【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10月8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】	上場インデックスファンドＴＯＰＩＸ　Ｅｘ－Ｆｉｎａｎｃｉａｌｓ
【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】	30兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町２番１号

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financials（以下「ファンド」といいます。）
・愛称として「上場TOPIX（除く金融）」という名称を用いることがあります。

（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】

30兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または「（8）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（5）【申込手数料】

販売会社は、取得申込者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。
※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（6）【申込単位】

1,000口以上で販売会社が定める単位
※詳しくは、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10月9日から2021年4月8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/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【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。

（１２）【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】

①　ファンドの目的

TOPIX Ex-Financialsに採用されている銘柄の株式に投資を行ない、TOPIX Ex-Financialsの計算方法に従ってポートフォリオを構成し、原則としてそれを維持することにより、基準価額が同指数の動きと高位に連動することをめざします。

※TOPIX Ex-Financialsは、TOPIX(東証株価指数)の算出対象銘柄の中から、「保険業」、「銀行業」、「証券、商品先物取引業」および「その他金融業」の業種に属する銘柄を除いた銘柄を対象に、浮動株調整後の時価総額を指数として算出します。
TOPIX Ex-Financialsは、基準時を平成５年（1993年）７月５日（終値）に置き、その日の時価総額を1,000ポイントとして算出します。

業種の分類には、「証券コード協議会が定める33業種」を用います。

$$\text{TOPIX Ex-Financials} = \frac{\text{算出時の時価総額（円）}}{\text{基準時の時価総額（円）}} \times 1{,}000$$

「TOPIX Ex-Financials」の著作権などについて

- TOPIX Ex-Financials 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 TOPIX Ex-Financials に関するすべての権利・ノウハウおよび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。
- 株式会社東京証券取引所は、TOPIX Ex-Financials の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX Ex-Financials の指数値の算出もしくは公表の停止または TOPIX の商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- 株式会社東京証券取引所は、TOPIX Ex-Financials の指数値および TOPIX の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の TOPIX Ex-Financials の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- 株式会社東京証券取引所は、TOPIX Ex-Financials の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株式会社東京証券取引所は、TOPIX Ex-Financials の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- 株式会社東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- 株式会社東京証券取引所は、日興アセットマネジメント株式会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIX Ex-Financialsの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、株式会社東京証券取引所は当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

②　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）	独立区分	補足分類
単位型投信	国　内	株　式	ＭＭＦ	インデックス型
追加型投信	海　外	債　券	ＭＲＦ	特殊型
	内　外	不動産投信	ＥＴＦ	
		その他資産（　　）		
		資産複合		

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

◇追加型投信

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

◇国内

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

◇株式

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

◇ＥＴＦ

投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第１号および第２号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第９条の４の２に規定する上場証券投資信託をいいます。

◇インデックス型

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

２）属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

◇株式　一般

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

◇年２回

目論見書または投資信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。

◇日本

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。
上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）をご参照ください。

③　ファンドの特色

1. TOPIX Ex-Financials の動きに連動する投資成果をめざします。

・信託財産の１口あたりの純資産額の変動率を「TOPIX Ex-Financials」の変動率に一致させることをめざして、原則として「TOPIX Ex-Financials」に採用されている株式に投資を行ないます。
※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行なえない場合があります。

2. 受益権を東京証券取引所に上場しており、取引時間中であればいつでも売買が可能です。

・売買単位は１口単位です。（有価証券届出書提出日現在）
・売買手数料は、取扱会社が定めるものによります。
・取引方法は原則として株式と同様です。
※詳しくは、取扱会社へお問い合わせください。

3. 現金をもって受益権の購入申込みを行ないます。

・購入申込受付日の基準価額による購入となります。

4. 解約請求による途中換金をすることができます。

・換金申込受付日の基準価額による換金となります。

5. 受益権をもって株式と交換することはできません。

主な投資制限

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

分配方針

・信託財産から生ずる配当等収益などから諸経費などを控除後、全額分配することを原則とします。
※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。

④ 信託金限度額

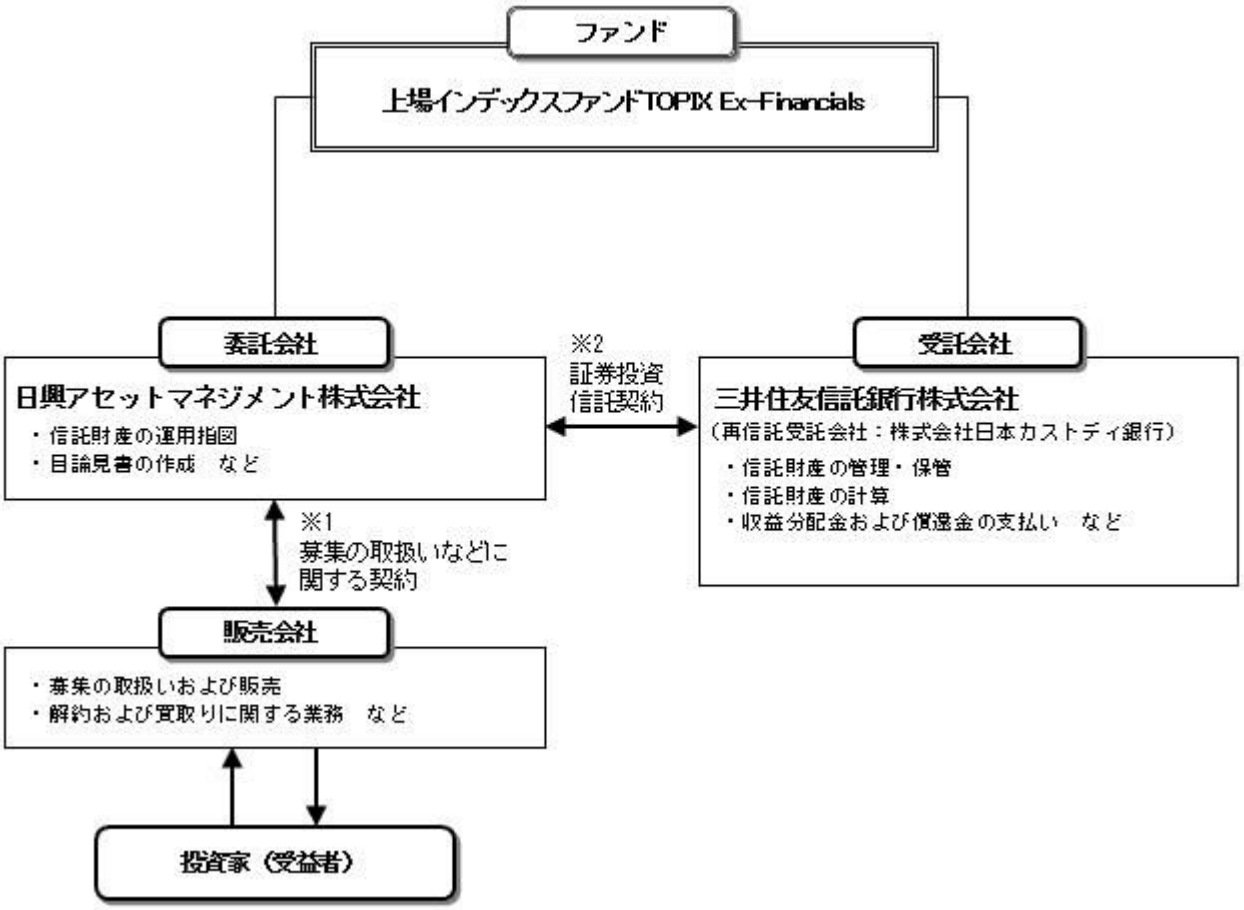
・5兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（２）【ファンドの沿革】

2013年 9月24日
・ファンドの信託契約締結、運用開始
2013年 9月26日
・ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場

（３）【ファンドの仕組み】

① 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。販売会社が行なう募集の取扱い、解約および買取りに関する業務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。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。

② 委託会社の概況（2020年7月末現在）

1）資本金

17,363百万円

2）沿革

1959年：日興證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】

・ファンドは、信託財産の１口あたりの純資産額の変動率をTOPIX Ex-Financialsの変動率に一致させることをめざして、TOPIX Ex-Financialsに採用されている株式に投資を行ないます。

・次に掲げる場合には、信託財産の構成を調整するための指図を行なうことがあります。

①TOPIX Ex-Financialsの計算方法が変更された場合

②TOPIX Ex-Financialsに採用されている銘柄の変更または資本異動などにより、TOPIX Ex-Financials

における個別銘柄の時価総額の修正が行なわれた場合
③追加信託ならびに一部解約の指図を行なう場合
④その他連動性を維持するために委託会社が必要と認めた場合
・TOPIX Ex-Financialsへの連動率を向上させるため、資金動向に応じて約款に定める有価証券指数等先物取引等を行なう場合があります。
・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

TOPIX Ex-Financialsに採用されている銘柄の株式を主要投資対象とします。
① 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24条、第25条および第26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
② 主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）株券または新株引受権証書
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）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
11）投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12）に定めるもの以外のもの
12）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
13）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。）
14）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。）
15）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。）
16）外国法人が発行する譲渡性預金証書
17）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。）
18）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
19）外国の者に対する権利で18）の有価証券の性質を有するもの
③ 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。）

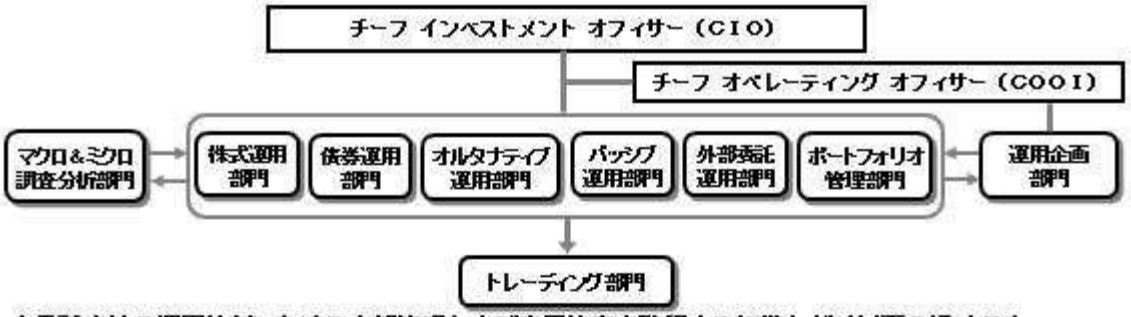
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６）外国の者に対する権利で５）の権利の性質を有するもの

④　次の取引ができます。

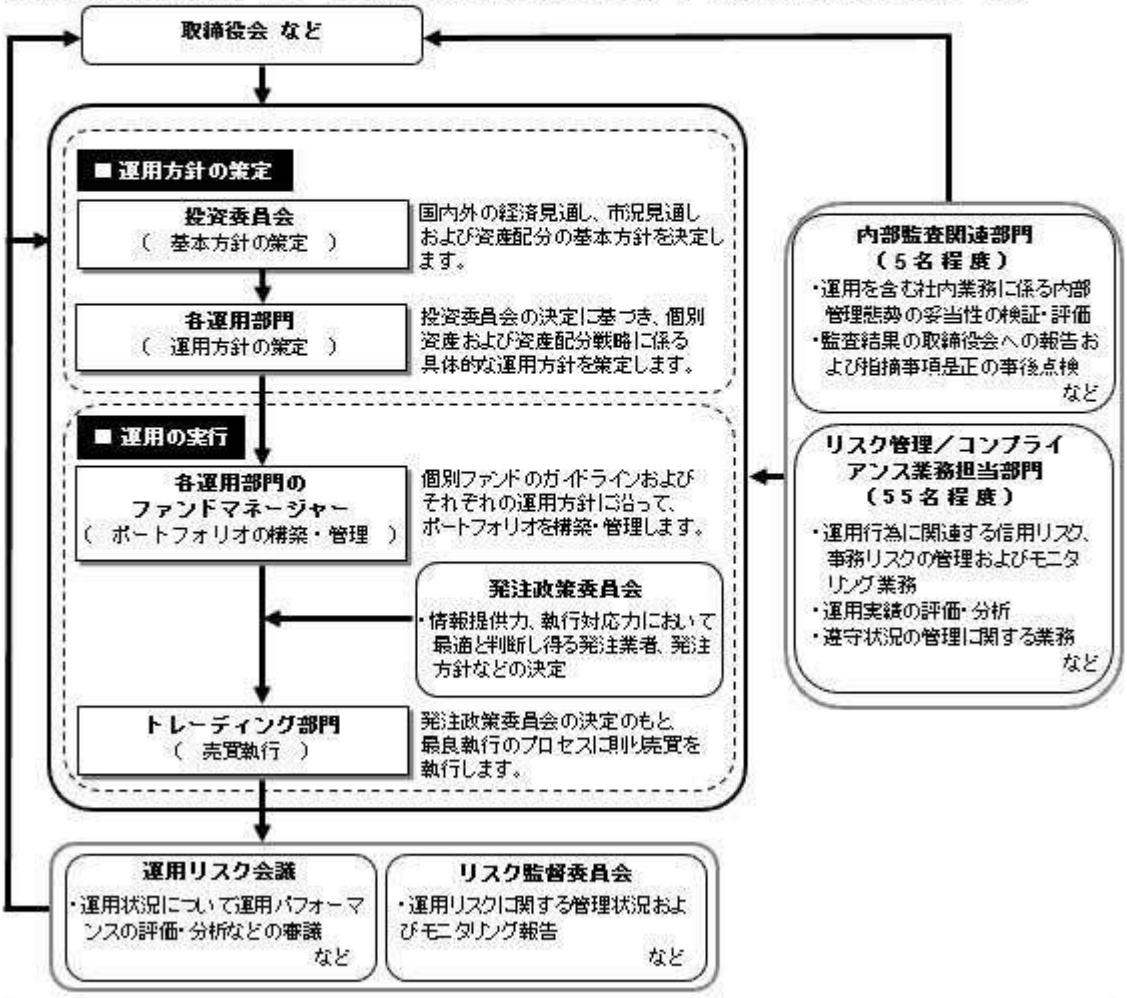
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）金利先渡取引
５）為替先渡取引
６）有価証券の貸付
７）公社債の空売
８）公社債の借入
９）外国為替予約取引
10）資金の借入

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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

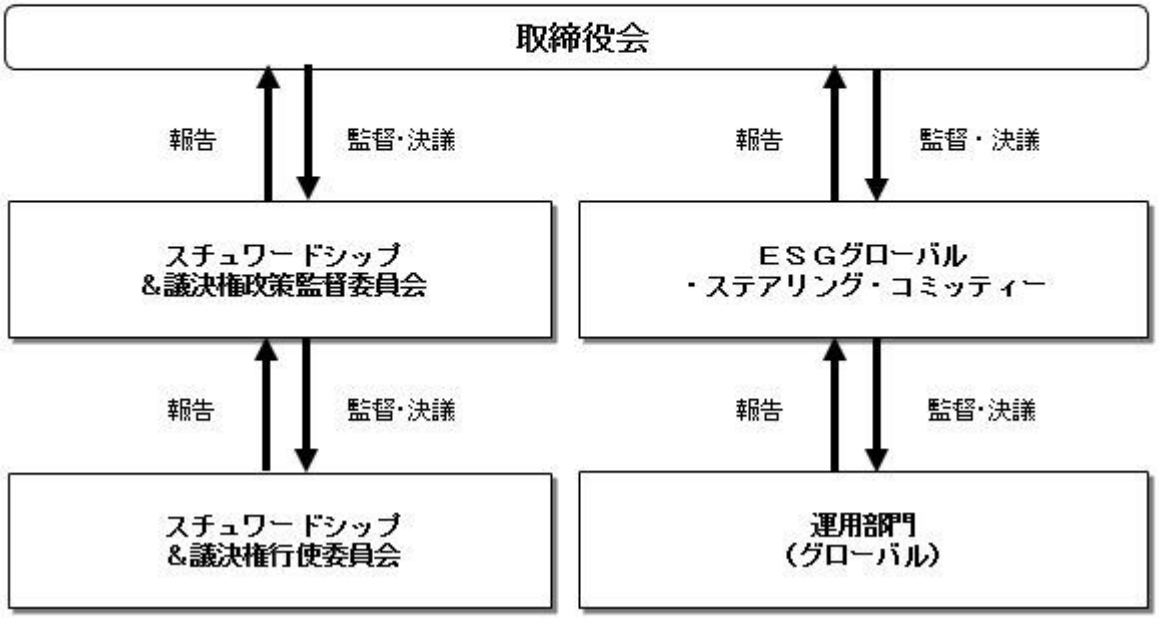


委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっております。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なっており、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。

◆投資家としてのESG／フィデューシャリー・デューティー

ＥＳＧ（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行なうこととしています。
（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）



※上記体制は2020年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

① 収益分配方針

１）信託財産から生ずる配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。）と前期から繰り越した分配準備積立金は、毎計算期末において諸経費、約款に定める報酬および当該報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、前期から繰り越した負数の分配準備積立金があるときはその全額を補てんした後、その残額を受益者に分配します。ただし、収益分配金額の調整のためその一部または全部を信託財産内に留保したときは分配準備積立金として積み立て、次期以降の分配に充てることができます。なお、諸経費、約款に定める報酬および当該報酬に係る消費税等に相当する金額ならびに負数の分配準備積立金を控除しきれないときは、その差額を負数の分配準備積立金として次期に繰り越します。

２）毎計算期末に信託財産から生じたイ）に掲げる利益の合計額は、ロ）に掲げる損失を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を補てんした後、次期に繰り越します。

イ）有価証券売買益（評価益を含む）、先物取引等取引益（評価益を含む）、追加信託差益金、解約差益金

ロ）有価証券売買損（評価損を含む）、先物取引等取引損（評価損を含む）、追加信託差損金、解約差損金

② 収益分配金の支払い

原則として受託会社が、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、受益者があらかじめ指定した預金口座などに振り込みます。なお、受益者が取扱会社と別途収益分配金の取扱いに係る契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとします。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限

１）株式への投資割合には、制限を設けません。

２）投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みま

す。以下同じ。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。

3）投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の５％以下とします。

4）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

6）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、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行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

7）わが国の金融商品取引所における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行なうことの指図をすることができます。

8）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行なうことの指図をすることができます。

9）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、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。

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

11）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、公社債および上場投資信託証券を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ハ）上場投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付上場投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する上場投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

12）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

13）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

14）信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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、解約に伴なう支払資金の手当て（解約に伴な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、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）解約に伴な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）借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内

ハ）解約に伴な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。

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。

② 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ないます。お申込みの際は、当ファンドのリスクを充分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

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

・当ファンドは、主に株式を投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。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。

① 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。

② 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。

③ 信用リスク

・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

④　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。

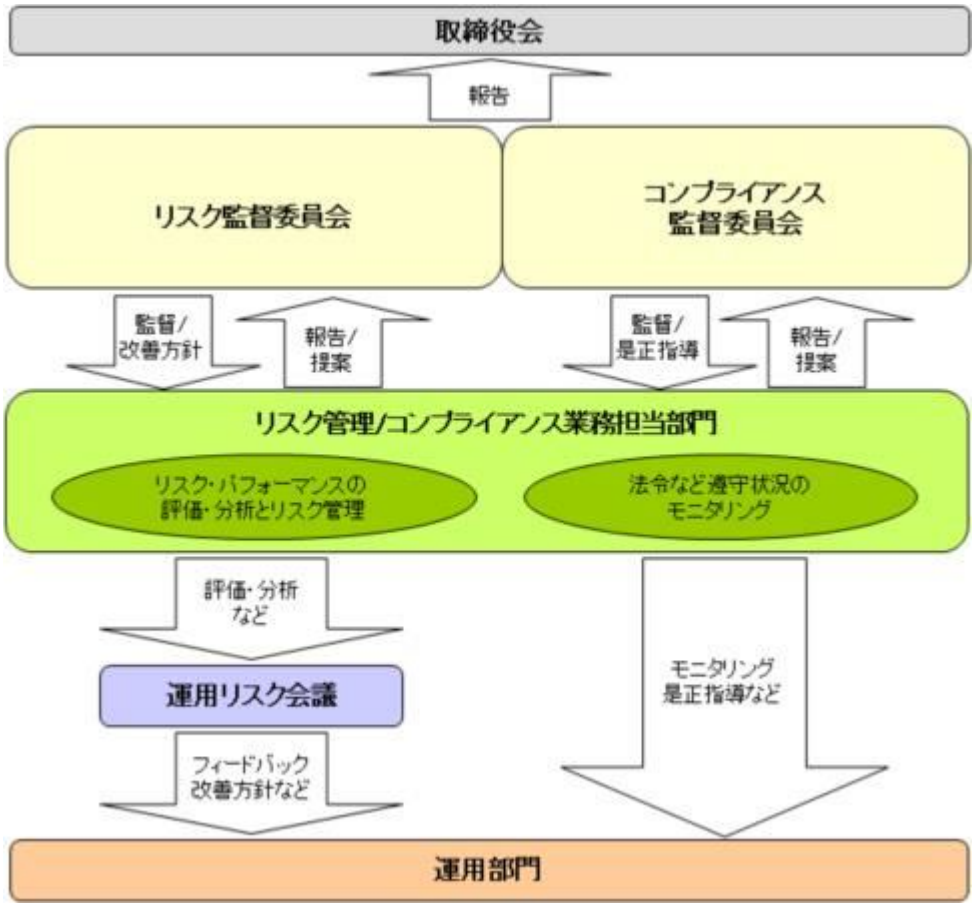
⑤　有価証券の貸付などにおけるリスク
有価証券の貸付行為などにおいては、取引相手先リスク（取引の相手方の倒産などにより貸付契約が不履行になったり、契約が解除されたりするリスク）を伴ない、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。貸付契約が不履行や契約解除の事態を受けて、貸付契約に基づく担保金を用いて清算手続きを行なう場合においても、買戻しを行なう際に、市場の時価変動などにより調達コストが担保金を上回る可能性もあり、不足金額をファンドが負担することにより、その結果ファンドに損害が発生する恐れがあります。

