

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年5月1日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 安倍 秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	財形株投（一般財形30） 財形株投（一般財形50） 財形株投（年金・住宅財形30）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	財形株投（一般財形30） 1兆円を上限とします。 財形株投（一般財形50） 1兆円を上限とします。 財形株投（年金・住宅財形30） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

財形株投（一般財形30）

財形株投（一般財形50）

財形株投（年金・住宅財形30）

- ・以下、上記を総称して、また各々を称して「財形株投」、「ファンド」または「ポートフォリオ」ということがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド毎に、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

勤務先の事務局、販売会社の照会先にお問い合わせください。

### （７）【申込期間】

2020年5月2日から2021年4月30日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

### （８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

( 9 ) 【払込期日】

- ・取得申込者は、原則として勤務先の事務局を通じて給与天引きにより申込金額を支払うものとします。
- ・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

( 1 0 ) 【払込取扱場所】

申込金額は、原則として勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

信託財産の成長と安定した収益の確保を目的として安定運用を行ないます。

ファンドの基本的性格

##### 1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株 式 債 券
	海外	不動産投信
追加型投信	内外	その他資産 ( )
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

##### 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

## ファンドの特色

# 1. 「財形株投」は、財形貯蓄制度をご利用いただく勤労者の皆様専用のファンドです。

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

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

<財形株投(一般財形 30)> 実質株式組入上限 30%

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

<財形株投(一般財形 50)> 実質株式組入上限 50%

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

<財形株投(年金・住宅財形 30)> 実質株式組入上限 30%

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

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

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

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

# 3. 信託財産の安定した成長をめざして安定運用を行ないます。

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

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



## \*1 パーラ日本株式モデル

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

## \*2 TOPIX(東証株価指数)

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

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

## 4.

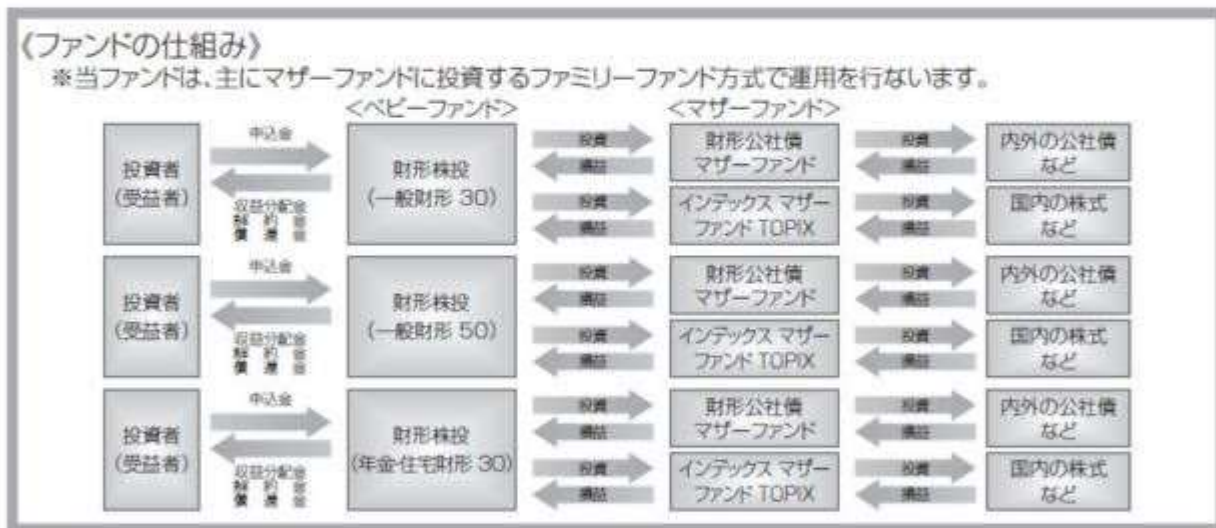
お買付けは無手数料で、給与天引きで行ないます。

給与からの天引きですので、毎月定期的に積立いただけます。

## 5.

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

詳しくは、勤務先の事務局へお問い合わせください。



## 主な投資制限

## 「財形株投(一般財形 30)」

## 「財形株投(年金・住宅財形 30)」

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

## 「財形株投(一般財形 50)」

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

## 分配方針

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

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 信託金限度額

- ・各ファンド毎に、5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

## (2) 【ファンドの沿革】

1994年 2月 4日

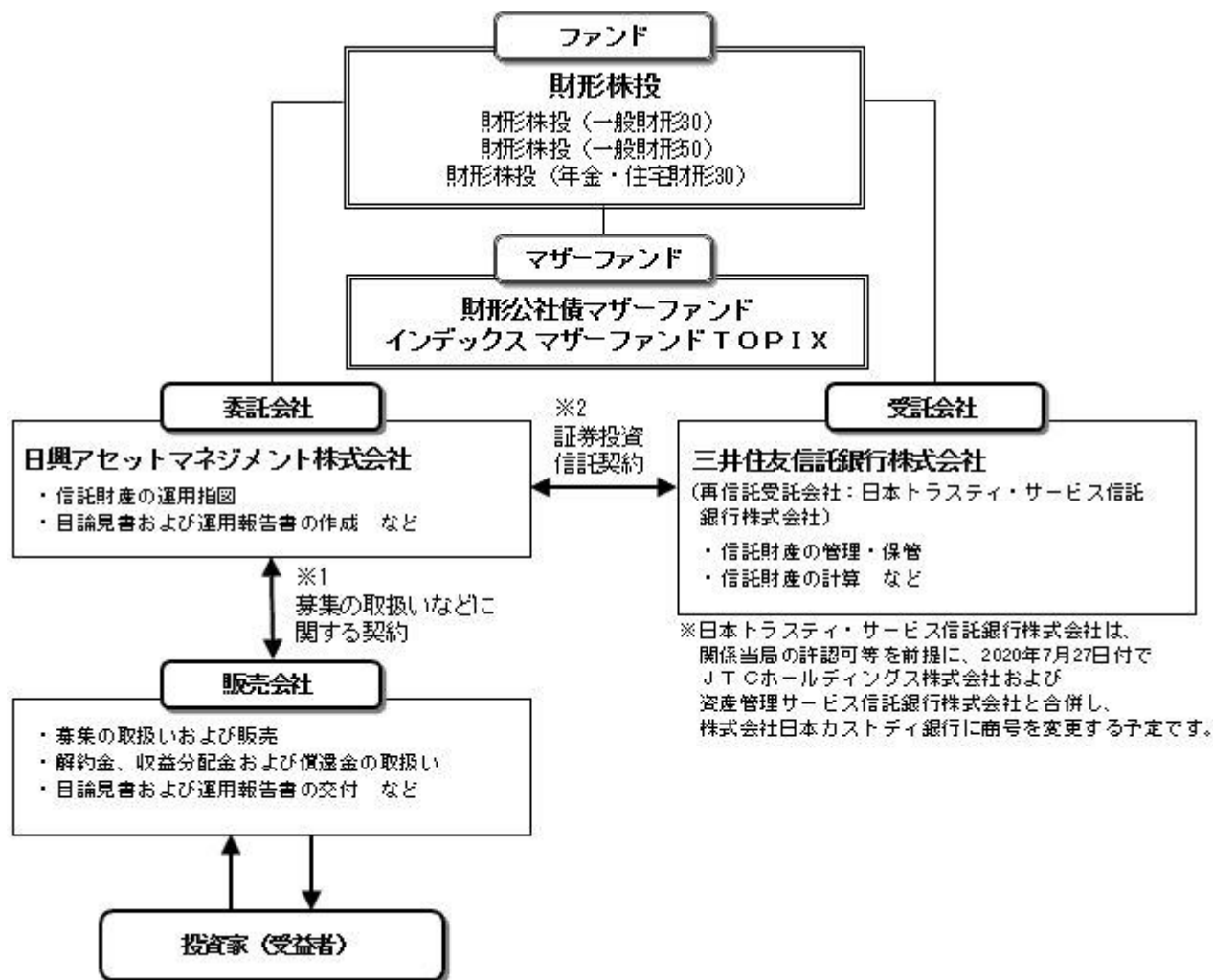
- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

2018年3月20日

・投資対象ファンドに関する変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものを。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を。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2020年2月末現在）

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

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



## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

<財形株投（一般財形30）>

<財形株投（年金・住宅財形30）>

- ・「財形公社債マザーファンド」受益証券および内外の公社債への投資により安定した収益の確保を図り、「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資により信託財産の成長をめざします。
- ・「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の30%とし、原則として常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

<財形株投（一般財形50）>

- ・「財形公社債マザーファンド」受益証券および内外の公社債への投資により安定した収益の確保を図り、「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資により信託財産の成長をめざします。
- ・「インデックス マザーファンド T O P I X」受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の50%とし、原則として常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

### (2)【投資対象】

<財形株投（一般財形30）>

<財形株投（一般財形50）>

<財形株投（年金・住宅財形30）>

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～8)の証券または証書の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券

- 11) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 12) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 13) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 16) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 17) 外国の者に対する権利で16)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。 )により運用することができます。
  - 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
    - 1) 信用取引
    - 2) 先物取引等
    - 3) スワップ取引
    - 4) 有価証券の貸付
    - 5) 外国為替予約取引
    - 6) 資金の借入

#### <インデックス マザーファンド TOPIX>

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第18条に定めるものに限ります。)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形  
主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。 )に投資することができます。
  - 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
  - 2) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。 )およびコマーシャル・ペーパー
  - 3) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)の証券の性質を有するもの
  - 4) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。 )
  - 5) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。 )のうち投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。 )に類する証券以外のもの
  - 6) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。 )
  - 7) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。 )により運用することができます。
    - 1) 預金

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

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

次の取引ができます。

1) 信用取引

2) 先物取引等

3) スワップ取引

4) 有価証券の貸付

#### < 財形公社債マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）

2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第13条および第13条の2に定めるものに限りま。

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

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

1) 国債証券

2) 地方債証券

3) 特別の法律により法人の発行する債券

4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限りま。

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

6) コマーシャル・ペーパー

7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの

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

9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。

12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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

1) 預金

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

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

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

1) 先物取引等

2) スワップ取引

3) 有価証券の貸付

## 4) 外国為替予約取引

## 投資対象とするマザーファンドの概要

## &lt; 財形公社債マザーファンド &gt;

運用の基本方針	
基本方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保を目的として安定運用を行いません。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保をはかります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 株式への投資は行いません。</li> <li>・ 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>・ 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。</li> <li>・ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1994年2月4日設定）
決算日	毎年2月1日 （2月1日および2日のいずれかが休業日のときは、2月1日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち2月1日に最も近い日を決算日とします。）

## &lt; インデックス マザーファンド TOPIX &gt;

## 運用の基本方針

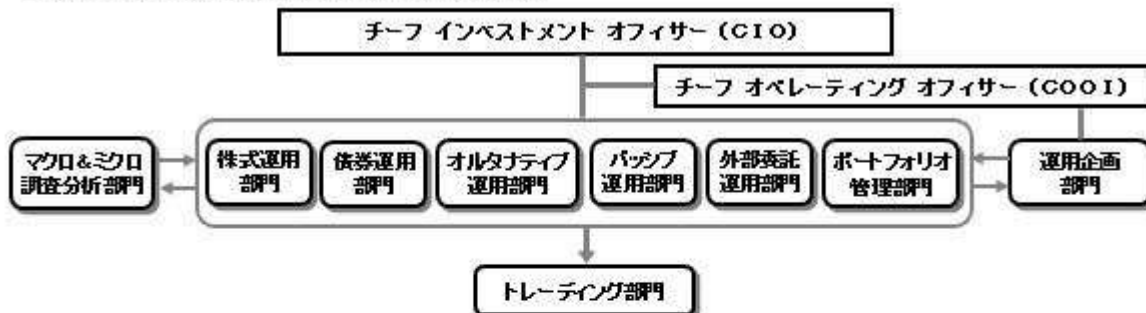
基本方針	わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、「バラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行いません。 東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行いません。 資金の流出入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行いません。 株式の組入比率は、高位を保ちます。</li> <li>株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</li> <li>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
決算日	毎年2月12日（休業日の場合は翌営業日）

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

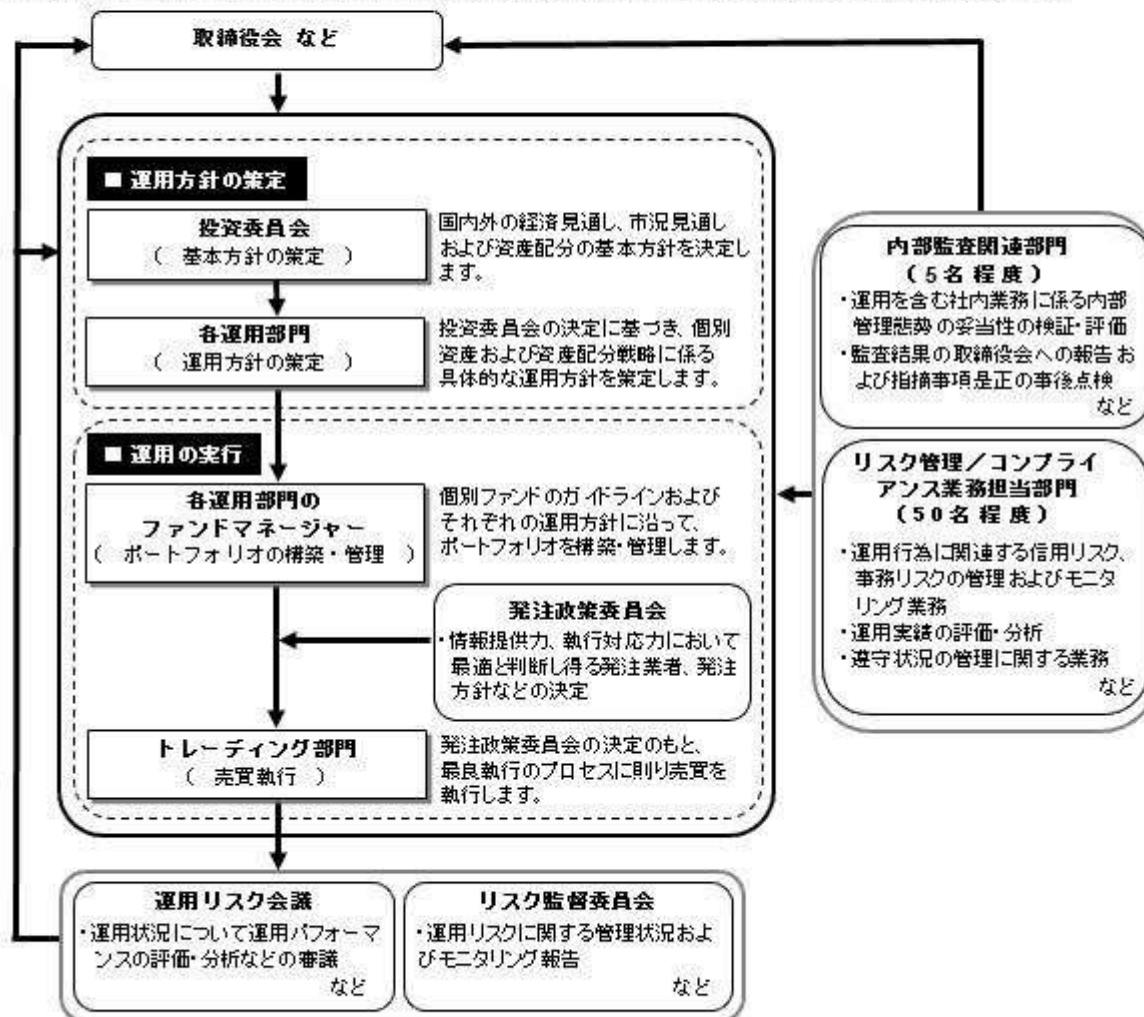
ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

## (3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



**委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制**

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

上記体制は2020年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【配分方針】

収益配分方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての配分方針

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

ります。

### 3) 留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行いません。

#### 収益分配金の支払い

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

## (5) 【投資制限】

### 約款に定める投資制限

< 財形株投(一般財形30) >

< 財形株投(一般財形50) >

< 財形株投(年金・住宅財形30) >

1) < 財形株投(一般財形30) >

< 財形株投(年金・住宅財形30) >

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

< 財形株投(一般財形50) >

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

2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。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) 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

6) 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

ロ) 株式分割により取得する株券

ハ) 有償増資により取得する株券

ニ) 売り出しにより取得する株券

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

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

9) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所にお



ける有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

10)信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

11)信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

12)信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額

とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 14) 信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
  - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- 八) 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
- 二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 17) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

#### <インデックス マザーファンド TOPIX>

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

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

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

#### <財形公社債マザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 4) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします。
  - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
  - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および

償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 5) 信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 6) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
- ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債を次に定める範囲内で貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則と

して、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

#### 法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

##### 流動性リスク

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

##### 信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト(債務不履行)や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト(債務不履行)が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

##### 為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、

ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

< その他の留意事項 >

・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

・ 投資対象とする投資信託証券に関する事項

ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

・ 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

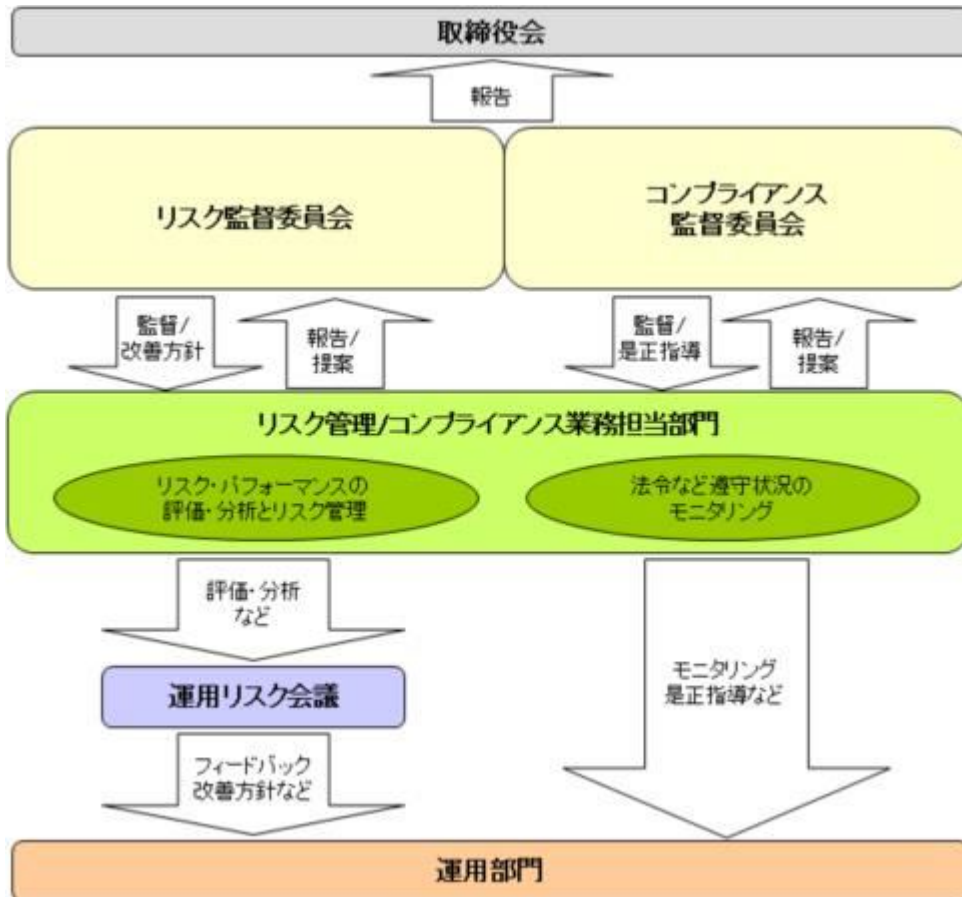
・ 運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・ 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

( 2 ) リスク管理体制



### 全社リスク管理

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

### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

### 法令など遵守状況のモニタリング

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

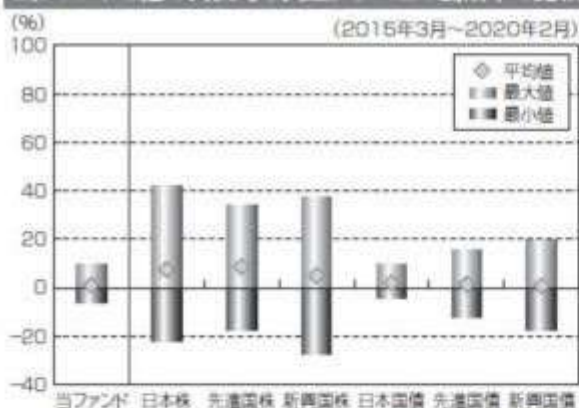
上記体制は2020年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。



## (参考情報)

## 「財形株投（一般財形 30）」

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	1.0%	7.5%	8.6%	4.9%	2.0%	1.3%	0.8%
最大値	9.9%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	15.3%	19.3%
最小値	-8.4%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

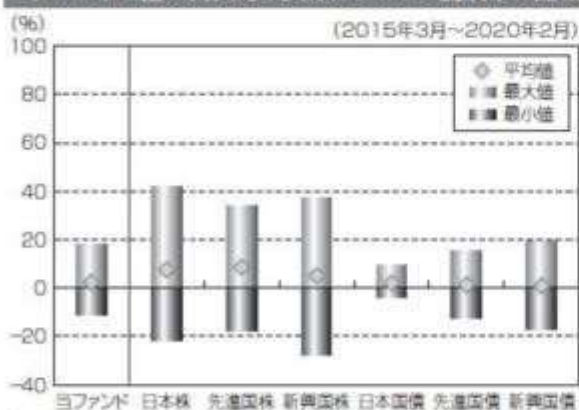
※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 「財形株投（一般財形 50）」

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

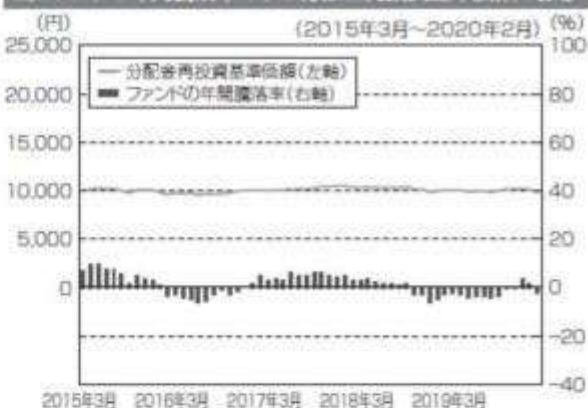
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	2.4%	7.5%	8.6%	4.9%	2.0%	1.3%	0.8%
最大値	17.7%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	15.3%	19.3%
最小値	-11.1%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

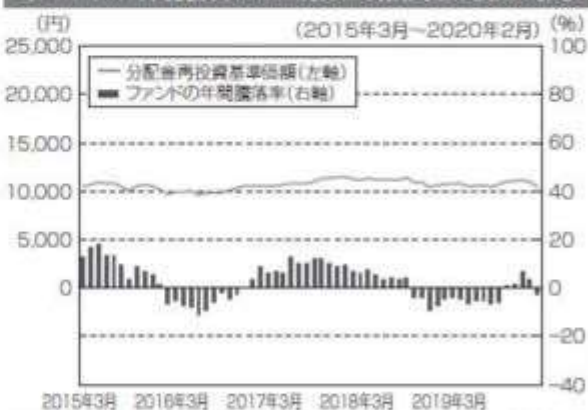


※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

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

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

## 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



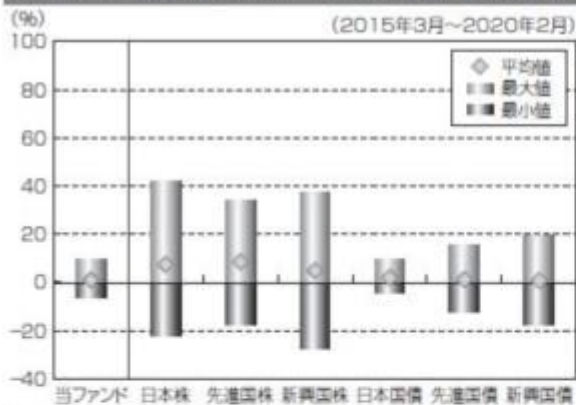
※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

