

【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11月15日 提出

【計算期間】 第2期（自 2021年2月16日 至 2021年8月15日）

【ファンド名】 NZAM 上場投信 S & P / J P Xカーボン・エフィシエ
ント指数

【発行者名】 農林中金全共連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 牛窪 克彦

【本店の所在の場所】 東京都千代田区平河町二丁目7番9号

【事務連絡者氏名】 田原 輝行

【連絡場所】 東京都千代田区平河町二丁目7番9号

【電話番号】 03-5210-8500

【縦覧に供する場所】 名称 株式会社東京証券取引所
所在地 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、投資信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を「S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数」（以下「対象株価指数」といいます。）の変動率に一致させることを目的とします。

一般社団法人 投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類は以下の通りです。

商品分類：追加型投信 / 国内 / 株式 / E T F / インデックス型

属性区分：株式（一般） / 年2回 / 日本 / その他（S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数）

商品分類および属性区分 一覧表

（当ファンドが該当する部分を網掛け表示しています。定義などの詳細については、一般社団法人 投資信託協会のホームページ <<https://www.toushin.or.jp/>> をご覧ください。）

商品分類表

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

商品分類定義

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われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書又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う。
株式	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
E T F	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。
インデックス型	目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

属性区分表

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

属性区分定義

株式（一般）	大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
年2回	目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書又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う。
S&P/JPX カーボン・エフィ シエント指数	目論見書又は投資信託約款において、S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

< 信託金の限度額 >

委託者は、受託者と合意のうえ、金10兆円に相当する有価証券および金銭を限度として追加信託することができます。

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。（信託の目的、金額および信託金の限度額（約款第3条））

<ファンドの特色>

- S & P / J P Xカーボン・エフィシエント指数の動きに連動する投資成果をめざし、S & P / J P Xカーボン・エフィシエント指数に採用されている銘柄（採用予定を含みま

す。）の株式を主要投資対象とします。

上記のファンドの目的に沿うよう、投資信託財産の構成を調整するための指図を行うこと（有価証券指数等先物取引等を利用することを含みます。）があります。

S & P / J P Xカーボン・エフィシエント指数

- S & P / J P Xカーボン・エフィシエント指数は、東証株価指数（TOPIX）をユニバースとして、同じ産業グループ内で環境情報の開示を十分に行っている企業や炭素効率性の高い（売上高当たりの炭素排出量が少ない）企業のウェイトを引き上げるなどの調整を行うことで、構成銘柄のウェイトを決定する指数です。市場全体の環境に対する取り組み、情報開示を促すことを目指しています。
- S & P / J P Xカーボン・エフィシエント指数は、基準日を2009年3月20日、基準値を100ポイント（基準時の対象時価総額）として、S & P ダウ・ジョーンズ・インデックスおよび日本取引所グループが算出・公表しております。

« S & P / J P Xカーボン・エフィシエント指数の著作権等について »

「S & P / J P Xカーボン・エフィシエント指数」（「当指数」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJII」）および株式会社日本取引所グループの商品であり、これを利用するライセンスが農林中金全共連アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。また、JPXは株式会社日本取引所グループ、TOPIXは東京証券取引所の商標です。これらの商標を利用するライセンスがSPDJIIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが農林中金全共連アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJII、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社、または株式会社日本取引所グループによってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

当ファンドは、以下の点で、通常の投資信託とは異なる仕組みを有しています。

1. 受益権が上場されます

受益権を東京証券取引所に上場しており、取引時間中であればいつでも株式と同様に売買することができます。

- ・売買単位は、10口です。
- ・売買手数料は、販売会社が個別に定めます。
- ・取引方法は、原則として株式と同様です。

※詳しくは、販売会社へお問い合わせください。

2. 取得申込みは有価証券により行われます

受益権の取得申込者は、取得時の「ユニット」を単位として、有価証券による取得申込みを行うことができます。

※「ユニット」とは、受益権取得時に適用される現物株式のポートフォリオで、対象株価指数に連動すると委託会社が想定するもので、委託会社が指定します。

原則として、所定の方法に定められている場合を除き、金銭によって受益権の取得申込みを行うことはできません。

3. 受益権と引き換えに有価証券を交付（交換）します

一定口数以上の受益権を保有する受益者は、それに相当する投資信託財産中の有価証券との交換を請求することができます。

通常の投資信託における換金手続きの解約申込みにより、受益権を換金することはできません。

主な投資制限

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

分配方針

毎計算期間末（毎年2月、8月の各15日）に、経費等控除後の配当等収益（配当金、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）の全額を分配することを原則とします。

ただし、分配金が零となる場合もあります。

※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。

- 市況動向や資産規模などによっては、上記の運用が行えないことがあります。

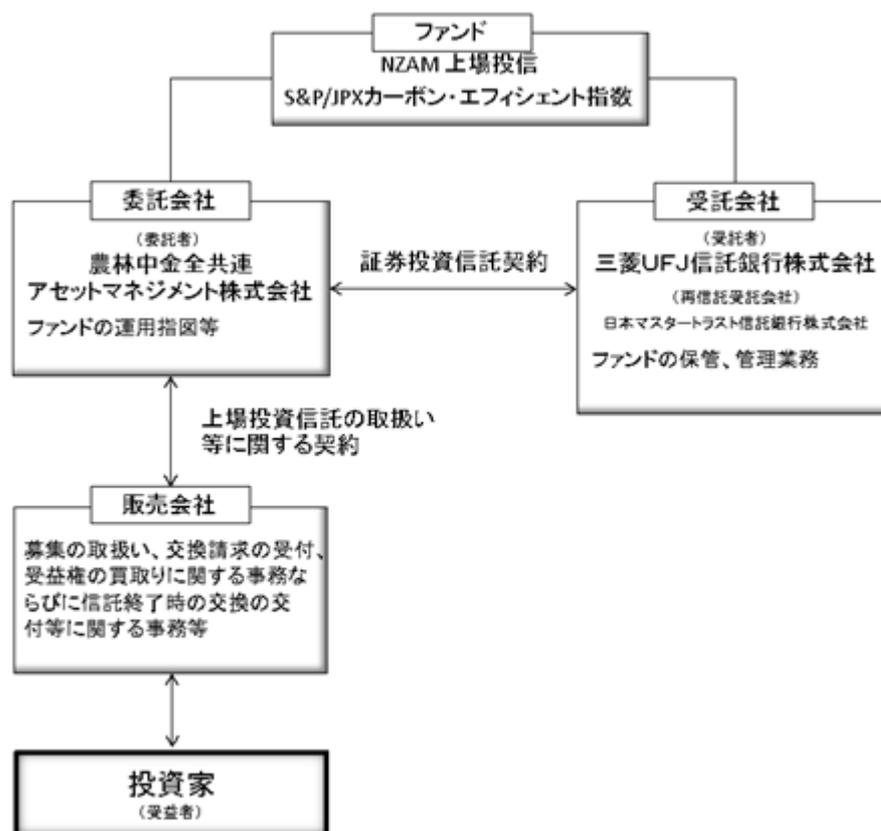
（2）【ファンドの沿革】

2020年8月24日 有価証券届出書の提出

2020年9月10日 信託契約締結日、ファンドの設定、運用開始日

2020年9月11日 受益権を東京証券取引所に上場

(3) 【ファンドの仕組み】



委託者（委託会社）の概況（2021年9月8日現在）

資本金の額

1,466百万円

沿革

1993年9月28日 農中投信株式会社設立

10月8日 証券投資信託委託業の免許取得

10月13日 営業開始

1996年8月20日 投資顧問業務の登録

9月30日 投資一任業務認可取得

10月1日 エヌケイユー投資顧問株式会社と合併し、同日付で「農中投信投資顧問株式会社」へ商号変更

2000年10月1日 「農林中金全共連アセットマネジメント株式会社」へ商号変更

2007年9月30日 金融商品取引業の登録

大株主の状況

株主名	住所	持株数 (株)	持株比率 (%)
農林中央金庫	東京都千代田区有楽町1丁目13番2号	19,551	66.66
全国共済農業協同組合連合会	東京都千代田区平河町2丁目7番9号	9,779	33.34

(注) 農林中央金庫が保有する株式は普通株式19,550株および議決権を有しないA種優先株式1株であり、全国共済農業協同組合連合会が保有する株式は普通株式9,778株および議決権を有しないB種優先株式1株です。

なお、議決権保有比率の状況は次のとおりです。

農林中央金庫 66.66%

全国共済農業協同組合連合会 33.34%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

運用の基本方針（約款第19条）

委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、次に掲げる運用の基本方針に従って、その指図を行います。

- 1．この信託は、投資信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象株価指数の変動率に一致させることを目的として、対象株価指数に採用されている銘柄（採用予定を含みます。）の株式を組入れることを原則とします。
- 2．上記1．の基本方針に沿うよう、投資信託財産の構成を調整するための指図を行うこと（有価証券指数等先物取引等を利用することを含みます。）があります。
- 3．市況動向や資産規模などによっては、上記の運用が行えないことがあります。
- 4．投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式の貸付けを行うことができるものとします。

「約款第 条」とは、信託約款の条項等と対応しております。（以下同じ。）

（2）【投資対象】

a．投資の対象とする資産の種類（約款第17条）

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．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23条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

- 2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

b．運用の指図範囲（約款第18条）

委託者は、投資信託財産を、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。）に投資することを指図します。

- 1．株式

- 2．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。）

委託者は、投資信託財産を、上記 に掲げる有価証券のほか、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を指図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。）

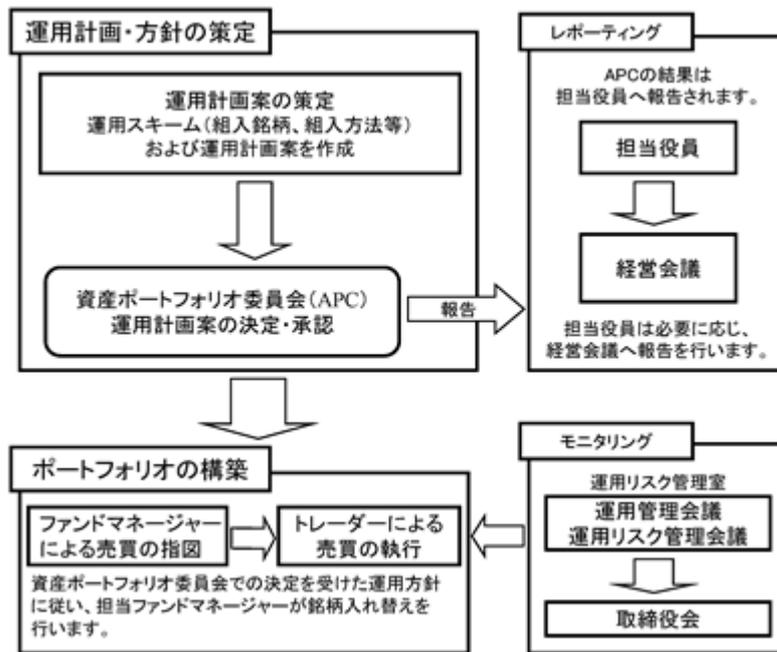
- 3．コール・ローン

- 4．手形割引市場において売買される手形

（3）【運用体制】

1．運用体制

当ファンドは、以下の投資プロセスに基づいた組織的運用を行います。



< 資産ポートフォリオ委員会（APC） >

原則月1回以上開催し、ファンドの運用計画を決定（承認）します。

2. ファンドの運用に携わる人員等

部署	人員
運用部	80名程度 (うち 投資判断に携わる者 60名程度)
トレーディング部	10名程度
運用リスク管理室	5名程度

3. ファンドの関係者に対する管理体制等

委託者は、ファンドの関係法人である受託会社について、その財務状況、管理体制、法令遵守体制等について定期的にモニタリングを行うとともに、必要に応じ適宜ヒアリング等を実施します。

運用体制は、本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

a. 収益分配方針（約款第20条）

毎計算期末（原則として2月、8月の各15日。）に、経費等控除後の配当等収益（配当金、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）の全額を分配することを原則とします。ただし、分配金が零となる場合もあります。

売買益（評価益を含みます。）からの分配は行いません。

収益の分配にあてなかった利益については、約款第19条の規定に基づいて運用を行います。

b. 収益の分配（約款第35条）

投資信託財産から生じる配当等収益と前期から繰り越した分配準備積立金は、約款第33条各号の諸費用、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、前期から繰り越した負数の分配準備積立金があるときはその全額を補てんした後、その残額を受益者に分配することができます。ただし、収益分配金額の調整のためその一部または全部を投資信託財産内に留保したときは分配準備積立金として積み立て、次期以降の分配にあてることができ

ます。なお、諸費用、信託報酬等および負数の分配準備積立金を控除しきれないときは、その差額を負数の分配準備積立金として次期に繰り越します。

毎計算期末に投資信託財産から生じた次の1.に掲げる利益の合計額は、次の2.に掲げる損失を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を補てんした後、次期に繰り越します。

1. 有価証券売買益(評価益を含みます。)、先物取引等取引益(評価益を含みます。)、追加信託差益金、交換(解約)差益金
2. 有価証券売買損(評価損を含みます。)、先物取引等取引損(評価損を含みます。)、追加信託差損金、交換(解約)差損金

(5)【投資制限】

a. 株式への投資制限(約款第19条)

株式への投資割合には、制限を設けません。

b. 投資する株式等の範囲(約款第22条)

委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。)に上場されている株式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等については、この限りではありません。

第1項の規定にかかわらず、上場予定の株式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、委託者が投資することを指図することができます。

c. 外貨建資産への投資制限(約款第19条)

外貨建資産への投資は、行いません。

d. 先物取引等の運用指図(約款第23条)

委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行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。

e. デリバティブ取引等に係る投資制限(約款第19条)

デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

f. 株式の貸付けの指図および範囲(約款第24条)

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式を貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えない範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

上記に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

委託者は、株式の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

g. 株式売却等の指図(約款第27条)

委託者は、投資信託財産に属する株式の売却等の指図ができます。

h. 再投資の指図(約款第28条)

委託者は、前条(上記g.)の規定による売却代金、株式の清算分配金、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

i. 信用リスク集中回避のための投資制限(約款第19条)

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等エクスポージャーの投資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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

j. デリバティブ取引に係る制限(金融商品取引法第42条の2第7号、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)

委託者は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ金融商品取引業者等が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券若しくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含む。)を行い、又は継続することを内容とした運用を行わないものとなっております。

k. 同一の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第9条及び同法施行規則第20条)

委託者は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法(平成17年法律第86号)第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)の総数が、当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託者に指図しないこととなっております。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

当ファンドの取得申込者には、慎重に投資判断を行うために、当ファンドの投資目的、リスクおよび留意事項を認識することが求められます。当ファンドは、株式など値動きのある証券を投資対象としているため、基準価額は変動します。したがって、**受益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、すべて受益者の皆様に帰属します。また、投資信託は、預貯金と異なります。**

当ファンドが有する主なリスクは以下のとおりです。

株価変動リスク

一般に、株式は国内外の景気、政治、経済、社会情勢等の影響を受け、また、個別企業の業績や株式市場全体の動向を反映して価格が大きく変動します。

ファンドに組入れている株式の価格が下落した場合には、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合は、その企業の株式の価格が大きく下落しあるいは無価値となるため、ファンドに重大な損失が生じることがあります。

乖離リスク

当ファンドは、対象株価指数との連動性をより高めるよう運用を行いますが、主として次の要因により対象株価指数の動きと乖離が生じます。

- イ. 対象株価指数の構成銘柄異動、その他一部の交換の場合等によってポートフォリオの調整が行われる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、売買手数料などの取引費用を負担すること
- ロ. 追加設定の一部が金銭にて行われた場合、および組入銘柄の配当金や権利処理等によって信託財産に現金が発生すること
- ハ. 対象銘柄の売買価格と評価価格に価格差が生じる場合があること
- ニ. 個別銘柄の組入比率を同指数構成銘柄の時価総額構成比率と全くの同一の比率とすることができないこと
- ホ. 先物取引を利用した場合、先物価格と対象株価指数との間に価格差があること
- ヘ. 信託報酬等のコスト負担があること

対象株価指数と基準価額の乖離要因は上記に限定されるものではありません。

流動性リスク

市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合、有価証券等を売買する際に市場実勢から期待される価格で売買できず、不測の損失を被るリスクがあります。

有価証券の貸し付けにおけるリスク

有価証券の貸付等において、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になるリスクがあります。この場合、貸し付けた有価証券が返還されず、不測の損失を被る可能性があります。

（２）その他の留意事項

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。

ファンドが組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。

ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

（３）投資リスクに対する管理体制

フロントにおけるリスク管理体制

フロント部門（運用部）では、担当ファンドマネージャーが、リスクモデルによるトラッキング・エラー（市場全体の動きとファンドが乖離するリスク）の水準を管理しています。また、日々のトラッキング・エラー管理（ポジションリスク管理およびパフォーマンス管理等）を行い、資産ポートフォリオ委員会で決められた方針の範囲内となるよう、管理を行うとともに、直属管理者が状況をモニタリングしています。

ミドルにおけるリスク管理体制

ミドル部門（運用リスク管理室）は、ファンド運用状況の日々のモニタリングや定期的なフィードバックを行いフロント部門を牽制することにより、受益者の負託に応えうる適正な運用プロセスを構築しています。

具体的には、不正な取引から顧客の利益を保護し、ファンド運用の適正性を確保する観点から、ファンドが法令等のルールや組織的に決定された運用計画に従って運用されるよう、日常的な管理を行うほか、運用管理会議を開催してこれらの遵守状況を検証しています。

また、信託財産の運用者として適切なファンドの運用責任を果たす観点から、市場リスクをはじめとする各種運用リスクとパフォーマンスの計測・管理を行うほか、運用リスク管理会議を開催してこれらの管理状況を検証しています。

[運用管理会議]

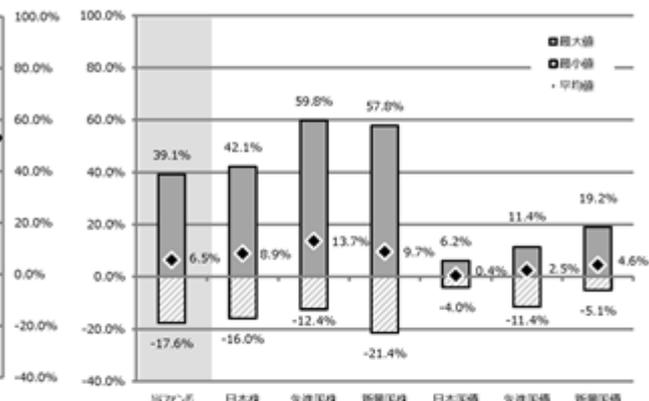
原則として月1回開催し、ファンドの法令等（法令、協会ルール、信託約款等）や運用計画の遵守状況について報告・審議を行います。その結果は取締役会に報告されます。

[運用リスク管理会議]

原則として月1回開催し、運用リスクや運用パフォーマンスの状況について報告・審議を行います。その結果は取締役会に報告されます。

投資リスクに対する管理体制は、本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移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

*2016年9月～2021年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率及び分配金再投資基準価額の推移について表示したものです。

*当ファンドは、設定から1年が経過していないため、当ファンドの年間騰落率のデータの代わりにベンチマークの年間騰落率のデータを用いて算出しています。

*分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

*2016年9月～2021年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び代表的な資産クラスについて表示し、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。

*すべ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。

*当ファンドは、設定から1年が経過していないため、当ファンドの年間騰落率のデータの代わりにベンチマークの年間騰落率のデータを用いて平均値、最大値、最小値を算出しています。

*各資産クラスの指数

日本株・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）

先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス（税引前配当込み、円ベース）

新興国株・・・MSCI Emerging Markets・インデックス（円換算ベース）

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・・・FTSE新興国市場国債インデックス（円ベース）

（注）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。

- 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（旧東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）の商標又は標章に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、本件商品の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- 「NOMURA-BPI国債」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、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」、「MSCI Emerging Markets・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
- 「FTSE世界国債インデックス（除く日本）」、「FTSE新興国市場国債インデックス」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。同指数は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。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社は、当該販売会社が個別に定める申込手数料ならびに当該申込手数料に係る消費税等に相当する金額を取得申込者から徴収することができるものとします。

詳しくは、委託者（下記参照）または販売会社にお問い合わせください。

農林中金全共連アセットマネジメント株式会社のお問い合わせ窓口
 <フリーダイヤル> 0120-439-244（営業日の午前9時から午後5時まで）
 <ホームページアドレス> <https://www.ja-asset.co.jp/>

申込手数料は、商品および投資環境の説明や情報提供、ならびに事務手続き等に係る費用の対価として、販売会社に支払われます。

(2)【換金（解約）手数料】

交換手数料

販売会社は、受益権の交換または買取りに際して、当該販売会社が個別に定める手数料ならびに当該手数料に係る消費税等に相当する金額を受益者から徴収することができるものとします。

詳しくは、委託者（下記参照）または販売会社にお問い合わせください。

農林中金全共連アセットマネジメント株式会社のお問い合わせ窓口
 <フリーダイヤル> 0120-439-244（営業日の午前9時から午後5時まで）
 <ホームページアドレス> <https://www.ja-asset.co.jp/>

交換手数料は、ファンドの交換等に関する事務手続き等に係る費用の対価として、販売会社に支払われます。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬等の額および支弁の方法

委託者および受託者の信託報酬（消費税等に相当する金額を含みます。）の総額は、計算期間を通じて毎日、次の1.の額に2.の額を加算して得た額とします。

1. 投資信託財産の純資産総額に年率0.132%（税抜0.12%）以内の率を乗じて得た額とします。

なお、委託者と受託者の配分については下記のとおり（税抜）とします。

（年率）

委託者	受託者	合計
0.092%	0.028%	0.12%

2. 投資信託財産に属する株式の貸付に係る品貸料（貸付株式から発生する配当金相当額等を含まないものとします。）に55%（税抜50%）以内の率を乗じて得た額。

ただし、株式の貸付けにあたって担保として現金を受け入れた場合には、当該品貸料に、当該現金の運用により生じたとみなし得る収益を加算し、貸付けの相手方に支払う当該現金に対する利息額を控除して得た額（当該額が負数のときは零とします。）に55%（税抜50%）以内の率を乗じて得た額とします。

なお、委託者と受託者の配分は4：1とします。

信託報酬の委託者への配分は、委託した資金の運用への対価です。

信託報酬の受託者への配分は、運用財産の管理、委託者からの指図の実行への対価です。

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとします。

（４）【その他の手数料等】

投資信託財産の組入有価証券を売買する際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額および先物取引・オプション取引等に要する費用は、投資信託財産中から支弁します。

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者の立て替えた立替金の利息および投資信託財産に係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、投資信託財産中より支弁します。なお、受益権の上場に係る費用¹および対象株価指数の商標（これに類する商標を含みます。）の使用料²ならびにこれらに係る消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁することができます。

1 本書提出日現在、受益権の上場に係る費用は以下のとおりです。

- ・新規上場料および追加上場料：新規上場時の純資産総額に対して、および追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して、0.00825%（税抜0.0075%）。
- ・年間上場料：毎年末の純資産総額に対して、最大0.00825%（税抜0.0075%）。
- ・上記のほか、新規上場に際して、上場審査料がかかります。

