

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年2月28日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 佐谷戸 淳一
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）（以下「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

- ・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
- ・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社債、株式等の振替に関する法律第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情などがある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込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「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。ただし、確定拠出年金制度などによる取得申込みを行なう場合は、１円以上１円単位とします。

（７）【申込期間】

2022年3月1日から2022年8月31日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、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。

（９）【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【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

わが国の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て運用を行ないます。

ファンドの基本的性格

1）商品分類

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

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	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 一般	年6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			
その他資産 ()	その他 ()	アフリカ	その他 ()
		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。

株式 一般

当ファンドは、株式に投資を行いません。「株式 一般」とは、大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。

年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。

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざします。

主として、TOPIX(東証株価指数)に採用されている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て運用を行ないます。なお、株価指数先物取引(TOPIX先物取引)などを活用する場合があります。

※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. 効率的な運用を行なうために、信託財産で保有する有価証券の貸付を行なう場合があります。

有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料の一部は信託財産の収益となります。

※当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。購入申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて購入の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

主な投資制限

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

分配方針

- ・毎決算時に、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

- ・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2)【ファンドの沿革】

2004年11月30日

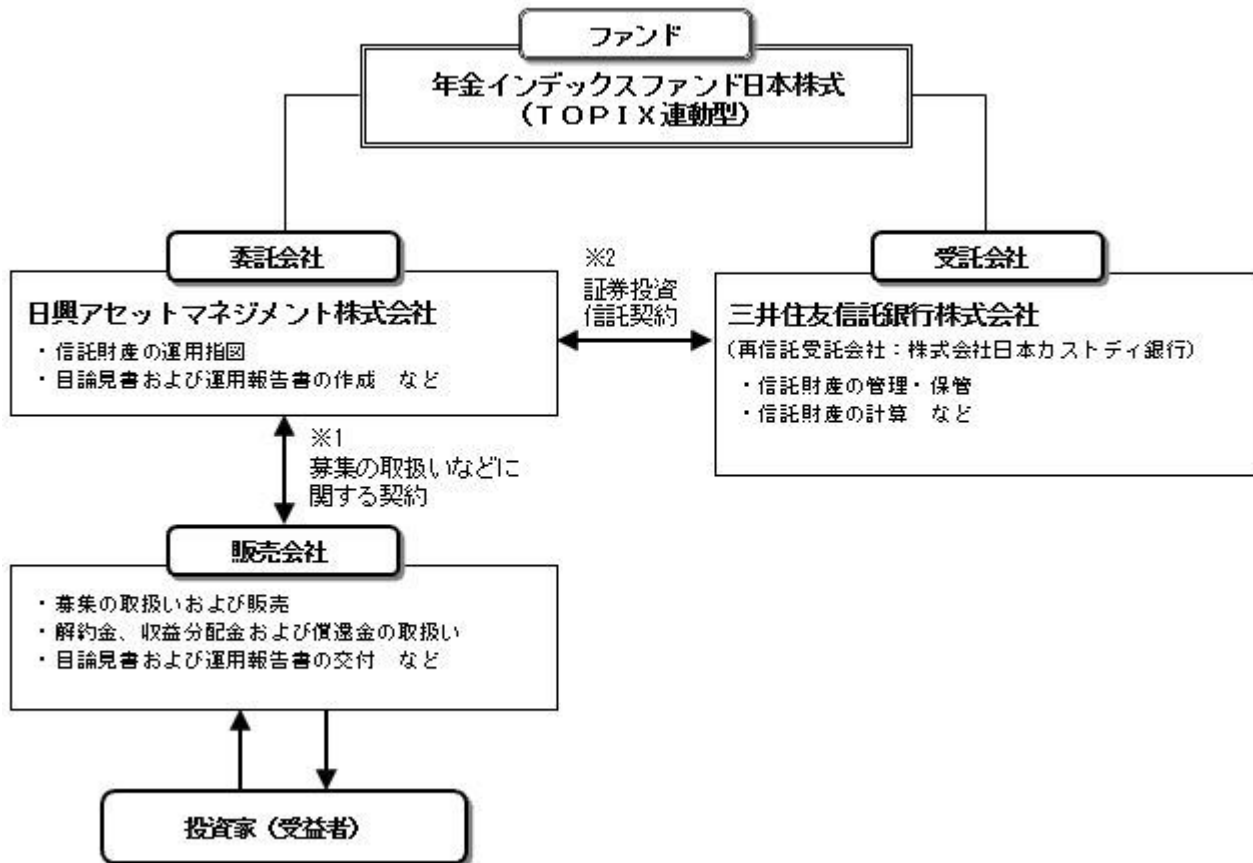
- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

2014年5月31日

- ・パナソニック ペンションファンドマネジメント株式会社からの投資助言による運用から、日興アセットマネジメント株式会社による直接運用に移行

(3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。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12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】

- ・主として、TOPIX（東証株価指数）に採用されている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て運用を行ないます。なお、株価指数先物取引など（TOPIX先物取引）を活用する場合があります。
- ・株式の実質組入比率は高位を保つことを原則とします。
- ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ・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。

(2) 【投資対象】

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限り、)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)~8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、)
- 14) 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 15) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、)
- 16) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

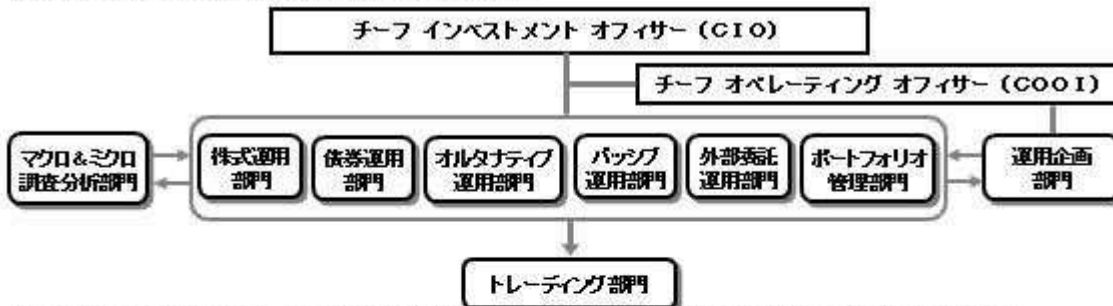
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。

- 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) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売

