

【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】	2022年2月8日提出
【計算期間】	第34期(自 2020年11月10日至 2021年11月8日)
【ファンド名】	インデックスポートフォリオ バランスポートフォリオ
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 佐谷戸 淳一
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

インデックスポートフォリオ	TOPIX（東証株価指数）の動きに連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
バランスポートフォリオ	TOPIX（東証株価指数）の動きに連動した投資成果に、内外公社債への投資による安定性を加味した運用を行ない、信託財産の長期的成長と安定した収益の確保をはかることをめざします。

ファンドの基本的性格

<インデックスポートフォリオ>

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

株式

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

インデックス型

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

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株 中小型株	年2回	日本		
	年4回	北米		日経 225
債券			ファミリーファンド	
一般	年5回	欧州		
公債	(隔月)			
社債		アジア		
その他債券	年12回			TOPIX
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
	日々	中南米		
不動産投信			ファンド・オブ・ ファンズ	
	その他 ()	アフリカ		その他 ()
その他資産 (投資信託証券(株式 一般))		中近東 (中東)		
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(株式 一般))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式に投資を行いません。よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「株式」に分類されます。

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

< バランスポートフォリオ >

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

国内

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

日本

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

ファミリーファンド

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. ミリオンには2つのポートフォリオがあり、皆様のニーズにあったポートフォリオをお選びいただけます。**「インデックスポートフォリオ」**

主として「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に投資を行ない、TOPIX(東証株価指数)*の動きに連動する投資成果をめざします。

「バランスポートフォリオ」

主として「インデックス東証株式マザーファンド」への投資を通じて、わが国の株式に50%程度投資を行ないます。また残りの50%程度は内外の公社債を中心に組み入れます。

市況の急激な変化が生じたときなど、やむを得ない事情が発生した場合ならびに信託財産の規模によっては上記のような運用ができない場合があります。

*TOPIX(東証株価指数)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、指数採用銘柄の浮動株調整後の時価総額を指数化したものです。

TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

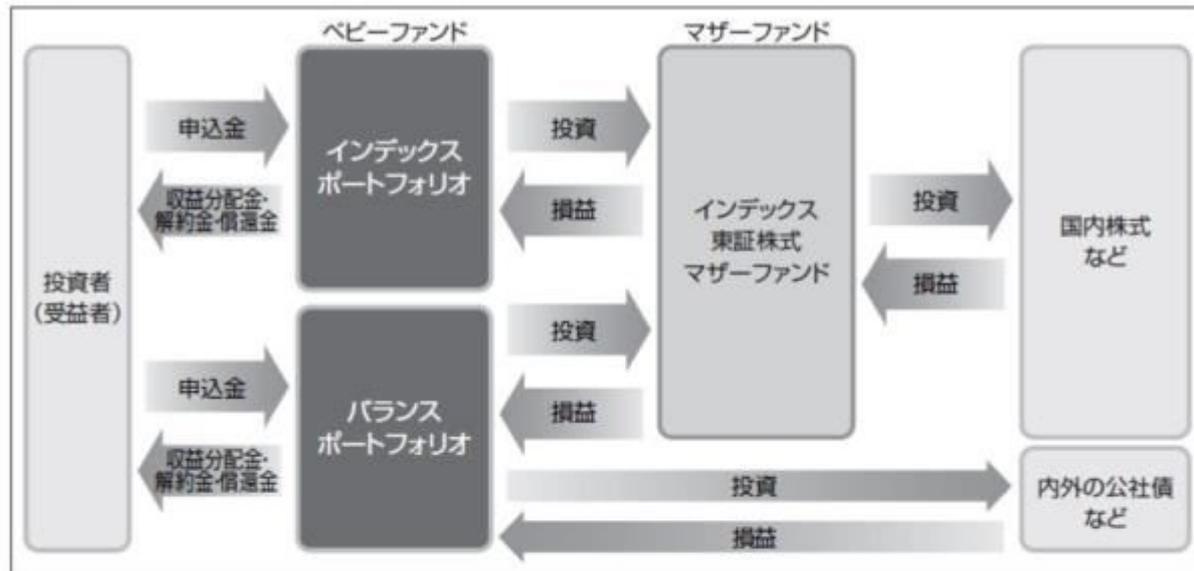
※TOPIX(東証株価指数)の構成銘柄は、現行の市場区分において、東京証券取引所第一部に上場されている全銘柄が対象となります。(有価証券届出書提出日現在)

2. お買付けは、原則として給与天引きです。**3. お買付けは、無手数料です。****4. ドル・コスト平均法の妙味を味わえます。**

ドル・コスト平均法とは、一定の金額を継続して投資する方法で、価格が安いときは多くの口数を、高いときは少ない口数を買い付けることによって、一定量(口数)ずつ買い付けた場合に比べて、平均買付コストを低く抑えることが期待できます。長期にわたり定期的に継続して積み立てることにより、ドル・コスト平均法が活かされます。

ファンドの仕組み

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



(主な投資制限)

「インデックスポートフォリオ」

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」への投資割合には制限を設けません。
- ・外貨建資産への投資は行ないません。

「バランスポートフォリオ」

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- ・外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

(分配方針)

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」

- ・毎決算時に、利子・配当等収益を中心に安定的に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。

ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

- ・各ポートフォリオ毎に、2,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

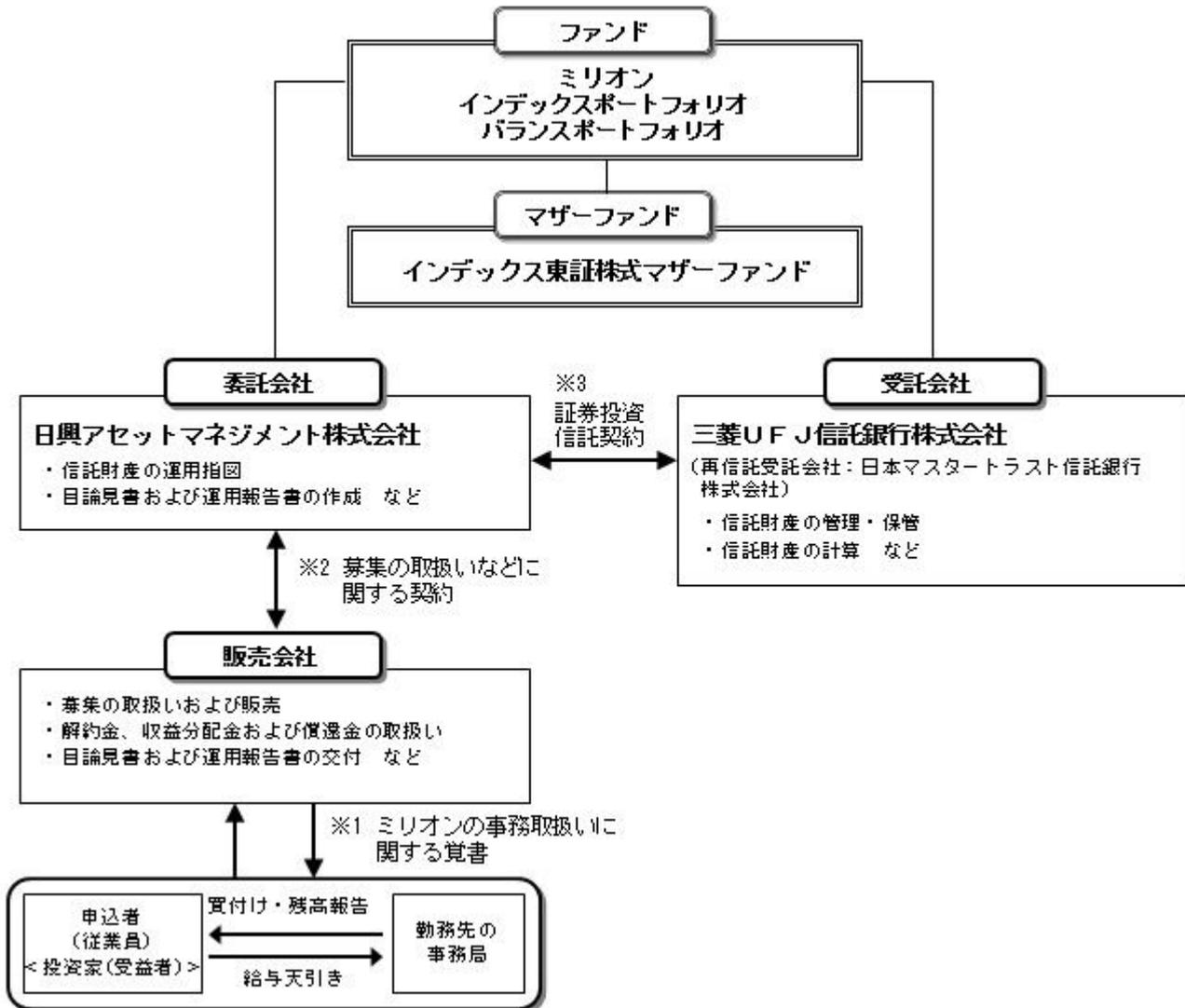
(2) 【ファンドの沿革】

1987年11月27日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 ミリオンの事務局と販売会社の間における、ミリオンの申込み・入金・換金などに関する手続きを規定しています。
- 2 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 3 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2021年11月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	192,211,000株	97.562%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<インデックスポートフォリオ>

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

< バランスポートフォリオ >

- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。
- ・「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券に投資することにより売買益を追求し、内外の公社債に投資することにより利息等収益の確保につとめます。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の75%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

< インデックスポートフォリオ >

「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

主として「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 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。）
- 4) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

次の取引ができます。

- 1) 資金の借入

< バランスポートフォリオ >

「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条および第17条の2に定めるものに限ります。）

- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 有価証券の貸付
 - 4) 外国為替予約取引
 - 5) 資金の借入

<インデックス東証株式マザーファンド>

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

2022年4月4日付で「わが国の金融商品取引所上場株式」に変更予定です。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第13条の2および第13条の4に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
- 2) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 3) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)の証券の性質を有するもの
- 4) 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。）
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 有価証券の貸付

投資対象とするマザーファンドの概要

<インデックス東証株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期的成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数） [*] の動きに連動する投資成果をめざします。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。 2022年4月4日付で「わが国の金融商品取引所上場株式」に変更予定です。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・投資成果をTOPIX（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、バラ日本株式モデルに従い次のポートフォリオ管理を行いません。投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。 ・資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として買付の場合は時価比率の高い銘柄から順に、売却の場合は時価比率の低い銘柄から順番に行いません。 ・株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合には制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1986年10月22日設定）
決算日	毎年10月21日（休業日の場合は翌営業日）

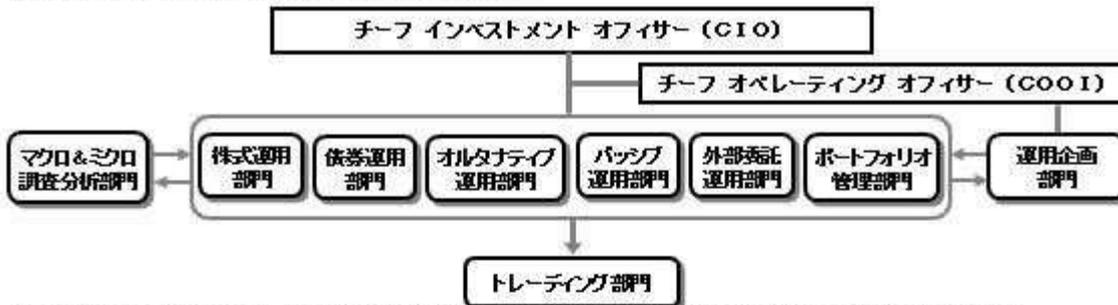
* T O P I X（東証株価指数）は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、指数採用銘柄の浮動株調整後の時価総額を指数化したものです。

T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびT O P I Xの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

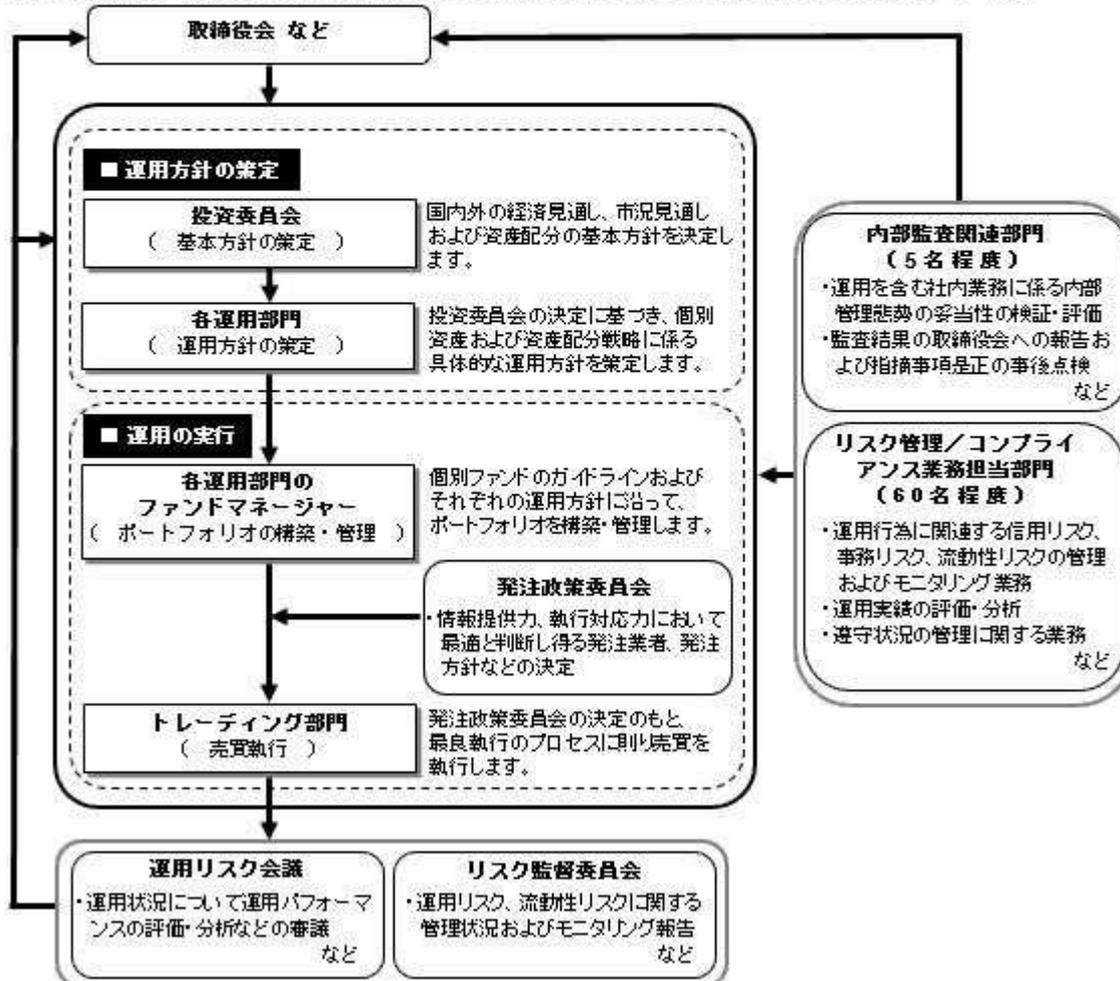
T O P I X（東証株価指数）の構成銘柄は、現行の市場区分において、東京証券取引所第一部に上場されている全銘柄が対象となります。（有価証券届出書提出日現在）

（３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



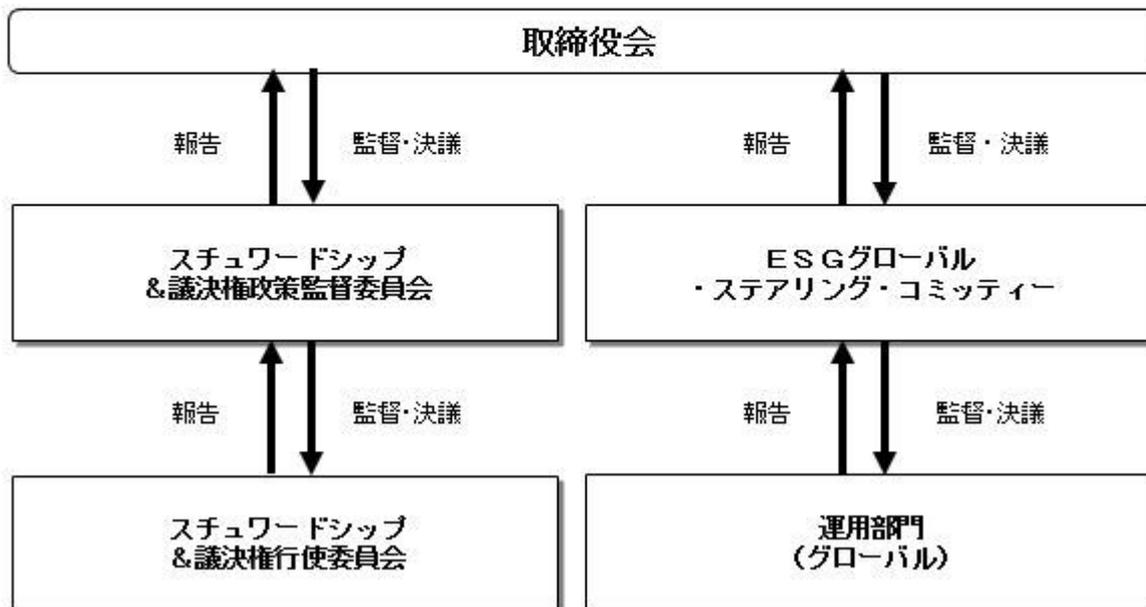
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

ESG（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行なうこととしています。

（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）



上記体制は2021年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

利子・配当等収益を中心に分配を行ないますが、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

3) 留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

<インデックスポートフォリオ>

1) 「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合には制限を設けません。

2) 外貨建資産への投資は行ないません。

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

イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範

囲内

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

ハ)借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

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

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

<バランスポートフォリオ>

- 1)「インデックス東証株式マザーファンド」受益証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- 2)同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3)外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 4)信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 5)信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- イ)先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
- ロ)先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- ハ)コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 6)信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取

引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- 二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が弁済される日からその翌営業日までとします。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<インデックス東証株式マザーファンド>

- 1) 株式への投資割合には制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式は、金融商品取引所が開設する市場に上場されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 5) 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されるものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第10条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ約款で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- 8) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 9) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこ

とします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（１）ファンドのリスク

<インデックスポートフォリオ>

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

- ・投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に株式を実質的な投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

< T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

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

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

< バランスポートフォリオ >

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

- ・投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

流動性リスク

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

信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

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

< その他の留意事項 >

・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

換金の取り扱いを停止することもあります。

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

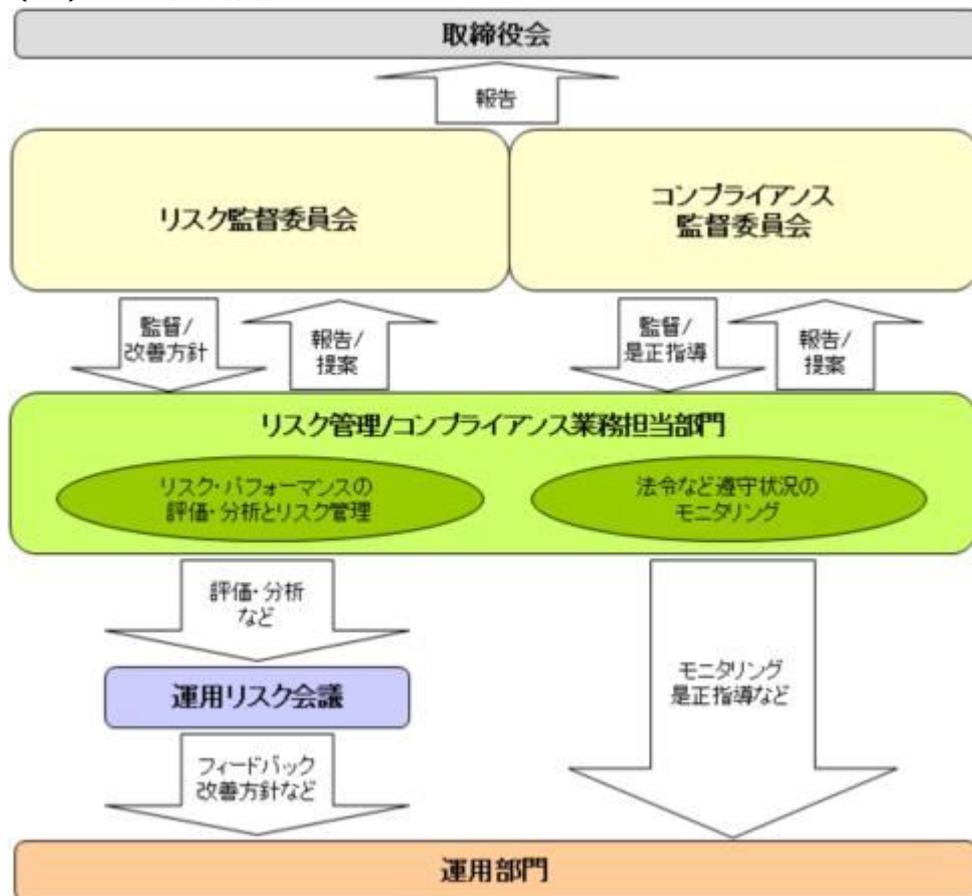
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

（２）リスク管理体制



全社的なリスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議において

は、法令遵守状況や各種リスク(運用リスク、事務リスク、システムリスク、流動性リスクなど)に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

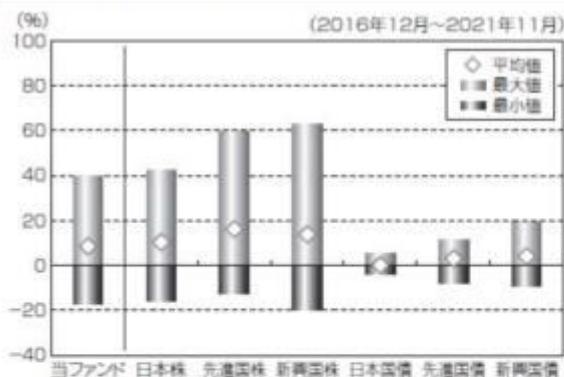
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2021年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

