【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30日提出
【計算期間】	第27期(自 2020年2月4日至 2021年2月1日)
【ファンド名】	財形株投（一般財形３０） 財形株投（一般財形５０） 財形株投（年金・住宅財形３０）
【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】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

信託財産の成長と安定した収益の確保を目的として安定運用を行ないます。

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国内	株式
追加型投信	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

◇追加型投信

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

◇国内

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

◇資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

２）属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

◇その他資産（投資信託証券（資産複合　資産配分固定型（株式、債券））

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券に投資を行ないます。よって、商品分類の「投資対象資産（収益の源泉）」においては、「資産複合」に分類されます。

「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

◇年１回

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

◇日本

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

◇ファミリーファンド

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

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

③　ファンドの特色

1. 「財形株投」は、財形貯蓄制度をご利用いただく勤労者の皆様専用のファンドです。

※財形貯蓄制度は、「勤労者財産形成促進法」に基づいて設けられた勤労者を対象とした制度で、勤労者財産形成貯蓄（財形貯蓄）、勤労者財産形成住宅貯蓄（財形住宅貯蓄）、勤労者財産形成年金貯蓄（財形年金貯蓄）があります。

2. 「財形株投」は、一般財形、年金財形、住宅財形の3つの財形貯蓄にご利用できるように、次の3本のファンドから構成されています。その中からご利用の皆様のニーズに応じて選択していただきます。

<財形株投（一般財形 30）>　実質株式組入上限 30%
信託財産の純資産総額の30%を限度として株式に、残りの70%程度を公社債などに投資して信託財産の着実な成長をめざします。原則として、常時相当程度の組入比率を維持します。一般財形にご利用いただけます。

<財形株投（一般財形 50）>　実質株式組入上限 50%
信託財産の純資産総額の50%を限度として株式に、残りの50%程度を公社債などに投資して信託財産の着実な成長をめざします。原則として、常時相当程度の組入比率を維持します。一般財形にご利用いただけます。

<財形株投（年金・住宅財形 30）>　実質株式組入上限 30%
信託財産の純資産総額の30%を限度として株式に、残りの70%程度を公社債などに投資して信託財産の着実な成長をめざします。原則として、常時相当程度の組入比率を維持します。年金財形と住宅財形にご利用いただけます。

※ご選択によりそれぞれ「勤労者財産形成貯蓄契約」、「勤労者財産形成年金貯蓄契約」または「勤労者財産形成住宅貯蓄契約」を結んでいただきます。

一般財形 30 一般財形 50	勤労者財産形成貯蓄契約
年金・住宅財形 30	勤労者財産形成年金貯蓄契約 または 勤労者財産形成住宅貯蓄契約

○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できない場合があります。

3. 信託財産の安定した成長をめざして安定運用を行ないます。

内外の公社債への投資により安定収益の確保を図るとともに、株式の運用部分については「バーラ日本株式モデル*1」によりポートフォリオを構築してTOPIX（東証株価指数）*2の動きに連動した投資効果をめざし、信託財産全体の安定した成長をめざします。

○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できない場合があります。

＊1 バーラ日本株式モデル
バーラ日本株式モデルは、日本株への投資から期待される収益（必然的にリスクを伴ないます。）の発生源を、①市場全体の動き、②財務・株式関連データから開発された個別銘柄の株価変動指数、③業種指標、④ポートフォリオ（または個別銘柄）固有の特性などからもたらされる部分に分解・分析し数値化します。
これらのデータをもとに、常に市場全体の株価変動の性格分析を行なうと同時に、検証を重ねつつ最適のポートフォリオを求めます。

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

4. お買付けは無手数料で、給与天引きで行ないます。

給与からの天引きですので、毎月定期的に積立ていただけます。

5. 財形貯蓄制度をご利用される方には、公的融資である財形持家融資を受けられる特典があります。

詳しくは、勤務先の事務局へお問い合わせください。

〈ファンドの仕組み〉

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

主な投資制限

「財形株投（一般財形 30）」
「財形株投（年金・住宅財形 30）」
・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

「財形株投（一般財形 50）」
・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

分配方針

「財形株投（一般財形 30）」「財形株投（一般財形 50）」「財形株投（年金・住宅財形 30）」
・毎決算時に、利子配当等収益を中心に安定的に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

④ 信託金限度額

・各ファンド毎に、5,000億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。

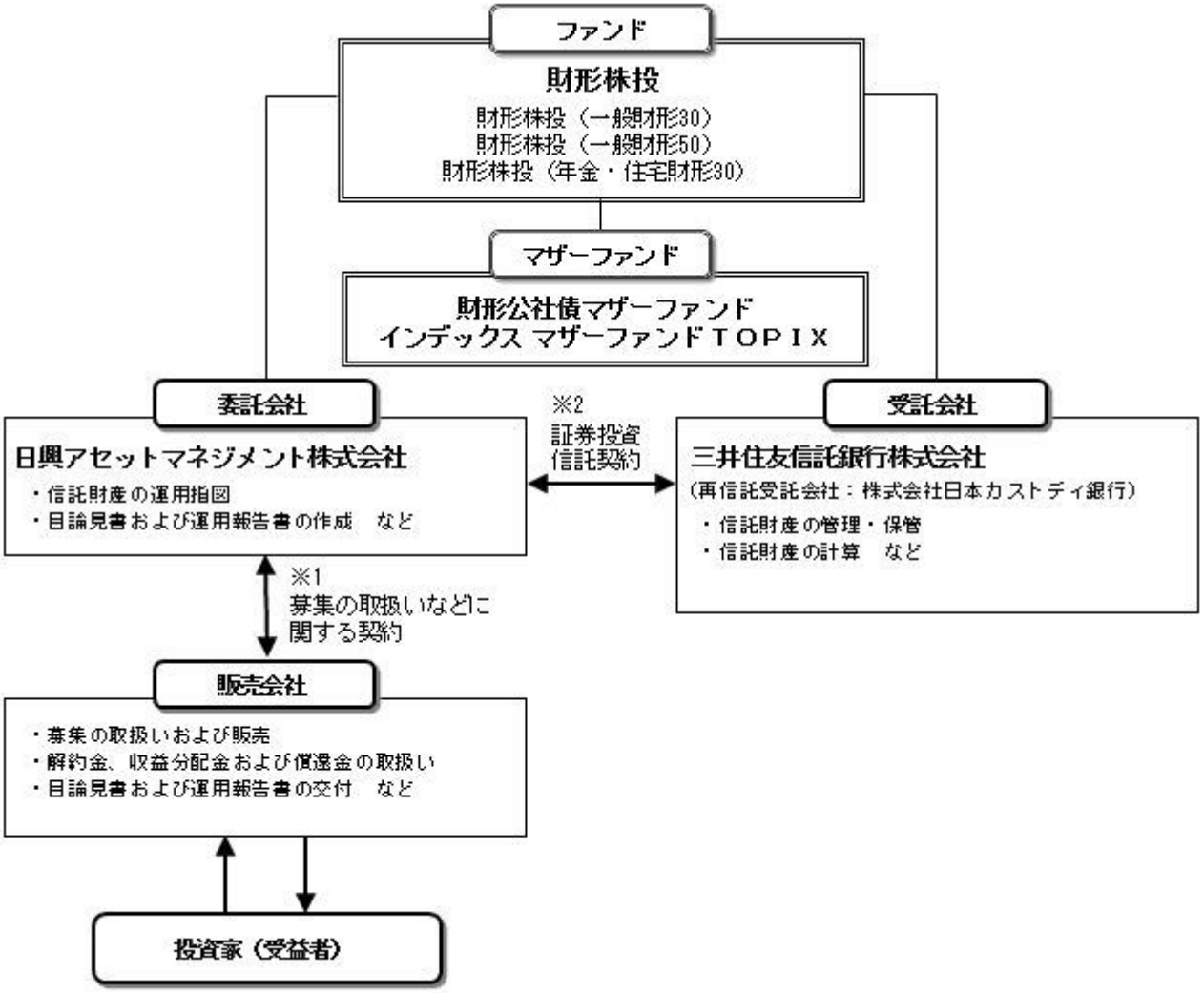
（2）【ファンドの沿革】

1994年 2月 4日
・ファンドの信託契約締結、運用開始

2018年3月20日
・投資対象ファンドに関する変更

（3）【ファンドの仕組み】

①　ファンドの仕組み



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

②　委託会社の概況（2021年2月末現在）

1）資本金
17,363百万円

2）沿革
1959年：日興證券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

3）大株主の状況

名　　称	住　　所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番１号	194,152,500株	98.54%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜財形株投（一般財形30）＞
＜財形株投（年金・住宅財形30）＞
・「財形公社債マザーファンド」受益証券および内外の公社債への投資により安定した収益の確保を図り、「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券およびわが国の株式への投資により信託財産の成長をめざします。
・「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の30%とし、原則として常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。
＜財形株投（一般財形50）＞
・「財形公社債マザーファンド」受益証券および内外の公社債への投資により安定した収益の確保を図り、「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券およびわが国の株式への投資により信託財産の成長をめざします。
・「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の50%とし、原則として常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

（2）【投資対象】

＜財形株投（一般財形30）＞
＜財形株投（一般財形50）＞
＜財形株投（年金・住宅財形30）＞
「財形公社債マザーファンド」受益証券および「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券ならびに内外の公社債およびわが国の株式を主要投資対象とします。
①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第18条および第18条の2に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形
②　主として「インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ」受益証券および「財形公社債マザーファンド」受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）株券または新株引受権証書
２）国債証券
３）地方債証券
４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７）コマーシャル・ペーパー
８）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
９）外国または外国の者の発行する証券または証書で、１）～８）の証券または証書の性質を有するもの
10）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
11）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。）
12）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

13）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。）
14）外国法人が発行する譲渡性預金証書
15）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
16）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
17）外国の者に対する権利で16）の有価証券の性質を有するもの

③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６）外国の者に対する権利で５）の権利の性質を有するもの

④　次の取引ができます。
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）有価証券の貸付
５）外国為替予約取引
６）資金の借入

＜インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ＞

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第18条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

②　主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
２）短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
３）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、２）の証券の性質を有するもの
４）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。）
５）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。）のうち投資法人債券（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。）に類する証券以外のもの
６）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
７）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

③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形

５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

④　次の取引ができます。

１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）有価証券の貸付

＜財形公社債マザーファンド＞

内外の公社債を主要投資対象とします。

①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１）有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
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13条および第13条の2に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

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

１）国債証券
２）地方債証券
３）特別の法律により法人の発行する債券
４）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を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
５）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。）
６）コマーシャル・ペーパー
７）外国または外国の者の発行する証券で、１）～６）の証券の性質を有するもの
８）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
９）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。）
10）外国法人が発行する譲渡性預金証書
11）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
12）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
13）外国の者に対する権利で12）の有価証券の性質を有するもの

③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６）外国の者に対する権利で５）の権利の性質を有するもの

④　次の取引ができます。

１）先物取引等
２）スワップ取引
３）有価証券の貸付
４）外国為替予約取引

◆投資対象とするマザーファンドの概要

＜財形公社債マザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保を目的として安定運用を行ないます。
	主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
	投資方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保をはかります。
	主な投資制限	・株式への投資は行ないません。 ・同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（1994年２月４日設定）
	決算日	毎年２月１日 （２月１日および２日のいずれかが休業日のときは、２月１日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち２月１日に最も近い日を決算日とします。）

＜インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ＞

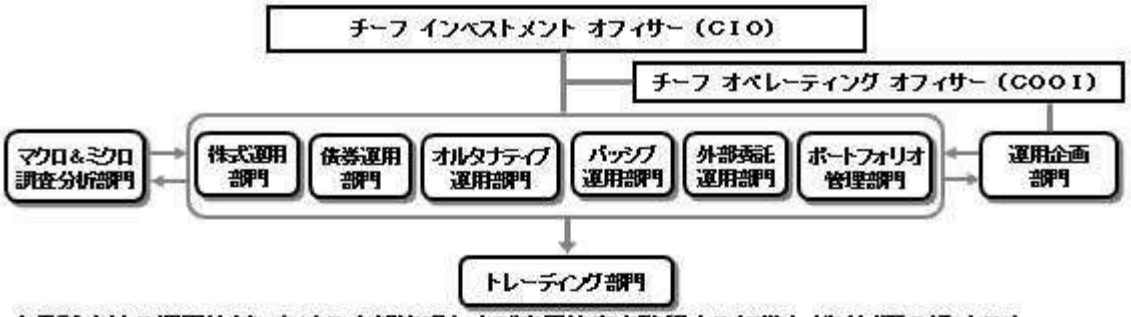
運用の基本方針		
	基本方針	わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）＊の動きに連動する投資成果をめざします。
	主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

	投資方針	・投資成果をＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、「バーラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行ないます。 ①東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とし、分散投資を行ないます。 ②資金の流出入に伴なう売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行ないます。 ③株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
	受託会社	三井住友信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
	決算日	毎年２月12日（休業日の場合は翌営業日）

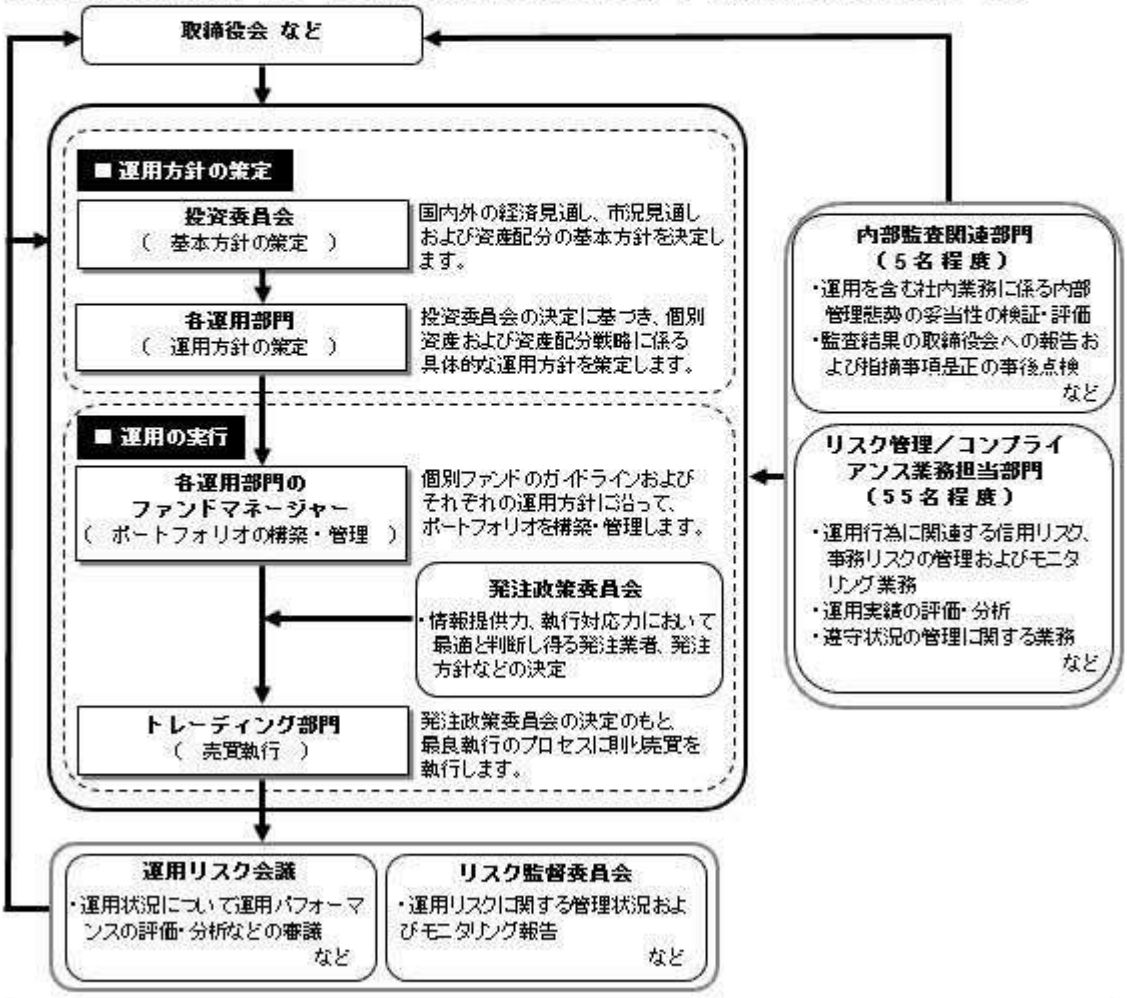
＊ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。
ＴＯＰＩＸの指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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

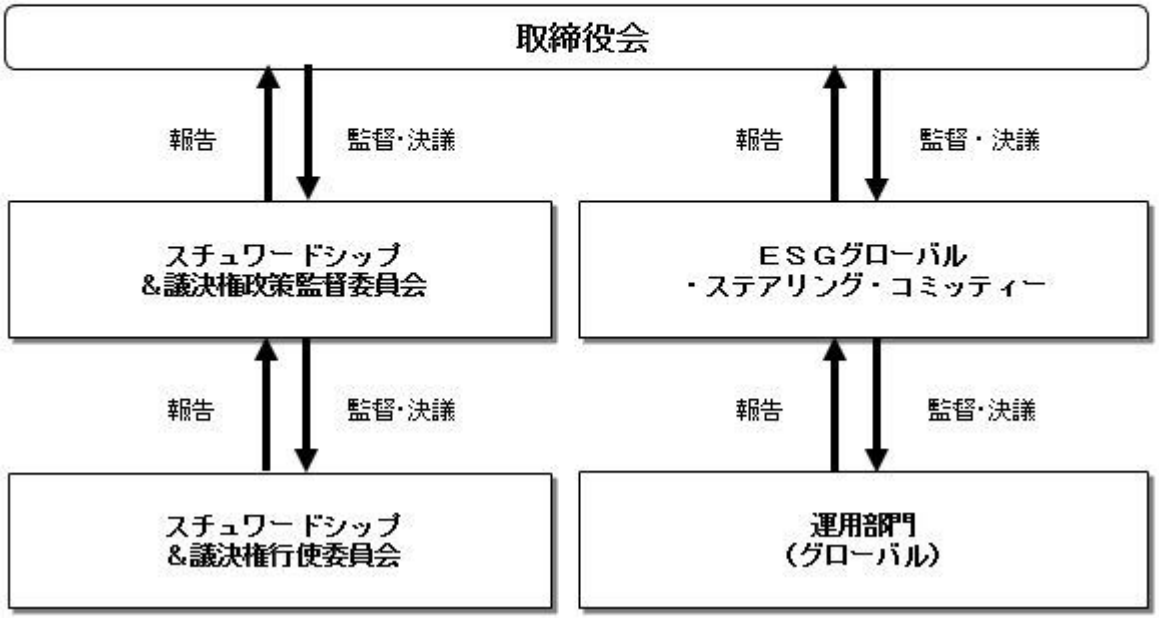


委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG／フィデューシャリー・デューティー

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



※上記体制は2021年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

① 収益分配方針
毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。
１）分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
２）分配対象額についての分配方針
利子・配当等収益を中心に安定的に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
３）留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
② 収益分配金の支払い
原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限
＜財形株投（一般財形30）＞
＜財形株投（一般財形50）＞
＜財形株投（年金・住宅財形30）＞
１）＜財形株投（一般財形30）＞
＜財形株投（年金・住宅財形30）＞
株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
＜財形株投（一般財形50）＞
株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資

産総額の50%以下とします。

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）同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

4）新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

5）同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

6）同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

7）外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

8）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、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ）株式分割により取得する株券

ハ）有償増資により取得する株券

ニ）売り出しにより取得する株券

ホ）信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

ヘ）信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使ならびに信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

9）信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で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て取り扱うものとします。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の５％を上回らない範囲内とします。

10）信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の５％を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の５％を上回らない範囲内とします。

11）信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が１年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の５％を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の５％を上回らない範囲内とします。

12）信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

13）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

14）信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

15）信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴なう支払資金の手当て（解約に伴なう支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。

イ）解約に伴なう支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価

証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内

ロ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内

ハ）借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

ニ）解約に伴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。

ホ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

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。

＜インデックス マザーファンド ＴＯＰＩＸ＞

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

２）投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

３）投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

４）外貨建資産への投資は行ないません。

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

信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ）株式分割により取得する株券

ハ）有償増資により取得する株券

ニ）売り出しにより取得する株券

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わが国の有価証券指数等先物取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

７）信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が１年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第13条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第13条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の５％を上回らない範囲内とし、かつ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の５％を上回らない範囲内とします。

８）信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利また

は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

9）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を次に定める範囲内で貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

10）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。

11）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。

＜財形公社債マザーファンド＞

1）株式への投資は行ないません。

2）同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

3）外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

4）信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、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次の範囲で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て取り扱うものとします。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の５％を上回らない範囲内とします。

5）信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の５％を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の５％を上回らない範囲内とします。

6）信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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

引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が１年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第10条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第２項第１号から第４号に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の５％を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の５％を上回らない範囲内とします。

７）信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

８）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債を次に定める範囲内で貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

９）信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

10）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。

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

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

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

・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を

被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①　価格変動リスク

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

・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

②　流動性リスク

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

③　信用リスク

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

・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（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、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。

・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。

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

④　為替変動リスク

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

＜その他の留意事項＞

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

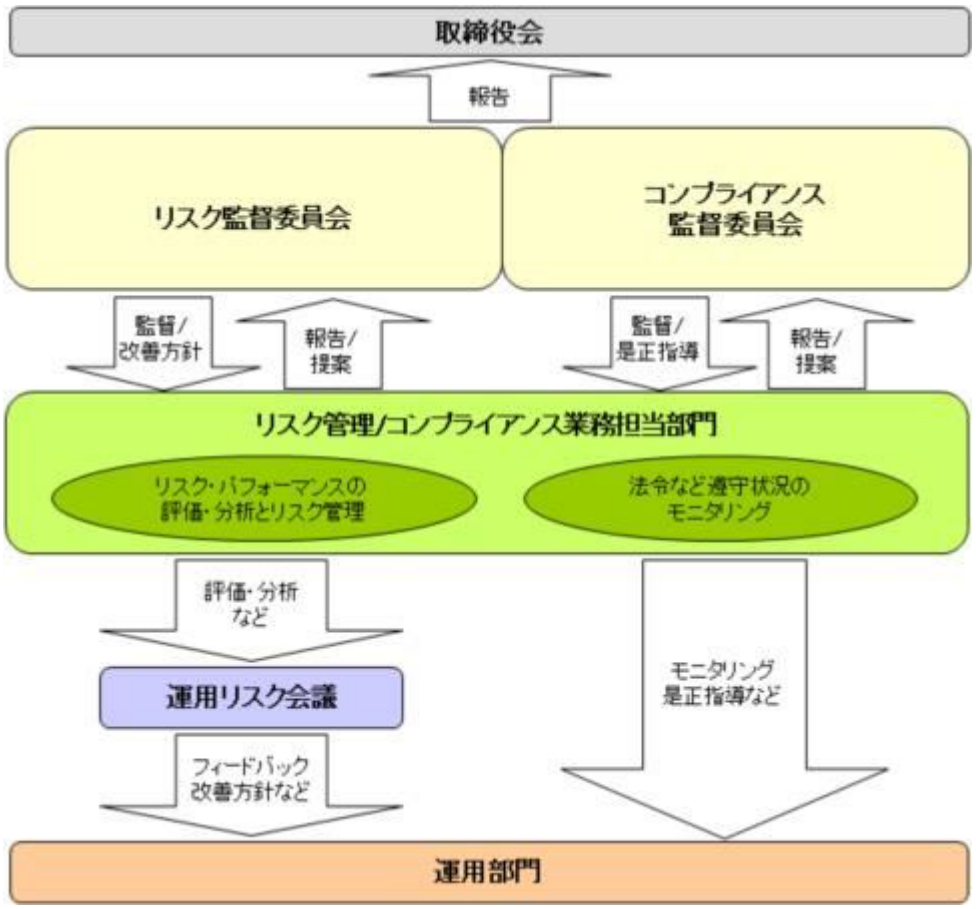
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴なう資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

・解約によるファンドの資金流出に伴なう基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

（2）リスク管理体制



■全社的リスク管理

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

■運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

■法令など遵守状況のモニタリング

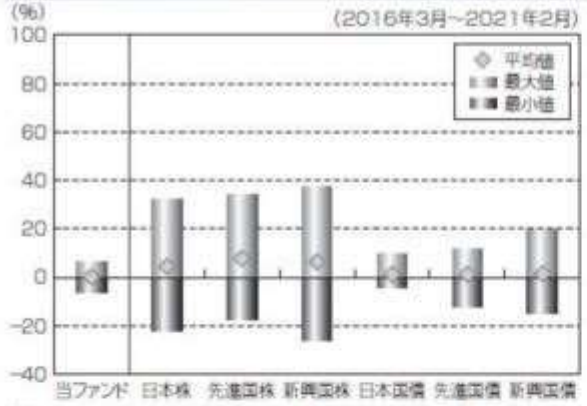
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