2 本書提出日現在、商標使用料は投資信託財産の純資産総額に、年0.015%以内の率を乗じて得た額。（ただし年間最低額は150万円）

その他の手数料等については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

（１）から（４）の手数料等の合計額については、ファンドの保有期間等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】

課税上は特定株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

受益権の売却時

売却時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により税率20.315%（所得税15.315%、地方税5%）が適用されます。（源泉徴収ありの特定口座は、原則として確定申告不要です。）

収益分配金の受取時

収益分配金については、税率20.315%（所得税15.315%、地方税5%）が適用されます。（原則として確定申告不要です。）

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

受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、上記「受益権の売却時」と同様の取扱いとなります。

2013年1月1日から2037年12月31日までの間、所得税の税率には復興特別所得税（0.315%）が含まれます。

損益通算について

売却時および交換時の損失（譲渡損）については、確定申告により上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）ならびに特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等との損益通算が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、分配金の受取方法によっては非課税とならない場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、受益権の取得価額と売却価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されます。

収益分配金の受取時

収益分配金については、税率15.315%（所得税15.315%、地方税の源泉徴収はありません。）が適用されます。益金不算入制度の適用があります。なお、税額控除が適用されません。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、上記「受益権の売却時」と同様の取扱いとなります。

2013年1月1日から2037年12月31日までの間、所得税の税率には復興特別所得税（0.315%）が含まれません。

（注意）

税制が改正された場合等には、上記の内容（2021年8月31日現在）が変更となることがあります。詳しくは、販売会社、税務署等へお問い合わせください。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

2021年 8月31日現在の運用状況は、以下のとおりです。

表示単位未満の端数が生じる場合には、金額は各々切り捨て、比率は各々四捨五入により記載しております。したがって、表示の合計値が個別数値と一致しない場合もあります。

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

(1)【投資状況】

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	28,234,168,950	98.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		574,265,308	1.99
合計(純資産総額)		28,808,434,258	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	530,415,000	1.84

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	133,600	9,965.00	1,331,324,000	9,592.00	1,281,491,200	4.45
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	88,800	11,165.00	991,452,000	11,360.00	1,008,768,000	3.50
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	11,700	64,370.00	753,129,000	66,130.00	773,721,000	2.69
4	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	79,900	6,350.00	507,365,000	6,500.00	519,350,000	1.80
5	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	74,800	6,647.00	497,195,600	6,181.00	462,338,800	1.60
6	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	689,500	610.50	420,939,750	594.40	409,838,800	1.42
7	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	8,400	44,500.00	373,800,000	47,240.00	396,816,000	1.38
8	日本	株式	H O Y A	精密機器	20,200	17,350.00	350,470,000	17,780.00	359,156,000	1.25
9	日本	株式	ダイキン工業	機械	13,000	26,000.00	338,000,000	27,405.00	356,265,000	1.24
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	96,700	3,674.00	355,275,800	3,679.00	355,759,300	1.23
11	日本	株式	K D D I	情報・通信業	99,700	3,373.00	336,288,100	3,370.00	335,989,000	1.17
12	日本	株式	日本電産	電気機器	24,900	12,755.00	317,599,500	12,620.00	314,238,000	1.09
13	日本	株式	信越化学工業	化学	17,200	17,930.00	308,396,000	18,205.00	313,126,000	1.09
14	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	101,000	2,913.50	294,263,500	2,936.00	296,536,000	1.03
15	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	87,700	3,574.00	313,439,800	3,342.00	293,093,400	1.02
16	日本	株式	任天堂	その他製品	5,300	52,440.00	277,932,000	52,900.00	280,370,000	0.97
17	日本	株式	日立製作所	電気機器	45,900	6,310.00	289,629,000	6,085.00	279,301,500	0.97
18	日本	株式	第一三共	医薬品	103,100	2,296.50	236,769,150	2,614.50	269,554,950	0.94
19	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	70,700	3,873.00	273,821,100	3,801.00	268,730,700	0.93
20	日本	株式	ファナック	電気機器	10,600	24,450.00	259,170,000	23,990.00	254,294,000	0.88
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	27,800	9,064.00	251,979,200	9,119.00	253,508,200	0.88
22	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	12,800	15,745.00	201,536,000	16,660.00	213,248,000	0.74
23	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	41,900	4,928.00	206,483,200	4,815.00	201,748,500	0.70
24	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	60,600	3,410.00	206,646,000	3,311.00	200,646,600	0.70
25	日本	株式	デンソー	輸送用機器	25,900	7,820.00	202,538,000	7,710.00	199,689,000	0.69
26	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	106,200	1,788.50	189,938,700	1,857.00	197,213,400	0.68
27	日本	株式	資生堂	化学	27,000	7,609.00	205,443,000	7,293.00	196,911,000	0.68
28	日本	株式	三井物産	卸売業	80,000	2,633.50	210,680,000	2,429.00	194,320,000	0.67
29	日本	株式	花王	化学	29,000	6,765.00	196,185,000	6,646.00	192,734,000	0.67
30	日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	20,500	7,976.00	163,508,000	9,068.00	185,894,000	0.65

□.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.06
		鉱業	0.13
		建設業	2.68
		食料品	3.41
		繊維製品	0.43
		パルプ・紙	0.20
		化学	7.22
		医薬品	5.33
		石油・石炭製品	0.38
		ゴム製品	0.27
		ガラス・土石製品	0.65
		鉄鋼	0.57
		非鉄金属	0.70
		金属製品	0.37
		機械	5.43
		電気機器	18.71
		輸送用機器	8.18
		精密機器	2.98
		その他製品	2.07
		電気・ガス業	1.16
		陸運業	3.34
		海運業	0.25
		空運業	0.31
		倉庫・運輸関連業	0.16
		情報・通信業	8.29
		卸売業	4.32
		小売業	4.27
		銀行業	4.56
		証券、商品先物取引業	0.77
		保険業	1.97
その他金融業	1.05		
不動産業	1.76		
サービス業	6.05		
合計			98.01

【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	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (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	買建	27	日本円	528,390,000	530,415,000	1.84

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(円)		1口当たり純資産額(円)		東京証券取引所 取引価格(円)
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)	
第1計算期間末 (2021年 2月15日)	28,829,624,444	29,051,153,644	260.28	262.28	253
第2計算期間末 (2021年 8月15日)	28,740,588,478	29,028,576,438	259.47	262.07	262
2020年 9月末日	24,114,692,412		217.71		216
10月末日	23,436,369,896		211.59		209
11月末日	26,115,330,138		235.77		226
12月末日	26,892,823,511		242.79		255
2021年 1月末日	26,861,879,305		242.51		244
2月末日	27,521,355,380		248.47		251
3月末日	29,005,210,282		261.86		264
4月末日	28,162,322,356		254.25		257
5月末日	28,573,761,917		257.97		258
6月末日	28,880,014,601		260.73		259
7月末日	28,249,683,530		255.04		254
8月末日	28,808,434,258		260.09		252

(注)計算期間末が東京証券取引所の休業日にあたる場合、東京証券取引所取引価格は直前営業日の終値を表示していません。終値がない場合には、その直近値を表示しています。

【分配の推移】

期	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間末	2020年 9月10日～2021年 2月15日	2.00
第2計算期間末	2021年 2月16日～2021年 8月15日	2.60

【収益率の推移】

期	計算期間	収益率(%)
第1計算期間末	2020年 9月10日～2021年 2月15日	23.1
第2計算期間末	2021年 2月16日～2021年 8月15日	0.7

(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	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間末	2020年 9月10日 ~ 2021年 2月15日	110,764,600		110,764,600
第2計算期間末	2021年 2月16日 ~ 2021年 8月15日			110,764,600

(注) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注) 解約口数は交換口数を表示しております。

< 参考情報 >

交付目論見書の運用実績（2021年8月末現在）

2021年8月末現在

基準価額・純資産の推移



・分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資して算出。

分配の推移

決算期／年月日		分配金
1期	2021年2月15日	200円
2期	2021年8月15日	260円
設定来累計		460円

・分配金のデータは、100口当たり、税引前の金額です。

主要な資産の状況

《組入上位銘柄》

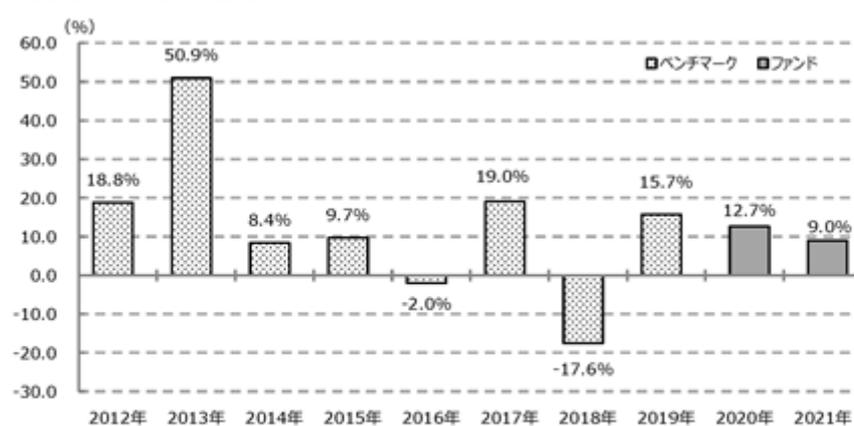
	銘柄名	業種	組入比率 (%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	4.4
2	ソニーグループ	電気機器	3.5
3	キーエンス	電気機器	2.7
4	リクルートホールディングス	サービス業	1.8
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.6
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.4
7	東京エレクトロン	電気機器	1.4
8	H O Y A	精密機器	1.2
9	ダイキン工業	機械	1.2
10	武田薬品工業	医薬品	1.2

・組入比率は、ファンドの純資産総額に対する比率です。

《組入上位業種》

	業種	組入比率 (%)
1	電気機器	18.7
2	情報・通信業	8.3
3	輸送用機器	8.2
4	化学	7.2
5	サービス業	6.1
6	機械	5.4
7	医薬品	5.3
8	銀行業	4.6
9	卸売業	4.3
10	小売業	4.3

年間収益率の推移



・ベンチマークは、「S & P / J P X カーボン・エフィシエント指数」です。

・ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資して算出。

・2019年以前は、ベンチマークの収益率を表示。

・2020年は設定日（9月10日）から年末までの騰落率、2021年は年初から運用実績作成基準日までの騰落率を表示。

※このグラフ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。

※ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

※最新の運用実績は、農林中金全共連アセットマネジメントのホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込期間

当ファンドは、原則として継続申込期間中の販売会社の営業日に受益権の募集が行われます。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

原則として、次に該当する場合は、受益権の取得申込の受付を停止します。ただし、委託者は、投資信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、投資信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される場合には、受益権の取得申込みの受け付けを行うことができます。

- 1．対象株価指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して2営業日以内
- 2．対象株価指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々前々営業日から起算して3営業日以内
- 3．対象株価指数の構成銘柄の株式移転および合併等に伴う新規銘柄の対象株価指数への採用日ならびに存続銘柄の指数用株式数変更日の前営業日
- 4．計算期間終了日の3営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内）
- 5．この信託が終了となる場合において、償還日の直前5営業日間
- 6．上記1．から上記5．のほか、委託者が、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めた場合

（2）取得申込

販売会社は、その取得申込者に対し、約款第7条第1項の規定により分割される受益権の取得の申込に応じることができるものとします。

受益権の取得申込者は、委託者が指定する一定口数の整数倍の受益権の取得を申し込むものとします。この場合、取得申込みは、対象株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式をもって行うものとします。ただし、当該株式の評価額が、一定口数の整数倍の受益権の評価額に満たない場合は、その差額に相当する金銭を支払うものとします。なお、一定口数は、当該銘柄によって構成される、委託者が対象株価指数に連動すると想定する1単位のポートフォリオに相当する口数とします。

販売会社は受益権の取得申込者に対し、その申込みの当日（正午を過ぎて申込みを受領した場合は翌営業日）（約款第3条第1項の規定に係る取得については信託契約締結日とします。）を取得申込受付日として当該取得申込を受け付けます。

取得申込者が対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社またはその子会社（会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社またはその子会社を以下「発行会社等」といいます。）である場合には、上記の規定にかかわらず、原則として取得申込みに係る当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額を当該株式に代えて金銭をもって取得することができるものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、上記の基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値（終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。）に第1項の取得申込に係る有価証券に含まれる当該発行会社の株数を乗じて得た金額とします。なお、委託者は、当該発行会社の株式を投資信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額を徴することができるものとします。

上記に該当する場合には、受益権の取得申込者は、販売会社を通じてその旨を委託者に通知するものとします。この通知が取得申込の際に行われなかった場合において、そのことにより投資信託財産その他に損害が生じた場合には、販売会社がすべての責を負うものとします。

上記の取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込に係る有価証券ならびに上記ただし書きおよび上記に規定する金銭の受渡または支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行う

ことができます。また、約款第6条ただし書きに掲げる業務方法書に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受付によって生じる有価証券の委託者への受渡または支払いの債務の負担を清算機関に申し込み、これを当該清算機関が負担する場合には、振替機関等における当該清算機関の名義の口座に口数の増加の記載または記録が行われ、取得申込者が自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座における口数の増加の記載または記録は、当該清算機関と販売会社(販売会社による清算機関への債務の負担の申込みにおいて、当該販売会社の委託を受けて金融商品取引法第2条第27項に定める有価証券等清算取次ぎが行われる場合には、当該有価証券等清算取次ぎを行う金融商品取引業者または登録金融機関を含みます。)との間で振替機関等を介して行われます。

上記 から上記 の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得の申込を中止すること、および既に受け付けた取得の申込の受付を取り消すことができます。

(3) 申込単位

1 ユニット 以上 1 ユニット単位

「ユニット」とは、対象株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の株式として委託者が指定するもの(対象株価指数に連動すると委託者が想定する1単位の現物株式のポートフォリオ)に相当する口数の受益権をいいます。

1ユニットの受益権の口数は、1口の整数倍とし、取得申込受付日に委託者が定めます。

取得申込日の3営業日前までに、申込ユニット数に応じた現物株式のポートフォリオを販売会社に提示します。

(4) 申込手数料

販売会社は、当該販売会社が個別に定める申込手数料ならびに当該申込手数料に係る消費税等に相当する金額を取得申込者から徴収することができるものとします。

詳しくは、委託者(下記参照)または販売会社にお問い合わせください

農林中金全共連アセットマネジメント株式会社のお問い合わせ窓口

<フリーダイヤル> 0120-439-244 (営業日の午前9時から午後5時まで)

<ホームページアドレス> <https://www.ja-asset.co.jp/>

(5) 申込価額

100口当たり取得申込受付日の基準価額 とします。

原則として、取得申込みが正午までに行われたものを当該取得申込受付日の受付分とします。

基準価額とは、投資信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除した額をいいます。なお、ファンドにおいては100口当たりの価額で表示されます。

基準価額は、原則として委託者の営業日において日々算出され、委託者(下記参照)または販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

農林中金全共連アセットマネジメント株式会社のお問い合わせ窓口

<フリーダイヤル> 0120-439-244 (営業日の午前9時から午後5時まで)

<ホームページアドレス> <https://www.ja-asset.co.jp/>

2 【換金(解約)手続等】

(1) 一部解約

受益者は、自己に帰属する受益権(約款第52条の規定に基づき、受託者が書面決議において重大な約款の変更等に反対した受益者からの請求により買い取った受益権を除きます。)につき、信託期間中において、当ファンドの一部解約の実行を請求することはできません。

(2) 交換申込

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、当該受益権と当該受益権の投資信託財産に対する持分に相当する有価証券との交換(以下「交換」といいます。)を請求することができます。

受益者が交換請求をするときは、販売会社に対し、委託者が定める一定口数の整数倍の振替受益権をもって行うものとします。

受益者は、2020年10月12日以降において、自己に帰属する受益権につき、その請求の当日(正午を過ぎて請求を受領した場合は翌営業日)を交換請求受付日として、交換を請求することができます。

委託者は、交換に際し、投資信託財産に属する有価証券の評価額をもって、それに相当する口数の受益権と交換するものとします。交換に際し、受益権の価額は、交換請求受付日の基準価額とします。この場合において、受益者が交換によって取得する個別銘柄の有価証券は、交換請求受付日における当該有価証券の評価額に基づいて計算された数とし、取引所売買単位(金融商品取引所が定める1売買単位をいいます。)の整数倍とします。

上記にかかわらず、委託者は、原則として、次に該当する場合は、受益権の交換請求の受付を停止します。ただし、委託者は、投資信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、投資信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される場合には、受益権の交換請求の受け付けを行うことがあります。

1. 対象株価指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日
2. 対象株価指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々前々営業日から起算して3営業日以内
3. 対象株価指数の構成銘柄の株式移転および合併等に伴う新規銘柄の対象株価指数への採用日ならびに存続銘柄の指数用株式数変更日の前営業日
4. 計算期間終了日の3営業日前から起算して4営業日以内(ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内)
5. この信託が終了となる場合において、償還日の直前5営業日間
6. 上記1.から上記5.のほか、委託者が、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めた場合

上記の販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消に係る手続を行うものとします。なお、約款第6条ただし書きに掲げる業務方法書に定めるところにより、当該販売会社が、振替受益権の委託者への受渡しの債務の負担を清算機関に申し込み、これを当該清算機関が負担する場合には、当該清算機関が振替受益権の抹消に係る手続を行います。当該抹消に係る手続および約款第39条第4項に掲げる交換有価証券に係る振替請求が行われた後に、振替機関は、約款第39条第1項または第2項に定める交換に係る受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定に従い振替機関等の口座に第1項の交換の請求を行った受益者に係る当該口数の減少の記載または記録が行われます。

受託者は、約款第39条第1項または第2項の委託者の交換の指図に係る振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続および約款第39条第5項に定める抹消の確認をもって、当該振替受益権を受け入れ、抹消したものとして取り扱います。

販売会社は、当該販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を交換請求者から徴収することができるものとします。

委託者は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合、その他やむを得ない事情があるときおよび委託者が必要と認めるときは、交換請求の受付の中止、交換請求の受付の取消またはその両方を行うことができます。

上記により交換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以前に行った当日の交換請求を撤回することができます。ただし、受益者がその交換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交換請求を受け付けたものとして計算されるものとします。

委託者は、上記の請求を受け付けた場合には、当該請求に係る受益権と、当該受益権の投資信託財産に対する持分に相当する有価証券として委託者が指定するものとの交換を行うよう受託者に指図します。

上記の規定にかかわらず、交換の請求を行った受益者が対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合には、原則として、委託者は、上記の請求に係る受益権の口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額に相当する口数を除いた口数の受益権と、当該受益権の持分に相当する有価証券（当該発行会社の株式を除きます。）を交換するよう受託者に指図するものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、上記の基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値（終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。）に上記の交換請求に係る有価証券に含まれる当該発行会社の株数を乗じて得た金額とします。なお、委託者は、当該発行会社の株式を投資信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額を徴することができるものとします。

上記に該当する場合には、交換請求を行う受益者は、販売会社を通じてその旨を委託者に通知するものとします。この通知が交換請求の際に行われなかった場合において、そのことによって投資信託財産その他に損害が生じた場合には、販売会社がすべての責を負うものとします。

受託者は、上記に掲げる手続が行われたことを確認したときには、委託者の指図に従い、振替機関の定める方法により投資信託財産に属する交換有価証券に係る振替請求を行うものとします。ただし、約款第6条ただし書きに掲げる業務方法書に定めるところにより、上記に掲げる交換の請求を受け付けた販売会社が、振替受益権の委託者への受渡しの債務の負担を清算機関に申し込み、これを当該清算機関が負担する場合には、受託者は、上記に掲げる手続にかかわらず、委託者の指図に従い、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換有価証券に係る振替請求を行うものとします。受益者への交換有価証券の交付に際しては、原則として、交換請求受付日から起算して3営業日目から振替機関等の口座に上記の交換の請求を行った受益者に係る有価証券の増加の記載または記録が行われます。

委託者は、交換請求受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したものとして取扱うこととし、受託者は、当該受益権に係る振替受益権が交換有価証券の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

（3）受益権の買取り

販売会社は、次に該当する場合で、受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。ただし、次の2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

1. 交換により取引所売買単位未満の振替受益権が生じた場合
2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になった場合

上記の買取価額は、買取請求受付日の基準価額から、販売会社が定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を控除した価額とすることができます。

販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託者との協議に基づいて第1項による受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。

上記の規定により受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取停止以前に行った当日の買取請求を撤回することができます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取停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、上記の規定に準じて計算されたものとします。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

a. 基準価額の計算方法（追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法（約款第8条））

基準価額とは、投資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または一部償却原価法により評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除して得た金額をいいます。

b. 主要な投資対象資産の評価方法

ファンドの主要な投資対象資産の評価につきましては、法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって、以下のとおり評価しております。

資産の種類	評価方法
国内上場株式	原則として金融商品取引所における計算日の最終相場で評価しております。

c. 基準価額の算出頻度等

基準価額は、原則として委託者の営業日において日々算出され、委託者（下記参照）または販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

なお、基準価額は、日本経済新聞に掲載されます。（ファンド名の表示は「農中カーボン」です。）

<p>農林中金全共連アセットマネジメント株式会社のお問い合わせ窓口 <フリーダイヤル> 0120-439-244（営業日の午前9時から午後5時まで） <ホームページアドレス> https://www.ja-asset.co.jp/</p>

d. 追加信託金および受益権と有価証券の交換の計理処理（約款第37条）

追加信託に相当する金額（追加信託に係る有価証券の評価額を含みます。）は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託差金として処理します。

受益権と有価証券との交換にあたっては、交換に係る受益権口数に交換請求の受付日の基準価額を乗じて得た金額と元本に相当する金額との差額を、交換（解約）差金として処理します。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間（約款第4条）

この信託は、期間の定めを設けません。ただし、約款第46条第1項、同条第2項、第47条第1項、第48条第1項および第50条第2項の規定により信託を終了させる場合があります。

(4) 【計算期間】

信託の計算期間（約款第31条）

この信託の計算期間は、毎年2月16日から8月15日まで、8月16日から翌年2月15日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は、信託契約締結日から2021年2月15日までとし、最終計算期間の終了日は約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

a. 信託期間の終了

下記の信託約款の条項に規定する場合は、信託期間終了日前に信託契約を解約し、当該信託を終了させる場合があります。

(イ) 信託契約の解約（約款第46条）

委託者は、信託期間中において、投資信託財産の一部を受益権と交換することにより、2023年2月15日以降の受益権の口数が500万口を下ることとなった場合もしくは、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

委託者は、信託期間中において次に該当することとなった場合は、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

1. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合
2. 対象株価指数が廃止された場合
3. 対象株価指数の計算方法その他の変更等に伴って委託者または受託者が必要と認めたこの信託約款の変更が約款第51条第2項に規定する書面決議により否決された場合

なお、上記1.に掲げる事由によりこの信託契約を解約する場合には、その廃止された日に信託を終了するための手続を開始するものとします。

委託者は、上記の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとする場合、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

上記の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使用することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使用することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