インデックスポートフォリオ

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

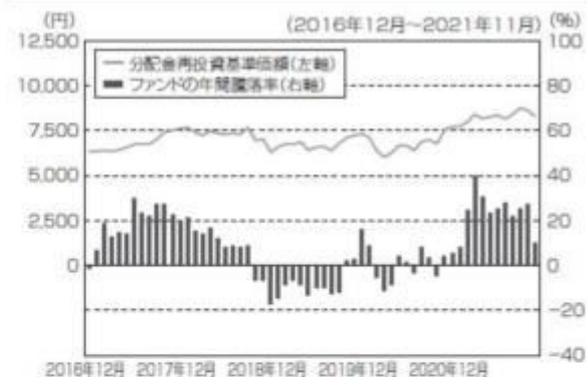
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	8.6%	10.4%	16.2%	13.9%	0.2%	3.2%	4.1%
最大値	39.7%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	11.4%	19.3%
最小値	-17.3%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-4.0%	-7.9%	-9.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2016年12月から2021年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



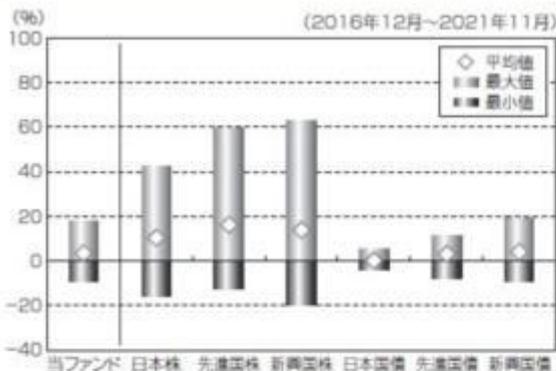
※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2016年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

バランスポートフォリオ

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	3.6%	10.4%	16.2%	13.9%	0.2%	3.2%	4.1%
最大値	17.9%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	11.4%	19.3%
最小値	-9.3%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-4.0%	-7.9%	-9.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2016年12月から2021年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバルレティバースィファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

当指数は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

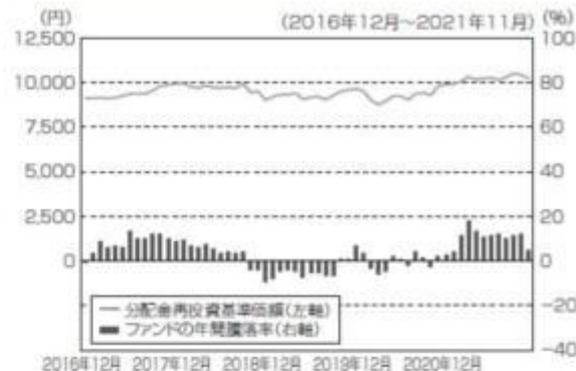
MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2016年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

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

4【手数料等及び税金】**(1)【申込手数料】**

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.672%（税抜1.52%）以内の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬（有価証券届出書提出日現在）の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.52%	0.34%	1.10%	0.08%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

- ・組入る有価証券の売買時の売買委託手数料
- ・信託事務の処理に要する諸費用
- ・信託財産に関する租税 など

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

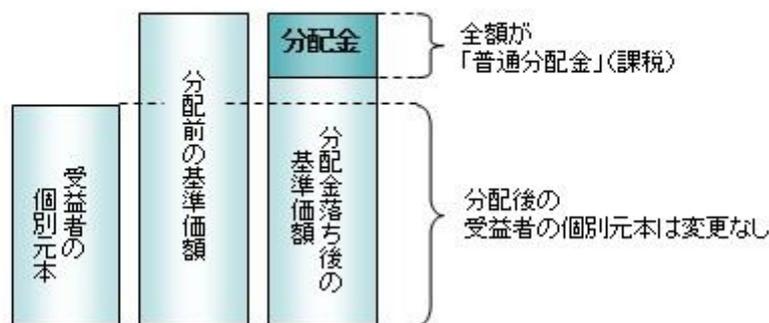
普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

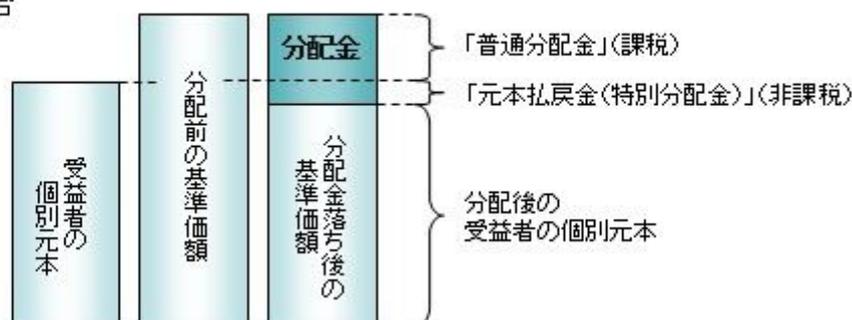
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2022年2月8日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【インデックスポートフォリオ】

以下の運用状況は2021年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	9,233,407,868	99.90
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		9,326,709	0.10
合計(純資産総額)		9,242,734,577	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	4,456,277,929	2.1840	9,732,510,997	2.0720	9,233,407,868	99.90

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第25計算期間末 (2012年11月7日)	7,945	7,958	0.3085	0.3090
第26計算期間末 (2013年11月7日)	11,931	11,943	0.4906	0.4911
第27計算期間末 (2014年11月7日)	12,764	12,776	0.5660	0.5665
第28計算期間末 (2015年11月9日)	12,726	12,735	0.6615	0.6620
第29計算期間末 (2016年11月7日)	10,507	10,516	0.5690	0.5695
第30計算期間末 (2017年11月7日)	12,193	12,201	0.7599	0.7604
第31計算期間末 (2018年11月7日)	10,188	10,195	0.6952	0.6957
第32計算期間末 (2019年11月7日)	10,181	10,188	0.7201	0.7206
第33計算期間末 (2020年11月9日)	9,387	9,393	0.7182	0.7187
第34計算期間末 (2021年11月8日)	9,766	9,771	0.8723	0.8728
2020年11月末日	9,558		0.7493	
12月末日	9,646		0.7701	
2021年1月末日	9,464		0.7711	
2月末日	9,478		0.7939	
3月末日	9,839		0.8378	
4月末日	9,374		0.8129	
5月末日	9,456		0.8230	
6月末日	9,522		0.8315	

7月末日	9,287		0.8123
8月末日	9,535		0.8367
9月末日	9,805		0.8720
10月末日	9,630		0.8588
11月末日	9,242		0.8260

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0005
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.0005
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.06
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	59.19
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	15.47
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	16.96
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	13.91
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	33.64
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	8.45
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	3.65
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.19
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	21.53

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
---	----	---------	---------

第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	1,098,402,396	1,156,956,048
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	726,814,196	2,160,223,460
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	540,447,887	2,308,575,579
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	397,656,514	3,710,414,810
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	404,194,947	1,174,901,250
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	324,013,392	2,744,057,822
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	240,808,421	1,634,396,234
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	252,391,538	768,201,863
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	226,616,601	1,294,592,956
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	170,327,435	2,044,549,305

【バランスポートフォリオ】

以下の運用状況は2021年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
地方債証券	日本	54,597,490	26.58
親投資信託受益証券	日本	101,900,083	49.61
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		48,895,818	23.81
合計（純資産総額）		205,393,391	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	インデックス東証 株式マザーファン ド	49,179,577	2.1860	107,506,555	2.0720	101,900,083			49.61
日本	地方債証券	平成24年度第1 0回静岡県公募公 債	18,000,000	100.92	18,166,680	100.87	18,157,320	0.678	2023/3/22	8.84
日本	地方債証券	第401回大阪府 公募公債（10 年）	15,000,000	101.85	15,278,400	101.84	15,276,900	0.477	2025/10/29	7.44
日本	地方債証券	平成26年度第1 回滋賀県公募公 債	11,000,000	101.50	11,165,110	101.46	11,161,370	0.495	2024/11/28	5.43
日本	地方債証券	平成30年度第1 回鹿児島県公募公 債（5年）	10,000,000	100.03	10,003,900	100.01	10,001,900	0.020	2023/10/31	4.87

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
地方債証券	26.58
親投資信託受益証券	49.61
合 計	76.19

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第25計算期間末 (2012年11月 7日)	366	366	0.6377	0.6382
第26計算期間末 (2013年11月 7日)	436	437	0.8067	0.8072
第27計算期間末 (2014年11月 7日)	382	382	0.8619	0.8624
第28計算期間末 (2015年11月 9日)	322	322	0.9300	0.9305
第29計算期間末 (2016年11月 7日)	271	271	0.8629	0.8634
第30計算期間末 (2017年11月 7日)	268	268	0.9920	0.9925
第31計算期間末 (2018年11月 7日)	218	218	0.9443	0.9448
第32計算期間末 (2019年11月 7日)	217	217	0.9565	0.9570
第33計算期間末 (2020年11月 9日)	213	213	0.9545	0.9550
第34計算期間末 (2021年11月 8日)	212	213	1.0465	1.0470
2020年11月末日	218		0.9748	
12月末日	218		0.9877	
2021年 1月末日	212		0.9879	
2月末日	207		1.0020	
3月末日	213		1.0296	
4月末日	209		1.0136	
5月末日	208		1.0191	
6月末日	209		1.0238	
7月末日	204		1.0110	
8月末日	208		1.0258	
9月末日	212		1.0474	
10月末日	211		1.0388	
11月末日	205		1.0177	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.0005
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	0.0005
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	0.0005
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	0.0005
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	0.0005
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	0.0005
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	0.0005
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	0.0005
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.0005
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	0.0005

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	0.33
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	26.58
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	6.90
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	7.96
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	7.16
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	15.02
第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	4.76
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	1.34
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	0.16
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	9.69

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第25期	2011年11月 8日～2012年11月 7日	21,493,518	42,290,225
第26期	2012年11月 8日～2013年11月 7日	14,701,201	47,759,106
第27期	2013年11月 8日～2014年11月 7日	11,634,468	109,900,290
第28期	2014年11月 8日～2015年11月 9日	9,591,772	106,409,569
第29期	2015年11月10日～2016年11月 7日	9,326,069	41,548,116
第30期	2016年11月 8日～2017年11月 7日	7,480,324	50,984,226

第31期	2017年11月 8日～2018年11月 7日	6,405,223	46,051,030
第32期	2018年11月 8日～2019年11月 7日	6,506,949	10,601,618
第33期	2019年11月 8日～2020年11月 9日	7,044,581	10,651,253
第34期	2020年11月10日～2021年11月 8日	5,792,929	25,835,192

(参考)

インデックス東証株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年11月30日現在です。

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

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	9,196,492,480	98.52
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		137,849,432	1.48
合計(純資産総額)		9,334,341,912	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	113,760,000	1.22

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	176,300	1,983.51	349,692,813	2,001.00	352,776,300	3.78
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	21,800	12,665.00	276,097,000	13,825.00	301,385,000	3.23
日本	株式	キーエンス	電気機器	3,200	67,250.00	215,200,000	70,330.00	225,056,000	2.41
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	25,700	7,072.98	181,775,586	6,901.00	177,355,700	1.90
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	220,100	654.80	144,121,480	601.40	132,368,140	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	2,200	48,959.09	107,710,000	59,840.00	131,648,000	1.41
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	39,900	3,141.00	125,325,900	3,125.00	124,687,500	1.34
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	20,500	6,574.00	134,767,000	6,030.00	123,615,000	1.32
日本	株式	HOYA	精密機器	6,800	17,000.00	115,600,000	18,020.00	122,536,000	1.31
日本	株式	日本電産	電気機器	9,000	12,491.53	112,423,770	13,000.00	117,000,000	1.25

日本	株式	日立製作所	電気機器	16,700	6,692.00	111,756,400	6,688.00	111,689,600	1.20
日本	株式	信越化学工業	化学	5,800	19,145.00	111,041,000	19,000.00	110,200,000	1.18
日本	株式	ダイキン工業	機械	4,400	25,396.00	111,742,400	23,150.00	101,860,000	1.09
日本	株式	任天堂	その他製品	2,000	50,060.00	100,120,000	50,100.00	100,200,000	1.07
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	23,700	3,872.00	91,766,400	3,703.00	87,761,100	0.94
日本	株式	三菱商事	卸売業	25,700	3,572.10	91,802,970	3,391.00	87,148,700	0.93
日本	株式	村田製作所	電気機器	10,200	8,509.00	86,791,800	8,380.00	85,476,000	0.92
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	27,400	3,416.00	93,598,400	3,101.00	84,967,400	0.91
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	27,300	3,207.00	87,551,100	3,031.00	82,746,300	0.89
日本	株式	KDDI	情報・通信業	24,900	3,726.00	92,777,400	3,300.00	82,170,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	51,700	1,537.91	79,509,947	1,562.50	80,781,250	0.87
日本	株式	第一三共	医薬品	27,300	2,734.31	74,646,663	2,824.50	77,108,850	0.83
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	23,500	3,262.00	76,657,000	3,260.00	76,610,000	0.82
日本	株式	S M C	機械	1,000	65,990.00	65,990,000	72,650.00	72,650,000	0.78
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	3,900	17,989.35	70,158,500	17,840.00	69,576,000	0.75
日本	株式	ファナック	電気機器	3,100	24,370.00	75,547,000	22,245.00	68,959,500	0.74
日本	株式	三井物産	卸売業	26,600	2,587.50	68,827,500	2,557.00	68,016,200	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	11,300	6,094.00	68,862,200	5,708.00	64,500,400	0.69
日本	株式	デンソー	輸送用機器	7,700	7,807.00	60,113,900	8,331.00	64,148,700	0.69
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	43,900	1,555.50	68,286,450	1,402.00	61,547,800	0.66

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.22
		建設業	2.15
		食料品	3.21
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.20
		化学	6.69
		医薬品	4.75
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.64
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.70
		非鉄金属	0.68
		金属製品	0.63
		機械	5.28
		電気機器	19.51
輸送用機器	7.95		

	精密機器	2.97
	その他製品	2.15
	電気・ガス業	1.06
	陸運業	2.94
	海運業	0.42
	空運業	0.37
	倉庫・運輸関連業	0.16
	情報・通信業	8.49
	卸売業	5.02
	小売業	4.14
	銀行業	4.59
	証券、商品先物取引業	0.72
	保険業	1.89
	その他金融業	1.11
	不動産業	1.85
	サービス業	6.32
合 計		98.52

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2021年12月	買建		6日本円	120,712,200	113,760,000	1.22

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

参考情報

運用実績(インデックスポートフォリオ)

2021年11月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額8,260円

純資産総額92.42億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2011年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したもとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2017年11月	2018年11月	2019年11月	2020年11月	2021年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	170円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	98.41%
株式先物	1.22%
債券	—
債券先物	—
現金その他	1.59%

※当ファンドの実質組入比率です。

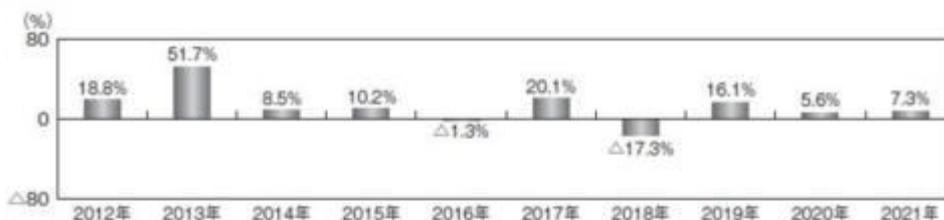
<組入上位10銘柄>

インデックス東証株式マザーファンド

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.78%
2 ソニーグループ	電気機器	3.23%
3 キーエンス	電気機器	2.41%
4 リクルートホールディングス	サービス業	1.90%
5 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.42%
6 東京エレクトロン	電気機器	1.41%
7 日本電信電話	情報・通信業	1.34%
8 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.32%
9 HOYA	精密機器	1.31%
10 日本電産	電気機器	1.25%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

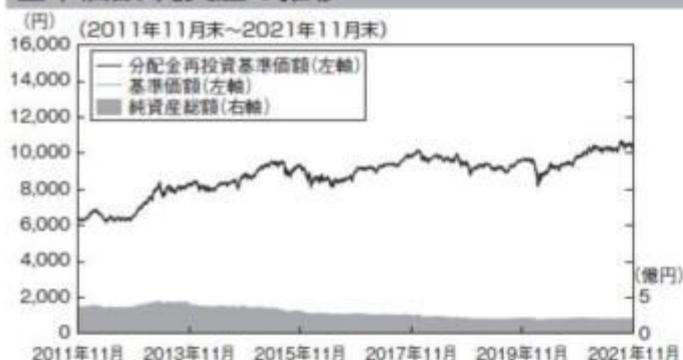
※2021年は、2021年11月末までの騰落率です。

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

運用実績(バランスポートフォリオ)

2021年11月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額 10,177円

純資産総額 2.05億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2011年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したもとのとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2017年11月	2018年11月	2019年11月	2020年11月	2021年11月	設定来累計
5円	5円	5円	5円	5円	170円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	48.87%
株式先物	0.60%
債券	26.58%
債券先物	0.00%
現金その他	24.54%

※当ファンドの実質組入比率です。

<組入上位銘柄>

当ファンド

	銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率
1	インデックス東証株式マザーファンド	積投資信託受益証券	—	—	49.61%
2	平成24年度第10回静岡県公債	地方債証券	0.678%	2023年3月22日	8.84%
3	第401回大阪府公債(10年)	地方債証券	0.477%	2025年10月29日	7.44%
4	平成26年度第1回滋賀県公債	地方債証券	0.495%	2024年11月28日	5.43%
5	平成30年度第1回鹿児島県公債(5年)	地方債証券	0.020%	2023年10月31日	4.87%

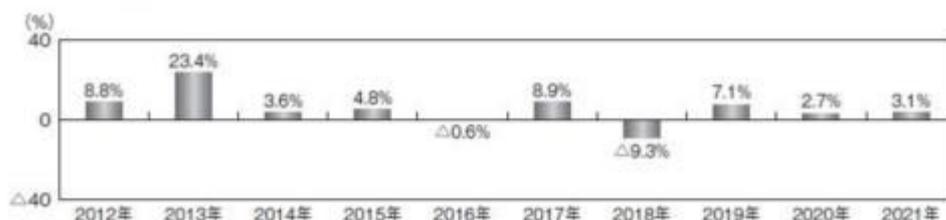
※当ファンドの対純資産総額比です。

インデックス東証株式マザーファンド

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.78%
2	ソニーグループ	電気機器	3.23%
3	キーエンス	電気機器	2.41%
4	リクルートホールディングス	サービス業	1.90%
5	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.42%

※マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したもとのとして計算しております。

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2021年は、2021年11月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

- ・原則として、勤務先の事務局を通じて、販売会社所定の方法でお申し込みください。

- ・原則として、勤務先の事務局を通じて給与天引きで行なわれるため、販売会社に入金された日を取得申込受付日とします。

(2) 申込金額

取得申込受付日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(3) 申込単位

勤務先の事務局、販売会社の照会先にお問い合わせください。

(4) 申込代金の支払い

原則として、勤務先の事務局を通じて販売会社にお支払いいただきます。

(5) 受付の中止および取消

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

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

2【換金(解約)手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の請求

勤務先の事務局を通じて解約の請求をしていただきます。

(2) 解約制限

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

(3) 解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(4) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。
税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(5) 解約単位

1口単位

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

(6) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

(7) 受付の中止および取消

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

< 買取請求による換金 >

(1) 買取りの請求

勤務先の事務局を通じて買取りの請求をしていただきます。

(2) 買取制限

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

(3) 買取価額

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

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(4) 手取額

1口当たりの手取額は、当該買取価額となります。

(5) 買取単位

1口単位

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

(6) 受付の中止および取消

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

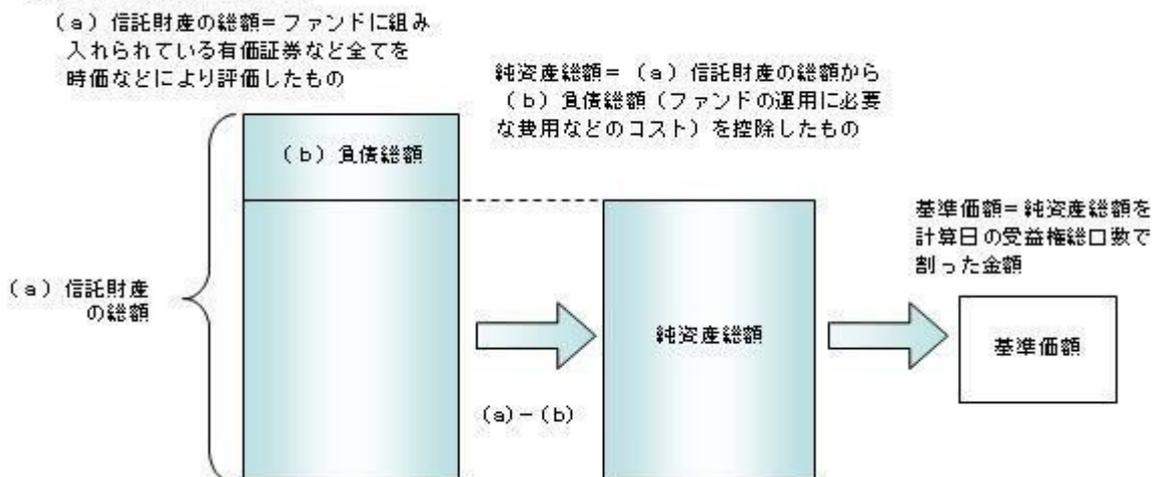
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

インデックスポートフォリオ	マザーファンド受益証券 基準価額計算日の基準価額で評価します。 国内上場株式 原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
バランスポートフォリオ	マザーファンド受益証券 基準価額計算日の基準価額で評価します。 国内上場株式 原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。 公社債（国内・外国） 原則として、基準価額計算日 [*] における以下のいずれかの価額で評価します。 a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） b) 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。） c) 価格情報会社の提供する価額 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。 [*] 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします（1987年11月27日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（4）【計算期間】

毎年11月8日から翌年11月7日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（5）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させること

ができます。

<インデックスポートフォリオ>

- イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
- ロ) 対象インデックスが改廃の場合
- ハ) やむを得ない事情が発生したとき

