

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年4月20日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	上場インデックスファンド海外新興国株式（MSCIエマージング）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	30兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町2番1号

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

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	不動産投信	MRF	特殊型
	内外	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。

海外

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海外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

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,328,556,759	100.00
合計（純資産総額）		1,328,556,759	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

ロ. 種類別の投資比率

該当事項はありません。

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。

参考情報

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10期 2020年 1月20日現在	第11期 2021年 1月20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10期(2020年1月20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
投資信託受益証券	781,633,940
親投資信託受益証券	40
合計	781,633,900

第11期（2021年 1月20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
投資信託受益証券	940,387,905
親投資信託受益証券	30
合計	940,387,875

（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10期 2020年 1月20日現在		第11期 2021年 1月20日現在	
1口当たり純資産額	1,575.89円	1口当たり純資産額	1,796.06円
(100口当たり純資産額)	(157,589円)	(100口当たり純資産額)	(179,606円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

	GENTING BHD	162,800	4.23	688,644.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	450,000	2.41	1,084,500.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,200	31.76	387,472.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	377,375	4.45	1,679,318.75	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	59,600	23.76	1,416,096.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	10,900	139.00	1,515,100.00	
	PPB GROUP BERHAD	92,380	19.08	1,762,610.40	
	QL RESOURCES BHD	194,100	5.80	1,125,780.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	276,120	4.98	1,375,077.60	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	233,500	12.20	2,848,700.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	313,500	5.35	1,677,225.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	218,200	4.07	888,074.00	
	SUPERMAX CORP BHD	217,846	6.34	1,381,143.64	
	TOP GLOVE CORP BHD	663,400	6.13	4,066,642.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	290,100	3.19	925,419.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	915,000	4.00	3,660,000.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	52,800	17.44	920,832.00	
	MALAYAN BANKING BHD	534,450	8.10	4,329,045.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	396,970	20.90	8,296,673.00	
	RHB BANK BHD	243,659	5.24	1,276,773.16	
	AXIATA GROUP BERHAD	286,900	3.56	1,021,364.00	
	DIGI.COM BHD	439,100	4.07	1,787,137.00	
	MAXIS BHD	337,200	5.04	1,699,488.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	168,200	6.00	1,009,200.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	113,500	16.62	1,886,370.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	318,425	10.00	3,184,250.00	
	マレーシアリングット小計	9,780,345		64,195,364.15 (1,648,536,951)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	183,310	113.00	20,714,030.00	
	PTT PCL-NVDR	1,547,500	41.00	63,447,500.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	173,800	59.00	10,254,200.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	177,200	38.25	6,777,900.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	309,745	63.50	19,668,807.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	107,200	388.00	41,593,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	578,100	60.75	35,119,575.00	

BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	759,300	8.30	6,302,190.00
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	802,600	9.80	7,865,480.00
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	1,140,200	4.88	5,564,176.00
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	429,168	25.50	10,943,784.00
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	246,816	30.25	7,466,184.00
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	873,400	13.90	12,140,260.00
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	123,700	36.50	4,515,050.00
CP ALL PCL-NVDR	790,600	58.00	45,854,800.00
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	572,800	29.25	16,754,400.00
OSOTSPA PCL-NVDR	117,200	35.75	4,189,900.00
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	533,500	14.20	7,575,700.00
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,291,600	21.20	27,381,920.00
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	69,000	124.00	8,556,000.00
BANGKOK BANK-FOREIGN REG	76,040	122.00	9,276,880.00
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	154,900	114.50	17,736,050.00
KASIKORNBANK PCL-NVDR	84,300	115.00	9,694,500.00
KRUNG THAI BANK - NVDR	630,925	12.10	7,634,192.50
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	104,000	91.25	9,490,000.00
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	249,900	21.50	5,372,850.00
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	111,300	77.00	8,570,100.00
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	124,400	66.50	8,272,600.00
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	118,200	69.50	8,214,900.00
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	310,300	48.25	14,971,975.00
LAND & HOUSES PUB - NVDR	638,600	8.05	5,140,730.00
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	43,800	622.00	27,243,600.00
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	159,300	179.00	28,514,700.00
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	316,400	57.75	18,272,100.00
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	66,400	34.00	2,257,600.00
TRUE CORP PCL-NVDR	1,683,600	3.44	5,791,584.00
B GRIMM POWER PCL-NVDR	123,300	53.75	6,627,375.00
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	22,100	191.50	4,232,150.00
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	216,300	63.75	13,789,125.00
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	114,300	83.25	9,515,475.00
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	319,290	35.50	11,334,795.00
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	135,700	52.00	7,056,400.00