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

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

## 「財形株投(年金・住宅財形 30)」

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	1.0%	7.5%	8.6%	4.9%	2.0%	1.3%	0.8%
最大値	9.9%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	15.3%	19.3%
最小値	-6.4%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

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

## &lt;各資産クラスの指数&gt;

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)  
 先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)  
 新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)  
 日本国債……NOMURA-BPI国債  
 先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
 新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバルレディバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

## 東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

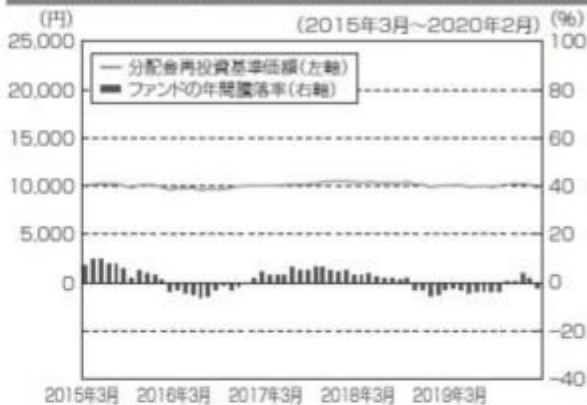
## MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

## NOMURA-BPI国債

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

## 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※ 基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
 ※ 分配金再投資基準価額は、2015年3月末の基準価額を起点として指数化しています。  
 ※ 当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

**FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）**

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

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

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

**4【手数料等及び税金】****(1)【申込手数料】**

ありません。

**(2)【換金（解約）手数料】**

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

**(3)【信託報酬等】**

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.617%（税抜1.47%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

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

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

**(4)【その他の手数料等】**

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

## (5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

<一般財形の場合>

収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、20.315% (所得税15.315%および地方税5%) の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用はありません。)のいずれかを選択することもできます。

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

<年金・住宅財形の場合>

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

(目的外解約)

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

個別元本

- 1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

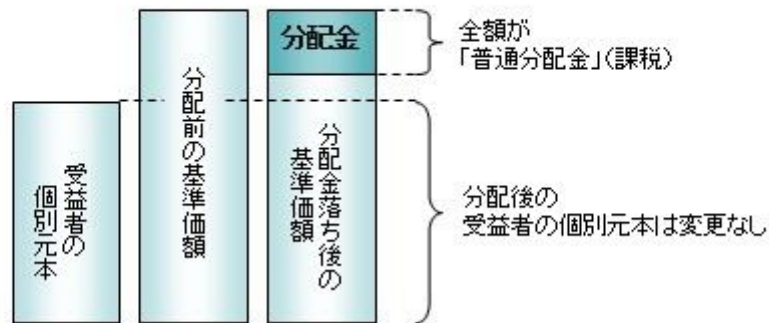
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際



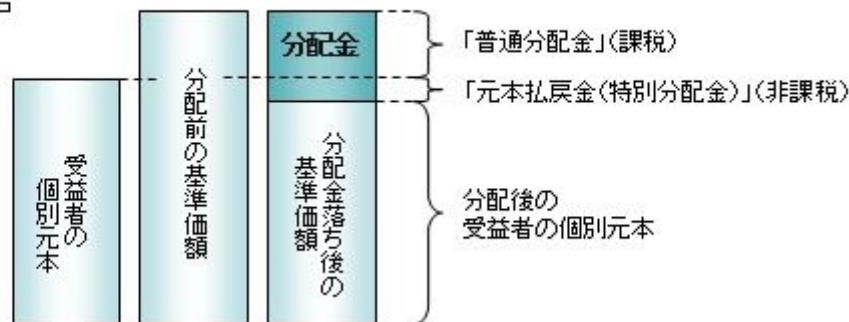
- イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2020年5月1日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【財形株投（一般財形30）】

以下の運用状況は2020年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	97,659,415	94.24
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		5,966,931	5.76
合計(純資産総額)		103,626,346	100.00

#### (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	55,705,859	1.2810	71,361,340	1.2830	71,470,617	68.97
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	13,739,467	2.1094	28,982,032	1.9061	26,188,798	25.27

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.24
合 計	94.24

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第17計算期間末 (2011年 2月 1日)	67	67	0.8673	0.8678
第18計算期間末 (2012年 2月 1日)	66	66	0.8241	0.8246
第19計算期間末 (2013年 2月 4日)	73	74	0.8775	0.8780
第20計算期間末 (2014年 2月 3日)	76	76	0.9341	0.9346
第21計算期間末 (2015年 2月 2日)	76	76	0.9788	0.9793
第22計算期間末 (2016年 2月 1日)	74	74	0.9931	0.9936
第23計算期間末 (2017年 2月 1日)	74	74	1.0043	1.0048
第24計算期間末 (2018年 2月 1日)	96	96	1.0543	1.0548
第25計算期間末 (2019年 2月 4日)	92	92	0.9991	0.9996
第26計算期間末 (2020年 2月 3日)	102	102	1.0087	1.0092
2019年 2月末日	95		1.0031	
3月末日	96		1.0032	
4月末日	97		1.0063	

5月末日	96	0.9861
6月末日	97	0.9933
7月末日	100	0.9946
8月末日	98	0.9852
9月末日	101	1.0005
10月末日	100	1.0127
11月末日	101	1.0161
12月末日	102	1.0181
2020年 1月末日	102	1.0108
2月末日	103	0.9813

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.0005
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	0.0005
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.0005

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.14
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	4.92
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	6.54
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.51
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.84
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.51
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.18
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	5.03
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	5.19
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	1.01

(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17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	9,715,295	447,586
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	9,162,753	6,529,292
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	7,267,816	3,692,263
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	5,310,568	7,297,643
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	7,771,084	11,906,050
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	10,650,522	13,562,169
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	9,441,348	10,877,640
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	19,263,657	1,878,188
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	12,037,575	10,950,460
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	14,822,167	5,888,725

## 【財形株投（一般財形50）】

以下の運用状況は2020年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	193,715,035	97.35
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		5,267,902	2.65
合計（純資産総額）		198,982,937	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	77,686,501	1.2809	99,508,640	1.2830	99,671,780	50.09
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	49,338,049	2.1064	103,927,855	1.9061	94,043,255	47.26

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.35

合 計	97.35
-----	-------

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第17計算期間末 (2011年 2月 1日)	147	147	0.7994	0.7999
第18計算期間末 (2012年 2月 1日)	147	147	0.7364	0.7369
第19計算期間末 (2013年 2月 4日)	180	180	0.8230	0.8235
第20計算期間末 (2014年 2月 3日)	169	169	0.9212	0.9217
第21計算期間末 (2015年 2月 2日)	183	183	0.9993	0.9998
第22計算期間末 (2016年 2月 1日)	187	187	1.0263	1.0268
第23計算期間末 (2017年 2月 1日)	207	207	1.0525	1.0530
第24計算期間末 (2018年 2月 1日)	241	241	1.1549	1.1554
第25計算期間末 (2019年 2月 4日)	225	225	1.0635	1.0640
第26計算期間末 (2020年 2月 3日)	209	209	1.0921	1.0926
2019年 2月末日	228		1.0713	
3月末日	215		1.0714	
4月末日	217		1.0783	
5月末日	205		1.0426	
6月末日	207		1.0556	
7月末日	213		1.0590	
8月末日	211		1.0417	
9月末日	218		1.0709	
10月末日	225		1.0948	
11月末日	228		1.1031	
12月末日	213		1.1088	
2020年 1月末日	210		1.0961	
2月末日	198		1.0404	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.0005
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	0.0005
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.0005

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.77
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	7.82
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	11.83
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	11.99
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	8.53
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	2.75
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	2.60
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	9.78
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	7.87
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	2.74

(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17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	28,271,781	18,105,413
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	27,582,276	11,103,657
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	26,104,473	7,608,165
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	18,531,876	53,414,352
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	17,501,615	18,329,958
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	17,040,435	17,577,441
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	18,988,051	4,886,387
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	48,663,216	36,200,357
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	21,221,642	18,123,775

第26期	2019年 2月 5日 ~ 2020年 2月 3日	21,804,485	42,344,325
------	---------------------------	------------	------------

### 【財形株投（年金・住宅財形30）】

以下の運用状況は2020年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	192,015,792	97.29
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		5,347,180	2.71
合計(純資産総額)		197,362,972	100.00

#### (2) 【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	106,930,370	1.2809	136,967,111	1.2830	137,191,664	69.51
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	28,762,462	2.1028	60,484,308	1.9061	54,824,128	27.78

##### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.29
合計	97.29

##### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

##### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第17計算期間末 (2011年 2月 1日)	159	159	0.8692	0.8697
第18計算期間末 (2012年 2月 1日)	167	167	0.8257	0.8262
第19計算期間末 (2013年 2月 4日)	178	178	0.8795	0.8800
第20計算期間末 (2014年 2月 3日)	188	188	0.9360	0.9365
第21計算期間末 (2015年 2月 2日)	190	190	0.9807	0.9812
第22計算期間末 (2016年 2月 1日)	178	178	0.9949	0.9954
第23計算期間末 (2017年 2月 1日)	182	182	1.0057	1.0062
第24計算期間末 (2018年 2月 1日)	210	210	1.0558	1.0563
第25計算期間末 (2019年 2月 4日)	203	203	1.0016	1.0021
第26計算期間末 (2020年 2月 3日)	201	201	1.0109	1.0114
2019年 2月末日	205		1.0057	
3月末日	207		1.0058	
4月末日	202		1.0088	
5月末日	198		0.9885	
6月末日	201		0.9956	
7月末日	202		0.9969	
8月末日	199		0.9875	
9月末日	203		1.0028	
10月末日	204		1.0150	
11月末日	203		1.0184	
12月末日	202		1.0203	
2020年 1月末日	201		1.0131	
2月末日	197		0.9827	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.0005
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	0.0005
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.0005

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.14
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	4.95
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	6.58
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.48
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.83
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.50
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.14
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	5.03
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	5.09
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.98

(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17期	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	24,955,206	12,293,357
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	23,698,329	4,235,525
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	20,751,257	20,707,336
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	17,559,108	18,995,836
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	20,521,555	27,814,502
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	20,768,810	35,315,828
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	22,112,907	19,936,078
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	34,698,129	17,021,386
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	22,034,865	18,046,134
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	21,763,698	25,689,628

（参考）

#### 財形公社債マザーファンド

以下の運用状況は2020年 2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	166,084,660	53.86
地方債証券	日本	38,713,860	12.55
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		103,591,821	33.59

合計（純資産総額）	308,390,341	100.00
-----------	-------------	--------

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第398回利付国債 (2年)	54,000,000	100.27	54,150,120	100.31	54,172,260	0.100	2021/3/1	17.57
日本	国債証券	第129回利付国債 (5年)	50,000,000	100.43	50,215,500	100.52	50,261,000	0.100	2021/9/20	16.30
日本	国債証券	第353回利付国債 (10年)	40,000,000	101.88	40,752,400	102.78	41,112,000	0.100	2028/12/20	13.33
日本	国債証券	第355回利付国債 (10年)	20,000,000	101.79	20,359,000	102.69	20,539,400	0.100	2029/6/20	6.66
日本	地方債証券	平成24年度第3回 愛知県公募公債(10年)	15,000,000	102.06	15,309,750	102.07	15,310,950	0.891	2022/5/30	4.96
日本	地方債証券	平成23年度第2回 京都府公募公債	13,000,000	101.65	13,215,280	101.60	13,208,910	1.200	2021/6/22	4.28
日本	地方債証券	第718回東京都公 募公債	10,000,000	101.87	10,187,300	101.94	10,194,000	0.600	2023/3/20	3.31

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	53.86
地方債証券	12.55
合計	66.41

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## インデックス マザーファンド TOPIX

以下の運用状況は2020年2月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

株式	日本	35,468,416,590	99.76
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		86,008,062	0.24
合計(純資産総額)		35,554,424,652	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	104,965,000	0.30

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	186,000	7,794.00	1,449,684,000	7,127.00	1,325,622,000	3.73
日本	株式	ソニー	電気機器	105,400	7,717.00	813,371,800	6,611.00	696,799,400	1.96
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	129,800	5,751.00	746,479,800	5,013.00	650,687,400	1.83
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,125,000	572.50	644,062,500	531.90	598,387,500	1.68
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	218,800	2,820.50	617,125,400	2,529.50	553,454,600	1.56
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	138,600	4,396.00	609,285,600	3,763.00	521,551,800	1.47
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,100	38,700.00	584,370,000	34,410.00	519,591,000	1.46
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	114,100	4,525.00	516,302,500	3,758.00	428,787,800	1.21
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	113,700	3,928.00	446,613,600	3,484.00	396,130,800	1.11
日本	株式	KDDI	情報・通信業	122,000	3,440.00	419,680,000	3,058.00	373,076,000	1.05
日本	株式	任天堂	その他製品	10,200	40,560.00	413,712,000	36,270.00	369,954,000	1.04
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	131,200	2,958.00	388,089,600	2,799.50	367,294,400	1.03
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	121,000	3,140.00	379,940,000	2,927.50	354,227,500	1.00
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	58,800	6,137.00	360,855,600	5,801.00	341,098,800	0.96
日本	株式	信越化学工業	化学	28,000	13,315.00	372,820,000	12,145.00	340,060,000	0.96
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,233,000	162.50	362,862,500	147.60	329,590,800	0.93
日本	株式	HOYA	精密機器	33,300	10,245.00	341,158,500	9,609.00	319,979,700	0.90
日本	株式	第一三共	医薬品	47,700	8,027.00	382,887,900	6,590.00	314,343,000	0.88
日本	株式	花王	化学	39,900	8,530.00	340,347,000	7,868.00	313,933,200	0.88
日本	株式	ダイキン工業	機械	21,200	16,070.00	340,684,000	14,725.00	312,170,000	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	115,200	2,889.00	332,812,800	2,690.00	309,888,000	0.87
日本	株式	日立製作所	電気機器	80,100	4,265.00	341,626,500	3,637.00	291,323,700	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	15,800	20,900.00	330,220,000	17,970.00	283,926,000	0.80



日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	114,800	2,619.00	300,661,200	2,461.50	282,580,200	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	49,000	6,624.00	324,576,000	5,721.00	280,329,000	0.79
日本	株式	三井物産	卸売業	144,200	1,952.00	281,478,400	1,783.50	257,180,700	0.72
日本	株式	日本電産	電気機器	20,100	14,540.00	292,254,000	12,780.00	256,878,000	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	146,600	1,945.00	285,137,000	1,699.00	249,073,400	0.70
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	11,100	25,175.00	279,442,500	22,325.00	247,807,500	0.70
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	13,900	22,090.00	307,051,000	17,780.00	247,142,000	0.70

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.27
		建設業	2.77
		食料品	3.80
		繊維製品	0.56
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.16
		医薬品	6.10
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.81
		鉄鋼	0.68
		非鉄金属	0.70
		金属製品	0.57
		機械	5.03
		電気機器	14.42
		輸送用機器	7.84
		精密機器	2.49
		その他製品	2.19
		電気・ガス業	1.53
		陸運業	4.09
		海運業	0.15
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	9.30
		卸売業	5.12
小売業	4.46		
銀行業	5.73		
証券、商品先物取引業	0.81		
保険業	2.39		
その他金融業	1.23		
不動産業	2.41		

	サービス業	5.01
合計		99.76

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2020年03月	買建	7	日本円	118,165,550	104,965,000	0.30

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

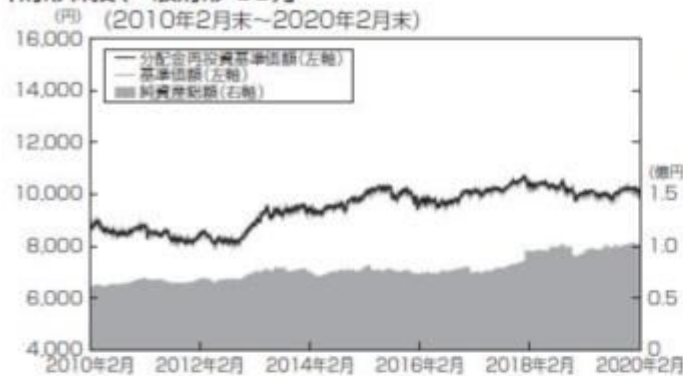
#### 参考情報

## 運用実績

2020年2月28日現在

## 基準価額・純資産の推移

## 「財形株投（一般財形 30）」



基準価額……………9,813円

純資産総額……………1.03億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額は、2010年2月末の基準価額を起点として指数化しています。  
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

## 「財形株投（一般財形 50）」

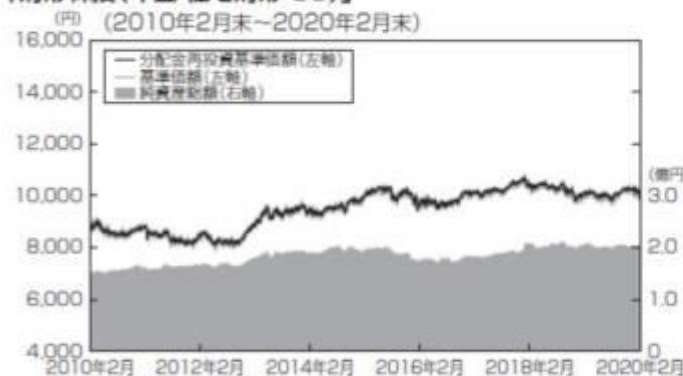


基準価額……………10,404円

純資産総額……………1.98億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額は、2010年2月末の基準価額を起点として指数化しています。  
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

## 「財形株投（年金・住宅財形 30）」



基準価額……………9,827円

純資産総額……………1.97億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額は、2010年2月末の基準価額を起点として指数化しています。  
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

## 「財形株投（一般財形 30）」

2016年2月	2017年2月	2018年2月	2019年2月	2020年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	125円

## 「財形株投（一般財形 50）」

2016年2月	2017年2月	2018年2月	2019年2月	2020年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	125円

## 「財形株投（年金・住宅財形 30）」

2016年2月	2017年2月	2018年2月	2019年2月	2020年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	125円

## 主要な資産の状況

### <資産構成比率>

組入資産	財形株投 (一般財形 30)	財形株投 (一般財形 50)	財形株投 (年金・住宅財形 30)
財形公社債マザーファンド	68.97%	50.09%	69.51%
インデックス マザーファンド TOPIX	25.27%	47.26%	27.78%
現金その他	5.76%	2.65%	2.71%

\*各ファンドの実質組入比率です。

### <組入上位銘柄>

#### 財形公社債マザーファンド

銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1 第398回利付国債(2年)	国債証券	0.1%	2021年3月1日	17.57%
2 第129回利付国債(5年)	国債証券	0.1%	2021年9月20日	16.30%
3 第353回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2028年12月20日	13.33%

\*財形公社債マザーファンドの対純資産総額比です。

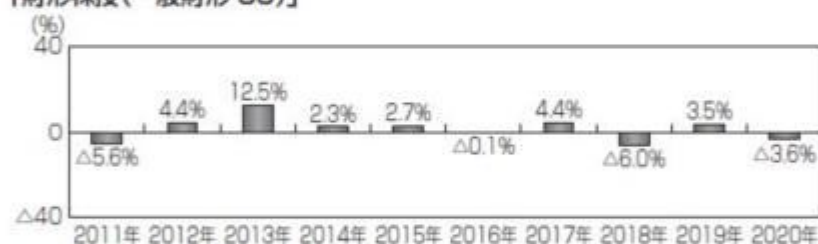
#### インデックス マザーファンド TOPIX

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.73%
2 ソニー	電気機器	1.96%
3 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.83%
4 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.68%
5 日本電信電話	情報・通信業	1.56%

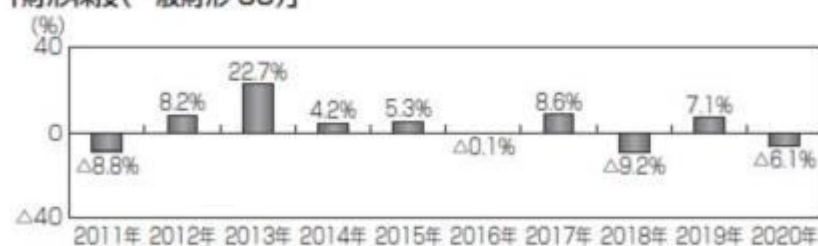
\*インデックス マザーファンド TOPIXの対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移

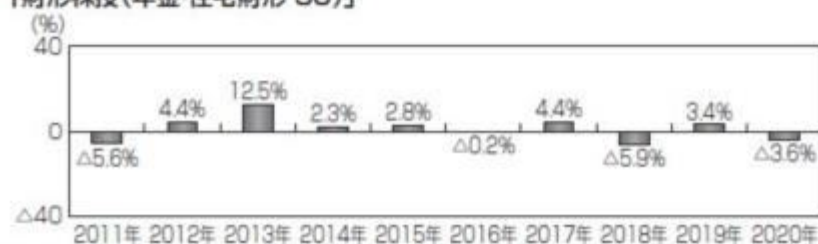
### 「財形株投(一般財形 30)」



### 「財形株投(一般財形 50)」



### 「財形株投(年金・住宅財形 30)」



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

\*当ファンドには、ベンチマークはありません。

\*2020年は、2020年2月末までの騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### (1) 申込方法

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

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

## (2) 申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。なお、「財形貯蓄に関する契約」で定める日(原則として、毎月10日、20日および月末を締切日とし、各締切日から起算して5営業日目)を取得申込受付日とします。

## (3) 申込単位

勤務先の事務局、販売会社の照会先にお問い合わせください。

## (4) 申込代金の支払い

原則として、勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

## (5) 受付の中止および取消

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

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

## 2【換金(解約)手続等】

### <解約請求による換金>

#### (1) 解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

一般財形の場合( <一般財形30> <一般財形50> )

原則として、いつでも解約が可能です。

年金財形の場合( <年金・住宅財形30> )

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

住宅財形の場合( <年金・住宅財形30> )

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

#### (2) 解約制限

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

#### (3) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

#### <委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (4) 手取額

一般財形の場合( <一般財形30> <一般財形50> )

1口当りの手取額は、解約価額から、解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。

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

## 年金財形の場合（＜年金・住宅財形30＞）

## 1）年金受取りを目的として解約される場合

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

## 2）年金受取り以外の目的で解約される場合

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

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

## 住宅財形の場合（＜年金・住宅財形30＞）

## 1）自宅用住宅の取得などを目的として解約される場合

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

## 2）自宅用住宅の取得など以外の目的で解約される場合

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

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

## （5）解約単位

## 1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

## （6）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

## （7）受付の中止および取消

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

## &lt; 買取請求による換金 &gt;

## （1）買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

## （2）買取制限

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

## （3）買取価額

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



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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(4) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(5) 買取単位

1口単位

販売会社によっては、買取単位が異なる場合があります。詳しくは、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

(6) 受付の中止および取消

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

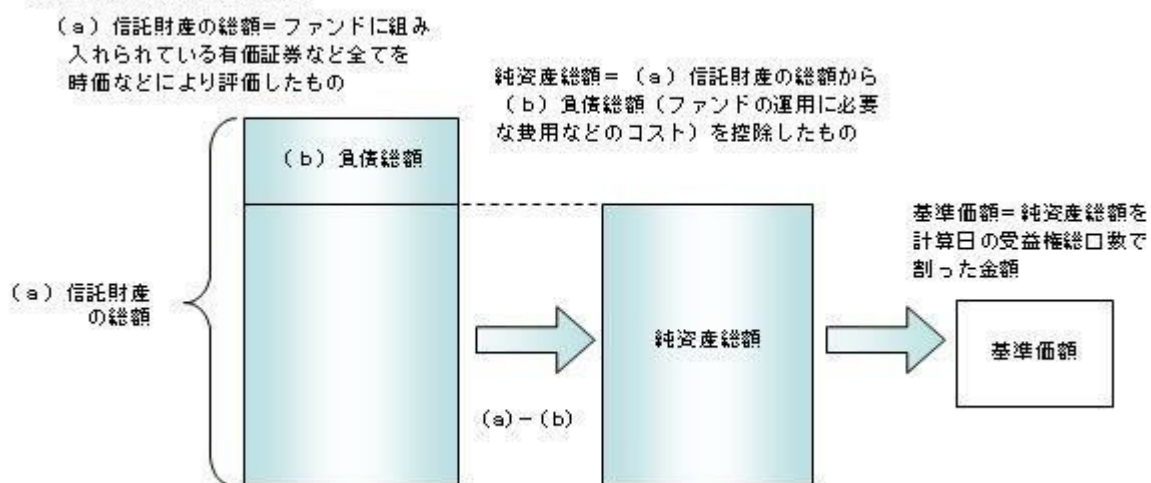
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

##### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

##### 国内上場株式

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

##### 国内公社債

原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)
- ・金融商品取引業者(第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。)、銀行などの提示する価額(売気配相場を除きます。)
- ・価格情報会社の提供する価額



残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

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

## (4)【計算期間】

毎年2月2日から翌年2月1日(2月1日および2日のいずれかが休業日のときは、2月1日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち、2月1日に最も近い日)までとし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

## (5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

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

償還金について

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

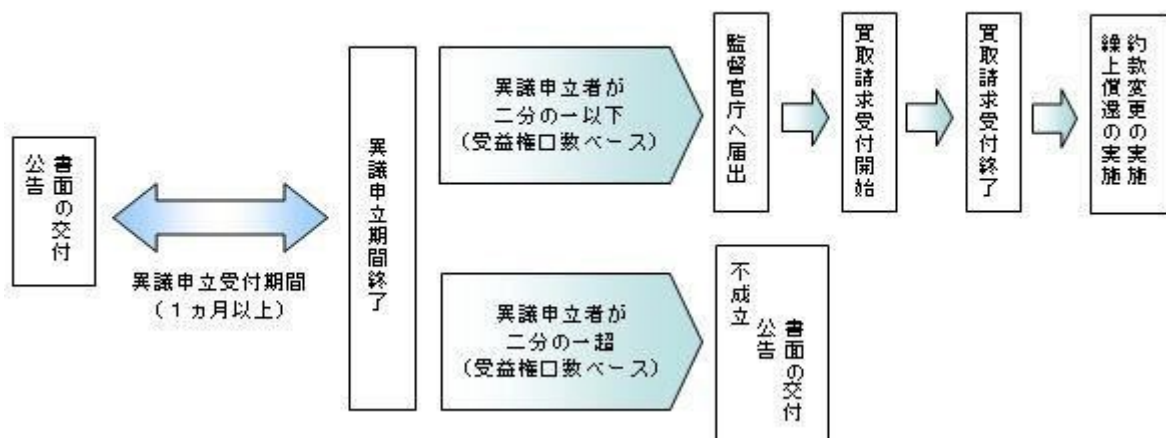
信託約款の変更

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

#### 異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



#### 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

#### 運用報告書の作成

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

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

#### 関係法人との契約について

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期計算期間（2019年2月5日から2020年2月3日まで）の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【財形株投（一般財形30）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第25期 2019年 2月 4日現在	第26期 2020年 2月 3日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,986,497	3,305,803
親投資信託受益証券	90,051,961	99,671,432
未収利息	1	-
流動資産合計	93,038,459	102,977,235
資産合計	93,038,459	102,977,235
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	46,142	50,609
未払受託者報酬	26,730	28,012
未払委託者報酬	760,848	797,357
未払利息	-	1
その他未払費用	2,064	2,189
流動負債合計	835,784	878,168
負債合計	835,784	878,168
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	92,284,753	101,218,195
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	82,078	880,872
（分配準備積立金）	7,813,081	7,313,165
元本等合計	92,202,675	102,099,067
純資産合計	92,202,675	102,099,067
負債純資産合計	93,038,459	102,977,235

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第25期		第26期	
	自 2018年 2月 2日	至 2019年 2月 4日	自 2019年 2月 5日	至 2020年 2月 3日
営業収益				
受取利息		4		2
有価証券売買等損益		3,481,151		2,539,027
営業収益合計		3,481,147		2,539,029
営業費用				
支払利息		1,167		895
受託者報酬		52,376		53,519
委託者報酬		1,490,905		1,523,442
その他費用		4,239		4,233
営業費用合計		1,548,687		1,582,089
営業利益又は営業損失( )		5,029,834		956,940
経常利益又は経常損失( )		5,029,834		956,940
当期純利益又は当期純損失( )		5,029,834		956,940
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( )		346,849		21,970
期首剰余金又は期首欠損金( )		4,951,848		82,078
剰余金増加額又は欠損金減少額		264,124		34,649
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		4,755
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		264,124		29,894
剰余金減少額又は欠損金増加額		568,923		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		568,923		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		46,142		50,609
期末剰余金又は期末欠損金( )		82,078		880,872

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月2日から翌年2月1日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）もしくはその翌日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で、翌日が営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当計算期間は2019年 2月 5日から2020年 2月 3日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

		第25期 2019年 2月 4日現在	第26期 2020年 2月 3日現在
1.	期首元本額	91,197,638円	92,284,753円
	期中追加設定元本額	12,037,575円	14,822,167円
	期中一部解約元本額	10,950,460円	5,888,725円
2.	受益権の総数	92,284,753口	101,218,195口
3.	元本の欠損		
	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	82,078円	- 円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第25期 自 2018年 2月 2日 至 2019年 2月 4日		第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益
C	信託約款に定める収益調整金	11,093,393円	C 信託約款に定める収益調整金
D	信託約款に定める分配準備積立 金	7,859,223円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	18,952,616円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,053円	F 分配対象収益(1万口当たり)
G	分配金額	46,142円	G 分配金額
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	第25期 自 2018年 2月 2日 至 2019年 2月 4日	第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3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25期 2019年 2月 4日現在	第26期 2020年 2月 3日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)



第25期(2019年2月4日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,438,208
合計	1,438,208

第26期(2020年2月3日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,315,048
合計	2,315,048

(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25期 2019年2月4日現在		第26期 2020年2月3日現在	
1口当たり純資産額	0.9991円	1口当たり純資産額	1.0087円
(1万口当たり純資産額)	(9,991円)	(1万口当たり純資産額)	(10,087円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

親投資信託受益 証券	財形公社債マザーファンド	55,067,554	70,541,536	
	インデックス マザーファンド TOPIX	13,809,565	29,129,896	
合計		68,877,119	99,671,432	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【財形株投（一般財形50）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第25期 2019年 2月 4日現在	第26期 2020年 2月 3日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,309,522	7,025,183
親投資信託受益証券	220,505,943	204,373,609
未収利息	2	-
流動資産合計	227,815,467	211,398,792
資産合計	227,815,467	211,398,792
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	106,182	95,912
未払受託者報酬	62,906	61,111
未払委託者報酬	1,788,067	1,737,268
未払利息	-	3
その他未払費用	4,972	4,822
流動負債合計	1,962,127	1,899,116
負債合計	1,962,127	1,899,116
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	212,365,170	191,825,330
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,488,170	17,674,346
（分配準備積立金）	39,200,153	31,704,518
元本等合計	225,853,340	209,499,676
純資産合計	225,853,340	209,499,676
負債純資産合計	227,815,467	211,398,792

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第25期		第26期	
	自 2018年 2月 2日	至 2019年 2月 4日	自 2019年 2月 5日	至 2020年 2月 3日
営業収益				
受取利息		17		5
有価証券売買等損益		15,086,345		9,804,865
営業収益合計		15,086,328		9,804,870
営業費用				
支払利息		2,966		2,173
受託者報酬		125,122		118,184
委託者報酬		3,556,685		3,359,739
その他費用		10,378		9,507
営業費用合計		3,695,151		3,489,603
営業利益又は営業損失( )		18,781,479		6,315,267
経常利益又は経常損失( )		18,781,479		6,315,267
当期純利益又は当期純損失( )		18,781,479		6,315,267
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( )		588,128		902,108
期首剰余金又は期首欠損金( )		32,422,303		13,488,170
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,146,539		1,570,607
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		2,146,539		1,570,607
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,781,139		2,701,678
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,781,139		2,701,678
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		106,182		95,912
期末剰余金又は期末欠損金( )		13,488,170		17,674,346

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月2日から翌年2月1日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）もしくはその翌日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で、翌日が営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2019年 2月 5日から2020年 2月 3日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

		第25期 2019年 2月 4日現在	第26期 2020年 2月 3日現在
1.	期首元本額	209,267,303円	212,365,170円
	期中追加設定元本額	21,221,642円	21,804,485円
	期中一部解約元本額	18,123,775円	42,344,325円
2.	受益権の総数	212,365,170口	191,825,330口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第25期 自 2018年 2月 2日 至 2019年 2月 4日		第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益
C	信託約款に定める収益調整金	45,878,000円	C 信託約款に定める収益調整金
D	信託約款に定める分配準備積立 金	39,306,335円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
E	分配対象収益 ( A+B+C+D )	85,184,335円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D )
F	分配対象収益(1万口当たり)	4,011円	F 分配対象収益(1万口当たり)
G	分配金額	106,182円	G 分配金額
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)

## (金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第25期 自 2018年 2月 2日 至 2019年 2月 4日	第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3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25期 2019年 2月 4日現在	第26期 2020年 2月 3日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第25期（2019年 2月 4日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	6,190,463
合計	6,190,463

第26期（2020年 2月 3日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	8,198,293
合計	8,198,293

（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25期 2019年 2月 4日現在		第26期 2020年 2月 3日現在	
1口当たり純資産額	1.0635円	1口当たり純資産額	1.0921円
(1万口当たり純資産額)	(10,635円)	(1万口当たり純資産額)	(10,921円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	80,128,382	102,644,457	
	インデックス マザーファンド TOPIX	48,226,582	101,729,152	
合計		128,354,964	204,373,609	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



## 【財形株投（年金・住宅財形30）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第25期 2019年 2月 4日現在	第26期 2020年 2月 3日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	6,961,942	6,989,977
親投資信託受益証券	198,384,613	196,270,407
未収利息	2	-
流動資産合計	205,346,557	203,260,384
<b>資産合計</b>	205,346,557	203,260,384
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	101,621	99,658
未払受託者報酬	56,608	56,456
未払委託者報酬	1,609,412	1,605,232
未払利息	-	3
その他未払費用	4,467	4,461
流動負債合計	1,772,108	1,765,810
<b>負債合計</b>	1,772,108	1,765,810
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	203,242,007	199,316,077
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	332,442	2,178,497
（分配準備積立金）	19,368,927	16,949,161
元本等合計	203,574,449	201,494,574
<b>純資産合計</b>	203,574,449	201,494,574
<b>負債純資産合計</b>	205,346,557	203,260,384

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第25期		第26期	
	自 2018年 2月 2日	至 2019年 2月 4日	自 2019年 2月 5日	至 2020年 2月 3日
営業収益				
受取利息		15		5
有価証券売買等損益		7,582,899		5,282,503
営業収益合計		7,582,884		5,282,508
営業費用				
支払利息		2,652		2,037
受託者報酬		111,090		109,852
委託者報酬		3,158,361		3,123,346
その他費用		9,162		8,838
営業費用合計		3,281,265		3,244,073
営業利益又は営業損失（ ）		10,864,149		2,038,435
経常利益又は経常損失（ ）		10,864,149		2,038,435
当期純利益又は当期純損失（ ）		10,864,149		2,038,435
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（ ）		645,507		148,449
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		11,115,341		332,442
剰余金増加額又は欠損金減少額		525,745		97,229
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		525,745		97,229
剰余金減少額又は欠損金増加額		988,381		41,502
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		988,381		41,502
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		101,621		99,658
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		332,442		2,178,497

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月2日から翌年2月1日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）もしくはその翌日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で、翌日が営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2019年 2月 5日から2020年 2月 3日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

		第25期 2019年 2月 4日現在	第26期 2020年 2月 3日現在
1.	期首元本額	199,253,276円	203,242,007円
	期中追加設定元本額	22,034,865円	21,763,698円
	期中一部解約元本額	18,046,134円	25,689,628円
2.	受益権の総数	203,242,007口	199,316,077口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第25期 自 2018年 2月 2日 至 2019年 2月 4日		第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益
C	信託約款に定める収益調整金	30,529,151円	C 信託約款に定める収益調整金
D	信託約款に定める分配準備積立 金	19,470,548円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
E	分配対象収益 ( A+B+C+D )	49,999,699円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D )
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,460円	F 分配対象収益(1万口当たり)
G	分配金額	101,621円	G 分配金額
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)

## (金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第25期 自 2018年 2月 2日 至 2019年 2月 4日	第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3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25期 2019年 2月 4日現在	第26期 2020年 2月 3日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第25期(2019年2月4日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

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

第26期(2020年2月3日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	4,600,976
合計	4,600,976

(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25期 2019年2月4日現在		第26期 2020年2月3日現在	
1口当たり純資産額	1.0016円	1口当たり純資産額	1.0109円
(1万口当たり純資産額)	(10,016円)	(1万口当たり純資産額)	(10,109円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	108,462,854	138,940,915	
	インデックス マザーファンド T O P I X	27,178,104	57,329,492	
合計		135,640,958	196,270,407	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

### 財形公社債マザーファンド

#### 貸借対照表

	(単位：円)	
	2019年 2月 4日現在	2020年 2月 3日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	111,272,131	107,710,850
国債証券	196,596,084	165,477,020
地方債証券	-	38,712,330
未収利息	38,726	59,553
前払費用	-	57,953
流動資産合計	307,906,941	312,017,706
資産合計	307,906,941	312,017,706
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払利息	-	56
流動負債合計	-	56
負債合計	-	56
<b>純資産の部</b>		
元本等		

	2019年 2月 4日現在	2020年 2月 3日現在
元本	240,503,461	243,658,790
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	67,403,480	68,358,860
元本等合計	307,906,941	312,017,650
純資産合計	307,906,941	312,017,650
負債純資産合計	307,906,941	312,017,706

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 2月 4日現在	2020年 2月 3日現在
1. 期首	2018年 2月 2日	2019年 2月 5日
期首元本額	261,514,898円	240,503,461円
期首からの追加設定元本額	29,706,668円	40,597,626円
期首からの一部解約元本額	50,718,105円	37,442,297円
元本の内訳		
財形株投（一般財形30）	48,773,754円	55,067,554円
財形株投（一般財形50）	84,015,101円	80,128,382円
財形株投（年金・住宅財形30）	107,714,606円	108,462,854円
計	240,503,461円	243,658,790円
2. 受益権の総数	240,503,461口	243,658,790口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2018年 2月 2日 至 2019年 2月 4日	自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 2月 4日現在	2020年 2月 3日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)



(2019年 2月 4日現在)

## 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	759,534
合計	759,534

(2020年 2月 3日現在)

## 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	69,980
地方債証券	105,070
合計	175,050

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2019年 2月 4日現在		2020年 2月 3日現在	
1口当たり純資産額	1.280円	1口当たり純資産額	1.281円
(1千口当たり純資産額)	(1,280円)	(1千口当たり純資産額)	(1,281円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第398回利付国債（2年）	54,000,000	54,150,120	
	第129回利付国債（5年）	50,000,000	50,215,500	
	第353回利付国債（10年）	40,000,000	40,752,400	
	第355回利付国債（10年）	20,000,000	20,359,000	
国債証券 合計		164,000,000	165,477,020	
地方債証券	第718回東京都公募公債	10,000,000	10,187,300	
	平成23年度第2回京都府公募公債	13,000,000	13,215,280	
	平成24年度第3回愛知県公募公債（10年）	15,000,000	15,309,750	
地方債証券 合計		38,000,000	38,712,330	
合計		202,000,000	204,189,350	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## インデックス マザーファンド TOPIX

### 貸借対照表

（単位：円）

	2019年 2月 4日現在	2020年 2月 3日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	523,094,773	64,333,617
株式	39,111,235,220	39,283,692,490
派生商品評価勘定	2,444,600	-
未収配当金	63,372,197	66,063,365
未収利息	179	-
前払金	-	2,640,000
流動資産合計	39,700,146,969	39,416,729,472
資産合計		
	39,700,146,969	39,416,729,472
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	3,333,300
前受金	550,000	-
未払金	410,009,323	12,289,500
未払解約金	22,386,743	23,705,950
未払利息	-	33
流動負債合計	432,946,066	39,328,783
負債合計		
	432,946,066	39,328,783
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	20,186,693,914	18,667,515,485
剰余金		

	2019年 2月 4日現在	2020年 2月 3日現在
剰余金又は欠損金( )	19,080,506,989	20,709,885,204
元本等合計	39,267,200,903	39,377,400,689
純資産合計	39,267,200,903	39,377,400,689
負債純資産合計	39,700,146,969	39,416,729,472

## 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)

	2019年 2月 4日現在	2020年 2月 3日現在
1. 期首	2018年 2月 2日	2019年 2月 5日
期首元本額	19,493,872,454円	20,186,693,914円
期首からの追加設定元本額	3,273,462,447円	1,606,465,100円
期首からの一部解約元本額	2,580,640,987円	3,125,643,529円
元本の内訳		
インデックスファンドTSP	11,246,584,240円	10,103,237,838円
財形株投(一般財形30)	14,199,854円	13,809,565円
財形株投(一般財形50)	58,074,550円	48,226,582円
財形株投(年金・住宅財形30)	31,107,299円	27,178,104円
インデックスファンドTOPIX(日本株式)	8,223,160,610円	7,910,424,272円
TOPIXインデックスファンド(個人型年金向け)	464,708,380円	452,367,550円
時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08	34,137,961円	30,127,887円
時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-08	26,437,958円	16,425,193円
時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11	17,168,805円	11,826,344円

時間分散型バランスファンド(成長指向)2016-11	31,065,212円	24,972,879円
時間分散型バランスファンド(安定指向)2017-02	16,142,481円	10,027,835円
時間分散型バランスファンド(成長指向)2017-02	23,906,564円	18,891,436円
計	20,186,693,914円	18,667,515,485円
2. 受益権の総数	20,186,693,914口	18,667,515,485口
3. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	264,357,000円	281,114,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2018年 2月 2日 至 2019年 2月 4日	自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 2月 4日現在	2020年 2月 3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	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

（2019年 2月 4日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,243,318,401
合計	3,243,318,401

（2020年 2月 3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	2,308,503,330
合計	2,308,503,330

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2019年 2月 4日現在）

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	155,600,000	-	158,050,000	2,450,000
合計		155,600,000	-	158,050,000	2,450,000

(2020年 2月 3日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	103,380,000	-	100,050,000	3,330,000
合計		103,380,000	-	100,050,000	3,330,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

2019年 2月 4日現在		2020年 2月 3日現在	
1口当たり純資産額	1.9452円	1口当たり純資産額	2.1094円
(1万口当たり純資産額)	(19,452円)	(1万口当たり純資産額)	(21,094円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	2,825.00	2,260,000	
日本水産	22,800	596.00	13,588,800	
マルハニチロ	3,300	2,648.00	8,738,400	
カネコ種苗	700	1,276.00	893,200	
サカタのタネ	2,700	3,455.00	9,328,500	
ホクト	1,700	1,930.00	3,281,000	
ホクリヨウ	400	837.00	334,800	
住石ホールディングス	4,700	135.00	634,500	
日鉄鉱業	500	4,455.00	2,227,500	
三井松島ホールディングス	900	1,141.00	1,026,900	
国際石油開発帝石	90,800	1,024.00	92,979,200	
石油資源開発	3,000	2,705.00	8,115,000	
K&Oエナジーグループ	1,100	1,600.00	1,760,000	
ヒノキヤグループ	600	2,005.00	1,203,000	
ショーボンドホールディングス	3,500	4,450.00	15,575,000	
ミライト・ホールディングス	6,700	1,646.00	11,028,200	
タマホーム	1,200	1,305.00	1,566,000	
サンヨーホームズ	200	724.00	144,800	
日本アクア	900	585.00	526,500	
ファーストコーポレーション	700	577.00	403,900	
ベステラ	400	1,172.00	468,800	
キャンディル	200	838.00	167,600	
スペースバリューホールディングス	2,900	545.00	1,580,500	
ダイセキ環境ソリューション	500	1,066.00	533,000	
第一カッター興業	300	1,758.00	527,400	
明豊ファシリティワークス	600	779.00	467,400	
安藤・間	13,500	890.00	12,015,000	
東急建設	6,600	765.00	5,049,000	
コムシスホールディングス	8,000	3,135.00	25,080,000	
ビーアールホールディングス	2,500	478.00	1,195,000	
高松コンストラクショングループ	1,400	2,642.00	3,698,800	
東建コーポレーション	700	7,600.00	5,320,000	
ソネック	200	798.00	159,600	
ヤマウラ	1,000	939.00	939,000	
大成建設	17,400	4,360.00	75,864,000	
大林組	52,300	1,204.00	62,969,200	
清水建設	53,100	1,115.00	59,206,500	
飛鳥建設	1,600	1,389.00	2,222,400	
長谷工コーポレーション	20,200	1,419.00	28,663,800	
松井建設	2,100	768.00	1,612,800	

銭高組	200	4,010.00	802,000
鹿島建設	41,000	1,399.00	57,359,000
不動テトラ	1,400	1,663.00	2,328,200
大末建設	600	974.00	584,400
鉄建建設	1,200	2,775.00	3,330,000
西松建設	4,100	2,445.00	10,024,500
三井住友建設	12,700	612.00	7,772,400
大豊建設	1,200	2,675.00	3,210,000
前田建設工業	13,100	1,043.00	13,663,300
ナカノフドー建設	1,500	482.00	723,000
奥村組	2,800	2,919.00	8,173,200
東鉄工業	2,200	3,240.00	7,128,000
イチケン	400	1,763.00	705,200
富士ピー・エス	800	555.00	444,000
浅沼組	600	4,680.00	2,808,000
戸田建設	21,700	709.00	15,385,300
熊谷組	2,400	3,115.00	7,476,000
北野建設	300	2,503.00	750,900
植木組	300	2,450.00	735,000
矢作建設工業	2,300	820.00	1,886,000
ピーエス三菱	1,800	717.00	1,290,600
日本ハウスホールディングス	3,700	460.00	1,702,000
大東建託	6,300	12,770.00	80,451,000
新日本建設	2,200	906.00	1,993,200
N I P P O	4,300	2,700.00	11,610,000
東亜道路工業	400	3,415.00	1,366,000
前田道路	5,600	3,700.00	20,720,000
日本道路	500	7,370.00	3,685,000
東亜建設工業	1,700	1,576.00	2,679,200
日本国土開発	3,800	596.00	2,264,800
若築建設	1,000	1,641.00	1,641,000
東洋建設	6,000	518.00	3,108,000
五洋建設	20,800	654.00	13,603,200
世紀東急工業	2,500	910.00	2,275,000
福田組	600	4,820.00	2,892,000
住友林業	13,300	1,579.00	21,000,700
日本基礎技術	1,800	385.00	693,000
巴コーポレーション	2,400	419.00	1,005,600
大和ハウス工業	51,700	3,447.00	178,209,900
ライト工業	3,000	1,534.00	4,602,000
積水ハウス	57,200	2,352.50	134,563,000
日特建設	1,400	843.00	1,180,200