＜TOPIX Ex-Financialsと基準価額の主なカイ離要因＞
当ファンドは、基準価額の変動率をTOPIX Ex-Financialsの変動率に一致させることをめざしますが、次のような要因があるため、同指数と一致した推移をすることをお約束できるものではありません。
・TOPIX Ex-Financialsの採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。
・組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。
・先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きとTOPIX Ex-Financialsの採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

◇　金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額のカイ離
当ファンドは東京証券取引所に上場され公に取引されますが、市場価格は、主に当ファンドの需要、当ファンドの運用成果および投資者が代替的な投資と比較して当ファンドが全般的にどの程度魅力的であるか、などの評価に左右されます。したがって、当ファンドの市場価格が、基準価額を下回って取引されるかまたは上回って取引されるかは予測することはできません。

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

（２）リスク管理体制



■全社的リスク管理

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。

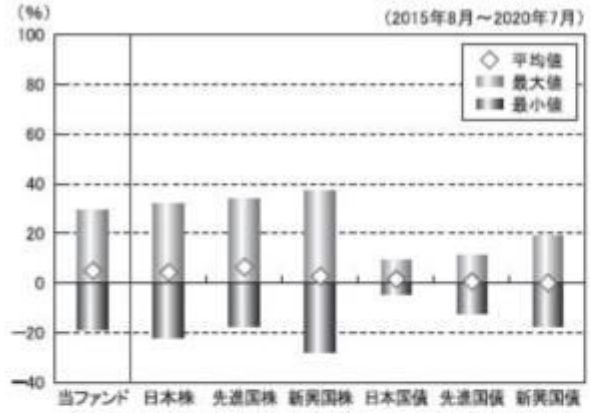
■法令など遵守状況のモニタリング

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7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

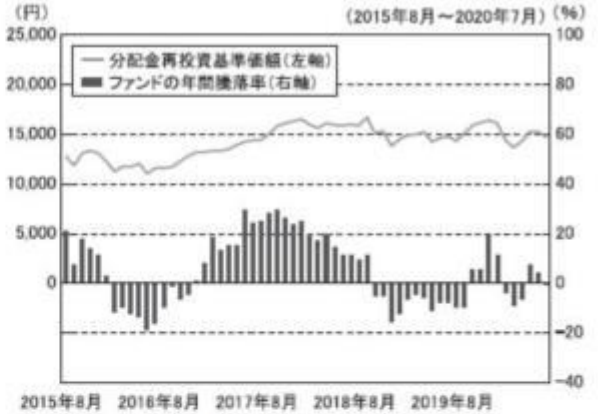


（当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率（%））

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	5.1%	4.4%	6.5%	2.8%	1.7%	0.7%	0.2%
最大値	29.3%	32.2%	34.1%	37.2%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-18.5%	-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8月から2020年7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10口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2015年8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。

<各資産クラスの指数>

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）
当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc．に帰属します。

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

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・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）
当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

販売会社は、取得申込者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。
※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
※申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

（2）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
販売会社は、受益者が解約請求を行なうときおよび受益権の買取りを行なうときは、当該受益者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。
※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
※換金手数料は、換金時の事務手続きなどに係る対価です。

② 信託財産留保額
ありません。

（3）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.0968%（税抜0.088%）以内の率を乗じて得た額とします。

② 信託報酬の配分
当ファンドの信託報酬が税抜0.088%（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	受託会社
0.088%	0.060%	0.028%

委託会社	委託した資金の運用の対価
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。

③ 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】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）なお、①から⑦までに該当する業務を委託する場合は、その委託費用を含みます。また、実際に支払う金

額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乗じて得た額をかかる諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.1%を上限として、これを変更することができます。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。

① ファンドの計理業務（設定解約処理、約定処理、基準価額算出、決算処理等）およびこれに付随する業務（法定帳簿管理、法定報告等）に係る費用。
② 振替受益権に係る費用ならびにやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。
③ 有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。
④ 目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
⑤ 信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
⑥ 運用報告書および決算短信など開示資料の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
⑦ ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。
⑧ 格付の取得に要する費用。
⑨ ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。
⑩ 受益権の上場に係る費用。
⑪ 「TOPIX Ex-Financials」その他これに類する標章の使用料。

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

① 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
② 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、解約に伴な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。
③ 有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料に0.55（税抜0.5）以内（有価証券届出書提出日現在、0.55（税抜0.5））を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は４：１とし、信託報酬と同時期に支払います。

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。
＊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、上場証券投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

① 個人受益者の場合

１）受益権の売却時の課税

売却時の差益（譲渡益）については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税

率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

２）収益分配金の受取り時の課税

収益分配金は配当所得として、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。

３）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

② 法人受益者の場合

１）受益権の売却時の課税

受益権の売却価額と取得価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されます。

２）収益分配金の受取り時の課税

収益分配金は配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれ、他の法人所得と合算して課税されます。

３）解約金および償還金に対する課税

受益権の解約価額および償還価額と取得価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されます。

４）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

※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10月8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】

【上場インデックスファンドＴＯＰＩＸ　Ｅｘ－Ｆｉｎａｎｃｉａｌｓ】

以下の運用状況は2020年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	17,749,871,290	99.80
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	35,141,016	0.20
合計（純資産総額）		17,785,012,306	100.00

（２）【投資資産】

①【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	103,600	6,722.28	696,428,400	6,217.00	644,081,200	3.62
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	72,300	6,095.90	440,733,900	6,595.00	476,818,500	2.68
日本	株式	ソニー	電気機器	58,200	7,499.75	436,485,700	8,076.00	470,023,200	2.64
日本	株式	キーエンス	電気機器	8,400	44,754.40	375,937,000	44,220.00	371,448,000	2.09
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	121,800	2,494.25	303,800,100	2,443.50	297,618,300	1.67
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	77,300	3,754.51	290,224,300	3,756.00	290,338,800	1.63
日本	株式	任天堂	その他製品	5,700	49,635.61	282,923,000	46,440.00	264,708,000	1.49
日本	株式	第一三共	医薬品	26,600	8,469.00	225,275,500	9,258.00	246,262,800	1.38
日本	株式	ダイキン工業	機械	11,800	18,391.56	217,020,500	18,450.00	217,710,000	1.22
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	66,400	3,264.47	216,761,000	3,259.00	216,397,600	1.22
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	63,600	3,627.05	230,680,400	3,268.00	207,844,800	1.17
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	18,400	10,778.80	198,330,000	10,420.00	191,728,000	1.08
日本	株式	信越化学工業	化学	15,600	12,417.72	193,716,500	12,275.00	191,490,000	1.08
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	65,200	2,937.05	191,495,800	2,907.50	189,569,000	1.07
日本	株式	日本電産	電気機器	22,400	7,079.25	158,575,300	8,375.00	187,600,000	1.05
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	73,100	2,723.61	199,096,000	2,524.00	184,504,400	1.04
日本	株式	村田製作所	電気機器	27,300	6,562.26	179,149,700	6,609.00	180,425,700	1.01
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	5,900	29,817.20	175,921,500	28,800.00	169,920,000	0.96
日本	株式	花王	化学	22,200	8,518.10	189,102,000	7,636.00	169,519,200	0.95
日本	株式	ＳＭＣ	機械	2,900	56,474.82	163,777,000	55,070.00	159,703,000	0.90
日本	株式	ファナック	電気機器	8,700	19,405.51	168,828,000	17,705.00	154,033,500	0.87
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	64,000	2,309.12	147,783,750	2,300.00	147,200,000	0.83
日本	株式	日立製作所	電気機器	44,600	3,388.80	151,140,900	3,128.00	139,508,800	0.78
日本	株式	中外製薬	医薬品	29,100	5,525.83	160,801,800	4,736.00	137,817,600	0.77
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	80,500	1,728.66	139,157,600	1,650.00	132,825,000	0.75
日本	株式	三菱電機	電気機器	92,900	1,401.81	130,228,550	1,370.50	127,319,450	0.72
日本	株式	三菱商事	卸売業	60,000	2,273.23	136,394,100	2,119.50	127,170,000	0.72
日本	株式	富士通	電気機器	9,000	13,032.66	117,294,000	14,120.00	127,080,000	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	79,200	1,572.09	124,509,850	1,574.00	124,660,800	0.70
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	9,400	14,104.78	132,585,000	12,670.00	119,098,000	0.67

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	0.10
		鉱業	0.19
		建設業	2.72
		食料品	4.25
		繊維製品	0.52
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.93
		医薬品	7.49
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.60
		ガラス・土石製品	0.82
		鉄鋼	0.59
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.59
		機械	5.87
		電気機器	17.26
		輸送用機器	7.70
		精密機器	2.90
		その他製品	2.76
		電気・ガス業	1.61
		陸運業	3.87
		海運業	0.14
		空運業	0.35
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	11.84
		卸売業	4.94
		小売業	5.56
		不動産業	2.06
		サービス業	5.48
合　　計			99.80

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【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)		東京証券取引所取引価格（円）
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き	
第1計算期間末　(2014年 1月 8日)	1,507	1,514	1,076.6	1,081.6	1,080
第2計算期間末　(2014年 7月 8日)	48,298	48,388	1,075.3	1,077.3	1,078
第3計算期間末　(2015年 1月 8日)	3,671	3,735	1,162.0	1,182.0	1,194
第4計算期間末　(2015年 7月 8日)	3,537	3,567	1,315.2	1,326.2	1,315
第5計算期間末　(2016年 1月 8日)	2,890	2,926	1,210.1	1,225.1	1,207
第6計算期間末　(2016年 7月 8日)	4,933	4,989	1,049.3	1,061.3	1,100
第7計算期間末　(2017年 1月 8日)	5,856	5,901	1,306.9	1,316.9	1,250
第8計算期間末　(2017年 7月 8日)	5,151	5,212	1,358.7	1,374.7	1,300
第9計算期間末　(2018年 1月 8日)	5,983	6,028	1,602.4	1,614.4	1,520
第10計算期間末　(2018年 7月 8日)	20,560	20,687	1,463.0	1,472.0	1,468
第11計算期間末　(2019年 1月 8日)	23,926	24,126	1,313.4	1,324.4	1,319
第12計算期間末　(2019年 7月 8日)	26,476	26,783	1,377.7	1,393.7	1,380
第13計算期間末　(2020年 1月 8日)	31,283	31,577	1,488.8	1,502.8	1,494
第14計算期間末　(2020年 7月 8日)	9,587	9,712	1,381.5	1,399.5	1,430
2019年 7月末日	27,668	—	1,368.6	—	1,368
8月末日	26,794	—	1,324.4	—	1,321
9月末日	28,302	—	1,399.6	—	1,431
10月末日	29,902	—	1,471.0	—	1,469
11月末日	31,227	—	1,498.1	—	—
12月末日	31,925	—	1,519.4	—	1,518
2020年 1月末日	15,767	—	1,475.1	—	1,481
2月末日	13,592	—	1,322.1	—	1,353
3月末日	11,012	—	1,254.7	—	1,267
4月末日	10,695	—	1,309.1	—	1,348
5月末日	11,511	—	1,400.7	—	—
6月末日	9,502	—	1,400.9	—	—
7月末日	17,785	—	1,330.1	—	1,387

(注)計算期間末が東京証券取引所の休業日にあたる場合、東京証券取引所取引価格は直前営業日の終値を表示しています。

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2013年 9月24日～2014年 1月 8日	5.0000
第2期	2014年 1月 9日～2014年 7月 8日	2.0000
第3期	2014年 7月 9日～2015年 1月 8日	20.0000
第4期	2015年 1月 9日～2015年 7月 8日	11.0000
第5期	2015年 7月 9日～2016年 1月 8日	15.0000
第6期	2016年 1月 9日～2016年 7月 8日	12.0000
第7期	2016年 7月 9日～2017年 1月 8日	10.0000

第8期	2017年 1月 9日～2017年 7月 8日	16.0000
第9期	2017年 7月 9日～2018年 1月 8日	12.0000
第10期	2018年 1月 9日～2018年 7月 8日	9.0000
第11期	2018年 7月 9日～2019年 1月 8日	11.0000
第12期	2019年 1月 9日～2019年 7月 8日	16.0000
第13期	2019年 7月 9日～2020年 1月 8日	14.0000
第14期	2020年 1月 9日～2020年 7月 8日	18.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2013年 9月24日～2014年 1月 8日	8.16
第2期	2014年 1月 9日～2014年 7月 8日	0.07
第3期	2014年 7月 9日～2015年 1月 8日	9.92
第4期	2015年 1月 9日～2015年 7月 8日	14.13
第5期	2015年 7月 9日～2016年 1月 8日	△6.85
第6期	2016年 1月 9日～2016年 7月 8日	△12.30
第7期	2016年 7月 9日～2017年 1月 8日	25.50
第8期	2017年 1月 9日～2017年 7月 8日	5.19
第9期	2017年 7月 9日～2018年 1月 8日	18.82
第10期	2018年 1月 9日～2018年 7月 8日	△8.14
第11期	2018年 7月 9日～2019年 1月 8日	△9.47
第12期	2019年 1月 9日～2019年 7月 8日	6.11
第13期	2019年 7月 9日～2020年 1月 8日	9.08
第14期	2020年 1月 9日～2020年 7月 8日	△6.00

(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1期	2013年 9月24日～2014年 1月 8日	1,400,000	0
第2期	2014年 1月 9日～2014年 7月 8日	53,096,000	9,580,485
第3期	2014年 7月 9日～2015年 1月 8日	4,880,000	46,635,515
第4期	2015年 1月 9日～2015年 7月 8日	1,380,000	1,850,000
第5期	2015年 7月 9日～2016年 1月 8日	1,189,000	1,490,000
第6期	2016年 1月 9日～2016年 7月 8日	2,445,000	132,631
第7期	2016年 7月 9日～2017年 1月 8日	0	220,000
第8期	2017年 1月 9日～2017年 7月 8日	77,000	767,000
第9期	2017年 7月 9日～2018年 1月 8日	0	57,000

第10期	**2018年 1月 9日～2018年 7月 8日**	**16,169,713**	**5,850,000**
第11期	**2018年 7月 9日～2019年 1月 8日**	**8,038,000**	**3,875,000**
第12期	**2019年 1月 9日～2019年 7月 8日**	**1,000,000**	**0**
第13期	**2019年 7月 9日～2020年 1月 8日**	**1,865,000**	**70,000**
第14期	**2020年 1月 9日～2020年 7月 8日**	**1,914,000**	**15,986,568**

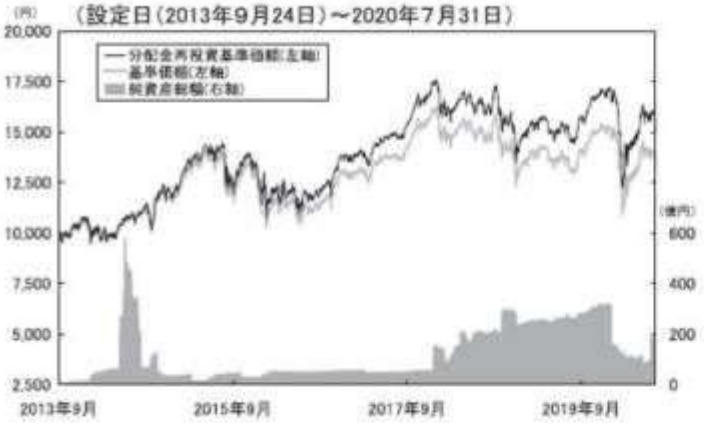
(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

≪参考情報≫

運用実績

2020年7月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……13,301円
純資産総額……177.85億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の10口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、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ることにご留意ください。

分配の推移（税引前、10口当たり）

2018年7月	2019年1月	2019年7月	2020年1月	2020年7月	設定来累計
90円	110円	160円	140円	180円	1,710円

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

組入資産		比率
株式		99.80%
	うち先物	0.00%
現金その他		0.20%

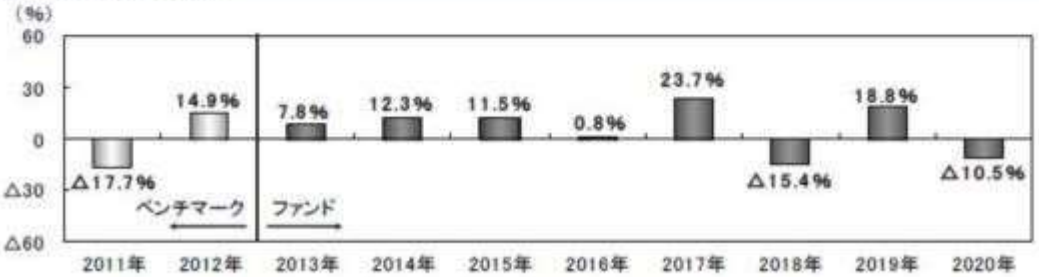
※対純資産総額比です。

＜組入上位10銘柄＞

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.62%
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.68%
3	ソニー	電気機器	2.64%
4	キーエンス	電気機器	2.09%
5	日本電信電話	情報・通信業	1.67%
6	武田薬品工業	医薬品	1.63%
7	任天堂	その他製品	1.49%
8	第一三共	医薬品	1.38%
9	ダイキン工業	機械	1.22%
10	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1.22%

※対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算しております。
※2012年以前は、ベンチマーク（TOPIX Ex-Financials）の収益率を表示しております。
※ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
※2013年は、設定時から2013年末までの騰落率です。
※2020年は、2020年7月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込方法

・取得申込者は、販売会社所定の方法でお申し込みください。申込時において、販売会社が独自に定める

手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。

・当ファンドは、東京証券取引所に上場しております。委託会社は、当該金融商品取引所が定める諸規則などを遵守し、当該金融商品取引所が諸規則などに基づいて行なう売買取引の停止または上場廃止その他の措置に従うものとします。

（２）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（３）取扱時間

原則として、午後 2時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

（４）取得申込不可日

販売会社の営業日であっても、取得申込日がファンドの計算期間終了日（決算日）の２営業日前以降の２営業日間（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、取得申込日が当該計算期間終了日の３営業日前以降の３営業日間）に該当する場合は、原則として取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（５）申込金額

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

（６）申込単位

1,000口以上で販売会社が定める単位

※詳しくは、販売会社の照会先にお問い合わせください。

（７）申込代金の支払い

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

（８）受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所※における取引の停止、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号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

２【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

（１）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（２）取扱時間

原則として、午後 2時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

（３）解約請求不可日

販売会社の営業日であっても、解約請求日がファンドの計算期間終了日（決算日）の２営業日前以降の２営業日間（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、解約請求日が当該計算期間終了日の３営業日前以降の３営業日間）に該当する場合は、原則として解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（４）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。

（５）解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

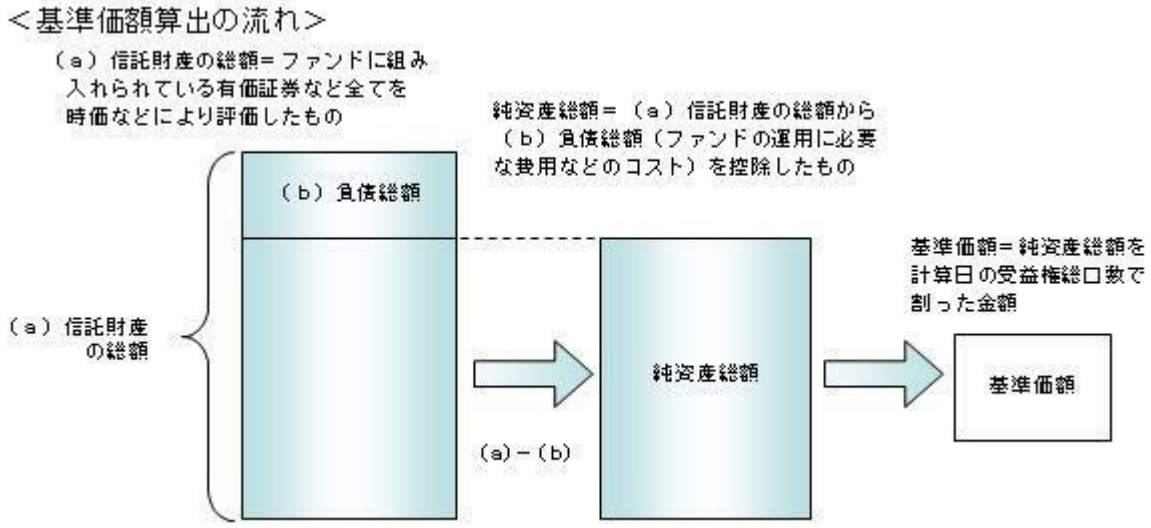
（６）解約手数料
受益者は解約時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。
（７）解約単位
1,000口以上 1口単位
※販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
（８）解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。
（９）受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・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（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

