

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年3月1日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 安倍 秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）（以下「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

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

（７）【申込期間】

2021年3月2日から2021年8月31日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（９）【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

インデックス型

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

株式 一般

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

年1回

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

日本

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざします。

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

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

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

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

主な投資制限

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

分配方針

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

信託金限度額

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

(2) 【ファンドの沿革】

2004年11月30日

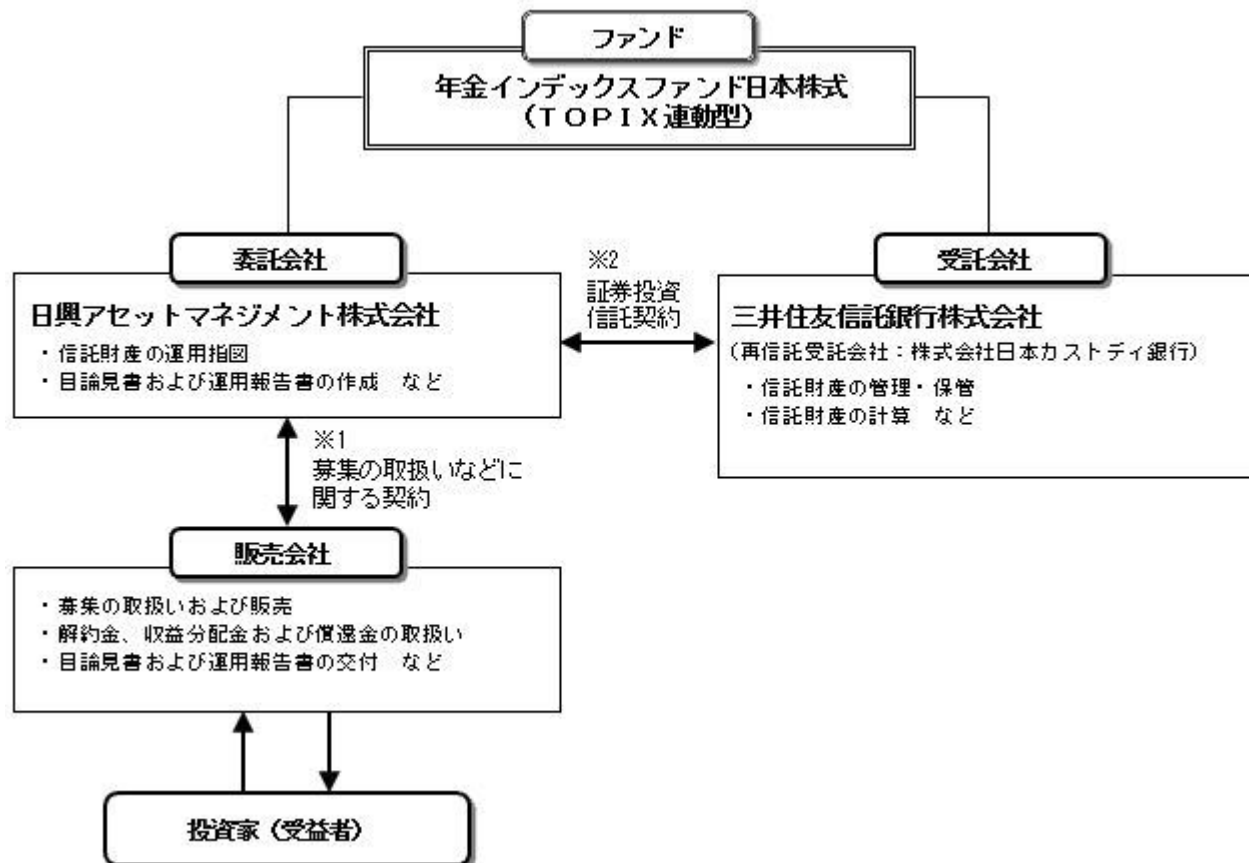
- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

2014年5月31日

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

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2020年12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、TOPIX（東証株価指数）に採用されているわが国の株式に投資を行ない、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、株価指数先物取引など（TOPIX先物取引）を活用する場合があります。
- ・株式の実質組入比率は高位を保つことを原則とします。
- ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

(2)【投資対象】

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

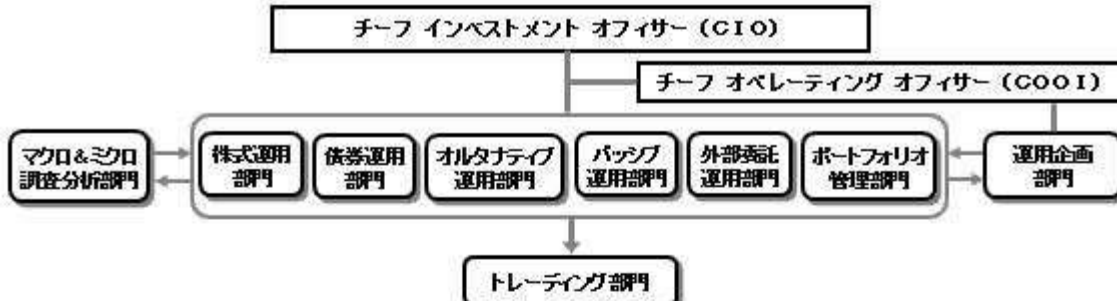
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
次の取引ができます。

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引

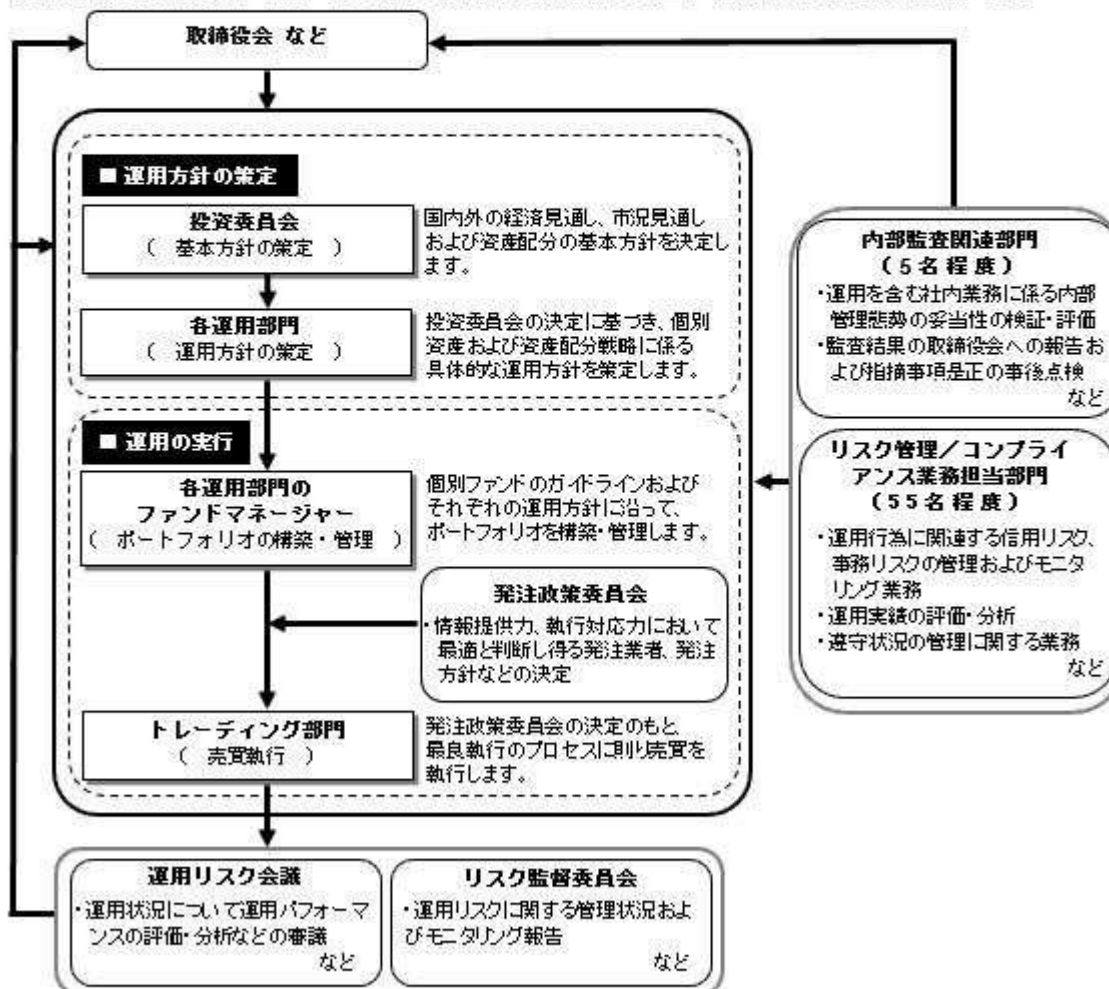
- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- 8) 資金の借入

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆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12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ないます。

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

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

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

3) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。

4) 外貨建資産への投資は行ないません。

5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることがで

きます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
 - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
 - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 14) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 15) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場

合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

- ・ 投資者の皆様は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）の皆様には帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・ 当ファンドは、主に株式を投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

有価証券の貸付などにおけるリスク

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

< T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

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

- ・ T O P I X（東証株価指数）の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行

なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。

- ・組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。
- ・先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きとTOPIX(東証株価指数)の採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

<その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

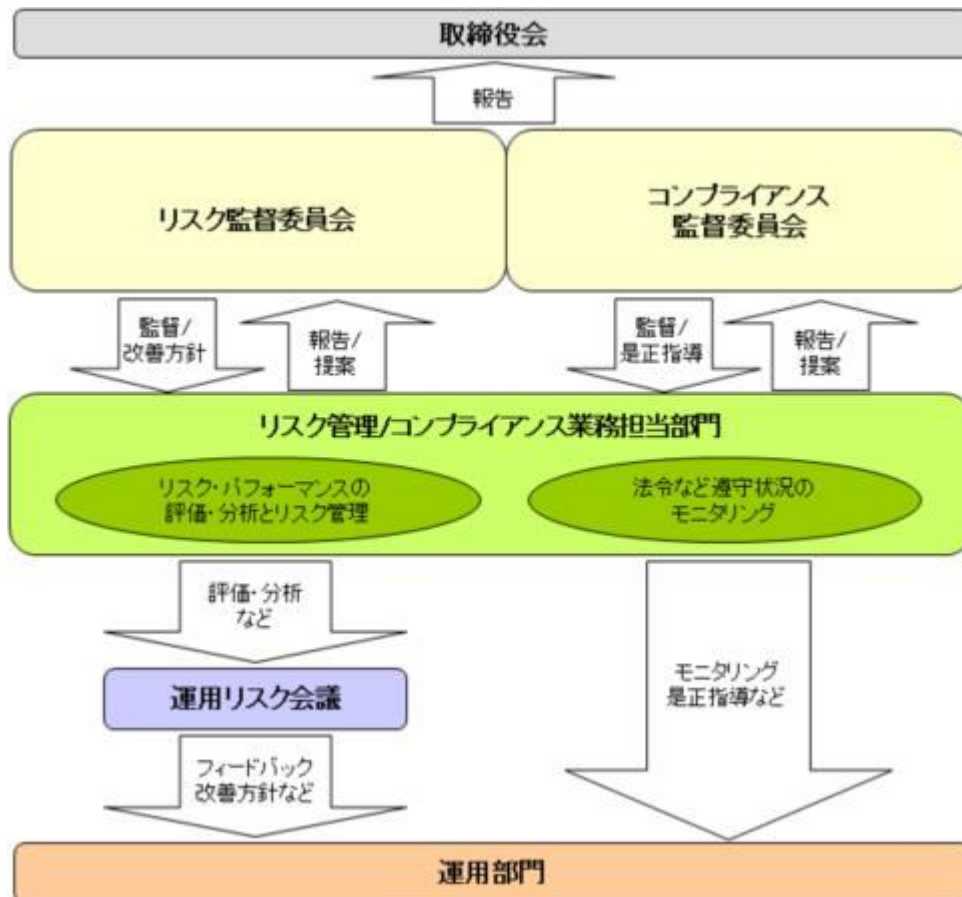
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

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。

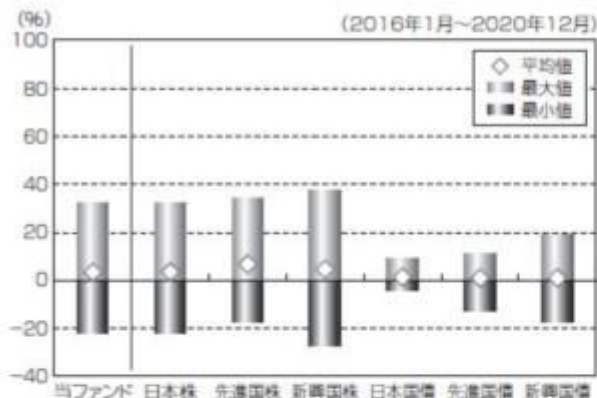
運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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12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%	3.6%	6.8%	4.6%	1.4%	1.0%	1.0%
最大値	32.0%	32.2%	34.1%	37.2%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-22.1%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2016年1月から2020年12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・ティパーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について**東証株価指数 (TOPIX、配当込)**

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

MSCI-KOKUSAIインデックス (配当込、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込、円ベース)

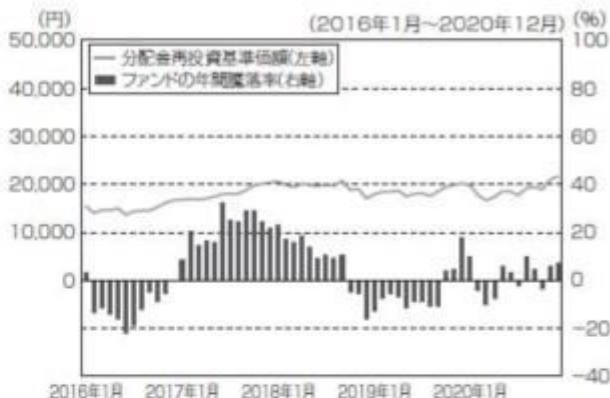
当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2016年1月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.154%（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
0.140%	0.052%	0.065%	0.023%

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料に0.44（税抜0.4）を乗じて得た貸

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

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

確定拠出年金の場合

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

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

厚生年金基金および企業年金基金の場合

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

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

規約型企業年金の場合

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

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

上記以外の場合

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

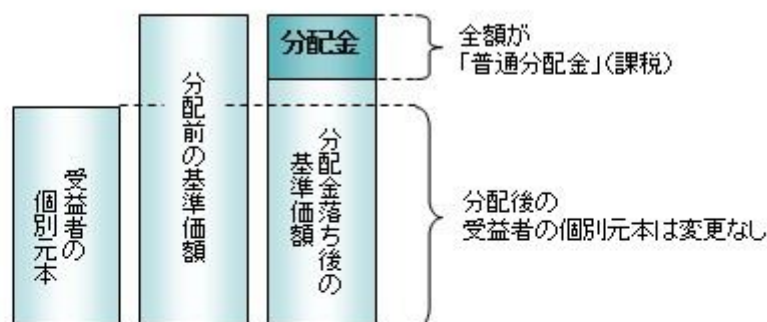
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

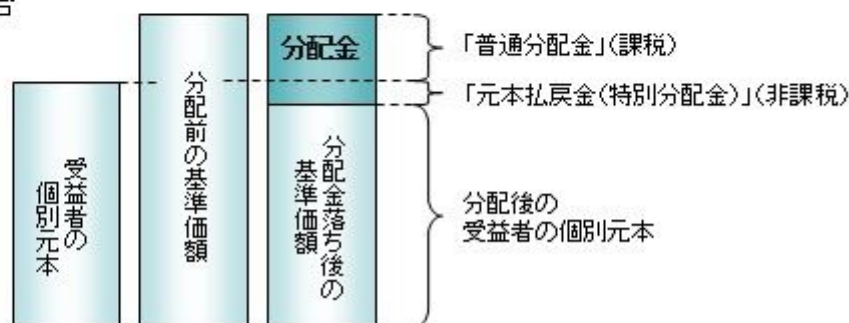
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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3月1日現在のものですので、税法、確定給付企業年金法および確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

以下の運用状況は2020年12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（％）
株式	日本	66,561,238,730	99.02
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		659,742,886	0.98
合計（純資産総額）		67,220,981,616	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	667,665,000	0.99

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	297,100	6,733.04	2,000,387,256	7,957.00	2,364,024,700	3.52
日本	株式	ソニー	電気機器	166,800	7,071.69	1,179,559,000	10,285.00	1,715,538,000	2.55
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	207,300	5,110.96	1,059,503,414	8,058.00	1,670,423,400	2.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	24,100	44,496.82	1,072,373,520	58,000.00	1,397,800,000	2.08
日本	株式	任天堂	その他製品	16,300	44,988.59	733,314,040	65,830.00	1,073,029,000	1.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	349,300	2,447.76	855,004,833	2,645.50	924,073,150	1.37
日本	株式	日本電産	電気機器	64,100	6,938.79	444,776,974	12,980.00	832,018,000	1.24
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	221,500	4,093.32	906,671,405	3,755.00	831,732,500	1.24
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,796,500	436.91	784,921,673	456.10	819,383,650	1.22
日本	株式	信越化学工業	化学	44,800	12,726.54	570,149,202	18,040.00	808,192,000	1.20
日本	株式	第一三共	医薬品	228,600	3,170.39	724,752,840	3,535.00	808,101,000	1.20
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	182,300	3,765.10	686,378,079	4,321.00	787,718,300	1.17
日本	株式	ダイキン工業	機械	33,900	16,240.93	550,567,581	22,920.00	776,988,000	1.16
日本	株式	HOYA	精密機器	52,800	10,353.65	546,672,968	14,270.00	753,456,000	1.12
日本	株式	村田製作所	電気機器	78,200	6,266.48	490,039,248	9,320.00	728,824,000	1.08
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	16,900	22,969.85	388,190,590	38,400.00	648,960,000	0.97
日本	株式	ファナック	電気機器	25,000	19,367.26	484,181,515	25,360.00	634,000,000	0.94

日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	209,700	2,794.74	586,057,117	2,877.50	603,411,750	0.90
日本	株式	KDDI	情報・通信業	190,500	3,158.44	601,683,250	3,066.00	584,073,000	0.87
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	181,600	3,088.53	560,878,225	3,188.00	578,940,800	0.86
日本	株式	エムスリー	サービス業	56,100	4,496.99	252,281,260	9,743.00	546,582,300	0.81
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	183,400	2,346.85	430,413,568	2,964.00	543,597,600	0.81
日本	株式	S M C	機械	8,400	56,445.80	474,144,756	62,950.00	528,780,000	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	127,900	3,584.83	458,500,700	4,065.00	519,913,500	0.77
日本	株式	花王	化学	63,700	8,843.21	563,312,550	7,970.00	507,689,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	92,800	4,628.91	429,563,659	5,308.00	492,582,400	0.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	356,800	1,329.56	474,387,236	1,307.50	466,516,000	0.69
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	27,100	15,552.90	421,483,652	17,040.00	461,784,000	0.69
日本	株式	中外製薬	医薬品	83,300	5,252.86	437,563,630	5,503.00	458,399,900	0.68
日本	株式	三菱商事	卸売業	171,900	2,478.14	425,993,260	2,541.00	436,797,900	0.65

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.14
		建設業	2.33
		食料品	3.49
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.22
		化学	7.50
		医薬品	5.87
		石油・石炭製品	0.36
		ゴム製品	0.50
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.61
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.60
		機械	5.72
		電気機器	17.13
		輸送用機器	7.33
		精密機器	2.77
		その他製品	2.75
		電気・ガス業	1.29
陸運業	3.45		
海運業	0.19		
空運業	0.38		
倉庫・運輸関連業	0.17		

	情報・通信業	9.07
	卸売業	4.53
	小売業	4.74
	銀行業	4.41
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	1.89
	その他金融業	1.10
	不動産業	1.92
	サービス業	5.74
合 計		99.02

【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 2021年03月	買建	37	日本円	655,820,350	667,665,000	0.99

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第7計算期間末 (2011年 5月31日)	11,800	11,814	0.8348	0.8358
第8計算期間末 (2012年 5月31日)	12,319	12,335	0.7308	0.7318
第9計算期間末 (2013年 5月31日)	18,870	18,886	1.1759	1.1769
第10計算期間末 (2014年 6月 2日)	18,195	18,210	1.2858	1.2868
第11計算期間末 (2015年 6月 1日)	27,517	27,532	1.7971	1.7981
第12計算期間末 (2016年 5月31日)	27,352	27,370	1.5035	1.5045
第13計算期間末 (2017年 5月31日)	33,130	33,149	1.7427	1.7437
第14計算期間末 (2018年 5月31日)	41,841	41,862	1.9775	1.9785
第15計算期間末 (2019年 5月31日)	40,637	40,661	1.7476	1.7486
第16計算期間末 (2020年 6月 1日)	58,379	58,411	1.8556	1.8566
2019年12月末日	61,266		2.0132	
2020年 1月末日	60,064		1.9698	
2月末日	53,751		1.7673	
3月末日	51,257		1.6613	

4月末日	53,711		1.7328
5月末日	58,206		1.8504
6月末日	57,850		1.8460
7月末日	55,472		1.7715
8月末日	59,853		1.9160
9月末日	60,901		1.9406
10月末日	59,344		1.8854
11月末日	65,060		2.0957
12月末日	67,220		2.1576

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第7期	2010年 6月 1日～2011年 5月31日	0.0010
第8期	2011年 6月 1日～2012年 5月31日	0.0010
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	0.0010
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	0.0010
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	0.0010
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	0.0010
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	0.0010
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	0.0010
第15期	2018年 6月 1日～2019年 5月31日	0.0010
第16期	2019年 6月 1日～2020年 6月 1日	0.0010
当中間期	2020年 6月 2日～2020年12月 1日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第7期	2010年 6月 1日～2011年 5月31日	2.88
第8期	2011年 6月 1日～2012年 5月31日	12.34
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	61.04
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	9.43
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	39.84
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	16.28
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	15.98
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	13.53
第15期	2018年 6月 1日～2019年 5月31日	11.58
第16期	2019年 6月 1日～2020年 6月 1日	6.24
当中間期	2020年 6月 2日～2020年12月 1日	13.80

