

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年2月5日提出
【計算期間】	第17期(自 2019年11月7日至 2020年11月6日)
【ファンド名】	インデックスファンド日本株式（DC専用）
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 安倍 秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

インデックス型

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

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株 中小型株	年2回	日本		
	年4回	北米		日経225
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)			
社債		アジア		
その他債券	年12回			TOPIX
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
	日々	中南米		
不動産投信			ファンド・オブ・ファンズ	
	その他 ()	アフリカ		その他 ()
その他資産 (投資信託証券(株式一般))		中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（株式 一般））

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

主として、「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」に投資を行ない、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

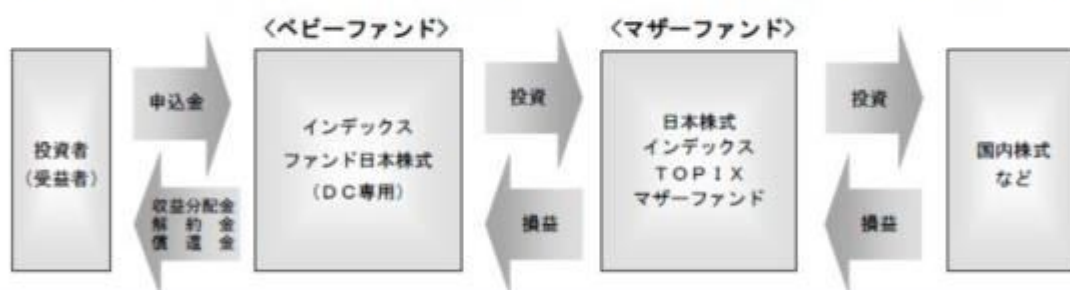
「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」の組入比率は高位を保つことを原則とします。また、購入・換金動向に応じて有価証券指数先物取引などを活用し、組入比率を調整することがあります。

ただし、資金動向、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。

※当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。購入申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて購入の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

《ファンドの仕組み》

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



主な投資制限

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

分配方針

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

信託金限度額

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

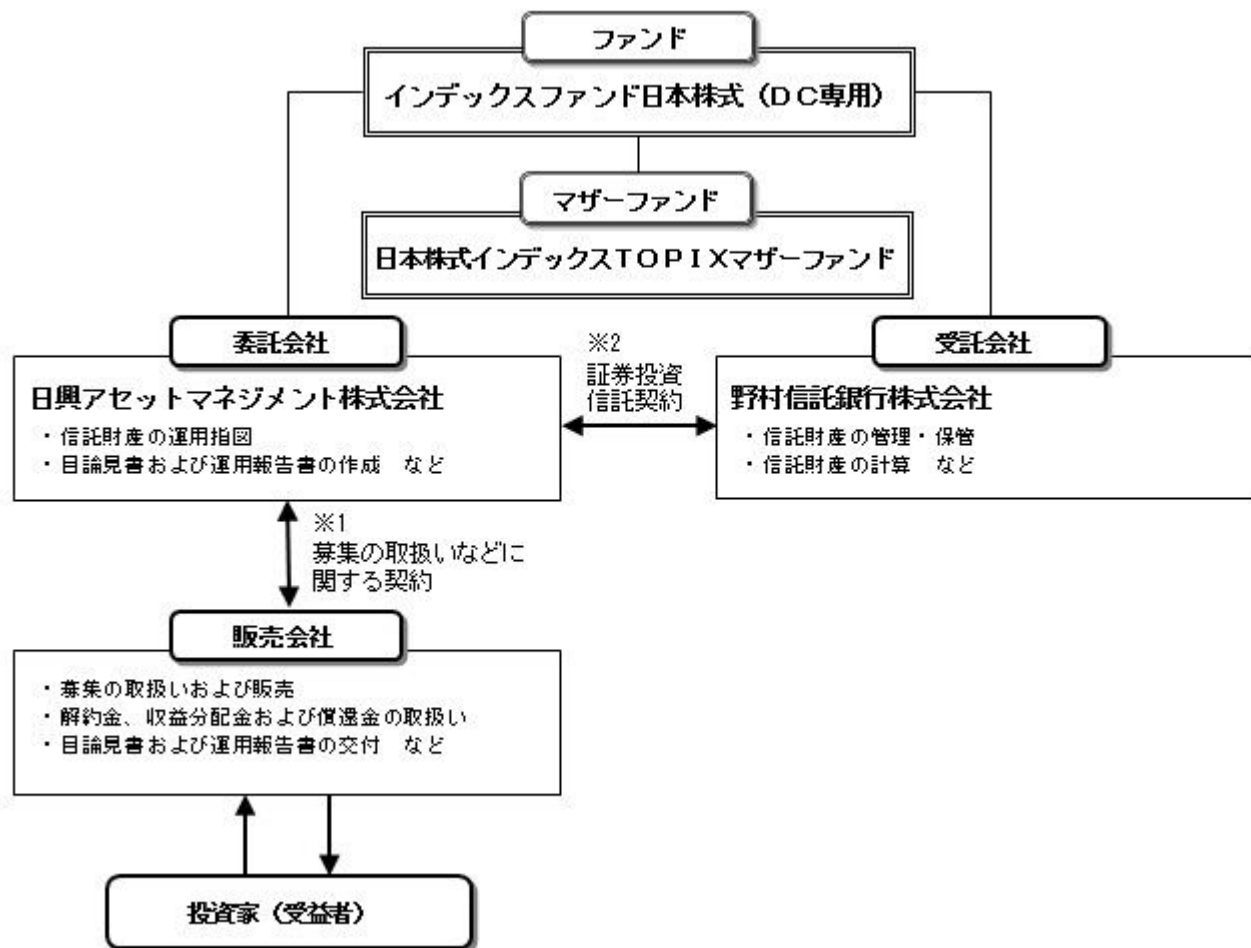
(2) 【ファンドの沿革】

2003年11月 7日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2020年11月末現在）

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・主として、「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券に投資を行ない、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ・マザーファンド受益証券の組入比率は高位を保つことを原則とします。また、設定・解約動向に応じて有価証券指数先物取引などを活用し、組入比率を調整することがあります。

- ・株式以外の資産への実質投資割合(マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。)は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

<インデックスファンド日本株式(DC専用)>

「日本株式インデックストップIXマザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。

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

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

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

6) 公社債の空売

7) 公社債の借入

投資対象とするマザーファンドの概要

< 日本株式インデックスT O P I Xマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X（東証株価指数） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・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。 ・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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

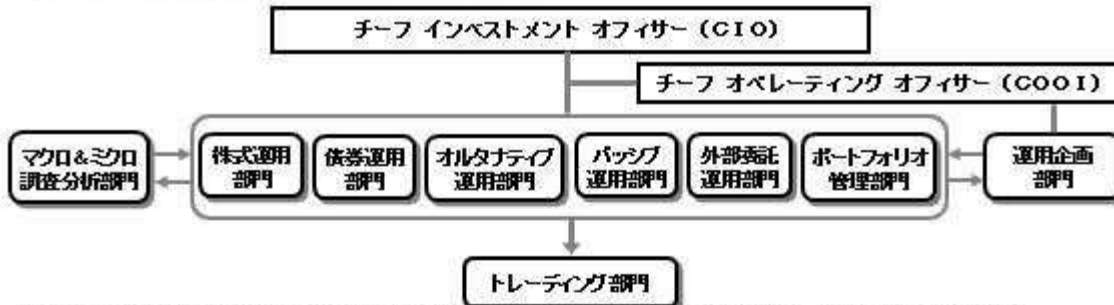
* T O P I X（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。

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

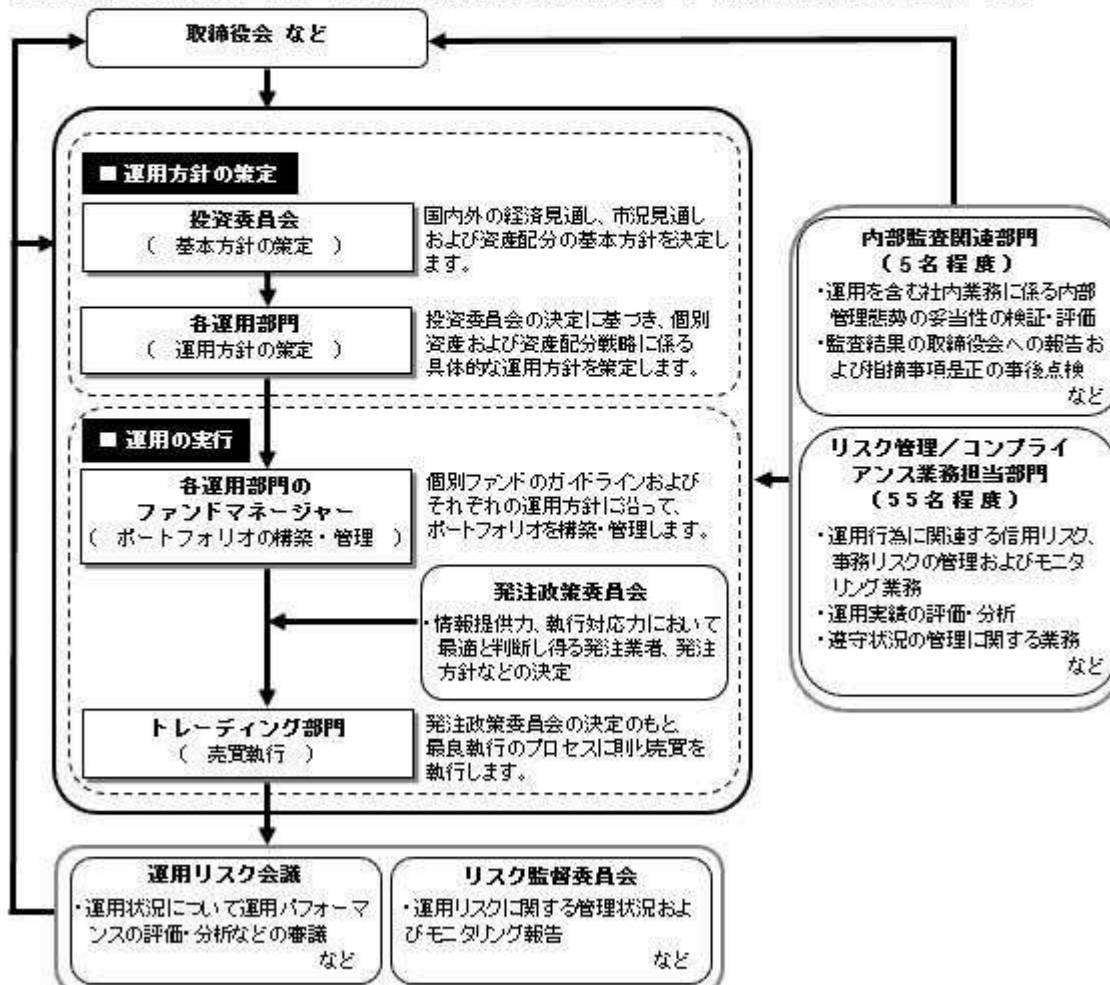
すべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

<インデックスファンド日本株式（DC専用）>

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

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

3) 外貨建資産への投資は行ないません。

4) 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。

- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 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。
- 11) 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。
- 12) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
 - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
 - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が弁済される日からその翌営業日までとします。
- 13) 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。
- 14) 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。

<日本株式インデックストップIXマザーファンド>

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)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。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 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。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 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。
- 11) 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。
- 12) 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。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

3【投資リスク】

（１）ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

< T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

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

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

< その他の留意事項 >

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

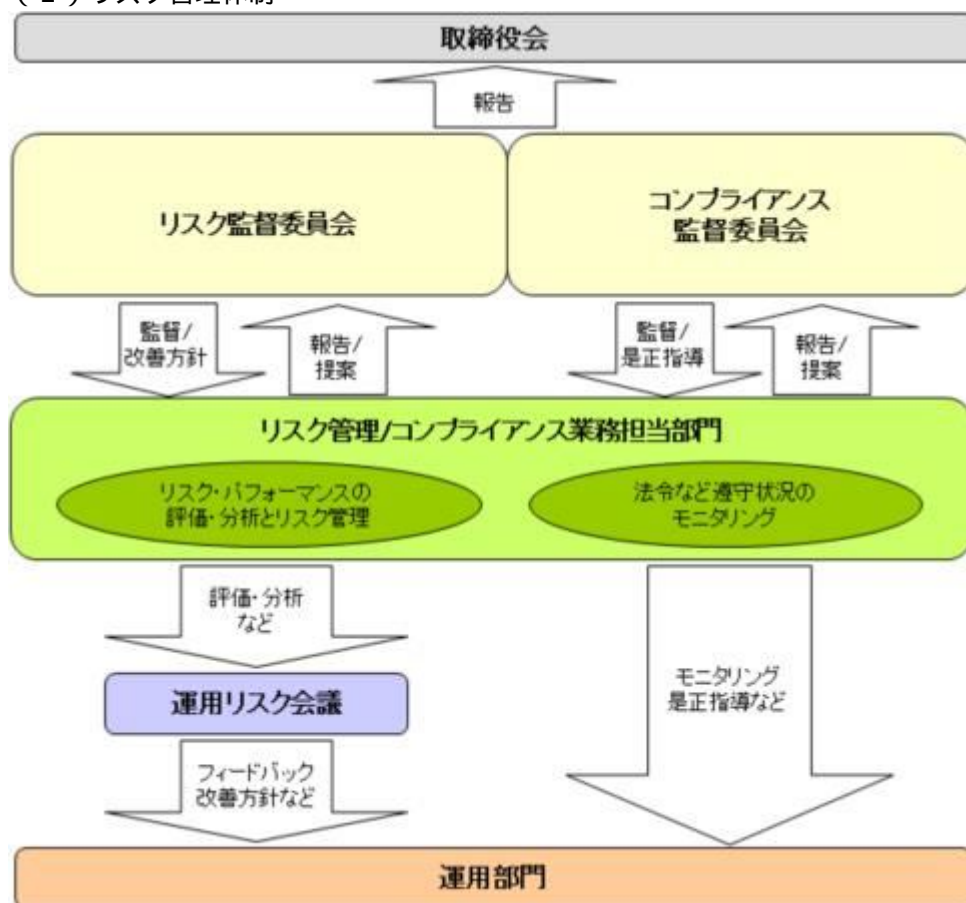
・投資対象とする投資信託証券に関する事項

ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資

する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性やインデックスと基準価額が乖離する可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

（２）リスク管理体制



全社リスク管理

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。

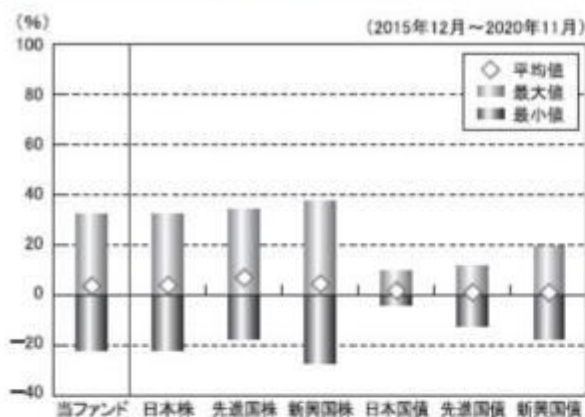
法令など遵守状況のモニタリング

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11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	3.4%	3.7%	6.6%	4.2%	1.5%	0.8%	0.8%
最大値	31.8%	32.2%	34.1%	37.2%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-22.2%	-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12月から2020年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

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

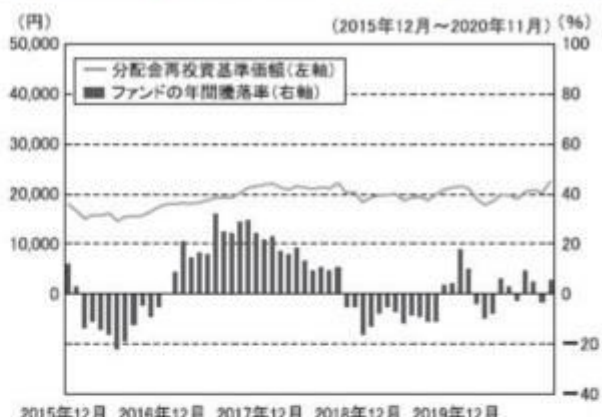
東証株価指数（TOPIX、配当込）

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

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



2015年12月 2016年12月 2017年12月 2018年12月 2019年12月

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2015年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

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】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.154%(税抜0.14%)の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分(年率)は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.14%	0.05%	0.07%	0.02%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用(日々、計上されます。)

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5)【課税上の取扱い】

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

確定拠出年金の場合

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

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

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

が可能です。

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

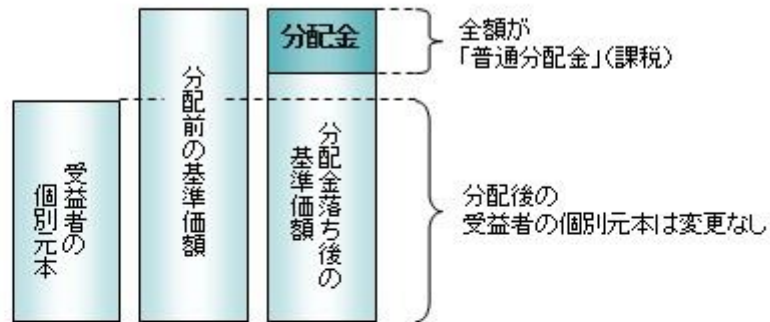
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

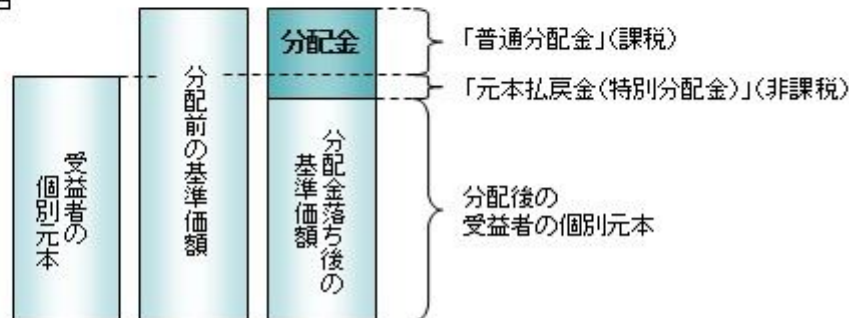
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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2021年2月5日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【インデックスファンド日本株式（DC専用）】

以下の運用状況は2020年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,198,472,949	99.99
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		223,792	0.01
合計(純資産総額)		2,198,696,741	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
------	----	-----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1,317,792,333	1.5765	2,077,570,404	1.6683	2,198,472,949	99.99
----	-----------	------------------------	---------------	--------	---------------	--------	---------------	-------

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第8計算期間末 (2011年11月 7日)	506	506	0.8109	0.8119
第9計算期間末 (2012年11月 6日)	581	582	0.8215	0.8225
第10計算期間末 (2013年11月 6日)	1,031	1,032	1.3381	1.3391
第11計算期間末 (2014年11月 6日)	1,198	1,199	1.5489	1.5499
第12計算期間末 (2015年11月 6日)	1,542	1,543	1.8154	1.8164
第13計算期間末 (2016年11月 7日)	1,582	1,583	1.6113	1.6123
第14計算期間末 (2017年11月 6日)	1,970	1,971	2.1571	2.1581
第15計算期間末 (2018年11月 6日)	2,236	2,237	2.0328	2.0338
第16計算期間末 (2019年11月 6日)	2,142	2,143	2.1204	2.1214
第17計算期間末 (2020年11月 6日)	2,135	2,136	2.1209	2.1219
2019年11月末日	2,137		2.1263	
12月末日	2,118		2.1566	
2020年 1月末日	2,086		2.1098	
2月末日	1,841		1.8928	
3月末日	2,018		1.7799	
4月末日	2,085		1.8565	
5月末日	2,156		1.9824	
6月末日	2,051		1.9785	
7月末日	1,975		1.8985	
8月末日	2,120		2.0532	