タイパーツ小計		16,630,094		601,695,138.00 (2,087,882,128)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	279,700	44.85	12,544,545.00	
	AYALA CORPORATION	40,912	826.00	33,793,312.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	18,357	569.50	10,454,311.50	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	403,345	74.50	30,049,202.50	
	SM INVESTMENTS CORP	32,223	1,072.00	34,543,056.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	125,380	126.80	15,898,184.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	62,790	190.70	11,974,053.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	177,500	37.95	6,736,125.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	124,560	153.80	19,157,328.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	162,007	84.50	13,689,591.50	
	BDO UNIBANK INC	274,504	111.00	30,469,944.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	283,137	48.00	13,590,576.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,454,000	4.39	10,773,060.00	
	AYALA LAND INC	1,104,860	39.65	43,807,699.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,348,910	39.00	52,607,490.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,610	2,060.00	9,496,600.00	
	PLDT INC	12,785	1,420.00	18,154,700.00	
ABOITIZ POWER CORP	258,800	26.50	6,858,200.00		
MANILA ELECTRIC COMPANY	37,480	290.00	10,869,200.00		
フィリピンペソ小計		7,205,860		385,467,177.50 (832,609,103)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	2,051,400	1,415.00	2,902,731,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	199,700	25,925.00	5,177,222,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	4,083,100	1,000.00	4,083,100,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	382,100	12,775.00	4,881,327,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	219,700	15,650.00	3,438,305,000.00	
	SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	428,600	12,400.00	5,314,640,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,815,700	6,675.00	18,794,797,500.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	754,900	1,740.00	1,313,526,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,071,300	6,425.00	6,883,102,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	70,200	41,175.00	2,890,485,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	247,900	9,750.00	2,417,025,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	550,100	6,800.00	3,740,680,000.00	

	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,055,600	7,575.00	7,996,170,000.00
	KALBE FARMA TBK PT	2,999,000	1,585.00	4,753,415,000.00
	BANK MANDIRI TBK	2,550,600	6,975.00	17,790,435,000.00
	BANK RAKYAT INDONESIA	7,524,100	4,620.00	34,761,342,000.00
	PT BANK CENTRAL ASIA	1,331,900	35,475.00	47,249,152,500.00
	PT BANK NEGARA INDONESIA	1,063,300	6,225.00	6,619,042,500.00
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	3,352,000	960.00	3,217,920,000.00
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	6,754,900	3,410.00	23,034,209,000.00
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	1,974,800	1,705.00	3,367,034,000.00
インドネシアルピア小計		41,480,900		210,625,662,000.00 (1,558,629,898)
韓国ウォン	GS HOLDINGS	7,755	38,650.00	299,730,750.00
	S-OIL CORPORATION	6,055	73,600.00	445,648,000.00
	SK INNOVATION CO LTD	7,477	270,000.00	2,018,790,000.00
	HANWHA SOLUTIONS CORP	14,650	55,200.00	808,680,000.00
	HANWHA SOLUTIONS CORP-RTS(N)	2,292	10,300.00	23,607,600.00
	HYUNDAI STEEL CO	11,980	45,400.00	543,892,000.00
	KOREA ZINC CO LTD	725	418,000.00	303,050,000.00
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	2,430	165,000.00	400,950,000.00
	LG CHEM LTD	6,217	997,000.00	6,198,349,000.00
	LG CHEM LTD-PRF	1,110	496,000.00	550,560,000.00
	LOTTE CHEMICAL CORP	2,375	292,500.00	694,687,500.00
	POSCO	10,080	271,000.00	2,731,680,000.00
	POSCO CHEMICAL CO LTD	2,815	128,000.00	360,320,000.00
	POSCO CHEMICAL CO LTD(N)	868	128,000.00	111,104,000.00
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,110	392,000.00	435,120,000.00
	CJ CORP	2,345	109,000.00	255,605,000.00
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	3,080	27,450.00	84,546,000.00
	DOOSAN BOBCAT INC	7,960	32,000.00	254,720,000.00
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	28,100	13,300.00	373,730,000.00
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	9,153	44,500.00	407,308,500.00
	HANWHA CORPORATION	3,900	31,250.00	121,875,000.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	11,400	45,150.00	514,710,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	1,356	268,000.00	363,408,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	12,880	30,050.00	387,044,000.00	

KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	5,357	110,500.00	591,948,500.00	
LG CORP	12,950	103,000.00	1,333,850,000.00	
LOTTE CORP	2,784	35,500.00	98,832,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	11,337	144,000.00	1,632,528,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	22,460	13,600.00	305,456,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	71,454	6,850.00	489,459,900.00	
SK HOLDINGS CO LTD	4,741	309,000.00	1,464,969,000.00	
S1 CORPORATION	1,580	87,500.00	138,250,000.00	
CJ LOGISTICS	1,595	165,000.00	263,175,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,590	189,000.00	489,510,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	12,222	31,700.00	387,437,400.00	
PAN OCEAN CO LTD	23,480	4,825.00	113,291,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,652	40,900.00	231,166,800.00	
HANON SYSTEMS	22,510	17,650.00	397,301,500.00	
HYUNDAI MOBIS	9,040	345,000.00	3,118,800,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	20,460	261,500.00	5,350,290,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,790	117,500.00	562,825,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	2,820	118,000.00	332,760,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	35,970	83,400.00	2,999,898,000.00	
COWAY CO LTD	6,970	74,000.00	515,780,000.00	
FILA HOLDINGS CORP	7,010	47,300.00	331,573,000.00	
HLB INC	6,324	91,200.00	576,748,800.00	
LG ELECTRONICS INC	14,515	148,000.00	2,148,220,000.00	
KANGWON LAND INC	15,620	24,600.00	384,252,000.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	12,000	20,350.00	244,200,000.00	
KAKAO CORP	7,755	440,000.00	3,412,200,000.00	
NAVER CORP	16,655	308,000.00	5,129,740,000.00	
NCSOFT CORP	2,235	957,000.00	2,138,895,000.00	
NETMARBLE CORP	3,100	120,500.00	373,550,000.00	
PEARL ABYSS CORP	1,015	266,900.00	270,903,500.00	
CJ ENM CO LTD	1,802	163,000.00	293,726,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	4,630	84,300.00	390,309,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	1,612	115,000.00	185,380,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	1,092	243,500.00	265,902,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	767	145,000.00	111,215,000.00	

E-MART CO LTD	2,422	172,000.00	416,584,000.00	
GS RETAIL CO LTD	2,330	35,250.00	82,132,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	939	437,000.00	410,343,000.00	
KT&G CORP	16,445	81,000.00	1,332,045,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,986	120,500.00	359,813,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	4,395	223,000.00	980,085,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	4,695	61,100.00	286,864,500.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1,275	1,551,000.00	1,977,525,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PRF	295	694,000.00	204,730,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	9,283	140,000.00	1,299,620,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD(N)	198	140,000.00	27,720,000.00	
ALTEOGEN INC	2,620	149,500.00	391,690,000.00	
CELLTRION INC	12,774	312,500.00	3,991,875,000.00	
CELLTRION INC(N)	271	312,500.00	84,687,500.00	
CELLTRION PHARM INC	2,280	181,700.00	414,276,000.00	
CELLTRION PHARM INC(N)	50	181,700.00	9,085,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	979	350,000.00	342,650,000.00	
HANMI PHARM CO LTD(N)	19	350,000.00	6,650,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,280	796,000.00	1,814,880,000.00	
SEEGENE INC	2,700	165,000.00	445,500,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	3,950	96,800.00	382,360,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,060	148,000.00	304,880,000.00	
YUHAN CORP	6,445	72,600.00	467,907,000.00	
YUHAN CORP(N)	385	72,600.00	27,951,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	41,148	38,250.00	1,573,911,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	41,580	8,630.00	358,835,400.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	53,340	45,200.00	2,410,968,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	59,278	33,050.00	1,959,137,900.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	77,511	9,900.00	767,358,900.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	6,135	87,800.00	538,653,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	44,418	10,000.00	444,180,000.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	13,500	11,650.00	157,275,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,787	41,900.00	200,575,300.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	6,980	42,000.00	293,160,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	11,010	21,600.00	237,816,000.00	

	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	4,240	183,000.00	775,920,000.00
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	9,355	79,600.00	744,658,000.00
	DOUZONE BIZON CO LTD	2,750	113,000.00	310,750,000.00
	SAMSUNG SDS CO LTD	4,790	200,000.00	958,000,000.00
	KMW CO LTD	3,650	79,200.00	289,080,000.00
	LG DISPLAY CO LTD	32,210	21,000.00	676,410,000.00
	LG INNOTEK CO LTD	2,235	188,500.00	421,297,500.00
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	7,695	207,000.00	1,592,865,000.00
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	650,010	87,000.00	56,550,870,000.00
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	111,120	76,400.00	8,489,568,000.00
	SAMSUNG SDI CO LTD	7,448	732,000.00	5,451,936,000.00
	LG UPLUS CORP.	30,860	12,050.00	371,863,000.00
	SK TELECOM	5,340	245,000.00	1,308,300,000.00
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	35,130	24,950.00	876,493,500.00
	SK HYNIX INC	73,930	130,500.00	9,647,865,000.00
	韓国ウォン小計	1,957,533		169,233,057,750.00 (15,992,523,957)
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	113,080	99.20	11,217,536.00
	ASIA CEMENT CORP	289,978	42.15	12,222,572.70
	CHINA STEEL CORP	1,640,181	24.30	39,856,398.30
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	474,047	83.10	39,393,305.70
	FORMOSA PLASTICS CORP	512,424	93.20	47,757,916.80
	NAN YA PLASTICS CORP	681,145	71.70	48,838,096.50
	TAIWAN CEMENT	678,326	41.75	28,320,110.50
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	17,000	1,130.00	19,210,000.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	432,957	27.45	11,884,669.65
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	37,684	441.50	16,637,486.00
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	320,000	32.00	10,240,000.00
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	150,000	30.00	4,500,000.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	140,947	43.20	6,088,910.40
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	22,254	402.00	8,946,108.00
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	52,935	189.50	10,031,182.50
	GIANT MANUFACTURING	46,000	289.50	13,317,000.00
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	21,000	370.00	7,770,000.00
	POU CHEN	369,145	29.10	10,742,119.50