北陸電気工事	900	1,121.00	1,008,900
ユアテック	3,000	656.00	1,968,000
四電工	300	2,709.00	812,700
中電工	2,100	2,550.00	5,355,000
関電工	7,400	1,032.00	7,636,800
きんでん	12,400	1,833.00	22,729,200
東京エネシス	1,700	880.00	1,496,000
トーエネック	500	3,670.00	1,835,000
住友電設	1,500	2,600.00	3,900,000
日本電設工業	2,900	2,378.00	6,896,200
協和エクシオ	7,900	2,740.00	21,646,000
新日本空調	1,400	2,024.00	2,833,600
九電工	3,700	3,095.00	11,451,500
三機工業	3,800	1,495.00	5,681,000
日揮ホールディングス	16,100	1,547.00	24,906,700
中外炉工業	600	1,707.00	1,024,200
ヤマト	1,700	789.00	1,341,300
太平電業	1,300	2,302.00	2,992,600
高砂熱学工業	4,500	1,903.00	8,563,500
三晃金属工業	200	2,629.00	525,800
朝日工業社	400	3,350.00	1,340,000
明星工業	3,400	838.00	2,849,200
大気社	2,500	3,780.00	9,450,000
ダイダン	1,300	2,658.00	3,455,400
日比谷総合設備	1,700	1,914.00	3,253,800
フィル・カンパニー	200	4,090.00	818,000
東洋エンジニアリング	2,300	558.00	1,283,400
レイズネクスト	2,800	1,302.00	3,645,600
日本製粉	4,900	1,646.00	8,065,400
日清製粉グループ本社	18,900	1,879.00	35,513,100
日東富士製粉	100	6,290.00	629,000
昭和産業	1,500	3,040.00	4,560,000
鳥越製粉	1,500	826.00	1,239,000
中部飼料	2,100	1,676.00	3,519,600
フィード・ワン	11,300	180.00	2,034,000
東洋精糖	300	1,192.00	357,600
日本甜菜製糖	900	1,879.00	1,691,100
三井製糖	1,500	2,214.00	3,321,000
塩水港精糖	1,900	231.00	438,900
日新製糖	800	1,998.00	1,598,400
森永製菓	3,900	5,330.00	20,787,000
中村屋	400	4,050.00	1,620,000

江崎グリコ	5,000	4,660.00	23,300,000
名糖産業	800	1,395.00	1,116,000
井村屋グループ	700	1,903.00	1,332,100
不二家	900	2,177.00	1,959,300
山崎製パン	12,500	2,086.00	26,075,000
第一屋製パン	300	937.00	281,100
モロゾフ	300	4,985.00	1,495,500
亀田製菓	900	4,965.00	4,468,500
寿スピリッツ	1,600	7,290.00	11,664,000
カルビー	7,600	3,605.00	27,398,000
森永乳業	3,100	4,190.00	12,989,000
六甲バター	1,100	1,597.00	1,756,700
ヤクルト本社	11,500	5,480.00	63,020,000
明治ホールディングス	11,000	7,730.00	85,030,000
雪印メグミルク	4,000	2,579.00	10,316,000
プリマハム	2,600	2,435.00	6,331,000
日本ハム	6,400	4,725.00	30,240,000
林兼産業	600	683.00	409,800
丸大食品	1,800	2,131.00	3,835,800
S Foods	1,300	2,599.00	3,378,700
柿安本店	600	3,245.00	1,947,000
伊藤ハム米久ホールディングス	10,600	699.00	7,409,400
サッポロホールディングス	5,700	2,657.00	15,144,900
アサヒグループホールディングス	35,000	5,021.00	175,735,000
キリンホールディングス	70,900	2,413.00	171,081,700
宝ホールディングス	12,600	958.00	12,070,800
オエノンホールディングス	4,600	380.00	1,748,000
養命酒製造	500	1,964.00	982,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,700	2,912.00	34,070,400
サントリー食品インターナショナル	11,200	4,670.00	52,304,000
ダイトーグループホールディングス	900	4,070.00	3,663,000
伊藤園	5,100	5,350.00	27,285,000
キーコーヒー	1,700	2,267.00	3,853,900
ユニカフェ	500	961.00	480,500
ジャパンフーズ	300	1,242.00	372,600
日清オイリオグループ	2,100	3,695.00	7,759,500
不二製油グループ本社	4,100	2,835.00	11,623,500
かどや製油	200	3,830.00	766,000
J - オイルミルズ	900	4,060.00	3,654,000
キッコーマン	12,100	5,160.00	62,436,000
味の素	37,000	1,915.00	70,855,000
キューピー	9,300	2,258.00	20,999,400

ハウス食品グループ本社	6,300	3,550.00	22,365,000
カゴメ	6,300	2,687.00	16,928,100
焼津水産化学工業	800	1,023.00	818,400
アリアケジャパン	1,500	7,330.00	10,995,000
ピエトロ	200	1,634.00	326,800
エバラ食品工業	400	2,137.00	854,800
やまみ	100	2,150.00	215,000
ニチレイ	7,900	2,646.00	20,903,400
東洋水産	8,600	4,655.00	40,033,000
イートアンド	600	1,858.00	1,114,800
大冷	200	1,959.00	391,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	1,095.00	1,095,000
日清食品ホールディングス	7,100	8,420.00	59,782,000
永谷園ホールディングス	800	2,130.00	1,704,000
一正蒲鉾	700	976.00	683,200
フジッコ	1,800	1,949.00	3,508,200
ロック・フィールド	1,800	1,436.00	2,584,800
日本たばこ産業	96,500	2,290.50	221,033,250
ケンコーマヨネーズ	900	2,425.00	2,182,500
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,819.00	2,000,900
なとり	900	1,686.00	1,517,400
イフジ産業	300	767.00	230,100
ピクルスコーポレーション	400	2,696.00	1,078,400
北の達人コーポレーション	5,900	619.00	3,652,100
ユーグレナ	7,200	895.00	6,444,000
ミヨシ油脂	600	1,184.00	710,400
理研ビタミン	800	3,935.00	3,148,000
片倉工業	2,400	1,236.00	2,966,400
ゲンゼ	1,200	4,350.00	5,220,000
東洋紡	6,500	1,488.00	9,672,000
ユニチカ	4,900	391.00	1,915,900
富士紡ホールディングス	800	3,380.00	2,704,000
倉敷紡績	1,600	2,307.00	3,691,200
シキボウ	900	1,350.00	1,215,000
日本毛織	5,300	1,044.00	5,533,200
ダイトウボウ	2,700	221.00	596,700
トーア紡コーポレーション	700	552.00	386,400
ガイドーリミテッド	2,200	272.00	598,400
帝国繊維	1,900	2,439.00	4,634,100
帝人	13,300	1,968.00	26,174,400
東レ	118,200	718.70	84,950,340
サカイオーベックス	400	1,750.00	700,000

住江織物	400	2,484.00	993,600
日本フェルト	900	494.00	444,600
日東製網	200	1,655.00	331,000
アツギ	1,400	774.00	1,083,600
ダイニック	600	765.00	459,000
セーレン	4,000	1,402.00	5,608,000
ソトー	500	969.00	484,500
東海染工	200	1,135.00	227,000
小松マテーレ	2,700	749.00	2,022,300
ワコールホールディングス	4,300	2,932.00	12,607,600
ホギメディカル	1,800	3,610.00	6,498,000
レナウン	4,300	106.00	455,800
クラウディアホールディングス	400	480.00	192,000
T S Iホールディングス	5,500	504.00	2,772,000
マツオカコーポレーション	500	1,911.00	955,500
ワールド	2,300	2,324.00	5,345,200
三陽商会	900	1,213.00	1,091,700
ナイガイ	600	443.00	265,800
オンワードホールディングス	9,900	616.00	6,098,400
ルックホールディングス	600	1,041.00	624,600
キムラタン	8,800	28.00	246,400
ゴールドウイン	3,000	6,540.00	19,620,000
デサント	3,200	1,779.00	5,692,800
キング	800	563.00	450,400
ヤマトインターナショナル	900	409.00	368,100
特種東海製紙	1,000	3,970.00	3,970,000
王子ホールディングス	68,300	564.00	38,521,200
日本製紙	7,300	1,772.00	12,935,600
三菱製紙	1,900	453.00	860,700
北越コーポレーション	10,800	508.00	5,486,400
中越パルプ工業	700	1,552.00	1,086,400
巴川製紙所	500	864.00	432,000
大王製紙	7,200	1,453.00	10,461,600
阿波製紙	500	551.00	275,500
レンゴー	15,500	767.00	11,888,500
トモク	1,000	1,852.00	1,852,000
ザ・バック	1,200	4,065.00	4,878,000
クラレ	25,700	1,315.00	33,795,500
旭化成	108,200	1,125.00	121,725,000
共和レザー	900	781.00	702,900
昭和電工	11,600	2,652.00	30,763,200
住友化学	119,900	448.00	53,715,200

住友精化	700	3,090.00	2,163,000
日産化学	9,100	4,535.00	41,268,500
ラサ工業	600	1,431.00	858,600
クレハ	1,400	6,090.00	8,526,000
多木化学	500	4,370.00	2,185,000
テイカ	1,200	1,852.00	2,222,400
石原産業	3,000	923.00	2,769,000
片倉コープアグリ	400	1,220.00	488,000
日本曹達	2,400	2,935.00	7,044,000
東ソー	25,200	1,631.00	41,101,200
トクヤマ	4,700	2,740.00	12,878,000
セントラル硝子	3,300	2,390.00	7,887,000
東亜合成	10,200	1,251.00	12,760,200
大阪ソーダ	1,600	2,929.00	4,686,400
関東電化工業	3,900	1,001.00	3,903,900
デンカ	6,000	2,952.00	17,712,000
信越化学工業	28,000	12,745.00	356,860,000
日本カーバイド工業	600	1,347.00	808,200
堺化学工業	1,100	2,218.00	2,439,800
第一稀元素化学工業	1,800	915.00	1,647,000
エア・ウォーター	15,200	1,507.00	22,906,400
大陽日酸	15,700	2,388.00	37,491,600
日本化学工業	500	3,205.00	1,602,500
東邦アセチレン	200	1,351.00	270,200
日本パーカライズン	8,200	1,168.00	9,577,600
高压ガス工業	2,600	793.00	2,061,800
四国化成工業	2,500	1,280.00	3,200,000
戸田工業	400	2,092.00	836,800
ステラ ケミファ	900	3,020.00	2,718,000
保土谷化学工業	600	4,235.00	2,541,000
日本触媒	2,500	6,410.00	16,025,000
大日精化工業	1,400	2,873.00	4,022,200
カネカ	4,200	3,380.00	14,196,000
三菱瓦斯化学	15,400	1,677.00	25,825,800
三井化学	14,800	2,426.00	35,904,800
J S R	15,200	1,984.00	30,156,800
東京応化工業	2,800	4,600.00	12,880,000
大阪有機化学工業	1,500	1,788.00	2,682,000
三菱ケミカルホールディングス	109,000	791.70	86,295,300
K Hネオケム	2,900	2,451.00	7,107,900
ダイセル	22,400	1,043.00	23,363,200
住友ベークライト	2,600	3,990.00	10,374,000

積水化学工業	35,100	1,825.00	64,057,500
日本ゼオン	14,700	1,181.00	17,360,700
アイカ工業	4,900	3,495.00	17,125,500
宇部興産	8,200	2,208.00	18,105,600
積水樹脂	3,000	2,475.00	7,425,000
タキロンシーアイ	3,500	694.00	2,429,000
旭有機材	900	1,651.00	1,485,900
日立化成	7,500	4,595.00	34,462,500
ニチバン	900	1,718.00	1,546,200
リケンテクノス	4,100	465.00	1,906,500
大倉工業	800	1,725.00	1,380,000
積水化成成品工業	2,200	732.00	1,610,400
群栄化学工業	400	2,410.00	964,000
タイガースポリマー	800	567.00	453,600
ミライアル	600	1,244.00	746,400
ダイキアクシス	600	850.00	510,000
ダイキョーニシカワ	3,400	750.00	2,550,000
竹本容器	600	854.00	512,400
森六ホールディングス	900	2,193.00	1,973,700
日本化薬	10,100	1,251.00	12,635,100
カーリットホールディングス	1,800	568.00	1,022,400
日本精化	1,300	1,361.00	1,769,300
扶桑化学工業	1,700	3,380.00	5,746,000
トリケミカル研究所	400	10,800.00	4,320,000
A D E K A	7,500	1,594.00	11,955,000
日油	6,100	3,620.00	22,082,000
新日本理化	2,800	208.00	582,400
ハリマ化成グループ	1,400	1,136.00	1,590,400
花王	39,900	8,701.00	347,169,900
第一工業製薬	600	4,390.00	2,634,000
石原ケミカル	400	1,770.00	708,000
日華化学	500	840.00	420,000
三洋化成工業	1,000	5,110.00	5,110,000
有機合成薬品工業	1,300	273.00	354,900
大日本塗料	1,800	1,112.00	2,001,600
日本ペイントホールディングス	13,500	5,200.00	70,200,000
関西ペイント	18,300	2,580.00	47,214,000
神東塗料	1,300	203.00	263,900
中国塗料	4,700	968.00	4,549,600
日本特殊塗料	1,200	1,263.00	1,515,600
藤倉化成	2,100	549.00	1,152,900
太陽ホールディングス	1,200	4,595.00	5,514,000

D I C	6,900	2,886.00	19,913,400
サカタインクス	3,600	1,144.00	4,118,400
東洋インキSCホールディングス	3,400	2,449.00	8,326,600
T & K T O K A	1,200	965.00	1,158,000
富士フイルムホールディングス	32,000	5,485.00	175,520,000
資生堂	33,100	6,820.00	225,742,000
ライオン	21,700	2,024.00	43,920,800
高砂香料工業	1,100	2,371.00	2,608,100
マンダム	3,800	2,510.00	9,538,000
ミルボン	2,200	5,850.00	12,870,000
ファンケル	6,700	2,830.00	18,961,000
コーセー	3,100	14,120.00	43,772,000
コタ	900	1,477.00	1,329,300
シーボン	200	2,442.00	488,400
ポーラ・オルビスホールディングス	7,100	2,342.00	16,628,200
ノエビアホールディングス	1,600	5,040.00	8,064,000
アジュバンコスメジャパン	400	978.00	391,200
エステー	1,100	1,644.00	1,808,400
アグロ カネショウ	500	1,420.00	710,000
コニシ	2,700	1,533.00	4,139,100
長谷川香料	2,200	2,255.00	4,961,000
星光PMC	1,000	927.00	927,000
小林製薬	4,700	8,550.00	40,185,000
荒川化学工業	1,500	1,494.00	2,241,000
メック	1,200	1,523.00	1,827,600
日本高純度化学	500	2,623.00	1,311,500
タカラバイオ	4,400	2,049.00	9,015,600
J C U	2,000	3,100.00	6,200,000
新田ゼラチン	1,100	651.00	716,100
O A T アグリオ	300	1,409.00	422,700
デクセリアルズ	4,300	926.00	3,981,800
アース製薬	1,300	5,850.00	7,605,000
北興化学工業	1,700	623.00	1,059,100
大成ラミック	600	2,801.00	1,680,600
クミアイ化学工業	6,900	847.00	5,844,300
日本農薬	3,100	549.00	1,701,900
アキレス	1,200	1,719.00	2,062,800
有沢製作所	2,700	986.00	2,662,200
日東電工	11,500	6,100.00	70,150,000
レック	1,800	1,193.00	2,147,400
三光合成	2,000	353.00	706,000
きもと	2,900	172.00	498,800

藤森工業	1,500	3,325.00	4,987,500
前澤化成工業	1,100	1,131.00	1,244,100
未来工業	900	2,078.00	1,870,200
ウェーブロックホールディングス	600	731.00	438,600
J S P	1,000	1,848.00	1,848,000
エフピコ	1,800	6,480.00	11,664,000
天馬	1,100	1,964.00	2,160,400
信越ポリマー	3,000	957.00	2,871,000
東リ	4,200	294.00	1,234,800
ニフコ	6,100	2,846.00	17,360,600
バルカー	1,400	2,345.00	3,283,000
ユニ・チャーム	32,100	3,770.00	121,017,000
ショーエイコーポレーション	200	827.00	165,400
協和キリン	16,800	2,621.00	44,032,800
武田薬品工業	138,600	4,189.00	580,595,400
アステラス製薬	146,600	1,859.00	272,529,400
大日本住友製薬	12,300	1,823.00	22,422,900
塩野義製薬	21,300	6,514.00	138,748,200
わかもと製薬	2,100	260.00	546,000
あすか製薬	1,900	1,216.00	2,310,400
日本新薬	4,400	9,700.00	42,680,000
バイオフェルミン製薬	300	2,383.00	714,900
中外製薬	17,400	11,570.00	201,318,000
科研製薬	2,900	5,930.00	17,197,000
エーザイ	20,000	8,680.00	173,600,000
ロート製薬	8,600	3,075.00	26,445,000
小野薬品工業	38,300	2,584.50	98,986,350
久光製薬	4,400	5,530.00	24,332,000
持田製薬	2,300	4,155.00	9,556,500
参天製薬	31,000	2,063.00	63,953,000
扶桑薬品工業	600	1,938.00	1,162,800
日本ケミファ	200	2,667.00	533,400
ツムラ	5,100	2,964.00	15,116,400
日医工	4,700	1,280.00	6,016,000
キッセイ薬品工業	2,900	2,978.00	8,636,200
生化学工業	3,200	1,165.00	3,728,000
栄研化学	2,900	2,249.00	6,522,100
日水製薬	700	1,349.00	944,300
鳥居薬品	1,000	3,725.00	3,725,000
J C R ファーマ	1,200	9,430.00	11,316,000
東和薬品	2,100	2,497.00	5,243,700
富士製薬工業	1,100	1,356.00	1,491,600



沢井製薬	3,400	7,220.00	24,548,000
ゼリア新薬工業	3,000	1,915.00	5,745,000
第一三共	47,700	7,578.00	361,470,600
キョーリン製薬ホールディングス	3,700	2,021.00	7,477,700
大幸薬品	700	4,010.00	2,807,000
ダイト	1,000	3,525.00	3,525,000
大塚ホールディングス	31,800	4,850.00	154,230,000
大正製薬ホールディングス	3,500	7,800.00	27,300,000
ペプチドリーム	8,400	5,220.00	43,848,000
日本コークス工業	13,800	78.00	1,076,400
ニチレキ	2,000	1,336.00	2,672,000
ユシロ化学工業	900	1,366.00	1,229,400
ビーピー・カストロール	600	1,428.00	856,800
富士石油	4,600	225.00	1,035,000
MORESCO	600	1,384.00	830,400
出光興産	18,800	2,748.00	51,662,400
JXTGホールディングス	250,700	464.20	116,374,940
コスモエネルギーホールディングス	4,800	2,109.00	10,123,200
横浜ゴム	9,700	1,876.00	18,197,200
TOYO TIRE	9,600	1,387.00	13,315,200
ブリヂストン	51,200	3,898.00	199,577,600
住友ゴム工業	15,000	1,209.00	18,135,000
藤倉コンポジット	1,500	434.00	651,000
オカモト	1,000	3,820.00	3,820,000
フコク	800	699.00	559,200
ニッタ	1,900	3,075.00	5,842,500
住友理工	3,300	856.00	2,824,800
三ツ星ベルト	2,200	1,855.00	4,081,000
バンドー化学	2,900	819.00	2,375,100
日東紡績	2,500	4,615.00	11,537,500
A G C	16,500	3,740.00	61,710,000
日本板硝子	8,100	571.00	4,625,100
石塚硝子	300	2,602.00	780,600
日本山村硝子	700	1,205.00	843,500
日本電気硝子	6,700	2,137.00	14,317,900
オハラ	700	1,200.00	840,000
住友大阪セメント	3,200	4,445.00	14,224,000
太平洋セメント	10,500	2,950.00	30,975,000
日本ヒューム	1,700	796.00	1,353,200
日本コンクリート工業	3,700	276.00	1,021,200
三谷セキサン	800	3,795.00	3,036,000
アジアパイルホールディングス	2,500	554.00	1,385,000

東海カーボン	17,500	1,005.00	17,587,500
日本カーボン	900	3,750.00	3,375,000
東洋炭素	1,000	2,035.00	2,035,000
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,275.00	3,847,500
TOTO	11,900	4,600.00	54,740,000
日本碍子	20,300	1,838.00	37,311,400
日本特殊陶業	13,000	1,915.00	24,895,000
ダントーホールディングス	1,300	113.00	146,900
MARUWA	600	8,070.00	4,842,000
品川リフラクトリーズ	400	2,924.00	1,169,600
黒崎播磨	300	6,250.00	1,875,000
ヨータイ	1,300	700.00	910,000
イソライト工業	900	589.00	530,100
東京窯業	2,000	311.00	622,000
ニッカトー	800	713.00	570,400
フジインコーポレーテッド	1,500	2,998.00	4,497,000
クニミネ工業	700	1,284.00	898,800
エーアンドエーマテリアル	300	1,498.00	449,400
ニチアス	4,600	2,641.00	12,148,600
ニチハ	2,300	2,715.00	6,244,500
日本製鉄	73,800	1,513.00	111,659,400
神戸製鋼所	30,400	491.00	14,926,400
合同製鐵	900	2,789.00	2,510,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	44,600	1,293.00	57,667,800
東京製鐵	8,000	807.00	6,456,000
共英製鋼	1,900	1,848.00	3,511,200
大和工業	3,500	2,585.00	9,047,500
東京鐵鋼	700	1,492.00	1,044,400
大阪製鐵	900	1,563.00	1,406,700
淀川製鋼所	2,200	1,956.00	4,303,200
丸一鋼管	5,300	3,005.00	15,926,500
モリ工業	500	2,721.00	1,360,500
大同特殊鋼	2,700	4,190.00	11,313,000
日本高周波鋼業	600	418.00	250,800
日本冶金工業	1,400	2,073.00	2,902,200
山陽特殊製鋼	1,100	1,424.00	1,566,400
愛知製鋼	900	3,485.00	3,136,500
日立金属	17,800	1,703.00	30,313,400
日本金属	400	827.00	330,800
大平洋金属	1,200	2,130.00	2,556,000
新日本電工	10,900	159.00	1,733,100
栗本鐵工所	800	2,102.00	1,681,600

虹技	300	1,322.00	396,600
日本鑄鉄管	200	1,529.00	305,800
三菱製鋼	1,300	993.00	1,290,900
日亜鋼業	2,500	320.00	800,000
日本精線	300	3,630.00	1,089,000
エンビプロ・ホールディングス	700	742.00	519,400
シンニッタン	2,600	452.00	1,175,200
新家工業	400	1,421.00	568,400
大紀アルミニウム工業所	2,700	673.00	1,817,100
日本軽金属ホールディングス	41,700	207.00	8,631,900
三井金属鉱業	4,500	2,592.00	11,664,000
東邦亜鉛	900	1,862.00	1,675,800
三菱マテリアル	10,900	2,747.00	29,942,300
住友金属鉱山	21,100	3,087.00	65,135,700
D O W Aホールディングス	4,200	3,880.00	16,296,000
古河機械金属	3,000	1,324.00	3,972,000
エス・サイエンス	7,500	45.00	337,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	1,292.00	2,325,600
東邦チタニウム	3,000	797.00	2,391,000
U A C J	2,500	2,226.00	5,565,000
C Kサンエツ	400	3,210.00	1,284,000
古河電気工業	5,100	2,571.00	13,112,100
住友電気工業	61,600	1,458.00	89,812,800
フジクラ	20,100	407.00	8,180,700
昭和電線ホールディングス	2,000	1,373.00	2,746,000
タツタ電線	3,300	572.00	1,887,600
カナレ電気	300	1,817.00	545,100
平河ヒューテック	600	1,420.00	852,000
リョービ	2,000	1,757.00	3,514,000
アーレスティ	2,200	518.00	1,139,600
アサヒホールディングス	2,900	2,654.00	7,696,600
稲葉製作所	1,000	1,371.00	1,371,000
宮地エンジニアリンググループ	500	1,975.00	987,500
トーカロ	4,600	1,114.00	5,124,400
アルファC o	600	1,282.00	769,200
S U M C O	19,700	1,705.00	33,588,500
川田テクノロジーズ	300	6,260.00	1,878,000
R S Technologies	500	2,864.00	1,432,000
信和	700	1,060.00	742,000
東洋製罐グループホールディングス	10,500	1,858.00	19,509,000
ホッカカンホールディングス	900	1,900.00	1,710,000
コロナ	1,000	1,000.00	1,000,000

