

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年4月8日提出
【計算期間】	第15期(自 2020年7月9日至 2021年1月8日)
【ファンド名】	上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financials
【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 佐谷戸 淳一
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部【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

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

※TOPIX Ex-Financialsは、TOPIX(東証株価指数)の算出対象銘柄の中から、「保険業」、「銀行業」、「証券、商品先物取引業」および「その他金融業」の業種に属する銘柄を除いた銘柄を対象に、浮動株調整後の時価総額を指数として算出します。

TOPIX Ex-Financialsは、基準時を平成5年(1993年)7月5日(終値)に置き、その日の時価総額を1,000ポイントとして算出します。

業種の分類には、「証券コード協議会が定める33業種」を用います。

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

「TOPIX Ex-Financials」の著作権などについて

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

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

ETF

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

インデックス型

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

2) 属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

株式 一般

当ファンドは、株式に投資を行いません。「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2回

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

日本

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. **TOPIX Ex-Financials の動きに連動する投資成果をめざします。**
 - ・信託財産の1口あたりの純資産額の変動率を「TOPIX Ex-Financials」の変動率に一致させることをめざして、原則として「TOPIX Ex-Financials」に採用されている株式に投資を行ないます。
 - ※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。
2. **受益権を東京証券取引所に上場しており、取引時間中であればいつでも売買が可能です。**
 - ・売買単位は1口単位です。（有価証券届出書提出日現在）
 - ・売買手数料は、取扱会社が定めるものによります。
 - ・取引方法は原則として株式と同様です。
 - ※詳しくは、取扱会社へお問い合わせください。
3. **現金をもって受益権の購入申込みを行ないます。**
 - ・購入申込受付日の基準価額による購入となります。
4. **解約請求による途中換金をすることができます。**
 - ・換金申込受付日の基準価額による換金となります。
5. **受益権をもって株式と交換することはできません。**

主な投資制限

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

分配方針

- ・信託財産から生ずる配当等収益などから諸経費などを控除後、全額分配することを原則とします。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

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

(2) 【ファンドの沿革】

2013年 9月24日

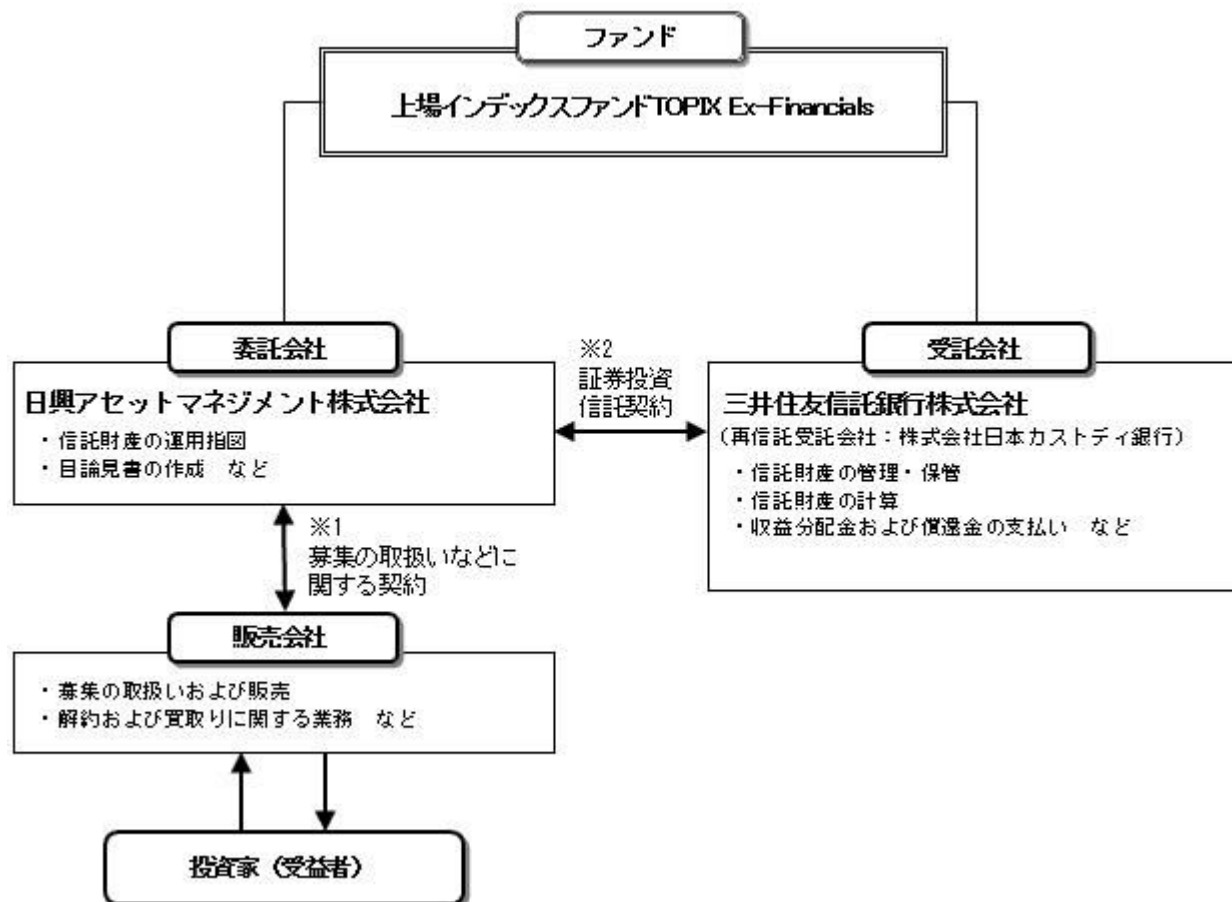
- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

2013年 9月26日

- ・ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。販売会社が行なう募集の取扱い、解約および買取りに関する業務の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2021年1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	194,152,500株	98.54%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・ファンドは、信託財産の1口あたりの純資産額の変動率をTOPIX Ex-Financialsの変動率に一致させることをめざして、TOPIX Ex-Financialsに採用されている株式に投資を行ないます。
- ・次に掲げる場合には、信託財産の構成を調整するための指図を行なうことがあります。
 - TOPIX Ex-Financialsの計算方法が変更された場合
 - TOPIX Ex-Financialsに採用されている銘柄の変更または資本異動などにより、TOPIX Ex-Financialsにおける個別銘柄の時価総額の修正が行なわれた場合
 - 追加信託ならびに一部解約の指図を行なう場合

その他連動性を維持するために委託会社が必要と認めた場合

- ・ TOPIX Ex-Financialsへの連動率を向上させるため、資金動向に応じて約款に定める有価証券指数等先物取引等を行なう場合があります。
- ・ ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

TOPIX Ex-Financialsに採用されている銘柄の株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限り、)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 株券または新株引受権証券
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)~8)の証券または証書の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、)
 - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、)
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- 次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

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

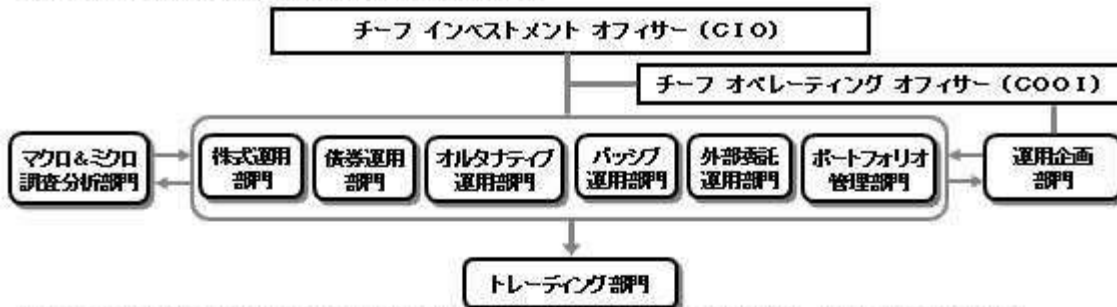
6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

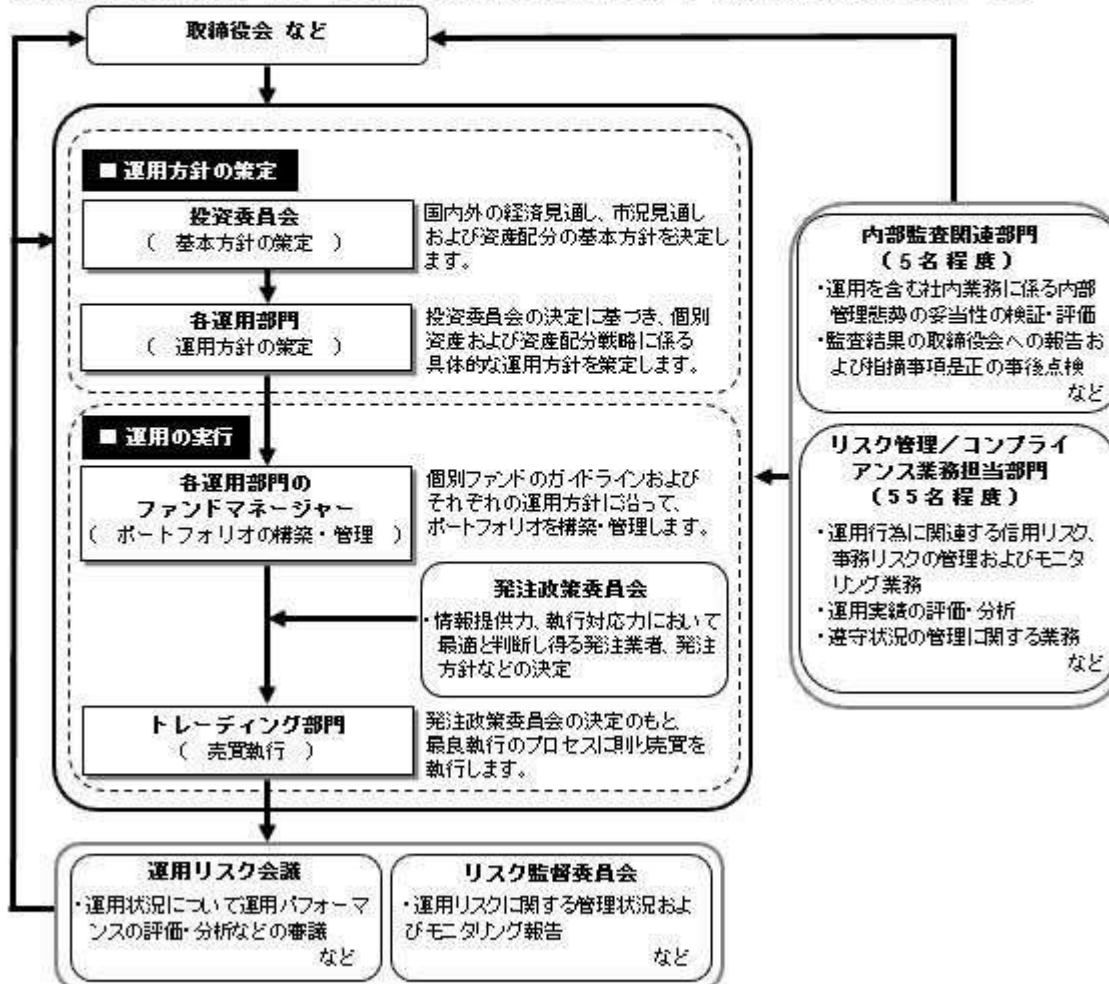
- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 為替先渡取引
- 6) 有価証券の貸付
- 7) 公社債の空売
- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引
- 10) 資金の借入

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆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2021年1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

- 1) 信託財産から生ずる配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。）と前期から繰り越した分配準備積立金は、毎計算期末において諸経費、約款に定める報酬および当該報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、前期から繰り越した負数の分配準備積立金があるときはその全額を補てんした後、その残額を受益者に分配します。ただし、収益分配金額の調整のためその一部または全部を信託財産内に留保したときは分配準備積立金として積み立て、次期以降の分配に充てることができます。なお、諸経費、約款に定める報酬および当該報酬に係る消費税等に相当する金額ならびに負数の分配準備積立金を控除しきれないときは、その差額を負数の分配準備積立金として次期に繰り越します。
- 2) 毎計算期末に信託財産から生じたイ)に掲げる利益の合計額は、ロ)に掲げる損失を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を補てんした後、次期に繰り越します。
 - イ) 有価証券売買益（評価益を含む）、先物取引等取引益（評価益を含む）、追加信託差益金、解約差益金
 - ロ) 有価証券売買損（評価損を含む）、先物取引等取引損（評価損を含む）、追加信託差損金、解約差損金

収益分配金の支払い

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

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みま

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

- 3) 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および上場投資信託証券を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - ハ) 上場投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付上場投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する上場投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴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、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) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内

ハ) 解約に伴なう支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

- 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 17) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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）の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・ 当ファンドは、主に株式を投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

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。

為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

有価証券の貸付などにおけるリスク

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

< TOPIX Ex-Financialsと基準価額の主なカイ離要因 >

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

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

金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額のカイ離

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

< その他の留意事項 >

・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・ 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

・ 運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・ 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



全社的なリスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

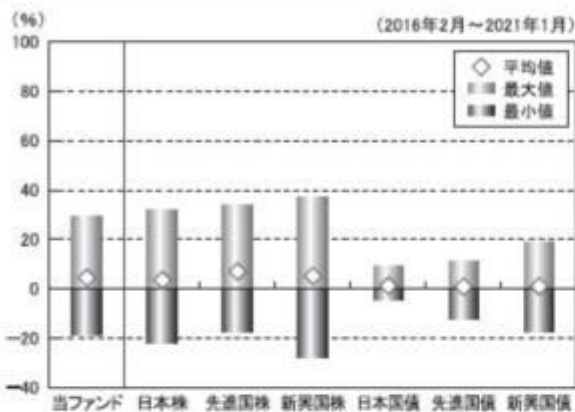
法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2021年1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	4.6%	3.7%	7.1%	5.3%	1.4%	1.0%	1.1%
最大値	29.3%	32.2%	34.1%	37.2%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-18.5%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2016年2月から2021年1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）

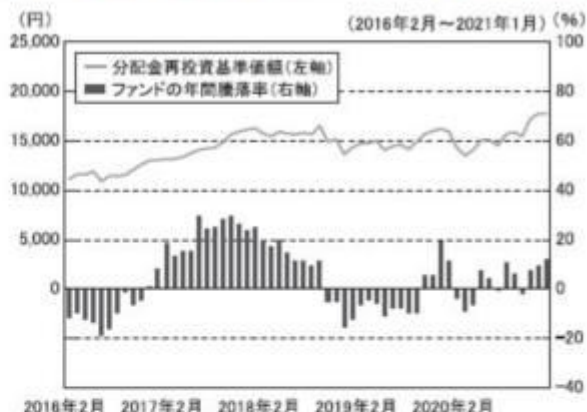
先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）

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）

※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。

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



2016年2月 2017年2月 2018年2月 2019年2月 2020年2月

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の10口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2016年2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。

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数（TOPIX、配当込）

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

MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（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】**

販売会社は、取得申込者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

販売会社は、受益者が解約請求を行なうときおよび受益権の買取りを行なうときは、当該受益者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金手数料は、換金時の事務手続きなどに係る対価です。

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0.0968%（税抜0.088%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

当ファンドの信託報酬が税抜0.088%（有価証券届出書提出日現在）の場合の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率		
合計	委託会社	受託会社
0.088%	0.060%	0.028%

委託会社	委託した資金の運用の対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

(4)【その他の手数料等】

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

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

ファンドの計理業務(設定解約処理、約定処理、基準価額算出、決算処理等)およびこれに付随する業務(法定帳簿管理、法定報告等)に係る費用。

振替受益権に係る費用ならびにやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。

有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書(これらの訂正に係る書類を含みます。)の作成、印刷および提出に係る費用。

目論見書および仮目論見書(これらの訂正事項分を含みます。)の作成、印刷および交付に係る費用(これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)

信託約款の作成、印刷および交付に係る費用(これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)

運用報告書および決算短信など開示資料の作成、印刷および交付に係る費用(これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)

ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

受益権の上場に係る費用。

「TOPIX Ex-Financials」その他これに類する標章の使用料。

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

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

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

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賃料に0.55(税抜0.5)以内(有価証券届出書提出日現在、0.55(税抜0.5))を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は4:1とし、信託報酬と同時期に支払います。

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 受益権の売却時の課税

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

率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

2) 収益分配金の受取り時の課税

収益分配金は配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

3) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

法人受益者の場合

1) 受益権の売却時の課税

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

2) 収益分配金の受取り時の課税

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

3) 解約金および償還金に対する課税

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

4) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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