HOTAI MOTOR COMPANY LTD	41,000	638.00	26,158,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	76,448	264.00	20,182,272.00	
STANDARD FOODS CORP	45,320	57.20	2,592,304.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	650,703	67.10	43,662,171.30	
ONENESS BIOTECH CO LTD	28,000	206.00	5,768,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	724,534	17.75	12,860,478.50	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,353,746	19.65	46,251,108.90	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,523,666	24.90	37,939,283.40	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,396,726	20.90	29,191,573.40	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,129,634	17.90	20,220,448.60	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,489,356	29.10	43,340,259.60	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,472,075	11.35	16,708,051.25	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,460,834	13.05	19,063,883.70	
TAIWAN BUSINESS BANK	996,589	9.48	9,447,663.72	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,254,531	19.90	24,965,166.90	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	474,161	41.10	19,488,017.10	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	167,896	168.50	28,290,476.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,343,507	21.30	28,616,699.10	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,053,731	41.35	43,571,776.85	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,787,715	9.31	16,643,626.65	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	217,204	22.60	4,908,810.40	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	888,743	47.25	41,993,106.75	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,540,214	8.49	13,076,416.86	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	78,045	44.40	3,465,198.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	92,419	40.00	3,696,760.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	72,000	283.00	20,376,000.00	
ACER INC	435,812	24.35	10,612,022.20	
ADVANTECH CO LTD	54,627	393.00	21,468,411.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	97,797	285.00	27,872,145.00	
AU OPTRONICS CORP	1,195,994	14.70	17,581,111.80	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	96,405	208.00	20,052,240.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	105,356	87.40	9,208,114.40	
COMPAL ELECTRONICS	665,955	21.50	14,318,032.50	
DELTA ELECTRONICS INC	262,541	294.00	77,187,054.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	155,787	76.00	11,839,812.00	

MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	154,840	159.50	24,696,980.00	
MRF LTD	280	87,197.55	24,415,314.00	
TATA MOTORS LTD	232,178	258.65	60,052,839.70	
PAGE INDUSTRIES LTD	810	28,307.20	22,928,832.00	
TITAN CO LTD	48,120	1,519.90	73,137,588.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	11,680	2,801.75	32,724,440.00	
INFO EDGE INDIA LTD	9,890	4,927.40	48,731,986.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	128,110	225.05	28,831,155.50	
TRENT LTD	26,500	677.75	17,960,375.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	22,270	2,778.40	61,874,968.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	14,290	3,601.25	51,461,862.50	
ITC LTD	392,945	218.85	85,996,013.25	
NESTLE INDIA LIMITED	4,630	17,754.70	82,204,261.00	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	69,960	582.70	40,765,692.00	
UNITED SPIRITS LTD	42,230	628.75	26,552,112.50	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	11,540	1,556.10	17,957,394.00	
DABUR INDIA LTD	68,450	541.40	37,058,830.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	54,665	786.70	43,004,955.50	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	110,100	2,363.15	260,182,815.00	
MARICO LTD	78,310	417.15	32,667,016.50	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	13,200	2,645.50	34,920,600.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	42,470	924.25	39,252,897.50	
BIOCON LTD	46,250	451.60	20,886,500.00	
CIPLA LTD	55,450	822.45	45,604,852.50	
DIVI'S LABORATORIES LTD	17,710	3,599.45	63,746,259.50	
DR. REDDY'S LABORATORIES	16,470	5,088.90	83,814,183.00	
IPCA LABORATORIES LTD	10,150	2,128.50	21,604,275.00	
LUPIN LTD	34,230	1,089.20	37,283,316.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	117,024	596.55	69,810,667.20	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,750	2,750.90	18,568,575.00	
AXIS BANK LTD	304,430	668.75	203,587,562.50	
BANDHAN BANK LTD	103,210	362.30	37,392,983.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	230,285	2,656.95	611,855,730.75	
ICICI BANK LTD	685,237	546.45	374,447,758.65	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	74,350	1,887.00	140,298,450.00	