横河ブリッジホールディングス	3,100	2,102.00	6,516,200
駒井ハルテック	300	1,862.00	558,600
高田機工	200	2,677.00	535,400
三和ホールディングス	15,900	1,161.00	18,459,900
文化シャッター	4,800	879.00	4,219,200
三協立山	2,100	1,460.00	3,066,000
アルインコ	1,200	1,194.00	1,432,800
東洋シャッター	400	689.00	275,600
LIXILグループ	24,400	1,904.00	46,457,600
日本フィルコン	1,300	528.00	686,400
ノーリツ	3,400	1,334.00	4,535,600
長府製作所	1,700	2,288.00	3,889,600
リンナイ	3,200	7,760.00	24,832,000
ダイニチ工業	900	701.00	630,900
日東精工	2,300	571.00	1,313,300
三洋工業	200	1,921.00	384,200
岡部	3,400	849.00	2,886,600
ジーテクト	2,100	1,585.00	3,328,500
東プレ	3,100	1,684.00	5,220,400
高周波熱錬	3,200	868.00	2,777,600
東京製綱	1,200	1,079.00	1,294,800
サンコール	900	531.00	477,900
モリテック スチール	1,300	356.00	462,800
パイオラックス	2,400	1,944.00	4,665,600
エイチワン	1,700	726.00	1,234,200
日本発條	17,700	867.00	15,345,900
中央発條	200	3,045.00	609,000
アドバネクス	300	1,628.00	488,400
立川ブラインド工業	800	1,241.00	992,800
三益半導体工業	1,300	2,347.00	3,051,100
日本ドライケミカル	400	1,712.00	684,800
日本製鋼所	5,000	1,975.00	9,875,000
三浦工業	7,100	3,815.00	27,086,500
タクマ	5,600	1,187.00	6,647,200
ツガミ	3,500	1,013.00	3,545,500
オークマ	1,900	5,090.00	9,671,000
東芝機械	1,900	3,405.00	6,469,500
アマダホールディングス	20,900	1,146.00	23,951,400
アイダエンジニアリング	4,300	877.00	3,771,100
滝澤鉄工所	500	1,332.00	666,000
F U J I	7,100	1,719.00	12,204,900
牧野フライス製作所	2,000	4,220.00	8,440,000

オーエスジー	7,600	1,864.00	14,166,400
ダイジェット工業	200	1,409.00	281,800
旭ダイヤモンド工業	4,400	590.00	2,596,000
D M G 森精機	10,500	1,581.00	16,600,500
ソディック	3,900	854.00	3,330,600
ディスコ	2,200	25,280.00	55,616,000
日東工器	900	2,340.00	2,106,000
日進工具	500	2,805.00	1,402,500
パンチ工業	1,600	475.00	760,000
富士ダイス	800	721.00	576,800
豊和工業	1,000	823.00	823,000
O K K	700	613.00	429,100
東洋機械金属	1,200	515.00	618,000
津田駒工業	300	1,068.00	320,400
島精機製作所	2,700	2,038.00	5,502,600
オプトラン	1,800	2,876.00	5,176,800
N C ホールディングス	500	650.00	325,000
イワキポンプ	800	1,156.00	924,800
フリュー	1,600	1,176.00	1,881,600
ヤマシンフィルタ	3,600	756.00	2,721,600
日阪製作所	2,000	898.00	1,796,000
やまびこ	3,200	1,056.00	3,379,200
平田機工	800	6,410.00	5,128,000
ペガサスミシン製造	1,700	467.00	793,900
マルマエ	700	1,006.00	704,200
タツモ	800	1,203.00	962,400
ナプテスコ	9,700	3,185.00	30,894,500
三井海洋開発	1,800	2,487.00	4,476,600
レオン自動機	1,600	1,417.00	2,267,200
S M C	5,200	47,820.00	248,664,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	1,500	494.00	741,000
ホソカワミクロン	600	4,955.00	2,973,000
ユニオンツール	600	3,065.00	1,839,000
オイレス工業	2,100	1,538.00	3,229,800
日精エー・エス・ビー機械	600	3,740.00	2,244,000
サトーホールディングス	2,400	3,070.00	7,368,000
技研製作所	1,500	4,810.00	7,215,000
日本エアーテック	500	1,019.00	509,500
カワタ	500	956.00	478,000
日精樹脂工業	1,400	943.00	1,320,200
オカダアイヨン	600	1,204.00	722,400
ワイエイシイホールディングス	700	631.00	441,700

小松製作所	75,500	2,417.50	182,521,250
住友重機械工業	9,500	2,847.00	27,046,500
日立建機	6,700	2,966.00	19,872,200
日工	2,300	800.00	1,840,000
巴工業	700	2,200.00	1,540,000
井関農機	1,700	1,426.00	2,424,200
TOWA	1,700	988.00	1,679,600
丸山製作所	400	1,677.00	670,800
北川鉄工所	700	2,176.00	1,523,200
ローツェ	700	4,060.00	2,842,000
タカキタ	600	565.00	339,000
クボタ	88,400	1,738.00	153,639,200
荏原実業	400	2,147.00	858,800
三菱化工機	600	2,055.00	1,233,000
月島機械	3,100	1,428.00	4,426,800
帝国電機製作所	1,400	1,343.00	1,880,200
新東工業	3,900	943.00	3,677,700
澁谷工業	1,400	3,020.00	4,228,000
アイチ コーポレーション	2,800	724.00	2,027,200
小森コーポレーション	4,200	979.00	4,111,800
鶴見製作所	1,300	1,782.00	2,316,600
住友精密工業	200	3,015.00	603,000
日本ギア工業	500	398.00	199,000
酒井重工業	300	2,681.00	804,300
荏原製作所	6,900	3,030.00	20,907,000
石井鐵工所	200	2,771.00	554,200
西島製作所	1,700	875.00	1,487,500
北越工業	1,700	1,300.00	2,210,000
ダイキン工業	21,200	15,595.00	330,614,000
オルガノ	600	6,860.00	4,116,000
トーヨーカネツ	800	2,164.00	1,731,200
栗田工業	9,000	3,235.00	29,115,000
椿本チエイン	2,400	3,330.00	7,992,000
大同工業	800	815.00	652,000
木村化工機	1,400	613.00	858,200
アネスト岩田	2,600	1,000.00	2,600,000
ダイフク	8,500	6,670.00	56,695,000
サムコ	500	1,982.00	991,000
加藤製作所	900	1,595.00	1,435,500
油研工業	300	1,694.00	508,200
タダノ	8,100	1,032.00	8,359,200
フジテック	6,100	1,780.00	10,858,000

CKD	4,700	1,790.00	8,413,000
キトー	1,300	1,653.00	2,148,900
平和	4,700	2,258.00	10,612,600
理想科学工業	1,500	1,806.00	2,709,000
SANKYO	3,700	3,715.00	13,745,500
日本金銭機械	1,900	811.00	1,540,900
マースグループホールディングス	1,100	1,995.00	2,194,500
フクシマガリレイ	1,000	3,960.00	3,960,000
オーイズミ	700	549.00	384,300
ダイコク電機	800	1,581.00	1,264,800
竹内製作所	2,800	1,865.00	5,222,000
アマノ	4,400	3,020.00	13,288,000
JUKI	2,400	759.00	1,821,600
サンデンホールディングス	2,300	651.00	1,497,300
蛇の目ミシン工業	1,600	402.00	643,200
マックス	2,600	2,034.00	5,288,400
グローリー	4,300	3,175.00	13,652,500
新晃工業	1,600	1,680.00	2,688,000
大和冷機工業	2,400	1,136.00	2,726,400
セガサミーホールディングス	16,600	1,479.00	24,551,400
日本ピストンリング	600	1,438.00	862,800
リケン	800	3,505.00	2,804,000
TPR	2,200	1,773.00	3,900,600
ツバキ・ナカシマ	3,400	1,291.00	4,389,400
ホシザキ	4,900	10,190.00	49,931,000
大豊工業	1,400	715.00	1,001,000
日本精工	31,500	919.00	28,948,500
NTN	38,900	287.00	11,164,300
ジェイテクト	16,000	1,170.00	18,720,000
不二越	1,600	4,090.00	6,544,000
日本トムソン	5,100	459.00	2,340,900
THK	9,700	2,824.00	27,392,800
ユーシン精機	1,300	908.00	1,180,400
前澤給装工業	600	2,289.00	1,373,400
イーグル工業	2,100	980.00	2,058,000
前澤工業	1,100	387.00	425,700
日本ピラー工業	1,700	1,447.00	2,459,900
キッツ	6,700	754.00	5,051,800
マキタ	21,700	4,180.00	90,706,000
日立造船	13,400	404.00	5,413,600
三菱重工業	27,900	4,009.00	111,851,100
IHI	12,000	2,582.00	30,984,000

スター精密	2,500	1,375.00	3,437,500
日清紡ホールディングス	11,100	946.00	10,500,600
イビデン	10,200	2,501.00	25,510,200
コニカミノルタ	36,600	680.00	24,888,000
ブラザー工業	20,400	2,138.00	43,615,200
ミネベアミツミ	30,900	2,166.00	66,929,400
日立製作所	80,100	4,100.00	328,410,000
三菱電機	166,700	1,584.00	264,052,800
富士電機	10,000	3,340.00	33,400,000
東洋電機製造	600	1,457.00	874,200
安川電機	18,000	3,845.00	69,210,000
シンフォニアテクノロジー	2,200	1,227.00	2,699,400
明電舎	3,100	2,087.00	6,469,700
オリジン	500	1,528.00	764,000
山洋電気	800	5,320.00	4,256,000
デンヨー	1,400	2,068.00	2,895,200
東芝テック	2,100	4,330.00	9,093,000
芝浦メカトロニクス	300	3,670.00	1,101,000
マブチモーター	4,600	3,950.00	18,170,000
日本電産	20,100	13,850.00	278,385,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	406.00	406,000
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,469.00	1,469,000
東光高岳	1,000	1,169.00	1,169,000
ダブル・スコープ	2,700	885.00	2,389,500
ダイヘン	1,800	3,490.00	6,282,000
ヤーマン	2,700	649.00	1,752,300
JVCケンウッド	14,000	243.00	3,402,000
ミマキエンジニアリング	1,600	501.00	801,600
第一精工	600	2,387.00	1,432,200
日新電機	3,900	1,242.00	4,843,800
大崎電気工業	3,300	629.00	2,075,700
オムロン	15,000	6,470.00	97,050,000
日東工業	2,400	2,250.00	5,400,000
I D E C	2,400	1,954.00	4,689,600
正興電機製作所	400	1,028.00	411,200
不二電機工業	200	1,245.00	249,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,600	2,165.00	12,124,000
サクサホールディングス	400	2,001.00	800,400
メルコホールディングス	600	2,691.00	1,614,600
テクノメディカ	400	2,070.00	828,000
日本電気	20,200	4,995.00	100,899,000
富士通	16,100	11,950.00	192,395,000



沖電気工業	6,800	1,355.00	9,214,000
岩崎通信機	700	823.00	576,100
電気興業	800	3,700.00	2,960,000
サンケン電気	1,800	2,724.00	4,903,200
ナカヨ	300	1,662.00	498,600
アイホン	1,000	1,667.00	1,667,000
ルネサスエレクトロニクス	79,600	704.00	56,038,400
セイコーエプソン	20,800	1,665.00	34,632,000
ワコム	11,300	386.00	4,361,800
アルバック	3,100	3,980.00	12,338,000
アクセル	700	825.00	577,500
E I Z O	1,300	3,715.00	4,829,500
日本信号	4,300	1,386.00	5,959,800
京三製作所	3,900	552.00	2,152,800
能美防災	2,200	2,433.00	5,352,600
ホーチキ	1,200	1,484.00	1,780,800
星和電機	900	540.00	486,000
エレコム	1,800	4,320.00	7,776,000
パナソニック	190,500	1,075.50	204,882,750
シャープ	19,400	1,501.00	29,119,400
アンリツ	10,800	2,173.00	23,468,400
富士通ゼネラル	4,600	2,451.00	11,274,600
ソニー	105,400	7,703.00	811,896,200
T D K	8,100	11,770.00	95,337,000
帝国通信工業	700	1,234.00	863,800
タムラ製作所	5,600	643.00	3,600,800
アルプスアルパイン	14,800	1,920.00	28,416,000
池上通信機	600	1,166.00	699,600
日本電波工業	1,600	473.00	756,800
鈴木	900	747.00	672,300
日本トリム	200	4,390.00	878,000
ローランド ディー . ジー .	900	1,982.00	1,783,800
フォスター電機	1,800	1,603.00	2,885,400
S M K	400	3,055.00	1,222,000
ヨコオ	1,100	2,888.00	3,176,800
ホシデン	4,600	1,193.00	5,487,800
ヒロセ電機	2,600	13,590.00	35,334,000
日本航空電子工業	3,800	1,923.00	7,307,400
T O A	1,800	1,112.00	2,001,600
マクセルホールディングス	3,600	1,421.00	5,115,600
古野電気	2,200	1,064.00	2,340,800
ユニデンホールディングス	500	2,042.00	1,021,000

スミダコーポレーション	1,300	1,046.00	1,359,800
アイコム	900	2,536.00	2,282,400
リオン	700	3,035.00	2,124,500
本多通信工業	1,500	516.00	774,000
船井電機	1,800	658.00	1,184,400
横河電機	15,300	1,917.00	29,330,100
新電元工業	600	3,325.00	1,995,000
アズビル	10,500	2,965.00	31,132,500
東亜ディーケーケー	900	960.00	864,000
日本光電工業	6,900	3,155.00	21,769,500
チノー	600	1,377.00	826,200
共和電業	1,600	427.00	683,200
日本電子材料	700	925.00	647,500
堀場製作所	3,300	6,980.00	23,034,000
アドバンテスト	12,400	5,710.00	70,804,000
小野測器	600	585.00	351,000
エスベック	1,500	2,192.00	3,288,000
キーエンス	15,100	37,120.00	560,512,000
日置電機	900	3,925.00	3,532,500
シスメックス	11,900	7,866.00	93,605,400
日本マイクロニクス	2,900	1,262.00	3,659,800
メガチップス	1,600	1,705.00	2,728,000
O B A R A G R O U P	900	3,480.00	3,132,000
澤藤電機	200	2,113.00	422,600
原田工業	800	954.00	763,200
コーセル	2,200	1,101.00	2,422,200
イリソ電子工業	1,400	4,130.00	5,782,000
オブテックスグループ	2,700	1,438.00	3,882,600
千代田インテグレ	800	2,040.00	1,632,000
アイ・オー・データ機器	600	1,007.00	604,200
レーザーテック	7,300	5,510.00	40,223,000
スタンレー電気	11,700	2,898.00	33,906,600
岩崎電気	700	1,523.00	1,066,100
ウシオ電機	9,700	1,522.00	14,763,400
岡谷電機産業	1,400	368.00	515,200
ヘリオス テクノ ホールディング	1,600	429.00	686,400
エノモト	500	1,287.00	643,500
日本セラミック	1,700	2,424.00	4,120,800
遠藤照明	800	687.00	549,600
古河電池	1,200	731.00	877,200
双信電機	900	434.00	390,600
山一電機	1,200	1,626.00	1,951,200

図研	1,100	2,502.00	2,752,200
日本電子	3,300	3,560.00	11,748,000
カシオ計算機	14,800	2,007.00	29,703,600
ファナック	15,800	20,380.00	322,004,000
日本シイエムケイ	3,900	515.00	2,008,500
エンプラス	900	2,875.00	2,587,500
大真空	600	1,653.00	991,800
ローム	7,400	7,920.00	58,608,000
浜松ホトニクス	12,000	4,645.00	55,740,000
三井ハイテック	1,900	1,669.00	3,171,100
新光電気工業	5,600	1,285.00	7,196,000
京セラ	23,400	7,093.00	165,976,200
太陽誘電	7,400	3,205.00	23,717,000
村田製作所	49,000	6,249.00	306,201,000
双葉電子工業	2,700	1,261.00	3,404,700
北陸電気工業	700	1,213.00	849,100
ニチコン	5,700	986.00	5,620,200
日本ケミコン	1,300	1,651.00	2,146,300
K O A	2,500	1,150.00	2,875,000
市光工業	2,500	677.00	1,692,500
小糸製作所	10,000	4,820.00	48,200,000
ミツバ	3,200	637.00	2,038,400
S C R E E Nホールディングス	2,900	5,960.00	17,284,000
キャノン電子	1,700	2,014.00	3,423,800
キャノン	89,700	2,872.00	257,618,400
リコー	42,600	1,253.00	53,377,800
象印マホービン	4,900	2,187.00	10,716,300
M U T O Hホールディングス	300	1,719.00	515,700
東京エレクトロン	11,100	24,070.00	267,177,000
トヨタ紡織	4,900	1,639.00	8,031,100
芦森工業	400	1,357.00	542,800
ユニプレス	3,300	1,412.00	4,659,600
豊田自動織機	13,500	5,850.00	78,975,000
モリタホールディングス	2,900	1,754.00	5,086,600
三櫻工業	2,200	1,031.00	2,268,200
デンソー	36,700	4,451.00	163,351,700
東海理化電機製作所	4,400	1,864.00	8,201,600
三井E & Sホールディングス	6,200	930.00	5,766,000
川崎重工業	13,000	2,126.00	27,638,000
名村造船所	5,500	236.00	1,298,000
サノヤスホールディングス	2,100	173.00	363,300
日本車輛製造	600	2,916.00	1,749,600

三菱ロジスネクスト	2,200	1,695.00	3,729,000	
近畿車輛	300	1,630.00	489,000	
日産自動車	196,500	590.00	115,935,000	
いすゞ自動車	48,300	1,072.00	51,777,600	
トヨタ自動車	186,000	7,580.00	1,409,880,000	代用有価証券 23,000株
日野自動車	20,800	1,026.00	21,340,800	
三菱自動車工業	61,700	402.00	24,803,400	
エフテック	1,200	748.00	897,600	
レシップホールディングス	700	655.00	458,500	
G M B	300	802.00	240,600	
ファルテック	300	1,046.00	313,800	
武蔵精密工業	3,700	1,311.00	4,850,700	
日産車体	3,300	1,047.00	3,455,100	
新明和工業	4,500	1,349.00	6,070,500	
極東開発工業	3,100	1,404.00	4,352,400	
日信工業	3,400	2,234.00	7,595,600	
トピー工業	1,400	1,742.00	2,438,800	
ティラド	600	1,790.00	1,074,000	
タチエス	2,800	1,258.00	3,522,400	
N O K	9,000	1,500.00	13,500,000	
フタバ産業	4,700	654.00	3,073,800	
K Y B	1,900	2,967.00	5,637,300	
大同メタル工業	3,200	675.00	2,160,000	
プレス工業	8,300	362.00	3,004,600	
ミクニ	2,200	331.00	728,200	
太平洋工業	3,500	1,281.00	4,483,500	
ケーヒン	3,900	2,580.00	10,062,000	
河西工業	2,300	805.00	1,851,500	
アイシン精機	13,700	3,730.00	51,101,000	
マツダ	49,200	909.00	44,722,800	
今仙電機製作所	1,500	879.00	1,318,500	
本田技研工業	131,200	2,809.50	368,606,400	
スズキ	33,000	5,025.00	165,825,000	
S U B A R U	51,700	2,746.00	141,968,200	
安永	800	1,123.00	898,400	
ヤマハ発動機	21,700	2,048.00	44,441,600	
ショーワ	4,000	2,282.00	9,128,000	
T B K	1,900	459.00	872,100	
エクセディ	2,300	2,296.00	5,280,800	
豊田合成	5,400	2,319.00	12,522,600	
愛三工業	2,700	720.00	1,944,000	
盟和産業	300	1,079.00	323,700	

日本プラスト	1,400	669.00	936,600
ヨロズ	1,600	1,417.00	2,267,200
エフ・シー・シー	2,700	2,269.00	6,126,300
シマノ	6,300	16,800.00	105,840,000
テイ・エス テック	3,900	3,050.00	11,895,000
ジャムコ	900	1,358.00	1,222,200
テルモ	47,200	3,890.00	183,608,000
クリエートメディック	500	1,068.00	534,000
日機装	5,000	1,332.00	6,660,000
日本エム・ディ・エム	1,000	2,148.00	2,148,000
島津製作所	19,900	3,110.00	61,889,000
JMS	1,400	927.00	1,297,800
長野計器	1,200	886.00	1,063,200
ブイ・テクノロジー	800	4,835.00	3,868,000
東京計器	1,100	998.00	1,097,800
愛知時計電機	200	4,240.00	848,000
インターアクション	900	2,640.00	2,376,000
オーバル	1,500	240.00	360,000
東京精密	3,000	3,860.00	11,580,000
マニー	6,600	2,794.00	18,440,400
ニコン	27,000	1,314.00	35,478,000
トプコン	8,400	1,205.00	10,122,000
オリンパス	92,300	1,785.50	164,801,650
理研計器	1,500	2,125.00	3,187,500
タムロン	1,400	2,324.00	3,253,600
HOYA	33,300	10,590.00	352,647,000
シード	700	1,000.00	700,000
ノーリツ鋼機	1,200	1,550.00	1,860,000
エー・アンド・デイ	1,600	898.00	1,436,800
朝日インテック	14,200	2,998.00	42,571,600
シチズン時計	19,700	522.00	10,283,400
リズム時計工業	600	892.00	535,200
大研医器	1,200	663.00	795,600
メニコン	2,300	4,955.00	11,396,500
シンシア	200	678.00	135,600
松風	800	1,831.00	1,464,800
セイコーホールディングス	2,400	2,629.00	6,309,600
ニプロ	11,500	1,248.00	14,352,000
中本パックス	400	1,626.00	650,400
スノーピーク	800	1,003.00	802,400
パラマウントベッドホールディングス	1,700	4,540.00	7,718,000
トランザクション	1,100	1,097.00	1,206,700

粧美堂	500	395.00	197,500
ニホンフラッシュ	800	2,625.00	2,100,000
前田工織	1,800	2,129.00	3,832,200
永大産業	2,300	345.00	793,500
アートネイチャー	1,800	763.00	1,373,400
バンダイナムコホールディングス	17,200	6,332.00	108,910,400
アイフィスジャパン	500	702.00	351,000
共立印刷	2,900	165.00	478,500
S H O E I	800	5,310.00	4,248,000
フランスベッドホールディングス	2,400	942.00	2,260,800
パイロットコーポレーション	2,700	4,335.00	11,704,500
萩原工業	900	1,582.00	1,423,800
トッパン・フォームズ	3,600	1,195.00	4,302,000
フジシールインターナショナル	3,700	2,311.00	8,550,700
タカラトミー	7,500	1,173.00	8,797,500
廣済堂	1,200	1,045.00	1,254,000
エステールホールディングス	500	687.00	343,500
アーク	6,600	93.00	613,800
タカノ	600	784.00	470,400
プロネクサス	1,400	1,124.00	1,573,600
ホクシン	1,100	158.00	173,800
ウッドワン	600	1,137.00	682,200
大建工業	1,100	1,844.00	2,028,400
凸版印刷	23,500	2,189.00	51,441,500
大日本印刷	21,800	3,055.00	66,599,000
共同印刷	500	2,958.00	1,479,000
N I S S H A	3,500	1,004.00	3,514,000
光村印刷	200	1,718.00	343,600
T A K A R A & C O M P A N Y	800	1,723.00	1,378,400
アシックス	13,800	1,588.00	21,914,400
ツツミ	600	2,106.00	1,263,600
小松ウオール工業	500	2,088.00	1,044,000
ヤマハ	9,900	5,510.00	54,549,000
河合楽器製作所	500	3,495.00	1,747,500
クリナップ	1,600	668.00	1,068,800
ピジョン	10,100	3,855.00	38,935,500
オリバー	400	3,235.00	1,294,000
兼松サステック	100	1,829.00	182,900
キングジム	1,400	881.00	1,233,400
リンテック	3,900	2,395.00	9,340,500
イトーキ	3,600	469.00	1,688,400
任天堂	10,200	40,040.00	408,408,000