9月末日	2,115		2.0796	
10月末日	2,061		2.0204	
11月末日	2,198		2.2444	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第8期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0010
第9期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	0.0010
第10期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010
第11期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010
第12期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010
第13期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.0010
第14期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	0.0010
第15期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	0.0010
第16期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	0.0010
第17期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	0.0010

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第8期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	8.90
第9期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	1.43
第10期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	63.01
第11期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	15.83
第12期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	17.27
第13期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	11.19
第14期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	33.94
第15期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	5.72
第16期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	4.36
第17期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	0.07

(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8期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	136,508,266	105,650,698
第9期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	147,118,920	63,433,210

第10期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	294,742,645	231,483,165
第11期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	237,384,876	234,829,395
第12期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	312,411,268	236,517,460
第13期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	288,363,284	155,583,971
第14期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	351,818,827	420,627,030
第15期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	445,704,483	258,786,033
第16期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	279,042,339	369,276,249
第17期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	472,262,171	475,562,737

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2020年11月30日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	35,314,888,060	98.71
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		463,178,826	1.29
合計(純資産総額)		35,778,066,886	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	421,320,000	1.18

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	161,600	6,989.84	1,129,558,144	6,999.00	1,131,038,400	3.16
日本	株式	ソニー	電気機器	90,700	8,017.44	727,181,808	9,704.00	880,152,800	2.46
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	112,800	6,888.11	776,978,808	7,272.00	820,281,600	2.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	13,100	48,430.00	634,433,000	53,290.00	698,099,000	1.95
日本	株式	任天堂	その他製品	8,900	55,090.00	490,301,000	59,260.00	527,414,000	1.47
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	190,000	2,230.10	423,719,000	2,465.00	468,350,000	1.31

日本	株式	日本電産	電気機器	34,900	10,648.90	371,646,610	13,305.00	464,344,500	1.30
日本	株式	第一三共	医薬品	124,400	2,680.05	333,398,220	3,694.00	459,533,600	1.28
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	120,500	3,494.96	421,142,680	3,745.00	451,272,500	1.26
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	977,400	423.37	413,801,838	448.50	438,363,900	1.23
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,500	19,459.55	360,001,675	23,665.00	437,802,500	1.22
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	99,200	4,150.99	411,778,208	4,400.00	436,480,000	1.22
日本	株式	信越化学工業	化学	24,400	14,630.00	356,972,000	17,135.00	418,094,000	1.17
日本	株式	HOYA	精密機器	28,700	11,785.71	338,249,877	13,910.00	399,217,000	1.12
日本	株式	村田製作所	電気機器	42,600	7,382.93	314,512,818	9,129.00	388,895,400	1.09
日本	株式	ファナック	電気機器	13,600	21,578.92	293,473,312	25,365.00	344,964,000	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	114,100	2,584.76	294,921,116	2,871.50	327,638,150	0.92
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,200	28,415.00	261,418,000	35,470.00	326,324,000	0.91
日本	株式	KDDI	情報・通信業	103,600	2,798.21	289,894,556	2,982.50	308,987,000	0.86
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	98,800	2,980.35	294,458,580	3,032.00	299,561,600	0.84
日本	株式	S M C	機械	4,500	56,345.95	253,556,775	66,320.00	298,440,000	0.83
日本	株式	エムスリー	サービス業	30,500	6,701.72	204,402,460	9,622.00	293,471,000	0.82
日本	株式	日立製作所	電気機器	69,600	3,667.85	255,282,360	3,966.00	276,033,600	0.77
日本	株式	花王	化学	34,700	7,551.28	262,029,416	7,808.00	270,937,600	0.76
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	96,800	2,554.50	247,275,600	2,758.50	267,022,800	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	50,500	4,929.80	248,954,900	5,190.00	262,095,000	0.73
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	14,700	15,350.00	225,645,000	17,765.00	261,145,500	0.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	194,200	1,310.94	254,584,548	1,327.50	257,800,500	0.72
日本	株式	中外製薬	医薬品	45,300	4,167.05	188,767,365	5,044.00	228,493,200	0.64
日本	株式	三菱商事	卸売業	93,600	2,443.42	228,704,112	2,433.00	227,728,800	0.64

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	0.08
		鉱業	0.14
		建設業	2.33
		食料品	3.50
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.20
		化学	7.50
		医薬品	6.00
		石油・石炭製品	0.36
		ゴム製品	0.54
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.60
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.61

	機械	5.68
	電気機器	16.74
	輸送用機器	6.92
	精密機器	2.76
	その他製品	2.67
	電気・ガス業	1.30
	陸運業	3.46
	海運業	0.17
	空運業	0.35
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	9.28
	卸売業	4.39
	小売業	4.75
	銀行業	4.50
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	1.91
	その他金融業	1.10
	不動産業	2.01
	サービス業	6.02
合 計		98.71

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2020年12月	買建	24	日本円	402,407,700	421,320,000	1.18

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

参考情報

運用実績

2020年11月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……………22,444円

純資産総額……………21.98億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金再投資基準価額は、2010年11月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移（税引前、1万口当たり）

2016年11月	2017年11月	2018年11月	2019年11月	2020年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	140円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	98.70%
先物	1.18%
現金その他	1.30%

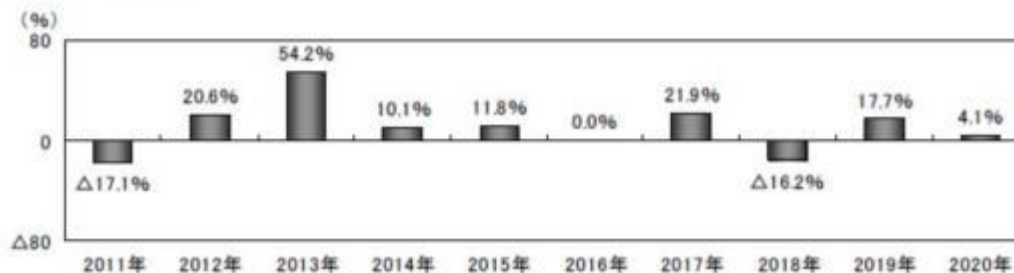
※当ファンドの実質組入比率です。

<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	3.16%
2	ソニー	電気機器	2.46%
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.29%
4	キーエンス	電気機器	1.95%
5	任天堂	その他製品	1.47%
6	日本電信電話	情報・通信業	1.31%
7	日本電産	電気機器	1.30%
8	第一三共	医薬品	1.28%
9	武田薬品工業	医薬品	1.26%
10	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.23%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※2020年は、2020年11月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

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

(4) 申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(5) 申込単位

1円以上1円単位

(6) 申込代金の支払い

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

(7) 受付の中止および取消

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

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

2【換金(解約)手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関の場合を記載しています。

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の解約請求を撤回できます。ただ

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

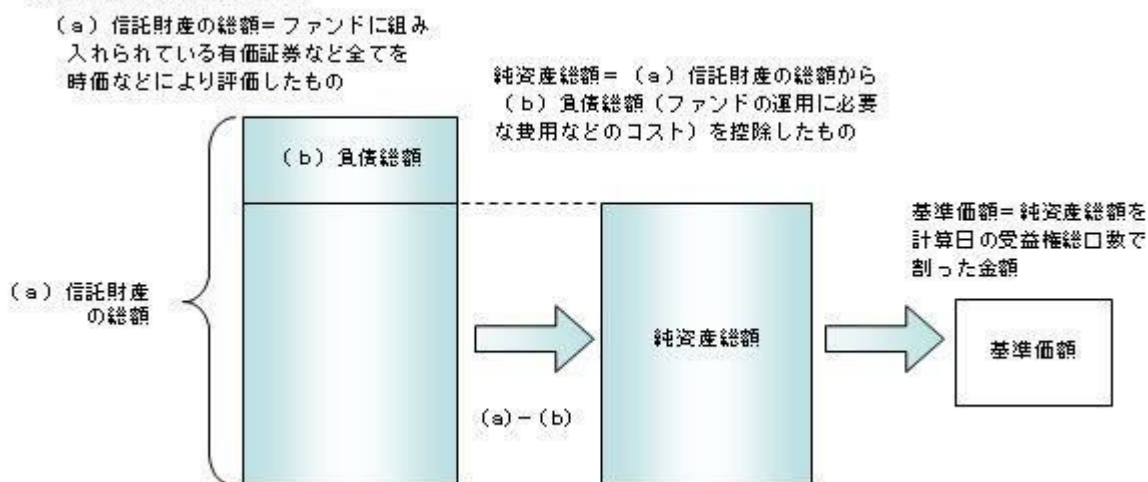
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

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（2003年11月7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11月7日から翌年11月6日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

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

イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ロ) やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

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

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

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

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

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

償還金について

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

・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更

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

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

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

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

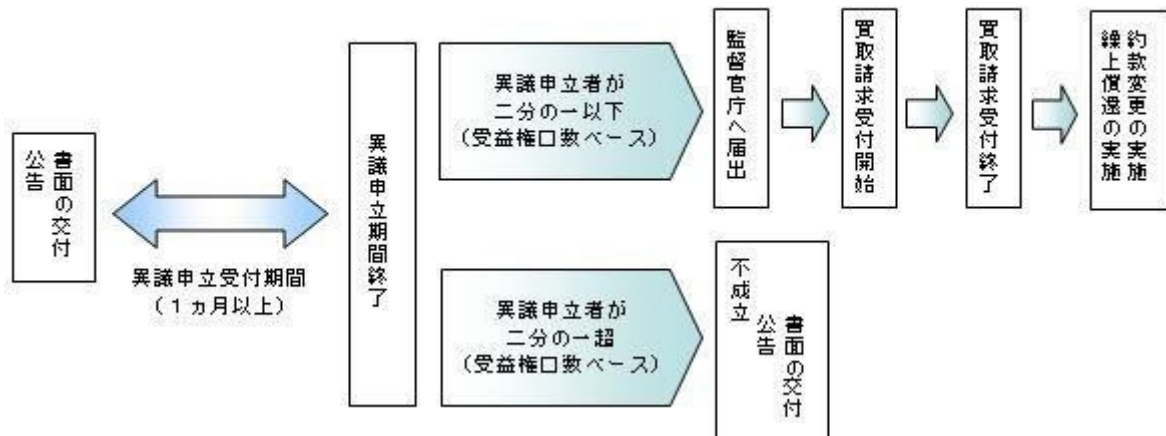
異議の申立て

1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間(2019年11月7日から2020年11月6日まで)の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【インデックスファンド日本株式(DC専用)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第16期 2019年11月 6日現在	第17期 2020年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,940,886	5,525,427
親投資信託受益証券	2,141,805,585	2,135,263,366
未収入金	7,607,382	27,704,482
流動資産合計	2,155,353,853	2,168,493,275
資産合計	2,155,353,853	2,168,493,275
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,010,175	1,006,874
未払解約金	9,584,293	30,350,334
未払受託者報酬	323,531	230,543
未払委託者報酬	2,373,007	1,383,646
未払利息	3	3
その他未払費用	43,084	46,055
流動負債合計	13,334,093	33,017,455
負債合計	13,334,093	33,017,455
純資産の部		
元本等		
元本	1,010,175,376	1,006,874,810
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,131,844,384	1,128,601,010
(分配準備積立金)	368,946,181	289,475,615
元本等合計	2,142,019,760	2,135,475,820
純資産合計	2,142,019,760	2,135,475,820
負債純資産合計	2,155,353,853	2,168,493,275

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期		第17期	
	自	2018年11月7日 至 2019年11月6日	自	2019年11月7日 至 2020年11月6日
営業収益				
受取利息		3		-
有価証券売買等損益		101,667,184		56,700,527
営業収益合計		101,667,187		56,700,527
営業費用				
支払利息		2,074		2,054
受託者報酬		669,376		515,277
委託者報酬		4,909,693		3,328,338
その他費用		89,426		91,178
営業費用合計		5,670,569		3,936,847
営業利益又は営業損失()		95,996,618		52,763,680
経常利益又は経常損失()		95,996,618		52,763,680
当期純利益又は当期純損失()		95,996,618		52,763,680
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()		17,236,324		35,784,612
期首剰余金又は期首欠損金()		1,136,483,095		1,131,844,384
剰余金増加額又は欠損金減少額		259,114,020		414,630,525
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		259,114,020		414,630,525
剰余金減少額又は欠損金増加額		375,975,498		505,415,317
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		375,975,498		505,415,317
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		1,010,175		1,006,874
期末剰余金又は期末欠損金()		1,131,844,384		1,128,601,010

(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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

		第16期 2019年11月 6日現在	第17期 2020年11月 6日現在
1.	期首元本額	1,100,409,286円	1,010,175,376円
	期中追加設定元本額	279,042,339円	472,262,171円
	期中一部解約元本額	369,276,249円	475,562,737円
2.	受益権の総数	1,010,175,376口	1,006,874,810口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6日		第17期 自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	47,333,057円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 46,879,513円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 9,456,893円
C	信託約款に定める収益調整金	1,196,320,559円	C 信託約款に定める収益調整金 1,328,614,531円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	322,623,299円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 234,146,083円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	1,566,276,915円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 1,619,097,020円
F	分配対象収益(1万口当たり)	15,504円	F 分配対象収益(1万口当たり) 16,080円
G	分配金額	1,010,175円	G 分配金額 1,006,874円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第16期 自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6日	第17期 自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	第16期 2019年11月 6日現在	第17期 2020年11月 6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16期(2019年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
----	-------------------

親投資信託受益証券	119,034,648
合計	119,034,648

第17期(2020年11月6日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	75,727,205
合計	75,727,205

(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16期 2019年11月6日現在		第17期 2020年11月6日現在	
1口当たり純資産額	2,1204円	1口当たり純資産額	2,1209円
(1万口当たり純資産額)	(21,204円)	(1万口当たり純資産額)	(21,209円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本株式インデックストピックスマザーファンド	1,354,690,627	2,135,263,366	
合計		1,354,690,627	2,135,263,366	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2019年11月 6日現在	2020年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	96,981,135	99,769,328
株式	33,417,562,630	34,394,247,690
派生商品評価勘定	17,618,570	7,827,350
未収入金	1,747,820	52,158,410
未収配当金	319,496,862	297,955,110
流動資産合計	33,853,407,017	34,851,957,888
資産合計	33,853,407,017	34,851,957,888
負債の部		
流動負債		
前受金	20,140,000	5,230,000
未払解約金	33,457,645	52,611,923
未払利息	53	68
流動負債合計	53,597,698	57,841,991
負債合計	53,597,698	57,841,991
純資産の部		
元本等		
元本	21,517,048,675	22,074,085,898
剰余金		
剰余金又は欠損金()	12,282,760,644	12,720,029,999
元本等合計	33,799,809,319	34,794,115,897
純資産合計	33,799,809,319	34,794,115,897
負債純資産合計	33,853,407,017	34,851,957,888

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2019年11月 6日現在	2020年11月 6日現在
1.	期首	2018年11月 7日	2019年11月 7日
	期首元本額	19,628,127,216円	21,517,048,675円
	期首からの追加設定元本額	3,688,070,856円	5,120,023,303円
	期首からの一部解約元本額	1,799,149,397円	4,562,986,080円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	573,098,014円	706,769,163円
	DCインデックスバランス(株式40)	1,482,617,542円	1,801,534,543円
	DCインデックスバランス(株式60)	2,869,213,373円	3,409,693,795円
	DCインデックスバランス(株式80)	2,959,007,071円	3,476,712,685円
	インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,363,512,596円	1,354,690,627円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	3,585,817,766円	3,236,646,653円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	739,710,271円	734,514,070円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	51,444,028円	49,485,768円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	42,485,478円	40,124,492円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	63,721,419円	59,041,463円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	61,225,049円	53,396,078円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,300,617,772円	3,753,508,024円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	283,866,304円	294,227,367円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	809,568,305円	804,213,731円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,180,262,868円	1,181,735,058円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,150,880,819円	1,117,792,381円

	計	21,517,048,675円	22,074,085,898円
2.	受益権の総数	21,517,048,675口	22,074,085,898口
3.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	437,610,000円	370,645,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2018年11月 7日 至 2019年11月 6日	自 2019年11月 7日 至 2020年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2019年11月 6日現在	2020年11月 6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	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引

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

(有価証券に関する注記)

(2019年11月 6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	903,790,303
合計	903,790,303

(2020年11月 6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	820,501,596
合計	820,501,596

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2019年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益

市場取引	株価指数先物取引 買建	338,740,000	-	356,370,000	17,630,000
合計		338,740,000	-	356,370,000	17,630,000

(2020年11月 6日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	374,075,000	-	381,915,000	7,840,000
合計		374,075,000	-	381,915,000	7,840,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2019年11月 6日現在		2020年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.5708円	1口当たり純資産額	1.5762円
(1万口当たり純資産額)	(15,708円)	(1万口当たり純資産額)	(15,762円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	700	2,782.00	1,947,400	

日本水産	20,100	421.00	8,462,100
マルハニチロ	2,900	2,219.00	6,435,100
雪国まいたけ	1,300	2,003.00	2,603,900
カネコ種苗	600	1,530.00	918,000
サカタのタネ	2,400	3,665.00	8,796,000
ホクト	1,500	2,142.00	3,213,000
ホクリヨウ	300	678.00	203,400
住石ホールディングス	4,200	126.00	529,200
日鉄鉱業	500	5,060.00	2,530,000
三井松島ホールディングス	800	706.00	564,800
国際石油開発帝石	73,900	507.00	37,467,300
石油資源開発	2,600	1,700.00	4,420,000
K&Oエナジーグループ	900	1,464.00	1,317,600
ヒノキヤグループ	500	2,232.00	1,116,000
ショーボンドホールディングス	3,100	5,270.00	16,337,000
ミライト・ホールディングス	6,000	1,553.00	9,318,000
サンヨーホームズ	200	677.00	135,400
日本アクア	900	703.00	632,700
ファーストコーポレーション	700	747.00	522,900
ベステラ	400	1,413.00	565,200
キャンディル	400	610.00	244,000
スペースバリューホールディングス	2,500	598.00	1,495,000
ダイセキ環境ソリューション	400	701.00	280,400
第一カッター興業	300	2,226.00	667,800
安藤・間	12,000	666.00	7,992,000
東急建設	6,000	486.00	2,916,000
コムシスホールディングス	7,100	2,826.00	20,064,600
ビーアールホールディングス	2,300	770.00	1,771,000
高松コンストラクショングループ	1,300	2,195.00	2,853,500
東建コーポレーション	600	8,010.00	4,806,000
ソネック	300	863.00	258,900
ヤマウラ	900	902.00	811,800
大成建設	15,500	3,385.00	52,467,500
大林組	46,500	904.00	42,036,000
清水建設	47,200	757.00	35,730,400
飛島建設	1,400	1,125.00	1,575,000
長谷工コーポレーション	18,000	1,278.00	23,004,000
松井建設	1,900	721.00	1,369,900
銭高組	200	4,680.00	936,000
鹿島建設	36,500	1,147.00	41,865,500
不動テトラ	1,300	1,512.00	1,965,600
大末建設	600	835.00	501,000