	STATE BANK OF INDIA	244,010	298.60	72,861,386.00	
	YES BANK LTD	1,463,300	17.90	26,193,070.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	36,620	4,959.15	181,604,073.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	7,560	3,204.60	24,226,776.00	
	MUTHOOT FINANCE LTD	17,600	1,207.85	21,258,160.00	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	13,159	1,591.55	20,943,206.45	
	REC LTD	129,150	147.50	19,049,625.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	14,904	1,228.35	18,307,328.40	
	BAJAJ FINSERV LTD	5,370	8,924.15	47,922,685.50	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	97,460	698.55	68,080,683.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	28,900	1,510.00	43,639,000.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	49,890	515.55	25,720,789.50	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,100	904.40	48,023,640.00	
	DLF LTD	94,200	289.00	27,223,800.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	145,410	983.85	143,061,628.50	
	INFOSYS LTD	460,608	1,316.65	606,459,523.20	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	7,650	4,091.35	31,298,827.50	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	126,150	3,260.70	411,337,305.00	
	TECH MAHINDRA LTD	85,160	992.50	84,521,300.00	
	WIPRO LTD	159,109	430.25	68,456,647.25	
	BHARTI AIRTEL LTD	172,385	592.30	102,103,635.50	
	INDUS TOWERS LTD	45,490	258.25	11,747,792.50	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	52,400	992.85	52,025,340.00	
	GAIL INDIA LTD	237,556	139.65	33,174,695.40	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	36,800	557.55	20,517,840.00	
	NTPC LIMITED	601,872	99.65	59,976,544.80	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	289,970	199.65	57,892,510.50	
	インドルピー小計	10,783,006		7,504,903,635.95	(10,732,012,199)
パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	73,100	112.47	8,221,557.00	
	HABIB BANK LTD	107,900	139.45	15,046,655.00	
	MCB BANK LTD	76,300	196.01	14,955,563.00	
	パキスタンルピー小計	257,300		38,223,775.00	(24,845,453)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	69,390	19.15	1,328,818.50	

	KUWAIT FINANCE HOUSE	580,900	0.70	408,372.70
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	886,200	0.85	755,928.60
	MABANEE CO KPSC	59,500	0.71	42,721.00
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	294,600	0.63	186,187.20
クウェート・ディナール小計		2,296,800		1,636,659.90 (562,307,241)
香港・オフショア ア人民币元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	87,300	5.77	503,721.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	214,717	4.17	895,369.89
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	49,400	18.74	925,756.00
	PETROCHINA CO LTD-A	160,833	4.26	685,148.58
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	73,700	11.07	815,859.00
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	61,300	6.02	369,026.00
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	14,900	44.88	668,712.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	117,200	3.46	405,512.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	46,700	55.07	2,571,769.00
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	123,000	6.21	763,830.00
	BBMG CORPORATION-A	131,400	2.99	392,886.00
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	32,400	47.37	1,534,788.00
	CHINA JUSHI CO LTD -A	23,000	22.50	517,500.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	139,200	5.89	819,888.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	11,500	125.59	1,444,285.00
	GEM CO LTD-A	55,400	7.92	438,768.00
	GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	43,800	4.98	218,124.00
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	66,254	38.21	2,531,565.34
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	438,792	1.16	508,998.72
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	66,500	4.80	319,200.00
	JIANGXI COPPER CO LTD-A	20,600	20.87	429,922.00
	LOMON BILLIONS GROUP CO -A	14,800	39.67	587,116.00
	RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	66,967	32.19	2,155,667.73
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	54,544	23.14	1,262,148.16
	SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	11,800	41.58	490,644.00
	SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	145,000	3.49	506,050.00
	TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	28,900	14.34	414,426.00
	TONGKUN GROUP CO LTD-A	29,100	25.25	734,775.00
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	31,700	107.49	3,407,433.00

WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	5,200	89.09	463,268.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C-A	11,000	130.16	1,431,760.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	8,500	78.55	667,675.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	34,900	14.60	509,540.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	110,000	10.28	1,130,800.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	24,100	66.80	1,609,880.00	
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	35,900	12.38	444,442.00	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	7,400	81.58	603,692.00	
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUST-A	21,800	34.36	749,048.00	
AVICOPTER PLC-A	9,400	62.81	590,414.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	12,200	49.36	602,192.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	46,600	6.67	310,822.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	48,800	6.11	298,168.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	185,000	5.65	1,045,250.00	
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	180,262	4.39	791,350.18	
CHINA STATE CONSTRUCTION-A	550,500	5.06	2,785,530.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	20,200	366.11	7,395,422.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,300	11.06	478,898.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	21,583	91.50	1,974,844.50	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	60,060	7.48	449,248.80	
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	14,100	37.00	521,700.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	10,700	44.39	474,973.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	9,300	52.13	484,809.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	15,479	116.69	1,806,244.51	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	61,500	11.11	683,265.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	157,500	3.11	489,825.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	37,663	29.31	1,103,902.53	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	122,702	4.03	494,489.06	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	87,000	39.30	3,419,100.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	87,700	3.01	263,977.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	73,500	5.31	390,285.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	15,984	93.41	1,493,065.44	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	12,200	25.70	313,540.00	
TBEA CO LTD-A	39,500	10.87	429,365.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	38,500	18.75	721,875.00	

XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	43,900	14.35	629,965.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	20,100	37.64	756,564.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	42,510	24.41	1,037,669.10	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	49,000	11.36	556,640.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	49,900	7.51	374,749.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	10,700	93.47	1,000,129.00	
AIR CHINA LTD-A	37,700	7.20	271,440.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	113,700	4.65	528,705.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	37,900	5.81	220,199.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	101,700	14.08	1,431,936.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD-A	60,600	6.64	402,384.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	29,800	13.15	391,870.00	
S F HOLDING CO LTD-A	28,200	91.50	2,580,300.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,238	71.65	375,302.70	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	24,570	16.48	404,913.60	
BYD CO LTD -A	20,600	216.20	4,453,720.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2,300	190.32	437,736.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS-A	36,571	29.52	1,079,575.92	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC-A	23,500	29.00	681,500.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	90,700	23.69	2,148,683.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	12,500	42.05	525,625.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	68,800	33.76	2,322,688.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,400	42.70	401,380.00	
NAVINFO CO LTD-A	30,300	15.78	478,134.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	3,780	130.10	491,778.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	106,800	9.08	969,744.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	6,493	79.85	518,466.05	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	22,000	32.30	710,600.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	7,000	47.13	329,910.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	76,498	7.20	550,785.60	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	34,720	15.71	545,451.20	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	45,400	12.73	577,942.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	172,000	11.68	2,008,960.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	14,300	18.12	259,116.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	23,400	82.60	1,932,840.00	

GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	3,700	132.98	492,026.00	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	5,880	74.47	437,883.60	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	19,900	29.27	582,473.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	19,667	18.75	368,756.25	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	16,073	28.50	458,080.50	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	46,571	13.30	619,394.30	
OVCTEK CHINA INC-A	4,800	86.78	416,544.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	17,900	19.08	341,532.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	9,055	425.91	3,856,615.05	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	3,400	281.13	955,842.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	33,670	14.50	488,215.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	2,700	295.20	797,040.00	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	9,620	39.80	382,876.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	3,300	148.62	490,446.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	3,900	451.00	1,758,900.00	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	8,200	39.81	326,442.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	9,700	25.94	251,618.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	15,200	132.30	2,010,960.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	13,100	29.78	390,118.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	3,400	159.06	540,804.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	20,930	51.20	1,071,616.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	44,928	104.95	4,715,193.60	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	12,480	34.00	424,320.00	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	24,000	22.04	528,960.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	20,700	49.90	1,032,930.00	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	65,500	7.39	484,045.00	
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	13,900	17.38	241,582.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	7,300	140.01	1,022,073.00	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	32,000	11.91	381,120.00	
WUXI APPTTEC CO LTD-A	25,140	143.38	3,604,573.20	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,100	131.51	1,196,741.00	
ZHANGZHOU PIEN TZE HUANG PHA-A	6,400	283.50	1,814,400.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	11,620	27.38	318,155.60	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	17,000	39.26	667,420.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	672,600	3.20	2,152,320.00	

BANK OF BEIJING CO LTD -A	172,123	4.92	846,845.16	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	38,000	10.61	403,180.00	
BANK OF CHINA LTD-A	361,600	3.22	1,164,352.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	528,700	4.60	2,432,020.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	140,010	5.59	782,655.90	
BANK OF NANJING CO LTD -A	79,112	8.48	670,869.76	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	65,770	38.89	2,557,795.30	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	142,927	8.37	1,196,298.99	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	47,700	6.95	331,515.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	387,100	4.21	1,629,691.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	195,110	51.85	10,116,453.50	
CHINA MINSHENG BANKING-A	256,600	5.27	1,352,282.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	104,443	6.31	659,035.33	
IND & COMM BK OF CHINA-A	669,500	5.20	3,481,400.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	192,521	23.88	4,597,401.48	
PING AN BANK CO LTD-A	201,444	22.34	4,500,258.96	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	304,321	10.16	3,091,901.36	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	141,400	4.42	624,988.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	56,600	11.61	657,126.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	87,100	8.18	712,478.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	91,730	25.17	2,308,844.10	
CITIC SECURITIES CO-A	131,900	30.45	4,016,355.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	29,800	42.22	1,258,156.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	43,500	12.31	535,485.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	101,560	37.04	3,761,782.40	
EVERBRIGHT SECURITIE CO-A	30,800	17.72	545,776.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	55,200	7.98	440,496.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	64,900	9.09	589,941.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	46,700	17.40	812,580.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	32,317	13.34	431,108.78	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	77,088	17.55	1,352,894.40	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	68,900	8.59	591,851.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	60,400	12.79	772,516.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	79,200	7.38	584,496.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	49,200	19.14	941,688.00	