(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】

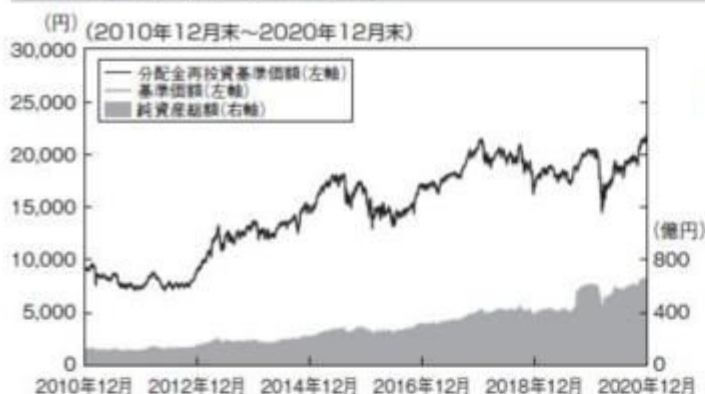
期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第7期	2010年 6月 1日～2011年 5月31日	2,416,667,454	921,766,695
第8期	2011年 6月 1日～2012年 5月31日	3,959,202,241	1,239,279,452
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	4,667,083,142	5,475,394,820
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	5,541,023,939	7,437,910,957
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	6,052,501,542	4,891,151,568
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	7,174,553,570	4,294,430,475
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	5,730,325,471	4,911,678,612
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	6,496,323,254	4,348,409,754
第15期	2018年 6月 1日～2019年 5月31日	6,092,908,576	3,998,730,448
第16期	2019年 6月 1日～2020年 6月 1日	14,798,267,469	6,589,455,296
当中間期	2020年 6月 2日～2020年12月 1日	3,389,341,479	3,832,594,121

参考情報

運用実績

2020年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額21,576円

純資産総額672.20億円

※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12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5月	2017年5月	2018年5月	2019年5月	2020年6月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	130円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	99.02%
株式先物	0.99%
現金その他	0.98%

※対純資産総額比です。

<組入上位10銘柄>

銘柄		業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.52%
2	ソニー	電気機器	2.55%
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.48%
4	キーエンス	電気機器	2.08%
5	任天堂	その他製品	1.60%
6	日本電信電話	情報・通信業	1.37%
7	日本電産	電気機器	1.24%
8	武田薬品工業	医薬品	1.24%
9	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.22%
10	信越化学工業	化学	1.20%

※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。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

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

合は、当該規定に従うものとしします。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

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

(4) 申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(5) 申込単位

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

(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。

確定給付企業年金法および確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関などでない場合、解約価額から解約に係る所定の税金が差し引かれます。

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

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

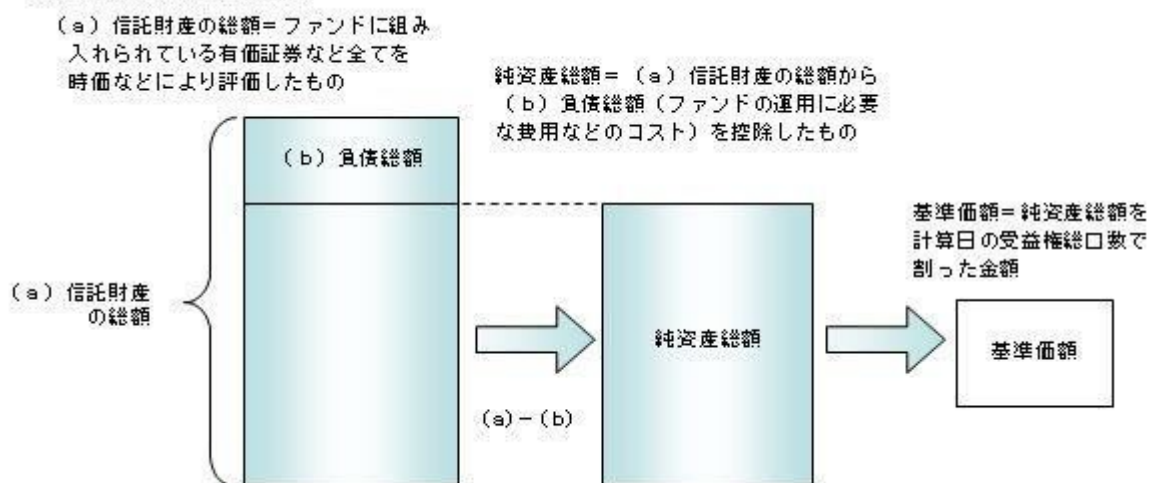
3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

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

<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>

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

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
 - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更

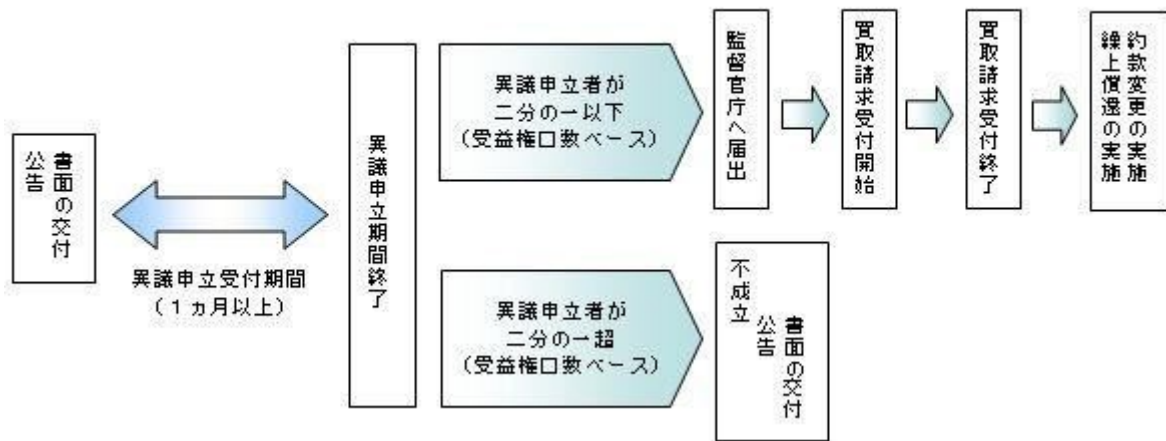
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4)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

異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行いません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、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16期計算期間（2019年6月1日から2020年6月1日まで）の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 2019年 5月31日現在	第16期 2020年 6月 1日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,789,878,216	4,400,071,521
コール・ローン	749,048,347	876,965,950
株式	39,583,035,700	57,197,888,200
派生商品評価勘定	-	58,385,400
未収入金	611,000	-
未収配当金	421,106,951	546,748,470
前払金	38,510,000	-
その他未収収益	8,528,675	6,456,736
流動資産合計	42,590,718,889	63,086,516,277
資産合計		
	42,590,718,889	63,086,516,277
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	56,188,880	282,750
前受金	-	47,320,000
未払金	2,996,500	13,286,700
未払収益分配金	23,253,184	31,461,996
未払解約金	40,015,754	163,145,864
未払受託者報酬	6,722,157	8,402,824
未払委託者報酬	32,893,260	41,401,811
未払利息	1,103	1,385
受入担保金	1,789,878,216	4,400,071,521
その他未払費用	893,040	1,228,701
流動負債合計	1,952,842,094	4,706,603,552
負債合計		
	1,952,842,094	4,706,603,552
純資産の部		
元本等		
元本	23,253,184,012	31,461,996,185
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,384,692,783	26,917,916,540
（分配準備積立金）	8,140,757,959	7,530,802,756
元本等合計	40,637,876,795	58,379,912,725
純資産合計		
	40,637,876,795	58,379,912,725
負債純資産合計		
	42,590,718,889	63,086,516,277

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自 2018年 6月 1日	至 2019年 5月31日	自 2019年 6月 1日	至 2020年 6月 1日
営業収益				
受取配当金		977,383,523		1,220,745,835
受取利息		2,606		1,629
有価証券売買等損益		5,905,394,374		1,389,420,631
派生商品取引等損益		75,084,860		63,158,470
その他収益		24,473,403		28,831,921
営業収益合計		4,978,619,702		2,702,158,486
営業費用				
支払利息		225,345		219,133
受託者報酬		13,626,929		16,415,824
委託者報酬		66,682,608		80,482,157
その他費用		3,722,183		5,136,728
営業費用合計		84,257,065		102,253,842
営業利益又は営業損失（ ）		5,062,876,767		2,599,904,644
経常利益又は経常損失（ ）		5,062,876,767		2,599,904,644
当期純利益又は当期純損失（ ）		5,062,876,767		2,599,904,644
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（ ）		326,984,396		321,413,392
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		20,682,516,597		17,384,692,783
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,334,519,561		12,426,518,632
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		5,334,519,561		12,426,518,632
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,873,197,820		5,140,324,131
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,873,197,820		5,140,324,131
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		23,253,184		31,461,996
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		17,384,692,783		26,917,916,540

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>当ファンドの計算期間は原則として、毎年6月1日から翌年5月31日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2019年 6月 1日から2020年 6月 1日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		第15期 2019年 5月31日現在	第16期 2020年 6月 1日現在
1.	期首元本額	21,159,005,884円	23,253,184,012円
	期中追加設定元本額	6,092,908,576円	14,798,267,469円
	期中一部解約元本額	3,998,730,448円	6,589,455,296円
2.	受益権の総数	23,253,184,012口	31,461,996,185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	113,216,210円	695,879,250円
4.	有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券は次のとおりであります。		
	株式	1,677,699,880円	4,172,009,900円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 2018年 6月 1日 至 2019年 5月31日		第16期 自 2019年 6月 1日 至 2020年 6月 1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	850,086,870円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益
C	信託約款に定める収益調整金	26,338,581,611円	C 信託約款に定める収益調整金
D	信託約款に定める分配準備積立 金	7,313,924,273円	D 信託約款に定める分配準備積立 金
E	分配対象収益(A+B+C+D)	34,502,592,754円	E 分配対象収益(A+B+C+D)
F	分配対象収益(1万口当たり)	14,837円	F 分配対象収益(1万口当たり)
G	分配金額	23,253,184円	G 分配金額
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第15期 自 2018年 6月 1日 至 2019年 5月31日	第16期 自 2019年 6月 1日 至 2020年 6月 1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15期 2019年 5月31日現在	第16期 2020年 6月 1日現在

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

（有価証券に関する注記）

第15期（2019年 5月31日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	5,697,336,994
合計	5,697,336,994

第16期（2020年 6月 1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	1,132,024,379
合計	1,132,024,379

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

第15期（2019年 5月31日現在）

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,140,470,000	-	1,084,320,000	56,150,000
合計		1,140,470,000	-	1,084,320,000	56,150,000

第16期(2020年6月1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	1,153,065,000	-	1,211,210,000	58,145,000
合計		1,153,065,000	-	1,211,210,000	58,145,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第15期 2019年5月31日現在		第16期 2020年6月1日現在	
1口当たり純資産額	1.7476円	1口当たり純資産額	1.8556円
(1万口当たり純資産額)	(17,476円)	(1万口当たり純資産額)	(18,556円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	1,300	2,701.00	3,511,300	
日本水産	35,200	497.00	17,494,400	貸付有価証券 600株
マルハニチロ	5,100	2,301.00	11,735,100	
カネコ種苗	1,100	1,393.00	1,532,300	
サカタのタネ	4,200	3,635.00	15,267,000	貸付有価証券 200株
ホクト	2,700	2,008.00	5,421,600	貸付有価証券 100株
ホクリヨウ	600	656.00	393,600	
住石ホールディングス	7,100	115.00	816,500	
日鉄鉱業	800	4,635.00	3,708,000	
三井松島ホールディングス	1,400	866.00	1,212,400	
国際石油開発帝石	141,400	741.40	104,833,960	
石油資源開発	4,600	2,003.00	9,213,800	貸付有価証券 300株
K & O エナジーグループ	1,700	1,554.00	2,641,800	
ヒノキヤグループ	900	1,685.00	1,516,500	
ショーボンドホールディングス	5,500	5,000.00	27,500,000	
ミライト・ホールディングス	10,500	1,520.00	15,960,000	
タマホーム	1,900	1,250.00	2,375,000	貸付有価証券 1,300株
サンヨーホームズ	300	633.00	189,900	
日本アクア	1,400	605.00	847,000	
ファーストコーポレーション	1,100	537.00	590,700	貸付有価証券 700株
ベステラ	600	1,055.00	633,000	貸付有価証券 400株
キャンディル	600	544.00	326,400	
スペースバリューホールディングス	4,300	359.00	1,543,700	
ダイセキ環境ソリューション	700	1,064.00	744,800	
第一カッター興業	400	1,879.00	751,600	
明豊ファシリティワークス	1,100	567.00	623,700	
安藤・間	21,000	708.00	14,868,000	
東急建設	10,300	582.00	5,994,600	貸付有価証券 500株

コムシスホールディングス	12,500	3,010.00	37,625,000	
ビーアールホールディングス	3,800	563.00	2,139,400	貸付有価証券 100株
高松コンストラクショングループ	2,200	2,487.00	5,471,400	
東建コーポレーション	1,100	7,310.00	8,041,000	
ソネック	400	819.00	327,600	
ヤマウラ	1,500	814.00	1,221,000	
大成建設	27,100	3,805.00	103,115,500	
大林組	81,300	1,020.00	82,926,000	
清水建設	82,600	919.00	75,909,400	
飛島建設	2,300	1,108.00	2,548,400	
長谷工コーポレーション	31,500	1,322.00	41,643,000	貸付有価証券 500株
松井建設	3,200	614.00	1,964,800	貸付有価証券 100株
銭高組	400	3,645.00	1,458,000	
鹿島建設	63,900	1,240.00	79,236,000	
不動テトラ	2,100	1,428.00	2,998,800	貸付有価証券 100株
大末建設	1,000	776.00	776,000	
鉄建建設	1,700	2,190.00	3,723,000	
西松建設	6,300	2,120.00	13,356,000	貸付有価証券 100株
三井住友建設	19,600	461.00	9,035,600	
大豊建設	1,800	2,506.00	4,510,800	
前田建設工業	20,400	847.00	17,278,800	貸付有価証券 800株
佐田建設	1,800	413.00	743,400	
ナカノフード建設	2,200	389.00	855,800	
奥村組	4,400	2,600.00	11,440,000	
東鉄工業	3,500	2,842.00	9,947,000	
イチケン	600	1,510.00	906,000	
富士ピー・エス	1,200	566.00	679,200	
浅沼組	900	4,245.00	3,820,500	貸付有価証券 100株
戸田建設	33,800	692.00	23,389,600	貸付有価証券 200株
熊谷組	3,800	2,624.00	9,971,200	

北野建設	500	2,621.00	1,310,500	
植木組	400	2,467.00	986,800	
矢作建設工業	3,600	776.00	2,793,600	貸付有価証券 100株
ピーエス三菱	2,700	551.00	1,487,700	
日本ハウスホールディングス	5,600	312.00	1,747,200	貸付有価証券 100株
大東建託	8,900	11,225.00	99,902,500	
新日本建設	3,500	775.00	2,712,500	
N I P P O	6,700	2,652.00	17,768,400	貸付有価証券 200株
東亜道路工業	500	3,245.00	1,622,500	
前田道路	7,200	2,061.00	14,839,200	
日本道路	800	7,050.00	5,640,000	
東亜建設工業	2,700	1,640.00	4,428,000	貸付有価証券 1,800株
日本国土開発	7,900	538.00	4,250,200	貸付有価証券 1,800株
若築建設	1,500	1,173.00	1,759,500	
東洋建設	9,000	430.00	3,870,000	
五洋建設	32,200	568.00	18,289,600	貸付有価証券 1,200株
世紀東急工業	3,900	780.00	3,042,000	
福田組	900	4,910.00	4,419,000	
住友林業	20,700	1,281.00	26,516,700	
日本基礎技術	2,700	418.00	1,128,600	
巴コーポレーション	3,700	380.00	1,406,000	
大和ハウス工業	80,500	2,661.50	214,250,750	
ライト工業	4,700	1,473.00	6,923,100	
積水ハウス	88,300	2,022.00	178,542,600	貸付有価証券 40,700株
日特建設	2,100	724.00	1,520,400	
北陸電気工事	1,500	953.00	1,429,500	
ユアテック	4,600	618.00	2,842,800	
日本リーテック	1,700	2,097.00	3,564,900	貸付有価証券 300株
四電工	400	2,332.00	932,800	
中電工	3,300	2,279.00	7,520,700	

関電工	11,600	981.00	11,379,600	貸付有価証券 100株
きんでん	19,300	1,791.00	34,566,300	
東京エネシス	2,700	749.00	2,022,300	
トーエネック	800	3,820.00	3,056,000	
住友電設	2,300	2,529.00	5,816,700	
日本電設工業	4,500	2,367.00	10,651,500	貸付有価証券 100株
協和エクシオ	12,300	2,468.00	30,356,400	
新日本空調	2,100	2,586.00	5,430,600	
九電工	5,700	2,960.00	16,872,000	
三機工業	5,800	1,352.00	7,841,600	貸付有価証券 100株
日揮ホールディングス	25,100	1,132.00	28,413,200	
中外炉工業	900	1,590.00	1,431,000	
ヤマト	2,600	660.00	1,716,000	
太平電業	2,000	2,370.00	4,740,000	
高砂熱学工業	7,100	1,799.00	12,772,900	貸付有価証券 300株
三晃金属工業	400	2,069.00	827,600	
朝日工業社	500	3,100.00	1,550,000	
明星工業	5,200	789.00	4,102,800	貸付有価証券 100株
大気社	4,000	3,330.00	13,320,000	
ダイダン	1,900	2,835.00	5,386,500	
日比谷総合設備	2,600	1,908.00	4,960,800	貸付有価証券 100株
フィル・カンパニー	500	2,981.00	1,490,500	貸付有価証券 300株
OSJBホールディングス	13,200	245.00	3,234,000	貸付有価証券 500株
東洋エンジニアリング	3,300	411.00	1,356,300	
レイズネクスト	4,400	1,260.00	5,544,000	
日本製粉	7,600	1,625.00	12,350,000	貸付有価証券 100株
日清製粉グループ本社	29,400	1,680.00	49,392,000	
日東富士製粉	200	6,070.00	1,214,000	
昭和産業	2,400	3,305.00	7,932,000	
鳥越製粉	2,300	901.00	2,072,300	

中部飼料	3,200	1,714.00	5,484,800	
フィード・ワン	17,900	186.00	3,329,400	貸付有価証券 700株
東洋精糖	500	1,258.00	629,000	
日本甜菜製糖	1,400	1,707.00	2,389,800	
三井製糖	2,300	2,096.00	4,820,800	
塩水港精糖	2,800	212.00	593,600	
日新製糖	1,200	1,951.00	2,341,200	
森永製菓	6,100	4,595.00	28,029,500	
中村屋	700	4,065.00	2,845,500	
江崎グリコ	7,700	5,170.00	39,809,000	
名糖産業	1,300	1,312.00	1,705,600	
井村屋グループ	1,500	2,024.00	3,036,000	
不二家	1,500	2,167.00	3,250,500	
山崎製パン	19,500	1,889.00	36,835,500	貸付有価証券 300株
第一屋製パン	500	950.00	475,000	
モロゾフ	400	5,950.00	2,380,000	
亀田製菓	1,500	5,370.00	8,055,000	
寿スピリッツ	2,500	5,260.00	13,150,000	
カルビー	11,900	3,105.00	36,949,500	貸付有価証券 300株
森永乳業	4,800	4,525.00	21,720,000	貸付有価証券 100株
六甲バター	1,700	1,536.00	2,611,200	
ヤクルト本社	17,900	6,580.00	117,782,000	
明治ホールディングス	17,200	8,180.00	140,696,000	
雪印メグミルク	6,300	2,629.00	16,562,700	貸付有価証券 100株
プリマハム	4,100	2,612.00	10,709,200	貸付有価証券 300株
日本ハム	10,000	3,990.00	39,900,000	
林兼産業	900	576.00	518,400	
丸大食品	2,800	1,972.00	5,521,600	
S Foods	2,100	2,589.00	5,436,900	
柿安本店	900	2,595.00	2,335,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	16,800	655.00	11,004,000	貸付有価証券 600株

サッポロホールディングス	8,900	2,147.00	19,108,300	
アサヒグループホールディングス	54,500	4,091.00	222,959,500	貸付有価証券 26,100株
キリンホールディングス	110,400	2,236.50	246,909,600	貸付有価証券 66,800株
宝ホールディングス	19,300	861.00	16,617,300	
オエノンホールディングス	6,800	393.00	2,672,400	貸付有価証券 200株
養命酒製造	800	1,898.00	1,518,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	18,300	2,157.00	39,473,100	
サントリー食品インターナショナル	17,400	4,375.00	76,125,000	
ダイドーグループホールディングス	1,300	5,070.00	6,591,000	貸付有価証券 900株
伊藤園	7,900	6,200.00	48,980,000	貸付有価証券 1,500株
キーコーヒー	2,600	2,329.00	6,055,400	貸付有価証券 1,000株
ユニカフェ	700	954.00	667,800	
ジャパンフーズ	400	1,173.00	469,200	
日清オイリオグループ	3,400	3,460.00	11,764,000	貸付有価証券 100株
不二製油グループ本社	6,300	2,859.00	18,011,700	貸付有価証券 200株
かどや製油	300	3,715.00	1,114,500	
J - オイルミルズ	1,400	4,290.00	6,006,000	
キッコーマン	18,700	5,360.00	100,232,000	
味の素	57,500	1,834.00	105,455,000	
キューピー	14,500	2,110.00	30,595,000	貸付有価証券 300株
ハウス食品グループ本社	9,700	3,610.00	35,017,000	
カゴメ	9,900	3,015.00	29,848,500	
焼津水産化学工業	1,200	932.00	1,118,400	
アリアケジャパン	2,400	7,410.00	17,784,000	
ピエトロ	300	1,618.00	485,400	
エバラ食品工業	600	2,197.00	1,318,200	
やまみ	200	2,184.00	436,800	
ニチレイ	12,400	3,025.00	37,510,000	
東洋水産	13,400	5,610.00	75,174,000	