鉄建建設	1,000	1,994.00	1,994,000
西松建設	3,600	1,960.00	7,056,000
三井住友建設	11,300	425.00	4,802,500
大豊建設	1,100	3,435.00	3,778,500
前田建設工業	11,700	783.00	9,161,100
ナカノフドー建設	1,400	413.00	578,200
奥村組	2,200	2,460.00	5,412,000
東鉄工業	2,000	2,894.00	5,788,000
イチケン	400	1,628.00	651,200
富士ピー・エス	800	589.00	471,200
浅沼組	500	4,200.00	2,100,000
戸田建設	19,300	618.00	11,927,400
熊谷組	2,200	2,477.00	5,449,400
北野建設	300	2,541.00	762,300
植木組	200	2,816.00	563,200
矢作建設工業	2,100	932.00	1,957,200
ピーエス三菱	1,600	575.00	920,000
日本ハウスホールディングス	3,300	241.00	795,300
大東建託	5,100	9,460.00	48,246,000
新日本建設	2,100	961.00	2,018,100
N I P P O	3,900	2,816.00	10,982,400
東亜道路工業	300	3,775.00	1,132,500
前田道路	4,100	1,816.00	7,445,600
日本道路	500	8,070.00	4,035,000
東亜建設工業	1,500	2,003.00	3,004,500
日本国土開発	4,600	566.00	2,603,600
若築建設	900	1,240.00	1,116,000
東洋建設	5,300	408.00	2,162,400
五洋建設	18,500	693.00	12,820,500
福田組	500	5,210.00	2,605,000
住友林業	11,800	1,700.00	20,060,000
日本基礎技術	1,700	451.00	766,700
巴コーポレーション	2,200	373.00	820,600
大和ハウス工業	46,000	2,846.50	130,939,000
ライト工業	2,700	1,573.00	4,247,100
積水ハウス	50,400	1,789.00	90,165,600
日特建設	1,300	804.00	1,045,200
北陸電気工事	800	1,208.00	966,400
ユアテック	2,800	657.00	1,839,600
日本リーテック	1,000	2,384.00	2,384,000
四電工	300	2,379.00	713,700
中電工	1,900	2,135.00	4,056,500

関電工	6,600	818.00	5,398,800
きんでん	11,100	1,669.00	18,525,900
東京エネシス	1,600	855.00	1,368,000
トーエネック	500	3,570.00	1,785,000
住友電設	1,300	2,765.00	3,594,500
日本電設工業	2,600	2,162.00	5,621,200
協和エクシオ	7,100	2,558.00	18,161,800
新日本空調	1,300	2,210.00	2,873,000
九電工	3,300	3,010.00	9,933,000
三機工業	3,300	1,186.00	3,913,800
日揮ホールディングス	14,300	877.00	12,541,100
中外炉工業	500	1,501.00	750,500
ヤマト	1,500	746.00	1,119,000
太平電業	1,100	2,329.00	2,561,900
高砂熱学工業	3,600	1,474.00	5,306,400
三晃金属工業	200	2,664.00	532,800
朝日工業社	300	2,927.00	878,100
明星工業	3,100	872.00	2,703,200
大気社	2,300	2,865.00	6,589,500
ダイダン	1,100	2,727.00	2,999,700
日比谷総合設備	1,500	1,764.00	2,646,000
フィル・カンパニー	300	2,094.00	628,200
OSJBホールディングス	7,600	250.00	1,900,000
東洋エンジニアリング	2,100	315.00	661,500
レイズネクスト	2,500	1,258.00	3,145,000
日本製粉	4,400	1,731.00	7,616,400
日清製粉グループ本社	16,800	1,644.00	27,619,200
日東富士製粉	100	6,590.00	659,000
昭和産業	1,400	3,280.00	4,592,000
鳥越製粉	1,300	1,078.00	1,401,400
中部飼料	1,800	1,482.00	2,667,600
フィード・ワン	2,100	903.00	1,896,300
東洋精糖	300	1,263.00	378,900
日本甜菜製糖	800	1,794.00	1,435,200
三井製糖	1,300	1,831.00	2,380,300
塩水港精糖	1,700	230.00	391,000
日新製糖	700	1,890.00	1,323,000
森永製菓	3,500	4,120.00	14,420,000
中村屋	400	4,150.00	1,660,000
江崎グリコ	4,100	4,360.00	17,876,000
名糖産業	700	1,490.00	1,043,000
井村屋グループ	800	2,541.00	2,032,800

不二家	1,000	2,395.00	2,395,000
山崎製パン	11,100	1,739.00	19,302,900
第一屋製パン	300	1,004.00	301,200
モロゾフ	300	6,050.00	1,815,000
亀田製菓	800	4,875.00	3,900,000
寿スピリッツ	1,400	5,000.00	7,000,000
カルビー	6,800	3,105.00	21,114,000
森永乳業	2,800	5,290.00	14,812,000
六甲バター	1,000	1,792.00	1,792,000
ヤクルト本社	10,200	5,150.00	52,530,000
明治ホールディングス	9,800	7,630.00	74,774,000
雪印メグミルク	3,600	2,343.00	8,434,800
プリマハム	2,300	3,020.00	6,946,000
日本ハム	5,700	4,470.00	25,479,000
林兼産業	500	583.00	291,500
丸大食品	1,600	1,666.00	2,665,600
S Foods	1,200	3,365.00	4,038,000
柿安本店	500	2,577.00	1,288,500
伊藤ハム米久ホールディングス	9,600	723.00	6,940,800
サッポロホールディングス	5,100	1,840.00	9,384,000
アサヒグループホールディングス	32,500	3,616.00	117,520,000
キリンホールディングス	63,100	1,985.00	125,253,500
宝ホールディングス	11,000	1,124.00	12,364,000
オエノンホールディングス	4,300	417.00	1,793,100
養命酒製造	500	1,817.00	908,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,400	1,531.00	17,453,400
サントリー食品インターナショナル	9,900	3,665.00	36,283,500
ダイドーグループホールディングス	800	5,450.00	4,360,000
伊藤園	4,500	7,080.00	31,860,000
キーコーヒー	1,500	2,154.00	3,231,000
ユニカフェ	500	1,065.00	532,500
ジャパンフーズ	200	1,268.00	253,600
日清オイリオグループ	1,900	3,045.00	5,785,500
不二製油グループ本社	3,600	3,430.00	12,348,000
J - オイルミルズ	800	3,740.00	2,992,000
キッコーマン	10,700	6,030.00	64,521,000
味の素	32,800	2,294.00	75,243,200
キュービー	8,300	2,207.00	18,318,100
ハウス食品グループ本社	5,600	3,630.00	20,328,000
カゴメ	6,100	3,875.00	23,637,500
焼津水産化学工業	700	1,000.00	700,000
アリアケジャパン	1,400	7,140.00	9,996,000

ピエトロ	200	1,698.00	339,600
エバラ食品工業	400	2,325.00	930,000
やまみ	100	2,241.00	224,100
ニチレイ	7,100	2,804.00	19,908,400
東洋水産	7,600	5,450.00	41,420,000
イトアンドホールディングス	500	1,886.00	943,000
大冷	200	2,134.00	426,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	800	869.00	695,200
日清食品ホールディングス	6,300	9,160.00	57,708,000
永谷園ホールディングス	700	2,360.00	1,652,000
一正蒲鉾	600	1,057.00	634,200
フジッコ	1,600	2,022.00	3,235,200
ロック・フィールド	1,600	1,492.00	2,387,200
日本たばこ産業	79,700	2,051.50	163,504,550
ケンコーマヨネーズ	800	1,840.00	1,472,000
わらべや日洋ホールディングス	1,000	1,473.00	1,473,000
なとり	900	2,069.00	1,862,100
イフジ産業	300	906.00	271,800
ピクルスコーポレーション	300	2,957.00	887,100
北の達人コーポレーション	5,200	489.00	2,542,800
ユーグレナ	6,400	871.00	5,574,400
ミヨシ油脂	500	1,191.00	595,500
理研ビタミン	1,400	1,571.00	2,199,400
片倉工業	2,000	1,215.00	2,430,000
ゲンゼ	1,100	3,830.00	4,213,000
東洋紡	5,700	1,406.00	8,014,200
ユニチカ	4,400	364.00	1,601,600
富士紡ホールディングス	700	3,600.00	2,520,000
倉敷紡績	1,500	1,867.00	2,800,500
シキボウ	800	949.00	759,200
日本毛織	4,800	1,070.00	5,136,000
ダイトウボウ	2,400	100.00	240,000
トーア紡コーポレーション	600	470.00	282,000
ダイドーリミテッド	2,000	199.00	398,000
帝国繊維	1,600	2,707.00	4,331,200
帝人	11,800	1,705.00	20,119,000
東レ	105,100	501.30	52,686,630
サカイオーベックス	400	2,000.00	800,000
住江織物	300	2,030.00	609,000
日本フェルト	800	480.00	384,000
イチカワ	200	1,309.00	261,800
日東製網	200	1,455.00	291,000

アツギ	1,200	535.00	642,000
ダイニック	600	773.00	463,800
セーレン	3,600	1,688.00	6,076,800
ソトー	600	941.00	564,600
東海染工	200	1,129.00	225,800
小松マテーレ	2,400	905.00	2,172,000
ワコールホールディングス	3,600	2,099.00	7,556,400
ホギメディカル	1,600	3,200.00	5,120,000
クラウディアホールディングス	400	299.00	119,600
T S Iホールディングス	4,400	237.00	1,042,800
マツオカコーポレーション	400	2,385.00	954,000
ワールド	2,100	1,425.00	2,992,500
三陽商会	800	529.00	423,200
ナイガイ	600	356.00	213,600
オンワードホールディングス	8,800	207.00	1,821,600
ルックホールディングス	500	996.00	498,000
ゴールドウイン	2,600	7,450.00	19,370,000
デサント	2,800	1,782.00	4,989,600
キング	700	551.00	385,700
ヤマトインターナショナル	1,300	327.00	425,100
特種東海製紙	900	4,915.00	4,423,500
王子ホールディングス	60,500	461.00	27,890,500
日本製紙	6,400	1,225.00	7,840,000
三菱製紙	1,600	326.00	521,600
北越コーポレーション	8,600	369.00	3,173,400
中越パルプ工業	600	1,313.00	787,800
巴川製紙所	500	951.00	475,500
大王製紙	7,000	1,621.00	11,347,000
阿波製紙	400	421.00	168,400
レンゴー	13,700	834.00	11,425,800
トーモク	900	1,791.00	1,611,900
ザ・パック	1,100	2,971.00	3,268,100
クラレ	22,900	1,004.00	22,991,600
旭化成	96,200	926.00	89,081,200
共和レザー	800	627.00	501,600
昭和電工	11,000	1,875.00	20,625,000
住友化学	106,600	366.00	39,015,600
住友精化	600	3,725.00	2,235,000
日産化学	8,000	5,750.00	46,000,000
ラサ工業	500	2,099.00	1,049,500
クレハ	1,200	4,555.00	5,466,000
多木化学	600	6,750.00	4,050,000

テイカ	1,100	1,463.00	1,609,300
石原産業	2,600	686.00	1,783,600
片倉コープアグリ	400	1,226.00	490,400
日本曹達	2,100	2,785.00	5,848,500
東ソー	22,400	1,693.00	37,923,200
トクヤマ	4,200	2,253.00	9,462,600
セントラル硝子	2,900	2,246.00	6,513,400
東亜合成	9,100	1,110.00	10,101,000
大阪ソーダ	1,500	2,569.00	3,853,500
関東電化工業	3,500	719.00	2,516,500
デンカ	5,300	3,245.00	17,198,500
信越化学工業	24,900	14,640.00	364,536,000
日本カーバイド工業	500	1,223.00	611,500
堺化学工業	1,000	2,006.00	2,006,000
第一稀元素化学工業	1,600	720.00	1,152,000
エア・ウォーター	13,500	1,558.00	21,033,000
日本酸素ホールディングス	14,000	1,616.00	22,624,000
日本化学工業	500	2,536.00	1,268,000
東邦アセチレン	200	1,248.00	249,600
日本パーカラライジング	7,300	1,064.00	7,767,200
高压ガス工業	2,300	829.00	1,906,700
四国化成工業	2,100	1,183.00	2,484,300
戸田工業	300	2,036.00	610,800
ステラ ケミファ	800	3,155.00	2,524,000
保土谷化学工業	500	4,530.00	2,265,000
日本触媒	2,200	5,230.00	11,506,000
大日精化工業	1,300	2,162.00	2,810,600
カネカ	3,700	3,045.00	11,266,500
三菱瓦斯化学	13,500	1,881.00	25,393,500
三井化学	13,500	2,778.00	37,503,000
J S R	13,500	2,487.00	33,574,500
東京応化工業	2,500	6,130.00	15,325,000
大阪有機化学工業	1,300	2,736.00	3,556,800
三菱ケミカルホールディングス	97,000	568.30	55,125,100
K Hネオケム	2,400	2,573.00	6,175,200
ダイセル	18,200	781.00	14,214,200
住友ベークライト	2,300	2,992.00	6,881,600
積水化学工業	30,700	1,673.00	51,361,100
日本ゼオン	13,100	1,288.00	16,872,800
アイカ工業	4,400	3,800.00	16,720,000
宇部興産	7,300	1,762.00	12,862,600
積水樹脂	2,600	2,284.00	5,938,400

タキロンシーアイ	3,200	678.00	2,169,600
旭有機材	800	1,473.00	1,178,400
ニチバン	800	1,661.00	1,328,800
リケンテクノス	3,500	436.00	1,526,000
大倉工業	700	1,908.00	1,335,600
積水化成成品工業	2,000	589.00	1,178,000
群栄化学工業	300	2,551.00	765,300
タイガースポリマー	800	437.00	349,600
ミライアル	500	1,247.00	623,500
ダイキアクシス	600	871.00	522,600
ダイキョーニシカワ	3,100	641.00	1,987,100
竹本容器	600	929.00	557,400
森六ホールディングス	800	2,010.00	1,608,000
日本化薬	9,000	929.00	8,361,000
カーリットホールディングス	1,600	553.00	884,800
日本精化	1,200	1,549.00	1,858,800
扶桑化学工業	1,500	3,350.00	5,025,000
トリケミカル研究所	300	12,890.00	3,867,000
A D E K A	6,700	1,463.00	9,802,100
日油	5,500	4,180.00	22,990,000
新日本理化	2,400	163.00	391,200
ハリマ化成グループ	1,200	1,000.00	1,200,000
花王	35,500	7,644.00	271,362,000
第一工業製薬	500	4,315.00	2,157,500
石原ケミカル	400	2,126.00	850,400
日華化学	500	932.00	466,000
ニイタカ	300	3,220.00	966,000
三洋化成工業	900	4,510.00	4,059,000
有機合成薬品工業	1,100	311.00	342,100
大日本塗料	1,700	1,011.00	1,718,700
日本ペイントホールディングス	12,000	10,180.00	122,160,000
関西ペイント	16,300	2,836.00	46,226,800
神東塗料	1,200	174.00	208,800
中国塗料	4,100	1,009.00	4,136,900
日本特殊塗料	1,100	946.00	1,040,600
藤倉化成	2,000	509.00	1,018,000
太陽ホールディングス	1,100	5,660.00	6,226,000
D I C	6,100	2,574.00	15,701,400
サカタインクス	3,200	1,133.00	3,625,600
東洋インキS Cホールディングス	3,100	1,963.00	6,085,300
T & K T O K A	1,100	871.00	958,100
富士フイルムホールディングス	28,400	5,468.00	155,291,200

資生堂	29,400	6,941.00	204,065,400
ライオン	19,300	2,425.00	46,802,500
高砂香料工業	900	2,138.00	1,924,200
マンダム	3,300	1,638.00	5,405,400
ミルボン	2,000	5,570.00	11,140,000
ファンケル	6,000	3,620.00	21,720,000
コーセー	2,800	15,150.00	42,420,000
コタ	900	1,352.00	1,216,800
ポーラ・オルビスホールディングス	6,300	2,055.00	12,946,500
ノエビアホールディングス	1,200	4,700.00	5,640,000
アジュバンコスメジャパン	300	1,014.00	304,200
エステー	1,000	2,000.00	2,000,000
アグロ カネショウ	600	1,661.00	996,600
コニシ	2,500	1,555.00	3,887,500
長谷川香料	2,500	2,156.00	5,390,000
星光PMC	900	660.00	594,000
小林製薬	4,200	10,830.00	45,486,000
荒川化学工業	1,400	1,132.00	1,584,800
メック	1,000	2,212.00	2,212,000
日本高純度化学	400	2,694.00	1,077,600
タカラバイオ	3,900	2,913.00	11,360,700
JCU	1,800	3,370.00	6,066,000
新田ゼラチン	1,000	701.00	701,000
OATアグリオ	300	1,294.00	388,200
デクセリアルズ	3,800	1,148.00	4,362,400
アース製薬	1,100	6,740.00	7,414,000
北興化学工業	1,400	1,120.00	1,568,000
大成ラミック	500	2,793.00	1,396,500
クミアイ化学工業	6,100	1,034.00	6,307,400
日本農薬	2,700	502.00	1,355,400
アキレス	1,000	1,575.00	1,575,000
有沢製作所	2,400	954.00	2,289,600
日東電工	10,200	7,550.00	77,010,000
レック	1,600	1,498.00	2,396,800
三光合成	1,800	294.00	529,200
きもと	2,500	177.00	442,500
藤森工業	1,300	4,370.00	5,681,000
前澤化成工業	900	996.00	896,400
未来工業	800	1,944.00	1,555,200
ウェーブロックホールディングス	500	706.00	353,000
JSP	900	1,523.00	1,370,700
エフピコ	3,100	4,360.00	13,516,000

天馬	1,000	1,892.00	1,892,000	
信越ポリマー	2,700	937.00	2,529,900	
東リ	3,700	259.00	958,300	
ニフコ	5,400	3,215.00	17,361,000	
バルカー	1,200	1,849.00	2,218,800	
ユニ・チャーム	31,400	5,202.00	163,342,800	
ショーエイコーポレーション	200	1,172.00	234,400	
協和キリン	14,900	2,825.00	42,092,500	
武田薬品工業	123,300	3,463.00	426,987,900	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	128,500	1,565.50	201,166,750	
大日本住友製薬	11,000	1,336.00	14,696,000	
塩野義製薬	18,600	5,553.00	103,285,800	
わかもと製薬	1,900	260.00	494,000	
あすか製薬	1,700	1,561.00	2,653,700	
日本新薬	3,900	7,920.00	30,888,000	
ビオフェルミン製薬	300	2,432.00	729,600	
中外製薬	46,400	4,429.00	205,505,600	
科研製薬	2,500	4,195.00	10,487,500	
エーザイ	17,700	10,240.00	181,248,000	
ロート製薬	7,600	3,500.00	26,600,000	
小野薬品工業	34,100	3,211.00	109,495,100	
久光製薬	3,900	5,410.00	21,099,000	
持田製薬	2,100	4,130.00	8,673,000	
参天製薬	27,600	2,034.00	56,138,400	
扶桑薬品工業	500	2,909.00	1,454,500	
日本ケミファ	200	2,459.00	491,800	
ツムラ	4,600	3,365.00	15,479,000	
日医工	4,200	1,103.00	4,632,600	
キッセイ薬品工業	2,600	2,127.00	5,530,200	
生化学工業	2,900	1,031.00	2,989,900	
栄研化学	2,600	2,033.00	5,285,800	
日水製薬	700	1,002.00	701,400	
鳥居薬品	900	3,095.00	2,785,500	
JCRファーマ	4,200	2,923.00	12,276,600	
東和薬品	1,900	2,052.00	3,898,800	
富士製薬工業	1,000	1,270.00	1,270,000	
沢井製薬	3,000	5,300.00	15,900,000	
ゼリア新薬工業	2,700	1,910.00	5,157,000	
第一三共	127,200	3,185.00	405,132,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,300	1,961.00	6,471,300	
大幸薬品	1,800	1,975.00	3,555,000	
ダイト	900	4,105.00	3,694,500	

