

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2018年8月31日提出
【計算期間】	第14期(自 2017年6月1日至 2018年5月31日)
【ファンド名】	年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 柴田 拓美
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## ファンドの目的

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

## ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 追加型投信

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

## 国内

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

## 株式

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

## インデックス型

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

株式 一般

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

年1回

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

日本

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

## ファンドの特色

# 1. TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざします。

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

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

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

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

## 主な投資制限

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

## 分配方針

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

## 信託金限度額

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

## (2)【ファンドの沿革】

2004年11月30日

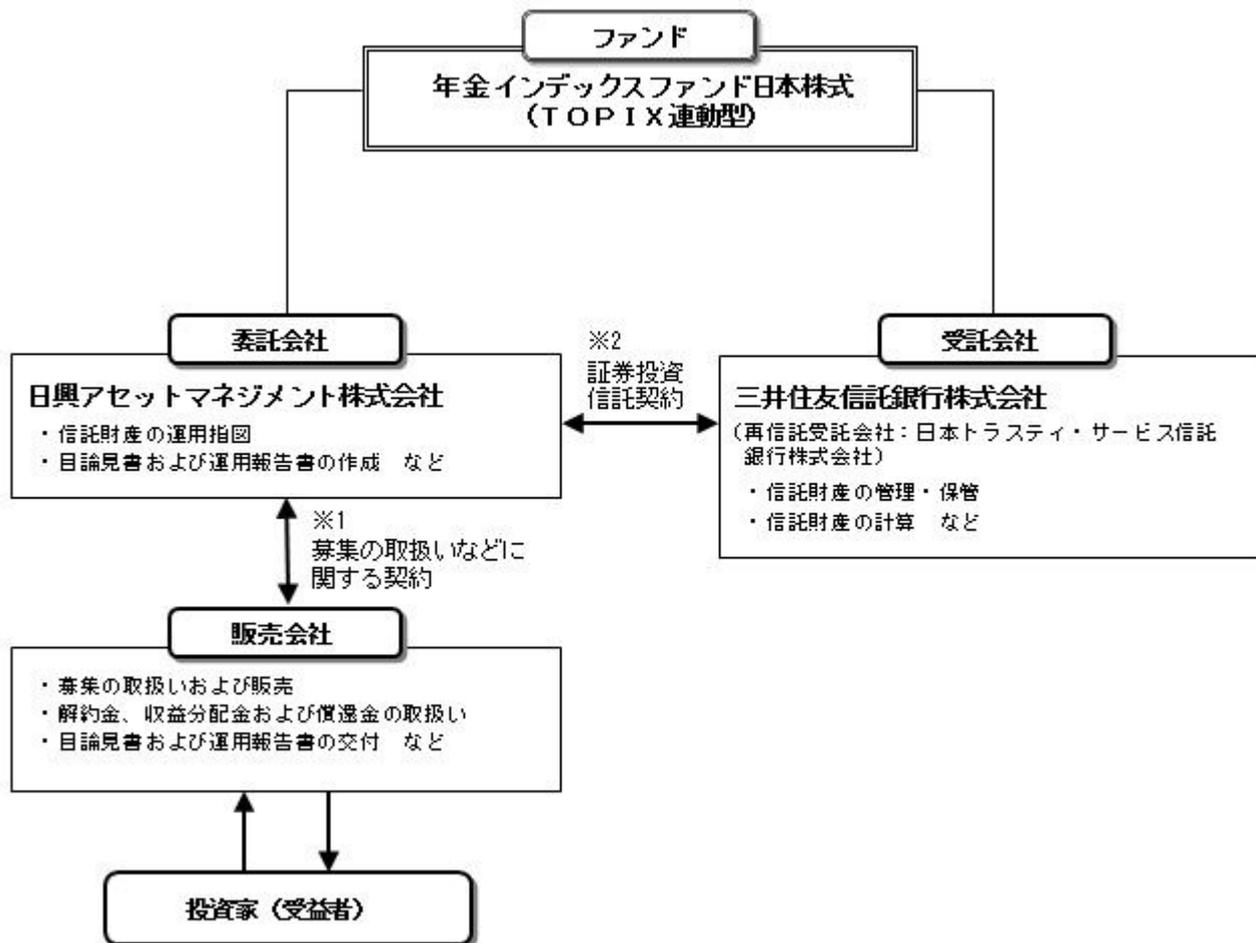
- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

2014年5月31日

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

## (3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2018年6月末現在）

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

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

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

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

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

## (2) 【投資対象】

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限ります。)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)~8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 14) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 15) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 16) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

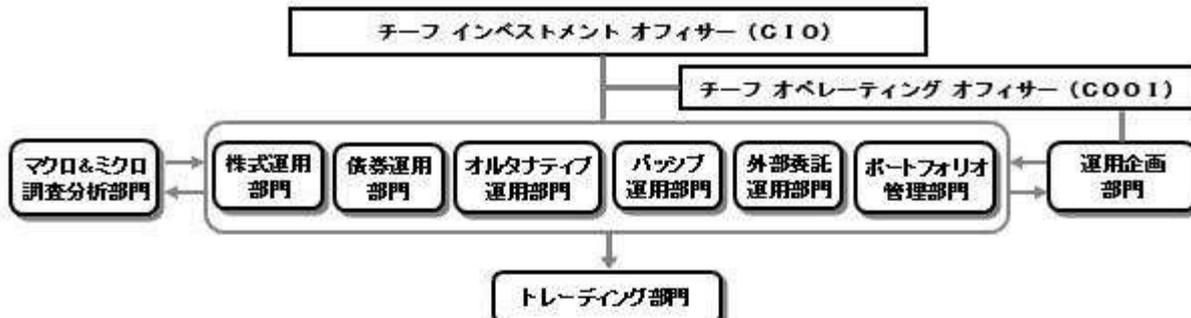
- 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等

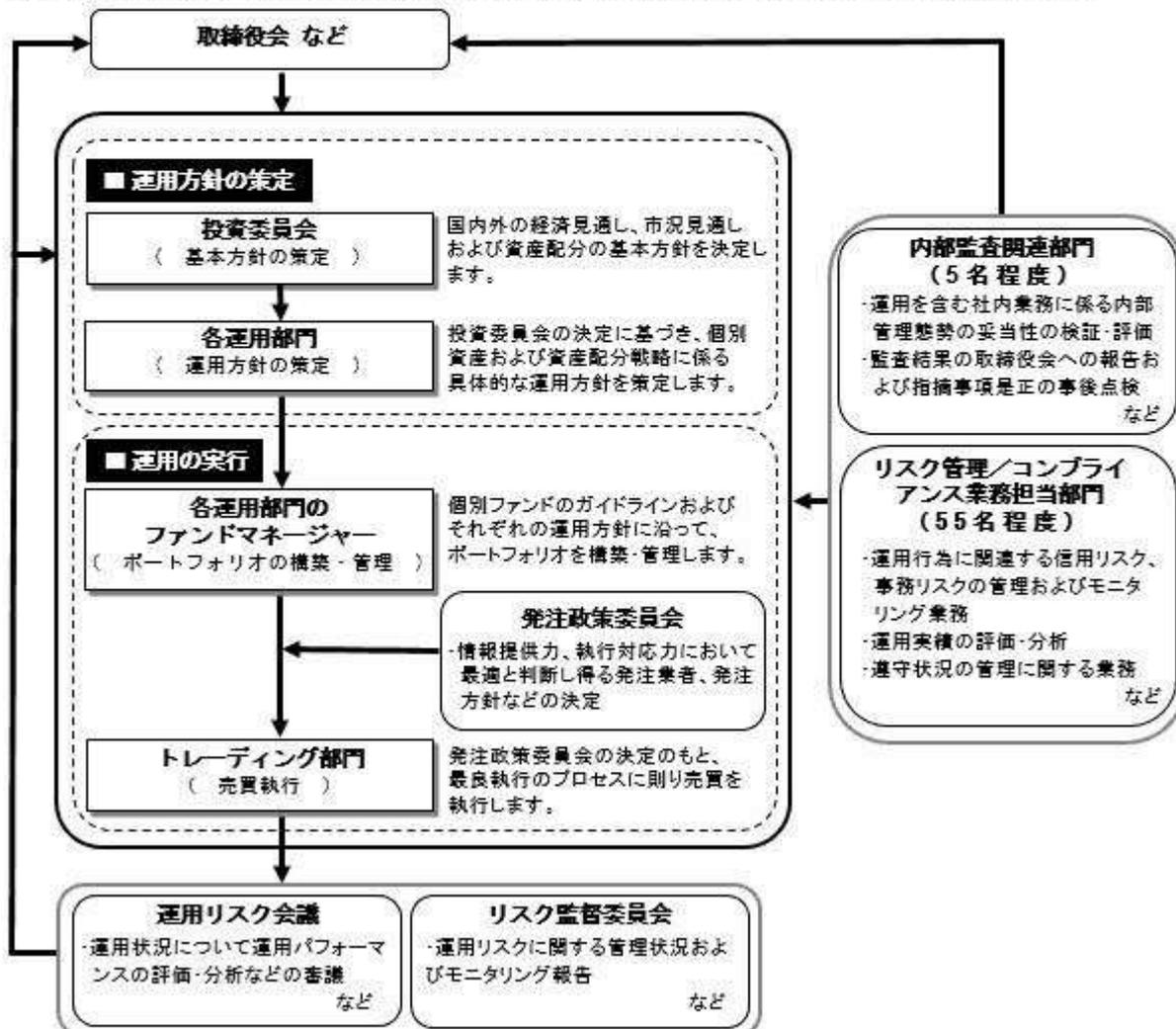
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- 8) 資金の借入

### (3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



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

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

上記体制は2018年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### （４）【配分方針】

##### 収益配分方針

毎決算時に、原則として次の通り収益配分を行なう方針です。

##### 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配分方針

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

##### ３）留保益の運用方針

収益配分に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

##### 収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

#### （５）【投資制限】

##### 約款に定める投資制限

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

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

３）投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の５％以下とします。

４）外貨建資産への投資は行ないません。

５）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

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

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

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

10）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公

社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。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、主に株式を投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

### 流動性リスク

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

### 信用リスク

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

### 有価証券の貸付などにおけるリスク

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

### < T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

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

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

### < その他の留意事項 >

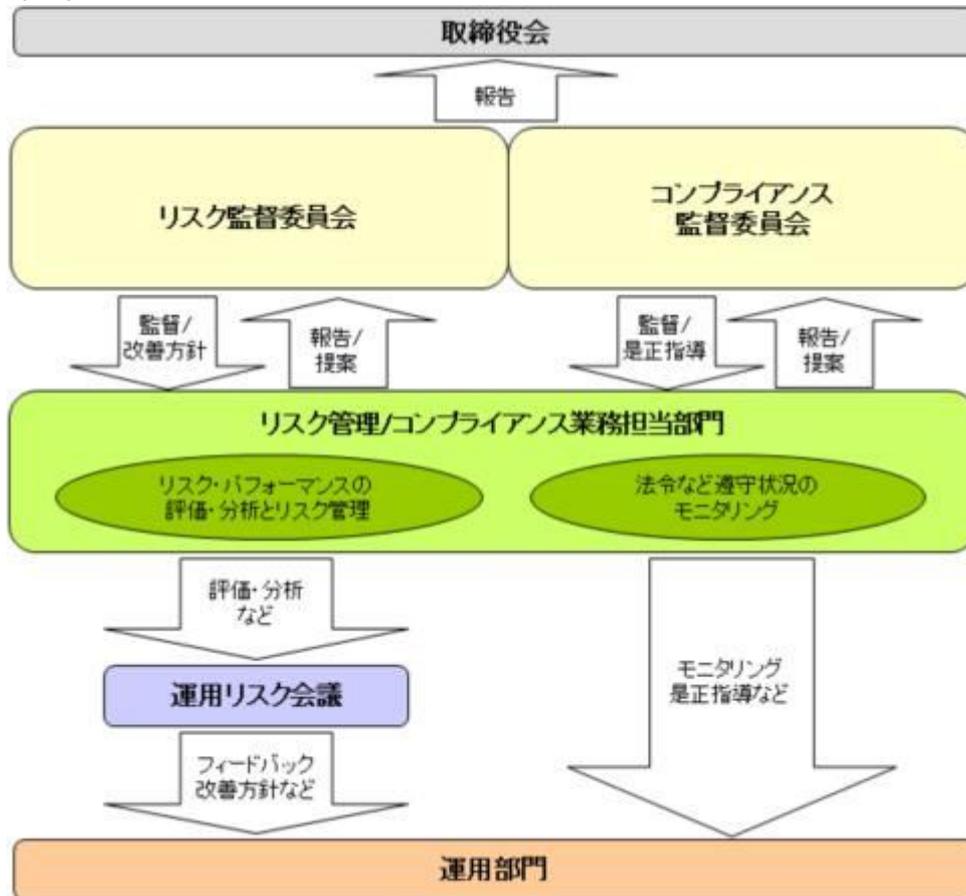
- ・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項  
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。
- ・ 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項  
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項  
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・ 運用制限や規制上の制限に関する事項  
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限さ

れることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性やインデックスと基準価額が乖離する可能性があります。

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

## (2) リスク管理体制



### 全社的なリスク管理

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

### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

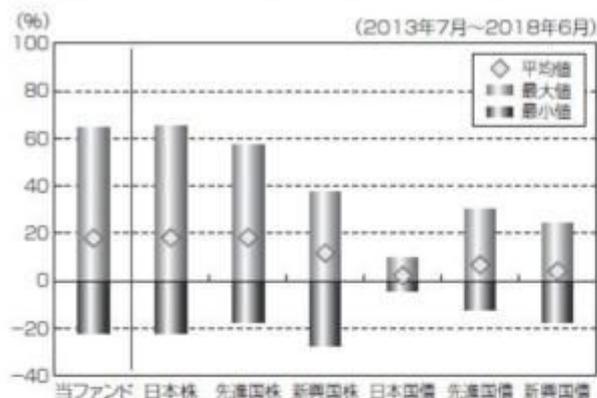
### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2018年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (参考情報)

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	17.9%	18.1%	18.2%	11.7%	2.2%	6.7%	4.0%
最大値	64.7%	65.0%	57.1%	37.2%	9.3%	30.4%	24.1%
最小値	-22.1%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。  
 ※上記は2013年7月から2018年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## &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・ディバースィファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

## 東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

## MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

## NOMURA-BPI国債

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

## FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income

## 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2013年7月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

ありません。

##### (2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.18252%(税抜0.169%)の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分(年率)は、以下の通りとします。

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬(信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。)は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。)および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

##### (4)【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用(日々、計上されます。)

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

有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料に0.432(税抜0.4)を乗じて得た

貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は3：1とし、信託報酬と同時期に支払います。

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

## （5）【課税上の取扱い】

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

### 確定拠出年金の場合

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

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

### 厚生年金基金および企業年金基金の場合

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

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

### 規約型企業年金の場合

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

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

### 上記以外の場合

#### 個人受益者の場合

#### 1) 収益分配金に対する課税

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

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

#### 2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

## 法人受益者の場合

## 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

## 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

## 個別元本

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

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

## 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

## 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

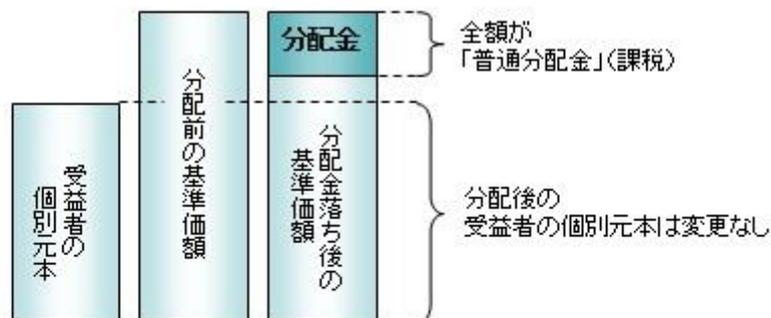
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

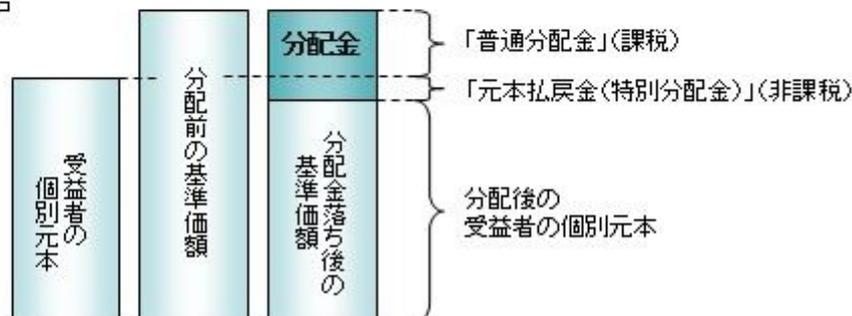
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

## イ) の場合



## ロ)、ハ) の場合



上記は2018年8月31日現在のものですので、税法、確定給付企業年金法および確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## 【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

以下の運用状況は2018年 6月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## （１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	40,873,605,480	97.33
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,122,459,740	2.67
合計（純資産総額）		41,996,065,220	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	1,107,520,000	2.64

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

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	201,000	6,923.55	1,391,634,600	7,170.00	1,441,170,000	3.43
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,141,700	655.93	748,879,650	631.10	720,526,870	1.72
日本	株式	ソニー	電気機器	110,700	5,160.30	571,245,800	5,664.00	627,004,800	1.49
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	116,400	5,106.05	594,344,900	5,036.00	586,190,400	1.40
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	73,500	7,765.23	570,745,100	7,973.00	586,015,500	1.40
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	123,400	4,503.33	555,711,200	4,306.00	531,360,400	1.27
日本	株式	キーエンス	電気機器	8,100	66,842.34	541,423,000	62,560.00	506,736,000	1.21
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	148,800	3,447.34	512,965,100	3,253.00	484,046,400	1.15
日本	株式	KDDI	情報・通信業	143,000	2,945.27	421,173,610	3,031.00	433,433,000	1.03
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,216,300	189.72	420,478,510	186.50	413,339,950	0.98
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	121,900	3,030.01	369,358,500	3,066.00	373,745,400	0.89
日本	株式	任天堂	その他製品	10,200	44,982.35	458,820,000	36,200.00	369,240,000	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	114,300	3,031.34	346,482,300	3,078.00	351,815,400	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	15,700	23,269.01	365,323,500	22,005.00	345,478,500	0.82
日本	株式	花王	化学	40,700	8,439.91	343,504,400	8,450.00	343,915,000	0.82

日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	14,800	22,508.95	333,132,500	22,960.00	339,808,000	0.81
日本	株式	日本電産	電気機器	19,900	16,888.26	336,076,500	16,625.00	330,837,500	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	68,300	4,820.87	329,265,800	4,831.00	329,957,300	0.79
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	116,500	2,817.67	328,259,400	2,822.50	328,821,250	0.78
日本	株式	キヤノン	電気機器	89,000	3,714.00	330,546,500	3,631.00	323,159,000	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	17,300	16,186.09	280,019,500	18,620.00	322,126,000	0.77
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	61,400	5,240.73	321,781,200	5,193.00	318,850,200	0.76
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	102,700	2,935.72	301,498,600	3,095.00	317,856,500	0.76
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	29,700	10,754.12	319,397,500	10,615.00	315,265,500	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	397,000	796.57	316,238,500	781.60	310,295,200	0.74
日本	株式	ダイキン工業	機械	22,600	12,583.31	284,383,000	13,270.00	299,902,000	0.71
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	60,900	4,450.40	271,029,900	4,678.00	284,890,200	0.68
日本	株式	パナソニック	電気機器	188,900	1,489.68	281,400,800	1,493.50	282,122,150	0.67
日本	株式	信越化学工業	化学	28,500	10,890.26	310,372,410	9,873.00	281,380,500	0.67
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	162,600	1,664.82	270,699,732	1,689.00	274,631,400	0.65

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.28
		建設業	3.09
		食料品	4.38
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.21
		医薬品	4.61
		石油・石炭製品	0.74
		ゴム製品	0.80
		ガラス・土石製品	0.97
		鉄鋼	1.00
		非鉄金属	0.83
		金属製品	0.61
		機械	5.01
		電気機器	13.26
		輸送用機器	8.38
		精密機器	1.69
		その他製品	2.03
		電気・ガス業	1.71
陸運業	4.27		
海運業	0.18		
空運業	0.56		
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	7.30		

	卸売業	4.67
	小売業	4.91
	銀行業	6.48
	証券、商品先物取引業	0.90
	保険業	2.20
	その他金融業	1.18
	不動産業	2.37
	サービス業	4.50
合 計		97.33

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2018年09月	買建	64	日本円	1,115,469,560	1,107,520,000	2.64