イトアンド	900	1,795.00	1,615,500	
大冷	400	1,958.00	783,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,500	1,175.00	1,762,500	貸付有価証券 1,000株
日清食品ホールディングス	11,100	8,970.00	99,567,000	
永谷園ホールディングス	1,300	2,228.00	2,896,400	
一正蒲鉾	1,000	989.00	989,000	
フジッコ	2,800	1,977.00	5,535,600	
ロック・フィールド	2,800	1,369.00	3,833,200	貸付有価証券 600株
日本たばこ産業	150,300	2,142.50	322,017,750	貸付有価証券 62,100株
ケンコーマヨネーズ	1,400	2,142.00	2,998,800	
わらべや日洋ホールディングス	1,700	1,757.00	2,986,900	
なとり	1,500	1,737.00	2,605,500	
イフジ産業	500	801.00	400,500	
ピククルスコーポレーション	600	2,321.00	1,392,600	
北の達人コーポレーション	9,100	522.00	4,750,200	貸付有価証券 6,200株
ユーグレナ	11,200	745.00	8,344,000	貸付有価証券 6,700株
ミヨシ油脂	1,000	1,160.00	1,160,000	
理研ビタミン	2,500	2,238.00	5,595,000	
片倉工業	3,700	1,202.00	4,447,400	
ゲンゼ	1,900	3,825.00	7,267,500	
東洋紡	10,000	1,506.00	15,060,000	貸付有価証券 200株
ユニチカ	7,500	359.00	2,692,500	
富士紡ホールディングス	1,200	3,245.00	3,894,000	
倉敷紡績	2,500	2,417.00	6,042,500	貸付有価証券 1,600株
シキボウ	1,300	1,057.00	1,374,100	貸付有価証券 900株
日本毛織	8,400	1,011.00	8,492,400	貸付有価証券 700株
ダイトウボウ	4,700	133.00	625,100	貸付有価証券 3,200株
トーア紡コーポレーション	1,100	512.00	563,200	

ダイドーリミテッド	3,300	226.00	745,800	貸付有価証券 1,500株
帝国繊維	2,900	2,352.00	6,820,800	貸付有価証券 100株
帝人	20,700	1,766.00	36,556,200	貸付有価証券 1,000株
東レ	184,000	528.00	97,152,000	貸付有価証券 1,700株
サカイオーベックス	700	2,172.00	1,520,400	
住江織物	700	1,923.00	1,346,100	
日本フェルト	1,400	470.00	658,000	貸付有価証券 100株
イチカワ	400	1,351.00	540,400	
日東製網	300	1,423.00	426,900	
アツギ	2,100	628.00	1,318,800	
ダイニック	900	757.00	681,300	
セーレン	6,300	1,318.00	8,303,400	
ソトー	1,100	952.00	1,047,200	
東海染工	400	1,122.00	448,800	
小松マテーレ	4,100	765.00	3,136,500	
ワコールホールディングス	6,600	2,198.00	14,506,800	貸付有価証券 200株
ホギメディカル	2,900	3,560.00	10,324,000	
T S Iホールディングス	8,600	465.00	3,999,000	貸付有価証券 1,400株
マツオカコーポレーション	700	2,345.00	1,641,500	
ワールド	3,600	1,537.00	5,533,200	貸付有価証券 100株
三陽商会	1,300	862.00	1,120,600	貸付有価証券 500株
ナイガイ	1,000	370.00	370,000	貸付有価証券 700株
オンワードホールディングス	15,300	361.00	5,523,300	
ルックホールディングス	900	841.00	756,900	
ゴールドウイン	4,600	6,850.00	31,510,000	貸付有価証券 2,700株
デサント	5,000	1,637.00	8,185,000	貸付有価証券 200株
キング	1,300	509.00	661,700	

ヤマトインターナショナル	2,200	349.00	767,800	
特種東海製紙	1,600	4,255.00	6,808,000	
王子ホールディングス	106,200	538.00	57,135,600	
日本製紙	11,200	1,575.00	17,640,000	貸付有価証券 600株
三菱製紙	2,800	375.00	1,050,000	
北越コーポレーション	15,200	402.00	6,110,400	
中越パルプ工業	1,100	1,476.00	1,623,600	
巴川製紙所	800	892.00	713,600	
大王製紙	11,200	1,462.00	16,374,400	貸付有価証券 7,400株
阿波製紙	700	545.00	381,500	
レンゴー	24,100	863.00	20,798,300	
トーモク	1,600	1,739.00	2,782,400	
ザ・パック	1,900	3,185.00	6,051,500	貸付有価証券 100株
クラレ	40,100	1,150.00	46,115,000	
旭化成	168,500	852.90	143,713,650	
共和レザー	1,500	673.00	1,009,500	
昭和電工	18,100	2,571.00	46,535,100	貸付有価証券 12,100株
住友化学	186,700	339.00	63,291,300	
住友精化	1,100	3,130.00	3,443,000	
日産化学	14,100	4,810.00	67,821,000	
ラサ工業	900	1,475.00	1,327,500	
クレハ	2,200	4,805.00	10,571,000	
多木化学	1,000	7,140.00	7,140,000	貸付有価証券 700株
テイカ	1,900	1,552.00	2,948,800	
石原産業	4,600	770.00	3,542,000	
片倉コープアグリ	700	1,193.00	835,100	
日本曹達	3,800	3,005.00	11,419,000	
東ソー	39,300	1,523.00	59,853,900	
トクヤマ	7,300	2,582.00	18,848,600	
セントラル硝子	5,200	1,989.00	10,342,800	貸付有価証券 200株
東亜合成	16,000	1,031.00	16,496,000	貸付有価証券 400株

大阪ソーダ	2,600	2,630.00	6,838,000	貸付有価証券 100株
関東電化工業	6,000	920.00	5,520,000	
デンカ	9,300	2,673.00	24,858,900	
信越化学工業	43,600	12,600.00	549,360,000	
日本カーバイド工業	900	1,405.00	1,264,500	貸付有価証券 600株
堺化学工業	1,600	1,990.00	3,184,000	
第一稀元素化学工業	2,700	799.00	2,157,300	
エア・ウォーター	23,600	1,551.00	36,603,600	貸付有価証券 600株
大陽日酸	24,400	1,793.00	43,749,200	
日本化学工業	800	2,419.00	1,935,200	
日本パーカラライジング	12,800	1,133.00	14,502,400	
高压ガス工業	4,000	755.00	3,020,000	
四国化成工業	3,900	1,126.00	4,391,400	貸付有価証券 100株
戸田工業	600	1,736.00	1,041,600	
ステラ ケミファ	1,400	2,639.00	3,694,600	貸付有価証券 600株
保土谷化学工業	1,000	4,130.00	4,130,000	
日本触媒	3,900	5,950.00	23,205,000	
大日精化工業	2,300	2,527.00	5,812,100	
カネカ	6,600	2,863.00	18,895,800	
三菱瓦斯化学	23,600	1,609.00	37,972,400	
三井化学	23,100	2,220.00	51,282,000	
J S R	23,700	2,092.00	49,580,400	
東京応化工業	4,400	5,190.00	22,836,000	
大阪有機化学工業	2,400	1,929.00	4,629,600	
三菱ケミカルホールディングス	169,900	640.20	108,769,980	
K Hネオケム	4,500	2,121.00	9,544,500	貸付有価証券 500株
ダイセル	33,100	901.00	29,823,100	
住友ベークライト	4,000	3,035.00	12,140,000	貸付有価証券 400株
積水化学工業	54,600	1,506.00	82,227,600	
日本ゼオン	22,900	1,031.00	23,609,900	
アイカ工業	7,600	3,225.00	24,510,000	

宇部興産	12,800	1,923.00	24,614,400	
積水樹脂	4,600	2,342.00	10,773,200	貸付有価証券 100株
タキロンシーアイ	5,700	692.00	3,944,400	
旭有機材	1,400	1,523.00	2,132,200	
日立化成	5,100	4,625.00	23,587,500	
ニチバン	1,300	1,517.00	1,972,100	貸付有価証券 600株
リケンテクノス	6,300	431.00	2,715,300	貸付有価証券 300株
大倉工業	1,200	1,636.00	1,963,200	
積水化成成品工業	3,400	595.00	2,023,000	
群栄化学工業	600	2,725.00	1,635,000	
タイガースポリマー	1,400	470.00	658,000	
ミライアル	900	1,297.00	1,167,300	
ダイキアクシス	1,000	775.00	775,000	貸付有価証券 600株
ダイキョーニシカワ	5,300	597.00	3,164,100	貸付有価証券 200株
竹本容器	1,000	738.00	738,000	貸付有価証券 100株
森六ホールディングス	1,400	1,562.00	2,186,800	
日本化薬	15,700	1,092.00	17,144,400	
カーリットホールディングス	2,700	558.00	1,506,600	
日本精化	2,000	1,461.00	2,922,000	
扶桑化学工業	2,600	3,985.00	10,361,000	
トリケミカル研究所	600	11,860.00	7,116,000	貸付有価証券 200株
A D E K A	11,700	1,473.00	17,234,100	貸付有価証券 600株
日油	9,600	3,765.00	36,144,000	
新日本理化	4,600	176.00	809,600	貸付有価証券 2,900株
ハリマ化成グループ	2,100	977.00	2,051,700	
花王	62,100	8,891.00	552,131,100	貸付有価証券 36,900株
第一工業製薬	900	4,720.00	4,248,000	
石原ケミカル	700	1,995.00	1,396,500	
日華化学	900	936.00	842,400	

ニイタカ	500	3,805.00	1,902,500	貸付有価証券 300株
三洋化成工業	1,500	4,920.00	7,380,000	
有機合成薬品工業	2,300	386.00	887,800	
大日本塗料	2,900	986.00	2,859,400	
日本ペイントホールディングス	21,000	7,750.00	162,750,000	
関西ペイント	28,500	2,238.00	63,783,000	
中国塗料	7,200	822.00	5,918,400	
日本特殊塗料	1,900	911.00	1,730,900	
藤倉化成	3,500	493.00	1,725,500	
太陽ホールディングス	1,900	5,050.00	9,595,000	
D I C	10,700	2,786.00	29,810,200	
サカティンクス	5,600	1,058.00	5,924,800	貸付有価証券 100株
東洋インキS Cホールディングス	5,400	2,066.00	11,156,400	貸付有価証券 700株
T & K T O K A	2,000	786.00	1,572,000	
富士フイルムホールディングス	49,800	4,954.00	246,709,200	
資生堂	51,600	6,802.00	350,983,200	貸付有価証券 34,600株
ライオン	33,700	2,410.00	81,217,000	
高砂香料工業	1,700	2,472.00	4,202,400	
マンダム	5,800	2,170.00	12,586,000	
ミルボン	3,500	5,290.00	18,515,000	
ファンケル	10,500	3,090.00	32,445,000	
コーセー	4,900	14,050.00	68,845,000	
コタ	1,500	1,203.00	1,804,500	
シーボン	400	2,111.00	844,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	11,100	2,086.00	23,154,600	貸付有価証券 400株
ノエビアホールディングス	2,200	4,825.00	10,615,000	
アジュバンコスメジャパン	700	950.00	665,000	
エステー	1,700	1,657.00	2,816,900	
アグロ カネショウ	1,100	1,408.00	1,548,800	貸付有価証券 100株
コニシ	4,300	1,504.00	6,467,200	貸付有価証券 100株

長谷川香料	4,500	2,344.00	10,548,000	貸付有価証券 100株
星光PMC	1,400	711.00	995,400	
小林製薬	7,300	9,460.00	69,058,000	
荒川化学工業	2,300	1,299.00	2,987,700	貸付有価証券 100株
メック	1,800	2,072.00	3,729,600	貸付有価証券 1,100株
日本高純度化学	700	2,653.00	1,857,100	
タカラバイオ	6,800	2,895.00	19,686,000	
JCU	3,100	3,240.00	10,044,000	
新田ゼラチン	1,700	709.00	1,205,300	
OATアグリオ	500	1,130.00	565,000	
デクセリアルズ	6,700	880.00	5,896,000	貸付有価証券 100株
アース製薬	2,000	7,060.00	14,120,000	
北興化学工業	2,700	616.00	1,663,200	
大成ラミック	900	2,677.00	2,409,300	
クミアイ化学工業	10,700	865.00	9,255,500	貸付有価証券 200株
日本農薬	4,600	487.00	2,240,200	
アキレス	1,900	1,712.00	3,252,800	
有沢製作所	4,300	817.00	3,513,100	貸付有価証券 200株
日東電工	17,900	5,880.00	105,252,000	
レック	2,800	1,627.00	4,555,600	貸付有価証券 100株
三光合成	3,200	305.00	976,000	
きもと	4,900	159.00	779,100	
藤森工業	2,300	3,565.00	8,199,500	
前澤化成工業	1,700	1,069.00	1,817,300	
未来工業	1,400	1,977.00	2,767,800	
ウェーブロックホールディングス	1,000	770.00	770,000	貸付有価証券 700株
JSP	1,500	1,486.00	2,229,000	貸付有価証券 100株
エフピコ	2,900	7,980.00	23,142,000	
天馬	1,700	1,787.00	3,037,900	
信越ポリマー	4,600	948.00	4,360,800	

東リ	6,500	259.00	1,683,500	貸付有価証券 100株
ニフコ	9,500	2,390.00	22,705,000	貸付有価証券 300株
バルカー	2,100	2,012.00	4,225,200	
ユニ・チャーム	50,000	4,063.00	203,150,000	
ショーエイコーポレーション	400	888.00	355,200	
協和キリン	26,100	2,862.00	74,698,200	貸付有価証券 17,200株
武田薬品工業	215,900	4,114.00	888,212,600	代用有価証券 21,400株
アステラス製薬	225,000	1,969.50	443,137,500	
大日本住友製薬	19,300	1,501.00	28,969,300	
塩野義製薬	32,700	6,190.00	202,413,000	
わかもと製薬	3,000	285.00	855,000	貸付有価証券 700株
あすか製薬	3,000	1,177.00	3,531,000	貸付有価証券 200株
日本新薬	6,800	9,240.00	62,832,000	
ピオフェルミン製薬	400	2,266.00	906,400	
中外製薬	27,100	15,800.00	428,180,000	貸付有価証券 10,300株
科研製薬	4,400	5,820.00	25,608,000	
エーザイ	31,100	8,450.00	262,795,000	
ロート製薬	13,300	3,315.00	44,089,500	
小野薬品工業	59,600	3,067.00	182,793,200	貸付有価証券 100株
久光製薬	6,900	5,400.00	37,260,000	貸付有価証券 400株
持田製薬	3,600	4,075.00	14,670,000	貸付有価証券 100株
参天製薬	48,300	1,968.00	95,054,400	
扶桑薬品工業	900	2,589.00	2,330,100	
日本ケミファ	300	2,752.00	825,600	
ツムラ	8,000	2,977.00	23,816,000	貸付有価証券 300株
日医工	7,300	1,321.00	9,643,300	貸付有価証券 200株
キッセイ薬品工業	4,600	2,748.00	12,640,800	貸付有価証券 200株

生化学工業	5,000	1,128.00	5,640,000	貸付有価証券 100株
栄研化学	4,500	1,903.00	8,563,500	貸付有価証券 100株
日水製薬	1,100	1,258.00	1,383,800	
鳥居薬品	1,600	3,220.00	5,152,000	
J C R ファーマ	1,800	12,270.00	22,086,000	
東和薬品	3,300	2,231.00	7,362,300	
富士製薬工業	1,800	1,237.00	2,226,600	
沢井製薬	5,300	5,920.00	31,376,000	
ゼリア新薬工業	4,700	2,146.00	10,086,200	貸付有価証券 900株
第一三共	74,300	9,506.00	706,295,800	
キョーリン製薬ホールディングス	5,700	2,288.00	13,041,600	
大幸薬品	3,200	2,222.00	7,110,400	貸付有価証券 2,200株
ダイト	1,600	4,330.00	6,928,000	
大塚ホールディングス	49,400	4,739.00	234,106,600	貸付有価証券 33,200株
大正製薬ホールディングス	5,500	6,700.00	36,850,000	
ペプチドリーム	13,200	4,755.00	62,766,000	
日本コークス工業	22,300	63.00	1,404,900	
ニチレキ	3,100	1,618.00	5,015,800	貸付有価証券 100株
ユシロ化学工業	1,500	1,284.00	1,926,000	
ビーピー・カストロール	900	1,282.00	1,153,800	
富士石油	6,800	185.00	1,258,000	
MORESCO	900	1,039.00	935,100	
出光興産	28,800	2,383.00	68,630,400	
J X T Gホールディングス	390,500	412.20	160,964,100	
コスモエネルギーホールディングス	7,500	1,681.00	12,607,500	貸付有価証券 2,300株
横浜ゴム	15,000	1,615.00	24,225,000	
TOYO TIRE	14,900	1,520.00	22,648,000	貸付有価証券 500株
ブリヂストン	74,700	3,520.00	262,944,000	貸付有価証券 44,000株
住友ゴム工業	23,300	1,094.00	25,490,200	貸付有価証券 900株

藤倉コンポジット	2,300	370.00	851,000	
オカモト	1,600	3,840.00	6,144,000	
フコク	1,100	683.00	751,300	
ニッタ	2,900	2,207.00	6,400,300	
住友理工	5,000	630.00	3,150,000	
三ツ星ベルト	3,400	1,671.00	5,681,400	貸付有価証券 100株
バンドー化学	4,500	643.00	2,893,500	貸付有価証券 100株
日東紡績	3,900	5,950.00	23,205,000	貸付有価証券 2,600株
A G C	25,600	3,160.00	80,896,000	
日本板硝子	12,400	409.00	5,071,600	貸付有価証券 8,600株
石塚硝子	500	2,190.00	1,095,000	
日本山村硝子	1,100	837.00	920,700	
日本電気硝子	10,400	1,718.00	17,867,200	貸付有価証券 100株
オハラ	1,000	983.00	983,000	貸付有価証券 700株
住友大阪セメント	4,900	3,770.00	18,473,000	
太平洋セメント	16,400	2,539.00	41,639,600	貸付有価証券 200株
日本ヒューム	2,600	727.00	1,890,200	
日本コンクリート工業	5,600	270.00	1,512,000	
三谷セキサン	1,200	5,130.00	6,156,000	
アジアパイルホールディングス	3,700	451.00	1,668,700	貸付有価証券 200株
東海カーボン	27,200	988.00	26,873,600	貸付有価証券 14,800株
日本カーボン	1,300	3,410.00	4,433,000	貸付有価証券 600株
東洋炭素	1,500	1,649.00	2,473,500	
ノリタケカンパニーリミテド	1,400	3,525.00	4,935,000	
T O T O	18,500	4,275.00	79,087,500	
日本碍子	31,200	1,586.00	49,483,200	
日本特殊陶業	19,800	1,735.00	34,353,000	
ダントーホールディングス	1,800	95.00	171,000	
M A R U W A	1,000	8,330.00	8,330,000	

品川リフラクトリーズ	700	2,440.00	1,708,000	
黒崎播磨	500	3,965.00	1,982,500	
ヨータイ	2,100	698.00	1,465,800	
イソライト工業	1,400	501.00	701,400	
東京窯業	3,400	301.00	1,023,400	貸付有価証券 100株
ニッカトー	1,200	665.00	798,000	
フジミインコーポレーテッド	2,300	3,165.00	7,279,500	
クニミネ工業	1,000	1,005.00	1,005,000	
エーアンドエーマテリアル	400	1,202.00	480,800	
ニチアス	7,100	2,458.00	17,451,800	
ニチハ	3,600	2,318.00	8,344,800	
日本製鉄	114,900	1,019.00	117,083,100	
神戸製鋼所	46,900	402.00	18,853,800	貸付有価証券 3,400株
中山製鋼所	3,500	352.00	1,232,000	
合同製鐵	1,400	2,115.00	2,961,000	貸付有価証券 100株
ジェイ エフ イー ホールディングス	69,300	794.00	55,024,200	
東京製鐵	12,500	704.00	8,800,000	貸付有価証券 300株
共英製鋼	2,900	1,424.00	4,129,600	
大和工業	5,500	2,234.00	12,287,000	
東京鐵鋼	1,100	1,341.00	1,475,100	貸付有価証券 600株
大阪製鐵	1,400	1,283.00	1,796,200	
淀川製鋼所	3,500	1,698.00	5,943,000	
丸一鋼管	8,300	2,779.00	23,065,700	貸付有価証券 200株
モリ工業	800	2,346.00	1,876,800	
大同特殊鋼	4,200	3,740.00	15,708,000	
日本高周波鋼業	1,000	394.00	394,000	
日本冶金工業	2,200	1,709.00	3,759,800	
山陽特殊製鋼	1,800	975.00	1,755,000	
愛知製鋼	1,400	3,040.00	4,256,000	
日立金属	27,600	1,228.00	33,892,800	
日本金属	600	706.00	423,600	

大平洋金属	1,700	1,729.00	2,939,300	貸付有価証券 200株
新日本電工	16,600	158.00	2,622,800	貸付有価証券 1,300株
栗本鐵工所	1,300	1,842.00	2,394,600	貸付有価証券 100株
虹技	400	1,202.00	480,800	
日本鑄鉄管	300	1,409.00	422,700	
三菱製鋼	1,900	696.00	1,322,400	貸付有価証券 100株
日亜鋼業	3,700	276.00	1,021,200	貸付有価証券 100株
日本精線	400	3,215.00	1,286,000	
エンビプロ・ホールディングス	1,000	678.00	678,000	
シンニッタン	3,900	271.00	1,056,900	
新家工業	600	1,159.00	695,400	
大紀アルミニウム工業所	4,200	610.00	2,562,000	貸付有価証券 100株
日本軽金属ホールディングス	64,900	180.00	11,682,000	
三井金属鉱業	6,900	2,249.00	15,518,100	
東邦亜鉛	1,300	1,569.00	2,039,700	
三菱マテリアル	17,000	2,393.00	40,681,000	
住友金属鉱山	32,800	2,953.50	96,874,800	
D O W Aホールディングス	6,500	3,490.00	22,685,000	
古河機械金属	4,500	1,097.00	4,936,500	貸付有価証券 200株
エス・サイエンス	11,200	42.00	470,400	貸付有価証券 300株
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,700	1,019.00	2,751,300	
東邦チタニウム	4,500	675.00	3,037,500	
U A C J	3,900	1,962.00	7,651,800	貸付有価証券 200株
C Kサンエツ	500	3,165.00	1,582,500	
古河電気工業	8,000	2,622.00	20,976,000	貸付有価証券 100株
住友電気工業	96,000	1,250.50	120,048,000	
フジクラ	31,000	317.00	9,827,000	
昭和電線ホールディングス	3,000	1,096.00	3,288,000	貸付有価証券 100株