※上記体制は2021年2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）

「財形株投（一般財形 30）」

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

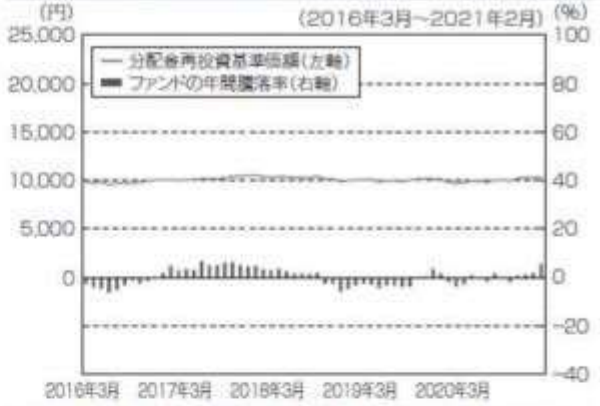


（当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率（%））

	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	0.0%	4.4%	7.8%	6.4%	1.2%	1.2%	1.5%
最大値	6.5%	32.2%	34.1%	37.2%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-6.4%	-22.0%	-17.5%	-26.3%	-4.0%	-12.3%	-15.0%

※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3月から2021年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

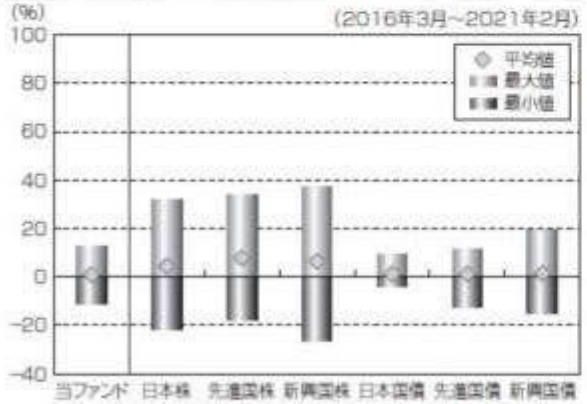
当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2016年3月末の基準価額を起点として指数化しています。
※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

「財形株投（一般財形 50）」

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

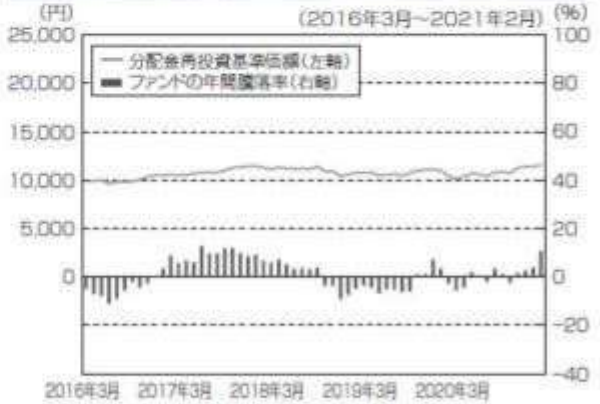


（当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率（%））

	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	0.9%	4.4%	7.8%	6.4%	1.2%	1.2%	1.5%
最大値	12.7%	32.2%	34.1%	37.2%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-11.1%	-22.0%	-17.5%	-26.3%	-4.0%	-12.3%	-15.0%

※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3月から2021年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

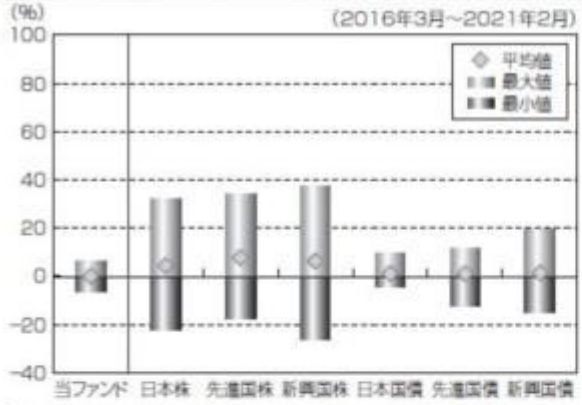
当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2016年3月末の基準価額を起点として指数化しています。
※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

「財形株投(年金･住宅財形 30)」

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	0.0%	4.4%	7.8%	6.4%	1.2%	1.2%	1.5%
最大値	6.5%	32.2%	34.1%	37.2%	9.3%	11.4%	19.3%
最小値	-6.4%	-22.0%	-17.5%	-26.3%	-4.0%	-12.3%	-15.0%

※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3月から2021年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大･最小･平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2016年3月末の基準価額を起点として指数化しています。
※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

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

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

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

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

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

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.617%（税抜1.47%）以内の率を乗じて得た額とします。
② 信託報酬の配分
当ファンドの信託報酬が税抜1.47%（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	販売会社	受託会社
1.47%	0.37%	1.05%	0.05%

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。
③ 支払時期
信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。
① 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

③　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴なう支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

＜投資対象とするマザーファンドに係る費用＞
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
・信託事務の処理に要する諸費用
・信託財産に関する租税　など

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。
＊監査費用、売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①　個人受益者の場合

＜一般財形の場合＞

収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、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。

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

※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。

＜年金・住宅財形の場合＞

・個人が受け取る収益分配金ならびに償還金および解約金には税金はかかりません。
・ただし、積み立てられた元金および収益分配金の累計額が、限度額（年金財形・住宅財形の合計で550万円）を超える場合には、非課税の特典を失い課税されます。この場合、収益分配金、解約金および償還金に対する課税は、一般財形の場合と同様の取扱いとなります。

（目的外解約）

年金・住宅財形の場合、年金受取り、自宅用住宅取得など以外の目的で解約請求するときには、家屋が災害などによる被害を受けた場合など法令で定められた事由がある場合を除き、非課税の特典を失い課税されます。この場合、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収となります。また、過去５年間にさかのぼり、その間に支払われた普通分配金に対しても課税が行なわれます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②　個別元本

１）各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
２）受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、１口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

③　普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

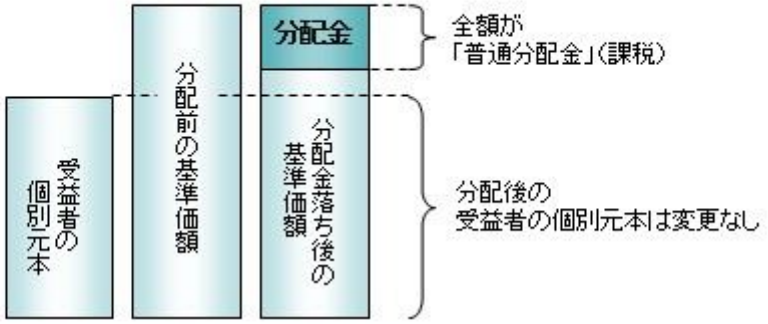
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

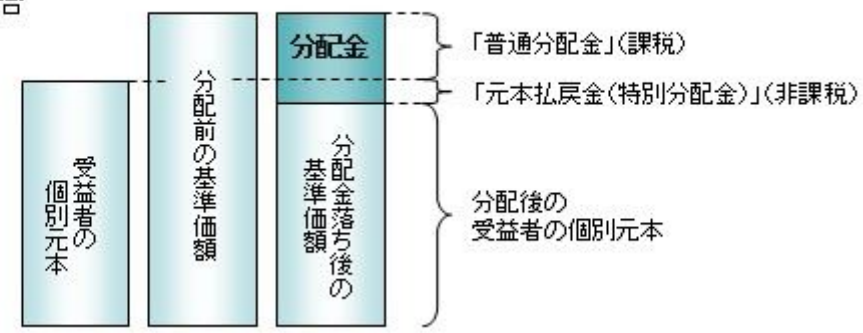
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



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

※上記は2021年4月30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】

【財形株投（一般財形３０）】

以下の運用状況は2021年 2月26日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	114,049,182	97.49
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	2,938,125	2.51
合計（純資産総額）		116,987,307	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	63,418,576	1.2779	81,042,599	1.2750	80,858,684	69.12
日本	親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	13,770,277	2.3649	32,565,329	2.4103	33,190,498	28.37

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.49
合　　計	97.49

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第18計算期間末　(2012年 2月 1日)	66	66	0.8241	0.8246
第19計算期間末　(2013年 2月 4日)	73	74	0.8775	0.8780
第20計算期間末　(2014年 2月 3日)	76	76	0.9341	0.9346
第21計算期間末　(2015年 2月 2日)	76	76	0.9788	0.9793
第22計算期間末　(2016年 2月 1日)	74	74	0.9931	0.9936
第23計算期間末　(2017年 2月 1日)	74	74	1.0043	1.0048
第24計算期間末　(2018年 2月 1日)	96	96	1.0543	1.0548
第25計算期間末　(2019年 2月 4日)	92	92	0.9991	0.9996
第26計算期間末　(2020年 2月 3日)	102	102	1.0087	1.0092
第27計算期間末　(2021年 2月 1日)	116	116	1.0311	1.0316
2020年 2月末日	103	—	0.9813	—
3月末日	102	—	0.9635	—
4月末日	104	—	0.9749	—

5月末日	107	—	0.9925	—
6月末日	107	—	0.9901	—
7月末日	107	—	0.9777	—
8月末日	110	—	0.9985	—
9月末日	111	—	1.0015	—
10月末日	110	—	0.9914	—
11月末日	114	—	1.0214	—
12月末日	116	—	1.0289	—
2021年 1月末日	115	—	1.0283	—
2月末日	116	—	1.0345	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	0.0005
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.0005
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	0.0005

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	△4.92
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	6.54
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.51
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.84
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.51
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.18
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	5.03
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	△5.19
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	1.01
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	2.27

(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18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	9,162,753	6,529,292
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	7,267,816	3,692,263
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	5,310,568	7,297,643
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	7,771,084	11,906,050
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	10,650,522	13,562,169
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	9,441,348	10,877,640
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	19,263,657	1,878,188
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	12,037,575	10,950,460
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	14,822,167	5,888,725
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	16,599,772	5,126,195

【財形株投（一般財形５０）】

以下の運用状況は2021年 2月26日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	191,110,989	97.47
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	4,959,777	2.53
合計（純資産総額）		196,070,766	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	76,240,963	1.2779	97,434,598	1.2750	97,207,227	49.58
日本	親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	38,959,367	2.3650	92,138,903	2.4103	93,903,762	47.89

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(％)
親投資信託受益証券	97.47

合　　計	97.47

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第18計算期間末　(2012年 2月 1日)	147	147	0.7364	0.7369
第19計算期間末　(2013年 2月 4日)	180	180	0.8230	0.8235
第20計算期間末　(2014年 2月 3日)	169	169	0.9212	0.9217
第21計算期間末　(2015年 2月 2日)	183	183	0.9993	0.9998
第22計算期間末　(2016年 2月 1日)	187	187	1.0263	1.0268
第23計算期間末　(2017年 2月 1日)	207	207	1.0525	1.0530
第24計算期間末　(2018年 2月 1日)	241	241	1.1549	1.1554
第25計算期間末　(2019年 2月 4日)	225	225	1.0635	1.0640
第26計算期間末　(2020年 2月 3日)	209	209	1.0921	1.0926
第27計算期間末　(2021年 2月 1日)	194	194	1.1429	1.1434
2020年 2月末日	198	—	1.0404	—
3月末日	191	—	1.0100	—
4月末日	194	—	1.0306	—
5月末日	202	—	1.0630	—
6月末日	203	—	1.0603	—
7月末日	203	—	1.0385	—
8月末日	210	—	1.0773	—
9月末日	210	—	1.0833	—
10月末日	208	—	1.0666	—
11月末日	221	—	1.1219	—
12月末日	197	—	1.1372	—
2021年 1月末日	193	—	1.1371	—
2月末日	196	—	1.1517	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	0.0005
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.0005
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	0.0005

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	△7.82
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	11.83
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	11.99
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	8.53
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	2.75
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	2.60
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	9.78
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	△7.87
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	2.74
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	4.70

(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18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	27,582,276	11,103,657
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	26,104,473	7,608,165
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	18,531,876	53,414,352
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	17,501,615	18,329,958
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	17,040,435	17,577,441
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	18,988,051	4,886,387
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	48,663,216	36,200,357
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	21,221,642	18,123,775
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	21,804,485	42,344,325

第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	20,242,673	42,112,594

【財形株投（年金・住宅財形３０）】

以下の運用状況は2021年 2月26日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	217,858,123	97.55
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	5,480,124	2.45
合計（純資産総額）		223,338,247	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
日本	親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	121,287,612	1.2779	155,003,931	1.2750	154,641,705	69.24
日本	親投資信託受益証券	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	26,227,614	2.3649	62,025,685	2.4103	63,216,418	28.31

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(％)
親投資信託受益証券	97.55
合　　計	97.55

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第18計算期間末　(2012年 2月 1日)	167	167	0.8257	0.8262
第19計算期間末　(2013年 2月 4日)	178	178	0.8795	0.8800
第20計算期間末　(2014年 2月 3日)	188	188	0.9360	0.9365
第21計算期間末　(2015年 2月 2日)	190	190	0.9807	0.9812
第22計算期間末　(2016年 2月 1日)	178	178	0.9949	0.9954
第23計算期間末　(2017年 2月 1日)	182	182	1.0057	1.0062
第24計算期間末　(2018年 2月 1日)	210	210	1.0558	1.0563
第25計算期間末　(2019年 2月 4日)	203	203	1.0016	1.0021
第26計算期間末　(2020年 2月 3日)	201	201	1.0109	1.0114
第27計算期間末　(2021年 2月 1日)	221	221	1.0324	1.0329
2020年 2月末日	197	—	0.9827	—
3月末日	195	—	0.9646	—
4月末日	198	—	0.9760	—
5月末日	203	—	0.9936	—
6月末日	204	—	0.9912	—
7月末日	205	—	0.9789	—
8月末日	210	—	0.9996	—
9月末日	212	—	1.0026	—
10月末日	211	—	0.9925	—
11月末日	219	—	1.0225	—
12月末日	221	—	1.0301	—
2021年 1月末日	220	—	1.0296	—
2月末日	223	—	1.0359	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	0.0005
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	0.0005
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	0.0005
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.0005
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	0.0005

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	△4.95
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	6.58
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.48
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.83
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.50
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.14
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	5.03
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	△5.09
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	0.98
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	2.18

(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18期	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	23,698,329	4,235,525
第19期	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	20,751,257	20,707,336
第20期	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	17,559,108	18,995,836
第21期	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	20,521,555	27,814,502
第22期	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	20,768,810	35,315,828
第23期	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	22,112,907	19,936,078
第24期	2017年 2月 2日～2018年 2月 1日	34,698,129	17,021,386
第25期	2018年 2月 2日～2019年 2月 4日	22,034,865	18,046,134
第26期	2019年 2月 5日～2020年 2月 3日	21,763,698	25,689,628
第27期	2020年 2月 4日～2021年 2月 1日	21,694,209	6,452,657

（参考）

財形公社債マザーファンド

以下の運用状況は2021年 2月26日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	224,261,786	67.40
地方債証券	日本	38,334,870	11.52
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	70,118,442	21.07

合計（純資産総額）	332,715,098	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

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
日本	国債証券	第３９８回利付国債（２年）	54,000,000	100.00	54,003,306	100.00	54,003,306	0.100	2021/3/1	16.23
日本	国債証券	第１２９回利付国債（５年）	50,000,000	100.14	50,072,180	100.14	50,072,180	0.100	2021/9/20	15.05
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	40,000,000	101.10	40,442,400	100.23	40,092,800	0.100	2028/12/20	12.05
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	30,000,000	100.41	30,125,100	100.38	30,116,400	0.100	2022/12/20	9.05
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	30,000,000	100.51	30,155,700	99.86	29,960,700	0.100	2029/12/20	9.00
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	20,000,000	100.96	20,192,800	100.08	20,016,400	0.100	2029/6/20	6.02
日本	地方債証券	平成２４年度第３回愛知県公募公債（１０年）	15,000,000	101.16	15,174,750	101.09	15,164,550	0.891	2022/5/30	4.56
日本	地方債証券	平成２３年度第２回京都府公募公債	13,000,000	100.37	13,048,820	100.37	13,048,820	1.200	2021/6/22	3.92
日本	地方債証券	第７１８回東京都公募公債	10,000,000	101.24	10,124,500	101.21	10,121,500	0.600	2023/3/20	3.04

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	67.40
地方債証券	11.52
合　　計	78.93

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。

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

以下の運用状況は2021年 2月26日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	41,413,425,450	99.74
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	108,525,412	0.26
合計（純資産総額）		41,521,950,862	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	112,530,000	0.27

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	164,100	8,413.00	1,380,573,300	7,873.00	1,291,959,300	3.11
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	126,100	9,797.00	1,235,401,700	9,895.00	1,247,759,500	3.01
日本	株式	ソニー	電気機器	101,500	11,845.00	1,202,267,500	11,120.00	1,128,680,000	2.72
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,900	57,690.00	917,271,000	50,560.00	803,904,000	1.94
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,092,700	528.60	577,601,220	558.00	609,726,600	1.47
日本	株式	任天堂	その他製品	9,300	66,340.00	616,962,000	64,750.00	602,175,000	1.45
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	110,800	5,128.00	568,182,400	5,281.00	585,134,800	1.41
日本	株式	日本電産	電気機器	39,000	14,800.00	577,200,000	13,520.00	527,280,000	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	186,000	2,805.50	521,823,000	2,758.00	512,988,000	1.24
日本	株式	信越化学工業	化学	29,300	18,285.00	535,750,500	17,350.00	508,355,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	134,800	3,688.00	497,142,400	3,582.00	482,853,600	1.16
日本	株式	村田製作所	電気機器	47,600	9,752.00	464,195,200	9,081.00	432,255,600	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	20,600	23,040.00	474,624,000	20,720.00	426,832,000	1.03
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	127,600	3,315.00	422,994,000	3,290.00	419,804,000	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	139,000	3,251.00	451,889,000	3,010.00	418,390,000	1.01
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,500	42,990.00	408,405,000	43,550.00	413,725,000	1.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	110,500	3,601.00	397,910,500	3,742.00	413,491,000	1.00
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	32,100	13,060.00	419,226,000	12,100.00	388,410,000	0.94
日本	株式	日立製作所	電気機器	77,900	4,892.00	381,086,800	4,876.00	379,840,400	0.91
日本	株式	ファナック	電気機器	14,200	28,050.00	398,310,000	26,340.00	374,028,000	0.90
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	127,500	3,019.00	384,922,500	2,911.50	371,216,250	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	111,400	3,117.00	347,233,800	3,168.00	352,915,200	0.85

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	217,000	1,530.00	332,010,000	1,559.00	338,303,000	0.81
日本	株式	ＳＭＣ	機械	4,800	66,440.00	318,912,000	62,900.00	301,920,000	0.73
日本	株式	三井物産	卸売業	129,400	2,009.00	259,964,600	2,263.50	292,896,900	0.71
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	16,400	17,735.00	290,854,000	17,840.00	292,576,000	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	97,000	2,853.00	276,741,000	3,003.00	291,291,000	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	53,000	5,534.00	293,302,000	5,253.00	278,409,000	0.67
日本	株式	花王	化学	38,800	7,486.00	290,456,800	7,144.00	277,187,200	0.67
日本	株式	資生堂	化学	32,200	7,995.00	257,439,000	7,913.00	254,798,600	0.61

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.18
		建設業	2.28
		食料品	3.32
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.28
		医薬品	5.43
		石油・石炭製品	0.45
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.79
		鉄鋼	0.69
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.63
		機械	5.57
		電気機器	17.61
		輸送用機器	6.97
		精密機器	2.55
		その他製品	2.48
		電気・ガス業	1.28
		陸運業	3.62
		海運業	0.21
		空運業	0.48
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.58
		卸売業	4.69
		小売業	4.71
		銀行業	5.04
		証券、商品先物取引業	0.82
		保険業	1.89
		その他金融業	1.09

		不動産業	1.99
		サービス業	5.74
合　　計			99.74

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物　２０２１年０３月	買建	6	日本円	115,680,000	112,530,000	0.27

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

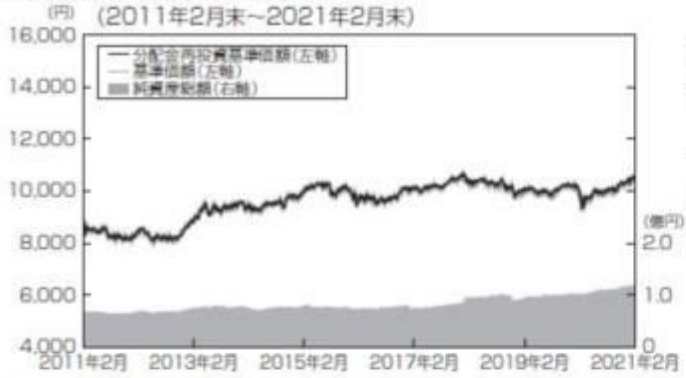
≪参考情報≫

運用実績

2021年2月26日現在

基準価額・純資産の推移

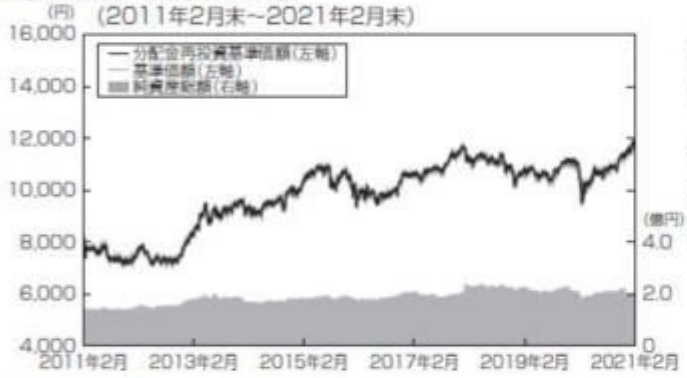
「財形株投（一般財形 30）」



基準価額……10,345円
純資産総額……1.16億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2011年2月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金（税引前）を再投資したものとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

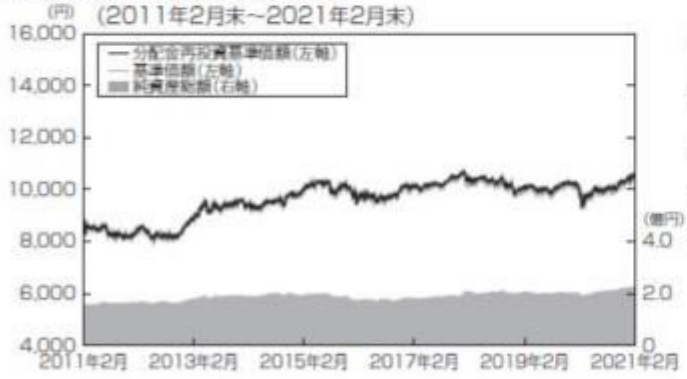
「財形株投（一般財形 50）」



基準価額……11,517円
純資産総額……1.96億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2011年2月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金（税引前）を再投資したものとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

「財形株投（年金・住宅財形 30）」



基準価額……10,359円
純資産総額……2.23億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2011年2月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金（税引前）を再投資したものとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移（税引前、1万口当たり）

「財形株投（一般財形 30）」

2017年2月	2018年2月	2019年2月	2020年2月	2021年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	130円

「財形株投（一般財形 50）」

2017年2月	2018年2月	2019年2月	2020年2月	2021年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	130円

「財形株投（年金・住宅財形 30）」

2017年2月	2018年2月	2019年2月	2020年2月	2021年2月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	130円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	財形株投（一般財形 30）	財形株投（一般財形 50）	財形株投（年金･住宅財形 30）
財形公社債マザーファンド	69.12%	49.58%	69.24%
インデックス マザーファンド TOPIX	28.37%	47.89%	28.31%
現金その他	2.51%	2.53%	2.45%

※各ファンドの実質組入比率です。

<組入上位銘柄>
財形公社債マザーファンド

	銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1	第398回利付国債(2年)	国債証券	0.1%	2021年3月1日	16.23%
2	第129回利付国債(5年)	国債証券	0.1%	2021年9月20日	15.05%
3	第353回利付国債(10年)	国債証券	0.1%	2028年12月20日	12.05%

※財形公社債マザーファンドの対純資産総額比です。

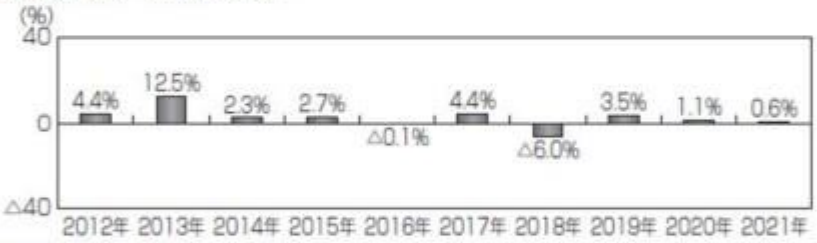
インデックス マザーファンド TOPIX

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.11%
2	ソフトバンクグループ	情報･通信業	3.01%
3	ソニー	電気機器	2.72%
4	キーエンス	電気機器	1.94%
5	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.47%