(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5計算期間末 (2009年 6月 1日)	9,360	9,370	0.8781	0.8791
第6計算期間末 (2010年 5月31日)	10,879	10,891	0.8606	0.8616
第7計算期間末 (2011年 5月31日)	11,800	11,814	0.8348	0.8358
第8計算期間末 (2012年 5月31日)	12,319	12,335	0.7308	0.7318
第9計算期間末 (2013年 5月31日)	18,870	18,886	1.1759	1.1769
第10計算期間末 (2014年 6月 2日)	18,195	18,210	1.2858	1.2868
第11計算期間末 (2015年 6月 1日)	27,517	27,532	1.7971	1.7981
第12計算期間末 (2016年 5月31日)	27,352	27,370	1.5035	1.5045
第13計算期間末 (2017年 5月31日)	33,130	33,149	1.7427	1.7437
第14計算期間末 (2018年 5月31日)	41,841	41,862	1.9775	1.9785
2017年 6月末日	34,196		1.7928	
7月末日	34,585		1.7999	
8月末日	34,965		1.7988	
9月末日	36,377		1.8765	
10月末日	38,434		1.9786	

11月末日	39,511		2.0080
12月末日	40,575		2.0385
2018年 1月末日	41,754		2.0599
2月末日	40,830		1.9834
3月末日	40,418		1.9426
4月末日	42,330		2.0116
5月末日	41,841		1.9775
6月末日	41,996		1.9610

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第5期	2008年 6月 3日～2009年 6月 1日	0.0010
第6期	2009年 6月 2日～2010年 5月31日	0.0010
第7期	2010年 6月 1日～2011年 5月31日	0.0010
第8期	2011年 6月 1日～2012年 5月31日	0.0010
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	0.0010
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	0.0010
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	0.0010
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	0.0010
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	0.0010
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	0.0010

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第5期	2008年 6月 3日～2009年 6月 1日	34.73
第6期	2009年 6月 2日～2010年 5月31日	1.88
第7期	2010年 6月 1日～2011年 5月31日	2.88
第8期	2011年 6月 1日～2012年 5月31日	12.34
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	61.04
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	9.43
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	39.84
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	16.28
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	15.98
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	13.53

(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5期	2008年 6月 3日～2009年 6月 1日	1,912,395,058	555,314,403
第6期	2009年 6月 2日～2010年 5月31日	2,784,974,927	803,649,568
第7期	2010年 6月 1日～2011年 5月31日	2,416,667,454	921,766,695
第8期	2011年 6月 1日～2012年 5月31日	3,959,202,241	1,239,279,452
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	4,667,083,142	5,475,394,820
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	5,541,023,939	7,437,910,957
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	6,052,501,542	4,891,151,568
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	7,174,553,570	4,294,430,475
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	5,730,325,471	4,911,678,612
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	6,496,323,254	4,348,409,754

## 参考情報

## 運用実績

2018年6月29日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額 …………… 19,610円  
純資産総額 …………… 419.96億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
※分配金再投資基準価額は、2008年6月末の基準価額を起点として指数化しています。  
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2014年6月2日	2015年6月1日	2016年5月31日	2017年5月31日	2018年5月31日	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	110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	97.33%
株式先物	2.64%
現金その他	2.67%

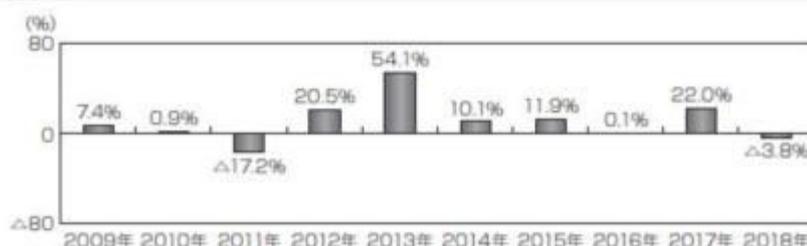
※対純資産総額比です。

## &lt;組入上位10銘柄&gt;

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.43%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.72%
3	ソニー	電気機器	1.49%
4	日本電信電話	情報・通信業	1.40%
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.40%
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.27%
7	キーエンス	電気機器	1.21%
8	本田技研工業	輸送用機器	1.15%
9	KDDI	情報・通信業	1.03%
10	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	0.98%

※対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



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

※2018年は、2018年6月末までの騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## (1) 申込方法

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

合は、当該規定に従うものとしします。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

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

(4) 申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(5) 申込単位

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 申込代金の支払い

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

(7) 受付の中止および取消

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <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、解約価額に基づいて計算された金額となります。

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

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

## (6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

## (7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

## (8) 受付の中止および取消

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

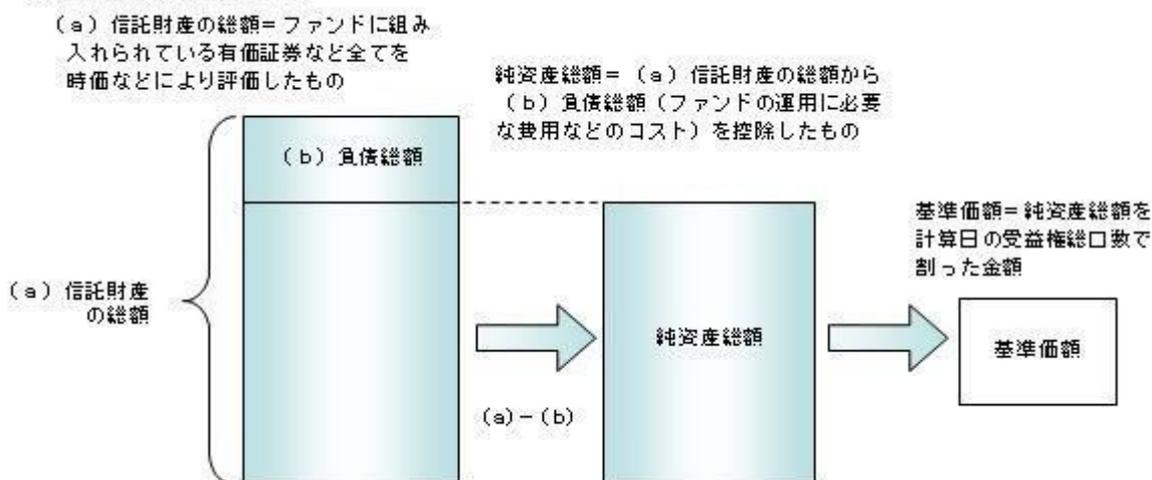
## 3【資産管理等の概要】

## (1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

&lt;基準価額算出の流れ&gt;



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。

&lt;主な資産の評価方法&gt;

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。

&lt;委託会社の照会先&gt;

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

無期限とします(2004年11月30日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

## (4)【計算期間】

毎年6月1日から翌年5月31日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

## (5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

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) やむを得ない事情が発生したとき

2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)

4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)

ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更

1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)

4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

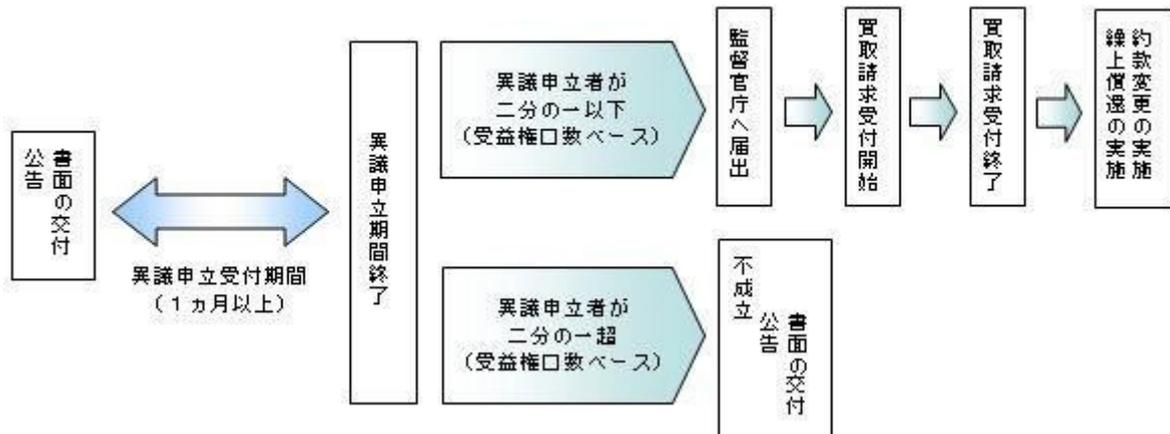
異議の申立て

1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手

続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

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

＜繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ＞



#### 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

#### 運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス <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14期計算期間(平成29年6月1日から平成30年5月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【年金インデックスファンド日本株式(TOPIX連動型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 平成29年 5月31日現在	第14期 平成30年 5月31日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	7,418,565	947,742,285
コール・ローン	513,758,028	696,568,270
株式	32,440,624,900	40,894,462,100
派生商品評価勘定	4,928,260	3,419,060
未収入金	7,427,062	8,920,700
未収配当金	275,559,390	341,057,000
前払金	-	14,930,000
その他未収収益	1,005,380	3,028,925
流動資産合計	33,250,721,585	42,910,128,340
資産合計	33,250,721,585	42,910,128,340
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,792,020	13,703,760
前受金	4,400,000	-
未払金	4,354,057	2,542,800
未払収益分配金	19,011,092	21,159,005
未払解約金	52,006,004	44,171,519
未払受託者報酬	5,199,770	6,411,018
未払委託者報酬	25,390,411	31,794,591
未払利息	785	1,102
受入担保金	7,418,565	947,742,285
その他未払費用	841,612	1,079,779
流動負債合計	120,414,316	1,068,605,859
負債合計	120,414,316	1,068,605,859
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	19,011,092,384	21,159,005,884
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	14,119,214,885	20,682,516,597
(分配準備積立金)	6,224,811,790	8,750,298,525
元本等合計	33,130,307,269	41,841,522,481
純資産合計	33,130,307,269	41,841,522,481
負債純資産合計	33,250,721,585	42,910,128,340

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	平成28年 6月 1日 至 平成29年 5月31日	自	平成29年 6月 1日 至 平成30年 5月31日
営業収益				
受取配当金		633,469,706		782,064,900
受取利息		1,814		2,249
有価証券売買等損益		3,968,099,669		3,689,209,626
派生商品取引等損益		63,071,980		86,447,420
その他収益		21,185,247		11,510,711
営業収益合計		4,685,828,416		4,569,234,906
営業費用				
支払利息		8,654		222,319
受託者報酬		9,772,737		12,060,751
委託者報酬		47,476,788		59,748,267
その他費用		3,569,510		3,420,923
営業費用合計		60,827,689		75,452,260
営業利益又は営業損失（ ）		4,625,000,727		4,493,782,646
経常利益又は経常損失（ ）		4,625,000,727		4,493,782,646
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,625,000,727		4,493,782,646
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（ ）		479,455,136		714,934,760
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,159,575,295		14,119,214,885
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,308,084,291		6,124,285,377
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,308,084,291		6,124,285,377
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,474,979,200		3,318,672,546
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,474,979,200		3,318,672,546
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		19,011,092		21,159,005
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		14,119,214,885		20,682,516,597

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

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

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

		第13期 平成29年 5月31日現在	第14期 平成30年 5月31日現在
1.	期首元本額	18,192,445,525円	19,011,092,384円
	期中追加設定元本額	5,730,325,471円	6,496,323,254円
	期中一部解約元本額	4,911,678,612円	4,348,409,754円
2.	受益権の総数	19,011,092,384口	21,159,005,884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	119,957,090円	121,657,280円
4.	有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券は次のとおりであります。 株式	7,066,200円	898,036,670円

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第13期 自 平成28年 6月 1日 至 平成29年 5月31日		第14期 自 平成29年 6月 1日 至 平成30年 5月31日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	579,659,490円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	721,935,846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	92,117,659円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	3,056,912,040円
C	信託約款に定める収益調整金	17,743,214,492円	C	信託約款に定める収益調整金	21,779,451,949円
D	信託約款に定める分配準備積立金	5,572,045,733円	D	信託約款に定める分配準備積立金	4,992,609,644円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	23,987,037,374円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	30,550,909,479円
F	分配対象収益(1万口当たり)	12,617円	F	分配対象収益(1万口当たり)	14,438円
G	分配金額	19,011,092円	G	分配金額	21,159,005円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	第13期 自 平成28年 6月 1日 至 平成29年 5月31日	第14期 自 平成29年 6月 1日 至 平成30年 5月31日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第13期 平成29年 5月31日現在	第14期 平成30年 5月31日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1)有価証券 同左

	(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(2)デリバティブ取引  同左  (3)上記以外の金融商品  同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

第13期（平成29年 5月31日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,826,559,573
合計	3,826,559,573

第14期（平成30年 5月31日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,517,534,971
合計	3,517,534,971

（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13期（平成29年 5月31日現在）

（単位：円）

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

	買建	687,640,000	-	690,800,000	3,160,000
	合計	687,640,000	-	690,800,000	3,160,000

第14期(平成30年 5月31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	969,730,000	-	959,475,000	10,255,000
	合計	969,730,000	-	959,475,000	10,255,000

(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13期 平成29年 5月31日現在		第14期 平成30年 5月31日現在	
1口当たり純資産額	1.7427円	1口当たり純資産額	1.9775円
(1万口当たり純資産額)	(17,427円)	(1万口当たり純資産額)	(19,775円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	700	3,780.00	2,646,000	
日本水産	20,600	533.00	10,979,800	
マル八二チ口	3,500	4,155.00	14,542,500	

カネコ種苗	600	1,612.00	967,200	
サカタのタネ	2,700	4,090.00	11,043,000	
ホクト	1,900	2,033.00	3,862,700	
ホクリヨウ	300	884.00	265,200	
住石ホールディングス	5,200	154.00	800,800	貸付有価証券 3,600株
日鉄鉱業	500	5,380.00	2,690,000	
三井松島産業	900	1,506.00	1,355,400	
国際石油開発帝石	89,200	1,214.00	108,288,800	
日本海洋掘削	600	1,748.00	1,048,800	貸付有価証券 400株
石油資源開発	2,900	2,775.00	8,047,500	
K & O エナジーグループ	1,100	1,801.00	1,981,100	
ヒノキヤグループ	500	2,963.00	1,481,500	貸付有価証券 300株
ショーボンドホールディングス	1,700	7,310.00	12,427,000	
ミライト・ホールディングス	5,600	1,707.00	9,559,200	貸付有価証券 3,900株
タマホーム	1,400	1,105.00	1,547,000	
サンヨーホームズ	400	1,196.00	478,400	
日本アクア	500	406.00	203,000	
ファーストコーポレーション	300	1,169.00	350,700	
ベステラ	300	1,494.00	448,200	貸付有価証券 200株
T A T E R U	1,600	2,141.00	3,425,600	
ダイセキ環境ソリューション	500	1,030.00	515,000	貸付有価証券 200株
第一カッター興業	200	2,699.00	539,800	
安藤・間	14,300	953.00	13,627,900	
東急建設	7,100	1,103.00	7,831,300	
コムシスホールディングス	6,400	2,895.00	18,528,000	
ミサワホーム	1,500	969.00	1,453,500	
ピーアールホールディングス	1,800	407.00	732,600	
高松コンストラクショングループ	1,200	3,045.00	3,654,000	
東建コーポレーション	700	10,380.00	7,266,000	
ソネック	200	807.00	161,400	
ヤマウラ	800	871.00	696,800	貸付有価証券 500株
大成建設	18,300	5,990.00	109,617,000	
大林組	55,000	1,099.00	60,445,000	
清水建設	56,000	1,065.00	59,640,000	
飛島建設	16,700	183.00	3,056,100	
長谷工コーポレーション	21,400	1,654.00	35,395,600	
松井建設	2,100	881.00	1,850,100	
銭高組	300	5,690.00	1,707,000	

鹿島建設	81,000	888.00	71,928,000	
不動テトラ	13,800	186.00	2,566,800	
大末建設	600	1,336.00	801,600	
鉄建建設	1,100	2,985.00	3,283,500	
西松建設	4,200	3,140.00	13,188,000	
三井住友建設	13,200	728.00	9,609,600	
大豊建設	7,000	610.00	4,270,000	
前田建設工業	13,100	1,181.00	15,471,100	
佐田建設	1,400	479.00	670,600	
ナカノフドー建設	1,500	610.00	915,000	
奥村組	3,000	3,625.00	10,875,000	
東鉄工業	2,200	3,440.00	7,568,000	
イチケン	200	2,540.00	508,000	
浅沼組	6,000	359.00	2,154,000	
戸田建設	21,000	958.00	20,118,000	
熊谷組	2,900	3,670.00	10,643,000	
青木あすなろ建設	1,200	969.00	1,162,800	
北野建設	4,000	375.00	1,500,000	
植木組	200	2,606.00	521,200	
三井ホーム	2,000	735.00	1,470,000	
矢作建設工業	2,500	885.00	2,212,500	
ピーエス三菱	2,200	582.00	1,280,400	
日本ハウスホールディングス	3,600	566.00	2,037,600	
大東建託	6,500	17,770.00	115,505,000	
新日本建設	2,200	1,278.00	2,811,600	
N I P P O	4,200	2,105.00	8,841,000	
東亜道路工業	400	3,870.00	1,548,000	
前田道路	5,700	2,159.00	12,306,300	
日本道路	500	5,750.00	2,875,000	
東亜建設工業	1,500	2,601.00	3,901,500	
若築建設	1,000	1,620.00	1,620,000	
東洋建設	5,700	479.00	2,730,300	
五洋建設	21,800	709.00	15,456,200	
世紀東急工業	2,400	755.00	1,812,000	
福田組	600	6,750.00	4,050,000	
住友林業	11,700	1,665.00	19,480,500	
日本基礎技術	2,100	371.00	779,100	
日成ビルド工業	2,700	1,225.00	3,307,500	
ヤマダ・エスバイエルホーム	9,000	68.00	612,000	貸付有価証券 6,000株
巴コーポレーション	2,200	509.00	1,119,800	
大和ハウス工業	54,200	3,947.00	213,927,400	
ライト工業	3,500	1,073.00	3,755,500	

積水ハウス	59,700	1,942.00	115,937,400	
日特建設	1,600	607.00	971,200	
北陸電気工事	1,000	1,179.00	1,179,000	
ユアテック	2,600	887.00	2,306,200	
西部電気工業	300	3,630.00	1,089,000	
四電工	200	2,742.00	548,400	
中電工	2,400	2,918.00	7,003,200	
関電工	7,300	1,195.00	8,723,500	
きんでん	12,200	1,793.00	21,874,600	
東京エネシス	2,100	1,292.00	2,713,200	
トーエネック	500	3,325.00	1,662,500	
住友電設	1,500	1,980.00	2,970,000	
日本電設工業	2,800	2,375.00	6,650,000	
協和エクシオ	6,600	2,850.00	18,810,000	
新日本空調	1,400	1,702.00	2,382,800	
N D S	300	5,910.00	1,773,000	
九電工	3,600	5,250.00	18,900,000	
三機工業	3,900	1,086.00	4,235,400	
日揮	15,800	2,273.00	35,913,400	
中外炉工業	600	2,936.00	1,761,600	
ヤマト	1,500	722.00	1,083,000	
太平電業	1,200	2,950.00	3,540,000	
高砂熱学工業	5,000	1,966.00	9,830,000	
三晃金属工業	200	3,540.00	708,000	
朝日工業社	400	3,415.00	1,366,000	
明星工業	3,400	832.00	2,828,800	
大気社	2,300	3,420.00	7,866,000	
ダイダン	1,200	2,439.00	2,926,800	
日比谷総合設備	2,000	2,172.00	4,344,000	
東芝プラントシステム	4,000	2,429.00	9,716,000	
O S J Bホールディングス	8,000	290.00	2,320,000	
東洋エンジニアリング	2,200	830.00	1,826,000	貸付有価証券 1,500株
千代田化工建設	11,900	946.00	11,257,400	貸付有価証券 6,300株
新興プランテック	3,500	967.00	3,384,500	
日本製粉	5,400	1,814.00	9,795,600	
日清製粉グループ本社	20,100	2,300.00	46,230,000	
日東富士製粉	100	5,270.00	527,000	
昭和産業	1,500	2,879.00	4,318,500	
鳥越製粉	1,400	958.00	1,341,200	
中部飼料	2,000	2,049.00	4,098,000	
フィード・ワン	11,100	254.00	2,819,400	