東京特殊電線	400	2,339.00	935,600	
タツタ電線	5,000	622.00	3,110,000	貸付有価証券 100株
カナレ電気	400	1,789.00	715,600	
平河ヒューテック	1,300	1,102.00	1,432,600	貸付有価証券 100株
リョービ	3,200	1,351.00	4,323,200	貸付有価証券 100株
アーレスティ	3,500	360.00	1,260,000	
アサヒホールディングス	4,500	2,744.00	12,348,000	
稲葉製作所	1,500	1,405.00	2,107,500	貸付有価証券 900株
宮地エンジニアリンググループ	800	1,665.00	1,332,000	
トーカロ	7,100	1,032.00	7,327,200	貸付有価証券 100株
アルファC o	900	934.00	840,600	
SUMCO	30,500	1,663.00	50,721,500	
川田テクノロジーズ	500	5,100.00	2,550,000	
RS Technologies	700	3,565.00	2,495,500	
信和	1,400	680.00	952,000	
東洋製罐グループホールディングス	16,300	1,225.00	19,967,500	
ホッカンホールディングス	1,400	1,698.00	2,377,200	
コロナ	1,500	940.00	1,410,000	
横河ブリッジホールディングス	4,800	2,139.00	10,267,200	貸付有価証券 300株
駒井ハルテック	500	1,491.00	745,500	
高田機工	200	2,329.00	465,800	
三和ホールディングス	24,200	916.00	22,167,200	
文化シャッター	7,500	798.00	5,985,000	
三協立山	3,300	966.00	3,187,800	貸付有価証券 500株
アルインコ	1,900	953.00	1,810,700	
東洋シャッター	600	705.00	423,000	
LIXILグループ	37,900	1,578.00	59,806,200	貸付有価証券 500株
日本フィルコン	2,000	532.00	1,064,000	
ノーリツ	5,300	1,244.00	6,593,200	貸付有価証券 100株

長府製作所	2,600	2,297.00	5,972,200	貸付有価証券 100株
リンナイ	5,000	9,150.00	45,750,000	
ダイニチ工業	1,400	702.00	982,800	
日東精工	3,600	490.00	1,764,000	貸付有価証券 100株
三洋工業	400	1,789.00	715,600	
岡部	5,200	816.00	4,243,200	貸付有価証券 100株
ジーテクト	3,200	1,088.00	3,481,600	貸付有価証券 100株
東プレ	4,800	1,288.00	6,182,400	
高周波熱錬	4,900	555.00	2,719,500	貸付有価証券 400株
東京製綱	1,800	562.00	1,011,600	
サンコール	1,900	422.00	801,800	
モリテック スチール	2,000	314.00	628,000	
パイオラックス	3,800	1,705.00	6,479,000	
エイチワン	2,500	570.00	1,425,000	貸付有価証券 1,600株
日本発條	27,500	744.00	20,460,000	
中央発條	300	2,787.00	836,100	
アドバネクス	400	1,334.00	533,600	
立川ブラインド工業	1,100	1,185.00	1,303,500	
三益半導体工業	2,000	2,302.00	4,604,000	貸付有価証券 100株
日本ドライケミカル	600	1,589.00	953,400	
日本製鋼所	7,800	1,591.00	12,409,800	
三浦工業	11,100	4,510.00	50,061,000	貸付有価証券 300株
タクマ	8,700	1,389.00	12,084,300	
ツガミ	5,300	1,003.00	5,315,900	
オークマ	3,000	4,530.00	13,590,000	
芝浦機械	2,900	2,396.00	6,948,400	貸付有価証券 1,900株
アマダ	31,900	948.00	30,241,200	
アイダエンジニアリング	6,700	752.00	5,038,400	貸付有価証券 700株
滝澤鉄工所	800	1,017.00	813,600	

F U J I	11,000	1,976.00	21,736,000	貸付有価証券 100株
牧野フライス製作所	3,000	3,315.00	9,945,000	
オーエスジー	11,800	1,537.00	18,136,600	
ダイジェット工業	300	1,356.00	406,800	
旭ダイヤモンド工業	6,900	505.00	3,484,500	
D M G 森精機	16,200	1,295.00	20,979,000	貸付有価証券 8,200株
ソディック	6,000	823.00	4,938,000	
ディスコ	3,500	25,220.00	88,270,000	
日東工器	1,400	1,975.00	2,765,000	
日進工具	1,000	2,757.00	2,757,000	
パンチ工業	2,300	437.00	1,005,100	貸付有価証券 100株
富士ダイス	1,100	641.00	705,100	
豊和工業	1,400	816.00	1,142,400	
O K K	1,100	443.00	487,300	
石川製作所	600	1,686.00	1,011,600	貸付有価証券 400株
東洋機械金属	1,800	418.00	752,400	
津田駒工業	500	867.00	433,500	
エンシュウ	600	966.00	579,600	
島精機製作所	4,000	1,626.00	6,504,000	貸付有価証券 200株
オプトラン	2,900	2,832.00	8,212,800	
N C ホールディングス	800	535.00	428,000	
イワキポンプ	1,600	1,030.00	1,648,000	
フリー	2,500	905.00	2,262,500	貸付有価証券 200株
ヤマシンフィルタ	5,500	1,001.00	5,505,500	貸付有価証券 3,500株
日阪製作所	3,200	770.00	2,464,000	
やまびこ	5,000	969.00	4,845,000	
平田機工	1,200	6,140.00	7,368,000	
ペガサスミシン製造	2,600	340.00	884,000	
マルマエ	1,000	916.00	916,000	貸付有価証券 700株
タツモ	1,200	1,623.00	1,947,600	貸付有価証券 800株

ナブテスコ	15,100	3,365.00	50,811,500	
三井海洋開発	2,700	1,601.00	4,322,700	
レオン自動機	2,700	1,336.00	3,607,200	貸付有価証券 100株
S M C	8,100	56,220.00	455,382,000	貸付有価証券 400株
ホソカワミクロン	900	6,160.00	5,544,000	
ユニオンツール	1,000	2,789.00	2,789,000	
オイレス工業	3,300	1,430.00	4,719,000	
日精エー・エス・ビー機械	700	3,450.00	2,415,000	
サトーホールディングス	3,600	2,554.00	9,194,400	貸付有価証券 100株
技研製作所	2,300	4,815.00	11,074,500	
日本エアーテック	900	1,087.00	978,300	貸付有価証券 600株
カワタ	800	769.00	615,200	
日精樹脂工業	2,200	884.00	1,944,800	貸付有価証券 100株
オカダアイヨン	800	978.00	782,400	
ワイエイシイホールディングス	1,100	502.00	552,200	貸付有価証券 700株
小松製作所	117,500	2,189.00	257,207,500	
住友重機械工業	14,800	2,447.00	36,215,600	
日立建機	10,400	2,849.00	29,629,600	
日工	3,600	661.00	2,379,600	貸付有価証券 300株
巴工業	1,100	1,810.00	1,991,000	
井関農機	2,600	1,218.00	3,166,800	
T O W A	2,600	1,219.00	3,169,400	貸付有価証券 600株
丸山製作所	600	1,250.00	750,000	
北川鉄工所	1,200	1,698.00	2,037,600	
ローツェ	1,100	5,300.00	5,830,000	
タカキタ	1,000	610.00	610,000	
クボタ	137,700	1,491.50	205,379,550	貸付有価証券 92,600株
荏原実業	600	2,595.00	1,557,000	
三菱化工機	900	1,774.00	1,596,600	

月島機械	4,800	1,277.00	6,129,600	貸付有価証券 200株
帝国電機製作所	2,100	1,299.00	2,727,900	
東京機械製作所	1,100	288.00	316,800	
新東工業	6,200	781.00	4,842,200	貸付有価証券 100株
澁谷工業	2,300	3,025.00	6,957,500	
アイチ コーポレーション	4,500	729.00	3,280,500	貸付有価証券 100株
小森コーポレーション	6,600	757.00	4,996,200	貸付有価証券 500株
鶴見製作所	2,000	1,911.00	3,822,000	
住友精密工業	400	2,398.00	959,200	
日本ギア工業	1,000	286.00	286,000	
酒井重工業	500	2,313.00	1,156,500	
荏原製作所	10,700	2,544.00	27,220,800	
石井鐵工所	300	2,550.00	765,000	
西島製作所	2,600	833.00	2,165,800	
北越工業	2,700	1,039.00	2,805,300	
ダイキン工業	33,100	15,950.00	527,945,000	
オルガノ	900	6,060.00	5,454,000	
トーヨーカネツ	1,100	2,096.00	2,305,600	
栗田工業	14,000	2,983.00	41,762,000	貸付有価証券 300株
椿本チエイン	3,700	2,754.00	10,189,800	
大同工業	1,200	632.00	758,400	
木村化工機	2,100	465.00	976,500	貸付有価証券 1,400株
アネスト岩田	4,000	864.00	3,456,000	貸付有価証券 200株
ダイフク	13,300	8,590.00	114,247,000	
サムコ	700	2,119.00	1,483,300	貸付有価証券 400株
加藤製作所	1,400	1,181.00	1,653,400	
油研工業	400	1,537.00	614,800	
タダノ	12,500	859.00	10,737,500	貸付有価証券 7,000株
フジテック	9,400	1,637.00	15,387,800	

C K D	7,100	1,850.00	13,135,000	貸付有価証券 200株
キトー	2,000	1,198.00	2,396,000	
平和	7,200	1,843.00	13,269,600	貸付有価証券 300株
理想科学工業	2,200	1,331.00	2,928,200	
S A N K Y O	5,800	2,890.00	16,762,000	
日本金銭機械	2,900	564.00	1,635,600	
マースグループホールディングス	1,600	1,614.00	2,582,400	
フクシマガリレイ	1,600	3,300.00	5,280,000	
オーイズミ	1,100	435.00	478,500	
ダイコク電機	1,200	1,270.00	1,524,000	
竹内製作所	4,300	1,824.00	7,843,200	
アマノ	6,800	2,329.00	15,837,200	
J U K I	3,600	625.00	2,250,000	
サンデンホールディングス	3,600	374.00	1,346,400	貸付有価証券 700株
蛇の目ミシン工業	2,400	473.00	1,135,200	
マックス	4,000	1,685.00	6,740,000	貸付有価証券 100株
グローリー	6,700	2,442.00	16,361,400	貸付有価証券 200株
新晃工業	2,500	1,535.00	3,837,500	
大和冷機工業	3,800	958.00	3,640,400	貸付有価証券 100株
セガサミーホールディングス	25,700	1,395.00	35,851,500	貸付有価証券 700株
日本ピストンリング	900	1,211.00	1,089,900	
リケン	1,200	2,771.00	3,325,200	
T P R	3,500	1,435.00	5,022,500	
ツバキ・ナカシマ	5,500	953.00	5,241,500	
ホシザキ	7,600	8,770.00	66,652,000	貸付有価証券 300株
大豊工業	2,000	527.00	1,054,000	
日本精工	48,900	793.00	38,777,700	貸付有価証券 300株
N T N	60,300	224.00	13,507,200	
ジェイテクト	24,900	862.00	21,463,800	

不二越	2,400	3,490.00	8,376,000	貸付有価証券 100株
日本トムソン	7,600	385.00	2,926,000	貸付有価証券 300株
T H K	15,100	2,866.00	43,276,600	
ユーシン精機	2,100	679.00	1,425,900	
前澤給装工業	900	2,021.00	1,818,900	
イーグル工業	3,200	752.00	2,406,400	
前澤工業	1,800	358.00	644,400	
日本ピラー工業	2,600	1,508.00	3,920,800	貸付有価証券 100株
キッツ	10,500	714.00	7,497,000	貸付有価証券 500株
マキタ	33,800	3,620.00	122,356,000	
日立造船	20,600	404.00	8,322,400	
三菱重工業	43,500	2,754.50	119,820,750	
I H I	18,700	1,518.00	28,386,600	
スター精密	4,000	1,270.00	5,080,000	貸付有価証券 100株
日清紡ホールディングス	17,300	811.00	14,030,300	
イビデン	15,900	3,030.00	48,177,000	
コニカミノルタ	56,700	393.00	22,283,100	貸付有価証券 1,700株
ブラザー工業	31,700	2,011.00	63,748,700	
ミネベアミツミ	48,200	1,915.00	92,303,000	
日立製作所	124,800	3,579.00	446,659,200	
三菱電機	259,400	1,423.50	369,255,900	
富士電機	15,600	2,867.00	44,725,200	
東洋電機製造	1,000	1,236.00	1,236,000	
安川電機	27,900	3,860.00	107,694,000	貸付有価証券 5,700株
シンフォニアテクノロジー	3,500	1,080.00	3,780,000	貸付有価証券 100株
明電舎	4,800	1,828.00	8,774,400	貸付有価証券 200株
オリジン	800	1,512.00	1,209,600	
山洋電気	1,300	4,940.00	6,422,000	
デンヨー	2,200	1,936.00	4,259,200	

東芝テック	3,300	3,845.00	12,688,500	貸付有価証券 100株
芝浦メカトロニクス	500	2,780.00	1,390,000	
マブチモーター	7,200	3,575.00	25,740,000	
日本電産	62,500	6,733.00	420,812,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,700	341.00	579,700	
トレックス・セミコンダクター	1,500	1,219.00	1,828,500	
東光高岳	1,400	1,037.00	1,451,800	
ダイヘン	2,800	3,615.00	10,122,000	
ヤーマン	4,200	768.00	3,225,600	貸付有価証券 2,900株
JVCケンウッド	21,100	177.00	3,734,700	
ミマキエンジニアリング	2,400	404.00	969,600	
第一精工	1,100	2,489.00	2,737,900	貸付有価証券 700株
日新電機	6,100	1,134.00	6,917,400	
大崎電気工業	5,200	524.00	2,724,800	貸付有価証券 100株
オムロン	23,300	7,200.00	167,760,000	
日東工業	3,800	1,891.00	7,185,800	貸付有価証券 100株
I D E C	3,700	1,766.00	6,534,200	貸付有価証券 100株
正興電機製作所	700	1,147.00	802,900	
不二電機工業	400	1,290.00	516,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	8,700	1,871.00	16,277,700	貸付有価証券 400株
サクサホールディングス	600	1,743.00	1,045,800	
メルコホールディングス	900	2,725.00	2,452,500	
テクノメディカ	600	1,831.00	1,098,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	602.00	301,000	
日本電気	31,500	4,855.00	152,932,500	
富士通	25,000	11,645.00	291,125,000	
沖電気工業	10,500	1,083.00	11,371,500	貸付有価証券 200株
岩崎通信機	1,200	855.00	1,026,000	
電気興業	1,300	2,674.00	3,476,200	

サンケン電気	2,800	2,494.00	6,983,200	貸付有価証券 500株
ナカヨ	500	1,399.00	699,500	
アイホン	1,500	1,588.00	2,382,000	
ルネサスエレクトロニクス	124,100	557.00	69,123,700	貸付有価証券 1,700株
セイコーエプソン	32,200	1,203.00	38,736,600	
ワコム	17,400	498.00	8,665,200	貸付有価証券 900株
アルバック	4,800	3,260.00	15,648,000	
アクセル	1,200	845.00	1,014,000	
E I Z O	2,000	3,965.00	7,930,000	
日本信号	6,600	1,210.00	7,986,000	
京三製作所	6,000	534.00	3,204,000	貸付有価証券 800株
能美防災	3,400	1,977.00	6,721,800	貸付有価証券 100株
ホーチキ	1,900	1,359.00	2,582,100	
星和電機	1,300	698.00	907,400	
エレコム	2,900	5,060.00	14,674,000	
パナソニック	296,400	956.40	283,476,960	
シャープ	30,000	1,167.00	35,010,000	貸付有価証券 800株
アンリツ	16,700	2,133.00	35,621,100	貸付有価証券 11,600株
富士通ゼネラル	7,000	2,131.00	14,917,000	貸付有価証券 200株
ソニー	162,600	6,973.00	1,133,809,800	代用有価証券 13,000株
T D K	12,500	10,340.00	129,250,000	
帝国通信工業	1,200	1,188.00	1,425,600	
タムラ製作所	8,500	446.00	3,791,000	
アルプスアルパイン	23,000	1,370.00	31,510,000	
池上通信機	900	899.00	809,100	
日本電波工業	2,300	417.00	959,100	貸付有価証券 1,600株
鈴木	1,500	793.00	1,189,500	
日本トリム	300	3,215.00	964,500	
ローランド ディー . ジー .	1,500	1,315.00	1,972,500	

フォスター電機	2,700	1,204.00	3,250,800	
S M K	700	2,648.00	1,853,600	
ヨコオ	1,700	2,817.00	4,788,900	
ホシデン	7,100	930.00	6,603,000	
ヒロセ電機	4,000	12,540.00	50,160,000	貸付有価証券 200株
日本航空電子工業	5,900	1,495.00	8,820,500	貸付有価証券 100株
T O A	2,800	746.00	2,088,800	貸付有価証券 100株
マクセルホールディングス	5,600	1,069.00	5,986,400	貸付有価証券 300株
古野電気	3,300	900.00	2,970,000	貸付有価証券 100株
ユニデンホールディングス	700	2,041.00	1,428,700	
スミダコーポレーション	2,000	748.00	1,496,000	
アイコム	1,500	3,005.00	4,507,500	
リオン	1,100	2,413.00	2,654,300	
本多通信工業	2,400	431.00	1,034,400	貸付有価証券 1,600株
船井電機	2,600	525.00	1,365,000	
横河電機	23,800	1,555.00	37,009,000	
新電元工業	900	2,666.00	2,399,400	
アズビル	16,400	2,758.00	45,231,200	
東亜ディーケーケー	1,300	889.00	1,155,700	
日本光電工業	10,700	3,590.00	38,413,000	
チノー	900	1,425.00	1,282,500	
共和電業	2,700	403.00	1,088,100	
日本電子材料	1,100	1,048.00	1,152,800	
堀場製作所	5,100	5,850.00	29,835,000	
アドバンテスト	19,300	5,630.00	108,659,000	
小野測器	1,200	524.00	628,800	
エスベック	2,400	1,750.00	4,200,000	
キーエンス	23,500	44,290.00	1,040,815,000	
日置電機	1,400	3,405.00	4,767,000	
シスメックス	18,600	8,527.00	158,602,200	
日本マイクロニクス	4,500	1,042.00	4,689,000	
メガチップス	2,500	1,982.00	4,955,000	

OBARA GROUP	1,500	3,235.00	4,852,500	貸付有価証券 500株
澤藤電機	300	1,559.00	467,700	
原田工業	1,300	828.00	1,076,400	
コーセル	3,400	930.00	3,162,000	貸付有価証券 600株
イリソ電子工業	2,200	3,700.00	8,140,000	
オブテックスグループ	4,200	1,440.00	6,048,000	貸付有価証券 100株
千代田インテグレ	1,200	1,810.00	2,172,000	
アイ・オー・データ機器	1,000	984.00	984,000	
レーザーテック	11,400	9,160.00	104,424,000	
スタンレー電気	18,200	2,639.00	48,029,800	
岩崎電気	1,100	1,791.00	1,970,100	
ウシオ電機	14,300	1,338.00	19,133,400	貸付有価証券 500株
岡谷電機産業	2,300	323.00	742,900	
ハリオス テクノ ホールディング	2,300	354.00	814,200	
エノモト	800	1,101.00	880,800	
日本セラミック	2,600	2,109.00	5,483,400	貸付有価証券 100株
遠藤照明	1,400	574.00	803,600	
古河電池	1,800	598.00	1,076,400	
双信電機	1,400	388.00	543,200	貸付有価証券 500株
山一電機	1,900	1,688.00	3,207,200	
図研	1,800	2,681.00	4,825,800	
日本電子	5,100	3,250.00	16,575,000	
カシオ計算機	23,000	1,887.00	43,401,000	貸付有価証券 100株
ファナック	24,700	19,210.00	474,487,000	
日本シイエムケイ	6,100	398.00	2,427,800	貸付有価証券 4,300株
エンプラス	1,300	2,519.00	3,274,700	
大真空	1,000	1,965.00	1,965,000	貸付有価証券 600株
ローム	11,500	7,330.00	84,295,000	貸付有価証券 100株
浜松ホトニクス	18,600	4,860.00	90,396,000	

三井ハイテック	3,000	1,429.00	4,287,000	
新光電気工業	8,700	1,422.00	12,371,400	貸付有価証券 700株
京セラ	36,500	5,918.00	216,007,000	
太陽誘電	11,500	3,095.00	35,592,500	貸付有価証券 7,900株
村田製作所	76,200	6,189.00	471,601,800	
双葉電子工業	4,100	967.00	3,964,700	
北陸電気工業	1,100	923.00	1,015,300	
ニチコン	8,800	768.00	6,758,400	貸付有価証券 300株
日本ケミコン	2,000	1,611.00	3,222,000	貸付有価証券 300株
K O A	4,000	986.00	3,944,000	貸付有価証券 100株
市光工業	3,900	531.00	2,070,900	貸付有価証券 100株
小糸製作所	15,600	4,465.00	69,654,000	
ミツバ	4,900	440.00	2,156,000	貸付有価証券 100株
S C R E E Nホールディングス	4,500	5,050.00	22,725,000	
キャノン電子	2,700	1,700.00	4,590,000	
キャノン	139,700	2,206.00	308,178,200	
リコー	66,000	808.00	53,328,000	
象印マホービン	7,600	1,671.00	12,699,600	
M U T O Hホールディングス	400	1,594.00	637,600	
東京エレクトロン	16,500	22,455.00	370,507,500	貸付有価証券 500株
トヨタ紡織	7,500	1,517.00	11,377,500	
芦森工業	500	901.00	450,500	
ユニプレス	5,000	1,024.00	5,120,000	
豊田自動織機	21,000	5,510.00	115,710,000	
モリタホールディングス	4,500	1,820.00	8,190,000	
三櫻工業	3,300	763.00	2,517,900	
デンソー	57,100	4,101.00	234,167,100	
東海理化電機製作所	6,800	1,589.00	10,805,200	貸付有価証券 300株
三井E & Sホールディングス	9,400	555.00	5,217,000	貸付有価証券 100株