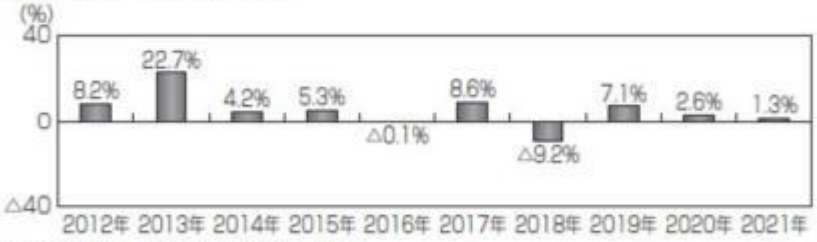
※インデックス マザーファンド TOPIXの対純資産総額比です。

年間収益率の推移

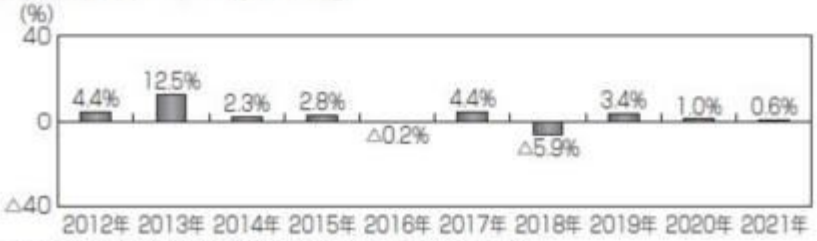
「財形株投（一般財形 30）」



「財形株投（一般財形 50）」



「財形株投（年金･住宅財形 30）」



※ファンドの年間収益率は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算しております。
※当ファンドには、ベンチマークはありません。
※2021年は、2021年2月末までの騰落率です。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込方法

- **原則として、勤務先の事務局を通じて、販売会社所定の方法でお申し込みください。**
- **原則として、勤務先の事務局を通じて給与天引きで行なわれるため、販売会社に入金された日を取得申込受付日とします。**

・ご選択によりそれぞれ「勤労者財産形成貯蓄契約」、「勤労者財産形成年金貯蓄契約」または「勤労者財産形成住宅貯蓄契約」（以下「財形貯蓄に関する契約」といいます。）を結んでいただきます。

（２）申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。なお、「財形貯蓄に関する契約」で定める日（原則として、毎月10日、20日および月末を締切日とし、各締切日から起算して５営業日目）を取得申込受付日とします。

（３）申込単位

勤務先の事務局、販売会社の照会先にお問い合わせください。

（４）申込代金の支払い

原則として、勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

（５）受付の中止および取消

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

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

２【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

（１）解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

①　一般財形の場合（＜一般財形30＞＜一般財形50＞）

原則として、いつでも解約が可能です。

②　年金財形の場合（＜年金・住宅財形30＞）

・年金受取り以外の目的での解約は原則として認められません。

・年金受取り以外の目的で解約された場合には、財形年金口座そのものが全額解約されることになり、したがって、家屋が災害などによる被害を受けた場合など法令で定められた事由がある場合を除き、非課税の特典を失うことになります。

③　住宅財形の場合（＜年金・住宅財形30＞）

・自宅用住宅の取得など以外の目的での解約は原則として認められません。

・自宅用住宅の取得など以外の目的で解約された場合には、住宅財形口座そのものが全額解約されることになり、したがって、家屋が災害などによる被害を受けた場合など法令で定められた事由がある場合を除き、非課税の特典を失うことになります。

（２）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。

（３）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。

（４）手取額

①　一般財形の場合（＜一般財形30＞＜一般財形50＞）

１口当りの手取額は、解約価額から、解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。

※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。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

② 年金財形の場合（＜年金・住宅財形30＞）

１）年金受取りを目的として解約される場合

積み立てられた元金および収益分配金の累計額が限度額（住宅財形と年金財形の合計で550万円）以下である場合は、年金の受取りが終了するまで非課税扱いです。したがって、１口当たりの手取額は、解約価額となります。

２）年金受取り以外の目的で解約される場合

非課税の特典を失い（家屋が災害などによる被害を受けた場合など法令で定められた事由がある場合を除きます。）、財形年金口座そのものが全額解約されることになります。１口につき、解約価額から、解約に係る所定の税金が差し引かれるほか、過去５年間にさかのぼり、その間に支払われた普通分配金に対しても課税が行なわれます。（加入者の死亡・重度障害などの場合には、上記と取扱いが異なります。詳しくは、勤務先の事務局にお問い合わせください。）

※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。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

③ 住宅財形の場合（＜年金・住宅財形30＞）

１）自宅用住宅の取得などを目的として解約される場合

積み立てられた元金および収益分配金の累計額が限度額（住宅財形と年金財形の合計で550万円）以下である場合は、非課税扱いです。したがって、１口当たりの手取額は、解約価額となります。

２）自宅用住宅の取得など以外の目的で解約される場合

非課税の特典を失い（家屋が災害などによる被害を受けた場合など法令で定められた事由がある場合を除きます。）、住宅財形口座そのものが全額解約されることになります。１口につき、解約価額から、解約に係る所定の税金が差し引かれるほか、過去５年間にさかのぼり、その間に支払われた普通分配金に対しても課税が行なわれます。（加入者の死亡・重度障害などの場合には、上記と取扱いが異なります。詳しくは、勤務先の事務局にお問い合わせください。）

※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。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（５）解約単位

１口単位

※販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

（６）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。

（７）受付の中止および取消

・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、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）買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

（２）買取制限

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、大口の買取り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。

（３）買取価額

買取請求受付日の基準価額から、当該買取りを行なう販売会社に係る源泉徴収税額に相当する金額を控除した価額となります。なお、一定の要件の下では、買取請求受付日の基準価額となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※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。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（４）手取額

１口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

（５）買取単位

１口単位

※販売会社によっては、買取単位が異なる場合があります。詳しくは、勤務先の事務局または販売会社にお問い合わせください。

（６）受付の中止および取消

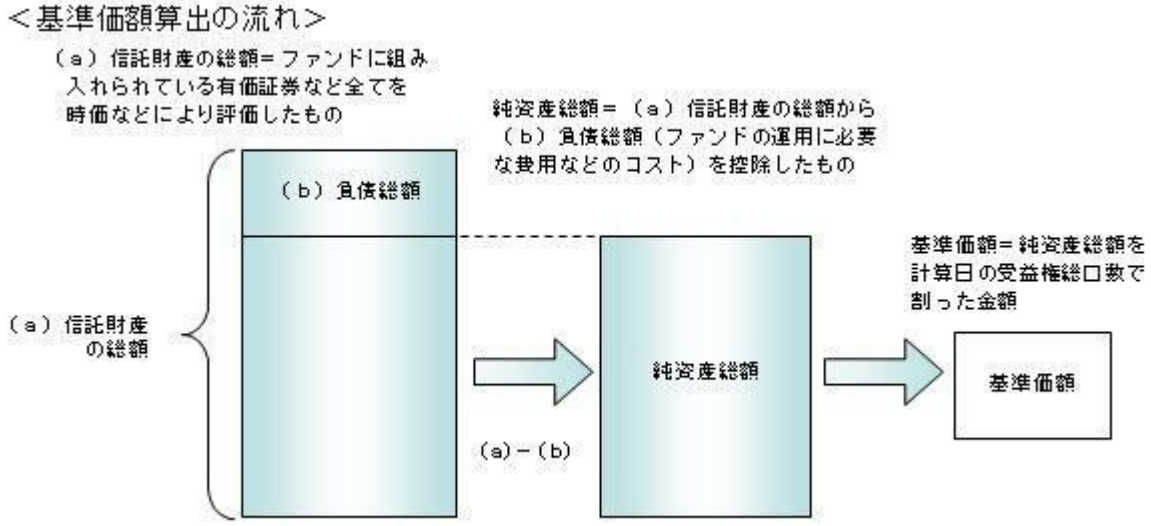
・販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて買取りを中止すること、および既に受け付けた買取りを取り消すことができます。
・買取請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

① 基準価額の算出

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



② 有価証券などの評価基準

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

＜主な資産の評価方法＞

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇国内公社債

原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。

・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
・価格情報会社の提供する価額

※残存期間１年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

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

③　基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（1994年2月4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２月２日から翌年２月１日（２月１日および２日のいずれかが休業日のときは、２月１日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち、２月１日に最も近い日）までとし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

①　信託の終了（繰上償還）

１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
イ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
ロ）やむを得ない事情が発生したとき

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

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

４）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
イ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
ハ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
ニ）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

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

②　償還金について

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

・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

③　信託約款の変更

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

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

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

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

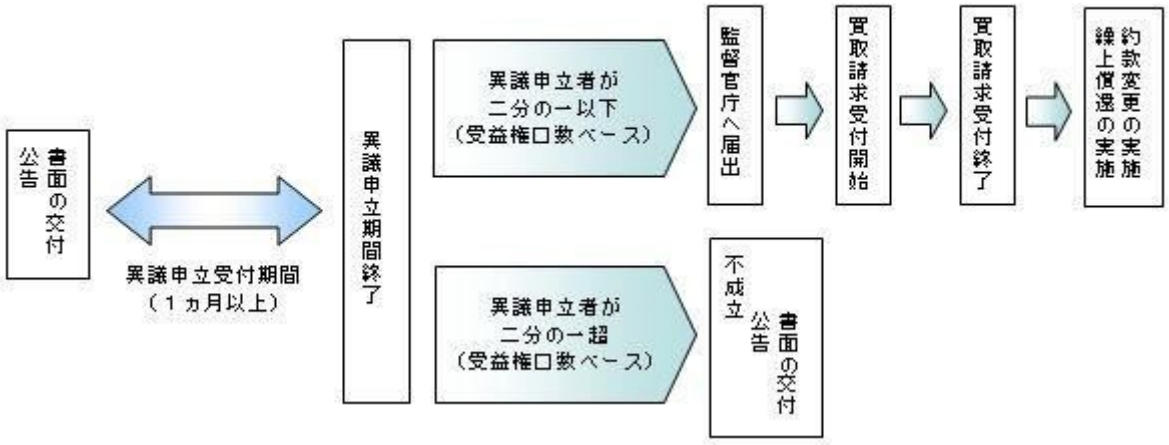
④　異議の申立て

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

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

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

＜繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ＞



⑤　公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥　運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス　　www.nikkoam.com/

⑦　関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（1）収益分配金・償還金受領権

- **受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。**

・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から５年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行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）解約請求権

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

（３）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

＜財形株投（一般財形３０）＞
＜財形株投（一般財形５０）＞
＜財形株投（年金・住宅財形３０）＞

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

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期計算期間（2020年 2月 4日から2021年 2月 1日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【財形株投（一般財形３０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第26期 2020年 2月 3日現在	第27期 2021年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,305,803	3,857,740
親投資信託受益証券	99,671,432	113,308,714
流動資産合計	102,977,235	117,166,454
資産合計	102,977,235	117,166,454
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	50,609	56,345
未払受託者報酬	28,012	30,918
未払委託者報酬	797,357	879,742
未払利息	1	-
その他未払費用	2,189	2,418
流動負債合計	878,168	969,423
負債合計	878,168	969,423
純資産の部		
元本等		
元本	101,218,195	112,691,772
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	880,872	3,505,259
（分配準備積立金）	7,313,165	6,917,561
元本等合計	102,099,067	116,197,031
純資産合計	102,099,067	116,197,031
負債純資産合計	102,977,235	117,166,454

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第26期 自　2019年 2月 5日 至　2020年 2月 3日	第27期 自　2020年 2月 4日 至　2021年 2月 1日
営業収益		
受取利息	2	1
有価証券売買等損益	2,539,027	4,577,045
営業収益合計	2,539,029	4,577,046
営業費用		
支払利息	895	638
受託者報酬	53,519	59,561
委託者報酬	1,523,442	1,694,937
その他費用	4,233	4,655
営業費用合計	1,582,089	1,759,791
営業利益又は営業損失（△）	956,940	2,817,255
経常利益又は経常損失（△）	956,940	2,817,255
当期純利益又は当期純損失（△）	956,940	2,817,255
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（△）	△21,970	22,208
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△82,078	880,872
剰余金増加額又は欠損金減少額	34,649	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,755	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	29,894	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	114,315
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	37,519
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	76,796
分配金	50,609	56,345
期末剰余金又は期末欠損金（△）	880,872	3,505,259

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月2日から翌年2月1日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）もしくはその翌日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で、翌日が営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2020年 2月 4日から2021年 2月 1日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

		第26期 2020年 2月 3日現在	第27期 2021年 2月 1日現在
1.	期首元本額	92,284,753円	101,218,195円
	期中追加設定元本額	14,822,167円	16,599,772円
	期中一部解約元本額	5,888,725円	5,126,195円
2.	受益権の総数	101,218,195口	112,691,772口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日		第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	0円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	13,372,874円	C 信託約款に定める収益調整金	16,056,868円
D 信託約款に定める分配準備積立金	7,363,774円	D 信託約款に定める分配準備積立金	6,973,906円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	20,736,648円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	23,030,774円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,048円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,043円
G 分配金額	50,609円	G 分配金額	56,345円
H 分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)	5円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日	第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第26期 2020年 2月 3日現在	第27期 2021年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 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26期（2020年 2月 3日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,315,048
合計	2,315,048

第27期（2021年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	4,678,354
合計	4,678,354

（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26期 2020年 2月 3日現在		第27期 2021年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.0087円	1口当たり純資産額	1.0311円
(1万口当たり純資産額)	(10,087円)	(1万口当たり純資産額)	(10,311円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	62,432,858	79,789,192	
	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	14,175,557	33,519,522	
合計		76,608,415	113,308,714	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【財形株投（一般財形５０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第26期 2020年 2月 3日現在	第27期 2021年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,025,183	6,757,873
親投資信託受益証券	204,373,609	189,270,146
流動資産合計	211,398,792	196,028,019
資産合計	211,398,792	196,028,019
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	95,912	84,977
未払受託者報酬	61,111	57,837
未払委託者報酬	1,737,268	1,644,256
未払利息	3	1
その他未払費用	4,822	4,569
流動負債合計	1,899,116	1,791,640
負債合計	1,899,116	1,791,640
純資産の部		
元本等		
元本	191,825,330	169,955,409
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	17,674,346	24,280,970
（分配準備積立金）	31,704,518	26,728,460
元本等合計	209,499,676	194,236,379
純資産合計	209,499,676	194,236,379
負債純資産合計	211,398,792	196,028,019

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第26期 自　2019年 2月 5日 至　2020年 2月 3日	第27期 自　2020年 2月 4日 至　2021年 2月 1日
営業収益		
受取利息	5	4
有価証券売買等損益	9,804,865	13,044,495
営業収益合計	9,804,870	13,044,499
営業費用		
支払利息	2,173	1,338
受託者報酬	118,184	112,437
委託者報酬	3,359,739	3,196,662
その他費用	9,507	8,886
営業費用合計	3,489,603	3,319,323
営業利益又は営業損失（△）	6,315,267	9,725,176
経常利益又は経常損失（△）	6,315,267	9,725,176
当期純利益又は当期純損失（△）	6,315,267	9,725,176
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（△）	902,108	737,695
期首剰余金又は期首欠損金（△）	13,488,170	17,674,346
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,570,607	1,511,774
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	1,570,607	1,511,774
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,701,678	3,807,654
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,701,678	3,807,654
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	95,912	84,977
期末剰余金又は期末欠損金（△）	17,674,346	24,280,970

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月2日から翌年2月1日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）もしくはその翌日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で、翌日が営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2020年 2月 4日から2021年 2月 1日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

		第26期 2020年 2月 3日現在	第27期 2021年 2月 1日現在
1.	期首元本額	212,365,170円	191,825,330円
	期中追加設定元本額	21,804,485円	20,242,673円
	期中一部解約元本額	42,344,325円	42,112,594円
2.	受益権の総数	191,825,330口	169,955,409口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日		第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	0円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	1,536,158円
C 信託約款に定める収益調整金	45,048,817円	C 信託約款に定める収益調整金	42,725,294円
D 信託約款に定める分配準備積立金	31,800,430円	D 信託約款に定める分配準備積立金	25,277,279円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	76,849,247円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	69,538,731円
F 分配対象収益(1万口当たり)	4,006円	F 分配対象収益(1万口当たり)	4,091円
G 分配金額	95,912円	G 分配金額	84,977円
H 分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)	5円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日	第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第26期 2020年 2月 3日現在	第27期 2021年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 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26期（2020年 2月 3日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	8,198,293
合計	8,198,293

第27期（2021年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	12,336,605
合計	12,336,605

（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26期 2020年 2月 3日現在		第27期 2021年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.0921円	1口当たり純資産額	1.1429円
(1万口当たり純資産額)	(10,921円)	(1万口当たり純資産額)	(11,429円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	74,318,346	94,978,846	
	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	39,876,216	94,291,300	
合計		114,194,562	189,270,146	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【財形株投（年金・住宅財形３０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第26期 2020年 2月 3日現在	第27期 2021年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,989,977	7,582,418
親投資信託受益証券	196,270,407	215,786,245
流動資産合計	203,260,384	223,368,663
資産合計	203,260,384	223,368,663
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	99,658	107,278
未払受託者報酬	56,456	59,060
未払委託者報酬	1,605,232	1,678,851
未払利息	3	1
その他未払費用	4,461	4,663
流動負債合計	1,765,810	1,849,853
負債合計	1,765,810	1,849,853
純資産の部		
元本等		
元本	199,316,077	214,557,629
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,178,497	6,961,181
（分配準備積立金）	16,949,161	16,334,973
元本等合計	201,494,574	221,518,810
純資産合計	201,494,574	221,518,810
負債純資産合計	203,260,384	223,368,663

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第26期 自　2019年 2月 5日 至　2020年 2月 3日	第27期 自　2020年 2月 4日 至　2021年 2月 1日
営業収益		
受取利息	5	4
有価証券売買等損益	5,282,503	8,351,784
営業収益合計	5,282,508	8,351,788
営業費用		
支払利息	2,037	1,346
受託者報酬	109,852	113,908
委託者報酬	3,123,346	3,238,355
その他費用	8,838	8,996
営業費用合計	3,244,073	3,362,605
営業利益又は営業損失（△）	2,038,435	4,989,183
経常利益又は経常損失（△）	2,038,435	4,989,183
当期純利益又は当期純損失（△）	2,038,435	4,989,183
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（△）	148,449	21,192
期首剰余金又は期首欠損金（△）	332,442	2,178,497
剰余金増加額又は欠損金減少額	97,229	-
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	97,229	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	41,502	78,029
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	41,502	62,713
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	15,316
分配金	99,658	107,278
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,178,497	6,961,181

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年2月2日から翌年2月1日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）もしくはその翌日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で、翌日が営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2020年 2月 4日から2021年 2月 1日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

		第26期 2020年 2月 3日現在	第27期 2021年 2月 1日現在
１．	期首元本額	203,242,007円	199,316,077円
	期中追加設定元本額	21,763,698円	21,694,209円
	期中一部解約元本額	25,689,628円	6,452,657円
２．	受益権の総数	199,316,077口	214,557,629口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日		第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	0円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	31,885,313円	C 信託約款に定める収益調整金	36,126,448円
D 信託約款に定める分配準備積立金	17,048,819円	D 信託約款に定める分配準備積立金	16,442,251円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	48,934,132円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	52,568,699円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,455円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,450円
G 分配金額	99,658円	G 分配金額	107,278円
H 分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり)	5円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第26期 自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日	第27期 自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第26期 2020年 2月 3日現在	第27期 2021年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 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26期（2020年 2月 3日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	4,600,976
合計	4,600,976

第27期（2021年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	8,653,327
合計	8,653,327

（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26期 2020年 2月 3日現在		第27期 2021年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.0109円	1口当たり純資産額	1.0324円
(1万口当たり純資産額)	(10,109円)	(1万口当たり純資産額)	(10,324円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	財形公社債マザーファンド	118,893,324	151,945,668	
	インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ	26,998,468	63,840,577	
合計		145,891,792	215,786,245	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「財形株投（一般財形30）」「財形株投（一般財形50）」「財形株投（年金・住宅財形30）」は、「財形公社債マザーファンド」「インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

財形公社債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 2月 3日現在	2021年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	107,710,850	123,475,640
国債証券	165,477,020	164,731,161
地方債証券	38,712,330	38,358,570
未収利息	59,553	114,529
前払費用	57,953	-
流動資産合計	312,017,706	326,679,900
資産合計	312,017,706	326,679,900
負債の部		
流動負債		
未払利息	56	27
流動負債合計	56	27
負債合計	56	27
純資産の部		

	2020年 2月 3日現在	2021年 2月 1日現在
元本等		
元本	243,658,790	255,644,528
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	68,358,860	71,035,345
元本等合計	312,017,650	326,679,873
純資産合計	312,017,650	326,679,873
負債純資産合計	312,017,706	326,679,900

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

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 2月 3日現在	2021年 2月 1日現在
1．	期首	2019年 2月 5日	2020年 2月 4日
	期首元本額	240,503,461円	243,658,790円
	期首からの追加設定元本額	40,597,626円	59,352,411円
	期首からの一部解約元本額	37,442,297円	47,366,673円
	元本の内訳　※		
	財形株投（一般財形３０）	55,067,554円	62,432,858円
	財形株投（一般財形５０）	80,128,382円	74,318,346円
	財形株投（年金・住宅財形３０）	108,462,854円	118,893,324円
	計	243,658,790円	255,644,528円
2．	受益権の総数	243,658,790口	255,644,528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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日	自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年 2月 3日現在	2021年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 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）

（2020年 2月 3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
国債証券	△69,980
地方債証券	△105,070
合計	△175,050

（2021年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△745,859
地方債証券	△353,760
合計	△1,099,619

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

（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 2月 3日現在		2021年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	1.281円	1口当たり純資産額	1.278円
(1千口当たり純資産額)	(1,281円)	(1千口当たり純資産額)	(1,278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

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第３９８回利付国債（２年）	54,000,000	54,015,156	
	第１２９回利付国債（５年）	50,000,000	50,080,805	
	第３５３回利付国債（１０年）	40,000,000	40,442,400	
	第３５５回利付国債（１０年）	20,000,000	20,192,800	
国債証券 合計		164,000,000	164,731,161	
地方債証券	第７１８回東京都公募公債	10,000,000	10,124,500	
	平成２３年度第２回京都府公募公債	13,000,000	13,059,320	
	平成２４年度第３回愛知県公募公債（１０年）	15,000,000	15,174,750	
地方債証券 合計		38,000,000	38,358,570	
合計		202,000,000	203,089,731	

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。

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 2月 3日現在	2021年 2月 1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	64,333,617	981,509,609
株式	39,283,692,490	40,992,862,260
派生商品評価勘定	-	4,004,700
未収配当金	66,063,365	55,032,124
前払金	2,640,000	-
流動資産合計	39,416,729,472	42,033,408,693
資産合計	39,416,729,472	42,033,408,693
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,333,300	-
前受金	-	2,208,000
未払金	12,289,500	817,164,014
未払解約金	23,705,950	113,183,506
未払利息	33	219
流動負債合計	39,328,783	932,555,739
負債合計	39,328,783	932,555,739
純資産の部		
元本等		
元本	18,667,515,485	17,381,724,461
剰余金		

	2020年 2月 3日現在	2021年 2月 1日現在
剰余金又は欠損金（△）	20,709,885,204	23,719,128,493
元本等合計	39,377,400,689	41,100,852,954
純資産合計	39,377,400,689	41,100,852,954
負債純資産合計	39,416,729,472	42,033,408,693

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 2月 3日現在	2021年 2月 1日現在
1．	期首	2019年 2月 5日	2020年 2月 4日
	期首元本額	20,186,693,914円	18,667,515,485円
	期首からの追加設定元本額	1,606,465,100円	2,059,737,644円
	期首からの一部解約元本額	3,125,643,529円	3,345,528,668円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンドＴＳＰ	10,103,237,838円	9,027,519,254円
	財形株投（一般財形３０）	13,809,565円	14,175,557円
	財形株投（一般財形５０）	48,226,582円	39,876,216円
	財形株投（年金・住宅財形３０）	27,178,104円	26,998,468円
	インデックスファンドＴＯＰＩＸ（日本株式）	7,910,424,272円	7,727,142,604円
	ＴＯＰＩＸインデックスファンド（個人型年金向け）	452,367,550円	456,908,229円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－０８	30,127,887円	25,298,128円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－０８	16,425,193円	13,158,073円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１６－１１	11,826,344円	9,268,925円

	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１６－１１	24,972,879円	18,757,161円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）２０１７－０２	10,027,835円	8,791,308円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）２０１７－０２	18,891,436円	13,830,538円
	計	18,667,515,485円	17,381,724,461円
２．	受益権の総数	18,667,515,485口	17,381,724,461口
３．	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
	株式	281,114,000円	258,387,000円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 2月 5日 至 2020年 2月 3日	自 2020年 2月 4日 至 2021年 2月 1日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2020年 2月 3日現在	2021年 2月 1日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	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）

（2020年 2月 3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	2,308,503,330
合計	2,308,503,330

（2021年 2月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,525,860,800
合計	2,525,860,800

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（2020年 2月 3日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	103,380,000	－	100,050,000	△3,330,000
合計		103,380,000	－	100,050,000	△3,330,000