上記から上記までの規定は、上記の規定に基づいてこの信託契約を解約するとき、または委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資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あって、上記から上記までの手続を行うことが困難な場合も同じとします。

(口) 信託契約に関する監督官庁の命令(約款第47条第1項)

委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、この信託契約を解約し信託を終了させます。

(ハ) 委託者の登録取り消しなどに伴う取り扱い(約款第48条)

委託者が監督官庁より登録の取り消しを受けたとき、解散したとき、または業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

上記の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、約款第51条第2項の書面決議において否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(二) 受託者の辞任および解任に伴う取り扱い(約款第50条)

受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、約款第51条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

b. 約款の変更

約款の変更は、信託約款の下記の条項により行うものとします。

(イ) 信託契約に関する監督官庁の命令(約款第47条第2項)

委託者は、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、約款第51条の規定に従います。

(ロ) 信託約款の変更等(約款第51条)

委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合

しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

委託者は、上記の変更または併合(上記の変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

上記の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

上記から上記までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

上記から上記までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

c. 金融商品取引所への上場(約款第13条)

委託者は、この信託の受益権について、金融商品取引所に上場申請を行うものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所が開設する市場に上場されるものとします。

委託者は、この信託の受益権が上場された場合には、上記の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行う受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置に従うものとします。

d. その他の契約の変更

<募集等に関する契約>

委託者と販売会社との間の上場投資信託の募集等に関する契約は当事者の別段の意思表示がない限り、1年ごとに自動的に更新されます。

当契約は、当事者間の合意により変更することができます。

その終了または変更は、必要に応じて受益者に対して通知を行う手配をしますが、必ずしも直ちに受益者全員にこれを知らせるものではありません。

e. 運用報告書等

<運用報告書>

委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に基づく運用報告書の作成・交付は行いません。

<有価証券報告書>

委託者は、金融商品取引法第24条第1項の規定に基づき有価証券報告書を作成し、関東財務局に提出します。

<臨時報告書>

委託者は、金融商品取引法第24条の5第4項の規定に基づき臨時報告書を作成し、関東財務局に提出します。

f. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い(約款第49条)

委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

g. 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限(約款第53条)

この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

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

h. 公告(約款第54条)

委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

i. 信託約款に関する疑義の取り扱い(約款第55条)

信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

j. 信託事務処理の再信託

受託者は、当ファンドに係る信託事務の処理の一部について、日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

4【受益者の権利等】

受益者は「投資信託及び投資法人に関する法律」ならびに信託約款の規定および本書の記載に従い、以下の権利を有するものとします。

(イ) 収益分配金に対する請求権および名義登録

受益者は、持分に応じて収益分配金を請求する権利を有します。

受託者は、計算期間終了日現在において、約款第16条の受益者名簿に名義登録されている者を計算期間終了日における受益者(以下「名義登録受益者」といいます。)とし、収益分配金を当該名義登録受益者に支払います。

受託者は収益分配金の支払いについて、受益者名簿の作成した者にこれを委託することができます。

上記に規定する収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了後40日以内の委託者の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定した預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式により行うものとします。なお、名義登録受益者が約款第16条第3項に規定する金融商品取引所の会員と別途収益分配金の取扱いに係る契約を締結している場合は、当該契約に従い支払われるものとします。

受益者が、収益分配金について上記に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(受益者名簿の作成と名義登録(約款第16条))

1. 受託者は、この信託に係る受益者名簿を作成し、受益者について、その氏名または名称、住所および個人番号(行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。以下同じ。)または法人番号(同法同条に規定する法人番号をいいます。以下同じ。)(個人番号または法人番号を有しない者にあつては、氏名または名称および住所とします。)その他受託者が定める事項を、受益者名簿に名義登録するものとします。
2. 受託者は、計算期間終了日において、社振法等関係法令、諸規則等に基づき、振替機関より通知を受けた受益権の帰属者を振替機関等の振替口座簿に記載または記録された受益権に係る受益者として、その氏名または名称、住所および個人番号または法人番号(個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払いの取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。)その他受託者の定める事項を受益者名簿に登録するものとします。なお、受託者は他の証券代行業社等、受託者が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成および受益者名簿への名義登録を委託することができます。
3. 受益者は、この信託の受益権が上場されている金融商品取引所の会員(口座管理機関であるものに限ります。以下同じ。)を経由して上記1.の受益者名簿に名義を登録することを請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。
4. 上記3.に規定する名義登録は、毎計算期間の末日の翌日から15日間停止するものとします。また、この信託が終了することとなる場合は、信託終了日の直前5営業日間に於いて名義登録を停止するものとします。

（ロ）信託終了時の交換等

委託者は、この信託が終了するときは、委託者が別に定める一定口数以上の受益権を有する受益者に対しては、投資信託財産に対する持分に相当する有価証券を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権と引換えに交換するものとします。

上記の交換は、販売会社の営業所において行うものとします。

上記の交換に係る受益権の評価額は信託終了日の5営業日前の基準価額とします。この場合において、受益者が交換により取得する個別銘柄の有価証券は、信託終了日の5営業日前の日における当該有価証券の評価額に基づいて計算された数とし、取引所売買単位の整数倍とします。

対象株価指数に採用されている銘柄の株式の発行会社等である受益者が、上記の定めによって交換する場合には、委託者は当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数の受益権を買取を受託者に指図します。この場合の個別銘柄時価総額は、信託終了日の4営業日前の寄付き以降成行きの方法またはこれに準ずるものとして合理的な売却の方法によって当該株式を売却した額（売却するのに必要な経費を控除した後の金額）とします。

上記の規定により投資信託財産が買取った受益権については、上記の個別銘柄時価総額が確定した日から4営業日目に金銭の交付を行います。

販売会社は、上記による交換を行うときは、当該受益者から販売会社が定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

上記の有価証券の交換は、原則として、交換のための振替受益権の抹消の申請が振替機関に受け付けられたことを受託者が確認した日の翌営業日から起算して3営業日目から行います。

委託者は、信託終了日の4営業日前の日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権（約款第40条の規定により買取りの対象となった受益権を含みます。）を失効したのものとして取り扱うこととし、受託者は、当該受益権に係る振替受益権が交換有価証券の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

上記および上記の規定にかかわらず、次の場合には信託終了時の受益権の価額をもとに販売会社が買取りを行うことを原則とします。

1. 上記において、受益者の有する口数から有価証券の交換に要した口数を控除した後に残余の口数を生じた場合の残余の口数の振替受益権
2. 上記における一定口数に満たない振替受益権（取引所売買単位未満の振替受益権を含みます。）

販売会社は、上記の買取りを行うときは、販売会社が定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

信託終了に係る金銭は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者である販売会社に支払います。なお、販売会社は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託を終了するのと引換えに、信託終了に係る金銭に相当する受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

受益者が、信託終了時の交換について、信託終了日から10年間その交換請求をしないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（ハ）反対者の買取請求権（約款第52条）

約款第46条に規定する信託契約の解約または約款第51条に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

（ニ）投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写請求権（投資信託及び投資法人に関する法律第15条第2項）

受益者は委託者に対し、その営業時間内に当該受益者に係る投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

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2期計算期間（2021年 2月16日から2021年 8月15日まで）の財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

NZAM 上場投信 S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2021年 2月15日現在	第2期 2021年 8月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	762,475,998	811,023,673
株式	28,218,636,920	28,176,010,270
派生商品評価勘定	25,092,300	224,060
未収入金	21,346,160	-
未収配当金	37,653,961	32,782,296
前払金	-	520,000
差入委託証拠金	38,745,000	31,365,000
流動資産合計	29,103,950,339	29,051,925,299
資産合計	29,103,950,339	29,051,925,299
負債の部		
流動負債		
前受金	34,904,900	-
未払金	-	146,160
未払収益分配金	221,529,200	287,987,960
未払受託者報酬	3,384,337	4,381,852
未払委託者報酬	11,119,886	14,397,451
未払利息	316	1,516
その他未払費用	3,387,256	4,421,882
流動負債合計	274,325,895	311,336,821
負債合計	274,325,895	311,336,821
純資産の部		
元本等		
元本	23,592,859,800	23,592,859,800
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,236,764,644	5,147,728,678
(分配準備積立金)	10,114,935	9,095,880
元本等合計	28,829,624,444	28,740,588,478
純資産合計	28,829,624,444	28,740,588,478
負債純資産合計	29,103,950,339	29,051,925,299

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2020年 9月10日 至 2021年 2月15日	自	2021年 2月16日 至 2021年 8月15日
営業収益				
受取配当金		249,542,027		310,255,324
受取利息		5,340		1,052
有価証券売買等損益		4,781,321,916		93,809,291
派生商品取引等損益		63,799,660		5,792,380
その他収益		24,008		46,049
営業収益合計		5,094,692,951		222,285,514
営業費用				
支払利息		34,639		132,335
受託者報酬		3,384,337		4,381,852
委託者報酬		11,119,886		14,397,451
その他費用		3,388,378		4,421,882
営業費用合計		17,927,240		23,333,520
営業利益又は営業損失（ ）		5,076,765,711		198,951,994
経常利益又は経常損失（ ）		5,076,765,711		198,951,994
当期純利益又は当期純損失（ ）		5,076,765,711		198,951,994
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		-		-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		5,236,764,644
剰余金増加額又は欠損金減少額		381,528,133		-
当期一部交換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		381,528,133		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
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		221,529,200		287,987,960
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,236,764,644		5,147,728,678

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知り得る直近の日の主たる取引所の発表する清算値段、又は最終相場に基づいて評価しております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

<p>第2期 (2021年 8月15日現在)</p>
<p>当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当計算期間の翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目		第1期 2021年 2月15日現在	第2期 2021年 8月15日現在
1.	投資信託財産に係る元本の状況		
	期首元本額	9,829,566,600円	23,592,859,800円
	期中追加設定元本額	13,763,293,200円	- 円
	期中一部交換元本額	- 円	- 円
2.	計算期間の末日における受益権の総数	110,764,600口	110,764,600口
3.	1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	260.28円 (26,028円)	259.47円 (25,947円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 2020年 9月10日 至 2021年 2月15日		第2期 自 2021年 2月16日 至 2021年 8月15日	
	分配金の計算過程	A. 配当等収益額	249,536,736円	A. 配当等収益額
	B. 分配準備積立金額	0円	B. 分配準備積立金額	10,114,935円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	249,536,736円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	320,285,025円
	D. 経費	17,892,601円	D. 経費	23,201,185円
	E. 収益分配可能額 (C - D)	231,644,135円	E. 収益分配可能額 (C - D)	297,083,840円
	F. 収益分配金	221,529,200円	F. 収益分配金	287,987,960円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E - F)	10,114,935円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E - F)	9,095,880円
	H. 口数	110,764,600口	H. 口数	110,764,600口
	I. 100口当たり分配金 (F / H × 100)	200円	I. 100口当たり分配金 (F / H × 100)	260円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2020年 9月10日 至 2021年 2月15日	第2期 自 2021年 2月16日 至 2021年 8月15日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権等であります。 当ファンドが保有する有価証券は、全て売買目的で保有しており、デリバティブ取引は、ヘッジ目的以外にも利用する場合があります。また、これらの詳細は、「（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、デリバティブ等の評価基準及び評価方法」に記載しております。 当該金融商品は、株価変動リスク、金利変動リスク、信用リスク、流動性リスク、価格変動リスク等に晒されています。	同左
3．金融商品に係るリスクの管理体制	フロント部門では、ポジションリスク管理及びパフォーマンス管理を行っています。また、決定された運用計画に基づいた運用（あるいはポジション組成）となっているか管理を行っております。 ミドル部門は、ファンド運用状況の日々のモニタリングや定期的なフィードバックを行ないフロント部門を牽制しております。法令等のルールや組織的に決定された運用計画に従って運用されるよう、日常的な管理を行うほか、運用管理会議を開催してこれらの遵守状況を検証しております。また、各種運用リスクとパフォーマンスの計測・管理を行うほか、運用リスク管理会議を開催してこれらの管理状況を検証しております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2021年 2月15日現在	第2期 2021年 8月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	株式 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 先物取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権 短期で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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1期(自 2020年 9月10日 至 2021年 2月15日)

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	4,624,722,797
合計	4,624,722,797

第2期(自 2021年 2月16日 至 2021年 8月15日)

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	139,291,978
合計	139,291,978

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

第1期(2021年2月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	562,151,100	-	587,250,000	25,098,900
合計		562,151,100	-	587,250,000	25,098,900

第2期(2021年8月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	528,160,000	-	528,390,000	230,000
合計		528,160,000	-	528,390,000	230,000

(注)時価の算定方法

- 1.先物取引の時価評価については、原則として計算日に知り得る直近の日の主たる取引所の発表する清算値段、又は最終相場に基づいて評価しております。
- 2.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は含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	400	3,020.00	1,208,000	
日本水産	19,900	583.00	11,601,700	
マル八二チロ	700	2,390.00	1,673,000	
雪国まいたけ	900	1,621.00	1,458,900	
サカタのタネ	100	3,685.00	368,500	
ホクト	100	1,927.00	192,700	
住石ホールディングス	3,900	130.00	507,000	
日鉄鉱業	300	6,710.00	2,013,000	
三井松島ホールディングス	300	1,125.00	337,500	
I N P E X	40,100	799.00	32,039,900	
石油資源開発	1,400	1,834.00	2,567,600	
K & O エナジーグループ	900	1,301.00	1,170,900	
ショーボンドホールディングス	2,200	4,860.00	10,692,000	
ミライト・ホールディングス	6,700	2,070.00	13,869,000	
タマホーム	1,000	2,508.00	2,508,000	
サンヨーホームズ	200	721.00	144,200	
日本アクア	800	557.00	445,600	
ファーストコーポレーション	600	764.00	458,400	
ベステラ	200	1,463.00	292,600	
R o b o t H o m e	2,600	206.00	535,600	
スペースバリューホールディングス	200	825.00	165,000	
ダイセキ環境ソリューション	100	1,155.00	115,500	
第一カッター興業	400	1,300.00	520,000	
安藤・間	9,400	836.00	7,858,400	
東急建設	5,700	755.00	4,303,500	
コムシスホールディングス	6,100	3,020.00	18,422,000	
ビーアールホールディングス	2,000	488.00	976,000	
高松コンストラクショングループ	1,000	2,029.00	2,029,000	
東建コーポレーション	500	10,200.00	5,100,000	
オリエンタル白石	5,900	282.00	1,663,800	
大成建設	12,100	3,610.00	43,681,000	
大林組	41,400	941.00	38,957,400	
清水建設	34,600	836.00	28,925,600	
飛島建設	1,100	1,103.00	1,213,300	

長谷工コーポレーション	10,400	1,536.00	15,974,400	
銭高組	200	4,075.00	815,000	
鹿島建設	32,700	1,464.00	47,872,800	
不動テトラ	900	1,780.00	1,602,000	
大末建設	300	996.00	298,800	
鉄建建設	900	1,829.00	1,646,100	
西松建設	2,700	3,435.00	9,274,500	
三井住友建設	8,600	479.00	4,119,400	
大豊建設	800	4,095.00	3,276,000	
前田建設工業	8,800	839.00	7,383,200	
佐田建設	1,000	481.00	481,000	
奥村組	1,900	3,020.00	5,738,000	
東鉄工業	2,100	2,408.00	5,056,800	
イチケン	200	1,939.00	387,800	
浅沼組	200	4,515.00	903,000	
戸田建設	16,100	792.00	12,751,200	
熊谷組	1,700	2,763.00	4,697,100	
矢作建設工業	1,600	712.00	1,139,200	
ピーエス三菱	1,200	663.00	795,600	
日本ハウスホールディングス	2,300	409.00	940,700	
大東建託	5,200	12,260.00	63,752,000	
新日本建設	1,300	846.00	1,099,800	
N I P P O	2,900	3,080.00	8,932,000	
東亜道路工業	200	4,530.00	906,000	
前田道路	1,500	1,908.00	2,862,000	
日本道路	300	8,080.00	2,424,000	
東亜建設工業	800	2,331.00	1,864,800	
日本国土開発	3,600	575.00	2,070,000	
若築建設	800	1,915.00	1,532,000	
東洋建設	4,500	562.00	2,529,000	
五洋建設	15,100	705.00	10,645,500	
世紀東急工業	1,900	850.00	1,615,000	
福田組	300	4,840.00	1,452,000	
住友林業	2,100	2,044.00	4,292,400	
巴コーポレーション	1,400	401.00	561,400	
大和ハウス工業	41,200	3,397.00	139,956,400	
ライト工業	2,400	1,907.00	4,576,800	
積水ハウス	50,200	2,203.50	110,615,700	
日特建設	1,000	746.00	746,000	
ユアテック	2,100	696.00	1,461,600	

日本リーテック	800	1,666.00	1,332,800	
中電工	2,000	2,254.00	4,508,000	
関電工	6,400	940.00	6,016,000	
きんでん	7,200	1,825.00	13,140,000	
東京エネシス	1,200	1,020.00	1,224,000	
トーエネック	100	3,660.00	366,000	
住友電設	1,100	2,062.00	2,268,200	
日本電設工業	1,900	1,896.00	3,602,400	
協和エクシオ	6,700	2,729.00	18,284,300	
新日本空調	1,200	2,300.00	2,760,000	
九電工	2,300	3,825.00	8,797,500	
三機工業	2,400	1,465.00	3,516,000	
日揮ホールディングス	11,400	972.00	11,080,800	
中外炉工業	300	1,861.00	558,300	
太平電業	1,000	2,652.00	2,652,000	
高砂熱学工業	3,500	2,021.00	7,073,500	
三晃金属工業	100	2,211.00	221,100	
明星工業	2,300	749.00	1,722,700	
大気社	2,300	3,480.00	8,004,000	
ダイダン	1,200	2,667.00	3,200,400	
日比谷総合設備	1,100	1,864.00	2,050,400	
フィル・カンパニー	200	2,893.00	578,600	
東洋エンジニアリング	1,200	954.00	1,144,800	
レイズネクスト	2,000	1,110.00	2,220,000	
ニッポン	100	1,619.00	161,900	
日清製粉グループ本社	2,400	1,784.00	4,281,600	
昭和産業	100	2,851.00	285,100	
中部飼料	200	1,123.00	224,600	
フィード・ワン	100	746.00	74,600	
DM三井製糖ホールディングス	300	1,944.00	583,200	
日新製糖	200	1,693.00	338,600	
森永製菓	2,800	3,860.00	10,808,000	
江崎グリコ	900	4,245.00	3,820,500	
井村屋グループ	200	2,272.00	454,400	
不二家	200	2,265.00	453,000	
山崎製パン	11,600	1,633.00	18,942,800	
亀田製菓	700	4,570.00	3,199,000	
寿スピリッツ	1,700	6,530.00	11,101,000	
カルビー	2,000	2,599.00	5,198,000	
森永乳業	200	6,770.00	1,354,000	

六甲バター	100	1,571.00	157,100
ヤクルト本社	800	6,560.00	5,248,000
明治ホールディングス	1,500	6,640.00	9,960,000
雪印メグミルク	200	2,238.00	447,600
プリマハム	200	2,954.00	590,800
日本ハム	1,100	4,135.00	4,548,500
林兼産業	100	584.00	58,400
丸大食品	100	1,750.00	175,000
S Foods	100	3,335.00	333,500
柿安本店	100	2,499.00	249,900
伊藤ハム米久ホールディングス	900	743.00	668,700
サッポロホールディングス	6,800	2,353.00	16,000,400
アサヒグループホールディングス	34,500	5,032.00	173,604,000
キリンホールディングス	61,400	1,946.00	119,484,400
宝ホールディングス	10,700	1,416.00	15,151,200
オエノンホールディングス	3,100	375.00	1,162,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	17,200	1,527.00	26,264,400
サントリー食品インターナショナル	15,600	4,280.00	66,768,000
ダイドーグループホールディングス	200	5,390.00	1,078,000
伊藤園	1,000	6,770.00	6,770,000
キーコーヒー	200	2,154.00	430,800
日清オイリオグループ	200	3,030.00	606,000
不二製油グループ本社	800	2,491.00	1,992,800
J - オイルミルズ	400	1,803.00	721,200
キッコーマン	14,700	7,230.00	106,281,000
味の素	9,700	3,015.00	29,245,500
キューピー	6,200	2,490.00	15,438,000
ハウス食品グループ本社	1,600	3,350.00	5,360,000
カゴメ	5,800	2,890.00	16,762,000
アリアケジャパン	1,000	6,160.00	6,160,000
ニチレイ	1,900	2,591.00	4,922,900
東洋水産	7,100	4,220.00	29,962,000
イートアンドホールディングス	200	2,067.00	413,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	800	756.00	604,800
日清食品ホールディングス	5,700	8,090.00	46,113,000
フジッコ	200	1,923.00	384,600
ロック・フィールド	300	1,489.00	446,700
日本たばこ産業	76,500	2,161.00	165,316,500
ケンコーマヨネーズ	800	1,556.00	1,244,800

わらべや日洋ホールディングス	100	2,237.00	223,700	
なとり	200	1,961.00	392,200	
ピックルスコーポレーション	200	3,555.00	711,000	
北の達人コーポレーション	3,700	544.00	2,012,800	
ユーグレナ	600	911.00	546,600	
ミヨシ油脂	100	1,265.00	126,500	
理研ビタミン	200	1,731.00	346,200	
片倉工業	1,300	1,469.00	1,909,700	
グンゼ	100	4,515.00	451,500	
東洋紡	3,700	1,410.00	5,217,000	
ユニチカ	700	352.00	246,400	
富士紡ホールディングス	100	4,105.00	410,500	
倉敷紡績	200	1,981.00	396,200	
シキボウ	100	937.00	93,700	
日本毛織	300	980.00	294,000	
ダイトウボウ	2,100	102.00	214,200	
トーア紡コーポレーション	100	430.00	43,000	
帝国繊維	900	1,964.00	1,767,600	
帝人	12,100	1,650.00	19,965,000	
東レ	77,500	739.10	57,280,250	
サカイオーベックス	100	3,805.00	380,500	
アツギ	900	630.00	567,000	
セーレン	400	2,096.00	838,400	
小松マテーレ	400	990.00	396,000	
ワコールホールディングス	2,600	2,447.00	6,362,200	
ホギメディカル	1,100	3,465.00	3,811,500	
T S Iホールディングス	3,400	340.00	1,156,000	
マツオカコーポレーション	200	1,508.00	301,600	
ワールド	1,200	1,385.00	1,662,000	
三陽商会	800	861.00	688,800	
ナイガイ	500	337.00	168,500	
オンワードホールディングス	6,000	298.00	1,788,000	
ルックホールディングス	100	1,312.00	131,200	
キムラタン	2,100	24.00	50,400	
ゴールドウイン	1,800	6,740.00	12,132,000	
デザート	2,000	3,380.00	6,760,000	
特種東海製紙	400	4,740.00	1,896,000	
王子ホールディングス	39,300	622.00	24,444,600	
日本製紙	3,900	1,293.00	5,042,700	
三菱製紙	1,200	364.00	436,800	