東洋精糖	200	1,227.00	245,400	
日本甜菜製糖	900	2,255.00	2,029,500	
三井製糖	1,300	3,655.00	4,751,500	
塩水港精糖	2,100	260.00	546,000	
日新製糖	800	2,135.00	1,708,000	
森永製菓	3,900	5,400.00	21,060,000	
中村屋	400	4,760.00	1,904,000	
江崎グリコ	4,600	5,650.00	25,990,000	貸付有価証券 300株
名糖産業	800	1,707.00	1,365,600	
井村屋グループ	700	3,355.00	2,348,500	
不二家	1,000	2,639.00	2,639,000	
山崎製パン	13,400	2,360.00	31,624,000	
第一屋製パン	300	1,173.00	351,900	
モロゾフ	300	6,730.00	2,019,000	
亀田製菓	1,000	5,880.00	5,880,000	
寿スピリッツ	1,600	5,830.00	9,328,000	
カルビー	7,500	3,970.00	29,775,000	貸付有価証券 5,100株
森永乳業	3,300	4,275.00	14,107,500	
六甲バター	1,100	2,364.00	2,600,400	
ヤクルト本社	9,600	7,160.00	68,736,000	
明治ホールディングス	10,800	9,270.00	100,116,000	
雪印メグミルク	4,000	3,010.00	12,040,000	
プリマハム	12,000	653.00	7,836,000	
日本ハム	7,100	4,475.00	31,772,500	
林兼産業	600	807.00	484,200	
丸大食品	9,000	501.00	4,509,000	
S Foods	1,200	4,490.00	5,388,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	10,500	1,029.00	10,804,500	
サッポロホールディングス	6,000	2,800.00	16,800,000	
アサヒグループホールディングス	34,400	5,696.00	195,942,400	
キリンホールディングス	79,000	3,095.00	244,505,000	
宝ホールディングス	12,300	1,295.00	15,928,500	
オエノンホールディングス	4,700	473.00	2,223,100	
養命酒製造	500	2,340.00	1,170,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,500	4,585.00	52,727,500	
サントリー食品インターナショナル	12,600	4,840.00	60,984,000	
ダイドーグループホールディングス	800	6,230.00	4,984,000	
伊藤園	5,400	4,475.00	24,165,000	
キーコーヒー	1,600	2,172.00	3,475,200	
ユニカフェ	600	1,120.00	672,000	

ジャパンフーズ	300	1,464.00	439,200	
日清オイリオグループ	1,900	3,110.00	5,909,000	
不二製油グループ本社	4,400	3,950.00	17,380,000	
かどや製油	200	6,150.00	1,230,000	
J・オイルミルズ	900	3,975.00	3,577,500	
キッコーマン	12,800	5,140.00	65,792,000	貸付有価証券 6,700株
味の素	37,800	2,079.50	78,605,100	
キューピー	9,100	2,631.00	23,942,100	
ハウス食品グループ本社	6,300	3,990.00	25,137,000	
カゴメ	6,600	3,780.00	24,948,000	
焼津水産化学工業	900	1,207.00	1,086,300	
アリアケジャパン	1,500	9,450.00	14,175,000	
ピエトロ	200	1,641.00	328,200	
エバラ食品工業	500	2,317.00	1,158,500	
ニチレイ	7,900	2,951.00	23,312,900	
東洋水産	9,000	3,885.00	34,965,000	
イトアンド	500	2,113.00	1,056,500	
大冷	100	1,995.00	199,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	300	979.00	293,700	貸付有価証券 200株
日清食品ホールディングス	7,200	8,100.00	58,320,000	
永谷園ホールディングス	2,000	1,495.00	2,990,000	
一正蒲鉾	600	1,405.00	843,000	
フジッコ	1,800	2,667.00	4,800,600	
ロック・フィールド	1,800	1,951.00	3,511,800	
日本たばこ産業	101,600	2,936.00	298,297,600	
ケンコーマヨネーズ	1,100	4,190.00	4,609,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,100	2,752.00	3,027,200	
なとり	900	1,866.00	1,679,400	
イフジ産業	300	778.00	233,400	
ピックルスコーポレーション	300	2,116.00	634,800	
北の達人コーポレーション	5,000	850.00	4,250,000	貸付有価証券 3,500株
ユーグレナ	6,500	887.00	5,765,500	貸付有価証券 4,500株
ミヨシ油脂	600	1,421.00	852,600	
理研ビタミン	600	4,320.00	2,592,000	
片倉工業	2,000	1,320.00	2,640,000	
グンゼ	1,300	7,000.00	9,100,000	
東洋紡	6,300	1,809.00	11,396,700	
ユニチカ	5,000	625.00	3,125,000	
富士紡ホールディングス	900	3,975.00	3,577,500	
倉敷紡績	17,000	374.00	6,358,000	

シキボウ	900	1,298.00	1,168,200	
日本毛織	4,800	1,065.00	5,112,000	
ダイトウボウ	2,400	99.00	237,600	
トーア紡コーポレーション	700	565.00	395,500	
ダイドーリミテッド	2,000	453.00	906,000	
帝国繊維	1,800	2,320.00	4,176,000	
帝人	14,100	2,112.00	29,779,200	
東レ	124,400	890.90	110,827,960	貸付有価証券 15,300株
サカイオーベックス	400	2,451.00	980,400	
住江織物	400	2,754.00	1,101,600	
日本フェルト	1,100	517.00	568,700	
イチカワ	1,000	359.00	359,000	
日東製網	100	1,711.00	171,100	
アツギ	1,100	1,202.00	1,322,200	
ダイニック	700	1,026.00	718,200	
セーレン	3,900	2,002.00	7,807,800	
ソトー	700	1,033.00	723,100	
東海染工	200	1,448.00	289,600	
小松精練	2,600	973.00	2,529,800	
ワコールホールディングス	4,700	3,240.00	15,228,000	
ホギメディカル	2,200	4,945.00	10,879,000	
レナウン	4,600	150.00	690,000	貸付有価証券 3,200株
T S Iホールディングス	5,900	762.00	4,495,800	
マツオカコーポレーション	400	4,285.00	1,714,000	
三陽商会	900	2,362.00	2,125,800	
ナイガイ	600	571.00	342,600	
オンワードホールディングス	10,000	891.00	8,910,000	
ルックホールディングス	3,000	304.00	912,000	
キムラタン	7,500	40.00	300,000	貸付有価証券 4,900株
ゴールドウイン	1,000	9,010.00	9,010,000	
デサント	3,900	2,094.00	8,166,600	
キング	800	514.00	411,200	
ヤマトインターナショナル	1,200	605.00	726,000	
特種東海製紙	900	4,240.00	3,816,000	
王子ホールディングス	72,000	715.00	51,480,000	
日本製紙	7,700	1,833.00	14,114,100	貸付有価証券 5,300株
三菱製紙	2,600	640.00	1,664,000	
北越紀州製紙	9,500	590.00	5,605,000	
中越パルプ工業	700	1,813.00	1,269,100	
巴川製紙所	2,000	257.00	514,000	

大王製紙	6,800	1,560.00	10,608,000	
阿波製紙	200	624.00	124,800	
レンゴー	16,400	966.00	15,842,400	
トーモク	1,000	2,147.00	2,147,000	
ザ・パック	1,200	3,795.00	4,554,000	
クラレ	28,800	1,668.00	48,038,400	
旭化成	106,900	1,495.50	159,868,950	
共和レザー	1,100	1,001.00	1,101,100	
昭和電工	11,400	4,705.00	53,637,000	
住友化学	126,000	659.00	83,034,000	
住友精化	700	4,995.00	3,496,500	
日産化学工業	10,000	5,120.00	51,200,000	
ラサ工業	600	2,561.00	1,536,600	
クレハ	1,500	7,300.00	10,950,000	
多木化学	200	4,830.00	966,000	
テイカ	1,300	2,556.00	3,322,800	
石原産業	3,100	1,201.00	3,723,100	
片倉コープアグリ	500	1,215.00	607,500	
日東エフシー	1,100	743.00	817,300	
日本曹達	12,000	603.00	7,236,000	
東ソー	24,800	1,910.00	47,368,000	
トクヤマ	5,000	3,885.00	19,425,000	
セントラル硝子	3,500	2,419.00	8,466,500	
東亜合成	10,000	1,270.00	12,700,000	
大阪ソーダ	1,700	3,155.00	5,363,500	貸付有価証券 1,100株
関東電化工業	4,100	1,128.00	4,624,800	
デンカ	6,300	3,995.00	25,168,500	
信越化学工業	28,500	10,890.00	310,365,000	
日本カーバイド工業	500	1,989.00	994,500	
堺化学工業	1,200	2,785.00	3,342,000	
エア・ウォーター	14,100	2,118.00	29,863,800	
太陽日酸	13,200	1,614.00	21,304,800	
日本化学工業	600	4,825.00	2,895,000	
日本パーカラライジング	8,800	1,618.00	14,238,400	
高圧ガス工業	2,500	957.00	2,392,500	
四国化成工業	2,500	1,520.00	3,800,000	
戸田工業	300	2,894.00	868,200	
ステラ ケミファ	900	3,565.00	3,208,500	貸付有価証券 300株
保土谷化学工業	600	3,690.00	2,214,000	
日本触媒	2,700	8,390.00	22,653,000	
大日精化工業	1,300	3,785.00	4,920,500	

カネカ	23,000	1,120.00	25,760,000
三菱瓦斯化学	14,100	2,781.00	39,212,100
三井化学	15,600	3,150.00	49,140,000
J S R	17,200	2,124.00	36,532,800
東京応化工業	3,000	4,130.00	12,390,000
大阪有機化学工業	1,500	1,444.00	2,166,000
三菱ケミカルホールディングス	114,800	1,008.00	115,718,400
K Hネオケム	2,600	2,939.00	7,641,400
ダイセル	23,100	1,232.00	28,459,200
住友ベークライト	14,000	1,107.00	15,498,000
積水化学工業	35,600	1,788.00	63,652,800
日本ゼオン	14,500	1,382.00	20,039,000
アイカ工業	4,800	4,070.00	19,536,000
宇部興産	8,600	3,095.00	26,617,000
積水樹脂	2,600	2,273.00	5,909,800
タキロンシーアイ	3,500	682.00	2,387,000
旭有機材	1,000	2,079.00	2,079,000
日立化成	8,500	2,346.00	19,941,000
ニチバン	800	2,881.00	2,304,800
リケンテクノス	3,700	540.00	1,998,000
大倉工業	4,000	529.00	2,116,000
積水化成品工業	2,200	1,274.00	2,802,800
群栄化学工業	400	3,470.00	1,388,000
タイガースポリマー	1,000	778.00	778,000
ミライアル	600	1,544.00	926,400
ダイキアクシス	500	1,389.00	694,500
ダイキョーニシカワ	3,400	1,762.00	5,990,800
竹本容器	300	3,395.00	1,018,500
森六ホールディングス	900	3,020.00	2,718,000
日本化薬	11,100	1,196.00	13,275,600
カーリットホールディングス	1,600	1,106.00	1,769,600
日本精化	1,500	1,165.00	1,747,500
扶桑化学工業	1,600	2,789.00	4,462,400
トリケミカル研究所	400	4,550.00	1,820,000
A D E K A	7,400	1,963.00	14,526,200
日油	6,600	3,310.00	21,846,000
新日本理化	2,900	248.00	719,200
ハリマ化成グループ	1,300	869.00	1,129,700
花王	40,300	8,442.00	340,212,600
第一工業製薬	3,000	727.00	2,181,000
石原ケミカル	400	1,985.00	794,000
日華化学	600	1,173.00	703,800

ニイタカ	200	1,789.00	357,800	
三洋化成工業	1,100	5,250.00	5,775,000	
有機合成薬品工業	1,200	288.00	345,600	
大日本塗料	2,000	1,532.00	3,064,000	
日本ペイントホールディングス	13,200	4,555.00	60,126,000	貸付有価証券 9,100株
関西ペイント	18,000	2,336.00	42,048,000	貸付有価証券 400株
中国塗料	4,900	1,064.00	5,213,600	
日本特殊塗料	1,100	2,068.00	2,274,800	
藤倉化成	2,200	697.00	1,533,400	
太陽ホールディングス	1,300	4,470.00	5,811,000	
D I C	6,800	3,555.00	24,174,000	
サカタインクス	3,500	1,534.00	5,369,000	
東洋インキＳＣホールディングス	17,000	610.00	10,370,000	
T & K T O K A	1,100	1,220.00	1,342,000	
富士フイルムホールディングス	34,000	4,182.00	142,188,000	
資生堂	30,500	8,626.00	263,093,000	
ライオン	22,800	1,993.00	45,440,400	
高砂香料工業	1,000	3,450.00	3,450,000	
マンダム	3,200	3,550.00	11,360,000	
ミルボン	2,200	5,270.00	11,594,000	
ファンケル	4,000	5,030.00	20,120,000	
コーセー	2,800	23,670.00	66,276,000	
コタ	800	1,513.00	1,210,400	
シーズ・ホールディングス	2,000	6,190.00	12,380,000	
シーボン	200	3,000.00	600,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,000	5,390.00	37,730,000	
ノエビアホールディングス	1,000	8,080.00	8,080,000	
アジュバンコスメジャパン	400	968.00	387,200	
エステー	1,200	2,677.00	3,212,400	
アグロ カネショウ	700	2,767.00	1,936,900	
コニシ	2,700	1,832.00	4,946,400	
長谷川香料	2,000	2,209.00	4,418,000	
星光P M C	1,000	1,160.00	1,160,000	
小林製薬	4,600	9,610.00	44,206,000	
荒川化学工業	1,500	1,830.00	2,745,000	
メック	1,100	2,305.00	2,535,500	
日本高純度化学	500	2,427.00	1,213,500	
タカラバイオ	4,300	2,539.00	10,917,700	
J C U	2,000	2,566.00	5,132,000	
新田ゼラチン	1,100	854.00	939,400	
O A T アグリオ	200	3,410.00	682,000	

デクセリアルズ	4,200	1,089.00	4,573,800	
アース製薬	1,200	5,680.00	6,816,000	
北興化学工業	1,700	677.00	1,150,900	
大成ラミック	500	3,110.00	1,555,000	
クミアイ化学工業	7,500	682.00	5,115,000	
日本農薬	3,900	689.00	2,687,100	
アキレス	1,300	2,271.00	2,952,300	
有沢製作所	2,800	1,177.00	3,295,600	
日東電工	12,400	8,559.00	106,131,600	
レック	1,000	4,190.00	4,190,000	
きもと	3,200	304.00	972,800	
藤森工業	1,400	3,780.00	5,292,000	
前澤化成工業	1,100	1,201.00	1,321,100	
ウェーブロックホールディングス	400	1,230.00	492,000	
J S P	1,000	3,390.00	3,390,000	
エフピコ	1,300	6,310.00	8,203,000	
天馬	1,300	1,903.00	2,473,900	
信越ポリマー	3,400	1,089.00	3,702,600	
東リ	4,200	353.00	1,482,600	
ニフコ	6,000	3,755.00	22,530,000	
日本バルカー工業	1,300	3,320.00	4,316,000	
ユニ・チャーム	34,700	3,381.00	117,320,700	
協和発酵キリン	20,500	2,228.00	45,674,000	
武田薬品工業	60,300	4,452.00	268,455,600	貸付有価証券 42,000株
アステラス製薬	168,200	1,664.50	279,968,900	
大日本住友製薬	12,100	2,263.00	27,382,300	貸付有価証券 7,000株
塩野義製薬	23,100	5,714.00	131,993,400	
田辺三菱製薬	20,000	1,950.00	39,000,000	
わかもと製薬	2,400	294.00	705,600	
あすか製薬	1,900	1,283.00	2,437,700	
日本新薬	4,300	7,810.00	33,583,000	
バイオフェルミン製薬	200	2,872.00	574,400	
中外製薬	17,000	6,150.00	104,550,000	
科研製薬	3,000	6,030.00	18,090,000	
エーザイ	19,600	7,877.00	154,389,200	
ロート製薬	9,000	3,515.00	31,635,000	
小野薬品工業	38,700	2,699.50	104,470,650	
久光製薬	4,800	9,060.00	43,488,000	
持田製薬	1,100	7,740.00	8,514,000	
参天製薬	31,000	1,897.00	58,807,000	
扶桑薬品工業	600	2,909.00	1,745,400	

日本ケミファ	200	4,575.00	915,000	
ツムラ	5,800	3,965.00	22,997,000	
日医工	4,300	1,671.00	7,185,300	貸付有価証券 2,400株
キッセイ薬品工業	2,900	2,948.00	8,549,200	
生化学工業	3,200	1,543.00	4,937,600	
栄研化学	2,700	2,461.00	6,644,700	
日水製薬	700	1,405.00	983,500	
鳥居薬品	1,000	2,811.00	2,811,000	
JCRファーマ	1,100	6,930.00	7,623,000	
東和薬品	800	6,820.00	5,456,000	
富士製薬工業	600	4,005.00	2,403,000	
沢井製薬	3,300	4,785.00	15,790,500	
ゼリア新薬工業	3,500	2,244.00	7,854,000	
第一三共	46,900	3,495.00	163,915,500	
キョーリン製薬ホールディングス	4,600	2,270.00	10,442,000	
大幸薬品	900	2,063.00	1,856,700	
ダイト	1,000	3,615.00	3,615,000	
大塚ホールディングス	34,000	5,419.00	184,246,000	
大正製薬ホールディングス	3,700	11,570.00	42,809,000	
ペプチドリーム	7,500	4,730.00	35,475,000	
日本コークス工業	14,000	112.00	1,568,000	
昭和シェル石油	15,300	1,448.00	22,154,400	
ニチレキ	2,100	1,228.00	2,578,800	
ユシロ化学工業	900	1,633.00	1,469,700	
ビーピー・カストロール	700	1,665.00	1,165,500	
富士石油	4,100	380.00	1,558,000	
MORESCO	600	1,939.00	1,163,400	
出光興産	13,700	3,655.00	50,073,500	
JXTGホールディングス	261,300	702.90	183,667,770	
コスモエネルギーホールディングス	4,700	3,705.00	17,413,500	
横浜ゴム	9,500	2,370.00	22,515,000	
東洋ゴム工業	9,700	1,688.00	16,373,600	
ブリヂストン	54,200	4,365.00	236,583,000	
住友ゴム工業	16,900	1,825.00	30,842,500	
藤倉ゴム工業	1,400	703.00	984,200	
オカモト	6,000	1,145.00	6,870,000	
フコク	900	971.00	873,900	
ニッタ	1,700	4,165.00	7,080,500	
住友理工	3,200	1,135.00	3,632,000	
三ツ星ベルト	4,000	1,319.00	5,276,000	
バンドー化学	3,100	1,301.00	4,033,100	
日東紡績	2,400	2,497.00	5,992,800	

旭硝子	16,500	4,460.00	73,590,000	
日本板硝子	8,200	1,095.00	8,979,000	
石塚硝子	200	2,478.00	495,600	
日本山村硝子	7,000	178.00	1,246,000	
日本電気硝子	7,100	2,952.00	20,959,200	
オハラ	700	2,198.00	1,538,600	
住友大阪セメント	32,000	511.00	16,352,000	
太平洋セメント	10,300	4,030.00	41,509,000	
日本ヒューム	1,600	841.00	1,345,600	
日本コンクリート工業	3,500	368.00	1,288,000	
三谷セキサン	800	2,642.00	2,113,600	
アジアパイルホールディングス	2,100	678.00	1,423,800	
東海カーボン	14,900	2,233.00	33,271,700	
日本カーボン	800	6,400.00	5,120,000	
東洋炭素	1,100	3,740.00	4,114,000	
ノリタケカンパニーリミテド	900	5,460.00	4,914,000	
TOTO	12,600	5,700.00	71,820,000	
日本碍子	20,000	1,987.00	39,740,000	
日本特殊陶業	14,000	2,980.00	41,720,000	
ダントーホールディングス	2,300	145.00	333,500	
MARUWA	600	8,700.00	5,220,000	
品川リフラクトリーズ	400	3,475.00	1,390,000	
黒崎播磨	300	5,720.00	1,716,000	
ヨータイ	1,300	700.00	910,000	貸付有価証券 900株
イソライト工業	1,100	741.00	815,100	
東京窯業	2,500	388.00	970,000	
ニッカトー	700	1,053.00	737,100	
フジミインコーポレーテッド	1,500	2,674.00	4,011,000	
クニミネ工業	400	1,009.00	403,600	
エーアンドエーマテリアル	500	1,260.00	630,000	
ニチアス	9,000	1,368.00	12,312,000	
ニチハ	2,500	4,345.00	10,862,500	
新日鐵住金	72,400	2,282.50	165,253,000	
神戸製鋼所	29,600	1,093.00	32,352,800	
中山製鋼所	2,300	685.00	1,575,500	
合同製鐵	900	2,291.00	2,061,900	
ジェイ エフ イー ホールディングス	43,600	2,252.00	98,187,200	
日新製鋼	4,500	1,595.00	7,177,500	
東京製鐵	8,700	885.00	7,699,500	
共英製鋼	1,800	2,079.00	3,742,200	貸付有価証券 1,100株
大和工業	3,400	3,390.00	11,526,000	