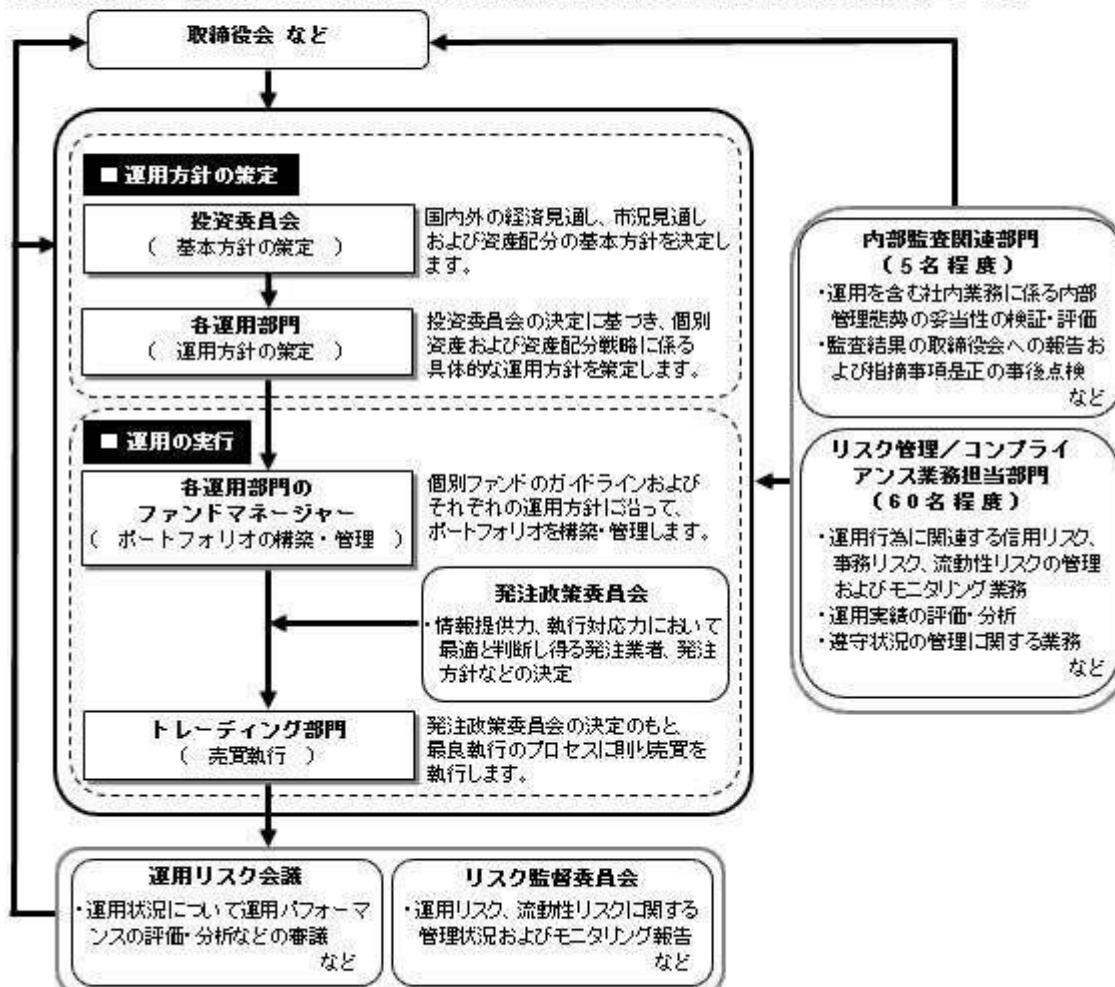
- 7) 公社債の借入
8) 資金の借入

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

ESG（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行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12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

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

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

2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。

3) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。

4) 外貨建資産への投資は行ないません。

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

きます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。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行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - 7) わが国の金融商品取引所における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行なうことの指図をすることができます。
 - 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった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。
 - 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 13) 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) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
 - ニ) 解約に伴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。
- 14) 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。
- 15) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場

合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

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。

有価証券の貸付などにおけるリスク

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

< 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

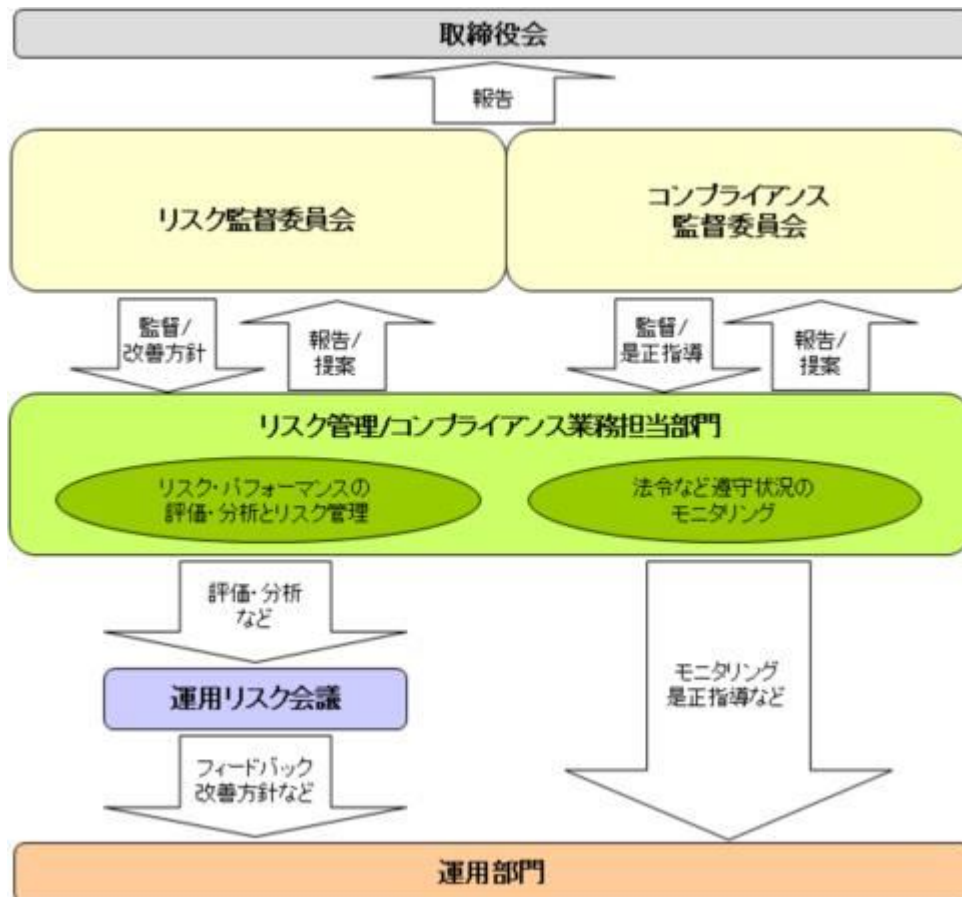
なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。

- ・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TOPIX（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。

<その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性やインデックスと基準価額が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。

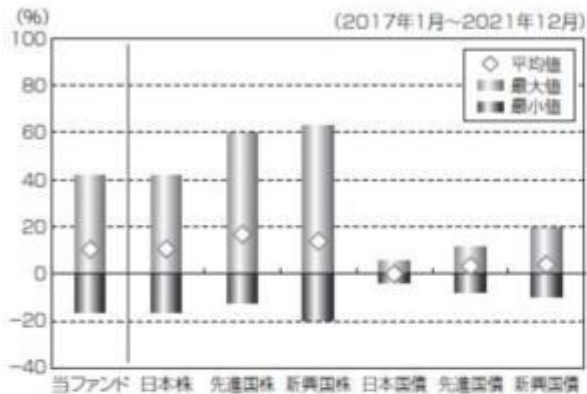
法令など遵守状況のモニタリング

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12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	10.4%	10.6%	16.8%	13.9%	0.1%	3.3%	4.0%
最大値	41.9%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	11.4%	19.3%
最小値	-16.1%	-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2017年1月から2021年12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・ディバースファイド(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、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income