北越コーポレーション	8,400	635.00	5,334,000	
中越パルプ工業	300	1,227.00	368,100	
大王製紙	4,500	2,041.00	9,184,500	
レンゴー	11,300	943.00	10,655,900	
ザ・パックス	600	2,929.00	1,757,400	
クラレ	13,100	1,066.00	13,964,600	
旭化成	85,400	1,198.00	102,309,200	
昭和電工	6,500	3,370.00	21,905,000	
住友化学	82,100	566.00	46,468,600	
住友精化	600	3,555.00	2,133,000	
日産化学	7,300	5,570.00	40,661,000	
ラサ工業	200	1,913.00	382,600	
クレハ	700	7,590.00	5,313,000	
多木化学	200	6,060.00	1,212,000	
テイカ	700	1,315.00	920,500	
石原産業	1,500	1,340.00	2,010,000	
日本曹達	1,500	3,555.00	5,332,500	
東ソー	12,800	1,963.00	25,126,400	
トクヤマ	1,400	2,385.00	3,339,000	
セントラル硝子	1,400	2,208.00	3,091,200	
東亜合成	4,500	1,234.00	5,553,000	
大阪ソーダ	1,200	2,540.00	3,048,000	
関東電化工業	2,300	1,090.00	2,507,000	
デンカ	3,400	3,860.00	13,124,000	
信越化学工業	17,200	17,930.00	308,396,000	
日本カーバイド工業	200	1,297.00	259,400	
堺化学工業	400	2,086.00	834,400	
第一稀元素化学工業	1,400	1,774.00	2,483,600	
エア・ウォーター	11,100	1,827.00	20,279,700	
日本酸素ホールディングス	7,500	2,530.00	18,975,000	
日本化学工業	100	3,620.00	362,000	
日本パーカライジング	6,800	1,164.00	7,915,200	
チタン工業	100	1,822.00	182,200	
四国化成工業	1,200	1,318.00	1,581,600	
戸田工業	200	3,460.00	692,000	
ステラ ケミファ	300	2,849.00	854,700	
保土谷化学工業	400	4,645.00	1,858,000	
日本触媒	1,900	5,820.00	11,058,000	
大日精化工業	900	2,446.00	2,201,400	
カネカ	3,000	4,495.00	13,485,000	

三菱瓦斯化学	13,000	2,152.00	27,976,000
三井化学	7,400	3,890.00	28,786,000
J S R	12,600	3,590.00	45,234,000
東京応化工業	3,000	7,100.00	21,300,000
大阪有機化学工業	900	3,790.00	3,411,000
三菱ケミカルホールディングス	57,300	956.50	54,807,450
K Hネオケム	1,300	2,945.00	3,828,500
ダイセル	15,100	891.00	13,454,100
住友ベークライト	2,000	4,660.00	9,320,000
積水化学工業	4,900	1,967.00	9,638,300
日本ゼオン	9,800	1,541.00	15,101,800
アイカ工業	2,700	3,740.00	10,098,000
宇部興産	1,400	2,275.00	3,185,000
積水樹脂	1,400	2,178.00	3,049,200
タキロンシーアイ	3,200	620.00	1,984,000
旭有機材	800	1,441.00	1,152,800
ニチバン	100	1,820.00	182,000
リケンテクノス	4,300	582.00	2,502,600
大倉工業	700	2,300.00	1,610,000
積水化成品工業	1,900	595.00	1,130,500
群栄化学工業	200	2,571.00	514,200
ミライアル	300	1,249.00	374,700
ダイキアクシス	100	864.00	86,400
ダイキョーニシカワ	900	699.00	629,100
竹本容器	300	947.00	284,100
森六ホールディングス	700	2,158.00	1,510,600
恵和	100	3,400.00	340,000
日本化薬	8,200	1,224.00	10,036,800
カーリットホールディングス	1,500	826.00	1,239,000
日本精化	1,000	1,869.00	1,869,000
扶桑化学工業	500	4,370.00	2,185,000
トリケミカル研究所	200	3,325.00	665,000
A D E K A	6,200	2,361.00	14,638,200
日油	3,300	6,250.00	20,625,000
新日本理化	1,500	277.00	415,500
ハリマ化成グループ	1,100	915.00	1,006,500
花王	29,000	6,765.00	196,185,000
第一工業製薬	400	3,325.00	1,330,000
ニイタカ	200	2,184.00	436,800
三洋化成工業	700	6,060.00	4,242,000

有機合成薬品工業	700	334.00	233,800
大日本塗料	1,600	862.00	1,379,200
日本ペイントホールディングス	66,000	1,372.00	90,552,000
関西ペイント	15,900	2,862.00	45,505,800
中国塗料	3,600	912.00	3,283,200
日本特殊塗料	900	1,060.00	954,000
藤倉化成	2,000	520.00	1,040,000
太陽ホールディングス	500	5,970.00	2,985,000
D I C	5,300	3,050.00	16,165,000
サカタインクス	2,800	1,152.00	3,225,600
東洋インキS Cホールディングス	3,500	2,068.00	7,238,000
富士フイルムホールディングス	20,500	7,976.00	163,508,000
資生堂	27,000	7,609.00	205,443,000
ライオン	17,000	1,826.00	31,042,000
高砂香料工業	1,000	2,907.00	2,907,000
マンダム	2,800	1,704.00	4,771,200
ミルボン	1,600	6,780.00	10,848,000
ファンケル	5,500	3,660.00	20,130,000
コーセー	2,000	14,460.00	28,920,000
コタ	800	1,571.00	1,256,800
ポーラ・オルビスホールディングス	6,400	2,646.00	16,934,400
ノエビアホールディングス	900	5,770.00	5,193,000
新日本製薬	300	1,824.00	547,200
エステー	1,000	1,740.00	1,740,000
コニシ	2,600	1,679.00	4,365,400
長谷川香料	2,500	2,725.00	6,812,500
星光P M C	700	875.00	612,500
小林製薬	3,800	8,590.00	32,642,000
荒川化学工業	1,200	1,279.00	1,534,800
メック	1,000	3,500.00	3,500,000
タカラバイオ	200	3,005.00	601,000
J C U	1,600	4,115.00	6,584,000
新田ゼラチン	1,200	631.00	757,200
O A Tアグリオ	100	1,600.00	160,000
デクセリアルズ	2,600	2,171.00	5,644,600
アース製薬	800	6,340.00	5,072,000
北興化学工業	1,000	1,060.00	1,060,000
クミアイ化学工業	5,100	850.00	4,335,000
日本農薬	2,100	533.00	1,119,300
アキレス	1,000	1,359.00	1,359,000

有沢製作所	1,400	949.00	1,328,600	
日東電工	9,100	8,440.00	76,804,000	
レック	100	1,104.00	110,400	
三光合成	900	478.00	430,200	
きもと	2,100	247.00	518,700	
藤森工業	1,200	4,275.00	5,130,000	
ウェーブロックホールディングス	700	686.00	480,200	
J S P	700	1,644.00	1,150,800	
エフピコ	2,300	4,255.00	9,786,500	
天馬	800	2,708.00	2,166,400	
信越ポリマー	2,600	1,012.00	2,631,200	
ニフコ	1,500	3,625.00	5,437,500	
バルカー	1,200	2,187.00	2,624,400	
ユニ・チャーム	3,600	4,775.00	17,190,000	
協和キリン	12,000	3,460.00	41,520,000	
武田薬品工業	96,700	3,674.00	355,275,800	
アステラス製薬	106,200	1,788.50	189,938,700	
大日本住友製薬	8,400	1,900.00	15,960,000	
塩野義製薬	14,700	6,536.00	96,079,200	
日本新薬	200	8,630.00	1,726,000	
中外製薬	41,700	4,108.00	171,303,600	
科研製薬	1,900	5,020.00	9,538,000	
エーザイ	13,400	9,179.00	122,998,600	
ロート製薬	5,300	3,290.00	17,437,000	
小野薬品工業	31,500	2,507.50	78,986,250	
久光製薬	3,200	4,535.00	14,512,000	
持田製薬	1,500	3,555.00	5,332,500	
参天製薬	24,400	1,625.00	39,650,000	
扶桑薬品工業	300	2,346.00	703,800	
ツムラ	200	3,615.00	723,000	
日医工	3,500	838.00	2,933,000	
キッセイ薬品工業	2,100	2,356.00	4,947,600	
生化学工業	2,200	1,107.00	2,435,400	
栄研化学	2,100	2,175.00	4,567,500	
日水製薬	700	1,005.00	703,500	
鳥居薬品	700	2,766.00	1,936,200	
J C R ファーマ	2,700	2,993.00	8,081,100	
東和薬品	1,500	3,080.00	4,620,000	
富士製薬工業	900	1,133.00	1,019,700	
ゼリア新薬工業	2,100	2,080.00	4,368,000	

第一三共	103,100	2,296.50	236,769,150
キョーリン製薬ホールディングス	2,500	1,827.00	4,567,500
大幸薬品	1,300	948.00	1,232,400
ダイト	700	3,380.00	2,366,000
大塚ホールディングス	2,100	4,686.00	9,840,600
大正製薬ホールディングス	2,600	6,100.00	15,860,000
ペプチドリーム	600	4,250.00	2,550,000
あすか製薬ホールディングス	1,200	987.00	1,184,400
サワイグループホールディングス	200	4,845.00	969,000
日本コークス工業	8,400	119.00	999,600
ニチレキ	1,300	1,269.00	1,649,700
ユシロ化学工業	800	1,205.00	964,000
ビーピー・カストロール	300	1,354.00	406,200
富士石油	900	239.00	215,100
MORESCO	300	1,166.00	349,800
出光興産	9,100	2,623.00	23,869,300
ENEOSホールディングス	174,300	457.50	79,742,250
コスモエネルギーホールディングス	2,700	2,478.00	6,690,600
横浜ゴム	1,600	2,053.00	3,284,800
TOYO TIRE	1,500	2,059.00	3,088,500
ブリヂストン	11,000	5,144.00	56,584,000
住友ゴム工業	2,700	1,399.00	3,777,300
藤倉コンポジット	500	645.00	322,500
オカモト	1,000	4,115.00	4,115,000
ニッタ	1,000	2,742.00	2,742,000
住友理工	900	726.00	653,400
三ツ星ベルト	1,200	1,921.00	2,305,200
バンドー化学	1,400	950.00	1,330,000
日東紡績	1,300	3,350.00	4,355,000
AGC	6,400	4,940.00	31,616,000
日本板硝子	3,200	577.00	1,846,400
石塚硝子	100	1,967.00	196,700
日本山村硝子	300	937.00	281,100
日本電気硝子	3,100	2,422.00	7,508,200
オハラ	200	1,352.00	270,400
住友大阪セメント	1,000	3,160.00	3,160,000
太平洋セメント	2,700	2,644.00	7,138,800
日本ヒューム	700	738.00	516,600
日本コンクリート工業	1,600	305.00	488,000
三谷セキサン	300	4,840.00	1,452,000

アジアパイルホールディングス	1,000	485.00	485,000	
東海カーボン	14,400	1,633.00	23,515,200	
日本カーボン	300	4,410.00	1,323,000	
東洋炭素	400	2,947.00	1,178,800	
ノリタケカンパニーリミテド	300	4,200.00	1,260,000	
TOTO	9,100	5,950.00	54,145,000	
日本碍子	9,300	1,834.00	17,056,200	
日本特殊陶業	3,500	1,689.00	5,911,500	
ダントーホールディングス	500	249.00	124,500	
MARUWA	300	10,730.00	3,219,000	
品川リフラクトリーズ	200	4,115.00	823,000	
黒崎播磨	100	5,010.00	501,000	
ヨータイ	700	1,230.00	861,000	
イソライト工業	500	673.00	336,500	
東京窯業	1,100	328.00	360,800	
ニッカトー	200	683.00	136,600	
フジミインコーポレーテッド	1,300	5,810.00	7,553,000	
エーアンドエーマテリアル	200	999.00	199,800	
ニチアス	2,400	2,847.00	6,832,800	
ニチハ	1,000	3,075.00	3,075,000	
日本製鉄	29,400	2,244.50	65,988,300	
神戸製鋼所	12,800	731.00	9,356,800	
中山製鋼所	600	425.00	255,000	
合同製鐵	300	1,572.00	471,600	
ジェイ エフ イー ホールディングス	18,100	1,654.00	29,937,400	
東京製鐵	3,500	1,201.00	4,203,500	
共英製鋼	1,000	1,510.00	1,510,000	
大和工業	1,500	4,135.00	6,202,500	
東京鐵鋼	200	1,568.00	313,600	
大阪製鐵	200	1,247.00	249,400	
淀川製鋼所	1,200	2,398.00	2,877,600	
丸一鋼管	2,500	2,714.00	6,785,000	
モリ工業	200	2,372.00	474,400	
大同特殊鋼	1,500	5,310.00	7,965,000	
日本高周波鋼業	200	412.00	82,400	
日本冶金工業	800	2,841.00	2,272,800	
山陽特殊製鋼	700	1,854.00	1,297,800	
愛知製鋼	400	2,818.00	1,127,200	
日立金属	8,400	2,128.00	17,875,200	

日本金属	200	1,053.00	210,600
大平洋金属	200	1,689.00	337,800
新日本電工	1,900	328.00	623,200
栗本鐵工所	300	1,636.00	490,800
虹技	200	1,099.00	219,800
日本鑄鉄管	100	1,201.00	120,100
三菱製鋼	800	1,453.00	1,162,400
日本精線	100	5,100.00	510,000
エンビプロ・ホールディングス	300	1,668.00	500,400
シンニッタン	600	252.00	151,200
大紀アルミニウム工業所	1,200	1,509.00	1,810,800
日本軽金属ホールディングス	2,800	1,987.00	5,563,600
三井金属鉱業	2,800	3,575.00	10,010,000
東邦亜鉛	300	2,097.00	629,100
三菱マテリアル	5,600	2,398.00	13,428,800
住友金属鉱山	13,200	4,386.00	57,895,200
DOWAホールディングス	2,700	4,895.00	13,216,500
古河機械金属	1,400	1,293.00	1,810,200
エス・サイエンス	6,300	36.00	226,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	900	833.00	749,700
東邦チタニウム	2,000	1,217.00	2,434,000
UACJ	1,900	2,946.00	5,597,400
古河電気工業	3,000	2,532.00	7,596,000
住友電気工業	38,100	1,530.00	58,293,000
フジクラ	14,000	620.00	8,680,000
昭和電線ホールディングス	1,400	2,083.00	2,916,200
東京特殊電線	200	2,707.00	541,400
タツタ電線	2,300	535.00	1,230,500
平河ヒューテック	800	1,195.00	956,000
リョービ	1,000	1,401.00	1,401,000
アーレスティ	500	459.00	229,500
アサヒホールディングス	5,600	2,152.00	12,051,200
宮地エンジニアリンググループ	200	2,540.00	508,000
トーカロ	2,500	1,376.00	3,440,000
SUMCO	1,200	2,274.00	2,728,800
川田テクノロジーズ	200	3,765.00	753,000
RS Technologies	400	5,610.00	2,244,000
ジェイテックコーポレーション	100	3,185.00	318,500
東洋製罐グループホールディングス	4,800	1,547.00	7,425,600
コロナ	100	916.00	91,600

横河ブリッジホールディングス	2,400	2,135.00	5,124,000	
駒井ハルテック	200	1,675.00	335,000	
三和ホールディングス	6,900	1,409.00	9,722,100	
文化シャッター	4,300	1,132.00	4,867,600	
三協立山	1,000	755.00	755,000	
アルインコ	800	1,009.00	807,200	
L I X I L	13,100	3,235.00	42,378,500	
ノーリツ	2,400	1,878.00	4,507,200	
長府製作所	200	2,030.00	406,000	
リンナイ	500	11,020.00	5,510,000	
ダイニチ工業	100	772.00	77,200	
岡部	2,200	665.00	1,463,000	
ジーテクト	300	1,485.00	445,500	
東プレ	2,200	1,460.00	3,212,000	
高周波熱錬	2,500	644.00	1,610,000	
東京製綱	900	1,028.00	925,200	
モリテック スチール	1,000	467.00	467,000	
パイオラックス	300	1,556.00	466,800	
エイチワン	1,000	722.00	722,000	
日本発條	3,100	856.00	2,653,600	
三益半導体工業	900	2,325.00	2,092,500	
日本製鋼所	3,100	2,633.00	8,162,300	
三浦工業	5,100	5,080.00	25,908,000	
タクマ	2,600	1,722.00	4,477,200	
ツガミ	2,400	1,620.00	3,888,000	
オークマ	1,300	5,320.00	6,916,000	
芝浦機械	1,200	2,717.00	3,260,400	
アマダ	16,400	1,148.00	18,827,200	
アイダエンジニアリング	3,100	1,052.00	3,261,200	
滝澤鉄工所	200	1,138.00	227,600	
F U J I	4,600	2,830.00	13,018,000	
牧野フライス製作所	1,200	4,250.00	5,100,000	
オーエスジー	5,800	2,041.00	11,837,800	
旭ダイヤモンド工業	2,200	531.00	1,168,200	
D M G 森精機	6,600	1,871.00	12,348,600	
ソディック	2,600	1,024.00	2,662,400	
ディスコ	1,700	31,300.00	53,210,000	
日東工器	800	1,939.00	1,551,200	
日進工具	800	1,502.00	1,201,600	
パンチ工業	800	558.00	446,400	

富士ダイス	300	662.00	198,600
豊和工業	800	822.00	657,600
OKK	700	412.00	288,400
石川製作所	200	1,657.00	331,400
東洋機械金属	900	493.00	443,700
津田駒工業	200	868.00	173,600
エンシュウ	200	842.00	168,400
島精機製作所	1,500	2,082.00	3,123,000
オプトラ	1,400	2,142.00	2,998,800
NCホールディングス	200	1,207.00	241,400
フリュー	1,200	1,685.00	2,022,000
ヤマシンフィルタ	2,100	659.00	1,383,900
日阪製作所	1,300	819.00	1,064,700
やまびこ	2,100	1,268.00	2,662,800
平田機工	600	6,640.00	3,984,000
ペガサスミシン製造	1,000	460.00	460,000
マルマエ	200	1,999.00	399,800
タツモ	400	1,538.00	615,200
ナプテスコ	7,200	4,375.00	31,500,000
三井海洋開発	1,200	1,726.00	2,071,200
レオン自動機	1,000	1,515.00	1,515,000
SMC	2,600	71,270.00	185,302,000
ホソカワミクロン	300	6,710.00	2,013,000
ユニオンツール	300	4,055.00	1,216,500
オイレス工業	1,200	1,626.00	1,951,200
日精エー・エス・ビー機械	200	4,365.00	873,000
サトーホールディングス	1,000	2,803.00	2,803,000
技研製作所	900	4,545.00	4,090,500
日本エアーテック	400	1,188.00	475,200
カワタ	200	888.00	177,600
日精樹脂工業	1,100	1,204.00	1,324,400
オカダアイヨン	200	1,348.00	269,600
ワイエイシイホールディングス	300	926.00	277,800
小松製作所	50,100	2,814.50	141,006,450
住友重機械工業	4,900	3,125.00	15,312,500
日立建機	4,900	3,140.00	15,386,000
日工	1,400	676.00	946,400
巴工業	200	2,262.00	452,400
井関農機	1,200	1,720.00	2,064,000
TOWA	1,000	2,698.00	2,698,000

丸山製作所	200	1,674.00	334,800
北川鉄工所	400	1,636.00	654,400
ローツェ	600	8,110.00	4,866,000
クボタ	52,600	2,318.50	121,953,100
荏原実業	400	2,549.00	1,019,600
三菱化工機	300	2,403.00	720,900
月島機械	2,100	1,183.00	2,484,300
帝国電機製作所	1,000	1,278.00	1,278,000
東京機械製作所	700	1,204.00	842,800
新東工業	2,700	787.00	2,124,900
澁谷工業	900	3,000.00	2,700,000
アイチ コーポレーション	1,400	769.00	1,076,600
小森コーポレーション	3,500	838.00	2,933,000
住友精密工業	200	2,491.00	498,200
酒井重工業	200	2,531.00	506,200
荏原製作所	4,200	5,560.00	23,352,000
石井鐵工所	200	3,050.00	610,000
西島製作所	1,000	889.00	889,000
北越工業	1,100	1,099.00	1,208,900
ダイキン工業	13,000	26,000.00	338,000,000
オルガノ	500	6,140.00	3,070,000
トーヨーカネツ	300	2,537.00	761,100
栗田工業	5,900	5,060.00	29,854,000
椿本チエイン	1,200	3,385.00	4,062,000
大同工業	700	1,116.00	781,200
木村化工機	1,000	759.00	759,000
アネスト岩田	1,900	999.00	1,898,100
ダイフク	5,400	9,740.00	52,596,000
サムコ	200	3,020.00	604,000
加藤製作所	400	933.00	373,200
タダノ	3,800	1,185.00	4,503,000
フジテック	2,800	2,659.00	7,445,200
C K D	2,500	2,275.00	5,687,500
キトー	800	1,729.00	1,383,200
平和	2,700	1,996.00	5,389,200
理想科学工業	1,200	2,340.00	2,808,000
SANKYO	2,400	2,808.00	6,739,200
日本金銭機械	1,100	569.00	625,900
マースグループホールディングス	100	1,722.00	172,200
フクシマガリレイ	700	4,785.00	3,349,500

オーイズミ	700	393.00	275,100
ダイコク電機	800	907.00	725,600
竹内製作所	1,800	2,824.00	5,083,200
アマノ	2,700	2,760.00	7,452,000
J U K I	2,000	838.00	1,676,000
サンデンホールディングス	700	297.00	207,900
蛇の目マシン工業	200	697.00	139,400
マックス	1,500	1,879.00	2,818,500
グローリー	3,000	2,341.00	7,023,000
新晃工業	1,000	2,200.00	2,200,000
大和冷機工業	1,400	1,170.00	1,638,000
セガサミーホールディングス	10,700	1,428.00	15,279,600
日本ピストンリング	400	1,464.00	585,600
リケン	100	2,693.00	269,300
T P R	1,200	1,600.00	1,920,000
ツバキ・ナカシマ	1,200	1,646.00	1,975,200
ホシザキ	3,700	9,900.00	36,630,000
大豊工業	200	919.00	183,800
日本精工	16,800	849.00	14,263,200
N T N	17,600	271.00	4,769,600
ジェイテクト	4,400	1,041.00	4,580,400
不二越	800	4,605.00	3,684,000
日本トムソン	2,300	627.00	1,442,100
T H K	5,400	2,789.00	15,060,600
ユーシン精機	900	846.00	761,400
イーグル工業	1,200	1,304.00	1,564,800
日本ピラー工業	1,200	2,691.00	3,229,200
キッツ	5,100	857.00	4,370,700
マキタ	15,200	5,850.00	88,920,000
日立造船	7,100	826.00	5,864,600
三菱重工業	16,700	3,018.00	50,400,600
I H I	7,000	2,631.00	18,417,000
スター精密	1,600	1,563.00	2,500,800
日清紡ホールディングス	4,900	988.00	4,841,200
イビデン	4,100	5,750.00	23,575,000
コニカミノルタ	23,000	577.00	13,271,000
ブラザー工業	15,600	2,385.00	37,206,000
ミネベアミツミ	16,200	2,950.00	47,790,000
日立製作所	45,900	6,310.00	289,629,000
三菱電機	121,300	1,514.00	183,648,200