上記は2021年4月8日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financials】

以下の運用状況は2021年1月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	14,389,413,570	99.53
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		67,736,176	0.47
合計（純資産総額）		14,457,149,746	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	64,400	7,939.00	511,271,600	7,300.00	470,120,000	3.25
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	49,500	7,990.98	395,553,670	8,108.00	401,346,000	2.78
日本	株式	ソニー	電気機器	39,800	10,708.14	426,184,196	10,050.00	399,990,000	2.77
日本	株式	キーエンス	電気機器	6,300	58,615.57	369,278,136	56,140.00	353,682,000	2.45
日本	株式	任天堂	その他製品	3,600	65,370.00	235,332,000	60,580.00	218,088,000	1.51
日本	株式	日本電産	電気機器	15,300	14,030.06	214,659,922	13,850.00	211,905,000	1.47
日本	株式	信越化学工業	化学	11,500	19,000.14	218,501,616	18,175.00	209,012,500	1.45
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	43,500	4,438.42	193,071,532	4,542.00	197,577,000	1.37
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	52,900	3,695.26	195,479,450	3,698.00	195,624,200	1.35
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	72,900	2,816.50	205,322,850	2,618.00	190,852,200	1.32
日本	株式	村田製作所	電気機器	18,700	10,073.45	188,373,584	10,055.00	188,028,500	1.30
日本	株式	第一三共	医薬品	54,600	3,643.02	198,909,180	3,365.00	183,729,000	1.27
日本	株式	ダイキン工業	機械	8,100	23,410.74	189,627,046	22,105.00	179,050,500	1.24
日本	株式	HOYA	精密機器	12,600	14,066.05	177,232,241	13,395.00	168,777,000	1.17
日本	株式	KDDI	情報・通信業	50,000	3,203.54	160,177,250	3,079.00	153,950,000	1.06
日本	株式	ファナック	電気機器	5,600	27,155.00	152,068,000	27,365.00	153,244,000	1.06
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	3,700	40,680.00	150,516,000	39,810.00	147,297,000	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	50,000	2,932.08	146,604,470	2,764.50	138,225,000	0.96
日本	株式	日立製作所	電気機器	30,600	4,321.95	132,251,848	4,306.00	131,763,600	0.91
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	43,800	3,090.81	135,377,490	2,997.50	131,290,500	0.91
日本	株式	S M C	機械	1,900	68,200.00	129,580,000	63,360.00	120,384,000	0.83
日本	株式	花王	化学	15,200	7,842.97	119,213,246	7,597.00	115,474,400	0.80
日本	株式	中外製薬	医薬品	19,900	5,535.41	110,154,676	5,472.00	108,892,800	0.75
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	6,400	16,120.00	103,168,000	16,350.00	104,640,000	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	63,600	1,638.75	104,225,119	1,594.50	101,410,200	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	38,100	2,628.00	100,126,800	2,647.50	100,869,750	0.70
日本	株式	三井物産	卸売業	50,800	1,983.50	100,761,800	1,936.50	98,374,200	0.68
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	24,500	3,993.01	97,828,954	3,961.00	97,044,500	0.67
日本	株式	エムスリー	サービス業	10,700	10,545.00	112,831,500	8,811.00	94,277,700	0.65
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	55,100	1,623.42	89,450,540	1,692.50	93,256,750	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	0.10
		鉱業	0.16
		建設業	2.49
		食料品	3.89
		繊維製品	0.54
		パルプ・紙	0.27
		化学	8.32
		医薬品	6.55
		石油・石炭製品	0.45
		ゴム製品	0.61
		ガラス・土石製品	0.86
		鉄鋼	0.66
		非鉄金属	0.80
		金属製品	0.64
		機械	6.29
		電気機器	19.76
		輸送用機器	7.38
		精密機器	2.93
		その他製品	2.71
		電気・ガス業	1.47
		陸運業	3.76
		海運業	0.19
		空運業	0.44
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	10.07
		卸売業	4.95
小売業	5.16		
不動産業	2.07		
サービス業	5.82		
合 計			99.53

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)		東京証券取引所 取引価格(円)
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き	
第1計算期間末 (2014年 1月 8日)	1,507	1,514	1,076.6	1,081.6	1,080
第2計算期間末 (2014年 7月 8日)	48,298	48,388	1,075.3	1,077.3	1,078
第3計算期間末 (2015年 1月 8日)	3,671	3,735	1,162.0	1,182.0	1,194
第4計算期間末 (2015年 7月 8日)	3,537	3,567	1,315.2	1,326.2	1,315
第5計算期間末 (2016年 1月 8日)	2,890	2,926	1,210.1	1,225.1	1,207
第6計算期間末 (2016年 7月 8日)	4,933	4,989	1,049.3	1,061.3	1,100
第7計算期間末 (2017年 1月 8日)	5,856	5,901	1,306.9	1,316.9	1,250
第8計算期間末 (2017年 7月 8日)	5,151	5,212	1,358.7	1,374.7	1,300
第9計算期間末 (2018年 1月 8日)	5,983	6,028	1,602.4	1,614.4	1,520
第10計算期間末 (2018年 7月 8日)	20,560	20,687	1,463.0	1,472.0	1,468
第11計算期間末 (2019年 1月 8日)	23,926	24,126	1,313.4	1,324.4	1,319
第12計算期間末 (2019年 7月 8日)	26,476	26,783	1,377.7	1,393.7	1,380
第13計算期間末 (2020年 1月 8日)	31,283	31,577	1,488.8	1,502.8	1,494
第14計算期間末 (2020年 7月 8日)	9,587	9,712	1,381.5	1,399.5	1,430
第15計算期間末 (2021年 1月 8日)	16,501	16,651	1,648.8	1,663.8	1,584
2020年 1月末日	15,767		1,475.1		1,481
2月末日	13,592		1,322.1		1,353
3月末日	11,012		1,254.7		1,267
4月末日	10,695		1,309.1		1,348
5月末日	11,511		1,400.7		
6月末日	9,502		1,400.9		
7月末日	17,785		1,330.1		1,387
8月末日	19,893		1,433.3		
9月末日	18,592		1,456.8		1,499
10月末日	13,542		1,414.9		1,423
11月末日	14,813		1,575.3		1,598
12月末日	16,240		1,624.6		1,617
2021年 1月末日	14,457		1,612.0		1,620

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

【分配の推移】

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

第6期	2016年 1月 9日～2016年 7月 8日	12.0000
第7期	2016年 7月 9日～2017年 1月 8日	10.0000
第8期	2017年 1月 9日～2017年 7月 8日	16.0000
第9期	2017年 7月 9日～2018年 1月 8日	12.0000
第10期	2018年 1月 9日～2018年 7月 8日	9.0000
第11期	2018年 7月 9日～2019年 1月 8日	11.0000
第12期	2019年 1月 9日～2019年 7月 8日	16.0000
第13期	2019年 7月 9日～2020年 1月 8日	14.0000
第14期	2020年 1月 9日～2020年 7月 8日	18.0000
第15期	2020年 7月 9日～2021年 1月 8日	15.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2013年 9月24日～2014年 1月 8日	8.16
第2期	2014年 1月 9日～2014年 7月 8日	0.07
第3期	2014年 7月 9日～2015年 1月 8日	9.92
第4期	2015年 1月 9日～2015年 7月 8日	14.13
第5期	2015年 7月 9日～2016年 1月 8日	6.85
第6期	2016年 1月 9日～2016年 7月 8日	12.30
第7期	2016年 7月 9日～2017年 1月 8日	25.50
第8期	2017年 1月 9日～2017年 7月 8日	5.19
第9期	2017年 7月 9日～2018年 1月 8日	18.82
第10期	2018年 1月 9日～2018年 7月 8日	8.14
第11期	2018年 7月 9日～2019年 1月 8日	9.47
第12期	2019年 1月 9日～2019年 7月 8日	6.11
第13期	2019年 7月 9日～2020年 1月 8日	9.08
第14期	2020年 1月 9日～2020年 7月 8日	6.00
第15期	2020年 7月 9日～2021年 1月 8日	20.43

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2013年 9月24日～2014年 1月 8日	1,400,000	0
第2期	2014年 1月 9日～2014年 7月 8日	53,096,000	9,580,485
第3期	2014年 7月 9日～2015年 1月 8日	4,880,000	46,635,515
第4期	2015年 1月 9日～2015年 7月 8日	1,380,000	1,850,000
第5期	2015年 7月 9日～2016年 1月 8日	1,189,000	1,490,000

第6期	2016年 1月 9日 ~ 2016年 7月 8日	2,445,000	132,631
第7期	2016年 7月 9日 ~ 2017年 1月 8日	0	220,000
第8期	2017年 1月 9日 ~ 2017年 7月 8日	77,000	767,000
第9期	2017年 7月 9日 ~ 2018年 1月 8日	0	57,000
第10期	2018年 1月 9日 ~ 2018年 7月 8日	16,169,713	5,850,000
第11期	2018年 7月 9日 ~ 2019年 1月 8日	8,038,000	3,875,000
第12期	2019年 1月 9日 ~ 2019年 7月 8日	1,000,000	0
第13期	2019年 7月 9日 ~ 2020年 1月 8日	1,865,000	70,000
第14期	2020年 1月 9日 ~ 2020年 7月 8日	1,914,000	15,986,568
第15期	2020年 7月 9日 ~ 2021年 1月 8日	7,900,000	4,831,000

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

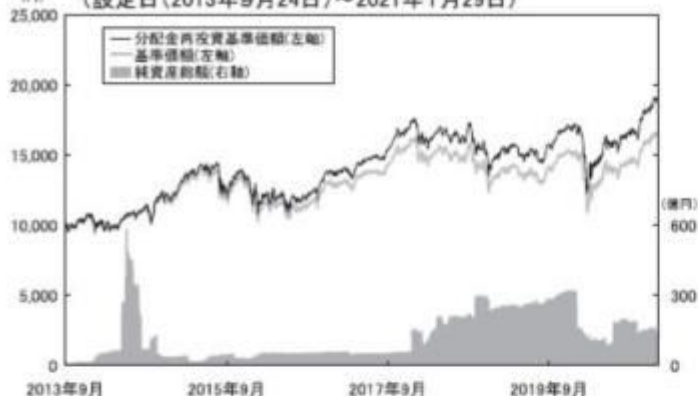
参考情報

運用実績

2021年1月29日現在

基準価額・純資産の推移

(PI) (設定日(2013年9月24日)~2021年1月29日)



基準価額……………16,120円

純資産総額……………144.57億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の10口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移（税引前、10口当たり）

2019年1月	2019年7月	2020年1月	2020年7月	2021年1月	設定来累計
110円	160円	140円	180円	150円	1,860円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	99.53%
うち先物	0.00%
現金その他	0.47%

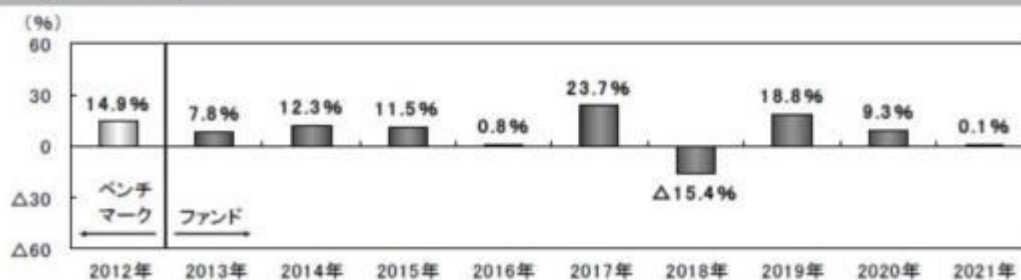
※対純資産総額比です。

<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	3.25%
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.78%
3	ソニー	電気機器	2.77%
4	キーエンス	電気機器	2.45%
5	任天堂	その他製品	1.51%
6	日本電産	電気機器	1.47%
7	信越化学工業	化学	1.45%
8	リクルートホールディングス	サービス業	1.37%
9	武田薬品工業	医薬品	1.35%
10	日本電信電話	情報・通信業	1.32%

※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。

※2012年以前は、ベンチマーク（TOPIX Ex-Financials）の収益率を表示しております。

※ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

※2013年は、設定時から2013年末までの騰落率です。

※2021年は、2021年1月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

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

手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。

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

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

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

(4) 取得申込不可日

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

(5) 申込金額

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

(6) 申込単位

1,000口以上で販売会社が定める単位

詳しくは、販売会社の照会先にお問い合わせください。

(7) 申込代金の支払い

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

(8) 受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 解約手数料

受益者は解約時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。

(7) 解約単位

1,000口以上 1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

< 買取請求による換金 >

- (1) 受益者は、保有する受益権口数の合計が金融商品取引所の定める受益権の取引単位に満たない場合は、販売会社に当該受益権の買取りを請求することができます。
- (2) 原則として、午後2時までに販売会社において所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (3) 受益権の買取価額は、買取請求受付日の基準価額とします。
- (4) 受益者は買取時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。
- (5) 販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて買取りを中止すること、および既に受け付けた買取りを取り消すことができます。
- (6) 買取請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（2013年9月24日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年 1月 9日から 7月 8日までおよび 7月 9日から翌年 1月 8日までとします。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 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。
 - 純資産総額が 5億円を下回るようになった場合
 - 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
 - やむを得ない事情が発生したとき
- この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の

「書面決議」をご覧ください。)

- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
- イ) 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合
 - ロ) TOPIX Ex-Financialsが廃止された場合
 - ハ) TOPIX Ex-Financialsの計算方法の変更などに伴って委託会社または受託会社が必要と認めた信託約款の変更が、書面決議の規定を満たさず、信託約款の変更が行なわれないこととなった場合
 - ニ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
 - ホ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ヘ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。)
 - ト) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- なお、上記イ) について、すべての金融商品取引所において上場が廃止された場合には、その廃止された日に信託を終了するための手続を開始するものとします。

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

償還金について

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

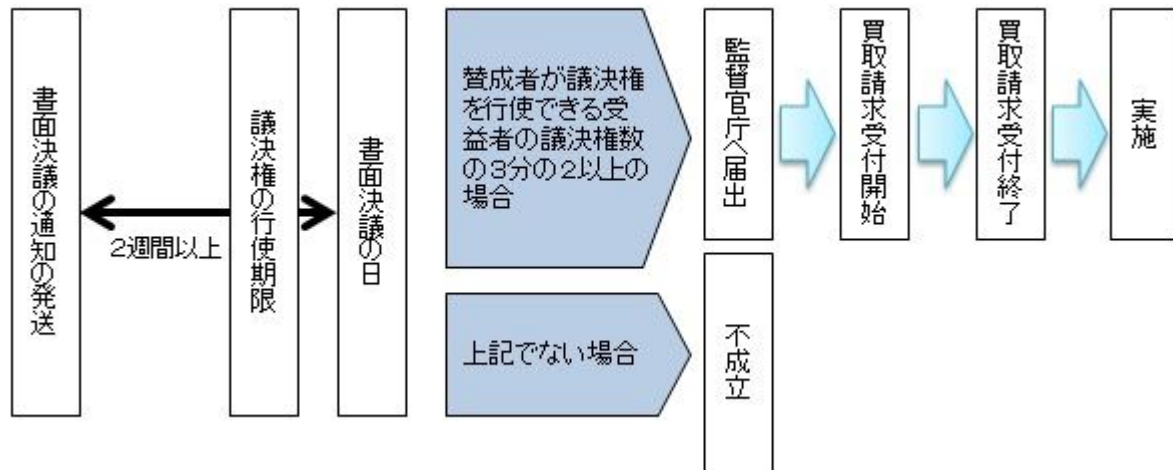
信託約款の変更など

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(以下「併合」といいます。)を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合(受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。)については、書面決議を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)
- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知れている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。
- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6) 当ファンドの繰上償還、信託約款の重大な変更または併合を行なう場合には、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己の有する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

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

運用報告書の作成

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

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。

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

- 1．他の受益者の氏名または名称および住所
- 2．他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

- ・名義登録手続きによって受益者を確定し、当該受益者に対して収益分配金の支払いを行ないます。当ファンドの収益分配金は、計算期間終了日現在において、受託会社に名義登録している受益者に支払われます。受益者は、取扱会社を經由して名義登録を行なうことができます。
- ・計算期間終了日現在において、氏名または名称および住所が受託会社に登録されている受益者は、ファンドの収益分配金を登録されている受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が収益分配金について支払開始日から5年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 償還金受領権

- ・信託期間終了日現在において、氏名または名称および住所が受託会社に登録されている受益者は、ファンドの償還金を登録されている受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が償還金について支払開始日から10年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(3) 解約請求権

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

(4) 受益権の買取請求権

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

(5) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間(2020年7月9日から2021年1月8日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【上場インデックスファンドTOPIX Ex - Financials】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第14期 2020年 7月 8日現在	第15期 2021年 1月 8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	28,344,676	37,871,223
株式	9,687,624,120	16,451,981,550
未収入金	-	156,223,650
未収配当金	16,396,977	22,866,435
流動資産合計	9,732,365,773	16,668,942,858
資産合計	9,732,365,773	16,668,942,858
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	124,911,252	150,127,710
未払受託者報酬	2,187,619	2,698,677
未払委託者報酬	4,687,904	5,783,008
未払利息	15	8
その他未払費用	13,443,182	8,762,014
流動負債合計	145,229,972	167,371,417
負債合計	145,229,972	167,371,417
純資産の部		
元本等		
元本	6,939,514,000	10,008,514,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,647,621,801	6,493,057,441
(分配準備積立金)	10,435,035	7,968,991
元本等合計	9,587,135,801	16,501,571,441
純資産合計	9,587,135,801	16,501,571,441
負債純資産合計	9,732,365,773	16,668,942,858

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期		第15期	
	自	2020年 1月 9日	自	2020年 7月 9日
	至	2020年 7月 8日	至	2021年 1月 8日
営業収益				
受取配当金		141,740,750		164,912,619
受取利息		11		19
有価証券売買等損益		1,089,502,871		2,857,050,284
その他収益		51,322		27,657
営業収益合計		947,710,788		3,021,990,579
営業費用				
支払利息		45,854		34,930
受託者報酬		2,187,619		2,698,677
委託者報酬		4,687,904		5,783,008
その他費用		8,966,807		8,762,014
営業費用合計		15,888,184		17,278,629
営業利益又は営業損失()		963,598,972		3,004,711,950
経常利益又は経常損失()		963,598,972		3,004,711,950
当期純利益又は当期純損失()		963,598,972		3,004,711,950
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		-		-
期首剰余金又は期首欠損金()		10,271,197,627		2,647,621,801
剰余金増加額又は欠損金減少額		526,338,500		3,208,045,900
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		526,338,500		3,208,045,900
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,061,404,102		2,217,194,500
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,061,404,102		2,217,194,500
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		124,911,252		150,127,710
期末剰余金又は期末欠損金()		2,647,621,801		6,493,057,441

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<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>
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

		第14期 2020年 7月 8日現在	第15期 2021年 1月 8日現在
1.	期首元本額	21,012,082,000円	6,939,514,000円
	期中追加設定元本額	1,914,000,000円	7,900,000,000円
	期中一部解約元本額	15,986,568,000円	4,831,000,000円
2.	受益権の総数	6,939,514口	10,008,514口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 2020年 1月 9日 至 2020年 7月 8日		第15期 自 2020年 7月 9日 至 2021年 1月 8日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	当期配当等収益額 141,746,229円	A	当期配当等収益額 164,905,365円
B	分配準備積立金 9,442,388円	B	分配準備積立金 10,435,035円
C	配当等収益額合計(A+B) 151,188,617円	C	配当等収益額合計(A+B) 175,340,400円
D	経費 15,842,330円	D	経費 17,243,699円
E	収益分配可能額(C-D) 135,346,287円	E	収益分配可能額(C-D) 158,096,701円
F	収益分配金額 124,911,252円	F	収益分配金額 150,127,710円
G	次期繰越金(分配準備積立金) (E-F) 10,435,035円	G	次期繰越金(分配準備積立金) (E-F) 7,968,991円
H	口数 6,939,514口	H	口数 10,008,514口
I	分配金額(10口当たり) 180円	I	分配金額(10口当たり) 150円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	第14期 自 2020年 1月 9日 至 2020年 7月 8日	第15期 自 2020年 7月 9日 至 2021年 1月 8日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第14期 2020年 7月 8日現在	第15期 2021年 1月 8日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
-------------------------	---	----