＜買取請求による換金＞
（１）受益者は、保有する受益権口数の合計が金融商品取引所の定める受益権の取引単位に満たない場合は、販売会社に当該受益権の買取りを請求することができます。
（２）原則として、午後 2時までに販売会社において所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
（３）受益権の買取価額は、買取請求受付日の基準価額とします。
（４）受益者は買取時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。
（５）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。
（６）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】

① 基準価額の算出
・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは10口当たりに換算した価額で表示することがあります。



② 有価証券などの評価基準

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

＜主な資産の評価方法＞

◇国内上場株式

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

・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。

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（2013年9月24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 1月 9日から 7月 8日までおよび 7月 9日から翌年 1月 8日までとします。

（５）【その他】

① 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）純資産総額が 5億円を下回ることとなった場合

ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ）やむを得ない事情が発生したとき

２）この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の

「書面決議」をご覧ください。）

3）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」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）受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合

ロ）TOPIX Ex-Financialsが廃止された場合

ハ）TOPIX Ex-Financialsの計算方法の変更などに伴なって委託会社または受託会社が必要と認めた信託約款の変更が、書面決議の規定を満たさず、信託約款の変更が行なわれないこととなった場合

ニ）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、書面決議が困難な場合

ホ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ヘ）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たときは、書面決議で可決された場合、存続します。）

ト）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

なお、上記イ）について、すべての金融商品取引所において上場が廃止された場合には、その廃止された日に信託を終了するための手続を開始するものとします。

4）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。

② 償還金について

原則として受託会社または取扱会社が、信託終了後40日以内の委託会社の指定する日に、受益者があらかじめ指定した預金口座などに振り込みます。

③ 信託約款の変更など

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、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容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または併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

3）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「書面決議」の規定を適用します。

④ 書面決議

1）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の２週間前までに知れている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

2）受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。

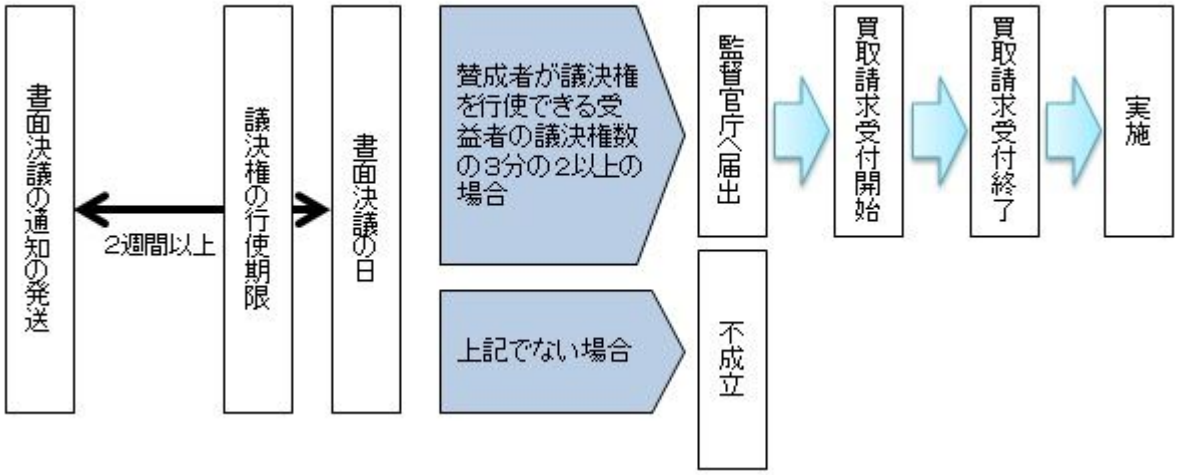
3）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

4）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。

5）当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

6）当ファンドの繰上償還、信託約款の重大な変更または併合を行なう場合には、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己の有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。

<書面決議の主な流れ>



⑤ 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/

※なお、やむを得ない事由によって公告を電子公告によって行なうことができない場合には、公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥ 運用報告書の作成

投資信託及び投資法人に関する法律により、運用報告書の作成・交付は行ないません。

⑦ 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。

⑧ 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

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）収益分配金受領権

・名義登録手続きによって受益者を確定し、当該受益者に対して収益分配金の支払いを行ないます。当ファンドの収益分配金は、計算期間終了日現在において、受託会社に名義登録している受益者に支払われます。受益者は、取扱会社を経由して名義登録を行なうことができます。

・計算期間終了日現在において、氏名または名称および住所が受託会社に登録されている受益者は、ファンドの収益分配金を登録されてい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支払開始日から５年間請求を行な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）償還金受領権

・信託期間終了日現在において、氏名または名称および住所が受託会社に登録されている受益者は、ファンドの償還金を登録されてい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、受益者が償還金について支払開始日から10年間請求を行な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。

（３）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。

（４）受益権の買取請求権

受益者が保有する受益権の口数の合計が、金融商品取引所の定める受益権の取引単位に満たない場合は、販売会社に対して、受益権の買取りを請求することができます。

（５）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

（１）　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドの計算期間は、6ヶ月であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。

（３）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2020年 1月 9日から2020年 7月 8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】

【上場インデックスファンドＴＯＰＩＸ　Ｅｘ－Ｆｉｎａｎｃｉａｌｓ】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 2020年 1月 8日現在	第14期 2020年 7月 8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	46,684,582	28,344,676
株式	31,244,898,619	9,687,624,120
未収入金	249,010,050	-
未収配当金	55,519,398	16,396,977
流動資産合計	31,596,112,649	9,732,365,773
資産合計	31,596,112,649	9,732,365,773
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	294,169,148	124,911,252
未払受託者報酬	4,473,492	2,187,619
未払委託者報酬	9,586,178	4,687,904
未払利息	63	15
その他未払費用	4,604,141	13,443,182
流動負債合計	312,833,022	145,229,972
負債合計	312,833,022	145,229,972
純資産の部		
元本等		
元本	21,012,082,000	6,939,514,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,271,197,627	2,647,621,801
（分配準備積立金）	9,442,388	10,435,035
元本等合計	31,283,279,627	9,587,135,801
純資産合計	31,283,279,627	9,587,135,801
負債純資産合計	31,596,112,649	9,732,365,773

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自　2019年 7月 9日 至　2020年 1月 8日	第14期 自　2020年 1月 9日 至　2020年 7月 8日
営業収益		
受取配当金	312,124,984	141,740,750
受取利息	18	11
有価証券売買等損益	2,261,331,655	△1,089,502,871
その他収益	177,799	51,322
営業収益合計	2,573,634,456	△947,710,788
営業費用		
支払利息	30,452	45,854
受託者報酬	4,473,492	2,187,619
委託者報酬	9,586,178	4,687,904
その他費用	4,606,188	8,966,807
営業費用合計	18,696,310	15,888,184
営業利益又は営業損失（△）	2,554,938,146	△963,598,972
経常利益又は経常損失（△）	2,554,938,146	△963,598,972
当期純利益又は当期純損失（△）	2,554,938,146	△963,598,972
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（△）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（△）	7,258,995,229	10,271,197,627
剰余金増加額又は欠損金減少額	778,803,400	526,338,500
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	778,803,400	526,338,500
剰余金減少額又は欠損金増加額	27,370,000	7,061,404,102
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	27,370,000	7,061,404,102
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	294,169,148	124,911,252
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,271,197,627	2,647,621,801

（３）【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	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。 （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。 （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。 （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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		第13期 2020年 1月 8日現在	第14期 2020年 7月 8日現在
１．	期首元本額	19,217,082,000円	21,012,082,000円
	期中追加設定元本額	1,865,000,000円	1,914,000,000円
	期中一部解約元本額	70,000,000円	15,986,568,000円
２．	受益権の総数	21,012,082口	6,939,514口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第13期 自 2019年 7月 9日 至 2020年 1月 8日		第14期 自 2020年 1月 9日 至 2020年 7月 8日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 当期配当等収益額	312,272,349円	A 当期配当等収益額	141,746,229円
B 分配準備積立金	10,005,045円	B 分配準備積立金	9,442,388円
C 配当等収益額合計（A+B）	322,277,394円	C 配当等収益額合計（A+B）	151,188,617円
D 経費	18,665,858円	D 経費	15,842,330円
E 収益分配可能額（C-D）	303,611,536円	E 収益分配可能額（C-D）	135,346,287円
F 収益分配金額	294,169,148円	F 収益分配金額	124,911,252円
G 次期繰越金（分配準備積立金）（E-F）	9,442,388円	G 次期繰越金（分配準備積立金）（E-F）	10,435,035円
H 口数	21,012,082口	H 口数	6,939,514口
I 分配金額（10口当たり）	140円	I 分配金額（10口当たり）	180円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第13期 自 2019年 7月 9日 至 2020年 1月 8日	第14期 自 2020年 1月 9日 至 2020年 7月 8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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第13期 2020年 1月 8日現在	第14期 2020年 7月 8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）

第13期（2020年 1月 8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	2,209,686,122
合計	2,209,686,122

第14期（2020年 7月 8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	△448,592,077
合計	△448,592,077

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

第13期 2020年 1月 8日現在		第14期 2020年 7月 8日現在	
1口当たり純資産額	1,488.8円	1口当たり純資産額	1,381.5円
(10口当たり純資産額)	(14,888円)	(10口当たり純資産額)	(13,815円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	200	2,733.00	546,600	
日本水産	6,600	467.00	3,082,200	
マルハニチロ	1,000	2,138.00	2,138,000	
カネコ種苗	200	1,440.00	288,000	
サカタのタネ	800	3,260.00	2,608,000	
ホクト	500	2,004.00	1,002,000	
ホクリヨウ	100	646.00	64,600	
住石ホールディングス	1,300	121.00	157,300	
日鉄鉱業	100	4,210.00	421,000	
三井松島ホールディングス	200	792.00	158,400	
国際石油開発帝石	26,600	634.00	16,864,400	
石油資源開発	900	1,815.00	1,633,500	
K＆Oエナジーグループ	300	1,455.00	436,500	
ヒノキヤグループ	200	1,552.00	310,400	
ショーボンドホールディングス	1,000	4,830.00	4,830,000	
ミライト・ホールディングス	2,000	1,566.00	3,132,000	
タマホーム	400	1,213.00	485,200	
日本アクア	200	607.00	121,400	
ファーストコーポレーション	200	555.00	111,000	
ベステラ	100	1,010.00	101,000	
ＴＡＴＥＲＵ	1,200	182.00	218,400	
キャンディル	100	536.00	53,600	
スペースバリューホールディングス	800	356.00	284,800	
ダイセキ環境ソリューション	100	811.00	81,100	
第一カッター興業	100	2,388.00	238,800	
明豊ファシリティワークス	200	548.00	109,600	
安藤・間	3,900	602.00	2,347,800	
東急建設	1,900	540.00	1,026,000	
コムシスホールディングス	2,400	3,115.00	7,476,000	
ビーアールホールディングス	700	572.00	400,400	
高松コンストラクショングループ	400	2,365.00	946,000	
東建コーポレーション	200	6,970.00	1,394,000	
ソネック	100	789.00	78,900	
ヤマウラ	300	845.00	253,500	
大成建設	5,100	3,840.00	19,584,000	
大林組	15,300	990.00	15,147,000	
清水建設	15,500	847.00	13,128,500	
飛島建設	400	1,055.00	422,000	

長谷工コーポレーション	5,900	1,336.00	7,882,400	
松井建設	600	630.00	378,000	
錢高組	100	3,730.00	373,000	
鹿島建設	12,000	1,248.00	14,976,000	
不動テトラ	400	1,454.00	581,600	
大末建設	200	820.00	164,000	
鉄建建設	300	2,026.00	607,800	
西松建設	1,200	2,076.00	2,491,200	
三井住友建設	3,700	459.00	1,698,300	
大豊建設	300	2,408.00	722,400	
前田建設工業	3,800	794.00	3,017,200	
佐田建設	300	418.00	125,400	
ナカノフドー建設	400	364.00	145,600	
奥村組	800	2,448.00	1,958,400	
東鉄工業	700	2,671.00	1,869,700	
イチケン	100	1,510.00	151,000	
富士ピー・エス	200	607.00	121,400	
淺沼組	200	4,090.00	818,000	
戸田建設	6,400	688.00	4,403,200	
熊谷組	700	2,584.00	1,808,800	
北野建設	100	2,663.00	266,300	
植木組	100	2,499.00	249,900	
矢作建設工業	700	770.00	539,000	
ピーエス三菱	500	528.00	264,000	
日本ハウスホールディングス	1,000	270.00	270,000	
大東建託	1,700	9,866.00	16,772,200	
新日本建設	600	831.00	498,600	
ＮＩＰＰＯ	1,300	2,663.00	3,461,900	
東亜道路工業	100	3,130.00	313,000	
前田道路	1,300	1,997.00	2,596,100	
日本道路	100	7,110.00	711,000	
東亜建設工業	500	1,553.00	776,500	
日本国土開発	1,500	570.00	855,000	
若築建設	300	1,240.00	372,000	
東洋建設	1,700	391.00	664,700	
五洋建設	6,100	585.00	3,568,500	
世紀東急工業	700	750.00	525,000	
福田組	200	4,765.00	953,000	
住友林業	3,900	1,303.00	5,081,700	
日本基礎技術	500	422.00	211,000	
巴コーポレーション	700	335.00	234,500	
大和ハウス工業	15,100	2,454.00	37,055,400	

ライト工業	900	1,459.00	1,313,100	
積水ハウス	16,600	2,053.50	34,088,100	
日特建設	400	771.00	308,400	
北陸電気工事	300	953.00	285,900	
ユアテック	900	630.00	567,000	
日本リーテック	300	2,630.00	789,000	
四電工	100	2,419.00	241,900	
中電工	600	2,243.00	1,345,800	
関電工	2,200	894.00	1,966,800	
きんでん	3,600	1,749.00	6,296,400	
東京エネシス	500	754.00	377,000	
トーエネック	200	3,615.00	723,000	
住友電設	400	2,359.00	943,600	
日本電設工業	800	2,357.00	1,885,600	
協和エクシオ	2,300	2,554.00	5,874,200	
新日本空調	400	2,305.00	922,000	
九電工	1,100	3,140.00	3,454,000	
三機工業	1,100	1,218.00	1,339,800	
日揮ホールディングス	4,700	1,119.00	5,259,300	
中外炉工業	200	1,619.00	323,800	
ヤマト	500	611.00	305,500	
太平電業	400	2,227.00	890,800	
高砂熱学工業	1,300	1,564.00	2,033,200	
三晃金属工業	100	2,091.00	209,100	
朝日工業社	100	3,215.00	321,500	
明星工業	1,000	781.00	781,000	
大氣社	700	3,010.00	2,107,000	
ダイダン	400	2,695.00	1,078,000	
日比谷総合設備	500	1,816.00	908,000	
フィル・カンパニー	100	2,358.00	235,800	
ＯＳＪＢホールディングス	2,400	225.00	540,000	
東洋エンジニアリング	700	345.00	241,500	
レイズネクスト	800	1,252.00	1,001,600	
日本製粉	1,400	1,617.00	2,263,800	
日清製粉グループ本社	5,500	1,556.00	8,558,000	
昭和産業	500	3,165.00	1,582,500	
鳥越製粉	400	856.00	342,400	
中部飼料	600	1,563.00	937,800	
フィード・ワン	3,200	193.00	617,600	
東洋精糖	100	1,201.00	120,100	
日本甜菜製糖	200	1,720.00	344,000	
三井製糖	400	1,970.00	788,000	

塩水港精糖	500	236.00	118,000	
日新製糖	200	1,801.00	360,200	
森永製菓	1,200	4,045.00	4,854,000	
中村屋	100	4,000.00	400,000	
江崎グリコ	1,400	5,100.00	7,140,000	
名糖産業	200	1,366.00	273,200	
井村屋グループ	300	2,187.00	656,100	
不二家	300	2,273.00	681,900	
山崎製パン	3,700	1,835.00	6,789,500	
第一屋製パン	100	987.00	98,700	
モロゾフ	100	5,500.00	550,000	
亀田製菓	300	5,160.00	1,548,000	
寿スピリッツ	500	4,325.00	2,162,500	
カルビー	2,200	3,040.00	6,688,000	
森永乳業	900	4,770.00	4,293,000	
六甲バター	300	1,501.00	450,300	
ヤクルト本社	3,400	6,150.00	20,910,000	
明治ホールディングス	3,200	8,450.00	27,040,000	
雪印メグミルク	1,200	2,446.00	2,935,200	
プリマハム	800	2,789.00	2,231,200	
日本ハム	1,900	4,285.00	8,141,500	
林兼産業	100	569.00	56,900	
丸大食品	500	1,879.00	939,500	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	400	2,597.00	1,038,800	
柿安本店	200	2,704.00	540,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	3,200	634.00	2,028,800	
サッポロホールディングス	1,700	1,960.00	3,332,000	
アサヒグループホールディングス	10,300	3,682.00	37,924,600	
キリンホールディングス	20,800	2,165.50	45,042,400	
宝ホールディングス	3,600	952.00	3,427,200	
オエノンホールディングス	1,300	395.00	513,500	
養命酒製造	100	1,810.00	181,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	3,400	1,924.00	6,541,600	
サントリー食品インターナショナル	3,300	4,210.00	13,893,000	
ダイドーグループホールディングス	200	4,860.00	972,000	
伊藤園	1,500	6,270.00	9,405,000	
キーコーヒー	500	2,207.00	1,103,500	
ユニカフェ	100	1,034.00	103,400	
ジャパンフーズ	100	1,199.00	119,900	
日清オイリオグループ	600	3,330.00	1,998,000	
不二製油グループ本社	1,200	2,747.00	3,296,400	
Ｊ－オイルミルズ	200	4,010.00	802,000	

キッコーマン	3,500	5,000.00	17,500,000	
味の素	10,800	1,747.50	18,873,000	
キユーピー	2,700	1,924.00	5,194,800	
ハウス食品グループ本社	1,800	3,395.00	6,111,000	
カゴメ	1,900	3,235.00	6,146,500	
焼津水産化学工業	200	900.00	180,000	
アリアケジャパン	400	6,760.00	2,704,000	
ピエトロ	100	1,628.00	162,800	
エバラ食品工業	100	2,158.00	215,800	
ニチレイ	2,300	3,115.00	7,164,500	
東洋水産	2,500	6,190.00	15,475,000	
イートアンド	200	1,765.00	353,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	300	1,183.00	354,900	
日清食品ホールディングス	2,100	9,520.00	19,992,000	
永谷園ホールディングス	200	2,143.00	428,600	
一正蒲鉾	200	981.00	196,200	
フジッコ	500	2,035.00	1,017,500	
ロック・フィールド	500	1,288.00	644,000	
日本たばこ産業	28,300	1,969.50	55,736,850	
ケンコーマヨネーズ	300	1,867.00	560,100	
わらべや日洋ホールディングス	300	1,569.00	470,700	
なとり	300	1,740.00	522,000	
イフジ産業	100	821.00	82,100	
ピックルスコーポレーション	100	2,932.00	293,200	
北の達人コーポレーション	1,700	541.00	919,700	
ユーグレナ	2,100	761.00	1,598,100	
ミヨシ油脂	200	1,072.00	214,400	
理研ビタミン	500	2,220.00	1,110,000	
片倉工業	700	1,106.00	774,200	
グンゼ	300	4,045.00	1,213,500	
東洋紡	1,900	1,471.00	2,794,900	
ユニチカ	1,400	346.00	484,400	
富士紡ホールディングス	200	3,200.00	640,000	
倉敷紡績	500	2,113.00	1,056,500	
シキボウ	200	990.00	198,000	
日本毛織	1,600	1,006.00	1,609,600	
ダイトウボウ	700	113.00	79,100	
トーア紡コーポレーション	200	474.00	94,800	
ダイドーリミテッド	600	209.00	125,400	
帝国繊維	500	2,218.00	1,109,000	
帝人	3,900	1,663.00	6,485,700	
東レ	34,600	497.70	17,220,420	

サカイオーベックス	100	2,229.00	222,900	
住江織物	100	2,019.00	201,900	
日本フエルト	300	449.00	134,700	
イチカワ	100	1,190.00	119,000	
日東製網	100	1,368.00	136,800	
アツギ	400	604.00	241,600	
ダイニック	200	757.00	151,400	
セーレン	1,200	1,313.00	1,575,600	
ソトー	200	951.00	190,200	
東海染工	100	1,133.00	113,300	
小松マテーレ	800	730.00	584,000	
ワコールホールディングス	1,200	1,940.00	2,328,000	
ホギメディカル	500	3,125.00	1,562,500	
クラウディアホールディングス	100	367.00	36,700	
ＴＳＩホールディングス	1,600	356.00	569,600	
マツオカコーポレーション	100	1,786.00	178,600	
ワールド	700	1,554.00	1,087,800	
三陽商会	200	568.00	113,600	
ナイガイ	200	354.00	70,800	
オンワードホールディングス	2,900	285.00	826,500	
ルックホールディングス	100	708.00	70,800	
キムラタン	2,300	27.00	62,100	
ゴールドウイン	900	6,700.00	6,030,000	
デサント	900	1,524.00	1,371,600	
キング	200	453.00	90,600	
ヤマトインターナショナル	400	381.00	152,400	
特種東海製紙	300	4,565.00	1,369,500	
王子ホールディングス	20,000	480.00	9,600,000	
日本製紙	2,100	1,442.00	3,028,200	
三菱製紙	500	337.00	168,500	
北越コーポレーション	2,800	370.00	1,036,000	
中越パルプ工業	200	1,483.00	296,600	
巴川製紙所	100	995.00	99,500	
大王製紙	2,100	1,434.00	3,011,400	
阿波製紙	100	490.00	49,000	
レンゴー	4,500	841.00	3,784,500	
トーモク	300	1,716.00	514,800	
ザ・パック	400	2,942.00	1,176,800	
クラレ	7,500	1,087.00	8,152,500	
旭化成	31,700	835.90	26,498,030	
共和レザー	300	661.00	198,300	
昭和電工	3,400	2,346.00	7,976,400	