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、2017年1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。

LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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0.154%（税抜0.14%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（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
0.140%	0.052%	0.065%	0.023%

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

組入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、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料に0.44（税抜0.4）を乗じて得た貸

付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は3：1とし、信託報酬と同時期に支払います。

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

* 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。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

確定拠出年金の場合

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会の場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されません。

厚生年金基金および企業年金基金の場合

これら所得税法別表第一に掲げられる公共法人である受益者に対しては、所得税および地方税はかかりません。

なお、企業年金基金については、企業年金基金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

規約型企業年金の場合

規約型企業年金を目的として、確定給付企業年金法の規定に基づく契約を締結した場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、規約型企業年金については規約型企業年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記以外の場合

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す。）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。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。ただし、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

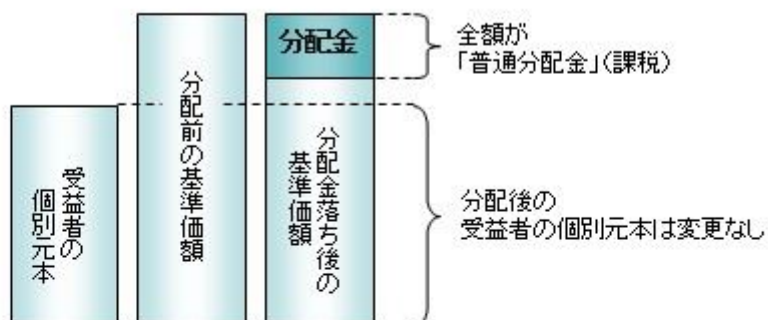
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

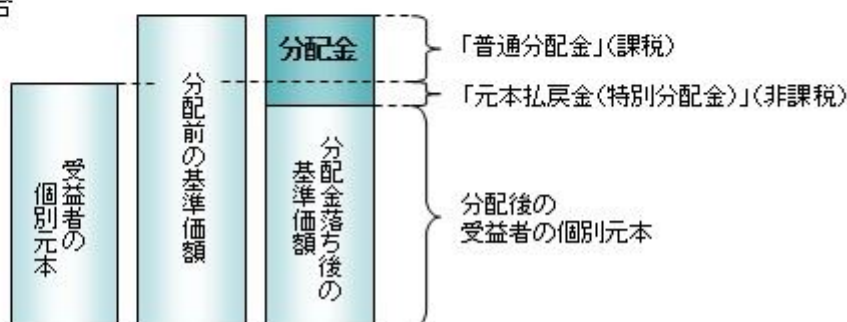
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 - 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28日現在のもので、税法、確定給付企業年金法および確定拠出年金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】

【年金インデックスファンド日本株式(TOPPIX連動型)】

以下の運用状況は2021年12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(%)
株式	日本	78,423,809,450	99.09
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		716,880,163	0.91
合計(純資産総額)		79,140,689,613	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	717,120,000	0.91

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

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	1,457,700	1,833.19	2,672,241,063	2,105.50	3,069,187,350	3.88
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	180,300	10,872.60	1,960,329,780	14,475.00	2,609,842,500	3.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	26,100	54,463.61	1,421,500,414	72,280.00	1,886,508,000	2.38
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	212,100	5,745.52	1,218,624,792	6,972.00	1,478,761,200	1.87
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	18,300	49,068.75	897,958,164	66,280.00	1,212,924,000	1.53
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,780,000	620.00	1,103,600,000	624.90	1,112,322,000	1.41
日本	株式	日本電産	電気機器	74,600	12,528.26	934,608,196	13,520.00	1,008,592,000	1.27
日本	株式	信越化学工業	化学	48,400	18,867.16	913,170,544	19,920.00	964,128,000	1.22
日本	株式	HOYA	精密機器	56,100	14,499.31	813,411,291	17,110.00	959,871,000	1.21
日本	株式	ダイキン工業	機械	36,700	21,740.37	797,871,803	26,090.00	957,503,000	1.21
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	295,400	2,937.02	867,595,708	3,150.00	930,510,000	1.18
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	169,300	8,150.74	1,379,920,282	5,434.00	919,976,200	1.16
日本	株式	任天堂	その他製品	16,200	67,184.98	1,088,396,676	53,650.00	869,130,000	1.10
日本	株式	日立製作所	電気機器	138,400	5,781.40	800,145,760	6,230.00	862,232,000	1.09
日本	株式	三菱商事	卸売業	212,400	3,112.51	661,097,124	3,652.00	775,684,800	0.98
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	196,500	3,944.27	775,049,055	3,943.00	774,799,500	0.98
日本	株式	村田製作所	電気機器	84,500	8,311.89	702,354,705	9,157.00	773,766,500	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	226,600	3,357.83	760,884,278	3,230.00	731,918,000	0.92

日本	株式	武田薬品工業	医薬品	226,200	3,702.78	837,568,836	3,137.00	709,589,400	0.90
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	198,200	3,251.87	644,520,634	3,518.00	697,267,600	0.88
日本	株式	KDDI	情報・通信業	205,900	3,702.50	762,344,750	3,362.00	692,235,800	0.87
日本	株式	第一三共	医薬品	226,200	2,535.67	573,568,554	2,925.00	661,635,000	0.84
日本	株式	S M C	機械	8,400	65,713.66	551,994,783	77,590.00	651,756,000	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	32,500	16,518.22	536,842,150	19,395.00	630,337,500	0.80
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	427,800	1,466.14	627,214,692	1,454.50	622,235,100	0.79
日本	株式	ファナック	電気機器	25,300	26,188.06	662,558,000	24,380.00	616,814,000	0.78
日本	株式	デンソー	輸送用機器	63,400	7,525.55	477,119,870	9,529.00	604,138,600	0.76
日本	株式	三井物産	卸売業	220,100	2,422.84	533,267,084	2,723.50	599,442,350	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	93,500	5,208.41	486,986,335	6,392.00	597,652,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	110,900	4,748.59	526,618,631	5,056.00	560,710,400	0.71

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	0.23
		建設業	2.20
		食料品	3.24
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.21
		化学	6.69
		医薬品	4.74
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.74
		非鉄金属	0.69
		金属製品	0.63
		機械	5.49
		電気機器	19.97
		輸送用機器	8.05
		精密機器	2.88
		その他製品	2.20
		電気・ガス業	1.05
陸運業	2.90		
海運業	0.51		
空運業	0.38		
倉庫・運輸関連業	0.17		
情報・通信業	7.91		
卸売業	5.23		

	小売業	4.04
	銀行業	4.70
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	1.95
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.81
	サービス業	6.24
合 計		99.09

【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 2022年03月	買建	36	日本円	715,493,100	717,120,000	0.91