大塚ホールディングス	30,800	4,182.00	128,805,600
大正製薬ホールディングス	3,100	6,470.00	20,057,000
ペプチドリーム	7,500	5,020.00	37,650,000
日本コークス工業	12,700	73.00	927,100
ニチレキ	1,800	1,728.00	3,110,400
ユシロ化学工業	800	1,326.00	1,060,800
ビーピー・カストロール	500	1,252.00	626,000
富士石油	3,900	188.00	733,200
MORESCO	500	1,019.00	509,500
出光興産	16,400	2,155.00	35,342,000
Eneosホールディングス	222,900	363.30	80,979,570
コスモエネルギーホールディングス	4,300	1,586.00	6,819,800
横浜ゴム	8,600	1,506.00	12,951,600
TOYO TIRE	7,800	1,593.00	12,425,400
ブリヂストン	39,400	3,493.00	137,624,200
住友ゴム工業	13,300	958.00	12,741,400
藤倉コンポジット	1,300	350.00	455,000
オカモト	900	4,360.00	3,924,000
フコク	600	712.00	427,200
ニッタ	1,700	2,273.00	3,864,100
住友理工	2,800	536.00	1,500,800
三ツ星ベルト	2,000	1,745.00	3,490,000
バンドー化学	2,600	602.00	1,565,200
日東紡績	2,200	4,165.00	9,163,000
AGC	13,600	3,290.00	44,744,000
日本板硝子	7,100	419.00	2,974,900
石塚硝子	300	1,926.00	577,800
日本山村硝子	600	848.00	508,800
日本電気硝子	5,500	2,148.00	11,814,000
オハラ	600	1,261.00	756,600
住友大阪セメント	2,800	3,250.00	9,100,000
太平洋セメント	9,300	2,519.00	23,426,700
日本ヒューム	1,500	804.00	1,206,000
日本コンクリート工業	3,200	318.00	1,017,600
三谷セキサン	700	4,955.00	3,468,500
アジアパイルホールディングス	2,100	474.00	995,400
東海カーボン	14,500	1,168.00	16,936,000
日本カーボン	800	3,750.00	3,000,000
東洋炭素	900	1,808.00	1,627,200
ノリタケカンパニーリミテド	800	3,065.00	2,452,000
TOTO	10,600	5,230.00	55,438,000
日本碍子	17,800	1,552.00	27,625,600

日本特殊陶業	11,300	1,840.00	20,792,000
ダントーホールディングス	1,000	557.00	557,000
MARUWA	600	10,740.00	6,444,000
品川リフラクトリーズ	400	2,221.00	888,400
黒崎播磨	300	2,935.00	880,500
ヨータイ	1,200	799.00	958,800
イソライト工業	800	470.00	376,000
東京窯業	1,900	341.00	647,900
ニッカトー	700	706.00	494,200
フジミインコーポレーテッド	1,300	3,550.00	4,615,000
クニミネ工業	600	1,100.00	660,000
エーアンドエーマテリアル	200	1,086.00	217,200
ニチアス	4,000	2,328.00	9,312,000
ニチハ	2,000	3,175.00	6,350,000
日本製鉄	65,600	1,101.00	72,225,600
神戸製鋼所	26,900	461.00	12,400,900
合同製鐵	800	1,913.00	1,530,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	39,600	801.00	31,719,600
東京製鐵	7,200	701.00	5,047,200
共英製鋼	1,700	1,388.00	2,359,600
大和工業	3,100	2,559.00	7,932,900
東京鐵鋼	600	2,041.00	1,224,600
大阪製鐵	800	1,154.00	923,200
淀川製鋼所	2,000	1,994.00	3,988,000
丸一鋼管	4,800	2,447.00	11,745,600
モリ工業	500	2,517.00	1,258,500
大同特殊鋼	2,400	3,695.00	8,868,000
日本高周波鋼業	600	342.00	205,200
日本冶金工業	1,200	1,519.00	1,822,800
山陽特殊製鋼	1,000	1,059.00	1,059,000
愛知製鋼	800	2,630.00	2,104,000
日立金属	15,800	1,393.00	22,009,400
日本金属	400	640.00	256,000
大平洋金属	1,000	1,623.00	1,623,000
新日本電工	9,700	251.00	2,434,700
栗本鐵工所	700	1,889.00	1,322,300
虹技	200	1,231.00	246,200
日本鑄鐵管	200	1,314.00	262,800
三菱製鋼	1,200	526.00	631,200
日亜鋼業	2,300	306.00	703,800
日本精線	200	3,435.00	687,000
エンビプロ・ホールディングス	700	538.00	376,600

シンニッタン	2,600	198.00	514,800
新家工業	400	1,156.00	462,400
大紀アルミニウム工業所	2,500	661.00	1,652,500
日本軽金属ホールディングス	3,700	1,724.00	6,378,800
三井金属鉱業	3,900	2,736.00	10,670,400
東邦亜鉛	800	2,099.00	1,679,200
三菱マテリアル	9,700	1,934.00	18,759,800
住友金属鉱山	18,700	3,458.00	64,664,600
D O W Aホールディングス	3,700	3,175.00	11,747,500
古河機械金属	2,600	1,140.00	2,964,000
エス・サイエンス	6,900	46.00	317,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,600	800.00	1,280,000
東邦チタニウム	2,700	663.00	1,790,100
U A C J	2,200	1,637.00	3,601,400
C Kサンエツ	300	3,735.00	1,120,500
古河電気工業	4,500	2,458.00	11,061,000
住友電気工業	54,900	1,194.50	65,578,050
フジクラ	17,700	382.00	6,761,400
昭和電線ホールディングス	1,700	1,360.00	2,312,000
タツタ電線	3,000	579.00	1,737,000
カナレ電気	300	1,744.00	523,200
平河ヒューテック	800	1,065.00	852,000
リョービ	1,800	1,165.00	2,097,000
アーレスティ	2,000	320.00	640,000
アサヒホールディングス	2,600	3,735.00	9,711,000
稲葉製作所	800	1,376.00	1,100,800
宮地エンジニアリンググループ	500	1,919.00	959,500
トーカロ	4,100	1,096.00	4,493,600
アルファC o	600	980.00	588,000
S U M C O	18,800	1,623.00	30,512,400
川田テクノロジーズ	300	4,385.00	1,315,500
R S Technologies	500	3,620.00	1,810,000
ジェイテックコーポレーション	100	3,955.00	395,500
信和	900	720.00	648,000
東洋製罐グループホールディングス	9,300	1,016.00	9,448,800
ホッカンホールディングス	800	1,445.00	1,156,000
コロナ	800	987.00	789,600
横河ブリッジホールディングス	2,700	1,922.00	5,189,400
駒井ハルテック	300	1,505.00	451,500
高田機工	100	2,498.00	249,800
三和ホールディングス	13,800	1,260.00	17,388,000
文化シャッター	4,300	922.00	3,964,600

三協立山	1,900	922.00	1,751,800
アルインコ	1,100	910.00	1,001,000
東洋シャッター	300	738.00	221,400
LIXILグループ	21,600	2,322.00	50,155,200
日本フィルコン	1,000	545.00	545,000
ノーリツ	3,000	1,657.00	4,971,000
長府製作所	1,500	2,115.00	3,172,500
リンナイ	2,800	11,120.00	31,136,000
ダイニチ工業	800	790.00	632,000
日東精工	1,800	468.00	842,400
三洋工業	200	1,944.00	388,800
岡部	3,000	817.00	2,451,000
ジーテクト	1,800	1,322.00	2,379,600
東プレ	2,700	1,046.00	2,824,200
高周波熱錬	2,800	507.00	1,419,600
東京製網	1,100	499.00	548,900
サンコール	1,200	423.00	507,600
モリテック スチール	1,200	303.00	363,600
パイオラックス	2,200	1,555.00	3,421,000
エイチワン	1,500	610.00	915,000
日本発條	15,700	626.00	9,828,200
中央発條	200	2,988.00	597,600
アドバネクス	200	1,228.00	245,600
立川ブラインド工業	700	1,277.00	893,900
三益半導体工業	1,100	2,571.00	2,828,100
日本ドライケミカル	400	1,509.00	603,600
日本製鋼所	4,400	2,358.00	10,375,200
三浦工業	6,300	5,400.00	34,020,000
タクマ	4,900	1,666.00	8,163,400
ツガミ	3,000	1,480.00	4,440,000
オークマ	1,700	5,380.00	9,146,000
芝浦機械	1,600	2,158.00	3,452,800
アマダ	18,100	937.00	16,959,700
アイダエンジニアリング	3,800	838.00	3,184,400
滝澤鉄工所	400	980.00	392,000
F U J I	6,300	2,224.00	14,011,200
牧野フライス製作所	1,700	3,835.00	6,519,500
オーエスジー	7,200	1,595.00	11,484,000
ダイジェット工業	200	1,412.00	282,400
旭ダイヤモンド工業	3,900	483.00	1,883,700
D M G 森精機	9,200	1,513.00	13,919,600
ソディック	3,200	800.00	2,560,000

ディスコ	2,000	28,810.00	57,620,000
日東工器	800	1,707.00	1,365,600
日進工具	600	2,252.00	1,351,200
パンチ工業	1,300	484.00	629,200
富士ダイス	700	643.00	450,100
豊和工業	800	815.00	652,000
OKK	400	358.00	143,200
東洋機械金属	1,100	406.00	446,600
津田駒工業	300	904.00	271,200
島精機製作所	2,300	1,611.00	3,705,300
オプトラン	1,800	2,165.00	3,897,000
NCホールディングス	400	611.00	244,400
イワキポンプ	900	821.00	738,900
フリー	1,400	1,208.00	1,691,200
ヤマシンフィルタ	3,100	1,059.00	3,282,900
日阪製作所	1,800	907.00	1,632,600
やまびこ	2,800	1,330.00	3,724,000
平田機工	700	6,610.00	4,627,000
ペガサスミシン製造	1,500	286.00	429,000
マルマエ	500	906.00	453,000
タツモ	600	1,688.00	1,012,800
ナプテスコ	8,600	4,000.00	34,400,000
三井海洋開発	1,600	1,594.00	2,550,400
レオン自動機	1,400	1,040.00	1,456,000
S M C	4,700	58,770.00	276,219,000
ホソカワミクロン	500	5,410.00	2,705,000
ユニオンツール	600	3,115.00	1,869,000
オイレス工業	1,900	1,565.00	2,973,500
日精エー・エス・ビー機械	400	4,165.00	1,666,000
サトーホールディングス	2,100	2,057.00	4,319,700
技研製作所	1,300	3,845.00	4,998,500
日本エアージェック	500	1,799.00	899,500
カワタ	400	801.00	320,400
日精樹脂工業	1,200	911.00	1,093,200
オカダアイヨン	400	1,007.00	402,800
ワイエイシイホールディングス	600	652.00	391,200
小松製作所	67,100	2,427.00	162,851,700
住友重機械工業	8,500	2,372.00	20,162,000
日立建機	5,900	2,690.00	15,871,000
日工	1,900	681.00	1,293,900
巴工業	600	1,959.00	1,175,400
井関農機	1,500	1,461.00	2,191,500

T O W A	1,500	1,285.00	1,927,500
丸山製作所	300	1,325.00	397,500
北川鉄工所	700	1,362.00	953,400
ローツェ	600	4,915.00	2,949,000
タカキタ	500	699.00	349,500
クボタ	78,600	2,018.50	158,654,100
荏原実業	400	3,585.00	1,434,000
三菱化工機	500	2,020.00	1,010,000
月島機械	2,700	1,251.00	3,377,700
帝国電機製作所	1,200	1,153.00	1,383,600
新東工業	3,600	726.00	2,613,600
澁谷工業	1,300	3,415.00	4,439,500
アイチ コーポレーション	2,600	941.00	2,446,600
小森コーポレーション	3,800	693.00	2,633,400
鶴見製作所	1,100	1,783.00	1,961,300
住友精密工業	200	1,921.00	384,200
酒井重工業	300	2,371.00	711,300
荏原製作所	6,100	2,885.00	17,598,500
石井鐵工所	200	2,764.00	552,800
西島製作所	1,500	804.00	1,206,000
北越工業	1,500	1,067.00	1,600,500
ダイキン工業	18,900	22,285.00	421,186,500
オルガノ	500	5,550.00	2,775,000
トーヨーカネツ	600	2,197.00	1,318,200
栗田工業	8,000	3,345.00	26,760,000
椿本チエイン	2,100	2,529.00	5,310,900
大同工業	700	632.00	442,400
木村化工機	1,200	454.00	544,800
アネスト岩田	2,300	894.00	2,056,200
ダイフク	7,600	11,880.00	90,288,000
サムコ	400	2,725.00	1,090,000
加藤製作所	800	1,049.00	839,200
油研工業	300	1,479.00	443,700
タダノ	7,100	757.00	5,374,700
フジテック	5,400	2,254.00	12,171,600
C K D	4,000	1,834.00	7,336,000
キトー	1,100	1,441.00	1,585,100
平和	4,100	1,714.00	7,027,400
理想科学工業	1,300	1,243.00	1,615,900
S A N K Y O	3,300	2,748.00	9,068,400
日本金銭機械	1,700	531.00	902,700
マースグループホールディングス	900	1,652.00	1,486,800

フクシマガリレイ	900	3,950.00	3,555,000
オーイズミ	600	375.00	225,000
ダイコク電機	700	969.00	678,300
竹内製作所	2,500	2,359.00	5,897,500
アマノ	3,900	2,521.00	9,831,900
J U K I	2,100	453.00	951,300
サンデンホールディングス	1,800	352.00	633,600
蛇の目マシン工業	1,300	592.00	769,600
マックス	2,200	1,484.00	3,264,800
グローリー	3,800	2,260.00	8,588,000
新晃工業	1,400	1,569.00	2,196,600
大和冷機工業	2,400	969.00	2,325,600
セガサミーホールディングス	14,600	1,430.00	20,878,000
日本ピストンリング	500	1,012.00	506,000
リケン	700	2,547.00	1,782,900
T P R	2,000	1,308.00	2,616,000
ツバキ・ナカシマ	2,800	818.00	2,290,400
ホシザキ	4,700	9,180.00	43,146,000
大豊工業	1,200	586.00	703,200
日本精工	27,800	858.00	23,852,400
N T N	34,200	210.00	7,182,000
ジェイテクト	14,200	864.00	12,268,800
不二越	1,400	4,260.00	5,964,000
日本トムソン	4,400	365.00	1,606,000
T H K	9,200	2,872.00	26,422,400
ユーシン精機	1,100	727.00	799,700
前澤給装工業	500	2,201.00	1,100,500
イーグル工業	1,900	877.00	1,666,300
前澤工業	1,000	489.00	489,000
日本ピラー工業	1,500	1,536.00	2,304,000
キッツ	6,000	576.00	3,456,000
マキタ	19,300	5,140.00	99,202,000
日立造船	11,600	424.00	4,918,400
三菱重工業	24,800	2,297.00	56,965,600
I H I	10,600	1,340.00	14,204,000
スター精密	2,300	1,445.00	3,323,500
日清紡ホールディングス	9,100	720.00	6,552,000
イビデン	9,100	4,350.00	39,585,000
コニカミノルタ	32,600	279.00	9,095,400
ブラザー工業	18,100	1,653.00	29,919,300
ミネベアミツミ	27,500	2,030.00	55,825,000
日立製作所	71,200	3,564.00	253,756,800

三菱電機	148,200	1,346.50	199,551,300
富士電機	8,900	3,410.00	30,349,000
東洋電機製造	600	1,128.00	676,800
安川電機	16,000	4,210.00	67,360,000
シンフォニアテクノロジー	2,000	1,224.00	2,448,000
明電舎	2,700	1,681.00	4,538,700
オリジン	400	1,370.00	548,000
山洋電気	700	4,785.00	3,349,500
デンヨー	1,300	2,419.00	3,144,700
東芝テック	1,900	4,210.00	7,999,000
芝浦メカトロニクス	300	3,500.00	1,050,000
マブチモーター	4,100	4,380.00	17,958,000
日本電産	35,700	11,120.00	396,984,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	288.00	288,000
トレックス・セミコンダクター	900	1,379.00	1,241,100
東光高岳	800	1,127.00	901,600
ダイヘン	1,600	4,225.00	6,760,000
ヤーマン	2,400	1,647.00	3,952,800
JVCケンウッド	12,700	153.00	1,943,100
ミマキエンジニアリング	1,500	450.00	675,000
I - P E X	700	1,936.00	1,355,200
日新電機	3,500	1,121.00	3,923,500
大崎電気工業	3,100	570.00	1,767,000
オムロン	13,300	7,820.00	104,006,000
日東工業	2,200	2,027.00	4,459,400
I D E C	2,200	1,849.00	4,067,800
正興電機製作所	400	1,588.00	635,200
不二電機工業	300	1,303.00	390,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,000	1,861.00	9,305,000
サクサホールディングス	400	1,422.00	568,800
メルコホールディングス	500	2,916.00	1,458,000
テクノメディカ	400	1,595.00	638,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	400	796.00	318,400
日本電気	18,000	5,630.00	101,340,000
富士通	14,300	13,300.00	190,190,000
沖電気工業	6,000	964.00	5,784,000
岩崎通信機	700	854.00	597,800
電気興業	700	2,665.00	1,865,500
サンケン電気	1,600	3,395.00	5,432,000
ナカヨ	300	1,475.00	442,500
アイホン	800	1,517.00	1,213,600
ルネサスエレクトロニクス	63,400	911.00	57,757,400

セイコーエプソン	18,400	1,279.00	23,533,600
ワコム	10,000	755.00	7,550,000
アルバック	2,700	3,990.00	10,773,000
アクセル	700	905.00	633,500
E I Z O	1,200	3,670.00	4,404,000
日本信号	3,800	928.00	3,526,400
京三製作所	3,500	430.00	1,505,000
能美防災	2,000	2,422.00	4,844,000
ホーチキ	1,100	1,305.00	1,435,500
星和電機	800	625.00	500,000
エレコム	1,700	5,100.00	8,670,000
パナソニック	169,300	1,005.00	170,146,500
シャープ	17,200	1,300.00	22,360,000
アンリツ	9,500	2,315.00	21,992,500
富士通ゼネラル	4,000	3,200.00	12,800,000
ソニー	92,800	9,145.00	848,656,000
T D K	7,200	12,940.00	93,168,000
帝国通信工業	700	1,164.00	814,800
タムラ製作所	5,100	516.00	2,631,600
アルプスアルパイン	13,100	1,439.00	18,850,900
池上通信機	500	811.00	405,500
鈴木	800	691.00	552,800
日本トリム	200	3,765.00	753,000
ローランド ディー . ジー .	900	1,283.00	1,154,700
フォスター電機	1,600	1,204.00	1,926,400
S M K	400	2,826.00	1,130,400
ヨコオ	1,000	2,719.00	2,719,000
ホシデン	4,100	960.00	3,936,000
ヒロセ電機	2,300	14,230.00	32,729,000
日本航空電子工業	3,400	1,489.00	5,062,600
T O A	1,600	876.00	1,401,600
マクセルホールディングス	3,200	1,113.00	3,561,600
古野電気	2,000	1,206.00	2,412,000
ユニデンホールディングス	400	2,015.00	806,000
スミダコーポレーション	1,300	1,016.00	1,320,800
アイコム	800	2,884.00	2,307,200
リオン	600	2,540.00	1,524,000
本多通信工業	1,300	470.00	611,000
船井電機	1,500	440.00	660,000
横河電機	13,600	1,676.00	22,793,600
新電元工業	500	2,277.00	1,138,500
アズビル	9,400	4,400.00	41,360,000