住友化学	35,100	327.00	11,477,700	
住友精化	200	3,515.00	703,000	
日産化学	2,600	5,460.00	14,196,000	
ラサ工業	200	1,490.00	298,000	
クレハ	400	4,590.00	1,836,000	
多木化学	200	6,850.00	1,370,000	
テイカ	300	1,381.00	414,300	
石原産業	900	695.00	625,500	
片倉コープアグリ	100	1,234.00	123,400	
日本曹達	700	2,778.00	1,944,600	
東ソー	7,400	1,443.00	10,678,200	
トクヤマ	1,400	2,425.00	3,395,000	
セントラル硝子	1,000	1,846.00	1,846,000	
東亞合成	3,000	1,060.00	3,180,000	
大阪ソーダ	500	2,340.00	1,170,000	
関東電化工業	1,100	837.00	920,700	
デンカ	1,700	2,568.00	4,365,600	
信越化学工業	8,200	12,375.00	101,475,000	
日本カーバイド工業	200	1,204.00	240,800	
堺化学工業	300	2,008.00	602,400	
第一稀元素化学工業	500	772.00	386,000	
エア・ウォーター	4,500	1,502.00	6,759,000	
大陽日酸	4,600	1,773.00	8,155,800	
日本化学工業	200	2,168.00	433,600	
東邦アセチレン	100	1,290.00	129,000	
日本パーカライジング	2,400	1,103.00	2,647,200	
高圧ガス工業	800	764.00	611,200	
チタン工業	100	1,757.00	175,700	
四国化成工業	700	1,045.00	731,500	
戸田工業	100	1,754.00	175,400	
ステラ　ケミファ	300	2,370.00	711,000	
保土谷化学工業	200	4,865.00	973,000	
日本触媒	700	5,580.00	3,906,000	
大日精化工業	400	2,267.00	906,800	
カネカ	1,200	2,661.00	3,193,200	
三菱瓦斯化学	4,400	1,604.00	7,057,600	
三井化学	4,300	2,243.00	9,644,900	
ＪＳＲ	4,400	2,116.00	9,310,400	
東京応化工業	800	5,660.00	4,528,000	
大阪有機化学工業	400	2,674.00	1,069,600	
三菱ケミカルホールディングス	32,000	620.90	19,868,800	
ＫＨネオケム	800	2,048.00	1,638,400	

ダイセル	6,200	790.00	4,898,000	
住友ベークライト	800	2,864.00	2,291,200	
積水化学工業	10,100	1,501.00	15,160,100	
日本ゼオン	4,300	949.00	4,080,700	
アイカ工業	1,400	3,505.00	4,907,000	
宇部興産	2,400	1,802.00	4,324,800	
積水樹脂	900	2,055.00	1,849,500	
タキロンシーアイ	1,000	678.00	678,000	
旭有機材	300	1,403.00	420,900	
ニチバン	200	1,475.00	295,000	
リケンテクノス	1,200	406.00	487,200	
大倉工業	200	1,563.00	312,600	
積水化成品工業	600	548.00	328,800	
群栄化学工業	100	2,622.00	262,200	
タイガースポリマー	200	480.00	96,000	
ミライアル	200	1,047.00	209,400	
ダイキアクシス	200	739.00	147,800	
ダイキョーニシカワ	1,000	457.00	457,000	
竹本容器	200	685.00	137,000	
森六ホールディングス	300	1,641.00	492,300	
日本化薬	3,000	1,084.00	3,252,000	
カーリットホールディングス	500	502.00	251,000	
日本精化	400	1,400.00	560,000	
扶桑化学工業	500	3,885.00	1,942,500	
トリケミカル研究所	100	11,560.00	1,156,000	
ＡＤＥＫＡ	2,200	1,415.00	3,113,000	
日油	1,800	3,890.00	7,002,000	
新日本理化	700	160.00	112,000	
ハリマ化成グループ	400	930.00	372,000	
花王	11,700	8,529.00	99,789,300	
第一工業製薬	200	4,990.00	998,000	
石原ケミカル	100	1,971.00	197,100	
日華化学	100	867.00	86,700	
ニイタカ	100	5,260.00	526,000	
三洋化成工業	300	4,680.00	1,404,000	
有機合成薬品工業	400	350.00	140,000	
大日本塗料	500	882.00	441,000	
日本ペイントホールディングス	3,900	7,970.00	31,083,000	
関西ペイント	5,400	2,236.00	12,074,400	
神東塗料	400	176.00	70,400	
中国塗料	1,400	805.00	1,127,000	
日本特殊塗料	400	971.00	388,400	

藤倉化成	600	512.00	307,200	
太陽ホールディングス	400	5,070.00	2,028,000	
ＤＩＣ	2,000	2,655.00	5,310,000	
サカタインクス	1,000	1,026.00	1,026,000	
東洋インキＳＣホールディングス	1,000	2,033.00	2,033,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	400	841.00	336,400	
富士フイルムホールディングス	9,400	4,665.00	43,851,000	
資生堂	9,700	6,845.00	66,396,500	
ライオン	6,300	2,625.00	16,537,500	
高砂香料工業	300	2,120.00	636,000	
マンダム	1,100	1,927.00	2,119,700	
ミルボン	600	4,990.00	2,994,000	
ファンケル	2,000	3,110.00	6,220,000	
コーセー	900	12,780.00	11,502,000	
コタ	300	1,177.00	353,100	
ポーラ・オルビスホールディングス	2,100	1,811.00	3,803,100	
ノエビアホールディングス	400	4,560.00	1,824,000	
アジュバンコスメジャパン	100	951.00	95,100	
エステー	300	1,666.00	499,800	
アグロ　カネショウ	200	1,289.00	257,800	
コニシ	800	1,429.00	1,143,200	
長谷川香料	800	2,379.00	1,903,200	
星光ＰＭＣ	300	707.00	212,100	
小林製薬	1,400	9,460.00	13,244,000	
荒川化学工業	400	1,207.00	482,800	
メック	300	2,064.00	619,200	
日本高純度化学	100	2,584.00	258,400	
タカラバイオ	1,300	3,055.00	3,971,500	
ＪＣＵ	600	3,230.00	1,938,000	
新田ゼラチン	300	677.00	203,100	
ＯＡＴアグリオ	100	1,130.00	113,000	
デクセリアルズ	1,300	813.00	1,056,900	
アース製薬	400	7,620.00	3,048,000	
北興化学工業	500	561.00	280,500	
大成ラミック	200	2,715.00	543,000	
クミアイ化学工業	2,000	989.00	1,978,000	
日本農薬	900	500.00	450,000	
アキレス	300	1,990.00	597,000	
有沢製作所	800	825.00	660,000	
日東電工	3,400	5,850.00	19,890,000	
レック	500	1,485.00	742,500	
三光合成	500	261.00	130,500	

きもと	700	166.00	116,200	
藤森工業	400	3,560.00	1,424,000	
前澤化成工業	300	983.00	294,900	
未来工業	300	1,901.00	570,300	
ウェーブロックホールディングス	200	919.00	183,800	
ＪＳＰ	300	1,409.00	422,700	
エフピコ	500	8,610.00	4,305,000	
天馬	300	1,609.00	482,700	
信越ポリマー	900	871.00	783,900	
東リ	1,200	262.00	314,400	
ニフコ	1,800	2,270.00	4,086,000	
バルカー	400	1,862.00	744,800	
ユニ・チャーム	9,400	4,794.00	45,063,600	
ショーエイコーポレーション	100	900.00	90,000	
協和キリン	4,900	2,717.00	13,313,300	
武田薬品工業	40,600	3,766.00	152,899,600	
アステラス製薬	42,300	1,732.50	73,284,750	
大日本住友製薬	3,600	1,384.00	4,982,400	
塩野義製薬	6,100	6,286.00	38,344,600	
わかもと製薬	600	284.00	170,400	
あすか製薬	600	1,172.00	703,200	
日本新薬	1,300	7,970.00	10,361,000	
ビオフェルミン製薬	100	2,235.00	223,500	
中外製薬	15,300	5,533.00	84,654,900	
科研製薬	800	5,200.00	4,160,000	
エーザイ	5,800	8,535.00	49,503,000	
ロート製薬	2,500	3,425.00	8,562,500	
小野薬品工業	11,200	3,014.00	33,756,800	
久光製薬	1,300	5,480.00	7,124,000	
持田製薬	700	3,905.00	2,733,500	
参天製薬	9,100	1,925.00	17,517,500	
扶桑薬品工業	200	2,310.00	462,000	
日本ケミファ	100	2,479.00	247,900	
ツムラ	1,500	2,747.00	4,120,500	
日医工	1,400	1,261.00	1,765,400	
キッセイ薬品工業	900	2,380.00	2,142,000	
生化学工業	900	1,079.00	971,100	
栄研化学	900	1,618.00	1,456,200	
日水製薬	200	1,103.00	220,600	
鳥居薬品	300	3,075.00	922,500	
ＪＣＲファーマ	300	10,650.00	3,195,000	
東和薬品	600	1,916.00	1,149,600	

富士製薬工業	300	1,151.00	345,300	
沢井製薬	1,000	5,200.00	5,200,000	
ゼリア新薬工業	900	1,866.00	1,679,400	
第一三共	14,000	8,516.00	119,224,000	
キョーリン製薬ホールディングス	1,100	2,063.00	2,269,300	
大幸薬品	600	2,266.00	1,359,600	
ダイト	300	3,760.00	1,128,000	
大塚ホールディングス	9,300	4,579.00	42,584,700	
大正製薬ホールディングス	1,000	6,240.00	6,240,000	
ペプチドリーム	2,500	4,675.00	11,687,500	
日本コークス工業	4,000	65.00	260,000	
ニチレキ	600	1,613.00	967,800	
ユシロ化学工業	300	1,310.00	393,000	
ビーピー・カストロール	200	1,119.00	223,800	
富士石油	1,200	161.00	193,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	200	1,004.00	200,800	
出光興産	5,400	2,327.00	12,565,800	
ＥＮＥＯＳホールディングス	73,400	383.10	28,119,540	
コスモエネルギーホールディングス	1,400	1,567.00	2,193,800	
横浜ゴム	2,800	1,504.00	4,211,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	2,800	1,432.00	4,009,600	
ブリヂストン	14,100	3,398.00	47,911,800	
住友ゴム工業	4,400	1,016.00	4,470,400	
藤倉コンポジット	400	372.00	148,800	
オカモト	300	3,870.00	1,161,000	
フコク	200	664.00	132,800	
ニッタ	500	2,327.00	1,163,500	
住友理工	1,000	600.00	600,000	
三ツ星ベルト	600	1,682.00	1,009,200	
バンドー化学	900	621.00	558,900	
日東紡績	700	5,110.00	3,577,000	
ＡＧＣ	4,800	3,130.00	15,024,000	
日本板硝子	2,300	382.00	878,600	
石塚硝子	100	1,802.00	180,200	
日本山村硝子	200	856.00	171,200	
日本電気硝子	2,000	1,687.00	3,374,000	
オハラ	200	1,098.00	219,600	
住友大阪セメント	900	3,675.00	3,307,500	
太平洋セメント	3,100	2,378.00	7,371,800	
日本ヒューム	500	775.00	387,500	
日本コンクリート工業	1,000	270.00	270,000	
三谷セキサン	200	5,200.00	1,040,000	

アジアパイルホールディングス	700	461.00	322,700	
東海カーボン	5,100	992.00	5,059,200	
日本カーボン	300	3,435.00	1,030,500	
東洋炭素	300	1,699.00	509,700	
ノリタケカンパニーリミテド	300	3,345.00	1,003,500	
ＴＯＴＯ	3,500	4,175.00	14,612,500	
日本碍子	5,900	1,435.00	8,466,500	
日本特殊陶業	3,700	1,491.00	5,516,700	
ダントーホールディングス	300	92.00	27,600	
ＭＡＲＵＷＡ	200	7,970.00	1,594,000	
品川リフラクトリーズ	100	2,136.00	213,600	
黒崎播磨	100	3,640.00	364,000	
ヨータイ	400	714.00	285,600	
イソライト工業	300	418.00	125,400	
東京窯業	600	297.00	178,200	
ニッカトー	200	682.00	136,400	
フジミインコーポレーテッド	400	3,335.00	1,334,000	
クニミネ工業	200	943.00	188,600	
エーアンドエーマテリアル	100	1,070.00	107,000	
ニチアス	1,300	2,260.00	2,938,000	
ニチハ	700	2,239.00	1,567,300	
日本製鉄	21,600	1,018.00	21,988,800	
神戸製鋼所	8,800	377.00	3,317,600	
中山製鋼所	700	353.00	247,100	
合同製鐵	300	1,794.00	538,200	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	13,000	792.00	10,296,000	
東京製鐵	2,400	618.00	1,483,200	
共英製鋼	500	1,277.00	638,500	
大和工業	1,000	2,113.00	2,113,000	
東京鐵鋼	200	1,496.00	299,200	
大阪製鐵	300	1,224.00	367,200	
淀川製鋼所	600	1,831.00	1,098,600	
丸一鋼管	1,600	2,654.00	4,246,400	
モリ工業	100	2,320.00	232,000	
大同特殊鋼	800	3,285.00	2,628,000	
日本高周波鋼業	200	355.00	71,000	
日本冶金工業	400	1,549.00	619,600	
山陽特殊製鋼	300	878.00	263,400	
愛知製鋼	300	2,986.00	895,800	
日立金属	5,200	1,289.00	6,702,800	
日本金属	100	610.00	61,000	
大平洋金属	300	1,550.00	465,000	

新日本電工	3,100	164.00	508,400	
栗本鐵工所	200	1,636.00	327,200	
虹技	100	1,239.00	123,900	
日本鋳鉄管	100	1,272.00	127,200	
三菱製鋼	400	643.00	257,200	
日亜鋼業	700	290.00	203,000	
日本精線	100	3,325.00	332,500	
エンビプロ・ホールディングス	200	543.00	108,600	
シンニッタン	800	220.00	176,000	
新家工業	100	1,169.00	116,900	
大紀アルミニウム工業所	800	529.00	423,200	
日本軽金属ホールディングス	12,200	184.00	2,244,800	
三井金属鉱業	1,300	2,208.00	2,870,400	
東邦亜鉛	200	1,522.00	304,400	
三菱マテリアル	3,200	2,265.00	7,248,000	
住友金属鉱山	6,200	3,130.00	19,406,000	
ＤＯＷＡホールディングス	1,200	3,235.00	3,882,000	
古河機械金属	900	1,074.00	966,600	
エス・サイエンス	1,900	47.00	89,300	
大阪チタニウムテクノロジーズ	500	909.00	454,500	
東邦チタニウム	900	645.00	580,500	
ＵＡＣＪ	700	1,882.00	1,317,400	
ＣＫサンエツ	100	3,075.00	307,500	
古河電気工業	1,500	2,622.00	3,933,000	
住友電気工業	18,100	1,249.50	22,615,950	
フジクラ	5,800	322.00	1,867,600	
昭和電線ホールディングス	600	1,152.00	691,200	
東京特殊電線	100	2,124.00	212,400	
タツタ電線	1,000	540.00	540,000	
カナレ電気	100	1,712.00	171,200	
平河ヒューテック	200	1,022.00	204,400	
リョービ	600	1,144.00	686,400	
アーレスティ	600	345.00	207,000	
アサヒホールディングス	800	2,844.00	2,275,200	
稲葉製作所	300	1,410.00	423,000	
宮地エンジニアリンググループ	100	1,623.00	162,300	
トーカロ	1,300	1,152.00	1,497,600	
アルファＣｏ	200	916.00	183,200	
ＳＵＭＣＯ	5,700	1,655.00	9,433,500	
川田テクノロジーズ	100	4,815.00	481,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	100	3,830.00	383,000	
信和	300	718.00	215,400	

東洋製罐グループホールディングス	3,100	1,169.00	3,623,900	
ホッカンホールディングス	300	1,731.00	519,300	
コロナ	300	1,006.00	301,800	
横河ブリッジホールディングス	900	2,201.00	1,980,900	
駒井ハルテック	100	1,430.00	143,000	
三和ホールディングス	4,600	921.00	4,236,600	
文化シヤッター	1,400	742.00	1,038,800	
三協立山	600	911.00	546,600	
アルインコ	400	929.00	371,600	
東洋シヤッター	100	675.00	67,500	
ＬＩＸＩＬグループ	7,100	1,547.00	10,983,700	
日本フイルコン	400	456.00	182,400	
ノーリツ	1,000	1,317.00	1,317,000	
長府製作所	500	2,179.00	1,089,500	
リンナイ	900	8,860.00	7,974,000	
ダイニチ工業	300	692.00	207,600	
日東精工	700	458.00	320,600	
三洋工業	100	1,883.00	188,300	
岡部	1,000	800.00	800,000	
ジーテクト	600	988.00	592,800	
東プレ	900	1,145.00	1,030,500	
高周波熱錬	900	507.00	456,300	
東京製綱	300	580.00	174,000	
サンコール	300	418.00	125,400	
モリテック　スチール	400	290.00	116,000	
パイオラックス	700	1,535.00	1,074,500	
エイチワン	500	550.00	275,000	
日本発條	5,200	667.00	3,468,400	
中央発條	100	2,765.00	276,500	
アドバネクス	100	1,400.00	140,000	
立川ブラインド工業	200	1,261.00	252,200	
三益半導体工業	400	2,377.00	950,800	
日本ドライケミカル	100	1,728.00	172,800	
日本製鋼所	1,500	1,525.00	2,287,500	
三浦工業	2,100	4,455.00	9,355,500	
タクマ	1,600	1,460.00	2,336,000	
ツガミ	1,000	880.00	880,000	
オークマ	600	4,475.00	2,685,000	
芝浦機械	500	2,109.00	1,054,500	
アマダ	6,000	833.00	4,998,000	
アイダエンジニアリング	1,300	718.00	933,400	
滝澤鉄工所	200	1,003.00	200,600	

ＦＵＪＩ	2,100	1,879.00	3,945,900	
牧野フライス製作所	600	3,175.00	1,905,000	
オーエスジー	2,200	1,639.00	3,605,800	
旭ダイヤモンド工業	1,300	471.00	612,300	
ＤＭＧ森精機	3,100	1,282.00	3,974,200	
ソディック	1,100	805.00	885,500	
ディスコ	700	27,610.00	19,327,000	
日東工器	300	1,886.00	565,800	
日進工具	200	2,491.00	498,200	
パンチ工業	500	406.00	203,000	
冨士ダイス	200	660.00	132,000	
豊和工業	300	760.00	228,000	
ＯＫＫ	200	388.00	77,600	
石川製作所	100	1,591.00	159,100	
東洋機械金属	300	400.00	120,000	
津田駒工業	100	864.00	86,400	
エンシュウ	100	945.00	94,500	
島精機製作所	800	1,415.00	1,132,000	
オプトラン	500	2,548.00	1,274,000	
ＮＣホールディングス	100	544.00	54,400	
イワキポンプ	300	982.00	294,600	
フリュー	500	986.00	493,000	
ヤマシンフィルタ	1,100	1,041.00	1,145,100	
日阪製作所	600	745.00	447,000	
やまびこ	900	926.00	833,400	
平田機工	200	6,050.00	1,210,000	
ペガサスミシン製造	500	312.00	156,000	
マルマエ	200	1,220.00	244,000	
タツモ	200	1,813.00	362,600	
ナブテスコ	2,800	3,350.00	9,380,000	
三井海洋開発	500	1,553.00	776,500	
レオン自動機	500	1,243.00	621,500	
ＳＭＣ	1,500	56,530.00	84,795,000	
ホソカワミクロン	200	5,630.00	1,126,000	
ユニオンツール	200	2,628.00	525,600	
オイレス工業	600	1,389.00	833,400	
日精エー・エス・ビー機械	100	3,070.00	307,000	
サトーホールディングス	700	2,372.00	1,660,400	
技研製作所	400	4,945.00	1,978,000	
日本エアーテック	200	1,076.00	215,200	
カワタ	100	734.00	73,400	
日精樹脂工業	400	803.00	321,200	