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（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8計算期間末 (2012年 5月31日)	12,319	12,335	0.7308	0.7318
第9計算期間末 (2013年 5月31日)	18,870	18,886	1.1759	1.1769
第10計算期間末 (2014年 6月 2日)	18,195	18,210	1.2858	1.2868
第11計算期間末 (2015年 6月 1日)	27,517	27,532	1.7971	1.7981
第12計算期間末 (2016年 5月31日)	27,352	27,370	1.5035	1.5045
第13計算期間末 (2017年 5月31日)	33,130	33,149	1.7427	1.7437
第14計算期間末 (2018年 5月31日)	41,841	41,862	1.9775	1.9785
第15計算期間末 (2019年 5月31日)	40,637	40,661	1.7476	1.7486
第16計算期間末 (2020年 6月 1日)	58,379	58,411	1.8556	1.8566
第17計算期間末 (2021年 5月31日)	73,805	73,837	2.3196	2.3206
2020年12月末日	67,220		2.1576	
2021年 1月末日	67,399		2.1622	
2月末日	69,410		2.2295	
3月末日	74,352		2.3563	
4月末日	72,596		2.2894	
5月末日	73,805		2.3196	

6月末日	75,023		2.3468
7月末日	73,689		2.2954
8月末日	76,203		2.3677
9月末日	79,596		2.4707
10月末日	79,360		2.4353
11月末日	76,283		2.3468
12月末日	79,140		2.4282

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第8期	2011年 6月 1日～2012年 5月31日	0.0010
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	0.0010
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	0.0010
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	0.0010
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	0.0010
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	0.0010
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	0.0010
第15期	2018年 6月 1日～2019年 5月31日	0.0010
第16期	2019年 6月 1日～2020年 6月 1日	0.0010
第17期	2020年 6月 2日～2021年 5月31日	0.0010
当中間期	2021年 6月 1日～2021年11月30日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第8期	2011年 6月 1日～2012年 5月31日	12.34
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	61.04
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	9.43
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	39.84
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	16.28
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	15.98
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	13.53
第15期	2018年 6月 1日～2019年 5月31日	11.58
第16期	2019年 6月 1日～2020年 6月 1日	6.24
第17期	2020年 6月 2日～2021年 5月31日	25.06
当中間期	2021年 6月 1日～2021年11月30日	1.17

(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】

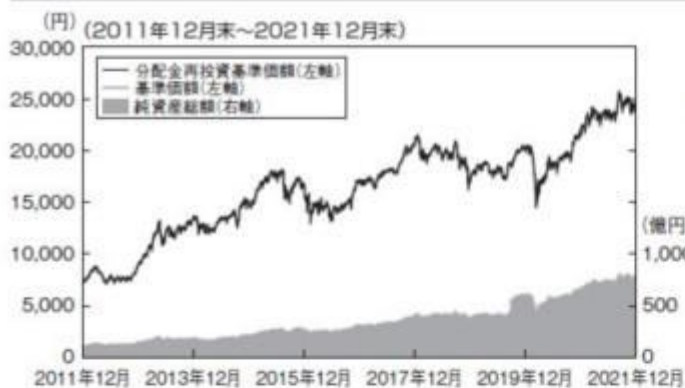
期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第8期	2011年 6月 1日～2012年 5月31日	3,959,202,241	1,239,279,452
第9期	2012年 6月 1日～2013年 5月31日	4,667,083,142	5,475,394,820
第10期	2013年 6月 1日～2014年 6月 2日	5,541,023,939	7,437,910,957
第11期	2014年 6月 3日～2015年 6月 1日	6,052,501,542	4,891,151,568
第12期	2015年 6月 2日～2016年 5月31日	7,174,553,570	4,294,430,475
第13期	2016年 6月 1日～2017年 5月31日	5,730,325,471	4,911,678,612
第14期	2017年 6月 1日～2018年 5月31日	6,496,323,254	4,348,409,754
第15期	2018年 6月 1日～2019年 5月31日	6,092,908,576	3,998,730,448
第16期	2019年 6月 1日～2020年 6月 1日	14,798,267,469	6,589,455,296
第17期	2020年 6月 2日～2021年 5月31日	7,669,720,398	7,313,401,343
当中間期	2021年 6月 1日～2021年11月30日	4,244,961,749	3,558,488,212

参考情報

運用実績

2021年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額 24,282円
純資産総額 791.40億円

※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12月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2017年5月	2018年5月	2019年5月	2020年6月	2021年5月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	140円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
株式	99.09%
株式先物	0.91%
現金その他	0.91%

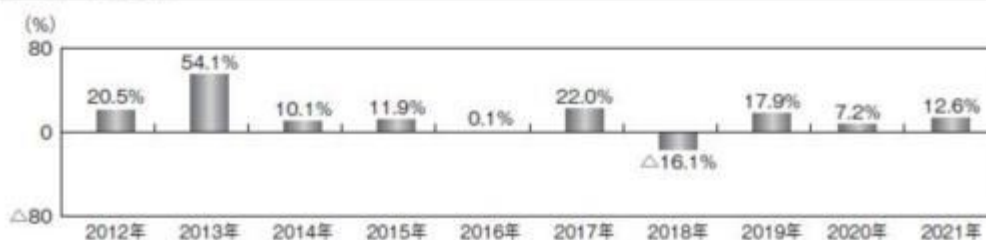
※対純資産総額比です。

<組入上位10銘柄>

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.88%
2 ソニーグループ	電気機器	3.30%
3 キーエンス	電気機器	2.38%
4 リクルートホールディングス	サービス業	1.87%
5 東京エレクトロン	電気機器	1.53%
6 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.41%
7 日本電産	電気機器	1.27%
8 信越化学工業	化学	1.22%
9 HOYA	精密機器	1.21%
10 ダイキン工業	機械	1.21%

※対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※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

販売会社所定の方法でお申し込みください。なお、確定拠出年金制度などによる取得申込みを行なう場

合は、当該規定に従うものとします。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(4) 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。

(5) 申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。ただし、確定拠出年金制度などによる取得申込みを行なう場合は、1円以上1円単位とします。

(6) 申込代金の支払い

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

(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、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

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

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(3) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などにに基づき、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。

(4) 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。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

確定給付企業年金法および確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関などでない場合、解約価額から解約に係る所定の税金が差し引かれます。

税法または確定給付企業年金法および確定拠出年金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。

(6) 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。

(7) 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。

(8) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、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。