三菱鉛筆	2,700	1,593.00	4,301,100
タカスタンダード	3,400	1,863.00	6,334,200
コクヨ	8,000	1,610.00	12,880,000
ナカバヤシ	1,600	613.00	980,800
オカムラ	5,800	1,042.00	6,043,600
美津濃	1,500	2,663.00	3,994,500
東京電力ホールディングス	133,100	449.00	59,761,900
中部電力	50,900	1,520.00	77,368,000
関西電力	63,200	1,255.50	79,347,600
中国電力	23,000	1,464.00	33,672,000
北陸電力	15,300	892.00	13,647,600
東北電力	41,600	1,036.00	43,097,600
四国電力	15,000	940.00	14,100,000
九州電力	34,400	905.00	31,132,000
北海道電力	15,700	498.00	7,818,600
沖縄電力	3,100	2,045.00	6,339,500
電源開発	13,300	2,479.00	32,970,700
エフオン	800	760.00	608,000
イーレックス	2,400	1,679.00	4,029,600
レノバ	2,800	1,321.00	3,698,800
東京瓦斯	32,000	2,431.50	77,808,000
大阪瓦斯	32,300	1,873.00	60,497,900
東邦瓦斯	8,200	4,235.00	34,727,000
北海道瓦斯	900	1,631.00	1,467,900
広島ガス	3,300	353.00	1,164,900
西部瓦斯	1,900	2,349.00	4,463,100
静岡ガス	4,700	886.00	4,164,200
メタウォーター	800	4,145.00	3,316,000
SBSホールディングス	1,400	1,823.00	2,552,200
東武鉄道	17,600	3,825.00	67,320,000
相鉄ホールディングス	5,300	2,931.00	15,534,300
東急	42,000	1,916.00	80,472,000
京浜急行電鉄	21,500	2,026.00	43,559,000
小田急電鉄	24,800	2,403.00	59,594,400
京王電鉄	8,700	6,210.00	54,027,000
京成電鉄	11,600	3,850.00	44,660,000
富士急行	2,300	3,745.00	8,613,500
東日本旅客鉄道	29,300	9,533.00	279,316,900
西日本旅客鉄道	14,900	8,907.00	132,714,300
東海旅客鉄道	13,900	21,605.00	300,309,500
西武ホールディングス	22,400	1,700.00	38,080,000
鴻池運輸	2,600	1,539.00	4,001,400

西日本鉄道	4,600	2,545.00	11,707,000
ハマキョウレックス	1,300	3,325.00	4,322,500
サカイ引越センター	900	6,100.00	5,490,000
近鉄グループホールディングス	15,800	5,720.00	90,376,000
阪急阪神ホールディングス	21,100	4,430.00	93,473,000
南海電気鉄道	7,500	2,738.00	20,535,000
京阪ホールディングス	7,000	4,900.00	34,300,000
神戸電鉄	400	3,980.00	1,592,000
名古屋鉄道	13,000	3,205.00	41,665,000
山陽電気鉄道	1,200	2,101.00	2,521,200
日本通運	5,600	5,770.00	32,312,000
ヤマトホールディングス	27,700	1,849.00	51,217,300
山九	4,400	5,420.00	23,848,000
丸運	500	325.00	162,500
丸全昭和運輸	1,300	2,924.00	3,801,200
センコーグループホールディングス	8,600	873.00	7,507,800
トナミホールディングス	400	5,010.00	2,004,000
ニッコンホールディングス	5,600	2,549.00	14,274,400
日本石油輸送	200	2,973.00	594,600
福山通運	2,000	3,605.00	7,210,000
セイノーホールディングス	11,800	1,404.00	16,567,200
エスライン	400	1,032.00	412,800
神奈川中央交通	400	4,020.00	1,608,000
日立物流	2,900	3,130.00	9,077,000
丸和運輸機関	1,700	2,201.00	3,741,700
C & F ロジホールディングス	1,600	1,276.00	2,041,600
九州旅客鉄道	14,100	3,555.00	50,125,500
S Gホールディングス	16,500	2,392.00	39,468,000
日本郵船	13,200	1,745.00	23,034,000
商船三井	10,000	2,562.00	25,620,000
川崎汽船	4,900	1,425.00	6,982,500
N S ユナイテッド海運	900	1,971.00	1,773,900
明治海運	1,700	364.00	618,800
飯野海運	7,700	360.00	2,772,000
共栄タンカー	300	921.00	276,300
乾汽船	1,000	1,131.00	1,131,000
日本航空	28,400	3,037.00	86,250,800
A N Aホールディングス	28,900	3,375.00	97,537,500
パスコ	300	2,049.00	614,700
トランコム	400	7,640.00	3,056,000
日新	1,300	1,634.00	2,124,200
三菱倉庫	5,000	2,715.00	13,575,000



三井倉庫ホールディングス	1,800	1,794.00	3,229,200
住友倉庫	5,800	1,442.00	8,363,600
澁澤倉庫	900	2,097.00	1,887,300
東陽倉庫	2,800	316.00	884,800
日本トランスシティ	3,500	475.00	1,662,500
ケイヒン	300	1,290.00	387,000
中央倉庫	1,000	1,114.00	1,114,000
川西倉庫	300	1,028.00	308,400
安田倉庫	1,300	1,104.00	1,435,200
ファイブホールディングス	300	467.00	140,100
東洋埠頭	400	1,396.00	558,400
宇徳	1,300	541.00	703,300
上組	9,000	2,355.00	21,195,000
サンリツ	400	701.00	280,400
キムラユニティー	400	1,126.00	450,400
キューソー流通システム	400	1,968.00	787,200
近鉄エクスプレス	3,400	1,746.00	5,936,400
東海運	900	280.00	252,000
エーアイティー	1,100	986.00	1,084,600
内外トランスライン	600	1,272.00	763,200
日本コンセプト	500	1,534.00	767,000
NEC ネットエスアイ	1,600	4,170.00	6,672,000
クロスキャット	400	1,190.00	476,000
システナ	5,800	1,850.00	10,730,000
デジタルアーツ	800	4,915.00	3,932,000
日鉄ソリューションズ	2,400	3,230.00	7,752,000
キューブシステム	900	762.00	685,800
エイジア	300	1,495.00	448,500
コア	700	1,381.00	966,700
ソリトンシステムズ	700	1,211.00	847,700
ソフトクリエイトホールディングス	700	1,750.00	1,225,000
T I S	5,400	6,620.00	35,748,000
ネオス	700	708.00	495,600
電算システム	600	2,843.00	1,705,800
グリー	10,000	464.00	4,640,000
コーエーテクモホールディングス	3,300	2,909.00	9,599,700
三菱総合研究所	700	4,170.00	2,919,000
ボルテージ	300	522.00	156,600
電算	200	2,204.00	440,800
A G S	900	802.00	721,800
ファインデックス	1,400	1,108.00	1,551,200
ブレインパッド	400	5,840.00	2,336,000

K L a b	3,200	789.00	2,524,800
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,000	914.00	1,828,000
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,763.00	528,900
ネクソン	46,600	1,482.00	69,061,200
アイスタイル	4,600	454.00	2,088,400
エムアップ	500	2,993.00	1,496,500
エイチーム	1,200	914.00	1,096,800
エニグモ	1,200	869.00	1,042,800
テクノスジャパン	1,300	512.00	665,600
e n i s h	800	552.00	441,600
コロプラ	5,400	1,186.00	6,404,400
ブロードリーフ	8,200	601.00	4,928,200
クロス・マーケティンググループ	800	344.00	275,200
デジタルハーツホールディングス	900	901.00	810,900
システム情報	900	988.00	889,200
メディアドゥホールディングス	500	3,135.00	1,567,500
じげん	4,100	494.00	2,025,400
ブイキューブ	1,100	697.00	766,700
エンカレッジ・テクノロジー	300	854.00	256,200
サイバーリンクス	300	1,120.00	336,000
フィックスターズ	1,800	1,502.00	2,703,600
C A R T A H O L D I N G S	800	1,049.00	839,200
オブティム	400	4,260.00	1,704,000
セレス	600	1,190.00	714,000
S H I F T	400	7,480.00	2,992,000
ティーガイア	1,400	2,696.00	3,774,400
セック	300	3,720.00	1,116,000
日本アジアグループ	1,800	367.00	660,600
豆蔵ホールディングス	1,100	1,880.00	2,068,000
テクマトリックス	1,200	2,623.00	3,147,600
プロシップ	500	1,332.00	666,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	2,034.00	8,136,000
G M O ペイメントゲートウェイ	2,700	7,050.00	19,035,000
ザッパラス	900	381.00	342,900
システムリサーチ	500	1,770.00	885,000
インターネットイニシアティブ	2,400	3,000.00	7,200,000
さくらインターネット	1,800	629.00	1,132,200
ヴィンクス	500	1,096.00	548,000
G M O クラウド	300	2,504.00	751,200
S R A ホールディングス	800	2,526.00	2,020,800
システムインテグレータ	600	886.00	531,600
朝日ネット	1,200	717.00	860,400

e B A S E	1,000	1,693.00	1,693,000
アバント	1,200	1,087.00	1,304,400
アドソル日進	600	2,335.00	1,401,000
フリービット	800	839.00	671,200
コムチュア	1,800	2,142.00	3,855,600
サイバーコム	300	2,030.00	609,000
アステリア	1,000	552.00	552,000
アイル	600	1,779.00	1,067,400
マークラインズ	800	1,963.00	1,570,400
メディカル・データ・ビジョン	1,300	811.00	1,054,300
g u m i	2,200	738.00	1,623,600
ショーケース	400	674.00	269,600
モバイルファクトリー	400	1,670.00	668,000
テラスカイ	600	2,981.00	1,788,600
デジタル・インフォメーション・テクノロ ジー	600	1,733.00	1,039,800
P C Iホールディングス	300	2,138.00	641,400
パイプドHD	200	1,760.00	352,000
アイビーシー	300	1,484.00	445,200
ネオジャパン	300	1,166.00	349,800
P R T I M E S	200	2,350.00	470,000
ランドコンピュータ	200	1,122.00	224,400
ダブルスタンダード	200	4,170.00	834,000
オープンドア	800	1,311.00	1,048,800
マイネット	600	642.00	385,200
アカツキ	600	5,560.00	3,336,000
ベネフィットジャパン	100	1,740.00	174,000
U b i c o mホールディングス	400	1,335.00	534,000
L I N E	3,700	5,360.00	19,832,000
カナミックネットワーク	1,000	761.00	761,000
ノムラシステムコーポレーション	400	513.00	205,200
チェンジ	400	3,210.00	1,284,000
シンクロ・フード	700	510.00	357,000
オークネット	1,000	1,184.00	1,184,000
セグエグループ	300	835.00	250,500
エイトレッド	200	1,373.00	274,600
A O I T Y O H o l d i n g s	1,700	684.00	1,162,800
マクロミル	3,300	993.00	3,276,900
ビーグリー	300	1,173.00	351,900
オロ	500	3,420.00	1,710,000
ユーザーローカル	100	2,972.00	297,200
ニーズウェル	200	766.00	153,200
サインポスト	300	1,902.00	570,600

ソルクシーズ	700	901.00	630,700
フェイス	600	783.00	469,800
プロトコーポレーション	1,500	1,427.00	2,140,500
ハイマックス	200	1,943.00	388,600
野村総合研究所	23,200	2,546.00	59,067,200
サイバネットシステム	1,200	880.00	1,056,000
C Eホールディングス	1,000	471.00	471,000
日本システム技術	300	1,357.00	407,100
インタージホールディングス	2,000	883.00	1,766,000
東邦システムサイエンス	400	883.00	353,200
ソースネクスト	7,900	490.00	3,871,000
インフォコム	1,800	3,105.00	5,589,000
HEROZ	200	4,990.00	998,000
ラクスル	900	3,495.00	3,145,500
F I G	1,800	295.00	531,000
システムサポート	200	2,526.00	505,200
イーソル	600	2,339.00	1,403,400
アルテリア・ネットワークス	1,800	1,908.00	3,434,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,723.00	689,200
フォーカスシステムズ	1,000	963.00	963,000
クレスコ	1,000	1,829.00	1,829,000
フジ・メディア・ホールディングス	15,700	1,490.00	23,393,000
オービック	5,700	15,110.00	86,127,000
ジャストシステム	2,700	5,850.00	15,795,000
T D Cソフト	1,400	966.00	1,352,400
Zホールディングス	224,600	424.00	95,230,400
トレンドマイクロ	7,300	5,750.00	41,975,000
I Dホールディングス	600	1,482.00	889,200
日本オラクル	3,300	9,500.00	31,350,000
アルファシステムズ	500	2,810.00	1,405,000
フューチャー	2,000	1,900.00	3,800,000
C A C Holdings	1,100	1,410.00	1,551,000
S Bテクノロジー	600	2,402.00	1,441,200
トーセ	500	898.00	449,000
オービックビジネスコンサルタント	1,700	4,215.00	7,165,500
伊藤忠テクノソリューションズ	7,400	3,240.00	23,976,000
アイティフォー	2,000	750.00	1,500,000
東計電算	200	3,530.00	706,000
エクスネット	200	968.00	193,600
大塚商会	8,800	4,350.00	38,280,000
サイボウズ	1,900	1,979.00	3,760,100
ソフトブレーン	1,000	564.00	564,000

電通国際情報サービス	1,000	4,585.00	4,585,000
デジタルガレージ	2,900	4,015.00	11,643,500
E Mシステムズ	2,300	905.00	2,081,500
ウェザーニューズ	600	3,820.00	2,292,000
C I J	1,200	852.00	1,022,400
ビジネスエンジニアリング	200	3,280.00	656,000
日本エンタープライズ	1,700	252.00	428,400
WOWOW	800	2,665.00	2,132,000
スカラ	1,200	727.00	872,400
インテリジェント ウェイブ	700	779.00	545,300
I M A G I C A G R O U P	1,400	517.00	723,800
ネットワンシステムズ	6,200	1,841.00	11,414,200
システムソフト	4,000	98.00	392,000
アルゴグラフィックス	1,400	3,515.00	4,921,000
マーベラス	2,500	696.00	1,740,000
エイベックス	2,800	1,207.00	3,379,600
日本ユニシス	5,100	3,325.00	16,957,500
兼松エレクトロニクス	900	3,480.00	3,132,000
東京放送ホールディングス	9,900	1,882.00	18,631,800
日本テレビホールディングス	13,600	1,488.00	20,236,800
朝日放送グループホールディングス	1,500	742.00	1,113,000
テレビ朝日ホールディングス	4,500	2,091.00	9,409,500
スカパーJ S A Tホールディングス	10,500	463.00	4,861,500
テレビ東京ホールディングス	1,300	2,336.00	3,036,800
日本BS放送	500	1,197.00	598,500
ビジョン	1,500	1,454.00	2,181,000
スマートバリュー	500	797.00	398,500
U S E N - N E X T H O L D I N G S	700	1,663.00	1,164,100
コネクション	1,000	1,579.00	1,579,000
クロップス	300	719.00	215,700
日本電信電話	218,800	2,786.50	609,686,200
K D D I	122,000	3,300.00	402,600,000
ソフトバンク	148,900	1,500.00	223,350,000
光通信	1,700	27,020.00	45,934,000
N T T ドコモ	121,000	3,084.00	373,164,000
エムティーアイ	1,600	682.00	1,091,200
G M O インターネット	6,400	2,100.00	13,440,000
ファイバーゲート	400	1,209.00	483,600
アйдママーケティングコミュニケーション	500	595.00	297,500
K A D O K A W A	4,400	1,819.00	8,003,600
学研ホールディングス	600	7,110.00	4,266,000
ゼンリン	3,300	1,475.00	4,867,500

昭文社	800	370.00	296,000
インプレスホールディングス	1,400	167.00	233,800
アイネット	800	1,461.00	1,168,800
松竹	1,100	14,620.00	16,082,000
東宝	9,800	4,005.00	39,249,000
東映	600	14,700.00	8,820,000
エヌ・ティ・ティ・データ	43,500	1,549.00	67,381,500
ピー・シー・エー	200	4,465.00	893,000
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,472.00	741,600
D T S	3,600	2,548.00	9,172,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,000	5,410.00	37,870,000
シーイーシー	1,700	2,046.00	3,478,200
カブコン	7,700	3,120.00	24,024,000
アイ・エス・ピー	300	1,854.00	556,200
ジャステック	1,000	1,065.00	1,065,000
S C S K	3,800	5,670.00	21,546,000
日本システムウエア	500	2,350.00	1,175,000
アイネス	1,600	1,608.00	2,572,800
T K C	1,400	5,460.00	7,644,000
富士ソフト	2,100	4,405.00	9,250,500
N S D	5,300	1,782.00	9,444,600
コナミホールディングス	5,900	4,130.00	24,367,000
福井コンピュータホールディングス	600	3,335.00	2,001,000
J B C Cホールディングス	1,100	1,893.00	2,082,300
ミロク情報サービス	1,400	3,005.00	4,207,000
ソフトバンクグループ	129,800	4,502.00	584,359,600
ハウスイ	200	924.00	184,800
高千穂交易	600	1,157.00	694,200
伊藤忠食品	400	5,040.00	2,016,000
エレマテック	1,500	1,076.00	1,614,000
J A L U X	500	2,325.00	1,162,500
あらた	1,300	4,475.00	5,817,500
トーメンデバイス	200	3,800.00	760,000
東京エレクトロン デバイス	600	2,508.00	1,504,800
フィールズ	1,300	555.00	721,500
双日	90,900	343.00	31,178,700
アルフレッサ ホールディングス	18,200	2,229.00	40,567,800
横浜冷凍	4,600	960.00	4,416,000
神栄	300	774.00	232,200
ラサ商事	900	920.00	828,000
ラクーンホールディングス	800	778.00	622,400
アルコニックス	1,800	1,317.00	2,370,600

神戸物産	5,700	4,225.00	24,082,500
あい ホールディングス	2,400	1,834.00	4,401,600
ディーブイエックス	600	925.00	555,000
ダイワボウホールディングス	1,400	5,990.00	8,386,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,900	1,644.00	6,411,600
ラクト・ジャパン	600	4,070.00	2,442,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,100	1,037.00	3,214,700
八洲電機	1,300	892.00	1,159,600
メディアスホールディングス	900	830.00	747,000
レスターホールディングス	1,700	1,824.00	3,100,800
ジューテックホールディングス	400	1,165.00	466,000
大光	700	658.00	460,600
OCHIホールディングス	500	1,460.00	730,000
TOKAIホールディングス	8,600	1,022.00	8,789,200
黒谷	400	488.00	195,200
Cominix	300	812.00	243,600
三洋貿易	1,600	1,304.00	2,086,400
ビューティガレージ	300	2,213.00	663,900
ウイン・パートナーズ	1,200	1,160.00	1,392,000
ミタチ産業	400	711.00	284,400
シップヘルスケアホールディングス	2,600	4,865.00	12,649,000
明治電機工業	500	1,466.00	733,000
デリカフーズホールディングス	600	709.00	425,400
スターティアホールディングス	400	757.00	302,800
コメダホールディングス	3,600	2,184.00	7,862,400
ピーバンドットコム	100	1,190.00	119,000
アセンテック	200	2,398.00	479,600
富士興産	500	646.00	323,000
協栄産業	200	1,367.00	273,400
小野建	1,500	1,350.00	2,025,000
南陽	400	1,772.00	708,800
佐島電機	1,200	870.00	1,044,000
エコートレーディング	400	574.00	229,600
伯東	1,000	1,261.00	1,261,000
コンドーテック	1,300	1,139.00	1,480,700
中山福	1,000	514.00	514,000
ナガイレーベン	2,400	2,342.00	5,620,800
三菱食品	1,800	3,165.00	5,697,000
松田産業	1,200	1,561.00	1,873,200
第一興商	2,400	5,270.00	12,648,000
メディバルホールディングス	17,700	2,316.00	40,993,200
SPK	400	2,555.00	1,022,000

萩原電気ホールディングス	600	2,533.00	1,519,800
アズワン	1,100	9,460.00	10,406,000
スズデン	600	1,410.00	846,000
シモジマ	1,000	1,120.00	1,120,000
ドウシシャ	1,600	1,716.00	2,745,600
小津産業	400	1,905.00	762,000
高速	1,000	1,190.00	1,190,000
たけびし	600	1,467.00	880,200
リックス	400	1,703.00	681,200
丸文	1,400	598.00	837,200
ハピネット	1,400	1,326.00	1,856,400
橋本総業ホールディングス	400	1,706.00	682,400
日本ライフライン	4,800	1,379.00	6,619,200
タカショー	800	459.00	367,200
エクセル	500	1,596.00	798,000
マルカ	600	2,009.00	1,205,400
I D O M	4,500	581.00	2,614,500
進和	900	2,194.00	1,974,600
エスケイジャパン	400	438.00	175,200
ダイトロン	700	1,674.00	1,171,800
シークス	2,100	1,284.00	2,696,400
田中商事	500	717.00	358,500
オーハシテクニカ	900	1,535.00	1,381,500
白銅	600	1,431.00	858,600
伊藤忠商事	114,800	2,530.00	290,444,000
丸紅	170,900	785.60	134,259,040
高島	200	1,902.00	380,400
長瀬産業	9,200	1,509.00	13,882,800
蝶理	1,000	2,099.00	2,099,000
豊田通商	18,300	3,605.00	65,971,500
三共生興	2,500	572.00	1,430,000
兼松	6,100	1,400.00	8,540,000
ツカモトコーポレーション	300	1,140.00	342,000
三井物産	144,200	1,937.00	279,315,400
日本紙パルプ商事	900	4,070.00	3,663,000
日立ハイテクノロジーズ	5,700	8,100.00	46,170,000
カメイ	2,100	1,120.00	2,352,000
東都水産	200	2,773.00	554,600
O U Gホールディングス	300	2,655.00	796,500
スターゼン	600	4,285.00	2,571,000
山善	6,400	1,015.00	6,496,000
椿本興業	300	3,990.00	1,197,000



住友商事	103,600	1,638.50	169,748,600
内田洋行	700	7,050.00	4,935,000
三菱商事	115,200	2,798.00	322,329,600
第一実業	800	3,490.00	2,792,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,700	2,632.00	12,370,400
西華産業	900	1,270.00	1,143,000
佐藤商事	1,300	943.00	1,225,900
菱洋エレクトロ	1,700	1,826.00	3,104,200
東京産業	1,500	608.00	912,000
ユアサ商事	1,500	3,505.00	5,257,500
神鋼商事	400	2,472.00	988,800
小林産業	1,000	277.00	277,000
阪和興業	3,100	2,663.00	8,255,300
正栄食品工業	1,100	3,680.00	4,048,000
カナデン	1,300	1,332.00	1,731,600
菱電商事	1,200	1,647.00	1,976,400
フルサト工業	900	1,734.00	1,560,600
岩谷産業	3,700	3,685.00	13,634,500
すてきナイスグループ	700	1,269.00	888,300
昭光通商	600	688.00	412,800
ニチモウ	300	1,955.00	586,500
極東貿易	500	1,976.00	988,000
イワキ	2,200	512.00	1,126,400
三愛石油	4,000	1,097.00	4,388,000
稲畑産業	3,600	1,470.00	5,292,000
G S Iクレオス	400	1,230.00	492,000
明和産業	1,600	595.00	952,000
クワザワ	600	648.00	388,800
ワキタ	3,500	1,004.00	3,514,000
東邦ホールディングス	5,300	2,244.00	11,893,200
サンゲツ	4,500	1,928.00	8,676,000
ミツウロコグループホールディングス	2,400	1,139.00	2,733,600
シナネンホールディングス	700	2,032.00	1,422,400
伊藤忠エネクス	3,500	927.00	3,244,500
サンリオ	4,700	2,104.00	9,888,800
サンワテクノス	1,200	956.00	1,147,200
リョーサン	1,800	2,476.00	4,456,800
新光商事	2,500	830.00	2,075,000
トーホー	800	1,788.00	1,430,400
三信電気	900	1,704.00	1,533,600
東陽テクニカ	1,900	1,156.00	2,196,400
モスフードサービス	2,200	3,020.00	6,644,000