（2021年 2月 1日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	106,032,000	－	110,040,000	4,008,000
合計		106,032,000	－	110,040,000	4,008,000

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2020年 2月 3日現在		2021年 2月 1日現在	
1口当たり純資産額	2.1094円	1口当たり純資産額	2.3646円
(1万口当たり純資産額)	(21,094円)	(1万口当たり純資産額)	(23,646円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	3,020.00	2,416,000	
日本水産	20,700	443.00	9,170,100	
マルハニチロ	3,500	2,337.00	8,179,500	
雪国まいたけ	1,500	1,794.00	2,691,000	
カネコ種苗	700	1,568.00	1,097,600	
サカタのタネ	2,700	3,645.00	9,841,500	
ホクト	1,900	2,156.00	4,096,400	
ホクリヨウ	400	698.00	279,200	
住石ホールディングス	4,400	110.00	484,000	
日鉄鉱業	500	5,380.00	2,690,000	
三井松島ホールディングス	900	775.00	697,500	
国際石油開発帝石	81,700	601.00	49,101,700	
石油資源開発	2,900	2,003.00	5,808,700	
K＆Oエナジーグループ	1,100	1,428.00	1,570,800	
ヒノキヤグループ	600	2,020.00	1,212,000	
ショーボンドホールディングス	3,200	4,520.00	14,464,000	
ミライト・ホールディングス	7,700	1,707.00	13,143,900	
タマホーム	1,400	1,916.00	2,682,400	
サンヨーホームズ	300	852.00	255,600	
日本アクア	900	585.00	526,500	
ファーストコーポレーション	800	707.00	565,600	
ベステラ	500	1,615.00	807,500	
キャンディル	500	532.00	266,000	
スペースバリューホールディングス	2,800	663.00	1,856,400	
ダイセキ環境ソリューション	500	785.00	392,500	
第一カッター興業	600	1,341.00	804,600	
安藤・間	14,400	738.00	10,627,200	
東急建設	6,600	524.00	3,458,400	
コムシスホールディングス	7,900	3,150.00	24,885,000	
ビーアールホールディングス	2,700	663.00	1,790,100	
高松コンストラクショングループ	1,400	2,057.00	2,879,800	
東建コーポレーション	700	8,230.00	5,761,000	
ソネック	300	808.00	242,400	
ヤマウラ	1,000	920.00	920,000	
大成建設	16,000	3,440.00	55,040,000	
大林組	51,300	887.00	45,503,100	
清水建設	48,100	737.00	35,449,700	
飛島建設	1,500	1,061.00	1,591,500	
長谷工コーポレーション	16,800	1,246.00	20,932,800	
松井建設	2,000	704.00	1,408,000	

錢高組	200	4,400.00	880,000	
鹿島建設	37,600	1,417.00	53,279,200	
不動テトラ	1,300	1,714.00	2,228,200	
大末建設	600	834.00	500,400	
鉄建建設	1,100	1,857.00	2,042,700	
西松建設	3,700	2,464.00	9,116,800	
三井住友建設	12,500	439.00	5,487,500	
大豊建設	1,200	3,725.00	4,470,000	
前田建設工業	12,900	877.00	11,313,300	
ナカノフドー建設	1,300	397.00	516,100	
奥村組	2,800	2,648.00	7,414,400	
東鉄工業	2,200	2,661.00	5,854,200	
イチケン	400	1,894.00	757,600	
富士ピー・エス	700	575.00	402,500	
淺沼組	600	4,250.00	2,550,000	
戸田建設	21,300	735.00	15,655,500	
熊谷組	2,400	2,642.00	6,340,800	
北野建設	300	2,425.00	727,500	
植木組	200	2,704.00	540,800	
矢作建設工業	2,300	843.00	1,938,900	
ピーエス三菱	1,700	608.00	1,033,600	
日本ハウスホールディングス	3,900	324.00	1,263,600	
大東建託	5,600	10,740.00	60,144,000	
新日本建設	2,200	832.00	1,830,400	
ＮＩＰＰＯ	4,200	2,606.00	10,945,200	
東亜道路工業	300	3,730.00	1,119,000	
前田道路	3,200	1,773.00	5,673,600	
日本道路	500	7,240.00	3,620,000	
東亜建設工業	1,400	2,004.00	2,805,600	
日本国土開発	5,000	551.00	2,755,000	
若築建設	900	1,215.00	1,093,500	
東洋建設	6,000	510.00	3,060,000	
五洋建設	21,900	873.00	19,118,700	
世紀東急工業	2,400	806.00	1,934,400	
福田組	600	5,080.00	3,048,000	
住友林業	12,100	2,121.00	25,664,100	
日本基礎技術	1,500	474.00	711,000	
巴コーポレーション	2,300	384.00	883,200	
大和ハウス工業	47,400	2,987.00	141,583,800	
ライト工業	3,000	1,726.00	5,178,000	
積水ハウス	55,600	2,050.00	113,980,000	
日特建設	1,400	761.00	1,065,400	

北陸電気工事	900	1,186.00	1,067,400	
ユアテック	3,000	831.00	2,493,000	
日本リーテック	1,100	2,247.00	2,471,700	
四電工	300	2,869.00	860,700	
中電工	2,400	2,169.00	5,205,600	
関電工	8,400	890.00	7,476,000	
きんでん	11,100	1,715.00	19,036,500	
東京エネシス	1,700	941.00	1,599,700	
トーエネック	500	3,825.00	1,912,500	
住友電設	1,500	2,529.00	3,793,500	
日本電設工業	2,800	1,931.00	5,406,800	
協和エクシオ	7,800	2,765.00	21,567,000	
新日本空調	1,400	2,106.00	2,948,400	
九電工	3,600	3,315.00	11,934,000	
三機工業	3,700	1,246.00	4,610,200	
日揮ホールディングス	17,200	1,205.00	20,726,000	
中外炉工業	600	1,590.00	954,000	
ヤマト	1,700	692.00	1,176,400	
太平電業	1,100	2,471.00	2,718,100	
高砂熱学工業	4,700	1,602.00	7,529,400	
三晃金属工業	200	2,808.00	561,600	
朝日工業社	400	2,951.00	1,180,400	
明星工業	3,300	775.00	2,557,500	
大氣社	2,500	2,830.00	7,075,000	
ダイダン	1,100	2,883.00	3,171,300	
日比谷総合設備	1,700	1,860.00	3,162,000	
フィル・カンパニー	300	1,826.00	547,800	
東洋エンジニアリング	2,500	452.00	1,130,000	
レイズネクスト	2,700	1,143.00	3,086,100	
ニップン	4,800	1,620.00	7,776,000	
日清製粉グループ本社	18,500	1,765.00	32,652,500	
日東富士製粉	100	6,660.00	666,000	
昭和産業	1,400	3,040.00	4,256,000	
鳥越製粉	1,400	842.00	1,178,800	
中部飼料	2,000	1,391.00	2,782,000	
フィード・ワン	2,200	864.00	1,900,800	
東洋精糖	300	1,215.00	364,500	
日本甜菜製糖	800	1,622.00	1,297,600	
三井製糖	1,300	1,889.00	2,455,700	
塩水港精糖	2,100	223.00	468,300	
日新製糖	700	1,850.00	1,295,000	
森永製菓	3,900	4,080.00	15,912,000	

中村屋	400	3,820.00	1,528,000	
江崎グリコ	4,500	4,560.00	20,520,000	
名糖産業	700	1,402.00	981,400	
井村屋グループ	1,000	2,525.00	2,525,000	
不二家	1,100	2,292.00	2,521,200	
山崎製パン	12,300	1,920.00	23,616,000	
第一屋製パン	500	967.00	483,500	
モロゾフ	300	5,680.00	1,704,000	
亀田製菓	900	4,840.00	4,356,000	
寿スピリッツ	1,600	5,780.00	9,248,000	
カルビー	7,500	3,000.00	22,500,000	
森永乳業	3,000	5,030.00	15,090,000	
六甲バター	1,100	1,809.00	1,989,900	
ヤクルト本社	11,300	5,280.00	59,664,000	
明治ホールディングス	10,900	7,110.00	77,499,000	
雪印メグミルク	4,000	2,236.00	8,944,000	
プリマハム	2,300	3,230.00	7,429,000	
日本ハム	6,300	4,490.00	28,287,000	
林兼産業	600	587.00	352,200	
丸大食品	1,600	1,687.00	2,699,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,500	3,380.00	5,070,000	
柿安本店	600	2,655.00	1,593,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	10,400	714.00	7,425,600	
サッポロホールディングス	5,600	2,020.00	11,312,000	
アサヒグループホールディングス	35,900	4,203.00	150,887,700	
キリンホールディングス	69,600	2,245.50	156,286,800	
宝ホールディングス	12,100	1,255.00	15,185,500	
オエノンホールディングス	4,700	381.00	1,790,700	
養命酒製造	500	1,875.00	937,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	12,600	1,581.00	19,920,600	
サントリー食品インターナショナル	11,000	3,650.00	40,150,000	
ダイドーグループホールディングス	900	5,210.00	4,689,000	
伊藤園	5,000	6,440.00	32,200,000	
キーコーヒー	1,700	2,140.00	3,638,000	
ユニカフェ	600	997.00	598,200	
ジャパンフーズ	300	1,258.00	377,400	
日清オイリオグループ	2,100	3,035.00	6,373,500	
不二製油グループ本社	4,000	3,110.00	12,440,000	
かどや製油	200	4,000.00	800,000	
Ｊ－オイルミルズ	800	3,650.00	2,920,000	
キッコーマン	11,800	7,270.00	85,786,000	
味の素	39,100	2,342.50	91,591,750	

キユーピー	9,100	2,446.00	22,258,600	
ハウス食品グループ本社	6,100	3,830.00	23,363,000	
カゴメ	6,700	3,390.00	22,713,000	
焼津水産化学工業	700	1,012.00	708,400	
アリアケジャパン	1,500	6,780.00	10,170,000	
ピエトロ	300	1,750.00	525,000	
エバラ食品工業	400	2,586.00	1,034,400	
やまみ	200	2,176.00	435,200	
ニチレイ	7,800	2,940.00	22,932,000	
東洋水産	8,500	4,855.00	41,267,500	
イートアンドホールディングス	700	1,858.00	1,300,600	
大冷	200	1,932.00	386,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	852.00	852,000	
日清食品ホールディングス	6,400	8,800.00	56,320,000	
永谷園ホールディングス	800	2,307.00	1,845,600	
一正蒲鉾	600	1,179.00	707,400	
フジッコ	1,800	2,028.00	3,650,400	
ロック・フィールド	1,800	1,532.00	2,757,600	
日本たばこ産業	88,000	2,088.00	183,744,000	
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,860.00	1,860,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,635.00	1,798,500	
なとり	900	1,927.00	1,734,300	
イフジ産業	300	864.00	259,200	
ピックルスコーポレーション	400	3,490.00	1,396,000	
北の達人コーポレーション	5,800	575.00	3,335,000	
ユーグレナ	7,200	855.00	6,156,000	
ミヨシ油脂	500	1,167.00	583,500	
理研ビタミン	1,600	1,367.00	2,187,200	
片倉工業	2,200	1,359.00	2,989,800	
グンゼ	1,100	3,315.00	3,646,500	
東洋紡	6,300	1,325.00	8,347,500	
ユニチカ	4,900	381.00	1,866,900	
富士紡ホールディングス	800	4,105.00	3,284,000	
倉敷紡績	1,500	1,791.00	2,686,500	
シキボウ	900	1,011.00	909,900	
日本毛織	5,100	952.00	4,855,200	
ダイトウボウ	3,100	106.00	328,600	
トーア紡コーポレーション	700	461.00	322,700	
ダイドーリミテッド	2,600	187.00	486,200	
帝国繊維	1,800	2,272.00	4,089,600	
帝人	15,100	1,961.00	29,611,100	
東レ	116,100	689.10	80,004,510	

サカイオーベックス	400	2,153.00	861,200	
住江織物	400	2,007.00	802,800	
日本フエルト	900	438.00	394,200	
日東製網	200	1,493.00	298,600	
アツギ	1,200	471.00	565,200	
ダイニック	600	782.00	469,200	
セーレン	3,900	1,584.00	6,177,600	
ソトー	700	803.00	562,100	
東海染工	200	1,119.00	223,800	
小松マテーレ	2,600	994.00	2,584,400	
ワコールホールディングス	4,000	2,234.00	8,936,000	
ホギメディカル	2,100	3,135.00	6,583,500	
クラウディアホールディングス	600	270.00	162,000	
ＴＳＩホールディングス	5,000	255.00	1,275,000	
マツオカコーポレーション	500	2,006.00	1,003,000	
ワールド	2,100	1,217.00	2,555,700	
三陽商会	900	629.00	566,100	
ナイガイ	700	320.00	224,000	
オンワードホールディングス	10,000	255.00	2,550,000	
ルックホールディングス	500	894.00	447,000	
ゴールドウイン	2,700	6,310.00	17,037,000	
デサント	2,700	1,697.00	4,581,900	
キング	800	588.00	470,400	
ヤマトインターナショナル	1,400	335.00	469,000	
特種東海製紙	1,000	4,540.00	4,540,000	
王子ホールディングス	72,200	643.00	46,424,600	
日本製紙	7,100	1,296.00	9,201,600	
三菱製紙	2,500	333.00	832,500	
北越コーポレーション	11,300	437.00	4,938,100	
中越パルプ工業	600	1,190.00	714,000	
巴川製紙所	600	795.00	477,000	
大王製紙	7,800	1,868.00	14,570,400	
阿波製紙	500	457.00	228,500	
レンゴー	16,500	882.00	14,553,000	
トーモク	1,000	1,834.00	1,834,000	
ザ・パック	1,200	2,560.00	3,072,000	
クラレ	25,300	1,129.00	28,563,700	
旭化成	106,200	1,175.50	124,838,100	
共和レザー	800	640.00	512,000	
昭和電工	12,200	2,558.00	31,207,600	
住友化学	126,400	509.00	64,337,600	
住友精化	800	4,330.00	3,464,000	

日産化学	8,800	6,040.00	53,152,000	
ラサ工業	600	2,398.00	1,438,800	
クレハ	1,400	6,600.00	9,240,000	
多木化学	600	6,030.00	3,618,000	
テイカ	1,200	1,465.00	1,758,000	
石原産業	3,000	755.00	2,265,000	
片倉コープアグリ	400	1,236.00	494,400	
日本曹達	2,200	3,025.00	6,655,000	
東ソー	24,800	1,860.00	46,128,000	
トクヤマ	4,800	2,675.00	12,840,000	
セントラル硝子	3,000	2,166.00	6,498,000	
東亞合成	9,700	1,149.00	11,145,300	
大阪ソーダ	1,600	2,540.00	4,064,000	
関東電化工業	3,900	833.00	3,248,700	
デンカ	5,900	4,050.00	23,895,000	
信越化学工業	29,600	18,270.00	540,792,000	
日本カーバイド工業	600	1,295.00	777,000	
堺化学工業	1,100	2,031.00	2,234,100	
第一稀元素化学工業	1,700	933.00	1,586,100	
エア・ウォーター	16,400	1,720.00	28,208,000	
日本酸素ホールディングス	13,200	2,030.00	26,796,000	
日本化学工業	500	2,959.00	1,479,500	
東邦アセチレン	300	1,425.00	427,500	
日本パーカライジング	8,000	1,022.00	8,176,000	
高圧ガス工業	2,500	730.00	1,825,000	
四国化成工業	2,100	1,212.00	2,545,200	
戸田工業	400	2,184.00	873,600	
ステラ　ケミファ	900	3,555.00	3,199,500	
保土谷化学工業	500	5,450.00	2,725,000	
日本触媒	2,900	5,900.00	17,110,000	
大日精化工業	1,300	2,241.00	2,913,300	
カネカ	4,100	3,765.00	15,436,500	
三菱瓦斯化学	16,100	2,438.00	39,251,800	
三井化学	13,800	3,165.00	43,677,000	
ＪＳＲ	16,100	3,210.00	51,681,000	
東京応化工業	2,800	7,060.00	19,768,000	
大阪有機化学工業	1,500	3,605.00	5,407,500	
三菱ケミカルホールディングス	107,300	726.00	77,899,800	
ＫＨネオケム	2,700	2,367.00	6,390,900	
ダイセル	21,600	794.00	17,150,400	
住友ベークライト	2,500	3,760.00	9,400,000	
積水化学工業	33,800	1,919.00	64,862,200	

日本ゼオン	14,500	1,719.00	24,925,500	
アイカ工業	4,500	3,675.00	16,537,500	
宇部興産	8,000	2,056.00	16,448,000	
積水樹脂	2,600	2,107.00	5,478,200	
タキロンシーアイ	3,400	647.00	2,199,800	
旭有機材	900	1,497.00	1,347,300	
ニチバン	900	1,670.00	1,503,000	
リケンテクノス	3,800	476.00	1,808,800	
大倉工業	800	1,853.00	1,482,400	
積水化成品工業	2,100	540.00	1,134,000	
群栄化学工業	400	2,535.00	1,014,000	
タイガースポリマー	800	407.00	325,600	
ミライアル	500	1,171.00	585,500	
ダイキアクシス	600	1,053.00	631,800	
ダイキョーニシカワ	3,300	798.00	2,633,400	
竹本容器	700	889.00	622,300	
森六ホールディングス	800	2,015.00	1,612,000	
恵和	300	2,029.00	608,700	
日本化薬	9,900	1,000.00	9,900,000	
カーリットホールディングス	1,700	726.00	1,234,200	
日本精化	1,200	1,374.00	1,648,800	
扶桑化学工業	1,300	3,605.00	4,686,500	
トリケミカル研究所	1,200	4,265.00	5,118,000	
ＡＤＥＫＡ	7,300	1,771.00	12,928,300	
日油	6,000	5,120.00	30,720,000	
新日本理化	2,900	258.00	748,200	
ハリマ化成グループ	1,200	904.00	1,084,800	
花王	39,200	7,594.00	297,684,800	
第一工業製薬	600	3,855.00	2,313,000	
石原ケミカル	400	2,033.00	813,200	
日華化学	600	876.00	525,600	
ニイタカ	300	2,635.00	790,500	
三洋化成工業	900	5,230.00	4,707,000	
有機合成薬品工業	1,400	290.00	406,000	
大日本塗料	1,800	917.00	1,650,600	
日本ペイントホールディングス	13,200	9,500.00	125,400,000	
関西ペイント	18,000	3,085.00	55,530,000	
神東塗料	1,300	201.00	261,300	
中国塗料	3,900	910.00	3,549,000	
日本特殊塗料	1,200	1,060.00	1,272,000	
藤倉化成	2,200	484.00	1,064,800	
太陽ホールディングス	1,200	6,220.00	7,464,000	

ＤＩＣ	6,800	2,604.00	17,707,200	
サカタインクス	3,500	1,055.00	3,692,500	
東洋インキＳＣホールディングス	3,300	1,844.00	6,085,200	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,200	820.00	984,000	
富士フイルムホールディングス	28,800	6,063.00	174,614,400	
資生堂	32,500	6,871.00	223,307,500	
ライオン	21,300	2,366.00	50,395,800	
高砂香料工業	1,000	2,559.00	2,559,000	
マンダム	3,400	1,627.00	5,531,800	
ミルボン	2,200	6,980.00	15,356,000	
ファンケル	5,900	3,965.00	23,393,500	
コーセー	3,100	17,210.00	53,351,000	
コタ	1,000	1,431.00	1,431,000	
シーボン	300	1,953.00	585,900	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,000	1,997.00	13,979,000	
ノエビアホールディングス	1,400	4,880.00	6,832,000	
アジュバンコスメジャパン	500	1,066.00	533,000	
新日本製薬	400	2,697.00	1,078,800	
エステー	1,100	1,998.00	2,197,800	
アグロ　カネショウ	700	1,552.00	1,086,400	
コニシ	2,700	1,541.00	4,160,700	
長谷川香料	2,800	2,007.00	5,619,600	
星光ＰＭＣ	1,000	740.00	740,000	
小林製薬	4,600	11,810.00	54,326,000	
荒川化学工業	1,400	1,229.00	1,720,600	
メック	1,100	2,211.00	2,432,100	
日本高純度化学	500	2,712.00	1,356,000	
タカラバイオ	4,300	2,914.00	12,530,200	
ＪＣＵ	1,900	3,810.00	7,239,000	
新田ゼラチン	1,000	671.00	671,000	
ＯＡＴアグリオ	400	1,324.00	529,600	
デクセリアルズ	4,600	1,411.00	6,490,600	
アース製薬	1,200	5,930.00	7,116,000	
北興化学工業	1,600	1,181.00	1,889,600	
大成ラミック	600	2,850.00	1,710,000	
クミアイ化学工業	6,800	853.00	5,800,400	
日本農薬	2,900	484.00	1,403,600	
アキレス	1,200	1,435.00	1,722,000	
有沢製作所	2,300	971.00	2,233,300	
日東電工	10,500	9,670.00	101,535,000	
レック	2,000	1,352.00	2,704,000	
三光合成	1,900	435.00	826,500	

きもと	3,100	190.00	589,000	
藤森工業	1,500	4,585.00	6,877,500	
前澤化成工業	1,000	945.00	945,000	
未来工業	500	1,712.00	856,000	
ウェーブロックホールディングス	600	800.00	480,000	
ＪＳＰ	1,100	1,738.00	1,911,800	
エフピコ	3,000	4,165.00	12,495,000	
天馬	1,200	2,144.00	2,572,800	
信越ポリマー	2,600	1,032.00	2,683,200	
東リ	3,600	241.00	867,600	
ニフコ	6,000	3,775.00	22,650,000	
バルカー	1,400	2,041.00	2,857,400	
ユニ・チャーム	34,700	4,663.00	161,806,100	
ショーエイコーポレーション	400	1,022.00	408,800	
協和キリン	16,400	3,185.00	52,234,000	
武田薬品工業	136,200	3,723.00	507,072,600	
アステラス製薬	141,900	1,734.00	246,054,600	
大日本住友製薬	12,200	1,752.00	21,374,400	
塩野義製薬	20,600	5,715.00	117,729,000	
わかもと製薬	2,000	244.00	488,000	
あすか製薬	1,900	1,561.00	2,965,900	
日本新薬	4,700	7,710.00	36,237,000	
ビオフェルミン製薬	200	2,492.00	498,400	
中外製薬	51,200	5,459.00	279,500,800	
科研製薬	2,800	4,100.00	11,480,000	
エーザイ	18,100	7,793.00	141,053,300	
ロート製薬	7,800	3,100.00	24,180,000	
小野薬品工業	37,500	3,159.00	118,462,500	
久光製薬	4,700	6,330.00	29,751,000	
持田製薬	2,300	3,970.00	9,131,000	
参天製薬	28,500	1,745.00	49,732,500	
扶桑薬品工業	500	2,647.00	1,323,500	
日本ケミファ	200	2,225.00	445,000	
ツムラ	5,500	3,410.00	18,755,000	
日医工	4,700	1,008.00	4,737,600	
キッセイ薬品工業	2,900	2,309.00	6,696,100	
生化学工業	2,900	1,037.00	3,007,300	
栄研化学	2,900	2,381.00	6,904,900	
日水製薬	600	1,017.00	610,200	
鳥居薬品	1,000	3,255.00	3,255,000	
ＪＣＲファーマ	4,600	3,210.00	14,766,000	
東和薬品	2,300	2,083.00	4,790,900	

富士製薬工業	1,200	1,225.00	1,470,000	
沢井製薬	3,600	4,730.00	17,028,000	
ゼリア新薬工業	3,000	1,993.00	5,979,000	
第一三共	140,500	3,368.00	473,204,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,600	1,965.00	7,074,000	
大幸薬品	2,000	1,580.00	3,160,000	
ダイト	1,100	3,645.00	4,009,500	
大塚ホールディングス	34,000	4,520.00	153,680,000	
大正製薬ホールディングス	3,900	6,880.00	26,832,000	
ペプチドリーム	8,300	6,340.00	52,622,000	
日本コークス工業	14,400	94.00	1,353,600	
ニチレキ	1,900	1,487.00	2,825,300	
ユシロ化学工業	900	1,101.00	990,900	
ビーピー・カストロール	600	1,228.00	736,800	
富士石油	4,700	211.00	991,700	
ＭＯＲＥＳＣＯ	700	1,115.00	780,500	
出光興産	18,200	2,439.00	44,389,800	
ＥＮＥＯＳホールディングス	246,100	421.40	103,706,540	
コスモエネルギーホールディングス	5,200	2,237.00	11,632,400	
横浜ゴム	9,500	1,692.00	16,074,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	8,700	1,609.00	13,998,300	
ブリヂストン	43,500	3,906.00	169,911,000	
住友ゴム工業	14,900	980.00	14,602,000	
藤倉コンポジット	1,500	413.00	619,500	
オカモト	1,000	3,890.00	3,890,000	
フコク	800	673.00	538,400	
ニッタ	1,700	2,212.00	3,760,400	
住友理工	3,100	597.00	1,850,700	
三ツ星ベルト	2,000	1,697.00	3,394,000	
バンドー化学	2,900	659.00	1,911,100	
日東紡績	2,400	4,985.00	11,964,000	
ＡＧＣ	15,000	3,665.00	54,975,000	
日本板硝子	8,600	485.00	4,171,000	
石塚硝子	300	1,818.00	545,400	
日本山村硝子	600	863.00	517,800	
日本電気硝子	6,100	2,367.00	14,438,700	
オハラ	700	1,810.00	1,267,000	
住友大阪セメント	2,900	3,180.00	9,222,000	
太平洋セメント	9,700	2,632.00	25,530,400	
日本ヒューム	1,500	757.00	1,135,500	
日本コンクリート工業	3,700	330.00	1,221,000	
三谷セキサン	800	4,645.00	3,716,000	