<バランスポートフォリオ>

- イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
- ロ) やむを得ない事情が発生したとき

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

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

償還金について

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

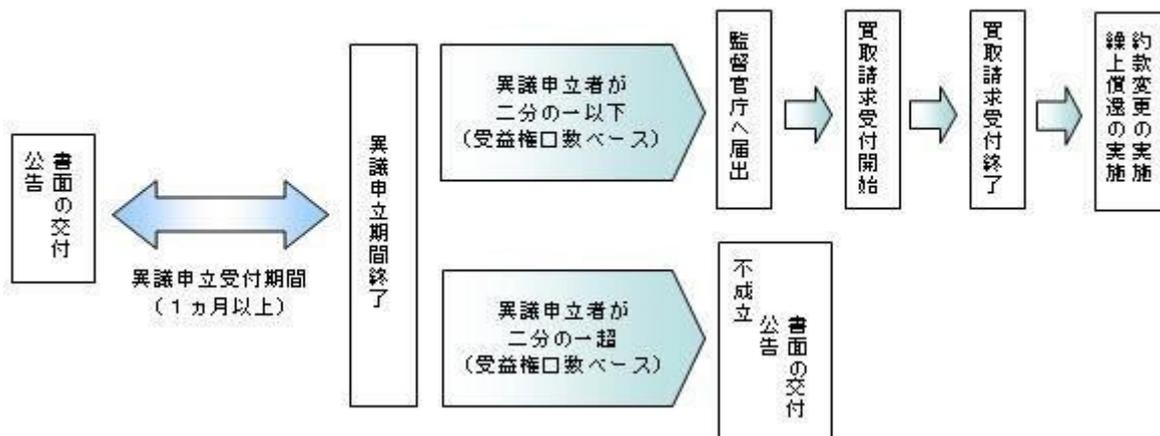
信託約款の変更

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

異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行いません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

<インデックスポートフォリオ>

<バランスポートフォリオ>

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期計算期間(2020年11月10日から2021年11月8日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【インデックスポートフォリオ】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第33期 2020年11月 9日現在	第34期 2021年11月 8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	84,370,205	89,580,335
親投資信託受益証券	9,416,916,044	9,764,564,850
未収入金	4,172,077	1,364,283
流動資産合計	9,505,458,326	9,855,509,468
資産合計	9,505,458,326	9,855,509,468
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	6,535,141	5,598,030
未払解約金	34,878,965	2,343,824
未払受託者報酬	4,023,525	4,273,559
未払委託者報酬	72,424,571	76,925,218
未払利息	61	48
その他未払費用	201,116	213,619
流動負債合計	118,063,379	89,354,298
負債合計	118,063,379	89,354,298
純資産の部		
元本等		
元本	13,070,282,130	11,196,060,260
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,682,887,183	1,429,905,090
(分配準備積立金)	2,274,004,168	3,224,063,371
元本等合計	9,387,394,947	9,766,155,170
純資産合計	9,387,394,947	9,766,155,170
負債純資産合計	9,505,458,326	9,855,509,468

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第33期		第34期	
	自	2019年11月 8日 至 2020年11月 9日	自	2020年11月10日 至 2021年11月 8日
営業収益				
受取利息		27		78
有価証券売買等損益		108,094,208		2,054,710,777
営業収益合計		108,094,235		2,054,710,855
営業費用				
支払利息		12,849		5,508
受託者報酬		8,067,849		8,466,078
委託者報酬		145,223,485		152,391,629
その他費用		403,320		423,189
営業費用合計		153,707,503		161,286,404
営業利益又は営業損失()		45,613,268		1,893,424,451
経常利益又は経常損失()		45,613,268		1,893,424,451
当期純利益又は当期純損失()		45,613,268		1,893,424,451
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		37,198,244		178,570,079
期首剰余金又は期首欠損金()		3,956,980,623		3,682,887,183
剰余金増加額又は欠損金減少額		362,644,534		575,440,882
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		362,644,534		575,440,882
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		73,600,929		31,715,131
当期一部解約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		73,600,929		31,715,131
分配金		6,535,141		5,598,030
期末剰余金又は期末欠損金()		3,682,887,183		1,429,905,090

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月8日から翌年11月7日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2020年11月10日から2021年11月8日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第33期 2020年11月9日現在	第34期 2021年11月8日現在
1.	期首元本額	14,138,258,485円	13,070,282,130円
	期中追加設定元本額	226,616,601円	170,327,435円
	期中一部解約元本額	1,294,592,956円	2,044,549,305円
2.	受益権の総数	13,070,282,130口	11,196,060,260口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	3,682,887,183円	1,429,905,090円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第33期 自 2019年11月8日 至 2020年11月9日		第34期 自 2020年11月10日 至 2021年11月8日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 1,309,631,325円
C	信託約款に定める収益調整金	1,702,878,166円	C 信託約款に定める収益調整金 1,486,589,180円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	2,280,539,309円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 1,920,030,076円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	3,983,417,475円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 4,716,250,581円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,047円	F 分配対象収益(1万口当たり) 4,212円
G	分配金額	6,535,141円	G 分配金額 5,598,030円
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H 分配金額(1万口当たり) 5円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第33期 自 2019年11月 8日 至 2020年11月 9日	第34期 自 2020年11月10日 至 2021年11月 8日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第33期 2020年11月 9日現在	第34期 2021年11月 8日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第33期（2020年11月 9日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	223,578,560
合計	223,578,560

第34期（2021年11月 8日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,862,682,315
合計	1,862,682,315

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第33期 2020年11月 9日現在		第34期 2021年11月 8日現在	
1口当たり純資産額	0.7182円	1口当たり純資産額	0.8723円
(1万口当たり純資産額)	(7,182円)	(1万口当たり純資産額)	(8,723円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	4,466,864,067	9,764,564,850	
合計		4,466,864,067	9,764,564,850	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【バランスポートフォリオ】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第33期 2020年11月 9日現在	第34期 2021年11月 8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	52,717,478	52,712,505
地方債証券	54,824,130	54,614,090
親投資信託受益証券	107,693,399	107,506,555
未収利息	42,818	42,134
流動資産合計	215,277,825	214,875,284
資産合計	215,277,825	214,875,284
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	111,785	101,764
未払受託者報酬	93,025	93,519
未払委託者報酬	1,675,571	1,684,503
未払利息	38	28
その他未払費用	4,605	4,618
流動負債合計	1,885,024	1,884,432
負債合計	1,885,024	1,884,432
純資産の部		
元本等		
元本	223,571,562	203,529,299
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,178,761	9,461,553
(分配準備積立金)	25,581,671	34,724,773
元本等合計	213,392,801	212,990,852
純資産合計	213,392,801	212,990,852
負債純資産合計	215,277,825	214,875,284

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第33期		第34期	
	自	2019年11月 8日 至 2020年11月 9日	自	2020年11月10日 至 2021年11月 8日
営業収益				
受取利息		246,495		249,452
有価証券売買等損益		2,942,853		23,206,824
営業収益合計		3,189,348		23,456,276
営業費用				
支払利息		14,297		6,235
受託者報酬		184,052		186,258
委託者報酬		3,315,124		3,354,962
その他費用		9,232		9,203
営業費用合計		3,522,705		3,556,658
営業利益又は営業損失()		333,357		19,899,618
経常利益又は経常損失()		333,357		19,899,618
当期純利益又は当期純損失()		333,357		19,899,618
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		210,060		1,404,604
期首剰余金又は期首欠損金()		9,888,055		10,178,761
剰余金増加額又は欠損金減少額		467,009		1,247,064
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		467,009		1,166,470
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		80,594
剰余金減少額又は欠損金増加額		522,633		-
当期一部解約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		522,633		-
分配金		111,785		101,764
期末剰余金又は期末欠損金()		10,178,761		9,461,553

(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>地方債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月8日から翌年11月7日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2020年11月10日から2021年11月 8日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		第33期 2020年11月 9日現在	第34期 2021年11月 8日現在
1.	期首元本額	227,178,234円	223,571,562円
	期中追加設定元本額	7,044,581円	5,792,929円
	期中一部解約元本額	10,651,253円	25,835,192円
2.	受益権の総数	223,571,562口	203,529,299口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	10,178,761円	- 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第33期 自 2019年11月 8日 至 2020年11月 9日		第34期 自 2020年11月10日 至 2021年11月 8日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	203,202円

B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	11,969,130円
C	信託約款に定める収益調整金	33,989,225円	C	信託約款に定める収益調整金	31,576,641円
D	信託約款に定める分配準備積立金	25,693,456円	D	信託約款に定める分配準備積立金	22,654,205円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	59,682,681円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	66,403,178円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,669円	F	分配対象収益(1万口当たり)	3,262円
G	分配金額	111,785円	G	分配金額	101,764円
H	分配金額(1万口当たり)	5円	H	分配金額(1万口当たり)	5円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第33期 自 2019年11月 8日 至 2020年11月 9日	第34期 自 2020年11月10日 至 2021年11月 8日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第33期 2020年11月 9日現在	第34期 2021年11月 8日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1)有価証券 同左

	(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

第33期（2020年11月 9日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
地方債証券	257,610
親投資信託受益証券	4,504,980
合計	4,247,370

第34期（2021年11月 8日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
地方債証券	210,040
親投資信託受益証券	20,507,883
合計	20,297,843

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第33期 2020年11月 9日現在		第34期 2021年11月 8日現在	
1口当たり純資産額	0.9545円	1口当たり純資産額	1.0465円
(1万口当たり純資産額)	(9,545円)	(1万口当たり純資産額)	(10,465円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
地方債証券	第401回大阪府公募公債(10年)	15,000,000	15,278,400	
	平成24年度第10回静岡県公募公債	18,000,000	18,166,680	
	平成26年度第1回滋賀県公募公債	11,000,000	11,165,110	
	平成30年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	10,000,000	10,003,900	
地方債証券 合計		54,000,000	54,614,090	
親投資信託受益証券	インデックス東証株式マザーファンド	49,179,577	107,506,555	
親投資信託受益証券 合計		49,179,577	107,506,555	
	合計	103,179,577	162,120,645	

(注)親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「インデックスポートフォリオ」「バランスポートフォリオ」は、「インデックス東証株式マザーファン

ド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

(参考)

インデックス東証株式マザーファンド

貸借対照表

	(単位:円)	
	2020年11月 9日現在	2021年11月 8日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	993,497	806,211
コール・ローン	58,507,336	47,909,393
株式	9,358,426,120	9,744,487,560
派生商品評価勘定	3,096,150	937,250
未収入金	30,486,960	-
未収配当金	81,498,829	82,395,476
流動資産合計	9,533,008,892	9,876,535,890
資産合計	9,533,008,892	9,876,535,890
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	675,550
前受金	1,665,000	385,000
未払解約金	4,172,077	1,364,283
未払利息	42	25
流動負債合計	5,837,119	2,424,858
負債合計	5,837,119	2,424,858
純資産の部		
元本等		
元本	5,384,177,187	4,516,043,644
剰余金		
剰余金又は欠損金()	4,142,994,586	5,358,067,388
元本等合計	9,527,171,773	9,874,111,032
純資産合計	9,527,171,773	9,874,111,032
負債純資産合計	9,533,008,892	9,876,535,890

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p>
--------------------	--

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2020年11月 9日現在	2021年11月 8日現在
1.	期首	2019年11月 8日	2020年11月10日
	期首元本額	5,911,412,269円	5,384,177,187円
	期首からの追加設定元本額	50,641,251円	18,387,773円
	期首からの一部解約元本額	577,876,333円	886,521,316円
	元本の内訳		
	インデックスポートフォリオ	5,323,299,064円	4,466,864,067円
	バランスポートフォリオ	60,878,123円	49,179,577円
	計	5,384,177,187円	4,516,043,644円
2.	受益権の総数	5,384,177,187口	4,516,043,644口
3.	担保資産		
	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		
	株式	67,760,550円	102,746,700円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年11月 8日 至 2020年11月 9日	自 2020年11月10日 至 2021年11月 8日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
----------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

	2020年11月 9日現在	2021年11月 8日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2020年11月 9日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	247,055,270
合計	247,055,270

(2021年11月 8日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	168,586,790
合計	168,586,790

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2020年11月 9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	114,570,000	-	117,670,000	3,100,000
合計		114,570,000	-	117,670,000	3,100,000

(2021年11月 8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	121,745,000	-	122,010,000	265,000
合計		121,745,000	-	122,010,000	265,000

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020年11月 9日現在		2021年11月 8日現在	
1口当たり純資産額	1.769円	1口当たり純資産額	2.186円
(1千口当たり純資産額)	(1,769円)	(1千口当たり純資産額)	(2,186円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	200	3,065.00	613,000	
日本水産	4,800	629.00	3,019,200	
マルハニチロ	700	2,588.00	1,811,600	
雪国まいたけ	300	1,413.00	423,900	
カネコ種苗	100	1,494.00	149,400	
サカタのタネ	600	3,370.00	2,022,000	
ホクト	400	1,957.00	782,800	
ホクリヨウ	100	748.00	74,800	
住石ホールディングス	800	139.00	111,200	
日鉄鉱業	100	6,500.00	650,000	
三井松島ホールディングス	200	1,389.00	277,800	
I N P E X	19,000	970.00	18,430,000	
石油資源開発	600	2,208.00	1,324,800	
K & O エナジーグループ	200	1,605.00	321,000	
ヒノキヤグループ	100	2,342.00	234,200	
ショーボンドホールディングス	700	4,815.00	3,370,500	
ミライト・ホールディングス	1,500	2,189.00	3,283,500	
タマホーム	300	2,279.00	683,700	
サンヨーホームズ	100	729.00	72,900	
日本アクア	200	625.00	125,000	
ファーストコーポレーション	200	777.00	155,400	
ベステラ	100	1,409.00	140,900	
キャンディル	100	520.00	52,000	
スペースバリューホールディングス	500	928.00	464,000	
ダイセキ環境ソリューション	100	1,911.00	191,100	
第一カッター興業	100	1,398.00	139,800	
安藤・間	2,600	753.00	1,957,800	
東急建設	1,400	804.00	1,125,600	
コムシスホールディングス	1,500	2,844.00	4,266,000	

ビーアールホールディングス	600	432.00	259,200
高松コンストラクショングループ	300	2,006.00	601,800
東建コーポレーション	100	9,340.00	934,000
ソネック	100	1,083.00	108,300
ヤマウラ	200	928.00	185,600
オリエンタル白石	1,700	271.00	460,700
大成建設	3,200	3,465.00	11,088,000
大林組	11,000	900.00	9,900,000
清水建設	10,300	809.00	8,332,700
飛鳥建設	300	1,056.00	316,800
長谷工コーポレーション	3,300	1,516.00	5,002,800
松井建設	500	728.00	364,000
銭高組	100	4,080.00	408,000
鹿島建設	8,000	1,359.00	10,872,000
不動テトラ	200	1,817.00	363,400
大末建設	100	1,120.00	112,000
鉄建建設	200	1,820.00	364,000
西松建設	700	3,340.00	2,338,000
三井住友建設	2,500	493.00	1,232,500
大豊建設	200	3,740.00	748,000
佐田建設	300	481.00	144,300
ナカノフドー建設	300	339.00	101,700
奥村組	600	2,976.00	1,785,600
東鉄工業	500	2,504.00	1,252,000
イチケン	100	1,908.00	190,800
富士ピー・エス	200	533.00	106,600
浅沼組	100	4,575.00	457,500
戸田建設	4,600	722.00	3,321,200
熊谷組	600	2,809.00	1,685,400
北野建設	100	2,167.00	216,700
植木組	100	1,473.00	147,300
矢作建設工業	500	731.00	365,500
ピーエス三菱	400	682.00	272,800
日本ハウスホールディングス	700	379.00	265,300
大東建託	1,100	13,510.00	14,861,000
新日本建設	500	850.00	425,000
N I P P O	900	4,040.00	3,636,000
東亜道路工業	100	5,140.00	514,000
日本道路	100	8,050.00	805,000
東亜建設工業	300	2,563.00	768,900
日本国土開発	1,100	586.00	644,600
若築建設	200	2,017.00	403,400

東洋建設	1,200	569.00	682,800
五洋建設	4,400	788.00	3,467,200
世紀東急工業	600	810.00	486,000
福田組	100	4,535.00	453,500
住友林業	2,800	2,325.00	6,510,000
日本基礎技術	300	483.00	144,900
巴コーポレーション	500	457.00	228,500
大和ハウス工業	10,100	3,615.00	36,511,500
ライト工業	700	2,018.00	1,412,600
積水ハウス	11,900	2,409.50	28,673,050
日特建設	200	696.00	139,200
北陸電気工事	200	1,030.00	206,000
ユアテック	600	653.00	391,800
日本リーテック	200	1,496.00	299,200
四電工	100	1,606.00	160,600
中電工	500	2,180.00	1,090,000
関電工	1,800	874.00	1,573,200
きんでん	2,500	1,846.00	4,615,000
東京エネシス	400	1,084.00	433,600
トーエネック	100	3,340.00	334,000
住友電設	300	2,095.00	628,500
日本電設工業	600	1,727.00	1,036,200
エクシオグループ	1,700	2,678.00	4,552,600
新日本空調	300	2,353.00	705,900
九電工	900	3,505.00	3,154,500
三機工業	700	1,447.00	1,012,900
日揮ホールディングス	3,400	1,099.00	3,736,600
中外炉工業	100	1,728.00	172,800
ヤマト	300	766.00	229,800
太平電業	200	2,652.00	530,400
高砂熱学工業	1,000	2,076.00	2,076,000
朝日工業社	100	3,420.00	342,000
明星工業	700	658.00	460,600
大気社	500	3,260.00	1,630,000
ダイダン	200	2,302.00	460,400
日比谷総合設備	400	1,958.00	783,200
フィル・カンパニー	100	2,848.00	284,800
テスホールディングス	200	2,474.00	494,800
インフロニア・ホールディングス	4,700	929.00	4,366,300
東洋エンジニアリング	500	860.00	430,000
レイズネクスト	500	1,229.00	614,500
ニッポン	1,000	1,617.00	1,617,000

日清製粉グループ本社	4,000	1,751.00	7,004,000
日東富士製粉	100	3,515.00	351,500
昭和産業	300	2,779.00	833,700
鳥越製粉	300	767.00	230,100
中部飼料	400	1,066.00	426,400
フィード・ワン	500	760.00	380,000
東洋精糖	100	1,164.00	116,400
日本甜菜製糖	200	1,643.00	328,600
D M三井製糖ホールディングス	300	1,964.00	589,200
塩水港精糖	500	219.00	109,500
日新製糖	200	1,703.00	340,600
森永製菓	800	3,965.00	3,172,000
中村屋	100	3,735.00	373,500
江崎グリコ	1,000	3,950.00	3,950,000
名糖産業	200	1,710.00	342,000
井村屋グループ	200	2,309.00	461,800
不二家	200	2,343.00	468,600
山崎製パン	2,600	1,680.00	4,368,000
第一屋製パン	100	696.00	69,600
モロゾフ	100	5,440.00	544,000
亀田製菓	200	4,490.00	898,000
寿スピリッツ	300	7,500.00	2,250,000
カルビー	1,600	2,873.00	4,596,800
森永乳業	700	6,660.00	4,662,000
六甲バター	300	1,668.00	500,400
ヤクルト本社	2,600	5,850.00	15,210,000
明治ホールディングス	2,300	7,150.00	16,445,000
雪印メグミルク	800	2,209.00	1,767,200
プリマハム	400	2,572.00	1,028,800
日本ハム	1,300	4,070.00	5,291,000
林兼産業	100	589.00	58,900
丸大食品	300	1,719.00	515,700
S Foods	300	3,435.00	1,030,500
柿安本店	100	2,581.00	258,100
伊藤ハム米久ホールディングス	2,300	689.00	1,584,700
サッポロホールディングス	1,200	2,457.00	2,948,400
アサヒグループホールディングス	8,200	5,180.00	42,476,000
キリンホールディングス	12,900	2,006.00	25,877,400
宝ホールディングス	2,400	1,536.00	3,686,400
オエノンホールディングス	1,000	380.00	380,000
養命酒製造	100	1,816.00	181,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	2,500	1,601.00	4,002,500

サントリー食品インターナショナル	2,400	4,425.00	10,620,000
ダイドーグループホールディングス	200	5,520.00	1,104,000
伊藤園	1,100	7,590.00	8,349,000
キーコーヒー	300	2,212.00	663,600
ユニカフェ	100	1,096.00	109,600
ジャパンフーズ	100	1,219.00	121,900
日清オイリオグループ	400	3,000.00	1,200,000
不二製油グループ本社	800	2,716.00	2,172,800
J・オイルミルズ	300	1,760.00	528,000
キッコーマン	2,500	9,440.00	23,600,000
味の素	7,700	3,406.00	26,226,200
ブルドックソース	200	2,165.00	433,000
キューピー	1,900	2,517.00	4,782,300
ハウス食品グループ本社	1,300	3,110.00	4,043,000
カゴメ	1,300	2,970.00	3,861,000
焼津水産化学工業	200	987.00	197,400
アリアケジャパン	300	7,150.00	2,145,000
ピエトロ	100	1,779.00	177,900
エバラ食品工業	100	2,479.00	247,900
ニチレイ	1,700	2,722.00	4,627,400
東洋水産	1,700	4,895.00	8,321,500
イトアンドホールディングス	100	2,184.00	218,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	200	793.00	158,600
日清食品ホールディングス	1,400	8,960.00	12,544,000
永谷園ホールディングス	200	2,050.00	410,000
一正蒲鉾	100	910.00	91,000
フジッコ	400	1,905.00	762,000
ロック・フィールド	400	1,766.00	706,400
日本たばこ産業	18,800	2,344.00	44,067,200
ケンコーマヨネーズ	200	1,499.00	299,800
わらべや日洋ホールディングス	200	2,156.00	431,200
なとり	200	1,958.00	391,600
イフジ産業	100	962.00	96,200
ピックルスコーポレーション	200	1,818.00	363,600
ファーマフーズ	300	2,636.00	790,800
ユーグレナ	1,800	858.00	1,544,400
紀文食品	200	1,186.00	237,200
ミヨシ油脂	100	1,311.00	131,100
理研ビタミン	400	1,801.00	720,400
片倉工業	400	1,822.00	728,800
ゲンゼ	200	4,335.00	867,000
東洋紡	1,400	1,371.00	1,919,400

ユニチカ	1,000	357.00	357,000
富士紡ホールディングス	200	4,120.00	824,000
倉敷紡績	300	1,905.00	571,500
シキボウ	200	921.00	184,200
日本毛織	1,000	916.00	916,000
ダイトウボウ	600	99.00	59,400
トーア紡コーポレーション	100	436.00	43,600
ダイドーリミテッド	500	170.00	85,000
帝国繊維	400	2,083.00	833,200
帝人	3,200	1,495.00	4,784,000
東レ	24,800	757.40	18,783,520
住江織物	100	1,770.00	177,000
日本フェルト	200	442.00	88,400
アツギ	300	646.00	193,800
ダイニック	100	762.00	76,200
セーレン	700	2,383.00	1,668,100
ソトー	100	827.00	82,700
小松マテーレ	600	1,082.00	649,200
ワコールホールディングス	800	2,218.00	1,774,400
ホギメディカル	500	3,095.00	1,547,500
クラウディアホールディングス	100	285.00	28,500
T S Iホールディングス	1,200	379.00	454,800
マツオカコーポレーション	100	1,403.00	140,300
ワールド	400	1,512.00	604,800
三陽商会	200	903.00	180,600
ナイガイ	100	326.00	32,600
オンワードホールディングス	2,000	370.00	740,000
ルックホールディングス	100	1,432.00	143,200
ゴールドウイン	600	7,270.00	4,362,000
デサント	700	4,435.00	3,104,500
キング	200	540.00	108,000
ヤマトインターナショナル	300	311.00	93,300
特種東海製紙	200	4,380.00	876,000
王子ホールディングス	14,300	572.00	8,179,600
日本製紙	1,600	1,172.00	1,875,200
三菱製紙	500	350.00	175,000
北越コーポレーション	2,200	748.00	1,645,600
中越パルプ工業	100	1,150.00	115,000
巴川製紙所	100	834.00	83,400
大王製紙	1,700	2,079.00	3,534,300
阿波製紙	100	380.00	38,000
レンゴー	3,200	828.00	2,649,600