(有価証券に関する注記)

第14期(2020年7月8日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	448,592,077
合計	448,592,077

第15期(2021年1月8日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,481,806,333
合計	2,481,806,333

(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14期 2020年7月8日現在		第15期 2021年1月8日現在	
1口当たり純資産額	1,381.5円	1口当たり純資産額	1,648.8円
(10口当たり純資産額)	(13,815円)	(10口当たり純資産額)	(16,488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	300	2,999.00	899,700	
日本水産	9,500	436.00	4,142,000	
マルハニチロ	1,400	2,234.00	3,127,600	
雪国まいたけ	600	1,777.00	1,066,200	
カネコ種苗	300	1,598.00	479,400	
サカタのタネ	1,100	3,655.00	4,020,500	
ホクト	700	2,126.00	1,488,200	
ホクリヨウ	100	698.00	69,800	
住石ホールディングス	1,800	120.00	216,000	
日鉄鉱業	200	6,310.00	1,262,000	
三井松島ホールディングス	400	754.00	301,600	
国際石油開発帝石	35,100	609.00	21,375,900	
石油資源開発	1,300	2,029.00	2,637,700	
K & O エナジーグループ	500	1,445.00	722,500	
ヒノキヤグループ	200	2,082.00	416,400	
ショーボンドホールディングス	1,500	5,040.00	7,560,000	
ミライト・ホールディングス	2,800	1,758.00	4,922,400	
タマホーム	500	1,477.00	738,500	
サンヨーホームズ	100	749.00	74,900	
日本アクア	400	656.00	262,400	
ファーストコーポレーション	300	712.00	213,600	
ベステラ	200	1,811.00	362,200	
T A T E R U	1,700	178.00	302,600	
キャンディル	200	530.00	106,000	
スペースバリューホールディングス	1,200	707.00	848,400	
ダイセキ環境ソリューション	200	811.00	162,200	
第一カッター興業	200	1,417.00	283,400	
安藤・間	5,700	741.00	4,223,700	
東急建設	2,800	514.00	1,439,200	
コムシスホールディングス	3,400	3,250.00	11,050,000	
ピーアールホールディングス	1,000	639.00	639,000	
高松コンストラクショングループ	600	2,082.00	1,249,200	
東建コーポレーション	300	8,260.00	2,478,000	
ソネック	100	874.00	87,400	
ヤマウラ	400	930.00	372,000	
大成建設	7,300	3,555.00	25,951,500	
大林組	22,000	924.00	20,328,000	
清水建設	22,300	768.00	17,126,400	

飛島建設	600	1,080.00	648,000
長谷工コーポレーション	8,500	1,213.00	10,310,500
松井建設	900	720.00	648,000
銭高組	100	4,135.00	413,500
鹿島建設	17,300	1,413.00	24,444,900
不動テトラ	600	1,751.00	1,050,600
大末建設	300	849.00	254,700
鉄建建設	500	1,863.00	931,500
西松建設	1,700	2,343.00	3,983,100
三井住友建設	5,300	442.00	2,342,600
大豊建設	500	3,750.00	1,875,000
前田建設工業	5,500	907.00	4,988,500
佐田建設	500	450.00	225,000
ナカノフドー建設	600	423.00	253,800
奥村組	1,000	2,591.00	2,591,000
東鉄工業	900	2,717.00	2,445,300
イチケン	200	1,808.00	361,600
富士ピー・エス	300	605.00	181,500
浅沼組	200	4,115.00	823,000
戸田建設	9,100	733.00	6,670,300
熊谷組	1,000	2,742.00	2,742,000
北野建設	100	2,465.00	246,500
植木組	100	2,815.00	281,500
矢作建設工業	1,000	890.00	890,000
ピーエス三菱	700	615.00	430,500
日本ハウスホールディングス	1,500	331.00	496,500
大東建託	2,400	9,740.00	23,376,000
新日本建設	900	847.00	762,300
N I P P O	1,800	2,750.00	4,950,000
東亜道路工業	100	3,830.00	383,000
前田道路	1,900	1,725.00	3,277,500
日本道路	200	7,750.00	1,550,000
東亜建設工業	700	2,063.00	1,444,100
日本国土開発	2,100	584.00	1,226,400
若築建設	400	1,244.00	497,600
東洋建設	2,500	463.00	1,157,500
五洋建設	8,700	931.00	8,099,700
世紀東急工業	1,100	840.00	924,000
福田組	300	5,400.00	1,620,000
住友林業	5,600	2,126.00	11,905,600
日本基礎技術	700	493.00	345,100
巴コーポレーション	1,000	411.00	411,000

大和ハウス工業	21,800	3,095.00	67,471,000
ライト工業	1,300	1,764.00	2,293,200
積水ハウス	23,900	2,105.50	50,321,450
日特建設	600	795.00	477,000
北陸電気工事	400	1,252.00	500,800
ユアテック	1,300	816.00	1,060,800
日本リーテック	500	2,529.00	1,264,500
四電工	100	2,836.00	283,600
中電工	900	2,241.00	2,016,900
関電工	3,100	901.00	2,793,100
きんでん	5,200	1,703.00	8,855,600
東京エネシス	700	956.00	669,200
トーエネック	200	4,195.00	839,000
住友電設	600	2,636.00	1,581,600
日本電設工業	1,200	2,051.00	2,461,200
協和エクシオ	3,300	2,900.00	9,570,000
新日本空調	600	2,285.00	1,371,000
九電工	1,500	3,340.00	5,010,000
三機工業	1,600	1,239.00	1,982,400
日揮ホールディングス	6,800	1,100.00	7,480,000
中外炉工業	200	1,714.00	342,800
ヤマト	700	732.00	512,400
太平電業	500	2,537.00	1,268,500
高砂熱学工業	1,700	1,570.00	2,669,000
三晃金属工業	100	2,887.00	288,700
朝日工業社	200	2,999.00	599,800
明星工業	1,400	811.00	1,135,400
大気社	1,100	2,790.00	3,069,000
ダイダン	500	2,952.00	1,476,000
日比谷総合設備	700	1,900.00	1,330,000
フィル・カンパニー	100	2,003.00	200,300
OSJBホールディングス	3,500	283.00	990,500
東洋エンジニアリング	900	466.00	419,400
レイズネクスト	1,200	1,233.00	1,479,600
ニッポン	2,100	1,665.00	3,496,500
日清製粉グループ本社	8,000	1,673.00	13,384,000
昭和産業	700	3,115.00	2,180,500
鳥越製粉	600	923.00	553,800
中部飼料	900	1,476.00	1,328,400
フィード・ワン	1,000	894.00	894,000
東洋精糖	100	1,227.00	122,700
日本甜菜製糖	400	1,646.00	658,400

三井製糖	600	1,839.00	1,103,400
塩水港精糖	700	224.00	156,800
日新製糖	300	1,860.00	558,000
森永製菓	1,600	3,865.00	6,184,000
中村屋	200	3,945.00	789,000
江崎グリコ	1,900	4,570.00	8,683,000
名糖産業	300	1,457.00	437,100
井村屋グループ	400	2,594.00	1,037,600
不二家	400	2,337.00	934,800
山崎製パン	5,300	1,726.00	9,147,800
第一屋製パン	200	982.00	196,400
モロゾフ	100	5,750.00	575,000
亀田製菓	400	4,900.00	1,960,000
寿スピリッツ	700	5,110.00	3,577,000
カルビー	3,200	3,120.00	9,984,000
森永乳業	1,300	5,080.00	6,604,000
六甲バター	500	1,846.00	923,000
ヤクルト本社	4,900	5,260.00	25,774,000
明治ホールディングス	4,700	7,320.00	34,404,000
雪印メグミルク	1,700	2,226.00	3,784,200
プリマハム	1,100	3,345.00	3,679,500
日本ハム	2,700	4,625.00	12,487,500
林兼産業	200	590.00	118,000
丸大食品	700	1,710.00	1,197,000
S Foods	600	3,475.00	2,085,000
柿安本店	200	2,697.00	539,400
伊藤ハム米久ホールディングス	4,500	679.00	3,055,500
サッポロホールディングス	2,400	1,973.00	4,735,200
アサヒグループホールディングス	15,400	4,227.00	65,095,800
キリンホールディングス	29,900	2,292.50	68,545,750
宝ホールディングス	5,200	1,232.00	6,406,400
オエノンホールディングス	2,000	407.00	814,000
養命酒製造	200	1,873.00	374,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	5,400	1,544.00	8,337,600
サントリー食品インターナショナル	4,700	3,630.00	17,061,000
ダイドーグループホールディングス	400	5,110.00	2,044,000
伊藤園	2,100	6,610.00	13,881,000
キーコーヒー	700	2,146.00	1,502,200
ユニカフェ	200	1,013.00	202,600
ジャパンフーズ	100	1,211.00	121,100
日清オイリオグループ	900	3,080.00	2,772,000
不二製油グループ本社	1,700	3,020.00	5,134,000

かどや製油	100	3,965.00	396,500
J-オイルミルズ	400	3,610.00	1,444,000
キッコーマン	5,100	7,260.00	37,026,000
味の素	15,600	2,400.00	37,440,000
キューピー	3,900	2,422.00	9,445,800
ハウス食品グループ本社	2,600	3,830.00	9,958,000
カゴメ	2,900	3,525.00	10,222,500
焼津水産化学工業	300	1,021.00	306,300
アリアケジャパン	600	7,160.00	4,296,000
ピエトロ	100	1,706.00	170,600
エバラ食品工業	200	2,443.00	488,600
やまみ	100	2,198.00	219,800
ニチレイ	3,400	2,945.00	10,013,000
東洋水産	3,600	5,350.00	19,260,000
イトアンドホールディングス	200	1,791.00	358,200
大冷	100	1,940.00	194,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	400	783.00	313,200
日清食品ホールディングス	3,000	9,110.00	27,330,000
永谷園ホールディングス	300	2,311.00	693,300
一正蒲鉾	300	1,159.00	347,700
フジッコ	800	2,011.00	1,608,800
ロック・フィールド	800	1,531.00	1,224,800
日本たばこ産業	37,800	2,046.00	77,338,800
ケンコーマヨネーズ	400	1,810.00	724,000
わらべや日洋ホールディングス	500	1,642.00	821,000
なとり	400	1,886.00	754,400
イフジ産業	100	858.00	85,800
ピックルスコーポレーション	200	3,270.00	654,000
北の達人コーポレーション	2,500	470.00	1,175,000
ユーグレナ	3,100	807.00	2,501,700
ミヨシ油脂	200	1,195.00	239,000
理研ビタミン	700	1,417.00	991,900
片倉工業	900	1,339.00	1,205,100
ゲンゼ	500	3,370.00	1,685,000
東洋紡	2,700	1,400.00	3,780,000
ユニチカ	2,000	401.00	802,000
富士紡ホールディングス	300	3,905.00	1,171,500
倉敷紡績	700	1,872.00	1,310,400
シキボウ	400	1,019.00	407,600
日本毛織	2,300	1,001.00	2,302,300
ダイトウボウ	1,100	111.00	122,100
トーア紡コーポレーション	300	463.00	138,900

ダイドーリミテッド	800	183.00	146,400
帝国繊維	800	2,327.00	1,861,600
帝人	5,600	1,954.00	10,942,400
東レ	49,800	649.70	32,355,060
サカイオーベックス	200	2,168.00	433,600
住江織物	200	2,102.00	420,400
日本フェルト	400	423.00	169,200
イチカワ	100	1,273.00	127,300
日東製網	100	1,483.00	148,300
アツギ	600	501.00	300,600
ダイニック	300	818.00	245,400
セーレン	1,700	1,660.00	2,822,000
ソトー	300	821.00	246,300
東海染工	100	1,134.00	113,400
小松マテーレ	1,100	1,020.00	1,122,000
ワコールホールディングス	1,700	2,041.00	3,469,700
ホギメディカル	800	3,290.00	2,632,000
クラウディアホールディングス	200	271.00	54,200
T S Iホールディングス	2,000	217.00	434,000
マツオカコーポレーション	200	2,043.00	408,600
ワールド	1,000	1,237.00	1,237,000
三陽商会	300	614.00	184,200
ナイガイ	200	341.00	68,200
オンワードホールディングス	4,100	215.00	881,500
ルックホールディングス	200	974.00	194,800
キムラタン	3,700	25.00	92,500
ゴールドウイン	1,200	6,730.00	8,076,000
デサント	1,300	1,935.00	2,515,500
キング	300	546.00	163,800
ヤマトインターナショナル	600	332.00	199,200
特種東海製紙	400	5,040.00	2,016,000
王子ホールディングス	28,700	673.00	19,315,100
日本製紙	3,000	1,272.00	3,816,000
三菱製紙	800	321.00	256,800
北越コーポレーション	4,100	430.00	1,763,000
中越パルプ工業	300	1,255.00	376,500
巴川製紙所	200	827.00	165,400
大王製紙	3,300	2,100.00	6,930,000
阿波製紙	200	476.00	95,200
レンゴー	6,500	883.00	5,739,500
トーモク	400	1,800.00	720,000
ザ・パック	500	2,700.00	1,350,000

クラレ	10,800	1,080.00	11,664,000
旭化成	45,600	1,103.00	50,296,800
共和レザー	400	652.00	260,800
昭和電工	5,200	2,251.00	11,705,200
住友化学	50,500	425.00	21,462,500
住友精化	300	4,200.00	1,260,000
日産化学	3,800	6,300.00	23,940,000
ラサ工業	200	2,380.00	476,000
クレハ	600	7,160.00	4,296,000
多木化学	300	6,450.00	1,935,000
テイカ	500	1,475.00	737,500
石原産業	1,200	673.00	807,600
片倉コープアグリ	200	1,210.00	242,000
日本曹達	1,000	3,075.00	3,075,000
東ソー	10,600	1,660.00	17,596,000
トクヤマ	2,000	2,538.00	5,076,000
セントラル硝子	1,400	2,387.00	3,341,800
東亜合成	4,300	1,192.00	5,125,600
大阪ソーダ	700	2,751.00	1,925,700
関東電化工業	1,600	818.00	1,308,800
デンカ	2,500	4,200.00	10,500,000
信越化学工業	11,800	19,020.00	224,436,000
日本カーバイド工業	200	1,316.00	263,200
堺化学工業	400	2,026.00	810,400
第一稀元素化学工業	800	952.00	761,600
エア・ウォーター	6,400	1,837.00	11,756,800
日本酸素ホールディングス	6,600	2,090.00	13,794,000
日本化学工業	200	2,985.00	597,000
東邦アセチレン	100	1,573.00	157,300
日本パーカライズン	3,500	1,102.00	3,857,000
高压ガス工業	1,100	839.00	922,900
チタン工業	100	1,962.00	196,200
四国化成工業	1,000	1,223.00	1,223,000
戸田工業	200	2,399.00	479,800
ステラ ケミファ	400	3,445.00	1,378,000
保土谷化学工業	300	5,360.00	1,608,000
日本触媒	1,100	6,000.00	6,600,000
大日精化工業	600	2,371.00	1,422,600
カネカ	1,800	3,595.00	6,471,000
三菱瓦斯化学	6,400	2,402.00	15,372,800
三井化学	6,400	3,010.00	19,264,000
J S R	6,400	3,130.00	20,032,000

東京応化工業	1,200	7,440.00	8,928,000	
大阪有機化学工業	600	3,575.00	2,145,000	
三菱ケミカルホールディングス	46,000	637.90	29,343,400	
KHネオケム	1,100	2,656.00	2,921,600	
ダイセル	8,600	760.00	6,536,000	
住友ベークライト	1,100	3,890.00	4,279,000	
積水化学工業	14,600	2,004.00	29,258,400	
日本ゼオン	6,200	1,501.00	9,306,200	
アイカ工業	2,100	3,585.00	7,528,500	
宇部興産	3,500	1,918.00	6,713,000	
積水樹脂	1,200	2,227.00	2,672,400	
タキロンシーアイ	1,500	683.00	1,024,500	
旭有機材	400	1,568.00	627,200	
ニチバン	400	1,654.00	661,600	
リケンテクノス	1,700	471.00	800,700	
大倉工業	300	1,982.00	594,600	
積水化成成品工業	900	543.00	488,700	
群栄化学工業	200	2,439.00	487,800	
タイガースポリマー	300	407.00	122,100	
ミライアル	300	1,200.00	360,000	
ダイキアクシス	200	1,171.00	234,200	
ダイキョーニシカワ	1,400	858.00	1,201,200	
竹本容器	200	927.00	185,400	
森六ホールディングス	400	2,190.00	876,000	
日本化薬	4,300	983.00	4,226,900	
カーリットホールディングス	700	757.00	529,900	
日本精化	600	1,455.00	873,000	
扶桑化学工業	700	3,705.00	2,593,500	
トリケミカル研究所	100	17,460.00	1,746,000	
ADEKA	3,200	1,783.00	5,705,600	
日油	2,600	5,080.00	13,208,000	
新日本理化	1,100	253.00	278,300	
ハリマ化成グループ	600	1,066.00	639,600	
花王	16,800	7,844.00	131,779,200	
第一工業製薬	300	4,445.00	1,333,500	
石原ケミカル	200	2,131.00	426,200	
日華化学	200	939.00	187,800	
ニイタカ	100	3,050.00	305,000	
三洋化成工業	400	5,650.00	2,260,000	
有機合成薬品工業	500	312.00	156,000	
大日本塗料	800	980.00	784,000	
日本ペイントホールディングス	5,700	10,580.00	60,306,000	