オカダアイヨン	100	934.00	93,400	
ワイエイシイホールディングス	200	649.00	129,800	
小松製作所	22,100	2,180.00	48,178,000	
住友重機械工業	2,800	2,249.00	6,297,200	
日立建機	2,000	3,000.00	6,000,000	
日工	700	619.00	433,300	
巴工業	200	1,830.00	366,000	
井関農機	500	1,131.00	565,500	
ＴＯＷＡ	500	1,416.00	708,000	
丸山製作所	100	1,151.00	115,100	
北川鉄工所	200	1,527.00	305,400	
ローツェ	200	5,800.00	1,160,000	
タカキタ	200	601.00	120,200	
クボタ	25,900	1,549.50	40,132,050	
荏原実業	100	2,851.00	285,100	
三菱化工機	200	1,871.00	374,200	
月島機械	900	1,134.00	1,020,600	
帝国電機製作所	400	1,232.00	492,800	
東京機械製作所	200	289.00	57,800	
新東工業	1,200	759.00	910,800	
澁谷工業	400	2,818.00	1,127,200	
アイチ　コーポレーション	800	739.00	591,200	
小森コーポレーション	1,200	683.00	819,600	
鶴見製作所	400	1,826.00	730,400	
住友精密工業	100	2,137.00	213,700	
日本ギア工業	200	282.00	56,400	
酒井重工業	100	2,030.00	203,000	
荏原製作所	2,000	2,570.00	5,140,000	
酉島製作所	500	834.00	417,000	
北越工業	500	1,033.00	516,500	
ダイキン工業	6,200	18,365.00	113,863,000	
オルガノ	200	5,600.00	1,120,000	
トーヨーカネツ	200	2,072.00	414,400	
栗田工業	2,600	2,993.00	7,781,800	
椿本チエイン	700	2,579.00	1,805,300	
大同工業	200	649.00	129,800	
木村化工機	400	415.00	166,000	
アネスト岩田	800	832.00	665,600	
ダイフク	2,500	10,190.00	25,475,000	
サムコ	100	2,940.00	294,000	
加藤製作所	300	1,204.00	361,200	
油研工業	100	1,481.00	148,100	

タダノ	2,400	891.00	2,138,400	
フジテック	1,800	1,923.00	3,461,400	
ＣＫＤ	1,300	2,045.00	2,658,500	
キトー	400	1,242.00	496,800	
平和	1,400	1,787.00	2,501,800	
理想科学工業	400	1,341.00	536,400	
ＳＡＮＫＹＯ	1,100	2,633.00	2,896,300	
日本金銭機械	500	571.00	285,500	
マースグループホールディングス	300	1,614.00	484,200	
フクシマガリレイ	300	3,265.00	979,500	
オーイズミ	200	382.00	76,400	
ダイコク電機	200	1,215.00	243,000	
竹内製作所	800	1,759.00	1,407,200	
アマノ	1,300	2,298.00	2,987,400	
ＪＵＫＩ	700	535.00	374,500	
サンデンホールディングス	600	302.00	181,200	
蛇の目ミシン工業	400	441.00	176,400	
マックス	700	1,513.00	1,059,100	
グローリー	1,200	2,493.00	2,991,600	
新晃工業	400	1,448.00	579,200	
大和冷機工業	700	943.00	660,100	
セガサミーホールディングス	4,800	1,311.00	6,292,800	
日本ピストンリング	200	1,191.00	238,200	
リケン	200	2,859.00	571,800	
ＴＰＲ	700	1,298.00	908,600	
ツバキ・ナカシマ	1,000	807.00	807,000	
ホシザキ	1,400	9,150.00	12,810,000	
大豊工業	400	530.00	212,000	
日本精工	9,200	786.00	7,231,200	
ＮＴＮ	11,300	212.00	2,395,600	
ジェイテクト	4,700	802.00	3,769,400	
不二越	500	3,315.00	1,657,500	
日本トムソン	1,400	335.00	469,000	
ＴＨＫ	2,800	2,719.00	7,613,200	
ユーシン精機	400	706.00	282,400	
前澤給装工業	200	2,017.00	403,400	
イーグル工業	600	703.00	421,800	
前澤工業	300	407.00	122,100	
日本ピラー工業	500	1,380.00	690,000	
キッツ	2,000	678.00	1,356,000	
マキタ	6,400	3,965.00	25,376,000	
日立造船	3,900	375.00	1,462,500	

三菱重工業	8,200	2,571.00	21,082,200	
ＩＨＩ	3,500	1,572.00	5,502,000	
スター精密	700	1,260.00	882,000	
日清紡ホールディングス	3,200	770.00	2,464,000	
イビデン	3,000	3,155.00	9,465,000	
コニカミノルタ	10,700	375.00	4,012,500	
ブラザー工業	6,000	1,861.00	11,166,000	
ミネベアミツミ	9,100	1,917.00	17,444,700	
日立製作所	23,500	3,391.00	79,688,500	
三菱電機	48,800	1,405.00	68,564,000	
富士電機	2,900	2,885.00	8,366,500	
東洋電機製造	200	1,190.00	238,000	
安川電機	5,300	4,040.00	21,412,000	
シンフォニアテクノロジー	600	1,027.00	616,200	
明電舎	900	1,603.00	1,442,700	
オリジン	100	1,339.00	133,900	
山洋電気	200	4,795.00	959,000	
デンヨー	400	1,990.00	796,000	
東芝テック	600	4,180.00	2,508,000	
芝浦メカトロニクス	100	2,822.00	282,200	
マブチモーター	1,400	3,325.00	4,655,000	
日本電産	11,800	7,074.00	83,473,200	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	300	418.00	125,400	
トレックス・セミコンダクター	300	1,234.00	370,200	
東光高岳	300	1,008.00	302,400	
ダブル・スコープ	800	782.00	625,600	
宮越ホールディングス	200	748.00	149,600	
ダイヘン	500	4,015.00	2,007,500	
ヤーマン	800	977.00	781,600	
ＪＶＣケンウッド	3,900	158.00	616,200	
ミマキエンジニアリング	400	382.00	152,800	
第一精工	200	2,064.00	412,800	
日新電機	1,100	1,030.00	1,133,000	
大崎電気工業	1,000	517.00	517,000	
オムロン	4,400	7,330.00	32,252,000	
日東工業	700	1,807.00	1,264,900	
ＩＤＥＣ	700	1,640.00	1,148,000	
正興電機製作所	100	958.00	95,800	
不二電機工業	100	1,340.00	134,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	1,600	1,838.00	2,940,800	
サクサホールディングス	100	1,566.00	156,600	
メルコホールディングス	200	3,275.00	655,000	

テクノメディカ	100	1,786.00	178,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	100	581.00	58,100	
日本電気	5,900	5,570.00	32,863,000	
富士通	4,700	12,980.00	61,006,000	
沖電気工業	2,000	1,065.00	2,130,000	
岩崎通信機	200	830.00	166,000	
電気興業	200	2,523.00	504,600	
サンケン電気	500	2,062.00	1,031,000	
ナカヨ	100	1,410.00	141,000	
アイホン	300	1,449.00	434,700	
ルネサスエレクトロニクス	23,400	598.00	13,993,200	
セイコーエプソン	6,100	1,207.00	7,362,700	
ワコム	3,300	577.00	1,904,100	
アルバック	900	3,265.00	2,938,500	
アクセル	200	761.00	152,200	
ＥＩＺＯ	400	4,110.00	1,644,000	
ジャパンディスプレイ	13,700	49.00	671,300	
日本信号	1,200	1,112.00	1,334,400	
京三製作所	1,100	551.00	606,100	
能美防災	600	2,024.00	1,214,400	
ホーチキ	300	1,220.00	366,000	
星和電機	200	616.00	123,200	
エレコム	500	5,410.00	2,705,000	
パナソニック	55,800	956.30	53,361,540	
シャープ	5,700	1,150.00	6,555,000	
アンリツ	3,100	2,505.00	7,765,500	
富士通ゼネラル	1,300	2,373.00	3,084,900	
ソニー	30,600	7,430.00	227,358,000	
ＴＤＫ	2,400	10,490.00	25,176,000	
帝国通信工業	200	1,185.00	237,000	
タムラ製作所	1,600	441.00	705,600	
アルプスアルパイン	4,300	1,393.00	5,989,900	
池上通信機	200	863.00	172,600	
日本電波工業	400	336.00	134,400	
鈴木	200	683.00	136,600	
日本トリム	100	3,270.00	327,000	
ローランド　ディー．ジー．	300	1,140.00	342,000	
フォスター電機	500	1,069.00	534,500	
ＳＭＫ	100	2,629.00	262,900	
ヨコオ	300	2,704.00	811,200	
ティアック	300	150.00	45,000	
ホシデン	1,300	932.00	1,211,600	

ヒロセ電機	800	11,840.00	9,472,000	
日本航空電子工業	1,100	1,459.00	1,604,900	
ＴＯＡ	500	743.00	371,500	
マクセルホールディングス	1,100	960.00	1,056,000	
古野電気	600	978.00	586,800	
ユニデンホールディングス	100	1,772.00	177,200	
スミダコーポレーション	400	721.00	288,400	
アイコム	300	2,981.00	894,300	
リオン	200	2,118.00	423,600	
本多通信工業	400	408.00	163,200	
船井電機	500	493.00	246,500	
横河電機	4,500	1,652.00	7,434,000	
新電元工業	200	2,112.00	422,400	
アズビル	3,100	3,390.00	10,509,000	
東亜ディーケーケー	200	853.00	170,600	
日本光電工業	2,000	3,580.00	7,160,000	
チノー	200	1,380.00	276,000	
共和電業	500	418.00	209,000	
日本電子材料	200	1,477.00	295,400	
堀場製作所	1,000	5,750.00	5,750,000	
アドバンテスト	3,600	6,820.00	24,552,000	
小野測器	200	517.00	103,400	
エスペック	400	1,763.00	705,200	
キーエンス	4,400	44,560.00	196,064,000	
日置電機	300	3,260.00	978,000	
シスメックス	3,500	8,012.00	28,042,000	
日本マイクロニクス	900	1,228.00	1,105,200	
メガチップス	500	1,998.00	999,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	300	3,375.00	1,012,500	
原田工業	200	935.00	187,000	
コーセル	600	860.00	516,000	
イリソ電子工業	400	3,240.00	1,296,000	
オプテックスグループ	800	1,217.00	973,600	
千代田インテグレ	200	1,603.00	320,600	
アイ・オー・データ機器	200	1,031.00	206,200	
レーザーテック	2,100	11,140.00	23,394,000	
スタンレー電気	3,400	2,582.00	8,778,800	
岩崎電気	200	1,877.00	375,400	
ウシオ電機	2,700	1,370.00	3,699,000	
岡谷電機産業	400	306.00	122,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	400	317.00	126,800	
エノモト	100	1,052.00	105,200	

日本セラミック	500	2,234.00	1,117,000	
遠藤照明	200	616.00	123,200	
古河電池	300	1,360.00	408,000	
双信電機	200	416.00	83,200	
山一電機	300	1,368.00	410,400	
図研	300	3,050.00	915,000	
日本電子	1,000	3,110.00	3,110,000	
カシオ計算機	4,300	1,850.00	7,955,000	
ファナック	4,600	19,320.00	88,872,000	
日本シイエムケイ	1,200	410.00	492,000	
エンプラス	200	2,345.00	469,000	
大真空	200	2,316.00	463,200	
ローム	2,200	7,100.00	15,620,000	
浜松ホトニクス	3,500	4,810.00	16,835,000	
三井ハイテック	500	1,690.00	845,000	
新光電気工業	1,600	1,626.00	2,601,600	
京セラ	6,900	5,755.00	39,709,500	
太陽誘電	2,200	3,395.00	7,469,000	
村田製作所	14,300	6,553.00	93,707,900	
双葉電子工業	800	960.00	768,000	
北陸電気工業	200	848.00	169,600	
ニチコン	1,700	700.00	1,190,000	
日本ケミコン	400	1,933.00	773,200	
ＫＯＡ	700	968.00	677,600	
市光工業	700	481.00	336,700	
小糸製作所	2,900	4,365.00	12,658,500	
ミツバ	900	399.00	359,100	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	900	5,290.00	4,761,000	
キヤノン電子	500	1,583.00	791,500	
キヤノン	26,300	2,085.00	54,835,500	
リコー	12,400	780.00	9,672,000	
象印マホービン	1,400	1,335.00	1,869,000	
東京エレクトロン	3,100	29,810.00	92,411,000	
トヨタ紡織	1,400	1,408.00	1,971,200	
芦森工業	100	1,001.00	100,100	
ユニプレス	1,000	890.00	890,000	
豊田自動織機	4,000	5,600.00	22,400,000	
モリタホールディングス	900	1,779.00	1,601,100	
三櫻工業	600	670.00	402,000	
デンソー	10,700	4,168.00	44,597,600	
東海理化電機製作所	1,300	1,499.00	1,948,700	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	1,800	432.00	777,600	

川崎重工業	3,800	1,559.00	5,924,200	
名村造船所	1,600	155.00	248,000	
サノヤスホールディングス	500	159.00	79,500	
日本車輌製造	200	2,443.00	488,600	
三菱ロジスネクスト	600	913.00	547,800	
近畿車輛	100	1,225.00	122,500	
日産自動車	57,600	391.20	22,533,120	
いすゞ自動車	14,100	949.70	13,390,770	
トヨタ自動車	54,500	6,728.00	366,676,000	
日野自動車	6,100	706.00	4,306,600	
三菱自動車工業	18,100	271.00	4,905,100	
エフテック	300	484.00	145,200	
レシップホールディングス	200	550.00	110,000	
ＧＭＢ	100	611.00	61,100	
ファルテック	100	694.00	69,400	
武蔵精密工業	1,100	886.00	974,600	
日産車体	1,000	899.00	899,000	
新明和工業	1,300	1,018.00	1,323,400	
極東開発工業	900	1,325.00	1,192,500	
日信工業	1,000	2,193.00	2,193,000	
トピー工業	400	1,165.00	466,000	
ティラド	200	1,281.00	256,200	
曙ブレーキ工業	2,600	172.00	447,200	
タチエス	800	863.00	690,400	
ＮＯＫ	2,600	1,315.00	3,419,000	
フタバ産業	1,400	441.00	617,400	
ＫＹＢ	600	1,977.00	1,186,200	
大同メタル工業	900	532.00	478,800	
プレス工業	2,400	284.00	681,600	
ミクニ	600	268.00	160,800	
太平洋工業	1,000	906.00	906,000	
ケーヒン	1,100	2,533.00	2,786,300	
河西工業	600	438.00	262,800	
アイシン精機	4,000	3,105.00	12,420,000	
マツダ	14,400	653.00	9,403,200	
今仙電機製作所	400	693.00	277,200	
本田技研工業	38,400	2,726.00	104,678,400	
スズキ	9,700	3,794.00	36,801,800	
ＳＵＢＡＲＵ	15,200	2,222.00	33,774,400	
安永	200	1,007.00	201,400	
ヤマハ発動機	6,400	1,642.00	10,508,800	
ショーワ	1,100	2,236.00	2,459,600	

ＴＢＫ	600	435.00	261,000	
エクセディ	700	1,530.00	1,071,000	
豊田合成	1,600	2,162.00	3,459,200	
愛三工業	800	510.00	408,000	
盟和産業	100	920.00	92,000	
日本プラスト	400	443.00	177,200	
ヨロズ	500	1,026.00	513,000	
エフ・シー・シー	800	1,808.00	1,446,400	
シマノ	1,800	21,520.00	38,736,000	
テイ・エス　テック	1,100	2,877.00	3,164,700	
ジャムコ	300	742.00	222,600	
テルモ	13,800	4,022.00	55,503,600	
クリエートメディック	100	983.00	98,300	
日機装	1,500	978.00	1,467,000	
日本エム・ディ・エム	300	1,570.00	471,000	
島津製作所	5,800	2,898.00	16,808,400	
ＪＭＳ	400	786.00	314,400	
クボテック	100	365.00	36,500	
長野計器	400	1,032.00	412,800	
ブイ・テクノロジー	200	3,870.00	774,000	
東京計器	300	941.00	282,300	
愛知時計電機	100	4,515.00	451,500	
インターアクション	300	1,927.00	578,100	
オーバル	400	219.00	87,600	
東京精密	900	3,465.00	3,118,500	
マニー	1,900	2,922.00	5,551,800	
ニコン	7,500	870.00	6,525,000	
トプコン	2,500	825.00	2,062,500	
オリンパス	27,000	1,990.50	53,743,500	
理研計器	400	2,361.00	944,400	
タムロン	400	1,760.00	704,000	
ＨＯＹＡ	9,700	10,730.00	104,081,000	
シード	200	724.00	144,800	
ノーリツ鋼機	300	1,614.00	484,200	
エー・アンド・デイ	400	676.00	270,400	
朝日インテック	5,500	3,045.00	16,747,500	
シチズン時計	5,700	339.00	1,932,300	
リズム時計工業	200	600.00	120,000	
大研医器	300	570.00	171,000	
メニコン	700	5,350.00	3,745,000	
松風	200	1,452.00	290,400	
セイコーホールディングス	700	1,618.00	1,132,600	

ニプロ	3,400	1,155.00	3,927,000	
中本パックス	100	1,518.00	151,800	
スノーピーク	200	1,260.00	252,000	
パラマウントベッドホールディングス	500	4,360.00	2,180,000	
トランザクション	300	1,079.00	323,700	
粧美堂	100	346.00	34,600	
ニホンフラッシュ	500	1,340.00	670,000	
前田工繊	500	2,523.00	1,261,500	
永大産業	600	299.00	179,400	
アートネイチャー	500	599.00	299,500	
バンダイナムコホールディングス	5,100	5,777.00	29,462,700	
アイフィスジャパン	100	728.00	72,800	
共立印刷	800	135.00	108,000	
ＳＨＯＥＩ	400	2,818.00	1,127,200	
フランスベッドホールディングス	700	822.00	575,400	
パイロットコーポレーション	800	3,330.00	2,664,000	
萩原工業	300	1,455.00	436,500	
トッパン・フォームズ	1,100	1,043.00	1,147,300	
フジシールインターナショナル	1,100	1,990.00	2,189,000	
タカラトミー	2,200	863.00	1,898,600	
廣済堂	300	771.00	231,300	
エステールホールディングス	100	618.00	61,800	
アーク	1,700	116.00	197,200	
タカノ	200	685.00	137,000	
プロネクサス	400	1,200.00	480,000	
ホクシン	300	120.00	36,000	
ウッドワン	200	1,151.00	230,200	
大建工業	300	1,766.00	529,800	
凸版印刷	6,900	1,710.00	11,799,000	
大日本印刷	6,400	2,421.00	15,494,400	
共同印刷	100	2,750.00	275,000	
ＮＩＳＳＨＡ	1,000	986.00	986,000	
光村印刷	100	1,509.00	150,900	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	200	2,095.00	419,000	
アシックス	4,000	1,238.00	4,952,000	
ツツミ	100	1,831.00	183,100	
小松ウオール工業	100	1,744.00	174,400	
ヤマハ	2,900	4,820.00	13,978,000	
河合楽器製作所	200	2,699.00	539,800	
クリナップ	500	566.00	283,000	
ピジョン	2,900	4,425.00	12,832,500	
オリバー	100	2,573.00	257,300	

キングジム	400	822.00	328,800	
リンテック	1,200	2,550.00	3,060,000	
イトーキ	1,000	339.00	339,000	
任天堂	3,000	49,630.00	148,890,000	
三菱鉛筆	800	1,256.00	1,004,800	
タカラスタンダード	1,000	1,505.00	1,505,000	
コクヨ	2,300	1,260.00	2,898,000	
ナカバヤシ	500	577.00	288,500	
グローブライド	200	2,085.00	417,000	
オカムラ	1,700	750.00	1,275,000	
美津濃	400	2,016.00	806,400	
東京電力ホールディングス	39,000	315.00	12,285,000	
中部電力	14,900	1,334.50	19,884,050	
関西電力	18,500	1,060.50	19,619,250	
中国電力	7,000	1,418.00	9,926,000	
北陸電力	4,500	667.00	3,001,500	
東北電力	12,200	1,001.00	12,212,200	
四国電力	4,400	775.00	3,410,000	
九州電力	10,100	885.00	8,938,500	
北海道電力	4,600	401.00	1,844,600	
沖縄電力	900	1,742.00	1,567,800	
電源開発	3,900	1,779.00	6,938,100	
エフオン	300	592.00	177,600	
イーレックス	700	1,462.00	1,023,400	
レノバ	800	965.00	772,000	
東京瓦斯	9,400	2,575.50	24,209,700	
大阪瓦斯	9,500	2,132.00	20,254,000	
東邦瓦斯	2,400	5,340.00	12,816,000	
北海道瓦斯	300	1,594.00	478,200	
広島ガス	1,000	352.00	352,000	
西部瓦斯	600	2,531.00	1,518,600	
静岡ガス	1,400	909.00	1,272,600	
メタウォーター	200	4,730.00	946,000	
ＳＢＳホールディングス	400	2,200.00	880,000	
東武鉄道	5,100	3,490.00	17,799,000	
相鉄ホールディングス	1,600	2,819.00	4,510,400	
東急	12,300	1,439.00	17,699,700	
京浜急行電鉄	6,300	1,595.00	10,048,500	
小田急電鉄	7,300	2,606.00	19,023,800	
京王電鉄	2,500	5,960.00	14,900,000	
京成電鉄	3,400	3,210.00	10,914,000	
富士急行	700	3,250.00	2,275,000	