富士電機	5,600	4,820.00	26,992,000
東洋電機製造	700	1,138.00	796,600
安川電機	16,900	5,680.00	95,992,000
シンフォニアテクノロジー	1,400	1,238.00	1,733,200
明電舎	2,600	2,520.00	6,552,000
オリジン	200	1,296.00	259,200
山洋電気	400	7,150.00	2,860,000
デンヨー	1,200	2,028.00	2,433,600
東芝テック	1,400	4,605.00	6,447,000
芝浦メカトロニクス	100	6,920.00	692,000
マブチモーター	2,400	3,970.00	9,528,000
日本電産	24,900	12,755.00	317,599,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	862.00	603,400
トレックス・セミコンダクター	700	2,791.00	1,953,700
東光高岳	400	1,488.00	595,200
ダブル・スコープ	3,200	663.00	2,121,600
宮越ホールディングス	200	1,065.00	213,000
ダイヘン	1,000	4,880.00	4,880,000
ヤーマン	2,000	1,110.00	2,220,000
JVCケンウッド	8,100	221.00	1,790,100
ミマキエンジニアリング	1,100	945.00	1,039,500
I - P E X	300	2,149.00	644,700
日新電機	2,200	1,269.00	2,791,800
大崎電気工業	2,500	577.00	1,442,500
オムロン	11,500	9,860.00	113,390,000
日東工業	2,000	1,766.00	3,532,000
I D E C	1,400	2,291.00	3,207,400
正興電機製作所	200	1,473.00	294,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3,200	2,637.00	8,438,400
サクサホールディングス	100	1,347.00	134,700
メルコホールディングス	200	5,890.00	1,178,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	200	2,551.00	510,200
日本電気	12,900	5,620.00	72,498,000
富士通	8,900	19,380.00	172,482,000
沖電気工業	5,500	983.00	5,406,500
岩崎通信機	700	957.00	669,900
電気興業	300	2,316.00	694,800
サンケン電気	1,100	4,995.00	5,494,500
ルネサスエレクトロニクス	5,600	1,150.00	6,440,000

セイコーエプソン	14,600	2,090.00	30,514,000
ワコム	8,600	767.00	6,596,200
アルバック	2,100	5,770.00	12,117,000
アクセル	300	803.00	240,900
E I Z O	800	4,350.00	3,480,000
ジャパンディスプレイ	29,800	37.00	1,102,600
日本信号	2,400	926.00	2,222,400
京三製作所	3,500	428.00	1,498,000
能美防災	1,500	2,064.00	3,096,000
ホーチキ	900	1,114.00	1,002,600
エレコム	2,400	1,743.00	4,183,200
パナソニック	29,000	1,358.50	39,396,500
シャープ	15,700	1,545.00	24,256,500
アンリツ	9,000	1,892.00	17,028,000
富士通ゼネラル	900	2,831.00	2,547,900
ソニーグループ	88,800	11,165.00	991,452,000
T D K	4,600	11,880.00	54,648,000
タムラ製作所	3,800	770.00	2,926,000
アルプスアルパイン	9,600	1,128.00	10,828,800
池上通信機	200	808.00	161,600
日本電波工業	1,100	802.00	882,200
鈴木	700	868.00	607,600
日本トリム	200	3,890.00	778,000
ローランド ディー . ジー .	700	3,110.00	2,177,000
フォスター電機	1,300	893.00	1,160,900
S M K	200	2,363.00	472,600
ヨコオ	800	2,594.00	2,075,200
ティアック	1,200	121.00	145,200
ホシデン	2,400	950.00	2,280,000
ヒロセ電機	1,800	17,270.00	31,086,000
日本航空電子工業	2,200	1,659.00	3,649,800
T O A	1,200	839.00	1,006,800
マクセルホールディングス	2,100	1,383.00	2,904,300
古野電気	1,200	1,088.00	1,305,600
ユニデンホールディングス	200	2,653.00	530,600
スミダコーポレーション	700	1,473.00	1,031,100
アイコム	700	2,420.00	1,694,000
リオン	400	2,623.00	1,049,200
本多通信工業	900	481.00	432,900
横河電機	12,400	1,769.00	21,935,600

新電元工業	300	4,545.00	1,363,500
アズビル	9,100	4,520.00	41,132,000
日本光電工業	4,800	3,545.00	17,016,000
日本電子材料	700	1,864.00	1,304,800
堀場製作所	2,400	8,000.00	19,200,000
アドバンテスト	10,300	9,270.00	95,481,000
エスペック	1,000	2,237.00	2,237,000
キーエンス	11,700	64,370.00	753,129,000
日置電機	600	8,420.00	5,052,000
シスメックス	10,000	11,970.00	119,700,000
日本マイクロニクス	1,400	1,418.00	1,985,200
メガチップス	1,100	3,145.00	3,459,500
O B A R A G R O U P	500	4,030.00	2,015,000
澤藤電機	100	2,015.00	201,500
コーセル	1,100	1,036.00	1,139,600
イリソ電子工業	700	4,970.00	3,479,000
オブテックスグループ	1,600	1,524.00	2,438,400
千代田インテグレ	700	1,879.00	1,315,300
アイ・オー・データ機器	200	912.00	182,400
レーザーテック	4,900	20,410.00	100,009,000
スタンレー電気	2,800	2,945.00	8,246,000
岩崎電気	300	2,003.00	600,900
ウシオ電機	6,000	1,950.00	11,700,000
岡谷電機産業	900	351.00	315,900
ヘリオス テクノ ホールディング	1,000	341.00	341,000
エノモト	200	1,684.00	336,800
日本セラミック	900	2,954.00	2,658,600
遠藤照明	700	826.00	578,200
古河電池	200	1,553.00	310,600
双信電機	600	816.00	489,600
山一電機	900	1,738.00	1,564,200
函研	800	3,355.00	2,684,000
日本電子	2,000	7,270.00	14,540,000
カシオ計算機	9,700	1,861.00	18,051,700
ファナック	10,600	24,450.00	259,170,000
日本シイエムケイ	2,300	394.00	906,200
エンプラス	300	3,175.00	952,500
大真空	300	3,365.00	1,009,500
ローム	500	10,130.00	5,065,000
浜松ホトニクス	7,100	6,180.00	43,878,000

三井ハイテック	100	6,640.00	664,000
新光電気工業	300	3,495.00	1,048,500
京セラ	15,200	6,813.00	103,557,600
太陽誘電	4,000	5,840.00	23,360,000
村田製作所	27,800	9,064.00	251,979,200
双葉電子工業	1,400	795.00	1,113,000
北陸電気工業	400	1,092.00	436,800
ニチコン	2,600	1,041.00	2,706,600
日本ケミコン	400	2,143.00	857,200
K O A	1,200	1,709.00	2,050,800
市光工業	700	656.00	459,200
小糸製作所	2,900	7,010.00	20,329,000
ミツバ	700	684.00	478,800
S C R E E Nホールディングス	2,400	9,740.00	23,376,000
キャノン電子	1,100	1,589.00	1,747,900
キャノン	58,400	2,638.00	154,059,200
リコー	28,600	1,120.00	32,032,000
象印マホービン	300	1,580.00	474,000
M U T O Hホールディングス	100	1,600.00	160,000
東京エレクトロン	8,400	44,500.00	373,800,000
トヨタ紡織	3,600	2,142.00	7,711,200
芦森工業	100	1,060.00	106,000
ユニプレス	800	1,001.00	800,800
豊田自動織機	4,200	9,640.00	40,488,000
モリタホールディングス	2,400	1,544.00	3,705,600
三櫻工業	1,200	1,387.00	1,664,400
デンソー	25,900	7,820.00	202,538,000
東海理化電機製作所	1,000	1,698.00	1,698,000
三井E & Sホールディングス	3,600	536.00	1,929,600
川崎重工業	8,100	2,446.00	19,812,600
名村造船所	3,200	290.00	928,000
サノヤスホールディングス	1,500	147.00	220,500
日本車輛製造	300	2,108.00	632,400
三菱ロジスネクスト	1,000	940.00	940,000
近畿車輛	200	1,177.00	235,400
日産自動車	139,100	616.90	85,810,790
いすゞ自動車	41,000	1,503.00	61,623,000
トヨタ自動車	133,600	9,965.00	1,331,324,000
日野自動車	15,800	953.00	15,057,400
三菱自動車工業	49,100	305.00	14,975,500

エフテック	200	696.00	139,200
G M B	200	942.00	188,400
武蔵精密工業	800	2,125.00	1,700,000
日産車体	2,700	716.00	1,933,200
新明和工業	3,200	937.00	2,998,400
極東開発工業	2,200	1,633.00	3,592,600
トピー工業	800	1,206.00	964,800
ティラド	100	3,285.00	328,500
曙ブレーキ工業	1,700	189.00	321,300
タチエス	700	1,426.00	998,200
N O K	5,800	1,409.00	8,172,200
フタバ産業	2,900	499.00	1,447,100
K Y B	1,100	3,345.00	3,679,500
大同メタル工業	800	601.00	480,800
プレス工業	1,400	365.00	511,000
ミクニ	1,700	316.00	537,200
太平洋工業	900	1,259.00	1,133,100
河西工業	1,700	406.00	690,200
アイシン	2,900	4,385.00	12,716,500
マツダ	41,800	1,018.00	42,552,400
今仙電機製作所	200	704.00	140,800
本田技研工業	87,700	3,574.00	313,439,800
スズキ	23,500	4,889.00	114,891,500
S U B A R U	38,600	2,203.50	85,055,100
安永	700	1,134.00	793,800
ヤマハ発動機	7,100	2,865.00	20,341,500
T B K	1,100	407.00	447,700
エクセディ	600	1,690.00	1,014,000
豊田合成	1,600	2,436.00	3,897,600
愛三工業	2,000	908.00	1,816,000
日本プラスト	900	641.00	576,900
ヨロズ	200	1,245.00	249,000
エフ・シー・シー	700	1,541.00	1,078,700
シマノ	900	31,850.00	28,665,000
テイ・エス テック	5,000	1,589.00	7,945,000
ジャムコ	700	1,075.00	752,500
テルモ	33,300	4,357.00	145,088,100
日機装	2,600	1,008.00	2,620,800
日本エム・ディ・エム	600	2,183.00	1,309,800
島津製作所	17,800	4,675.00	83,215,000

J M S	900	762.00	685,800
長野計器	800	1,112.00	889,600
ブイ・テクノロジー	500	4,790.00	2,395,000
東京計器	700	1,002.00	701,400
インターアクション	100	2,561.00	256,100
オーバル	1,000	272.00	272,000
東京精密	1,900	4,715.00	8,958,500
マニー	4,200	2,281.00	9,580,200
ニコン	17,900	1,146.00	20,513,400
トプコン	5,900	1,723.00	10,165,700
オリンパス	52,700	2,239.50	118,021,650
理研計器	1,000	2,700.00	2,700,000
タムロン	900	2,595.00	2,335,500
H O Y A	20,200	17,350.00	350,470,000
シード	700	723.00	506,100
ノーリツ鋼機	800	2,479.00	1,983,200
エー・アンド・デイ	1,000	1,084.00	1,084,000
朝日インテック	10,800	3,010.00	32,508,000
シチズン時計	12,800	438.00	5,606,400
大研医器	1,000	534.00	534,000
メニコン	1,600	8,270.00	13,232,000
シンシア	100	583.00	58,300
松風	200	2,013.00	402,600
セイコーホールディングス	1,400	2,213.00	3,098,200
ニプロ	6,800	1,277.00	8,683,600
中本パックス	100	1,726.00	172,600
スノーピーク	100	4,985.00	498,500
パラマウントベッドホールディングス	2,000	2,009.00	4,018,000
トランザクション	200	1,129.00	225,800
ニホンフラッシュ	900	1,256.00	1,130,400
前田工織	1,000	3,600.00	3,600,000
アートネイチャー	900	702.00	631,800
バンダイナムコホールディングス	12,800	7,409.00	94,835,200
共立印刷	500	163.00	81,500
S H O E I	1,000	4,775.00	4,775,000
フランスベッドホールディングス	2,000	933.00	1,866,000
パイロットコーポレーション	1,300	4,150.00	5,395,000
萩原工業	100	1,451.00	145,100
トッパン・フォームズ	1,700	1,029.00	1,749,300
フジシールインターナショナル	2,600	2,486.00	6,463,600

タカラトミー	5,100	1,081.00	5,513,100
廣濟堂	100	789.00	78,900
大建工業	1,200	2,451.00	2,941,200
凸版印刷	10,800	1,892.00	20,433,600
大日本印刷	9,000	2,525.00	22,725,000
N I S S H A	2,100	1,789.00	3,756,900
T A K A R A & C O M P A N Y	400	1,729.00	691,600
アシックス	10,900	2,669.00	29,092,100
ローランド	700	5,380.00	3,766,000
小松ウオール工業	200	1,940.00	388,000
ヤマハ	6,900	6,350.00	43,815,000
河合楽器製作所	300	4,095.00	1,228,500
ピジョン	8,500	3,295.00	28,007,500
兼松サステック	100	1,807.00	180,700
リンテック	2,300	2,492.00	5,731,600
イトーキ	100	375.00	37,500
任天堂	5,300	52,440.00	277,932,000
三菱鉛筆	1,300	1,458.00	1,895,400
タカラスタANDARD	2,400	1,693.00	4,063,200
コクヨ	4,000	1,899.00	7,596,000
グローブライド	100	8,010.00	801,000
オカムラ	2,500	1,723.00	4,307,500
美津濃	1,200	2,710.00	3,252,000
東京電力ホールディングス	74,700	290.00	21,663,000
中部電力	24,600	1,351.50	33,246,900
関西電力	29,900	1,104.00	33,009,600
中国電力	11,600	1,023.00	11,866,800
北陸電力	4,600	589.00	2,709,400
東北電力	18,200	853.00	15,524,600
四国電力	5,800	749.00	4,344,200
九州電力	17,500	853.00	14,927,500
北海道電力	5,800	505.00	2,929,000
沖縄電力	1,100	1,419.00	1,560,900
電源開発	1,400	1,658.00	2,321,200
エフオン	100	1,203.00	120,300
イーレックス	300	2,464.00	739,200
レノバ	2,500	4,575.00	11,437,500
東京瓦斯	32,900	2,169.50	71,376,550
大阪瓦斯	25,200	2,113.00	53,247,600
東邦瓦斯	8,700	5,450.00	47,415,000

西部ガスホールディングス	2,800	2,455.00	6,874,000	
静岡ガス	4,400	1,208.00	5,315,200	
メタウォーター	900	1,889.00	1,700,100	
SBSホールディングス	1,200	3,645.00	4,374,000	
東武鉄道	8,800	2,839.00	24,983,200	
相鉄ホールディングス	3,700	2,149.00	7,951,300	
東急	38,300	1,490.00	57,067,000	
京浜急行電鉄	10,700	1,325.00	14,177,500	
小田急電鉄	18,500	2,584.00	47,804,000	
京王電鉄	9,500	6,080.00	57,760,000	
京成電鉄	10,100	3,275.00	33,077,500	
富士急行	1,400	4,625.00	6,475,000	
東日本旅客鉄道	18,000	7,262.00	130,716,000	
西日本旅客鉄道	9,400	5,853.00	55,018,200	
東海旅客鉄道	8,800	16,000.00	140,800,000	
西武ホールディングス	9,300	1,249.00	11,615,700	
鴻池運輸	2,200	1,325.00	2,915,000	
西日本鉄道	2,300	2,740.00	6,302,000	
ハマキョウレックス	700	3,260.00	2,282,000	
サカイ引越センター	500	4,840.00	2,420,000	
近鉄グループホールディングス	12,900	3,660.00	47,214,000	
阪急阪神ホールディングス	13,800	3,295.00	45,471,000	
南海電気鉄道	5,000	2,306.00	11,530,000	
京阪ホールディングス	6,200	2,970.00	18,414,000	
名古屋鉄道	6,800	1,865.00	12,682,000	
日本通運	4,900	8,500.00	41,650,000	
ヤマトホールディングス	18,200	2,965.00	53,963,000	
山九	1,300	5,000.00	6,500,000	
丸全昭和運輸	900	3,320.00	2,988,000	
センコーグループホールディングス	9,400	1,069.00	10,048,600	
トナミホールディングス	200	4,755.00	951,000	
ニッコンホールディングス	2,600	2,417.00	6,284,200	
福山通運	1,000	4,505.00	4,505,000	
セイノーホールディングス	5,700	1,394.00	7,945,800	
日立物流	3,000	4,415.00	13,245,000	
丸和運輸機関	2,700	1,415.00	3,820,500	
C&Fロジホールディングス	800	1,730.00	1,384,000	
九州旅客鉄道	7,400	2,437.00	18,033,800	
SGホールディングス	15,500	3,110.00	48,205,000	
日本郵船	5,800	8,040.00	46,632,000	

商船三井	1,600	7,300.00	11,680,000	
川崎汽船	1,000	4,975.00	4,975,000	
N S ユナイテッド海運	200	3,310.00	662,000	
飯野海運	2,300	519.00	1,193,700	
日本航空	16,400	2,253.00	36,949,200	
A N A ホールディングス	19,200	2,575.50	49,449,600	
パスコ	200	1,397.00	279,400	
ランコム	400	8,430.00	3,372,000	
日新	1,400	1,479.00	2,070,600	
三菱倉庫	4,900	3,195.00	15,655,500	
三井倉庫ホールディングス	1,300	2,687.00	3,493,100	
住友倉庫	2,500	1,723.00	4,307,500	
ファイズホールディングス	200	722.00	144,400	
東洋埠頭	200	1,486.00	297,200	
上組	4,400	2,268.00	9,979,200	
キューソー流通システム	200	1,685.00	337,000	
近鉄エクスプレス	1,100	2,594.00	2,853,400	
東海運	700	341.00	238,700	
エーアイテイー	1,000	1,114.00	1,114,000	
内外トランスライン	400	2,105.00	842,000	
N E C ネットエスアイ	3,600	1,936.00	6,969,600	
クロスキャット	200	1,007.00	201,400	
システナ	3,700	2,088.00	7,725,600	
デジタルアーツ	600	8,240.00	4,944,000	
日鉄ソリューションズ	1,400	3,670.00	5,138,000	
キューブシステム	600	1,039.00	623,400	
W O W W O R L D	200	1,577.00	315,400	
コア	400	1,525.00	610,000	
ラクーンホールディングス	400	2,427.00	970,800	
ソリトンシステムズ	300	1,410.00	423,000	
ソフトクリエイイトホールディングス	500	2,964.00	1,482,000	
T I S	9,700	2,809.00	27,247,300	
J N S ホールディングス	200	509.00	101,800	
グリー	7,000	633.00	4,431,000	
G M O ペパボ	100	3,560.00	356,000	
コーエーテクモホールディングス	2,800	4,805.00	13,454,000	
三菱総合研究所	400	4,025.00	1,610,000	
ボルテージ	200	481.00	96,200	
ファインデックス	1,200	1,048.00	1,257,600	
ブレインパッド	200	4,800.00	960,000	

K L a b	3,100	624.00	1,934,400	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,400	1,059.00	1,482,600	
イーブックイニシアティブジャパン	100	3,810.00	381,000	
ネクソン	36,200	2,267.00	82,065,400	
アイスタイル	3,000	439.00	1,317,000	
エムアップホールディングス	200	3,020.00	604,000	
エイチーム	1,000	1,474.00	1,474,000	
エニグモ	1,000	1,461.00	1,461,000	
テクノスジャパン	800	608.00	486,400	
e n i s h	700	557.00	389,900	
コロプラ	5,600	799.00	4,474,400	
オルトプラス	900	461.00	414,900	
ブロードリーフ	7,300	509.00	3,715,700	
デジタルハーツホールディングス	700	1,723.00	1,206,100	
システム情報	800	922.00	737,600	
メディアドゥ	300	4,735.00	1,420,500	
じげん	2,400	427.00	1,024,800	
ブイキューブ	800	2,193.00	1,754,400	
サイバーリンクス	400	1,371.00	548,400	
ディー・エル・イー	200	353.00	70,600	
フィックスターズ	1,000	771.00	771,000	
C A R T A H O L D I N G S	300	1,938.00	581,400	
オブティム	800	1,901.00	1,520,800	
セレス	200	2,641.00	528,200	
S H I F T	400	21,230.00	8,492,000	
ティーガイア	1,200	1,962.00	2,354,400	
セック	200	2,455.00	491,000	
日本アジアグループ	1,000	963.00	963,000	
テクマトリックス	1,400	1,658.00	2,321,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,400	2,070.00	9,108,000	
GMOペイメントゲートウェイ	3,400	12,990.00	44,166,000	
ザッパラス	600	563.00	337,800	
システムリサーチ	200	1,945.00	389,000	
インターネットイニシアティブ	3,000	3,390.00	10,170,000	
さくらインターネット	1,100	607.00	667,700	
ヴィンクス	200	937.00	187,400	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	3,855.00	1,156,500	
S R Aホールディングス	400	2,738.00	1,095,200	

システムインテグレータ	300	620.00	186,000
朝日ネット	800	728.00	582,400
e B A S E	1,200	806.00	967,200
アバント	1,200	1,566.00	1,879,200
アドソル日進	400	1,971.00	788,400
フリービット	700	802.00	561,400
コムチュア	1,000	2,564.00	2,564,000
サイバーコム	200	1,306.00	261,200
アステリア	800	616.00	492,800
アイル	800	1,635.00	1,308,000
マークライズ	400	2,598.00	1,039,200
メディカル・データ・ビジョン	1,000	1,748.00	1,748,000
g u m i	1,600	808.00	1,292,800
ショーケース	200	698.00	139,600
モバイルファクトリー	200	1,072.00	214,400
テラスカイ	300	1,910.00	573,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	300	1,895.00	568,500
P C Iホールディングス	200	1,091.00	218,200
パイプドHD	100	2,153.00	215,300
アイビーシー	200	945.00	189,000
ネオジャパン	200	1,388.00	277,600
P R T I M E S	200	2,985.00	597,000
ダブルスタンダード	200	5,230.00	1,046,000
オープンドア	700	2,135.00	1,494,500
マイネット	300	681.00	204,300
アカツキ	500	3,085.00	1,542,500
ベネフィットジャパン	100	2,367.00	236,700
U b i c o mホールディングス	200	3,000.00	600,000
カナミックネットワーク	1,000	620.00	620,000
チェンジ	1,800	2,262.00	4,071,600
シンクロ・フード	500	365.00	182,500
セグエグループ	200	884.00	176,800
エイトレッド	200	2,195.00	439,000
A O I T Y O H o l d i n g s	1,000	898.00	898,000
マクロミル	1,900	771.00	1,464,900
ビーグリー	200	1,395.00	279,000
オロ	200	3,470.00	694,000
ユーザーローカル	200	1,809.00	361,800
テモナ	200	850.00	170,000