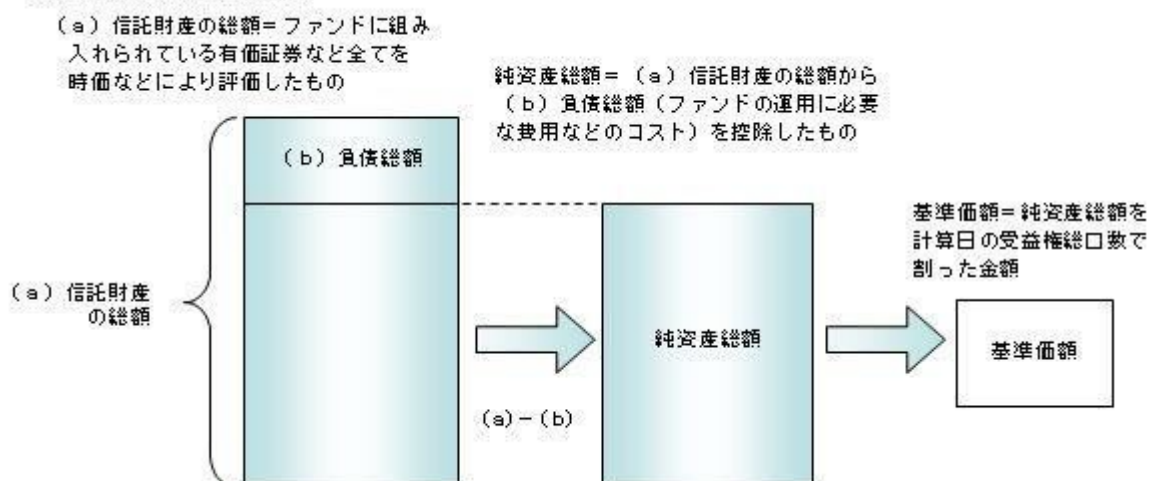
3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

国内上場株式

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

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(2004年11月30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6月1日から翌年5月31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) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
 - ロ) 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
 - ハ) 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。)
 - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

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

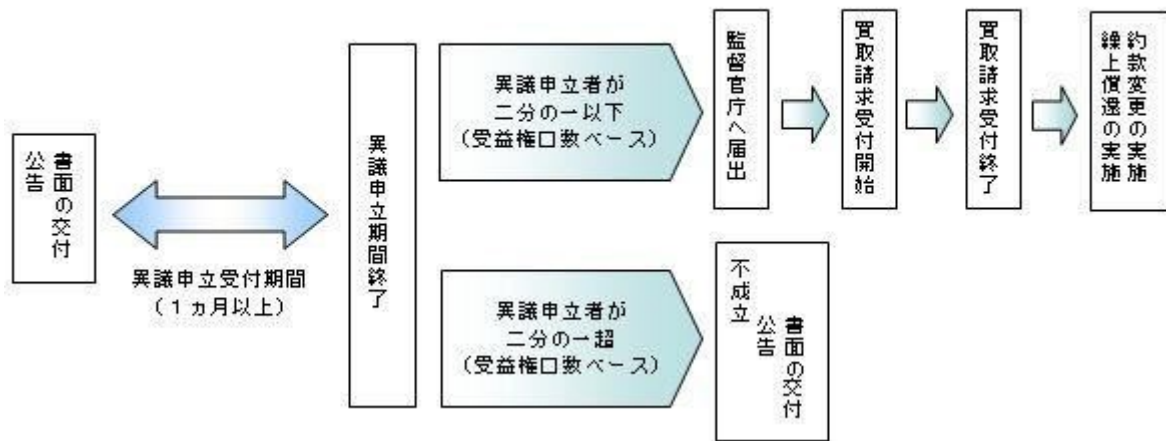
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4)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

- (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17期計算期間（2020年6月2日から2021年5月31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】

【年金インデックスファンド日本株式(TOPIX連動型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第16期 2020年 6月 1日現在	第17期 2021年 5月31日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,400,071,521	4,706,324,590
コール・ローン	876,965,950	957,210,910
株式	57,197,888,200	72,400,851,110
派生商品評価勘定	58,385,400	10,179,200
未収入金	-	64,435,700
未収配当金	546,748,470	626,003,355
その他未収収益	6,456,736	9,902,167
流動資産合計	63,086,516,277	78,774,907,032
資産合計	63,086,516,277	78,774,907,032
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	282,750	5,044,900
前受金	47,320,000	19,605,000
未払金	13,286,700	8,675,900
未払収益分配金	31,461,996	31,818,315
未払解約金	163,145,864	140,236,477
未払受託者報酬	8,402,824	9,415,937
未払委託者報酬	41,401,811	46,909,914
未払利息	1,385	327
受入担保金	4,400,071,521	4,706,324,590
その他未払費用	1,228,701	1,555,106
流動負債合計	4,706,603,552	4,969,586,466
負債合計	4,706,603,552	4,969,586,466
純資産の部		
元本等		
元本	31,461,996,185	31,818,315,240
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	26,917,916,540	41,987,005,326
(分配準備積立金)	7,530,802,756	16,244,494,561
元本等合計	58,379,912,725	73,805,320,566
純資産合計	58,379,912,725	73,805,320,566
負債純資産合計	63,086,516,277	78,774,907,032

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期		第17期	
	自 2019年 6月 1日	至 2020年 6月 1日	自 2020年 6月 2日	至 2021年 5月31日
営業収益				
受取配当金	1,220,745,835		1,407,354,929	
受取利息	1,629		350	
有価証券売買等損益	1,389,420,631		13,058,063,312	
派生商品取引等損益	63,158,470		123,431,550	
その他収益	28,831,921		36,608,605	
営業収益合計	2,702,158,486		14,625,458,746	
営業費用				
支払利息	219,133		98,720	
受託者報酬	16,415,824		17,501,873	
委託者報酬	80,482,157		86,949,537	
その他費用	5,136,728		7,354,062	
営業費用合計	102,253,842		111,904,192	
営業利益又は営業損失（ ）	2,599,904,644		14,513,554,554	
経常利益又は経常損失（ ）	2,599,904,644		14,513,554,554	
当期純利益又は当期純損失（ ）	2,599,904,644		14,513,554,554	
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（ ）	321,413,392		1,622,735,466	
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	17,384,692,783		26,917,916,540	
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,426,518,632		8,581,535,838	
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-		-	
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,426,518,632		8,581,535,838	
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,140,324,131		6,371,447,825	
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,140,324,131		6,371,447,825	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-		-	
分配金	31,461,996		31,818,315	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,917,916,540		41,987,005,326	

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>当ファンドの計算期間は原則として、毎年6月1日から翌年5月31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いたしますので、当計算期間は2020年 6月 2日から2021年 5月31日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		第16期 2020年 6月 1日現在	第17期 2021年 5月31日現在
1.	期首元本額	23,253,184,012円	31,461,996,185円
	期中追加設定元本額	14,798,267,469円	7,669,720,398円
	期中一部解約元本額	6,589,455,296円	7,313,401,343円
2.	受益権の総数	31,461,996,185口	31,818,315,240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	695,879,250円	930,928,700円
4.	有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券は次のとおりであります。 株式	4,172,009,900円	4,499,684,650円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 2019年 6月 1日 至 2020年 6月 1日		第17期 自 2020年 6月 2日 至 2021年 5月31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	1,090,774,131円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	1,313,882,923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	9,002,684,853円
C 信託約款に定める収益調整金	40,340,364,433円	C 信託約款に定める収益調整金	42,588,488,423円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	6,471,490,621円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	5,959,745,100円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	47,902,629,185円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	58,864,801,299円
F 分配対象収益(1万口当たり)	15,225円	F 分配対象収益(1万口当たり)	18,500円
G 分配金額	31,461,996円	G 分配金額	31,818,315円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10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16期 自 2019年 6月 1日 至 2020年 6月 1日	第17期 自 2020年 6月 2日 至 2021年 5月31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16期 2020年 6月 1日現在	第17期 2021年 5月31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）