アジアパイルホールディングス	2,500	479.00	1,197,500	
東海カーボン	16,000	1,511.00	24,176,000	
日本カーボン	900	4,045.00	3,640,500	
東洋炭素	1,000	1,926.00	1,926,000	
ノリタケカンパニーリミテド	900	3,290.00	2,961,000	
ＴＯＴＯ	11,700	6,510.00	76,167,000	
日本碍子	18,100	1,890.00	34,209,000	
日本特殊陶業	12,500	1,948.00	24,350,000	
ダントーホールディングス	1,300	403.00	523,900	
ＭＡＲＵＷＡ	600	10,990.00	6,594,000	
品川リフラクトリーズ	400	2,686.00	1,074,400	
黒崎播磨	300	4,685.00	1,405,500	
ヨータイ	1,100	866.00	952,600	
イソライト工業	800	529.00	423,200	
東京窯業	1,900	322.00	611,800	
ニッカトー	800	800.00	640,000	
フジミインコーポレーテッド	1,300	4,220.00	5,486,000	
クニミネ工業	500	1,239.00	619,500	
エーアンドエーマテリアル	200	1,063.00	212,600	
ニチアス	4,100	2,406.00	9,864,600	
ニチハ	2,300	3,400.00	7,820,000	
日本製鉄	77,300	1,222.00	94,460,600	
神戸製鋼所	29,600	503.00	14,888,800	
合同製鐵	800	1,931.00	1,544,800	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	46,800	934.00	43,711,200	
東京製鐵	6,300	747.00	4,706,100	
共英製鋼	1,800	1,345.00	2,421,000	
大和工業	3,400	2,695.00	9,163,000	
東京鐵鋼	600	1,938.00	1,162,800	
大阪製鐵	800	1,217.00	973,600	
淀川製鋼所	2,100	2,044.00	4,292,400	
丸一鋼管	5,300	2,275.00	12,057,500	
モリ工業	500	2,233.00	1,116,500	
大同特殊鋼	2,600	4,605.00	11,973,000	
日本高周波鋼業	800	346.00	276,800	
日本冶金工業	1,300	1,756.00	2,282,800	
山陽特殊製鋼	2,000	1,616.00	3,232,000	
愛知製鋼	900	3,135.00	2,821,500	
日立金属	15,300	1,685.00	25,780,500	
日本金属	500	1,143.00	571,500	
大平洋金属	1,100	2,209.00	2,429,900	
新日本電工	10,700	268.00	2,867,600	

栗本鐵工所	700	1,675.00	1,172,500	
虹技	200	1,096.00	219,200	
日本鋳鉄管	200	1,273.00	254,600	
三菱製鋼	1,300	641.00	833,300	
日亜鋼業	2,200	292.00	642,400	
日本精線	300	3,965.00	1,189,500	
エンビプロ・ホールディングス	800	671.00	536,800	
シンニッタン	1,800	206.00	370,800	
新家工業	400	1,339.00	535,600	
大紀アルミニウム工業所	2,400	817.00	1,960,800	
日本軽金属ホールディングス	4,400	1,927.00	8,478,800	
三井金属鉱業	4,400	3,765.00	16,566,000	
東邦亜鉛	1,000	2,236.00	2,236,000	
三菱マテリアル	10,700	2,284.00	24,438,800	
住友金属鉱山	20,700	4,705.00	97,393,500	
ＤＯＷＡホールディングス	4,100	3,905.00	16,010,500	
古河機械金属	2,700	1,236.00	3,337,200	
エス・サイエンス	10,700	40.00	428,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	763.00	1,373,400	
東邦チタニウム	3,000	859.00	2,577,000	
ＵＡＣＪ	2,500	1,869.00	4,672,500	
ＣＫサンエツ	300	3,780.00	1,134,000	
古河電気工業	5,000	2,916.00	14,580,000	
住友電気工業	56,400	1,420.50	80,116,200	
フジクラ	19,800	509.00	10,078,200	
昭和電線ホールディングス	1,600	1,634.00	2,614,400	
タツタ電線	3,000	687.00	2,061,000	
カナレ電気	300	1,767.00	530,100	
平河ヒューテック	900	1,215.00	1,093,500	
リョービ	2,000	1,203.00	2,406,000	
アーレスティ	2,200	355.00	781,000	
アサヒホールディングス	3,100	4,440.00	13,764,000	
稲葉製作所	1,100	1,404.00	1,544,400	
宮地エンジニアリンググループ	500	2,427.00	1,213,500	
トーカロ	4,200	1,460.00	6,132,000	
アルファＣｏ	600	1,002.00	601,200	
ＳＵＭＣＯ	20,700	2,292.00	47,444,400	
川田テクノロジーズ	300	4,145.00	1,243,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	500	6,440.00	3,220,000	
ジェイテックコーポレーション	100	3,985.00	398,500	
信和	1,000	697.00	697,000	
東洋製罐グループホールディングス	10,200	1,122.00	11,444,400	

ホッカンホールディングス	800	1,433.00	1,146,400	
コロナ	1,000	930.00	930,000	
横河ブリッジホールディングス	2,800	1,975.00	5,530,000	
駒井ハルテック	400	2,164.00	865,600	
高田機工	100	2,541.00	254,100	
三和ホールディングス	15,300	1,235.00	18,895,500	
文化シヤッター	4,700	935.00	4,394,500	
三協立山	2,100	815.00	1,711,500	
アルインコ	1,100	938.00	1,031,800	
東洋シヤッター	300	704.00	211,200	
ＬＩＸＩＬ	22,300	2,526.00	56,329,800	
日本フイルコン	1,100	501.00	551,100	
ノーリツ	3,300	1,518.00	5,009,400	
長府製作所	1,700	2,025.00	3,442,500	
リンナイ	3,200	11,430.00	36,576,000	
ダイニチ工業	900	892.00	802,800	
日東精工	2,000	450.00	900,000	
三洋工業	200	1,842.00	368,400	
岡部	3,300	773.00	2,550,900	
ジーテクト	2,000	1,487.00	2,974,000	
東プレ	3,000	1,492.00	4,476,000	
高周波熱錬	3,100	482.00	1,494,200	
東京製綱	1,200	1,252.00	1,502,400	
サンコール	1,300	473.00	614,900	
モリテック　スチール	1,400	418.00	585,200	
パイオラックス	2,400	1,529.00	3,669,600	
エイチワン	1,600	767.00	1,227,200	
日本発條	16,100	737.00	11,865,700	
中央発條	100	2,826.00	282,600	
アドバネクス	300	1,421.00	426,300	
立川ブラインド工業	700	1,289.00	902,300	
三益半導体工業	1,200	2,715.00	3,258,000	
日本ドライケミカル	400	1,471.00	588,400	
日本製鋼所	4,900	3,075.00	15,067,500	
三浦工業	7,000	6,050.00	42,350,000	
タクマ	5,500	2,221.00	12,215,500	
ツガミ	3,400	1,743.00	5,926,200	
オークマ	1,900	6,150.00	11,685,000	
芝浦機械	1,700	2,762.00	4,695,400	
アマダ	23,700	1,221.00	28,937,700	
アイダエンジニアリング	4,200	1,003.00	4,212,600	
滝澤鉄工所	500	999.00	499,500	

ＦＵＪＩ	6,400	2,797.00	17,900,800	
牧野フライス製作所	1,900	4,035.00	7,666,500	
オーエスジー	8,000	1,855.00	14,840,000	
ダイジェット工業	200	1,341.00	268,200	
旭ダイヤモンド工業	4,400	458.00	2,015,200	
ＤＭＧ森精機	10,300	1,638.00	16,871,400	
ソディック	3,600	956.00	3,441,600	
ディスコ	2,200	34,900.00	76,780,000	
日東工器	800	1,744.00	1,395,200	
日進工具	700	2,759.00	1,931,300	
パンチ工業	1,400	417.00	583,800	
冨士ダイス	700	650.00	455,000	
豊和工業	1,000	849.00	849,000	
ＯＫＫ	900	444.00	399,600	
東洋機械金属	1,300	421.00	547,300	
津田駒工業	400	870.00	348,000	
島精機製作所	2,400	2,182.00	5,236,800	
オプトラン	2,000	2,568.00	5,136,000	
ＮＣホールディングス	500	593.00	296,500	
イワキポンプ	1,100	804.00	884,400	
フリュー	1,600	1,080.00	1,728,000	
ヤマシンフィルタ	3,300	1,011.00	3,336,300	
日阪製作所	1,900	809.00	1,537,100	
やまびこ	3,100	1,288.00	3,992,800	
平田機工	800	8,500.00	6,800,000	
ペガサスミシン製造	1,900	380.00	722,000	
マルマエ	600	1,255.00	753,000	
タツモ	700	1,490.00	1,043,000	
ナブテスコ	9,500	4,925.00	46,787,500	
三井海洋開発	1,700	1,982.00	3,369,400	
レオン自動機	1,600	1,151.00	1,841,600	
ＳＭＣ	4,800	64,510.00	309,648,000	
ホソカワミクロン	600	6,170.00	3,702,000	
ユニオンツール	600	3,505.00	2,103,000	
オイレス工業	2,300	1,628.00	3,744,400	
日精エー・エス・ビー機械	500	5,990.00	2,995,000	
サトーホールディングス	2,200	2,237.00	4,921,400	
技研製作所	1,400	5,000.00	7,000,000	
日本エアーテック	500	1,446.00	723,000	
カワタ	400	928.00	371,200	
日精樹脂工業	1,300	903.00	1,173,900	
オカダアイヨン	600	1,122.00	673,200	

ワイエイシイホールディングス	700	1,010.00	707,000	
小松製作所	74,100	2,973.00	220,299,300	
住友重機械工業	9,400	3,035.00	28,529,000	
日立建機	7,700	2,903.00	22,353,100	
日工	2,400	710.00	1,704,000	
巴工業	700	2,072.00	1,450,400	
井関農機	1,600	1,351.00	2,161,600	
ＴＯＷＡ	1,600	1,965.00	3,144,000	
丸山製作所	300	1,608.00	482,400	
北川鉄工所	700	1,352.00	946,400	
ローツェ	700	8,120.00	5,684,000	
タカキタ	600	706.00	423,600	
クボタ	86,000	2,378.50	204,551,000	
荏原実業	400	3,705.00	1,482,000	
三菱化工機	500	3,005.00	1,502,500	
月島機械	3,000	1,348.00	4,044,000	
帝国電機製作所	1,100	1,231.00	1,354,100	
新東工業	3,800	741.00	2,815,800	
澁谷工業	1,400	3,465.00	4,851,000	
アイチ　コーポレーション	2,700	913.00	2,465,100	
小森コーポレーション	4,200	685.00	2,877,000	
鶴見製作所	1,300	1,829.00	2,377,700	
住友精密工業	300	1,984.00	595,200	
日本ギア工業	800	299.00	239,200	
酒井重工業	300	2,145.00	643,500	
荏原製作所	6,800	3,665.00	24,922,000	
石井鐵工所	300	2,867.00	860,100	
西島製作所	1,700	891.00	1,514,700	
北越工業	1,700	1,024.00	1,740,800	
ダイキン工業	20,800	22,255.00	462,904,000	
オルガノ	500	6,710.00	3,355,000	
トーヨーカネツ	700	2,433.00	1,703,100	
栗田工業	8,800	4,505.00	39,644,000	
椿本チエイン	2,300	2,727.00	6,272,100	
大同工業	800	763.00	610,400	
木村化工機	1,400	578.00	809,200	
アネスト岩田	2,800	1,126.00	3,152,800	
ダイフク	9,000	12,400.00	111,600,000	
サムコ	400	3,920.00	1,568,000	
加藤製作所	900	936.00	842,400	
油研工業	200	1,595.00	319,000	
タダノ	8,000	950.00	7,600,000	

フジテック	5,600	2,382.00	13,339,200	
ＣＫＤ	3,800	2,415.00	9,177,000	
キトー	1,400	1,523.00	2,132,200	
平和	4,700	1,465.00	6,885,500	
理想科学工業	1,300	1,390.00	1,807,000	
ＳＡＮＫＹＯ	3,900	2,986.00	11,645,400	
日本金銭機械	2,200	511.00	1,124,200	
マースグループホールディングス	1,000	1,522.00	1,522,000	
フクシマガリレイ	1,100	4,260.00	4,686,000	
オーイズミ	800	406.00	324,800	
ダイコク電機	700	872.00	610,400	
竹内製作所	2,700	2,426.00	6,550,200	
アマノ	4,300	2,504.00	10,767,200	
ＪＵＫＩ	2,400	636.00	1,526,400	
サンデンホールディングス	2,700	428.00	1,155,600	
蛇の目ミシン工業	1,600	825.00	1,320,000	
マックス	2,300	1,601.00	3,682,300	
グローリー	4,200	2,059.00	8,647,800	
新晃工業	1,500	1,840.00	2,760,000	
大和冷機工業	2,600	1,015.00	2,639,000	
セガサミーホールディングス	14,900	1,689.00	25,166,100	
日本ピストンリング	600	945.00	567,000	
リケン	700	2,070.00	1,449,000	
ＴＰＲ	2,200	1,404.00	3,088,800	
ツバキ・ナカシマ	3,200	1,197.00	3,830,400	
ホシザキ	5,100	9,410.00	47,991,000	
大豊工業	1,400	788.00	1,103,200	
日本精工	33,700	985.00	33,194,500	
ＮＴＮ	38,800	291.00	11,290,800	
ジェイテクト	15,700	950.00	14,915,000	
不二越	1,500	4,180.00	6,270,000	
日本トムソン	4,700	484.00	2,274,800	
ＴＨＫ	10,200	3,420.00	34,884,000	
ユーシン精機	1,200	971.00	1,165,200	
前澤給装工業	600	2,179.00	1,307,400	
イーグル工業	2,000	1,156.00	2,312,000	
前澤工業	1,000	564.00	564,000	
日本ピラー工業	1,700	1,726.00	2,934,200	
キッツ	5,000	595.00	2,975,000	
マキタ	21,300	4,780.00	101,814,000	
日立造船	13,100	615.00	8,056,500	
三菱重工業	25,700	3,045.00	78,256,500	

ＩＨＩ	11,000	1,895.00	20,845,000	
スター精密	2,500	1,608.00	4,020,000	
日清紡ホールディングス	9,900	800.00	7,920,000	
イビデン	7,900	4,960.00	39,184,000	
コニカミノルタ	33,400	464.00	15,497,600	
ブラザー工業	20,100	2,358.00	47,395,800	
ミネベアミツミ	28,200	2,358.00	66,495,600	
日立製作所	78,700	4,475.00	352,182,500	
三菱電機	163,600	1,622.00	265,359,200	
富士電機	9,900	4,345.00	43,015,500	
東洋電機製造	700	1,157.00	809,900	
安川電機	17,600	5,520.00	97,152,000	
シンフォニアテクノロジー	2,200	1,449.00	3,187,800	
明電舎	2,800	2,410.00	6,748,000	
オリジン	400	1,345.00	538,000	
山洋電気	800	6,380.00	5,104,000	
デンヨー	1,400	2,024.00	2,833,600	
東芝テック	1,800	3,970.00	7,146,000	
芝浦メカトロニクス	300	5,460.00	1,638,000	
マブチモーター	4,500	4,500.00	20,250,000	
日本電産	39,400	14,195.00	559,283,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	479.00	526,900	
トレックス・セミコンダクター	900	1,455.00	1,309,500	
東光高岳	800	1,596.00	1,276,800	
ダイヘン	1,800	4,955.00	8,919,000	
ヤーマン	2,700	1,818.00	4,908,600	
ＪＶＣケンウッド	14,800	201.00	2,974,800	
ミマキエンジニアリング	1,600	485.00	776,000	
Ｉ－ＰＥＸ	800	2,116.00	1,692,800	
日新電機	3,800	1,329.00	5,050,200	
大崎電気工業	3,400	586.00	1,992,400	
オムロン	13,600	9,520.00	129,472,000	
日東工業	2,400	2,051.00	4,922,400	
ＩＤＥＣ	2,200	1,914.00	4,210,800	
正興電機製作所	400	1,990.00	796,000	
不二電機工業	300	1,285.00	385,500	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	5,900	3,270.00	19,293,000	
サクサホールディングス	400	1,417.00	566,800	
メルコホールディングス	600	3,800.00	2,280,000	
テクノメディカ	400	1,578.00	631,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	1,682.00	841,000	
日本電気	20,800	6,430.00	133,744,000	

富士通	14,700	15,980.00	234,906,000	
沖電気工業	6,700	1,095.00	7,336,500	
岩崎通信機	700	833.00	583,100	
電気興業	800	2,684.00	2,147,200	
サンケン電気	1,900	4,475.00	8,502,500	
ナカヨ	300	1,450.00	435,000	
アイホン	900	1,679.00	1,511,100	
ルネサスエレクトロニクス	70,500	1,211.00	85,375,500	
セイコーエプソン	20,400	1,800.00	36,720,000	
ワコム	11,900	941.00	11,197,900	
アルバック	3,000	4,765.00	14,295,000	
アクセル	700	735.00	514,500	
ＥＩＺＯ	1,400	3,800.00	5,320,000	
日本信号	3,800	930.00	3,534,000	
京三製作所	3,500	411.00	1,438,500	
能美防災	2,100	2,218.00	4,657,800	
ホーチキ	1,200	1,277.00	1,532,400	
星和電機	800	687.00	549,600	
エレコム	1,900	4,960.00	9,424,000	
パナソニック	174,600	1,339.50	233,876,700	
シャープ	19,000	2,247.00	42,693,000	
アンリツ	9,900	2,559.00	25,334,100	
富士通ゼネラル	5,000	2,742.00	13,710,000	
ソニー	102,500	10,155.00	1,040,887,500	
ＴＤＫ	7,900	16,090.00	127,111,000	
帝国通信工業	700	1,061.00	742,700	
タムラ製作所	6,200	571.00	3,540,200	
アルプスアルパイン	13,400	1,340.00	17,956,000	
池上通信機	600	855.00	513,000	
鈴木	800	1,157.00	925,600	
日本トリム	400	4,285.00	1,714,000	
ローランド　ディー．ジー．	1,000	1,723.00	1,723,000	
フォスター電機	1,800	1,579.00	2,842,200	
ＳＭＫ	500	3,035.00	1,517,500	
ヨコオ	1,200	3,330.00	3,996,000	
ホシデン	4,500	966.00	4,347,000	
ヒロセ電機	2,500	16,340.00	40,850,000	
日本航空電子工業	3,800	1,667.00	6,334,600	
ＴＯＡ	1,900	857.00	1,628,300	
マクセルホールディングス	3,400	1,467.00	4,987,800	
古野電気	2,100	1,157.00	2,429,700	
ユニデンホールディングス	500	2,138.00	1,069,000	

スミダコーポレーション	1,400	1,009.00	1,412,600	
アイコム	700	2,714.00	1,899,800	
リオン	700	3,125.00	2,187,500	
本多通信工業	1,500	476.00	714,000	
船井電機	2,000	430.00	860,000	
横河電機	16,400	2,324.00	38,113,600	
新電元工業	700	2,786.00	1,950,200	
アズビル	11,100	5,410.00	60,051,000	
東亜ディーケーケー	800	831.00	664,800	
日本光電工業	6,800	3,150.00	21,420,000	
チノー	500	1,391.00	695,500	
共和電業	1,600	387.00	619,200	
日本電子材料	600	2,047.00	1,228,200	
堀場製作所	3,200	6,920.00	22,144,000	
アドバンテスト	12,200	8,450.00	103,090,000	
小野測器	600	528.00	316,800	
エスペック	1,400	1,961.00	2,745,400	
キーエンス	16,100	57,680.00	928,648,000	
日置電機	800	4,025.00	3,220,000	
シスメックス	12,800	12,700.00	162,560,000	
日本マイクロニクス	2,900	1,617.00	4,689,300	
メガチップス	1,600	3,255.00	5,208,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,000	4,155.00	4,155,000	
澤藤電機	200	2,034.00	406,800	
原田工業	700	850.00	595,000	
コーセル	2,100	1,180.00	2,478,000	
イリソ電子工業	1,400	4,745.00	6,643,000	
オプテックスグループ	2,700	1,946.00	5,254,200	
千代田インテグレ	800	1,776.00	1,420,800	
アイ・オー・データ機器	500	1,025.00	512,500	
レーザーテック	7,200	14,290.00	102,888,000	
スタンレー電気	11,500	3,450.00	39,675,000	
岩崎電気	600	1,397.00	838,200	
ウシオ電機	8,400	1,417.00	11,902,800	
岡谷電機産業	1,400	360.00	504,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,900	319.00	606,100	
エノモト	500	1,532.00	766,000	
日本セラミック	1,700	2,813.00	4,782,100	
遠藤照明	800	586.00	468,800	
古河電池	1,200	1,559.00	1,870,800	
双信電機	900	434.00	390,600	
山一電機	1,100	1,715.00	1,886,500	

図研	1,100	2,702.00	2,972,200	
日本電子	3,000	4,355.00	13,065,000	
カシオ計算機	13,200	1,951.00	25,753,200	
ファナック	14,400	27,655.00	398,232,000	
日本シイエムケイ	3,700	436.00	1,613,200	
エンプラス	700	4,915.00	3,440,500	
大真空	600	2,354.00	1,412,400	
ローム	6,800	10,830.00	73,644,000	
浜松ホトニクス	11,700	6,130.00	71,721,000	
三井ハイテック	1,600	4,180.00	6,688,000	
新光電気工業	5,500	2,684.00	14,762,000	
京セラ	24,900	6,760.00	168,324,000	
太陽誘電	7,300	5,990.00	43,727,000	
村田製作所	48,100	9,721.00	467,580,100	
双葉電子工業	2,900	971.00	2,815,900	
北陸電気工業	700	915.00	640,500	
ニチコン	5,200	1,437.00	7,472,400	
日本ケミコン	1,700	1,991.00	3,384,700	
ＫＯＡ	2,300	1,693.00	3,893,900	
市光工業	2,500	691.00	1,727,500	
小糸製作所	9,800	7,180.00	70,364,000	
ミツバ	3,200	429.00	1,372,800	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2,800	8,470.00	23,716,000	
キヤノン電子	1,600	1,737.00	2,779,200	
キヤノン	81,400	2,355.00	191,697,000	
リコー	41,800	817.00	34,150,600	
象印マホービン	4,400	1,774.00	7,805,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	200	1,548.00	309,600	
東京エレクトロン	9,600	40,290.00	386,784,000	
トヨタ紡織	4,800	1,769.00	8,491,200	
芦森工業	400	930.00	372,000	
ユニプレス	2,700	982.00	2,651,400	
豊田自動織機	13,200	8,390.00	110,748,000	
モリタホールディングス	2,600	1,732.00	4,503,200	
三櫻工業	2,300	889.00	2,044,700	
デンソー	36,000	5,925.00	213,300,000	
東海理化電機製作所	4,300	1,775.00	7,632,500	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	6,500	408.00	2,652,000	
川崎重工業	12,800	2,273.00	29,094,400	
名村造船所	5,800	170.00	986,000	
サノヤスホールディングス	2,400	152.00	364,800	
日本車輌製造	600	2,502.00	1,501,200	

三菱ロジスネクスト	2,200	1,197.00	2,633,400	
近畿車輛	200	1,232.00	246,400	
日産自動車	193,200	540.40	104,405,280	
いすゞ自動車	47,400	1,027.00	48,679,800	
トヨタ自動車	165,800	7,294.00	1,209,345,200	代用有価証券 23,000株
日野自動車	20,400	950.00	19,380,000	
三菱自動車工業	61,200	242.00	14,810,400	
エフテック	1,200	639.00	766,800	
レシップホールディングス	600	503.00	301,800	
ＧＭＢ	400	1,036.00	414,400	
ファルテック	300	699.00	209,700	
武蔵精密工業	3,700	1,551.00	5,738,700	
日産車体	2,400	836.00	2,006,400	
新明和工業	4,600	907.00	4,172,200	
極東開発工業	2,700	1,489.00	4,020,300	
トピー工業	1,400	1,267.00	1,773,800	
ティラド	500	1,379.00	689,500	
タチエス	2,500	1,102.00	2,755,000	
ＮＯＫ	8,000	1,399.00	11,192,000	
フタバ産業	4,200	519.00	2,179,800	
ＫＹＢ	1,900	2,389.00	4,539,100	
大同メタル工業	3,400	508.00	1,727,200	
プレス工業	8,000	314.00	2,512,000	
ミクニ	2,200	270.00	594,000	
太平洋工業	3,400	1,125.00	3,825,000	
河西工業	2,600	387.00	1,006,200	
アイシン精機	12,000	3,355.00	40,260,000	
マツダ	51,400	761.00	39,115,400	
今仙電機製作所	1,400	717.00	1,003,800	
本田技研工業	128,800	2,774.00	357,291,200	
スズキ	32,400	4,864.00	157,593,600	
ＳＵＢＡＲＵ	46,900	2,025.00	94,972,500	
安永	900	1,245.00	1,120,500	
ヤマハ発動機	23,100	2,382.00	55,024,200	
ＴＢＫ	1,900	436.00	828,400	
エクセディ	2,200	1,597.00	3,513,400	
豊田合成	5,300	2,861.00	15,163,300	
愛三工業	2,700	537.00	1,449,900	
盟和産業	200	882.00	176,400	
日本プラスト	1,400	507.00	709,800	
ヨロズ	1,500	1,244.00	1,866,000	
エフ・シー・シー	2,700	1,726.00	4,660,200	