サインポスト	200	672.00	134,400
電算システムホールディングス	300	2,700.00	810,000
ソルクシーズ	300	923.00	276,900
プロトコーポレーション	900	1,412.00	1,270,800
野村総合研究所	20,800	3,725.00	77,480,000
サイバネットシステム	900	682.00	613,800
C Eホールディングス	700	543.00	380,100
インテージホールディングス	1,100	1,318.00	1,449,800
ソースネクスト	5,600	293.00	1,640,800
インフォコム	900	2,328.00	2,095,200
HEROZ	200	1,931.00	386,200
ラクスル	600	5,230.00	3,138,000
I P S	100	2,509.00	250,900
F I G	1,200	279.00	334,800
システムサポート	200	1,358.00	271,600
イーソル	700	988.00	691,600
アルテリア・ネットワークス	1,300	1,879.00	2,442,700
E d u L a b	100	3,075.00	307,500
東海ソフト	100	1,267.00	126,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	100	1,952.00	195,200
ヴィッツ	100	1,624.00	162,400
トビラシステムズ	100	1,224.00	122,400
L i n k - U	100	1,426.00	142,600
ギフトィ	400	3,025.00	1,210,000
ベース	100	4,475.00	447,500
フォーカスシステムズ	800	952.00	761,600
クレスコ	800	1,907.00	1,525,600
フジ・メディア・ホールディングス	17,200	1,164.00	20,020,800
オービック	3,100	20,270.00	62,837,000
ジャストシステム	2,600	5,850.00	15,210,000
Zホールディングス	149,900	626.30	93,882,370
トレンドマイクロ	6,400	5,750.00	36,800,000
I Dホールディングス	400	931.00	372,400
日本オラクル	2,400	8,700.00	20,880,000
フューチャー	1,100	2,147.00	2,361,700
C A C H o l d i n g s	700	1,563.00	1,094,100
S Bテクノロジー	200	2,868.00	573,600
トーセ	300	797.00	239,100
オービックビジネスコンサルタント	1,500	5,700.00	8,550,000

伊藤忠テクノソリューションズ	5,000	3,310.00	16,550,000
アイティフォー	1,400	824.00	1,153,600
東計電算	200	4,815.00	963,000
大塚商会	6,100	5,690.00	34,709,000
サイボウズ	1,100	2,190.00	2,409,000
電通国際情報サービス	1,400	4,200.00	5,880,000
A C C E S S	900	896.00	806,400
デジタルガレージ	1,800	4,835.00	8,703,000
E Mシステムズ	1,900	814.00	1,546,600
ウェザーニューズ	300	5,710.00	1,713,000
C I J	800	849.00	679,200
日本エンタープライズ	1,000	203.00	203,000
WOWOW	800	2,360.00	1,888,000
スカラ	700	752.00	526,400
インテリジェント ウェイブ	700	607.00	424,900
I M A G I C A G R O U P	900	487.00	438,300
ネットワンシステムズ	3,800	3,430.00	13,034,000
システムソフト	2,400	205.00	492,000
アルゴグラフィックス	1,000	3,265.00	3,265,000
マーベラス	1,200	689.00	826,800
エイベックス	1,600	1,521.00	2,433,600
日本ユニシス	5,900	2,903.00	17,127,700
兼松エレクトロニクス	600	3,615.00	2,169,000
T B Sホールディングス	10,500	1,658.00	17,409,000
日本テレビホールディングス	8,400	1,224.00	10,281,600
テレビ朝日ホールディングス	5,000	1,693.00	8,465,000
スカパーJ S A Tホールディングス	9,300	407.00	3,785,100
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,103.00	2,103,000
ビジョン	1,100	1,212.00	1,333,200
スマートバリュー	200	681.00	136,200
U S E N - N E X T H O L D I N G S	400	2,745.00	1,098,000
ワイヤレスゲート	400	426.00	170,400
コネクシオ	900	1,550.00	1,395,000
日本通信	9,500	207.00	1,966,500
日本電信電話	101,000	2,913.50	294,263,500
K D D I	99,700	3,373.00	336,288,100
ソフトバンク	92,200	1,478.50	136,317,700
光通信	1,400	19,320.00	27,048,000
エムティーアイ	1,200	689.00	826,800

GMOインターネット	4,000	2,749.00	10,996,000	
ファイバーゲート	200	1,391.00	278,200	
KADOKAWA	2,800	4,935.00	13,818,000	
学研ホールディングス	1,400	1,227.00	1,717,800	
ゼンリン	2,000	1,073.00	2,146,000	
松竹	600	12,340.00	7,404,000	
東宝	5,500	4,710.00	25,905,000	
東映	300	19,500.00	5,850,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	26,800	1,777.00	47,623,600	
ピー・シー・エー	200	5,350.00	1,070,000	
D T S	2,100	2,564.00	5,384,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,000	6,210.00	31,050,000	
シーイーシー	1,100	1,588.00	1,746,800	
カプコン	9,600	2,929.00	28,118,400	
アイ・エス・ビー	400	1,186.00	474,400	
ジャステック	800	1,216.00	972,800	
S C S K	2,500	6,550.00	16,375,000	
日本システムウエア	200	2,296.00	459,200	
アイネス	1,200	1,415.00	1,698,000	
T K C	1,600	3,500.00	5,600,000	
富士ソフト	1,700	5,730.00	9,741,000	
N S D	3,300	1,894.00	6,250,200	
コナミホールディングス	3,100	6,480.00	20,088,000	
福井コンピュータホールディングス	400	4,040.00	1,616,000	
J B C Cホールディングス	800	1,451.00	1,160,800	
ミロク情報サービス	1,000	1,498.00	1,498,000	
ソフトバンクグループ	74,800	6,647.00	497,195,600	
エレマテック	1,000	1,140.00	1,140,000	
J A L U X	200	1,636.00	327,200	
あらた	900	4,325.00	3,892,500	
トーメンデバイス	200	4,865.00	973,000	
東京エレクトロン デバイス	400	5,270.00	2,108,000	
フィールズ	1,000	520.00	520,000	
双日	55,400	327.00	18,115,800	
アルフレッサ ホールディングス	13,300	1,725.00	22,942,500	
横浜冷凍	1,200	916.00	1,099,200	
神栄	200	1,032.00	206,400	
ラサ商事	800	898.00	718,400	
アルコニックス	1,200	1,601.00	1,921,200	

神戸物産	3,200	4,085.00	13,072,000	
ハイパー	200	541.00	108,200	
あいホールディングス	1,300	2,145.00	2,788,500	
ダイワボウホールディングス	4,500	2,107.00	9,481,500	
マクニカ・富士エレホールディングス	2,600	2,694.00	7,004,400	
ラクト・ジャパン	200	2,621.00	524,200	
グリムス	200	2,784.00	556,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,200	771.00	1,696,200	
レスターホールディングス	900	1,964.00	1,767,600	
TOKAIホールディングス	4,300	900.00	3,870,000	
三洋貿易	1,300	1,175.00	1,527,500	
ビューティガレージ	200	4,175.00	835,000	
ミタチ産業	600	802.00	481,200	
シップヘルスケアホールディングス	4,000	2,731.00	10,924,000	
明治電機工業	300	1,347.00	404,100	
スターティアホールディングス	200	2,008.00	401,600	
コメダホールディングス	1,700	2,053.00	3,490,100	
ピーバンドットコム	100	743.00	74,300	
アセンテック	200	1,094.00	218,800	
富士興産	200	1,009.00	201,800	
小野建	1,200	1,560.00	1,872,000	
佐島電機	800	842.00	673,600	
伯東	700	1,686.00	1,180,200	
ナガイレーベン	1,200	2,610.00	3,132,000	
三菱食品	1,200	2,834.00	3,400,800	
松田産業	100	2,600.00	260,000	
第一興商	1,100	3,800.00	4,180,000	
メディパルホールディングス	10,700	2,141.00	22,908,700	
萩原電気ホールディングス	400	2,318.00	927,200	
アズワン	900	15,290.00	13,761,000	
ドウシシャ	900	1,702.00	1,531,800	
たけびし	200	1,550.00	310,000	
丸文	1,200	742.00	890,400	
ハピネット	800	1,457.00	1,165,600	
日本ライフライン	3,200	1,364.00	4,364,800	
タカショー	500	985.00	492,500	
IDOM	2,200	959.00	2,109,800	
エスケイジャパン	400	451.00	180,400	
ダイトロン	400	2,178.00	871,200	

シークス	1,300	1,306.00	1,697,800
伊藤忠商事	60,600	3,410.00	206,646,000
丸紅	73,500	926.10	68,068,350
高島	200	1,787.00	357,400
長瀬産業	4,600	1,829.00	8,413,400
蝶理	900	1,948.00	1,753,200
豊田通商	10,200	5,470.00	55,794,000
兼松	5,000	1,462.00	7,310,000
三井物産	80,000	2,633.50	210,680,000
日本紙パルプ商事	600	3,705.00	2,223,000
カメイ	1,900	1,175.00	2,232,500
東都水産	100	4,660.00	466,000
スターゼン	200	2,240.00	448,000
山善	5,900	1,074.00	6,336,600
住友商事	79,400	1,584.00	125,769,600
内田洋行	300	5,130.00	1,539,000
三菱商事	52,700	3,308.00	174,331,600
第一実業	400	4,715.00	1,886,000
キャノンマーケティングジャパン	3,600	2,512.00	9,043,200
西華産業	900	1,669.00	1,502,100
菱洋エレクトロ	1,200	2,311.00	2,773,200
ユアサ商事	1,400	3,055.00	4,277,000
神鋼商事	200	3,135.00	627,000
阪和興業	2,500	3,615.00	9,037,500
正栄食品工業	700	4,020.00	2,814,000
菱電商事	700	1,778.00	1,244,600
岩谷産業	2,200	6,440.00	14,168,000
極東貿易	200	2,322.00	464,400
アステナホールディングス	1,200	574.00	688,800
三愛石油	3,200	1,325.00	4,240,000
稲畑産業	2,600	1,708.00	4,440,800
G S Iクレオス	400	1,028.00	411,200
明和産業	1,200	466.00	559,200
ワキタ	2,500	1,014.00	2,535,000
東邦ホールディングス	3,500	1,912.00	6,692,000
サンゲツ	3,400	1,576.00	5,358,400
ミツウロコグループホールディングス	1,600	1,294.00	2,070,400
シナネンホールディングス	600	3,415.00	2,049,000
伊藤忠エネクス	3,200	995.00	3,184,000
サンリオ	3,200	2,217.00	7,094,400

サンワテクノス	1,000	1,299.00	1,299,000	
リョーサン	1,500	2,206.00	3,309,000	
新光商事	2,000	769.00	1,538,000	
三信電気	700	1,806.00	1,264,200	
東陽テクニカ	1,200	1,162.00	1,394,400	
モスフードサービス	1,100	3,135.00	3,448,500	
加賀電子	1,000	2,859.00	2,859,000	
立花エレテック	1,000	1,472.00	1,472,000	
PALTAC	1,600	4,925.00	7,880,000	
三谷産業	1,000	379.00	379,000	
太平洋興発	700	640.00	448,000	
西本Wismettacホールディングス	200	3,320.00	664,000	
コア商事ホールディングス	600	648.00	388,800	
ヤマタネ	400	1,557.00	622,800	
日鉄物産	400	5,050.00	2,020,000	
泉州電業	200	3,885.00	777,000	
トラスコ中山	3,000	2,850.00	8,550,000	
オートバックスセブン	3,800	1,528.00	5,806,400	
モリト	100	645.00	64,500	
加藤産業	1,400	3,295.00	4,613,000	
イノテック	700	1,417.00	991,900	
イエローハット	2,200	1,909.00	4,199,800	
日伝	1,200	2,324.00	2,788,800	
因幡電機産業	2,900	2,689.00	7,798,100	
東テク	300	2,482.00	744,600	
ミスミグループ本社	13,500	4,200.00	56,700,000	
アルテック	900	324.00	291,600	
タキヒヨー	200	1,851.00	370,200	
スズケン	4,600	3,260.00	14,996,000	
ジェコス	400	866.00	346,400	
ローソン	3,300	5,690.00	18,777,000	
サンエー	900	4,065.00	3,658,500	
カワチ薬品	800	2,263.00	1,810,400	
エービーシー・マート	1,800	6,250.00	11,250,000	
ハードオフコーポレーション	300	786.00	235,800	
アスクル	2,800	1,579.00	4,421,200	
ゲオホールディングス	1,200	1,201.00	1,441,200	
アダストリア	1,200	1,844.00	2,212,800	
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	200	411.00	82,200	

くら寿司	600	4,300.00	2,580,000
キャンドウ	700	1,920.00	1,344,000
アイケイ	200	624.00	124,800
パルグループホールディングス	800	1,584.00	1,267,200
エディオン	4,400	1,048.00	4,611,200
サーラコーポレーション	2,400	607.00	1,456,800
ハローズ	300	2,946.00	883,800
フジオフードグループ本社	700	1,350.00	945,000
あみやき亭	200	2,898.00	579,600
ひらまつ	1,500	190.00	285,000
大黒天物産	300	6,410.00	1,923,000
ハニーズホールディングス	900	1,075.00	967,500
アルペン	800	3,790.00	3,032,000
ハブ	200	692.00	138,400
クオールホールディングス	1,300	1,576.00	2,048,800
ジinzホールディングス	600	7,160.00	4,296,000
ビックカメラ	6,800	1,101.00	7,486,800
D C Mホールディングス	6,100	1,087.00	6,630,700
ペッパーフードサービス	700	382.00	267,400
MonotaRO	17,000	2,343.00	39,831,000
DDホールディングス	300	456.00	136,800
アークランドサービスホールディングス	700	2,304.00	1,612,800
J.フロント リテイリング	12,600	984.00	12,398,400
ドトール・日レスホールディングス	2,000	1,662.00	3,324,000
マツモトキヨシホールディングス	4,000	5,010.00	20,040,000
ブロンコビリー	300	2,418.00	725,400
Z O Z O	6,300	4,100.00	25,830,000
トレジャー・ファクトリー	200	911.00	182,200
物語コーポレーション	400	6,410.00	2,564,000
ココカラファイン	900	8,460.00	7,614,000
三越伊勢丹ホールディングス	20,600	753.00	15,511,800
Hamee	200	1,607.00	321,400
ウエルシアホールディングス	6,000	3,845.00	23,070,000
クリエイトSDホールディングス	1,500	3,735.00	5,602,500
チムニー	200	1,439.00	287,800
シュッピン	800	1,227.00	981,600
オイシックス・ラ・大地	1,100	4,065.00	4,471,500
ネクステージ	1,200	2,184.00	2,620,800
ジョイフル本田	3,100	1,486.00	4,606,600

鳥貴族ホールディングス	200	1,711.00	342,200
ホットランド	700	1,264.00	884,800
すかいらーくホールディングス	8,400	1,465.00	12,306,000
SFPホールディングス	300	1,431.00	429,300
綿半ホールディングス	600	1,231.00	738,600
ヨシックスホールディングス	100	2,142.00	214,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,200	1,099.00	3,516,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	1,668.00	1,167,600
B E E N O S	400	3,510.00	1,404,000
あさひ	1,000	1,322.00	1,322,000
日本調剤	900	1,731.00	1,557,900
コスモス薬品	1,100	18,940.00	20,834,000
セブン&アイ・ホールディングス	41,900	4,928.00	206,483,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,700	907.00	3,355,900
ツルハホールディングス	2,300	13,970.00	32,131,000
サンマルクホールディングス	800	1,539.00	1,231,200
トリドールホールディングス	2,200	2,070.00	4,554,000
T O K Y O B A S E	900	660.00	594,000
J Mホールディングス	900	2,120.00	1,908,000
サツドラホールディングス	200	2,107.00	421,400
アレンザホールディングス	200	1,383.00	276,600
串カツ田中ホールディングス	200	1,876.00	375,200
バロックジャパンリミテッド	900	871.00	783,900
クスリのアオキホールディングス	1,000	7,740.00	7,740,000
力の源ホールディングス	100	615.00	61,500
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	3,900	4,265.00	16,633,500
メディカルシステムネットワーク	1,100	826.00	908,600
ノジマ	1,400	2,727.00	3,817,800
カップ・クリエイト	1,200	1,362.00	1,634,400
ライトオン	800	758.00	606,400
良品計画	13,600	2,311.00	31,429,600
アドヴァングループ	1,500	902.00	1,353,000
アルビス	300	2,352.00	705,600
コナカ	1,100	351.00	386,100
G - 7ホールディングス	700	2,994.00	2,095,800
イオン北海道	600	1,106.00	663,600
コジマ	1,500	692.00	1,038,000
コーナン商事	1,200	3,815.00	4,578,000

エコス	300	1,940.00	582,000
ワタミ	1,000	920.00	920,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	21,600	2,320.00	50,112,000
西松屋チェーン	2,200	1,410.00	3,102,000
ゼンショーホールディングス	4,200	2,810.00	11,802,000
幸楽苑ホールディングス	400	1,480.00	592,000
サイゼリヤ	1,200	2,483.00	2,979,600
V Tホールディングス	3,400	507.00	1,723,800
ユナイテッドアローズ	1,000	1,891.00	1,891,000
ハイデイ日高	1,200	1,699.00	2,038,800
京都きもの友禅	900	257.00	231,300
コロワイド	2,500	2,038.00	5,095,000
ピーシーデポコーポレーション	1,400	482.00	674,800
壱番屋	400	4,875.00	1,950,000
スギホールディングス	2,000	8,460.00	16,920,000
薬王堂ホールディングス	400	2,498.00	999,200
ヴィア・ホールディングス	1,000	188.00	188,000
スクロール	1,500	882.00	1,323,000
ヨンドシーホールディングス	1,100	1,818.00	1,999,800
木曽路	1,000	2,314.00	2,314,000
S R Sホールディングス	1,000	810.00	810,000
千趣会	2,000	382.00	764,000
リテールパートナーズ	1,300	1,257.00	1,634,100
ケーヨー	2,000	839.00	1,678,000
上新電機	1,200	2,506.00	3,007,200
日本瓦斯	5,400	1,578.00	8,521,200
ロイヤルホールディングス	1,200	1,956.00	2,347,200
いなげや	1,400	1,470.00	2,058,000
チヨダ	1,200	870.00	1,044,000
ライフコーポレーション	900	4,135.00	3,721,500
リンガーハット	1,000	2,281.00	2,281,000
M r M a x H D	1,400	642.00	898,800
A O K Iホールディングス	1,900	641.00	1,217,900
オークワ	1,400	1,136.00	1,590,400
コメリ	1,600	2,637.00	4,219,200
青山商事	2,200	701.00	1,542,200
しまむら	1,100	10,620.00	11,682,000
高島屋	7,900	1,142.00	9,021,800
松屋	2,000	894.00	1,788,000

エイチ・ツー・オー リテイリング	4,400	819.00	3,603,600	
近鉄百貨店	200	3,045.00	609,000	
丸井グループ	8,700	1,945.00	16,921,500	
アクシアル リテイリング	900	3,985.00	3,586,500	
井筒屋	700	217.00	151,900	
イオン	46,300	3,062.00	141,770,600	
イズミ	2,300	3,675.00	8,452,500	
平和堂	900	2,145.00	1,930,500	
フジ	1,400	1,977.00	2,767,800	
ヤオコー	1,200	6,890.00	8,268,000	
ゼビオホールディングス	1,400	1,132.00	1,584,800	
ケースホールディングス	8,300	1,154.00	9,578,200	
Olympicグループ	300	760.00	228,000	
日産東京販売ホールディングス	1,700	248.00	421,600	
シルバーライフ	100	1,867.00	186,700	
Genky DrugStores	500	4,300.00	2,150,000	
ブックオフグループホールディングス	700	968.00	677,600	
ギフト	100	2,234.00	223,400	
アインホールディングス	1,600	7,150.00	11,440,000	
元気寿司	200	2,527.00	505,400	
ヤマダホールディングス	38,100	496.00	18,897,600	
アークランドサカモト	1,300	1,575.00	2,047,500	
ニトリホールディングス	3,500	21,760.00	76,160,000	
グルメ杵屋	700	982.00	687,400	
愛眼	1,000	224.00	224,000	
吉野家ホールディングス	2,600	2,061.00	5,358,600	
松屋フーズホールディングス	400	3,605.00	1,442,000	
サガミホールディングス	1,200	1,045.00	1,254,000	
関西スーパーマーケット	1,000	1,319.00	1,319,000	
王将フードサービス	500	5,920.00	2,960,000	
プレナス	1,000	2,048.00	2,048,000	
ミニストップ	900	1,462.00	1,315,800	
アークス	2,200	2,296.00	5,051,200	
パローホールディングス	2,300	2,404.00	5,529,200	
ベルク	400	5,960.00	2,384,000	
大庄	300	1,010.00	303,000	
ファーストリテイリング	1,300	75,430.00	98,059,000	
サンドラッグ	4,000	3,580.00	14,320,000	
サックスパー ホールディングス	800	568.00	454,400	
やまや	200	2,426.00	485,200	

ベルーナ	2,100	845.00	1,774,500	
じもとホールディングス	700	669.00	468,300	
めぶきフィナンシャルグループ	49,500	247.00	12,226,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,500	1,651.00	2,476,500	
九州フィナンシャルグループ	23,800	407.00	9,686,600	
ゆうちょ銀行	31,300	971.00	30,392,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	61,400	440.00	27,016,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,000	687.00	4,809,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,000	1,484.00	1,484,000	
第四北越フィナンシャルグループ	1,700	2,574.00	4,375,800	
ひろぎんホールディングス	11,500	615.00	7,072,500	
新生銀行	6,800	1,456.00	9,900,800	
あおぞら銀行	6,400	2,644.00	16,921,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	689,500	610.50	420,939,750	
りそなホールディングス	93,200	436.60	40,691,120	
三井住友トラスト・ホールディングス	19,400	3,720.00	72,168,000	
三井住友フィナンシャルグループ	70,700	3,873.00	273,821,100	
千葉銀行	35,900	691.00	24,806,900	
群馬銀行	20,100	365.00	7,336,500	
武蔵野銀行	1,400	1,768.00	2,475,200	
千葉興業銀行	3,200	271.00	867,200	
筑波銀行	5,500	174.00	957,000	
七十七銀行	3,900	1,229.00	4,793,100	
青森銀行	1,000	2,069.00	2,069,000	
秋田銀行	800	1,460.00	1,168,000	
山形銀行	1,200	870.00	1,044,000	
岩手銀行	700	1,686.00	1,180,200	
東邦銀行	10,500	216.00	2,268,000	
みちのく銀行	800	923.00	738,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	7,500	2,077.00	15,577,500	
静岡銀行	25,200	871.00	21,949,200	
十六銀行	1,100	2,130.00	2,343,000	
スルガ銀行	10,900	353.00	3,847,700	
八十二銀行	21,900	372.00	8,146,800	
山梨中央銀行	1,400	832.00	1,164,800	
大垣共立銀行	2,400	1,893.00	4,543,200	
福井銀行	1,000	1,454.00	1,454,000	
北國銀行	1,100	2,081.00	2,289,100	
清水銀行	400	1,599.00	639,600	