東亜ディーケーケー	800	848.00	678,400
日本光電工業	6,100	3,410.00	20,801,000
チノー	500	1,382.00	691,000
共和電業	1,600	435.00	696,000
日本電子材料	600	1,826.00	1,095,600
堀場製作所	2,900	5,410.00	15,689,000
アドバンテスト	11,000	6,370.00	70,070,000
小野測器	700	515.00	360,500
エスベック	1,300	1,748.00	2,272,400
キーエンス	13,400	51,010.00	683,534,000
日置電機	700	3,900.00	2,730,000
シスメックス	10,600	10,355.00	109,763,000
日本マイクロニクス	2,600	1,079.00	2,805,400
メガチップス	1,400	2,823.00	3,952,200
O B A R A G R O U P	900	3,770.00	3,393,000
澤藤電機	200	1,861.00	372,200
原田工業	700	888.00	621,600
コーセル	2,000	1,027.00	2,054,000
イリソ電子工業	1,300	4,340.00	5,642,000
オブテックスグループ	2,500	1,654.00	4,135,000
千代田インテグレ	600	1,652.00	991,200
アイ・オー・データ機器	500	1,057.00	528,500
レーザーテック	6,500	9,510.00	61,815,000
スタンレー電気	10,400	3,000.00	31,200,000
岩崎電気	600	1,352.00	811,200
ウシオ電機	8,200	1,242.00	10,184,400
岡谷電機産業	1,300	345.00	448,500
ヘリオス テクノ ホールディング	1,500	310.00	465,000
エノモト	500	1,105.00	552,500
日本セラミック	1,500	2,680.00	4,020,000
遠藤照明	800	572.00	457,600
古河電池	1,100	1,102.00	1,212,200
双信電機	800	407.00	325,600
山一電機	1,100	1,408.00	1,548,800
図研	1,000	2,880.00	2,880,000
日本電子	2,900	3,495.00	10,135,500
カシオ計算機	13,100	1,695.00	22,204,500
ファナック	13,900	22,715.00	315,738,500
日本シイエムケイ	3,700	435.00	1,609,500
エンプラス	800	2,220.00	1,776,000
大真空	600	2,200.00	1,320,000
ローム	6,200	8,240.00	51,088,000

浜松ホトニクス	10,600	5,720.00	60,632,000	
三井ハイテック	1,700	2,211.00	3,758,700	
新光電気工業	5,000	1,854.00	9,270,000	
京セラ	20,900	5,810.00	121,429,000	
太陽誘電	6,600	3,885.00	25,641,000	
村田製作所	43,500	7,475.00	325,162,500	
双葉電子工業	2,400	898.00	2,155,200	
北陸電気工業	600	946.00	567,600	
ニチコン	5,100	891.00	4,544,100	
日本ケミコン	1,200	1,512.00	1,814,400	
K O A	2,300	1,292.00	2,971,600	
市光工業	2,300	461.00	1,060,300	
小糸製作所	8,900	5,370.00	47,793,000	
ミツバ	2,800	441.00	1,234,800	
S C R E E Nホールディングス	2,600	5,750.00	14,950,000	
キャノン電子	1,400	1,477.00	2,067,800	
キャノン	73,600	1,810.00	133,216,000	代用有価証券 10,000株
リコー	37,700	638.00	24,052,600	
象印マホービン	4,000	1,909.00	7,636,000	
M U T O Hホールディングス	200	1,487.00	297,400	
東京エレクトロン	9,400	29,030.00	272,882,000	
トヨタ紡織	4,300	1,481.00	6,368,300	
芦森工業	300	887.00	266,100	
ユニプレス	2,900	856.00	2,482,400	
豊田自動織機	12,000	6,750.00	81,000,000	
モリタホールディングス	2,600	1,993.00	5,181,800	
三櫻工業	1,900	618.00	1,174,200	
デンソー	32,600	4,882.00	159,153,200	
東海理化電機製作所	3,900	1,595.00	6,220,500	
三井E & Sホールディングス	5,400	345.00	1,863,000	
川崎重工業	11,500	1,383.00	15,904,500	
名村造船所	5,000	151.00	755,000	
サノヤスホールディングス	1,900	162.00	307,800	
日本車輛製造	600	2,409.00	1,445,400	
三菱ロジスネクスト	2,000	926.00	1,852,000	
近畿車輛	200	1,329.00	265,800	
日産自動車	174,900	386.10	67,528,890	
いすゞ自動車	42,900	891.00	38,223,900	
トヨタ自動車	165,300	7,019.00	1,160,240,700	代用有価証券 35,000株
日野自動車	18,500	847.00	15,669,500	
三菱自動車工業	54,700	195.00	10,666,500	

エフテック	1,100	548.00	602,800
レシップホールディングス	600	558.00	334,800
G M B	300	608.00	182,400
ファルテック	300	619.00	185,700
武蔵精密工業	3,300	1,275.00	4,207,500
日産車体	2,900	933.00	2,705,700
新明和工業	4,000	832.00	3,328,000
極東開発工業	2,800	1,399.00	3,917,200
トピー工業	1,200	1,119.00	1,342,800
ティラド	600	1,259.00	755,400
タチエス	2,500	1,115.00	2,787,500
N O K	7,900	1,255.00	9,914,500
フタバ産業	4,200	513.00	2,154,600
K Y B	1,700	2,172.00	3,692,400
大同メタル工業	2,900	545.00	1,580,500
プレス工業	7,500	292.00	2,190,000
ミクニ	1,900	275.00	522,500
太平洋工業	3,100	1,026.00	3,180,600
河西工業	2,000	368.00	736,000
アイシン精機	12,200	3,125.00	38,125,000
マツダ	43,600	596.00	25,985,600
今仙電機製作所	1,400	634.00	887,600
本田技研工業	116,700	2,589.50	302,194,650
スズキ	29,400	4,983.00	146,500,200
S U B A R U	46,100	2,091.50	96,418,150
安永	700	1,107.00	774,900
ヤマハ発動機	20,900	1,530.00	31,977,000
T B K	1,900	442.00	839,800
エクセディ	2,000	1,329.00	2,658,000
豊田合成	4,800	2,611.00	12,532,800
愛三工業	2,400	469.00	1,125,600
盟和産業	200	880.00	176,000
日本プラスト	1,200	440.00	528,000
ヨロズ	1,400	1,196.00	1,674,400
エフ・シー・シー	2,400	1,990.00	4,776,000
シマノ	5,500	24,760.00	136,180,000
テイ・エス テック	3,400	3,065.00	10,421,000
ジャムコ	800	604.00	483,200
テルモ	41,900	4,132.00	173,130,800
クリエートメディック	500	1,006.00	503,000
日機装	4,800	1,036.00	4,972,800
日本エム・ディ・エム	900	2,271.00	2,043,900

島津製作所	17,700	3,130.00	55,401,000
JMS	1,200	907.00	1,088,400
長野計器	1,100	804.00	884,400
ブイ・テクノロジー	700	4,760.00	3,332,000
東京計器	900	895.00	805,500
愛知時計電機	200	4,430.00	886,000
インターアクション	800	1,742.00	1,393,600
オーバル	1,300	227.00	295,100
東京精密	2,700	3,715.00	10,030,500
マニー	5,900	2,824.00	16,661,600
ニコン	22,600	680.00	15,368,000
トプコン	7,500	1,215.00	9,112,500
オリンパス	82,000	2,138.00	175,316,000
理研計器	1,300	2,924.00	3,801,200
タムロン	1,200	1,566.00	1,879,200
HOYA	29,400	12,565.00	369,411,000
シード	700	643.00	450,100
ノーリツ鋼機	1,000	1,984.00	1,984,000
エー・アンド・デイ	1,300	656.00	852,800
朝日インテック	16,800	3,370.00	56,616,000
シチズン時計	17,200	282.00	4,850,400
リズム	500	630.00	315,000
大研医器	1,000	527.00	527,000
メニコン	2,100	7,600.00	15,960,000
シンシア	200	399.00	79,800
松風	700	1,550.00	1,085,000
セイコーホールディングス	2,200	1,340.00	2,948,000
ニプロ	10,200	1,142.00	11,648,400
中本パックス	400	1,557.00	622,800
スノーピーク	900	1,931.00	1,737,900
パラマウントベッドホールディングス	1,600	4,470.00	7,152,000
トランザクション	800	947.00	757,600
粧美堂	400	354.00	141,600
ニホンフラッシュ	1,400	1,362.00	1,906,800
前田工織	1,600	2,864.00	4,582,400
永大産業	1,900	307.00	583,300
アートネイチャー	1,500	674.00	1,011,000
バンダイナムコホールディングス	15,300	8,191.00	125,322,300
アイフィスジャパン	400	731.00	292,400
共立印刷	2,600	129.00	335,400
SHOEI	1,300	3,245.00	4,218,500
フランスベッドホールディングス	2,100	894.00	1,877,400

パイロットコーポレーション	2,600	3,055.00	7,943,000
萩原工業	800	1,599.00	1,279,200
トッパン・フォームズ	3,200	1,000.00	3,200,000
フジシールインターナショナル	3,300	2,058.00	6,791,400
タカラトミー	6,600	950.00	6,270,000
廣済堂	1,000	624.00	624,000
エステールホールディングス	400	604.00	241,600
タカノ	700	608.00	425,600
プロネクサス	1,200	1,144.00	1,372,800
ホクシン	900	117.00	105,300
ウッドワン	500	1,161.00	580,500
大建工業	1,000	2,060.00	2,060,000
凸版印刷	20,900	1,393.00	29,113,700
大日本印刷	19,400	2,056.00	39,886,400
共同印刷	400	2,557.00	1,022,800
N I S S H A	3,100	1,229.00	3,809,900
光村印刷	100	1,673.00	167,300
TAKARA & COMPANY	700	1,997.00	1,397,900
アシックス	13,100	1,346.00	17,632,600
ツツミ	400	2,215.00	886,000
小松ウオール工業	500	1,746.00	873,000
ヤマハ	8,800	5,230.00	46,024,000
河合楽器製作所	400	2,558.00	1,023,200
クリナップ	1,400	446.00	624,400
ピジョン	9,500	4,505.00	42,797,500
オリバー	300	2,440.00	732,000
兼松サステック	100	1,612.00	161,200
キングジム	1,200	900.00	1,080,000
リンテック	3,500	2,396.00	8,386,000
イトーキ	2,700	331.00	893,700
任天堂	9,100	57,810.00	526,071,000
三菱鉛筆	2,500	1,442.00	3,605,000
タカラスタANDARD	3,100	1,467.00	4,547,700
コクヨ	7,100	1,424.00	10,110,400
ナカバヤシ	1,400	616.00	862,400
グローブライト	700	3,675.00	2,572,500
オカムラ	5,200	848.00	4,409,600
美津濃	1,400	1,848.00	2,587,200
東京電力ホールディングス	118,200	286.00	33,805,200
中部電力	45,300	1,255.50	56,874,150
関西電力	56,100	978.80	54,910,680
中国電力	21,400	1,382.00	29,574,800

北陸電力	13,500	776.00	10,476,000
東北電力	37,000	946.00	35,002,000
四国電力	13,400	781.00	10,465,400
九州電力	30,500	900.00	27,450,000
北海道電力	13,800	426.00	5,878,800
沖縄電力	2,900	1,599.00	4,637,100
電源開発	11,800	1,468.00	17,322,400
エフオン	800	871.00	696,800
イーレックス	2,100	1,214.00	2,549,400
レノバ	2,500	1,751.00	4,377,500
東京瓦斯	28,500	2,505.00	71,392,500
大阪瓦斯	28,700	2,023.00	58,060,100
東邦瓦斯	7,300	5,880.00	42,924,000
北海道瓦斯	800	1,553.00	1,242,400
広島ガス	3,000	378.00	1,134,000
西部瓦斯	1,700	2,756.00	4,685,200
静岡ガス	4,200	1,001.00	4,204,200
メタウォーター	1,400	2,466.00	3,452,400
SBSホールディングス	1,100	2,436.00	2,679,600
東武鉄道	15,400	3,200.00	49,280,000
相鉄ホールディングス	4,800	2,662.00	12,777,600
東急	37,400	1,310.00	48,994,000
京浜急行電鉄	19,000	1,558.00	29,602,000
小田急電鉄	22,000	2,766.00	60,852,000
京王電鉄	7,700	6,650.00	51,205,000
京成電鉄	10,300	3,230.00	33,269,000
富士急行	2,000	4,715.00	9,430,000
東日本旅客鉄道	26,100	5,660.00	147,726,000
西日本旅客鉄道	13,200	4,723.00	62,343,600
東海旅客鉄道	12,300	13,255.00	163,036,500
西武ホールディングス	19,400	1,112.00	21,572,800
鴻池運輸	2,400	1,126.00	2,702,400
西日本鉄道	4,100	2,950.00	12,095,000
ハマキョウレックス	1,100	3,090.00	3,399,000
サカイ引越センター	800	4,965.00	3,972,000
近鉄グループホールディングス	14,000	4,430.00	62,020,000
阪急阪神ホールディングス	18,700	3,360.00	62,832,000
南海電気鉄道	6,700	2,525.00	16,917,500
京阪ホールディングス	6,300	4,135.00	26,050,500
神戸電鉄	300	3,660.00	1,098,000
名古屋鉄道	11,500	2,896.00	33,304,000
山陽電気鉄道	1,000	2,152.00	2,152,000

日本通運	4,900	6,730.00	32,977,000
ヤマトホールディングス	24,600	2,587.00	63,640,200
山九	3,900	3,955.00	15,424,500
丸運	1,000	239.00	239,000
丸全昭和運輸	1,200	3,295.00	3,954,000
センコーグループホールディングス	7,800	975.00	7,605,000
トナミホールディングス	300	5,960.00	1,788,000
ニッコンホールディングス	5,000	2,113.00	10,565,000
日本石油輸送	200	2,556.00	511,200
福山通運	1,800	4,770.00	8,586,000
セイノーホールディングス	10,500	1,408.00	14,784,000
エスライン	500	990.00	495,000
神奈川中央交通	300	3,955.00	1,186,500
日立物流	2,600	3,505.00	9,113,000
丸和運輸機関	1,500	4,655.00	6,982,500
C & F ロジホールディングス	1,500	1,818.00	2,727,000
九州旅客鉄道	12,300	2,300.00	28,290,000
S Gホールディングス	29,500	2,655.00	78,322,500
日本郵船	11,700	2,014.00	23,563,800
商船三井	8,900	2,461.00	21,902,900
川崎汽船	4,300	1,390.00	5,977,000
N S ユナイテッド海運	800	1,446.00	1,156,800
明治海運	1,500	404.00	606,000
飯野海運	6,700	371.00	2,485,700
共栄タンカー	200	774.00	154,800
乾汽船	800	893.00	714,400
日本航空	24,800	1,843.00	45,706,400
A N Aホールディングス	25,600	2,297.00	58,803,200
パスコ	300	1,326.00	397,800
トランコム	400	7,980.00	3,192,000
日新	1,200	1,569.00	1,882,800
三菱倉庫	4,400	3,010.00	13,244,000
三井倉庫ホールディングス	1,600	2,034.00	3,254,400
住友倉庫	5,000	1,317.00	6,585,000
澁澤倉庫	800	2,282.00	1,825,600
東陽倉庫	2,500	351.00	877,500
日本トランスシティ	3,200	536.00	1,715,200
ケイヒン	300	1,367.00	410,100
中央倉庫	800	1,200.00	960,000
川西倉庫	300	1,060.00	318,000
安田倉庫	1,100	960.00	1,056,000
ファイズホールディングス	300	1,100.00	330,000

東洋埠頭	400	1,455.00	582,000
宇徳	1,200	496.00	595,200
上組	7,800	1,915.00	14,937,000
サンリツ	300	647.00	194,100
キムラユニティー	400	1,045.00	418,000
キューソー流通システム	400	1,747.00	698,800
近鉄エクスプレス	3,000	2,391.00	7,173,000
東海運	800	308.00	246,400
エーアイティー	1,000	1,028.00	1,028,000
内外トランスライン	500	1,195.00	597,500
日本コンセプト	400	1,573.00	629,200
NEC ネットエスアイ	4,100	1,917.00	7,859,700
クロスキャット	400	1,413.00	565,200
システナ	5,200	1,963.00	10,207,600
デジタルアーツ	700	8,950.00	6,265,000
日鉄ソリューションズ	2,200	3,155.00	6,941,000
キューブシステム	800	1,408.00	1,126,400
エイジア	300	1,945.00	583,500
コア	600	1,368.00	820,800
ラクーンホールディングス	700	2,341.00	1,638,700
ソリトンシステムズ	700	2,182.00	1,527,400
ソフトクリエイトホールディングス	600	3,945.00	2,367,000
T I S	14,500	2,159.00	31,305,500
J N Sホールディングス	600	677.00	406,200
電算システム	500	3,290.00	1,645,000
グリー	8,900	561.00	4,992,900
コーエーテクモホールディングス	3,000	5,450.00	16,350,000
三菱総合研究所	600	4,215.00	2,529,000
ボルテージ	400	531.00	212,400
電算	200	2,333.00	466,600
A G S	800	909.00	727,200
ファインデックス	1,300	1,329.00	1,727,700
ブレインパッド	400	4,125.00	1,650,000
K L a b	2,700	978.00	2,640,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,800	947.00	1,704,600
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,957.00	591,400
ネクソン	36,700	3,015.00	110,650,500
アイスタイル	4,100	385.00	1,578,500
エムアップホールディングス	400	2,580.00	1,032,000
エイチーム	1,000	880.00	880,000
エニグモ	1,400	1,440.00	2,016,000
テクノスジャパン	1,200	776.00	931,200

コロプラ	4,800	937.00	4,497,600
ブロードリーフ	7,200	598.00	4,305,600
クロス・マーケティンググループ	700	353.00	247,100
デジタルハーツホールディングス	800	1,055.00	844,000
システム情報	1,100	1,237.00	1,360,700
メディアドゥ	500	7,320.00	3,660,000
じげん	3,700	333.00	1,232,100
ブイキューブ	800	2,462.00	1,969,600
エンカレッジ・テクノロジー	300	856.00	256,800
サイバーリンクス	300	4,200.00	1,260,000
フィックスターズ	1,600	1,036.00	1,657,600
CARTA HOLDINGS	600	1,380.00	828,000
オブティム	800	3,170.00	2,536,000
セレス	500	2,072.00	1,036,000
SHIFT	600	14,350.00	8,610,000
ティーガイア	1,300	1,910.00	2,483,000
セック	200	3,095.00	619,000
日本アジアグループ	1,600	432.00	691,200
テクマトリックス	2,100	1,945.00	4,084,500
プロシップ	500	1,541.00	770,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,500	2,562.00	8,967,000
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	14,190.00	43,989,000
ザッパラス	700	460.00	322,000
システムリサーチ	400	1,615.00	646,000
インターネットイニシアティブ	2,200	4,865.00	10,703,000
さくらインターネット	1,600	765.00	1,224,000
ヴィンクス	400	1,292.00	516,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	11,930.00	3,579,000
SRAホールディングス	800	2,433.00	1,946,400
システムインテグレータ	500	722.00	361,000
朝日ネット	1,100	953.00	1,048,300
eBASE	1,800	1,023.00	1,841,400
アバント	1,400	1,119.00	1,566,600
アドソル日進	500	2,795.00	1,397,500
フリービット	800	874.00	699,200
コムチュア	1,600	2,818.00	4,508,800
サイバーコム	300	1,822.00	546,600
アステリア	900	787.00	708,300
アイル	800	1,376.00	1,100,800
マークライنز	600	2,536.00	1,521,600
メディカル・データ・ビジョン	1,700	2,589.00	4,401,300
gumi	1,900	882.00	1,675,800