トーマック	200	1,870.00	374,000
ザ・バック	300	2,893.00	867,900
北の達人コーポレーション	1,200	417.00	500,400
クラレ	5,000	1,044.00	5,220,000
旭化成	22,600	1,171.00	26,464,600
共和レザー	200	662.00	132,400
昭和電工	3,000	2,819.00	8,457,000
住友化学	25,100	583.00	14,633,300
住友精化	100	3,300.00	330,000
日産化学	1,900	6,540.00	12,426,000
ラサ工業	100	1,914.00	191,400
クレハ	300	8,020.00	2,406,000
多木化学	100	6,080.00	608,000
テイカ	300	1,316.00	394,800
石原産業	600	1,286.00	771,600
片倉コープアグリ	100	1,175.00	117,500
日本曹達	400	3,320.00	1,328,000
東ソー	4,900	1,815.00	8,893,500
トクヤマ	1,100	2,022.00	2,224,200
セントラル硝子	600	2,119.00	1,271,400
東亜合成	1,900	1,255.00	2,384,500
大阪ソーダ	300	2,773.00	831,900
関東電化工業	700	1,040.00	728,000
デンカ	1,300	3,685.00	4,790,500
信越化学工業	5,900	20,230.00	119,357,000
日本カーバイド工業	100	1,384.00	138,400
堺化学工業	200	2,168.00	433,600
第一稀元素化学工業	300	1,475.00	442,500
エア・ウォーター	3,200	1,761.00	5,635,200
日本酸素ホールディングス	3,300	2,711.00	8,946,300
日本化学工業	100	2,915.00	291,500
東邦アセチレン	100	1,219.00	121,900
日本パーカライズン	1,700	1,141.00	1,939,700
高圧ガス工業	500	765.00	382,500
四国化成工業	400	1,417.00	566,800
戸田工業	100	3,370.00	337,000
ステラ ケミファ	200	2,826.00	565,200
保土谷化学工業	100	5,270.00	527,000
日本触媒	600	5,650.00	3,390,000
大日精化工業	300	2,622.00	786,600
カネカ	900	4,365.00	3,928,500
三菱瓦斯化学	3,200	2,195.00	7,024,000

三井化学	3,100	3,420.00	10,602,000
J S R	3,200	4,200.00	13,440,000
東京応化工業	600	7,490.00	4,494,000
大阪有機化学工業	300	3,460.00	1,038,000
三菱ケミカルホールディングス	22,800	945.30	21,552,840
K Hネオケム	600	3,330.00	1,998,000
ダイセル	4,900	841.00	4,120,900
住友ベークライト	500	5,360.00	2,680,000
積水化学工業	7,200	1,911.00	13,759,200
日本ゼオン	3,100	1,338.00	4,147,800
アイカ工業	1,000	3,415.00	3,415,000
宇部興産	1,600	2,119.00	3,390,400
積水樹脂	500	2,143.00	1,071,500
タキロンシーアイ	700	570.00	399,000
旭有機材	200	1,469.00	293,800
ニチバン	200	1,908.00	381,600
リケンテクノス	800	540.00	432,000
大倉工業	200	2,134.00	426,800
積水化成成品工業	400	534.00	213,600
群栄化学工業	100	3,245.00	324,500
タイガースポリマー	200	432.00	86,400
ミライアル	100	1,572.00	157,200
ダイキアクシス	100	920.00	92,000
ダイキョーニシカワ	700	700.00	490,000
竹本容器	100	864.00	86,400
森六ホールディングス	200	1,871.00	374,200
恵和	100	5,200.00	520,000
日本化薬	2,700	1,234.00	3,331,800
カーリットホールディングス	300	772.00	231,600
日本精化	300	2,036.00	610,800
扶桑化学工業	300	4,840.00	1,452,000
トリケミカル研究所	300	3,430.00	1,029,000
A D E K A	1,600	2,584.00	4,134,400
日油	1,200	5,890.00	7,068,000
新日本理化	500	302.00	151,000
ハリマ化成グループ	200	864.00	172,800
花王	7,700	6,310.00	48,587,000
第一工業製薬	100	3,435.00	343,500
石原ケミカル	200	1,449.00	289,800
日華化学	100	905.00	90,500
ニイタカ	100	2,340.00	234,000
三洋化成工業	200	5,480.00	1,096,000

有機合成薬品工業	200	304.00	60,800
大日本塗料	400	850.00	340,000
日本ペイントホールディングス	12,900	1,191.00	15,363,900
関西ペイント	3,500	2,620.00	9,170,000
神東塗料	200	189.00	37,800
中国塗料	800	844.00	675,200
日本特殊塗料	200	1,019.00	203,800
藤倉化成	400	529.00	211,600
太陽ホールディングス	500	3,075.00	1,537,500
D I C	1,400	3,050.00	4,270,000
サカタインクス	700	1,091.00	763,700
東洋インキS Cホールディングス	700	2,015.00	1,410,500
T & K T O K A	300	825.00	247,500
富士フィルムホールディングス	6,100	9,104.00	55,534,400
資生堂	6,500	7,825.00	50,862,500
ライオン	4,200	1,798.00	7,551,600
高砂香料工業	200	2,930.00	586,000
マンダム	700	1,712.00	1,198,400
ミルボン	400	6,840.00	2,736,000
ファンケル	1,400	3,665.00	5,131,000
コーセー	700	14,030.00	9,821,000
コタ	200	1,577.00	315,400
シーボン	100	1,819.00	181,900
ポーラ・オルビスホールディングス	1,500	2,364.00	3,546,000
ノエビアホールディングス	300	5,690.00	1,707,000
アジュバンホールディングス	100	1,251.00	125,100
新日本製薬	100	1,671.00	167,100
エステー	200	1,604.00	320,800
アグロ カネショウ	100	1,335.00	133,500
コニシ	600	1,757.00	1,054,200
長谷川香料	600	2,786.00	1,671,600
星光P M C	200	777.00	155,400
小林製薬	1,000	9,470.00	9,470,000
荒川化学工業	300	1,196.00	358,800
メック	300	3,310.00	993,000
日本高純度化学	100	2,823.00	282,300
タカラバイオ	900	3,005.00	2,704,500
J C U	400	4,655.00	1,862,000
新田ゼラチン	200	618.00	123,600
O A T アグリオ	100	2,050.00	205,000
デクセリアルズ	900	3,285.00	2,956,500
アース製薬	300	6,900.00	2,070,000

北興化学工業	300	988.00	296,400
大成ラミック	100	2,790.00	279,000
クミアイ化学工業	1,300	866.00	1,125,800
日本農薬	600	545.00	327,000
アキレス	200	1,330.00	266,000
有沢製作所	500	954.00	477,000
日東電工	2,100	8,800.00	18,480,000
レック	400	993.00	397,200
三光合成	400	417.00	166,800
きもと	500	231.00	115,500
藤森工業	300	4,730.00	1,419,000
前澤化成工業	200	1,299.00	259,800
未来工業	100	1,668.00	166,800
ウェーブロックホールディングス	100	718.00	71,800
J S P	200	1,596.00	319,200
エフピコ	600	3,780.00	2,268,000
天馬	300	2,714.00	814,200
信越ポリマー	600	1,021.00	612,600
東リ	800	232.00	185,600
ニフコ	1,200	3,665.00	4,398,000
バルカー	300	2,485.00	745,500
ユニ・チャーム	6,700	4,649.00	31,148,300
ショーエイコーポレーション	100	787.00	78,700
協和キリン	4,100	3,790.00	15,539,000
武田薬品工業	27,500	3,246.00	89,265,000
アステラス製薬	30,300	1,984.50	60,130,350
大日本住友製薬	2,200	1,555.00	3,421,000
塩野義製薬	4,400	7,087.00	31,182,800
わかもと製薬	500	317.00	158,500
日本新薬	900	9,060.00	8,154,000
中外製薬	10,900	4,100.00	44,690,000
科研製薬	600	4,200.00	2,520,000
エーザイ	4,200	8,315.00	34,923,000
ロート製薬	1,800	3,440.00	6,192,000
小野薬品工業	8,000	2,441.50	19,532,000
久光製薬	900	3,860.00	3,474,000
持田製薬	400	3,310.00	1,324,000
参天製薬	6,500	1,632.00	10,608,000
扶桑薬品工業	100	2,557.00	255,700
ツムラ	1,100	3,605.00	3,965,500
日医工	1,100	889.00	977,900
キッセイ薬品工業	600	2,340.00	1,404,000

生化学工業	600	1,005.00	603,000
栄研化学	600	1,872.00	1,123,200
日水製薬	100	967.00	96,700
鳥居薬品	200	2,941.00	588,200
JCRファーマ	1,000	2,839.00	2,839,000
東和薬品	500	2,983.00	1,491,500
富士製薬工業	200	1,159.00	231,800
ゼリア新薬工業	600	2,083.00	1,249,800
第一三共	27,500	2,791.00	76,752,500
キョーリン製薬ホールディングス	700	1,761.00	1,232,700
大幸薬品	600	768.00	460,800
ダイト	200	3,120.00	624,000
大塚ホールディングス	7,300	4,499.00	32,842,700
大正製薬ホールディングス	800	6,060.00	4,848,000
ペプチドリーム	1,800	2,660.00	4,788,000
あすか製薬ホールディングス	400	1,012.00	404,800
サワイグループホールディングス	800	5,060.00	4,048,000
日本コークス工業	3,000	138.00	414,000
ニチレキ	400	1,321.00	528,400
ユシロ化学工業	200	1,179.00	235,800
ピーピー・カストロール	100	1,406.00	140,600
富士石油	900	268.00	241,200
MORESCO	100	1,182.00	118,200
出光興産	3,900	3,155.00	12,304,500
ENEOSホールディングス	52,500	465.70	24,449,250
コスモエネルギーホールディングス	1,000	2,305.00	2,305,000
横浜ゴム	2,000	2,037.00	4,074,000
TOYO TIRE	1,800	1,980.00	3,564,000
ブリヂストン	10,100	5,158.00	52,095,800
住友ゴム工業	3,100	1,493.00	4,628,300
藤倉コンポジット	300	752.00	225,600
オカモト	200	3,995.00	799,000
フコク	100	1,015.00	101,500
ニッタ	400	2,717.00	1,086,800
住友理工	700	634.00	443,800
三ツ星ベルト	400	2,006.00	802,400
バンドー化学	600	890.00	534,000
日東紡績	500	3,420.00	1,710,000
AGC	3,200	5,800.00	18,560,000
日本板硝子	1,600	607.00	971,200
石塚硝子	100	2,115.00	211,500
日本山村硝子	100	843.00	84,300

日本電気硝子	1,400	2,737.00	3,831,800
オハラ	100	1,402.00	140,200
住友大阪セメント	600	3,365.00	2,019,000
太平洋セメント	2,000	2,466.00	4,932,000
日本ヒューム	300	744.00	223,200
日本コンクリート工業	600	295.00	177,000
三谷セキサン	200	8,120.00	1,624,000
アジアパイルホールディングス	500	455.00	227,500
東海カーボン	2,900	1,361.00	3,946,900
日本カーボン	200	4,355.00	871,000
東洋炭素	200	3,230.00	646,000
ノリタケカンパニーリミテド	200	5,020.00	1,004,000
TOTO	2,500	5,420.00	13,550,000
日本碍子	3,800	1,961.00	7,451,800
日本特殊陶業	2,700	1,936.00	5,227,200
ダントーホールディングス	200	233.00	46,600
MARUWA	100	13,330.00	1,333,000
品川リフラクトリーズ	100	3,705.00	370,500
黒崎播磨	100	4,245.00	424,500
ヨータイ	200	1,270.00	254,000
イソライト工業	100	853.00	85,300
東京窯業	400	323.00	129,200
ニッカトー	100	760.00	76,000
フジインコーポレーテッド	300	7,500.00	2,250,000
クニミネ工業	100	1,112.00	111,200
エーアンドエーマテリアル	100	953.00	95,300
ニチアス	800	2,811.00	2,248,800
ニチハ	500	3,200.00	1,600,000
日本製鉄	15,400	1,918.00	29,537,200
神戸製鋼所	5,900	609.00	3,593,100
中山製鋼所	500	446.00	223,000
合同製鐵	200	1,435.00	287,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	9,300	1,500.00	13,950,000
東京製鐵	1,200	1,195.00	1,434,000
共英製鋼	400	1,351.00	540,400
大和工業	700	3,560.00	2,492,000
東京鐵鋼	100	1,463.00	146,300
大阪製鐵	200	1,101.00	220,200
淀川製鋼所	400	2,431.00	972,400
丸一鋼管	1,200	2,602.00	3,122,400
モリ工業	100	2,730.00	273,000
大同特殊鋼	600	4,165.00	2,499,000

日本高周波鋼業	100	385.00	38,500
日本冶金工業	200	2,336.00	467,200
山陽特殊製鋼	300	2,049.00	614,700
愛知製鋼	200	2,663.00	532,600
日立金属	3,700	2,152.00	7,962,400
日本金属	100	1,019.00	101,900
大太平洋金属	200	2,130.00	426,000
新日本電工	2,200	357.00	785,400
栗本鐵工所	200	1,587.00	317,400
三菱製鋼	200	1,056.00	211,200
日亜鋼業	400	287.00	114,800
日本精線	100	4,650.00	465,000
エンビプロ・ホールディングス	100	2,471.00	247,100
シンニッタン	400	230.00	92,000
新家工業	100	1,721.00	172,100
大紀アルミニウム工業所	500	1,610.00	805,000
日本軽金属ホールディングス	900	1,825.00	1,642,500
三井金属鉱業	900	3,205.00	2,884,500
東邦亜鉛	200	2,937.00	587,400
三菱マテリアル	2,300	2,212.00	5,087,600
住友金属鉱山	4,400	4,434.00	19,509,600
D O W Aホールディングス	900	4,795.00	4,315,500
古河機械金属	600	1,264.00	758,400
エス・サイエンス	1,700	30.00	51,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	400	865.00	346,000
東邦チタニウム	600	1,142.00	685,200
U A C J	500	2,807.00	1,403,500
C Kサンエツ	100	3,380.00	338,000
古河電気工業	1,100	2,467.00	2,713,700
住友電気工業	12,900	1,524.00	19,659,600
フジクラ	3,800	620.00	2,356,000
昭和電線ホールディングス	300	1,969.00	590,700
東京特殊電線	100	2,853.00	285,300
タツタ電線	600	504.00	302,400
カナレ電気	100	1,720.00	172,000
平河ヒューテック	200	1,215.00	243,000
リョービ	400	1,183.00	473,200
アーレスティ	400	395.00	158,000
アサヒホールディングス	1,400	2,061.00	2,885,400
稲葉製作所	200	1,357.00	271,400
宮地エンジニアリンググループ	100	2,631.00	263,100
トーカロ	900	1,355.00	1,219,500

アルファC o	100	1,238.00	123,800
SUMCO	5,300	2,427.00	12,863,100
川田テクノロジーズ	100	3,810.00	381,000
RS Technologies	100	6,590.00	659,000
信和	200	790.00	158,000
東洋製罐グループホールディングス	2,200	1,465.00	3,223,000
ホッカンホールディングス	200	1,513.00	302,600
コロナ	200	903.00	180,600
横河ブリッジホールディングス	600	2,194.00	1,316,400
駒井ハルテック	100	1,614.00	161,400
三和ホールディングス	3,300	1,299.00	4,286,700
文化シャッター	1,100	1,083.00	1,191,300
三協立山	400	746.00	298,400
アルインコ	200	959.00	191,800
東洋シャッター	100	647.00	64,700
LIXIL	5,400	2,959.00	15,978,600
日本フィルコン	200	546.00	109,200
ノーリツ	700	1,831.00	1,281,700
長府製作所	300	2,051.00	615,300
リンナイ	700	12,060.00	8,442,000
ダイニチ工業	200	784.00	156,800
日東精工	400	658.00	263,200
岡部	700	675.00	472,500
ジーテクト	400	1,437.00	574,800
東プレ	600	1,347.00	808,200
高周波熱錬	600	600.00	360,000
東京製綱	200	872.00	174,400
サンコール	300	478.00	143,400
モリテック スチール	200	414.00	82,800
パイオラックス	500	1,667.00	833,500
エイチワン	300	703.00	210,900
日本発條	3,200	876.00	2,803,200
中央発條	200	919.00	183,800
立川ブラインド工業	100	1,240.00	124,000
三益半導体工業	300	2,514.00	754,200
日本ドライケミカル	100	1,969.00	196,900
日本製綱所	1,000	3,455.00	3,455,000
三浦工業	1,500	4,445.00	6,667,500
タクマ	1,200	1,505.00	1,806,000
ツガミ	800	1,547.00	1,237,600
オークマ	400	5,470.00	2,188,000
芝浦機械	400	2,707.00	1,082,800

アマダ	5,500	1,157.00	6,363,500
アイダエンジニアリング	900	1,045.00	940,500
滝澤鉄工所	100	1,133.00	113,300
F U J I	1,600	2,744.00	4,390,400
牧野フライス製作所	400	3,915.00	1,566,000
オーエスジー	1,600	1,890.00	3,024,000
旭ダイヤモンド工業	900	714.00	642,600
D M G 森精機	2,100	2,041.00	4,286,100
ソディック	800	875.00	700,000
ディスコ	500	32,700.00	16,350,000
日東工器	200	1,857.00	371,400
日進工具	300	1,584.00	475,200
パンチ工業	300	583.00	174,900
富士ダイス	200	640.00	128,000
豊和工業	200	813.00	162,600
O K K	100	350.00	35,000
石川製作所	100	1,464.00	146,400
東洋機械金属	200	575.00	115,000
津田駒工業	100	810.00	81,000
エンシュウ	100	718.00	71,800
島精機製作所	500	2,257.00	1,128,500
オプトラン	400	2,362.00	944,800
N C ホールディングス	100	1,602.00	160,200
イワキポンプ	200	1,077.00	215,400
フリー	300	1,633.00	489,900
ヤマシンフィルタ	700	648.00	453,600
日阪製作所	400	861.00	344,400
やまびこ	700	1,284.00	898,800
野村マイクロ・サイエンス	100	5,100.00	510,000
平田機工	200	7,030.00	1,406,000
ペガサスミシン製造	400	517.00	206,800
マルマエ	100	2,422.00	242,200
タツモ	200	1,746.00	349,200
ナブテスコ	2,000	3,650.00	7,300,000
三井海洋開発	400	1,609.00	643,600
レオン自動機	400	1,395.00	558,000
S M C	1,000	71,400.00	71,400,000
ホソカワミクロン	200	3,165.00	633,000
ユニオンツール	100	3,900.00	390,000
オイレス工業	500	1,700.00	850,000
日精エー・エス・ビー機械	100	3,820.00	382,000
サトーホールディングス	500	2,611.00	1,305,500

技研製作所	300	4,420.00	1,326,000
日本エアージェット	200	1,262.00	252,400
カワタ	100	981.00	98,100
日精樹脂工業	200	1,119.00	223,800
オカダアイヨン	100	1,272.00	127,200
ワイエイシイホールディングス	100	951.00	95,100
小松製作所	15,800	3,103.00	49,027,400
住友重機械工業	2,000	2,950.00	5,900,000
日立建機	1,400	3,715.00	5,201,000
日工	500	661.00	330,500
巴工業	100	2,278.00	227,800
井関農機	300	1,671.00	501,300
TOWA	300	2,654.00	796,200
丸山製作所	100	1,531.00	153,100
北川鉄工所	200	1,582.00	316,400
ローツェ	200	12,120.00	2,424,000
タカキタ	100	663.00	66,300
クボタ	17,000	2,285.00	38,845,000
荏原実業	200	2,661.00	532,200
三菱化工機	100	2,489.00	248,900
月島機械	600	1,158.00	694,800
帝国電機製作所	200	1,440.00	288,000
東京機械製作所	200	1,700.00	340,000
新東工業	800	737.00	589,600
澁谷工業	300	3,005.00	901,500
アイチ コーポレーション	500	803.00	401,500
小森コーポレーション	900	729.00	656,100
鶴見製作所	300	1,851.00	555,300
住友精密工業	100	2,367.00	236,700
日本ギア工業	100	289.00	28,900
酒井重工業	100	2,547.00	254,700
荏原製作所	1,500	6,470.00	9,705,000
西島製作所	300	929.00	278,700
北越工業	300	1,001.00	300,300
ダイキン工業	4,500	25,550.00	114,975,000
オルガノ	100	6,820.00	682,000
トーヨーカネツ	100	2,621.00	262,100
栗田工業	1,900	5,850.00	11,115,000
椿本チエイン	500	3,195.00	1,597,500
大同工業	200	1,019.00	203,800
木村化工機	300	777.00	233,100
アネスト岩田	500	959.00	479,500

ダイフク	1,900	10,050.00	19,095,000
サムコ	100	2,854.00	285,400
加藤製作所	200	835.00	167,000
油研工業	100	1,742.00	174,200
タダノ	1,800	1,140.00	2,052,000
フジテック	1,300	2,545.00	3,308,500
C K D	1,000	2,415.00	2,415,000
キトー	300	1,742.00	522,600
平和	1,000	2,107.00	2,107,000
理想科学工業	300	2,039.00	611,700
S A N K Y O	800	2,858.00	2,286,400
日本金銭機械	300	808.00	242,400
マースグループホールディングス	200	1,639.00	327,800
フクシマガリレイ	200	4,575.00	915,000
オーイズミ	100	382.00	38,200
ダイコク電機	200	1,254.00	250,800
竹内製作所	500	3,010.00	1,505,000
アマノ	900	2,768.00	2,491,200
J U K I	500	805.00	402,500
サンデンホールディングス	500	272.00	136,000
ジャノメ	300	694.00	208,200
マックス	500	1,858.00	929,000
グローリー	900	2,405.00	2,164,500
新晃工業	300	2,099.00	629,700
大和冷機工業	500	1,294.00	647,000
セガサミーホールディングス	3,500	1,838.00	6,433,000
日本ピストンリング	100	1,328.00	132,800
リケン	200	2,776.00	555,200
T P R	500	1,473.00	736,500
ツバキ・ナカシマ	800	1,600.00	1,280,000
ホシザキ	1,000	9,680.00	9,680,000
大豊工業	300	808.00	242,400
日本精工	6,600	770.00	5,082,000
N T N	7,500	236.00	1,770,000
ジェイテクト	3,400	1,039.00	3,532,600
不二越	300	4,340.00	1,302,000
日本トムソン	1,000	603.00	603,000
T H K	2,000	2,434.00	4,868,000
ユーシン精機	300	780.00	234,000
前澤給装工業	200	1,055.00	211,000
イーグル工業	400	1,233.00	493,200
前澤工業	200	665.00	133,000