滋賀銀行	2,400	1,875.00	4,500,000	
南都銀行	1,500	2,019.00	3,028,500	
百五銀行	9,600	313.00	3,004,800	
京都銀行	3,600	4,945.00	17,802,000	
紀陽銀行	4,300	1,552.00	6,673,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	7,900	815.00	6,438,500	
山陰合同銀行	5,400	572.00	3,088,800	
中国銀行	9,300	871.00	8,100,300	
伊予銀行	15,200	583.00	8,861,600	
百十四銀行	1,200	1,597.00	1,916,400	
四国銀行	1,900	723.00	1,373,700	
阿波銀行	1,400	2,097.00	2,935,800	
大分銀行	800	1,790.00	1,432,000	
宮崎銀行	900	2,064.00	1,857,600	
佐賀銀行	800	1,428.00	1,142,400	
沖縄銀行	1,000	2,513.00	2,513,000	
琉球銀行	2,700	749.00	2,022,300	
セブン銀行	44,100	249.00	10,980,900	
みずほフィナンシャルグループ	109,900	1,630.50	179,191,950	
高知銀行	300	797.00	239,100	
山口フィナンシャルグループ	14,100	653.00	9,207,300	
名古屋銀行	800	2,491.00	1,992,800	
北洋銀行	16,600	255.00	4,233,000	
愛知銀行	400	3,385.00	1,354,000	
中京銀行	500	1,397.00	698,500	
愛媛銀行	1,500	776.00	1,164,000	
京葉銀行	5,000	430.00	2,150,000	
栃木銀行	5,900	174.00	1,026,600	
東和銀行	2,100	505.00	1,060,500	
福島銀行	1,000	250.00	250,000	
大東銀行	800	645.00	516,000	
トモニホールディングス	7,700	310.00	2,387,000	
フィデアホールディングス	11,200	125.00	1,400,000	
池田泉州ホールディングス	15,100	169.00	2,551,900	
F P G	2,600	714.00	1,856,400	
ジャパンインベストメントアドバイザ	500	1,444.00	722,000	
マーキュリアホールディングス	700	754.00	527,800	
S B Iホールディングス	15,000	2,748.00	41,220,000	
日本アジア投資	900	340.00	306,000	

ジャフコ グループ	1,600	6,470.00	10,352,000	
大和証券グループ本社	90,400	602.50	54,466,000	
野村ホールディングス	157,500	556.40	87,633,000	
岡三証券グループ	8,300	406.00	3,369,800	
丸三証券	3,100	624.00	1,934,400	
東洋証券	4,000	153.00	612,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	10,700	404.00	4,322,800	
光世証券	200	552.00	110,400	
水戸証券	3,100	299.00	926,900	
いちよし証券	1,900	612.00	1,162,800	
松井証券	5,800	804.00	4,663,200	
マネックスグループ	7,900	710.00	5,609,000	
極東証券	1,200	793.00	951,600	
岩井コスモホールディングス	1,000	1,411.00	1,411,000	
藍澤證券	2,100	1,088.00	2,284,800	
マネーパートナーズグループ	1,200	210.00	252,000	
スパークス・グループ	4,300	256.00	1,100,800	
かんぽ生命保険	12,600	1,908.00	24,040,800	
SOMPOホールディングス	19,400	4,718.00	91,529,200	
アニコム ホールディングス	3,700	886.00	3,278,200	
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	29,700	3,536.00	105,019,200	
第一生命ホールディングス	55,000	2,218.00	121,990,000	
東京海上ホールディングス	33,000	5,422.00	178,926,000	
T & Dホールディングス	31,900	1,437.00	45,840,300	
全国保証	2,600	5,150.00	13,390,000	
ジェイリース	300	1,693.00	507,900	
イントラスト	300	646.00	193,800	
日本モーゲージサービス	300	1,068.00	320,400	
C a s a	200	941.00	188,200	
アルヒ	1,200	1,286.00	1,543,200	
プレミアグループ	700	3,200.00	2,240,000	
クレディセゾン	5,800	1,291.00	7,487,800	
芙蓉総合リース	1,000	7,340.00	7,340,000	
みずほリース	1,500	3,575.00	5,362,500	
東京センチュリー	2,400	6,220.00	14,928,000	
日本証券金融	4,700	817.00	3,839,900	
アイフル	16,400	347.00	5,690,800	
リコーリース	900	3,535.00	3,181,500	
イオンフィナンシャルサービス	5,700	1,366.00	7,786,200	

アコム	21,100	439.00	9,262,900
ジャックス	1,200	2,669.00	3,202,800
オリエントコーポレーション	26,800	146.00	3,912,800
オリックス	55,500	2,088.50	115,911,750
三菱HCキャピタル	34,700	614.00	21,305,800
九州リースサービス	600	570.00	342,000
日本取引所グループ	28,000	2,619.50	73,346,000
イー・ギャランティ	1,400	2,237.00	3,131,800
NECキャピタルソリューション	300	2,140.00	642,000
いちご	12,000	343.00	4,116,000
日本駐車場開発	7,700	163.00	1,255,100
スター・マイカ・ホールディングス	700	1,246.00	872,200
SREホールディングス	100	7,040.00	704,000
ADワークスグループ	1,900	156.00	296,400
ヒューリック	22,400	1,283.00	28,739,200
三栄建築設計	300	1,962.00	588,600
野村不動産ホールディングス	8,800	2,916.00	25,660,800
三重交通グループホールディングス	2,200	479.00	1,053,800
サムティ	1,200	2,203.00	2,643,600
ディア・ライフ	1,200	502.00	602,400
コーセーアールイー	100	642.00	64,200
日本商業開発	700	1,681.00	1,176,700
プレサンスコーポレーション	1,900	1,680.00	3,192,000
THEグローバル社	900	225.00	202,500
日本管理センター	700	1,297.00	907,900
サンセイランディック	200	835.00	167,000
フージャースホールディングス	2,400	694.00	1,665,600
オープンハウス	3,400	5,610.00	19,074,000
東急不動産ホールディングス	28,900	627.00	18,120,300
飯田グループホールディングス	8,400	2,651.00	22,268,400
イーグランド	200	1,292.00	258,400
ムゲンエステート	700	484.00	338,800
ビーロッド	400	578.00	231,200
ファーストブラザーズ	200	996.00	199,200
ハウズドゥ	300	989.00	296,700
シーアールイー	300	1,559.00	467,700
ケイアイスター不動産	200	6,130.00	1,226,000
グッドコムアセット	400	1,442.00	576,800
テンポイノベーション	200	877.00	175,400
パーク24	4,500	2,054.00	9,243,000

三井不動産	59,300	2,516.50	149,228,450
三菱地所	26,500	1,732.00	45,898,000
平和不動産	1,900	3,960.00	7,524,000
東京建物	14,300	1,694.00	24,224,200
ダイビル	1,000	1,423.00	1,423,000
京阪神ビルディング	1,400	1,462.00	2,046,800
住友不動産	22,100	3,618.00	79,957,800
テオオーシー	1,800	645.00	1,161,000
レオパレス21	12,700	188.00	2,387,600
スターツコーポレーション	1,300	2,833.00	3,682,900
フジ住宅	1,200	673.00	807,600
空港施設	1,100	570.00	627,000
明和地所	700	604.00	422,800
ゴールドクレスト	900	1,639.00	1,475,100
エスリード	300	1,571.00	471,300
日神グループホールディングス	1,600	499.00	798,400
日本エスコン	2,000	767.00	1,534,000
タカラレーベン	4,300	318.00	1,367,400
A V A N T I A	700	920.00	644,000
イオンモール	1,500	1,680.00	2,520,000
ランド	61,300	12.00	735,600
カチタス	2,600	3,560.00	9,256,000
トーセイ	1,200	1,170.00	1,404,000
サンフロンティア不動産	1,300	1,111.00	1,444,300
エフ・ジェー・ネクスト	1,100	1,025.00	1,127,500
インテリックス	200	694.00	138,800
ランドビジネス	200	276.00	55,200
グランディハウス	700	461.00	322,700
日本空港ビルデング	3,400	4,985.00	16,949,000
日本工営	1,000	3,150.00	3,150,000
L I F U L L	3,800	330.00	1,254,000
ミクシィ	2,700	2,517.00	6,795,900
ジェイエイシーリクルートメント	900	1,700.00	1,530,000
日本M&Aセンター	16,200	3,150.00	51,030,000
メンバーズ	300	2,936.00	880,800
UTグループ	1,100	3,085.00	3,393,500
アイティメディア	200	2,049.00	409,800
タケエイ	900	1,726.00	1,553,400
E・Jホールディングス	300	1,256.00	376,800
夢真ビーネックグループ	1,300	1,149.00	1,493,700

コシダカホールディングス	2,700	580.00	1,566,000	
パソナグループ	1,200	2,250.00	2,700,000	
リンクアンドモチベーション	2,100	981.00	2,060,100	
G C A	1,200	1,378.00	1,653,600	
エス・エム・エス	3,900	3,480.00	13,572,000	
サニーサイドアップグループ	300	741.00	222,300	
パーソルホールディングス	10,100	2,635.00	26,613,500	
リニカル	700	920.00	644,000	
クックパッド	3,500	233.00	815,500	
エスクリ	500	469.00	234,500	
学情	300	1,185.00	355,500	
スタジオアリス	700	2,353.00	1,647,100	
シミックホールディングス	700	1,439.00	1,007,300	
総合警備保障	3,800	5,280.00	20,064,000	
カカコム	7,900	3,335.00	26,346,500	
アイロムグループ	300	1,948.00	584,400	
セントケア・ホールディング	800	897.00	717,600	
ルネサンス	300	1,143.00	342,900	
ディップ	1,400	3,375.00	4,725,000	
デジタルホールディングス	700	1,897.00	1,327,900	
新日本科学	100	864.00	86,400	
キャリアデザインセンター	200	1,085.00	217,000	
ベネフィット・ワン	3,500	3,750.00	13,125,000	
エムスリー	20,200	7,159.00	144,611,800	
ツカダ・グローバルホールディング	900	308.00	277,200	
アウトソーシング	5,200	1,834.00	9,536,800	
ウェルネット	1,100	493.00	542,300	
ワールドホールディングス	200	2,635.00	527,000	
ディー・エヌ・エー	4,100	1,998.00	8,191,800	
博報堂D Yホールディングス	13,100	1,757.00	23,016,700	
ぐるなび	1,300	466.00	605,800	
タカミヤ	1,200	474.00	568,800	
ジャパンベストレスキューシステム	900	1,164.00	1,047,600	
ファンコミュニケーションズ	2,800	411.00	1,150,800	
ライク	100	1,879.00	187,900	
ビジネス・ブレークスルー	800	420.00	336,000	
エスプール	2,500	898.00	2,245,000	
W D Bホールディングス	400	3,315.00	1,326,000	
手間いらず	100	5,220.00	522,000	
アドウェイズ	1,100	674.00	741,400	

バリューコマース	400	4,020.00	1,608,000	
インフォマート	11,000	927.00	10,197,000	
J Pホールディングス	4,100	278.00	1,139,800	
エコナックホールディングス	2,100	87.00	182,700	
E P Sホールディングス	1,600	1,798.00	2,876,800	
レグス	200	2,128.00	425,600	
プレステージ・インターナショナル	3,800	753.00	2,861,400	
アミューズ	400	2,241.00	896,400	
ドリームインキュベータ	200	890.00	178,000	
クイック	800	1,303.00	1,042,400	
T A C	1,000	232.00	232,000	
電通グループ	10,300	4,185.00	43,105,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,177.00	823,900	
ぴあ	300	3,265.00	979,500	
イオンファンタジー	400	1,890.00	756,000	
シーティーエス	1,100	778.00	855,800	
ネクシィーズグループ	200	891.00	178,200	
H . U . グループホールディングス	3,400	3,120.00	10,608,000	
アルプス技研	1,000	1,943.00	1,943,000	
サニックス	100	335.00	33,500	
オリエンタルランド	12,800	15,745.00	201,536,000	
ダスキン	2,000	2,575.00	5,150,000	
明光ネットワークジャパン	2,000	608.00	1,216,000	
ラウンドワン	3,100	1,215.00	3,766,500	
リゾートトラスト	3,900	1,852.00	7,222,800	
ビー・エム・エル	1,100	4,870.00	5,357,000	
りらいあコミュニケーションズ	1,200	1,213.00	1,455,600	
リソー教育	5,500	378.00	2,079,000	
ユー・エス・エス	11,700	1,885.00	22,054,500	
東京個別指導学院	600	613.00	367,800	
サイバーエージェント	25,200	1,969.00	49,618,800	
楽天グループ	58,600	1,244.00	72,898,400	
クリーク・アンド・リバー社	700	1,738.00	1,216,600	
モーニングスター	1,100	468.00	514,800	
テー・オー・ダブリュー	1,200	320.00	384,000	
山田コンサルティンググループ	800	1,055.00	844,000	
セントラルスポーツ	300	2,389.00	716,700	
フルキャストホールディングス	1,200	2,246.00	2,695,200	
エン・ジャパン	1,900	3,810.00	7,239,000	
テクノプロ・ホールディングス	6,000	2,608.00	15,648,000	

アイ・アールジャパンホールディングス	400	12,010.00	4,804,000	
KeePer 技研	800	4,045.00	3,236,000	
ファーストロジック	200	796.00	159,200	
三機サービス	100	1,080.00	108,000	
Gunosy	800	660.00	528,000	
デザインワン・ジャパン	500	230.00	115,000	
イー・ガーディアン	400	3,005.00	1,202,000	
リブセンス	900	216.00	194,400	
ジャパンマテリアル	3,800	1,287.00	4,890,600	
ベクトル	1,000	991.00	991,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,000	1,589.00	1,589,000	
キャリアリンク	500	1,942.00	971,000	
I B J	900	981.00	882,900	
アサンテ	400	1,738.00	695,200	
バリューHR	500	1,676.00	838,000	
M & Aキャピタルパートナーズ	900	4,890.00	4,401,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	200	1,455.00	291,000	
アビスト	200	2,925.00	585,000	
シグマクシス	800	2,100.00	1,680,000	
ウィルグループ	900	1,206.00	1,085,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,300	210.00	273,000	
メドピア	700	3,575.00	2,502,500	
レアジョブ	200	1,380.00	276,000	
リクルートホールディングス	79,900	6,350.00	507,365,000	
エラン	800	1,118.00	894,400	
土木管理総合試験所	700	380.00	266,000	
ネットマーケティング	300	393.00	117,900	
日本郵政	64,300	956.80	61,522,240	
ベルシステム24ホールディングス	1,500	1,622.00	2,433,000	
鎌倉新書	800	1,004.00	803,200	
一蔵	200	399.00	79,800	
エアトリ	400	2,468.00	987,200	
アトラエ	400	2,744.00	1,097,600	
ストライク	200	3,870.00	774,000	
ソラスト	3,300	1,423.00	4,695,900	
セラク	200	1,906.00	381,200	
インソース	600	1,902.00	1,141,200	
ベイカレント・コンサルティング	600	47,700.00	28,620,000	

Orchestra Holdings	200	2,776.00	555,200
アイモバイル	200	1,355.00	271,000
キャリアインデックス	600	962.00	577,200
MS - Japan	300	1,013.00	303,900
グレイステクノロジー	800	943.00	754,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	2,500	2,419.00	6,047,500
グリーンズ	200	546.00	109,200
GameWith	200	565.00	113,000
ソウルドアウト	200	1,895.00	379,000
エル・ティー・エス	100	3,420.00	342,000
ミダック	400	4,320.00	1,728,000
日総工産	800	814.00	651,200
キュービーネットホールディングス	300	1,596.00	478,800
RPAホールディングス	800	624.00	499,200
スプリックス	200	955.00	191,000
マネジメントソリューションズ	300	2,502.00	750,600
プロレド・パートナーズ	100	2,433.00	243,300
and factory	100	620.00	62,000
テノ・ホールディングス	100	917.00	91,700
フロンティア・マネジメント	200	920.00	184,000
ピアラ	100	926.00	92,600
コプロ・ホールディングス	200	1,201.00	240,200
ギークス	100	1,439.00	143,900
カーブスホールディングス	2,600	806.00	2,095,600
フォーラムエンジニアリング	700	893.00	625,100
ダイレクトマーケティングミックス	400	3,580.00	1,432,000
ポピンズホールディングス	200	2,963.00	592,600
LITALICO	400	4,590.00	1,836,000
アドバンテッジリスクマネジメント	600	1,057.00	634,200
リロググループ	1,900	2,595.00	4,930,500
東祥	800	1,792.00	1,433,600
エイチ・アイ・エス	1,600	2,448.00	3,916,800
ラックランド	200	2,721.00	544,200
共立メンテナンス	1,000	3,650.00	3,650,000
イチネンホールディングス	1,400	1,246.00	1,744,400
建設技術研究所	1,000	2,301.00	2,301,000
長大	700	1,903.00	1,332,100
スバル興業	100	7,920.00	792,000
東京テアトル	200	1,250.00	250,000

ナガワ	300	9,090.00	2,727,000	
東京都競馬	800	4,015.00	3,212,000	
常磐興産	200	1,426.00	285,200	
カナモト	2,200	2,579.00	5,673,800	
西尾レントオール	1,200	2,884.00	3,460,800	
アゴーラ ホスピタリティー グループ	5,300	24.00	127,200	
トランス・コスモス	1,000	3,230.00	3,230,000	
乃村工藝社	4,200	884.00	3,712,800	
藤田観光	200	2,432.00	486,400	
KNT - CTホールディングス	900	1,299.00	1,169,100	
日本管財	900	2,586.00	2,327,400	
トーカイ	1,200	2,389.00	2,866,800	
セコム	9,600	8,454.00	81,158,400	
セントラル警備保障	400	2,811.00	1,124,400	
丹青社	1,500	852.00	1,278,000	
メイテック	1,000	6,440.00	6,440,000	
応用地質	1,200	1,303.00	1,563,600	
船井総研ホールディングス	2,400	2,604.00	6,249,600	
いであ	200	1,862.00	372,400	
学究社	300	1,382.00	414,600	
ベネッセホールディングス	4,700	2,408.00	11,317,600	
イオンディライト	1,000	3,545.00	3,545,000	
ナック	100	934.00	93,400	
ダイセキ	1,100	4,915.00	5,406,500	
合計	10,793,800		28,176,010,270	

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 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

当表に記載すべき内容は、「(3) 注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に開示しておりますので、記載を省略しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(2021年 8月31日現在)

資産総額	29,626,606,947円
負債総額	818,172,689円
純資産総額(-)	28,808,434,258円
発行済口数	110,764,600口
100口当たり純資産額(/)	26,009円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）受益証券の名義書換手続き

該当事項はありません。

ファンドの受益権は、振替受益権であり、委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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、上記の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。）に社振法の規定にしたがい、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われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託者は、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等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（4）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、委託者および受託者に対抗することができません。

（5）受益権の再分割

社振法に定めるところにしたがい、受託者と協議のうえ、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）質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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係る収益分配金の支払い、交換請求の受付、交換有価証券の交付等については、この約款によるほか、民法その他の法令等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9月8日現在）

1,466百万円

発行する株式の総数：92,330株（普通株式92,328株、A種優先株式1株、B種優先株式1株）

発行済株式総数：29,330株（普通株式29,328株、A種優先株式1株、B種優先株式1株）

最近5年間における資本金の額の増減

- ・2021年9月8日 普通株式9,072株を消却し1,953,600,000円減資、またA種優先株式1株およびB種優先株式1株を発行し2円増資（資本金1,466百万円）

（注）A種優先株式およびB種優先株式は議決権を有しません。

(2) 委託会社等の機構

a. 委託会社等の機構（委託会社等の意思決定機構）

定款に基づき、10名以内の取締役が、株主総会において選任されます。取締役の選任は、総株主の議決権の過半数を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもってこれを行い、累積投票によらないものとします。

取締役の任期は、就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結のときまでとし、補欠により選任された取締役の任期は、退任者の残存期間とします。

取締役会はその決議をもって、取締役の中より取締役社長1名を置くとともに、取締役会長1名、取締役副社長、専務取締役および常務取締役若干名を選任することができます。また取締役の中より代表取締役を選任します。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、代表取締役が招集します。また、取締役会長が取締役会の議長となります。取締役会長に事故がある時は、あらかじめ取締役会の定めた順序により、他の取締役がこれに代わります。取締役会の招集通知は、開催日の3日前までに発することとします。また、取締役および監査役全員の同意がある場合は、招集の手続きを経ないで取締役会を開催することができます。

取締役会は、法令または定款に定められた事項を決議します。その決議は、取締役の過半数が出席し、その出席取締役の過半数をもって行います。

b. 運用プロセス（投資運用の意思決定機構）

運用に関する会議等

1. 投資戦略委員会

原則として月1回以上開催し、投資環境や市場動向等を踏まえ、最適な資産配分を決定します。

2. 資産ポートフォリオ委員会

原則として月1回以上開催し、個別資産毎にセクター、スタイル、ファクター等のリスク配分を決定します。

3. 銘柄会議

必要に応じ開催し、ポートフォリオ構築に必要な銘柄の相対的な優位性等を決定します。

4. 個別ファンド運用会議

運用担当役員が、特に必要と認めたファンドの運用方針を、個別に審議し決定します。

5. 運用リスク管理会議

原則として月1回開催し、ファンド運用資産に係るリスクを的確に把握・管理することを目的に、運用リスクや運用パフォーマンスの状況について報告・審議を行います。

6. 運用管理会議

原則として月1回開催し、ファンドの法令等（法令、協会ルール、信託約款等）の遵守状況の検証および運用計画と実績の検証を行います。

運用の流れ

1．運用方針の決定

経済環境や市場環境等グローバルな投資情報の分析等に基づき、最適な資産配分を決定した後、個別資産毎のリスク配分および資産構成銘柄等を組織的な意思決定プロセスを通じて決定しています。

2．運用の実践

ファンドマネージャーは、ファンド毎のリスク許容度やガイドライン等を考慮しながら、上記決定を受けた運用方針に基づいた運用を行います。

3．運用状況の評価

ファンドの運用状況については、運用リスク管理会議や運用管理会議による運用状況等の評価を通じ、最適な投資行動を実践しているかの確認を行っています。

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者は、証券投資信託の設定を行うとともに「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）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務および第二種金融商品取引業を行っています。

2021年8月31日現在、委託者が運用を行っている証券投資信託は以下のとおりです。

種類別（基本的性格）	本数	純資産総額
株式投資信託	268本	4,521,805百万円
公社債投資信託	93本	362,983百万円
合計	361本	4,884,789百万円

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）により、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、事業年度（2020年4月1日から2021年3月31日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		金額 (千円)		金額 (千円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金及び預金	1		1,500,057		14,672,714
分別金信託			100,000		100,000
有価証券			-		1,168
1年内償還予定のその他の関係 会社有価証券			1,000,000		1,000,000
立替金			18,100,000		-
前払費用			124,580		157,164
未収委託者報酬			1,838,990		1,807,353
未収運用受託報酬			150,845		162,310
未収投資助言報酬			162,884		115,889
未収収益			989		453
その他			49,574		58,455
流動資産計			23,027,922		18,075,509
固定資産					
有形固定資産			160,681		199,789
建物	2	98,910		112,748	
器具備品	2	61,770		87,040	
無形固定資産			7,610		6,940
商標権		5,216		4,545	
電話加入権等		2,394		2,394	
投資その他の資産			4,303,635		3,463,082
投資有価証券		1,003,692		1,107,341	
その他の関係会社有価証券		3,000,000		2,000,000	
長期差入保証金		80,859		140,940	
長期前払費用		2,702		3,828	
会員権		6,700		6,700	
繰延税金資産		209,680		204,272	
固定資産計			4,471,926		3,669,811
資産合計			27,499,849		21,745,321