ショーケース	300	800.00	240,000
モバイルファクトリー	400	1,032.00	412,800
テラスカイ	500	4,700.00	2,350,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,350.00	810,000
P C Iホールディングス	600	1,136.00	681,600
パイプドHD	200	1,716.00	343,200
アイビーシー	200	1,082.00	216,400
ネオジャパン	300	2,479.00	743,700
P R T I M E S	300	3,605.00	1,081,500
ランドコンピュータ	200	1,130.00	226,000
ダブルスタンダード	200	4,780.00	956,000
オープンドア	700	1,200.00	840,000
マイネット	500	1,203.00	601,500
アカツキ	500	5,070.00	2,535,000
ベネフィットジャパン	100	1,809.00	180,900
U b i c o mホールディングス	300	2,852.00	855,600
L I N E	3,400	5,390.00	18,326,000
カナミックネットワーク	1,400	803.00	1,124,200
ノムラシステムコーポレーション	700	425.00	297,500
チェンジ	1,000	9,170.00	9,170,000
シンクロ・フード	700	299.00	209,300
オークネット	800	1,442.00	1,153,600
セグエグループ	400	1,435.00	574,000
エイトレッド	300	2,710.00	813,000
A O I T Y O H o l d i n g s	1,600	405.00	648,000
マクロミル	3,000	663.00	1,989,000
ビーグリー	300	2,191.00	657,300
オロ	500	3,580.00	1,790,000
ユーザーローカル	200	4,610.00	922,000
テモナ	300	1,254.00	376,200
サインポスト	300	953.00	285,900
ソルクシーズ	600	1,059.00	635,400
フェイス	600	969.00	581,400
プロトコーポレーション	1,300	1,136.00	1,476,800
ハイマックス	400	1,227.00	490,800
野村総合研究所	20,600	3,285.00	67,671,000
サイバネットシステム	1,100	879.00	966,900
C Eホールディングス	800	621.00	496,800
日本システム技術	200	1,784.00	356,800
インテージホールディングス	1,900	1,000.00	1,900,000
東邦システムサイエンス	400	934.00	373,600
ソースネクスト	7,000	305.00	2,135,000

インフォコム	1,600	3,965.00	6,344,000
HEROZ	200	3,065.00	613,000
ラクスル	1,200	5,230.00	6,276,000
FIG	1,700	265.00	450,500
システムサポート	300	1,584.00	475,200
イーソル	800	1,272.00	1,017,600
アルテリア・ネットワークス	1,600	1,768.00	2,828,800
東海ソフト	100	1,097.00	109,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,480.00	444,000
東名	100	1,278.00	127,800
ヴィッツ	100	2,700.00	270,000
トピラシステムズ	100	1,550.00	155,000
Link-U	100	1,788.00	178,800
フォーカスシステムズ	900	939.00	845,100
クレスコ	900	1,262.00	1,135,800
フジ・メディア・ホールディングス	14,000	1,028.00	14,392,000
オービック	5,000	20,120.00	100,600,000
ジャストシステム	2,400	7,420.00	17,808,000
TDCソフト	1,300	1,041.00	1,353,300
Zホールディングス	199,700	651.50	130,104,550
トレンドマイクロ	7,800	6,130.00	47,814,000
IDホールディングス	600	1,373.00	823,800
日本オラクル	2,900	11,240.00	32,596,000
アルファシステムズ	500	3,440.00	1,720,000
フューチャー	1,800	1,771.00	3,187,800
CAC Holdings	900	1,343.00	1,208,700
SBテクノロジー	500	3,900.00	1,950,000
トーセ	400	895.00	358,000
オービックビジネスコンサルタント	1,500	6,090.00	9,135,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,600	3,820.00	25,212,000
アイティフォー	1,800	923.00	1,661,400
東計電算	200	4,390.00	878,000
エクスネット	200	1,039.00	207,800
大塚商会	7,900	5,100.00	40,290,000
サイボウズ	1,700	3,135.00	5,329,500
ソフトブレーン	1,200	869.00	1,042,800
電通国際情報サービス	900	5,610.00	5,049,000
ACCESS	1,400	799.00	1,118,600
デジタルガレージ	2,600	3,910.00	10,166,000
EMシステムズ	2,100	811.00	1,703,100
ウェザーニューズ	500	5,510.00	2,755,000
CIJ	1,000	1,022.00	1,022,000

ビジネスエンジニアリング	200	3,710.00	742,000
日本エンタープライズ	1,600	237.00	379,200
WOWOW	700	2,897.00	2,027,900
スカラ	1,000	954.00	954,000
インテリジェント ウェイブ	900	698.00	628,200
I M A G I C A G R O U P	1,300	407.00	529,100
ネットワンシステムズ	5,500	3,680.00	20,240,000
システムソフト	3,300	96.00	316,800
アルゴグラフィックス	1,200	3,380.00	4,056,000
マーベラス	2,300	759.00	1,745,700
エイベックス	2,500	987.00	2,467,500
日本ユニシス	4,500	3,215.00	14,467,500
兼松エレクトロニクス	800	4,505.00	3,604,000
都築電気	500	1,514.00	757,000
T B S ホールディングス	8,800	1,652.00	14,537,600
日本テレビホールディングス	12,100	1,095.00	13,249,500
朝日放送グループホールディングス	1,500	695.00	1,042,500
テレビ朝日ホールディングス	4,000	1,605.00	6,420,000
スカパーJ S A Tホールディングス	9,600	478.00	4,588,800
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,441.00	2,929,200
日本BS放送	500	1,083.00	541,500
ビジョン	1,900	974.00	1,850,600
スマートバリュー	400	1,225.00	490,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	600	1,390.00	834,000
コネクシオ	800	1,237.00	989,600
クロップス	300	825.00	247,500
日本電信電話	194,300	2,294.50	445,821,350
K D D I	106,000	2,990.00	316,940,000
ソフトバンク	132,100	1,223.00	161,558,300
光通信	1,500	25,350.00	38,025,000
N T T ドコモ	104,000	3,889.00	404,456,000
エムティーアイ	1,400	914.00	1,279,600
G M O インターネット	5,200	3,015.00	15,678,000
アйдママーケティングコミュニケーション	400	397.00	158,800
K A D O K A W A	3,900	3,305.00	12,889,500
学研ホールディングス	2,000	1,452.00	2,904,000
ゼンリン	2,900	1,271.00	3,685,900
昭文社ホールディングス	700	455.00	318,500
インプレスホールディングス	1,300	177.00	230,100
アイネット	800	1,445.00	1,156,000
松竹	1,000	13,040.00	13,040,000
東宝	8,600	4,305.00	37,023,000

東映	500	17,200.00	8,600,000
エヌ・ティ・ティ・データ	38,700	1,358.00	52,554,600
ピー・シー・エー	300	4,795.00	1,438,500
ビジネスブレイン太田昭和	500	1,522.00	761,000
D T S	3,300	2,273.00	7,500,900
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,200	6,470.00	40,114,000
シーイーシー	1,600	1,538.00	2,460,800
カプコン	6,900	5,710.00	39,399,000
アイ・エス・ビー	300	2,716.00	814,800
ジャステック	900	1,502.00	1,351,800
S C S K	3,400	5,780.00	19,652,000
日本システムウエア	500	2,092.00	1,046,000
アイネス	1,500	1,526.00	2,289,000
T K C	1,200	6,870.00	8,244,000
富士ソフト	1,600	5,980.00	9,568,000
N S D	4,700	1,967.00	9,244,900
コナミホールディングス	5,300	4,985.00	26,420,500
福井コンピュータホールディングス	600	3,410.00	2,046,000
J B C Cホールディングス	1,000	1,590.00	1,590,000
ミロク情報サービス	1,300	2,197.00	2,856,100
ソフトバンクグループ	115,400	6,722.00	775,718,800
ハウスイ	200	938.00	187,600
高千穂交易	600	950.00	570,000
カワニシホールディングス	200	1,336.00	267,200
伊藤忠食品	400	5,550.00	2,220,000
エレマテック	1,400	1,039.00	1,454,600
J A L U X	400	1,390.00	556,000
あらた	1,200	5,110.00	6,132,000
トーメンデバイス	200	3,700.00	740,000
東京エレクトロン デバイス	600	3,210.00	1,926,000
フィールズ	1,200	333.00	399,600
双日	80,700	232.00	18,722,400
アルフレッサ ホールディングス	16,200	2,020.00	32,724,000
横浜冷凍	3,900	871.00	3,396,900
神栄	300	624.00	187,200
ラサ商事	800	897.00	717,600
アルコニックス	1,600	1,452.00	2,323,200
神戸物産	10,100	2,972.00	30,017,200
ハイパー	300	572.00	171,600
あい ホールディングス	2,100	1,913.00	4,017,300
ディーブイエックス	600	1,042.00	625,200
ダイワボウホールディングス	1,200	6,610.00	7,932,000

マクニカ・富士エレホールディングス	3,500	2,035.00	7,122,500
ラクト・ジャパン	600	3,170.00	1,902,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,800	986.00	2,760,800
八洲電機	1,200	950.00	1,140,000
メディアスホールディングス	900	906.00	815,400
レスターホールディングス	1,500	2,332.00	3,498,000
ジューテックホールディングス	400	968.00	387,200
大光	700	707.00	494,900
OCHIホールディングス	500	1,500.00	750,000
TOKAIホールディングス	7,800	1,084.00	8,455,200
黒谷	500	557.00	278,500
Cominix	300	713.00	213,900
三洋貿易	1,500	1,049.00	1,573,500
ビューティガレージ	300	2,879.00	863,700
ウイン・パートナーズ	1,100	1,111.00	1,222,100
ミタチ産業	500	619.00	309,500
シップヘルスケアホールディングス	2,300	5,270.00	12,121,000
明治電機工業	500	1,308.00	654,000
デリカフーズホールディングス	600	603.00	361,800
スターティアホールディングス	400	718.00	287,200
コメダホールディングス	3,200	1,865.00	5,968,000
ピーバンドットコム	200	921.00	184,200
アセンテック	300	2,165.00	649,500
富士興産	500	928.00	464,000
協栄産業	200	1,344.00	268,800
小野建	1,300	1,217.00	1,582,100
南陽	400	1,758.00	703,200
佐島電機	1,100	820.00	902,000
エコートレーディング	400	608.00	243,200
伯東	900	1,136.00	1,022,400
コンドーテック	1,200	1,061.00	1,273,200
中山福	900	497.00	447,300
ナガイレーベン	2,000	2,718.00	5,436,000
三菱食品	1,600	2,792.00	4,467,200
松田産業	1,100	1,606.00	1,766,600
第一興商	2,200	3,725.00	8,195,000
メディバルホールディングス	15,800	1,832.00	28,945,600
SPK	600	1,303.00	781,800
萩原電気ホールディングス	600	2,299.00	1,379,400
アズワン	1,000	15,900.00	15,900,000
スズデン	500	1,159.00	579,500
シモジマ	900	1,328.00	1,195,200

ドウシシャ	1,400	1,925.00	2,695,000
小津産業	400	1,844.00	737,600
高速	900	1,554.00	1,398,600
たけびし	500	1,450.00	725,000
リックス	400	1,684.00	673,600
丸文	1,400	487.00	681,800
ハピネット	1,300	1,471.00	1,912,300
橋本総業ホールディングス	300	2,356.00	706,800
日本ライフライン	4,300	1,400.00	6,020,000
タカショー	1,000	685.00	685,000
マルカ	500	2,262.00	1,131,000
I D O M	4,000	568.00	2,272,000
進和	900	2,014.00	1,812,600
エスケイジャパン	400	602.00	240,800
ダイトロン	600	1,493.00	895,800
シークス	1,900	1,301.00	2,471,900
田中商事	500	702.00	351,000
オーハシテクニカ	800	1,463.00	1,170,400
白銅	600	1,309.00	785,400
ダイコー通産	100	1,395.00	139,500
伊藤忠商事	99,100	2,568.00	254,488,800
丸紅	152,000	577.20	87,734,400
高島	300	1,832.00	549,600
長瀬産業	8,200	1,395.00	11,439,000
蝶理	1,000	1,684.00	1,684,000
豊田通商	16,300	3,145.00	51,263,500
三共生興	2,300	439.00	1,009,700
兼松	5,500	1,294.00	7,117,000
ツカモトコーポレーション	300	1,231.00	369,300
三井物産	126,400	1,706.00	215,638,400
日本紙パルプ商事	800	3,815.00	3,052,000
カメイ	1,900	1,141.00	2,167,900
東都水産	200	4,045.00	809,000
O U Gホールディングス	200	2,849.00	569,800
スターゼン	600	4,310.00	2,586,000
山善	5,700	1,068.00	6,087,600
椿本興業	300	3,740.00	1,122,000
住友商事	92,100	1,217.00	112,085,700
内田洋行	600	5,440.00	3,264,000
三菱商事	95,700	2,389.50	228,675,150
第一実業	700	4,000.00	2,800,000
キャノンマーケティングジャパン	3,600	2,236.00	8,049,600

西華産業	800	1,211.00	968,800
佐藤商事	1,200	1,023.00	1,227,600
菱洋エレクトロ	1,500	2,966.00	4,449,000
東京産業	1,400	548.00	767,200
ユアサ商事	1,400	3,115.00	4,361,000
神鋼商事	400	1,843.00	737,200
トルク	1,000	293.00	293,000
阪和興業	2,700	2,099.00	5,667,300
正栄食品工業	1,000	3,865.00	3,865,000
カナデン	1,200	1,355.00	1,626,000
菱電商事	1,100	1,598.00	1,757,800
フルサト工業	800	1,371.00	1,096,800
岩谷産業	3,400	4,810.00	16,354,000
ナイス	700	1,361.00	952,700
昭光通商	500	602.00	301,000
ニチモウ	200	1,852.00	370,400
極東貿易	400	1,491.00	596,400
イワキ	2,000	532.00	1,064,000
三愛石油	3,600	1,100.00	3,960,000
稲畑産業	3,200	1,407.00	4,502,400
G S Iクレオス	400	1,964.00	785,600
明和産業	1,500	411.00	616,500
クワザワホールディングス	600	569.00	341,400
ヤマエ久野	1,100	1,238.00	1,361,800
ワキタ	3,200	1,131.00	3,619,200
東邦ホールディングス	4,700	2,054.00	9,653,800
サンゲツ	4,000	1,583.00	6,332,000
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,277.00	2,809,400
シナネンホールディングス	600	3,025.00	1,815,000
伊藤忠エネクス	3,300	968.00	3,194,400
サンリオ	4,100	1,793.00	7,351,300
サンワテクノス	1,100	944.00	1,038,400
リョーサン	1,600	1,984.00	3,174,400
新光商事	2,200	884.00	1,944,800
トーヨー	700	1,932.00	1,352,400
三信電気	800	2,152.00	1,721,600
東陽テクニカ	1,600	1,110.00	1,776,000
モスフードサービス	1,900	2,858.00	5,430,200
加賀電子	1,500	2,072.00	3,108,000
ソーダニッカ	1,600	572.00	915,200
立花エレクトック	1,100	1,765.00	1,941,500
フォーバル	700	942.00	659,400

PAL TAC	2,300	5,600.00	12,880,000
三谷産業	2,000	440.00	880,000
太平洋興発	600	609.00	365,400
西本Wismettacホールディングス	300	1,847.00	554,100
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,429.00	285,800
コア商事ホールディングス	400	1,311.00	524,400
国際紙パルプ商事	3,600	251.00	903,600
ヤマタネ	700	1,404.00	982,800
丸紅建材リース	200	1,728.00	345,600
日鉄物産	1,100	3,165.00	3,481,500
泉州電業	400	2,975.00	1,190,000
トラスコ中山	3,400	2,812.00	9,560,800
オートバックスセブン	5,500	1,352.00	7,436,000
モリト	1,100	612.00	673,200
加藤産業	2,100	3,550.00	7,455,000
北恵	400	1,000.00	400,000
イノテック	800	975.00	780,000
イエローハット	2,800	1,708.00	4,782,400
J Kホールディングス	1,400	820.00	1,148,000
日伝	1,300	2,301.00	2,991,300
北沢産業	1,200	291.00	349,200
杉本商事	800	2,176.00	1,740,800
因幡電機産業	4,200	2,597.00	10,907,400
東テク	500	2,525.00	1,262,500
ミスミグループ本社	18,300	3,245.00	59,383,500
アルテック	1,100	307.00	337,700
タキヒヨー	500	1,808.00	904,000
蔵王産業	300	1,341.00	402,300
スズケン	6,200	3,785.00	23,467,000
ジェコス	1,000	952.00	952,000
グローセル	1,600	408.00	652,800
ローソン	3,700	4,945.00	18,296,500
サンエー	1,200	4,415.00	5,298,000
カワチ薬品	1,100	3,130.00	3,443,000
エービーシー・マート	2,300	5,800.00	13,340,000
ハードオフコーポレーション	600	669.00	401,400
アスクル	1,500	4,090.00	6,135,000
ゲオホールディングス	2,600	1,583.00	4,115,800
アダストリア	2,000	1,731.00	3,462,000
ジーフット	1,000	445.00	445,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	430.00	129,000
くら寿司	900	6,210.00	5,589,000

キャンドウ	700	1,944.00	1,360,800
パルグループホールディングス	1,500	1,200.00	1,800,000
エディオン	6,700	1,019.00	6,827,300
サーラコーポレーション	3,000	596.00	1,788,000
ワッツ	700	800.00	560,000
ハローズ	600	3,390.00	2,034,000
フジオフードグループ本社	1,200	1,421.00	1,705,200
あみやき亭	300	2,913.00	873,900
ひらまつ	2,800	196.00	548,800
大黒天物産	400	5,680.00	2,272,000
ハニーズホールディングス	1,300	986.00	1,281,800
ファーマライズホールディングス	400	768.00	307,200
アルペン	1,100	2,517.00	2,768,700
ハブ	400	607.00	242,800
クオールホールディングス	2,200	1,128.00	2,481,600
ジーンズホールディングス	800	7,860.00	6,288,000
ビックカメラ	8,600	1,154.00	9,924,400
D C Mホールディングス	8,800	1,291.00	11,360,800
MonotaRO	10,400	5,820.00	60,528,000
東京一番フーズ	400	579.00	231,600
きちりホールディングス	400	668.00	267,200
アークランドサービスホールディングス	1,200	2,083.00	2,499,600
J.フロント リテイリング	17,400	809.00	14,076,600
ドトール・日レスホールディングス	2,100	1,464.00	3,074,400
マツモトキヨシホールディングス	6,000	4,150.00	24,900,000
ブロンコビリー	800	2,317.00	1,853,600
Z O Z O	10,000	2,855.00	28,550,000
トレジャー・ファクトリー	400	718.00	287,200
物語コーポレーション	400	11,200.00	4,480,000
ココカラファイン	1,500	6,970.00	10,455,000
三越伊勢丹ホールディングス	25,500	516.00	13,158,000
Hamee	500	1,809.00	904,500
ウエルシアホールディングス	8,600	4,325.00	37,195,000
クリエイトSDホールディングス	2,500	3,615.00	9,037,500
丸善CHIホールディングス	1,800	369.00	664,200
ミサワ	300	787.00	236,100
ティーライフ	200	1,157.00	231,400
チムニー	500	1,235.00	617,500
シュッピン	1,100	915.00	1,006,500
オイシックス・ラ・大地	1,400	3,490.00	4,886,000
ネクステージ	2,500	1,240.00	3,100,000
ジョイフル本田	4,300	1,621.00	6,970,300