シマノ	6,100	25,230.00	153,903,000	
テイ・エス　テック	3,800	3,090.00	11,742,000	
ジャムコ	1,100	651.00	716,100	
テルモ	50,100	4,104.00	205,610,400	
クリエートメディック	500	968.00	484,000	
日機装	5,300	1,022.00	5,416,600	
日本エム・ディ・エム	1,000	2,090.00	2,090,000	
島津製作所	21,100	4,015.00	84,716,500	
ＪＭＳ	1,400	1,020.00	1,428,000	
長野計器	1,200	941.00	1,129,200	
ブイ・テクノロジー	800	6,330.00	5,064,000	
東京計器	1,000	930.00	930,000	
愛知時計電機	200	4,335.00	867,000	
インターアクション	800	2,480.00	1,984,000	
オーバル	1,600	333.00	532,800	
東京精密	2,700	4,970.00	13,419,000	
マニー	6,500	2,775.00	18,037,500	
ニコン	25,200	822.00	20,714,400	
トプコン	8,300	1,281.00	10,632,300	
オリンパス	90,500	1,952.00	176,656,000	
理研計器	1,400	3,005.00	4,207,000	
タムロン	1,400	2,034.00	2,847,600	
ＨＯＹＡ	32,500	13,245.00	430,462,500	
シード	800	601.00	480,800	
ノーリツ鋼機	1,500	2,155.00	3,232,500	
エー・アンド・デイ	1,400	1,201.00	1,681,400	
朝日インテック	17,200	3,420.00	58,824,000	
シチズン時計	21,600	325.00	7,020,000	
リズム	600	728.00	436,800	
大研医器	1,400	545.00	763,000	
メニコン	2,500	6,300.00	15,750,000	
シンシア	200	635.00	127,000	
松風	800	1,827.00	1,461,600	
セイコーホールディングス	2,500	1,430.00	3,575,000	
ニプロ	12,300	1,242.00	15,276,600	
中本パックス	400	1,735.00	694,000	
スノーピーク	1,000	1,841.00	1,841,000	
パラマウントベッドホールディングス	1,500	4,530.00	6,795,000	
トランザクション	1,000	1,073.00	1,073,000	
粧美堂	700	406.00	284,200	
ニホンフラッシュ	1,400	1,194.00	1,671,600	
前田工繊	1,800	2,686.00	4,834,800	

永大産業	2,000	295.00	590,000	
アートネイチャー	1,500	649.00	973,500	
バンダイナムコホールディングス	13,500	9,140.00	123,390,000	
アイフィスジャパン	400	717.00	286,800	
共立印刷	2,600	124.00	322,400	
ＳＨＯＥＩ	1,500	4,065.00	6,097,500	
フランスベッドホールディングス	2,500	923.00	2,307,500	
パイロットコーポレーション	2,900	2,966.00	8,601,400	
萩原工業	900	1,427.00	1,284,300	
トッパン・フォームズ	2,900	1,163.00	3,372,700	
フジシールインターナショナル	3,300	1,949.00	6,431,700	
タカラトミー	7,600	904.00	6,870,400	
廣済堂	1,200	825.00	990,000	
エステールホールディングス	700	609.00	426,300	
タカノ	700	591.00	413,700	
プロネクサス	1,300	1,134.00	1,474,200	
ホクシン	1,500	115.00	172,500	
ウッドワン	500	1,030.00	515,000	
大建工業	1,100	1,760.00	1,936,000	
凸版印刷	24,800	1,522.00	37,745,600	
大日本印刷	19,700	1,823.00	35,913,100	
共同印刷	500	3,580.00	1,790,000	
ＮＩＳＳＨＡ	3,400	1,359.00	4,620,600	
光村印刷	100	1,763.00	176,300	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	800	1,704.00	1,363,200	
アシックス	14,500	1,860.00	26,970,000	
ツツミ	500	1,826.00	913,000	
小松ウオール工業	600	1,731.00	1,038,600	
ヤマハ	9,800	6,150.00	60,270,000	
河合楽器製作所	500	2,833.00	1,416,500	
クリナップ	1,400	456.00	638,400	
ピジョン	10,500	4,800.00	50,400,000	
オリバー	400	2,653.00	1,061,200	
兼松サステック	200	1,755.00	351,000	
キングジム	1,500	885.00	1,327,500	
リンテック	3,500	2,384.00	8,344,000	
イトーキ	3,600	327.00	1,177,200	
任天堂	9,400	62,640.00	588,816,000	
三菱鉛筆	2,700	1,324.00	3,574,800	
タカラスタンダード	3,300	1,455.00	4,801,500	
コクヨ	8,100	1,375.00	11,137,500	
ナカバヤシ	1,400	611.00	855,400	

オカムラ	6,500	923.00	5,999,500	
美津濃	1,700	2,066.00	3,512,200	
東京電力ホールディングス	139,100	397.00	55,222,700	
中部電力	49,900	1,301.00	64,919,900	
関西電力	62,000	1,030.50	63,891,000	
中国電力	23,700	1,271.00	30,122,700	
北陸電力	15,000	677.00	10,155,000	
東北電力	38,300	911.00	34,891,300	
四国電力	13,600	727.00	9,887,200	
九州電力	36,200	923.00	33,412,600	
北海道電力	15,600	438.00	6,832,800	
沖縄電力	3,200	1,396.00	4,467,200	
電源開発	13,100	1,664.00	21,798,400	
エフオン	1,000	1,083.00	1,083,000	
イーレックス	2,400	1,818.00	4,363,200	
レノバ	2,800	3,785.00	10,598,000	
東京瓦斯	31,500	2,260.00	71,190,000	
大阪瓦斯	29,600	1,940.00	57,424,000	
東邦瓦斯	8,000	6,160.00	49,280,000	
北海道瓦斯	800	1,563.00	1,250,400	
広島ガス	3,100	379.00	1,174,900	
西部瓦斯	1,900	2,849.00	5,413,100	
静岡ガス	4,600	952.00	4,379,200	
メタウォーター	1,800	2,386.00	4,294,800	
ＳＢＳホールディングス	1,200	2,455.00	2,946,000	
東武鉄道	17,100	2,920.00	49,932,000	
相鉄ホールディングス	5,700	2,472.00	14,090,400	
東急	41,300	1,217.00	50,262,100	
京浜急行電鉄	21,100	1,645.00	34,709,500	
小田急電鉄	26,200	3,040.00	79,648,000	
京王電鉄	9,100	7,940.00	72,254,000	
京成電鉄	12,300	3,515.00	43,234,500	
富士急行	2,200	5,010.00	11,022,000	
東日本旅客鉄道	28,800	6,561.00	188,956,800	
西日本旅客鉄道	14,600	5,408.00	78,956,800	
東海旅客鉄道	13,600	14,515.00	197,404,000	
西武ホールディングス	19,900	959.00	19,084,100	
鴻池運輸	2,500	1,018.00	2,545,000	
西日本鉄道	4,500	2,810.00	12,645,000	
ハマキョウレックス	1,300	3,190.00	4,147,000	
サカイ引越センター	800	4,825.00	3,860,000	
近鉄グループホールディングス	15,500	4,360.00	67,580,000	

阪急阪神ホールディングス	20,700	3,345.00	69,241,500	
南海電気鉄道	7,400	2,555.00	18,907,000	
京阪ホールディングス	6,900	4,735.00	32,671,500	
神戸電鉄	400	3,640.00	1,456,000	
名古屋鉄道	12,800	2,637.00	33,753,600	
山陽電気鉄道	1,200	2,006.00	2,407,200	
日本通運	5,400	7,750.00	41,850,000	
ヤマトホールディングス	21,700	2,857.00	61,996,900	
山九	3,900	3,885.00	15,151,500	
丸運	500	252.00	126,000	
丸全昭和運輸	1,200	3,310.00	3,972,000	
センコーグループホールディングス	8,500	968.00	8,228,000	
トナミホールディングス	400	5,440.00	2,176,000	
ニッコンホールディングス	5,200	2,132.00	11,086,400	
日本石油輸送	200	2,636.00	527,200	
福山通運	2,000	4,145.00	8,290,000	
セイノーホールディングス	11,600	1,414.00	16,402,400	
エスライン	300	879.00	263,700	
神奈川中央交通	400	3,830.00	1,532,000	
日立物流	3,400	3,295.00	11,203,000	
丸和運輸機関	3,300	2,304.00	7,603,200	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,600	1,920.00	3,072,000	
九州旅客鉄道	12,000	2,183.00	26,196,000	
ＳＧホールディングス	29,300	2,602.00	76,238,600	
日本郵船	13,000	2,484.00	32,292,000	
商船三井	9,200	2,928.00	26,937,600	
川崎汽船	4,800	1,854.00	8,899,200	
ＮＳユナイテッド海運	800	1,438.00	1,150,400	
明治海運	1,700	372.00	632,400	
飯野海運	7,500	407.00	3,052,500	
共栄タンカー	300	915.00	274,500	
乾汽船	900	935.00	841,500	
日本航空	37,800	1,864.00	70,459,200	
ＡＮＡホールディングス	41,900	2,221.00	93,059,900	
パスコ	300	1,361.00	408,300	
トランコム	500	8,500.00	4,250,000	
日新	1,200	1,245.00	1,494,000	
三菱倉庫	5,400	3,070.00	16,578,000	
三井倉庫ホールディングス	1,700	2,318.00	3,940,600	
住友倉庫	5,500	1,284.00	7,062,000	
澁澤倉庫	800	2,165.00	1,732,000	
東陽倉庫	2,500	309.00	772,500	

日本トランスシティ	3,300	536.00	1,768,800	
ケイヒン	200	1,341.00	268,200	
中央倉庫	900	1,134.00	1,020,600	
川西倉庫	300	1,155.00	346,500	
安田倉庫	1,200	931.00	1,117,200	
ファイズホールディングス	300	1,097.00	329,100	
東洋埠頭	400	1,380.00	552,000	
宇徳	1,000	466.00	466,000	
上組	8,600	1,864.00	16,030,400	
サンリツ	400	700.00	280,000	
キムラユニティー	300	1,116.00	334,800	
キユーソー流通システム	400	1,560.00	624,000	
近鉄エクスプレス	2,900	2,652.00	7,690,800	
東海運	1,100	310.00	341,000	
エーアイテイー	1,000	995.00	995,000	
内外トランスライン	600	1,200.00	720,000	
日本コンセプト	500	1,530.00	765,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	5,300	1,950.00	10,335,000	
クロスキャット	500	1,168.00	584,000	
システナ	5,700	2,010.00	11,457,000	
デジタルアーツ	900	9,510.00	8,559,000	
日鉄ソリューションズ	2,400	3,460.00	8,304,000	
キューブシステム	900	1,184.00	1,065,600	
エイジア	300	1,685.00	505,500	
コア	700	1,546.00	1,082,200	
ラクーンホールディングス	1,200	2,009.00	2,410,800	
ソリトンシステムズ	800	1,720.00	1,376,000	
ソフトクリエイトホールディングス	600	2,674.00	1,604,400	
ＴＩＳ	16,000	2,421.00	38,736,000	
ＪＮＳホールディングス	800	544.00	435,200	
電算システム	600	3,260.00	1,956,000	
グリー	9,900	583.00	5,771,700	
GMOペパボ	100	5,850.00	585,000	
コーエーテクモホールディングス	3,300	5,940.00	19,602,000	
三菱総合研究所	700	4,215.00	2,950,500	
ボルテージ	500	511.00	255,500	
電算	200	2,520.00	504,000	
ＡＧＳ	800	822.00	657,600	
ファインデックス	1,400	1,070.00	1,498,000	
ブレインパッド	400	4,115.00	1,646,000	
ＫＬａｂ	3,000	914.00	2,742,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,200	1,127.00	2,479,400	

イーブックイニシアティブジャパン	200	2,357.00	471,400	
ネクソン	40,600	3,295.00	133,777,000	
アイスタイル	5,000	416.00	2,080,000	
エムアップホールディングス	400	2,260.00	904,000	
エイチーム	1,100	1,146.00	1,260,600	
エニグモ	1,500	1,256.00	1,884,000	
テクノスジャパン	1,300	661.00	859,300	
コロプラ	5,300	911.00	4,828,300	
ブロードリーフ	7,900	627.00	4,953,300	
クロス・マーケティンググループ	800	368.00	294,400	
デジタルハーツホールディングス	800	1,257.00	1,005,600	
システム情報	1,200	1,133.00	1,359,600	
メディアドゥ	600	6,360.00	3,816,000	
じげん	4,100	374.00	1,533,400	
ブイキューブ	900	3,030.00	2,727,000	
エンカレッジ・テクノロジ	300	660.00	198,000	
サイバーリンクス	600	2,143.00	1,285,800	
フィックスターズ	1,800	941.00	1,693,800	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	700	1,328.00	929,600	
オプティム	1,100	3,130.00	3,443,000	
セレス	500	2,626.00	1,313,000	
ＳＨＩＦＴ	700	12,950.00	9,065,000	
ティーガイア	1,700	1,907.00	3,241,900	
セック	200	2,778.00	555,600	
日本アジアグループ	1,600	1,212.00	1,939,200	
テクマトリックス	2,500	2,049.00	5,122,500	
プロシップ	400	1,402.00	560,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,900	2,620.00	10,218,000	
GMOペイメントゲートウェイ	3,400	15,360.00	52,224,000	
ザッパラス	700	430.00	301,000	
システムリサーチ	500	1,702.00	851,000	
インターネットイニシアティブ	4,300	2,124.00	9,133,200	
さくらインターネット	1,800	672.00	1,209,600	
ヴィンクス	400	1,165.00	466,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	9,880.00	3,952,000	
ＳＲＡホールディングス	800	2,504.00	2,003,200	
システムインテグレータ	500	587.00	293,500	
朝日ネット	1,300	867.00	1,127,100	
ｅＢＡＳＥ	1,900	1,072.00	2,036,800	
アバント	1,700	1,416.00	2,407,200	
アドソル日進	600	3,090.00	1,854,000	
ＯＤＫソリューションズ	200	728.00	145,600	

フリービット	1,000	942.00	942,000	
コムチュア	1,500	2,974.00	4,461,000	
サイバーコム	300	1,667.00	500,100	
アステリア	1,200	991.00	1,189,200	
アイル	900	1,524.00	1,371,600	
マークラインズ	700	2,484.00	1,738,800	
メディカル・データ・ビジョン	1,800	2,695.00	4,851,000	
ｇｕｍｉ	2,300	865.00	1,989,500	
ショーケース	400	965.00	386,000	
モバイルファクトリー	400	1,037.00	414,800	
テラスカイ	500	3,690.00	1,845,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,628.00	1,302,400	
ＰＣＩホールディングス	600	1,482.00	889,200	
パイプドHD	300	1,554.00	466,200	
アイビーシー	300	1,043.00	312,900	
ネオジャパン	300	1,814.00	544,200	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	400	3,810.00	1,524,000	
ランドコンピュータ	200	1,125.00	225,000	
ダブルスタンダード	200	4,300.00	860,000	
オープンドア	1,000	1,754.00	1,754,000	
マイネット	600	892.00	535,200	
アカツキ	700	4,380.00	3,066,000	
ベネフィットジャパン	100	1,799.00	179,900	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	400	3,230.00	1,292,000	
カナミックネットワーク	1,500	710.00	1,065,000	
ノムラシステムコーポレーション	800	363.00	290,400	
チェンジ	2,300	3,550.00	8,165,000	
シンクロ・フード	1,000	327.00	327,000	
オークネット	900	1,253.00	1,127,700	
キャピタル・アセット・プランニング	200	955.00	191,000	
セグエグループ	400	1,279.00	511,600	
エイトレッド	300	2,677.00	803,100	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,700	445.00	756,500	
マクロミル	3,500	780.00	2,730,000	
ビーグリー	300	1,697.00	509,100	
オロ	500	3,675.00	1,837,500	
ユーザーローカル	300	4,020.00	1,206,000	
テモナ	400	944.00	377,600	
ニーズウェル	400	667.00	266,800	
サインポスト	400	991.00	396,400	
ソルクシーズ	600	949.00	569,400	
フェイス	500	781.00	390,500	

プロトコーポレーション	1,500	1,051.00	1,576,500	
ハイマックス	400	1,428.00	571,200	
野村総合研究所	29,300	3,530.00	103,429,000	
サイバネットシステム	1,200	962.00	1,154,400	
ＣＥホールディングス	900	640.00	576,000	
日本システム技術	300	1,519.00	455,700	
インテージホールディングス	2,000	1,162.00	2,324,000	
東邦システムサイエンス	400	931.00	372,400	
ソースネクスト	7,700	291.00	2,240,700	
インフォコム	1,500	3,110.00	4,665,000	
ＨＥＲＯＺ	500	2,857.00	1,428,500	
ラクスル	1,300	4,115.00	5,349,500	
ＩＰＳ	300	2,665.00	799,500	
ＦＩＧ	1,900	257.00	488,300	
システムサポート	500	1,537.00	768,500	
イーソル	900	1,198.00	1,078,200	
アルテリア・ネットワークス	1,800	1,557.00	2,802,600	
ＥｄｕＬａｂ	200	7,340.00	1,468,000	
東海ソフト	200	1,169.00	233,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,862.00	558,600	
東名	100	1,076.00	107,600	
ヴィッツ	100	2,113.00	211,300	
トビラシステムズ	200	1,365.00	273,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	100	1,307.00	130,700	
ギフティ	700	3,110.00	2,177,000	
ベース	100	5,530.00	553,000	
フォーカスシステムズ	1,100	950.00	1,045,000	
クレスコ	1,100	1,282.00	1,410,200	
フジ・メディア・ホールディングス	16,500	1,235.00	20,377,500	
オービック	5,000	19,620.00	98,100,000	
ジャストシステム	2,300	7,640.00	17,572,000	
ＴＤＣソフト	1,400	952.00	1,332,800	
Ｚホールディングス	220,600	675.80	149,081,480	
トレンドマイクロ	8,600	5,770.00	49,622,000	
ＩＤホールディングス	600	1,234.00	740,400	
日本オラクル	3,200	12,420.00	39,744,000	
アルファシステムズ	400	3,550.00	1,420,000	
フューチャー	1,900	1,767.00	3,357,300	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,000	1,366.00	1,366,000	
ＳＢテクノロジー	600	3,110.00	1,866,000	
トーセ	500	799.00	399,500	
オービックビジネスコンサルタント	1,600	6,490.00	10,384,000	

伊藤忠テクノソリューションズ	7,300	3,780.00	27,594,000	
アイティフォー	2,100	921.00	1,934,100	
東計電算	200	3,915.00	783,000	
エックスネット	200	1,015.00	203,000	
大塚商会	8,700	5,430.00	47,241,000	
サイボウズ	1,900	2,665.00	5,063,500	
電通国際情報サービス	2,000	3,905.00	7,810,000	
ＡＣＣＥＳＳ	1,600	745.00	1,192,000	
デジタルガレージ	2,600	3,665.00	9,529,000	
ＥＭシステムズ	2,700	962.00	2,597,400	
ウェザーニューズ	500	4,915.00	2,457,500	
ＣＩＪ	1,100	882.00	970,200	
ビジネスエンジニアリング	200	3,185.00	637,000	
日本エンタープライズ	1,900	234.00	444,600	
WOWOW	800	2,806.00	2,244,800	
スカラ	1,500	820.00	1,230,000	
インテリジェント　ウェイブ	1,000	728.00	728,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,400	362.00	506,800	
ネットワンシステムズ	6,600	3,535.00	23,331,000	
システムソフト	5,000	93.00	465,000	
アルゴグラフィックス	1,300	3,020.00	3,926,000	
マーベラス	2,600	886.00	2,303,600	
エイベックス	2,800	1,337.00	3,743,600	
日本ユニシス	5,600	4,040.00	22,624,000	
兼松エレクトロニクス	900	3,750.00	3,375,000	
都築電気	600	1,520.00	912,000	
ＴＢＳホールディングス	10,600	1,989.00	21,083,400	
日本テレビホールディングス	13,300	1,218.00	16,199,400	
朝日放送グループホールディングス	1,500	698.00	1,047,000	
テレビ朝日ホールディングス	4,900	1,958.00	9,594,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	10,500	465.00	4,882,500	
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,393.00	2,871,600	
日本ＢＳ放送	600	1,187.00	712,200	
ビジョン	2,000	878.00	1,756,000	
スマートバリュー	500	927.00	463,500	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	700	1,816.00	1,271,200	
コネクシオ	1,100	1,378.00	1,515,800	
クロップス	300	753.00	225,900	
日本電信電話	188,000	2,636.00	495,568,000	
ＫＤＤＩ	128,900	3,101.00	399,718,900	
ソフトバンク	146,200	1,361.00	198,978,200	
光通信	1,900	21,500.00	40,850,000	

エムティーアイ	1,600	800.00	1,280,000	
GMOインターネット	5,800	2,962.00	17,179,600	
ファイバーゲート	600	2,081.00	1,248,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	500	427.00	213,500	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	4,300	3,435.00	14,770,500	
学研ホールディングス	2,200	1,709.00	3,759,800	
ゼンリン	2,900	1,268.00	3,677,200	
昭文社ホールディングス	800	471.00	376,800	
インプレスホールディングス	1,600	177.00	283,200	
アイネット	800	1,490.00	1,192,000	
松竹	1,100	14,340.00	15,774,000	
東宝	9,500	4,035.00	38,332,500	
東映	500	18,830.00	9,415,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	42,700	1,546.00	66,014,200	
ピー・シー・エー	300	4,540.00	1,362,000	
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,792.00	1,075,200	
ＤＴＳ	3,300	2,286.00	7,543,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,900	6,270.00	43,263,000	
シーイーシー	1,700	1,412.00	2,400,400	
カプコン	6,900	6,690.00	46,161,000	
アイ・エス・ビー	800	1,277.00	1,021,600	
ジャステック	1,000	1,208.00	1,208,000	
ＳＣＳＫ	3,700	6,630.00	24,531,000	
日本システムウエア	500	2,148.00	1,074,000	
アイネス	1,600	1,421.00	2,273,600	
ＴＫＣ	1,300	6,850.00	8,905,000	
富士ソフト	1,700	5,510.00	9,367,000	
ＮＳＤ	5,100	1,980.00	10,098,000	
コナミホールディングス	5,800	6,580.00	38,164,000	
福井コンピュータホールディングス	700	3,745.00	2,621,500	
ＪＢＣＣホールディングス	1,100	1,484.00	1,632,400	
ミロク情報サービス	1,600	2,139.00	3,422,400	
ソフトバンクグループ	127,400	8,458.00	1,077,549,200	
ホウスイ	100	990.00	99,000	
高千穂交易	600	1,201.00	720,600	
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,523.00	456,900	
伊藤忠食品	400	5,290.00	2,116,000	
エレマテック	1,300	1,009.00	1,311,700	
ＪＡＬＵＸ	500	1,394.00	697,000	
あらた	1,300	4,560.00	5,928,000	
トーメンデバイス	200	4,035.00	807,000	
東京エレクトロン　デバイス	500	3,535.00	1,767,500	