第16期（2020年 6月 1日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,132,024,379
合計	1,132,024,379

第17期（2021年 5月31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	12,442,951,423
合計	12,442,951,423

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

第16期（2020年 6月 1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	1,153,065,000	-	1,211,210,000	58,145,000
	合計	1,153,065,000	-	1,211,210,000	58,145,000

第17期(2021年5月31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	1,421,915,000	-	1,427,090,000	5,175,000
	合計	1,421,915,000	-	1,427,090,000	5,175,000

(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)

第16期 2020年6月1日現在		第17期 2021年5月31日現在	
1口当たり純資産額	1.8556円	1口当たり純資産額	2.3196円
(1万口当たり純資産額)	(18,556円)	(1万口当たり純資産額)	(23,196円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	1,200	2,896.00	3,475,200	貸付有価証券 800株
日本水産	34,600	507.00	17,542,200	
マルハニチロ	5,800	2,395.00	13,891,000	
雪国まいたけ	3,100	1,723.00	5,341,300	貸付有価証券 1,100株
カネコ種苗	1,100	1,476.00	1,623,600	
サカタのタネ	4,400	3,715.00	16,346,000	貸付有価証券 3,000株
ホクト	3,100	1,933.00	5,992,300	貸付有価証券 2,100株
ホクリヨウ	600	767.00	460,200	
住石ホールディングス	7,800	129.00	1,006,200	貸付有価証券 3,800株
日鉄鉱業	900	6,250.00	5,625,000	
三井松島ホールディングス	1,500	949.00	1,423,500	
I N P E X	137,000	753.00	103,161,000	貸付有価証券 95,900株
石油資源開発	4,900	1,972.00	9,662,800	
K & O エナジーグループ	1,800	1,360.00	2,448,000	
ヒノキヤグループ	900	2,499.00	2,249,100	貸付有価証券 200株
ショーボンドホールディングス	5,300	4,575.00	24,247,500	貸付有価証券 100株
ミライト・ホールディングス	12,900	1,930.00	24,897,000	
タマホーム	2,300	2,104.00	4,839,200	貸付有価証券 1,600株
サンヨーホームズ	500	715.00	357,500	
日本アクア	1,500	538.00	807,000	
ファーストコーポレーション	1,200	751.00	901,200	
ベステラ	700	1,580.00	1,106,000	
Robot Home	6,900	261.00	1,800,900	
キャンディル	700	542.00	379,400	
スペースバリューホールディングス	4,500	733.00	3,298,500	
ダイセキ環境ソリューション	800	957.00	765,600	
第一カッター興業	1,000	1,360.00	1,360,000	
安藤・間	23,900	819.00	19,574,100	
東急建設	10,900	702.00	7,651,800	
コムシスホールディングス	13,200	3,090.00	40,788,000	
ピーアールホールディングス	4,900	504.00	2,469,600	貸付有価証券 600株
高松コンストラクショングループ	2,300	2,048.00	4,710,400	
東建コーポレーション	1,100	9,540.00	10,494,000	

ソネック	400	912.00	364,800	貸付有価証券 200株
ヤマウラ	1,600	906.00	1,449,600	貸付有価証券 1,100株
オリエンタル白石	12,800	279.00	3,571,200	貸付有価証券 300株
大成建設	26,800	3,820.00	102,376,000	
大林組	86,100	922.00	79,384,200	
清水建設	80,500	897.00	72,208,500	
飛島建設	2,400	1,060.00	2,544,000	
長谷工コーポレーション	28,200	1,535.00	43,287,000	貸付有価証券 2,800株
松井建設	3,400	737.00	2,505,800	
銭高組	400	4,380.00	1,752,000	
鹿島建設	63,000	1,515.00	95,445,000	貸付有価証券 300株
不動テトラ	2,200	1,793.00	3,944,600	
大末建設	1,000	991.00	991,000	
鉄建建設	1,800	1,845.00	3,321,000	
西松建設	6,100	3,360.00	20,496,000	貸付有価証券 900株
三井住友建設	20,800	468.00	9,734,400	
大豊建設	1,900	4,070.00	7,733,000	貸付有価証券 1,000株
前田建設工業	21,500	955.00	20,532,500	貸付有価証券 15,000株
佐田建設	1,800	463.00	833,400	
ナカノフドー建設	2,400	402.00	964,800	
奥村組	4,700	2,862.00	13,451,400	
東鉄工業	3,700	2,357.00	8,720,900	貸付有価証券 100株
イチケン	600	1,821.00	1,092,600	
富士ピー・エス	1,300	547.00	711,100	
浅沼組	1,000	4,485.00	4,485,000	
戸田建設	35,700	777.00	27,738,900	貸付有価証券 24,900株
熊谷組	4,000	2,975.00	11,900,000	
北野建設	500	2,375.00	1,187,500	
植木組	800	1,484.00	1,187,200	貸付有価証券 200株
矢作建設工業	3,800	705.00	2,679,000	
ピーエス三菱	2,900	651.00	1,887,900	
日本ハウスホールディングス	5,900	342.00	2,017,800	貸付有価証券 100株
大東建託	9,400	11,520.00	108,288,000	貸付有価証券 6,200株
新日本建設	3,700	853.00	3,156,100	

NIPPON	7,100	2,837.00	20,142,700	
東亜道路工業	500	4,525.00	2,262,500	
前田道路	5,300	2,151.00	11,400,300	貸付有価証券 1,400株
日本道路	800	7,520.00	6,016,000	
東亜建設工業	2,300	2,456.00	5,648,800	貸付有価証券 1,600株
日本国土開発	8,400	564.00	4,737,600	貸付有価証券 100株
若築建設	1,600	1,372.00	2,195,200	
東洋建設	9,700	560.00	5,432,000	
五洋建設	36,500	773.00	28,214,500	
世紀東急工業	4,200	841.00	3,532,200	
福田組	1,000	5,010.00	5,010,000	
住友林業	20,200	2,216.00	44,763,200	
日本基礎技術	2,700	504.00	1,360,800	
バコーポレーション	3,800	390.00	1,482,000	
大和ハウス工業	79,400	3,206.00	254,556,400	
ライト工業	4,900	1,817.00	8,903,300	
積水ハウス	93,300	2,278.00	212,537,400	貸付有価証券 500株
日特建設	2,200	759.00	1,669,800	
北陸電気工事	1,500	1,194.00	1,791,000	
ユアテック	5,000	735.00	3,675,000	
日本リーテック	1,800	1,621.00	2,917,800	貸付有価証券 400株
四電工	400	3,395.00	1,358,000	
中電工	4,000	2,329.00	9,316,000	
関電工	14,000	906.00	12,684,000	
きんでん	17,500	1,841.00	32,217,500	
東京エネシス	2,800	960.00	2,688,000	
トーエネック	900	3,695.00	3,325,500	
住友電設	2,400	2,282.00	5,476,800	
日本電設工業	4,700	1,789.00	8,408,300	
協和エクシオ	13,000	2,690.00	34,970,000	
新日本空調	2,300	2,034.00	4,678,200	貸付有価証券 1,600株
九電工	6,000	3,385.00	20,310,000	
三機工業	6,100	1,384.00	8,442,400	
日揮ホールディングス	28,700	1,044.00	29,962,800	
中外炉工業	900	2,079.00	1,871,100	
ヤマト	2,800	781.00	2,186,800	
太平電業	1,900	2,655.00	5,044,500	
高砂熱学工業	7,800	1,798.00	14,024,400	
三晃金属工業	300	2,396.00	718,800	