鳥貴族	400	1,573.00	629,200
キリン堂ホールディングス	600	3,505.00	2,103,000
ホットランド	1,100	1,232.00	1,355,200
すかいらーくホールディングス	16,300	1,537.00	25,053,100
SFPホールディングス	800	1,303.00	1,042,400
綿半ホールディングス	1,100	1,360.00	1,496,000
ヨシックス	200	1,655.00	331,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,200	1,140.00	4,788,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	866.00	692,800
B E E N O S	700	2,155.00	1,508,500
あさひ	1,100	1,628.00	1,790,800
日本調剤	900	1,682.00	1,513,800
コスモス薬品	1,300	18,200.00	23,660,000
トーエル	700	793.00	555,100
オンリー	300	483.00	144,900
セブン&アイ・ホールディングス	57,100	3,240.00	185,004,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,800	562.00	4,383,600
ツルハホールディングス	3,200	14,950.00	47,840,000
サンマルクホールディングス	1,200	1,506.00	1,807,200
フェリシモ	300	1,329.00	398,700
トリドールホールディングス	3,600	1,379.00	4,964,400
T O K Y O B A S E	1,300	414.00	538,200
ウイルプラスホールディングス	200	570.00	114,000
J Mホールディングス	1,100	2,423.00	2,665,300
サツドラホールディングス	200	1,997.00	399,400
アレンザホールディングス	700	1,394.00	975,800
串カツ田中ホールディングス	400	1,758.00	703,200
パロックジャパンリミテッド	1,000	675.00	675,000
クスリのアオキホールディングス	1,300	8,770.00	11,401,000
力の源ホールディングス	700	612.00	428,400
スシローグローバルホールディングス	8,000	2,922.00	23,376,000
メディカルシステムネットワーク	1,500	444.00	666,000
はるやまホールディングス	700	676.00	473,200
ノジマ	2,600	3,050.00	7,930,000
カップ・クリエイト	2,100	1,448.00	3,040,800
ライトオン	1,100	650.00	715,000
ジーンズメイト	500	307.00	153,500
良品計画	19,300	2,137.00	41,244,100
三城ホールディングス	1,600	285.00	456,000
アドヴァン	2,200	1,365.00	3,003,000
アルビス	500	2,617.00	1,308,500

コナカ	1,800	243.00	437,400
ハウス オブ ローゼ	200	1,639.00	327,800
G - 7ホールディングス	900	2,342.00	2,107,800
イオン北海道	1,900	894.00	1,698,600
コジマ	2,600	678.00	1,762,800
ヒマラヤ	600	893.00	535,800
コーナン商事	2,100	3,570.00	7,497,000
エコス	500	2,345.00	1,172,500
ワタミ	1,700	983.00	1,671,100
マルシェ	400	543.00	217,200
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	32,100	2,294.00	73,637,400
西松屋チェーン	3,200	1,705.00	5,456,000
ゼンショーホールディングス	7,000	2,526.00	17,682,000
幸楽苑ホールディングス	900	1,818.00	1,636,200
ハークスレイ	300	923.00	276,900
サイゼリヤ	2,200	1,838.00	4,043,600
V Tホールディングス	6,100	374.00	2,281,400
魚力	400	1,759.00	703,600
フジ・コーポレーション	400	2,215.00	886,000
ユナイテッドアローズ	1,500	1,358.00	2,037,000
ハイデイ日高	2,100	1,705.00	3,580,500
京都きもの友禅	1,000	231.00	231,000
コロワイド	4,800	1,623.00	7,790,400
ピーシーデポコーポレーション	1,900	666.00	1,265,400
壱番屋	1,000	5,420.00	5,420,000
P L A N T	400	798.00	319,200
スギホールディングス	2,900	7,190.00	20,851,000
薬王堂ホールディングス	600	2,591.00	1,554,600
スクロール	2,300	737.00	1,695,100
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,850.00	2,775,000
木曽路	1,900	2,497.00	4,744,300
S R Sホールディングス	1,700	911.00	1,548,700
千趣会	2,700	330.00	891,000
タカキュー	1,300	139.00	180,700
リテールパートナーズ	1,900	1,457.00	2,768,300
ケーヨー	3,000	785.00	2,355,000
上新電機	1,700	2,644.00	4,494,800
日本瓦斯	2,300	5,060.00	11,638,000
ロイヤルホールディングス	2,500	1,869.00	4,672,500
東天紅	100	970.00	97,000
いなげや	1,800	1,832.00	3,297,600
島忠	2,700	5,510.00	14,877,000

チヨダ	1,500	961.00	1,441,500
ライフコーポレーション	1,100	3,755.00	4,130,500
リンガーハット	1,800	2,228.00	4,010,400
MrMaxHD	2,000	822.00	1,644,000
テンアライド	1,400	356.00	498,400
AOKIホールディングス	2,900	446.00	1,293,400
オークワ	2,300	1,413.00	3,249,900
コメリ	2,200	3,025.00	6,655,000
青山商事	3,000	497.00	1,491,000
しまむら	1,700	11,310.00	19,227,000
はせがわ	400	285.00	114,000
高島屋	10,600	809.00	8,575,400
松屋	3,000	711.00	2,133,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,900	621.00	4,284,900
近鉄百貨店	600	3,290.00	1,974,000
丸井グループ	13,300	1,987.00	26,427,100
アクシアル リテイリング	1,200	4,700.00	5,640,000
イオン	56,100	2,808.00	157,528,800
イズミ	3,000	3,505.00	10,515,000
平和堂	3,000	2,153.00	6,459,000
フジ	1,800	2,016.00	3,628,800
ヤオコー	1,700	7,620.00	12,954,000
ゼビオホールディングス	1,800	712.00	1,281,600
ケーズホールディングス	14,000	1,346.00	18,844,000
Olympicグループ	700	960.00	672,000
日産東京販売ホールディングス	2,200	263.00	578,600
シルバーライフ	200	1,996.00	399,200
Genky DrugStores	600	4,380.00	2,628,000
ナルミヤ・インターナショナル	300	785.00	235,500
ブックオフグループホールディングス	800	858.00	686,400
アインホールディングス	1,800	7,710.00	13,878,000
元気寿司	400	2,336.00	934,400
ヤマダホールディングス	44,300	507.00	22,460,100
アークランドサカモト	2,300	2,004.00	4,609,200
ニトリホールディングス	6,300	22,250.00	140,175,000
愛眼	1,200	227.00	272,400
ケーユーホールディングス	800	790.00	632,000
吉野家ホールディングス	4,800	1,942.00	9,321,600
松屋フーズホールディングス	700	3,480.00	2,436,000
サガミホールディングス	2,000	1,291.00	2,582,000
関西スーパーマーケット	1,200	1,251.00	1,501,200
王将フードサービス	1,100	6,060.00	6,666,000

プレナス	1,600	1,730.00	2,768,000	
ミニストップ	1,100	1,375.00	1,512,500	
アークス	3,000	2,297.00	6,891,000	
パローホールディングス	3,200	2,625.00	8,400,000	
藤久	300	997.00	299,100	
ベルク	700	6,610.00	4,627,000	
大庄	800	1,097.00	877,600	
ファーストリテイリング	2,000	75,480.00	150,960,000	
サンドラッグ	5,500	4,155.00	22,852,500	
サクスパー ホールディングス	1,300	538.00	699,400	
ヤマザワ	400	1,738.00	695,200	
やまや	300	2,188.00	656,400	
ペルーナ	3,200	873.00	2,793,600	
島根銀行	400	597.00	238,800	
じもとホールディングス	1,000	1,047.00	1,047,000	
めぶきフィナンシャルグループ	75,800	216.00	16,372,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	1,177.00	2,354,000	
九州フィナンシャルグループ	31,900	513.00	16,364,700	
ゆうちょ銀行	41,400	859.00	35,562,600	
富山第一銀行	3,500	302.00	1,057,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	83,400	362.00	30,190,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,700	732.00	7,100,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	8,600	408.00	3,508,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,404.00	1,965,600	
第四北越フィナンシャルグループ	2,500	2,074.00	5,185,000	
ひろぎんホールディングス	21,500	576.00	12,384,000	
新生銀行	10,700	1,350.00	14,445,000	
あおぞら銀行	8,700	1,764.00	15,346,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	999,600	426.80	426,629,280	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	158,800	354.00	56,215,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,600	2,884.50	79,612,200	
三井住友フィナンシャルグループ	101,100	2,957.00	298,952,700	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	48,700	567.00	27,612,900	
群馬銀行	28,100	343.00	9,638,300	
武蔵野銀行	2,200	1,563.00	3,438,600	
千葉興業銀行	4,000	250.00	1,000,000	
筑波銀行	6,000	188.00	1,128,000	
七十七銀行	4,900	1,535.00	7,521,500	
青森銀行	1,100	2,411.00	2,652,100	
秋田銀行	900	1,577.00	1,419,300	
山形銀行	1,700	1,320.00	2,244,000	

岩手銀行	1,000	2,415.00	2,415,000	
東邦銀行	13,100	236.00	3,091,600	
東北銀行	700	1,100.00	770,000	
みちのく銀行	900	1,175.00	1,057,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,300	1,861.00	22,890,300	
静岡銀行	35,600	726.00	25,845,600	
十六銀行	1,800	1,993.00	3,587,400	
スルガ銀行	14,900	356.00	5,304,400	
八十二銀行	35,300	400.00	14,120,000	
山梨中央銀行	1,700	903.00	1,535,100	
大垣共立銀行	2,900	2,460.00	7,134,000	
福井銀行	1,300	1,978.00	2,571,400	
北國銀行	1,500	2,899.00	4,348,500	
清水銀行	600	1,800.00	1,080,000	
富山銀行	300	3,245.00	973,500	
滋賀銀行	2,900	2,372.00	6,878,800	
南都銀行	2,400	1,937.00	4,648,800	
百五銀行	13,100	329.00	4,309,900	
京都銀行	5,200	4,885.00	25,402,000	
紀陽銀行	5,200	1,673.00	8,699,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,700	1,022.00	9,913,400	
山陰合同銀行	8,700	553.00	4,811,100	
中国銀行	12,600	951.00	11,982,600	
鳥取銀行	500	1,147.00	573,500	
伊予銀行	20,800	684.00	14,227,200	
百十四銀行	1,600	1,706.00	2,729,600	
四国銀行	2,300	761.00	1,750,300	
阿波銀行	2,400	2,690.00	6,456,000	
大分銀行	800	2,568.00	2,054,400	
宮崎銀行	1,000	2,382.00	2,382,000	
佐賀銀行	900	1,388.00	1,249,200	
沖縄銀行	1,300	3,095.00	4,023,500	
琉球銀行	3,400	896.00	3,046,400	
セブン銀行	48,800	245.00	11,956,000	
みずほフィナンシャルグループ	198,600	1,341.00	266,322,600	
高知銀行	500	748.00	374,000	
山口フィナンシャルグループ	18,200	717.00	13,049,400	
長野銀行	500	1,440.00	720,000	
名古屋銀行	1,100	2,752.00	3,027,200	
北洋銀行	22,000	227.00	4,994,000	
愛知銀行	500	3,130.00	1,565,000	
中京銀行	600	2,180.00	1,308,000	

大光銀行	500	1,364.00	682,000
愛媛銀行	2,000	1,170.00	2,340,000
トマト銀行	600	1,025.00	615,000
京葉銀行	6,300	492.00	3,099,600
栃木銀行	7,000	188.00	1,316,000
北日本銀行	500	2,051.00	1,025,500
東和銀行	2,600	719.00	1,869,400
福島銀行	1,400	233.00	326,200
大東銀行	800	619.00	495,200
トモニホールディングス	11,300	333.00	3,762,900
フィデアホールディングス	14,100	108.00	1,522,800
池田泉州ホールディングス	17,000	161.00	2,737,000
F P G	4,600	479.00	2,203,400
マーキュリアインベストメント	600	640.00	384,000
S B Iホールディングス	16,800	2,596.00	43,612,800
ジャフコ グループ	2,200	4,830.00	10,626,000
大和証券グループ本社	117,300	435.10	51,037,230
野村ホールディングス	257,200	497.80	128,034,160
岡三証券グループ	12,500	346.00	4,325,000
丸三証券	4,400	475.00	2,090,000
東洋証券	5,500	120.00	660,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,800	285.00	4,788,000
光世証券	400	654.00	261,600
水戸証券	4,200	223.00	936,600
いちよし証券	2,800	423.00	1,184,400
松井証券	8,400	850.00	7,140,000
マネックスグループ	10,800	268.00	2,894,400
極東証券	2,000	706.00	1,412,000
岩井コスモホールディングス	1,400	1,295.00	1,813,000
藍澤証券	2,700	702.00	1,895,400
マネーパートナーズグループ	1,600	202.00	323,200
スパークス・グループ	7,000	237.00	1,659,000
かんぽ生命保険	5,100	1,671.00	8,522,100
S O M P Oホールディングス	27,500	3,957.00	108,817,500
アニコム ホールディングス	4,800	1,215.00	5,832,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	38,200	2,908.50	111,104,700
第一生命ホールディングス	82,700	1,575.50	130,293,850
東京海上ホールディングス	51,700	4,796.00	247,953,200
T & Dホールディングス	43,600	1,058.00	46,128,800
アドバンスクリエイト	300	2,065.00	619,500
全国保証	4,100	4,470.00	18,327,000
ジェイリース	400	772.00	308,800

イントラスト	500	920.00	460,000
日本モーゲージサービス	600	1,076.00	645,600
C a s a	500	1,287.00	643,500
アルヒ	2,300	2,155.00	4,956,500
プレミアグループ	800	2,105.00	1,684,000
クレディセゾン	10,200	1,198.00	12,219,600
芙蓉総合リース	1,500	6,220.00	9,330,000
みずほリース	2,200	2,677.00	5,889,400
東京センチュリー	2,900	5,660.00	16,414,000
日本証券金融	6,500	514.00	3,341,000
アイフル	22,300	322.00	7,180,600
リコーリース	1,200	2,907.00	3,488,400
イオンフィナンシャルサービス	9,000	1,119.00	10,071,000
アコム	29,400	487.00	14,317,800
ジャックス	1,600	1,850.00	2,960,000
オリエントコーポレーション	39,600	112.00	4,435,200
日立キャピタル	3,500	2,261.00	7,913,500
オリックス	90,700	1,348.50	122,308,950
三菱UFJリース	37,100	454.00	16,843,400
九州リースサービス	800	610.00	488,000
日本取引所グループ	42,000	2,550.00	107,100,000
イー・ギャランティ	1,700	2,105.00	3,578,500
アサックス	800	745.00	596,000
NECキャピタルソリューション	600	1,792.00	1,075,200
いちご	18,800	313.00	5,884,400
日本駐車場開発	15,000	132.00	1,980,000
スター・マイカ・ホールディングス	800	1,481.00	1,184,800
ADワークスグループ	3,200	155.00	496,000
ヒューリック	31,000	1,025.00	31,775,000
三栄建築設計	600	1,822.00	1,093,200
野村不動産ホールディングス	8,900	1,924.00	17,123,600
三重交通グループホールディングス	3,100	477.00	1,478,700
サムティ	2,100	1,755.00	3,685,500
ディア・ライフ	2,200	395.00	869,000
コーセーアールイー	600	547.00	328,200
日本商業開発	1,000	1,780.00	1,780,000
プレサンスコーポレーション	2,500	1,554.00	3,885,000
THEグローバル社	1,000	208.00	208,000
ハウスコム	300	1,290.00	387,000
日本管理センター	800	1,444.00	1,155,200
サンセイランディック	500	757.00	378,500
エストラスト	300	756.00	226,800

フージャースホールディングス	3,000	695.00	2,085,000
オープンハウス	4,600	3,940.00	18,124,000
東急不動産ホールディングス	39,800	472.00	18,785,600
飯田グループホールディングス	12,200	1,961.00	23,924,200
イーランド	300	788.00	236,400
ムゲンエステート	1,000	535.00	535,000
ビーロッド	800	786.00	628,800
ファーストブラザーズ	300	992.00	297,600
ハウストゥ	800	1,325.00	1,060,000
シーアールイー	400	1,415.00	566,000
プロパティエージェント	300	1,462.00	438,600
ケイアイスター不動産	500	2,716.00	1,358,000
アグレ都市デザイン	400	630.00	252,000
グッドコムアセット	800	1,437.00	1,149,600
ジェイ・エス・ビー	300	3,020.00	906,000
テンポイノベーション	400	888.00	355,200
グローバル・リンク・マネジメント	400	742.00	296,800
パーク24	7,900	1,395.00	11,020,500
パラカ	400	1,681.00	672,400
三井不動産	71,100	1,855.00	131,890,500
三菱地所	102,400	1,625.00	166,400,000
平和不動産	2,700	3,180.00	8,586,000
東京建物	14,500	1,261.00	18,284,500
ダイビル	3,800	1,289.00	4,898,200
京阪神ビルディング	2,400	2,177.00	5,224,800
住友不動産	32,900	3,006.00	98,897,400
テーオーシー	3,000	649.00	1,947,000
東京楽天地	300	4,505.00	1,351,500
スターツコーポレーション	2,000	2,569.00	5,138,000
フジ住宅	1,900	603.00	1,145,700
空港施設	1,700	471.00	800,700
明和地所	1,000	477.00	477,000
ゴールドクレスト	1,200	1,418.00	1,701,600
エスリード	600	1,366.00	819,600
日神グループホールディングス	2,400	396.00	950,400
日本エスコン	2,700	908.00	2,451,600
タカラレーベン	6,900	298.00	2,056,200
A V A N T I A	900	893.00	803,700
イオンモール	7,400	1,702.00	12,594,800
毎日コムネット	500	729.00	364,500
ファースト住建	700	1,016.00	711,200
カチタス	3,600	3,200.00	11,520,000

トーセイ	2,100	1,100.00	2,310,000
サンフロンティア不動産	2,200	898.00	1,975,600
エフ・ジェー・ネクスト	1,300	1,025.00	1,332,500
インテリックス	600	522.00	313,200
ランドビジネス	700	335.00	234,500
グランディハウス	1,300	358.00	465,400
日本空港ビルデング	4,700	4,520.00	21,244,000
明豊ファシリティワークス	700	623.00	436,100
日本工営	1,000	2,875.00	2,875,000
L I F U L L	5,000	401.00	2,005,000
ミクシィ	2,700	2,846.00	7,684,200
ジェイエイシーリクルートメント	900	1,359.00	1,223,100
日本M&Aセンター	10,800	6,330.00	68,364,000
メンバーズ	400	2,029.00	811,600
中広	200	453.00	90,600
UTグループ	2,200	3,335.00	7,337,000
アイティメディア	600	2,824.00	1,694,400
タケエイ	1,600	1,069.00	1,710,400
E・Jホールディングス	300	2,266.00	679,800
ビーネックスグループ	1,800	1,048.00	1,886,400
コシダカホールディングス	3,400	392.00	1,332,800
アルトナー	300	889.00	266,700
パソナグループ	1,600	1,740.00	2,784,000
C D S	400	1,310.00	524,000
リンクアンドモチベーション	2,600	422.00	1,097,200
G C A	1,800	675.00	1,215,000
エス・エム・エス	4,400	3,180.00	13,992,000
サニーサイドアップグループ	500	671.00	335,500
パーソルホールディングス	14,100	1,666.00	23,490,600
リニカル	700	765.00	535,500
クックパッド	4,600	386.00	1,775,600
エスクリ	500	332.00	166,000
アイ・ケイ・ケイ	700	663.00	464,100
学情	500	1,002.00	501,000
スタジオアリス	700	1,980.00	1,386,000
シミックホールディングス	700	1,340.00	938,000
エプコ	300	1,062.00	318,600
N J S	300	1,938.00	581,400
総合警備保障	5,600	5,100.00	28,560,000
カカクコム	10,500	2,944.00	30,912,000
アイロムグループ	500	1,907.00	953,500
セントケア・ホールディング	900	730.00	657,000