関西ペイント	7,700	3,095.00	23,831,500
神東塗料	500	219.00	109,500
中国塗料	2,000	1,081.00	2,162,000
日本特殊塗料	500	1,273.00	636,500
藤倉化成	900	533.00	479,700
太陽ホールディングス	500	6,220.00	3,110,000
D I C	2,900	2,551.00	7,397,900
サカタインクス	1,500	1,158.00	1,737,000
東洋インキS Cホールディングス	1,400	1,917.00	2,683,800
T & K T O K A	500	864.00	432,000
富士フィルムホールディングス	13,500	6,082.00	82,107,000
資生堂	14,000	6,722.00	94,108,000
ライオン	9,100	2,464.00	22,422,400
高砂香料工業	400	2,496.00	998,400
マンダム	1,600	1,666.00	2,665,600
ミルボン	900	6,520.00	5,868,000
ファンケル	2,800	3,850.00	10,780,000
コーセー	1,300	16,350.00	21,255,000
コタ	400	1,444.00	577,600
シーボン	100	1,903.00	190,300
ポーラ・オルビスホールディングス	3,000	2,144.00	6,432,000
ノエビアホールディングス	600	4,480.00	2,688,000
アジュバンコスメジャパン	100	1,030.00	103,000
エステー	400	1,984.00	793,600
アグロ カネショウ	300	1,750.00	525,000
コニシ	1,200	1,659.00	1,990,800
長谷川香料	1,200	2,107.00	2,528,400
星光P M C	400	802.00	320,800
小林製薬	2,000	12,360.00	24,720,000
荒川化学工業	600	1,290.00	774,000
メック	500	2,225.00	1,112,500
日本高純度化学	200	2,750.00	550,000
タカラバイオ	1,800	2,859.00	5,146,200
J C U	800	3,760.00	3,008,000
新田ゼラチン	400	673.00	269,200
O A T アグリオ	100	1,311.00	131,100
デクセリアルズ	1,800	1,348.00	2,426,400
アース製薬	500	5,720.00	2,860,000
北興化学工業	700	1,213.00	849,100
大成ラミック	200	3,005.00	601,000
クミアイ化学工業	2,900	911.00	2,641,900
日本農薬	1,300	495.00	643,500

アキレス	500	1,455.00	727,500
有沢製作所	1,000	987.00	987,000
日東電工	4,800	9,390.00	45,072,000
レック	800	1,315.00	1,052,000
三光合成	800	399.00	319,200
きもと	1,100	177.00	194,700
藤森工業	600	4,760.00	2,856,000
前澤化成工業	400	987.00	394,800
未来工業	400	1,741.00	696,400
ウェーブロックホールディングス	200	765.00	153,000
J S P	400	1,793.00	717,200
エフピコ	1,500	4,335.00	6,502,500
天馬	500	2,083.00	1,041,500
信越ポリマー	1,300	971.00	1,262,300
東リ	1,700	246.00	418,200
ニフコ	2,600	4,150.00	10,790,000
バルカー	600	2,099.00	1,259,400
ユニ・チャーム	14,900	5,005.00	74,574,500
ショーエイコーポレーション	100	1,014.00	101,400
協和キリン	7,100	2,835.00	20,128,500
武田薬品工業	58,400	3,695.00	215,788,000
アステラス製薬	60,900	1,622.50	98,810,250
大日本住友製薬	5,200	1,577.00	8,200,400
塩野義製薬	8,800	5,841.00	51,400,800
わかもと製薬	900	244.00	219,600
あすか製薬	800	1,594.00	1,275,200
日本新薬	1,800	7,430.00	13,374,000
バイオフェルミン製薬	100	2,515.00	251,500
中外製薬	22,000	5,535.00	121,770,000
科研製薬	1,200	4,095.00	4,914,000
エーザイ	8,400	7,357.00	61,798,800
ロート製薬	3,600	3,040.00	10,944,000
小野薬品工業	16,100	3,127.00	50,344,700
久光製薬	1,900	6,370.00	12,103,000
持田製薬	1,000	3,945.00	3,945,000
参天製薬	13,100	1,686.00	22,086,600
扶桑薬品工業	200	2,766.00	553,200
日本ケミファ	100	2,234.00	223,400
ツムラ	2,200	3,300.00	7,260,000
日医工	2,000	1,009.00	2,018,000
キッセイ薬品工業	1,200	2,270.00	2,724,000
生化学工業	1,400	1,044.00	1,461,600

栄研化学	1,200	2,061.00	2,473,200
日水製薬	300	1,007.00	302,100
鳥居薬品	400	3,270.00	1,308,000
JCRファーマ	2,000	2,510.00	5,020,000
東和薬品	900	1,934.00	1,740,600
富士製薬工業	500	1,226.00	613,000
沢井製薬	1,400	4,780.00	6,692,000
ゼリア新薬工業	1,300	1,919.00	2,494,700
第一三共	60,300	3,645.00	219,793,500
キョーリン製薬ホールディングス	1,600	1,967.00	3,147,200
大幸薬品	900	1,663.00	1,496,700
ダイト	400	3,820.00	1,528,000
大塚ホールディングス	14,600	4,405.00	64,313,000
大正製薬ホールディングス	1,500	7,300.00	10,950,000
ペプチドリーム	3,600	5,840.00	21,024,000
日本コークス工業	5,900	97.00	572,300
ニチレキ	800	1,600.00	1,280,000
ユシロ化学工業	400	1,112.00	444,800
ピーピー・カストロール	300	1,240.00	372,000
富士石油	1,800	182.00	327,600
MORESCO	200	1,033.00	206,600
出光興産	7,800	2,342.00	18,267,600
ENEOSホールディングス	105,700	405.60	42,871,920
コスモエネルギーホールディングス	2,000	2,002.00	4,004,000
横浜ゴム	4,100	1,608.00	6,592,800
TOYO TIRE	3,700	1,630.00	6,031,000
ブリヂストン	18,700	3,637.00	68,011,900
住友ゴム工業	6,300	938.00	5,909,400
藤倉コンポジット	600	385.00	231,000
オカモト	400	4,055.00	1,622,000
フコク	300	687.00	206,100
ニッタ	800	2,262.00	1,809,600
住友理工	1,400	595.00	833,000
三ツ星ベルト	900	1,738.00	1,564,200
バンドー化学	1,200	671.00	805,200
日東紡績	1,000	4,620.00	4,620,000
AGC	6,500	3,725.00	24,212,500
日本板硝子	3,400	493.00	1,676,200
石塚硝子	100	1,912.00	191,200
日本山村硝子	300	862.00	258,600
日本電気硝子	2,600	2,308.00	6,000,800
オハラ	300	1,959.00	587,700

住友大阪セメント	1,300	3,120.00	4,056,000
太平洋セメント	4,400	2,781.00	12,236,400
日本ヒューム	700	812.00	568,400
日本コンクリート工業	1,500	321.00	481,500
三谷セキサン	300	4,490.00	1,347,000
アジアパイルホールディングス	1,000	477.00	477,000
東海カーボン	6,900	1,342.00	9,259,800
日本カーボン	400	3,935.00	1,574,000
東洋炭素	400	2,000.00	800,000
ノリタケカンパニーリミテド	400	3,115.00	1,246,000
TOTO	5,000	6,200.00	31,000,000
日本碍子	8,400	1,727.00	14,506,800
日本特殊陶業	5,300	1,892.00	10,027,600
ダントーホールディングス	500	471.00	235,500
MARUWA	300	11,790.00	3,537,000
品川リフラクトリーズ	200	2,613.00	522,600
黒崎播磨	100	4,625.00	462,500
ヨータイ	600	841.00	504,600
イソライト工業	400	508.00	203,200
東京窯業	900	357.00	321,300
ニッカトー	300	868.00	260,400
フジインコーポレーテッド	600	3,910.00	2,346,000
クニミネ工業	300	1,276.00	382,800
エーアンドエーマテリアル	100	1,033.00	103,300
ニチアス	1,900	2,486.00	4,723,400
ニチハ	1,000	3,325.00	3,325,000
日本製鉄	31,100	1,458.00	45,343,800
神戸製鋼所	12,700	570.00	7,239,000
中山製鋼所	1,000	409.00	409,000
合同製鐵	400	2,051.00	820,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	18,800	1,094.00	20,567,200
東京製鐵	3,400	697.00	2,369,800
共英製鋼	800	1,484.00	1,187,200
大和工業	1,500	2,924.00	4,386,000
東京鐵鋼	300	2,138.00	641,400
大阪製鐵	400	1,251.00	500,400
淀川製鋼所	900	2,135.00	1,921,500
丸一鋼管	2,200	2,371.00	5,216,200
モリ工業	200	2,401.00	480,200
大同特殊鋼	1,100	4,660.00	5,126,000
日本高周波鋼業	200	344.00	68,800
日本冶金工業	600	1,817.00	1,090,200

山陽特殊製鋼	500	1,407.00	703,500
愛知製鋼	400	3,295.00	1,318,000
日立金属	7,500	1,575.00	11,812,500
日本金属	100	1,430.00	143,000
大太平洋金属	500	2,378.00	1,189,000
新日本電工	4,500	306.00	1,377,000
栗本鐵工所	300	1,680.00	504,000
虹技	100	1,090.00	109,000
日本鑄鉄管	100	1,245.00	124,500
三菱製鋼	500	727.00	363,500
日亜鋼業	1,000	295.00	295,000
日本精線	100	3,935.00	393,500
エンビプロ・ホールディングス	300	653.00	195,900
シンニッタン	1,000	214.00	214,000
新家工業	200	1,233.00	246,600
大紀アルミニウム工業所	1,100	794.00	873,400
日本軽金属ホールディングス	1,800	2,029.00	3,652,200
三井金属鉱業	1,900	4,090.00	7,771,000
東邦亜鉛	400	2,558.00	1,023,200
三菱マテリアル	4,600	2,379.00	10,943,400
住友金属鉱山	8,900	5,142.00	45,763,800
D O W Aホールディングス	1,800	4,130.00	7,434,000
古河機械金属	1,200	1,282.00	1,538,400
エス・サイエンス	2,900	39.00	113,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	700	880.00	616,000
東邦チタニウム	1,200	990.00	1,188,000
U A C J	1,100	2,009.00	2,209,900
C Kサンエツ	100	3,840.00	384,000
古河電気工業	2,200	2,925.00	6,435,000
住友電気工業	26,000	1,488.50	38,701,000
フジクラ	8,400	492.00	4,132,800
昭和電線ホールディングス	800	1,861.00	1,488,800
東京特殊電線	100	2,488.00	248,800
タツタ電線	1,400	761.00	1,065,400
カナレ電気	100	1,686.00	168,600
平河ヒューテック	300	1,437.00	431,100
リョービ	800	1,285.00	1,028,000
アーレスティ	900	371.00	333,900
アサヒホールディングス	1,200	3,980.00	4,776,000
稲葉製作所	400	1,419.00	567,600
宮地エンジニアリンググループ	200	2,511.00	502,200
トーカロ	1,900	1,504.00	2,857,600

アルファＣｏ	200	1,044.00	208,800
SUMCO	8,900	2,347.00	20,888,300
川田テクノロジーズ	100	4,325.00	432,500
RS Technologies	200	6,140.00	1,228,000
ジェイテックコーポレーション	100	3,710.00	371,000
信和	400	702.00	280,800
東洋製罐グループホールディングス	4,400	1,164.00	5,121,600
ホッカンホールディングス	400	1,466.00	586,400
コロナ	400	1,007.00	402,800
横河ブリッジホールディングス	1,300	2,130.00	2,769,000
駒井ハルテック	100	2,647.00	264,700
三和ホールディングス	6,600	1,249.00	8,243,400
文化シャッター	2,100	1,000.00	2,100,000
三協立山	900	832.00	748,800
アルインコ	500	952.00	476,000
東洋シャッター	200	680.00	136,000
LIXIL	10,300	2,440.00	25,132,000
日本フィルコン	500	535.00	267,500
ノーリツ	1,400	1,640.00	2,296,000
長府製作所	700	2,189.00	1,532,300
リンナイ	1,400	12,010.00	16,814,000
ダイニチ工業	400	981.00	392,400
日東精工	900	455.00	409,500
三洋工業	100	1,941.00	194,100
岡部	1,400	782.00	1,094,800
ジーテクト	900	1,547.00	1,392,300
東プレ	1,300	1,567.00	2,037,100
高周波熱錬	1,300	494.00	642,200
東京製綱	500	877.00	438,500
サンコール	500	469.00	234,500
モリテック スチール	500	467.00	233,500
パイオラックス	1,000	1,599.00	1,599,000
エイチワン	700	853.00	597,100
日本発條	7,400	744.00	5,505,600
中央発條	100	2,950.00	295,000
アドバネクス	100	1,308.00	130,800
立川ブラインド工業	300	1,332.00	399,600
三益半導体工業	500	2,707.00	1,353,500
日本ドライケミカル	200	1,585.00	317,000
日本製鋼所	2,100	3,345.00	7,024,500
三浦工業	3,000	6,160.00	18,480,000
タクマ	2,400	2,083.00	4,999,200

ツガミ	1,400	1,616.00	2,262,400
オークマ	800	6,120.00	4,896,000
芝浦機械	800	2,367.00	1,893,600
アマダ	8,600	1,180.00	10,148,000
アイダエンジニアリング	1,800	1,002.00	1,803,600
滝澤鉄工所	200	1,030.00	206,000
F U J I	3,000	2,833.00	8,499,000
牧野フライス製作所	800	4,260.00	3,408,000
オーエスジー	3,400	2,065.00	7,021,000
ダイジェット工業	100	1,356.00	135,600
旭ダイヤモンド工業	1,800	472.00	849,600
D M G 森精機	4,400	1,682.00	7,400,800
ソディック	1,500	911.00	1,366,500
ディスコ	900	36,100.00	32,490,000
日東工器	400	1,817.00	726,800
日進工具	300	2,577.00	773,100
パンチ工業	600	436.00	261,600
富士ダイス	300	660.00	198,000
豊和工業	400	905.00	362,000
O K K	300	424.00	127,200
石川製作所	200	1,749.00	349,800
東洋機械金属	500	430.00	215,000
津田駒工業	100	910.00	91,000
エンシュウ	200	924.00	184,800
島精機製作所	1,100	1,755.00	1,930,500
オプトラン	900	2,217.00	1,995,300
N C ホールディングス	200	560.00	112,000
イワキポンプ	400	836.00	334,400
フリー	700	1,125.00	787,500
ヤマシンフィルタ	1,600	1,115.00	1,784,000
日阪製作所	900	908.00	817,200
やまびこ	1,300	1,322.00	1,718,600
平田機工	300	8,070.00	2,421,000
ペガサスミシン製造	700	331.00	231,700
マルマエ	300	1,266.00	379,800
タツモ	300	1,429.00	428,700
ナブテスコ	4,100	4,880.00	20,008,000
三井海洋開発	700	2,063.00	1,444,100
レオン自動機	700	1,238.00	866,600
S M C	2,200	68,200.00	150,040,000
ホソカワミクロン	200	6,400.00	1,280,000
ユニオンツール	300	3,115.00	934,500

オイレス工業	900	1,661.00	1,494,900
日精エー・エス・ピー機械	200	6,790.00	1,358,000
サトーホールディングス	1,000	2,258.00	2,258,000
技研製作所	600	4,255.00	2,553,000
日本エアータック	200	1,650.00	330,000
カワタ	200	1,004.00	200,800
日精樹脂工業	600	950.00	570,000
オカダアイヨン	200	1,160.00	232,000
ワイエイシイホールディングス	300	1,173.00	351,900
小松製作所	31,800	3,052.00	97,053,600
住友重機械工業	4,000	2,793.00	11,172,000
日立建機	2,800	3,100.00	8,680,000
日工	1,000	718.00	718,000
巴工業	300	2,028.00	608,400
井関農機	700	1,415.00	990,500
TOWA	700	2,165.00	1,515,500
丸山製作所	200	1,543.00	308,600
北川鉄工所	300	1,373.00	411,900
ローツェ	300	7,300.00	2,190,000
タカキタ	300	741.00	222,300
クボタ	36,900	2,269.50	83,744,550
荏原実業	200	4,050.00	810,000
三菱化工機	200	3,320.00	664,000
月島機械	1,300	1,480.00	1,924,000
帝国電機製作所	600	1,213.00	727,800
東京機械製作所	300	279.00	83,700
新東工業	1,700	784.00	1,332,800
澁谷工業	600	3,680.00	2,208,000
アイチ コーポレーション	1,200	920.00	1,104,000
小森コーポレーション	1,800	725.00	1,305,000
鶴見製作所	500	1,814.00	907,000
住友精密工業	100	2,030.00	203,000
日本ギア工業	300	295.00	88,500
酒井重工業	100	2,326.00	232,600
荏原製作所	2,900	3,595.00	10,425,500
石井鐵工所	100	2,881.00	288,100
西島製作所	700	867.00	606,900
北越工業	700	1,091.00	763,700
ダイキン工業	8,900	23,420.00	208,438,000
オルガノ	300	6,320.00	1,896,000
トーヨーカネツ	300	2,222.00	666,600
栗田工業	3,800	4,395.00	16,701,000

椿本チエイン	1,000	2,854.00	2,854,000
大同工業	300	745.00	223,500
木村化工機	600	613.00	367,800
アネスト岩田	1,100	1,101.00	1,211,100
ダイフク	3,600	13,110.00	47,196,000
サムコ	200	3,750.00	750,000
加藤製作所	400	960.00	384,000
油研工業	100	1,530.00	153,000
タダノ	3,400	944.00	3,209,600
フジテック	2,500	2,359.00	5,897,500
C K D	1,900	2,499.00	4,748,100
キトー	500	1,593.00	796,500
平和	2,000	1,426.00	2,852,000
理想科学工業	600	1,436.00	861,600
S A N K Y O	1,600	2,793.00	4,468,800
日本金銭機械	800	530.00	424,000
マースグループホールディングス	400	1,557.00	622,800
フクシマガリレイ	400	4,435.00	1,774,000
オーイズミ	300	419.00	125,700
ダイコク電機	300	886.00	265,800
竹内製作所	1,200	2,632.00	3,158,400
アマノ	1,800	2,451.00	4,411,800
J U K I	1,000	529.00	529,000
サンデンホールディングス	900	365.00	328,500
蛇の目ミシン工業	600	846.00	507,600
マックス	1,100	1,433.00	1,576,300
グローリー	1,800	2,074.00	3,733,200
新晃工業	600	1,763.00	1,057,800
大和冷機工業	1,100	1,048.00	1,152,800
セガサミーホールディングス	7,000	1,603.00	11,221,000
日本ピストンリング	300	953.00	285,900
リケン	300	2,149.00	644,700
T P R	900	1,495.00	1,345,500
ツバキ・ナカシマ	1,300	1,223.00	1,589,900
ホシザキ	2,200	9,360.00	20,592,000
大豊工業	600	763.00	457,800
日本精工	13,200	924.00	12,196,800
N T N	16,200	263.00	4,260,600
ジェイテクト	6,700	874.00	5,855,800
不二越	600	4,550.00	2,730,000
日本トムソン	2,100	438.00	919,800
T H K	4,400	3,685.00	16,214,000