日本ピラー工業	400	2,797.00	1,118,800
キット	1,200	787.00	944,400
マキタ	4,200	5,253.00	22,062,600
三井E & Sホールディングス	1,200	441.00	529,200
日立造船	2,900	875.00	2,537,500
三菱重工業	5,500	2,919.50	16,057,250
I H I	2,200	2,851.00	6,272,200
サノヤスホールディングス	500	132.00	66,000
スター精密	500	1,493.00	746,500
日清紡ホールディングス	2,100	901.00	1,892,100
イビデン	1,800	6,750.00	12,150,000
コニカミノルタ	7,700	515.00	3,965,500
ブラザー工業	4,300	2,171.00	9,335,300
ミネベアミツミ	6,000	3,140.00	18,840,000
日立製作所	16,800	7,111.00	119,464,800
東芝	6,100	4,975.00	30,347,500
三菱電機	34,900	1,534.00	53,536,600
富士電機	2,100	5,710.00	11,991,000
東洋電機製造	100	1,055.00	105,500
安川電機	3,800	5,130.00	19,494,000
シンフォニアテクノロジー	400	1,374.00	549,600
明電舎	600	2,644.00	1,586,400
オリジン	100	1,290.00	129,000
山洋電気	200	6,250.00	1,250,000
デンヨー	300	1,978.00	593,400
東芝テック	400	4,580.00	1,832,000
芝浦メカトロニクス	100	7,780.00	778,000
マブチモーター	800	3,805.00	3,044,000
日本電産	9,100	13,025.00	118,527,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	650.00	130,000
トレックス・セミコンダクター	200	2,647.00	529,400
東光高岳	200	1,414.00	282,800
ダブル・スコープ	1,000	929.00	929,000
ダイヘン	400	4,700.00	1,880,000
ヤーマン	600	1,418.00	850,800
JVCケンウッド	2,900	182.00	527,800
ミマキエンジニアリング	300	1,029.00	308,700
I - P E X	200	2,113.00	422,600
日新電機	800	1,455.00	1,164,000
大崎電気工業	700	515.00	360,500
オムロン	2,900	11,495.00	33,335,500
日東工業	500	1,674.00	837,000

I D E C	400	2,640.00	1,056,000	
正興電機製作所	100	1,219.00	121,900	
不二電機工業	100	1,281.00	128,100	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,200	2,264.00	2,716,800	
サクサホールディングス	100	1,427.00	142,700	
メルコホールディングス	100	4,260.00	426,000	
テクノメディカ	100	1,685.00	168,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	100	2,087.00	208,700	
日本電気	4,400	5,650.00	24,860,000	
富士通	3,100	20,680.00	64,108,000	
沖電気工業	1,400	990.00	1,386,000	
岩崎通信機	100	880.00	88,000	
電気興業	200	2,550.00	510,000	
サンケン電気	300	5,730.00	1,719,000	
ナカヨ	100	1,351.00	135,100	
アイホン	200	2,345.00	469,000	
ルネサスエレクトロニクス	18,900	1,473.00	27,839,700	
セイコーエプソン	4,300	1,983.00	8,526,900	
ワコム	2,700	826.00	2,230,200	
アルバック	600	6,790.00	4,074,000	
アクセル	200	758.00	151,600	
E I Z O	300	4,215.00	1,264,500	
日本信号	900	990.00	891,000	
京三製作所	800	481.00	384,800	
能美防災	500	2,059.00	1,029,500	
ホーチキ	200	1,287.00	257,400	
星和電機	200	521.00	104,200	
エレコム	800	1,710.00	1,368,000	
パナソニック	37,200	1,368.50	50,908,200	
シャープ	4,000	1,330.00	5,320,000	
アンリツ	2,300	1,959.00	4,505,700	
富士通ゼネラル	900	2,746.00	2,471,400	
ソニーグループ	21,900	13,985.00	306,271,500	代用有価証券 4,300株
T D K	5,100	4,435.00	22,618,500	
帝国通信工業	200	1,394.00	278,800	
タムラ製作所	1,300	703.00	913,900	
アルプスアルパイン	3,100	1,130.00	3,503,000	
池上通信機	100	775.00	77,500	
日本電波工業	300	930.00	279,000	
鈴木	200	908.00	181,600	
メイコー	300	3,845.00	1,153,500	

日本トリム	100	3,440.00	344,000
ローランド ディー・ジー	200	3,100.00	620,000
フォスター電機	300	809.00	242,700
SMK	100	2,403.00	240,300
ヨコオ	300	2,582.00	774,600
ティアック	300	119.00	35,700
ホシデン	800	1,350.00	1,080,000
ヒロセ電機	500	18,950.00	9,475,000
日本航空電子工業	800	1,864.00	1,491,200
TOA	400	816.00	326,400
マクセル	700	1,361.00	952,700
古野電気	400	1,268.00	507,200
ユニデンホールディングス	100	3,275.00	327,500
スミダコーポレーション	300	1,306.00	391,800
アイコム	100	2,407.00	240,700
リオン	100	2,343.00	234,300
本多通信工業	300	448.00	134,400
横河電機	3,500	2,329.00	8,151,500
新電元工業	100	4,110.00	411,000
アズビル	2,000	5,110.00	10,220,000
東亜ディーケーケー	200	844.00	168,800
日本光電工業	1,400	3,620.00	5,068,000
チノー	100	1,427.00	142,700
共和電業	300	402.00	120,600
日本電子材料	200	1,927.00	385,400
堀場製作所	600	7,680.00	4,608,000
アドバンテスト	2,600	10,070.00	26,182,000
小野測器	200	504.00	100,800
エスベック	300	2,340.00	702,000
キーエンス	3,200	72,460.00	231,872,000
日置電機	200	8,310.00	1,662,000
シスメックス	3,000	13,950.00	41,850,000
日本マイクロニクス	600	1,549.00	929,400
メガチップス	300	4,090.00	1,227,000
OBARA GROUP	200	3,710.00	742,000
原田工業	200	981.00	196,200
コーセル	400	932.00	372,800
イリソ電子工業	300	5,260.00	1,578,000
オブテックスグループ	600	1,511.00	906,600
千代田インテグレ	100	2,170.00	217,000
アイ・オー・データ機器	100	914.00	91,400
レーザーテック	1,500	27,475.00	41,212,500

スタンレー電気	2,500	3,035.00	7,587,500
岩崎電気	100	2,121.00	212,100
ウシオ電機	1,800	2,323.00	4,181,400
岡谷電機産業	300	345.00	103,500
ハリオス テクノ ホールディング	300	309.00	92,700
エノモト	100	1,767.00	176,700
日本セラミック	300	2,927.00	878,100
遠藤照明	200	1,141.00	228,200
古河電池	300	1,526.00	457,800
双信電機	200	654.00	130,800
山一電機	300	2,033.00	609,900
図研	200	4,665.00	933,000
日本電子	700	9,290.00	6,503,000
カシオ計算機	2,500	1,600.00	4,000,000
ファナック	3,100	22,630.00	70,153,000
日本シイエムケイ	700	470.00	329,000
エンプラス	100	2,827.00	282,700
大真空	400	1,043.00	417,200
ローム	1,600	11,080.00	17,728,000
浜松ホトニクス	2,500	6,880.00	17,200,000
三井ハイテック	300	8,790.00	2,637,000
新光電気工業	1,000	4,925.00	4,925,000
京セラ	4,900	7,150.00	35,035,000
太陽誘電	1,700	5,920.00	10,064,000
村田製作所	10,300	8,461.00	87,148,300
双葉電子工業	600	822.00	493,200
北陸電気工業	100	1,020.00	102,000
ニチコン	1,100	1,035.00	1,138,500
日本ケミコン	300	1,968.00	590,400
K O A	500	1,578.00	789,000
市光工業	400	579.00	231,600
小糸製作所	1,900	6,690.00	12,711,000
ミツバ	600	626.00	375,600
S C R E E Nホールディングス	600	11,360.00	6,816,000
キャノン電子	300	1,576.00	472,800
キャノン	17,400	2,605.50	45,335,700
リコー	9,700	1,082.00	10,495,400
象印マホービン	900	1,580.00	1,422,000
東京エレクトロン	2,200	57,310.00	126,082,000
トヨタ紡織	1,400	2,273.00	3,182,200
芦森工業	100	989.00	98,900
ユニプレス	500	909.00	454,500

豊田自動織機	2,800	9,850.00	27,580,000	
モリタホールディングス	600	1,426.00	855,600	
三櫻工業	500	1,013.00	506,500	
デンソー	7,700	8,301.00	63,917,700	
東海理化電機製作所	900	1,606.00	1,445,400	
川崎重工業	2,600	2,327.00	6,050,200	
名村造船所	1,100	227.00	249,700	
日本車輛製造	100	2,113.00	211,300	
三菱ロジスネクスト	500	1,017.00	508,500	
近畿車輛	100	1,084.00	108,400	
日産自動車	41,200	591.20	24,357,440	
いすゞ自動車	11,000	1,593.00	17,523,000	
トヨタ自動車	177,000	2,028.00	358,956,000	
日野自動車	4,400	1,104.00	4,857,600	
三菱自動車工業	13,000	370.00	4,810,000	
エフテック	300	570.00	171,000	
レシップホールディングス	200	589.00	117,800	
G M B	100	770.00	77,000	
ファルテック	100	699.00	69,900	
武蔵精密工業	800	1,920.00	1,536,000	
日産車体	500	788.00	394,000	
新明和工業	1,000	919.00	919,000	
極東開発工業	600	1,551.00	930,600	
トピー工業	300	1,146.00	343,800	
ティラド	100	3,130.00	313,000	
タチエス	600	1,416.00	849,600	
N O K	1,700	1,374.00	2,335,800	
フタバ産業	900	440.00	396,000	
K Y B	400	3,200.00	1,280,000	
大同メタル工業	700	606.00	424,200	
プレス工業	1,800	406.00	730,800	
ミクニ	500	316.00	158,000	
太平洋工業	700	1,231.00	861,700	
河西工業	500	336.00	168,000	
アイシン	2,600	4,150.00	10,790,000	
マツダ	11,000	1,027.00	11,297,000	
今仙電機製作所	200	655.00	131,000	
本田技研工業	27,500	3,295.00	90,612,500	代用有価証券 4,700株
スズキ	8,000	5,446.00	43,568,000	
S U B A R U	10,000	2,213.00	22,130,000	
安永	200	1,083.00	216,600	
ヤマハ発動機	4,600	3,050.00	14,030,000	

T B K	400	413.00	165,200
エクセディ	500	1,743.00	871,500
豊田合成	1,100	2,358.00	2,593,800
愛三工業	600	832.00	499,200
盟和産業	100	1,020.00	102,000
日本プラスト	300	628.00	188,400
ヨロズ	300	1,218.00	365,400
エフ・シー・シー	600	1,617.00	970,200
シマノ	1,400	31,450.00	44,030,000
テイ・エス テック	1,500	1,458.00	2,187,000
ジャムコ	200	1,007.00	201,400
テルモ	9,900	4,889.00	48,401,100
クリエートメディック	100	980.00	98,000
日機装	1,000	1,027.00	1,027,000
日本エム・ディ・エム	200	2,158.00	431,600
島津製作所	4,500	4,675.00	21,037,500
J M S	300	645.00	193,500
長野計器	300	1,421.00	426,300
ブイ・テクノロジー	200	4,300.00	860,000
東京計器	200	1,010.00	202,000
インターアクション	200	2,363.00	472,600
オーバル	300	256.00	76,800
東京精密	600	5,270.00	3,162,000
マニー	1,400	1,855.00	2,597,000
ニコン	5,300	1,242.00	6,582,600
トプコン	1,600	2,041.00	3,265,600
オリンパス	18,300	2,656.50	48,613,950
理研計器	300	3,170.00	951,000
タムロン	300	2,575.00	772,500
H O Y A	6,800	18,035.00	122,638,000
シード	200	622.00	124,400
ノーリツ鋼機	300	2,463.00	738,900
エー・アンド・デイ	300	1,052.00	315,600
朝日インテック	3,800	2,841.00	10,795,800
シチズン時計	4,100	496.00	2,033,600
リズム	100	1,359.00	135,900
大研医器	300	560.00	168,000
メニコン	1,200	4,345.00	5,214,000
松風	100	2,286.00	228,600
セイコーホールディングス	500	2,484.00	1,242,000
ニプロ	2,600	1,162.00	3,021,200
中本パックス	100	1,743.00	174,300

スノーピーク	200	6,230.00	1,246,000
パラマウントベッドホールディングス	700	2,026.00	1,418,200
トランザクション	200	1,109.00	221,800
粧美堂	100	408.00	40,800
ニホンフラッシュ	300	1,109.00	332,700
前田工織	400	3,500.00	1,400,000
永大産業	400	294.00	117,600
アートネイチャー	300	695.00	208,500
バンダイナムコホールディングス	3,100	9,262.00	28,712,200
アイフィスジャパン	100	667.00	66,700
共立印刷	500	155.00	77,500
S H O E I	300	5,140.00	1,542,000
フランスベッドホールディングス	400	903.00	361,200
パイロットコーポレーション	600	4,155.00	2,493,000
萩原工業	200	1,506.00	301,200
トッパン・フォームズ	500	1,038.00	519,000
フジシールインターナショナル	800	2,553.00	2,042,400
タカラトミー	1,400	1,105.00	1,547,000
広済堂ホールディングス	200	937.00	187,400
エステールホールディングス	100	638.00	63,800
タカノ	100	737.00	73,700
プロネクサス	200	1,062.00	212,400
ホクシン	100	179.00	17,900
ウッドワン	100	1,062.00	106,200
大建工業	200	2,449.00	489,800
凸版印刷	5,300	1,840.00	9,752,000
大日本印刷	4,100	2,859.00	11,721,900
共同印刷	100	2,620.00	262,000
N I S S H A	700	1,832.00	1,282,400
T A K A R A & C O M P A N Y	100	1,797.00	179,700
アシックス	3,100	2,978.00	9,231,800
ツツミ	100	2,283.00	228,300
ローランド	200	4,765.00	953,000
小松ウオール工業	100	1,967.00	196,700
ヤマハ	2,100	6,520.00	13,692,000
河合楽器製作所	100	3,410.00	341,000
クリナップ	300	545.00	163,500
ピジョン	2,100	2,406.00	5,052,600
キングジム	300	886.00	265,800
リンテック	700	2,501.00	1,750,700
イトーキ	600	385.00	231,000
任天堂	2,000	49,260.00	98,520,000

三菱鉛筆	600	1,285.00	771,000
タカスタンダード	700	1,453.00	1,017,100
コクヨ	1,700	1,729.00	2,939,300
ナカバヤシ	300	551.00	165,300
グローブライド	300	3,335.00	1,000,500
オカムラ	1,200	1,378.00	1,653,600
美津濃	300	2,657.00	797,100
東京電力ホールディングス	26,200	308.00	8,069,600
中部電力	10,700	1,140.00	12,198,000
関西電力	13,200	1,050.00	13,860,000
中国電力	5,500	870.00	4,785,000
北陸電力	3,200	530.00	1,696,000
東北電力	8,200	739.00	6,059,800
四国電力	3,100	701.00	2,173,100
九州電力	7,200	814.00	5,860,800
北海道電力	3,000	457.00	1,371,000
沖縄電力	700	1,400.00	980,000
電源開発	3,000	1,455.00	4,365,000
エフオン	200	798.00	159,600
イーレックス	500	2,555.00	1,277,500
レノバ	700	5,450.00	3,815,000
東京瓦斯	6,700	2,003.00	13,420,100
大阪瓦斯	6,300	1,838.00	11,579,400
東邦瓦斯	1,600	3,185.00	5,096,000
北海道瓦斯	200	1,516.00	303,200
広島ガス	700	369.00	258,300
西部ガスホールディングス	400	2,195.00	878,000
静岡ガス	900	1,149.00	1,034,100
メタウォーター	400	1,969.00	787,600
SBSホールディングス	300	3,900.00	1,170,000
東武鉄道	3,400	2,857.00	9,713,800
相鉄ホールディングス	1,100	2,176.00	2,393,600
東急	8,800	1,673.00	14,722,400
京浜急行電鉄	4,500	1,320.00	5,940,000
小田急電鉄	5,200	2,394.00	12,448,800
京王電鉄	1,800	5,560.00	10,008,000
京成電鉄	2,400	3,740.00	8,976,000
富士急行	400	4,810.00	1,924,000
新京成電鉄	100	2,051.00	205,100
東日本旅客鉄道	6,100	7,337.00	44,755,700
西日本旅客鉄道	4,200	5,620.00	23,604,000
東海旅客鉄道	2,900	17,570.00	50,953,000

西武ホールディングス	4,600	1,369.00	6,297,400
鴻池運輸	600	1,221.00	732,600
西日本鉄道	1,000	2,858.00	2,858,000
ハマキョウレックス	300	3,115.00	934,500
サカイ引越センター	200	4,550.00	910,000
近鉄グループホールディングス	3,300	3,680.00	12,144,000
阪急阪神ホールディングス	4,100	3,670.00	15,047,000
南海電気鉄道	1,500	2,255.00	3,382,500
京阪ホールディングス	1,500	3,075.00	4,612,500
神戸電鉄	100	3,440.00	344,000
名古屋鉄道	2,700	1,995.00	5,386,500
山陽電気鉄道	300	2,026.00	607,800
アルプス物流	300	1,032.00	309,600
日本通運	1,200	7,210.00	8,652,000
ヤマトホールディングス	4,600	2,783.00	12,801,800
山九	900	4,955.00	4,459,500
丸運	300	266.00	79,800
丸全昭和運輸	300	3,445.00	1,033,500
センコーグループホールディングス	1,700	1,014.00	1,723,800
トナミホールディングス	100	4,395.00	439,500
ニッコンホールディングス	1,100	2,190.00	2,409,000
福山通運	500	4,680.00	2,340,000
セイノーホールディングス	2,300	1,387.00	3,190,100
エスライン	100	934.00	93,400
神奈川中央交通	100	3,465.00	346,500
日立物流	600	4,650.00	2,790,000
丸和運輸機関	700	1,519.00	1,063,300
C & F ロジホールディングス	300	1,700.00	510,000
九州旅客鉄道	2,600	2,759.00	7,173,400
S Gホールディングス	6,300	2,671.00	16,827,300
日本郵船	2,800	7,730.00	21,644,000
商船三井	1,900	7,000.00	13,300,000
川崎汽船	1,000	5,130.00	5,130,000
N S ユナイテッド海運	200	3,330.00	666,000
飯野海運	1,700	527.00	895,900
乾汽船	300	2,096.00	628,800
日本航空	7,600	2,630.00	19,988,000
A N A ホールディングス	8,400	2,891.00	24,284,400
パスコ	100	1,518.00	151,800
トランコム	100	8,520.00	852,000
日新	300	1,808.00	542,400
三菱倉庫	1,000	3,120.00	3,120,000

三井倉庫ホールディングス	300	2,376.00	712,800
住友倉庫	1,200	1,844.00	2,212,800
澁澤倉庫	200	2,216.00	443,200
東陽倉庫	500	332.00	166,000
日本トランスシティ	700	624.00	436,800
ケイヒン	100	1,423.00	142,300
中央倉庫	200	962.00	192,400
川西倉庫	100	1,212.00	121,200
安田倉庫	300	961.00	288,300
ファイズホールディングス	100	710.00	71,000
東洋埠頭	100	1,440.00	144,000
宇徳	200	525.00	105,000
上組	1,800	2,300.00	4,140,000
サンリツ	100	860.00	86,000
キムラユニティー	100	1,324.00	132,400
キューソー流通システム	100	2,053.00	205,300
近鉄エクスプレス	600	2,716.00	1,629,600
東海運	200	315.00	63,000
エーアイティー	200	1,146.00	229,200
内外トランスライン	100	2,002.00	200,200
日本コンセプト	100	1,747.00	174,700
NEC ネットエスアイ	1,100	1,897.00	2,086,700
クロスキャット	100	1,256.00	125,600
システナ	1,200	2,060.00	2,472,000
デジタルアーツ	200	10,050.00	2,010,000
日鉄ソリューションズ	500	3,590.00	1,795,000
キューブシステム	200	1,001.00	200,200
コア	100	1,603.00	160,300
ラクーンホールディングス	200	1,596.00	319,200
ソリトンシステムズ	200	1,323.00	264,600
ソフトクリエイイトホールディングス	100	4,070.00	407,000
T I S	3,300	3,275.00	10,807,500
J N S ホールディングス	100	494.00	49,400
グリー	2,100	1,052.00	2,209,200
コーエーテクモホールディングス	1,100	5,280.00	5,808,000
三菱総合研究所	100	4,040.00	404,000
ボルテージ	100	391.00	39,100
A G S	200	885.00	177,000
ファインデックス	300	927.00	278,100
ブレインパッド	100	5,820.00	582,000
K L a b	600	627.00	376,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	500	1,029.00	514,500