川崎重工業	20,200	1,699.00	34,319,800	貸付有価証券 4,600株
名村造船所	8,300	170.00	1,411,000	
サノヤスホールディングス	3,200	171.00	547,200	
日本車輛製造	900	2,742.00	2,467,800	
三菱ロジスネクスト	3,700	1,036.00	3,833,200	貸付有価証券 2,200株
近畿車輛	400	1,264.00	505,600	
日産自動車	306,100	411.90	126,082,590	貸付有価証券 100,700株
いすゞ自動車	75,200	981.80	73,831,360	
トヨタ自動車	289,600	6,720.00	1,946,112,000	代用有価証券 46,000株
日野自動車	32,400	732.00	23,716,800	
三菱自動車工業	96,300	303.00	29,178,900	貸付有価証券 3,700株
エフテック	1,700	517.00	878,900	
レシップホールディングス	1,000	575.00	575,000	
G M B	500	677.00	338,500	
ファルテック	500	709.00	354,500	
武蔵精密工業	5,800	972.00	5,637,600	貸付有価証券 100株
日産車体	5,100	972.00	4,957,200	貸付有価証券 200株
新明和工業	7,000	1,071.00	7,497,000	貸付有価証券 100株
極東開発工業	4,800	1,306.00	6,268,800	
日信工業	5,300	2,220.00	11,766,000	貸付有価証券 100株
トピー工業	2,100	1,293.00	2,715,300	
ティラド	1,000	1,401.00	1,401,000	
曙ブレーキ工業	14,200	241.00	3,422,200	
タチエス	4,200	922.00	3,872,400	貸付有価証券 100株
N O K	13,900	1,382.00	19,209,800	
フタバ産業	7,200	512.00	3,686,400	貸付有価証券 200株
K Y B	2,900	2,118.00	6,142,200	

大同メタル工業	4,900	567.00	2,778,300	貸付有価証券 600株
プレス工業	13,200	263.00	3,471,600	貸付有価証券 400株
ミクニ	3,300	290.00	957,000	貸付有価証券 100株
太平洋工業	5,400	987.00	5,329,800	貸付有価証券 100株
ケーヒン	6,000	2,558.00	15,348,000	貸付有価証券 200株
河西工業	3,700	498.00	1,842,600	貸付有価証券 100株
アイシン精機	21,400	3,395.00	72,653,000	
マツダ	76,300	696.00	53,104,800	貸付有価証券 1,700株
今仙電機製作所	2,400	754.00	1,809,600	
本田技研工業	204,300	2,794.50	570,916,350	代用有価証券 5,900株
スズキ	51,500	3,784.00	194,876,000	
S U B A R U	80,600	2,393.00	192,875,800	
安永	1,300	997.00	1,296,100	貸付有価証券 200株
ヤマハ発動機	33,800	1,535.00	51,883,000	貸付有価証券 22,000株
ショーワ	6,100	2,262.00	13,798,200	
T B K	3,100	462.00	1,432,200	貸付有価証券 100株
エクセディ	3,500	1,698.00	5,943,000	
豊田合成	8,400	2,321.00	19,496,400	
愛三工業	4,100	565.00	2,316,500	
盟和産業	400	959.00	383,600	
日本プラスト	2,000	471.00	942,000	
ヨロズ	2,400	1,194.00	2,865,600	貸付有価証券 200株
エフ・シー・シー	4,200	1,884.00	7,912,800	貸付有価証券 200株
シマノ	9,700	19,950.00	193,515,000	貸付有価証券 200株
テイ・エス テック	6,000	3,055.00	18,330,000	貸付有価証券 100株

ジャムコ	1,300	751.00	976,300	貸付有価証券 900株
テルモ	73,400	4,229.00	310,408,600	
クリエートメディック	900	987.00	888,300	
日機装	7,700	1,012.00	7,792,400	貸付有価証券 300株
日本エム・ディ・エム	1,500	1,749.00	2,623,500	
島津製作所	31,000	2,951.00	91,481,000	貸付有価証券 200株
JMS	2,200	843.00	1,854,600	
クボテック	700	342.00	239,400	
長野計器	1,900	1,046.00	1,987,400	貸付有価証券 300株
ブイ・テクノロジー	1,200	4,230.00	5,076,000	
東京計器	1,700	947.00	1,609,900	
愛知時計電機	300	4,375.00	1,312,500	
インターアクション	1,400	2,261.00	3,165,400	
オーバル	2,300	230.00	529,000	
東京精密	4,700	3,700.00	17,390,000	
マニー	10,400	2,910.00	30,264,000	
ニコン	39,600	977.00	38,689,200	
トプコン	13,000	956.00	12,428,000	貸付有価証券 400株
オリンパス	143,600	1,881.50	270,183,400	
理研計器	2,300	2,355.00	5,416,500	
タムロン	2,100	2,002.00	4,204,200	
HOYA	51,800	10,255.00	531,209,000	
シード	1,100	789.00	867,900	貸付有価証券 700株
ノーリツ鋼機	1,700	1,480.00	2,516,000	
エー・アンド・デイ	2,400	743.00	1,783,200	貸付有価証券 300株
朝日インテック	29,400	3,290.00	96,726,000	貸付有価証券 1,300株
シチズン時計	30,400	379.00	11,521,600	
リズム時計工業	800	611.00	488,800	
大研医器	1,800	624.00	1,123,200	
メニコン	3,700	5,480.00	20,276,000	

シンシア	300	474.00	142,200	
松風	1,200	1,621.00	1,945,200	
セイコーホールディングス	3,700	1,837.00	6,796,900	貸付有価証券 600株
ニプロ	17,900	1,254.00	22,446,600	貸付有価証券 700株
中本パックス	700	1,570.00	1,099,000	
スノーピーク	1,400	1,015.00	1,421,000	貸付有価証券 400株
パラマウントベッドホールディングス	2,700	4,115.00	11,110,500	
トランザクション	1,500	1,061.00	1,591,500	
粧美堂	800	360.00	288,000	
ニホンフラッシュ	2,400	1,440.00	3,456,000	
前田工織	2,900	2,378.00	6,896,200	貸付有価証券 1,900株
永大産業	3,400	303.00	1,030,200	
アートネイチャー	2,800	632.00	1,769,600	
バンダイナムコホールディングス	26,800	6,055.00	162,274,000	
アイフィスジャパン	700	685.00	479,500	
共立印刷	4,200	138.00	579,600	
S H O E I	2,300	2,470.00	5,681,000	
フランスベッドホールディングス	3,800	861.00	3,271,800	
パイロットコーポレーション	4,200	3,625.00	15,225,000	
萩原工業	1,400	1,428.00	1,999,200	
トッパン・フォームズ	5,600	1,119.00	6,266,400	貸付有価証券 100株
フジシールインターナショナル	5,800	2,175.00	12,615,000	貸付有価証券 1,300株
タカラトミー	11,600	910.00	10,556,000	貸付有価証券 200株
廣済堂	1,800	827.00	1,488,600	
エステールホールディングス	700	613.00	429,100	
アーク	9,800	113.00	1,107,400	
タカノ	1,000	707.00	707,000	
プロネクサス	2,200	1,164.00	2,560,800	
ホクシン	1,600	124.00	198,400	
ウッドワン	900	1,108.00	997,200	
大建工業	1,700	1,691.00	2,874,700	

凸版印刷	36,600	1,867.00	68,332,200	
大日本印刷	33,900	2,442.00	82,783,800	
共同印刷	800	2,988.00	2,390,400	
N I S S H A	5,300	962.00	5,098,600	
光村印刷	200	1,515.00	303,000	
TAKARA & COMPANY	1,300	1,871.00	2,432,300	貸付有価証券 800株
アシックス	21,400	1,174.00	25,123,600	貸付有価証券 400株
ツツミ	800	1,726.00	1,380,800	
小松ウオール工業	800	1,930.00	1,544,000	
ヤマハ	15,400	5,260.00	81,004,000	
河合楽器製作所	800	2,830.00	2,264,000	
クリナップ	2,500	514.00	1,285,000	
ピジョン	15,700	4,260.00	66,882,000	貸付有価証券 7,900株
オリバー	500	2,666.00	1,333,000	貸付有価証券 300株
兼松サステック	200	1,438.00	287,600	
キングジム	2,200	948.00	2,085,600	貸付有価証券 100株
リンテック	6,200	2,599.00	16,113,800	貸付有価証券 200株
イトーキ	5,500	413.00	2,271,500	貸付有価証券 100株
任天堂	15,900	44,460.00	706,914,000	
三菱鉛筆	4,300	1,409.00	6,058,700	貸付有価証券 100株
タカラスタンダード	5,400	1,565.00	8,451,000	貸付有価証券 300株
コクヨ	12,500	1,388.00	17,350,000	貸付有価証券 400株
ナカバヤシ	2,600	630.00	1,638,000	貸付有価証券 100株
グローブライド	1,200	2,287.00	2,744,400	貸付有価証券 100株
オカムラ	9,000	870.00	7,830,000	貸付有価証券 400株
美津濃	2,400	2,019.00	4,845,600	

東京電力ホールディングス	207,200	369.00	76,456,800	貸付有価証券 139,300株
中部電力	79,400	1,471.50	116,837,100	
関西電力	98,300	1,101.50	108,277,450	
中国電力	37,400	1,512.00	56,548,800	貸付有価証券 24,200株
北陸電力	23,700	709.00	16,803,300	貸付有価証券 100株
東北電力	64,800	1,113.00	72,122,400	
四国電力	23,300	809.00	18,849,700	貸付有価証券 1,400株
九州電力	53,500	919.00	49,166,500	
北海道電力	24,300	440.00	10,692,000	
沖縄電力	5,040	2,004.00	10,100,160	
電源開発	20,700	2,013.00	41,669,100	
エフオン	1,300	619.00	804,700	
イーレックス	3,700	1,487.00	5,501,900	貸付有価証券 700株
レノバ	4,300	944.00	4,059,200	貸付有価証券 1,100株
東京瓦斯	49,900	2,632.50	131,361,750	
大阪瓦斯	50,400	2,194.00	110,577,600	
東邦瓦斯	12,700	5,350.00	67,945,000	
北海道瓦斯	1,400	1,581.00	2,213,400	
広島ガス	5,400	349.00	1,884,600	貸付有価証券 100株
西部瓦斯	2,900	2,617.00	7,589,300	貸付有価証券 100株
静岡ガス	7,400	985.00	7,289,000	
メタウォーター	1,200	4,850.00	5,820,000	
SBSホールディングス	2,200	2,414.00	5,310,800	
東武鉄道	27,100	3,815.00	103,386,500	貸付有価証券 200株
相鉄ホールディングス	8,300	3,095.00	25,688,500	貸付有価証券 100株
東急	65,400	1,684.00	110,133,600	
京浜急行電鉄	33,300	1,772.00	59,007,600	
小田急電鉄	38,600	2,631.00	101,556,600	貸付有価証券 400株

京王電鉄	13,400	6,320.00	84,688,000	貸付有価証券 300株
京成電鉄	18,100	3,500.00	63,350,000	
富士急行	3,500	3,445.00	12,057,500	貸付有価証券 200株
新京成電鉄	700	2,125.00	1,487,500	
東日本旅客鉄道	45,700	8,275.00	378,167,500	
西日本旅客鉄道	23,100	6,816.00	157,449,600	貸付有価証券 200株
東海旅客鉄道	21,600	18,230.00	393,768,000	貸付有価証券 3,100株
西武ホールディングス	34,800	1,388.00	48,302,400	
鴻池運輸	4,100	1,207.00	4,948,700	
西日本鉄道	7,200	2,900.00	20,880,000	貸付有価証券 100株
ハマキョウレックス	2,000	3,200.00	6,400,000	
サカイ引越センター	1,400	6,000.00	8,400,000	貸付有価証券 100株
近鉄グループホールディングス	24,600	5,320.00	130,872,000	
阪急阪神ホールディングス	32,800	3,975.00	130,380,000	
南海電気鉄道	11,700	2,609.00	30,525,300	貸付有価証券 300株
京阪ホールディングス	10,900	5,090.00	55,481,000	
神戸電鉄	600	3,800.00	2,280,000	
名古屋鉄道	20,200	3,225.00	65,145,000	
山陽電気鉄道	1,800	2,256.00	4,060,800	
日本通運	8,500	5,590.00	47,515,000	
ヤマトホールディングス	43,100	2,347.00	101,155,700	
山九	6,800	4,340.00	29,512,000	
丸運	1,500	242.00	363,000	
丸全昭和運輸	2,000	2,837.00	5,674,000	
センコーグループホールディングス	13,500	842.00	11,367,000	
トナミホールディングス	600	6,130.00	3,678,000	
ニッコンホールディングス	8,800	2,153.00	18,946,400	貸付有価証券 100株
日本石油輸送	300	3,150.00	945,000	
福山通運	3,100	3,520.00	10,912,000	貸付有価証券 200株
セイノーホールディングス	18,400	1,461.00	26,882,400	

エスライン	700	1,007.00	704,900	
神奈川中央交通	600	4,090.00	2,454,000	
日立物流	4,500	2,883.00	12,973,500	貸付有価証券 100株
丸和運輸機関	2,600	3,020.00	7,852,000	貸付有価証券 1,400株
C & F ロジホールディングス	2,700	1,518.00	4,098,600	貸付有価証券 100株
九州旅客鉄道	21,500	3,035.00	65,252,500	
S Gホールディングス	25,800	3,550.00	91,590,000	貸付有価証券 300株
日本郵船	20,600	1,541.00	31,744,600	貸付有価証券 500株
商船三井	15,600	1,962.00	30,607,200	
川崎汽船	7,600	1,151.00	8,747,600	貸付有価証券 800株
N S ユナイテッド海運	1,400	1,443.00	2,020,200	
明治海運	2,500	339.00	847,500	
飯野海運	12,100	347.00	4,198,700	貸付有価証券 300株
共栄タンカー	500	882.00	441,000	
乾汽船	1,400	1,120.00	1,568,000	
日本航空	43,500	2,147.50	93,416,250	
A N Aホールディングス	44,900	2,614.00	117,368,600	貸付有価証券 31,200株
パスコ	500	1,491.00	745,500	貸付有価証券 300株
トランコム	700	6,890.00	4,823,000	
日新	2,200	1,641.00	3,610,200	貸付有価証券 100株
三菱倉庫	7,800	2,785.00	21,723,000	
三井倉庫ホールディングス	2,800	1,580.00	4,424,000	貸付有価証券 100株
住友倉庫	8,800	1,333.00	11,730,400	貸付有価証券 400株
澁澤倉庫	1,300	2,149.00	2,793,700	
東陽倉庫	4,400	317.00	1,394,800	
日本トランスシティ	5,400	521.00	2,813,400	貸付有価証券 100株
ケイヒン	500	1,294.00	647,000	

中央倉庫	1,500	994.00	1,491,000	
安田倉庫	2,100	893.00	1,875,300	
ファイブホールディングス	700	1,148.00	803,600	貸付有価証券 400株
東洋埠頭	800	1,347.00	1,077,600	
宇徳	2,200	461.00	1,014,200	
上組	13,700	2,092.00	28,660,400	貸付有価証券 200株
キムラユニティー	800	1,006.00	804,800	
キューソー流通システム	700	1,760.00	1,232,000	
近鉄エクスプレス	5,200	1,709.00	8,886,800	貸付有価証券 100株
東海運	1,900	266.00	505,400	
エーアイティー	1,800	770.00	1,386,000	
内外トランスライン	900	1,056.00	950,400	
日本コンセプト	800	1,478.00	1,182,400	
N E C ネットズエスアイ	7,200	2,047.00	14,738,400	
クロスキャット	700	1,063.00	744,100	
システナ	9,100	1,509.00	13,731,900	貸付有価証券 300株
デジタルアーツ	1,200	8,800.00	10,560,000	
日鉄ソリューションズ	3,800	3,005.00	11,419,000	貸付有価証券 100株
キューブシステム	1,400	780.00	1,092,000	
エイジア	500	1,363.00	681,500	
コア	1,100	1,227.00	1,349,700	
ラクーンホールディングス	1,300	805.00	1,046,500	
ソリトンシステムズ	1,100	1,439.00	1,582,900	貸付有価証券 700株
ソフトクリエイトホールディングス	1,100	2,214.00	2,435,400	
T I S	25,500	2,342.00	59,721,000	
ネオス	1,000	713.00	713,000	貸付有価証券 700株
電算システム	1,000	3,460.00	3,460,000	
グリー	15,600	452.00	7,051,200	
コーエーテクモホールディングス	5,200	3,165.00	16,458,000	
三菱総合研究所	1,100	4,120.00	4,532,000	
ボルテージ	500	491.00	245,500	

電算	300	2,192.00	657,600	
A G S	1,400	845.00	1,183,000	
ファインデックス	2,100	970.00	2,037,000	
ブレインパッド	700	5,080.00	3,556,000	貸付有価証券 400株
K L a b	4,900	789.00	3,866,100	貸付有価証券 900株
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,100	967.00	2,997,700	貸付有価証券 100株
イーブックイニシアティブジャパン	400	2,695.00	1,078,000	
ネクソン	71,000	2,329.00	165,359,000	
アイスタイル	7,100	316.00	2,243,600	貸付有価証券 3,200株
エムアップホールディングス	700	2,637.00	1,845,900	貸付有価証券 400株
エイチーム	1,800	806.00	1,450,800	
エニグモ	2,400	1,044.00	2,505,600	貸付有価証券 600株
テクノスジャパン	2,000	604.00	1,208,000	
コロプラ	8,400	1,089.00	9,147,600	貸付有価証券 5,700株
ブロードリーフ	12,600	573.00	7,219,800	貸付有価証券 100株
クロス・マーケティンググループ	1,300	325.00	422,500	貸付有価証券 300株
デジタルハーツホールディングス	1,300	889.00	1,155,700	
システム情報	1,900	1,225.00	2,327,500	
メディアドゥ	800	4,550.00	3,640,000	貸付有価証券 500株
じげん	6,300	375.00	2,362,500	
ブイキューブ	1,600	1,243.00	1,988,800	貸付有価証券 1,100株
エンカレッジ・テクノロジー	500	843.00	421,500	貸付有価証券 300株
サイバーリンクス	400	1,825.00	730,000	
フィックスターズ	2,800	1,321.00	3,698,800	
C A R T A H O L D I N G S	1,200	1,074.00	1,288,800	貸付有価証券 200株
オブティム	1,300	2,906.00	3,777,800	貸付有価証券 500株

セレス	800	1,224.00	979,200	
S H I F T	1,000	10,500.00	10,500,000	貸付有価証券 700株
ティーガイア	2,300	2,285.00	5,255,500	
セック	400	3,600.00	1,440,000	
日本アジアグループ	2,700	311.00	839,700	貸付有価証券 100株
テクマトリックス	1,800	3,420.00	6,156,000	
プロシップ	800	1,300.00	1,040,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,100	1,761.00	10,742,100	
GMOペイメントゲートウェイ	5,400	12,240.00	66,096,000	貸付有価証券 1,900株
ザッパラス	1,400	393.00	550,200	
システムリサーチ	700	1,895.00	1,326,500	
インターネットイニシアティブ	3,800	3,900.00	14,820,000	貸付有価証券 100株
さくらインターネット	2,700	684.00	1,846,800	
ヴィンクス	700	1,117.00	781,900	
GMOクラウド	500	6,480.00	3,240,000	貸付有価証券 300株
SRAホールディングス	1,300	2,478.00	3,221,400	
システムインテグレータ	800	933.00	746,400	
朝日ネット	1,800	1,152.00	2,073,600	
eBASE	3,100	1,270.00	3,937,000	
アバント	2,400	1,138.00	2,731,200	貸付有価証券 200株
アドソル日進	900	2,650.00	2,385,000	貸付有価証券 300株
フリービット	1,500	889.00	1,333,500	貸付有価証券 100株
コムチュア	2,900	3,010.00	8,729,000	
サイバーコム	400	1,935.00	774,000	
アステリア	1,600	511.00	817,600	貸付有価証券 1,100株
アイル	1,400	1,935.00	2,709,000	貸付有価証券 500株
マークライنز	1,300	2,017.00	2,622,100	
メディカル・データ・ビジョン	1,900	1,100.00	2,090,000	貸付有価証券 1,200株

g u m i	3,300	869.00	2,867,700	
ショーケース	700	617.00	431,900	貸付有価証券 100株
モバイルファクトリー	600	1,216.00	729,600	
テラスカイ	900	2,866.00	2,579,400	貸付有価証券 500株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,000	1,585.00	1,585,000	貸付有価証券 300株
P C Iホールディングス	1,100	989.00	1,087,900	
パイブドHD	300	1,627.00	488,100	貸付有価証券 200株
アイビーシー	500	1,059.00	529,500	
ネオジャパン	500	1,396.00	698,000	
P R T I M E S	200	2,449.00	489,800	
ランドコンピュータ	400	1,135.00	454,000	
ダブルスタンダード	300	5,000.00	1,500,000	
オープンドア	1,300	1,304.00	1,695,200	貸付有価証券 900株
マイネット	900	1,275.00	1,147,500	貸付有価証券 300株
アカツキ	900	4,190.00	3,771,000	貸付有価証券 600株
ベネフィットジャパン	200	1,530.00	306,000	貸付有価証券 100株
U b i c o mホールディングス	600	1,755.00	1,053,000	貸付有価証券 300株
L I N E	5,800	5,350.00	31,030,000	貸付有価証券 400株
カナミックネットワーク	2,300	963.00	2,214,900	
ノムラシステムコーポレーション	600	519.00	311,400	
チェンジ	900	5,670.00	5,103,000	
シンクロ・フード	1,100	360.00	396,000	貸付有価証券 700株
オークネット	1,600	1,183.00	1,892,800	
セグエグループ	500	915.00	457,500	貸付有価証券 300株
エイトレッド	400	1,940.00	776,000	
A O I T Y O H o l d i n g s	2,600	476.00	1,237,600	貸付有価証券 1,800株
マクロミル	5,300	725.00	3,842,500	

ビーグリー	500	1,586.00	793,000	
オロ	700	3,050.00	2,135,000	貸付有価証券 200株
ユーザーローカル	200	3,210.00	642,000	
テモナ	500	845.00	422,500	貸付有価証券 200株
ニーズウェル	500	709.00	354,500	
サインポスト	500	1,809.00	904,500	貸付有価証券 200株
ソルクシーズ	1,100	725.00	797,500	
フェイス	900	667.00	600,300	
プロトコーポレーション	2,300	1,100.00	2,530,000	
ハイマックス	300	1,985.00	595,500	
野村総合研究所	36,100	2,828.00	102,090,800	
サイバネットシステム	1,800	682.00	1,227,600	貸付有価証券 1,200株
C Eホールディングス	1,500	489.00	733,500	
日本システム技術	500	1,412.00	706,000	
インテージホールディングス	3,200	876.00	2,803,200	貸付有価証券 100株
東邦システムサイエンス	700	913.00	639,100	
ソースネクスト	12,200	326.00	3,977,200	貸付有価証券 8,100株
インフォコム	2,800	2,862.00	8,013,600	
HEROZ	400	3,840.00	1,536,000	貸付有価証券 200株
ラクスル	2,000	2,737.00	5,474,000	
F I G	2,800	275.00	770,000	
システムサポート	600	2,228.00	1,336,800	貸付有価証券 400株
イーソル	1,300	1,529.00	1,987,700	貸付有価証券 800株
アルテリア・ネットワークス	2,800	2,038.00	5,706,400	
東海ソフト	200	1,336.00	267,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	600	1,100.00	660,000	貸付有価証券 400株
トピラシステムズ	300	1,892.00	567,600	
フォーカスシステムズ	1,600	940.00	1,504,000	
クレスコ	1,600	1,560.00	2,496,000	