東京鐵鋼	700	1,592.00	1,114,400	
大阪製鐵	1,100	2,190.00	2,409,000	
淀川製鋼所	2,400	2,796.00	6,710,400	
東洋鋼鈹	4,100	716.00	2,935,600	
丸一鋼管	5,700	3,605.00	20,548,500	
モリ工業	500	3,355.00	1,677,500	
大同特殊鋼	2,900	5,120.00	14,848,000	
日本高周波鋼業	700	798.00	558,600	
日本冶金工業	13,300	330.00	4,389,000	
山陽特殊製鋼	1,900	2,799.00	5,318,100	貸付有価証券 300株
愛知製鋼	900	4,370.00	3,933,000	
日立金属	17,500	1,198.00	20,965,000	
日本金属	400	1,937.00	774,800	
大平洋金属	1,000	3,640.00	3,640,000	
新日本電工	9,700	327.00	3,171,900	貸付有価証券 6,700株
栗本鐵工所	900	1,966.00	1,769,400	
虹技	200	1,984.00	396,800	
日本鑄鉄管	1,000	163.00	163,000	
三菱製鋼	1,200	2,268.00	2,721,600	
日垂鋼業	2,300	334.00	768,200	
日本精線	300	4,485.00	1,345,500	
シンニッタン	2,600	467.00	1,214,200	
新家工業	400	2,121.00	848,400	
大紀アルミニウム工業所	2,700	717.00	1,935,900	
日本輕金属ホールディングス	47,200	254.00	11,988,800	
三井金属鋅業	4,400	4,770.00	20,988,000	
東邦亜鉛	900	4,285.00	3,856,500	
三菱マテリアル	10,700	3,025.00	32,367,500	
住友金属鋁山	20,700	4,166.00	86,236,200	
D O W Aホールディングス	4,100	3,445.00	14,124,500	
古河機械金属	2,700	1,601.00	4,322,700	
エス・サイエンス	7,600	76.00	577,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,700	1,903.00	3,235,100	
東邦チタニウム	2,900	1,157.00	3,355,300	
U A C J	2,400	2,477.00	5,944,800	貸付有価証券 1,600株
C Kサンエツ	300	3,795.00	1,138,500	
古河電氣工業	5,400	4,210.00	22,734,000	
住友電氣工業	60,500	1,644.50	99,492,250	
フジクラ	19,500	742.00	14,469,000	
昭和電線ホールディングス	2,100	794.00	1,667,400	

東京特殊電線	200	2,749.00	549,800	
タツタ電線	3,200	606.00	1,939,200	
カナレ電気	200	2,460.00	492,000	
平河ヒューテック	800	1,336.00	1,068,800	
リョービ	2,000	3,295.00	6,590,000	
アーレスティ	2,000	976.00	1,952,000	
アサヒホールディングス	2,800	2,003.00	5,608,400	
稲葉製作所	900	1,429.00	1,286,100	
宮地エンジニアリンググループ	400	2,018.00	807,200	
トーカロ	4,500	1,325.00	5,962,500	
アルファC o	600	1,701.00	1,020,600	
SUMCO	14,900	2,649.00	39,470,100	
川田テクノロジーズ	300	6,370.00	1,911,000	
RS Technologies	300	6,540.00	1,962,000	
東洋製罐グループホールディングス	11,100	1,827.00	20,279,700	
ホッカンホールディングス	4,000	361.00	1,444,000	
コロナ	900	1,264.00	1,137,600	
横河ブリッジホールディングス	3,000	2,501.00	7,503,000	
駒井ハルテック	300	2,296.00	688,800	
高田機工	100	3,110.00	311,000	
三和ホールディングス	15,500	1,191.00	18,460,500	
文化シャッター	4,800	989.00	4,747,200	
三協立山	2,200	1,543.00	3,394,600	
アルインコ	1,100	1,073.00	1,180,300	
東洋シャッター	500	653.00	326,500	
LIXILグループ	23,800	2,406.00	57,262,800	
日本フィルコン	1,300	601.00	781,300	
ノーリツ	3,600	1,897.00	6,829,200	
長府製作所	1,800	2,497.00	4,494,600	
リンナイ	2,900	10,400.00	30,160,000	
ダイニチ工業	900	808.00	727,200	
日東精工	2,200	743.00	1,634,600	
三洋工業	200	2,126.00	425,200	
岡部	3,300	971.00	3,204,300	
ジーテクト	1,800	1,865.00	3,357,000	
中国工業	200	680.00	136,000	貸付有価証券 100株
東プレ	3,000	3,030.00	9,090,000	
高周波熱錬	3,100	991.00	3,072,100	
東京製綱	1,200	2,029.00	2,434,800	
サンコール	1,100	702.00	772,200	
モリテック スチール	1,300	651.00	846,300	貸付有価証券 900株

パイオラックス	2,400	2,751.00	6,602,400	
エイチワン	1,600	1,209.00	1,934,400	
日本発條	16,100	1,073.00	17,275,300	
中央発條	200	3,645.00	729,000	
アドバネクス	400	2,199.00	879,600	
立川ブラインド工業	700	1,331.00	931,700	
三益半導体工業	1,300	1,849.00	2,403,700	
日本ドライケミカル	200	2,272.00	454,400	
日本製鋼所	5,300	3,070.00	16,271,000	
三浦工業	7,000	2,892.00	20,244,000	
タクマ	5,500	1,258.00	6,919,000	
ツガミ	4,000	1,135.00	4,540,000	
オークマ	1,900	6,370.00	12,103,000	
東芝機械	9,000	609.00	5,481,000	
アマダホールディングス	25,000	1,184.00	29,600,000	
アイダエンジニアリング	4,100	1,303.00	5,342,300	
滝澤鉄工所	600	1,905.00	1,143,000	
F U J I	4,800	2,227.00	10,689,600	
牧野フライス製作所	8,000	972.00	7,776,000	
オーエスジー	7,500	2,277.00	17,077,500	
ダイジェット工業	200	1,758.00	351,600	
旭ダイヤモンド工業	4,800	870.00	4,176,000	
D M G 森精機	9,000	1,830.00	16,470,000	
ソディック	3,500	1,110.00	3,885,000	
ディスコ	2,200	20,550.00	45,210,000	
日東工器	1,000	2,674.00	2,674,000	
日進工具	400	2,767.00	1,106,800	
パンチ工業	1,300	1,222.00	1,588,600	
富士ダイス	800	871.00	696,800	
豊和工業	900	1,061.00	954,900	
O K K	700	1,216.00	851,200	
石川製作所	400	2,135.00	854,000	貸付有価証券 200株
東洋機械金属	1,300	725.00	942,500	
津田駒工業	500	2,222.00	1,111,000	
エンシュウ	5,000	170.00	850,000	貸付有価証券 2,000株
島精機製作所	2,000	6,180.00	12,360,000	
オプトラン	1,600	3,710.00	5,936,000	貸付有価証券 1,100株
N C ホールディングス	600	775.00	465,000	
フリュー	1,100	980.00	1,078,000	
ヤマシンフィルタ	2,400	1,237.00	2,968,800	貸付有価証券 1,400株

日阪製作所	2,300	1,082.00	2,488,600	
やまびこ	3,100	1,436.00	4,451,600	
平田機工	600	7,970.00	4,782,000	貸付有価証券 400株
ペガサスミシン製造	1,600	938.00	1,500,800	
ナブテスコ	8,900	3,560.00	31,684,000	
三井海洋開発	1,700	2,957.00	5,026,900	
レオン自動機	1,400	2,237.00	3,131,800	
S M C	5,100	41,430.00	211,293,000	
新川	1,300	929.00	1,207,700	
ホソカワミクロン	600	6,830.00	4,098,000	
ユニオンツール	700	3,840.00	2,688,000	
オイレス工業	2,100	2,325.00	4,882,500	
日精エー・エス・ビー機械	500	5,190.00	2,595,000	
サトーホールディングス	2,100	2,940.00	6,174,000	
技研製作所	1,100	2,590.00	2,849,000	
日本エアータック	600	869.00	521,400	
カワタ	300	1,556.00	466,800	
日精樹脂工業	1,400	1,343.00	1,880,200	
オカダアイヨン	400	1,622.00	648,800	貸付有価証券 200株
ワイエイシイホールディングス	700	903.00	632,100	
小松製作所	79,000	3,587.00	283,373,000	
住友重機械工業	9,400	3,850.00	36,190,000	
日立建機	7,700	4,020.00	30,954,000	
日工	500	2,545.00	1,272,500	
巴工業	700	2,259.00	1,581,300	
井関農機	1,600	1,980.00	3,168,000	
T O W A	1,300	1,352.00	1,757,600	
丸山製作所	400	1,899.00	759,600	
北川鉄工所	800	2,761.00	2,208,800	
ローツェ	800	2,448.00	1,958,400	貸付有価証券 500株
タカキタ	600	779.00	467,400	
クボタ	87,800	1,833.00	160,937,400	
荏原実業	500	2,318.00	1,159,000	
三菱化工機	600	2,103.00	1,261,800	
月島機械	3,200	1,809.00	5,788,800	
帝国電機製作所	1,200	1,369.00	1,642,800	
東京機械製作所	700	470.00	329,000	
新東工業	3,900	1,034.00	4,032,600	
澁谷工業	1,400	3,655.00	5,117,000	
アイチ コーポレーション	2,800	719.00	2,013,200	

小森コーポレーション	4,100	1,349.00	5,530,900
鶴見製作所	1,400	1,929.00	2,700,600
住友精密工業	3,000	377.00	1,131,000
酒井重工業	300	4,060.00	1,218,000
荏原製作所	6,700	3,755.00	25,158,500
石井鐵工所	200	2,031.00	406,200
西島製作所	1,700	981.00	1,667,700
北越工業	1,900	1,082.00	2,055,800
ダイキン工業	22,300	12,580.00	280,534,000
オルガノ	600	3,080.00	1,848,000
トーヨーカネツ	700	3,795.00	2,656,500
栗田工業	8,900	3,130.00	27,857,000
椿本チエイン	10,000	851.00	8,510,000
大同工業	700	1,488.00	1,041,600
木村化工機	1,700	441.00	749,700
アネスト岩田	2,800	1,098.00	3,074,400
ダイフク	8,300	5,650.00	46,895,000
サムコ	500	1,283.00	641,500
加藤製作所	800	2,816.00	2,252,800
油研工業	400	2,778.00	1,111,200
タダノ	7,900	1,499.00	11,842,100
フジテック	5,200	1,444.00	7,508,800
C K D	4,500	2,263.00	10,183,500
キトー	1,200	2,385.00	2,862,000
平和	5,100	2,499.00	12,744,900
理想科学工業	1,600	2,433.00	3,892,800
S A N K Y O	4,100	4,315.00	17,691,500
日本金銭機械	1,500	1,176.00	1,764,000
マースエンジニアリング	1,000	2,695.00	2,695,000
福島工業	1,000	4,815.00	4,815,000
オーイズミ	700	566.00	396,200
ダイコク電機	700	1,886.00	1,320,200
竹内製作所	2,700	2,494.00	6,733,800
アマノ	5,100	2,714.00	13,841,400
J U K I	2,400	1,209.00	2,901,600
サンデンホールディングス	2,000	1,458.00	2,916,000
蛇の目ミシン工業	1,500	696.00	1,044,000
マックス	2,500	1,435.00	3,587,500
グローリー	4,900	3,225.00	15,802,500
新晃工業	1,700	1,988.00	3,379,600
大和冷機工業	2,600	1,272.00	3,307,200
セガサミーホールディングス	16,200	1,924.00	31,168,800

日本ピストンリング	600	2,213.00	1,327,800	
リケン	800	5,520.00	4,416,000	
T P R	1,800	2,812.00	5,061,600	
ツバキ・ナカシマ	1,600	2,722.00	4,355,200	
ホシザキ	5,200	10,930.00	56,836,000	
大豊工業	1,300	1,395.00	1,813,500	
日本精工	33,600	1,239.00	41,630,400	
N T N	37,900	464.00	17,585,600	
ジェイテクト	17,400	1,587.00	27,613,800	
不二越	1,500	5,220.00	7,830,000	
日本トムソン	5,200	857.00	4,456,400	
T H K	10,200	3,870.00	39,474,000	
ユーシン精機	1,400	1,381.00	1,933,400	
前澤給装工業	600	1,898.00	1,138,800	
イーグル工業	2,000	1,799.00	3,598,000	
前澤工業	1,200	468.00	561,600	
日本ピラー工業	1,700	1,638.00	2,784,600	
キッツ	6,700	973.00	6,519,100	
マキタ	21,300	4,860.00	103,518,000	
日立造船	13,000	558.00	7,254,000	
三菱重工業	27,400	4,120.00	112,888,000	
I H I	12,600	4,095.00	51,597,000	
スター精密	2,600	1,828.00	4,752,800	
日清紡ホールディングス	10,000	1,320.00	13,200,000	
イビデン	10,000	1,693.00	16,930,000	貸付有価証券 7,000株
コニカミノルタ	38,300	994.00	38,070,200	
ブラザー工業	20,000	2,280.00	45,600,000	
ミネベアミツミ	30,400	2,068.00	62,867,200	
日立製作所	393,000	796.60	313,063,800	
三菱電機	163,700	1,545.00	252,916,500	貸付有価証券 3,900株
富士電機	49,000	777.00	38,073,000	
東洋電機製造	600	1,742.00	1,045,200	
安川電機	19,000	4,400.00	83,600,000	貸付有価証券 12,200株
シンフォニアテクノロジー	11,000	426.00	4,686,000	
明電舎	14,000	408.00	5,712,000	
オリジン電気	500	2,298.00	1,149,000	
山洋電気	800	9,100.00	7,280,000	
デンヨー	1,500	1,961.00	2,941,500	
東芝テック	12,000	657.00	7,884,000	
芝浦メカトロニクス	2,000	403.00	806,000	

マブチモーター	4,500	5,050.00	22,725,000	
日本電産	19,700	16,885.00	332,634,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	600	2,934.00	1,760,400	
トレックス・セミコンダクター	500	1,435.00	717,500	
東光高岳	800	1,912.00	1,529,600	
ダブル・スコープ	2,400	1,872.00	4,492,800	貸付有価証券 900株
ダイヘン	9,000	773.00	6,957,000	
田淵電機	2,600	257.00	668,200	
ヤーマン	2,400	2,606.00	6,254,400	
JVCケンウッド	12,000	361.00	4,332,000	
ミマキエンジニアリング	1,500	919.00	1,378,500	
第一精工	800	2,013.00	1,610,400	
日新電機	3,800	1,025.00	3,895,000	
大崎電気工業	3,500	835.00	2,922,500	
オムロン	17,400	5,730.00	99,702,000	
日東工業	2,600	2,059.00	5,353,400	
I D E C	2,000	2,741.00	5,482,000	
不二電機工業	400	1,406.00	562,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	29,000	516.00	14,964,000	
サクサホールディングス	500	2,288.00	1,144,000	
メルコホールディングス	800	4,200.00	3,360,000	
テクノメディカ	400	2,011.00	804,400	
日本電気	21,200	3,070.00	65,084,000	
富士通	168,000	666.70	112,005,600	
沖電気工業	6,600	1,243.00	8,203,800	
岩崎通信機	800	822.00	657,600	
電気興業	900	3,070.00	2,763,000	
サンケン電気	10,000	645.00	6,450,000	
ナカヨ	500	1,882.00	941,000	
アイホン	1,000	1,853.00	1,853,000	
ルネサスエレクトロニクス	8,500	1,082.00	9,197,000	
セイコーエプソン	24,400	1,909.00	46,579,600	
ワコム	12,800	610.00	7,808,000	
アルバック	3,800	4,845.00	18,411,000	
アクセル	700	962.00	673,400	
E I Z O	1,500	4,670.00	7,005,000	
ジャパンディスプレイ	33,600	124.00	4,166,400	貸付有価証券 23,500株
日本信号	4,500	1,006.00	4,527,000	
京三製作所	3,900	771.00	3,006,900	
能美防災	2,200	2,647.00	5,823,400	
ホーチキ	1,200	2,227.00	2,672,400	

星和電機	600	607.00	364,200	
エレコム	1,400	2,813.00	3,938,200	
パナソニック	187,000	1,489.50	278,536,500	
シャープ	15,200	2,896.00	44,019,200	貸付有価証券 10,600株
アンリツ	11,900	1,459.00	17,362,100	
富士通ゼネラル	5,000	1,695.00	8,475,000	貸付有価証券 3,500株
ソニー	109,500	5,160.00	565,020,000	
T D K	8,600	9,780.00	84,108,000	
帝国通信工業	700	1,279.00	895,300	
タムラ製作所	6,300	796.00	5,014,800	
アルプス電気	14,100	2,584.00	36,434,400	
池上通信機	6,000	153.00	918,000	
パイオニア	27,200	155.00	4,216,000	貸付有価証券 18,800株
日本電波工業	1,500	620.00	930,000	
鈴木	900	1,022.00	919,800	
日本トリム	400	4,505.00	1,802,000	
ローランド ディー . ジー .	800	2,406.00	1,924,800	
フォスター電機	1,900	1,669.00	3,171,100	
クラリオン	9,000	284.00	2,556,000	
S M K	4,000	405.00	1,620,000	
ヨコオ	1,100	2,057.00	2,262,700	
ホシデン	4,100	1,048.00	4,296,800	
ヒロセ電機	2,800	14,170.00	39,676,000	
日本航空電子工業	4,000	1,815.00	7,260,000	
T O A	1,800	1,164.00	2,095,200	
マクセルホールディングス	3,200	1,792.00	5,734,400	
古野電気	1,900	944.00	1,793,600	
ユニデンホールディングス	4,000	337.00	1,348,000	
アルパイン	3,900	2,079.00	8,108,100	貸付有価証券 2,700株
スミダコーポレーション	1,700	1,201.00	2,041,700	
アイコム	900	2,726.00	2,453,400	
リオン	700	2,348.00	1,643,600	
本多通信工業	1,300	931.00	1,210,300	
船井電機	1,600	664.00	1,062,400	貸付有価証券 1,100株
横河電機	16,400	1,989.00	32,619,600	
新電元工業	600	6,170.00	3,702,000	
アズビル	4,900	5,330.00	26,117,000	
東亜ディーケーケー	700	1,241.00	868,700	
日本光電工業	6,800	3,020.00	20,536,000	

チノー	700	1,639.00	1,147,300	
共和電業	2,000	445.00	890,000	
日本電子材料	800	966.00	772,800	
堀場製作所	3,200	9,060.00	28,992,000	
アドバンテスト	9,100	2,557.00	23,268,700	
小野測器	800	865.00	692,000	
エスペック	1,400	2,390.00	3,346,000	
キーエンス	8,000	66,830.00	534,640,000	
日置電機	900	4,285.00	3,856,500	
シスメックス	12,700	9,810.00	124,587,000	
日本マイクロニクス	2,600	1,142.00	2,969,200	
メガチップス	1,300	3,170.00	4,121,000	貸付有価証券 900株
O B A R A G R O U P	1,000	6,340.00	6,340,000	
澤藤電機	200	2,292.00	458,400	
コーセル	2,300	1,384.00	3,183,200	
イリソ電子工業	1,400	6,760.00	9,464,000	
新日本無線	1,400	850.00	1,190,000	貸付有価証券 900株
オブテックスグループ	2,700	3,050.00	8,235,000	貸付有価証券 400株
千代田インテグレ	800	2,370.00	1,896,000	
アイ・オー・データ機器	600	1,196.00	717,600	
レーザーテック	3,300	3,715.00	12,259,500	
スタンレー電気	12,500	3,715.00	46,437,500	
岩崎電気	600	1,600.00	960,000	
ウシオ電機	9,900	1,400.00	13,860,000	
岡谷電機産業	1,400	523.00	732,200	貸付有価証券 900株
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	731.00	1,023,400	貸付有価証券 900株
日本セラミック	1,700	2,687.00	4,567,900	
遠藤照明	800	962.00	769,600	
古河電池	1,200	913.00	1,095,600	
双信電機	800	577.00	461,600	貸付有価証券 500株
山一電機	1,200	1,775.00	2,130,000	貸付有価証券 800株
図研	1,100	1,755.00	1,930,500	
日本電子	6,000	1,135.00	6,810,000	
カシオ計算機	13,100	1,665.00	21,811,500	
ファナック	15,600	23,270.00	363,012,000	
日本シイエムケイ	2,900	692.00	2,006,800	
エンプラス	700	3,200.00	2,240,000	
大真空	600	1,341.00	804,600	