朝日工業社	700	2,962.00	2,073,400	
明星工業	5,800	741.00	4,297,800	貸付有価証券 1,600株
大気社	4,200	3,150.00	13,230,000	
ダイダン	1,900	2,665.00	5,063,500	
日比谷総合設備	2,800	1,815.00	5,082,000	
フィル・カンパニー	500	2,973.00	1,486,500	
テスホールディングス	1,600	1,747.00	2,795,200	
東洋エンジニアリング	3,600	683.00	2,458,800	貸付有価証券 2,500株
レイズネクスト	4,600	1,159.00	5,331,400	
ニッポン	8,000	1,555.00	12,440,000	貸付有価証券 2,600株
日清製粉グループ本社	31,100	1,644.00	51,128,400	貸付有価証券 500株
日東富士製粉	200	7,180.00	1,436,000	
昭和産業	2,300	2,974.00	6,840,200	貸付有価証券 100株
鳥越製粉	2,500	807.00	2,017,500	
中部飼料	3,300	1,185.00	3,910,500	
フィード・ワン	3,800	757.00	2,876,600	
東洋精糖	400	1,188.00	475,200	
日本甜菜製糖	1,400	1,616.00	2,262,400	
D M三井製糖ホールディングス	2,200	1,818.00	3,999,600	
塩水港精糖	3,400	225.00	765,000	
日新製糖	1,300	1,713.00	2,226,900	
森永製菓	6,500	3,380.00	21,970,000	
中村屋	700	3,790.00	2,653,000	
江崎グリコ	7,600	4,180.00	31,768,000	
名糖産業	1,200	1,526.00	1,831,200	
井村屋グループ	1,600	2,344.00	3,750,400	
不二家	1,800	2,103.00	3,785,400	
山崎製パン	20,600	1,638.00	33,742,800	貸付有価証券 700株
第一屋製パン	600	951.00	570,600	
モロゾフ	400	5,300.00	2,120,000	
亀田製菓	1,600	4,450.00	7,120,000	
寿スピリッツ	2,700	6,950.00	18,765,000	貸付有価証券 600株
カルビー	12,600	2,525.00	31,815,000	貸付有価証券 1,900株
森永乳業	5,100	5,660.00	28,866,000	
六甲バター	1,800	1,526.00	2,746,800	
ヤクルト本社	18,900	5,910.00	111,699,000	
明治ホールディングス	18,200	6,800.00	123,760,000	貸付有価証券 1,600株

雪印メグミルク	6,600	2,103.00	13,879,800	
プリマハム	3,900	3,005.00	11,719,500	貸付有価証券 100株
日本ハム	10,500	4,375.00	45,937,500	貸付有価証券 400株
林兼産業	1,000	611.00	611,000	
丸大食品	2,800	1,672.00	4,681,600	貸付有価証券 500株
S Foods	2,500	3,215.00	8,037,500	貸付有価証券 100株
柿安本店	1,000	2,487.00	2,487,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	17,700	709.00	12,549,300	
サッポロホールディングス	9,400	2,147.00	20,181,800	貸付有価証券 200株
アサヒグループホールディングス	60,200	5,219.00	314,183,800	
キリンホールディングス	116,800	2,211.50	258,303,200	貸付有価証券 22,700株
宝ホールディングス	20,400	1,450.00	29,580,000	
オエノンホールディングス	7,900	377.00	2,978,300	
養命酒製造	900	1,781.00	1,602,900	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	21,100	1,804.00	38,064,400	貸付有価証券 1,500株
サントリー食品インターナショナル	18,400	4,035.00	74,244,000	
ダイドーグループホールディングス	1,600	4,940.00	7,904,000	貸付有価証券 1,100株
伊藤園	8,400	6,060.00	50,904,000	貸付有価証券 1,700株
キーコーヒー	2,700	2,074.00	5,599,800	貸付有価証券 200株
ユニカフェ	900	998.00	898,200	貸付有価証券 200株
ジャパンフーズ	400	1,210.00	484,000	
日清オイリオグループ	3,400	2,998.00	10,193,200	
不二製油グループ本社	6,700	2,757.00	18,471,900	貸付有価証券 300株
かどや製油	300	4,075.00	1,222,500	
J-オイルミルズ	2,600	1,865.00	4,849,000	貸付有価証券 1,800株
キッコーマン	19,800	7,110.00	140,778,000	貸付有価証券 400株
味の素	65,500	2,516.00	164,798,000	
ブルドックソース	1,200	2,279.00	2,734,800	
キューピー	15,300	2,505.00	38,326,500	
ハウス食品グループ本社	10,300	3,200.00	32,960,000	貸付有価証券 100株
カゴメ	11,300	2,905.00	32,826,500	貸付有価証券 900株
焼津水産化学工業	1,300	970.00	1,261,000	

アリアケジャパン	2,500	6,380.00	15,950,000	
ピエトロ	400	1,665.00	666,000	
エバラ食品工業	600	2,489.00	1,493,400	貸付有価証券 100株
やまみ	200	2,040.00	408,000	貸付有価証券 100株
ニチレイ	13,100	2,813.00	36,850,300	
東洋水産	14,200	4,390.00	62,338,000	貸付有価証券 4,200株
イトアンドホールディングス	1,000	1,863.00	1,863,000	貸付有価証券 700株
大冷	400	1,950.00	780,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,500	768.00	1,152,000	貸付有価証券 900株
日清食品ホールディングス	10,800	7,930.00	85,644,000	貸付有価証券 400株
永谷園ホールディングス	1,400	2,177.00	3,047,800	
一正蒲鉾	1,100	946.00	1,040,600	貸付有価証券 700株
フジッコ	3,000	1,909.00	5,727,000	
ロック・フィールド	3,000	1,570.00	4,710,000	貸付有価証券 1,600株
日本たばこ産業	147,600	2,162.50	319,185,000	貸付有価証券 103,300株
ケンコーマヨネーズ	1,700	1,670.00	2,839,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,800	1,907.00	3,432,600	
なとり	1,600	1,873.00	2,996,800	貸付有価証券 300株
イフジ産業	500	911.00	455,500	貸付有価証券 100株
ピクルスコーポレーション	700	3,105.00	2,173,500	
ファーマフーズ	2,600	3,155.00	8,203,000	貸付有価証券 1,800株
北の達人コーポレーション	9,800	476.00	4,664,800	貸付有価証券 4,200株
ユーグレナ	14,000	825.00	11,550,000	貸付有価証券 6,800株
紀文食品	1,600	1,628.00	2,604,800	
ミヨシ油脂	1,000	1,238.00	1,238,000	
理研ビタミン	2,700	1,440.00	3,888,000	
片倉工業	3,600	1,529.00	5,504,400	貸付有価証券 2,500株
ゲンゼ	2,000	4,365.00	8,730,000	貸付有価証券 300株
東洋紡	10,600	1,352.00	14,331,200	
ユニチカ	8,000	360.00	2,880,000	
富士紡ホールディングス	1,300	4,030.00	5,239,000	
倉敷紡績	2,500	1,821.00	4,552,500	