ユーシン精機	600	956.00	573,600
前澤給装工業	300	2,334.00	700,200
イーグル工業	900	1,015.00	913,500
前澤工業	500	471.00	235,500
日本ピラー工業	700	1,603.00	1,122,100
キット	2,600	665.00	1,729,000
マキタ	9,200	5,150.00	47,380,000
日立造船	5,600	679.00	3,802,400
三菱重工業	11,800	3,287.00	38,786,600
I H I	5,100	2,081.00	10,613,100
スター精密	1,100	1,638.00	1,801,800
日清紡ホールディングス	4,300	770.00	3,311,000
イビデン	4,300	4,885.00	21,005,500
コニカミノルタ	15,300	398.00	6,089,400
ブラザー工業	8,600	2,286.00	19,659,600
ミネベアミツミ	13,000	2,179.00	28,327,000
日立製作所	33,700	4,321.00	145,617,700
三菱電機	70,200	1,639.00	115,057,800
富士電機	4,200	3,990.00	16,758,000
東洋電機製造	200	1,188.00	237,600
安川電機	7,600	5,480.00	41,648,000
シンフォニアテクノロジー	900	1,498.00	1,348,200
明電舎	1,300	2,664.00	3,463,200
オリジン	200	1,363.00	272,600
山洋電気	300	5,870.00	1,761,000
デンヨー	600	2,229.00	1,337,400
東芝テック	900	3,820.00	3,438,000
芝浦メカトロニクス	100	4,835.00	483,500
マブチモーター	1,900	4,290.00	8,151,000
日本電産	16,900	14,025.00	237,022,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	400	450.00	180,000
トレックス・セミコンダクター	400	1,416.00	566,400
東光高岳	400	1,708.00	683,200
ダブル・スコープ	1,200	1,033.00	1,239,600
宮越ホールディングス	300	720.00	216,000
ダイヘン	800	5,030.00	4,024,000
ヤーマン	1,100	1,940.00	2,134,000
JVCケンウッド	5,700	169.00	963,300
ミマキエンジニアリング	600	481.00	288,600
I - P E X	300	1,987.00	596,100
日新電機	1,700	1,335.00	2,269,500
大崎電気工業	1,400	613.00	858,200

オムロン	6,300	9,540.00	60,102,000
日東工業	1,000	2,090.00	2,090,000
I D E C	1,000	1,889.00	1,889,000
正興電機製作所	200	2,295.00	459,000
不二電機工業	100	1,309.00	130,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,300	3,235.00	7,440,500
サクサホールディングス	200	1,396.00	279,200
メルコホールディングス	200	3,470.00	694,000
テクノメディカ	100	1,609.00	160,900
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	200	1,354.00	270,800
日本電気	8,500	5,700.00	48,450,000
富士通	6,800	15,755.00	107,134,000
沖電気工業	2,900	1,012.00	2,934,800
岩崎通信機	300	852.00	255,600
電気興業	300	2,697.00	809,100
サンケン電気	800	4,945.00	3,956,000
ナカヨ	200	1,460.00	292,000
アイホン	400	1,699.00	679,600
ルネサスエレクトロニクス	30,200	1,149.00	34,699,800
セイコーエプソン	8,700	1,545.00	13,441,500
ワコム	4,700	949.00	4,460,300
アルバック	1,300	4,720.00	6,136,000
アクセル	300	733.00	219,900
E I Z O	500	3,565.00	1,782,500
ジャパンディスプレイ	19,700	46.00	906,200
日本信号	1,800	967.00	1,740,600
京三製作所	1,600	433.00	692,800
能美防災	900	2,246.00	2,021,400
ホーチキ	500	1,300.00	650,000
星和電機	300	712.00	213,600
エレコム	800	5,300.00	4,240,000
パナソニック	80,200	1,289.50	103,417,900
シャープ	8,100	1,700.00	13,770,000
アンリツ	4,500	2,455.00	11,047,500
富士通ゼネラル	1,900	2,781.00	5,283,900
ソニー	44,000	10,715.00	471,460,000
T D K	3,400	16,340.00	55,556,000
帝国通信工業	300	1,037.00	311,100
タムラ製作所	2,300	573.00	1,317,900
アルプスアルパイン	6,200	1,414.00	8,766,800
池上通信機	200	868.00	173,600
日本電波工業	600	656.00	393,600

鈴木	300	1,182.00	354,600
日本トリム	100	4,195.00	419,500
ローランド ディー・ジー	400	1,876.00	750,400
フォスター電機	700	1,379.00	965,300
S M K	200	3,095.00	619,000
ヨコオ	500	3,065.00	1,532,500
ティアック	500	111.00	55,500
ホシデン	1,900	994.00	1,888,600
ヒロセ電機	1,100	15,730.00	17,303,000
日本航空電子工業	1,600	1,583.00	2,532,800
T O A	800	896.00	716,800
マクセルホールディングス	1,500	1,374.00	2,061,000
古野電気	900	1,238.00	1,114,200
ユニデンホールディングス	200	2,222.00	444,400
スミダコーポレーション	600	1,070.00	642,000
アイコム	400	2,731.00	1,092,400
リオン	300	3,445.00	1,033,500
本多通信工業	600	490.00	294,000
船井電機	700	421.00	294,700
横河電機	6,400	2,271.00	14,534,400
新電元工業	200	2,629.00	525,800
アズビル	4,400	5,980.00	26,312,000
東亜ディーケーケー	300	834.00	250,200
日本光電工業	2,900	3,250.00	9,425,000
チノー	200	1,519.00	303,800
共和電業	700	390.00	273,000
日本電子材料	300	2,098.00	629,400
堀場製作所	1,400	6,390.00	8,946,000
アドバンテスト	5,200	8,430.00	43,836,000
小野測器	300	520.00	156,000
エスベック	600	2,045.00	1,227,000
キーエンス	6,400	58,770.00	376,128,000
日置電機	300	4,250.00	1,275,000
シスメックス	5,000	13,215.00	66,075,000
日本マイクロニクス	1,200	1,395.00	1,674,000
メガチップス	700	3,065.00	2,145,500
O B A R A G R O U P	400	4,115.00	1,646,000
澤藤電機	100	2,198.00	219,800
原田工業	300	854.00	256,200
コーセル	900	1,306.00	1,175,400
イリソ電子工業	600	4,305.00	2,583,000
オプテックスグループ	1,200	1,887.00	2,264,400

千代田インテグレ	300	1,833.00	549,900
アイ・オー・データ機器	200	1,053.00	210,600
レーザーテック	3,100	14,400.00	44,640,000
スタンレー電気	4,900	3,420.00	16,758,000
岩崎電気	300	1,439.00	431,700
ウシオ電機	3,900	1,344.00	5,241,600
岡谷電機産業	600	394.00	236,400
ハリオス テクノ ホールディング	600	322.00	193,200
エノモト	200	1,488.00	297,600
日本セラミック	700	3,035.00	2,124,500
遠藤照明	300	522.00	156,600
古河電池	500	1,817.00	908,500
双信電機	300	469.00	140,700
山一電機	500	1,563.00	781,500
図研	500	2,792.00	1,396,000
日本電子	1,400	5,000.00	7,000,000
カシオ計算機	6,200	1,807.00	11,203,400
ファナック	6,600	27,155.00	179,223,000
日本シイエムケイ	1,700	442.00	751,400
エンプラス	400	4,205.00	1,682,000
大真空	300	2,638.00	791,400
ローム	2,900	10,610.00	30,769,000
浜松ホトニクス	5,000	6,140.00	30,700,000
三井ハイテック	800	4,370.00	3,496,000
新光電気工業	2,400	2,556.00	6,134,400
京セラ	9,900	6,570.00	65,043,000
太陽誘電	3,100	5,190.00	16,089,000
村田製作所	20,600	10,070.00	207,442,000
双葉電子工業	1,100	932.00	1,025,200
北陸電気工業	300	907.00	272,100
ニチコン	2,400	1,445.00	3,468,000
日本ケミコン	600	2,022.00	1,213,200
K O A	1,100	1,556.00	1,711,600
市光工業	1,100	704.00	774,400
小糸製作所	4,200	7,080.00	29,736,000
ミツバ	1,300	471.00	612,300
S C R E E Nホールディングス	1,200	7,950.00	9,540,000
キャノン電子	600	1,504.00	902,400
キャノン	34,900	1,995.00	69,625,500
リコー	17,900	694.00	12,422,600
象印マホービン	1,900	1,837.00	3,490,300
M U T O Hホールディングス	100	1,522.00	152,200

東京エレクトロン	4,500	40,680.00	183,060,000	
トヨタ紡織	2,000	1,700.00	3,400,000	
芦森工業	100	955.00	95,500	
ユニプレス	1,400	1,048.00	1,467,200	
豊田自動織機	5,700	8,400.00	47,880,000	
モリタホールディングス	1,200	1,769.00	2,122,800	
三櫻工業	900	944.00	849,600	
デンソー	15,500	6,199.00	96,084,500	
東海理化電機製作所	1,800	1,773.00	3,191,400	
三井E & Sホールディングス	2,500	378.00	945,000	
川崎重工業	5,500	2,527.00	13,898,500	
名村造船所	2,300	185.00	425,500	
サノヤスホールディングス	800	168.00	134,400	
日本車輛製造	300	2,525.00	757,500	
三菱ロジスネクスト	900	1,340.00	1,206,000	
近畿車輛	100	1,300.00	130,000	
日産自動車	82,800	544.10	45,051,480	
いすゞ自動車	20,300	1,014.00	20,584,200	
トヨタ自動車	78,300	7,939.00	621,623,700	
日野自動車	8,800	931.00	8,192,800	
三菱自動車工業	26,000	230.00	5,980,000	
エフテック	500	660.00	330,000	
レシップホールディングス	300	503.00	150,900	
G M B	100	852.00	85,200	
ファルテック	100	640.00	64,000	
武蔵精密工業	1,600	1,769.00	2,830,400	
日産車体	1,400	877.00	1,227,800	
新明和工業	1,900	900.00	1,710,000	
極東開発工業	1,300	1,459.00	1,896,700	
トピー工業	600	1,265.00	759,000	
ティラド	200	1,372.00	274,400	
曙ブレーキ工業	3,800	127.00	482,600	
タチエス	1,200	1,232.00	1,478,400	
N O K	3,800	1,178.00	4,476,400	
フタバ産業	1,900	538.00	1,022,200	
K Y B	800	2,357.00	1,885,600	
大同メタル工業	1,300	523.00	679,900	
プレス工業	3,500	311.00	1,088,500	
ミクニ	900	275.00	247,500	
太平洋工業	1,500	1,178.00	1,767,000	
河西工業	900	394.00	354,600	
アイシン精機	5,800	3,205.00	18,589,000	

マツダ	20,700	745.00	15,421,500
今仙電機製作所	700	747.00	522,900
本田技研工業	55,300	2,933.50	162,222,550
スズキ	13,900	5,140.00	71,446,000
S U B A R U	21,800	2,110.00	45,998,000
安永	300	1,262.00	378,600
ヤマハ発動機	9,900	2,156.00	21,344,400
T B K	800	470.00	376,000
エクセディ	900	1,324.00	1,191,600
豊田合成	2,300	3,010.00	6,923,000
愛三工業	1,100	564.00	620,400
盟和産業	100	901.00	90,100
日本プラスト	500	494.00	247,000
ヨロズ	700	1,159.00	811,300
エフ・シー・シー	1,200	1,779.00	2,134,800
シマノ	2,600	24,450.00	63,570,000
テイ・エス テック	1,600	3,165.00	5,064,000
ジャムコ	400	637.00	254,800
テルモ	19,900	4,346.00	86,485,400
クリエートメディック	200	1,016.00	203,200
日機装	2,300	1,029.00	2,366,700
日本エム・ディ・エム	400	2,468.00	987,200
島津製作所	8,400	4,020.00	33,768,000
J M S	600	969.00	581,400
クボテック	200	380.00	76,000
長野計器	500	994.00	497,000
ブイ・テクノロジー	300	6,390.00	1,917,000
東京計器	400	953.00	381,200
愛知時計電機	100	4,390.00	439,000
インターアクション	400	1,948.00	779,200
オーバル	600	327.00	196,200
東京精密	1,300	5,150.00	6,695,000
マニー	2,800	2,850.00	7,980,000
ニコン	10,700	751.00	8,035,700
トプコン	3,500	1,419.00	4,966,500
オリンパス	38,900	2,097.00	81,573,300
理研計器	600	3,150.00	1,890,000
タムロン	600	1,940.00	1,164,000
H O Y A	13,900	14,075.00	195,642,500
シード	300	623.00	186,900
ノーリツ鋼機	500	2,287.00	1,143,500
エー・アンド・デイ	600	1,327.00	796,200

朝日インテック	8,000	3,690.00	29,520,000
シチズン時計	8,200	311.00	2,550,200
リズム	200	651.00	130,200
大研医器	500	567.00	283,500
メニコン	1,000	6,590.00	6,590,000
シンシア	100	640.00	64,000
松風	300	1,923.00	576,900
セイコーホールディングス	1,000	1,355.00	1,355,000
ニプロ	4,900	1,225.00	6,002,500
中本パックス	200	1,657.00	331,400
スノーピーク	400	1,763.00	705,200
パラマウントベッドホールディングス	700	4,710.00	3,297,000
トランザクション	400	951.00	380,400
粧美堂	200	399.00	79,800
ニホンフラッシュ	700	1,314.00	919,800
前田工織	800	2,774.00	2,219,200
永大産業	900	279.00	251,100
アートネイチャー	800	661.00	528,800
バンダイナムコホールディングス	7,300	9,025.00	65,882,500
アイフィスジャパン	200	729.00	145,800
共立印刷	1,100	118.00	129,800
S H O E I	600	4,005.00	2,403,000
フランスベッドホールディングス	1,000	940.00	940,000
パイロットコーポレーション	1,200	2,987.00	3,584,400
萩原工業	400	1,505.00	602,000
トッパン・フォームズ	1,500	1,077.00	1,615,500
フジシールインターナショナル	1,600	2,035.00	3,256,000
タカラトミー	3,100	899.00	2,786,900
廣済堂	500	729.00	364,500
エステールホールディングス	200	621.00	124,200
タカノ	300	595.00	178,500
プロネクサス	600	1,077.00	646,200
ホクシン	400	113.00	45,200
ウッドワン	200	1,066.00	213,200
大建工業	500	1,710.00	855,000
凸版印刷	9,900	1,504.00	14,889,600
大日本印刷	9,200	1,938.00	17,829,600
共同印刷	200	3,230.00	646,000
N I S S H A	1,400	1,465.00	2,051,000
光村印刷	100	1,786.00	178,600
T A K A R A & C O M P A N Y	300	1,763.00	528,900
アシックス	6,200	1,941.00	12,034,200

ツツミ	200	2,186.00	437,200
小松ウオール工業	200	1,762.00	352,400
ヤマハ	4,200	6,200.00	26,040,000
河合楽器製作所	200	3,155.00	631,000
クリナップ	600	483.00	289,800
ピジョン	4,500	4,380.00	19,710,000
オリバー	100	2,482.00	248,200
兼松サステック	100	1,799.00	179,900
キングジム	600	863.00	517,800
リンテック	1,700	2,359.00	4,010,300
イトーキ	1,400	345.00	483,000
任天堂	4,300	65,370.00	281,091,000
三菱鉛筆	1,200	1,376.00	1,651,200
タカラスタANDARD	1,500	1,562.00	2,343,000
コクヨ	3,400	1,435.00	4,879,000
ナカバヤシ	700	640.00	448,000
グローブライド	300	4,240.00	1,272,000
オカムラ	2,500	947.00	2,367,500
美津濃	600	2,063.00	1,237,800
東京電力ホールディングス	56,000	301.00	16,856,000
中部電力	21,500	1,299.50	27,939,250
関西電力	26,600	1,019.50	27,118,700
中国電力	10,100	1,256.00	12,685,600
北陸電力	6,400	699.00	4,473,600
東北電力	17,500	875.00	15,312,500
四国電力	6,300	718.00	4,523,400
九州電力	14,500	934.00	13,543,000
北海道電力	6,600	399.00	2,633,400
沖縄電力	1,400	1,423.00	1,992,200
電源開発	5,600	1,695.00	9,492,000
エフオン	400	1,278.00	511,200
イーレックス	1,100	1,928.00	2,120,800
レノバ	1,200	4,765.00	5,718,000
東京瓦斯	13,500	2,398.00	32,373,000
大阪瓦斯	13,600	2,120.00	28,832,000
東邦瓦斯	3,500	6,790.00	23,765,000
北海道瓦斯	400	1,568.00	627,200
広島ガス	1,500	380.00	570,000
西部瓦斯	800	3,245.00	2,596,000
静岡ガス	2,000	1,076.00	2,152,000
メタウォーター	700	2,314.00	1,619,800
SBSホールディングス	500	2,514.00	1,257,000