イーブックイニシアティブジャパン	100	4,735.00	473,500
ネクソン	7,700	2,117.00	16,300,900
アイスタイル	1,000	370.00	370,000
エムアップホールディングス	100	4,065.00	406,500
エイチーム	200	1,774.00	354,800
エニグモ	400	1,123.00	449,200
テクノスジャパン	300	585.00	175,500
e n i s h	200	406.00	81,200
コロプラ	1,100	780.00	858,000
ブロードリーフ	1,700	552.00	938,400
クロス・マーケティンググループ	100	869.00	86,900
デジタルハーツホールディングス	100	1,810.00	181,000
システム情報	200	967.00	193,400
メディアドゥ	100	5,070.00	507,000
じげん	1,000	415.00	415,000
ブイキューブ	300	1,317.00	395,100
エンカレッジ・テクノロジー	100	655.00	65,500
サイバーリンクス	100	1,203.00	120,300
フィックスターズ	300	761.00	228,300
C A R T A H O L D I N G S	100	2,578.00	257,800
オブティム	200	1,776.00	355,200
セレス	100	2,868.00	286,800
S H I F T	200	28,180.00	5,636,000
ティーガイア	300	1,813.00	543,900
テクマトリックス	600	1,840.00	1,104,000
プロシップ	100	1,614.00	161,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	900	2,223.00	2,000,700
G M O ペイメントゲートウェイ	700	15,080.00	10,556,000
ザッパラス	100	548.00	54,800
システムリサーチ	100	1,951.00	195,100
インターネットイニシアティブ	900	4,385.00	3,946,500
さくらインターネット	300	596.00	178,800
ヴィンクス	100	985.00	98,500
G M O グローバルサイン・ホールディングス	100	4,460.00	446,000
S R A ホールディングス	200	2,918.00	583,600
システムインテグレータ	100	609.00	60,900
朝日ネット	300	707.00	212,100
e B A S E	400	721.00	288,400
アバント	400	1,395.00	558,000
アドソル日進	100	2,137.00	213,700
O D K ソリューションズ	100	689.00	68,900
フリービット	200	1,365.00	273,000

コムチュア	400	3,360.00	1,344,000
アステリア	200	714.00	142,800
アイル	200	1,674.00	334,800
マークラインズ	200	3,230.00	646,000
メディカル・データ・ビジョン	400	1,395.00	558,000
g u m i	500	879.00	439,500
ショーケース	100	584.00	58,400
モバイルファクトリー	100	1,040.00	104,000
テラスカイ	100	2,504.00	250,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	100	1,781.00	178,100
P C Iホールディングス	100	1,055.00	105,500
パイプドHD	100	2,931.00	293,100
ネオジャパン	100	1,297.00	129,700
P R T I M E S	100	3,260.00	326,000
ラクス	1,200	3,650.00	4,380,000
ランドコンピュータ	100	813.00	81,300
ダブルスタンダード	100	3,760.00	376,000
オープンドア	200	2,830.00	566,000
マイネット	100	687.00	68,700
アカツキ	200	3,235.00	647,000
U b i c o mホールディングス	100	2,819.00	281,900
カナミックネットワーク	300	600.00	180,000
ノムラシステムコーポレーション	200	289.00	57,800
チェンジ	600	2,026.00	1,215,600
シンクロ・フード	200	381.00	76,200
オークネット	200	2,405.00	481,000
キャピタル・アセット・プランニング	100	883.00	88,300
マクロミル	700	832.00	582,400
ビーグリー	100	1,662.00	166,200
オロ	100	3,730.00	373,000
ユーザーローカル	100	1,874.00	187,400
テモナ	100	726.00	72,600
ニーズウェル	100	703.00	70,300
マネーフォワード	500	8,130.00	4,065,000
サインポスト	100	1,929.00	192,900
電算システムホールディングス	100	2,625.00	262,500
ソルクシーズ	300	506.00	151,800
フェイス	100	650.00	65,000
プロトコーポレーション	400	1,370.00	548,000
ハイマックス	100	1,176.00	117,600
野村総合研究所	6,600	4,600.00	30,360,000
サイバネットシステム	200	697.00	139,400

C Eホールディングス	200	540.00	108,000
日本システム技術	100	2,231.00	223,100
インテージホールディングス	400	2,063.00	825,200
東邦システムサイエンス	100	999.00	99,900
ソースネクスト	1,400	198.00	277,200
インフォコム	400	2,364.00	945,600
シンプレクス・ホールディングス	400	2,720.00	1,088,000
HEROZ	100	1,683.00	168,300
ラクスル	400	6,860.00	2,744,000
I P S	100	1,799.00	179,900
F I G	400	315.00	126,000
システムサポート	100	1,363.00	136,300
イーソル	200	799.00	159,800
アルテリア・ネットワークス	400	1,680.00	672,000
東海ソフト	100	1,213.00	121,300
ウイングアーク1 s t	200	2,188.00	437,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	100	2,499.00	249,900
サーバーワークス	100	4,110.00	411,000
トピラシステムズ	100	1,048.00	104,800
S a n s a n	300	13,560.00	4,068,000
L i n k - U	100	1,201.00	120,100
ギフトィ	300	3,875.00	1,162,500
ベース	100	4,880.00	488,000
フォーカスシステムズ	200	1,036.00	207,200
クレスコ	200	2,177.00	435,400
フジ・メディア・ホールディングス	3,300	1,271.00	4,194,300
オービック	1,100	20,740.00	22,814,000
ジャストシステム	500	5,850.00	2,925,000
T D Cソフト	300	1,273.00	381,900
Zホールディングス	49,800	785.00	39,093,000
トレンドマイクロ	1,800	6,520.00	11,736,000
I Dホールディングス	200	919.00	183,800
日本オラクル	700	10,370.00	7,259,000
アルファシステムズ	100	4,290.00	429,000
フューチャー	400	3,765.00	1,506,000
C A C H o l d i n g s	200	1,663.00	332,600
S Bテクノロジー	100	3,105.00	310,500
トーセ	100	794.00	79,400
オービックビジネスコンサルタント	300	5,430.00	1,629,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,600	3,750.00	6,000,000
アイティフォー	400	872.00	348,800
エクスネット	100	996.00	99,600

大塚商会	1,900	5,290.00	10,051,000
サイボウズ	500	2,646.00	1,323,000
電通国際情報サービス	500	4,020.00	2,010,000
A C C E S S	400	861.00	344,400
デジタルガレージ	600	5,530.00	3,318,000
E Mシステムズ	600	766.00	459,600
ウェザーニューズ	100	8,670.00	867,000
C I J	200	850.00	170,000
日本エンタープライズ	300	198.00	59,400
WOWOW	200	2,222.00	444,400
スカラ	300	726.00	217,800
インテリジェント ウェイブ	200	563.00	112,600
I M A G I C A G R O U P	300	681.00	204,300
ネットワンシステムズ	1,300	3,815.00	4,959,500
システムソフト	700	134.00	93,800
アルゴグラフィックス	300	3,080.00	924,000
マーベラス	500	779.00	389,500
エイベックス	600	1,667.00	1,000,200
日本ユニシス	1,100	3,490.00	3,839,000
兼松エレクトロニクス	200	3,730.00	746,000
都築電気	200	1,818.00	363,600
T B Sホールディングス	2,100	1,896.00	3,981,600
日本テレビホールディングス	2,900	1,307.00	3,790,300
朝日放送グループホールディングス	300	714.00	214,200
テレビ朝日ホールディングス	800	1,805.00	1,444,000
スカパーJ S A Tホールディングス	2,900	436.00	1,264,400
テレビ東京ホールディングス	200	2,230.00	446,000
日本BS放送	100	1,125.00	112,500
ビジョン	600	1,559.00	935,400
スマートバリュー	100	577.00	57,700
U S E N - N E X T H O L D I N G S	300	3,600.00	1,080,000
コネクシオ	200	1,418.00	283,600
日本通信	2,800	205.00	574,000
クロップス	100	985.00	98,500
日本電信電話	40,100	3,224.00	129,282,400
K D D I	25,000	3,396.00	84,900,000
ソフトバンク	51,900	1,491.50	77,408,850
光通信	400	18,130.00	7,252,000
エムティーアイ	300	689.00	206,700
G M Oインターネット	1,200	3,225.00	3,870,000
ファイバーゲート	100	1,338.00	133,800
アйдママーケティングコミュニケーション	100	385.00	38,500

KADOKAWA	1,000	6,530.00	6,530,000
学研ホールディングス	500	1,087.00	543,500
ゼンリン	600	1,039.00	623,400
昭文社ホールディングス	100	492.00	49,200
インプレスホールディングス	300	270.00	81,000
アイネット	200	1,375.00	275,000
松竹	200	12,440.00	2,488,000
東宝	2,000	5,600.00	11,200,000
東映	100	23,320.00	2,332,000
エヌ・ティ・ティ・データ	9,100	2,380.00	21,658,000
ピー・シー・エー	200	1,646.00	329,200
ビジネスブレイン太田昭和	100	1,897.00	189,700
D T S	700	2,466.00	1,726,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,600	6,500.00	10,400,000
シーイーシー	400	1,357.00	542,800
カプコン	3,200	3,175.00	10,160,000
アイ・エス・ビー	200	1,154.00	230,800
ジャステック	200	1,297.00	259,400
S C S K	2,400	2,183.00	5,239,200
日本システムウエア	100	2,425.00	242,500
アイネス	300	1,460.00	438,000
T K C	600	3,530.00	2,118,000
富士ソフト	400	5,760.00	2,304,000
N S D	1,100	2,150.00	2,365,000
コナミホールディングス	1,200	6,520.00	7,824,000
福井コンピュータホールディングス	200	3,985.00	797,000
J B C Cホールディングス	200	1,747.00	349,400
ミロク情報サービス	300	1,815.00	544,500
ソフトバンクグループ	20,600	6,161.00	126,916,600
高千穂交易	100	1,239.00	123,900
オルバヘルスケアホールディングス	100	1,578.00	157,800
伊藤忠食品	100	5,120.00	512,000
エレマテック	300	1,120.00	336,000
J A L U X	100	2,552.00	255,200
あらた	300	4,110.00	1,233,000
トーメンデバイス	100	6,140.00	614,000
東京エレクトロン デバイス	100	7,470.00	747,000
フィールズ	300	542.00	162,600
双日	3,800	1,722.00	6,543,600
アルフレッサ ホールディングス	3,800	1,671.00	6,349,800
横浜冷凍	1,000	882.00	882,000
神栄	100	1,004.00	100,400

ラサ商事	200	925.00	185,000
アルコニックス	400	1,628.00	651,200
神戸物産	2,700	4,065.00	10,975,500
ハイパー	100	555.00	55,500
あい ホールディングス	500	2,182.00	1,091,000
ディーブイエックス	100	1,103.00	110,300
ダイワボウホールディングス	1,700	2,004.00	3,406,800
マクニカ・富士エレホールディングス	800	2,692.00	2,153,600
ラクト・ジャパン	100	2,697.00	269,700
グリムス	200	2,634.00	526,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	600	786.00	471,600
八洲電機	200	937.00	187,400
メディアスホールディングス	200	864.00	172,800
レスターホールディングス	300	1,902.00	570,600
ジューテックホールディングス	100	1,215.00	121,500
大光	100	717.00	71,700
OCHIホールディングス	100	1,269.00	126,900
TOKAIホールディングス	1,700	872.00	1,482,400
黒谷	100	656.00	65,600
Cominix	100	731.00	73,100
三洋貿易	400	1,072.00	428,800
ビューティガレージ	100	4,265.00	426,500
ウイン・パートナーズ	300	946.00	283,800
ミタチ産業	100	947.00	94,700
シップヘルスケアホールディングス	1,100	2,984.00	3,282,400
明治電機工業	100	1,338.00	133,800
デリカフーズホールディングス	100	623.00	62,300
スターティアホールディングス	100	1,459.00	145,900
コメダホールディングス	800	2,066.00	1,652,800
ピーバンドットコム	100	671.00	67,100
アセンテック	100	1,329.00	132,900
富士興産	100	1,067.00	106,700
フルサト・マルカホールディングス	300	1,986.00	595,800
ヤマエグループホールディングス	200	1,122.00	224,400
小野建	300	1,667.00	500,100
南陽	100	2,011.00	201,100
佐島電機	200	1,100.00	220,000
エコートレーディング	100	637.00	63,700
伯東	200	2,237.00	447,400
コンドーテック	300	941.00	282,300
中山福	200	388.00	77,600
ナガイレーベン	500	2,383.00	1,191,500

三菱食品	300	2,826.00	847,800
松田産業	300	3,360.00	1,008,000
第一興商	700	4,190.00	2,933,000
メディバルホールディングス	3,700	2,100.00	7,770,000
S P K	100	1,376.00	137,600
萩原電気ホールディングス	100	2,201.00	220,100
アズワン	200	14,610.00	2,922,000
スズデン	100	1,718.00	171,800
尾家産業	100	1,078.00	107,800
シモジマ	200	1,121.00	224,200
ドウシシャ	300	1,649.00	494,700
小津産業	100	1,912.00	191,200
高速	200	1,544.00	308,800
たけびし	100	1,478.00	147,800
リックス	100	1,534.00	153,400
丸文	300	842.00	252,600
ハピネット	300	1,536.00	460,800
橋本総業ホールディングス	100	2,151.00	215,100
日本ライフライン	1,000	1,191.00	1,191,000
タカショー	300	824.00	247,200
I D O M	1,100	782.00	860,200
進和	200	2,110.00	422,000
エスケイジャパン	100	492.00	49,200
ダイトロン	200	2,145.00	429,000
シークス	500	1,273.00	636,500
田中商事	100	666.00	66,600
オーハシテクニカ	200	1,460.00	292,000
白銅	100	2,910.00	291,000
伊藤忠商事	23,600	3,449.00	81,396,400
丸紅	33,900	1,037.50	35,171,250
高島	100	1,914.00	191,400
長瀬産業	1,900	1,807.00	3,433,300
蝶理	200	1,853.00	370,600
豊田通商	3,500	5,290.00	18,515,000
三共生興	500	572.00	286,000
兼松	1,300	1,311.00	1,704,300
ツカモトコーポレーション	100	1,339.00	133,900
三井物産	26,700	2,540.00	67,818,000
日本紙パルプ商事	200	3,900.00	780,000
カメイ	400	1,143.00	457,200
O U Gホールディングス	100	2,721.00	272,100
スターゼン	300	2,152.00	645,600

山善	1,500	1,055.00	1,582,500
椿本興業	100	3,825.00	382,500
住友商事	21,700	1,665.50	36,141,350
内田洋行	100	4,900.00	490,000
三菱商事	25,800	3,435.00	88,623,000
第一実業	200	5,190.00	1,038,000
キャノンマーケティングジャパン	900	2,305.00	2,074,500
西華産業	200	1,663.00	332,600
佐藤商事	300	1,193.00	357,900
菱洋エレクトロ	200	2,360.00	472,000
東京産業	300	747.00	224,100
ユアサ商事	300	3,020.00	906,000
神鋼商事	100	3,460.00	346,000
トルク	200	220.00	44,000
阪和興業	700	3,340.00	2,338,000
正栄食品工業	200	4,005.00	801,000
カナデン	300	1,044.00	313,200
菱電商事	300	1,741.00	522,300
岩谷産業	800	6,800.00	5,440,000
ナイス	100	1,847.00	184,700
ニチモウ	100	2,100.00	210,000
極東貿易	100	2,592.00	259,200
アステナホールディングス	500	572.00	286,000
三愛石油	800	1,400.00	1,120,000
稲畑産業	800	1,674.00	1,339,200
G S Iクレオス	200	900.00	180,000
明和産業	300	825.00	247,500
クワザワホールディングス	100	660.00	66,000
ワキタ	700	1,042.00	729,400
東邦ホールディングス	1,100	1,810.00	1,991,000
サンゲツ	900	1,580.00	1,422,000
ミツウロコグループホールディングス	500	1,351.00	675,500
シナネンホールディングス	100	3,450.00	345,000
伊藤忠エネクス	800	1,009.00	807,200
サンリオ	1,100	2,800.00	3,080,000
サンワテクノス	200	1,498.00	299,600
リョーサン	400	2,391.00	956,400
新光商事	500	862.00	431,000
トーホー	200	1,540.00	308,000
三信電気	200	1,668.00	333,600
東陽テクニカ	400	1,126.00	450,400
モスフードサービス	500	3,150.00	1,575,000

加賀電子	300	3,010.00	903,000
ソーダニッカ	400	625.00	250,000
立花エレテック	300	1,590.00	477,000
フォーバル	200	1,141.00	228,200
PALTAC	500	4,990.00	2,495,000
三谷産業	400	349.00	139,600
太平洋興発	100	651.00	65,100
西本Wismettacホールディングス	100	4,095.00	409,500
コア商事ホールディングス	300	693.00	207,900
国際紙パルプ商事	700	407.00	284,900
ヤマタネ	200	1,606.00	321,200
日鉄物産	200	4,960.00	992,000
泉州電業	100	4,735.00	473,500
トラスコ中山	700	2,691.00	1,883,700
オートボックスセブン	1,200	1,405.00	1,686,000
モリト	300	678.00	203,400
加藤産業	500	3,185.00	1,592,500
北恵	100	1,004.00	100,400
イノテック	200	1,500.00	300,000
イエローハット	600	1,729.00	1,037,400
JKホールディングス	300	1,039.00	311,700
日伝	300	2,270.00	681,000
北沢産業	300	248.00	74,400
杉本商事	200	2,359.00	471,800
因幡電機産業	900	2,708.00	2,437,200
東テク	100	2,591.00	259,100
ミスミグループ本社	4,300	4,845.00	20,833,500
アルテック	300	318.00	95,400
タキヒヨー	100	1,775.00	177,500
蔵王産業	100	1,884.00	188,400
スズケン	1,300	3,170.00	4,121,000
ジェコス	200	836.00	167,200
グローセル	400	403.00	161,200
ローソン	800	5,850.00	4,680,000
サンエー	300	4,195.00	1,258,500
カワチ薬品	300	2,329.00	698,700
エービーシー・マート	500	5,630.00	2,815,000
ハードオフコーポレーション	100	758.00	75,800
アスクル	500	1,545.00	772,500
ゲオホールディングス	400	1,224.00	489,600
アダストリア	400	2,140.00	856,000
ジーフット	200	399.00	79,800

くら寿司	400	3,815.00	1,526,000
キャンドウ	200	2,557.00	511,400
アイケイ	100	515.00	51,500
パルグループホールディングス	300	1,690.00	507,000
エディオン	1,600	1,071.00	1,713,600
サーラコーポレーション	700	631.00	441,700
ワッツ	100	763.00	76,300
ハローズ	200	2,829.00	565,800
フジオフードグループ本社	300	1,406.00	421,800
あみやき亭	100	3,050.00	305,000
ひらまつ	700	211.00	147,700
大黒天物産	100	6,620.00	662,000
ハニーズホールディングス	200	1,095.00	219,000
ファーマライズホールディングス	100	806.00	80,600
アルペン	300	2,458.00	737,400
ハブ	100	746.00	74,600
クオールホールディングス	400	1,632.00	652,800
ジinzホールディングス	200	7,370.00	1,474,000
ビックカメラ	2,000	1,004.00	2,008,000
D C Mホールディングス	2,100	1,121.00	2,354,100
MonotaRO	4,300	2,431.00	10,453,300
東京一番フーズ	100	599.00	59,900
アークランドサービスホールディングス	200	2,286.00	457,200
J.フロント リテイリング	4,100	1,111.00	4,555,100
ドトール・日レスホールディングス	600	1,666.00	999,600
マツキヨココカラ&カンパニー	2,100	4,910.00	10,311,000
ブロンコビリー	200	2,449.00	489,800
Z O Z O	2,400	3,660.00	8,784,000
トレジャー・ファクトリー	100	1,011.00	101,100
物語コーポレーション	200	7,280.00	1,456,000
三越伊勢丹ホールディングス	6,000	891.00	5,346,000
H a m e e	100	1,260.00	126,000
ウエルシアホールディングス	1,800	4,250.00	7,650,000
クリエイイトSDホールディングス	500	3,455.00	1,727,500
丸善C H Iホールディングス	400	378.00	151,200
シュッピン	300	1,313.00	393,900
オイシックス・ラ・大地	500	4,785.00	2,392,500
ネクステージ	700	2,256.00	1,579,200
ジョイフル本田	1,000	1,562.00	1,562,000
鳥貴族ホールディングス	100	1,975.00	197,500
ホットランド	200	1,385.00	277,000
すかいらーくホールディングス	4,400	1,553.00	6,833,200

SFPホールディングス	200	1,480.00	296,000	
綿半ホールディングス	200	1,236.00	247,200	
ヨシックスホールディングス	100	2,141.00	214,100	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,000	1,026.00	1,026,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	1,285.00	257,000	
B E E N O S	200	2,595.00	519,000	
あさひ	300	1,371.00	411,300	
日本調剤	200	1,510.00	302,000	
コスモス薬品	300	17,860.00	5,358,000	
トーエル	100	798.00	79,800	
セブン&アイ・ホールディングス	13,500	4,987.00	67,324,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,600	745.00	1,192,000	
ツルハホールディングス	800	14,230.00	11,384,000	
サンマルクホールディングス	300	1,556.00	466,800	
フェリシモ	100	1,432.00	143,200	
トリドールホールディングス	800	2,984.00	2,387,200	
T O K Y O B A S E	300	819.00	245,700	
J Mホールディングス	200	1,884.00	376,800	
アレンザホールディングス	200	1,176.00	235,200	
串カツ田中ホールディングス	100	2,333.00	233,300	
パロックジャパンリミテッド	200	877.00	175,400	
クスリのアオキホールディングス	300	7,590.00	2,277,000	
F O O D & L I F E C O M P A N I E	2,000	4,975.00	9,950,000	
メディカルシステムネットワーク	300	682.00	204,600	
はるやまホールディングス	100	585.00	58,500	
ノジマ	600	2,395.00	1,437,000	
カップ・クリエイト	500	1,421.00	710,500	
ライトオン	200	706.00	141,200	
良品計画	4,000	2,130.00	8,520,000	
三城ホールディングス	400	259.00	103,600	
アドヴァングループ	300	967.00	290,100	
アルビス	100	2,315.00	231,500	
コナカ	300	333.00	99,900	
G - 7ホールディングス	400	1,862.00	744,800	
イオン北海道	600	1,353.00	811,800	
コジマ	600	581.00	348,600	
ヒマラヤ	100	1,010.00	101,000	
コーナン商事	500	3,580.00	1,790,000	
エコス	100	1,859.00	185,900	
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	6,900	2,405.00	16,594,500	

西松屋チェーン	700	1,482.00	1,037,400
ゼンショーホールディングス	1,700	2,737.00	4,652,900
幸楽苑ホールディングス	200	1,509.00	301,800
ハークスレイ	100	473.00	47,300
サイゼリヤ	500	3,080.00	1,540,000
V Tホールディングス	1,200	513.00	615,600
魚力	100	2,000.00	200,000
フジ・コーポレーション	200	1,216.00	243,200
ユナイテッドアローズ	400	2,188.00	875,200
ハイデイ日高	500	1,662.00	831,000
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	100	229.00	22,900
コロワイド	1,400	1,689.00	2,364,600
ピーシーデポコーポレーション	400	474.00	189,600
壱番屋	200	4,620.00	924,000
トップカルチャー	100	319.00	31,900
P L A N T	100	720.00	72,000
スギホールディングス	700	8,310.00	5,817,000
薬王堂ホールディングス	200	2,414.00	482,800
スクロール	500	919.00	459,500
ヨンドシーホールディングス	300	1,716.00	514,800
木曽路	400	2,201.00	880,400
S R S ホールディングス	400	785.00	314,000
千趣会	600	397.00	238,200
リテールパートナーズ	400	1,207.00	482,800
ケーヨー	600	832.00	499,200
上新電機	400	2,256.00	902,400
日本瓦斯	1,700	1,419.00	2,412,300
ロイヤルホールディングス	600	2,144.00	1,286,400
いなげや	400	1,407.00	562,800
チヨダ	300	771.00	231,300
ライフコーポレーション	300	3,625.00	1,087,500
リンガーハット	400	2,266.00	906,400
M r M a x H D	400	589.00	235,600
A O K I ホールディングス	600	723.00	433,800
オークワ	500	1,114.00	557,000
コメリ	500	2,641.00	1,320,500
青山商事	700	837.00	585,900
しまむら	400	9,500.00	3,800,000
はせがわ	100	260.00	26,000
高島屋	2,500	1,169.00	2,922,500
松屋	700	1,029.00	720,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,600	926.00	1,481,600