新京成電鉄	100	2,225.00	222,500	
東日本旅客鉄道	8,600	7,235.00	62,221,000	
西日本旅客鉄道	4,400	5,677.00	24,978,800	
東海旅客鉄道	4,100	15,620.00	64,042,000	
西武ホールディングス	6,400	1,151.00	7,366,400	
鴻池運輸	800	1,114.00	891,200	
西日本鉄道	1,300	2,867.00	3,727,100	
ハマキョウレックス	400	3,170.00	1,268,000	
サカイ引越センター	300	5,290.00	1,587,000	
近鉄グループホールディングス	4,600	4,670.00	21,482,000	
阪急阪神ホールディングス	6,200	3,525.00	21,855,000	
南海電気鉄道	2,200	2,418.00	5,319,600	
京阪ホールディングス	2,100	4,700.00	9,870,000	
神戸電鉄	100	3,750.00	375,000	
名古屋鉄道	3,800	2,999.00	11,396,200	
山陽電気鉄道	300	2,186.00	655,800	
日本通運	1,600	5,540.00	8,864,000	
ヤマトホールディングス	8,100	2,771.00	22,445,100	
山九	1,300	3,995.00	5,193,500	
丸運	300	223.00	66,900	
丸全昭和運輸	400	3,040.00	1,216,000	
センコーグループホールディングス	2,500	803.00	2,007,500	
トナミホールディングス	100	5,520.00	552,000	
ニッコンホールディングス	1,700	2,080.00	3,536,000	
日本石油輸送	100	3,195.00	319,500	
福山通運	600	3,750.00	2,250,000	
セイノーホールディングス	3,500	1,390.00	4,865,000	
エスライン	100	937.00	93,700	
神奈川中央交通	100	4,090.00	409,000	
日立物流	800	2,835.00	2,268,000	
丸和運輸機関	500	3,255.00	1,627,500	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	500	1,562.00	781,000	
九州旅客鉄道	4,100	2,654.00	10,881,400	
ＳＧホールディングス	4,800	3,730.00	17,904,000	
日本郵船	3,900	1,490.00	5,811,000	
商船三井	2,900	1,996.00	5,788,400	
川崎汽船	1,400	1,065.00	1,491,000	
ＮＳユナイテッド海運	200	1,483.00	296,600	
明治海運	500	322.00	161,000	
飯野海運	2,200	342.00	752,400	
共栄タンカー	100	801.00	80,100	
乾汽船	300	787.00	236,100	

日本航空	8,200	1,971.00	16,162,200	
ＡＮＡホールディングス	8,500	2,448.00	20,808,000	
パスコ	100	1,473.00	147,300	
トランコム	100	7,260.00	726,000	
日新	400	1,500.00	600,000	
三菱倉庫	1,500	2,736.00	4,104,000	
三井倉庫ホールディングス	500	1,522.00	761,000	
住友倉庫	1,700	1,268.00	2,155,600	
澁澤倉庫	300	2,039.00	611,700	
東陽倉庫	800	318.00	254,400	
日本トランスシティ	1,000	474.00	474,000	
ケイヒン	100	1,295.00	129,500	
中央倉庫	300	950.00	285,000	
川西倉庫	100	1,019.00	101,900	
安田倉庫	400	879.00	351,600	
ファイズホールディングス	100	1,144.00	114,400	
東洋埠頭	100	1,365.00	136,500	
宇徳	400	484.00	193,600	
上組	2,600	2,071.00	5,384,600	
サンリツ	100	579.00	57,900	
キムラユニティー	100	1,046.00	104,600	
キユーソー流通システム	100	1,453.00	145,300	
近鉄エクスプレス	1,000	1,950.00	1,950,000	
東海運	200	273.00	54,600	
エーアイテイー	300	751.00	225,300	
内外トランスライン	200	1,000.00	200,000	
日本コンセプト	200	1,230.00	246,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	1,400	2,222.00	3,110,800	
クロスキャット	100	1,196.00	119,600	
システナ	1,700	1,400.00	2,380,000	
デジタルアーツ	200	8,570.00	1,714,000	
日鉄ソリューションズ	700	2,943.00	2,060,100	
キューブシステム	300	969.00	290,700	
エイジア	100	1,404.00	140,400	
コア	200	1,191.00	238,200	
ラクーンホールディングス	200	975.00	195,000	
ソリトンシステムズ	200	1,490.00	298,000	
ソフトクリエイトホールディングス	200	2,233.00	446,600	
ＴＩＳ	4,800	2,258.00	10,838,400	
ネオス	200	715.00	143,000	
電算システム	200	4,480.00	896,000	
グリー	2,900	464.00	1,345,600	

コーエーテクモホールディングス	1,000	3,545.00	3,545,000	
三菱総合研究所	200	4,305.00	861,000	
ボルテージ	100	479.00	47,900	
電算	100	2,150.00	215,000	
ＡＧＳ	300	801.00	240,300	
ファインデックス	400	936.00	374,400	
ブレインパッド	100	4,555.00	455,500	
ＫＬａｂ	900	740.00	666,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	600	864.00	518,400	
イーブックイニシアティブジャパン	100	3,165.00	316,500	
ネクソン	13,400	2,605.00	34,907,000	
アイスタイル	1,300	289.00	375,700	
エムアップホールディングス	100	2,526.00	252,600	
エイチーム	300	851.00	255,300	
エニグモ	400	1,257.00	502,800	
テクノスジャパン	400	784.00	313,600	
ｅｎｉｓｈ	300	848.00	254,400	
コロプラ	1,600	1,046.00	1,673,600	
オルトプラス	300	460.00	138,000	
ブロードリーフ	2,400	559.00	1,341,600	
クロス・マーケティンググループ	200	352.00	70,400	
デジタルハーツホールディングス	300	918.00	275,400	
システム情報	400	1,473.00	589,200	
メディアドゥ	200	4,410.00	882,000	
じげん	1,200	324.00	388,800	
ブイキューブ	300	1,252.00	375,600	
エンカレッジ・テクノロジ	100	851.00	85,100	
サイバーリンクス	100	2,168.00	216,800	
ディー・エル・イー	400	542.00	216,800	
フィックスターズ	500	1,253.00	626,500	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	200	1,269.00	253,800	
オプティム	300	3,510.00	1,053,000	
セレス	200	1,111.00	222,200	
ＳＨＩＦＴ	200	11,140.00	2,228,000	
ティーガイア	400	1,994.00	797,600	
セック	100	3,075.00	307,500	
日本アジアグループ	500	296.00	148,000	
テクマトリックス	700	1,891.00	1,323,700	
プロシップ	100	1,406.00	140,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,100	2,119.00	2,330,900	
GMOペイメントゲートウェイ	1,000	11,770.00	11,770,000	
ザッパラス	200	388.00	77,600	

システムリサーチ	100	1,988.00	198,800	
インターネットイニシアティブ	700	3,685.00	2,579,500	
さくらインターネット	500	637.00	318,500	
ヴィンクス	100	1,375.00	137,500	
GMOクラウド	100	9,120.00	912,000	
ＳＲＡホールディングス	200	2,334.00	466,800	
システムインテグレータ	200	1,054.00	210,800	
朝日ネット	300	1,165.00	349,500	
ｅＢＡＳＥ	600	1,317.00	790,200	
アバント	500	975.00	487,500	
アドソル日進	200	2,370.00	474,000	
フリービット	300	715.00	214,500	
コムチュア	500	2,705.00	1,352,500	
サイバーコム	100	1,820.00	182,000	
アステリア	300	513.00	153,900	
アイル	300	1,565.00	469,500	
マークラインズ	200	2,285.00	457,000	
メディカル・データ・ビジョン	400	1,252.00	500,800	
ｇｕｍｉ	600	1,007.00	604,200	
ショーケース	100	711.00	71,100	
モバイルファクトリー	100	1,026.00	102,600	
テラスカイ	200	2,830.00	566,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	200	1,370.00	274,000	
ＰＣＩホールディングス	200	1,147.00	229,400	
パイプドＨＤ	100	1,548.00	154,800	
アイビーシー	100	993.00	99,300	
ネオジャパン	100	2,297.00	229,700	
ランドコンピュータ	100	1,010.00	101,000	
ダブルスタンダード	100	5,620.00	562,000	
オープンドア	200	1,244.00	248,800	
マイネット	200	1,162.00	232,400	
アカツキ	200	4,020.00	804,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	100	2,123.00	212,300	
ＬＩＮＥ	1,100	5,480.00	6,028,000	
カナミックネットワーク	400	926.00	370,400	
ノムラシステムコーポレーション	200	339.00	67,800	
チェンジ	200	7,960.00	1,592,000	
シンクロ・フード	200	321.00	64,200	
オークネット	300	1,019.00	305,700	
セグエグループ	100	885.00	88,500	
エイトレッド	100	1,911.00	191,100	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	500	407.00	203,500	

マクロミル	1,000	726.00	726,000	
ビーグリー	100	1,932.00	193,200	
オロ	100	2,759.00	275,900	
テモナ	100	971.00	97,100	
ニーズウェル	100	741.00	74,100	
サインポスト	100	1,656.00	165,600	
ソルクシーズ	200	729.00	145,800	
フェイス	200	637.00	127,400	
プロトコーポレーション	400	953.00	381,200	
野村総合研究所	6,800	2,921.00	19,862,800	
サイバネットシステム	400	670.00	268,000	
ＣＥホールディングス	200	545.00	109,000	
日本システム技術	100	1,700.00	170,000	
インテージホールディングス	600	878.00	526,800	
東邦システムサイエンス	100	920.00	92,000	
ソースネクスト	2,300	284.00	653,200	
インフォコム	500	3,065.00	1,532,500	
ＨＥＲＯＺ	100	3,585.00	358,500	
ラクスル	400	3,015.00	1,206,000	
ＦＩＧ	500	272.00	136,000	
システムサポート	100	2,046.00	204,600	
イーソル	200	1,159.00	231,800	
アルテリア・ネットワークス	500	2,031.00	1,015,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	100	1,027.00	102,700	
トビラシステムズ	100	1,864.00	186,400	
フォーカスシステムズ	300	833.00	249,900	
クレスコ	300	1,352.00	405,600	
フジ・メディア・ホールディングス	4,600	989.00	4,549,400	
オービック	1,700	19,400.00	32,980,000	
ジャストシステム	800	7,720.00	6,176,000	
ＴＤＣソフト	400	927.00	370,800	
Ｚホールディングス	65,800	540.00	35,532,000	
トレンドマイクロ	2,100	6,140.00	12,894,000	
ＩＤホールディングス	200	1,371.00	274,200	
日本オラクル	1,000	13,290.00	13,290,000	
アルファシステムズ	100	3,865.00	386,500	
フューチャー	600	1,730.00	1,038,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	300	1,203.00	360,900	
ＳＢテクノロジー	200	3,675.00	735,000	
トーセ	100	939.00	93,900	
オービックビジネスコンサルタント	500	5,900.00	2,950,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	2,200	4,135.00	9,097,000	

アイティフォー	600	739.00	443,400	
東計電算	100	4,245.00	424,500	
エックスネット	100	978.00	97,800	
大塚商会	2,600	5,760.00	14,976,000	
サイボウズ	600	3,365.00	2,019,000	
ソフトブレーン	300	426.00	127,800	
電通国際情報サービス	300	5,000.00	1,500,000	
ＡＣＣＥＳＳ	500	967.00	483,500	
デジタルガレージ	900	3,535.00	3,181,500	
ＥＭシステムズ	700	976.00	683,200	
ウェザーニューズ	200	3,500.00	700,000	
ＣＩＪ	300	791.00	237,300	
日本エンタープライズ	500	264.00	132,000	
ＷＯＷＯＷ	200	2,440.00	488,000	
スカラ	300	664.00	199,200	
インテリジェント　ウェイブ	300	812.00	243,600	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	400	383.00	153,200	
ネットワンシステムズ	1,800	3,575.00	6,435,000	
システムソフト	900	97.00	87,300	
アルゴグラフィックス	400	3,300.00	1,320,000	
マーベラス	700	700.00	490,000	
エイベックス	800	872.00	697,600	
日本ユニシス	1,500	3,320.00	4,980,000	
兼松エレクトロニクス	300	4,015.00	1,204,500	
東京放送ホールディングス	2,900	1,653.00	4,793,700	
日本テレビホールディングス	4,000	1,160.00	4,640,000	
朝日放送グループホールディングス	500	737.00	368,500	
テレビ朝日ホールディングス	1,300	1,532.00	1,991,600	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	3,100	415.00	1,286,500	
テレビ東京ホールディングス	400	2,324.00	929,600	
日本ＢＳ放送	200	1,085.00	217,000	
ビジョン	400	671.00	268,400	
スマートバリュー	100	1,157.00	115,700	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	200	1,304.00	260,800	
ワイヤレスゲート	200	760.00	152,000	
コネクシオ	300	1,420.00	426,000	
日本通信	3,700	227.00	839,900	
クロップス	100	716.00	71,600	
日本電信電話	64,000	2,486.00	159,104,000	
ＫＤＤＩ	34,900	3,259.00	113,739,100	
ソフトバンク	43,500	1,386.00	60,291,000	
光通信	500	23,590.00	11,795,000	

ＮＴＴドコモ	34,300	2,925.00	100,327,500	
エムティーアイ	500	813.00	406,500	
GMOインターネット	1,900	3,075.00	5,842,500	
ファイバーゲート	200	1,555.00	311,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	100	458.00	45,800	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	1,300	2,329.00	3,027,700	
学研ホールディングス	600	1,461.00	876,600	
ゼンリン	1,000	1,161.00	1,161,000	
昭文社ホールディングス	200	431.00	86,200	
インプレスホールディングス	400	148.00	59,200	
アイネット	200	1,515.00	303,000	
松竹	300	14,630.00	4,389,000	
東宝	2,800	3,685.00	10,318,000	
東映	200	14,420.00	2,884,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	12,700	1,171.00	14,871,700	
ピー・シー・エー	100	4,370.00	437,000	
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,200.00	240,000	
ＤＴＳ	1,100	2,195.00	2,414,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,000	5,490.00	10,980,000	
シーイーシー	500	1,706.00	853,000	
カプコン	2,300	4,095.00	9,418,500	
アイ・エス・ビー	100	2,144.00	214,400	
ジャステック	300	1,267.00	380,100	
ＳＣＳＫ	1,100	5,180.00	5,698,000	
日本システムウエア	200	1,981.00	396,200	
アイネス	500	1,355.00	677,500	
ＴＫＣ	400	5,970.00	2,388,000	
富士ソフト	600	4,425.00	2,655,000	
ＮＳＤ	1,500	1,939.00	2,908,500	
コナミホールディングス	1,700	3,365.00	5,720,500	
福井コンピュータホールディングス	200	2,680.00	536,000	
ＪＢＣＣホールディングス	300	1,430.00	429,000	
ミロク情報サービス	400	2,232.00	892,800	
ソフトバンクグループ	38,000	6,019.00	228,722,000	
ホウスイ	100	895.00	89,500	
高千穂交易	200	920.00	184,000	
伊藤忠食品	100	4,975.00	497,500	
エレマテック	500	833.00	416,500	
ＪＡＬＵＸ	100	1,723.00	172,300	
あらた	400	4,645.00	1,858,000	
トーメンデバイス	100	3,625.00	362,500	
東京エレクトロン　デバイス	200	3,740.00	748,000	

フィールズ	400	341.00	136,400	
双日	26,600	233.00	6,197,800	
アルフレッサ　ホールディングス	5,300	2,168.00	11,490,400	
横浜冷凍	1,300	882.00	1,146,600	
神栄	100	513.00	51,300	
ラサ商事	300	928.00	278,400	
アルコニックス	500	1,226.00	613,000	
神戸物産	1,700	6,560.00	11,152,000	
ハイパー	100	590.00	59,000	
あい　ホールディングス	700	1,520.00	1,064,000	
ディーブイエックス	200	888.00	177,600	
ダイワボウホールディングス	400	7,200.00	2,880,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	1,100	1,493.00	1,642,300	
ラクト・ジャパン	200	3,425.00	685,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	900	1,027.00	924,300	
八洲電機	400	923.00	369,200	
メディアスホールディングス	300	873.00	261,900	
レスターホールディングス	500	2,035.00	1,017,500	
ジューテックホールディングス	100	1,034.00	103,400	
大光	200	662.00	132,400	
ＯＣＨＩホールディングス	100	1,492.00	149,200	
ＴＯＫＡＩホールディングス	2,500	994.00	2,485,000	
黒谷	100	539.00	53,900	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	100	738.00	73,800	
三洋貿易	500	975.00	487,500	
ビューティガレージ	100	2,133.00	213,300	
ウイン・パートナーズ	300	923.00	276,900	
ミタチ産業	100	570.00	57,000	
シップヘルスケアホールディングス	800	4,560.00	3,648,000	
明治電機工業	200	1,374.00	274,800	
デリカフーズホールディングス	200	617.00	123,400	
スターティアホールディングス	100	614.00	61,400	
コメダホールディングス	1,100	1,831.00	2,014,100	
アセンテック	100	3,765.00	376,500	
富士興産	200	429.00	85,800	
小野建	400	1,195.00	478,000	
南陽	100	1,568.00	156,800	
佐鳥電機	300	798.00	239,400	
エコートレーディング	100	551.00	55,100	
伯東	300	951.00	285,300	
コンドーテック	400	1,149.00	459,600	
中山福	300	454.00	136,200	

ナガイレーベン	600	2,641.00	1,584,600	
三菱食品	500	2,675.00	1,337,500	
松田産業	300	1,361.00	408,300	
第一興商	700	3,140.00	2,198,000	
メディパルホールディングス	5,200	1,980.00	10,296,000	
ＳＰＫ	200	1,300.00	260,000	
萩原電気ホールディングス	200	2,034.00	406,800	
アズワン	300	11,380.00	3,414,000	
スズデン	200	1,216.00	243,200	
尾家産業	100	1,310.00	131,000	
シモジマ	300	1,185.00	355,500	
ドウシシャ	400	1,625.00	650,000	
小津産業	100	1,739.00	173,900	
高速	300	1,423.00	426,900	
たけびし	200	1,437.00	287,400	
リックス	100	1,622.00	162,200	
丸文	400	553.00	221,200	
ハピネット	400	1,106.00	442,400	
橋本総業ホールディングス	100	2,044.00	204,400	
日本ライフライン	1,400	1,315.00	1,841,000	
タカショー	300	489.00	146,700	
マルカ	200	1,831.00	366,200	
ＩＤＯＭ	1,300	499.00	648,700	
進和	300	1,948.00	584,400	
エスケイジャパン	100	289.00	28,900	
ダイトロン	200	1,527.00	305,400	
シークス	600	956.00	573,600	
田中商事	200	696.00	139,200	
オーハシテクニカ	200	1,564.00	312,800	
白銅	200	1,384.00	276,800	
伊藤忠商事	33,600	2,307.50	77,532,000	
丸紅	50,000	482.90	24,145,000	
高島	100	1,788.00	178,800	
長瀬産業	2,700	1,300.00	3,510,000	
蝶理	300	1,716.00	514,800	
豊田通商	5,400	2,696.00	14,558,400	
三共生興	700	431.00	301,700	
兼松	1,800	1,256.00	2,260,800	
ツカモトコーポレーション	100	1,125.00	112,500	
三井物産	41,600	1,574.00	65,478,400	
日本紙パルプ商事	300	3,755.00	1,126,500	
カメイ	600	1,000.00	600,000	

東都水産	100	3,325.00	332,500	
ＯＵＧホールディングス	100	2,606.00	260,600	
スターゼン	200	4,025.00	805,000	
山善	1,900	900.00	1,710,000	
椿本興業	100	3,320.00	332,000	
住友商事	30,300	1,233.50	37,375,050	
内田洋行	200	6,310.00	1,262,000	
三菱商事	31,500	2,276.50	71,709,750	
第一実業	200	3,660.00	732,000	
キヤノンマーケティングジャパン	1,200	2,153.00	2,583,600	
西華産業	300	1,221.00	366,300	
佐藤商事	400	859.00	343,600	
菱洋エレクトロ	500	3,190.00	1,595,000	
東京産業	400	513.00	205,200	
ユアサ商事	500	2,904.00	1,452,000	
神鋼商事	100	1,841.00	184,100	
トルク	300	287.00	86,100	
阪和興業	900	1,966.00	1,769,400	
正栄食品工業	300	4,015.00	1,204,500	
カナデン	400	1,237.00	494,800	
菱電商事	300	1,422.00	426,600	
フルサト工業	300	1,355.00	406,500	
岩谷産業	1,100	3,755.00	4,130,500	
ナイス	200	860.00	172,000	
昭光通商	200	601.00	120,200	
ニチモウ	100	1,896.00	189,600	
極東貿易	100	1,287.00	128,700	
イワキ	600	510.00	306,000	
三愛石油	1,200	928.00	1,113,600	
稲畑産業	1,100	1,314.00	1,445,400	
ＧＳＩクレオス	100	1,192.00	119,200	
明和産業	400	455.00	182,000	
クワザワ	200	527.00	105,400	
ヤマエ久野	300	1,248.00	374,400	
ワキタ	1,000	927.00	927,000	
東邦ホールディングス	1,500	1,875.00	2,812,500	
サンゲツ	1,300	1,481.00	1,925,300	
ミツウロコグループホールディングス	700	1,139.00	797,300	
シナネンホールディングス	200	2,638.00	527,600	
伊藤忠エネクス	1,100	849.00	933,900	
サンリオ	1,300	1,654.00	2,150,200	
サンワテクノス	300	872.00	261,600	