加賀電子	1,600	2,243.00	3,588,800
ソーダニッカ	1,700	595.00	1,011,500
立花エレテック	1,200	1,767.00	2,120,400
フォーバル	700	1,134.00	793,800
PALTAC	2,600	5,180.00	13,468,000
三谷産業	2,100	346.00	726,600
太平洋興発	700	782.00	547,400
西本Wismettacホールディングス	300	3,600.00	1,080,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,107.00	421,400
国際紙パルプ商事	4,000	277.00	1,108,000
ヤマタネ	900	1,512.00	1,360,800
丸紅建材リース	200	1,841.00	368,200
日鉄物産	1,100	4,880.00	5,368,000
泉州電業	500	2,972.00	1,486,000
トラスコ中山	3,400	2,510.00	8,534,000
オートバックスセブン	6,100	1,586.00	9,674,600
モリト	1,100	798.00	877,800
加藤産業	2,600	3,410.00	8,866,000
北恵	300	889.00	266,700
イノテック	1,000	1,099.00	1,099,000
イエローハット	3,100	1,706.00	5,288,600
J Kホールディングス	1,500	725.00	1,087,500
日伝	1,500	2,058.00	3,087,000
北沢産業	1,300	268.00	348,400
杉本商事	900	1,950.00	1,755,000
因幡電機産業	4,700	2,696.00	12,671,200
東テク	600	2,654.00	1,592,400
ミスミグループ本社	20,600	2,789.00	57,453,400
アルテック	1,400	258.00	361,200
タキヒヨー	500	1,887.00	943,500
蔵王産業	300	1,447.00	434,100
スズケン	7,000	4,200.00	29,400,000
ジェコス	1,100	1,059.00	1,164,900
グローセル	1,500	445.00	667,500
ローソン	4,200	6,260.00	26,292,000
サンエー	1,300	4,500.00	5,850,000
カワチ薬品	1,300	2,157.00	2,804,100
エービーシー・マート	2,600	6,990.00	18,174,000
ハードオフコーポレーション	600	817.00	490,200
アスクル	1,700	3,540.00	6,018,000
ゲオホールディングス	3,000	1,219.00	3,657,000
アダストリア	2,300	2,113.00	4,859,900

ジーフット	900	618.00	556,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	661.00	198,300
くら寿司	900	5,470.00	4,923,000
キャンドウ	800	1,631.00	1,304,800
パルグループホールディングス	900	3,185.00	2,866,500
エディオン	7,500	1,128.00	8,460,000
サーラコーポレーション	3,300	617.00	2,036,100
ワッツ	800	622.00	497,600
ハローズ	600	2,685.00	1,611,000
フジオフードシステム	1,400	1,748.00	2,447,200
あみやき亭	400	3,450.00	1,380,000
ひらまつ	3,100	270.00	837,000
大黒天物産	400	3,550.00	1,420,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,338.00	2,007,000
ファーマライズホールディングス	400	658.00	263,200
アルペン	1,300	1,619.00	2,104,700
ハブ	500	1,005.00	502,500
クオールホールディングス	2,400	1,353.00	3,247,200
ジinzホールディングス	900	7,630.00	6,867,000
ビックカメラ	9,700	1,164.00	11,290,800
D C Mホールディングス	8,800	1,035.00	9,108,000
Monotaro	11,700	2,713.00	31,742,100
東京一番フーズ	400	622.00	248,800
DDホールディングス	700	1,627.00	1,138,900
きちりホールディングス	500	746.00	373,000
アークランドサービスホールディングス	1,200	1,959.00	2,350,800
J.フロント リテイリング	19,600	1,285.00	25,186,000
ドトール・日レスホールディングス	2,600	2,071.00	5,384,600
マツモトキヨシホールディングス	6,800	4,390.00	29,852,000
ブロンコビリー	900	2,596.00	2,336,400
Z O Z O	11,300	1,582.00	17,876,600
トレジャー・ファクトリー	500	847.00	423,500
物語コーポレーション	400	8,840.00	3,536,000
ココカラファイン	1,700	5,850.00	9,945,000
三越伊勢丹ホールディングス	28,800	802.00	23,097,600
Hamee	600	1,537.00	922,200
ウエルシアホールディングス	4,900	5,990.00	29,351,000
クリエイトSDホールディングス	2,800	2,813.00	7,876,400
丸善CHIホールディングス	1,700	361.00	613,700
ミサワ	400	648.00	259,200
ティーライフ	200	900.00	180,000
エー・ピーカンパニー	300	601.00	180,300

チムニー	500	2,311.00	1,155,500
シュッピン	1,200	1,081.00	1,297,200
ネクステージ	2,400	1,041.00	2,498,400
ジョイフル本田	4,800	1,260.00	6,048,000
鳥貴族	600	2,574.00	1,544,400
キリン堂ホールディングス	700	1,700.00	1,190,000
ホットランド	1,100	1,278.00	1,405,800
すかいらーくホールディングス	18,400	1,985.00	36,524,000
SFPホールディングス	700	2,242.00	1,569,400
綿半ホールディングス	600	1,921.00	1,152,600
ヨシックス	300	2,838.00	851,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,700	979.00	4,601,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	632.00	505,600
B E E N O S	600	1,155.00	693,000
あさひ	1,300	1,310.00	1,703,000
日本調剤	500	3,665.00	1,832,500
コスモス薬品	700	24,150.00	16,905,000
トーエル	800	784.00	627,200
オンリー	300	777.00	233,100
セブン&アイ・ホールディングス	64,200	4,256.00	273,235,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,400	2,281.00	10,036,400
ツルハホールディングス	3,600	13,020.00	46,872,000
サンマルクホールディングス	1,300	2,265.00	2,944,500
フェリシモ	400	994.00	397,600
トリドールホールディングス	2,000	2,502.00	5,004,000
T O K Y O B A S E	1,500	504.00	756,000
ウイルプラスホールディングス	300	825.00	247,500
J Mホールディングス	800	2,268.00	1,814,400
サツドラホールディングス	300	1,846.00	553,800
アレンザホールディングス	800	970.00	776,000
串カツ田中ホールディングス	300	2,230.00	669,000
パロックジャパンリミテッド	1,100	1,009.00	1,109,900
クスリのアオキホールディングス	1,500	6,490.00	9,735,000
力の源ホールディングス	800	1,002.00	801,600
スシローグローバルホールディングス	1,800	9,390.00	16,902,000
L I X I L ビバ	1,600	2,110.00	3,376,000
メディカルシステムネットワーク	1,600	527.00	843,200
はるやまホールディングス	700	858.00	600,600
ノジマ	2,900	2,159.00	6,261,100
カッパ・クリエイト	2,300	1,460.00	3,358,000
ライトオン	1,300	583.00	757,900

ジーンズメイト	500	292.00	146,000
良品計画	21,800	1,807.00	39,392,600
三城ホールディングス	1,800	333.00	599,400
アドヴァン	2,500	1,300.00	3,250,000
アルビス	600	2,200.00	1,320,000
コナカ	2,000	405.00	810,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,670.00	334,000
G - 7ホールディングス	1,000	2,335.00	2,335,000
イオン北海道	1,400	798.00	1,117,200
コジマ	2,900	519.00	1,505,100
ヒマラヤ	600	809.00	485,400
コーナン商事	2,300	2,384.00	5,483,200
エコス	600	1,687.00	1,012,200
ワタミ	2,000	1,273.00	2,546,000
マルシェ	500	780.00	390,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	36,100	1,746.00	63,030,600
西松屋チェーン	3,600	932.00	3,355,200
ゼンショーホールディングス	7,900	2,272.00	17,948,800
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,847.00	2,031,700
ハークスレイ	300	1,270.00	381,000
サイゼリヤ	2,700	2,395.00	6,466,500
V Tホールディングス	6,800	446.00	3,032,800
魚力	500	1,586.00	793,000
ポプラ	500	498.00	249,000
フジ・コーポレーション	400	2,039.00	815,600
ユナイテッドアローズ	1,700	2,858.00	4,858,600
ハイデイ日高	2,400	1,967.00	4,720,800
京都きもの友禅	1,100	323.00	355,300
コロワイド	5,500	2,198.00	12,089,000
ピーシーデポコーポレーション	2,200	575.00	1,265,000
壱番屋	1,100	5,670.00	6,237,000
P L A N T	400	562.00	224,800
スギホールディングス	3,300	5,400.00	17,820,000
薬王堂ホールディングス	700	2,169.00	1,518,300
ヴィア・ホールディングス	2,100	660.00	1,386,000
スクロール	2,600	352.00	915,200
ヨンドシーホールディングス	1,700	2,359.00	4,010,300
ファミリーマート	13,100	2,323.00	30,431,300
木曽路	2,100	2,926.00	6,144,600
S R Sホールディングス	1,900	1,040.00	1,976,000
千趣会	3,100	473.00	1,466,300
タカキュー	1,300	184.00	239,200

ケーヨー	3,400	540.00	1,836,000
上新電機	1,900	2,363.00	4,489,700
日本瓦斯	2,600	3,490.00	9,074,000
ロイヤルホールディングス	2,900	2,368.00	6,867,200
東天紅	100	1,269.00	126,900
いなげや	2,000	1,471.00	2,942,000
鳥忠	3,100	3,100.00	9,610,000
チヨダ	1,700	1,469.00	2,497,300
ライフコーポレーション	1,200	2,648.00	3,177,600
リンガーハット	2,000	2,447.00	4,894,000
MrMaxHD	2,200	460.00	1,012,000
テンアライド	1,600	436.00	697,600
AOKIホールディングス	3,200	1,070.00	3,424,000
オークワ	2,600	1,483.00	3,855,800
コメリ	2,500	2,369.00	5,922,500
青山商事	3,400	1,406.00	4,780,400
しまむら	1,900	8,220.00	15,618,000
はせがわ	800	403.00	322,400
高島屋	12,000	1,150.00	13,800,000
松屋	3,400	743.00	2,526,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,800	990.00	7,722,000
近鉄百貨店	600	3,440.00	2,064,000
パルコ	1,600	1,848.00	2,956,800
丸井グループ	15,000	2,480.00	37,200,000
アクシアル リテイリング	1,300	3,675.00	4,777,500
イオン	63,200	2,239.00	141,504,800
イズミ	3,300	3,395.00	11,203,500
平和堂	3,300	1,898.00	6,263,400
フジ	2,000	1,848.00	3,696,000
ヤオコー	1,800	5,650.00	10,170,000
ゼビオホールディングス	2,000	1,168.00	2,336,000
ケーズホールディングス	15,800	1,328.00	20,982,400
Olympicグループ	900	599.00	539,100
日産東京販売ホールディングス	2,500	277.00	692,500
Genky DrugStores	700	1,969.00	1,378,300
ナルミヤ・インターナショナル	300	1,219.00	365,700
総合メディカルホールディングス	1,400	2,005.00	2,807,000
ブックオフグループホールディングス	1,000	962.00	962,000
アインホールディングス	2,000	6,580.00	13,160,000
元気寿司	400	2,943.00	1,177,200
ヤマダ電機	50,000	548.00	27,400,000
アーランドサカモト	2,500	1,209.00	3,022,500

ニトリホールディングス	7,100	16,970.00	120,487,000	
愛眼	1,400	255.00	357,000	
ケーユーホールディングス	800	891.00	712,800	
吉野家ホールディングス	5,400	2,450.00	13,230,000	
松屋フーズホールディングス	800	4,755.00	3,804,000	
サガミホールディングス	2,200	1,372.00	3,018,400	
関西スーパーマーケット	1,400	1,015.00	1,421,000	
王将フードサービス	1,200	6,350.00	7,620,000	
プレナス	1,800	1,978.00	3,560,400	
ミニストップ	1,200	1,534.00	1,840,800	
アークス	3,300	1,937.00	6,392,100	
パローホールディングス	3,600	1,901.00	6,843,600	
藤久	200	723.00	144,600	
ベルク	800	5,970.00	4,776,000	
大庄	900	1,644.00	1,479,600	
ファーストリテイリング	2,200	57,600.00	126,720,000	
サンドラッグ	6,200	3,690.00	22,878,000	
サックスパー ホールディングス	1,400	837.00	1,171,800	
ヤマザワ	400	1,689.00	675,600	
やまや	300	2,219.00	665,700	
ベルーナ	3,500	618.00	2,163,000	
島根銀行	400	631.00	252,400	
じもとホールディングス	11,300	105.00	1,186,500	
めぶきフィナンシャルグループ	84,900	246.00	20,885,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,268.00	2,916,400	
九州フィナンシャルグループ	26,900	455.00	12,239,500	
ゆうちょ銀行	46,400	1,016.00	47,142,400	
富山第一銀行	3,800	322.00	1,223,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	96,600	419.00	40,475,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	11,100	731.00	8,114,100	
関西みらいフィナンシャルグループ	9,500	617.00	5,861,500	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,588.00	2,382,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,800	2,703.00	7,568,400	
新生銀行	12,100	1,690.00	20,449,000	
あおぞら銀行	9,800	3,060.00	29,988,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,131,400	564.90	639,127,860	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	180,400	452.80	81,685,120	
三井住友トラスト・ホールディングス	31,100	4,015.00	124,866,500	
三井住友フィナンシャルグループ	113,700	3,868.00	439,791,600	代用有価証券 13,000株
千葉銀行	56,500	602.00	34,013,000	
群馬銀行	32,300	355.00	11,466,500	

武蔵野銀行	2,400	1,711.00	4,106,400
千葉興業銀行	4,600	349.00	1,605,400
筑波銀行	7,100	208.00	1,476,800
七十七銀行	5,600	1,651.00	9,245,600
青森銀行	1,300	2,677.00	3,480,100
秋田銀行	1,000	1,996.00	1,996,000
山形銀行	1,900	1,382.00	2,625,800
岩手銀行	1,100	2,708.00	2,978,800
東邦銀行	14,700	251.00	3,689,700
東北銀行	800	1,040.00	832,000
みちのく銀行	1,100	1,392.00	1,531,200
ふくおかフィナンシャルグループ	13,800	1,931.00	26,647,800
静岡銀行	40,600	775.00	31,465,000
十六銀行	2,100	2,270.00	4,767,000
スルガ銀行	17,100	432.00	7,387,200
八十二銀行	39,700	424.00	16,832,800
山梨中央銀行	1,900	1,024.00	1,945,600
大垣共立銀行	3,300	2,272.00	7,497,600
福井銀行	1,400	1,631.00	2,283,400
北國銀行	1,700	3,175.00	5,397,500
清水銀行	700	2,066.00	1,446,200
富山銀行	300	2,165.00	649,500
滋賀銀行	3,300	2,637.00	8,702,100
南都銀行	2,700	2,611.00	7,049,700
百五銀行	14,700	329.00	4,836,300
京都銀行	5,900	4,420.00	26,078,000
紀陽銀行	5,800	1,578.00	9,152,400
ほくほくフィナンシャルグループ	10,900	1,062.00	11,575,800
広島銀行	24,200	498.00	12,051,600
山陰合同銀行	9,700	606.00	5,878,200
中国銀行	14,200	1,035.00	14,697,000
鳥取銀行	500	1,327.00	663,500
伊予銀行	23,500	564.00	13,254,000
百十四銀行	1,700	1,975.00	3,357,500
四国銀行	2,500	948.00	2,370,000
阿波銀行	2,700	2,416.00	6,523,200
大分銀行	1,000	2,533.00	2,533,000
宮崎銀行	1,100	2,470.00	2,717,000
佐賀銀行	1,000	1,545.00	1,545,000
沖縄銀行	1,500	3,515.00	5,272,500
琉球銀行	3,800	1,058.00	4,020,400
セブン銀行	55,000	324.00	17,820,000



みずほフィナンシャルグループ	2,233,000	162.30	362,415,900
高知銀行	600	823.00	493,800
山口フィナンシャルグループ	20,500	660.00	13,530,000
長野銀行	500	1,517.00	758,500
名古屋銀行	1,300	3,235.00	4,205,500
北洋銀行	24,900	221.00	5,502,900
愛知銀行	600	3,365.00	2,019,000
中京銀行	700	2,240.00	1,568,000
大光銀行	600	1,667.00	1,000,200
愛媛銀行	2,300	1,133.00	2,605,900
トマト銀行	600	1,034.00	620,400
京葉銀行	6,900	572.00	3,946,800
栃木銀行	8,200	205.00	1,681,000
北日本銀行	500	2,134.00	1,067,000
東和銀行	2,900	801.00	2,322,900
福島銀行	1,600	232.00	371,200
大東銀行	900	619.00	557,100
トモニホールディングス	12,700	367.00	4,660,900
フィデアホールディングス	15,800	123.00	1,943,400
池田泉州ホールディングス	19,200	193.00	3,705,600
F P G	5,100	964.00	4,916,400
マーキュリアインベストメント	800	718.00	574,400
S B Iホールディングス	18,400	2,512.00	46,220,800
ジャフコ	2,500	4,655.00	11,637,500
大和証券グループ本社	131,900	544.60	71,832,740
野村ホールディングス	289,300	555.30	160,648,290
岡三証券グループ	14,100	392.00	5,527,200
丸三証券	5,000	522.00	2,610,000
東洋証券	6,100	145.00	884,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,000	341.00	6,479,000
光世証券	400	582.00	232,800
水戸証券	4,900	224.00	1,097,600
いちよし証券	3,000	605.00	1,815,000
松井証券	9,400	881.00	8,281,400
だいこう証券ビジネス	800	694.00	555,200
マネックスグループ	12,700	252.00	3,200,400
極東証券	2,300	748.00	1,720,400
岩井コスモホールディングス	1,500	1,289.00	1,933,500
藍澤証券	2,900	733.00	2,125,700
マネーパートナーズグループ	1,800	235.00	423,000
スパークス・グループ	5,600	269.00	1,506,400
かんぽ生命保険	5,900	1,861.00	10,979,900

S O M P Oホールディングス	30,900	4,093.00	126,473,700
アニコム ホールディングス	1,400	3,980.00	5,572,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	42,900	3,651.00	156,627,900
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,500	2,525.00	34,087,500
第一生命ホールディングス	93,100	1,644.50	153,102,950
東京海上ホールディングス	58,800	6,002.00	352,917,600
T & Dホールディングス	49,200	1,181.00	58,105,200
アドバンスクリエイト	400	1,810.00	724,000
全国保証	4,600	4,635.00	21,321,000
ジェイリース	500	367.00	183,500
イントラスト	600	722.00	433,200
日本モーゲージサービス	400	1,991.00	796,400
C a s a	600	1,535.00	921,000
アルヒ	2,600	1,688.00	4,388,800
プレミアグループ	900	2,008.00	1,807,200
クレディセゾン	11,500	1,721.00	19,791,500
芙蓉総合リース	1,700	6,790.00	11,543,000
みずほリース	2,500	3,240.00	8,100,000
東京センチュリー	3,300	5,500.00	18,150,000
日本証券金融	7,200	504.00	3,628,800
アイフル	25,500	293.00	7,471,500
リコーリース	1,300	4,070.00	5,291,000
イオンフィナンシャルサービス	10,000	1,695.00	16,950,000
アコム	33,000	502.00	16,566,000
ジャックス	1,800	2,554.00	4,597,200
オリエントコーポレーション	44,700	161.00	7,196,700
日立キャピタル	3,900	2,960.00	11,544,000
アプラスフィナンシャル	8,200	85.00	697,000
オリックス	102,800	1,840.00	189,152,000
三菱U F Jリース	41,600	683.00	28,412,800
九州リースサービス	800	596.00	476,800
日本取引所グループ	47,200	1,940.00	91,568,000
イー・ギャランティ	1,800	1,308.00	2,354,400
アサックス	800	713.00	570,400
N E Cキャピタルソリューション	700	2,472.00	1,730,400
いちご	20,900	405.00	8,464,500
日本駐車場開発	18,200	142.00	2,584,400
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,640.00	1,476,000
ヒューリック	35,100	1,340.00	47,034,000
三栄建築設計	700	1,485.00	1,039,500
野村不動産ホールディングス	10,000	2,629.00	26,290,000
三重交通グループホールディングス	3,400	591.00	2,009,400

サムティ	2,300	1,849.00	4,252,700
ディア・ライフ	2,200	578.00	1,271,600
コーセーアールイー	500	616.00	308,000
エー・ディー・ワークス	31,500	29.00	913,500
日本商業開発	1,000	1,695.00	1,695,000
プレサンスコーポレーション	2,700	1,225.00	3,307,500
ユニゾホールディングス	2,500	5,570.00	13,925,000
THEグローバル社	900	449.00	404,100
ハウスコム	200	1,506.00	301,200
日本管理センター	1,100	1,351.00	1,486,100
サンセイランディック	500	860.00	430,000
エストラスト	300	858.00	257,400
フージャースホールディングス	3,300	684.00	2,257,200
オープンハウス	4,800	2,932.00	14,073,600
東急不動産ホールディングス	44,800	771.00	34,540,800
飯田グループホールディングス	13,700	1,850.00	25,345,000
イーランド	300	851.00	255,300
ムゲンエステート	1,200	685.00	822,000
ビーロッド	400	1,699.00	679,600
ファーストブラザーズ	400	1,203.00	481,200
ハウズドゥ	800	1,311.00	1,048,800
シーアールイー	400	1,137.00	454,800
プロパティエージェント	300	1,148.00	344,400
ケイアイスター不動産	500	1,872.00	936,000
アグレ都市デザイン	300	536.00	160,800
グッドコムアセット	400	2,268.00	907,200
ジェイ・エス・ビー	200	5,250.00	1,050,000
テンポイノベーション	400	855.00	342,000
グローバル・リンク・マネジメント	300	605.00	181,500
パーク24	8,800	2,744.00	24,147,200
パラカ	400	2,010.00	804,000
三井不動産	81,100	2,936.50	238,150,150
三菱地所	115,200	2,143.50	246,931,200
平和不動産	3,000	3,275.00	9,825,000
東京建物	18,000	1,767.00	31,806,000
ダイビル	4,300	1,353.00	5,817,900
京阪神ビルディング	2,700	1,448.00	3,909,600
住友不動産	37,000	4,051.00	149,887,000
テオーシー	3,300	875.00	2,887,500
東京楽天地	300	5,930.00	1,779,000
レオパレス21	21,800	313.00	6,823,400
スターツコーポレーション	2,200	2,624.00	5,772,800

フジ住宅	1,900	670.00	1,273,000
空港施設	1,600	541.00	865,600
明和地所	900	618.00	556,200
ゴールドクレスト	1,300	1,884.00	2,449,200
エスリード	600	1,950.00	1,170,000
日神グループホールディングス	2,400	546.00	1,310,400
日本エスコン	3,000	936.00	2,808,000
タカラレーベン	7,600	482.00	3,663,200
A V A N T I A	1,000	995.00	995,000
イオンモール	8,300	1,791.00	14,865,300
毎日コムネット	400	908.00	363,200
ファースト住建	700	1,231.00	861,700
カチタス	2,000	4,475.00	8,950,000
トーセイ	2,300	1,371.00	3,153,300
穴吹興産	400	1,685.00	674,000
サンフロンティア不動産	2,300	1,205.00	2,771,500
エフ・ジェー・ネクスト	1,400	1,210.00	1,694,000
インテリックス	500	711.00	355,500
ランドビジネス	700	765.00	535,500
日本社宅サービス	500	1,071.00	535,500
グランディハウス	1,300	487.00	633,100
日本空港ビルデング	5,200	5,190.00	26,988,000
日本工営	1,100	3,565.00	3,921,500
L I F U L L	5,600	561.00	3,141,600
ジェイエイシーリクルートメント	1,100	1,687.00	1,855,700
日本M&Aセンター	12,000	3,405.00	40,860,000
メンバーズ	500	1,836.00	918,000
中広	200	549.00	109,800
UTグループ	1,900	2,812.00	5,342,800
アイティメディア	500	973.00	486,500
タケエイ	1,600	1,030.00	1,648,000
E・Jホールディングス	300	1,702.00	510,600
ビーネックスグループ	2,000	1,130.00	2,260,000
コシダカホールディングス	3,800	1,510.00	5,738,000
アルトナー	400	807.00	322,800
パソナグループ	1,700	1,386.00	2,356,200
C D S	400	1,460.00	584,000
リンクアンドモチベーション	3,600	524.00	1,886,400
G C A	2,000	917.00	1,834,000
エス・エム・エス	5,000	2,294.00	11,470,000
サニーサイドアップグループ	400	1,064.00	425,600
パーソルホールディングス	15,900	2,018.00	32,086,200