ローム	7,400	10,090.00	74,666,000	
浜松ホトニクス	11,800	4,725.00	55,755,000	
三井ハイテック	2,200	1,482.00	3,260,400	貸付有価証券 1,400株
新光電気工業	6,100	920.00	5,612,000	
京セラ	26,900	6,456.00	173,666,400	
太陽誘電	7,400	2,452.00	18,144,800	
村田製作所	17,200	16,185.00	278,382,000	
ユーシン	2,500	737.00	1,842,500	
双葉電子工業	2,700	1,978.00	5,340,600	
北陸電気工業	600	1,304.00	782,400	
ニチコン	5,100	1,355.00	6,910,500	
日本ケミコン	1,300	4,110.00	5,343,000	
K O A	2,300	2,281.00	5,246,300	
市光工業	2,400	1,453.00	3,487,200	
小糸製作所	9,800	8,010.00	78,498,000	
ミツバ	3,000	1,110.00	3,330,000	
S C R E E Nホールディングス	3,100	9,260.00	28,706,000	
キャノン電子	1,500	2,376.00	3,564,000	
キャノン	88,100	3,714.00	327,203,400	
リコー	49,200	986.00	48,511,200	
象印マホービン	3,000	1,645.00	4,935,000	
M U T O Hホールディングス	200	2,413.00	482,600	
東京エレクトロン	10,900	20,400.00	222,360,000	
トヨタ紡織	4,700	2,068.00	9,719,600	
芦森工業	400	2,586.00	1,034,400	
ユニプレス	3,200	2,315.00	7,408,000	
豊田自動織機	13,200	6,360.00	83,952,000	
モリタホールディングス	2,600	2,193.00	5,701,800	
三櫻工業	2,100	719.00	1,509,900	
デンソー	36,300	5,290.00	192,027,000	
東海理化電機製作所	4,300	2,038.00	8,763,400	
三井E & Sホールディングス	5,900	1,456.00	8,590,400	
川崎重工業	12,700	3,305.00	41,973,500	
名村造船所	4,900	520.00	2,548,000	
サノヤスホールディングス	2,400	248.00	595,200	
日本車輛製造	6,000	270.00	1,620,000	
三菱ロジスネクスト	1,900	1,163.00	2,209,700	
近畿車輛	200	2,471.00	494,200	
日産自動車	193,200	1,080.50	208,752,600	
いすゞ自動車	47,500	1,459.00	69,302,500	
トヨタ自動車	199,000	6,921.00	1,377,279,000	代用有価証券 2,900株

日野自動車	23,400	1,221.00	28,571,400	
三菱自動車工業	60,600	824.00	49,934,400	
エフテック	1,000	1,365.00	1,365,000	
レシップホールディングス	500	856.00	428,000	
G M B	400	1,518.00	607,200	
ファルテック	300	1,226.00	367,800	
武蔵精密工業	1,700	4,000.00	6,800,000	
日産車体	6,400	976.00	6,246,400	
新明和工業	7,100	1,260.00	8,946,000	
極東開発工業	3,000	1,697.00	5,091,000	
日信工業	3,300	1,926.00	6,355,800	
トピー工業	1,300	3,135.00	4,075,500	
ティラド	600	3,595.00	2,157,000	
曙ブレーキ工業	7,700	214.00	1,647,800	
タチエス	2,800	1,949.00	5,457,200	
N O K	8,800	2,046.00	18,004,800	
フタバ産業	5,000	782.00	3,910,000	
K Y B	1,700	5,120.00	8,704,000	
大同メタル工業	2,100	1,220.00	2,562,000	
プレス工業	8,700	599.00	5,211,300	
ミクニ	2,100	581.00	1,220,100	
太平洋工業	3,400	1,539.00	5,232,600	
ケーヒン	3,800	2,121.00	8,059,800	
河西工業	2,000	1,454.00	2,908,000	
アイシン精機	13,500	5,480.00	73,980,000	
マツダ	51,400	1,370.00	70,418,000	
今仙電機製作所	1,500	1,267.00	1,900,500	
本田技研工業	147,400	3,447.00	508,087,800	代用有価証券 5,900株
スズキ	32,500	6,262.00	203,515,000	
S U B A R U	50,800	3,330.00	169,164,000	
安永	800	2,009.00	1,607,200	貸付有価証券 500株
ヤマハ発動機	23,100	3,150.00	72,765,000	
ショーワ	4,300	1,953.00	8,397,900	
T B K	2,100	534.00	1,121,400	
エクセディ	2,000	3,430.00	6,860,000	
豊田合成	5,900	2,869.00	16,927,100	
愛三工業	2,900	1,021.00	2,960,900	
盟和産業	400	1,290.00	516,000	
日本プラスト	900	1,008.00	907,200	
ヨロズ	1,700	1,779.00	3,024,300	
エフ・シー・シー	2,700	3,000.00	8,100,000	

シマノ	6,600	15,390.00	101,574,000	
テイ・エス テック	3,800	4,790.00	18,202,000	
ジャムコ	800	2,263.00	1,810,400	
テルモ	25,100	6,460.00	162,146,000	
クリエートメディック	600	1,474.00	884,400	
日機装	5,700	1,176.00	6,703,200	
島津製作所	19,500	3,005.00	58,597,500	
JMS	1,500	649.00	973,500	
クボテック	300	516.00	154,800	
長野計器	1,300	1,365.00	1,774,500	
ブイ・テクノロジー	400	24,840.00	9,936,000	
東京計器	1,000	1,305.00	1,305,000	
愛知時計電機	200	4,015.00	803,000	
インターアクション	700	1,341.00	938,700	
オーバル	1,500	339.00	508,500	
東京精密	3,000	4,165.00	12,495,000	
マニー	2,000	5,090.00	10,180,000	
ニコン	28,500	1,765.00	50,302,500	貸付有価証券 700株
トプコン	8,800	1,895.00	16,676,000	
オリンパス	24,400	3,860.00	94,184,000	
理研計器	1,600	2,675.00	4,280,000	
タムロン	1,300	2,112.00	2,745,600	
H O Y A	33,000	6,473.00	213,609,000	
シード	200	7,380.00	1,476,000	
ノーリツ鋼機	1,700	1,934.00	3,287,800	
エー・アンド・デイ	1,500	1,151.00	1,726,500	
シチズン時計	19,500	725.00	14,137,500	
リズム時計工業	600	2,428.00	1,456,800	
大研医器	1,400	758.00	1,061,200	
メニコン	2,300	2,883.00	6,630,900	
シンシア	200	639.00	127,800	貸付有価証券 100株
松風	900	1,412.00	1,270,800	
セイコーホールディングス	2,500	2,599.00	6,497,500	
ニプロ	11,300	1,322.00	14,938,600	
中本パックス	400	1,707.00	682,800	
スノーピーク	500	1,496.00	748,000	
パラマウントベッドホールディングス	1,700	4,955.00	8,423,500	
トランザクション	900	985.00	886,500	貸付有価証券 400株
S H O - B I	400	443.00	177,200	
ニホンフラッシュ	800	3,250.00	2,600,000	

前田工織	1,800	1,900.00	3,420,000	
永大産業	2,200	541.00	1,190,200	
アートネイチャー	1,800	713.00	1,283,400	
バンダイナムコホールディングス	16,900	4,630.00	78,247,000	
アイフィスジャパン	200	725.00	145,000	
共立印刷	2,600	380.00	988,000	
S H O E I	800	4,195.00	3,356,000	貸付有価証券 500株
フランスベッドホールディングス	1,900	989.00	1,879,100	
パイロットコーポレーション	2,900	5,770.00	16,733,000	
萩原工業	900	1,883.00	1,694,700	
トッパン・フォームズ	3,500	1,131.00	3,958,500	
フジシールインターナショナル	3,700	4,285.00	15,854,500	
タカラトミー	6,900	966.00	6,665,400	
廣済堂	1,500	535.00	802,500	
A s - m e エステール	400	794.00	317,600	
アーク	7,400	125.00	925,000	
タカノ	700	960.00	672,000	
プロネクサス	1,500	1,288.00	1,932,000	
ホクシン	900	170.00	153,000	
ウッドワン	500	1,419.00	709,500	
大建工業	1,300	2,551.00	3,316,300	
凸版印刷	46,000	888.00	40,848,000	
大日本印刷	21,400	2,342.00	50,118,800	貸付有価証券 600株
図書印刷	1,100	1,082.00	1,190,200	
共同印刷	500	2,911.00	1,455,500	
N I S S H A	3,400	2,222.00	7,554,800	
光村印刷	100	2,431.00	243,100	
宝印刷	800	1,945.00	1,556,000	
アシックス	16,300	1,816.00	29,600,800	貸付有価証券 10,000株
ツツミ	600	1,764.00	1,058,400	
小松ウオール工業	600	2,257.00	1,354,200	
ヤマハ	11,000	5,680.00	62,480,000	
河合楽器製作所	600	5,340.00	3,204,000	
クリナップ	1,600	902.00	1,443,200	
ピジョン	9,900	5,350.00	52,965,000	
兼松サステック	100	2,028.00	202,800	
キングジム	1,300	1,116.00	1,450,800	
リンテック	3,900	3,140.00	12,246,000	
イトーキ	3,400	636.00	2,162,400	
任天堂	10,100	45,000.00	454,500,000	

三菱鉛筆	2,700	2,258.00	6,096,600	
タカスタンダード	3,400	1,765.00	6,001,000	
コクヨ	7,800	2,041.00	15,919,800	
ナカバヤシ	1,200	696.00	835,200	
グロープライド	700	3,705.00	2,593,500	
オカムラ	5,700	1,638.00	9,336,600	
美津濃	1,600	3,965.00	6,344,000	
東京電力ホールディングス	130,600	517.00	67,520,200	
中部電力	50,000	1,685.50	84,275,000	
関西電力	66,800	1,566.00	104,608,800	
中国電力	22,600	1,423.00	32,159,800	
北陸電力	16,100	1,094.00	17,613,400	貸付有価証券 11,200株
東北電力	38,300	1,389.00	53,198,700	
四国電力	14,700	1,423.00	20,918,100	
九州電力	36,100	1,286.00	46,424,600	
北海道電力	16,400	740.00	12,136,000	
沖縄電力	3,250	2,477.00	8,050,250	
電源開発	13,000	2,891.00	37,583,000	
エフオン	800	1,639.00	1,311,200	
イーレックス	2,600	1,063.00	2,763,800	貸付有価証券 1,800株
レノバ	800	1,370.00	1,096,000	
東京瓦斯	34,900	2,965.00	103,478,500	
大阪瓦斯	31,800	2,374.50	75,509,100	
東邦瓦斯	8,100	3,435.00	27,823,500	
北海道瓦斯	4,000	307.00	1,228,000	
広島ガス	3,300	376.00	1,240,800	
西部瓦斯	2,000	2,987.00	5,974,000	
静岡ガス	4,700	1,038.00	4,878,600	
メタウォーター	900	2,934.00	2,640,600	
SBSホールディングス	1,600	1,269.00	2,030,400	
東武鉄道	17,300	3,375.00	58,387,500	
相鉄ホールディングス	5,200	3,145.00	16,354,000	
東京急行電鉄	44,400	1,934.00	85,869,600	
京浜急行電鉄	22,400	1,833.00	41,059,200	貸付有価証券 1,100株
小田急電鉄	24,300	2,355.00	57,226,500	
京王電鉄	9,100	5,060.00	46,046,000	
京成電鉄	11,400	3,695.00	42,123,000	
富士急行	2,200	3,195.00	7,029,000	貸付有価証券 1,400株
新京成電鉄	500	2,226.00	1,113,000	
東日本旅客鉄道	29,400	10,755.00	316,197,000	

西日本旅客鉄道	14,800	7,828.00	115,854,400	
東海旅客鉄道	14,700	22,510.00	330,897,000	
西武ホールディングス	20,800	1,791.00	37,252,800	
鴻池運輸	2,300	1,770.00	4,071,000	
西日本鉄道	4,500	2,865.00	12,892,500	
ハマキョウレックス	1,200	3,670.00	4,404,000	
サカイ引越センター	900	6,280.00	5,652,000	
近鉄グループホールディングス	15,500	4,555.00	70,602,500	
阪急阪神ホールディングス	20,700	4,490.00	92,943,000	
南海電気鉄道	7,300	3,035.00	22,155,500	
京阪ホールディングス	6,900	3,685.00	25,426,500	
神戸電鉄	400	3,990.00	1,596,000	
名古屋鉄道	12,300	2,798.00	34,415,400	
山陽電気鉄道	1,200	2,701.00	3,241,200	
日本通運	6,100	8,190.00	49,959,000	
ヤマトホールディングス	27,200	3,124.00	84,972,800	
山九	4,000	5,980.00	23,920,000	
丸運	800	349.00	279,200	
丸全昭和運輸	5,000	538.00	2,690,000	
センコーグループホールディングス	9,300	872.00	8,109,600	
トナミホールディングス	400	7,690.00	3,076,000	
ニッコンホールディングス	5,900	3,005.00	17,729,500	
日本石油輸送	100	3,125.00	312,500	
福山通運	2,300	5,480.00	12,604,000	
セイノーホールディングス	11,600	2,050.00	23,780,000	
エスライン	400	1,190.00	476,000	貸付有価証券 200株
神奈川中央交通	400	3,710.00	1,484,000	
日立物流	3,400	2,935.00	9,979,000	
丸和運輸機関	800	3,650.00	2,920,000	
C & F ロジホールディングス	1,700	1,406.00	2,390,200	
九州旅客鉄道	13,000	3,465.00	45,045,000	
S Gホールディングス	14,600	2,468.00	36,032,800	
日本郵船	13,000	2,219.00	28,847,000	
商船三井	9,800	2,878.00	28,204,400	
川崎汽船	7,200	2,240.00	16,128,000	
N S ユナイテッド海運	700	2,084.00	1,458,800	
明治海運	1,500	406.00	609,000	
飯野海運	7,800	498.00	3,884,400	
共栄タンカー	100	1,912.00	191,200	
乾汽船	1,200	991.00	1,189,200	
日本航空	28,800	4,218.00	121,478,400	
A N A ホールディングス	30,100	4,382.00	131,898,200	

パスコ	1,000	323.00	323,000	
トランコム	400	8,160.00	3,264,000	
日新	1,300	2,628.00	3,416,400	
三菱倉庫	5,400	2,306.00	12,452,400	
三井倉庫ホールディングス	9,000	336.00	3,024,000	
住友倉庫	11,000	698.00	7,678,000	
澁澤倉庫	900	1,800.00	1,620,000	
東陽倉庫	3,100	347.00	1,075,700	
日本トランスシティ	3,800	506.00	1,922,800	
ケイヒン	400	1,628.00	651,200	
中央倉庫	900	1,173.00	1,055,700	
安田倉庫	1,400	917.00	1,283,800	
東洋埠頭	500	1,698.00	849,000	
宇徳	1,600	501.00	801,600	
上組	9,600	2,382.00	22,867,200	
キムラユニティー	500	1,141.00	570,500	
キューソー流通システム	500	2,744.00	1,372,000	
近鉄エクスプレス	2,900	2,219.00	6,435,100	
東海運	1,000	384.00	384,000	
エーアイティー	1,100	1,227.00	1,349,700	
内外トランスライン	500	1,593.00	796,500	
日本コンセプト	300	1,409.00	422,700	
NEC ネットズエスアイ	1,800	2,484.00	4,471,200	
システナ	5,200	1,228.00	6,385,600	
デジタルアーツ	800	5,830.00	4,664,000	貸付有価証券 400株
新日鉄住金ソリューションズ	2,400	2,963.00	7,111,200	
キューブシステム	700	875.00	612,500	
エイジア	300	1,720.00	516,000	
コア	700	1,428.00	999,600	
ソリトンシステムズ	700	1,276.00	893,200	貸付有価証券 400株
ソフトクリエイトホールディングス	800	1,652.00	1,321,600	
T I S	5,400	5,120.00	27,648,000	
ネオス	600	413.00	247,800	
電算システム	600	2,080.00	1,248,000	
グリー	8,600	620.00	5,332,000	
コーエーテクモホールディングス	2,700	2,182.00	5,891,400	
三菱総合研究所	600	4,875.00	2,925,000	
ボルテージ	400	850.00	340,000	
電算	200	2,198.00	439,600	
A G S	700	842.00	589,400	

ファインデックス	1,300	837.00	1,088,100	貸付有価証券 900株
ヒト・コミュニケーションズ	400	2,129.00	851,600	貸付有価証券 200株
ブレインパッド	400	3,110.00	1,244,000	貸付有価証券 200株
K L a b	3,000	1,657.00	4,971,000	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,200	2,060.00	2,472,000	
イーブックイニシアティブジャパン	200	1,204.00	240,800	
ネクソン	36,100	1,801.00	65,016,100	
アイスタイル	4,100	1,201.00	4,924,100	
エイチーム	1,000	2,270.00	2,270,000	
テクノスジャパン	1,400	989.00	1,384,600	
コロプラ	4,600	779.00	3,583,400	
モバイルクリエイト	1,300	341.00	443,300	
オルトプラス	900	780.00	702,000	貸付有価証券 600株
ブロードリーフ	8,000	587.00	4,696,000	
クロス・マーケティンググループ	400	686.00	274,400	
ハーツユナイテッドグループ	900	1,620.00	1,458,000	
メディアドゥホールディングス	500	2,107.00	1,053,500	
ブイキューブ	1,100	577.00	634,700	
サイバーリンクス	200	1,100.00	220,000	
ディー・エル・イー	600	500.00	300,000	
フィックスターズ	1,500	1,637.00	2,455,500	貸付有価証券 1,000株
VOYAGE GROUP	800	1,187.00	949,600	
オブティム	400	2,586.00	1,034,400	
セレス	500	2,104.00	1,052,000	
ベリサーブ	200	3,065.00	613,000	貸付有価証券 100株
ティーガイア	1,600	3,055.00	4,888,000	
セック	200	2,623.00	524,600	貸付有価証券 100株
日本アジアグループ	1,900	509.00	967,100	
豆蔵ホールディングス	1,200	1,048.00	1,257,600	
テクマトリックス	900	2,283.00	2,054,700	
プロシップ	200	2,668.00	533,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	43,500	289.00	12,571,500	貸付有価証券 11,000株
GMOペイメントゲートウェイ	1,300	11,620.00	15,106,000	
ザッパラス	900	381.00	342,900	
システムリサーチ	200	2,899.00	579,800	
インターネットイニシアティブ	2,600	2,210.00	5,746,000	
さくらインターネット	1,900	818.00	1,554,200	

ヴィンクス	400	1,316.00	526,400	貸付有価証券 200株
GMOクラウド	400	2,926.00	1,170,400	
SRAホールディングス	800	3,295.00	2,636,000	
Minor iソリューションズ	400	1,578.00	631,200	
システムインテグレータ	200	1,089.00	217,800	
朝日ネット	1,500	533.00	799,500	
eBASE	400	1,565.00	626,000	
アバント	400	951.00	380,400	
アドソル日進	400	1,622.00	648,800	
フリービット	1,100	1,053.00	1,158,300	貸付有価証券 800株
コムチュア	800	3,360.00	2,688,000	
サイバーコム	200	2,164.00	432,800	貸付有価証券 100株
インフォテリア	800	1,261.00	1,008,800	
メディカル・データ・ビジョン	1,200	1,454.00	1,744,800	貸付有価証券 800株
gumi	1,900	930.00	1,767,000	貸付有価証券 1,100株
ショーケース・ティービー	200	1,341.00	268,200	
モバイルファクトリー	400	1,600.00	640,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,390.00	973,000	貸付有価証券 100株
PCIホールディングス	200	3,415.00	683,000	
パイプドHD	400	1,007.00	402,800	
アイピーシー	300	1,547.00	464,100	
ネオジャパン	400	1,456.00	582,400	貸付有価証券 200株
オープンドア	600	2,144.00	1,286,400	
マイネット	400	1,128.00	451,200	貸付有価証券 200株
アカツキ	400	4,745.00	1,898,000	貸付有価証券 200株
ベネフィットジャパン	100	1,278.00	127,800	
Ubicomホールディングス	200	1,026.00	205,200	
LINE	4,800	3,950.00	18,960,000	
シンクロ・フード	500	878.00	439,000	
オークネット	700	1,327.00	928,900	
AOI TYO Holdings	1,300	1,267.00	1,647,100	
マクロミル	2,000	2,558.00	5,116,000	
ビーグリー	400	1,426.00	570,400	
オロ	200	3,275.00	655,000	
ソルクシーズ	600	1,428.00	856,800	貸付有価証券 400株
フェイス	500	1,326.00	663,000	

ハイマックス	200	1,776.00	355,200	
野村総合研究所	10,200	5,480.00	55,896,000	
サイバネットシステム	1,300	898.00	1,167,400	
C Eホールディングス	400	821.00	328,400	
日本システム技術	300	1,351.00	405,300	
インテージホールディングス	1,900	1,139.00	2,164,100	
東邦システムサイエンス	600	872.00	523,200	
ソースネクスト	2,300	769.00	1,768,700	貸付有価証券 1,600株
フォーカスシステムズ	700	867.00	606,900	
クレスコ	400	3,425.00	1,370,000	
フジ・メディア・ホールディングス	16,800	1,831.00	30,760,800	
オービック	5,100	9,420.00	48,042,000	
ジャストシステム	2,600	2,350.00	6,110,000	
T D C ソフト	700	1,495.00	1,046,500	
ヤフー	115,800	396.00	45,856,800	貸付有価証券 81,200株
トレンドマイクロ	7,800	6,180.00	48,204,000	
インフォメーション・ディベロプメント	500	1,440.00	720,000	
日本オラクル	2,600	8,290.00	21,554,000	
アルファシステムズ	500	2,197.00	1,098,500	
フューチャー	2,200	1,445.00	3,179,000	
C A C H o l d i n g s	1,200	1,073.00	1,287,600	
ソフトバンク・テクノロジー	700	1,667.00	1,166,900	貸付有価証券 400株
トーセ	400	1,201.00	480,400	
オービックビジネスコンサルタント	800	8,150.00	6,520,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,300	1,975.00	14,417,500	
アイティフォー	1,900	1,288.00	2,447,200	
東計電算	200	3,195.00	639,000	
エクスネット	400	890.00	356,000	
大塚商会	9,700	4,495.00	43,601,500	
サイボウズ	2,200	577.00	1,269,400	
ソフトブレーン	2,200	578.00	1,271,600	
電通国際情報サービス	1,000	3,375.00	3,375,000	
デジタルガレージ	2,900	4,560.00	13,224,000	貸付有価証券 300株
E Mシステムズ	1,100	1,041.00	1,145,100	
ウェザーニューズ	500	3,535.00	1,767,500	
C I J	1,500	695.00	1,042,500	
東洋ビジネスエンジニアリング	200	1,910.00	382,000	
日本エンタープライズ	1,800	216.00	388,800	
WOWOW	800	3,300.00	2,640,000	貸付有価証券 400株