フジ・メディア・ホールディングス	24,600	1,079.00	26,543,400	貸付有価証券 600株
オービック	8,800	18,900.00	166,320,000	
ジャストシステム	4,100	7,670.00	31,447,000	
TDCソフト	2,200	963.00	2,118,600	貸付有価証券 300株
Zホールディングス	349,800	448.00	156,710,400	
トレンドマイクロ	11,300	5,950.00	67,235,000	
IDホールディングス	1,000	1,520.00	1,520,000	
日本オラクル	5,200	12,750.00	66,300,000	貸付有価証券 200株
アルファシステムズ	800	4,010.00	3,208,000	
フューチャー	3,100	1,799.00	5,576,900	貸付有価証券 100株
CAC Holdings	1,700	1,321.00	2,245,700	
SBテクノロジー	900	2,840.00	2,556,000	
トーセ	700	849.00	594,300	
オービックビジネスコンサルタント	2,600	5,920.00	15,392,000	貸付有価証券 100株
伊藤忠テクノソリューションズ	11,600	3,735.00	43,326,000	
アイティフォー	3,100	732.00	2,269,200	
東計電算	400	4,170.00	1,668,000	
エクスネット	400	967.00	386,800	
大塚商会	13,800	5,280.00	72,864,000	
サイボウズ	3,000	2,978.00	8,934,000	
ソフトブレーン	1,500	534.00	801,000	
電通国際情報サービス	1,600	5,120.00	8,192,000	
ACCESS	2,400	965.00	2,316,000	
デジタルガレージ	4,600	3,825.00	17,595,000	貸付有価証券 300株
EMシステムズ	3,600	840.00	3,024,000	貸付有価証券 2,500株
ウェザーニューズ	900	3,780.00	3,402,000	
CIJ	1,700	951.00	1,616,700	
ビジネスエンジニアリング	300	2,663.00	798,900	
日本エンタープライズ	2,600	278.00	722,800	
WOWOW	1,200	2,516.00	3,019,200	
スカラ	1,700	717.00	1,218,900	

インテリジェント ウェイブ	1,500	786.00	1,179,000	
I M A G I C A G R O U P	2,100	423.00	888,300	
ネットワンシステムズ	9,700	3,370.00	32,689,000	貸付有価証券 100株
システムソフト	6,200	84.00	520,800	
アルゴグラフィックス	2,200	3,820.00	8,404,000	
マーベラス	3,900	753.00	2,936,700	
エイベックス	4,500	953.00	4,288,500	
日本ユニシス	8,000	3,360.00	26,880,000	
兼松エレクトロニクス	1,400	3,980.00	5,572,000	
東京放送ホールディングス	15,500	1,699.00	26,334,500	貸付有価証券 10,600株
日本テレビホールディングス	21,300	1,230.00	26,199,000	貸付有価証券 300株
朝日放送グループホールディングス	2,500	733.00	1,832,500	
テレビ朝日ホールディングス	7,000	1,671.00	11,697,000	貸付有価証券 4,600株
スカパーJ S A Tホールディングス	16,700	437.00	7,297,900	貸付有価証券 400株
テレビ東京ホールディングス	2,100	2,442.00	5,128,200	
日本BS放送	900	1,129.00	1,016,100	貸付有価証券 100株
ビジョン	2,400	870.00	2,088,000	貸付有価証券 1,600株
スマートバリュー	800	1,275.00	1,020,000	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,000	1,372.00	1,372,000	貸付有価証券 700株
コネクシオ	1,400	1,509.00	2,112,600	貸付有価証券 200株
クロップス	500	699.00	349,500	
日本電信電話	340,400	2,448.50	833,469,400	
K D D I	189,800	3,167.00	601,096,600	
ソフトバンク	231,400	1,366.00	316,092,400	
光通信	2,600	24,290.00	63,154,000	
N T T ドコモ	182,100	2,965.00	539,926,500	
エムティーアイ	2,500	631.00	1,577,500	
G M O インターネット	10,000	2,842.00	28,420,000	貸付有価証券 500株

ファイバーゲート	800	1,433.00	1,146,400	貸付有価証券 400株
アйдママーケティングコミュニケーション	800	524.00	419,200	
KADOKAWA	6,800	1,747.00	11,879,600	貸付有価証券 100株
学研ホールディングス	3,400	1,628.00	5,535,200	
ゼンリン	5,100	1,341.00	6,839,100	貸付有価証券 100株
昭文社ホールディングス	1,300	404.00	525,200	
インプレスホールディングス	2,400	154.00	369,600	
アイネット	1,300	1,558.00	2,025,400	
松竹	1,700	13,960.00	23,732,000	貸付有価証券 1,100株
東宝	15,000	3,950.00	59,250,000	貸付有価証券 400株
東映	900	14,540.00	13,086,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	67,700	1,263.00	85,505,100	
ピー・シー・エー	400	4,310.00	1,724,000	貸付有価証券 200株
ビジネスブレイン太田昭和	400	2,702.00	1,080,800	
D T S	5,700	2,323.00	13,241,100	貸付有価証券 200株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	10,900	5,240.00	57,116,000	貸付有価証券 200株
シーイーシー	2,700	1,915.00	5,170,500	
カブコン	12,000	3,930.00	47,160,000	貸付有価証券 300株
アイ・エス・ビー	500	2,157.00	1,078,500	
ジャステック	1,800	1,178.00	2,120,400	
S C S K	5,900	5,350.00	31,565,000	貸付有価証券 200株
日本システムウエア	800	2,379.00	1,903,200	
アイネス	2,600	1,404.00	3,650,400	
T K C	2,200	5,650.00	12,430,000	
富士ソフト	3,300	4,650.00	15,345,000	貸付有価証券 600株
N S D	8,200	1,700.00	13,940,000	
コナミホールディングス	9,300	3,785.00	35,200,500	
福井コンピュータホールディングス	1,000	3,145.00	3,145,000	

J B C Cホールディングス	1,800	1,681.00	3,025,800	貸付有価証券 100株
ミロク情報サービス	2,200	2,528.00	5,561,600	貸付有価証券 1,500株
ソフトバンクグループ	202,100	5,018.00	1,014,137,800	代用有価証券 17,000株
ハウスイ	200	915.00	183,000	
高千穂交易	1,000	984.00	984,000	
カワニシホールディングス	300	1,318.00	395,400	
伊藤忠食品	600	4,705.00	2,823,000	
エレマテック	2,400	879.00	2,109,600	
J A L U X	700	1,790.00	1,253,000	
あらた	2,000	4,460.00	8,920,000	
トーメンデバイス	400	3,490.00	1,396,000	
東京エレクトロン デバイス	900	2,848.00	2,563,200	
フィールズ	2,000	370.00	740,000	貸付有価証券 1,300株
双日	141,100	252.00	35,557,200	貸付有価証券 3,400株
アルフレッサ ホールディングス	28,400	2,184.00	62,025,600	
横浜冷凍	6,700	902.00	6,043,400	貸付有価証券 300株
神栄	400	486.00	194,400	
ラサ商事	1,300	911.00	1,184,300	
アルコニックス	2,700	1,267.00	3,420,900	
神戸物産	8,800	5,960.00	52,448,000	貸付有価証券 300株
ハイパー	400	593.00	237,200	
あい ホールディングス	3,600	1,442.00	5,191,200	貸付有価証券 100株
ディーブイエックス	900	930.00	837,000	貸付有価証券 600株
ダイワボウホールディングス	2,200	7,680.00	16,896,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	6,100	1,713.00	10,449,300	貸付有価証券 300株
ラクト・ジャパン	1,000	3,950.00	3,950,000	貸付有価証券 600株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,800	1,080.00	5,184,000	貸付有価証券 200株

八洲電機	2,000	889.00	1,778,000	
メディアスホールディングス	1,400	977.00	1,367,800	貸付有価証券 900株
レスターホールディングス	2,700	2,069.00	5,586,300	
ジューテックホールディングス	600	985.00	591,000	
大光	1,100	673.00	740,300	
OCHIホールディングス	700	1,474.00	1,031,800	
TOKAIホールディングス	13,500	1,002.00	13,527,000	
黒谷	700	488.00	341,600	貸付有価証券 200株
Cominix	500	764.00	382,000	
三洋貿易	2,600	959.00	2,493,400	
ビューティガレージ	400	1,756.00	702,400	
ウイン・パートナーズ	2,000	1,003.00	2,006,000	
ミタチ産業	800	598.00	478,400	
シップヘルスケアホールディングス	4,100	4,635.00	19,003,500	貸付有価証券 300株
明治電機工業	800	1,370.00	1,096,000	
デリカフーズホールディングス	900	643.00	578,700	
スターティアホールディングス	700	705.00	493,500	貸付有価証券 400株
コメダホールディングス	5,600	1,860.00	10,416,000	
ピーバンドットコム	200	1,047.00	209,400	
アセンテック	300	3,380.00	1,014,000	
富士興産	900	509.00	458,100	
協栄産業	300	1,231.00	369,300	
小野建	2,300	1,268.00	2,916,400	
南陽	600	1,465.00	879,000	
佐島電機	1,800	864.00	1,555,200	
エコートレーディング	700	519.00	363,300	
伯東	1,500	979.00	1,468,500	
コンドーテック	2,000	1,062.00	2,124,000	
中山福	1,500	449.00	673,500	
ナガイレーベン	3,400	2,660.00	9,044,000	
三菱食品	2,800	2,694.00	7,543,200	
松田産業	1,900	1,421.00	2,699,900	

第一興商	3,800	3,780.00	14,364,000	貸付有価証券 300株
メディバルホールディングス	27,600	2,154.00	59,450,400	
S P K	1,100	1,427.00	1,569,700	
萩原電気ホールディングス	900	2,190.00	1,971,000	
アズワン	1,700	11,990.00	20,383,000	
スズデン	900	1,196.00	1,076,400	
尾家産業	700	1,476.00	1,033,200	
シモジマ	1,600	1,258.00	2,012,800	
ドウシシャ	2,500	1,546.00	3,865,000	
小津産業	600	1,765.00	1,059,000	貸付有価証券 400株
高速	1,500	1,472.00	2,208,000	
たけびし	900	1,491.00	1,341,900	
リックス	600	1,539.00	923,400	
丸文	2,200	490.00	1,078,000	
ハピネット	2,100	1,076.00	2,259,600	貸付有価証券 100株
橋本総業ホールディングス	500	1,890.00	945,000	
日本ライフライン	7,600	1,469.00	11,164,400	
タカショー	1,600	474.00	758,400	
マルカ	900	1,832.00	1,648,800	
I D O M	7,300	493.00	3,598,900	貸付有価証券 5,100株
進和	1,500	1,920.00	2,880,000	
エスケイジャパン	600	310.00	186,000	
ダイトロン	1,100	1,707.00	1,877,700	
シークス	3,300	1,082.00	3,570,600	
田中商事	900	684.00	615,600	
オーハシテクニカ	1,400	1,640.00	2,296,000	
白銅	1,000	1,409.00	1,409,000	
伊藤忠商事	178,800	2,330.00	416,604,000	貸付有価証券 103,100株
丸紅	266,000	518.90	138,027,400	
高島	400	1,700.00	680,000	
長瀬産業	14,400	1,350.00	19,440,000	貸付有価証券 300株
蝶理	1,600	1,857.00	2,971,200	

豊田通商	28,500	2,748.00	78,318,000	
三共生興	3,900	443.00	1,727,700	
兼松	9,500	1,345.00	12,777,500	
ツカモトコーポレーション	500	1,104.00	552,000	
三井物産	221,200	1,644.00	363,652,800	貸付有価証券 900株
日本紙パルプ商事	1,500	3,945.00	5,917,500	
カメイ	3,500	1,071.00	3,748,500	貸付有価証券 100株
東都水産	300	3,280.00	984,000	
OUGホールディングス	400	2,670.00	1,068,000	
スターゼン	900	4,625.00	4,162,500	
山善	10,000	925.00	9,250,000	
椿本興業	500	3,235.00	1,617,500	
住友商事	161,200	1,279.00	206,174,800	
内田洋行	1,000	5,850.00	5,850,000	
三菱商事	179,400	2,482.00	445,270,800	
第一実業	1,300	3,755.00	4,881,500	
キャノンマーケティングジャパン	6,400	2,203.00	14,099,200	貸付有価証券 100株
西華産業	1,500	1,240.00	1,860,000	
佐藤商事	2,100	925.00	1,942,500	
菱洋エレクトロ	2,600	2,784.00	7,238,400	貸付有価証券 300株
東京産業	2,300	576.00	1,324,800	
ユアサ商事	2,400	3,115.00	7,476,000	
神鋼商事	700	1,970.00	1,379,000	
トルク	1,600	308.00	492,800	
阪和興業	4,800	1,999.00	9,595,200	
正栄食品工業	1,700	4,460.00	7,582,000	
カナデン	2,100	1,280.00	2,688,000	
菱電商事	1,800	1,414.00	2,545,200	
フルサト工業	1,400	1,416.00	1,982,400	
岩谷産業	5,700	3,820.00	21,774,000	貸付有価証券 1,000株
ナイス	1,100	810.00	891,000	
昭光通商	900	595.00	535,500	

ニチモウ	400	1,812.00	724,800	
極東貿易	700	1,507.00	1,054,900	
イワキ	3,300	476.00	1,570,800	貸付有価証券 100株
三愛石油	6,300	1,070.00	6,741,000	貸付有価証券 100株
稲畑産業	5,600	1,306.00	7,313,600	貸付有価証券 100株
G S Iクレオス	700	1,152.00	806,400	
明和産業	2,300	488.00	1,122,400	貸付有価証券 500株
クワザワ	1,000	526.00	526,000	貸付有価証券 200株
ヤマエ久野	1,900	1,276.00	2,424,400	
ワキタ	5,400	1,011.00	5,459,400	
東邦ホールディングス	8,200	2,110.00	17,302,000	
サンゲツ	6,900	1,566.00	10,805,400	貸付有価証券 300株
ミツウロコグループホールディングス	3,800	1,188.00	4,514,400	貸付有価証券 200株
シナネンホールディングス	1,000	2,682.00	2,682,000	
伊藤忠エネクス	5,700	854.00	4,867,800	
サンリオ	7,200	1,810.00	13,032,000	貸付有価証券 2,100株
サンワテクノス	1,800	878.00	1,580,400	
リョーサン	2,800	2,455.00	6,874,000	
新光商事	4,100	896.00	3,673,600	貸付有価証券 100株
トーヨー	1,100	1,886.00	2,074,600	
三信電気	1,400	1,666.00	2,332,400	
東陽テクニカ	2,700	1,063.00	2,870,100	
モスフードサービス	3,400	2,993.00	10,176,200	貸付有価証券 2,200株
加賀電子	2,500	2,273.00	5,682,500	
ソーダニッカ	2,700	521.00	1,406,700	
立花エレテック	1,900	1,736.00	3,298,400	
フォーバル	1,100	1,161.00	1,277,100	
P A L T A C	4,100	5,300.00	21,730,000	
三谷産業	3,500	391.00	1,368,500	

太平洋興発	1,000	618.00	618,000	
西本Wismettacホールディングス	500	1,981.00	990,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,949.00	389,800	
国際紙バルブ商事	6,100	287.00	1,750,700	貸付有価証券 100株
ヤマタネ	1,300	1,214.00	1,578,200	
丸紅建材リース	300	1,586.00	475,800	
日鉄物産	1,800	3,640.00	6,552,000	
泉州電業	800	2,636.00	2,108,800	
トラスコ中山	5,300	2,477.00	13,128,100	
オートボックスセブン	9,500	1,325.00	12,587,500	貸付有価証券 200株
モリト	1,900	682.00	1,295,800	
加藤産業	3,700	3,785.00	14,004,500	
北恵	600	929.00	557,400	
イノテック	1,300	1,096.00	1,424,800	
イエローハット	4,800	1,500.00	7,200,000	貸付有価証券 100株
J Kホールディングス	2,300	875.00	2,012,500	
日伝	2,300	2,291.00	5,269,300	貸付有価証券 100株
北沢産業	2,000	289.00	578,000	貸付有価証券 1,300株
杉本商事	1,400	1,835.00	2,569,000	
因幡電機産業	7,300	2,460.00	17,958,000	貸付有価証券 100株
東テク	800	2,216.00	1,772,800	
ミスミグループ本社	32,000	2,885.00	92,320,000	
アルテック	2,200	228.00	501,600	
タキヒヨー	800	1,700.00	1,360,000	
蔵王産業	500	1,460.00	730,000	
スズケン	10,800	3,965.00	42,822,000	
ジェコス	1,800	960.00	1,728,000	
グローセル	2,600	439.00	1,141,400	貸付有価証券 300株
ローソン	6,500	5,870.00	38,155,000	
サンエー	2,100	4,300.00	9,030,000	貸付有価証券 100株

カワチ薬品	2,000	2,661.00	5,322,000	貸付有価証券 1,300株
エービーシー・マート	4,000	6,580.00	26,320,000	貸付有価証券 100株
ハードオフコーポレーション	1,000	741.00	741,000	
アスクル	2,700	3,580.00	9,666,000	
ゲオホールディングス	4,600	1,446.00	6,651,600	貸付有価証券 100株
アダストリア	3,500	1,728.00	6,048,000	貸付有価証券 700株
ジーフット	1,500	464.00	696,000	貸付有価証券 100株
シー・ヴィ・エス・バイエリア	400	503.00	201,200	
くら寿司	1,300	4,950.00	6,435,000	
キャンドウ	1,200	1,876.00	2,251,200	貸付有価証券 800株
パルグループホールディングス	2,700	1,346.00	3,634,200	
エディオン	11,700	989.00	11,571,300	貸付有価証券 7,600株
サーラコーポレーション	5,200	592.00	3,078,400	貸付有価証券 200株
ワッツ	1,100	761.00	837,100	
ハローズ	1,000	3,090.00	3,090,000	
フジオフードシステム	2,200	1,625.00	3,575,000	貸付有価証券 1,500株
あみやき亭	600	3,185.00	1,911,000	
ひらまつ	4,500	195.00	877,500	貸付有価証券 100株
大黒天物産	600	4,195.00	2,517,000	貸付有価証券 400株
ハニーズホールディングス	2,300	1,183.00	2,720,900	貸付有価証券 1,500株
ファーマライズホールディングス	700	663.00	464,100	
アルペン	2,100	1,770.00	3,717,000	貸付有価証券 1,400株
ハブ	700	729.00	510,300	
クオールホールディングス	3,700	1,225.00	4,532,500	
ジinzホールディングス	1,400	6,750.00	9,450,000	貸付有価証券 900株

ビックカメラ	15,200	1,131.00	17,191,200	貸付有価証券 4,300株
D C Mホールディングス	14,100	1,120.00	15,792,000	貸付有価証券 9,800株
M o n o t a R O	18,200	3,985.00	72,527,000	貸付有価証券 11,500株
東京一番フーズ	700	512.00	358,400	貸付有価証券 300株
D Dホールディングス	1,000	1,043.00	1,043,000	
きちりホールディングス	700	661.00	462,700	
アークランドサービスホールディングス	2,000	1,925.00	3,850,000	貸付有価証券 1,300株
J . フロント リテイリング	30,600	915.00	27,999,000	
ドトール・日レスホールディングス	3,700	1,808.00	6,689,600	貸付有価証券 200株
マツモトキヨシホールディングス	10,600	3,960.00	41,976,000	
ブロンコピリー	1,300	2,443.00	3,175,900	
Z O Z O	17,600	2,050.00	36,080,000	貸付有価証券 400株
トレジャー・ファクトリー	800	709.00	567,200	
物語コーポレーション	700	7,850.00	5,495,000	
ココカラファイン	2,700	5,390.00	14,553,000	貸付有価証券 200株
三越伊勢丹ホールディングス	44,700	712.00	31,826,400	貸付有価証券 3,000株
H a m e e	900	1,352.00	1,216,800	貸付有価証券 600株
ウエルシアホールディングス	7,600	8,940.00	67,944,000	
クリエイトSDホールディングス	4,300	3,450.00	14,835,000	貸付有価証券 3,000株
丸善C H Iホールディングス	2,900	381.00	1,104,900	
ミサワ	600	562.00	337,200	貸付有価証券 300株
ティーライフ	400	1,196.00	478,400	
チムニー	800	1,798.00	1,438,400	貸付有価証券 100株
シュッピン	1,700	829.00	1,409,300	貸付有価証券 1,100株
オイシックス・ラ・大地	2,500	2,300.00	5,750,000	

ネクステージ	3,600	894.00	3,218,400	貸付有価証券 2,500株
ジョイフル本田	7,500	1,345.00	10,087,500	貸付有価証券 200株
鳥貴族	800	1,872.00	1,497,600	貸付有価証券 500株
キリン堂ホールディングス	1,000	2,202.00	2,202,000	貸付有価証券 400株
ホットランド	1,700	1,238.00	2,104,600	貸付有価証券 1,100株
すかいらーくホールディングス	28,700	1,762.00	50,569,400	貸付有価証券 19,900株
SFPホールディングス	1,500	1,708.00	2,562,000	
綿半ホールディングス	1,000	1,871.00	1,871,000	
ヨシックス	400	2,443.00	977,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	7,400	1,129.00	8,354,600	貸付有価証券 200株
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,200	582.00	698,400	
B E E N O S	1,200	1,090.00	1,308,000	貸付有価証券 500株
あさひ	1,900	1,550.00	2,945,000	
日本調剤	1,500	1,746.00	2,619,000	
コスモス薬品	2,200	15,840.00	34,848,000	貸付有価証券 800株
トーエル	1,300	719.00	934,700	貸付有価証券 100株
オンリー	500	608.00	304,000	
セブン&アイ・ホールディングス	100,000	3,693.00	369,300,000	貸付有価証券 66,000株
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	13,700	827.00	11,329,900	貸付有価証券 9,300株
ツルハホールディングス	5,600	16,130.00	90,328,000	
サンマルクホールディングス	2,000	1,843.00	3,686,000	
フェリシモ	600	1,042.00	625,200	
トリドールホールディングス	6,300	1,211.00	7,629,300	
T O K Y O B A S E	2,200	352.00	774,400	
ウイルプラスホールディングス	500	710.00	355,000	
J Mホールディングス	1,900	2,710.00	5,149,000	
サツドラホールディングス	400	2,036.00	814,400	貸付有価証券 200株