フィールズ	1,500	514.00	771,000	
双日	89,600	246.00	22,041,600	
アルフレッサ　ホールディングス	16,700	2,096.00	35,003,200	
横浜冷凍	4,300	875.00	3,762,500	
神栄	300	1,670.00	501,000	
ラサ商事	900	903.00	812,700	
アルコニックス	1,800	1,589.00	2,860,200	
神戸物産	11,100	2,948.00	32,722,800	
ハイパー	200	521.00	104,200	
あい　ホールディングス	2,400	1,977.00	4,744,800	
ディーブイエックス	500	1,019.00	509,500	
ダイワボウホールディングス	1,500	8,800.00	13,200,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,800	2,265.00	8,607,000	
ラクト・ジャパン	700	2,559.00	1,791,300	
グリムス	300	1,612.00	483,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,700	815.00	2,200,500	
八洲電機	1,200	958.00	1,149,600	
メディアスホールディングス	900	790.00	711,000	
レスターホールディングス	1,700	2,087.00	3,547,900	
ジューテックホールディングス	400	1,037.00	414,800	
大光	800	661.00	528,800	
ＯＣＨＩホールディングス	500	1,335.00	667,500	
ＴＯＫＡＩホールディングス	7,800	980.00	7,644,000	
黒谷	500	671.00	335,500	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	400	778.00	311,200	
三洋貿易	1,600	972.00	1,555,200	
ビューティガレージ	300	2,379.00	713,700	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,096.00	1,205,600	
ミタチ産業	400	586.00	234,400	
シップヘルスケアホールディングス	2,800	6,130.00	17,164,000	
明治電機工業	500	1,423.00	711,500	
デリカフーズホールディングス	800	634.00	507,200	
スターティアホールディングス	300	946.00	283,800	
コメダホールディングス	3,600	1,901.00	6,843,600	
ピーバンドットコム	300	951.00	285,300	
アセンテック	500	1,880.00	940,000	
富士興産	500	1,188.00	594,000	
協栄産業	200	1,338.00	267,600	
小野建	1,400	1,201.00	1,681,400	
南陽	300	1,641.00	492,300	
佐鳥電機	1,000	751.00	751,000	
エコートレーディング	300	658.00	197,400	

伯東	1,000	1,296.00	1,296,000	
コンドーテック	1,200	1,050.00	1,260,000	
中山福	1,100	531.00	584,100	
ナガイレーベン	2,100	3,040.00	6,384,000	
三菱食品	1,700	2,817.00	4,788,900	
松田産業	1,200	1,828.00	2,193,600	
第一興商	2,400	3,615.00	8,676,000	
メディパルホールディングス	16,100	2,158.00	34,743,800	
ＳＰＫ	700	1,266.00	886,200	
萩原電気ホールディングス	600	2,648.00	1,588,800	
アズワン	1,100	15,990.00	17,589,000	
スズデン	600	1,227.00	736,200	
シモジマ	1,000	1,356.00	1,356,000	
ドウシシャ	1,600	1,825.00	2,920,000	
小津産業	400	1,902.00	760,800	
高速	800	1,500.00	1,200,000	
たけびし	500	1,583.00	791,500	
リックス	400	1,593.00	637,200	
丸文	1,400	539.00	754,600	
ハピネット	1,400	1,559.00	2,182,600	
橋本総業ホールディングス	300	2,512.00	753,600	
日本ライフライン	5,200	1,423.00	7,399,600	
タカショー	1,200	753.00	903,600	
マルカ	500	1,909.00	954,500	
ＩＤＯＭ	5,600	619.00	3,466,400	
進和	900	2,146.00	1,931,400	
エスケイジャパン	500	453.00	226,500	
ダイトロン	700	1,639.00	1,147,300	
シークス	2,100	1,528.00	3,208,800	
田中商事	500	700.00	350,000	
オーハシテクニカ	800	1,323.00	1,058,400	
白銅	600	1,401.00	840,600	
ダイコー通産	200	1,498.00	299,600	
伊藤忠商事	112,600	2,980.50	335,604,300	
丸紅	159,000	703.20	111,808,800	
高島	200	1,659.00	331,800	
長瀬産業	9,000	1,507.00	13,563,000	
蝶理	1,000	1,535.00	1,535,000	
豊田通商	16,200	4,125.00	66,825,000	
三共生興	2,300	465.00	1,069,500	
兼松	6,400	1,328.00	8,499,200	
ツカモトコーポレーション	300	1,571.00	471,300	

三井物産	130,800	1,931.00	252,574,800	
日本紙パルプ商事	800	3,540.00	2,832,000	
カメイ	2,000	1,210.00	2,420,000	
東都水産	200	3,355.00	671,000	
ＯＵＧホールディングス	300	2,826.00	847,800	
スターゼン	600	4,215.00	2,529,000	
山善	6,300	982.00	6,186,600	
椿本興業	300	3,570.00	1,071,000	
住友商事	101,800	1,411.00	143,639,800	
内田洋行	600	4,125.00	2,475,000	
三菱商事	98,000	2,652.50	259,945,000	
第一実業	700	4,190.00	2,933,000	
キヤノンマーケティングジャパン	4,000	2,400.00	9,600,000	
西華産業	800	1,369.00	1,095,200	
佐藤商事	1,300	913.00	1,186,900	
菱洋エレクトロ	1,200	2,902.00	3,482,400	
東京産業	1,400	604.00	845,600	
ユアサ商事	1,600	3,210.00	5,136,000	
神鋼商事	400	1,799.00	719,600	
トルク	1,000	250.00	250,000	
阪和興業	3,300	2,703.00	8,919,900	
正栄食品工業	1,100	3,705.00	4,075,500	
カナデン	1,400	1,209.00	1,692,600	
菱電商事	1,100	1,592.00	1,751,200	
フルサト工業	700	1,272.00	890,400	
岩谷産業	3,900	6,560.00	25,584,000	
ナイス	700	1,512.00	1,058,400	
昭光通商	800	632.00	505,600	
ニチモウ	300	1,857.00	557,100	
極東貿易	500	1,363.00	681,500	
イワキ	2,200	633.00	1,392,600	
三愛石油	3,900	1,080.00	4,212,000	
稲畑産業	3,800	1,473.00	5,597,400	
ＧＳＩクレオス	400	1,871.00	748,400	
明和産業	1,500	447.00	670,500	
クワザワホールディングス	600	637.00	382,200	
ヤマエ久野	1,200	1,059.00	1,270,800	
ワキタ	3,100	1,005.00	3,115,500	
東邦ホールディングス	5,200	1,998.00	10,389,600	
サンゲツ	4,300	1,563.00	6,720,900	
ミツウロコグループホールディングス	2,400	1,344.00	3,225,600	
シナネンホールディングス	600	2,943.00	1,765,800	

伊藤忠エネクス	3,400	1,012.00	3,440,800	
サンリオ	4,700	1,555.00	7,308,500	
サンワテクノス	1,100	1,037.00	1,140,700	
リョーサン	1,800	2,306.00	4,150,800	
新光商事	2,200	752.00	1,654,400	
トーホー	700	1,857.00	1,299,900	
三信電気	900	1,884.00	1,695,600	
東陽テクニカ	1,700	1,131.00	1,922,700	
モスフードサービス	2,300	3,060.00	7,038,000	
加賀電子	1,500	2,473.00	3,709,500	
ソーダニッカ	1,500	522.00	783,000	
立花エレテック	1,200	1,577.00	1,892,400	
フォーバル	600	822.00	493,200	
ＰＡＬＴＡＣ	2,600	5,390.00	14,014,000	
三谷産業	2,200	425.00	935,000	
太平洋興発	600	630.00	378,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	400	2,551.00	1,020,400	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,508.00	150,800	
コーア商事ホールディングス	500	1,322.00	661,000	
国際紙パルプ商事	3,500	243.00	850,500	
ヤマタネ	700	1,368.00	957,600	
丸紅建材リース	100	1,766.00	176,600	
日鉄物産	1,100	3,620.00	3,982,000	
泉州電業	500	3,200.00	1,600,000	
トラスコ中山	3,700	2,731.00	10,104,700	
オートバックスセブン	5,900	1,421.00	8,383,900	
モリト	1,100	600.00	660,000	
加藤産業	2,300	3,405.00	7,831,500	
北恵	500	954.00	477,000	
イノテック	900	1,244.00	1,119,600	
イエローハット	3,000	1,751.00	5,253,000	
ＪＫホールディングス	1,400	797.00	1,115,800	
日伝	1,300	2,190.00	2,847,000	
北沢産業	1,200	261.00	313,200	
杉本商事	800	2,291.00	1,832,800	
因幡電機産業	4,200	2,448.00	10,281,600	
東テク	500	2,701.00	1,350,500	
ミスミグループ本社	20,200	3,510.00	70,902,000	
アルテック	1,200	275.00	330,000	
タキヒヨー	600	1,858.00	1,114,800	
蔵王産業	300	1,347.00	404,100	
スズケン	6,800	4,055.00	27,574,000	

ジェコス	1,000	941.00	941,000	
グローセル	1,700	504.00	856,800	
ローソン	4,100	5,100.00	20,910,000	
サンエー	1,200	4,025.00	4,830,000	
カワチ薬品	1,100	2,947.00	3,241,700	
エービーシー・マート	2,500	5,910.00	14,775,000	
ハードオフコーポレーション	700	761.00	532,700	
アスクル	1,400	3,920.00	5,488,000	
ゲオホールディングス	2,100	1,216.00	2,553,600	
アダストリア	2,200	1,955.00	4,301,000	
ジーフット	1,300	418.00	543,400	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	300	398.00	119,400	
くら寿司	1,000	6,440.00	6,440,000	
キャンドゥ	800	1,858.00	1,486,400	
アイケイ	400	884.00	353,600	
パルグループホールディングス	1,400	1,509.00	2,112,600	
エディオン	6,800	1,031.00	7,010,800	
サーラコーポレーション	3,200	568.00	1,817,600	
ワッツ	800	864.00	691,200	
ハローズ	600	3,215.00	1,929,000	
フジオフードグループ本社	1,400	1,261.00	1,765,400	
あみやき亭	400	2,856.00	1,142,400	
ひらまつ	3,800	140.00	532,000	
大黒天物産	400	5,570.00	2,228,000	
ハニーズホールディングス	1,300	972.00	1,263,600	
ファーマライズホールディングス	300	774.00	232,200	
アルペン	1,200	2,330.00	2,796,000	
ハブ	600	628.00	376,800	
クオールホールディングス	2,200	1,163.00	2,558,600	
ジンズホールディングス	900	6,650.00	5,985,000	
ビックカメラ	9,600	1,127.00	10,819,200	
ＤＣＭホールディングス	9,900	1,057.00	10,464,300	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	11,400	5,400.00	61,560,000	
東京一番フーズ	600	598.00	358,800	
アークランドサービスホールディングス	1,400	2,083.00	2,916,200	
Ｊ．フロント　リテイリング	19,300	871.00	16,810,300	
ドトール・日レスホールディングス	2,600	1,559.00	4,053,400	
マツモトキヨシホールディングス	6,600	4,165.00	27,489,000	
ブロンコビリー	900	2,201.00	1,980,900	
ＺＯＺＯ	9,500	3,435.00	32,632,500	
トレジャー・ファクトリー	500	759.00	379,500	
物語コーポレーション	400	12,000.00	4,800,000	

ココカラファイン	1,400	6,910.00	9,674,000	
三越伊勢丹ホールディングス	28,300	649.00	18,366,700	
Ｈａｍｅｅ	400	1,752.00	700,800	
ウエルシアホールディングス	8,500	3,555.00	30,217,500	
クリエイトＳＤホールディングス	2,300	3,400.00	7,820,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	1,700	371.00	630,700	
ミサワ	400	666.00	266,400	
ティーライフ	200	1,136.00	227,200	
チムニー	600	1,221.00	732,600	
シュッピン	1,200	950.00	1,140,000	
オイシックス・ラ・大地	1,600	3,090.00	4,944,000	
ネクステージ	2,800	1,533.00	4,292,400	
ジョイフル本田	4,700	1,387.00	6,518,900	
鳥貴族ホールディングス	500	1,474.00	737,000	
ホットランド	1,300	1,230.00	1,599,000	
すかいらーくホールディングス	18,100	1,692.00	30,625,200	
ＳＦＰホールディングス	900	1,341.00	1,206,900	
綿半ホールディングス	1,200	1,293.00	1,551,600	
ヨシックス	300	1,967.00	590,100	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,600	1,125.00	5,175,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	892.00	802,800	
ＢＥＥＮＯＳ	800	2,241.00	1,792,800	
あさひ	1,200	1,616.00	1,939,200	
日本調剤	1,000	1,585.00	1,585,000	
コスモス薬品	1,600	16,000.00	25,600,000	
トーエル	700	836.00	585,200	
オンリー	300	452.00	135,600	
セブン&アイ・ホールディングス	63,000	3,978.00	250,614,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	8,800	796.00	7,004,800	
ツルハホールディングス	3,500	13,980.00	48,930,000	
サンマルクホールディングス	1,400	1,442.00	2,018,800	
フェリシモ	400	1,316.00	526,400	
トリドールホールディングス	4,000	1,534.00	6,136,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,600	510.00	816,000	
ウイルプラスホールディングス	300	808.00	242,400	
ＪＭホールディングス	1,200	2,027.00	2,432,400	
サツドラホールディングス	300	2,036.00	610,800	
アレンザホールディングス	1,000	1,353.00	1,353,000	
串カツ田中ホールディングス	400	1,560.00	624,000	
バロックジャパンリミテッド	1,200	754.00	904,800	
クスリのアオキホールディングス	1,600	8,400.00	13,440,000	

スシローグローバルホールディングス	8,800	3,690.00	32,472,000	
メディカルシステムネットワーク	1,500	588.00	882,000	
はるやまホールディングス	600	683.00	409,800	
ノジマ	2,800	2,663.00	7,456,400	
カッパ・クリエイト	2,400	1,520.00	3,648,000	
ライトオン	1,400	628.00	879,200	
ジーンズメイト	700	268.00	187,600	
良品計画	21,400	2,545.00	54,463,000	
三城ホールディングス	2,000	305.00	610,000	
アドヴァン	1,700	1,089.00	1,851,300	
アルビス	500	2,414.00	1,207,000	
コナカ	2,200	302.00	664,400	
ハウス　オブ　ローゼ	200	1,675.00	335,000	
Ｇ－７ホールディングス	900	2,403.00	2,162,700	
イオン北海道	2,100	988.00	2,074,800	
コジマ	2,700	623.00	1,682,100	
ヒマラヤ	600	980.00	588,000	
コーナン商事	2,300	2,858.00	6,573,400	
エコス	600	1,867.00	1,120,200	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	32,200	2,390.00	76,958,000	
西松屋チェーン	3,600	1,433.00	5,158,800	
ゼンショーホールディングス	8,700	2,895.00	25,186,500	
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,718.00	1,889,800	
ハークスレイ	300	893.00	267,900	
サイゼリヤ	2,400	2,146.00	5,150,400	
ＶＴホールディングス	6,200	420.00	2,604,000	
魚力	500	1,823.00	911,500	
フジ・コーポレーション	400	2,153.00	861,200	
ユナイテッドアローズ	1,900	1,628.00	3,093,200	
ハイデイ日高	2,300	1,751.00	4,027,300	
京都きもの友禅	1,500	216.00	324,000	
コロワイド	5,400	1,864.00	10,065,600	
ピーシーデポコーポレーション	1,900	562.00	1,067,800	
壱番屋	1,100	5,080.00	5,588,000	
ＰＬＡＮＴ	400	740.00	296,000	
スギホールディングス	3,200	6,890.00	22,048,000	
薬王堂ホールディングス	700	2,499.00	1,749,300	
スクロール	2,300	975.00	2,242,500	
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,925.00	2,887,500	
木曽路	2,200	2,339.00	5,145,800	
ＳＲＳホールディングス	2,300	821.00	1,888,300	
千趣会	2,900	316.00	916,400	

タカキュー	1,800	148.00	266,400	
リテールパートナーズ	1,900	1,328.00	2,523,200	
ケーヨー	3,000	738.00	2,214,000	
上新電機	1,900	2,726.00	5,179,400	
日本瓦斯	2,700	5,060.00	13,662,000	
ロイヤルホールディングス	2,800	1,843.00	5,160,400	
東天紅	100	903.00	90,300	
いなげや	1,800	1,680.00	3,024,000	
島忠	1,100	5,490.00	6,039,000	
チヨダ	1,700	919.00	1,562,300	
ライフコーポレーション	1,200	3,205.00	3,846,000	
リンガーハット	2,100	2,389.00	5,016,900	
ＭｒＭａｘＨＤ	2,200	742.00	1,632,400	
ＡＯＫＩホールディングス	3,300	543.00	1,791,900	
オークワ	2,500	1,251.00	3,127,500	
コメリ	2,500	2,742.00	6,855,000	
青山商事	3,800	608.00	2,310,400	
しまむら	1,900	11,810.00	22,439,000	
はせがわ	1,300	288.00	374,400	
高島屋	11,800	990.00	11,682,000	
松屋	3,600	883.00	3,178,800	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	7,700	769.00	5,921,300	
近鉄百貨店	600	3,190.00	1,914,000	
丸井グループ	13,700	1,877.00	25,714,900	
アクシアル　リテイリング	1,300	4,930.00	6,409,000	
イオン	62,000	3,308.00	205,096,000	
イズミ	3,300	3,810.00	12,573,000	
平和堂	2,900	2,145.00	6,220,500	
フジ	1,900	1,958.00	3,720,200	
ヤオコー	1,800	6,790.00	12,222,000	
ゼビオホールディングス	1,900	874.00	1,660,600	
ケーズホールディングス	14,300	1,402.00	20,048,600	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	900	877.00	789,300	
日産東京販売ホールディングス	2,100	260.00	546,000	
シルバーライフ	200	2,100.00	420,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	700	3,740.00	2,618,000	
ナルミヤ・インターナショナル	300	929.00	278,700	
ブックオフグループホールディングス	1,000	854.00	854,000	
ギフト	200	1,904.00	380,800	
アインホールディングス	2,300	6,550.00	15,065,000	
元気寿司	500	2,459.00	1,229,500	
ヤマダホールディングス	54,000	535.00	28,890,000	

アークランドサカモト	2,500	1,464.00	3,660,000	
ニトリホールディングス	6,400	20,810.00	133,184,000	
愛眼	1,200	222.00	266,400	
ケーユーホールディングス	800	812.00	649,600	
吉野家ホールディングス	5,400	2,172.00	11,728,800	
松屋フーズホールディングス	800	3,485.00	2,788,000	
サガミホールディングス	2,300	1,168.00	2,686,400	
関西スーパーマーケット	1,200	1,130.00	1,356,000	
王将フードサービス	1,000	5,760.00	5,760,000	
プレナス	1,800	2,016.00	3,628,800	
ミニストップ	1,300	1,408.00	1,830,400	
アークス	3,000	2,336.00	7,008,000	
バローホールディングス	3,300	2,508.00	8,276,400	
藤久	400	760.00	304,000	
ベルク	800	5,920.00	4,736,000	
大庄	1,000	988.00	988,000	
ファーストリテイリング	2,200	91,520.00	201,344,000	
サンドラッグ	6,100	4,245.00	25,894,500	
サックスバー　ホールディングス	1,500	532.00	798,000	
ヤマザワ	300	1,742.00	522,600	
やまや	300	2,163.00	648,900	
ベルーナ	3,500	1,124.00	3,934,000	
島根銀行	800	665.00	532,000	
じもとホールディングス	1,200	803.00	963,600	
めぶきフィナンシャルグループ	84,000	209.00	17,556,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,100	1,097.00	2,303,700	
九州フィナンシャルグループ	33,000	421.00	13,893,000	
ゆうちょ銀行	45,500	921.00	41,905,500	
富山第一銀行	3,700	287.00	1,061,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	98,000	385.00	37,730,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,700	648.00	6,933,600	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,600	517.00	3,929,200	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,257.00	1,759,800	
第四北越フィナンシャルグループ	2,600	2,193.00	5,701,800	
ひろぎんホールディングス	23,800	612.00	14,565,600	
新生銀行	13,200	1,283.00	16,935,600	
あおぞら銀行	9,700	1,969.00	19,099,300	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,104,100	475.30	524,778,730	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	175,400	372.80	65,389,120	
三井住友トラスト・ホールディングス	30,400	3,160.00	96,064,000	
三井住友フィナンシャルグループ	111,700	3,315.00	370,285,500	代用有価証券 13,000株

千葉銀行	53,700	581.00	31,199,700	
群馬銀行	33,200	328.00	10,889,600	
武蔵野銀行	2,400	1,503.00	3,607,200	
千葉興業銀行	4,300	237.00	1,019,100	
筑波銀行	7,100	176.00	1,249,600	
七十七銀行	5,000	1,328.00	6,640,000	
青森銀行	1,300	2,324.00	3,021,200	
秋田銀行	1,000	1,369.00	1,369,000	
山形銀行	1,900	1,013.00	1,924,700	
岩手銀行	1,100	1,951.00	2,146,100	
東邦銀行	14,400	205.00	2,952,000	
東北銀行	800	1,101.00	880,800	
みちのく銀行	1,200	1,001.00	1,201,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	14,500	1,912.00	27,724,000	
静岡銀行	39,200	762.00	29,870,400	
十六銀行	2,000	1,879.00	3,758,000	
スルガ銀行	14,300	309.00	4,418,700	
八十二銀行	36,400	344.00	12,521,600	
山梨中央銀行	2,000	800.00	1,600,000	
大垣共立銀行	3,200	1,981.00	6,339,200	
福井銀行	1,400	1,878.00	2,629,200	
北國銀行	1,500	2,534.00	3,801,000	
清水銀行	700	1,673.00	1,171,100	
富山銀行	300	2,797.00	839,100	
滋賀銀行	3,200	1,919.00	6,140,800	
南都銀行	2,400	1,692.00	4,060,800	
百五銀行	14,500	295.00	4,277,500	
京都銀行	5,800	5,500.00	31,900,000	
紀陽銀行	5,700	1,350.00	7,695,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	10,700	939.00	10,047,300	
山陰合同銀行	10,200	476.00	4,855,200	
中国銀行	13,900	815.00	11,328,500	
鳥取銀行	500	1,110.00	555,000	
伊予銀行	21,300	606.00	12,907,800	
百十四銀行	1,800	1,492.00	2,685,600	
四国銀行	2,300	664.00	1,527,200	
阿波銀行	2,400	2,151.00	5,162,400	
大分銀行	900	2,020.00	1,818,000	
宮崎銀行	1,000	2,145.00	2,145,000	
佐賀銀行	900	1,298.00	1,168,200	
沖縄銀行	1,400	2,690.00	3,766,000	
琉球銀行	3,500	736.00	2,576,000	

セブン銀行	54,200	230.00	12,466,000	
みずほフィナンシャルグループ	219,300	1,400.00	307,020,000	
高知銀行	600	704.00	422,400	
山口フィナンシャルグループ	20,000	600.00	12,000,000	
長野銀行	500	1,243.00	621,500	
名古屋銀行	1,300	2,603.00	3,383,900	
北洋銀行	24,100	215.00	5,181,500	
愛知銀行	600	2,795.00	1,677,000	
中京銀行	600	1,799.00	1,079,400	
大光銀行	600	1,246.00	747,600	
愛媛銀行	2,200	954.00	2,098,800	
トマト銀行	500	1,032.00	516,000	
京葉銀行	6,700	403.00	2,700,100	
栃木銀行	8,000	170.00	1,360,000	
北日本銀行	500	1,862.00	931,000	
東和銀行	3,000	668.00	2,004,000	
福島銀行	2,300	208.00	478,400	
大東銀行	800	621.00	496,800	
トモニホールディングス	12,500	304.00	3,800,000	
フィデアホールディングス	16,300	108.00	1,760,400	
池田泉州ホールディングス	19,200	149.00	2,860,800	
ＦＰＧ	5,300	524.00	2,777,200	
ジャパンインベストメントアドバイザー	800	1,143.00	914,400	
マーキュリアインベストメント	800	708.00	566,400	
ＳＢＩホールディングス	19,800	2,641.00	52,291,800	
ジャフコ　グループ	2,500	5,830.00	14,575,000	
大和証券グループ本社	120,800	489.10	59,083,280	
野村ホールディングス	246,400	549.10	135,298,240	
岡三証券グループ	13,700	372.00	5,096,400	
丸三証券	4,900	513.00	2,513,700	
東洋証券	5,600	135.00	756,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,400	310.00	5,394,000	
光世証券	400	613.00	245,200	
水戸証券	4,300	248.00	1,066,400	
いちよし証券	3,300	500.00	1,650,000	
松井証券	8,000	819.00	6,552,000	
マネックスグループ	14,600	570.00	8,322,000	
極東証券	2,300	760.00	1,748,000	
岩井コスモホールディングス	1,600	1,415.00	2,264,000	
藍澤證券	2,900	825.00	2,392,500	
マネーパートナーズグループ	2,200	206.00	453,200	
スパークス・グループ	7,600	290.00	2,204,000	