スカラ	1,200	848.00	1,017,600	
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,400	1,010.00	1,414,000	貸付有価証券 900株
ネットワンシステムズ	6,600	1,777.00	11,728,200	
システムソフト	3,100	141.00	437,100	貸付有価証券 2,100株
アルゴグラフィックス	800	3,690.00	2,952,000	
マーベラス	2,700	933.00	2,519,100	貸付有価証券 1,800株
エイベックス	3,000	1,516.00	4,548,000	
日本ユニシス	4,400	2,733.00	12,025,200	
兼松エレクトロニクス	1,000	3,575.00	3,575,000	
東京放送ホールディングス	8,900	2,307.00	20,532,300	
日本テレビホールディングス	14,700	1,834.00	26,959,800	
朝日放送グループホールディングス	1,600	840.00	1,344,000	
テレビ朝日ホールディングス	4,400	2,334.00	10,269,600	貸付有価証券 3,000株
スカパーJ S A Tホールディングス	12,200	491.00	5,990,200	
テレビ東京ホールディングス	1,300	3,055.00	3,971,500	
日本BS放送	400	1,453.00	581,200	貸付有価証券 200株
ビジョン	400	4,110.00	1,644,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	500	975.00	487,500	
ワイヤレスゲート	700	1,610.00	1,127,000	貸付有価証券 400株
コネクシオ	1,100	2,112.00	2,323,200	
クロップス	500	843.00	421,500	
日本電信電話	115,300	5,106.00	588,721,800	
KDDI	144,700	2,945.50	426,213,850	
光通信	1,900	19,340.00	36,746,000	
NTTドコモ	115,400	2,818.00	325,197,200	貸付有価証券 900株
エムティーアイ	1,800	635.00	1,143,000	
GMOインターネット	5,800	2,914.00	16,901,200	
アйдママーケティングコミュニケーション	300	760.00	228,000	
カドカワ	4,600	1,149.00	5,285,400	
学研ホールディングス	500	4,995.00	2,497,500	
ゼンリン	2,900	2,576.00	7,470,400	
昭文社	900	804.00	723,600	
インプレスホールディングス	1,600	188.00	300,800	
アイネット	900	1,702.00	1,531,800	
松竹	1,100	15,390.00	16,929,000	
東宝	10,600	3,780.00	40,068,000	
東映	600	11,790.00	7,074,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	49,900	1,217.00	60,728,300	

ピー・シー・エー	200	1,743.00	348,600	
ビジネスブレイン太田昭和	400	2,190.00	876,000	
D T S	1,700	4,345.00	7,386,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,500	5,410.00	40,575,000	
シーイーシー	900	3,685.00	3,316,500	
カプコン	6,900	2,559.00	17,657,100	
アイ・エス・ビー	400	1,956.00	782,400	
ジャステック	900	1,174.00	1,056,600	
S C S K	3,700	5,000.00	18,500,000	
日本システムウエア	500	2,478.00	1,239,000	
アイネス	2,000	1,075.00	2,150,000	
T K C	1,400	4,355.00	6,097,000	
富士ソフト	2,200	4,450.00	9,790,000	
N S D	2,600	2,365.00	6,149,000	
コナミホールディングス	6,600	5,110.00	33,726,000	貸付有価証券 1,000株
福井コンピュータホールディングス	500	1,894.00	947,000	
J B C Cホールディングス	1,200	1,147.00	1,376,400	
ミロク情報サービス	1,400	3,070.00	4,298,000	
ソフトバンクグループ	72,700	7,765.00	564,515,500	代用有価証券 3,400株
ハウスイ	100	1,156.00	115,600	
高千穂交易	700	1,187.00	830,900	
伊藤忠食品	400	6,230.00	2,492,000	
エレマテック	800	2,560.00	2,048,000	
J A L U X	500	2,950.00	1,475,000	
あらた	800	6,790.00	5,432,000	
トーメンデバイス	200	2,858.00	571,600	
東京エレクトロン デバイス	600	2,011.00	1,206,600	
フィールズ	1,200	931.00	1,117,200	
双日	95,300	388.00	36,976,400	
アルフレッサ ホールディングス	17,900	2,753.00	49,278,700	
横浜冷凍	4,100	1,068.00	4,378,800	
神栄	200	1,437.00	287,400	
ラサ商事	800	949.00	759,200	
ラクーン	800	653.00	522,400	
アルコニックス	1,700	1,761.00	2,993,700	
神戸物産	1,000	5,300.00	5,300,000	
ペッパーフードサービス	1,200	5,130.00	6,156,000	貸付有価証券 600株
あい ホールディングス	2,600	2,576.00	6,697,600	
ディーブイエックス	600	1,375.00	825,000	
ダイワボウホールディングス	1,400	6,100.00	8,540,000	

マクニカ・富士エレホールディングス	3,100	1,822.00	5,648,200	
ラクト・ジャパン	300	5,350.00	1,605,000	貸付有価証券 200株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,000	1,106.00	3,318,000	
八洲電機	1,200	912.00	1,094,400	
メディアスホールディングス	900	1,063.00	956,700	貸付有価証券 300株
U K C ホールディングス	1,000	2,217.00	2,217,000	
ジュテックホールディングス	400	1,131.00	452,400	
大光	400	800.00	320,000	
O C H I ホールディングス	500	1,477.00	738,500	
T O K A I ホールディングス	8,500	1,119.00	9,511,500	
C o m i n i x	200	913.00	182,600	
三洋貿易	800	2,078.00	1,662,400	
ビューティガレージ	200	2,413.00	482,600	
ウイン・パートナーズ	1,200	1,357.00	1,628,400	
ミタチ産業	500	1,048.00	524,000	
シップヘルスケアホールディングス	3,400	3,970.00	13,498,000	
明治電機工業	500	2,068.00	1,034,000	
デリカフーズホールディングス	400	1,567.00	626,800	
スターティアホールディングス	500	765.00	382,500	
コメダホールディングス	3,000	2,140.00	6,420,000	
富士興産	700	608.00	425,600	
協栄産業	200	2,005.00	401,000	貸付有価証券 100株
小野建	1,400	1,871.00	2,619,400	
佐島電機	1,200	1,060.00	1,272,000	
エコートレーディング	500	720.00	360,000	
伯東	1,000	1,708.00	1,708,000	
コンドーテック	1,300	983.00	1,277,900	
中山福	1,100	711.00	782,100	
ナガイレーベン	2,300	2,852.00	6,559,600	
三菱食品	1,800	2,918.00	5,252,400	
松田産業	1,200	1,708.00	2,049,600	
第一興商	2,400	5,080.00	12,192,000	
メディバルホールディングス	16,200	2,511.00	40,678,200	
S P K	300	2,791.00	837,300	
萩原電気ホールディングス	600	3,060.00	1,836,000	
アズワン	1,300	7,660.00	9,958,000	
スズデン	600	1,602.00	961,200	
尾家産業	600	1,396.00	837,600	
シモジマ	1,000	1,140.00	1,140,000	
ドウシシャ	1,700	2,489.00	4,231,300	

小津産業	400	2,200.00	880,000	
高速	1,000	1,308.00	1,308,000	
たけびし	600	1,677.00	1,006,200	
リックス	300	2,112.00	633,600	
丸文	1,400	879.00	1,230,600	
ハピネット	1,100	1,448.00	1,592,800	
橋本総業ホールディングス	400	1,752.00	700,800	
日本ライフライン	4,600	2,782.00	12,797,200	
エクセル	600	2,312.00	1,387,200	
マルカキカイ	500	2,007.00	1,003,500	
I D O M	4,900	730.00	3,577,000	
日本エム・ディ・エム	1,200	1,130.00	1,356,000	
進和	900	2,454.00	2,208,600	
エスケイジャパン	400	509.00	203,600	貸付有価証券 200株
ダイترون	700	2,515.00	1,760,500	
シークス	2,000	2,089.00	4,178,000	
田中商事	500	697.00	348,500	
オーハシテクニカ	900	1,789.00	1,610,100	
白銅	600	2,194.00	1,316,400	
伊藤忠商事	118,300	2,046.00	242,041,800	
丸紅	132,500	848.40	112,413,000	
高島	400	2,144.00	857,600	
長瀬産業	9,700	1,817.00	17,624,900	
蝶理	1,000	2,008.00	2,008,000	
豊田通商	18,000	3,760.00	67,680,000	
三共生興	2,700	448.00	1,209,600	
兼松	6,900	1,687.00	11,640,300	
ツカモトコーポレーション	300	1,266.00	379,800	
三井物産	132,700	1,917.00	254,385,900	
日本紙パルプ商事	800	4,895.00	3,916,000	
日立ハイテクノロジーズ	5,600	4,965.00	27,804,000	
カメイ	2,100	1,591.00	3,341,100	
東都水産	200	1,883.00	376,600	
O U Gホールディングス	200	2,760.00	552,000	
スターゼン	600	6,130.00	3,678,000	
山善	6,300	1,118.00	7,043,400	
橋本興業	400	3,960.00	1,584,000	
住友商事	101,700	1,827.50	185,856,750	
内田洋行	800	3,205.00	2,564,000	
三菱商事	113,100	3,031.00	342,806,100	
第一実業	700	3,380.00	2,366,000	
キャノンマーケティングジャパン	4,600	2,334.00	10,736,400	

西華産業	1,000	2,729.00	2,729,000	
佐藤商事	1,400	1,210.00	1,694,000	
菱洋エレクトロ	1,500	1,802.00	2,703,000	
東京産業	1,600	605.00	968,000	
ユアサ商事	1,500	3,675.00	5,512,500	
神鋼商事	400	3,085.00	1,234,000	
小林産業	1,300	349.00	453,700	
阪和興業	3,000	4,595.00	13,785,000	
正栄食品工業	900	4,655.00	4,189,500	
カナデン	1,500	1,444.00	2,166,000	
菱電商事	1,200	1,821.00	2,185,200	
フルサト工業	900	1,743.00	1,568,700	
岩谷産業	3,600	3,855.00	13,878,000	
すてきナイスグループ	700	1,364.00	954,800	
昭光通商	6,000	106.00	636,000	
ニチモウ	200	1,683.00	336,600	
極東貿易	2,000	476.00	952,000	
イワキ	2,300	441.00	1,014,300	
三愛石油	4,300	1,557.00	6,695,100	
稲畑産業	3,900	1,575.00	6,142,500	
G S Iクレオス	500	1,549.00	774,500	
明和産業	1,400	496.00	694,400	
ワキタ	3,400	1,179.00	4,008,600	
東邦ホールディングス	4,800	2,673.00	12,830,400	
サンゲツ	5,400	2,284.00	12,333,600	
ミツウロコグループホールディングス	2,300	881.00	2,026,300	
シナネンホールディングス	700	2,615.00	1,830,500	
伊藤忠エネクス	3,500	1,102.00	3,857,000	
サンリオ	4,500	2,008.00	9,036,000	貸付有価証券 3,100株
サンワテクノス	1,100	1,584.00	1,742,400	
リョーサン	2,000	3,975.00	7,950,000	
新光商事	1,800	1,748.00	3,146,400	
トーヨー	700	2,582.00	1,807,400	
三信電気	1,500	2,149.00	3,223,500	
東陽テクニカ	1,800	908.00	1,634,400	
モスフードサービス	2,100	3,265.00	6,856,500	
加賀電子	1,400	2,787.00	3,901,800	
ソーダニッカ	1,700	677.00	1,150,900	
立花エレテック	1,100	2,046.00	2,250,600	
フォーバル	700	892.00	624,400	
P A L T A C	2,300	6,430.00	14,789,000	
三谷産業	1,700	362.00	615,400	

太平洋興発	600	974.00	584,400	
西本Wismettacホールディングス	400	5,240.00	2,096,000	
ヤマタネ	800	2,076.00	1,660,800	
丸紅建材リース	1,000	239.00	239,000	
日鉄住金物産	1,300	5,620.00	7,306,000	
泉州電業	500	3,105.00	1,552,500	
トラスコ中山	3,400	2,724.00	9,261,600	
オートバックスセブン	6,400	1,984.00	12,697,600	
モリト	1,300	1,003.00	1,303,900	
加藤産業	2,500	3,795.00	9,487,500	
イノテック	1,400	1,422.00	1,990,800	
イエローハット	1,500	3,220.00	4,830,000	
J Kホールディングス	1,600	871.00	1,393,600	
日伝	1,300	2,104.00	2,735,200	
北沢産業	1,500	263.00	394,500	
杉本商事	900	1,990.00	1,791,000	
因幡電機産業	2,100	4,760.00	9,996,000	
バイテックホールディングス	700	2,378.00	1,664,600	
東テク	500	2,780.00	1,390,000	
ミスミグループ本社	18,700	3,150.00	58,905,000	
アルテック	1,600	346.00	553,600	
タキヒヨー	500	2,351.00	1,175,500	
蔵王産業	200	1,710.00	342,000	
スズケン	7,400	4,880.00	36,112,000	
ジェコス	1,100	1,079.00	1,186,900	
ルネサスイーストン	1,400	593.00	830,200	
ローソン	4,100	7,090.00	29,069,000	貸付有価証券 2,800株
サンエー	1,200	5,530.00	6,636,000	
カワチ薬品	1,300	2,436.00	3,166,800	
エービーシー・マート	2,900	6,700.00	19,430,000	
ハードオフコーポレーション	800	1,090.00	872,000	
アスクル	1,400	3,180.00	4,452,000	
ゲオホールディングス	3,000	1,550.00	4,650,000	
アダストリア	2,500	1,549.00	3,872,500	貸付有価証券 1,700株
ジーフット	1,100	775.00	852,500	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	768.00	153,600	
くらコーポレーション	900	8,260.00	7,434,000	
キャンドウ	800	1,771.00	1,416,800	貸付有価証券 500株
パルグループホールディングス	800	2,788.00	2,230,400	
エディオン	6,300	1,123.00	7,074,900	

サーラコーポレーション	2,800	675.00	1,890,000	
ワッツ	600	1,087.00	652,200	
ハローズ	600	2,643.00	1,585,800	
あみやき亭	300	5,090.00	1,527,000	
ひらまつ	2,300	539.00	1,239,700	
大黒天物産	400	5,570.00	2,228,000	
ハニーズホールディングス	1,600	997.00	1,595,200	
ファーマライズホールディングス	500	681.00	340,500	貸付有価証券 300株
アルペン	1,200	2,383.00	2,859,600	
ハブ	400	1,174.00	469,600	
クオール	1,800	2,327.00	4,188,600	
ジーンズ	1,100	6,080.00	6,688,000	貸付有価証券 700株
ビックカメラ	8,600	1,720.00	14,792,000	
D C Mホールディングス	8,700	1,093.00	9,509,100	貸付有価証券 700株
MonotaRO	5,700	4,380.00	24,966,000	貸付有価証券 3,500株
東京一番フーズ	500	663.00	331,500	
D Dホールディングス	400	2,908.00	1,163,200	貸付有価証券 100株
きちり	500	836.00	418,000	
アークランドサービスホールディングス	1,300	2,435.00	3,165,500	
J . フロント リテイリング	19,300	1,715.00	33,099,500	
ドトール・日レスホールディングス	2,800	2,222.00	6,221,600	
マツモトキヨシホールディングス	6,700	5,260.00	35,242,000	
ブロンコビリー	800	4,235.00	3,388,000	
スタートトゥデイ	15,800	3,785.00	59,803,000	
トレジャー・ファクトリー	500	747.00	373,500	
物語コーポレーション	500	11,290.00	5,645,000	
ココカラファイン	1,700	8,080.00	13,736,000	
三越伊勢丹ホールディングス	30,200	1,344.00	40,588,800	
H a m e e	400	1,721.00	688,400	
ウエルシアホールディングス	4,300	5,880.00	25,284,000	
クリエイティブSDホールディングス	2,400	3,245.00	7,788,000	
丸善C H Iホールディングス	2,000	358.00	716,000	
ミサワ	400	425.00	170,000	
ティーライフ	100	1,357.00	135,700	
チムニー	500	2,890.00	1,445,000	
シュッピン	1,000	1,451.00	1,451,000	
ネクステージ	1,700	1,248.00	2,121,600	貸付有価証券 1,100株
ジョイフル本田	2,400	3,755.00	9,012,000	貸付有価証券 1,600株

烏貴族	500	2,832.00	1,416,000	
キリン堂ホールディングス	600	3,175.00	1,905,000	
ホットランド	900	1,367.00	1,230,300	貸付有価証券 600株
すかいらーく	10,000	1,634.00	16,340,000	貸付有価証券 7,000株
綿半ホールディングス	600	3,485.00	2,091,000	
ヨシックス	200	3,645.00	729,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,300	1,427.00	7,563,100	
ブックオフコーポレーション	900	812.00	730,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	600	1,410.00	846,000	
B E E N O S	400	1,842.00	736,800	
あさひ	1,300	1,323.00	1,719,900	
日本調剤	600	2,974.00	1,784,400	
コスモス薬品	800	23,460.00	18,768,000	
トーエル	800	996.00	796,800	
一六堂	400	408.00	163,200	
オンリー	300	950.00	285,000	
セブン&アイ・ホールディングス	67,600	4,821.00	325,899,600	
薬王堂	700	3,975.00	2,782,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,300	1,440.00	6,192,000	
ツルハホールディングス	3,500	16,190.00	56,665,000	
サンマルクホールディングス	1,200	2,825.00	3,390,000	
フェリシモ	500	1,356.00	678,000	
トリドールホールディングス	2,000	3,280.00	6,560,000	
T O K Y O B A S E	1,400	970.00	1,358,000	貸付有価証券 700株
ウイルプラスホールディングス	100	1,097.00	109,700	
サツドラホールディングス	200	2,249.00	449,800	貸付有価証券 100株
ダイユー・リックホールディングス	600	1,165.00	699,000	
パロックジャパンリミテッド	1,300	1,116.00	1,450,800	貸付有価証券 400株
クスリのアオキホールディングス	1,300	7,980.00	10,374,000	
力の源ホールディングス	400	1,713.00	685,200	
スシローグローバルホールディングス	1,800	6,740.00	12,132,000	貸付有価証券 200株
L I X I L ビバ	2,100	1,892.00	3,973,200	
メディカルシステムネットワーク	1,800	484.00	871,200	
総合メディカル	1,400	2,385.00	3,339,000	
はるやまホールディングス	800	1,020.00	816,000	
ノジマ	2,800	2,684.00	7,515,200	
カッパ・クリエイト	2,000	1,422.00	2,844,000	

ライトオン	1,300	1,018.00	1,323,400	
ジーンズメイト	600	807.00	484,200	
良品計画	2,100	37,000.00	77,700,000	
三城ホールディングス	2,100	503.00	1,056,300	
アドヴァン	1,700	974.00	1,655,800	
アルビス	500	3,400.00	1,700,000	
コナカ	2,000	537.00	1,074,000	
ハウス オブ ローゼ	200	1,778.00	355,600	
G - 7ホールディングス	500	2,688.00	1,344,000	
イオン北海道	1,600	801.00	1,281,600	
コジマ	2,800	500.00	1,400,000	
ヒマラヤ	500	1,153.00	576,500	
コーナン商事	2,300	2,637.00	6,065,100	貸付有価証券 1,600株
エコス	700	1,736.00	1,215,200	
ワタミ	1,900	1,357.00	2,578,300	
マルシェ	400	812.00	324,800	
ドンキホーテホールディングス	10,400	5,800.00	60,320,000	
西松屋チェーン	3,500	1,184.00	4,144,000	
ゼンショーホールディングス	8,400	2,717.00	22,822,800	
幸楽苑ホールディングス	1,000	1,739.00	1,739,000	
ハークスレイ	400	1,055.00	422,000	
サイゼリヤ	2,700	2,512.00	6,782,400	
V Tホールディングス	5,500	520.00	2,860,000	
魚力	600	1,424.00	854,400	
ポプラ	500	893.00	446,500	
フジ・コーポレーション	200	2,572.00	514,400	
ユナイテッドアローズ	2,000	4,020.00	8,040,000	
ハイデイ日高	2,100	2,621.00	5,504,100	
京都きもの友禅	1,000	637.00	637,000	貸付有価証券 700株
コロワイド	5,300	3,050.00	16,165,000	貸付有価証券 3,300株
ピーシーデボコーポレーション	2,400	581.00	1,394,400	
壱番屋	1,100	4,690.00	5,159,000	
トップカルチャー	600	478.00	286,800	
P L A N T	400	1,326.00	530,400	
スギホールディングス	3,500	6,530.00	22,855,000	
ヴィア・ホールディングス	2,000	702.00	1,404,000	
スクロール	2,500	573.00	1,432,500	
ヨンドシーホールディングス	1,600	2,812.00	4,499,200	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	5,200	11,300.00	58,760,000	貸付有価証券 3,600株