リョーサン	500	2,192.00	1,096,000	
新光商事	800	832.00	665,600	
トーホー	200	1,859.00	371,800	
三信電気	300	1,606.00	481,800	
東陽テクニカ	500	973.00	486,500	
モスフードサービス	600	2,845.00	1,707,000	
加賀電子	500	1,983.00	991,500	
ソーダニッカ	500	512.00	256,000	
立花エレテック	300	1,740.00	522,000	
フォーバル	200	990.00	198,000	
ＰＡＬＴＡＣ	800	4,830.00	3,864,000	
三谷産業	600	340.00	204,000	
太平洋興発	200	620.00	124,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	100	2,157.00	215,700	
国際紙パルプ商事	1,100	284.00	312,400	
ヤマタネ	200	1,176.00	235,200	
日鉄物産	300	3,395.00	1,018,500	
泉州電業	100	2,733.00	273,300	
トラスコ中山	1,000	2,741.00	2,741,000	
オートバックスセブン	1,800	1,357.00	2,442,600	
モリト	400	671.00	268,400	
加藤産業	700	3,360.00	2,352,000	
北恵	100	945.00	94,500	
イノテック	200	973.00	194,600	
イエローハット	900	1,503.00	1,352,700	
ＪＫホールディングス	400	783.00	313,200	
日伝	400	2,201.00	880,400	
北沢産業	400	280.00	112,000	
杉本商事	300	1,788.00	536,400	
因幡電機産業	1,400	2,437.00	3,411,800	
東テク	200	2,216.00	443,200	
ミスミグループ本社	6,000	2,686.00	16,116,000	
アルテック	400	238.00	95,200	
タキヒヨー	100	1,865.00	186,500	
蔵王産業	100	1,429.00	142,900	
スズケン	2,000	3,745.00	7,490,000	
ジェコス	300	861.00	258,300	
グローセル	500	419.00	209,500	
ローソン	1,200	5,440.00	6,528,000	
サンエー	400	4,005.00	1,602,000	
カワチ薬品	400	2,870.00	1,148,000	
エービーシー・マート	800	6,100.00	4,880,000	

ハードオフコーポレーション	200	683.00	136,600	
アスクル	500	3,490.00	1,745,000	
ゲオホールディングス	900	1,373.00	1,235,700	
アダストリア	700	1,595.00	1,116,500	
ジーフット	300	506.00	151,800	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	100	474.00	47,400	
くら寿司	300	5,270.00	1,581,000	
キャンドゥ	200	2,063.00	412,600	
パルグループホールディングス	500	1,232.00	616,000	
エディオン	2,200	1,058.00	2,327,600	
サーラコーポレーション	1,000	586.00	586,000	
ワッツ	200	1,056.00	211,200	
ハローズ	200	3,400.00	680,000	
フジオフードグループ本社	400	1,332.00	532,800	
あみやき亭	100	2,950.00	295,000	
ひらまつ	800	170.00	136,000	
大黒天物産	100	5,300.00	530,000	
ハニーズホールディングス	400	1,118.00	447,200	
ファーマライズホールディングス	100	684.00	68,400	
アルペン	400	1,698.00	679,200	
ハブ	100	597.00	59,700	
クオールホールディングス	700	1,097.00	767,900	
ジンズホールディングス	200	7,540.00	1,508,000	
ビックカメラ	2,900	1,151.00	3,337,900	
ＤＣＭホールディングス	2,700	1,312.00	3,542,400	
ペッパーフードサービス	400	572.00	228,800	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	3,400	4,620.00	15,708,000	
東京一番フーズ	100	514.00	51,400	
ＤＤホールディングス	200	797.00	159,400	
きちりホールディングス	100	587.00	58,700	
アークランドサービスホールディングス	400	1,883.00	753,200	
Ｊ．フロント　リテイリング	5,700	685.00	3,904,500	
ドトール・日レスホールディングス	700	1,717.00	1,201,900	
マツモトキヨシホールディングス	2,000	3,935.00	7,870,000	
ブロンコビリー	200	2,308.00	461,600	
ＺＯＺＯ	3,300	2,459.00	8,114,700	
トレジャー・ファクトリー	200	803.00	160,600	
物語コーポレーション	100	8,050.00	805,000	
ココカラファイン	500	5,980.00	2,990,000	
三越伊勢丹ホールディングス	8,400	613.00	5,149,200	
Ｈａｍｅｅ	200	1,840.00	368,000	
ウエルシアホールディングス	1,400	8,910.00	12,474,000	

クリエイトＳＤホールディングス	800	3,345.00	2,676,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	600	403.00	241,800	
ミサワ	100	658.00	65,800	
ティーライフ	100	1,092.00	109,200	
エー・ピーカンパニー	100	433.00	43,300	
チムニー	200	1,266.00	253,200	
シュッピン	300	711.00	213,300	
オイシックス・ラ・大地	500	2,065.00	1,032,500	
ネクステージ	700	915.00	640,500	
ジョイフル本田	1,400	1,450.00	2,030,000	
鳥貴族	100	1,513.00	151,300	
キリン堂ホールディングス	200	2,529.00	505,800	
ホットランド	300	1,106.00	331,800	
すかいらーくホールディングス	5,400	1,622.00	8,758,800	
ＳＦＰホールディングス	300	1,482.00	444,600	
綿半ホールディングス	200	1,890.00	378,000	
ヨシックス	100	1,866.00	186,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,400	1,277.00	1,787,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	517.00	103,400	
ＢＥＥＮＯＳ	200	1,143.00	228,600	
あさひ	400	1,563.00	625,200	
日本調剤	300	1,691.00	507,300	
コスモス薬品	400	17,150.00	6,860,000	
トーエル	200	701.00	140,200	
オンリー	100	580.00	58,000	
セブン&アイ・ホールディングス	18,800	3,425.00	64,390,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	2,600	649.00	1,687,400	
ツルハホールディングス	1,000	14,900.00	14,900,000	
サンマルクホールディングス	400	1,590.00	636,000	
フェリシモ	100	1,096.00	109,600	
トリドールホールディングス	1,200	1,203.00	1,443,600	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	400	376.00	150,400	
ウイルプラスホールディングス	100	621.00	62,100	
ＪＭホールディングス	400	3,385.00	1,354,000	
サツドラホールディングス	100	1,980.00	198,000	
アレンザホールディングス	200	1,106.00	221,200	
串カツ田中ホールディングス	100	1,630.00	163,000	
バロックジャパンリミテッド	300	647.00	194,100	
クスリのアオキホールディングス	400	9,740.00	3,896,000	
力の源ホールディングス	200	679.00	135,800	
スシローグローバルホールディングス	2,600	2,514.00	6,536,400	

ＬＩＸＩＬビバ	500	2,596.00	1,298,000	
メディカルシステムネットワーク	500	501.00	250,500	
はるやまホールディングス	200	729.00	145,800	
ノジマ	800	2,644.00	2,115,200	
カッパ・クリエイト	700	1,383.00	968,100	
ライトオン	400	619.00	247,600	
ジーンズメイト	100	226.00	22,600	
良品計画	6,400	1,438.00	9,203,200	
三城ホールディングス	500	292.00	146,000	
アドヴァン	700	1,302.00	911,400	
アルビス	200	2,230.00	446,000	
コナカ	600	303.00	181,800	
ハウス　オブ　ローゼ	100	1,601.00	160,100	
Ｇ－７ホールディングス	300	2,417.00	725,100	
イオン北海道	600	821.00	492,600	
コジマ	800	545.00	436,000	
ヒマラヤ	200	824.00	164,800	
コーナン商事	700	3,465.00	2,425,500	
エコス	200	2,067.00	413,400	
ワタミ	600	888.00	532,800	
マルシェ	100	506.00	50,600	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	10,600	2,422.00	25,673,200	
西松屋チェーン	1,100	1,079.00	1,186,900	
ゼンショーホールディングス	2,300	2,144.00	4,931,200	
幸楽苑ホールディングス	300	1,512.00	453,600	
ハークスレイ	100	1,012.00	101,200	
サイゼリヤ	700	1,975.00	1,382,500	
ＶＴホールディングス	2,000	357.00	714,000	
魚力	100	1,604.00	160,400	
ポプラ	100	401.00	40,100	
フジ・コーポレーション	100	1,982.00	198,200	
ユナイテッドアローズ	500	1,615.00	807,500	
ハイデイ日高	700	1,556.00	1,089,200	
京都きもの友禅	300	256.00	76,800	
コロワイド	1,600	1,406.00	2,249,600	
ピーシーデポコーポレーション	600	697.00	418,200	
壱番屋	300	4,795.00	1,438,500	
トップカルチャー	200	351.00	70,200	
ＰＬＡＮＴ	100	640.00	64,000	
スギホールディングス	1,000	7,390.00	7,390,000	
薬王堂ホールディングス	200	2,727.00	545,400	
ヴィア・ホールディングス	600	349.00	209,400	

スクロール	700	438.00	306,600	
ヨンドシーホールディングス	500	1,667.00	833,500	
ファミリーマート	3,800	1,754.00	6,665,200	
木曽路	600	2,351.00	1,410,600	
ＳＲＳホールディングス	600	878.00	526,800	
千趣会	900	347.00	312,300	
タカキュー	300	131.00	39,300	
リテールパートナーズ	600	1,855.00	1,113,000	
ケーヨー	1,000	749.00	749,000	
上新電機	600	2,083.00	1,249,800	
日本瓦斯	800	4,605.00	3,684,000	
ロイヤルホールディングス	800	1,762.00	1,409,600	
いなげや	600	1,711.00	1,026,600	
島忠	900	2,994.00	2,694,600	
チヨダ	500	1,131.00	565,500	
ライフコーポレーション	400	3,725.00	1,490,000	
リンガーハット	600	2,252.00	1,351,200	
ＭｒＭａｘＨＤ	700	645.00	451,500	
テンアライド	500	370.00	185,000	
ＡＯＫＩホールディングス	1,000	596.00	596,000	
オークワ	800	1,512.00	1,209,600	
コメリ	700	2,736.00	1,915,200	
青山商事	1,000	662.00	662,000	
しまむら	600	7,190.00	4,314,000	
はせがわ	200	316.00	63,200	
高島屋	3,500	822.00	2,877,000	
松屋	1,000	670.00	670,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	2,300	703.00	1,616,900	
近鉄百貨店	200	2,999.00	599,800	
丸井グループ	4,400	1,802.00	7,928,800	
アクシアル　リテイリング	400	4,440.00	1,776,000	
井筒屋	300	175.00	52,500	
イオン	18,500	2,533.50	46,869,750	
イズミ	1,000	3,345.00	3,345,000	
平和堂	1,000	1,877.00	1,877,000	
フジ	600	1,807.00	1,084,200	
ヤオコー	600	7,850.00	4,710,000	
ゼビオホールディングス	600	809.00	485,400	
ケーズホールディングス	4,600	1,391.00	6,398,600	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	200	883.00	176,600	
日産東京販売ホールディングス	600	253.00	151,800	
シルバーライフ	100	2,150.00	215,000	

Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	200	3,590.00	718,000	
ナルミヤ・インターナショナル	100	605.00	60,500	
ブックオフグループホールディングス	300	792.00	237,600	
アインホールディングス	600	6,880.00	4,128,000	
元気寿司	100	2,275.00	227,500	
ヤマダ電機	14,600	506.00	7,387,600	
アークランドサカモト	800	1,812.00	1,449,600	
ニトリホールディングス	2,100	22,325.00	46,882,500	
グルメ杵屋	300	935.00	280,500	
愛眼	400	227.00	90,800	
ケーユーホールディングス	300	826.00	247,800	
吉野家ホールディングス	1,600	2,134.00	3,414,400	
松屋フーズホールディングス	200	3,570.00	714,000	
サガミホールディングス	600	1,208.00	724,800	
関西スーパーマーケット	400	1,112.00	444,800	
王将フードサービス	400	5,810.00	2,324,000	
プレナス	500	1,773.00	886,500	
ミニストップ	400	1,435.00	574,000	
アークス	1,000	2,473.00	2,473,000	
バローホールディングス	1,100	2,180.00	2,398,000	
藤久	100	1,073.00	107,300	
ベルク	200	7,680.00	1,536,000	
大庄	200	1,203.00	240,600	
ファーストリテイリング	600	62,130.00	37,278,000	
サンドラッグ	1,800	3,540.00	6,372,000	
サックスバー　ホールディングス	400	557.00	222,800	
ヤマザワ	100	1,736.00	173,600	
やまや	100	2,137.00	213,700	
ベルーナ	1,000	637.00	637,000	
いちご	6,100	254.00	1,549,400	
日本駐車場開発	4,700	138.00	648,600	
スター・マイカ・ホールディングス	200	1,473.00	294,600	
ＡＤワークスグループ	800	173.00	138,400	
ヒューリック	10,300	980.00	10,094,000	
三栄建築設計	200	1,413.00	282,600	
野村不動産ホールディングス	2,900	1,923.00	5,576,700	
三重交通グループホールディングス	1,000	467.00	467,000	
サムティ	700	1,276.00	893,200	
ディア・ライフ	700	491.00	343,700	
コーセーアールイー	100	530.00	53,000	
日本商業開発	300	1,509.00	452,700	
プレサンスコーポレーション	800	1,195.00	956,000	

ＴＨＥグローバル社	200	222.00	44,400	
ハウスコム	100	1,279.00	127,900	
日本管理センター	300	1,060.00	318,000	
サンセイランディック	100	792.00	79,200	
エストラスト	100	658.00	65,800	
フージャースホールディングス	1,000	528.00	528,000	
オープンハウス	1,400	3,735.00	5,229,000	
東急不動産ホールディングス	13,100	464.00	6,078,400	
飯田グループホールディングス	4,000	1,724.00	6,896,000	
イーグランド	100	696.00	69,600	
ムゲンエステート	300	498.00	149,400	
ビーロット	200	623.00	124,600	
ファーストブラザーズ	100	775.00	77,500	
ハウスドゥ	200	883.00	176,600	
シーアールイー	100	1,580.00	158,000	
プロパティエージェント	100	1,027.00	102,700	
ケイアイスター不動産	100	1,789.00	178,900	
アグレ都市デザイン	100	506.00	50,600	
グッドコムアセット	100	1,569.00	156,900	
ジェイ・エス・ビー	100	2,745.00	274,500	
テンポイノベーション	100	667.00	66,700	
グローバル・リンク・マネジメント	100	628.00	62,800	
パーク２４	2,600	1,773.00	4,609,800	
パラカ	100	1,625.00	162,500	
三井不動産	23,700	1,857.00	44,010,900	
三菱地所	33,700	1,576.50	53,128,050	
平和不動産	900	2,941.00	2,646,900	
東京建物	5,100	1,203.00	6,135,300	
ダイビル	1,200	1,015.00	1,218,000	
京阪神ビルディング	800	1,354.00	1,083,200	
住友不動産	10,800	2,781.00	30,034,800	
テーオーシー	900	662.00	595,800	
東京楽天地	100	4,125.00	412,500	
レオパレス２１	6,300	186.00	1,171,800	
スターツコーポレーション	600	2,163.00	1,297,800	
フジ住宅	500	522.00	261,000	
空港施設	500	411.00	205,500	
明和地所	300	394.00	118,200	
ゴールドクレスト	400	1,400.00	560,000	
エスリード	200	1,345.00	269,000	
日神グループホールディングス	700	361.00	252,700	
日本エスコン	900	802.00	721,800	

タカラレーベン	2,200	355.00	781,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	300	884.00	265,200	
イオンモール	2,400	1,333.00	3,199,200	
毎日コムネット	100	809.00	80,900	
ファースト住建	200	938.00	187,600	
ランド	26,100	10.00	261,000	
カチタス	1,200	2,625.00	3,150,000	
トーセイ	700	894.00	625,800	
穴吹興産	100	1,465.00	146,500	
サンフロンティア不動産	700	835.00	584,500	
エフ・ジェー・ネクスト	400	859.00	343,600	
インテリックス	100	462.00	46,200	
ランドビジネス	100	350.00	35,000	
サンネクスタグループ	100	1,032.00	103,200	
グランディハウス	400	375.00	150,000	
日本空港ビルデング	1,500	4,505.00	6,757,500	
日本工営	300	2,950.00	885,000	
ＬＩＦＵＬＬ	1,600	419.00	670,400	
ジェイエイシーリクルートメント	300	1,124.00	337,200	
日本M&Aセンター	3,500	5,010.00	17,535,000	
メンバーズ	100	1,431.00	143,100	
中広	100	543.00	54,300	
ＵＴグループ	700	2,591.00	1,813,700	
アイティメディア	200	1,843.00	368,600	
タケエイ	400	1,000.00	400,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	100	1,878.00	187,800	
ビーネックスグループ	600	947.00	568,200	
コシダカホールディングス	1,100	399.00	438,900	
アルトナー	100	886.00	88,600	
パソナグループ	500	1,178.00	589,000	
ＣＤＳ	100	1,200.00	120,000	
リンクアンドモチベーション	1,000	367.00	367,000	
ＧＣＡ	600	594.00	356,400	
エス・エム・エス	1,400	2,333.00	3,266,200	
サニーサイドアップグループ	100	698.00	69,800	
パーソルホールディングス	4,700	1,450.00	6,815,000	
リニカル	200	803.00	160,600	
クックパッド	1,600	318.00	508,800	
エスクリ	100	349.00	34,900	
アイ・ケイ・ケイ	200	551.00	110,200	
学情	200	1,110.00	222,000	
スタジオアリス	200	1,525.00	305,000	

シミックホールディングス	200	1,387.00	277,400	
エプコ	100	1,195.00	119,500	
ＮＪＳ	100	1,738.00	173,800	
綜合警備保障	1,900	5,010.00	9,519,000	
カカクコム	3,400	2,660.00	9,044,000	
アイロムグループ	200	2,578.00	515,600	
セントケア・ホールディング	300	419.00	125,700	
サイネックス	100	742.00	74,200	
ルネサンス	300	942.00	282,600	
ディップ	700	2,108.00	1,475,600	
デジタルホールディングス	200	1,469.00	293,800	
新日本科学	500	632.00	316,000	
ツクイ	1,100	512.00	563,200	
キャリアデザインセンター	100	871.00	87,100	
ベネフィット・ワン	1,700	2,167.00	3,683,900	
エムスリー	10,300	4,860.00	50,058,000	
ツカダ・グローバルホールディング	300	286.00	85,800	
ブラス	100	501.00	50,100	
アウトソーシング	2,700	630.00	1,701,000	
ウェルネット	500	645.00	322,500	
ワールドホールディングス	100	1,565.00	156,500	
ディー・エヌ・エー	2,000	1,320.00	2,640,000	
博報堂ＤＹホールディングス	6,500	1,219.00	7,923,500	
ぐるなび	800	722.00	577,600	
タカミヤ	500	541.00	270,500	
ジャパンベストレスキューシステム	400	818.00	327,200	
ファンコミュニケーションズ	1,300	438.00	569,400	
ライク	100	1,304.00	130,400	
ビジネス・ブレークスルー	200	375.00	75,000	
エスプール	1,200	684.00	820,800	
ＷＤＢホールディングス	200	2,659.00	531,800	
ティア	300	506.00	151,800	
ＣＤＧ	100	1,600.00	160,000	
バリューコマース	300	2,948.00	884,400	
インフォマート	5,100	744.00	3,794,400	
ＪＰホールディングス	1,500	266.00	399,000	
エコナックホールディングス	800	93.00	74,400	
ＥＰＳホールディングス	600	1,013.00	607,800	
レッグス	100	873.00	87,300	
プレステージ・インターナショナル	1,700	851.00	1,446,700	
アミューズ	300	2,252.00	675,600	
ドリームインキュベータ	100	1,317.00	131,700	

クイック	300	1,140.00	342,000	
ＴＡＣ	300	197.00	59,100	
ケネディクス	4,300	512.00	2,201,600	
電通グループ	4,800	2,548.00	12,230,400	
テイクアンドギヴ・ニーズ	200	573.00	114,600	
ぴあ	100	3,090.00	309,000	
イオンファンタジー	200	1,495.00	299,000	
シーティーエス	500	906.00	453,000	
ネクシィーズグループ	100	955.00	95,500	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	1,300	2,584.00	3,359,200	
アルプス技研	400	1,866.00	746,400	
サニックス	800	281.00	224,800	
ダイオーズ	100	996.00	99,600	
日本空調サービス	500	725.00	362,500	
オリエンタルランド	5,000	14,120.00	70,600,000	
ダスキン	1,200	2,702.00	3,242,400	
明光ネットワークジャパン	600	826.00	495,600	
ファルコホールディングス	300	1,528.00	458,400	
秀英予備校	100	428.00	42,800	
田谷	100	530.00	53,000	
ラウンドワン	1,300	757.00	984,100	
リゾートトラスト	2,100	1,349.00	2,832,900	
ビー・エム・エル	600	2,730.00	1,638,000	
ワタベウェディング	100	295.00	29,500	
りらいあコミュニケーションズ	800	1,032.00	825,600	
リソー教育	2,100	304.00	638,400	
早稲田アカデミー	200	939.00	187,800	
ユー・エス・エス	5,200	1,709.00	8,886,800	
東京個別指導学院	200	500.00	100,000	
サイバーエージェント	2,900	5,970.00	17,313,000	
楽天	21,700	992.00	21,526,400	
クリーク・アンド・リバー社	200	1,081.00	216,200	
テー・オー・ダブリュー	700	340.00	238,000	
山田コンサルティンググループ	300	1,234.00	370,200	
セントラルスポーツ	200	2,184.00	436,800	
フルキャストホールディングス	500	1,369.00	684,500	
エン・ジャパン	800	2,651.00	2,120,800	
テクノプロ・ホールディングス	900	5,820.00	5,238,000	
アトラ	100	231.00	23,100	
インターワークス	100	346.00	34,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	200	11,440.00	2,288,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	200	1,773.00	354,600	