サイネックス	300	859.00	257,700
ルネサンス	800	810.00	648,000
ディップ	1,900	2,090.00	3,971,000
デジタルホールディングス	1,000	1,378.00	1,378,000
新日本科学	1,500	691.00	1,036,500
ツクイホールディングス	3,400	554.00	1,883,600
キャリアデザインセンター	300	1,031.00	309,300
ベネフィット・ワン	5,200	2,845.00	14,794,000
エムスリー	31,200	7,769.00	242,392,800
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	251.00	276,100
プラス	200	423.00	84,600
アウトソーシング	8,100	1,184.00	9,590,400
ウェルネット	1,400	525.00	735,000
ワールドホールディングス	500	2,253.00	1,126,500
ディー・エヌ・エー	6,000	1,817.00	10,902,000
博報堂D Yホールディングス	19,700	1,405.00	27,678,500
ぐるなび	2,400	623.00	1,495,200
タカミヤ	1,500	565.00	847,500
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	1,067.00	1,173,700
ファンコミュニケーションズ	3,900	471.00	1,836,900
ライク	500	2,295.00	1,147,500
ビジネス・ブレークスルー	600	400.00	240,000
エスプール	3,700	730.00	2,701,000
WDBホールディングス	600	3,260.00	1,956,000
手間いらず	100	5,160.00	516,000
ティア	800	404.00	323,200
C D G	100	1,624.00	162,400
バリューコマース	1,000	3,415.00	3,415,000
インフォマート	14,300	949.00	13,570,700
J Pホールディングス	4,400	302.00	1,328,800
エコナックホールディングス	2,400	90.00	216,000
E P Sホールディングス	1,900	987.00	1,875,300
レッグス	400	1,522.00	608,800
プレステージ・インターナショナル	5,300	913.00	4,838,900
アミューズ	800	2,571.00	2,056,800
ドリームインキュベータ	400	1,537.00	614,800
クイック	900	1,096.00	986,400
T A C	900	229.00	206,100
ケネディクス	12,200	654.00	7,978,800
電通グループ	15,900	3,035.00	48,256,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	550.00	275,000
ぴあ	400	2,967.00	1,186,800

イオンファンタジー	500	2,199.00	1,099,500
シーティーエス	1,600	927.00	1,483,200
ネクシィーズグループ	400	1,002.00	400,800
H.U.グループホールディングス	4,000	2,720.00	10,880,000
アルプス技研	1,300	2,096.00	2,724,800
ダイオーズ	300	943.00	282,900
日本空調サービス	1,500	763.00	1,144,500
オリエンタルランド	15,100	15,705.00	237,145,500
ダスキン	3,500	2,786.00	9,751,000
明光ネットワークジャパン	1,800	624.00	1,123,200
ファルコホールディングス	800	1,645.00	1,316,000
秀英予備校	300	411.00	123,300
ラウンドワン	4,000	868.00	3,472,000
リゾートトラスト	6,500	1,532.00	9,958,000
ビー・エム・エル	1,800	3,050.00	5,490,000
ワタベウェディング	200	277.00	55,400
りらいあコミュニケーションズ	2,500	1,233.00	3,082,500
リソー教育	6,500	331.00	2,151,500
早稲田アカデミー	600	986.00	591,600
ユー・エス・エス	15,800	1,992.00	31,473,600
東京個別指導学院	500	612.00	306,000
サイバーエージェント	8,700	6,350.00	55,245,000
楽天	66,000	1,078.00	71,148,000
クリーク・アンド・リバー社	700	1,041.00	728,700
テー・オー・ダブリュー	2,400	288.00	691,200
山田コンサルティンググループ	900	1,035.00	931,500
セントラルスポーツ	500	2,291.00	1,145,500
フルキャストホールディングス	1,200	1,623.00	1,947,600
エン・ジャパン	2,500	2,560.00	6,400,000
リソルホールディングス	200	3,715.00	743,000
テクノプロ・ホールディングス	2,800	7,070.00	19,796,000
アトラ	400	266.00	106,400
インターワークス	300	332.00	99,600
アイ・アールジャパンホールディングス	600	12,690.00	7,614,000
Keeper 技研	1,000	1,513.00	1,513,000
ファーストロジック	300	836.00	250,800
三機サービス	300	983.00	294,900
Gunosy	900	777.00	699,300
デザインワン・ジャパン	500	235.00	117,500
イー・ガーディアン	600	3,480.00	2,088,000
リブセンス	800	267.00	213,600
ジャパンマテリアル	4,300	1,478.00	6,355,400

ベクトル	1,800	895.00	1,611,000
ウチヤマホールディングス	700	309.00	216,300
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	1,223.00	1,467,600
キャリアリンク	500	1,541.00	770,500
I B J	1,100	973.00	1,070,300
アサンテ	600	1,580.00	948,000
N・フィールド	1,000	722.00	722,000
バリューHR	600	1,688.00	1,012,800
M&Aキャピタルパートナーズ	1,100	5,730.00	6,303,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	2,369.00	1,184,500
E R Iホールディングス	400	650.00	260,000
アビスト	200	2,791.00	558,200
シグマクシス	1,000	1,549.00	1,549,000
ウィルグループ	900	848.00	763,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,100	316.00	663,600
メドピア	700	5,680.00	3,976,000
リクルートホールディングス	101,400	4,434.00	449,607,600
エラン	1,000	2,609.00	2,609,000
土木管理総合試験所	700	404.00	282,800
ネットマーケティング	600	599.00	359,400
日本郵政	116,000	739.80	85,816,800
ベルシステム24ホールディングス	2,400	1,650.00	3,960,000
鎌倉新書	1,100	1,104.00	1,214,400
S M N	300	810.00	243,000
一蔵	200	365.00	73,000
L I T A L I C O	500	3,160.00	1,580,000
グローバルキッズCOMPANY	300	769.00	230,700
エアトリ	700	1,346.00	942,200
ハイアス・アンド・カンパニー	900	159.00	143,100
アトラエ	400	2,735.00	1,094,000
ストライク	500	5,890.00	2,945,000
ソラスト	3,900	1,373.00	5,354,700
セラク	400	2,062.00	824,800
インソース	600	3,560.00	2,136,000
ベikalレント・コンサルティング	900	16,190.00	14,571,000
Orchestra Holdings	300	2,300.00	690,000
アイモバイル	500	1,283.00	641,500
キャリアインデックス	600	482.00	289,200
M S - J a p a n	500	819.00	409,500
船場	300	915.00	274,500
グレイステクノロジー	700	5,930.00	4,151,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,600	4,250.00	6,800,000

フルテック	200	1,443.00	288,600
グリーンズ	400	481.00	192,400
ツナググループ・ホールディングス	300	410.00	123,000
GameWith	400	555.00	222,000
ソウルドアウト	300	1,466.00	439,800
MS&Consulting	300	615.00	184,500
エル・ティー・エス	100	5,000.00	500,000
ミダック	200	2,823.00	564,600
日総工産	1,000	820.00	820,000
キュービーネットホールディングス	600	1,584.00	950,400
RPAホールディングス	1,100	718.00	789,800
スプリックス	400	906.00	362,400
マネジメントソリューションズ	700	1,493.00	1,045,100
プロレド・パートナーズ	200	5,060.00	1,012,000
and factory	100	851.00	85,100
フロンティア・マネジメント	100	5,350.00	535,000
ピアラ	100	2,518.00	251,800
コプロ・ホールディングス	100	3,270.00	327,000
ギークス	100	1,171.00	117,100
カーブスホールディングス	3,900	678.00	2,644,200
フォーラムエンジニアリング	700	918.00	642,600
アドバンテッジリスクマネジメント	700	701.00	490,700
リログループ	7,700	2,580.00	19,866,000
東祥	900	1,183.00	1,064,700
エイチ・アイ・エス	2,200	1,467.00	3,227,400
ラックランド	400	2,264.00	905,600
共立メンテナンス	2,300	3,990.00	9,177,000
イチネンホールディングス	1,600	1,278.00	2,044,800
建設技術研究所	900	2,043.00	1,838,700
スペース	900	794.00	714,600
長大	600	1,276.00	765,600
燦ホールディングス	600	1,250.00	750,000
スバル興業	100	8,000.00	800,000
東京テアトル	600	1,285.00	771,000
タナベ経営	300	1,394.00	418,200
ナガワ	500	8,600.00	4,300,000
よみうりランド	300	4,800.00	1,440,000
東京都競馬	900	5,170.00	4,653,000
常磐興産	600	1,485.00	891,000
カナモト	2,500	2,212.00	5,530,000
東京ドーム	5,700	882.00	5,027,400
西尾レントオール	1,300	2,040.00	2,652,000

トランス・コスモス	1,300	3,160.00	4,108,000	
乃村工藝社	6,100	729.00	4,446,900	
藤田観光	600	1,526.00	915,600	
KNT-CTホールディングス	900	925.00	832,500	
日本管財	1,500	2,117.00	3,175,500	
トーカイ	1,400	2,074.00	2,903,600	
白洋舎	200	2,350.00	470,000	
セコム	15,000	9,167.00	137,505,000	
セントラル警備保障	700	3,365.00	2,355,500	
丹青社	2,700	748.00	2,019,600	
メイテック	1,700	5,240.00	8,908,000	
応用地質	1,700	1,250.00	2,125,000	
船井総研ホールディングス	2,900	2,540.00	7,366,000	
進学会ホールディングス	300	422.00	126,600	
オオバ	1,000	791.00	791,000	
いであ	300	1,708.00	512,400	
学究社	400	1,065.00	426,000	
ベネッセホールディングス	4,700	2,551.00	11,989,700	
イオンディライト	1,700	2,825.00	4,802,500	
ナック	800	928.00	742,400	
ダイセキ	2,400	2,775.00	6,660,000	
ステップ	500	1,596.00	798,000	
合 計	15,605,600		34,394,247,690	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年11月30日現在です。

【インデックスファンド日本株式(DC専用)】

【純資産額計算書】

資産総額	2,208,513,730円
負債総額	9,816,989円
純資産総額(-)	2,198,696,741円
発行済口数	979,653,187口
1口当たり純資産額(/)	2.2444円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	35,952,962,359円
負債総額	174,895,473円
純資産総額(-)	35,778,066,886円
発行済口数	21,445,433,227口
1口当たり純資産額(/)	1.6683円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2020年11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11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11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11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	847	234,110
株式投資信託	790	200,621
単位型	277	11,204
追加型	513	189,416
公社債投資信託	57	33,489
単位型	44	1,698
追加型	13	31,791

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第62期中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第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				

ソフトウェア	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
未払法人税等		2,382	1,439
未払消費税等	4	621	4
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		第61期	
	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		(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	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756
当期変動額							

剰余金の配当				1,640	1,640		1,640
当期純利益				8,823	8,823		8,823
自己株式の取得						47	47
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)							
当期変動額合計	-	-	-	7,182	7,182	47	7,135
当期末残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	408	346	754	62,511
当期変動額				
剰余金の配当				1,640
当期純利益				8,823
自己株式の取得				47
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	85	160	75	75
当期変動額合計	85	160	75	7,060
当期末残高	493	185	679	69,571

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	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	3年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p>				

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

（未適用の会計基準等）

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

（1）概要

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

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

（2）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

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

<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 1,347百万円</p> <p>未収収益 127百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 350百万円</p> <p>未払費用 767百万円</p> <p>その他 162百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務468百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 151百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 623百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務365百万円に対して保証を行っております。</p>
---	---

(損益計算書関係)

第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)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 1,831百万円</p> <p>デリバティブ収益 54百万円</p> <p>支払利息 75百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 4,849百万円</p>

(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 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	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、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	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ドマネの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	9,340	8,440	900
	小計	9,340	8,440	900
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	7,400	7,589	188
	小計	7,400	7,589	188
合計		16,740	16,029	711

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

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				
	売建				
	米ドル		2,251	-	42
	豪ドル		63	-	0
	シンガポール ドル	投資有価証券	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tockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

権利未行使残	-	-
--------	---	---

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,171,500	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。

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tockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,633百万円
 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)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	820	賞与引当金	822
投資有価証券評価損	96	投資有価証券評価損	102
関係会社株式評価損	1,430	関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	430	退職給付引当金	427
固定資産減価償却費	103	固定資産減価償却費	96
その他	761	その他	744
繰延税金資産小計	3,643	繰延税金資産小計	3,624
評価性引当金	1,430	評価性引当金	1,430
繰延税金資産合計	2,212	繰延税金資産合計	2,194
繰延税金負債		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	172
繰延ヘッジ利益	81	繰延税金負債合計	172
繰延税金負債合計	299	繰延税金資産の純額	2,022
繰延税金資産の純額	1,913		
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%	法定実効税率	30.6%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.8%	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	4.4%	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	0.6%	その他	1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%	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 貸建) (注1)	8 (SGD 104 千)	-	-
							資金の貸付 (米国ドル 貸建) (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 貸建) (注3)	17 (USD 209 千)	未収収益	17 (USD 209 千)
							資金の貸付 (円貸建) (注3)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注3)	12	未収収益	3
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 貸建) (注6)	5,364 (USD 50,000 千) (注7)	-	-
							資金の借入 の返済 (米国ドル 貸建) (注6)	5,526 (USD 50,000 千) (注7)	-	-
							借入金利息 (米国ドル 貸建) (注6)	65 (USD 593 千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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(円貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建)(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

- 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。
- 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せん。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無い場合、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無い場合、記載しておりません。

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せん。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載してありません。

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ありません。

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。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第62期中間会計期間 (2020年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	23,938
有価証券	42
未収委託者報酬	14,700
未収収益	838
関係会社短期貸付金	2,323
その他	2
流動資産合計	44,833
固定資産	
有形固定資産	1
無形固定資産	408
投資その他の資産	154
投資有価証券	21,271
関係会社株式	25,769
長期差入保証金	462
繰延税金資産	1,702
投資その他の資産合計	49,206
固定資産合計	49,769
資産合計	94,603

(単位：百万円)

第62期中間会計期間

(2020年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	7,010
未払費用	3,510
未払法人税等	1,507
未払消費税等	3 562
賞与引当金	1,606
役員賞与引当金	27
その他	1,069
流動負債合計	15,294
固定負債	
退職給付引当金	1,452
その他	315
固定負債合計	1,768
負債合計	17,062
純資産の部	
株主資本	
資本金	17,363
資本剰余金	
資本準備金	5,220
資本剰余金合計	5,220
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	55,970
利益剰余金合計	55,970
自己株式	2,067
株主資本合計	76,486
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	645
繰延ヘッジ損益	408
評価・換算差額等合計	1,054
純資産合計	77,541
負債純資産合計	94,603

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第62期中間会計期間

(自 2020年4月1日

至 2020年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	35,275
その他営業収益	1,507

営業収益合計		36,782
営業費用及び一般管理費	1	32,215
営業利益		4,567
営業外収益	2	789
営業外費用	3	418
経常利益		4,938
特別利益	4	43
特別損失	5	91
税引前中間純利益		4,891
法人税等	6	1,452
中間純利益		3,438

(3) 中間株主資本等変動計算書

第62期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073
当中間期変動額							
剰余金の配当				2,862	2,862		2,862
中間純利益				3,438	3,438		3,438
自己株式の取得						1,161	1,161
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計	-	-	-	575	575	1,161	586
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	55,970	55,970	2,067	76,486

	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	60	389	329	77,402
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,862
中間純利益				3,438
自己株式の取得				1,161
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	706	18	724	724
当中間期変動額合計	706	18	724	138
当中間期末残高	645	408	1,054	77,541

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第62期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>

5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理していません。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算していません。</p>
-----------------------------	--

(中間貸借対照表関係)

第62期中間会計期間 (2020年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	2,060百万円
2 信託資産	流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4 保証債務	当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務28百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

第62期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	43百万円
無形固定資産	20百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	40百万円
受取配当金	719百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	60百万円
デリバティブ費用	338百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	43百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	90百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

第62期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	1,454,500	1,405,500	-	2,860,000

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間 会計 期間末 残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,184,700	-	270,600	914,100	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,346,000	-	319,000	1,027,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	2,394,000	-	402,000	1,992,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,939,000	-	-	2,939,000	-
合計		7,863,700	-	991,600	6,872,100	-

(注) 1 当中間会計期間の減少は、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)914,100株、2016年度ストックオプション(1)1,027,000株、2016年度ストックオプション(2)1,198,000株及び2017年度ストックオプション(1)986,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(2)794,000株及び2017年度ストックオプション(1)1,953,000株は権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月12日 取締役会	普通株式	2,862	14.64	2020年3月31日	2020年7月1日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの該当事項はありません。

(リース取引関係)

第62期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	911百万円
1年超	5,692百万円
合計	6,604百万円

(金融商品関係)

第62期中間会計期間(2020年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

2020年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	23,938	23,938	-
(2) 未収委託者報酬	14,700	14,700	-
(3) 未収収益	838	838	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,323	2,323	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	21,297	21,297	-
(6) 未払金	(7,010)	(7,010)	-
(7) 未払費用	(3,510)	(3,510)	-
(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	(15)	(15)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	14	14	-
デリバティブ取引計	(1)	(1)	-

(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21百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、36百万円は、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65百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、51百万円は、流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証

券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

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

(有価証券関係)

第62期中間会計期間(2020年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	9,871	8,550	1,320
	小計	9,871	8,550	1,320
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	11,425	11,815	389
	小計	11,425	11,815	389
合計		21,297	20,366	930

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

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

(デリバティブ取引関係)

第62期中間会計期間(2020年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,250	-	36	36
合計		2,250	-	36	36

(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	1,766	-	21	21
合計		1,766	-	21	21

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

2 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価証券	4,775	-	53
	豪ドル		3	-	0
	シンガポールドル		509	-	1
	ユーロ		47	-	0
	香港ドル		1,068	-	12
	人民元		2,404	-	48
	合計		8,808	-	14

(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62期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,003百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	10,460百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,335百万円

(ストックオプション等関係)

第62期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第62期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

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

[関連情報]

第62期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第62期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第62期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第62期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第62期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
1株当たり純資産額	399円38銭
1株当たり中間純利益金額	17円64銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第62期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益(百万円)	3,438
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	3,438
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,864
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1)914,100株、 2016年度ストックオプション(1)1,027,000株、 2016年度ストックオプション(2)1,992,000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62期中間会計期間 (2020年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	77,541
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	77,541
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間会計期間末の普通株式の数(千株)	194,153

(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

野村信託銀行株式会社	35,000百万円	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。
------------	-----------	---

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2020年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
日本生命保険相互会社	100,000百万円 (基金の総額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 2月 6日	有価証券届出書
2020年 2月 6日	有価証券報告書
2020年 8月 6日	有価証券届出書の訂正届出書
2020年 8月 6日	半期報告書

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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年12月16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 公認会計士 佐々木 貴司
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

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」に掲げられているインデックスファンド日本株式（DC専用）の2019年11月7日から2020年11月6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、インデックスファンド日本株式（DC専用）の2020年11月6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、継続企業的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、継続企業的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。継続企業的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。

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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月4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

中間監査意見

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。

- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。