木曾路	2,000	2,891.00	5,782,000	貸付有価証券 1,200株
S R S ホールディングス	1,900	982.00	1,865,800	
千趣会	2,900	512.00	1,484,800	
タカキュー	1,500	211.00	316,500	
ケーヨー	3,000	537.00	1,611,000	
上新電機	1,900	3,880.00	7,372,000	
日本瓦斯	3,000	5,680.00	17,040,000	
ロイヤルホールディングス	2,900	2,962.00	8,589,800	
東天紅	100	1,855.00	185,500	
いなげや	1,800	1,782.00	3,207,600	
島忠	3,600	3,365.00	12,114,000	
チヨダ	1,900	2,563.00	4,869,700	
ライフコーポレーション	1,200	2,745.00	3,294,000	
リンガーハット	2,000	2,625.00	5,250,000	
さが美グループホールディングス	1,000	149.00	149,000	
M r M a x H D	2,000	659.00	1,318,000	
テンアライド	1,600	472.00	755,200	
A O K I ホールディングス	3,200	1,741.00	5,571,200	
オークワ	2,000	1,085.00	2,170,000	
コメリ	2,500	2,778.00	6,945,000	
青山商事	3,100	3,860.00	11,966,000	
しまむら	1,900	11,120.00	21,128,000	
はせがわ	1,000	481.00	481,000	
高島屋	25,000	909.00	22,725,000	
松屋	3,300	1,491.00	4,920,300	
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,600	1,848.00	14,044,800	
近鉄百貨店	600	3,990.00	2,394,000	
パルコ	1,600	1,306.00	2,089,600	
丸井グループ	15,400	2,211.00	34,049,400	
アクシアル リテイリング	1,300	4,105.00	5,336,500	
井筒屋	1,000	347.00	347,000	
イオン	62,000	2,159.00	133,858,000	貸付有価証券 13,900株
イズミ	2,900	6,750.00	19,575,000	
東武ストア	200	3,030.00	606,000	
平和堂	3,300	2,634.00	8,692,200	
フジ	1,900	2,304.00	4,377,600	
ヤオコー	1,800	5,790.00	10,422,000	
ゼビオホールディングス	2,200	1,835.00	4,037,000	
ケーズホールディングス	14,200	1,320.00	18,744,000	
O l y m p i c グループ	1,100	565.00	621,500	
日産東京販売ホールディングス	2,400	364.00	873,600	

Genky DrugStores	600	4,440.00	2,664,000	
アインホールディングス	2,200	7,700.00	16,940,000	
元気寿司	400	3,220.00	1,288,000	
ヤマダ電機	54,000	564.00	30,456,000	貸付有価証券 37,800株
アークランドサカモト	2,700	1,672.00	4,514,400	
ニトリホールディングス	6,400	18,715.00	119,776,000	
グルメ杵屋	1,000	1,201.00	1,201,000	
愛眼	1,300	458.00	595,400	貸付有価証券 900株
ケーユーホールディングス	900	1,018.00	916,200	
吉野家ホールディングス	5,300	2,132.00	11,299,600	
松屋フーズ	800	3,735.00	2,988,000	
サガミチェーン	2,200	1,393.00	3,064,600	
関西スーパーマーケット	1,200	1,223.00	1,467,600	
王将フードサービス	1,200	5,980.00	7,176,000	
プレナス	1,800	1,853.00	3,335,400	貸付有価証券 1,200株
ミニストップ	1,200	2,243.00	2,691,600	
アークス	3,000	2,954.00	8,862,000	
バローホールディングス	3,700	2,630.00	9,731,000	
藤久	100	1,577.00	157,700	
ベルク	700	5,690.00	3,983,000	
大庄	900	1,744.00	1,569,600	
ファーストリテイリング	2,200	47,730.00	105,006,000	
サンドラッグ	6,800	4,950.00	33,660,000	
サクスパー ホールディングス	1,500	1,041.00	1,561,500	
ヤマザワ	400	1,805.00	722,000	
やまや	300	3,485.00	1,045,500	
ペルーナ	4,000	1,404.00	5,616,000	
島根銀行	400	1,271.00	508,400	
じもとホールディングス	11,000	183.00	2,013,000	
めぶきフィナンシャルグループ	83,900	396.00	33,224,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,200	2,474.00	5,442,800	
九州フィナンシャルグループ	26,500	521.00	13,806,500	
ゆうちょ銀行	45,700	1,361.00	62,197,700	
富山第一銀行	4,200	488.00	2,049,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	96,300	613.00	59,031,900	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,300	1,266.00	13,039,800	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,100	841.00	5,971,100	
三十三フィナンシャルグループ	1,300	2,300.00	2,990,000	
新生銀行	14,000	1,720.00	24,080,000	
あおぞら銀行	9,600	4,310.00	41,376,000	

三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,130,300	655.80	741,250,740	代用有価証券 27,100株
りそなホールディングス	177,200	606.90	107,542,680	
三井住友トラスト・ホールディングス	31,700	4,542.00	143,981,400	
三井住友フィナンシャルグループ	122,200	4,503.00	550,266,600	代用有価証券 4,400株
第四銀行	2,000	4,545.00	9,090,000	
北越銀行	1,600	2,254.00	3,606,400	
千葉銀行	57,200	840.00	48,048,000	
群馬銀行	32,800	618.00	20,270,400	
武蔵野銀行	2,600	3,470.00	9,022,000	
千葉興業銀行	4,400	495.00	2,178,000	
筑波銀行	6,600	296.00	1,953,600	
七十七銀行	5,100	2,421.00	12,347,100	
青森銀行	1,200	3,300.00	3,960,000	
秋田銀行	1,000	2,970.00	2,970,000	
山形銀行	1,800	2,389.00	4,300,200	
岩手銀行	1,100	4,205.00	4,625,500	
東邦銀行	14,500	404.00	5,858,000	
東北銀行	800	1,354.00	1,083,200	
みちのく銀行	1,000	1,724.00	1,724,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	66,000	582.00	38,412,000	
静岡銀行	42,600	1,051.00	44,772,600	
十六銀行	2,200	2,873.00	6,320,600	
スルガ銀行	16,500	1,256.00	20,724,000	
八十二銀行	29,200	483.00	14,103,600	
山梨中央銀行	10,000	444.00	4,440,000	
大垣共立銀行	2,500	2,817.00	7,042,500	
福井銀行	1,400	2,248.00	3,147,200	
北國銀行	1,800	4,315.00	7,767,000	
清水銀行	600	2,285.00	1,371,000	
富山銀行	300	4,040.00	1,212,000	
滋賀銀行	15,000	573.00	8,595,000	
南都銀行	1,900	2,826.00	5,369,400	
百五銀行	15,500	455.00	7,052,500	
京都銀行	6,200	5,700.00	35,340,000	
紀陽銀行	6,100	1,821.00	11,108,100	
ほくほくフィナンシャルグループ	10,700	1,545.00	16,531,500	
広島銀行	23,800	773.00	18,397,400	
山陰合同銀行	9,600	1,004.00	9,638,400	
中国銀行	11,200	1,224.00	13,708,800	
鳥取銀行	500	1,708.00	854,000	
伊予銀行	23,000	747.00	17,181,000	

百十四銀行	17,000	358.00	6,086,000	
四国銀行	2,500	1,409.00	3,522,500	
阿波銀行	13,000	694.00	9,022,000	
大分銀行	900	3,875.00	3,487,500	貸付有価証券 500株
宮崎銀行	1,100	3,475.00	3,822,500	
佐賀銀行	1,000	2,377.00	2,377,000	
十八銀行	10,000	295.00	2,950,000	
沖縄銀行	1,600	4,235.00	6,776,000	
琉球銀行	3,100	1,652.00	5,121,200	
セブン銀行	60,600	344.00	20,846,400	
みずほフィナンシャルグループ	2,194,300	189.70	416,258,710	代用有価証券 91,000株
高知銀行	600	1,240.00	744,000	
山口フィナンシャルグループ	20,000	1,313.00	26,260,000	
長野銀行	500	1,804.00	902,000	貸付有価証券 300株
名古屋銀行	1,300	3,870.00	5,031,000	
北洋銀行	24,200	361.00	8,736,200	
愛知銀行	500	4,950.00	2,475,000	
中京銀行	700	2,323.00	1,626,100	
大光銀行	600	2,212.00	1,327,200	
愛媛銀行	2,300	1,235.00	2,840,500	
トマト銀行	600	1,510.00	906,000	
京葉銀行	14,000	487.00	6,818,000	
栃木銀行	8,400	392.00	3,292,800	
北日本銀行	500	2,787.00	1,393,500	
東和銀行	2,800	1,247.00	3,491,600	
福島銀行	1,500	681.00	1,021,500	
大東銀行	800	1,220.00	976,000	
トモニホールディングス	13,400	472.00	6,324,800	
フィデアホールディングス	15,700	177.00	2,778,900	
池田泉州ホールディングス	17,200	385.00	6,622,000	
F P G	5,100	1,461.00	7,451,100	
マーキュリアインベストメント	400	1,070.00	428,000	
S B Iホールディングス	18,200	2,974.00	54,126,800	貸付有価証券 11,600株
ジャフコ	2,300	4,475.00	10,292,500	
大和証券グループ本社	138,000	631.70	87,174,600	
野村ホールディングス	277,800	564.10	156,706,980	
岡三証券グループ	14,000	548.00	7,672,000	
丸三証券	5,100	1,005.00	5,125,500	
東洋証券	6,000	271.00	1,626,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,800	720.00	12,816,000	

光世証券	500	1,349.00	674,500	
水戸証券	4,700	396.00	1,861,200	
いちよし証券	3,400	1,289.00	4,382,600	
松井証券	7,900	1,029.00	8,129,100	
だいこう証券ビジネス	800	596.00	476,800	
マネックスグループ	16,400	646.00	10,594,400	貸付有価証券 11,900株
カブドットコム証券	10,300	388.00	3,996,400	
極東証券	2,200	1,462.00	3,216,400	
岩井コスモホールディングス	1,700	1,446.00	2,458,200	
藍澤證券	3,000	771.00	2,313,000	
マネーパートナーズグループ	2,100	490.00	1,029,000	
小林洋行	600	288.00	172,800	
かんぼ生命保険	6,100	2,423.00	14,780,300	
S O M P Oホールディングス	31,600	4,732.00	149,531,200	
アニコム ホールディングス	1,100	4,140.00	4,554,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	42,200	3,464.00	146,180,800	
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,300	2,001.00	26,613,300	
第一生命ホールディングス	91,300	2,030.50	185,384,650	
東京海上ホールディングス	60,800	5,240.00	318,592,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	500	1,173.00	586,500	
T & Dホールディングス	49,900	1,717.00	85,678,300	
アドバンスクリエイト	400	2,156.00	862,400	
全国保証	4,500	5,240.00	23,580,000	
ジェイリース	300	681.00	204,300	
イントラスト	300	847.00	254,100	
アルヒ	1,800	1,745.00	3,141,000	
クレディセゾン	12,300	1,807.00	22,226,100	
アクリーティブ	1,200	312.00	374,400	貸付有価証券 800株
芙蓉総合リース	1,800	7,860.00	14,148,000	
興銀リース	3,000	3,075.00	9,225,000	
東京センチュリー	3,300	6,550.00	21,615,000	
日本証券金融	6,600	647.00	4,270,200	
アイフル	27,100	360.00	9,756,000	
リコーリース	1,300	3,630.00	4,719,000	
イオンフィナンシャルサービス	11,500	2,540.00	29,210,000	
アコム	32,500	457.00	14,852,500	貸付有価証券 22,500株
ジャックス	2,000	2,461.00	4,922,000	
オリエントコーポレーション	34,800	151.00	5,254,800	貸付有価証券 24,200株
日立キャピタル	4,400	2,821.00	12,412,400	

アプラスフィナンシャル	7,900	111.00	876,900	
オリックス	107,700	1,826.50	196,714,050	
三菱UFJリース	41,000	651.00	26,691,000	
九州リースサービス	700	754.00	527,800	
日本取引所グループ	46,300	2,069.00	95,794,700	
イー・ギャランティ	900	2,221.00	1,998,900	
アサックス	400	1,894.00	757,600	
NECキャピタルソリューション	700	1,995.00	1,396,500	
いちご	23,000	513.00	11,799,000	
日本駐車場開発	19,600	183.00	3,586,800	
ヒューリック	33,700	1,117.00	37,642,900	
三栄建築設計	700	1,869.00	1,308,300	
スター・マイカ	800	2,302.00	1,841,600	
野村不動産ホールディングス	10,700	2,553.00	27,317,100	
三重交通グループホールディングス	3,200	484.00	1,548,800	
サムティ	1,400	2,115.00	2,961,000	
ディア・ライフ	1,800	509.00	916,200	
コーセーアールイー	400	903.00	361,200	
エー・ディー・ワークス	28,900	40.00	1,156,000	貸付有価証券 20,200株
日本商業開発	900	1,812.00	1,630,800	貸付有価証券 600株
プレサンスコーポレーション	2,200	1,759.00	3,869,800	
ユニゾホールディングス	1,900	2,180.00	4,142,000	
THEグローバル社	600	836.00	501,600	貸付有価証券 400株
日本管理センター	1,100	1,475.00	1,622,500	
サンセイランディック	400	1,208.00	483,200	
エストラスト	400	930.00	372,000	
フージャースホールディングス	3,900	798.00	3,112,200	
オープンハウス	2,600	6,860.00	17,836,000	
東急不動産ホールディングス	39,100	804.00	31,436,400	
飯田グループホールディングス	13,500	2,079.00	28,066,500	
イーランド	300	1,182.00	354,600	
ムゲンエステート	1,000	1,142.00	1,142,000	
ビーロッド	200	1,892.00	378,400	
ファーストブラザーズ	500	1,454.00	727,000	
ハウスドゥ	200	5,280.00	1,056,000	
シーアールイー	200	1,825.00	365,000	
ケイアイスター不動産	600	2,706.00	1,623,600	
グッドコムアセット	200	1,585.00	317,000	
パーク24	9,400	2,938.00	27,617,200	
バラカ	400	2,392.00	956,800	

三井不動産	80,700	2,735.00	220,714,500	
三菱地所	120,200	1,976.00	237,515,200	
平和不動産	2,900	2,257.00	6,545,300	
東京建物	17,600	1,508.00	26,540,800	
ダイビル	4,200	1,164.00	4,888,800	
京阪神ビルディング	2,700	894.00	2,413,800	
住友不動産	39,000	4,113.00	160,407,000	
大京	2,600	2,587.00	6,726,200	
テオーシー	5,600	874.00	4,894,400	
東京楽天地	300	5,770.00	1,731,000	
レオパレス21	19,300	750.00	14,475,000	
スターツコーポレーション	2,200	2,790.00	6,138,000	
フジ住宅	2,100	972.00	2,041,200	
空港施設	1,900	627.00	1,191,300	
明和地所	1,000	709.00	709,000	
ゴールドクレスト	1,300	1,950.00	2,535,000	
日本エスリード	600	2,016.00	1,209,600	
日神不動産	2,200	745.00	1,639,000	
日本エスコン	2,900	673.00	1,951,700	
タカラレーベン	7,600	421.00	3,199,600	
サンヨーハウジング名古屋	900	1,225.00	1,102,500	
イオンモール	10,400	2,103.00	21,871,200	
ファースト住建	600	1,481.00	888,600	
カチタス	2,200	3,990.00	8,778,000	
トーセイ	2,000	1,371.00	2,742,000	
穴吹興産	100	3,375.00	337,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	10,000	1,139.00	11,390,000	
サンフロンティア不動産	2,000	1,343.00	2,686,000	
エフ・ジェー・ネクスト	1,300	1,012.00	1,315,600	
インテリックス	400	1,011.00	404,400	
ランドビジネス	800	332.00	265,600	
グランディハウス	1,400	491.00	687,400	
日本空港ビルデング	4,700	5,020.00	23,594,000	
日本工営	1,100	3,060.00	3,366,000	
LIFULL	5,400	778.00	4,201,200	貸付有価証券 3,800株
ジェイエイシーリクルートメント	1,300	2,166.00	2,815,800	
日本M&Aセンター	10,800	3,580.00	38,664,000	
メンバーズ	500	1,227.00	613,500	
中広	200	776.00	155,200	
タケエイ	1,600	1,220.00	1,952,000	
トラスト・テック	700	3,270.00	2,289,000	
コシダカホールディングス	4,000	1,728.00	6,912,000	

パソナグループ	1,500	1,694.00	2,541,000	貸付有価証券 1,000株
C D S	400	1,454.00	581,600	
リンクアンドモチベーション	2,900	1,437.00	4,167,300	
G C A	1,800	940.00	1,692,000	
エス・エム・エス	3,100	4,085.00	12,663,500	貸付有価証券 400株
パーソルホールディングス	14,400	2,333.00	33,595,200	
リニカル	1,000	2,131.00	2,131,000	
クックパッド	4,900	590.00	2,891,000	貸付有価証券 2,300株
エスクリ	600	872.00	523,200	
アイ・ケイ・ケイ	800	838.00	670,400	貸付有価証券 500株
学情	700	1,352.00	946,400	貸付有価証券 200株
スタジオアリス	800	2,520.00	2,016,000	
シミックホールディングス	900	2,187.00	1,968,300	
N J S	500	1,799.00	899,500	
総合警備保障	6,200	4,985.00	30,907,000	
カカクコム	11,800	2,369.00	27,954,200	
アイロムグループ	500	1,956.00	978,000	
セントケア・ホールディング	700	701.00	490,700	
サイネックス	100	840.00	84,000	
ルネサンス	700	2,363.00	1,654,100	
ディップ	2,200	2,683.00	5,902,600	
オプトホールディング	1,100	1,980.00	2,178,000	
新日本科学	1,900	505.00	959,500	
ツクイ	3,700	844.00	3,122,800	
キャリアデザインセンター	400	2,236.00	894,400	
エムスリー	16,500	4,555.00	75,157,500	
ツカダ・グローバルホールディング	1,300	619.00	804,700	
プラス	100	828.00	82,800	
アウトソーシング	4,700	2,087.00	9,808,900	
ウェルネット	1,600	1,280.00	2,048,000	
ワールドホールディングス	500	3,755.00	1,877,500	
ディー・エヌ・エー	8,400	2,094.00	17,589,600	
博報堂D Yホールディングス	21,700	1,652.00	35,848,400	
ぐるなび	2,500	925.00	2,312,500	
エスアールジータカミヤ	1,800	674.00	1,213,200	
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	860.00	1,548,000	
ファンコミュニケーションズ	4,400	737.00	3,242,800	
ライク	600	2,126.00	1,275,600	貸付有価証券 400株
ビジネス・ブレークスルー	600	451.00	270,600	

WDBホールディングス	700	3,045.00	2,131,500	
ティア	700	1,053.00	737,100	
CDG	100	1,721.00	172,100	
バリューコマース	1,400	1,488.00	2,083,200	
インフォマート	7,900	1,121.00	8,855,900	
J Pホールディングス	4,900	397.00	1,945,300	
エコナックホールディングス	3,100	126.00	390,600	
E P Sホールディングス	2,300	2,158.00	4,963,400	
レグス	400	1,011.00	404,400	
プレステージ・インターナショナル	3,300	1,591.00	5,250,300	
アミューズ	1,000	3,090.00	3,090,000	
ドリームインキュベータ	500	2,266.00	1,133,000	
クイック	1,000	1,693.00	1,693,000	
T A C	1,100	316.00	347,600	
ケネディクス	20,700	701.00	14,510,700	
電通	19,000	5,200.00	98,800,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	1,530.00	1,224,000	
ぴあ	500	6,080.00	3,040,000	貸付有価証券 300株
イオンファンタジー	500	7,050.00	3,525,000	
シーティーエス	1,600	956.00	1,529,600	
ネクシィーズグループ	500	1,599.00	799,500	
みらかホールディングス	4,700	3,540.00	16,638,000	
アルプス技研	1,400	2,334.00	3,267,600	
サニックス	2,700	342.00	923,400	
ダイオーズ	400	1,300.00	520,000	
日本空調サービス	1,700	792.00	1,346,400	
オリエンタルランド	18,500	11,150.00	206,275,000	
ダスキン	4,200	2,638.00	11,079,600	
明光ネットワークジャパン	2,000	1,278.00	2,556,000	
ファルコホールディングス	800	1,852.00	1,481,600	
秀英予備校	400	486.00	194,400	
田谷	300	671.00	201,300	
ラウンドワン	4,900	1,922.00	9,417,800	
リゾートトラスト	6,600	2,002.00	13,213,200	
ビー・エム・エル	2,000	2,725.00	5,450,000	
ワタベウェディング	400	547.00	218,800	
りらいあコミュニケーションズ	2,500	1,548.00	3,870,000	
リソー教育	2,600	868.00	2,256,800	
早稲田アカデミー	200	2,193.00	438,600	
ユー・エス・エス	19,100	2,061.00	39,365,100	
東京個別指導学院	600	1,109.00	665,400	
サイバーエージェント	9,600	5,690.00	54,624,000	