アレンザホールディングス	1,300	853.00	1,108,900	貸付有価証券 100株
串カツ田中ホールディングス	500	1,738.00	869,000	貸付有価証券 300株
バロックジャパンリミテッド	1,800	646.00	1,162,800	貸付有価証券 1,200株
クスリのアオキホールディングス	2,300	8,970.00	20,631,000	
力の源ホールディングス	1,200	797.00	956,400	貸付有価証券 700株
スシログローバルホールディングス	14,000	2,378.00	33,292,000	
LIXILビバ	2,500	2,515.00	6,287,500	
メディカルシステムネットワーク	2,400	472.00	1,132,800	
はるやまホールディングス	1,300	740.00	962,000	
ノジマ	4,600	2,430.00	11,178,000	
カップ・クリエイト	3,600	1,515.00	5,454,000	貸付有価証券 500株
ライトオン	2,000	542.00	1,084,000	貸付有価証券 1,300株
ジーンズメイト	800	240.00	192,000	貸付有価証券 500株
良品計画	33,900	1,629.00	55,223,100	貸付有価証券 22,900株
三城ホールディングス	2,700	276.00	745,200	
アドヴァン	3,900	1,235.00	4,816,500	貸付有価証券 300株
アルビス	1,000	2,112.00	2,112,000	
コナカ	3,000	327.00	981,000	貸付有価証券 100株
ハウス オブ ローゼ	300	1,610.00	483,000	
G - 7ホールディングス	1,600	2,414.00	3,862,400	
イオン北海道	3,400	778.00	2,645,200	
コジマ	4,400	501.00	2,204,400	
ヒマラヤ	900	820.00	738,000	
コーナン商事	3,600	3,130.00	11,268,000	
エコス	900	1,949.00	1,754,100	
ワタミ	3,100	1,047.00	3,245,700	貸付有価証券 2,100株
マルシェ	700	630.00	441,000	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	56,200	2,168.00	121,841,600	

西松屋チェーン	5,600	938.00	5,252,800	貸付有価証券 1,900株
ゼンショーホールディングス	12,300	2,286.00	28,117,800	貸付有価証券 300株
幸楽苑ホールディングス	1,600	1,747.00	2,795,200	貸付有価証券 1,100株
ハークスレイ	600	1,009.00	605,400	
サイゼリヤ	3,800	2,274.00	8,641,200	貸付有価証券 100株
V Tホールディングス	10,900	352.00	3,836,800	
魚力	700	1,585.00	1,109,500	
ポブラ	800	448.00	358,400	
フジ・コーポレーション	700	1,979.00	1,385,300	貸付有価証券 300株
ユナイテッドアローズ	2,700	1,856.00	5,011,200	
ハイデイ日高	3,700	1,909.00	7,063,300	貸付有価証券 2,500株
京都きもの友禅	1,600	233.00	372,800	
コロワイド	8,500	1,614.00	13,719,000	貸付有価証券 5,800株
ピーシーデポコーポレーション	3,400	620.00	2,108,000	貸付有価証券 100株
壱番屋	1,800	5,450.00	9,810,000	貸付有価証券 900株
P L A N T	700	602.00	421,400	
スギホールディングス	5,100	7,010.00	35,751,000	貸付有価証券 300株
薬王堂ホールディングス	1,100	2,720.00	2,992,000	
ヴィア・ホールディングス	3,100	502.00	1,556,200	貸付有価証券 300株
スクロール	3,900	367.00	1,431,300	
ヨンドシーホールディングス	2,600	1,960.00	5,096,000	
ファミリーマート	20,400	1,979.00	40,371,600	貸付有価証券 13,700株
木曽路	3,300	2,506.00	8,269,800	貸付有価証券 2,200株
S R Sホールディングス	3,000	914.00	2,742,000	
千趣会	4,900	406.00	1,989,400	貸付有価証券 3,200株
タカキュー	2,200	141.00	310,200	

リテールパートナーズ	3,400	1,719.00	5,844,600	
ケーヨー	5,100	620.00	3,162,000	貸付有価証券 200株
上新電機	3,000	2,218.00	6,654,000	
日本瓦斯	4,000	4,395.00	17,580,000	貸付有価証券 100株
ロイヤルホールディングス	4,500	1,930.00	8,685,000	貸付有価証券 3,000株
東天紅	200	995.00	199,000	
いなげや	3,100	1,683.00	5,217,300	貸付有価証券 300株
島忠	4,800	2,861.00	13,732,800	
チヨダ	2,700	1,063.00	2,870,100	貸付有価証券 100株
ライフコーポレーション	1,900	3,335.00	6,336,500	
リンガーハット	3,100	2,435.00	7,548,500	貸付有価証券 1,000株
MrMaxHD	3,500	444.00	1,554,000	貸付有価証券 100株
テンアライド	2,400	392.00	940,800	貸付有価証券 1,600株
AOKIホールディングス	5,300	675.00	3,577,500	貸付有価証券 300株
オークワ	4,000	1,521.00	6,084,000	貸付有価証券 200株
コメリ	3,900	2,603.00	10,151,700	貸付有価証券 200株
青山商事	5,300	863.00	4,573,900	
しまむら	3,000	7,470.00	22,410,000	
はせがわ	1,400	342.00	478,800	
高島屋	18,600	1,049.00	19,511,400	貸付有価証券 2,600株
松屋	5,500	677.00	3,723,500	
エイチ・ツー・オー リテイリング	12,100	845.00	10,224,500	貸付有価証券 200株
近鉄百貨店	1,000	3,235.00	3,235,000	
丸井グループ	23,400	1,920.00	44,928,000	
アクシアル リテイリング	2,100	4,130.00	8,673,000	
井筒屋	1,600	195.00	312,000	

イオン	98,300	2,377.00	233,659,100	貸付有価証券 15,100株
イズミ	5,200	3,330.00	17,316,000	
平和堂	5,200	1,925.00	10,010,000	貸付有価証券 400株
フジ	3,100	1,898.00	5,883,800	貸付有価証券 100株
ヤオコー	2,900	7,140.00	20,706,000	
ゼビオホールディングス	3,100	919.00	2,848,900	
ケーズホールディングス	24,700	1,360.00	33,592,000	
Olympicグループ	1,400	687.00	961,800	
日産東京販売ホールディングス	3,800	232.00	881,600	貸付有価証券 300株
シルバーライフ	300	2,340.00	702,000	貸付有価証券 200株
一家ダイニングプロジェクト	300	656.00	196,800	
Genky DrugStores	1,100	3,065.00	3,371,500	貸付有価証券 800株
ナルミヤ・インターナショナル	600	776.00	465,600	
ブックオフグループホールディングス	1,500	859.00	1,288,500	貸付有価証券 1,000株
アインホールディングス	3,100	6,930.00	21,483,000	
元気寿司	600	2,434.00	1,460,400	貸付有価証券 400株
ヤマダ電機	77,900	517.00	40,274,300	貸付有価証券 2,600株
アークランドサカモト	4,000	1,204.00	4,816,000	貸付有価証券 100株
ニトリホールディングス	11,100	19,905.00	220,945,500	
グルメ杵屋	1,800	1,013.00	1,823,400	貸付有価証券 500株
愛眼	2,200	215.00	473,000	貸付有価証券 100株
ケーユーホールディングス	1,300	828.00	1,076,400	
吉野家ホールディングス	8,400	2,457.00	20,638,800	貸付有価証券 3,800株
松屋フーズホールディングス	1,200	3,930.00	4,716,000	貸付有価証券 100株
サガミホールディングス	3,400	1,284.00	4,365,600	貸付有価証券 2,300株

関西スーパーマーケット	2,100	1,092.00	2,293,200	
王将フードサービス	1,900	6,220.00	11,818,000	
プレナス	2,800	1,854.00	5,191,200	
ミニストップ	1,900	1,530.00	2,907,000	
アークス	5,200	2,158.00	11,221,600	貸付有価証券 100株
バローホールディングス	5,700	2,073.00	11,816,100	貸付有価証券 100株
藤久	300	929.00	278,700	
ベルク	1,300	6,790.00	8,827,000	
大庄	1,400	1,402.00	1,962,800	
ファーストリテイリング	3,400	61,880.00	210,392,000	貸付有価証券 1,000株
サンドラッグ	9,600	3,620.00	34,752,000	
サックスパー ホールディングス	2,200	541.00	1,190,200	
ヤマザワ	600	1,725.00	1,035,000	
やまや	500	2,263.00	1,131,500	
ペルーナ	5,500	562.00	3,091,000	貸付有価証券 300株
島根銀行	700	518.00	362,600	
じもとホールディングス	17,400	96.00	1,670,400	貸付有価証券 700株
めぶきフィナンシャルグループ	133,000	244.00	32,452,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,500	1,057.00	3,699,500	
九州フィナンシャルグループ	56,000	449.00	25,144,000	貸付有価証券 2,200株
ゆうちょ銀行	72,400	882.00	63,856,800	貸付有価証券 11,700株
富山第一銀行	6,100	261.00	1,592,100	貸付有価証券 100株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	146,200	353.00	51,608,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	17,000	729.00	12,393,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	15,000	382.00	5,730,000	
三十三フィナンシャルグループ	2,500	1,490.00	3,725,000	
第四北越フィナンシャルグループ	4,400	2,245.00	9,878,000	貸付有価証券 300株
新生銀行	18,800	1,375.00	25,850,000	
あおぞら銀行	15,200	1,976.00	30,035,200	貸付有価証券 200株

三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,750,900	437.00	765,143,300	代用有価証券 184,400株 貸付有価証券 131,900株
りそなホールディングス	280,900	380.10	106,770,090	
三井住友トラスト・ホールディングス	48,400	3,107.00	150,378,800	
三井住友フィナンシャルグループ	177,000	3,091.00	547,107,000	代用有価証券 4,400株 貸付有価証券 95,300株
千葉銀行	85,400	503.00	42,956,200	
群馬銀行	49,100	328.00	16,104,800	貸付有価証券 2,000株
武蔵野銀行	3,800	1,491.00	5,665,800	貸付有価証券 100株
千葉興業銀行	7,100	250.00	1,775,000	貸付有価証券 100株
筑波銀行	10,700	187.00	2,000,900	貸付有価証券 700株
七十七銀行	8,600	1,501.00	12,908,600	
青森銀行	2,000	2,122.00	4,244,000	貸付有価証券 100株
秋田銀行	1,700	1,500.00	2,550,000	
山形銀行	2,900	1,333.00	3,865,700	貸付有価証券 100株
岩手銀行	1,700	2,487.00	4,227,900	貸付有価証券 200株
東邦銀行	22,800	230.00	5,244,000	
東北銀行	1,200	943.00	1,131,600	
みちのく銀行	1,700	1,175.00	1,997,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	21,600	1,763.00	38,080,800	
静岡銀行	63,400	692.00	43,872,800	
十六銀行	3,200	2,051.00	6,563,200	貸付有価証券 100株
スルガ銀行	26,200	392.00	10,270,400	
八十二銀行	61,800	395.00	24,411,000	
山梨中央銀行	3,000	905.00	2,715,000	貸付有価証券 100株
大垣共立銀行	5,100	2,226.00	11,352,600	貸付有価証券 200株
福井銀行	2,300	1,651.00	3,797,300	

北國銀行	2,500	2,830.00	7,075,000	
清水銀行	1,100	1,856.00	2,041,600	
富山銀行	500	2,186.00	1,093,000	
滋賀銀行	5,100	2,465.00	12,571,500	
南都銀行	4,300	2,207.00	9,490,100	貸付有価証券 100株
百五銀行	23,100	312.00	7,207,200	貸付有価証券 900株
京都銀行	9,200	3,845.00	35,374,000	貸付有価証券 300株
紀陽銀行	9,100	1,667.00	15,169,700	貸付有価証券 200株
ほくほくフィナンシャルグループ	17,000	892.00	15,164,000	
広島銀行	37,700	493.00	18,586,100	貸付有価証券 700株
山陰合同銀行	15,100	526.00	7,942,600	貸付有価証券 1,800株
中国銀行	22,000	953.00	20,966,000	貸付有価証券 700株
鳥取銀行	900	1,298.00	1,168,200	
伊予銀行	36,500	601.00	21,936,500	貸付有価証券 1,300株
百十四銀行	2,700	1,950.00	5,265,000	
四国銀行	4,200	818.00	3,435,600	貸付有価証券 400株
阿波銀行	4,200	2,482.00	10,424,400	貸付有価証券 400株
大分銀行	1,500	2,418.00	3,627,000	
宮崎銀行	1,700	2,406.00	4,090,200	
佐賀銀行	1,600	1,092.00	1,747,200	
沖縄銀行	2,300	3,220.00	7,406,000	貸付有価証券 300株
琉球銀行	5,900	941.00	5,551,900	貸付有価証券 200株
セブン銀行	85,600	311.00	26,621,600	
みずほフィナンシャルグループ	3,479,900	132.90	462,478,710	代用有価証券 91,000株 貸付有価証券 50,800株
高知銀行	1,000	712.00	712,000	

山口フィナンシャルグループ	31,900	639.00	20,384,100	
長野銀行	800	1,136.00	908,800	
名古屋銀行	1,900	2,330.00	4,427,000	
北洋銀行	38,500	204.00	7,854,000	貸付有価証券 1,500株
愛知銀行	900	3,005.00	2,704,500	
中京銀行	1,000	2,128.00	2,128,000	
大光銀行	900	1,548.00	1,393,200	
愛媛銀行	3,500	1,143.00	4,000,500	
トマト銀行	1,000	1,038.00	1,038,000	
京葉銀行	10,800	507.00	5,475,600	貸付有価証券 400株
栃木銀行	12,400	165.00	2,046,000	貸付有価証券 600株
北日本銀行	800	2,033.00	1,626,400	
東和銀行	4,500	699.00	3,145,500	
福島銀行	2,500	180.00	450,000	
大東銀行	1,400	615.00	861,000	
トモニホールディングス	19,800	346.00	6,850,800	
フィデアホールディングス	24,900	105.00	2,614,500	貸付有価証券 700株
池田泉州ホールディングス	29,500	167.00	4,926,500	貸付有価証券 5,600株
F P G	7,900	641.00	5,063,900	貸付有価証券 5,300株
マーキュリアインベストメント	1,300	562.00	730,600	
S B Iホールディングス	28,600	2,335.00	66,781,000	
ジャフコ	3,900	3,610.00	14,079,000	貸付有価証券 700株
大和証券グループ本社	205,400	451.20	92,676,480	
野村ホールディングス	450,300	475.20	213,982,560	
岡三証券グループ	21,800	347.00	7,564,600	
丸三証券	7,800	454.00	3,541,200	貸付有価証券 600株
東洋証券	8,800	137.00	1,205,600	貸付有価証券 100株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	29,300	248.00	7,266,400	貸付有価証券 1,000株
光世証券	900	529.00	476,100	

水戸証券	7,400	211.00	1,561,400	
いちよし証券	4,800	464.00	2,227,200	貸付有価証券 100株
松井証券	14,600	844.00	12,322,400	貸付有価証券 2,400株
だいこう証券ビジネス	1,500	919.00	1,378,500	
マネックスグループ	18,800	236.00	4,436,800	貸付有価証券 12,800株
極東証券	3,400	519.00	1,764,600	貸付有価証券 300株
岩井コスモホールディングス	2,400	990.00	2,376,000	
藍澤証券	4,700	713.00	3,351,100	貸付有価証券 200株
マネーパートナーズグループ	3,300	200.00	660,000	
スパークス・グループ	11,800	219.00	2,584,200	
小林洋行	1,100	248.00	272,800	
かんぽ生命保険	9,100	1,383.00	12,585,300	貸付有価証券 500株
S O M P Oホールディングス	48,100	3,790.00	182,299,000	
アニコム ホールディングス	2,100	5,140.00	10,794,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	66,900	3,140.00	210,066,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	21,000	2,596.00	54,516,000	貸付有価証券 3,600株
第一生命ホールディングス	144,900	1,371.00	198,657,900	
東京海上ホールディングス	90,500	4,612.00	417,386,000	
T & Dホールディングス	76,500	956.00	73,134,000	
アドバンスクリエイト	600	2,279.00	1,367,400	
全国保証	7,200	4,170.00	30,024,000	貸付有価証券 200株
ジェイリース	700	407.00	284,900	貸付有価証券 400株
イントラスト	900	766.00	689,400	
日本モーゲージサービス	500	2,048.00	1,024,000	貸付有価証券 300株
C a s a	900	1,241.00	1,116,900	
アルヒ	4,100	1,463.00	5,998,300	貸付有価証券 800株
プレミアグループ	1,400	1,945.00	2,723,000	
クレディセゾン	17,900	1,271.00	22,750,900	

芙蓉総合リース	2,700	6,130.00	16,551,000	
みずほリース	3,900	2,339.00	9,122,100	
東京センチュリー	5,200	4,600.00	23,920,000	貸付有価証券 100株
日本証券金融	11,200	497.00	5,566,400	
アイフル	39,000	267.00	10,413,000	
リコーリース	2,000	3,115.00	6,230,000	
イオンフィナンシャルサービス	15,600	1,193.00	18,610,800	
アコム	51,400	435.00	22,359,000	
ジャックス	2,800	1,875.00	5,250,000	
オリエントコーポレーション	69,100	124.00	8,568,400	
日立キャピタル	6,000	2,234.00	13,404,000	貸付有価証券 100株
アプラスフィナンシャル	12,400	69.00	855,600	
オリックス	160,100	1,430.00	228,943,000	
三菱UFJリース	65,100	521.00	33,917,100	
九州リースサービス	1,300	487.00	633,100	
日本取引所グループ	73,500	2,372.00	174,342,000	
イー・ギャランティ	2,700	2,197.00	5,931,900	貸付有価証券 400株
アサックス	1,300	640.00	832,000	貸付有価証券 800株
NECキャピタルソリューション	1,000	2,011.00	2,011,000	
いちご	32,600	304.00	9,910,400	貸付有価証券 100株
日本駐車場開発	24,800	142.00	3,521,600	
スター・マイカ・ホールディングス	1,300	1,459.00	1,896,700	
ADワークスグループ	4,600	183.00	841,800	貸付有価証券 1,500株
ヒューリック	54,700	1,092.00	59,732,400	
三栄建築設計	1,100	1,220.00	1,342,000	
野村不動産ホールディングス	15,500	2,038.00	31,589,000	
三重交通グループホールディングス	5,200	487.00	2,532,400	貸付有価証券 100株
サムティ	3,600	1,461.00	5,259,600	貸付有価証券 1,300株
ディア・ライフ	3,700	476.00	1,761,200	貸付有価証券 100株

コーセーアールイー	800	584.00	467,200	貸付有価証券 300株
日本商業開発	1,600	1,535.00	2,456,000	
プレサンスコーポレーション	4,200	1,294.00	5,434,800	
ユニゾホールディングス	800	5,980.00	4,784,000	
THEグローバル社	1,400	197.00	275,800	貸付有価証券 900株
ハウスコム	400	1,370.00	548,000	
日本管理センター	1,700	1,191.00	2,024,700	
サンセイランディック	800	855.00	684,000	
エストラスト	400	629.00	251,600	貸付有価証券 200株
フージャースホールディングス	5,000	612.00	3,060,000	貸付有価証券 300株
オープンハウス	7,400	3,030.00	22,422,000	貸付有価証券 300株
東急不動産ホールディングス	69,500	549.00	38,155,500	貸付有価証券 700株
飯田グループホールディングス	21,400	1,648.00	35,267,200	
イーランド	500	669.00	334,500	
ムゲンエステート	1,700	528.00	897,600	貸付有価証券 200株
ビーロッド	1,200	672.00	806,400	
ファーストブラザーズ	600	748.00	448,800	
ハウズドゥ	1,200	1,045.00	1,254,000	貸付有価証券 800株
シーアールイー	700	1,199.00	839,300	
プロパティエージェント	500	997.00	498,500	
ケイアイスター不動産	800	1,438.00	1,150,400	
アグレ都市デザイン	500	480.00	240,000	貸付有価証券 300株
グッドコムアセット	600	1,660.00	996,000	貸付有価証券 300株
ジェイ・エス・ビー	600	2,370.00	1,422,000	
テンポイノベーション	700	714.00	499,800	貸付有価証券 400株
グローバル・リンク・マネジメント	500	587.00	293,500	貸付有価証券 300株
パーク24	13,700	2,142.00	29,345,400	貸付有価証券 1,700株

パラカ	600	1,793.00	1,075,800	
三井不動産	126,200	2,087.50	263,442,500	
三菱地所	179,300	1,732.00	310,547,600	
平和不動産	4,700	2,956.00	13,893,200	貸付有価証券 200株
東京建物	26,900	1,388.00	37,337,200	貸付有価証券 300株
ダイビル	6,600	1,048.00	6,916,800	貸付有価証券 100株
京阪神ビルディング	4,100	1,463.00	5,998,300	貸付有価証券 200株
住友不動産	57,600	3,014.00	173,606,400	
テーオーシー	5,300	691.00	3,662,300	貸付有価証券 300株
東京楽天地	400	4,555.00	1,822,000	
レオパレス21	33,500	274.00	9,179,000	貸付有価証券 200株
スターツコーポレーション	3,500	2,181.00	7,633,500	貸付有価証券 100株
フジ住宅	3,000	515.00	1,545,000	
空港施設	2,500	432.00	1,080,000	
明和地所	1,500	426.00	639,000	
ゴールドクレスト	2,100	1,577.00	3,311,700	貸付有価証券 1,400株
エスリード	1,000	1,487.00	1,487,000	
日神グループホールディングス	3,800	403.00	1,531,400	
日本エスコン	4,800	809.00	3,883,200	
タカラレーベン	11,700	370.00	4,329,000	貸付有価証券 100株
A V A N T I A	1,400	789.00	1,104,600	
イオンモール	12,800	1,543.00	19,750,400	貸付有価証券 400株
毎日コムネット	600	819.00	491,400	
ファースト住建	1,100	912.00	1,003,200	
カチタス	6,300	2,541.00	16,008,300	貸付有価証券 4,300株
トーセイ	3,700	1,070.00	3,959,000	貸付有価証券 600株
穴吹興産	600	1,768.00	1,060,800	貸付有価証券 400株