ファーストロジック	100	615.00	61,500	
三機サービス	100	932.00	93,200	
Ｇｕｎｏｓｙ	300	927.00	278,100	
デザインワン・ジャパン	100	288.00	28,800	
イー・ガーディアン	200	2,979.00	595,800	
リブセンス	300	288.00	86,400	
ジャパンマテリアル	1,400	1,733.00	2,426,200	
ベクトル	600	881.00	528,600	
ウチヤマホールディングス	200	301.00	60,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	400	770.00	308,000	
ライクキッズ	100	1,003.00	100,300	
キャリアリンク	100	724.00	72,400	
ＩＢＪ	300	679.00	203,700	
アサンテ	200	1,452.00	290,400	
Ｎ・フィールド	300	524.00	157,200	
バリューＨＲ	200	1,375.00	275,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	400	4,120.00	1,648,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	200	2,505.00	501,000	
ＥＲＩホールディングス	100	642.00	64,200	
アビスト	100	2,666.00	266,600	
シグマクシス	300	1,587.00	476,100	
ウィルグループ	300	648.00	194,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	600	204.00	122,400	
リクルートホールディングス	33,400	3,630.00	121,242,000	
エラン	300	1,708.00	512,400	
土木管理総合試験所	200	417.00	83,400	
ネットマーケティング	200	630.00	126,000	
ベルシステム２４ホールディングス	800	1,409.00	1,127,200	
鎌倉新書	300	1,055.00	316,500	
ＳＭＮ	100	1,093.00	109,300	
一蔵	100	394.00	39,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	200	2,297.00	459,400	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	100	614.00	61,400	
エアトリ	200	1,185.00	237,000	
アトラエ	100	3,105.00	310,500	
ストライク	200	5,170.00	1,034,000	
ソラスト	1,300	1,061.00	1,379,300	
セラク	200	1,110.00	222,000	
インソース	200	2,642.00	528,400	
ベイカレント・コンサルティング	300	9,190.00	2,757,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	100	1,648.00	164,800	
アイモバイル	200	699.00	139,800	

キャリアインデックス	200	482.00	96,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	100	777.00	77,700	
船場	100	1,036.00	103,600	
グレイステクノロジー	200	5,670.00	1,134,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	500	3,610.00	1,805,000	
フルテック	100	1,309.00	130,900	
グリーンズ	100	463.00	46,300	
ツナググループ・ホールディングス	100	426.00	42,600	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	100	579.00	57,900	
ソウルドアウト	100	2,669.00	266,900	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	100	566.00	56,600	
ミダック	100	1,684.00	168,400	
日総工産	300	644.00	193,200	
キュービーネットホールディングス	200	1,965.00	393,000	
ＲＰＡホールディングス	300	748.00	224,400	
スプリックス	100	699.00	69,900	
マネジメントソリューションズ	200	1,267.00	253,400	
プロレド・パートナーズ	100	5,300.00	530,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	100	951.00	95,100	
カーブスホールディングス	1,300	583.00	757,900	
フォーラムエンジニアリング	200	748.00	149,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	200	807.00	161,400	
リログループ	2,600	1,999.00	5,197,400	
東祥	300	1,247.00	374,100	
エイチ・アイ・エス	700	1,638.00	1,146,600	
ラックランド	100	2,094.00	209,400	
共立メンテナンス	800	3,545.00	2,836,000	
イチネンホールディングス	500	1,210.00	605,000	
建設技術研究所	300	1,784.00	535,200	
スペース	300	917.00	275,100	
長大	200	1,085.00	217,000	
燦ホールディングス	200	1,203.00	240,600	
東京テアトル	200	1,205.00	241,000	
タナベ経営	100	1,283.00	128,300	
ナガワ	200	7,330.00	1,466,000	
よみうりランド	100	3,525.00	352,500	
東京都競馬	300	4,100.00	1,230,000	
常磐興産	200	1,400.00	280,000	
カナモト	800	2,379.00	1,903,200	
東京ドーム	1,900	725.00	1,377,500	
西尾レントオール	400	2,233.00	893,200	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	2,700	32.00	86,400	

トランス・コスモス	400	2,362.00	944,800	
乃村工藝社	2,000	885.00	1,770,000	
藤田観光	200	1,560.00	312,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	300	959.00	287,700	
日本管財	500	1,884.00	942,000	
トーカイ	500	2,322.00	1,161,000	
セコム	5,000	9,396.00	46,980,000	
セントラル警備保障	200	3,960.00	792,000	
丹青社	900	724.00	651,600	
メイテック	600	5,080.00	3,048,000	
応用地質	500	1,435.00	717,500	
船井総研ホールディングス	1,000	2,363.00	2,363,000	
進学会ホールディングス	200	460.00	92,000	
オオバ	300	609.00	182,700	
いであ	100	1,988.00	198,800	
学究社	100	1,118.00	111,800	
ベネッセホールディングス	1,600	2,834.00	4,534,400	
イオンディライト	600	2,887.00	1,732,200	
ナック	300	881.00	264,300	
ニチイ学館	700	1,591.00	1,113,700	
ダイセキ	800	2,551.00	2,040,800	
ステップ	200	1,533.00	306,600	
合　　計	4,060,100		9,687,624,120	

(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

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年 7月31日現在です。

【上場インデックスファンドＴＯＰＩＸ　Ｅｘ－Ｆｉｎａｎｃｉａｌｓ】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	17,853,208,840円
Ⅱ　負債総額	68,196,534円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	17,785,012,306円
Ⅳ　発行済口数	13,371,514口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1,330.1円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換

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

（２）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

①　譲渡制限はありません。

②　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た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。

③　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7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7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7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7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			839	204,546
	株式投資信託		785	174,234
		単位型	270	10,792
		追加型	515	163,441
	公社債投資信託		54	30,312
		単位型	41	1,466
		追加型	13	28,845

3【委託会社等の経理状況】

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第61期事業年度（2019年４月１日から2020年３月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第60期 (2019年３月31日)		第61期 (2020年３月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金	※3	20,680		24,591
有価証券		1		19
前払費用		495		603
未収入金		38		14
未収委託者報酬		16,867		16,912
未収収益	※3	618	※3	1,412
関係会社短期貸付金		2,408		2,371
立替金		791		1,437
その他	※2	869	※2	1,316
流動資産合計		42,769		48,679
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	136	※1	182
器具備品	※1	137	※1	135
有形固定資産合計		274		318
無形固定資産				
ソフトウエア		107		120
無形固定資産合計		107		120
投資その他の資産				
投資有価証券		16,755		17,826
関係会社株式		25,769		25,769
長期差入保証金		447		484

繰延税金資産	1,913	2,022
投資その他の資産合計	44,886	46,102
固定資産合計	45,268	46,540
資産合計	88,038	95,220

（単位：百万円）

		第60期 (2019年３月31日)		第61期 (2020年３月31日)
負債の部				
流動負債				
預り金		354		554
未払金		6,112		5,881
未払収益分配金		7		8
未払償還金		71		71
未払手数料	※3	5,299		5,202
その他未払金		734		599
未払費用	※3	3,897	※3	4,289
未払法人税等		2,382		1,439
未払消費税等	※4	621	※4	746
賞与引当金		2,680		2,718
役員賞与引当金		210		55
その他	※3	172		42
流動負債合計		16,431		15,726
固定負債				
退職給付引当金		1,405		1,395
その他		629		695
固定負債合計		2,035		2,091
負債合計		18,466		17,818
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		47,142		55,395
利益剰余金合計		47,142		55,395
自己株式		△833		△905
株主資本合計		68,891		77,073
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		493		△60
繰延ヘッジ損益		185		389
評価・換算差額等合計		679		329
純資産合計		69,571		77,402
負債純資産合計		88,038		95,220

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第60期 (自　2018年４月１日 至　2019年３月31日)	第61期 (自　2019年４月１日 至　2020年３月31日)
営業収益		
委託者報酬	77,264	74,265
その他営業収益	3,063	2,994
営業収益合計	80,328	77,259
営業費用		
支払手数料	32,834	31,322
広告宣伝費	960	953
公告費	2	2
調査費	18,251	17,275
調査費	890	920
委託調査費	17,333	16,333
図書費	27	21
委託計算費	541	534
営業雑経費	794	1,058
通信費	128	116
印刷費	334	337
協会費	69	52
諸会費	19	10
その他	243	541
営業費用計	53,385	51,148
一般管理費		
給料	9,783	9,857
役員報酬	241	360
役員賞与引当金繰入額	210	55
給料・手当	6,589	6,675
賞与	61	64
賞与引当金繰入額	2,680	2,702
交際費	92	92
寄付金	13	29
旅費交通費	476	420
租税公課	428	440
不動産賃借料	888	901
退職給付費用	378	387
退職金	52	82
固定資産減価償却費	108	118
福利費	1,071	1,014
諸経費	3,106	3,229
一般管理費計	16,401	16,573
営業利益	10,540	9,538

（単位：百万円）

	第60期 (自　2018年４月１日 至　2019年３月31日)	第61期 (自　2019年４月１日 至　2020年３月31日)
営業外収益		
受取利息	37	99

受取配当金	※１	1,865	※１	4,881
有価証券償還益		1		－
デリバティブ収益	※１	142		223
時効成立分配金・償還金		21		1
為替差益		58		5
その他		48		145
営業外収益合計		2,176		5,357
営業外費用				
支払利息	※１	286		185
有価証券償還損		－		0
時効成立後支払分配金・償還金		78		1
その他		24		12
営業外費用合計		388		199
経常利益		12,328		14,695
特別利益				
投資有価証券売却益		218		164
特別利益合計		218		164
特別損失				
投資有価証券売却損		176		19
投資有価証券評価損		－		21
固定資産処分損		0		0
役員退職一時金		180		－
特別損失合計		357		41
税引前当期純利益		12,189		14,818
法人税、住民税及び事業税		3,741		3,307
法人税等調整額		△375		45
法人税等合計		3,366		3,353
当期純利益		8,823		11,465

（３）【株主資本等変動計算書】

第60期（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 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

第61期（自　2019年４月１日　至　2020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	47,142	47,142	△833	68,891
当期変動額							
剰余金の配当				△3,212	△3,212		△3,212
当期純利益				11,465	11,465		11,465
自己株式の取得						△71	△71
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	－	－	－	8,252	8,252	△71	8,181
当期末残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	△905	77,073

	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
当期変動額				
剰余金の配当				△3,212
当期純利益				11,465
自己株式の取得				△71
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△553	204	△349	△349
当期変動額合計	△553	204	△349	7,831
当期末残高	△60	389	329	77,402

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
１　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①　子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②　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 (2) デリバティブ 時価法
２　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物　３年～15年 器具備品　３年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウエア(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。
３　引当金の計上基準	(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。 (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。 (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。 ①　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。 ②　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。

4　ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (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。 (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。 (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。
5　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

（未適用の会計基準等）

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

（１）　概要
収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。
ステップ１：顧客との契約を識別する。
ステップ２：契約における履行義務を識別する。
ステップ３：取引価格を算定する。
ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。
ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

（２）　適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

（３）　当該会計基準等の適用による影響
影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

第60期 (2019年３月31日)	第61期 (2020年３月31日)
※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,281百万円 器具備品　655百万円	※１　有形固定資産の減価償却累計額 建物　1,311百万円 器具備品　707百万円
※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。	※２　信託資産 流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。

※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金　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	※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) 未収収益　151百万円 (流動負債) 未払費用　623百万円
※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。	※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。
※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。	※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365百万円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

第60期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　1,831百万円 デリバティブ収益　54百万円 支払利息　75百万円	※１　各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　4,849百万円

（株主資本等変動計算書関係）

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

第61期（自　2019年４月１日　至　2020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）	1,365,700	88,800	―	1,454,500

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	1,171,500	―	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	―	871,200	1,184,700	―
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	―	2,272,000	1,346,000	―
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	―	1,417,000	2,394,000	―
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	―	1,417,000	2,939,000	―
合計		15,088,300	―	7,224,600	7,863,700	―

(注) 1　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。
2　2011年度ストックオプション(1)1,184,700株、2016年度ストックオプション(1)881,000株及び2016年度ストックオプション(2)804,000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)465,000株、2016年度ストックオプション(2)1,590,000株及び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
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
2020年６月12日取締役会	普通株式	利益剰余金	2,862	14.64	2020年３月31日	2020年７月１日

(リース取引関係)

第60期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）		第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	
オペレーティング・リース取引		オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料		解約不能のものに係る未経過リース料	
１年内	853百万円	１年内	912百万円
１年超	6,704百万円	１年超	6,148百万円
合計	7,558百万円	合計	7,060百万円

（金融商品関係）

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

１ 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4　ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

① 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。

② 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、バリュー・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。

③ 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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債

権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「４　ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

① 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。

② 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、バリュー・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。

③ 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

2020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	24,591	24,591	－
(2) 未収委託者報酬	16,912	16,912	－
(3) 未収収益	1,412	1,412	－
(4) 関係会社短期貸付金	2,371	2,371	－
(5) 有価証券及び投資有価証券			

その他有価証券	17,828	17,828	－
(6) 未払金	(5,881)	(5,881)	－
(7) 未払費用	(4,289)	(4,289)	－
(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	(25)	(25)	－
ヘッジ会計が適用されているもの	167	167	－
デリバティブ取引計	142	142	－

(※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15百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、41百万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167百万円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、「(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	24,591	－	－	－
未収委託者報酬	16,912	－	－	－
未収収益	1,412	－	－	－
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	19	149	8,709	29
合計	42,936	149	8,709	29

（有価証券関係）
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・フローを見積もること等ができず、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・フローを見積もること等ができず、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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020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・フローを見積もること等ができず、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	5,381	4,912	469
	小計	5,381	4,912	469
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	12,447	13,003	△556
	小計	12,447	13,003	△556
合計		17,828	17,915	△86

(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。当事業年度において、有価証券について21百万円（その他有価証券の投資信託）減損処理を行っております。
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	2,230	164	19
合計	2,230	164	19

（デリバティブ取引関係）
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。

第61期(2020年３月31日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	1,913	－	△41	△41
	買建	－	－	－	－
合計		1,913	－	△41	△41

(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	1,808	－	15	15
合計		1,808	－	15	15

(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		3,427	－	20
	豪ドル		48	－	9
	シンガポールドル		944	－	58
	香港ドル		529	－	2
	人民元		2,017	－	76
	ユーロ		70	－	1
合計			7,038	－	167

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

（持分法損益等）

第60期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	第61期 （自　2019年４月１日 至　2020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　3,010	(1)関連会社に対する投資の金額　3,002
(2)持分法を適用した場合の投資の金額　10,668	(2)持分法を適用した場合の投資の金額　10,485
(3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　1,704	(3)持分法を適用した場合の投資利益の金額　1,631

（退職給付関係）

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	0.1%

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。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020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	1,411
勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の発生額	△31
退職給付の支払額	△164
退職給付債務の期末残高	1,363

（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	1,363
未積立退職給付債務	1,363
未認識数理計算上の差異	31
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の費用処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用	154

（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、233百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

1　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年２月８日	2010年８月20日

権利確定条件	2012年１月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の２分の１、４分の１、４分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年１月22日から 2020年１月21日まで	同左

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員　31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員　36名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　4,409,000株	普通株式　4,422,000株
付与日	2017年４月27日	2018年４月27日

権利確定条件	2019年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① 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。

②　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　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額　　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。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

１　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員　271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員　48名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　19,724,100株	普通株式　1,702,800株
付与日	2010年２月８日	2010年８月20日
権利確定条件	2012年１月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の２分の１、４分の１、４分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年１月22日から 2020年１月21日まで	同左

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員　31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員　36名
株式の種類別のストックオプションの付与数　(注)	普通株式　4,409,000株	普通株式　4,422,000株
付与日	2017年４月27日	2018年４月27日

権利確定条件	2019年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年４月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から１年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から２年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の３分の１、３分の１、３分の１ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から２年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① 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	1,171,500	75,900
付与	0	0
失効	1,171,500	75,900
権利確定	0	0
権利未確定残	―	―
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	2,055,900	3,618,000
付与	0	0
失効	871,200	2,272,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,184,700	1,346,000
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	3,811,000	4,356,000
付与	0	0
失効	1,417,000	1,417,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,394,000	2,939,000
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。

②　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（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
２　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額　　1,633百万円
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60期 (2019年３月31日)	第61期 (2020年３月31日)

1　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
	（単位：百万円）
繰延税金資産	
賞与引当金	820
投資有価証券評価損	96
関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	430
固定資産減価償却費	103
その他	761
繰延税金資産小計	3,643
評価性引当金	△1,430
繰延税金資産合計	2,212
繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	217
繰延ヘッジ利益	81
繰延税金負債合計	299
繰延税金資産の純額	1,913

1　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
	（単位：百万円）
繰延税金資産	
賞与引当金	822
投資有価証券評価損	102
関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	427
固定資産減価償却費	96
その他	744
繰延税金資産小計	3,624
評価性引当金	△1,430
繰延税金資産合計	2,194
繰延税金負債	
繰延ヘッジ利益	172
繰延税金負債合計	172
繰延税金資産の純額	2,022

2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%
（調整）	
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%

2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%
受取配当金等永久に益金に参入されない項目	△9.6%
その他	1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.6%

（関連当事者情報）

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)
							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)	―	―

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	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2019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	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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020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(米国ドル貸建)(注1)	―	関係会社短期貸付金	1,793 (USD 16,500 千)
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注1)	86 (USD 798千)	未収収益	13 (USD 122 千)
							資金の貸付(円貨建)(注1)	―	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貨建)(注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 2)	アセットマネジメント業	直接 100.00	―	配当の受取	1,526 (USD 14,000 千)	―	―
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	1,550 (百万円)	アセットマネジメント業	直接 100.00	―	配当の受取	2,700	―	―

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

1　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。

2　Nikko AM Americas Holding Co., 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。

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）

(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2019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	28,121百万円
負債合計	5,242百万円
純資産合計	22,879百万円

営業収益	14,853百万円
税引前当期純利益	4,354百万円
当期純利益	3,194百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

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

関連情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

１　製品及びサービスごとの情報

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

２　地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

１　製品及びサービスごとの情報

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

２　地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020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。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020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。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020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60期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
１株当たり純資産額	355円59銭	395円50銭
１株当たり当期純利益金額	45円08銭	58円61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60期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	第61期 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）
当期純利益（百万円）	8,823	11,465
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）	8,823	11,465
普通株式の期中平均株式数（千株）	195,677	195,599

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) 1,171,500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	2011年度ストックオプション(1) 1,184,700株、2016年度ストックオプション（1）1,346,000株、2016年度ストックオプション（2）2,394,000株、2017年度ストックオプション（1）2,939,000株

３　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期 (2019年３月31日)	第61期 (2020年３月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	69,571	77,402
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）	69,571	77,402
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）	195,647	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）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

（４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

（５）上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

（１）定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（２）訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名　　称	資本金の額 （2020年3月末現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

＜再信託受託会社の概要＞

名称　　：株式会社日本カストディ銀行
資本金の額　：51,000百万円（2020年7月27日現在）
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（株式会社日本カストディ銀行）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 （2020年3月末現在）	事業の内容
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,500百万円	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。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	
ＪＰモルガン証券株式会社	73,272百万円	
シティグループ証券株式会社	96,307百万円 (2019年12月末現在)	
大和証券株式会社	100,000百万円	
野村證券株式会社	10,000百万円	
ＢＮＰパリバ証券株式会社	102,025百万円	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
メリルリンチ日本証券株式会社	83,140百万円	
モルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券株式会社	62,149百万円	

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などの管理・計算事務・収益分配金および償還金の支払いなどを行ないます。

（２）販売会社
日本におけるファンドの募集の取扱い、解約および買取りに関する業務などを行ないます。

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。

① 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

② ファンドの基本的性格など

③ 委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

④ 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

⑤ 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。

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 「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。

⑤ 「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。

⑥ 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。

⑦ 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。

⑧ 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

⑨ 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。

⑩ 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。

⑪ 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。

⑫ 委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。

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

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

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

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

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

① 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。

② 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。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2020年６月８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
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　貞 廣 篤 典

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　竹 内 知 明

監査意見
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。
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2020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、全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。

監査意見の根拠
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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任
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。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象

や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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.ＸＢＲＬ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８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

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　佐々木　貴司

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　榊原　康太

監査意見

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」に掲げられている上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financialsの2020年１月９日から2020年７月８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。

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、上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financialsの2020年７月８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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、日興アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

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.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。