中間純利益金額	30円36銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益(百万円)	5,940
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,940
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,640
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1)1,613,700株、 2016年度ストックオプション(1)2,085,000株、 2016年度ストックオプション(2)2,793,000株、 2017年度ストックオプション(1)3,338,000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61期中間会計期間 (2019年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	72,302
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	72,302
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	195,558

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もし

くは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。 )。

- ( 3 ) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下( 4 )、( 5 )において同じ。 ) または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。 ) と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- ( 4 ) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- ( 5 ) 上記( 3 )、( 4 )に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、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9月末現在 )	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### < 再信託受託会社の概要 >

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

資本金の額 : 51,000百万円( 2019年9月末現在 )

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

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

#### ( 2 ) 販売会社

名 称	資本金の額 ( 2019年9月末現在 )	事業の内容
藍澤証券株式会社	8,000百万円	
あかつき証券株式会社	3,067百万円 ( 2019年3月末現在 )	
池田泉州TT証券株式会社	1,250百万円	
エース証券株式会社	8,831百万円	

auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
O K B 証券株式会社 1	1,500,000百万円 (2019年10月7日現在)	
光世証券株式会社	12,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
東武証券株式会社	420百万円	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	
東洋証券株式会社 1	13,494百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	
西日本シティ T T 証券株式会社 1	3,000百万円 (2019年8月26日現在)	
浜銀 T T 証券株式会社 1	3,307百万円 (2019年6月25日現在)	
ばんせい証券株式会社	1,558百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
丸三証券株式会社	10,000百万円	
みずほ証券株式会社 1	125,167百万円	
三菱 U F J モルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
明和証券株式会社 1	511百万円	
山和証券株式会社	585百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円 (2019年6月28日現在)	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社沖縄銀行	22,725百万円	
株式会社神奈川銀行	5,191百万円	
株式会社京都銀行	42,103百万円	
株式会社きらぼし銀行	43,734百万円	
株式会社京葉銀行	49,759百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社四国銀行	25,000百万円	
株式会社ジャパンネット銀行	37,250百万円	
株式会社十六銀行	36,839百万円	
ソニー銀行株式会社	31,000百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社東北銀行	13,233百万円	

株式会社徳島大正銀行	11,036百万円 (2020年1月1日現在)	
株式会社栃木銀行	27,408百万円	
株式会社トマト銀行	17,810百万円	
株式会社富山銀行	6,730百万円	
株式会社富山第一銀行	10,182百万円	
株式会社三井住友銀行 1	1,770,996百万円	
株式会社みなと銀行	27,484百万円	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
株式会社山梨中央銀行	15,400百万円	
株式会社S M B C 信託銀行	87,550百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
全国信用協同組合連合会	107,275百万円 (出資の総額)	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

1 募集の取扱いを行いません。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

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

2020年3月25日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### PWCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスファンドTSPの2019年2月13日から2020年2月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスファンドTSPの2020年2月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。



## 独立監査人の中間監査報告書

2019年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞 廣 篤 典  
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2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。