東武鉄道	7,300	3,005.00	21,936,500
相鉄ホールディングス	2,200	2,422.00	5,328,400
東急	17,700	1,230.00	21,771,000
京浜急行電鉄	9,000	1,752.00	15,768,000
小田急電鉄	10,400	3,090.00	32,136,000
京王電鉄	3,700	7,750.00	28,675,000
京成電鉄	4,900	3,330.00	16,317,000
富士急行	1,000	4,390.00	4,390,000
新京成電鉄	200	2,216.00	443,200
東日本旅客鉄道	12,400	6,599.00	81,827,600
西日本旅客鉄道	6,300	5,289.00	33,320,700
東海旅客鉄道	5,800	14,250.00	82,650,000
西武ホールディングス	9,200	966.00	8,887,200
鴻池運輸	1,100	1,006.00	1,106,600
西日本鉄道	1,900	3,015.00	5,728,500
ハマキョウレックス	500	2,943.00	1,471,500
サカイ引越センター	400	5,120.00	2,048,000
近鉄グループホールディングス	6,700	4,460.00	29,882,000
阪急阪神ホールディングス	8,900	3,385.00	30,126,500
南海電気鉄道	3,200	2,518.00	8,057,600
京阪ホールディングス	3,000	4,905.00	14,715,000
神戸電鉄	200	3,630.00	726,000
名古屋鉄道	5,500	2,693.00	14,811,500
山陽電気鉄道	500	1,991.00	995,500
日本通運	2,300	7,060.00	16,238,000
ヤマトホールディングス	11,000	2,711.00	29,821,000
山九	1,900	4,090.00	7,771,000
丸運	400	253.00	101,200
丸全昭和運輸	500	3,625.00	1,812,500
センコーグループホールディングス	3,700	1,034.00	3,825,800
トナミホールディングス	200	6,100.00	1,220,000
ニッコンホールディングス	2,400	2,168.00	5,203,200
日本石油輸送	100	2,606.00	260,600
福山通運	800	4,370.00	3,496,000
セイノーホールディングス	5,000	1,490.00	7,450,000
エスライン	200	917.00	183,400
神奈川中央交通	200	3,935.00	787,000
日立物流	1,200	3,190.00	3,828,000
丸和運輸機関	1,400	2,225.00	3,115,000
C & F ロジホールディングス	700	2,170.00	1,519,000
九州旅客鉄道	5,800	2,180.00	12,644,000
S Gホールディングス	14,000	2,969.00	41,566,000

日本郵船	5,600	2,567.00	14,375,200
商船三井	4,200	3,255.00	13,671,000
川崎汽船	2,100	2,271.00	4,769,100
N Sユナイテッド海運	400	1,421.00	568,400
明治海運	700	399.00	279,300
飯野海運	3,100	446.00	1,382,600
共栄タンカー	100	899.00	89,900
乾汽船	400	978.00	391,200
日本航空	14,900	1,908.00	28,429,200
A N Aホールディングス	16,600	2,184.00	36,254,400
パスコ	100	1,421.00	142,100
トランコム	200	9,730.00	1,946,000
日新	600	1,251.00	750,600
三菱倉庫	2,100	3,155.00	6,625,500
三井倉庫ホールディングス	800	2,380.00	1,904,000
住友倉庫	2,400	1,354.00	3,249,600
澁澤倉庫	400	2,279.00	911,600
東陽倉庫	1,200	323.00	387,600
日本トランスシティ	1,500	554.00	831,000
ケイヒン	100	1,309.00	130,900
中央倉庫	400	1,118.00	447,200
川西倉庫	100	1,133.00	113,300
安田倉庫	600	981.00	588,600
ファイズホールディングス	100	1,092.00	109,200
東洋埠頭	200	1,403.00	280,600
宇徳	600	500.00	300,000
上組	3,700	1,898.00	7,022,600
サンリツ	200	677.00	135,400
キムラユニティー	200	1,101.00	220,200
キューソー流通システム	200	1,615.00	323,000
近鉄エクスプレス	1,400	2,524.00	3,533,600
東海運	400	311.00	124,400
エーアイティー	500	961.00	480,500
内外トランスライン	200	1,239.00	247,800
日本コンセプト	200	1,676.00	335,200
N E C ネットエスアイ	1,900	1,850.00	3,515,000
クロスキャット	200	1,233.00	246,600
システナ	2,500	2,244.00	5,610,000
デジタルアーツ	300	9,710.00	2,913,000
日鉄ソリューションズ	1,000	3,325.00	3,325,000
キューブシステム	400	1,259.00	503,600
エイジア	100	1,886.00	188,600

コア	300	1,486.00	445,800
ラクーンホールディングス	300	1,712.00	513,600
ソリトンシステムズ	300	1,834.00	550,200
ソフトクリエイティブホールディングス	300	2,831.00	849,300
T I S	6,900	2,133.00	14,717,700
J N S ホールディングス	300	531.00	159,300
電算システム	300	3,280.00	984,000
グリー	4,200	603.00	2,532,600
コーエーテクモホールディングス	1,400	6,210.00	8,694,000
三菱総合研究所	300	4,185.00	1,255,500
ボルテージ	200	504.00	100,800
電算	100	2,432.00	243,200
A G S	400	900.00	360,000
ファインデックス	600	1,159.00	695,400
ブレインパッド	200	4,280.00	856,000
K L a b	1,300	911.00	1,184,300
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	800	1,173.00	938,400
イーブックイニシアティブジャパン	100	2,700.00	270,000
ネクソン	17,400	3,260.00	56,724,000
アイスタイル	1,900	397.00	754,300
エムアップホールディングス	200	2,398.00	479,600
エイチーム	500	1,130.00	565,000
エニグモ	600	1,215.00	729,000
テクノスジャパン	500	686.00	343,000
e n i s h	300	452.00	135,600
コロプラ	2,300	961.00	2,210,300
オルトプラス	400	400.00	160,000
ブロードリーフ	3,400	670.00	2,278,000
クロス・マーケティンググループ	300	368.00	110,400
デジタルハーツホールディングス	400	1,241.00	496,400
システム情報	500	1,137.00	568,500
メディアドゥ	200	7,780.00	1,556,000
じげん	1,700	382.00	649,400
ブイキューブ	400	3,450.00	1,380,000
エンカレッジ・テクノロジー	200	746.00	149,200
サイバーリンクス	200	2,364.00	472,800
ディー・エル・イー	500	305.00	152,500
フィックスターズ	700	941.00	658,700
C A R T A H O L D I N G S	300	1,268.00	380,400
オブティム	400	2,831.00	1,132,400
セレス	200	2,609.00	521,800
S H I F T	300	12,400.00	3,720,000

ティーガイア	600	1,937.00	1,162,200
セック	100	2,792.00	279,200
日本アジアグループ	700	837.00	585,900
テクマトリックス	1,000	2,072.00	2,072,000
プロシップ	200	1,561.00	312,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,700	2,413.00	4,102,100
GMOペイメントゲートウェイ	1,500	14,060.00	21,090,000
ザッパラス	300	537.00	161,100
システムリサーチ	200	1,776.00	355,200
インターネットイニシアティブ	2,000	2,109.00	4,218,000
さくらインターネット	700	700.00	490,000
ヴィンクス	200	1,128.00	225,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	200	9,450.00	1,890,000
SRAホールディングス	400	2,594.00	1,037,600
システムインテグレータ	200	625.00	125,000
朝日ネット	500	873.00	436,500
eBASE	800	1,037.00	829,600
アバント	700	1,148.00	803,600
アドソル日進	200	3,370.00	674,000
フリービット	400	910.00	364,000
コムチュア	800	3,015.00	2,412,000
サイバーコム	100	1,640.00	164,000
アステリア	400	1,023.00	409,200
アイル	400	1,491.00	596,400
マークライنز	300	2,545.00	763,500
メディカル・データ・ビジョン	800	2,979.00	2,383,200
gumi	900	829.00	746,100
ショーケース	200	973.00	194,600
モバイルファクトリー	200	973.00	194,600
テラスカイ	200	4,300.00	860,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	300	1,519.00	455,700
PCIホールディングス	300	1,620.00	486,000
パイプドHD	100	1,665.00	166,500
アイビーシー	100	1,093.00	109,300
ネオジャパン	100	1,981.00	198,100
PR TIMES	100	3,740.00	374,000
ランドコンピュータ	100	1,122.00	112,200
ダブルスタンダード	100	4,285.00	428,500
オープンドア	300	1,403.00	420,900
マイネット	200	926.00	185,200
アカツキ	200	4,050.00	810,000
ベネフィットジャパン	100	1,821.00	182,100

Ubicomホールディングス	200	3,815.00	763,000
カナミックネットワーク	600	731.00	438,600
ノムラシステムコーポレーション	300	367.00	110,100
チェンジ	1,000	3,450.00	3,450,000
シンクロ・フード	300	322.00	96,600
オークネット	400	1,371.00	548,400
セグエグループ	200	1,400.00	280,000
エイトレッド	100	2,625.00	262,500
AOI TYO Holdings	700	422.00	295,400
マクロミル	1,400	673.00	942,200
ビーグリー	100	1,870.00	187,000
オロ	200	4,685.00	937,000
ユーザーローカル	100	4,255.00	425,500
テモナ	200	994.00	198,800
ニーズウェル	100	670.00	67,000
サインポスト	100	904.00	90,400
ソルクシーズ	300	991.00	297,300
フェイス	200	840.00	168,000
プロトコーポレーション	600	1,051.00	630,600
ハイマックス	200	1,195.00	239,000
野村総合研究所	9,800	3,895.00	38,171,000
サイバネットシステム	500	976.00	488,000
CEホールディングス	400	581.00	232,400
日本システム技術	100	1,490.00	149,000
インテージホールディングス	900	1,150.00	1,035,000
東邦システムサイエンス	200	936.00	187,200
ソースネクスト	3,300	282.00	930,600
インフォコム	800	3,340.00	2,672,000
HEROZ	100	2,747.00	274,700
ラクスル	600	4,510.00	2,706,000
FIG	800	268.00	214,400
システムサポート	200	1,680.00	336,000
イーソル	400	1,193.00	477,200
アルテリア・ネットワークス	800	1,569.00	1,255,200
EduLab	100	6,840.00	684,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	100	1,393.00	139,300
トピラシステムズ	100	1,347.00	134,700
フォーカスシステムズ	400	937.00	374,800
クレスコ	400	1,283.00	513,200
フジ・メディア・ホールディングス	6,600	1,154.00	7,616,400
オービック	2,400	21,670.00	52,008,000
ジャストシステム	1,100	7,270.00	7,997,000

TDCソフト	600	1,000.00	600,000
Zホールディングス	94,600	694.90	65,737,540
トレンドマイクロ	3,700	5,830.00	21,571,000
IDホールディングス	300	1,248.00	374,400
日本オラクル	1,400	14,070.00	19,698,000
アルファシステムズ	200	3,670.00	734,000
フューチャー	800	1,779.00	1,423,200
CAC Holdings	500	1,399.00	699,500
SBテクノロジー	200	3,565.00	713,000
トーセ	200	834.00	166,800
オービックビジネスコンサルタント	700	6,840.00	4,788,000
伊藤忠テクノソリューションズ	3,100	3,730.00	11,563,000
アイティフォー	800	943.00	754,400
東計電算	100	4,170.00	417,000
エクスネット	100	969.00	96,900
大塚商会	3,700	5,250.00	19,425,000
サイボウズ	800	2,691.00	2,152,800
電通国際情報サービス	900	3,510.00	3,159,000
ACCESS	600	757.00	454,200
デジタルガレージ	1,200	4,005.00	4,806,000
EMシステムズ	1,000	978.00	978,000
ウェザーニューズ	200	5,170.00	1,034,000
CIJ	500	889.00	444,500
ビジネスエンジニアリング	100	3,230.00	323,000
日本エンタープライズ	700	216.00	151,200
WOWOW	300	2,863.00	858,900
スカラ	500	819.00	409,500
インテリジェント ウェイブ	400	720.00	288,000
IMAGICA GROUP	600	342.00	205,200
ネットワンシステムズ	2,600	3,490.00	9,074,000
システムソフト	1,400	91.00	127,400
アルゴグラフィックス	600	3,170.00	1,902,000
マーベラス	1,000	911.00	911,000
エイベックス	1,200	1,123.00	1,347,600
日本ユニシス	2,200	4,060.00	8,932,000
兼松エレクトロニクス	400	4,150.00	1,660,000
都築電気	200	1,645.00	329,000
TBSホールディングス	4,200	1,906.00	8,005,200
日本テレビホールディングス	5,700	1,151.00	6,560,700
朝日放送グループホールディングス	700	706.00	494,200
テレビ朝日ホールディングス	1,900	1,809.00	3,437,100
スカパーJ SATホールディングス	4,500	481.00	2,164,500

テレビ東京ホールディングス	600	2,411.00	1,446,600	
日本BS放送	200	1,140.00	228,000	
ビジョン	900	941.00	846,900	
スマートバリュー	200	935.00	187,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	300	1,419.00	425,700	
ワイヤレスゲート	300	605.00	181,500	
コネクシオ	400	1,454.00	581,600	
日本通信	5,200	171.00	889,200	
クロップス	100	771.00	77,100	
日本電信電話	92,100	2,816.50	259,399,650	
KDDI	50,200	3,204.00	160,840,800	
ソフトバンク	62,600	1,347.00	84,322,200	
光通信	700	21,970.00	15,379,000	
エムティーアイ	700	832.00	582,400	
GMOインターネット	2,500	3,440.00	8,600,000	
ファイバーゲート	200	2,285.00	457,000	
アイドマーケティングコミュニケーション	200	416.00	83,200	
KADOKAWA	1,900	3,415.00	6,488,500	
学研ホールディングス	900	1,710.00	1,539,000	
ゼンリン	1,400	1,276.00	1,786,400	
昭文社ホールディングス	300	458.00	137,400	
インプレスホールディングス	500	172.00	86,000	
アイネット	400	1,592.00	636,800	
松竹	500	14,280.00	7,140,000	
東宝	4,100	4,390.00	17,999,000	
東映	300	17,320.00	5,196,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	18,400	1,485.00	27,324,000	
ピー・シー・エー	100	4,375.00	437,500	
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,682.00	336,400	
DTS	1,500	2,164.00	3,246,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,900	5,950.00	17,255,000	
シーイーシー	700	1,516.00	1,061,200	
カブコン	3,300	6,700.00	22,110,000	
アイ・エス・ビー	300	1,386.00	415,800	
ジャステック	400	1,368.00	547,200	
SCSK	1,600	5,790.00	9,264,000	
日本システムウエア	200	2,134.00	426,800	
アイネス	700	1,422.00	995,400	
TKC	600	7,630.00	4,578,000	
富士ソフト	700	5,180.00	3,626,000	
NSD	2,200	2,161.00	4,754,200	
コナミホールディングス	2,500	5,970.00	14,925,000	

福井コンピュータホールディングス	300	3,885.00	1,165,500
J B C Cホールディングス	500	1,439.00	719,500
ミロク情報サービス	600	2,069.00	1,241,400
ソフトバンクグループ	54,700	7,988.00	436,943,600
ハウスイ	100	1,012.00	101,200
高千穂交易	300	1,222.00	366,600
オルパヘルスケアホールディングス	100	1,435.00	143,500
伊藤忠食品	200	5,480.00	1,096,000
エレマテック	600	1,075.00	645,000
J A L U X	200	1,353.00	270,600
あらた	600	4,910.00	2,946,000
トーメンデバイス	100	3,465.00	346,500
東京エレクトロン デバイス	200	3,300.00	660,000
フィールズ	500	469.00	234,500
双日	38,200	243.00	9,282,600
アルフレッサ ホールディングス	7,700	1,952.00	15,030,400
横浜冷凍	1,800	876.00	1,576,800
神栄	100	1,912.00	191,200
ラサ商事	400	910.00	364,000
アルコニックス	700	1,460.00	1,022,000
神戸物産	4,800	3,065.00	14,712,000
ハイパー	100	545.00	54,500
あい ホールディングス	1,000	2,005.00	2,005,000
ディーブイエックス	200	1,035.00	207,000
ダイワボウホールディングス	600	9,540.00	5,724,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,600	1,952.00	3,123,200
ラクト・ジャパン	300	2,832.00	849,600
グリムス	100	1,871.00	187,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,300	816.00	1,060,800
八洲電機	500	981.00	490,500
メディアスホールディングス	400	810.00	324,000
レスターホールディングス	700	2,282.00	1,597,400
ジュテックホールディングス	100	1,004.00	100,400
大光	300	674.00	202,200
O C H Iホールディングス	200	1,303.00	260,600
T O K A Iホールディングス	3,600	1,022.00	3,679,200
黒谷	200	829.00	165,800
C o m i n i x	100	758.00	75,800
三洋貿易	700	1,013.00	709,100
ビューティガレージ	100	2,552.00	255,200
ウイン・パートナーズ	500	1,193.00	596,500
ミタチ産業	200	592.00	118,400

シップヘルスケアホールディングス	1,100	5,700.00	6,270,000	
明治電機工業	200	1,468.00	293,600	
デリカフーズホールディングス	300	662.00	198,600	
スターティアホールディングス	200	950.00	190,000	
コメダホールディングス	1,500	1,852.00	2,778,000	
ピーバンドットコム	100	1,140.00	114,000	
アセンテック	100	1,863.00	186,300	
富士興産	200	1,030.00	206,000	
協栄産業	100	1,384.00	138,400	
小野建	600	1,255.00	753,000	
南陽	100	1,652.00	165,200	
佐島電機	500	751.00	375,500	
エコートレーディング	100	700.00	70,000	
伯東	400	1,118.00	447,200	
コンドーテック	500	1,126.00	563,000	
中山福	400	541.00	216,400	
ナガイレーベン	900	2,887.00	2,598,300	
三菱食品	800	2,865.00	2,292,000	
松田産業	500	1,850.00	925,000	
第一興商	1,000	3,490.00	3,490,000	
メディバルホールディングス	7,500	2,010.00	15,075,000	
S P K	300	1,272.00	381,600	
萩原電気ホールディングス	300	2,493.00	747,900	
アズワン	500	17,900.00	8,950,000	
スズデン	200	1,243.00	248,600	
尾家産業	200	1,263.00	252,600	
シモジマ	400	1,464.00	585,600	
ドウシシャ	600	1,936.00	1,161,600	
小津産業	100	1,929.00	192,900	
高速	400	1,651.00	660,400	
たけびし	200	1,595.00	319,000	
リックス	200	1,558.00	311,600	
丸文	600	525.00	315,000	
ハビネット	600	1,585.00	951,000	
橋本総業ホールディングス	100	2,717.00	271,700	
日本ライフライン	2,100	1,650.00	3,465,000	
タカショー	400	887.00	354,800	
マルカ	200	2,018.00	403,600	
I D O M	1,900	590.00	1,121,000	
進和	400	2,165.00	866,000	
エスケイジャパン	200	474.00	94,800	
ダイトロン	300	1,601.00	480,300	