インドルピー小計				()
南アフリ カランド	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	509,430	5,858,445.00
南アフリカランド小計			509,430	5,858,445.00 (40,657,608)
合計				96,332,361 (96,332,361)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入債券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 75銘柄	100.0%			16.0%
メキシコペソ	株式 24銘柄	97.2%			1.6%
	投資証券 1銘柄			2.8%	0.0%
ブラジルレアル	株式 54銘柄	100.0%			4.6%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%			0.5%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%			0.2%
ユーロ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
英ポンド	株式 1銘柄	100.0%			0.1%
トルコリラ	株式 14銘柄	100.0%			0.4%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	100.0%			0.6%
香港ドル	株式 199銘柄	100.0%			22.0%
マレーシアリンギット	株式 35銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式 42銘柄	100.0%			1.8%
フィリピンペソ	株式 19銘柄	100.0%			0.7%
インドネシアルピア	株式 21銘柄	100.0%			1.3%
韓国ウォン	株式 109銘柄	100.0%			13.5%
台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%			13.4%
インドルピー	株式 96銘柄	100.0%			9.1%

	社債券	1銘柄				
パキスタンルピー	株式	3銘柄	100.0%			0.0%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			0.7%
エジプトポンド	株式	3銘柄	100.0%			0.1%
南アフリカランド	株式	36銘柄	99.0%			3.4%
	投資証券	1銘柄			1.0%	0.0%
アラブディルハム	株式	9銘柄	100.0%			0.6%
クウェート・ディナール	株式	7銘柄	100.0%			0.5%
香港・オフショア人民元	株式	290銘柄	100.0%			4.7%
サウジアラビリアル	株式	36銘柄	100.0%			2.4%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

マネー・アカウント・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 1月20日現在	2021年 1月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	671,589,756	1,266,466,695
流動資産合計	671,589,756	1,266,466,695
資産合計	671,589,756	1,266,466,695
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,515	355,771
未払利息	96	286
流動負債合計	33,611	356,057
負債合計	33,611	356,057
純資産の部		
元本等		
元本	669,761,765	1,263,053,118
剰余金		

日興グラビティ・ファンド	765,053円	682,906円
インデックスファンドMLP・為替ヘッジあり(適格機関投資家向け)	58,224円	-円
日興ハイブリッド3分法ファンド毎月分配型(ヘッジなしコース)	42,205円	-円
日興ハイブリッド3分法ファンド毎月分配型(通貨プレミアムコース)	181,037円	-円
計	669,761,765円	1,263,053,118円
2. 受益権の総数	669,761,765口	1,263,053,118口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 1月21日 至 2020年 1月20日	自 2020年 1月21日 至 2021年 1月20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

	2020年 1月20日現在	2021年 1月20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 該当事項はありません。 (2)デリバティブ取引	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引

	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。	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

(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)

2020年 1月20日現在		2021年 1月20日現在	
1口当たり純資産額	1.0027円	1口当たり純資産額	1.0024円
(1万口当たり純資産額)	(10,027円)	(1万口当たり純資産額)	(10,024円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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海外新興国株式（MSCIEマージング）】

【純資産額計算書】

資産総額	7,382,630,577円
負債総額	97,552,651円
純資産総額（ - ）	7,285,077,926円
発行済口数	4,116,630口
1口当たり純資産額（ / ）	1,769.67円

（参考）

インデックスファンド新興国株式（適格機関投資家向け）

純資産額計算書

資産総額	7,985,194,866円
負債総額	491,883円
純資産総額（ - ）	7,984,702,983円
発行済口数	6,787,236,257口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1764円

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	121,904,774,368円
負債総額	21,078,626円
純資産総額（ - ）	121,883,695,742円
発行済口数	53,984,150,402口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2578円

マネー・アカウント・マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	1,331,309,472円
負債総額	2,752,713円
純資産総額（ - ）	1,328,556,759円
発行済口数	1,325,351,183口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0024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。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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】

(単位：百万円)

	第60期 (2019年3月31日)		第61期 (2020年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	20,680		24,591
有価証券		1		19
前払費用		495		603
未収入金		38		14
未収委託者報酬		16,867		16,912
未収収益	3	618	3	1,412
関係会社短期貸付金		2,408		2,371
立替金		791		1,437
その他	2	869	2	1,316
流動資産合計		42,769		48,679
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	136	1	182
器具備品	1	137	1	135
有形固定資産合計		274		318
無形固定資産				

ソフトウェア	107	120
無形固定資産合計	107	120
投資その他の資産		
投資有価証券	16,755	17,826
関係会社株式	25,769	25,769
長期差入保証金	447	484
繰延税金資産	1,913	2,022
投資その他の資産合計	44,886	46,102
固定資産合計	45,268	46,540
資産合計	88,038	95,220

(単位：百万円)