かんぽ生命保険	20,000	2,129.00	42,580,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	28,400	4,144.00	117,689,600	
アニコム　ホールディングス	4,600	1,152.00	5,299,200	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	39,200	3,015.00	118,188,000	
第一生命ホールディングス	85,300	1,606.00	136,991,800	
東京海上ホールディングス	53,500	5,147.00	275,364,500	
Ｔ＆Ｄホールディングス	48,200	1,230.00	59,286,000	
アドバンスクリエイト	300	1,858.00	557,400	
全国保証	4,200	4,725.00	19,845,000	
ジェイリース	600	719.00	431,400	
イントラスト	500	777.00	388,500	
日本モーゲージサービス	900	1,203.00	1,082,700	
Ｃａｓａ	500	969.00	484,500	
アルヒ	2,400	1,810.00	4,344,000	
プレミアグループ	800	2,450.00	1,960,000	
クレディセゾン	9,400	1,204.00	11,317,600	
芙蓉総合リース	1,700	7,410.00	12,597,000	
みずほリース	2,500	3,285.00	8,212,500	
東京センチュリー	3,700	8,880.00	32,856,000	
日本証券金融	6,800	520.00	3,536,000	
アイフル	27,500	271.00	7,452,500	
リコーリース	1,200	3,120.00	3,744,000	
イオンフィナンシャルサービス	9,900	1,267.00	12,543,300	
アコム	32,500	454.00	14,755,000	
ジャックス	1,800	1,922.00	3,459,600	
オリエントコーポレーション	44,500	122.00	5,429,000	
日立キャピタル	3,800	2,661.00	10,111,800	
オリックス	100,100	1,715.50	171,721,550	
三菱ＵＦＪリース	36,300	526.00	19,093,800	
九州リースサービス	900	614.00	552,600	
日本取引所グループ	43,600	2,462.50	107,365,000	
イー・ギャランティ	1,900	2,231.00	4,238,900	
アサックス	900	731.00	657,900	
ＮＥＣキャピタルソリューション	600	1,925.00	1,155,000	
いちご	18,000	292.00	5,256,000	
日本駐車場開発	16,400	140.00	2,296,000	
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,092.00	982,800	
ＳＲＥホールディングス	200	4,665.00	933,000	
ＡＤワークスグループ	3,900	156.00	608,400	
ヒューリック	34,200	1,163.00	39,774,600	
三栄建築設計	700	1,739.00	1,217,300	
野村不動産ホールディングス	9,800	2,333.00	22,863,400	

三重交通グループホールディングス	3,300	476.00	1,570,800	
サムティ	2,300	1,640.00	3,772,000	
ディア・ライフ	2,300	436.00	1,002,800	
コーセーアールイー	600	603.00	361,800	
日本商業開発	1,100	1,680.00	1,848,000	
プレサンスコーポレーション	2,600	1,471.00	3,824,600	
ＴＨＥグローバル社	1,300	244.00	317,200	
ハウスコム	300	1,288.00	386,400	
日本管理センター	900	1,155.00	1,039,500	
サンセイランディック	500	737.00	368,500	
エストラスト	300	710.00	213,000	
フージャースホールディングス	2,700	665.00	1,795,500	
オープンハウス	5,100	4,305.00	21,955,500	
東急不動産ホールディングス	44,000	598.00	26,312,000	
飯田グループホールディングス	13,500	2,377.00	32,089,500	
イーグランド	300	828.00	248,400	
ムゲンエステート	1,300	458.00	595,400	
ビーロット	900	606.00	545,400	
ファーストブラザーズ	300	970.00	291,000	
ハウスドゥ	900	1,185.00	1,066,500	
シーアールイー	400	1,266.00	506,400	
プロパティエージェント	300	1,333.00	399,900	
ケイアイスター不動産	500	2,467.00	1,233,500	
アグレ都市デザイン	400	710.00	284,000	
グッドコムアセット	800	1,226.00	980,800	
ジェイ・エス・ビー	300	3,380.00	1,014,000	
テンポイノベーション	500	857.00	428,500	
グローバル・リンク・マネジメント	300	722.00	216,600	
パーク２４	8,700	2,042.00	17,765,400	
パラカ	400	1,606.00	642,400	
三井不動産	73,600	2,120.00	156,032,000	
三菱地所	106,100	1,663.50	176,497,350	
平和不動産	2,800	3,660.00	10,248,000	
東京建物	16,000	1,412.00	22,592,000	
ダイビル	4,200	1,200.00	5,040,000	
京阪神ビルディング	2,800	1,598.00	4,474,400	
住友不動産	36,300	3,144.00	114,127,200	
テーオーシー	3,100	729.00	2,259,900	
東京楽天地	300	4,285.00	1,285,500	
スターツコーポレーション	1,900	2,721.00	5,169,900	
フジ住宅	1,900	633.00	1,202,700	
空港施設	1,400	488.00	683,200	

明和地所	900	609.00	548,100	
ゴールドクレスト	1,500	1,759.00	2,638,500	
エスリード	700	1,490.00	1,043,000	
日神グループホールディングス	2,400	411.00	986,400	
日本エスコン	3,000	725.00	2,175,000	
タカラレーベン	7,000	334.00	2,338,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	900	849.00	764,100	
イオンモール	8,100	1,733.00	14,037,300	
毎日コムネット	600	678.00	406,800	
ファースト住建	700	1,078.00	754,600	
カチタス	4,000	3,165.00	12,660,000	
トーセイ	2,300	1,036.00	2,382,800	
穴吹興産	300	1,644.00	493,200	
サンフロンティア不動産	2,000	883.00	1,766,000	
エフ・ジェー・ネクスト	1,600	1,016.00	1,625,600	
インテリックス	500	568.00	284,000	
ランドビジネス	600	331.00	198,600	
サンネクスタグループ	600	945.00	567,000	
グランディハウス	1,200	408.00	489,600	
日本空港ビルデング	5,100	5,490.00	27,999,000	
明豊ファシリティワークス	800	633.00	506,400	
日本工営	1,000	2,702.00	2,702,000	
ＬＩＦＵＬＬ	5,500	410.00	2,255,000	
ミクシィ	3,000	2,504.00	7,512,000	
ジェイエイシーリクルートメント	1,000	1,871.00	1,871,000	
日本M&Aセンター	12,800	6,090.00	77,952,000	
メンバーズ	500	2,505.00	1,252,500	
中広	300	336.00	100,800	
ＵＴグループ	2,300	3,220.00	7,406,000	
アイティメディア	500	2,123.00	1,061,500	
タケエイ	1,800	1,303.00	2,345,400	
Ｅ・Ｊホールディングス	600	997.00	598,200	
ビーネックスグループ	2,000	1,189.00	2,378,000	
コシダカホールディングス	3,800	411.00	1,561,800	
アルトナー	400	881.00	352,400	
パソナグループ	1,700	1,931.00	3,282,700	
ＣＤＳ	400	1,382.00	552,800	
リンクアンドモチベーション	3,000	586.00	1,758,000	
ＧＣＡ	2,100	708.00	1,486,800	
エス・エム・エス	5,300	4,080.00	21,624,000	
サニーサイドアップグループ	600	630.00	378,000	
パーソルホールディングス	15,600	1,980.00	30,888,000	

リニカル	1,000	757.00	757,000	
クックパッド	5,100	305.00	1,555,500	
エスクリ	600	316.00	189,600	
アイ・ケイ・ケイ	900	616.00	554,400	
学情	600	1,274.00	764,400	
スタジオアリス	800	2,075.00	1,660,000	
シミックホールディングス	800	1,506.00	1,204,800	
エプコ	400	939.00	375,600	
ＮＪＳ	400	1,987.00	794,800	
綜合警備保障	6,200	4,990.00	30,938,000	
カカクコム	11,500	3,045.00	35,017,500	
アイロムグループ	600	1,775.00	1,065,000	
セントケア・ホールディング	1,200	941.00	1,129,200	
サイネックス	300	713.00	213,900	
ルネサンス	1,100	915.00	1,006,500	
ディップ	2,400	3,010.00	7,224,000	
デジタルホールディングス	1,100	1,875.00	2,062,500	
新日本科学	2,000	712.00	1,424,000	
ツクイホールディングス	3,800	581.00	2,207,800	
キャリアデザインセンター	400	910.00	364,000	
ベネフィット・ワン	5,700	2,936.00	16,735,200	
エムスリー	27,600	9,280.00	256,128,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,200	280.00	336,000	
ブラス	300	469.00	140,700	
アウトソーシング	9,000	1,357.00	12,213,000	
ウェルネット	1,900	472.00	896,800	
ワールドホールディングス	600	1,881.00	1,128,600	
ディー・エヌ・エー	6,600	2,022.00	13,345,200	
博報堂ＤＹホールディングス	21,700	1,565.00	33,960,500	
ぐるなび	2,800	529.00	1,481,200	
タカミヤ	2,000	527.00	1,054,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	848.00	1,102,400	
ファンコミュニケーションズ	4,400	408.00	1,795,200	
ライク	400	2,061.00	824,400	
ビジネス・ブレークスルー	700	447.00	312,900	
エスプール	4,100	1,019.00	4,177,900	
ＷＤＢホールディングス	700	2,716.00	1,901,200	
手間いらず	200	4,375.00	875,000	
ティア	1,000	412.00	412,000	
ＣＤＧ	200	1,502.00	300,400	
アドウェイズ	2,000	674.00	1,348,000	
バリューコマース	1,100	3,020.00	3,322,000	

インフォマート	15,800	915.00	14,457,000	
ＪＰホールディングス	4,700	281.00	1,320,700	
エコナックホールディングス	3,400	91.00	309,400	
ＥＰＳホールディングス	2,100	1,020.00	2,142,000	
レッグス	400	1,635.00	654,000	
プレステージ・インターナショナル	5,900	883.00	5,209,700	
アミューズ	900	2,534.00	2,280,600	
ドリームインキュベータ	500	1,298.00	649,000	
クイック	1,000	1,145.00	1,145,000	
ＴＡＣ	1,000	251.00	251,000	
ケネディクス	4,500	748.00	3,366,000	
電通グループ	17,600	3,370.00	59,312,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	570.00	456,000	
ぴあ	500	2,874.00	1,437,000	
イオンファンタジー	600	2,121.00	1,272,600	
シーティーエス	1,800	913.00	1,643,400	
ネクシィーズグループ	600	875.00	525,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	4,400	3,090.00	13,596,000	
アルプス技研	1,400	2,068.00	2,895,200	
日本空調サービス	1,600	715.00	1,144,000	
オリエンタルランド	16,600	16,290.00	270,414,000	
ダスキン	3,600	2,770.00	9,972,000	
明光ネットワークジャパン	2,100	580.00	1,218,000	
ファルコホールディングス	800	1,698.00	1,358,400	
秀英予備校	200	425.00	85,000	
ラウンドワン	5,400	887.00	4,789,800	
リゾートトラスト	7,200	1,480.00	10,656,000	
ビー・エム・エル	2,000	3,680.00	7,360,000	
ワタベウェディング	300	294.00	88,200	
りらいあコミュニケーションズ	2,400	1,465.00	3,516,000	
リソー教育	8,000	331.00	2,648,000	
早稲田アカデミー	600	972.00	583,200	
ユー・エス・エス	17,500	2,086.00	36,505,000	
東京個別指導学院	1,400	663.00	928,200	
サイバーエージェント	9,600	6,710.00	64,416,000	
楽天	72,900	1,013.00	73,847,700	
クリーク・アンド・リバー社	900	1,167.00	1,050,300	
モーニングスター	1,800	477.00	858,600	
テー・オー・ダブリュー	2,800	270.00	756,000	
山田コンサルティンググループ	1,000	953.00	953,000	
セントラルスポーツ	600	2,130.00	1,278,000	
フルキャストホールディングス	1,400	1,690.00	2,366,000	

エン・ジャパン	2,800	3,040.00	8,512,000	
リソルホールディングス	200	3,865.00	773,000	
テクノプロ・ホールディングス	3,100	8,420.00	26,102,000	
アトラ	500	311.00	155,500	
インターワークス	700	360.00	252,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	600	17,760.00	10,656,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	1,000	2,127.00	2,127,000	
ファーストロジック	300	754.00	226,200	
三機サービス	300	1,000.00	300,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	1,100	767.00	843,700	
デザインワン・ジャパン	700	211.00	147,700	
イー・ガーディアン	700	3,115.00	2,180,500	
リブセンス	1,100	239.00	262,900	
ジャパンマテリアル	4,800	1,486.00	7,132,800	
ベクトル	2,000	1,251.00	2,502,000	
ウチヤマホールディングス	700	340.00	238,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	1,328.00	1,593,600	
キャリアリンク	500	2,796.00	1,398,000	
ＩＢＪ	1,300	882.00	1,146,600	
アサンテ	600	1,580.00	948,000	
Ｎ・フィールド	1,100	854.00	939,400	
バリューＨＲ	700	1,768.00	1,237,600	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	1,300	5,230.00	6,799,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	2,122.00	1,273,200	
ＥＲＩホールディングス	400	613.00	245,200	
アビスト	200	2,942.00	588,400	
シグマクシス	900	1,651.00	1,485,900	
ウィルグループ	1,200	1,010.00	1,212,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,400	284.00	681,600	
メドピア	700	7,370.00	5,159,000	
レアジョブ	200	2,329.00	465,800	
リクルートホールディングス	112,000	4,655.00	521,360,000	
エラン	2,200	1,483.00	3,262,600	
土木管理総合試験所	900	345.00	310,500	
ネットマーケティング	800	673.00	538,400	
日本郵政	118,100	838.30	99,003,230	
ベルシステム２４ホールディングス	2,600	1,891.00	4,916,600	
鎌倉新書	1,600	885.00	1,416,000	
ＳＭＮ	300	740.00	222,000	
一蔵	300	346.00	103,800	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	600	3,700.00	2,220,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	300	885.00	265,500	

エアトリ	900	1,417.00	1,275,300	
アトラエ	500	2,804.00	1,402,000	
ストライク	600	4,740.00	2,844,000	
ソラスト	3,900	1,591.00	6,204,900	
セラク	500	1,769.00	884,500	
インソース	1,300	2,390.00	3,107,000	
ベイカレント・コンサルティング	1,000	16,100.00	16,100,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	400	2,150.00	860,000	
アイモバイル	600	1,240.00	744,000	
キャリアインデックス	700	553.00	387,100	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	700	1,138.00	796,600	
船場	400	865.00	346,000	
グレイステクノロジー	800	6,120.00	4,896,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,500	2,495.00	11,227,500	
フルテック	300	1,407.00	422,100	
グリーンズ	800	453.00	362,400	
ツナググループ・ホールディングス	400	316.00	126,400	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	500	555.00	277,500	
ソウルドアウト	400	1,546.00	618,400	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	300	557.00	167,100	
エル・ティー・エス	100	3,910.00	391,000	
ミダック	400	3,245.00	1,298,000	
日総工産	1,300	801.00	1,041,300	
キュービーネットホールディングス	800	1,399.00	1,119,200	
ＲＰＡホールディングス	1,900	639.00	1,214,100	
スプリックス	500	794.00	397,000	
マネジメントソリューションズ	800	1,798.00	1,438,400	
プロレド・パートナーズ	200	3,500.00	700,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	200	689.00	137,800	
テノ．ホールディングス	100	1,211.00	121,100	
フロンティア・マネジメント	300	2,199.00	659,700	
ピアラ	100	1,946.00	194,600	
コプロ・ホールディングス	100	3,565.00	356,500	
ギークス	200	1,593.00	318,600	
カーブスホールディングス	4,400	861.00	3,788,400	
フォーラムエンジニアリング	800	907.00	725,600	
ダイレクトマーケティングミックス	700	3,230.00	2,261,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	900	643.00	578,700	
リログループ	8,600	2,605.00	22,403,000	
東祥	1,000	1,524.00	1,524,000	
エイチ・アイ・エス	2,300	1,754.00	4,034,200	
ラックランド	500	2,371.00	1,185,500	

共立メンテナンス	2,600	3,425.00	8,905,000	
イチネンホールディングス	1,600	1,220.00	1,952,000	
建設技術研究所	1,000	2,484.00	2,484,000	
スペース	1,100	785.00	863,500	
長大	600	1,562.00	937,200	
燦ホールディングス	600	1,150.00	690,000	
スバル興業	100	8,220.00	822,000	
東京テアトル	700	1,273.00	891,100	
タナベ経営	300	1,380.00	414,000	
ナガワ	500	10,900.00	5,450,000	
よみうりランド	100	6,040.00	604,000	
東京都競馬	1,000	4,395.00	4,395,000	
常磐興産	800	1,341.00	1,072,800	
カナモト	2,700	2,255.00	6,088,500	
東京ドーム	6,400	1,297.00	8,300,800	
西尾レントオール	1,400	2,197.00	3,075,800	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	12,900	24.00	309,600	
トランス・コスモス	1,500	2,763.00	4,144,500	
乃村工藝社	6,700	767.00	5,138,900	
藤田観光	800	1,475.00	1,180,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	900	905.00	814,500	
日本管財	1,700	2,030.00	3,451,000	
トーカイ	1,500	2,013.00	3,019,500	
白洋舎	200	2,396.00	479,200	
セコム	15,400	9,423.00	145,114,200	
セントラル警備保障	800	3,255.00	2,604,000	
丹青社	3,000	755.00	2,265,000	
メイテック	1,900	5,470.00	10,393,000	
応用地質	1,800	1,281.00	2,305,800	
船井総研ホールディングス	3,200	2,393.00	7,657,600	
進学会ホールディングス	600	485.00	291,000	
オオバ	1,100	731.00	804,100	
いであ	400	1,714.00	685,600	
学究社	500	1,349.00	674,500	
ベネッセホールディングス	5,700	2,024.00	11,536,800	
イオンディライト	1,900	2,749.00	5,223,100	
ナック	700	927.00	648,900	
ダイセキ	2,600	3,365.00	8,749,000	
ステップ	500	1,559.00	779,500	
合　　計	17,012,100		40,992,862,260	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 2月26日現在です。

【財形株投（一般財形３０）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	117,437,425円
Ⅱ　負債総額	450,118円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	116,987,307円
Ⅳ　発行済口数	113,084,083口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0345円

【財形株投（一般財形５０）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	196,292,076円
Ⅱ　負債総額	221,310円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	196,070,766円
Ⅳ　発行済口数	170,251,557口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1517円

【財形株投（年金・住宅財形３０）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	223,588,498円
Ⅱ　負債総額	250,251円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	223,338,247円
Ⅳ　発行済口数	215,605,649口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0359円

（参考）

財形公社債マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	333,048,181円
Ⅱ　負債総額	333,083円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	332,715,098円
Ⅳ　発行済口数	260,947,151口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.275円

インデックス　マザーファンド　ＴＯＰＩＸ

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	41,631,912,790円
Ⅱ　負債総額	109,961,928円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	41,521,950,862円
Ⅳ　発行済口数	17,226,734,172口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4103円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換
該当事項はありません。
（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。
（３）譲渡制限の内容
① 譲渡制限はありません。
② 受益権の譲渡
・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
③ 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
（４）受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
（５）受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解

約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第二部【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2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2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2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2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			840	250,370
	株式投資信託		777	214,171
		単位型	270	10,692
		追加型	507	203,479
	公社債投資信託		63	36,199
		単位型	50	2,029
		追加型	13	34,170

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				

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

（単位：百万円）

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

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

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第60期（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

第61期（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

[注記事項]

（重要な会計方針）

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

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

（未適用の会計基準等）

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

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

（２）　適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

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

（貸借対照表関係）

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

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

（損益計算書関係）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第60期（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

３　新株予約権等に関する事項

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

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

(注) 1　2017年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
2　当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
3　2009年度ストックオプション(1)1,171,500株、2009年度ストックオプション(2)75,900株、2011年度ストックオプション(1)2,055,900株及び2016年度ストックオプション(1)1,206,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)2,412,000株、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第61期（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

1　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2　自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3　新株予約権等に関する事項

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

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

4　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

（金融商品関係）

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

１ 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

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

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬 、(3) 未収収益並びに（4）関係会社短期貸付金
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券
投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

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

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

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

4　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

２ 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

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

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

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬 、(3) 未収収益並びに（4）関係会社短期貸付金
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券
投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

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

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

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

4　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

（有価証券関係）
第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)
1　子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

(注)　子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、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	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		2,251	－	△42
	豪ドル		63	－	△0
	シンガポールドル		975	－	△18

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

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

第61期(2020年３月31日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

(注) 1　上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
2　時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

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

２　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

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

（持分法損益等）

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

（退職給付関係）

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

１　採用している退職給付制度の概要

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

２　確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,411
未積立退職給付債務	1,411
未認識数理計算上の差異	△6
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

退職給付引当金	1,405
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	148

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.1%

３　確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、230百万円でありました。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

１　採用している退職給付制度の概要

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

2　確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	（百万円）
退職給付債務の期首残高	1,411
勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の発生額	△31
退職給付の支払額	△164
退職給付債務の期末残高	1,363

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

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

退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%

3　確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

1　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

権利未行使残	―	―

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

(注)　株式数に換算して記載しております。

②　単価情報

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

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

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

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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

１　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション（新株予約権）の数

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

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月７日	2016年７月15日
権利確定前(株)		
期首	2,055,900	3,618,000
付与	0	0
失効	871,200	2,272,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,184,700	1,346,000
権利確定後(株)		
期首	―	―
権利確定	―	―
権利行使	―	―
失効	―	―

権利未行使残	―	―

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年４月27日	2018年４月27日
権利確定前(株)		
期首	3,811,000	4,356,000
付与	0	0
失効	1,417,000	1,417,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,394,000	2,939,000
権利確定後(株)		
期首	―	―
権利確定	―	―
権利行使	―	―
失効	―	―
権利未行使残	―	―

(注)　株式数に換算して記載しております。

②　単価情報

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

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

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

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

(税効果会計関係)

第60期 (2019年３月31日)	第61期 (2020年３月31日)

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

2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.8%
受取配当金等永久に益金に参入されない項目	△4.4%
その他	0.6%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%

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

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

（関連当事者情報）

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

１　関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
							資金の貸付の返済（シンガポールドル貸建）(注1)	554 (SGD 6,800 千) (注2)	―	―

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

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

1　融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

2　取引金額554百万円（SGD6,800千）の内訳は、貸付の返済554百万円（SGD6,800千）であります。

3　融資枠5,000百万円（若しくは5,000百万円相当額の外国通貨）、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

4　取引金額1,807百万円（USD16,500千）の内訳は、貸付1,807百万円（USD16,500千）であります。

5　Nikko AM Americas Holding Co., Inc.及びNikko Asset Management Americas, Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

6　借入枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

7　取引金額5,364百万円（USD50,000千）及び5,526百万円（USD50,000千）の内訳は、借入5,364百万円（USD50,000千）及び借入の返済5,526百万円（USD50,000千）であります。

2　親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

三井住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

１　関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

1　資枠5,000百万円（若しくは5,000百万円相当額の外国通貨）、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

2　Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

２　親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

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

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

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

関連情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

１　製品及びサービスごとの情報

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

２　地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

１　製品及びサービスごとの情報

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

２　地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

該当事項はありません。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

該当事項はありません。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第60期(自　2018年４月１日　至　2019年３月31日)

該当事項はありません。

第61期(自　2019年４月１日　至　2020年３月31日)

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

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

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

２　１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

３　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

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						
	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	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	(1) 有価証券 ①子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②その他有価証券 時価のあるもの 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 (2) デリバティブ 時価法
２　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以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。 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウエア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。
３　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき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。 ①　退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当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。 ②　数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。
４　ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。

５　その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(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おります。 (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おります。

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第62期中間会計期間（自　2020年４月１日　至　2020年９月30日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

（注）自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

３　新株予約権等に関する事項

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

（注）１　当中間会計期間の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

４　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(リース取引関係)

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

（金融商品関係）

第62期中間会計期間(2020年９月30日)

金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

(※1)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

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

券及び投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

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

（有価証券関係）

第62期中間会計期間(2020年９月30日)

１　子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

２　その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

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

（デリバティブ取引関係）

第62期中間会計期間(2020年９月30日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

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

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

２ 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

（2）通貨関連

種類		契約額等 （百万円）	契約額等の うち１年超 （百万円）	時価 （百万円）	評価損益 （百万円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,766	－	21	21
合計		1,766	－	21	21

（注）１ 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
２ 時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

２ ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

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

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

（持分法損益等）

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

（ストックオプション等関係）

第62期中間会計期間(自　2020年４月１日　至　2020年９月30日)
該当事項はありません。

（セグメント情報等）
［セグメント情報］
第62期中間会計期間(自　2020年４月１日　至　2020年９月30日)
当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

［関連情報］
第62期中間会計期間(自　2020年４月１日　至　2020年９月30日)
１ 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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おりません。

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
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（1）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
（2）販売会社
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

3【資本関係】

（1）受託会社
該当事項はありません。
（2）販売会社
該当事項はありません。

第3【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 5月 1日	有価証券届出書
2020年 5月 1日	有価証券報告書
2020年11月 2日	有価証券届出書の訂正届出書
2020年11月 2日	半期報告書

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2020年６月８日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　貞 廣 篤 典

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　竹 内 知 明

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2019年４月１日から2020年３月31日までの第61期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2020年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

以　上

(注)1.上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年３月10日

日興アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　佐々木　貴司
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　榊原　康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（一般財形30）の2020年２月４日から2021年２月１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（一般財形30）の2021年２月１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年３月10日

日興アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwCあらた有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　佐々木　貴司
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　榊原　康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（一般財形50）の2020年２月４日から2021年２月１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（一般財形50）の2021年２月１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年３月10日

日興アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwCあらた有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　佐々木　貴司
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　榊原　康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（年金・住宅財形30）の2020年２月４日から2021年２月１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、財形株投（年金・住宅財形30）の2021年２月１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2020年12月４日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　貞 廣 篤 典

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　竹 内 知 明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2020年４月１日から2021年３月31日までの第62期事業年度の中間会計期間（2020年４月１日から2020年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、

継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。