サンフロンティア不動産	3,500	938.00	3,283,000	
エフ・ジェー・ネクスト	2,200	876.00	1,927,200	貸付有価証券 1,500株
インテリックス	800	520.00	416,000	
ランドビジネス	1,000	360.00	360,000	
日本社宅サービス	800	1,130.00	904,000	
グランディハウス	2,000	393.00	786,000	
日本空港ビルデング	8,200	4,700.00	38,540,000	貸付有価証券 4,700株
日本工営	1,700	3,230.00	5,491,000	
L I F U L L	8,600	420.00	3,612,000	貸付有価証券 700株
ジェイエイシーリクルートメント	1,700	1,362.00	2,315,400	
日本M&Aセンター	18,700	4,470.00	83,589,000	
メンバーズ	700	1,859.00	1,301,300	
中広	300	536.00	160,800	
U T グループ	3,900	2,175.00	8,482,500	貸付有価証券 2,700株
アイティメディア	1,000	1,151.00	1,151,000	貸付有価証券 400株
タケエイ	2,400	986.00	2,366,400	
E・Jホールディングス	300	1,542.00	462,600	
ビーネックスグループ	3,100	820.00	2,542,000	
コシダカホールディングス	6,000	537.00	3,222,000	
アルトナー	600	780.00	468,000	
パソナグループ	2,700	1,271.00	3,431,700	貸付有価証券 500株
C D S	600	1,313.00	787,800	
リンクアンドモチベーション	5,500	447.00	2,458,500	
G C A	3,000	658.00	1,974,000	貸付有価証券 100株
エス・エム・エス	7,700	2,759.00	21,244,300	
サニーサイドアップグループ	800	830.00	664,000	貸付有価証券 400株
パーソルホールディングス	24,800	1,423.00	35,290,400	
リニカル	1,200	931.00	1,117,200	
クックパッド	8,700	305.00	2,653,500	
エスクリ	800	441.00	352,800	

アイ・ケイ・ケイ	1,200	605.00	726,000	貸付有価証券 700株
学情	900	1,341.00	1,206,900	
スタジオアリス	1,300	1,640.00	2,132,000	
シミックホールディングス	1,200	1,577.00	1,892,400	
エプロ	500	1,128.00	564,000	
N J S	600	1,790.00	1,074,000	
総合警備保障	9,900	5,270.00	52,173,000	
カカクコム	18,300	2,707.00	49,538,100	
アイロムグループ	900	2,788.00	2,509,200	貸付有価証券 600株
セントケア・ホールディング	1,600	428.00	684,800	
サイネックス	400	656.00	262,400	
ルネサンス	1,400	1,170.00	1,638,000	
ディップ	3,500	2,647.00	9,264,500	
オプトホールディング	1,400	1,524.00	2,133,600	
新日本科学	2,700	659.00	1,779,300	貸付有価証券 1,800株
ツクイ	5,800	511.00	2,963,800	
キャリアデザインセンター	600	994.00	596,400	貸付有価証券 200株
ベネフィット・ワン	9,000	2,412.00	21,708,000	貸付有価証券 1,700株
エムスリー	54,700	4,340.00	237,398,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,600	371.00	593,600	
プラス	300	542.00	162,600	
アウトソーシング	14,200	645.00	9,159,000	
ウェルネット	2,500	735.00	1,837,500	
ワールドホールディングス	800	1,832.00	1,465,600	
ディー・エヌ・エー	12,100	1,504.00	18,198,400	貸付有価証券 100株
博報堂D Yホールディングス	34,500	1,312.00	45,264,000	
ぐるなび	4,300	688.00	2,958,400	貸付有価証券 200株
タカミヤ	2,700	496.00	1,339,200	
ジャパンベストレスキューシステム	2,100	883.00	1,854,300	貸付有価証券 1,400株
ファンコミュニケーションズ	6,900	457.00	3,153,300	貸付有価証券 300株

ライク	800	1,575.00	1,260,000	貸付有価証券 500株
ビジネス・ブレイクスルー	1,100	398.00	437,800	
エスプール	6,400	787.00	5,036,800	
WDBホールディングス	1,100	2,640.00	2,904,000	
手間いらず	200	5,180.00	1,036,000	
ティア	1,400	526.00	736,400	
C D G	300	1,543.00	462,900	
バリューコマース	1,400	2,714.00	3,799,600	
インフォマート	27,200	915.00	24,888,000	
J Pホールディングス	7,700	283.00	2,179,100	
エコナックホールディングス	4,300	101.00	434,300	貸付有価証券 200株
E P Sホールディングス	3,300	1,119.00	3,692,700	貸付有価証券 700株
レッグス	600	1,050.00	630,000	貸付有価証券 400株
プレステージ・インターナショナル	9,300	935.00	8,695,500	貸付有価証券 100株
アミューズ	1,400	2,457.00	3,439,800	貸付有価証券 500株
ドリームインキュベータ	700	1,494.00	1,045,800	
クイック	1,500	1,273.00	1,909,500	
T A C	1,600	189.00	302,400	
ケネディクス	23,100	581.00	13,421,100	
電通グループ	25,500	2,918.00	74,409,000	貸付有価証券 300株
テイクアンドギヴ・ニーズ	900	704.00	633,600	
ぴあ	700	3,670.00	2,569,000	貸付有価証券 400株
イオンファンタジー	1,000	1,851.00	1,851,000	貸付有価証券 600株
シーティーエス	2,800	720.00	2,016,000	貸付有価証券 100株
ネクシィーズグループ	800	1,137.00	909,600	
みらかホールディングス	6,900	2,533.00	17,477,700	
アルプス技研	2,200	1,935.00	4,257,000	貸付有価証券 100株

サニックス	4,300	328.00	1,410,400	貸付有価証券 3,000株
ダイオーズ	500	1,132.00	566,000	
日本空調サービス	2,600	725.00	1,885,000	
オリエンタルランド	26,400	15,530.00	409,992,000	
ダスキン	6,200	2,899.00	17,973,800	貸付有価証券 300株
明光ネットワークジャパン	3,100	855.00	2,650,500	貸付有価証券 400株
ファルコホールディングス	1,400	1,629.00	2,280,600	
秀英予備校	600	422.00	253,200	
田谷	500	533.00	266,500	貸付有価証券 300株
ラウンドワン	6,900	907.00	6,258,300	貸付有価証券 4,700株
リゾートトラスト	11,400	1,330.00	15,162,000	貸付有価証券 500株
ビー・エム・エル	3,200	3,025.00	9,680,000	
ワタベウェディング	400	417.00	166,800	
りらいあコミュニケーションズ	4,500	1,192.00	5,364,000	貸付有価証券 300株
リソー教育	11,700	309.00	3,615,300	
早稲田アカデミー	1,100	958.00	1,053,800	貸付有価証券 100株
ユー・エス・エス	27,800	1,873.00	52,069,400	
東京個別指導学院	900	607.00	546,300	貸付有価証券 500株
サイバーエージェント	15,300	5,430.00	83,079,000	貸付有価証券 9,400株
楽天	115,600	995.00	115,022,000	貸付有価証券 300株
クリーク・アンド・リバー社	1,200	1,079.00	1,294,800	
テー・オー・ダブリュー	3,900	359.00	1,400,100	
山田コンサルティンググループ	1,600	1,304.00	2,086,400	
セントラルスポーツ	900	2,607.00	2,346,300	
フルキャストホールディングス	2,500	1,592.00	3,980,000	
エン・ジャパン	4,400	2,980.00	13,112,000	
リソルホールディングス	300	3,545.00	1,063,500	貸付有価証券 100株

テクノプロ・ホールディングス	5,000	6,500.00	32,500,000	
アトラ	600	269.00	161,400	
インターワークス	500	392.00	196,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,000	10,050.00	10,050,000	貸付有価証券 400株
K e e P e r 技研	900	1,573.00	1,415,700	
ファーストロジック	600	609.00	365,400	
三機サービス	500	1,068.00	534,000	
G u n o s y	1,500	950.00	1,425,000	貸付有価証券 1,100株
デザインワン・ジャパン	700	267.00	186,900	
イー・ガーディアン	1,100	2,584.00	2,842,400	貸付有価証券 800株
リブセンス	1,600	280.00	448,000	貸付有価証券 900株
ジャパンマテリアル	7,600	1,766.00	13,421,600	貸付有価証券 200株
ベクトル	3,100	862.00	2,672,200	貸付有価証券 2,100株
ウチヤマホールディングス	1,200	368.00	441,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	2,100	876.00	1,839,600	貸付有価証券 600株
ライクキッズ	600	733.00	439,800	
キャリアリンク	900	567.00	510,300	貸付有価証券 500株
I B J	1,700	866.00	1,472,200	貸付有価証券 1,100株
アサンテ	1,000	1,548.00	1,548,000	
N・フィールド	1,700	522.00	887,400	
バリューHR	1,000	1,579.00	1,579,000	
M & A キャピタルパートナーズ	2,000	4,065.00	8,130,000	貸付有価証券 100株
ライドオンエクスプレスホールディングス	900	1,814.00	1,632,600	貸付有価証券 600株
E R I ホールディングス	700	673.00	471,100	
アピスト	400	2,488.00	995,200	
シグマクシス	1,700	1,933.00	3,286,100	
ウィルグループ	1,700	717.00	1,218,900	

エスクロー・エージェント・ジャパン	3,400	209.00	710,600	貸付有価証券 400株
リクルートホールディングス	177,600	3,751.00	666,177,600	貸付有価証券 6,800株
エラン	1,500	1,820.00	2,730,000	
土木管理総合試験所	1,100	382.00	420,200	
ネットマーケティング	900	678.00	610,200	貸付有価証券 500株
日本郵政	203,300	777.00	157,964,100	
ベルシステム24ホールディングス	4,200	1,360.00	5,712,000	貸付有価証券 1,000株
鎌倉新書	1,900	1,212.00	2,302,800	貸付有価証券 1,000株
S MN	500	943.00	471,500	
一蔵	200	411.00	82,200	
L I T A L I C O	800	2,801.00	2,240,800	
グローバルキッズCOMPANY	400	614.00	245,600	
エアトリ	1,300	1,328.00	1,726,400	貸付有価証券 800株
アトラエ	800	3,360.00	2,688,000	貸付有価証券 500株
ストライク	900	5,050.00	4,545,000	貸付有価証券 200株
ソラスト	6,800	1,257.00	8,547,600	貸付有価証券 100株
セラク	800	1,035.00	828,000	
インソース	1,000	2,917.00	2,917,000	貸付有価証券 700株
ペイカレント・コンサルティング	1,500	7,760.00	11,640,000	
Orchestra Holdings	500	1,364.00	682,000	
アイモバイル	900	745.00	670,500	貸付有価証券 600株
キャリアインデックス	1,100	332.00	365,200	貸付有価証券 700株
MS - J a p a n	800	936.00	748,800	貸付有価証券 200株
船場	400	980.00	392,000	
グレイステクノロジー	1,100	4,645.00	5,109,500	貸付有価証券 400株

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	2,600	3,300.00	8,580,000	
フルテック	400	1,292.00	516,800	
グリーンズ	900	532.00	478,800	
ツナググループ・ホールディングス	400	488.00	195,200	貸付有価証券 200株
GameWith	700	680.00	476,000	貸付有価証券 400株
ソウルドアウト	500	2,263.00	1,131,500	貸付有価証券 300株
MS&Consulting	500	627.00	313,500	
ミダック	300	1,659.00	497,700	
日総工産	1,600	710.00	1,136,000	
キュービーネットホールディングス	1,000	2,209.00	2,209,000	
RPAホールディングス	1,900	913.00	1,734,700	貸付有価証券 1,300株
スプリックス	800	886.00	708,800	貸付有価証券 500株
マネジメントソリューションズ	1,100	1,179.00	1,296,900	貸付有価証券 600株
プロレド・パートナーズ	300	5,310.00	1,593,000	
and factory	200	1,256.00	251,200	貸付有価証券 100株
ギークス	300	1,414.00	424,200	
カーブスホールディングス	6,800	672.00	4,569,600	貸付有価証券 1,200株
フォーラムエンジニアリング	1,300	943.00	1,225,900	貸付有価証券 100株
アドバンテッジリスクマネジメント	1,200	900.00	1,080,000	
リログループ	13,600	2,355.00	32,028,000	貸付有価証券 100株
東祥	1,500	1,393.00	2,089,500	
エイチ・アイ・エス	3,900	2,017.00	7,866,300	貸付有価証券 2,600株
ラックランド	500	2,127.00	1,063,500	
共立メンテナンス	4,100	3,430.00	14,063,000	貸付有価証券 200株
イチネンホールディングス	2,900	1,245.00	3,610,500	
建設技術研究所	1,700	1,781.00	3,027,700	貸付有価証券 100株

スペース	1,600	999.00	1,598,400	
長大	1,000	1,031.00	1,031,000	
燦ホールディングス	1,100	1,204.00	1,324,400	
スバル興業	100	7,920.00	792,000	
東京テアトル	1,000	1,249.00	1,249,000	
タナベ経営	500	1,280.00	640,000	
ナガワ	800	7,990.00	6,392,000	
よみうりランド	500	3,715.00	1,857,500	
東京都競馬	1,600	3,585.00	5,736,000	貸付有価証券 200株
常磐興産	1,100	1,473.00	1,620,300	
カナモト	4,100	2,334.00	9,569,400	貸付有価証券 100株
東京ドーム	10,000	905.00	9,050,000	貸付有価証券 6,700株
西尾レントオール	2,300	2,389.00	5,494,700	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	16,600	23.00	381,800	貸付有価証券 400株
トランス・コスモス	2,400	2,543.00	6,103,200	
乃村工藝社	10,600	985.00	10,441,000	
藤田観光	1,100	1,879.00	2,066,900	貸付有価証券 700株
KNT-CTホールディングス	1,500	1,185.00	1,777,500	貸付有価証券 1,000株
日本管財	2,700	1,853.00	5,003,100	
トーカイ	2,400	2,636.00	6,326,400	
白洋舎	300	2,888.00	866,400	
セコム	26,300	9,394.00	247,062,200	
セントラル警備保障	1,200	4,530.00	5,436,000	
丹青社	4,900	747.00	3,660,300	貸付有価証券 100株
メイテック	3,000	5,240.00	15,720,000	
応用地質	2,700	1,377.00	3,717,900	
船井総研ホールディングス	5,100	2,593.00	13,224,300	貸付有価証券 500株
進学会ホールディングス	1,000	521.00	521,000	
オオバ	1,700	641.00	1,089,700	貸付有価証券 1,100株
いであ	600	1,777.00	1,066,200	

学究社	800	1,121.00	896,800	
ベネッセホールディングス	8,300	2,891.00	23,995,300	貸付有価証券 300株
イオンディライト	3,100	3,165.00	9,811,500	貸付有価証券 300株
ナック	1,400	906.00	1,268,400	貸付有価証券 300株
ニチイ学館	3,700	1,639.00	6,064,300	
ダイセキ	4,100	2,832.00	11,611,200	貸付有価証券 500株
ステップ	900	1,485.00	1,336,500	
合 計	30,500,340		57,197,888,200	

(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。

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（2020年 6月 2日から2020年12月 1日まで）の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【年金インデックスファンド日本株式(TOPIX連動型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前計算期間末 2020年 6月 1日現在	当中間計算期間末 2020年12月 1日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,400,071,521	1,491,288,444
コール・ローン	876,965,950	1,470,065,508
株式	57,197,888,200	63,937,438,870
派生商品評価勘定	58,385,400	-
未収入金	-	22,818,400
未収配当金	546,748,470	281,776,165
その他未収収益	6,456,736	4,037,095
流動資産合計	63,086,516,277	67,207,424,482
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	282,750	5,224,200
前受金	47,320,000	6,860,000
未払金	13,286,700	13,086,409
未払収益分配金	31,461,996	-
未払解約金	163,145,864	187,727,809
未払受託者報酬	8,402,824	47,179
未払委託者報酬	41,401,811	235,656
未払利息	1,385	776
受入担保金	4,400,071,521	1,491,288,444
その他未払費用	1,228,701	7,842
流動負債合計	4,706,603,552	1,704,478,315
純資産の部		
元本等		
元本	31,461,996,185	31,018,743,543
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	26,917,916,540	34,484,202,624
(分配準備積立金)	7,530,802,756	6,660,938,679
元本等合計	58,379,912,725	65,502,946,167
純資産合計	58,379,912,725	65,502,946,167
負債純資産合計	63,086,516,277	67,207,424,482

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2019年 6月 1日 至 2019年11月30日	当中間計算期間 自 2020年 6月 2日 至 2020年12月 1日
営業収益		
受取配当金	498,729,485	605,244,229
受取利息	622	-
有価証券売買等損益	5,788,879,636	7,361,590,262
派生商品取引等損益	81,326,020	71,278,150
その他収益	12,410,818	17,186,072
営業収益合計	6,381,346,581	8,055,298,713
営業費用		
支払利息	135,337	74,198
受託者報酬	7,848,898	8,133,115
委託者報酬	38,277,552	40,275,279
その他費用	2,459,837	3,941,918
営業費用合計	48,721,624	52,424,510
営業利益又は営業損失（ ）	6,332,624,957	8,002,874,203
経常利益又は経常損失（ ）	6,332,624,957	8,002,874,203
中間純利益又は中間純損失（ ）	6,332,624,957	8,002,874,203
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	243,301,398	300,934,352
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	17,384,692,783	26,917,916,540
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,369,723,515	3,151,119,867
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,369,723,515	3,151,119,867
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,868,402,445	3,286,773,634
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,868,402,445	3,286,773,634
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	29,975,337,412	34,484,202,624

(3) 【中間注記表】

(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中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は中間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>

(中間貸借対照表に関する注記)

		前計算期間末 2020年 6月 1日現在	当中間計算期間末 2020年12月 1日現在
1.	期首元本額	23,253,184,012円	31,461,996,185円
	期中追加設定元本額	14,798,267,469円	3,389,341,479円
	期中一部解約元本額	6,589,455,296円	3,832,594,121円
2.	受益権の総数	31,461,996,185口	31,018,743,543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	695,879,250円	767,672,370円
4.	有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券は次のとおりであります。		
	株式	4,172,009,900円	1,413,833,890円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2019年 6月 1日 至 2019年11月30日	当中間計算期間 自 2020年 6月 2日 至 2020年12月 1日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 2020年 6月 1日現在	当中間計算期間末 2020年12月 1日現在
中間貸借対照表計上額、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。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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）

前計算期間末（2020年 6月 1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	1,153,065,000	-	1,211,210,000	58,145,000
合計		1,153,065,000	-	1,211,210,000	58,145,000

当中間計算期間末（2020年12月 1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	782,460,000	-	777,260,000	5,200,000
	合計	782,460,000	-	777,260,000	5,200,000

(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。

原則として中間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、同中間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。

(1口当たり情報)

前計算期間末 2020年 6月 1日現在		当中間計算期間末 2020年12月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.8556円	1口当たり純資産額	2.1117円
(1万口当たり純資産額)	(18,556円)	(1万口当たり純資産額)	(21,117円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年12月30日現在です。

【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

【純資産額計算書】

資産総額	69,259,513,090円
負債総額	2,038,531,474円
純資産総額（ - ）	67,220,981,616円
発行済口数	31,154,939,736口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1576円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

該当事項はありません。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

（4）受益証券の再発行

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

（5）受益権の再分割

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2020年12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12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12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12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	849	240,912
株式投資信託	790	206,595
単位型	277	11,306
追加型	513	195,289
公社債投資信託	59	34,316
単位型	46	1,842
追加型	13	32,474

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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】

	第60期 (2019年3月31日)		第61期 (2020年3月31日)	
(単位：百万円)				
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	4,289
未払法人税等		2,382		1,439
未払消費税等	4	621	4	746
賞与引当金		2,680		2,718
役員賞与引当金		210		55
その他	3	172		42
流動負債合計		16,431		15,726
固定負債				
退職給付引当金		1,405		1,395
その他		629		695
固定負債合計		2,035		2,091
負債合計		18,466		17,818
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		47,142		55,395
利益剰余金合計		47,142		55,395
自己株式		833		905
株主資本合計		68,891		77,073

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	493	60
繰延ヘッジ損益	185	389
評価・換算差額等合計	679	329
純資産合計	69,571	77,402
負債純資産合計	88,038	95,220

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

	第60期		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	投資有価証券	2,251	-	42
	豪ドル		63	-	0
	シンガポール ドル		975	-	18

	香港ドル		518	-	8
	人民元		2,149	-	58
	ユーロ		81	-	0
合計			6,040	-	127

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第61期(2020年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建 米ドル	1,808	-	15	15
合計		1,808	-	15	15

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		3,427	-	20
	豪ドル		48	-	9
	シンガポールドル		944	-	58
	香港ドル		529	-	2
	人民元		2,017	-	76
	ユーロ		70	-	1
合計			7,038	-	167

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（持分法損益等）

第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,002
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,668	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,485
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,704	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,631

（退職給付関係）

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,313
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	59
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,411</u>

(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
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,405</u>
退職給付引当金	1,405
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,405</u>

(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
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>148</u>

(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す。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載してありません。

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

三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
--------------	------------	---

< 再信託受託会社の概要 >

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円(2020年7月27日現在)

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

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(株式会社日本カストディ銀行)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2020年3月末現在)	事業の内容
株式会社京都銀行	42,103百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社北國銀行	26,673百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社りそな銀行	279,928百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
住友生命保険相互会社	639,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	
ソニ - 生命保険株式会社	70,000百万円	
第一生命保険株式会社	60,000百万円	
富国生命保険相互会社	12,000百万円 (基金の総額)	
信金中央金庫	690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

- (1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。
- (2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。
- 委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
 - ファンドの基本的性格など
 - 委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
 - 委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
 - 目論見書の使用開始日
- (3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
 - 投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
 - 投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
 - 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
 - 「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
 - 請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。
 - 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
 - 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
 - 商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
 - 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
 - 有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
 - 委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
- ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。
 - 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
 - 分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独立監査人の監査報告書

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7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

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」に掲げられている年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2019年6月1日から2020年6月1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、年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2020年6月1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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年1月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2020年6月2日から2020年12月1日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2020年12月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年6月2日から2020年12月1日まで）の損益の状況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、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、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。

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に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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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

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。