	第60期 (2019年3月31日)		第61期 (2020年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金	354		554	
未払金	6,112		5,881	
未払収益分配金	7		8	
未払償還金	71		71	
未払手数料	3	5,299	5,202	
その他未払金		734	599	
未払費用	3	3,897	3	4,289
未払法人税等		2,382		1,439
未払消費税等	4	621	4	746
賞与引当金		2,680		2,718
役員賞与引当金		210		55
その他	3	172		42
流動負債合計		16,431		15,726
固定負債				
退職給付引当金		1,405		1,395
その他		629		695
固定負債合計		2,035		2,091
負債合計		18,466		17,818
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		47,142		55,395
利益剰余金合計		47,142		55,395
自己株式		833		905
株主資本合計		68,891		77,073

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

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

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

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

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

第61期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<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 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。 建物 3年～15年 器具備品 3年～20年</p> <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>
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。 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。 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</p> <p>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あります。</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)	
1 有形固定資産の減価償却累計額		1 有形固定資産の減価償却累計額	
建物	1,281百万円	建物	1,311百万円
器具備品	655百万円	器具備品	707百万円
2 信託資産		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。		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>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)

<p>第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)</p>	<p>第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)</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 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	-

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する、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ー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

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tockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

権利未行使残	-	-
--------	---	---

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額)の見積りに
よっております。
2 ス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 (調整)	30.6%	法定実効税率 (調整)	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない 項目	0.8%	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千)(注2)6,800	-	-

子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	貸付金利息 (シンガポールドル 貸建) (注1)	8 (SGD 104 千)	-	-
							資金の貸付 (米国ドル 貸建) (注3)	1,807 (USD 16,500 千) (注4)	関係会社 短期 貸付金	1,830 (USD 16,500 千)
							貸付金利息 (米国ドル 貸建) (注3)	17 (USD 209 千)	未収収益	17 (USD 209 千)
							資金の貸付 (円貸建) (注3)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注3)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 5)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	配当の受取	1,021 (USD 9,000 千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	米国	181,542 (USD 千) (注 5)	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入 (米国ドル 貸建) (注6)	5,364 (USD 50,000 千) (注7)	-	-
							資金の借入 の返済 (米国ドル 貸建) (注6)	5,526 (USD 50,000 千) (注7)	-	-
							借入金利息 (米国ドル 貸建) (注6)	65 (USD 593 千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2019年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	26,768百万円
負債合計	5,586百万円
純資産合計	21,181百万円
営業収益	14,075百万円
税引前当期純利益	3,894百万円
当期純利益	2,730百万円

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	資金の貸付(米国ドル貸建) (注1)	-	関係会社短期貸付金	1,793 (USD 16,500千)
							貸付金利息(米国ドル貸建) (注1)	86 (USD 798千)	未収収益	13 (USD 122千)
							資金の貸付(円貸建) (注1)	-	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建) (注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注2)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	1,526 (USD 14,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	1,550 (百万円)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	2,700	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 資枠5,000百万円(若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2019年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

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

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

関連情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載してありません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	355円59銭	395円50銭
1株当たり当期純利益金額	45円08銭	58円61銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(百万円)	8,823	11,465
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	8,823	11,465
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,677	195,599

希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2009年度ストックオプション(1) 1,171,500株、2009年度ストックオプション(2) 75,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,055,900株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,811,000株、2017年度ストックオプション(1) 4,356,000株	2011年度ストックオプション(1) 1,184,700株、2016年度ストックオプション(1) 1,346,000株、2016年度ストックオプション(2) 2,394,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,939,000株
--	--	---

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期 (2019年3月31日)	第61期 (2020年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	69,571	77,402
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	69,571	77,402
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	195,647	195,558

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

第62期中間会計期間

(2020年9月30日)

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

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第62期中間会計期間

(自 2020年4月1日

至 2020年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	35,275
その他営業収益	1,507

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第62期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

(単位：百万円)

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	60	389	329	77,402
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,862
中間純利益				3,438
自己株式の取得				1,161
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	706	18	724	724
当中間期変動額合計	706	18	724	138
当中間期末残高	645	408	1,054	77,541

注記事項

(重要な会計方針)

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

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

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第62期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当中間会計期間の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2011年度ストックオプション(1)914,100株、2016年度ストックオプション(1)1,027,000株、2016年度ストックオプション(2)1,198,000株及び2017年度ストックオプション(1)986,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(2)794,000株及び2017年度ストックオプション(1)1,953,000株は権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

第62期中間会計期間(2020年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

(1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないものうち21百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、36百万円は、流動負債のその他に含まれております。またヘッジ会計が適用されているものうち65百万円は、貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、51百万円は、流動負債のその他に含まれております。

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

券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

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

(有価証券関係)

第62期中間会計期間(2020年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

(デリバティブ取引関係)

第62期中間会計期間(2020年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

- (3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
- 投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
- 投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
- 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
- 「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
- 請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。
- 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
- 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
- 商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
- 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
- 有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
- 委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
- ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

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。

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。

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。