近鉄百貨店	100	2,661.00	266,100
丸井グループ	2,900	2,302.00	6,675,800
アクシアル リテイリング	300	3,435.00	1,030,500
井筒屋	200	325.00	65,000
イオン	13,200	2,691.50	35,527,800
イズミ	600	3,580.00	2,148,000
平和堂	600	2,006.00	1,203,600
フジ	400	2,014.00	805,600
ヤオコー	400	6,790.00	2,716,000
ゼビオホールディングス	500	1,033.00	516,500
ケーズホールディングス	3,200	1,158.00	3,705,600
Olympicグループ	200	724.00	144,800
日産東京販売ホールディングス	400	241.00	96,400
シルバーライフ	100	1,430.00	143,000
Genky DrugStores	100	5,160.00	516,000
ナルミヤ・インターナショナル	100	1,206.00	120,600
ブックオフグループホールディングス	200	994.00	198,800
アインホールディングス	500	6,350.00	3,175,000
元気寿司	100	2,708.00	270,800
ヤマダホールディングス	12,600	425.00	5,355,000
アークランドサカモト	500	1,748.00	874,000
ニトリホールディングス	1,400	21,160.00	29,624,000
グルメ杵屋	300	997.00	299,100
愛眼	200	201.00	40,200
ケーユーホールディングス	200	1,070.00	214,000
吉野家ホールディングス	1,200	2,388.00	2,865,600
松屋フーズホールディングス	200	3,655.00	731,000
サガミホールディングス	500	1,050.00	525,000
関西スーパーマーケット	300	1,235.00	370,500
王将フードサービス	200	5,970.00	1,194,000
プレナス	400	1,951.00	780,400
ミニストップ	200	1,415.00	283,000
アークス	600	2,209.00	1,325,400
バローホールディングス	800	2,425.00	1,940,000
藤久	100	786.00	78,600
ベルク	100	5,500.00	550,000
大庄	200	1,027.00	205,400
ファーストリテイリング	500	78,510.00	39,255,000
サンドラッグ	1,300	3,305.00	4,296,500
サクスパー ホールディングス	300	600.00	180,000
ヤマザワ	100	1,720.00	172,000
やまや	100	2,440.00	244,000

ペルーナ	700	767.00	536,900	
島根銀行	100	579.00	57,900	
じもとホールディングス	300	642.00	192,600	
めぶきフィナンシャルグループ	18,000	237.00	4,266,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	400	1,473.00	589,200	
九州フィナンシャルグループ	7,100	398.00	2,825,800	
ゆうちょ銀行	8,200	861.00	7,060,200	
富山第一銀行	800	289.00	231,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	19,700	455.00	8,963,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	2,300	717.00	1,649,100	
三十三フィナンシャルグループ	300	1,391.00	417,300	
第四北越フィナンシャルグループ	600	2,613.00	1,567,800	
ひろぎんホールディングス	5,100	651.00	3,320,100	
おきなわフィナンシャルグループ	300	2,499.00	749,700	
十六フィナンシャルグループ	500	2,054.00	1,027,000	
北國フィナンシャルホールディングス	300	2,110.00	633,000	
新生銀行	2,300	1,749.00	4,022,700	
あおぞら銀行	1,900	2,667.00	5,067,300	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	221,000	638.00	140,998,000	代用有価証券 21,400株
りそなホールディングス	39,500	437.50	17,281,250	
三井住友トラスト・ホールディングス	6,500	3,904.00	25,376,000	
三井住友フィナンシャルグループ	23,800	3,849.00	91,606,200	代用有価証券 3,500株
千葉銀行	11,500	719.00	8,268,500	
群馬銀行	6,600	354.00	2,336,400	
武蔵野銀行	500	1,752.00	876,000	
千葉興業銀行	800	265.00	212,000	
筑波銀行	1,400	167.00	233,800	
七十七銀行	1,100	1,210.00	1,331,000	
青森銀行	300	1,986.00	595,800	
秋田銀行	200	1,460.00	292,000	
山形銀行	400	813.00	325,200	
岩手銀行	200	1,655.00	331,000	
東邦銀行	2,900	204.00	591,600	
東北銀行	200	1,004.00	200,800	
みちのく銀行	200	874.00	174,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	2,900	2,098.00	6,084,200	
静岡銀行	8,400	924.00	7,761,600	
スルガ銀行	3,000	470.00	1,410,000	
八十二銀行	7,800	375.00	2,925,000	
山梨中央銀行	400	823.00	329,200	
大垣共立銀行	700	1,924.00	1,346,800	

福井銀行	300	1,524.00	457,200
清水銀行	100	1,560.00	156,000
富山銀行	100	1,940.00	194,000
滋賀銀行	600	1,935.00	1,161,000
南都銀行	500	1,962.00	981,000
百五銀行	3,300	334.00	1,102,200
京都銀行	1,200	5,260.00	6,312,000
紀陽銀行	1,200	1,486.00	1,783,200
ほくほくフィナンシャルグループ	2,200	838.00	1,843,600
山陰合同銀行	2,000	574.00	1,148,000
中国銀行	2,800	843.00	2,360,400
鳥取銀行	100	1,112.00	111,200
伊予銀行	4,600	568.00	2,612,800
百十四銀行	400	1,469.00	587,600
四国銀行	500	748.00	374,000
阿波銀行	500	2,113.00	1,056,500
大分銀行	200	1,811.00	362,200
宮崎銀行	200	2,018.00	403,600
佐賀銀行	200	1,400.00	280,000
琉球銀行	800	752.00	601,600
セブン銀行	10,300	240.00	2,472,000
みずほフィナンシャルグループ	44,100	1,547.00	68,222,700
高知銀行	100	756.00	75,600
山口フィナンシャルグループ	4,000	643.00	2,572,000
長野銀行	100	1,094.00	109,400
名古屋銀行	300	2,416.00	724,800
北洋銀行	5,200	239.00	1,242,800
愛知銀行	100	3,475.00	347,500
中京銀行	100	1,335.00	133,500
大光銀行	100	1,350.00	135,000
愛媛銀行	500	777.00	388,500
トマト銀行	100	1,046.00	104,600
京葉銀行	1,500	448.00	672,000
栃木銀行	1,700	178.00	302,600
北日本銀行	100	1,530.00	153,000
東和銀行	600	510.00	306,000
福島銀行	500	231.00	115,500
大東銀行	200	692.00	138,400
トモニホールディングス	2,700	304.00	820,800
フィデアホールディングス	300	1,159.00	347,700
池田泉州ホールディングス	4,000	159.00	636,000
F P G	1,200	621.00	745,200

ジャパンインベストメントアドバイザー	300	1,311.00	393,300
マーキュリアホールディングス	100	744.00	74,400
SBIホールディングス	4,300	2,880.00	12,384,000
日本アジア投資	300	226.00	67,800
ジャフコグループ	400	7,410.00	2,964,000
大和証券グループ本社	25,800	649.40	16,754,520
野村ホールディングス	52,600	510.40	26,847,040
岡三証券グループ	2,700	385.00	1,039,500
丸三証券	1,000	581.00	581,000
東洋証券	1,100	153.00	168,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	4,000	390.00	1,560,000
光世証券	100	543.00	54,300
水戸証券	900	291.00	261,900
いちよし証券	700	635.00	444,500
松井証券	1,700	813.00	1,382,100
マネックスグループ	2,800	1,045.00	2,926,000
極東証券	500	772.00	386,000
岩井コスモホールディングス	300	1,325.00	397,500
アイザワ証券グループ	600	1,065.00	639,000
マネーパートナーズグループ	400	254.00	101,600
スパークス・グループ	1,600	309.00	494,400
小林洋行	100	254.00	25,400
かんぽ生命保険	3,500	1,807.00	6,324,500
SOMPOホールディングス	6,100	4,921.00	30,018,100
アニコムホールディングス	1,100	882.00	970,200
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	7,700	3,706.00	28,536,200
第一生命ホールディングス	17,000	2,437.50	41,437,500
東京海上ホールディングス	11,300	6,001.00	67,811,300
T&Dホールディングス	9,000	1,439.00	12,951,000
アドバンスクリエイト	200	1,051.00	210,200
全国保証	800	5,270.00	4,216,000
あんしん保証	100	306.00	30,600
ジェイリース	100	2,327.00	232,700
イントラスト	100	830.00	83,000
日本モーゲージサービス	200	1,094.00	218,800
Casa	100	922.00	92,200
アルヒ	500	1,372.00	686,000
プレミアグループ	200	3,735.00	747,000
クレディセゾン	2,200	1,420.00	3,124,000
芙蓉総合リース	400	7,530.00	3,012,000
みずほリース	500	3,560.00	1,780,000
東京センチュリー	700	6,230.00	4,361,000

日本証券金融	1,300	809.00	1,051,700
アイフル	5,700	387.00	2,205,900
リコーリース	300	3,645.00	1,093,500
イオンフィナンシャルサービス	1,900	1,440.00	2,736,000
アコム	6,700	378.00	2,532,600
ジャックス	400	3,075.00	1,230,000
オリエントコーポレーション	9,300	147.00	1,367,100
オリックス	20,900	2,253.00	47,087,700
三菱HCキャピタル	12,700	578.00	7,340,600
九州リースサービス	200	602.00	120,400
日本取引所グループ	8,700	2,584.50	22,485,150
イー・ギャランティ	500	2,652.00	1,326,000
アサックス	200	714.00	142,800
NECキャピタルソリューション	100	2,016.00	201,600
いちご	3,800	335.00	1,273,000
日本駐車場開発	3,800	147.00	558,600
スター・マイカ・ホールディングス	200	1,486.00	297,200
SREホールディングス	100	8,640.00	864,000
ADワークスグループ	700	162.00	113,400
ヒューリック	8,200	1,133.00	9,290,600
三栄建築設計	100	1,765.00	176,500
野村不動産ホールディングス	1,800	2,723.00	4,901,400
三重交通グループホールディングス	700	490.00	343,000
サムティ	600	2,603.00	1,561,800
ディア・ライフ	400	563.00	225,200
コーセーアールイー	100	678.00	67,800
日本商業開発	200	1,776.00	355,200
プレサンスコーポレーション	500	1,975.00	987,500
THEグローバル社	300	222.00	66,600
ハウスコム	100	1,278.00	127,800
日本管理センター	200	1,130.00	226,000
サンセイランディック	100	830.00	83,000
エストラスト	100	647.00	64,700
フージャースホールディングス	400	696.00	278,400
オープンハウス	1,100	7,100.00	7,810,000
東急不動産ホールディングス	10,200	641.00	6,538,200
飯田グループホールディングス	2,900	2,861.00	8,296,900
イーランド	100	1,763.00	176,300
ムゲンエステート	200	488.00	97,600
ビーロッド	200	559.00	111,800
ファーストブラザーズ	100	1,053.00	105,300
ハウズドゥ	200	965.00	193,000

シーアールイー	100	1,791.00	179,100
ケイアイスター不動産	200	6,330.00	1,266,000
アグレ都市デザイン	100	1,545.00	154,500
グッドコムアセット	200	1,335.00	267,000
ジェイ・エス・ビー	100	2,817.00	281,700
テンポイノベーション	100	908.00	90,800
グローバル・リンク・マネジメント	100	1,053.00	105,300
パーク24	1,900	1,893.00	3,596,700
パラカ	100	1,633.00	163,300
宮越ホールディングス	100	1,171.00	117,100
三井不動産	15,700	2,677.00	42,028,900
三菱地所	22,600	1,727.50	39,041,500
平和不動産	600	3,465.00	2,079,000
東京建物	3,400	1,667.00	5,667,800
ダイビル	900	1,525.00	1,372,500
京阪神ビルディング	600	1,408.00	844,800
住友不動産	7,200	4,111.00	29,599,200
テオーシー	600	624.00	374,400
東京楽天地	100	4,135.00	413,500
スターツコーポレーション	500	2,741.00	1,370,500
フジ住宅	400	715.00	286,000
空港施設	400	580.00	232,000
明和地所	200	619.00	123,800
ゴールドクレスト	300	1,538.00	461,400
エスリード	100	1,707.00	170,700
日神グループホールディングス	500	500.00	250,000
日本エスコン	600	820.00	492,000
タカラレーベン	1,500	297.00	445,500
A V A N T I A	200	867.00	173,400
イオンモール	1,700	1,710.00	2,907,000
毎日コムネット	100	777.00	77,700
ファースト住建	100	1,224.00	122,400
カチタス	900	4,175.00	3,757,500
トーセイ	500	1,113.00	556,500
サンフロンティア不動産	500	1,080.00	540,000
F Jネクストホールディングス	400	1,078.00	431,200
インテリックス	100	721.00	72,100
ランドビジネス	200	276.00	55,200
サンネクスタグループ	100	1,035.00	103,500
グランディハウス	200	492.00	98,400
日本空港ビルデング	1,300	6,090.00	7,917,000
明豊ファシリティワークス	200	921.00	184,200

日本工営	200	3,550.00	710,000
LIFULL	1,100	364.00	400,400
ミクシィ	800	2,245.00	1,796,000
ジェイエイシーリクルートメント	300	2,259.00	677,700
日本M&Aセンターホールディングス	5,500	3,655.00	20,102,500
メンバーズ	100	2,556.00	255,600
中広	100	396.00	39,600
UTグループ	500	4,020.00	2,010,000
アイティメディア	200	2,207.00	441,400
E・Jホールディングス	200	1,305.00	261,000
夢真ビーネックスグループ	900	1,634.00	1,470,600
コシダカホールディングス	900	722.00	649,800
アルトナー	100	875.00	87,500
パソナグループ	400	3,645.00	1,458,000
CDS	100	1,619.00	161,900
リンクアンドモチベーション	800	1,140.00	912,000
エス・エム・エス	1,100	4,720.00	5,192,000
サニーサイドアップグループ	100	786.00	78,600
パーソルホールディングス	3,300	3,125.00	10,312,500
リニカル	200	824.00	164,800
クックパッド	1,100	225.00	247,500
エスクリ	200	596.00	119,200
アイ・ケイ・ケイホールディングス	200	670.00	134,000
学情	200	1,236.00	247,200
スタジオアリス	100	2,209.00	220,900
シミックホールディングス	200	1,600.00	320,000
エプコ	100	835.00	83,500
NJS	100	2,020.00	202,000
総合警備保障	1,300	4,795.00	6,233,500
カカクコム	2,500	3,685.00	9,212,500
アイロムグループ	100	1,918.00	191,800
セントケア・ホールディング	200	933.00	186,600
サイネックス	100	674.00	67,400
ルネサンス	200	1,319.00	263,800
ディップ	600	4,165.00	2,499,000
デジタルホールディングス	200	1,799.00	359,800
新日本科学	400	1,673.00	669,200
キャリアデザインセンター	100	1,171.00	117,100
ベネフィット・ワン	1,200	5,840.00	7,008,000
エムスリー	5,900	6,346.00	37,441,400
ツカダ・グローバルホールディング	300	351.00	105,300
プラス	100	834.00	83,400

アウトソーシング	1,900	1,657.00	3,148,300
ウェルネット	400	506.00	202,400
ワールドホールディングス	100	2,981.00	298,100
ディー・エヌ・エー	1,300	2,166.00	2,815,800
博報堂D Yホールディングス	4,700	1,940.00	9,118,000
ぐるなび	500	596.00	298,000
タカミヤ	400	448.00	179,200
ジャパンベストレスキューシステム	200	1,001.00	200,200
ファンコミュニケーションズ	900	450.00	405,000
ライク	100	1,850.00	185,000
ビジネス・ブレークスルー	200	429.00	85,800
エスプール	900	1,233.00	1,109,700
WDBホールディングス	200	3,725.00	745,000
ティア	200	484.00	96,800
アドウェイズ	500	879.00	439,500
バリューコマース	300	4,990.00	1,497,000
インフォマート	3,700	1,262.00	4,669,400
J Pホールディングス	900	254.00	228,600
エコナックホールディングス	800	99.00	79,200
レグス	100	1,585.00	158,500
プレステージ・インターナショナル	1,300	763.00	991,900
アミューズ	200	2,273.00	454,600
ドリームインキュベータ	100	793.00	79,300
クイック	200	1,434.00	286,800
T A C	300	239.00	71,700
電通グループ	3,400	4,420.00	15,028,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	200	1,330.00	266,000
ぴあ	100	4,230.00	423,000
イオンファンタジー	100	2,032.00	203,200
シーティーエス	400	825.00	330,000
ネクシィーズグループ	100	885.00	88,500
H . U . グループホールディングス	900	2,677.00	2,409,300
アルプス技研	300	2,085.00	625,500
サニックス	600	335.00	201,000
ダイオーズ	100	1,025.00	102,500
日本空調サービス	400	794.00	317,600
オリエンタルランド	3,900	18,690.00	72,891,000
ダスキン	800	2,713.00	2,170,400
明光ネットワークジャパン	400	565.00	226,000
ファルコホールディングス	200	1,710.00	342,000
秀英予備校	100	416.00	41,600
ラウンドワン	900	1,472.00	1,324,800

リゾートトラスト	1,500	2,077.00	3,115,500
ビー・エム・エル	400	3,985.00	1,594,000
りらいあコミュニケーションズ	500	1,184.00	592,000
リソー教育	1,500	448.00	672,000
早稲田アカデミー	200	1,040.00	208,000
ユー・エス・エス	3,800	1,845.00	7,011,000
東京個別指導学院	300	694.00	208,200
サイバーエージェント	8,200	2,001.00	16,408,200
楽天グループ	17,100	1,238.00	21,169,800
クリーク・アンド・リバー社	200	2,026.00	405,200
モーニングスター	600	535.00	321,000
テー・オー・ダブリュー	600	340.00	204,000
山田コンサルティンググループ	200	1,213.00	242,600
セントラルスポーツ	100	2,526.00	252,600
フルキャストホールディングス	300	2,785.00	835,500
エン・ジャパン	500	4,615.00	2,307,500
テクノプロ・ホールディングス	2,000	3,485.00	6,970,000
アトラグループ	100	315.00	31,500
インターワークス	100	409.00	40,900
アイ・アールジャパンホールディングス	200	9,050.00	1,810,000
Keeper 技研	200	3,280.00	656,000
ファーストロジック	100	794.00	79,400
三機サービス	100	1,063.00	106,300
Gunosy	200	624.00	124,800
デザインワン・ジャパン	200	226.00	45,200
イー・ガーディアン	100	3,300.00	330,000
リブセンス	300	240.00	72,000
ジャパンマテリアル	1,000	1,616.00	1,616,000
ベクトル	500	1,341.00	670,500
ウチヤマホールディングス	200	372.00	74,400
チャーム・ケア・コーポレーション	300	1,656.00	496,800
キャリアリンク	100	1,433.00	143,300
I B J	300	1,128.00	338,400
アサンテ	200	1,735.00	347,000
バリューHR	100	1,967.00	196,700
M&Aキャピタルパートナーズ	300	6,130.00	1,839,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	100	1,460.00	146,000
E R Iホールディングス	100	1,705.00	170,500
アピスト	100	2,886.00	288,600
シグマクシス・ホールディングス	200	2,944.00	588,800
ウィルグループ	200	1,398.00	279,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	500	198.00	99,000

メドピア	300	3,070.00	921,000
レアジョブ	100	1,202.00	120,200
リクルートホールディングス	25,800	7,899.00	203,794,200
エラン	500	1,239.00	619,500
土木管理総合試験所	200	349.00	69,800
ネットマーケティング	200	536.00	107,200
日本郵政	43,600	853.00	37,190,800
ベルシステム24ホールディングス	500	1,416.00	708,000
鎌倉新書	400	957.00	382,800
S MN	100	690.00	69,000
一蔵	100	457.00	45,700
グローバルキッズCOMPANY	100	905.00	90,500
エアトリ	200	4,310.00	862,000
アトラエ	200	2,449.00	489,800
ストライク	100	5,830.00	583,000
ソラスト	800	1,413.00	1,130,400
セラク	100	2,101.00	210,100
インソース	300	2,606.00	781,800
バイカレント・コンサルティング	200	53,400.00	10,680,000
Orchestra Holdings	100	4,975.00	497,500
アイモバイル	100	1,486.00	148,600
キャリアインデックス	100	1,010.00	101,000
MS - Japan	100	1,006.00	100,600
船場	100	789.00	78,900
グレイステクノロジー	400	1,021.00	408,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,100	2,538.00	2,791,800
フルテック	100	1,480.00	148,000
ツナググループ・ホールディングス	100	323.00	32,300
GameWith	100	540.00	54,000
ソウルドアウト	100	1,383.00	138,300
MS&Consulting	100	771.00	77,100
ウェルビー	200	1,681.00	336,200
ミダックホールディングス	100	5,530.00	553,000
日総工産	300	735.00	220,500
キュービーネットホールディングス	200	1,983.00	396,600
RPAホールディングス	500	426.00	213,000
スプリックス	100	1,265.00	126,500
マネジメントソリューションズ	200	3,365.00	673,000
プロレド・パートナーズ	100	1,280.00	128,000
and factory	100	474.00	47,400
テノ・ホールディングス	100	823.00	82,300
フロンティア・マネジメント	100	919.00	91,900