シークス	900	1,574.00	1,416,600
田中商事	200	701.00	140,200
オーハシテクニカ	400	1,454.00	581,600
白銅	200	1,448.00	289,600
伊藤忠商事	48,400	3,091.00	149,604,400
丸紅	72,000	727.00	52,344,000
高島	100	1,627.00	162,700
長瀬産業	3,900	1,562.00	6,091,800
蝶理	400	1,585.00	634,000
豊田通商	7,700	4,400.00	33,880,000
三共生興	1,100	490.00	539,000
兼松	2,600	1,325.00	3,445,000
ツカモトコーポレーション	100	1,506.00	150,600
三井物産	59,900	1,983.50	118,811,650
日本紙パルプ商事	400	3,645.00	1,458,000
カメイ	900	1,210.00	1,089,000
東都水産	100	3,845.00	384,500
OUGホールディングス	100	2,877.00	287,700
スターゼン	300	4,290.00	1,287,000
山善	2,700	1,050.00	2,835,000
椿本興業	100	3,900.00	390,000
住友商事	43,600	1,427.50	62,239,000
内田洋行	300	4,440.00	1,332,000
三菱商事	45,300	2,628.00	119,048,400
第一実業	300	4,240.00	1,272,000
キャノンマーケティングジャパン	1,700	2,318.00	3,940,600
西華産業	400	1,412.00	564,800
佐藤商事	600	917.00	550,200
菱洋エレクトロ	700	3,190.00	2,233,000
東京産業	600	615.00	369,000
ユアサ商事	700	3,425.00	2,397,500
神鋼商事	200	1,900.00	380,000
トルク	400	250.00	100,000
阪和興業	1,300	2,907.00	3,779,100
正栄食品工業	400	3,655.00	1,462,000
カナデン	600	1,315.00	789,000
菱電商事	500	1,563.00	781,500
フルサト工業	400	1,292.00	516,800
岩谷産業	1,800	7,110.00	12,798,000
ナイス	300	1,517.00	455,100
昭光通商	200	614.00	122,800
二チモウ	100	1,919.00	191,900

極東貿易	200	1,359.00	271,800
イワキ	900	530.00	477,000
三愛石油	1,700	1,149.00	1,953,300
稲畑産業	1,500	1,434.00	2,151,000
G S Iクレオス	200	1,821.00	364,200
明和産業	600	456.00	273,600
クワザワホールディングス	300	612.00	183,600
ヤマエ久野	500	1,153.00	576,500
ワキタ	1,500	1,044.00	1,566,000
東邦ホールディングス	2,200	1,857.00	4,085,400
サンゲツ	1,900	1,589.00	3,019,100
ミツウロコグループホールディングス	1,000	1,435.00	1,435,000
シナネンホールディングス	300	3,015.00	904,500
伊藤忠エネクス	1,500	1,084.00	1,626,000
サンリオ	1,900	1,447.00	2,749,300
サンワテクノス	500	980.00	490,000
リョーサン	800	1,950.00	1,560,000
新光商事	1,000	765.00	765,000
トーヨー	300	1,886.00	565,800
三信電気	400	2,007.00	802,800
東陽テクニカ	700	1,174.00	821,800
モスフードサービス	900	2,920.00	2,628,000
加賀電子	700	2,383.00	1,668,100
ソーダニッカ	700	543.00	380,100
立花エレテック	500	1,639.00	819,500
フォーバル	300	883.00	264,900
P A L T A C	1,100	5,720.00	6,292,000
三谷産業	900	478.00	430,200
太平洋興発	300	640.00	192,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	200	2,492.00	498,400
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,591.00	159,100
コア商事ホールディングス	100	1,410.00	141,000
国際紙パルプ商事	1,600	249.00	398,400
ヤマタネ	400	1,356.00	542,400
丸紅建材リース	100	1,693.00	169,300
日鉄物産	500	3,860.00	1,930,000
泉州電業	200	3,285.00	657,000
トラスコ中山	1,600	2,797.00	4,475,200
オートバックスセブン	2,600	1,409.00	3,663,400
モリト	500	624.00	312,000
加藤産業	1,000	3,535.00	3,535,000
北恵	200	860.00	172,000

イノテック	300	1,018.00	305,400
イエローハット	1,300	1,669.00	2,169,700
J Kホールディングス	600	833.00	499,800
日伝	600	2,315.00	1,389,000
北沢産業	500	273.00	136,500
杉本商事	400	2,493.00	997,200
因幡電機産業	2,000	2,635.00	5,270,000
東テク	200	2,825.00	565,000
ミスミグループ本社	8,700	3,420.00	29,754,000
アルテック	500	327.00	163,500
タキヒヨー	200	1,919.00	383,800
蔵王産業	100	1,363.00	136,300
スズケン	2,900	3,805.00	11,034,500
ジェコス	500	977.00	488,500
グローセル	700	465.00	325,500
ローソン	1,800	4,920.00	8,856,000
サンエー	600	4,330.00	2,598,000
カワチ薬品	500	3,150.00	1,575,000
エービーシー・マート	1,100	5,690.00	6,259,000
ハードオフコーポレーション	300	764.00	229,200
アスクル	700	3,905.00	2,733,500
ゲオホールディングス	1,200	1,228.00	1,473,600
アダストリア	1,000	1,949.00	1,949,000
ジーフット	400	429.00	171,600
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	402.00	40,200
くら寿司	400	5,830.00	2,332,000
キャンドゥ	300	1,918.00	575,400
パルグループホールディングス	700	1,196.00	837,200
エディオン	3,200	1,029.00	3,292,800
サーラコーポレーション	1,400	591.00	827,400
ワッツ	300	839.00	251,700
ハローズ	300	3,665.00	1,099,500
フジオフードグループ本社	600	1,209.00	725,400
あみやき亭	100	2,920.00	292,000
ひらまつ	1,200	145.00	174,000
大黒天物産	200	6,410.00	1,282,000
ハニーズホールディングス	600	1,011.00	606,600
ファーマライズホールディングス	200	784.00	156,800
アルペン	500	2,324.00	1,162,000
ハブ	200	564.00	112,800
クオールホールディングス	1,000	1,154.00	1,154,000
ジーンズホールディングス	400	6,730.00	2,692,000

ビックカメラ	4,100	1,181.00	4,842,100
D C Mホールディングス	4,200	1,129.00	4,741,800
ペッパーフードサービス	600	246.00	147,600
M o n o t a R O	4,900	5,250.00	25,725,000
東京一番フーズ	200	581.00	116,200
D Dホールディングス	200	525.00	105,000
きちりホールディングス	200	579.00	115,800
アークランドサービスホールディングス	600	2,092.00	1,255,200
J . フロント リテイリング	8,300	822.00	6,822,600
ドトール・日レスホールディングス	1,000	1,463.00	1,463,000
マツモトキヨシホールディングス	2,900	4,425.00	12,832,500
ブロンコビリー	400	2,214.00	885,600
Z O Z O	4,800	2,732.00	13,113,600
トレジャー・ファクトリー	200	695.00	139,000
物語コーポレーション	200	11,420.00	2,284,000
ココカラファイン	700	7,720.00	5,404,000
三越伊勢丹ホールディングス	12,100	601.00	7,272,100
H a m e e	300	1,926.00	577,800
ウエルシアホールディングス	4,100	4,040.00	16,564,000
クリエイトSDホールディングス	1,200	3,990.00	4,788,000
丸善C H Iホールディングス	800	380.00	304,000
ミサワ	100	681.00	68,100
ティーライフ	100	1,162.00	116,200
エー・ピーホールディングス	100	392.00	39,200
チムニー	200	1,138.00	227,600
シュッピン	500	927.00	463,500
オイシックス・ラ・大地	700	3,275.00	2,292,500
ネクステージ	1,200	1,542.00	1,850,400
ジョイフル本田	2,000	1,466.00	2,932,000
鳥貴族	200	1,404.00	280,800
ホットランド	500	1,175.00	587,500
すかいらーくホールディングス	7,800	1,556.00	12,136,800
S F Pホールディングス	400	1,251.00	500,400
綿半ホールディングス	500	1,398.00	699,000
ヨシックス	100	1,865.00	186,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	2,000	1,192.00	2,384,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	300	885.00	265,500
B E E N O S	300	2,846.00	853,800
あさひ	500	1,666.00	833,000
日本調剤	400	1,495.00	598,000
コスモス薬品	600	17,240.00	10,344,000
トーエル	300	811.00	243,300

オンリー	100	428.00	42,800	
セブン&アイ・ホールディングス	27,100	3,992.00	108,183,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,700	593.00	2,194,100	
ツルハホールディングス	1,500	14,980.00	22,470,000	
サンマルクホールディングス	500	1,384.00	692,000	
フェリシモ	200	1,506.00	301,200	
トリドールホールディングス	1,700	1,337.00	2,272,900	
TOKYO BASE	600	476.00	285,600	
ウイルプラスホールディングス	100	712.00	71,200	
JMホールディングス	500	2,346.00	1,173,000	
サツドラホールディングス	100	2,040.00	204,000	
アレンザホールディングス	300	1,265.00	379,500	
串カツ田中ホールディングス	200	1,449.00	289,800	
パロックジャパンリミテッド	500	697.00	348,500	
クスリのアオキホールディングス	600	9,120.00	5,472,000	
力の源ホールディングス	300	549.00	164,700	
スシローグローバルホールディングス	3,800	3,560.00	13,528,000	
メディカルシステムネットワーク	700	650.00	455,000	
はるやまホールディングス	300	688.00	206,400	
ノジマ	1,200	2,794.00	3,352,800	
カッパ・クリエイト	1,000	1,432.00	1,432,000	
ライトオン	500	662.00	331,000	
ジーンズメイト	200	300.00	60,000	
良品計画	9,200	2,356.00	21,675,200	
三城ホールディングス	700	304.00	212,800	
アドヴァン	1,100	1,245.00	1,369,500	
アルビス	300	2,533.00	759,900	
コナカ	800	286.00	228,800	
ハウス オブ ローゼ	100	1,675.00	167,500	
G - 7ホールディングス	400	2,313.00	925,200	
イオン北海道	900	1,043.00	938,700	
コジマ	1,200	714.00	856,800	
ヒマラヤ	300	957.00	287,100	
コーナン商事	1,000	3,280.00	3,280,000	
エコス	300	2,211.00	663,300	
ワタミ	800	838.00	670,400	
マルシェ	200	499.00	99,800	
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	15,200	2,321.00	35,279,200	
西松屋チェーン	1,500	1,549.00	2,323,500	
ゼンショーホールディングス	3,300	2,640.00	8,712,000	
幸楽苑ホールディングス	400	1,544.00	617,600	

ハークスレイ	100	887.00	88,700
サイゼリヤ	1,000	1,869.00	1,869,000
V Tホールディングス	2,900	438.00	1,270,200
魚力	200	1,798.00	359,600
ポブラ	200	402.00	80,400
フジ・コーポレーション	200	2,250.00	450,000
ユナイテッドアローズ	700	1,430.00	1,001,000
ハイデイ日高	1,000	1,607.00	1,607,000
京都きもの友禅	400	219.00	87,600
コロワイド	2,300	1,541.00	3,544,300
ピーシーデポコーポレーション	900	587.00	528,300
壱番屋	500	5,110.00	2,555,000
トップカルチャー	200	353.00	70,600
P L A N T	200	748.00	149,600
スギホールディングス	1,400	7,000.00	9,800,000
薬王堂ホールディングス	300	2,879.00	863,700
ヴィア・ホールディングス	800	218.00	174,400
スクロール	1,100	817.00	898,700
ヨンドシーホールディングス	700	1,967.00	1,376,900
木曽路	900	2,329.00	2,096,100
S R Sホールディングス	800	800.00	640,000
千趣会	1,200	316.00	379,200
タカキュー	500	156.00	78,000
リテールパートナーズ	900	1,565.00	1,408,500
ケーヨー	1,400	744.00	1,041,600
上新電機	800	2,871.00	2,296,800
日本瓦斯	1,000	5,730.00	5,730,000
ロイヤルホールディングス	1,200	1,676.00	2,011,200
いなげや	900	1,862.00	1,675,800
島忠	1,300	5,490.00	7,137,000
チヨダ	700	918.00	642,600
ライフコーポレーション	500	3,800.00	1,900,000
リンガーハット	900	2,249.00	2,024,100
M r M a x H D	1,000	801.00	801,000
テンアライド	600	314.00	188,400
A O K Iホールディングス	1,400	529.00	740,600
オークワ	1,100	1,307.00	1,437,700
コメリ	1,100	3,030.00	3,333,000
青山商事	1,400	585.00	819,000
しまむら	800	11,770.00	9,416,000
はせがわ	400	296.00	118,400
高島屋	5,000	882.00	4,410,000

松屋	1,400	748.00	1,047,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	3,300	699.00	2,306,700
近鉄百貨店	300	3,150.00	945,000
丸井グループ	6,300	1,804.00	11,365,200
アクシアル リテイリング	600	5,260.00	3,156,000
井筒屋	400	175.00	70,000
イオン	26,600	3,376.00	89,801,600
イズミ	1,400	3,925.00	5,495,000
平和堂	1,400	2,216.00	3,102,400
フジ	800	2,040.00	1,632,000
ヤオコー	800	7,200.00	5,760,000
ゼビオホールディングス	800	815.00	652,000
ケーズホールディングス	6,700	1,409.00	9,440,300
Olympicグループ	400	941.00	376,400
日産東京販売ホールディングス	1,000	268.00	268,000
シルバーライフ	100	2,142.00	214,200
一家ダイニングプロジェクト	100	525.00	52,500
Genky DrugStores	300	4,125.00	1,237,500
ナルミヤ・インターナショナル	100	781.00	78,100
ブックオフグループホールディングス	400	849.00	339,600
ギフト	100	1,810.00	181,000
アインホールディングス	800	6,700.00	5,360,000
元気寿司	200	2,269.00	453,800
ヤマダホールディングス	21,100	549.00	11,583,900
アークランドサカモト	1,100	1,652.00	1,817,200
ニトリホールディングス	3,000	22,990.00	68,970,000
グルメ杵屋	500	969.00	484,500
愛眼	600	235.00	141,000
ケーユーホールディングス	400	827.00	330,800
吉野家ホールディングス	2,300	1,919.00	4,413,700
松屋フーズホールディングス	300	3,350.00	1,005,000
サガミホールディングス	900	1,161.00	1,044,900
関西スーパーマーケット	600	1,213.00	727,800
王将フードサービス	500	5,680.00	2,840,000
プレナス	800	1,752.00	1,401,600
ミニストップ	500	1,452.00	726,000
アークス	1,400	2,400.00	3,360,000
バローホールディングス	1,500	2,704.00	4,056,000
藤久	200	785.00	157,000
ベルク	300	6,040.00	1,812,000
大庄	400	958.00	383,200
ファーストリテイリング	900	91,730.00	82,557,000

サンドラッグ	2,600	4,090.00	10,634,000
サックスパー ホールディングス	600	541.00	324,600
ヤマザワ	200	1,770.00	354,000
やまや	100	2,208.00	220,800
ベルーナ	1,500	1,101.00	1,651,500
いちご	8,800	310.00	2,728,000
日本駐車場開発	6,800	147.00	999,600
スター・マイカ・ホールディングス	400	1,372.00	548,800
A Dワークスグループ	1,200	155.00	186,000
ヒューリック	14,700	1,115.00	16,390,500
三栄建築設計	300	1,773.00	531,900
野村不動産ホールディングス	4,200	2,275.00	9,555,000
三重交通グループホールディングス	1,400	511.00	715,400
サムティ	1,000	1,707.00	1,707,000
ディア・ライフ	1,000	414.00	414,000
コーセーアールイー	200	663.00	132,600
日本商業開発	400	1,665.00	666,000
プレサンスコーポレーション	1,100	1,771.00	1,948,100
T H E グローバル社	300	252.00	75,600
ハウスコム	100	1,349.00	134,900
日本管理センター	400	1,186.00	474,400
サンセイランディック	200	740.00	148,000
エストラスト	100	735.00	73,500
フージャースホールディングス	1,400	659.00	922,600
オープンハウス	2,200	3,930.00	8,646,000
東急不動産ホールディングス	18,800	554.00	10,415,200
飯田グループホールディングス	5,800	2,127.00	12,336,600
イーランド	100	807.00	80,700
ムゲンエステート	400	458.00	183,200
ビーロット	300	641.00	192,300
ファーストブラザーズ	100	931.00	93,100
ハウズドゥ	300	1,211.00	363,300
シーアールイー	200	1,296.00	259,200
プロパティエージェント	100	1,448.00	144,800
ケイアイスター不動産	200	2,564.00	512,800
アグレ都市デザイン	100	675.00	67,500
グッドコムアセット	300	1,306.00	391,800
ジェイ・エス・ビー	100	3,400.00	340,000
テンポイノベーション	200	839.00	167,800
グローバル・リンク・マネジメント	100	738.00	73,800
パーク24	3,700	1,788.00	6,615,600
パラカ	200	1,607.00	321,400

三井不動産	33,700	2,104.50	70,921,650
三菱地所	48,500	1,679.00	81,431,500
平和不動産	1,300	3,950.00	5,135,000
東京建物	6,800	1,486.00	10,104,800
ダイビル	1,800	1,274.00	2,293,200
京阪神ビルディング	1,100	1,916.00	2,107,600
住友不動産	15,600	3,169.00	49,436,400
テオオーシー	1,400	727.00	1,017,800
東京楽天地	100	4,180.00	418,000
レオパレス21	8,800	137.00	1,205,600
スターツコーポレーション	900	2,861.00	2,574,900
フジ住宅	800	656.00	524,800
空港施設	700	494.00	345,800
明和地所	400	578.00	231,200
ゴールドクレスト	500	1,608.00	804,000
エスリード	300	1,446.00	433,800
日神グループホールディングス	1,000	415.00	415,000
日本エスコン	1,200	805.00	966,000
タカラレーベン	3,200	312.00	998,400
A V A N T I A	400	884.00	353,600
イオンモール	3,500	1,707.00	5,974,500
毎日コムネット	200	700.00	140,000
ファースト住建	300	1,063.00	318,900
ランド	35,400	9.00	318,600
カチタス	1,700	3,155.00	5,363,500
トーセイ	900	1,097.00	987,300
穴吹興産	100	1,643.00	164,300
サンフロンティア不動産	1,000	885.00	885,000
エフ・ジェー・ネクスト	600	1,001.00	600,600
インテリックス	200	552.00	110,400
ランドビジネス	200	330.00	66,000
サンネクスタグループ	200	968.00	193,600
グランディハウス	600	425.00	255,000
日本空港ビルデング	2,200	6,220.00	13,684,000
明豊ファシリティワークス	300	664.00	199,200
日本工営	400	2,820.00	1,128,000
L I F U L L	2,300	372.00	855,600
ミクシィ	1,300	2,593.00	3,370,900
ジェイエイシーリクルートメント	400	1,801.00	720,400
日本M&Aセンター	5,100	6,510.00	33,201,000
メンバーズ	200	2,663.00	532,600
中広	100	324.00	32,400