楽天	80,100	731.60	58,601,160	
クリーク・アンド・リバー社	800	1,111.00	888,800	
テー・オー・ダブリュー	1,500	901.00	1,351,500	
セントラルスポーツ	600	4,180.00	2,508,000	
フルキャストホールディングス	1,400	2,822.00	3,950,800	
リソルホールディングス	200	4,455.00	891,000	
テクノプロ・ホールディングス	3,000	7,050.00	21,150,000	
アトラ	200	799.00	159,800	
インターワークス	400	998.00	399,200	
Keepers 技研	500	1,327.00	663,500	
ファーストロジック	300	792.00	237,600	
三機サービス	200	1,732.00	346,400	貸付有価証券 100株
Gunosy	900	1,668.00	1,501,200	貸付有価証券 600株
デザインワン・ジャパン	300	1,294.00	388,200	
イー・ガーディアン	700	3,230.00	2,261,000	
リブセンス	1,100	559.00	614,900	
ジャパンマテリアル	4,300	1,766.00	7,593,800	
ベクトル	1,900	2,207.00	4,193,300	
ウチヤマホールディングス	800	559.00	447,200	
ライクキッズネクスト	500	1,129.00	564,500	
キャリアリンク	500	561.00	280,500	
I B J	1,200	681.00	817,200	貸付有価証券 800株
アサンテ	600	2,280.00	1,368,000	
N・フィールド	900	1,646.00	1,481,400	
バリューHR	200	1,954.00	390,800	
M&Aキャピタルパートナーズ	400	10,600.00	4,240,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,189.00	594,500	
E R Iホールディングス	500	1,025.00	512,500	
アビスト	200	4,965.00	993,000	
シグマクシス	800	1,469.00	1,175,200	貸付有価証券 500株
ウィルグループ	700	1,094.00	765,800	
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	2,200	448.00	985,600	貸付有価証券 1,400株
日本ビューホテル	200	1,503.00	300,600	
リクルートホールディングス	120,700	3,030.00	365,721,000	
エラン	500	2,553.00	1,276,500	
土木管理総合試験所	500	589.00	294,500	
日本郵政	88,800	1,247.00	110,733,600	
ベルシステム24ホールディングス	2,600	1,866.00	4,851,600	
鎌倉新書	200	3,490.00	698,000	貸付有価証券 100株

一蔵	100	821.00	82,100	
LITALICO	400	1,575.00	630,000	貸付有価証券 200株
グローバルグループ	200	1,596.00	319,200	
エボラブルアジア	400	2,112.00	844,800	貸付有価証券 200株
ストライク	400	4,065.00	1,626,000	貸付有価証券 200株
ソラスト	1,000	3,645.00	3,645,000	
セラク	300	795.00	238,500	貸付有価証券 200株
インソース	500	2,456.00	1,228,000	貸付有価証券 300株
キャリアインデックス	200	3,100.00	620,000	
MS - Japan	100	7,710.00	771,000	
船場	300	1,177.00	353,100	
フルテック	200	1,134.00	226,800	貸付有価証券 100株
グリーンズ	300	1,614.00	484,200	
日総工産	300	5,470.00	1,641,000	
キュービーネットホールディングス	800	1,785.00	1,428,000	
リログループ	8,500	2,815.00	23,927,500	
東祥	1,000	4,020.00	4,020,000	
エイチ・アイ・エス	2,400	3,760.00	9,024,000	
ラックランド	200	2,721.00	544,200	
共立メンテナンス	2,800	5,630.00	15,764,000	
イチネンホールディングス	1,800	1,431.00	2,575,800	
建設技術研究所	1,100	1,450.00	1,595,000	
スペース	1,000	1,474.00	1,474,000	
長大	600	929.00	557,400	
燦ホールディングス	400	2,695.00	1,078,000	
スバル興業	100	7,020.00	702,000	
東京テアトル	600	1,424.00	854,400	
タナベ経営	400	2,030.00	812,000	
ナガワ	300	4,425.00	1,327,500	
よみうりランド	300	4,790.00	1,437,000	
東京都競馬	1,200	4,745.00	5,694,000	
常磐興産	600	1,823.00	1,093,800	
カナモト	2,400	3,790.00	9,096,000	
東京ドーム	6,400	1,049.00	6,713,600	
西尾レントオール	1,600	3,595.00	5,752,000	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	10,000	34.00	340,000	
トランス・コスモス	1,700	2,586.00	4,396,200	
乃村工藝社	3,700	2,349.00	8,691,300	
藤田観光	600	3,390.00	2,034,000	

KNT-CTホールディングス	1,000	1,528.00	1,528,000	
日本管財	1,700	2,199.00	3,738,300	
トーカイ	1,500	2,262.00	3,393,000	
白洋舎	200	3,485.00	697,000	
セコム	16,600	8,119.00	134,775,400	
セントラル警備保障	800	4,360.00	3,488,000	
丹青社	3,200	1,395.00	4,464,000	
メイテック	1,800	5,020.00	9,036,000	
応用地質	1,700	1,459.00	2,480,300	
船井総研ホールディングス	3,200	2,651.00	8,483,200	
進学会ホールディングス	900	641.00	576,900	
オオバ	1,300	640.00	832,000	貸付有価証券 900株
いであ	300	1,114.00	334,200	
学究社	500	1,810.00	905,000	
ベネッセホールディングス	5,700	3,960.00	22,572,000	
イオンディライト	1,900	3,885.00	7,381,500	
ナック	1,000	902.00	902,000	
ニチイ学館	3,000	1,180.00	3,540,000	
ダイセキ	2,600	3,505.00	9,113,000	
ステップ	600	1,780.00	1,068,000	
合 計	19,856,050		40,894,462,100	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2018年 6月29日現在です。

### 【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	43,377,542,092円
負債総額	1,381,476,872円
純資産総額（ - ）	41,996,065,220円
発行済口数	21,415,868,397口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9610円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### （1）名義書換

該当事項はありません。

##### （2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

##### （3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

##### 受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

##### 受益権の譲渡の対抗要件

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

##### （4）受益証券の再発行

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

##### （5）受益権の再分割

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

##### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

2018年6月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の意思決定機関（2018年6月末現在）

###### ・株主総会

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

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

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

###### ・監査役会

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

##### (3) 運用の意思決定プロセス（2018年6月末現在）

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

### 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2018年6月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	810	176,770

株式投資信託	768	149,190
単位型	228	8,378
追加型	540	140,812
公社債投資信託	42	27,579
単位型	28	457
追加型	14	27,121

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第59期事業年度(平成29年4月1日から平成30年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	16,761	3	14,024
金銭の信託	3	152		-
有価証券		10		19
前払費用		506		551
未収入金		136		73
未収委託者報酬		10,757		15,873
未収収益	3	2,799	3	3,174
関係会社短期貸付金		962		1,128
立替金		1,240		2,776
繰延税金資産		865		1,014
その他	2,3	385	2,3	4,179
流動資産合計		34,577		42,814
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	93	1	68
器具備品	1	190	1	122
有形固定資産合計		283		191
無形固定資産				
ソフトウェア		138		99
無形固定資産合計		138		99
投資その他の資産				
投資有価証券		11,783		14,103
関係会社株式		23,203		25,769
関係会社長期貸付金		60		-
長期差入保証金		782		490

長期前払費用	0	0
繰延税金資産	423	489
投資その他の資産合計	36,253	40,854
固定資産合計	36,674	41,144
資産合計	71,252	83,959

(単位：百万円)

	第58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	3 589	3 3,804
未払金	4,043	5,874
未払収益分配金	7	7
未払償還金	91	91
未払手数料	3 3,499	3 5,124
その他未払金	445	651
未払費用	3 4,229	3 4,634
未払法人税等	1,808	2,185
未払消費税等	4 538	4 788
賞与引当金	2,077	2,286
役員賞与引当金	168	198
その他	3 62	41
流動負債合計	13,517	19,813
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	1,259	1,316
その他	-	318
固定負債合計	1,259	1,634
負債合計	14,777	21,448
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	34,015	39,959
利益剰余金合計	34,015	39,959
自己株式	672	786
株主資本合計	55,926	61,756
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	282	408
繰延ヘッジ損益	266	346
評価・換算差額等合計	548	754
純資産合計	56,475	62,511

負債純資産合計	71,252	83,959
---------	--------	--------

## (2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第58期	第59期
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	64,680	70,609
その他営業収益	4,218	5,398
営業収益合計	68,898	76,008
営業費用		
支払手数料	28,675	30,448
広告宣伝費	969	973
公告費	2	2
調査費	17,322	18,132
調査費	841	862
委託調査費	16,456	17,241
図書費	24	28
委託計算費	498	520
営業雑経費	656	740
通信費	185	173
印刷費	276	348
協会費	66	68
諸会費	17	24
その他	111	125
営業費用計	48,124	50,817
一般管理費		
給料	8,243	9,096
役員報酬	360	507
役員賞与引当金繰入額	168	198
給料・手当	5,576	6,083
賞与	61	20
賞与引当金繰入額	2,077	2,286
交際費	99	99
寄付金	17	16
旅費交通費	412	455
租税公課	375	424
不動産賃借料	889	890
退職給付費用	390	355
退職金	20	24
固定資産減価償却費	192	152
福利費	959	974
諸経費	2,791	3,175
一般管理費計	14,394	15,664
営業利益	6,380	9,526

	(単位：百万円)	
	第58期	第59期
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第58期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028
当期変動額							
剰余金の配当				1,495	1,495		1,495
当期純利益				5,562	5,562		5,562
自己株式の取得						170	170

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,067	4,067	170	3,897
当期末残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926

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

第59期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当期末残高	408	346	754	62,511
-------	-----	-----	-----	--------

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

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

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

## (貸借対照表関係)

第58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,222百万円</p> <p>器具備品 603百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,260百万円</p> <p>器具備品 612百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち3,030百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>
<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,243百万円</p> <p>金銭の信託 152百万円</p> <p>未収収益 619百万円</p> <p>その他 20百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>預り金 177百万円</p> <p>未払手数料 144百万円</p> <p>未払費用 251百万円</p> <p>その他 61百万円</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,189百万円</p> <p>未収収益 592百万円</p> <p>その他 345百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>預り金 419百万円</p> <p>未払手数料 376百万円</p> <p>未払費用 677百万円</p>
<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>	<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>
<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務587百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務546百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務553百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務103百万円に対して保証を行っております。</p>

## (損益計算書関係)

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

<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%;"> <tr> <td>受取配当金</td> <td style="text-align: right;">1,550百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ収益</td> <td style="text-align: right;">347百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">58百万円</td> </tr> </table> <p>2 過年度の取引に関する法人税等の追加費用計上額です。</p>	受取配当金	1,550百万円	デリバティブ収益	347百万円	支払利息	58百万円	<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%;"> <tr> <td>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
受取配当金	1,550百万円												
デリバティブ収益	347百万円												
支払利息	58百万円												
受取配当金	979百万円												
デリバティブ収益	407百万円												
支払利息	213百万円												

## (株主資本等変動計算書関係)

第58期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権等に関する事項

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

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

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

3 平成21年度ストックオプション(1)1,689,600株、平成21年度ストックオプション(2)174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,890,800株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第59期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,119,100	182,600	-	1,301,700

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,689,600	-	194,700	1,494,900	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	204,600	2,686,200	-
平成28年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	786,000	3,618,000	-
平成28年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	532,000	3,877,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	1,783,300	11,785,000	-

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

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

3 平成21年度ストックオプション(1)1,494,900株、平成21年度ストックオプション(2)108,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,686,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)及び平成28年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年5月31日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,640	8.38	平成30年3月31日	平成30年6月23日

## (リース取引関係)

第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
オペレーティング・リース取引	オペレーティング・リース取引

解約不能のものに係る未経過リース料		解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	865百万円	1年内	866百万円
1年超	1,787百万円	1年超	923百万円
合計	2,653百万円	合計	1,790百万円

## (金融商品関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

## 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損

益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ - ・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベ - スで実施しております。さらに、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

#### 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

#### (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

#### (6) 未払金及び(7) 未払費用

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

#### (8) デリバティブ取引

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

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

び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

#### 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	16,761	-	-	-
未収委託者報酬	10,757	-	-	-
未収収益	2,799	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	10	616	907	735
合計	30,328	616	907	735

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

##### 1 金融商品の状況に関する事項

###### (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

###### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

###### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

## 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

平成30年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額( 1)	時価( 1)	差額
(1) 現金・預金	14,024	14,024	-
(2) 未収委託者報酬	15,873	15,873	-
(3) 未収収益	3,174	3,174	-
(4) 関係会社短期貸付金	1,128	1,128	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	14,106	14,106	-
(6) 未払金	(5,874)	(5,874)	-
(7) 未払費用	(4,634)	(4,634)	-
(8) デリバティブ取引( 2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(14)	(14)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	336	336	-
デリバティブ取引計	321	321	-

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

## (6) 未払金及び(7) 未払費用

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

ております。

#### (8) デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないものうち8百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているものは貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

- 2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式（貸借対照表計上額22,876百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

#### 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

#### 1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,310
関連会社株式	2,892

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

#### 2 その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

#### 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

#### 2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

## (デリバティブ取引関係)

第58期(平成29年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資	2,993	-	11
	豪ドル	有価証券	77	-	2
	シンガポールドル		1,639	-	20
	香港ドル		205	-	2
	人民元		1,946	-	6
	ユーロ		57	-	0
合計			6,920	-	1

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第59期(平成30年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

第58期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)	第59期 (自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,030	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,008
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,455	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,409
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,092	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,827

## (退職給付関係)

第58期(自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

退職給付債務	1,190
未積立退職給付債務	1,190
未認識数理計算上の差異	69

貸借対照表に計上された負債の額	1,259
-----------------	-------

退職給付引当金	1,259
---------	-------

貸借対照表に計上された負債の額	1,259
-----------------	-------

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	150
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	23
----------------	----

確定給付制度に係る退職給付費用	177
-----------------	-----

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、213百万円でありました。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

退職給付債務の期首残高	1,190
-------------	-------

勤務費用	130
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の発生額	66
--------------	----

退職給付の支払額	76
----------	----

退職給付債務の期末残高	1,313
-------------	-------

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

退職給付債務	1,313
--------	-------

未積立退職給付債務	1,313
-----------	-------

未認識数理計算上の差異	2
-------------	---

貸借対照表に計上された負債の額	1,316
-----------------	-------

退職給付引当金	1,316
---------	-------

貸借対照表に計上された負債の額	1,316
-----------------	-------

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	130
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	0
----------------	---

確定給付制度に係る退職給付費用	132
-----------------	-----

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.2%

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、222百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## 単価情報

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

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年 7月15日
権利行使価格(円)	737 (注) 3	558

付与日における公正な評価単価 (円) (注)1	0	0
----------------------------	---	---

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

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

### (1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

	平成28年度ストックオプション(2)
--	--------------------

付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員	31名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式	4,409,000株
付与日	平成29年4月27日	
権利確定条件	平成31年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	
権利行使期間	平成31年4月27日から 平成39年4月30日まで	

（注） 株式数に換算して記載しております。

## （2）ストックオプション（新株予約権）の規模及びその変動状況

### ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,689,600	174,900
付与	0	0
失効	194,700	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,494,900	108,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,890,800	4,404,000
付与	0	0
失効	204,600	786,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,686,200	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

平成28年度ストックオプション(2)	
付与日	平成29年4月27日
権利行使価格(円)	553
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0

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

(税効果会計関係)

第58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳  (単位：百万円)	1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳  (単位：百万円)
	繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)
	賞与引当金 641		賞与引当金 700
	その他 224		その他 314
	小計 865		小計 1,014
	繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)
	投資有価証券評価損 96		投資有価証券評価損 96
	関係会社株式評価損 1,430		関係会社株式評価損 1,430
	退職給付引当金 385		退職給付引当金 402
	固定資産減価償却費 119		固定資産減価償却費 111
	その他 63		その他 211
	小計 2,095		小計 2,253
	繰延税金資産小計 2,961		繰延税金資産小計 3,268
	評価性引当金 1,430		評価性引当金 1,430
	繰延税金資産合計 1,530		繰延税金資産合計 1,838
	繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)
	その他有価証券評価差額金 0		その他有価証券評価差額金 -
	小計 0		小計 -
	繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(固定)
	その他有価証券評価差額金 123		その他有価証券評価差額金 180
	繰延ヘッジ利益 117		繰延ヘッジ利益 152
	小計 241		小計 333
	繰延税金負債合計 242		繰延税金負債合計 333
	繰延税金資産の純額 1,288		繰延税金資産の純額 1,504
2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
	法定実効税率 30.9% (調整)		法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.6%		
	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 5.3%		
	過年度法人税等 1.5%		
	海外子会社の留保利益の影響額等 0.2%		
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 27.9%		

## ( 関連当事者情報 )

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	312,000 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付 (シンガポールドル貨建) (注1)	65 (SGD 800 千) (注2)	関係会社 短期貸付 金	385 (SGD 4,800千)
							貸付金利息 (シンガポールドル貨建) (注1)	13 (SGD 177 千)	未収収益	8 (SGD 105千)
							資金の貸付 (円貨建) (注3)	4,422 (注4)	関係会社 短期貸付 金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注3)	3	未収収益	3
							-	増資の 引受 (注5)	1,501 (SGD 20,000 千)	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542 (USD 千) (注6)	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入 (米ドル貨建) (注7)	5,549 (USD 50,000 千) (注8)	関係会社 短期借入 金	-
							借入金利息 (米ドル貨建) (注7)	48 (USD 453 千)	未払費用	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	25,221百万円
負債合計	5,428百万円
純資産合計	19,792百万円

営業収益	18,250百万円
税引前当期純利益	6,809百万円
当期純利益	4,680百万円

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

### (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

#### (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

#### (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	159 (SGD 2,000千)(注2)	関係会社短期貸付金	550 (SGD 6,800千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	13 (SGD 162千)	未収収益	8 (SGD 110千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	-	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建)(注3)	12	未収収益	3
						-	増資の引受(注4)	2,466 (SGD 30,369千)	-	-
子会社	日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社	日本	100 (百万円)	金融商品取引業者として登録を受けるための準備会社	直接 100.00	-	増資の引受(注5)	100	-	-

#### (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額159百万円(SGD2,000千)の内訳は、貸付159百万円(SGD2,000千)であります。
- 融資枠5,000百万円、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った30,369,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
- 日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社の行った2,000株の新株発行を、1株につき50千円で当社が引受けたものであります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成29年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

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

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

## 関連情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(百万円)	5,562	6,979
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-

普通株式に係る当期純利益(百万円)	5,562	6,979
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,009	195,794
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 1,689,600株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,890,800株、平成28年度ストックオプション(1) 4,404,000株	平成21年度ストックオプション(1) 1,494,900株、平成21年度ストックオプション(2) 108,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,686,200株、平成28年度ストックオプション(1) 3,618,000株、平成28年度ストックオプション(2) 3,877,000株

### 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	56,475	62,511
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	56,475	62,511
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	195,893	195,711

#### (重要な後発事象)

#### 新株予約権(ストックオプション)の付与

当社は平成30年3月15日付の臨時株主総会及び平成30年3月20日開催の取締役会の決議に基づき、平成30年4月27日にストックオプションとして新株予約権を当社、当社子会社の取締役及び従業員36名に付与いたしました。

新株予約権の数	4,422個
新株予約権の目的となる株式の種類及び数	当社普通株式 4,422,000株
新株予約権の発行価額	無償
新株予約権の行使時の払込金額	1株当たり金694円
新株予約権の行使期間	平成32年4月27日から平成40年4月30日まで

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、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 (2018年3月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### < 再信託受託会社の概要 >

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額 : 51,000百万円(2018年3月末現在)

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

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

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2018年3月末現在)	事業の内容
株式会社京都銀行	42,103百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社北國銀行	26,673百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社りそな銀行	279,928百万円	
住友生命保険相互会社	100,000百万円 (基金の総額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
ソニ - 生命保険株式会社	70,000百万円	
第一生命保険株式会社	60,000百万円	

富国生命保険相互会社	10,000百万円 (基金の総額)	
信金中央金庫	690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(2018年3月末現在)

### (2) 販売会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(2018年3月末現在)

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2017年 8月31日	有価証券届出書
2017年 8月31日	有価証券報告書
2018年 2月28日	有価証券届出書の訂正届出書
2018年 2月28日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

平成30年6月15日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

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

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年7月11日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### P w Cあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の平成29年6月1日から平成30年5月31日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の平成30年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。