		前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
区分	注記 番号	金額 (千円)		金額 (千円)	
(負債の部)					
流動負債					
借入金			7,000,000		-
預り金			838,534		1,626,988
未払金			674,602		690,434
未払収益分配金			13		13
未払償還金			3,132		3,132
未払手数料			659,294		661,665
その他未払金			12,161		25,622
未払費用			152,123		241,043
未払法人税等			665,703		357,979
未払消費税等			137,084		58,344
賞与引当金			192,976		237,652
流動負債計			9,661,024		3,212,443
固定負債					
退職給付引当金			204,533		232,053
役員退任慰労引当金			45,400		39,300
固定負債計			249,933		271,353
負債合計			9,910,957		3,483,796
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			3,420,000		3,420,000
資本剰余金					
資本準備金			1,500,000		1,500,000
資本剰余金計			1,500,000		1,500,000
利益剰余金					
利益準備金			74,040		74,040
その他利益剰余金			12,619,519		13,202,783
別途積立金			10,005,000		11,205,000
繰越利益剰余金			2,614,519		1,997,783
利益剰余金計			12,693,559		13,276,823
株主資本計			17,613,559		18,196,823
評価・換算差額等					
その他有価証券評価差額金			24,667		64,701
評価・換算差額等計			24,667		64,701
純資産合計			17,588,892		18,261,524
負債純資産合計			27,499,849		21,745,321

（２）【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	
		金額 (千円)		金額 (千円)	
営業収益					
委託者報酬			8,458,016		8,346,111
運用受託報酬			898,248		687,942
投資助言報酬			280,440		283,839
その他営業収益			-		43
営業収益計			9,636,704		9,317,937
営業費用					
支払手数料			1,614,335		1,312,184
広告宣伝費			15,912		4,459
調査費			1,357,718		2,030,778
調査費		580,513		618,388	
委託調査費		774,552		1,410,360	
図書費		2,652		2,029	
委託計算費			362,447		352,704
営業雑経費			110,063		115,648
通信費		21,707		33,050	
印刷費		58,336		54,123	
協会費		15,124		15,172	
諸会費		1,469		1,851	
その他営業雑経費		13,425		11,450	
営業費用計			3,460,477		3,815,776
一般管理費					
給料			1,403,962		1,597,941
役員報酬		84,469		83,365	
給料・手当		939,814		1,033,043	
賞与		176,302		232,980	
賞与引当金繰入額		192,976		237,652	
役員退任慰労引当金繰入額		10,400		10,900	
福利厚生費			184,734		194,748
交際費			21,211		718
旅費交通費			43,592		611
租税公課			103,638		100,962
不動産賃借料			174,195		175,566
役員退任慰労金			3,750		3,400
退職給付費用			46,152		47,133
固定資産減価償却費			31,759		35,574
業務委託費			346,403		421,661
諸経費			160,019		210,941
一般管理費計			2,519,421		2,789,262
営業利益			3,656,806		2,712,898

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	
		金額 (千円)		金額 (千円)	
営業外収益					
受取配当金			7,701		5,816
有価証券利息	1		5,681		3,113
受取利息			82		102
投資有価証券売却益			25,593		-
投資有価証券償還益			637		4,502
その他			564		96
営業外収益計			40,260		13,632
営業外費用					
支払利息	1		3,925		1,533
投資有価証券売却損			1,036		6,544
投資有価証券償還損			-		16,497
その他			3,232		335
営業外費用計			8,193		24,910
經常利益			3,688,874		2,701,620
特別損失					
固定資産除却損	2		13		1,413
特別損失計			13		1,413
税引前当期純利益			3,688,860		2,700,207
法人税、住民税及び事業税			1,145,683		825,177
法人税等調整額			11,686		15,633
法人税等合計			1,133,996		809,543
当期純利益			2,554,863		1,890,664

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月 1 日 至 2020年3月31日)

(単位：千円)

項目	株主資本							株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 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		
				別途積立金				
当期首残高	3,420,000	1,500,000	1,500,000	74,040	8,805,000	2,451,010	11,330,050	16,250,050
当期変動額								
剰余金の配当						1,191,355	1,191,355	1,191,355
別途積立金の積立					1,200,000	1,200,000	-	-
当期純利益						2,554,863	2,554,863	2,554,863
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)								
当期変動額合計	-	-	-	-	1,200,000	163,508	1,363,508	1,363,508
当期末残高	3,420,000	1,500,000	1,500,000	74,040	10,005,000	2,614,519	12,693,559	17,613,559

項目	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	38,026	38,026	16,288,077
当期変動額			
剰余金の配当			1,191,355
別途積立金の積立			-
当期純利益			2,554,863
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	62,693	62,693	62,693
当期変動額合計	62,693	62,693	1,300,814
当期末残高	24,667	24,667	17,588,892

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

項目	株主資本							株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	3,420,000	1,500,000	1,500,000	74,040	10,005,000	2,614,519	12,693,559	17,613,559
当期変動額								
剰余金の配当						1,307,400	1,307,400	1,307,400
別途積立金の積立					1,200,000	1,200,000	-	-
当期純利益						1,890,664	1,890,664	1,890,664
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)								
当期変動額合計	-	-	-	-	1,200,000	616,735	583,264	583,264
当期末残高	3,420,000	1,500,000	1,500,000	74,040	11,205,000	1,997,783	13,276,823	18,196,823

項目	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	24,667	24,667	17,588,892
当期変動額			
剰余金の配当			1,307,400
別途積立金の積立			-
当期純利益			1,890,664
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	89,368	89,368	89,368
当期変動額合計	89,368	89,368	672,632
当期末残高	64,701	64,701	18,261,524

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法（定額法）を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

期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）を採用しております。

時価のないもの

総平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、建物（附属設備を除く。）及び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。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5～50年

器具備品 3～15年

(2) 無形固定資産

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。

商標権 10年

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額を計上しております。

(2) 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の見込額に基づき計上しております。

(3) 役員退任慰労引当金

役員の退任慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

4．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ます。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
1 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは次のとおりであります。 預金 1,357,112千円	1 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは次のとおりであります。 預金 14,416,599千円
2 有形固定資産の減価償却累計額 建物 93,907千円 器具備品 126,749千円 合計 220,656千円	2 有形固定資産の減価償却累計額 建物 96,194千円 器具備品 125,400千円 合計 221,595千円

（損益計算書関係）

前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021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。 有価証券利息 5,681千円 支払利息 3,925千円	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。 有価証券利息 3,113千円 支払利息 1,506千円
2 固定資産除却損の内訳は次のとおりであります。 建物 - 円 器具備品 13千円 合計 13千円	2 固定資産除却損の内訳は次のとおりであります。 建物 829千円 器具備品 583千円 合計 1,413千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

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）	38,400	-	-	38,400
A種種類株式（株）	15,000	-	-	15,000
合計（株）	53,400	-	-	53,400

2. 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 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2019年6月24日 定時株主総会	普通株式	1,170,355	30,478	2019年3月31日	2019年6月25日
	A種種類株式	21,000	1,400	2019年3月31日	2019年6月25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	配当金の総額 （千円）	配当の原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月25日 定時株主総会	普通株式	1,286,400	利益剰余金	33,500	2020年3月31日	2020年6月26日
	A種種類株式	21,000	利益剰余金	1,400	2020年3月31日	2020年6月26日

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

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）	38,400	-	-	38,400
A種種類株式（株）	15,000	-	-	15,000
合計（株）	53,400	-	-	53,400

2. 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 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月25日 定時株主総会	普通株式	1,286,400	33,500	2020年3月31日	2020年6月26日
	A種種類株式	21,000	1,400	2020年3月31日	2020年6月26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

決議予定	株式の種類	配当金の総額 （千円）	配当の原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2021年6月25日 定時株主総会	普通株式	680,832	利益剰余金	17,730	2021年3月31日	2021年6月28日
	A種種類株式	831,900	利益剰余金	55,460	2021年3月31日	2021年6月28日

(リース取引関係)

前事業年度 2020年3月31日	当事業年度 2021年3月31日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(金融商品関係)

前事業年度(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

当社は、資金運用については主に安全性の高い金融商品により行っております。なお、投資有価証券に含まれる投資信託については、市場リスクに晒されておりますが、その取得については、社内規定により、取得金額の上限を定めるとともに、当社が設定する投資信託について、当初設定時における取得、または商品性を適正に維持するための取得に限定しており、毎月時価の把握を行っております。また、金融債での運用については、毎月時価の把握や金利上昇時の評価損失等のリスク指標の把握を行っております。

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。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	1,500,057	1,500,057	-
(2)立替金	18,100,000	18,100,000	-
(3)未収委託者報酬	1,838,990	1,838,990	-
(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	1,003,692	1,003,692	-
(5)その他の関係会社有価証券(*) 満期保有目的の債券	4,000,000	3,998,450	1,550
資産計	26,442,739	26,441,189	1,550
(1)短期借入金	7,000,000	7,000,000	-
負債計	7,000,000	7,000,000	-

(*) 1年内償還予定のその他の関係会社有価証券を含んでおります。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金、(2) 立替金、(3) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(4) 有価証券及び投資有価証券

投資信託の時価は、当期の決算日の基準価額によっております。

(5) その他の関係会社有価証券

金融債の時価は、取引金融機関が提示する参考時価情報によっております。

負 債

(1) 短期借入金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 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：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
預金	1,499,843	-	-	-
未収委託者報酬	1,838,990	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満 期のあるもの	-	542,216	86,552	90,900
その他の関係会社有価証券 満期保有目的の債券	1,000,000	3,000,000	-	-
合計	4,338,833	3,542,216	86,552	90,900

（注3）社債、長期借入金、リース債務及びその他の有利子負債の決済日後の返済予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
短期借入金	7,000,000	-	-	-	-	-
合計	7,000,000	-	-	-	-	-

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

当社は、資金運用については主に安全性の高い金融商品により行っております。なお、投資有価証券に含まれる投資信託については、市場リスクに晒されておりますが、その取得については、社内規定により、取得金額の上限を定めるとともに、当社が設定する投資信託について、当初設定時における取得、または商品性を適正に維持するための取得に限定しており、毎月時価の把握を行っております。また、金融債での運用については、毎月時価の把握や金利上昇時の評価損失等のリスク指標の把握を行っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31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。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	14,672,714	14,672,714	-
(2)未収委託者報酬	1,807,353	1,807,353	-
(3)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,108,510	1,108,510	-
(4)その他の関係会社有価証券(*) 満期保有目的の債券	3,000,000	3,003,075	3,075
資産計	20,588,577	20,591,652	3,075

（*）1年内償還予定のその他の関係会社有価証券を含んでおります。

（注1）金融商品の時価の算定方法

資産

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（3）有価証券及び投資有価証券

投資信託の時価は、当期の決算日の基準価額によっております。

（4）その他の関係会社有価証券

金融債の時価は、取引金融機関が提示する参考時価情報によっております。

（注2）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：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
預金	14,672,707	-	-	-
未収委託者報酬	1,807,353	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 其他有価証券のうち満 期のあるもの	1,168	345,171	224,049	84,930
その他の関係会社有価証券 満期保有目的の債券	1,000,000	2,000,000	-	-
合計	17,481,229	2,345,171	224,049	84,930

（有価証券関係）

前事業年度（2020年3月31日）

1．満期保有目的の債券

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	時価	差額
時価が貸借対照表計上額を超えるもの	金融債	750,000	750,450	450
	小計	750,000	750,450	450
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	金融債	3,250,000	3,248,000	2,000
	小計	3,250,000	3,248,000	2,000
合計		4,000,000	3,998,450	1,550

2．その他有価証券

（単位：千円）

	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	その他	527,717	457,409	70,307
	小計	527,717	457,409	70,307
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	475,975	563,421	87,446
	小計	475,975	563,421	87,446
合計		1,003,692	1,020,831	17,138

（注）時価が取得原価に比べて著しく下落したものについては、回復可能性があるとは判断される銘柄を除き、当該時価をもって貸借対照表価額とするとともに、評価差額を当事業年度の損失として処理（以下、「減損処理」という。）することとしておりますが、当事業年度においては、該当事項はありません。

また、時価が著しく下落したと判断するための根拠を定めており、その概要は、原則として以下のとおりであります。

時価が取得原価の50%以下の銘柄

時価が取得原価の50%超70%以下の水準で一定期間推移している銘柄

3．売却したその他有価証券

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	117,187	25,593	1,036
合計	117,187	25,593	1,036

当事業年度（2021年3月31日）

1．満期保有目的の債券

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	時価	差額
時価が貸借対照表計上額を超えるもの	金融債	2,750,000	2,753,075	3,075
	小計	2,750,000	2,753,075	3,075
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	金融債	250,000	250,000	-
	小計	250,000	250,000	-
合計		3,000,000	3,003,075	3,075

2. その他有価証券

(単位:千円)

	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	その他	787,764	614,151	173,613
	小計	787,764	614,151	173,613
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	319,058	399,400	80,341
	小計	319,058	399,400	80,341
合計		1,106,823	1,013,551	93,271

(注) 時価が取得原価に比べて著しく下落したものについては、回復可能性があるとは判断される銘柄を除き、当該時価をもって貸借対照表価額とするとともに、評価差額を当事業年度の損失として処理(以下、「減損処理」という。)することとしておりますが、当事業年度においては、該当事項はありません。

また、時価が著しく下落したと判断するための根拠を定めており、その概要は、原則として以下のとおりであります。

時価が取得原価の50%以下の銘柄

時価が取得原価の50%超70%以下の水準で一定期間推移している銘柄

3. 売却したその他有価証券

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	47,455	-	6,544
合計	47,455	-	6,544

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2021年3月31日)

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度（非積立型制度であります。）を採用しております。

当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2．確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表（単位：千円）

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	187,460	204,533
退職給付費用	28,307	30,558
退職給付の支払額	11,234	3,038
退職給付引当金の期末残高	204,533	232,053

(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（単位：千円）

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	204,533	232,053
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	204,533	232,053
退職給付引当金	204,533	232,053
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	204,533	232,053

(3) 退職給付費用

（単位：千円）

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	28,307	30,558

（税効果会計関係）

（単位：千円）

前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021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	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
繰延税金資産	繰延税金資産
ソフトウェア償却超過額 52,965	ソフトウェア償却超過額 56,755
敷金償却否認 4,450	敷金償却否認 4,940
会員権評価損否認 2,591	会員権評価損否認 2,591
電話加入権評価損 1,395	電話加入権評価損 1,395
賞与引当金 59,089	賞与引当金 72,769
役員退任慰労引当金 13,901	役員退任慰労引当金 12,033
退職給付引当金 62,628	退職給付引当金 71,054
その他有価証券評価差額金 26,775	その他有価証券評価差額金 24,600
未払事業税 36,548	未払事業税 27,467
その他 5,978	その他 4,795
繰延税金資産小計 266,324	繰延税金資産小計 278,404
評価性引当額 35,115	評価性引当額 20,971
繰延税金資産合計 231,208	繰延税金資産合計 257,432
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 21,528	その他有価証券評価差額金 53,160
繰延税金負債合計 21,528	繰延税金負債合計 53,160
繰延税金資産の純額 209,680	繰延税金資産の純額 204,272
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差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
当事業年度は、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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。	当事業年度は、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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
<p>本社は不動産賃貸借契約により、退去時における原状回復に係る債務を有しております。</p> <p>当該賃貸借契約については、敷金が資産計上されておりますので、「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」第9項、第15項に基づき、資産除去債務の負債計上及びこれに対応する除去費用の資産計上に代えて、原状回復に係る費用を敷金の回収が見込めない金額として合理的に見積もり、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上しております。</p>	<p>本社は不動産賃貸借契約により、退去時における原状回復に係る債務を有しております。</p> <p>当該賃貸借契約については、敷金が資産計上されておりますので、「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」第9項、第15項に基づき、資産除去債務の負債計上及びこれに対応する除去費用の資産計上に代えて、原状回復に係る費用を敷金の回収が見込めない金額として合理的に見積もり、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上しております。</p>

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（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

投資信託委託会社としての投資運用業、投資一任契約及び投資助言契約に係る投資運用業それぞれの営業収益は損益計算書に記載されております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

(単位：千円)

日本	ケイマン	合計
8,768,245	868,459	9,636,704

(注) 営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称	営業収益	関連するセグメント名
農林中央金庫	1,913,159	投資運用業
全国共済農業協同組合連合会	1,433,389	投資運用業
State Street Cayman Trust Company, Ltd.	587,396	投資運用業

(注) 営業収益は、当社が直接募集により販売した投資信託に係る委託者報酬、投資一任契約による運用受託報酬及び投資助言契約による投資助言報酬を顧客ごとに集計しております。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

投資信託委託会社としての投資運用業、投資一任契約及び投資助言契約に係る投資運用業それぞれの営業収益は損益計算書に記載されております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	ケイマン	合計
8,654,658	663,278	9,317,937

（注）営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益	関連するセグメント名
農林中央金庫	1,414,162	投資運用業
全国共済農業協同組合連合会	1,856,861	投資運用業
State Street Cayman Trust Company, Ltd.	418,974	投資運用業

（注）営業収益は、当社が直接募集により販売した投資信託に係る委託者報酬、投資一任契約による運用受託報酬及び投資助言契約による投資助言報酬を顧客ごとに集計しております。

[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]

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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]

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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の発生益に関する情報]

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 関連当事者との取引

親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称 又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (百万円)	事業の 内容又 は職業	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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	農林中央 金庫	東京都 千代田区	4,040,198	金融業	被所有 直接 50.91%	当社投資信託の 購入、募集・販 売の取扱等 役員の兼任	資金の借入 に係る利息 の支払 (*)	3,925	短期借入 金	7,000,000

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

（*）資金の借入については、アームズレングスルールにおけるガイドラインに従い、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。なお、担保は差し入れておりません。

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

農林中央金庫（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 関連当事者との取引

親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称 又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (百万円)	事業の 内容又 は職業	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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	農林中央 金庫	東京都 千代田区	4,040,198	金融業	被所有 直接 50.91%	当社投資信託の 購入、募集・販 売の取扱等 役員の兼任	資金の借入 に係る利息 の支払 (*)	1,533	短期借入 金	-

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

（*）資金の借入については、アームズレングスルールにおけるガイドラインに従い、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。なお、担保は差し入れておりません。

兄弟会社等

属性	会社等の名称 又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (百万円)	事業の 内容又 は職業	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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社 の子会 社	農林中金 バリュ ー イン ベ ス ト メ ン ツ 株 式 会 社	東京都 千代田区	444	金融業	-	当社投資信託の 外部運用委託	外部運用委 託	1,063,602	未払運用 委託料	228,891

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

農林中央金庫（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	379,372円18銭	375,771円48銭
1株当たり当期純利益金額	65,986円03銭	27,571円98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、潜在株式が存在し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。

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額(千円)	2,554,863	1,890,664
普通株主に帰属しない金額(千円)	21,000	831,900
(うちA種種類株式配当額(千円))	(21,000)	(831,900)
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	2,533,863	1,058,764
普通株式の期中平均株式数(株)	38,400	38,400

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。

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
純資産の部の合計額(千円)	17,588,892	18,261,524
純資産の部の合計額から控除する金額 (千円)	3,021,000	3,831,900
(うちA種種類株式払込金額(千円))	(3,000,000)	(3,000,000)
(うちA種種類株式配当額(千円))	(21,000)	(831,900)
普通株式に係る期末の純資産額 (千円)	14,567,892	14,429,624
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(株)	38,400	38,400

(重要な後発事象)

(J A グループの資産運用ビジネスの強化)

農林中央金庫、全国共済農業協同組合連合会および当社は、2021年3月に社債投資をはじめとするクレジット投資やオルタナティブ投資を対象に、それぞれの人材やノウハウを当社に投入することで、J A グループの資産運用ビジネス強化の取組みを進めていくことを決定いたしました。2021年4月以降、当社の運用資産残高は10兆円超の増加を見込んでおります。

(A 種種類株式の取得及び消却)

当社は、2021年5月26日開催の取締役会において、A種種類株式につき、当社定款第13条の5の規定に基づく取得および会社法第178条の規定に基づく消却を行うことを決議いたしました。

1. 取得の理由

当社の運用体制の強化や持続的な成長のため2021年3月31日に締結した「株主間契約書」(同日取締役会決議)と当社定款の定めに従い、A種種類株式の取得を行うものであります。

2. 取得にかかる事項の内容

(1) 取得する株式の種類 A種種類株式

(2) 取得価額 3,000,000千円

(3) 取得の時期 2021年7月27日

(4) 相手方 農中信託銀行株式会社

3. 消却にかかる事項の内容

(1) 消却する株式の種類 A種種類株式

(2) 消却する株式の総数 15,000株

(3) 消却予定日 2021年7月27日

4【利害関係人との取引制限】

委託者は、「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。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又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。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又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。)

通常の見積り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、委託者の親法人等(委託者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

において同じ。)又は子法人等(委託者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又は金融デリバティブ取引を行うこと。

委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 に掲げるもののほか、委託者の親法人等又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、若しくは取引の公正を害し、又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、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項について
該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

本書提出日現在、委託者およびファンドに重要な影響を与えた事実、または、与えると予想される事実はありません。

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) 受託者

名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額（2021年3月末日現在）

324,279百万円

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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概況>

名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額（2021年3月末日現在）

10,000百万円

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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (2021年3月末日現在)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167百万円	「金融商品取引法」に定める 第一種金融商品取引業を営ん でいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
BNPパリバ証券株式会社	102,025百万円	
JPモルガン証券株式会社	73,272百万円	

2【関係業務の概要】

(1) 受託者

当証券投資信託契約の受託者として、委託者との信託契約の締結、信託財産の保管・管理・計算業務等を行います。

なお、信託事務の一部につき日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することができます。

(2) 販売会社

当証券投資信託の販売会社として、募集の取扱い、交換請求の受付、受益権の買取りに関する事務ならびに信託終了時の交換の交付等に関する事務等を行います。

3【資本関係】

ありません。

第3【参考情報】

当計算期間中において、当ファンドにかかる金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類を以下のとおり提出しております。

書類名	提出年月日	提出先
有価証券報告書	2021年5月14日	関東財務局
有価証券届出書の訂正届出書	2021年5月14日	

独立監査人の監査報告書

2021年6月17日

農林中金全共連アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所 指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 細野 和也 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 長尾 充洋 印

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」に掲げられている農林中金全共連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28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、農林中金全共連アセットマネジメント株式会社の2021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並びに監査役及び監査役会の責任

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。

監査役及び監査役会の責任は、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、監査役及び監査役会に対して、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。

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

利害関係

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年9月8日

農林中金全共連アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているNZAM 上場投信 S&P / JPXカーボン・エフィシエント指数の2021年2月16日から2021年8月15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、NZAM 上場投信 S&P / JPXカーボン・エフィシエント指数の2021年8月15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、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、農林中金全共連アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2 . X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。