UTグループ	1,100	3,125.00	3,437,500
アイティメディア	300	2,227.00	668,100
タケエイ	700	1,359.00	951,300
E・Jホールディングス	200	1,042.00	208,400
ビーネックスグループ	800	1,211.00	968,800
コシダカホールディングス	1,600	440.00	704,000
アルトナー	200	904.00	180,800
パソナグループ	700	2,232.00	1,562,400
CDS	200	1,374.00	274,800
リンクアンドモチベーション	1,200	531.00	637,200
GCA	900	731.00	657,900
エス・エム・エス	2,100	4,220.00	8,862,000
サニーサイドアップグループ	200	632.00	126,400
パーソルホールディングス	6,700	1,921.00	12,870,700
リニカル	300	786.00	235,800
クックパッド	2,100	312.00	655,200
エスクリ	200	314.00	62,800
アイ・ケイ・ケイ	300	623.00	186,900
学情	200	1,356.00	271,200
スタジオアリス	300	1,974.00	592,200
シミックホールディングス	300	1,428.00	428,400
エプロ	200	986.00	197,200
NJS	200	2,055.00	411,000
総合警備保障	2,700	5,430.00	14,661,000
カカクコム	5,000	2,812.00	14,060,000
アイロムグループ	200	1,740.00	348,000
セントケア・ホールディング	400	881.00	352,400
サイネックス	100	666.00	66,600
ルネサンス	400	887.00	354,800
ディップ	900	2,676.00	2,408,400
デジタルホールディングス	500	1,895.00	947,500
新日本科学	700	707.00	494,900
ツクイホールディングス	1,600	540.00	864,000
キャリアデザインセンター	100	977.00	97,700
ベネフィット・ワン	2,400	3,175.00	7,620,000
エムスリー	14,800	10,545.00	156,066,000
ツカダ・グローバルホールディング	500	250.00	125,000
プラス	100	477.00	47,700
アウトソーシング	3,800	1,358.00	5,160,400
ウェルネット	700	445.00	311,500
ワールドホールディングス	200	1,907.00	381,400
ディー・エヌ・エー	2,800	1,841.00	5,154,800

博報堂D Yホールディングス	9,300	1,419.00	13,196,700
ぐるなび	1,200	492.00	590,400
タカミヤ	700	547.00	382,900
ジャパンベストレスキューシステム	500	881.00	440,500
ファンコミュニケーションズ	1,800	408.00	734,400
ライク	200	2,074.00	414,800
ビジネス・ブレークスルー	300	472.00	141,600
エスプール	1,700	782.00	1,329,400
WDBホールディングス	300	2,707.00	812,100
ティア	400	411.00	164,400
C D G	100	1,533.00	153,300
バリューコマース	400	3,400.00	1,360,000
インフォマート	6,800	918.00	6,242,400
J Pホールディングス	2,100	284.00	596,400
エコナックホールディングス	1,100	91.00	100,100
E P Sホールディングス	900	991.00	891,900
レグス	200	1,641.00	328,200
プレステージ・インターナショナル	2,500	933.00	2,332,500
アミューズ	400	2,629.00	1,051,600
ドリームインキュベータ	200	1,407.00	281,400
クイック	400	1,045.00	418,000
T A C	400	249.00	99,600
ケネディクス	5,800	743.00	4,309,400
電通グループ	7,500	3,050.00	22,875,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	300	567.00	170,100
ぴあ	200	2,684.00	536,800
イオンファンタジー	300	2,362.00	708,600
シーティーエス	800	940.00	752,000
ネクシィーズグループ	200	872.00	174,400
H . U . グループホールディングス	1,900	2,866.00	5,445,400
アルプス技研	600	2,042.00	1,225,200
サニックス	1,200	299.00	358,800
ダイオーズ	100	950.00	95,000
日本空調サービス	700	772.00	540,400
オリエンタルランド	7,100	16,120.00	114,452,000
ダスキン	1,700	2,814.00	4,783,800
明光ネットワークジャパン	900	536.00	482,400
ファルコホールディングス	400	1,666.00	666,400
秀英予備校	200	412.00	82,400
田谷	100	539.00	53,900
ラウンドワン	1,900	830.00	1,577,000
リゾートトラスト	3,100	1,484.00	4,600,400

ビー・エム・エル	900	3,465.00	3,118,500
ワタベウェディング	100	275.00	27,500
りらいあコミュニケーションズ	1,200	1,350.00	1,620,000
リソー教育	3,100	311.00	964,100
早稲田アカデミー	300	995.00	298,500
ユー・エス・エス	7,500	2,121.00	15,907,500
東京個別指導学院	300	593.00	177,900
サイバーエージェント	4,100	7,370.00	30,217,000
楽天	31,300	999.00	31,268,700
クリーク・アンド・リバー社	300	1,125.00	337,500
モーニングスター	700	482.00	337,400
テー・オー・ダブリュー	1,100	260.00	286,000
山田コンサルティンググループ	400	977.00	390,800
セントラルスポーツ	200	2,145.00	429,000
フルキャストホールディングス	600	1,578.00	946,800
エン・ジャパン	1,200	3,125.00	3,750,000
リソルホールディングス	100	3,830.00	383,000
テクノプロ・ホールディングス	1,300	9,180.00	11,934,000
アトラ	200	312.00	62,400
インターワークス	100	365.00	36,500
アイ・アールジャパンホールディングス	300	17,220.00	5,166,000
K e e P e r 技研	500	2,308.00	1,154,000
ファーストロジック	100	773.00	77,300
三機サービス	100	979.00	97,900
G u n o s y	400	738.00	295,200
デザインワン・ジャパン	200	204.00	40,800
イー・ガーディアン	300	3,045.00	913,500
リブセンス	400	246.00	98,400
ジャパンマテリアル	2,100	1,436.00	3,015,600
ベクトル	800	984.00	787,200
ウチヤマホールディングス	300	322.00	96,600
チャーム・ケア・コーポレーション	600	1,303.00	781,800
キャリアリンク	200	2,208.00	441,600
I B J	500	765.00	382,500
アサnte	300	1,619.00	485,700
N・フィールド	500	832.00	416,000
バリューHR	300	1,634.00	490,200
M&Aキャピタルパートナーズ	500	5,560.00	2,780,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	300	2,150.00	645,000
E R Iホールディングス	200	620.00	124,000
アピスト	100	2,929.00	292,900
シグマクシス	500	1,731.00	865,500

ウィルグループ	400	970.00	388,000
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	1,000	332.00	332,000
メドピア	300	8,290.00	2,487,000
リクルートホールディングス	48,000	4,437.00	212,976,000
エラン	900	1,476.00	1,328,400
土木管理総合試験所	300	332.00	99,600
ネットマーケティング	300	642.00	192,600
ベルシステム24ホールディングス	1,100	1,682.00	1,850,200
鎌倉新書	500	1,030.00	515,000
S MN	100	754.00	75,400
一蔵	100	339.00	33,900
L I T A L I C O	200	3,885.00	777,000
グローバルキッズCOMPANY	100	928.00	92,800
エアトリ	400	1,274.00	509,600
アトラエ	200	2,784.00	556,800
ストライク	300	4,870.00	1,461,000
ソラスト	1,800	1,523.00	2,741,400
セラク	200	2,396.00	479,200
インソース	600	1,819.00	1,091,400
ベйкаレント・コンサルティング	400	18,360.00	7,344,000
Orchestra Holdings	100	2,096.00	209,600
アイモバイル	200	1,391.00	278,200
キャリアインデックス	300	563.00	168,900
MS - Japan	200	1,051.00	210,200
船場	100	836.00	83,600
グレイステクノロジー	300	6,160.00	1,848,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,500	2,580.00	3,870,000
フルテック	100	1,355.00	135,500
グリーンズ	200	439.00	87,800
ツナググループ・ホールディングス	100	303.00	30,300
GameWith	200	579.00	115,800
ソウルドアウト	200	1,525.00	305,000
MS&Consulting	100	594.00	59,400
エル・ティー・エス	100	3,950.00	395,000
ミダック	100	3,095.00	309,500
日総工産	400	707.00	282,800
キュービーネットホールディングス	300	1,381.00	414,300
RPAホールディングス	500	672.00	336,000
スプリックス	200	779.00	155,800
マネジメントソリューションズ	300	2,031.00	609,300
プロレド・パートナーズ	100	3,490.00	349,000
and factory	100	725.00	72,500

フロンティア・マネジメント	100	2,260.00	226,000
ギークス	100	1,169.00	116,900
カーブスホールディングス	1,800	762.00	1,371,600
フォーラムエンジニアリング	400	901.00	360,400
ダイレクトマーケティングミックス	300	2,712.00	813,600
アドバンテッジリスクマネジメント	400	640.00	256,000
リログループ	3,700	2,481.00	9,179,700
東祥	400	1,538.00	615,200
エイチ・アイ・エス	1,000	1,604.00	1,604,000
ラックランド	200	2,336.00	467,200
共立メンテナンス	1,100	3,840.00	4,224,000
イチネンホールディングス	700	1,287.00	900,900
建設技術研究所	400	2,370.00	948,000
スペース	400	799.00	319,600
長大	300	1,637.00	491,100
燦ホールディングス	300	1,207.00	362,100
スバル興業	100	8,810.00	881,000
東京テアトル	300	1,276.00	382,800
タナベ経営	100	1,347.00	134,700
ナガワ	200	9,930.00	1,986,000
よみうりランド	100	6,040.00	604,000
東京都競馬	400	4,640.00	1,856,000
常磐興産	300	1,395.00	418,500
カナモト	1,200	2,245.00	2,694,000
東京ドーム	2,700	1,298.00	3,504,600
西尾レントオール	600	2,167.00	1,300,200
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	3,500	23.00	80,500
トランス・コスモス	600	2,560.00	1,536,000
乃村工藝社	2,900	850.00	2,465,000
藤田観光	300	1,315.00	394,500
KNT-CTホールディングス	400	928.00	371,200
日本管財	700	2,073.00	1,451,100
トーカイ	600	2,016.00	1,209,600
白洋舎	100	2,471.00	247,100
セコム	7,100	9,650.00	68,515,000
セントラル警備保障	300	3,710.00	1,113,000
丹青社	1,300	806.00	1,047,800
メイテック	800	5,390.00	4,312,000
応用地質	800	1,280.00	1,024,000
船井総研ホールディングス	1,400	2,486.00	3,480,400
進学会ホールディングス	300	467.00	140,100
オオバ	500	750.00	375,000

いであ	200	1,829.00	365,800	
学究社	200	1,315.00	263,000	
ベネッセホールディングス	2,200	2,026.00	4,457,200	
イオンディライト	800	2,680.00	2,144,000	
ナック	400	981.00	392,400	
ダイセキ	1,100	3,555.00	3,910,500	
ステップ	200	1,567.00	313,400	
合 計	5,814,100		16,451,981,550	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 1月29日現在です。

【上場インデックスファンドTOPIX Ex - Financials】

【純資産額計算書】

資産総額	14,914,173,666円
負債総額	457,023,920円
純資産総額（ - ）	14,457,149,746円
発行済口数	8,968,514口
1口当たり純資産額（ / ）	1,612.0円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

（4）受益証券の再発行

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

（5）受益権の再分割

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

令などにしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2021年1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（2021年1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（2021年1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、2021年1月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	847	245,901
株式投資信託	786	210,573
単位型	278	11,140
追加型	508	199,432
公社債投資信託	61	35,327
単位型	48	1,921
追加型	13	33,406

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

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

(2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	77,264	74,265
その他営業収益	3,063	2,994
営業収益合計	80,328	77,259
営業費用		
支払手数料	32,834	31,322
広告宣伝費	960	953
公告費	2	2
調査費	18,251	17,275
調査費	890	920
委託調査費	17,333	16,333
図書費	27	21
委託計算費	541	534
営業雑経費	794	1,058
通信費	128	116
印刷費	334	337
協会費	69	52
諸会費	19	10
その他	243	541
営業費用計	53,385	51,148
一般管理費		
給料	9,783	9,857
役員報酬	241	360
役員賞与引当金繰入額	210	55
給料・手当	6,589	6,675
賞与	61	64
賞与引当金繰入額	2,680	2,702
交際費	92	92
寄付金	13	29
旅費交通費	476	420
租税公課	428	440
不動産賃借料	888	901
退職給付費用	378	387
退職金	52	82
固定資産減価償却費	108	118
福利費	1,071	1,014
諸経費	3,106	3,229
一般管理費計	16,401	16,573
営業利益	10,540	9,538

(単位：百万円)

	第60期		第61期	
	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		37		99
受取配当金	1	1,865	1	4,881
有価証券償還益		1		-
デリバティブ収益	1	142		223
時効成立分配金・償還金		21		1
為替差益		58		5
その他		48		145
営業外収益合計		2,176		5,357
営業外費用				
支払利息	1	286		185
有価証券償還損		-		0
時効成立後支払分配金・償還金		78		1
その他		24		12
営業外費用合計		388		199
経常利益		12,328		14,695
特別利益				
投資有価証券売却益		218		164
特別利益合計		218		164
特別損失				
投資有価証券売却損		176		19
投資有価証券評価損		-		21
固定資産処分損		0		0
役員退職一時金		180		-
特別損失合計		357		41
税引前当期純利益		12,189		14,818
法人税、住民税及び事業税		3,741		3,307
法人税等調整額		375		45
法人税等合計		3,366		3,353
当期純利益		8,823		11,465

(3) 【株主資本等変動計算書】

第60期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756
当期変動額							

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

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

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891
当期変動額							
剰余金の配当				3,212	3,212		3,212
当期純利益				11,465	11,465		11,465
自己株式の取得						71	71
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)							
当期変動額合計	-	-	-	8,252	8,252	71	8,181
当期末残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	493	185	679	69,571
当期変動額				
剰余金の配当				3,212
当期純利益				11,465

自己株式の取得				71
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	553	204	349	349
当期変動額合計	553	204	349	7,831
当期末残高	60	389	329	77,402

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	3年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>				

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

（未適用の会計基準等）

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

（1）概要

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

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

（2）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

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

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

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	-	3,618,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	-	66,000	3,811,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,422,000	66,000	4,356,000	-
合計		11,785,000	4,422,000	1,118,700	15,088,300	-

(注) 1 2017年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

3 2009年度ストックオプション(1)1,171,500株、2009年度ストックオプション(2)75,900株、2011年度ストックオプション(1)2,055,900株及び2016年度ストックオプション(1)1,206,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)2,412,000株、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,365,700	88,800	-	1,454,500

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,171,500	-	1,171,500	-	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	75,900	-	75,900	-	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,055,900	-	871,200	1,184,700	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	2,272,000	1,346,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	-	1,417,000	2,394,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	-	1,417,000	2,939,000	-
合計		15,088,300	-	7,224,600	7,863,700	-

- (注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
- 2 2011年度ストックオプション(1)1,184,700株、2016年度ストックオプション(1)881,000株及び2016年度ストックオプション(2)804,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)465,000株、2016年度ストックオプション(2)1,590,000株及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

- (1)負債に計上されているものについては、()で示しております。
 (2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

2020年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	24,591	24,591	-
(2) 未収委託者報酬	16,912	16,912	-
(3) 未収収益	1,412	1,412	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,371	2,371	-
(5) 有価証券及び投資有価証券			

その他有価証券	17,828	17,828	-
(6) 未払金	(5,881)	(5,881)	-
(7) 未払費用	(4,289)	(4,289)	-
(8) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(25)	(25)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	167	167	-
デリバティブ取引計	142	142	-

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち15百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、41百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち167百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	24,591	-	-	-
未収委託者報酬	16,912	-	-	-
未収収益	1,412	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	149	8,709	29
合計	42,936	149	8,709	29

(有価証券関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	5,381	4,912	469
	小計	5,381	4,912	469
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	12,447	13,003	556
	小計	12,447	13,003	556
合計		17,828	17,915	86

- (注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について21百万円(その他有価証券の投資信託)減損処理を行っております。
- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	2,230	164	19
合計	2,230	164	19

(デリバティブ取引関係)

第60期(2019年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル		2,251	-	42
	豪ドル		63	-	0
	シンガポール ドル	投資有価証券	975	-	18

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第61期(2020年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

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

(退職給付関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,313
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	59
<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 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 2,128百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割
又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開
日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

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 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 1,633百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第60期 (2019年3月31日)	第61期 (2020年3月31日)
----------------------	----------------------

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)	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場合、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無い場合、記載してありません。

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	2,990
流動資産合計		44,833
固定資産		
有形固定資産	1	408
無形固定資産		154
投資その他の資産		
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
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,500百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	
J P モルガン証券株式会社	73,272百万円	
シティグループ証券株式会社	96,307百万円 (2019年12月末現在)	
大和証券株式会社	100,000百万円	
野村証券株式会社	10,000百万円	
BofA証券株式会社	83,140百万円	
B N P パリバ証券株式会社	102,025百万円	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
三菱U F J モルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
モルガン・スタンレーM U F G 証券株式会社	62,149百万円	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券などの管理・計算事務・収益分配金および償還金の支払いなどを行いません。

(2) 販売会社

日本におけるファンドの募集の取扱い、解約および買取りに関する業務などを行いません。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年10月 8日	有価証券届出書
2020年10月 8日	有価証券報告書

独立監査人の監査報告書

2020年6月8日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞 廣 篤 典指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年2月3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」に掲げられている上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financialsの2020年7月9日から2021年1月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、上場インデックスファンドTOPIX Ex-Financialsの2021年1月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、日興アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. 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 公認会計士 貞 廣 篤 典
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明
業務執行社員

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。