ピアラ	100	728.00	72,800
コプロ・ホールディングス	100	1,241.00	124,100
ギークス	100	1,477.00	147,700
カーブスホールディングス	900	946.00	851,400
フォーラムエンジニアリング	200	880.00	176,000
ダイレクトマーケティングミックス	200	4,175.00	835,000
ポピンズホールディングス	100	3,690.00	369,000
L I T A L I C O	300	3,685.00	1,105,500
アドバンテッジリスクマネジメント	200	840.00	168,000
リログループ	1,800	2,257.00	4,062,600
東祥	300	2,195.00	658,500
T R Eホールディングス	500	1,635.00	817,500
人・夢・技術グループ	100	1,959.00	195,900
エイチ・アイ・エス	700	2,689.00	1,882,300
ラックランド	100	3,000.00	300,000
共立メンテナンス	600	4,560.00	2,736,000
イチネンホールディングス	400	1,432.00	572,800
建設技術研究所	200	2,776.00	555,200
スペース	300	975.00	292,500
燦ホールディングス	200	1,402.00	280,400
東京テアトル	100	1,243.00	124,300
タナベ経営	200	739.00	147,800
ナガワ	100	11,130.00	1,113,000
東京都競馬	300	4,580.00	1,374,000
常磐興産	100	1,446.00	144,600
カナモト	600	2,466.00	1,479,600
西尾レントオール	300	2,874.00	862,200
アゴラ ホスピタリティ グループ	2,100	24.00	50,400
トランス・コスモス	400	3,310.00	1,324,000
乃村工藝社	1,400	1,112.00	1,556,800
藤田観光	200	2,560.00	512,000
K N T - C Tホールディングス	200	1,780.00	356,000
日本管財	400	2,785.00	1,114,000
トーカイ	300	2,221.00	666,300
セコム	3,300	7,682.00	25,350,600
セントラル警備保障	200	2,693.00	538,600
丹青社	700	927.00	648,900
メイテック	400	7,000.00	2,800,000
応用地質	400	1,821.00	728,400
船井総研ホールディングス	700	2,635.00	1,844,500
進学会ホールディングス	200	401.00	80,200
オオバ	200	829.00	165,800

いであ	100	1,936.00	193,600	
学究社	100	1,409.00	140,900	
ベネッセホールディングス	1,100	2,443.00	2,687,300	
イオンディライト	400	3,515.00	1,406,000	
ナック	200	980.00	196,000	
ダイセキ	600	5,330.00	3,198,000	
ステップ	100	1,861.00	186,100	
合 計	3,802,800		9,744,487,560	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年11月30日現在です。

【インデックスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	9,252,848,906円
負債総額	10,114,329円
純資産総額（ - ）	9,242,734,577円
発行済口数	11,189,621,313口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8260円

【バランスポートフォリオ】

【純資産額計算書】

資産総額	205,607,901円
負債総額	214,510円
純資産総額（ - ）	205,393,391円
発行済口数	201,829,575口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0177円

（参考）

インデックス東証株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	9,344,088,411円
負債総額	9,746,499円
純資産総額（ - ）	9,334,341,912円
発行済口数	4,505,457,506口
1口当たり純資産額（ / ）	2.072円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

該当事項はありません。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

（４）受益証券の再発行

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

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2021年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2021年11月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

(3) 運用の意思決定プロセス（2021年11月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスクや流動性リスクの管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2021年11月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	872	258,513
株式投資信託	803	222,441
単位型	298	11,269
追加型	505	211,171
公社債投資信託	69	36,072
単位型	56	2,162
追加型	13	33,910

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第62期事業年度（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、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第63期中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第61期 (2020年3月31日)		第62期 (2021年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		24,591		24,698
有価証券		19		17
前払費用		603		785
未収入金		14		225
未収委託者報酬		16,912		24,738
未収収益	3	1,412	3	891
関係会社短期貸付金		2,371		2,403
立替金		1,437		930
その他	2	1,316	2	361
流動資産合計		48,679		55,053
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	182	1	245
器具備品	1	135	1	190
有形固定資産合計		318		436
無形固定資産				
ソフトウェア		120		241

無形固定資産合計	120	241
投資その他の資産		
投資有価証券	17,826	22,903
関係会社株式	25,769	25,987
長期差入保証金	484	678
繰延税金資産	2,022	1,845
投資その他の資産合計	46,102	51,414
固定資産合計	46,540	52,092
資産合計	95,220	107,145

(単位：百万円)

	第61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	554	844
未払金	5,881	9,834
未払収益分配金	8	8
未払償還金	71	71
未払手数料	5,202	8,956
その他未払金	599	798
未払費用	3 4,289	3 4,660
未払法人税等	1,439	1,090
未払消費税等	4 746	4 775
賞与引当金	2,718	3,034
役員賞与引当金	55	55
その他	42	643
流動負債合計	15,726	20,938
固定負債		
退職給付引当金	1,395	1,456
賞与引当金	-	156
その他	695	544
固定負債合計	2,091	2,157
負債合計	17,818	23,095
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	55,395	61,956
利益剰余金合計	55,395	61,956
自己株式	905	2,067
株主資本合計	77,073	82,472
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	60	1,461
繰延ヘッジ損益	389	115
評価・換算差額等合計	329	1,577
純資産合計	77,402	84,049
負債純資産合計	95,220	107,145

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	74,265	78,975
その他営業収益	2,994	3,973
営業収益合計	77,259	82,948
営業費用		
支払手数料	31,322	34,050
広告宣伝費	953	953
公告費	2	1
調査費	17,275	17,813
調査費	920	966
委託調査費	16,333	16,825
図書費	21	22
委託計算費	534	545
営業雑経費	1,058	1,053
通信費	116	174
印刷費	337	331
協会費	52	51
諸会費	10	11
その他	541	483
営業費用計	51,148	54,419
一般管理費		
給料	9,857	10,383
役員報酬	360	243
役員賞与引当金繰入額	55	55
給料・手当	6,675	6,766
賞与	64	159
賞与引当金繰入額	2,702	3,158
交際費	92	14
寄付金	29	30
旅費交通費	420	57
租税公課	440	485
不動産賃借料	901	939
退職給付費用	387	388
退職金	82	10
固定資産減価償却費	118	138
福利費	1,014	1,084
諸経費	3,229	4,286
一般管理費計	16,573	17,817
営業利益	9,538	10,711

(単位：百万円)

	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		99		75
受取配当金	1	4,881	1	2,555
有価証券償還益		-		14
デリバティブ収益		223		-
時効成立分配金・償還金		1		1
為替差益		5		-
その他		145		62
営業外収益合計		5,357		2,710
営業外費用				
支払利息		185		122
有価証券償還損		0		-
デリバティブ費用		-		804
時効成立後支払分配金・償還金		1		25
為替差損		-		59
その他		12		42
営業外費用合計		199		1,054
経常利益		14,695		12,367
特別利益				
投資有価証券売却益		164		774
その他		-		0
特別利益合計		164		774
特別損失				
投資有価証券売却損		19		237
投資有価証券評価損		21		5
固定資産処分損		0		0
役員退職一時金		-		125
特別損失合計		41		369
税引前当期純利益		14,818		12,773
法人税、住民税及び事業税		3,307		3,722
法人税等調整額		45		373
法人税等合計		3,353		3,348
当期純利益		11,465		9,424

(3) 【株主資本等変動計算書】

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891
当期変動額							
剰余金の配当				3,212	3,212		3,212

当期純利益				11,465	11,465		11,465
自己株式の取得						71	71
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	8,252	8,252	71	8,181
当期末残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	493	185	679	69,571
当期変動額				
剰余金の配当				3,212
当期純利益				11,465
自己株式の取得				71
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	553	204	349	349
当期変動額合計	553	204	349	7,831
当期末残高	60	389	329	77,402

第62期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073
当期変動額							
剰余金の配当				2,862	2,862		2,862
当期純利益				9,424	9,424		9,424
自己株式の取得						1,161	1,161
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	6,561	6,561	1,161	5,399
当期末残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	2,067	82,472

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	60	389	329	77,402
当期変動額				
剰余金の配当				2,862
当期純利益				9,424
自己株式の取得				1,161
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,521	273	1,247	1,247

当期変動額合計	1,521	273	1,247	6,647
当期末残高	1,461	115	1,577	84,049

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 3年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p>

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

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

(貸借対照表関係)

第61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,311百万円 器具備品 707百万円	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,349百万円 器具備品 764百万円
2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。	2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。
3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 151百万円 (流動負債) 未払費用 623百万円	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 257百万円 (流動負債) 未払費用 1,247百万円
4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。	4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。

<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務365百万円に対して保証を行っております。</p>	
--	--

(損益計算書関係)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">受取配当金 4,849百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">受取配当金 2,498百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(変動事由の概要)

2019年8月13日の取締役会決議による自己株式の取得 88,800株

3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第62期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	1,454,500	1,405,500	-	2,860,000

(変動事由の概要)

2020年3月25日の取締役会決議による自己株式の取得	594,300株
2020年7月17日の取締役会決議による自己株式の取得	811,200株

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,184,700	-	752,400	432,300	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,346,000	-	330,000	1,016,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	2,394,000	-	622,000	1,772,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,939,000	-	332,000	2,607,000	-
合計		7,863,700	-	2,036,400	5,827,300	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2011年度ストックオプション(1)432,300株、2016年度ストックオプション(1)1,016,000株、2016年度ストックオプション(2)1,088,000株及び2017年度ストックオプション874,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(2)684,000株及び2017年度ストックオプション(1)1,733,000株は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年5月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,191	26.74	2021年3月31日	2021年6月29日

(リース取引関係)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	912百万円	1年内	911百万円
1年超	6,148百万円	1年超	5,236百万円
合計	7,060百万円	合計	6,148百万円

(金融商品関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシドマネの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	24,591	24,591	-
(2) 未収委託者報酬	16,912	16,912	-
(3) 未収収益	1,412	1,412	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,371	2,371	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	17,828	17,828	-
(6) 未払金	(5,881)	(5,881)	-
(7) 未払費用	(4,289)	(4,289)	-
(8) デリバティブ取引(2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(25)	(25)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	167	167	-
デリバティブ取引計	142	142	-

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見

積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

第62期(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

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グロ・バルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネ・の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	24,698	24,698	-
(2) 未収委託者報酬	24,738	24,738	-
(3) 未収収益	891	891	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,403	2,403	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	22,905	22,905	-
(6) 未払金	(9,834)	(9,834)	-
(7) 未払費用	(4,660)	(4,660)	-
(8) デリバティブ取引(2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(188)	(188)	-
ヘッジ会計が適用されているもの デリバティブ取引計	(453) (642)	(453) (642)	- -

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上流動負債のその他

に含まれております。

- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式(貸借対照表計上額23,094百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。
- 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	24,698	-	-	-
未収委託者報酬	24,738	-	-	-
未収収益	891	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	17	812	10,348	20
合計	50,346	812	10,348	20

(有価証券関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%~50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について21百万円(その他有価証券の投資信託)減損処理を行っております。

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	23,094
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	16,914	14,476	2,438
	小計	16,914	14,476	2,438
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	5,990	6,322	332
	小計	5,990	6,322	332
合計		22,905	20,799	2,105

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%~50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について5百万円(その他有価証券の投資信託)減損処理を行っております。

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	5,735	774	237
合計	5,735	774	237

(デリバティブ取引関係)

第61期(2020年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

合計	1,913	-	41	41
----	-------	---	----	----

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第62期(2021年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建 買建	2,670 -	- -	75 -	75 -
合計		2,670	-	75	75

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
----	--	---------------	-------------------------	-------------	---------------

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,713	-	112	112
	合計	1,713	-	112	112

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価証券	4,620	-	273
	香港ドル		862	-	57
	人民元		1,684	-	117
	ユーロ		180	-	5
	合計		7,347	-	453

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,002	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,485	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 12,258
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,631	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,751

(退職給付関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,363
未積立退職給付債務	1,363
未認識数理計算上の差異	31

貸借対照表に計上された負債の額	1,395
-----------------	-------

退職給付引当金	1,395
---------	-------

貸借対照表に計上された負債の額	1,395
-----------------	-------

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	147
------	-----

利息費用	1
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	6
----------------	---

確定給付制度に係る退職給付費用	154
-----------------	-----

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233百万円でありました。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

退職給付債務の期首残高	1,363
-------------	-------

勤務費用	142
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の発生額	6
--------------	---

退職給付の支払額	86
----------	----

退職給付債務の期末残高	1,429
-------------	-------

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,429
--------	-------

未積立退職給付債務	1,429
-----------	-------

未認識数理計算上の差異	27
-------------	----

貸借対照表に計上された負債の額	1,456
-----------------	-------

退職給付引当金	1,456
---------	-------

貸借対照表に計上された負債の額	1,456
-----------------	-------

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	2
----------------	---

確定給付制度に係る退職給付費用	147
-----------------	-----

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、240百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名

株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況
ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) スtockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況 ストックオプション(新株予約権)の数

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	1,184,700	1,346,000
付与	0	0

失効	752,400	330,000
権利確定	0	0
権利未確定残	432,300	1,016,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	2,394,000	2,939,000
付与	0	0
失効	622,000	332,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,772,000	2,607,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,738百万円
 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第61期 (2020年3月31日)		第62期 (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 (単位：百万円)	1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳 (単位：百万円)
	繰延税金資産		繰延税金資産
	賞与引当金		賞与引当金
	投資有価証券評価損		投資有価証券評価損
	関係会社株式評価損		関係会社株式評価損
	退職給付引当金		退職給付引当金
	固定資産減価償却費		固定資産減価償却費
	その他		その他
	繰延税金資産小計		繰延税金資産小計
	評価性引当金		評価性引当金
	繰延税金資産合計		繰延税金資産合計
	繰延税金負債		繰延税金負債
	繰延ヘッジ利益		繰延ヘッジ利益
	繰延税金負債合計		繰延税金負債合計
	繰延税金資産の純額		繰延税金資産の純額
2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
	法定実効税率 (調整)		法定実効税率 (調整)
	交際費等永久に損金に算入されない項目		交際費等永久に損金に算入されない項目
	受取配当金等永久に益金に参入されない項目		受取配当金等永久に益金に参入されない項目
	その他		その他
	税効果会計適用後の法人税等の負担率		税効果会計適用後の法人税等の負担率

(関連当事者情報)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International	シンガポール	342,369 (SGD千)	アセット マネジメン	直接 100.00	-	資金の貸付 (米国ドル 貸建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	1,793 (USD 16,500千)
							貸付金利息 (米国ドル 貸建) (注1)	86 (USD 798千)	未収収益	13 (USD 122千)

	Limited	国		ト業			資金の貸付 (円貨建) (注1)		関係会社 短期 貸付金	
							-		577	
							貸付金利息 (円貨建) (注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 2)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	配当の受取	1,526 (USD 14,000 千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	1,550 (百万円)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	配当の受取	2,700	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	28,121百万円
負債合計	5,242百万円
純資産合計	22,879百万円
営業収益	14,853百万円
税引前当期純利益	4,354百万円
当期純利益	3,194百万円

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業 の内容	議決権等 の所有 (被所有 割合(%))	関連 当事者 との 関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
							資金の貸付 (米国ドル 貨建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	1,825 (USD 16,500 千)

子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	貸付金利息 (米国ドル 貨建) (注1)	63 (USD 596千)	未収収益	7 (USD 71千)
							資金の貸付 (円貨建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貨建) (注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注2)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	配当の受取	1,783 (USD 17,000千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Luxembourg S.A.	ルクセンブルグ	2,828 (EUR千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	増資の引受 (注3)	217 (EUR 1,750千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠5,000百万円(若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- Nikko Asset Management Luxembourg S.A.の行った70,000株の新株発行増資を、1株につき25ユーロで当社が引き受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロンドン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2020年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	30,151百万円
負債合計	5,919百万円
純資産合計	24,231百万円

営業収益	19,946百万円
税引前当期純利益	7,020百万円
当期純利益	5,194百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

関連情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第62期(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

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(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

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(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発生益に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	395円50銭	432円90銭
1株当たり当期純利益金額	58円61銭	48円45銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,465	9,424
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	11,465	9,424
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,599	194,509
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1) 1,184,700株、2016年度ストックオプション(1) 1,346,000株、2016年度ストックオプション(2) 2,394,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,939,000株	2011年度ストックオプション(1) 432,300株、2016年度ストックオプション(1) 1,016,000株、2016年度ストックオプション(2) 1,772,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,607,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第61期 (2020年3月31日)	第62期 (2021年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	77,402	84,049
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	77,402	84,049
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	195,558	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第63期中間会計期間 (2021年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	29,614
有価証券	244
未収委託者報酬	24,429
未収収益	1,019
関係会社短期貸付金	1,846

その他	2	2,556
流動資産合計		59,710
固定資産		
有形固定資産	1	392
無形固定資産		295
投資その他の資産		
投資有価証券		24,330
関係会社株式		28,277
長期差入保証金		664
繰延税金資産		1,790
投資その他の資産合計		55,062
固定資産合計		55,749
資産合計		115,460

(単位：百万円)

第63期中間会計期間
(2021年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		12,200
未払費用		4,648
未払法人税等		2,426
未払消費税等	3	2,260
賞与引当金		2,224
役員賞与引当金		2
その他		1,090
流動負債合計		24,855

固定負債

退職給付引当金		1,501
賞与引当金		261
その他		341
固定負債合計		2,104

負債合計		26,960
------	--	--------

純資産の部

株主資本

資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220

利益剰余金

その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		66,282
利益剰余金合計		66,282

自己株式		2,067
------	--	-------

株主資本合計		86,798
--------	--	--------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	1,674
繰延ヘッジ損益	26
評価・換算差額等合計	1,701
純資産合計	88,500
負債純資産合計	115,460

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第63期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			50,001
その他営業収益			2,200
営業収益合計			52,202
営業費用及び一般管理費	1		45,253
営業利益			6,948
営業外収益	2		5,135
営業外費用	3		275
経常利益			11,808
特別利益	4		167
特別損失	5		30
税引前中間純利益			11,945
法人税等	6		2,428
中間純利益			9,517

(3) 中間株主資本等変動計算書

第63期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	2,067	82,472
当中間期変動額							
剰余金の配当				5,191	5,191		5,191
中間純利益				9,517	9,517		9,517
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計	-	-	-	4,326	4,326	-	4,326
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	66,282	66,282	2,067	86,798

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他	繰延ヘッジ	評価・換算	

	有価証券 評価差額金	損益	差額等合計	
当期首残高	1,461	115	1,577	84,049
当中間期変動額				
剰余金の配当				5,191
中間純利益				9,517
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	213	89	124	124
当中間期変動額合計	213	89	124	4,450
当中間期末残高	1,674	26	1,701	88,500

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第63期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 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) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の日から費用処理しております。</p>

4 収益及び費用の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行业務の内容及び当該履行业務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務</p> <p>当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」)に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務</p> <p>当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬</p> <p>当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p>
5 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法</p> <p>繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象</p> <p>ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針</p> <p>ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法</p> <p>ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
6 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理</p> <p>資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法</p> <p>税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(会計方針の変更)

<p>第63期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)</p>
<p>(収益認識に関する会計基準の適用)</p> <p>「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。</p> <p>収益認識会計基準等の適用については、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。収益認識会計基準等の適用による、当中間財務諸表に与える影響はありません。</p> <p>(時価の算定に関する会計基準の適用)</p> <p>「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。なお、当中間財務諸表に与える影響はありません。</p>

(中間貸借対照表関係)

第63期中間会計期間 (2021年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	2,165百万円
2 信託資産	流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4 保証債務	日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッドが発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大5百万豪ドルを提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。

(中間損益計算書関係)

第63期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	52百万円
無形固定資産	30百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	24百万円
受取配当金	5,072百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	73百万円
デリバティブ費用	117百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	167百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	30百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	432,300	-	392,700	39,600	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,016,000	-	928,000	88,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,772,000	-	912,000	860,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,607,000	-	983,000	1,624,000	-
合計		5,827,300	-	3,215,700	2,611,600	-

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

2 2011年度ストックオプション(1)39,600株、2016年度ストックオプション(1)88,000株、2016年度ストックオプション(2)860,000株及び2017年度ストックオプション(1)935,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2017年度ストックオプション(1)689,000株は権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年5月25日 取締役会	普通株式	5,191	26.74	2021年3月31日	2021年6月29日

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

(リース取引関係)

第63期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	911百万円
1年超	4,780百万円
合計	5,692百万円

(金融商品関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した投資信託及び市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価

の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額(3)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
デリバティブ取引(1、2)				
株式関連	33	-	-	33
通貨関連	-	265	-	265
デリバティブ取引計	33	265	-	232

- (1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、で示しております。
- (2) 株式関連のデリバティブ取引のうち33百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち0百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、266百万円は、流動負債のその他に含まれております。
- (3) 時価算定適用指針に従い、経過措置を適用した投資信託は上記に含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は有価証券に244百万円、投資有価証券に24,313百万円となります。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（1年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

デリバティブ取引

株式関連

株式指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。

通貨関連

為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	23,094
関連会社株式	5,183

(有価証券関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(注)子会社株式及び関連会社株式は市場価格がない株式等であり、(金融商品関係)金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項(注2)に記載のとおりであります。

2 その他有価証券

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	17,930	15,256	2,674
	小計	17,930	15,256	2,674
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	6,627	6,888	260
	小計	6,627	6,888	260
合計		24,557	22,144	2,413

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

2 非上場株式(中間貸借対照表計上額16百万円)については、市場価格がない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,652	-	33	33
合計		2,652	-	33	33

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

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	売建 米ドル	1,811	-	34	34
合計		1,811	-	34	34

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		4,973	-	93
	ユーロ		1	-	0
	香港ドル		979	-	17
	人民元	4,970	-	120	
合計			10,924	-	230

（持分法損益等）

第63期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	5,300百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	14,304百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,421百万円

（収益認識関係）

第63期中間会計期間(2021年9月30日)

- 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。
- 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針 4. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。
- 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（ストックオプション等関係）

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

〔関連情報〕

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

- 製品及びサービスごとの情報
当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。
- 地域ごとの情報
 - 営業収益
国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。
 - 有形固定資産
国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。
- 主要な顧客ごとの情報
営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
第63期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第63期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
1株当たり純資産額	455円82銭
1株当たり中間純利益金額	49円02銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益(百万円)	9,517
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	9,517
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2011年度ストックオプション(1)39,600株、 2016年度ストックオプション(1)88,000株、 2016年度ストックオプション(2)860,000株、 2017年度ストックオプション(1)1,624,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期中間会計期間 (2021年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	88,500
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	88,500
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で

定めるものを除きます。)。

- (3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。) または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。) と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

< 再信託受託会社の概要 >

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額 : 10,000百万円 (2021年3月末現在)

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

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
アーク証券株式会社	2,619百万円	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。
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3 【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 2月 9日	有価証券届出書
2021年 2月 9日	有価証券報告書
2021年 8月 6日	有価証券届出書
2021年 8月 6日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2021年6月11日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 貞 廣 篤 典
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明
業務執行社員

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の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及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

ること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記は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12月15日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスポートフォリオの2020年11月10日から2021年11月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックスポートフォリオの2021年11月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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、日興アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. 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12月15日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランスポートフォリオの2020年11月10日から2021年11月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランスポートフォリオの2021年11月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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、日興アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年12月3日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞 廣 篤 典指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。