リニカル	800	1,050.00	840,000
クックパッド	5,700	326.00	1,858,200
エスクリ	500	761.00	380,500
アイ・ケイ・ケイ	700	721.00	504,700
学情	600	2,318.00	1,390,800
スタジオアリス	800	1,912.00	1,529,600
シミックホールディングス	900	1,796.00	1,616,400
エプロ	300	1,287.00	386,100
N J S	400	1,798.00	719,200
総合警備保障	6,300	5,770.00	36,351,000
カカクコム	11,900	2,815.00	33,498,500
アイロムグループ	600	1,496.00	897,600
セントケア・ホールディング	1,000	473.00	473,000
サイネックス	300	672.00	201,600
ルネサンス	900	1,718.00	1,546,200
ディップ	2,200	3,465.00	7,623,000
オプトホールディング	900	1,533.00	1,379,700
新日本科学	1,800	610.00	1,098,000
ツクイ	3,800	567.00	2,154,600
キャリアデザインセンター	400	1,230.00	492,000
ベネフィット・ワン	4,300	1,950.00	8,385,000
エムスリー	35,100	3,175.00	111,442,500
ツカダ・グローバルホールディング	900	575.00	517,500
プラス	200	721.00	144,200
アウトソーシング	9,100	1,008.00	9,172,800
ウェルネット	1,500	653.00	979,500
ワールドホールディングス	500	1,637.00	818,500
ディー・エヌ・エー	7,800	1,768.00	13,790,400
博報堂D Yホールディングス	22,100	1,558.00	34,431,800
ぐるなび	2,800	888.00	2,486,400
タカミヤ	1,700	626.00	1,064,200
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	950.00	1,045,000
ファンコミュニケーションズ	4,400	444.00	1,953,600
ライク	500	1,673.00	836,500
ビジネス・ブレークスルー	700	401.00	280,700
エスプール	3,100	805.00	2,495,500
W D Bホールディングス	700	2,685.00	1,879,500
ティア	900	595.00	535,500
C D G	200	1,421.00	284,200
バリューコマース	900	2,529.00	2,276,100
インフォマート	17,500	849.00	14,857,500
J Pホールディングス	5,000	315.00	1,575,000

エコナックホールディングス	3,000	140.00	420,000
E P S ホールディングス	2,400	1,352.00	3,244,800
レグス	400	1,525.00	610,000
プレステージ・インターナショナル	6,000	949.00	5,694,000
アミューズ	900	2,778.00	2,500,200
ドリームインキュベータ	500	1,606.00	803,000
クイック	1,000	1,481.00	1,481,000
T A C	1,000	221.00	221,000
ケネディクス	14,800	550.00	8,140,000
電通グループ	16,400	3,630.00	59,532,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	1,026.00	615,600
ぴあ	500	4,265.00	2,132,500
イオンファンタジー	600	2,289.00	1,373,400
シーティーエス	1,800	707.00	1,272,600
ネクシィーズグループ	600	1,691.00	1,014,600
みらかホールディングス	4,500	2,864.00	12,888,000
アルプス技研	1,400	1,783.00	2,496,200
日本空調サービス	1,700	755.00	1,283,500
オリエンタルランド	16,900	14,015.00	236,853,500
ダスキン	4,100	3,025.00	12,402,500
明光ネットワークジャパン	1,900	944.00	1,793,600
ファルコホールディングス	900	2,076.00	1,868,400
秀英予備校	400	441.00	176,400
田谷	300	620.00	186,000
ラウンドワン	4,500	1,005.00	4,522,500
リゾートトラスト	7,300	1,726.00	12,599,800
ビー・エム・エル	2,000	3,095.00	6,190,000
ワタベウェディング	300	534.00	160,200
りらいあコミュニケーションズ	2,900	1,433.00	4,155,700
リソー教育	7,300	358.00	2,613,400
早稲田アカデミー	500	1,073.00	536,500
ユー・エス・エス	17,800	1,966.00	34,994,800
東京個別指導学院	600	692.00	415,200
サイバーエージェント	9,200	4,390.00	40,388,000
楽天	74,300	847.00	62,932,100
クリーク・アンド・リバー社	800	1,028.00	822,400
テー・オー・ダブリュー	1,300	938.00	1,219,400
山田コンサルティンググループ	800	1,492.00	1,193,600
セントラルスポーツ	600	3,055.00	1,833,000
フルキャストホールディングス	1,600	2,384.00	3,814,400
エン・ジャパン	2,800	4,410.00	12,348,000
リソルホールディングス	200	4,135.00	827,000

テクノプロ・ホールディングス	3,200	7,470.00	23,904,000
アトラ	400	306.00	122,400
インターワークス	300	542.00	162,600
アイ・アールジャパンホールディングス	700	5,800.00	4,060,000
K e e P e r 技研	600	1,242.00	745,200
ファーストロジック	400	599.00	239,600
三機サービス	400	1,053.00	421,200
G u n o s y	1,000	1,221.00	1,221,000
デザインワン・ジャパン	300	299.00	89,700
イー・ガーディアン	800	1,802.00	1,441,600
リブセンス	1,100	287.00	315,700
ジャパンマテリアル	4,900	1,611.00	7,893,900
ベクトル	2,100	1,161.00	2,438,100
ウチヤマホールディングス	800	497.00	397,600
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	871.00	1,219,400
ライクキッズ	400	846.00	338,400
キャリアリンク	600	594.00	356,400
I B J	1,100	1,247.00	1,371,700
アサンテ	600	1,962.00	1,177,200
N・フィールド	1,100	609.00	669,900
バリューHR	300	3,000.00	900,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,100	3,610.00	3,971,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,828.00	1,096,800
E R Iホールディングス	500	768.00	384,000
アビスト	300	2,532.00	759,600
シグマクシス	1,100	1,980.00	2,178,000
ウィルグループ	1,100	1,063.00	1,169,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,300	214.00	492,200
リクルートホールディングス	114,100	4,336.00	494,737,600
エラン	1,000	1,688.00	1,688,000
土木管理総合試験所	700	415.00	290,500
ネットマーケティング	600	987.00	592,200
日本郵政	130,300	996.70	129,870,010
ベルシステム24ホールディングス	2,700	1,526.00	4,120,200
鎌倉新書	1,200	1,569.00	1,882,800
S M N	300	847.00	254,100
一蔵	200	681.00	136,200
L I T A L I C O	500	2,719.00	1,359,500
グローバルキッズCOMPANY	300	787.00	236,100
エアトリ	700	1,588.00	1,111,600
アトラエ	400	3,720.00	1,488,000
ストライク	600	4,665.00	2,799,000

ソラスト	4,400	1,113.00	4,897,200
セラク	500	1,208.00	604,000
インソース	800	3,315.00	2,652,000
ペイカレント・コンサルティング	1,000	7,890.00	7,890,000
Orchestra Holdings	300	1,183.00	354,900
アイモバイル	500	643.00	321,500
キャリアインデックス	700	369.00	258,300
MS - Japan	500	1,369.00	684,500
船場	300	1,018.00	305,400
グレイステクノロジー	700	2,691.00	1,883,700
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,700	2,409.00	4,095,300
フルテック	200	1,249.00	249,800
グリーンズ	400	942.00	376,800
ツナググループ・ホールディングス	200	687.00	137,400
GameWith	400	725.00	290,000
ソウルドアウト	300	2,119.00	635,700
MS&Consulting	200	1,033.00	206,600
ミダック	200	1,359.00	271,800
日総工産	1,100	1,008.00	1,108,800
キュービーネットホールディングス	700	2,298.00	1,608,600
RPAホールディングス	900	1,016.00	914,400
スプリックス	600	1,081.00	648,600
マネジメントソリューションズ	200	3,755.00	751,000
アドバンテッジリスクマネジメント	800	896.00	716,800
リログループ	8,700	2,910.00	25,317,000
東祥	1,000	2,162.00	2,162,000
エイチ・アイ・エス	2,500	2,504.00	6,260,000
ラックランド	300	2,144.00	643,200
共立メンテナンス	2,700	4,375.00	11,812,500
イチネンホールディングス	1,800	1,490.00	2,682,000
建設技術研究所	1,100	2,419.00	2,660,900
スペース	1,000	1,214.00	1,214,000
長大	600	1,216.00	729,600
燦ホールディングス	700	1,403.00	982,100
スバル興業	100	9,380.00	938,000
東京テアトル	700	1,367.00	956,900
タナベ経営	300	1,269.00	380,700
ナガワ	500	6,720.00	3,360,000
よみうりランド	400	4,320.00	1,728,000
東京都競馬	1,000	3,165.00	3,165,000
常磐興産	700	1,669.00	1,168,300
カナモト	2,600	2,668.00	6,936,800



東京ドーム	6,500	1,017.00	6,610,500
西尾レントオール	1,600	2,887.00	4,619,200
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	10,600	31.00	328,600
トランス・コスモス	1,500	2,823.00	4,234,500
乃村工藝社	6,800	1,246.00	8,472,800
藤田観光	700	2,629.00	1,840,300
KNT-CTホールディングス	1,000	1,284.00	1,284,000
日本管財	1,700	1,935.00	3,289,500
トーカイ	1,500	2,700.00	4,050,000
白洋舎	200	2,791.00	558,200
セコム	16,900	9,610.00	162,409,000
セントラル警備保障	800	5,990.00	4,792,000
丹青社	3,000	1,225.00	3,675,000
メイテック	2,000	6,260.00	12,520,000
応用地質	1,700	1,362.00	2,315,400
船井総研ホールディングス	3,300	2,804.00	9,253,200
進学会ホールディングス	600	510.00	306,000
オオバ	1,100	806.00	886,600
いであ	300	2,801.00	840,300
学究社	500	1,400.00	700,000
ベネッセホールディングス	5,300	3,025.00	16,032,500
イオンディライト	1,900	3,845.00	7,305,500
ナック	900	1,140.00	1,026,000
ニチイ学館	2,300	1,494.00	3,436,200
ダイセキ	2,700	2,992.00	8,078,400
ステップ	600	1,606.00	963,600
合計	19,565,800		39,283,692,490

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年 2月28日現在です。

## 【財形株投（一般財形30）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	103,738,697円
負債総額	112,351円
純資産総額（ - ）	103,626,346円
発行済口数	105,597,856口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9813円

## 【財形株投（一般財形50）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	199,216,993円
負債総額	234,056円
純資産総額（ - ）	198,982,937円
発行済口数	191,262,957口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0404円

## 【財形株投（年金・住宅財形30）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	197,587,565円
負債総額	224,593円
純資産総額（ - ）	197,362,972円
発行済口数	200,833,790口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9827円

（参考）

財形公社債マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	308,390,362円
負債総額	21円
純資産総額（ - ）	308,390,341円
発行済口数	240,322,730口
1口当たり純資産額（ / ）	1.283円

## インデックス マザーファンド TOPIX

### 純資産額計算書

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

### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

#### （1）名義書換

該当事項はありません。

#### （2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

#### （3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

##### 受益権の譲渡

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

##### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### （4）受益証券の再発行

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

#### （5）受益権の再分割

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

#### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

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

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

###### (2) 会社の意思決定機関（2020年2月末現在）

###### ・株主総会

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

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

###### ・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

###### ・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

###### (3) 運用の意思決定プロセス（2020年2月末現在）

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

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期事業年度（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

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

#### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

無形固定資産合計	99	107
投資その他の資産		
投資有価証券	14,103	16,755
関係会社株式	25,769	25,769
長期差入保証金	490	447
長期前払費用	0	-
繰延税金資産	1,504	1,913
投資その他の資産合計	41,868	44,886
固定資産合計	42,159	45,268
資産合計	83,959	88,038

(単位：百万円)

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

その他有価証券評価差額金	408	493
繰延ヘッジ損益	346	185
評価・換算差額等合計	754	679
純資産合計	62,511	69,571
負債純資産合計	83,959	88,038

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)



	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
	営業外収益			
受取利息		26		37
受取配当金	1	1,120	1	1,865
有価証券償還益		1		1
デリバティブ収益		-	1	142
時効成立分配金・償還金		1		21
為替差益		79		58
その他		41		48
営業外収益合計		1,272		2,176
営業外費用				
支払利息	1	223	1	286
デリバティブ費用	1	295		-
時効成立後支払分配金・償還金		0		78
長期差入保証金償却額		212		-
その他		34		24
営業外費用合計		767		388
経常利益		10,030		12,328
特別利益				
投資有価証券売却益		199		218
特別利益合計		199		218
特別損失				
投資有価証券売却損		133		176
固定資産処分損		7		0
役員退職一時金		117		180
損害賠償損失		81		-
特別損失合計		340		357
税引前当期純利益		9,890		12,189
法人税、住民税及び事業税		3,217		3,741
法人税等調整額		307		375
法人税等合計		2,910		3,366
当期純利益		6,979		8,823

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926
当期変動額							
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036
当期純利益				6,979	6,979		6,979
自己株式の取得						113	113

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	5,943	5,943	113	5,830
当期末残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756

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

第60期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	408	346	754	62,511
当期変動額				
剰余金の配当				1,640
当期純利益				8,823
自己株式の取得				47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	85	160	75	75

当期変動額合計	85	160	75	7,060
当期末残高	493	185	679	69,571

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	4年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	4年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>				

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

## (未適用の会計基準等)

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

## (1) 概要

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

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

## (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

## (表示方法の変更)

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

## (貸借対照表関係)

第59期 (2018年3月31日)		第60期 (2019年3月31日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額	1,260百万円	1,281百万円
	建物	612百万円	655百万円
	器具備品		

<p>2 信託資産 流動資産のその他のうち3,030百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 3,189百万円 未収収益 592百万円 その他 345百万円 (流動負債) 預り金 419百万円 未払手数料 376百万円 未払費用 677百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務553百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務103百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 1,347百万円 未収収益 127百万円 (流動負債) 未払手数料 350百万円 未払費用 767百万円 その他 162百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務468百万円に対して保証を行っております。</p>
---	---

## ( 損益計算書関係 )

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

## ( 株主資本等変動計算書関係 )

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権等に関する事項

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

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	当事業年度末残高(百万円)
2009年度ストックオプション(1)	普通株式	1,689,600	-	194,700	1,494,900	-
2009年度ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
2011年度ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	204,600	2,686,200	-
2016年度ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	786,000	3,618,000	-
2016年度ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	532,000	3,877,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	1,783,300	11,785,000	-

- (注) 1 2016年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。  
2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。  
3 2009年度ストックオプション(1)1,494,900株、2009年度ストックオプション(2)108,900株及び2011年度ストックオプション(1)2,686,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)及び2016年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年5月25日取締役会	普通株式	1,036	5.29	2017年3月31日	2017年6月22日

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

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

##### 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

##### 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,301,700	64,000	-	1,365,700

##### 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
2009年度ストックオプション(1)	普通株式	1,494,900	-	323,400	1,171,500	-
2009年度ストックオプション(2)	普通株式	108,900	-	33,000	75,900	-
2011年度ストックオプション(1)	普通株式	2,686,200	-	630,300	2,055,900	-
2016年度ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	-	3,618,000	-

2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	-	66,000	3,811,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,422,000	66,000	4,356,000	-
合計		11,785,000	4,422,000	1,118,700	15,088,300	-

- (注) 1 2017年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。  
 2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。  
 3 2009年度ストックオプション(1)1,171,500株、2009年度ストックオプション(2)75,900株、2011年度ストックオプション(1)2,055,900株及び2016年度ストックオプション(1)1,206,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)2,412,000株、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

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

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

##### (リース取引関係)

第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	866百万円	1年内	853百万円
1年超	923百万円	1年超	6,704百万円
合計	1,790百万円	合計	7,558百万円

##### (金融商品関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

##### 1 金融商品の状況に関する事項

##### (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

#### 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

#### 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

2018年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりませぬ。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,024	14,024	-
(2) 未収委託者報酬	15,873	15,873	-
(3) 未収収益	3,174	3,174	-
(4) 関係会社短期貸付金	1,128	1,128	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,106	14,106	-



(6) 未払金	(5,874)	(5,874)	-
(7) 未払費用	(4,634)	(4,634)	-
(8) デリバティブ取引( 2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(14)	(14)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	336	336	-
デリバティブ取引計	321	321	-

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額

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

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち3百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、35百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち0百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、127百万円は流動負債のその他に含まれております。

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	20,680	-	-	-
未収委託者報酬	16,867	-	-	-
未収収益	618	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	163	6,929	1,363
合計	38,167	163	6,929	1,363

(有価証券関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	投資信託	9,340	8,440	900
	小計	9,340	8,440	900

貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	7,400	7,589	188
	小計	7,400	7,589	188
合計		16,740	16,029	711

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

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

### 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	4,189	218	176
合計	4,189	218	176

(デリバティブ取引関係)

第59期(2018年3月31日)

#### 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

#### 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

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

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 第60期(2019年3月31日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

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

## 2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## (2) 通貨関連

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

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## 通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		2,251	-	42
	豪ドル		63	-	0
	シンガポール ドル		975	-	18
	香港ドル		518	-	8
	人民元		2,149	-	58
	ユーロ		81	-	0
合計			6,040	-	127

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

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

関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)		関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,008	(1) 関連会社に対する投資の金額	3,010
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	10,409	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	10,668
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,827	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,704

## (退職給付関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,190
勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	66
退職給付の支払額	76
退職給付債務の期末残高	1,313

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

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、222百万円でありました。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

退職給付債務の期首残高	1,313
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	59
退職給付債務の期末残高	1,411

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

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

退職給付引当金	1,405
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、230百万円でありました。

## (ストックオプション等関係)

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左



対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定条件	2013年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 4,409,000株
付与日	2017年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況  
ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,689,600	174,900
付与	0	0
失効	194,700	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,494,900	108,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,890,800	4,404,000
付与	0	0
失効	204,600	786,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,686,200	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2017年4月27日
権利確定前(株)	
期首	-
付与	4,409,000
失効	532,000
権利確定	0
権利未確定残	3,877,000
権利確定後(株)	
期首	-
権利確定	-
権利行使	-
失効	-
権利未行使残	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

### 単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注) 3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

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

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

#### 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

##### (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012年1月22日（以下「権利行使可能 初日」といいます。）、「当該権利行使 可能初日から1年経過した日の翌日、 及び当該権利行使可能初日から2年経 過した日の翌日まで原則として従業員 等の地位にあることを要し、それぞれ 保有する新株予約権の2分の1、4分 の1、4分の1ずつ権利確定する。た だし、本新株予約権の行使時におい て、当社が株式公開していることを要 する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	同左

権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左
--------	------------------------------	----

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定条件	2013年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) スtockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況  
ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日

権利確定前(株)		
期首	1,494,900	108,900
付与	0	0
失効	323,400	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,171,500	75,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## 単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注)3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 2,128百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

## (税効果会計関係)

第59期 (2018年3月31日)	第60期 (2019年3月31日)
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主原因別の内訳 (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原因別の内訳 (単位：百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 700	賞与引当金 820
投資有価証券評価損 96	投資有価証券評価損 96
関係会社株式評価損 1,430	関係会社株式評価損 1,430
退職給付引当金 402	退職給付引当金 430
固定資産減価償却費 111	固定資産減価償却費 103
その他 526	その他 761
繰延税金資産小計 3,268	繰延税金資産小計 3,643
評価性引当金 1,430	評価性引当金 1,430
繰延税金資産合計 1,838	繰延税金資産合計 2,212
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 180	その他有価証券評価差額金 217
繰延ヘッジ利益 152	繰延ヘッジ利益 81
繰延税金負債合計 333	繰延税金負債合計 299
繰延税金資産の純額 1,504	繰延税金資産の純額 1,913

<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p>	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">30.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">0.8%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に参入されない 項目</td> <td style="text-align: right;">4.4%</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right;">27.6%</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	30.6%	交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.8%	受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	4.4%	その他	0.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%
法定実効税率 (調整)	30.6%										
交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.8%										
受取配当金等永久に益金に参入されない 項目	4.4%										
その他	0.6%										
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%										

## ( 関連当事者情報 )

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額159百万円(SGD2,000千)の内訳は、貸付159百万円(SGD2,000千)であります。

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2017年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

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

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

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

### 1 関連当事者との取引

#### (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

##### (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

##### (イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付の返済 (シンガポールドル貨建) (注1)	554 (SGD 6,800 千) (注2)	-	-
							貸付金利息 (シンガポールドル貨建) (注1)	8 (SGD 104 千)	-	-
							資金の貸付 (米国ドル貨建) (注3)	1,807 (USD 16,500 千) (注4)	関係会社 短期貸付金	1,830 (USD 16,500 千)



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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)  
三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2018年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場場で円貨に換算したものであります。

資産合計 26,768百万円  
負債合計 5,586百万円

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

## (セグメント情報等)

### セグメント情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

### 関連情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

#### 1 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2 地域ごとの情報

##### (1) 営業収益

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

##### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

#### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

#### 1 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2 地域ごとの情報

##### (1) 営業収益

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

##### (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

#### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第59期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当事項はありません。

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	319円40銭	355円59銭
1株当たり当期純利益金額	35円64銭	45円08銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第59期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	6,979	8,823
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	6,979	8,823
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,794	195,677
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2009年度ストックオプション(1) 1,494,900株、2009年度ストックオプション(2) 108,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,686,200株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,877,000株	2009年度ストックオプション(1) 1,171,500株、2009年度ストックオプション(2) 75,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,055,900株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,811,000株、2017年度ストックオプション(1) 4,356,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	62,511	69,571
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	195,711	195,647

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表等

## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

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

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

## ( 2 ) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

## ( 3 ) 中間株主資本等変動計算書

第61期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891
当中間期変動額							
剰余金の配当				3,212	3,212		3,212
中間純利益				5,940	5,940		5,940
自己株式の取得						71	71
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計	-	-	-	2,727	2,727	71	2,655
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	49,870	49,870	905	71,547

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	493	185	679	69,571
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,212
中間純利益				5,940
自己株式の取得				71
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	136	212	75	75
当中間期変動額合計	136	212	75	2,731
当中間期末残高	356	398	755	72,302

## 注記事項

（重要な会計方針）

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

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

(中間貸借対照表関係)

第61期中間会計期間 (2019年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,977百万円
2 信託資産	流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4 保証債務	当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務396百万円に対して保証を行っております。

## (中間損益計算書関係)

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

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

## 3 新株予約権等に関する事項



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

(注) 1 2009年度ストックオプション(1)、2009年度ストックオプション(2)、2011年度ストックオプション(1)、2016年度ストックオプション(1)、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

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

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

##### (リース取引関係)

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

##### (金融商品関係)

##### 第61期中間会計期間(2019年9月30日)

##### 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

( 1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

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

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

(有価証券関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額

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

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

## (デリバティブ取引関係)

第61期中間会計期間(2019年9月30日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 株式関連

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

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

## 2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## (2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,760	-	17	17
合計		1,760	-	17	17

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

## 2 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## 通貨関連

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		2,261	-	10
	豪ドル		71	-	2
	シンガポールドル		913	-	11

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

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

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

## (ストックオプション等関係)

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

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

## [関連情報]

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無い場合、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無い場合、記載しておりません。

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第61期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

## ( 1株当たり情報 )

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

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

## 2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益(百万円)	5,940
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,940
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,640
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1)1,613,700株、 2016年度ストックオプション(1)2,085,000株、 2016年度ストックオプション(2)2,793,000株、 2017年度ストックオプション(1)3,338,000株

## 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期中間会計期間 (2019年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	72,302
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	72,302
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	195,558

## ( 重要な後発事象 )

該当事項はありません。

## 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

## 5【その他】

### ( 1 ) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### ( 2 ) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### ( 1 ) 受託会社

名 称	資本金の額 ( 2019年9月末現在 )	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### < 再信託受託会社の概要 >

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

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

資本金の額 : 51,000百万円( 2019年9月末現在 )

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

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

#### ( 2 ) 販売会社

名 称	資本金の額 ( 2019年9月末現在 )	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

### (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

### (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。

### (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

### (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

### (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

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

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

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



## 独立監査人の監査報告書

2019年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2020年3月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 佐々木 貴司  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（一般財形30）の2019年2月5日から2020年2月3日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（一般財形30）の2020年2月3日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2020年3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

### PWCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（一般財形50）の2019年2月5日から2020年2月3日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（一般財形50）の2020年2月3日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2020年3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 佐々木 貴司  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（年金・住宅財形30）の2019年2月5日から2020年2月3日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（年金・住宅財形30）の2020年2月3日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞 廣 篤 典  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。