シキボウ	1,500	931.00	1,396,500	貸付有価証券 100株
日本毛織	8,800	945.00	8,316,000	貸付有価証券 6,100株
ダイトウボウ	5,500	103.00	566,500	貸付有価証券 3,700株
トーア紡コーポレーション	1,200	457.00	548,400	
ガイドーリミテッド	4,200	176.00	739,200	貸付有価証券 100株
帝国繊維	3,000	2,029.00	6,087,000	
帝人	25,300	1,767.00	44,705,100	貸付有価証券 700株
東レ	194,600	710.60	138,282,760	貸付有価証券 7,800株
サカイオーベックス	700	2,958.00	2,070,600	
住江織物	600	1,900.00	1,140,000	
日本フェルト	1,500	451.00	676,500	貸付有価証券 100株
イチカワ	400	1,370.00	548,000	
日東製網	300	1,528.00	458,400	
アツギ	2,400	622.00	1,492,800	貸付有価証券 100株
ダイニック	1,000	785.00	785,000	
セーレン	6,600	2,031.00	13,404,600	貸付有価証券 900株
ソトー	1,000	797.00	797,000	
東海染工	400	1,126.00	450,400	
小松マテーレ	4,600	909.00	4,181,400	
ワコールホールディングス	6,700	2,500.00	16,750,000	
ホギメディカル	3,600	3,295.00	11,862,000	
T S Iホールディングス	8,100	302.00	2,446,200	
マツオカコーポレーション	900	1,739.00	1,565,100	
ワールド	3,600	1,382.00	4,975,200	貸付有価証券 100株
三陽商会	1,600	909.00	1,454,400	貸付有価証券 1,100株
ナイガイ	1,100	326.00	358,600	
オンワードホールディングス	16,300	298.00	4,857,400	貸付有価証券 1,400株
ルックホールディングス	1,000	1,465.00	1,465,000	
ゴールドウイン	4,400	6,050.00	26,620,000	
デサント	4,600	1,903.00	8,753,800	
キング	1,300	509.00	661,700	
ヤマトインターナショナル	2,600	335.00	871,000	
特種東海製紙	1,600	4,330.00	6,928,000	
王子ホールディングス	121,000	649.00	78,529,000	

日本製紙	11,900	1,292.00	15,374,800	貸付有価証券 8,300株
三菱製紙	3,200	359.00	1,148,800	貸付有価証券 300株
北越コーポレーション	19,300	590.00	11,387,000	貸付有価証券 5,200株
中越パルプ工業	1,100	1,198.00	1,317,800	
巴川製紙所	900	796.00	716,400	
大王製紙	13,000	1,687.00	21,931,000	
阿波製紙	900	426.00	383,400	
レンゴー	27,700	918.00	25,428,600	
トーマク	1,600	1,915.00	3,064,000	貸付有価証券 300株
ザ・パックス	2,000	2,745.00	5,490,000	
クラレ	42,300	1,136.00	48,052,800	貸付有価証券 29,600株
旭化成	178,100	1,205.00	214,610,500	
共和レザー	1,400	701.00	981,400	
昭和電工	20,400	3,405.00	69,462,000	貸付有価証券 14,000株
住友化学	211,500	600.00	126,900,000	
住友精化	1,300	3,525.00	4,582,500	
日産化学	14,800	5,670.00	83,916,000	
ラサ工業	900	1,883.00	1,694,700	
クレハ	2,300	6,370.00	14,651,000	
多木化学	1,000	5,450.00	5,450,000	貸付有価証券 500株
テイカ	1,900	1,223.00	2,323,700	
石原産業	4,900	952.00	4,664,800	
片倉コープアグリ	600	1,237.00	742,200	
日本曹達	3,700	3,350.00	12,395,000	
東ソー	41,500	1,913.00	79,389,500	貸付有価証券 1,400株
トクヤマ	8,000	2,294.00	18,352,000	貸付有価証券 1,500株
セントラル硝子	5,100	2,091.00	10,664,100	貸付有価証券 100株
東亜合成	16,400	1,184.00	19,417,600	
大阪ソーダ	2,700	2,464.00	6,652,800	
関東電化工業	6,400	968.00	6,195,200	
デンカ	9,800	4,060.00	39,788,000	
信越化学工業	49,700	18,855.00	937,093,500	貸付有価証券 3,000株
日本カーバイド工業	1,000	1,284.00	1,284,000	
堺化学工業	1,900	1,786.00	3,393,400	
第一稀元素化学工業	2,800	1,523.00	4,264,400	貸付有価証券 1,000株

エア・ウォーター	27,400	1,832.00	50,196,800	
日本酸素ホールディングス	22,100	2,160.00	47,736,000	
日本化学工業	800	2,739.00	2,191,200	
日本パーカラライジング	13,600	1,092.00	14,851,200	
高压ガス工業	4,400	657.00	2,890,800	
四国化成工業	3,700	1,229.00	4,547,300	
戸田工業	600	2,300.00	1,380,000	
ステラ ケミファ	1,500	2,904.00	4,356,000	
保土谷化学工業	800	3,985.00	3,188,000	
日本触媒	4,900	5,550.00	27,195,000	
大日精化工業	2,200	2,302.00	5,064,400	
カネカ	6,900	4,465.00	30,808,500	
三菱瓦斯化学	26,900	2,553.00	68,675,700	
三井化学	23,200	3,670.00	85,144,000	貸付有価証券 1,900株
J S R	27,000	3,225.00	87,075,000	貸付有価証券 5,200株
東京応化工業	4,600	6,780.00	31,188,000	貸付有価証券 700株
大阪有機化学工業	2,500	4,070.00	10,175,000	貸付有価証券 400株
三菱ケミカルホールディングス	179,600	875.60	157,257,760	貸付有価証券 9,700株
K Hネオケム	4,400	2,806.00	12,346,400	貸付有価証券 900株
ダイセル	36,100	871.00	31,443,100	
住友ベークライト	4,200	4,445.00	18,669,000	
積水化学工業	56,800	1,865.00	105,932,000	
日本ゼオン	24,200	1,607.00	38,889,400	
アイカ工業	7,500	3,895.00	29,212,500	
宇部興産	13,600	2,304.00	31,334,400	
積水樹脂	4,400	2,073.00	9,121,200	
タキロンシーアイ	5,900	589.00	3,475,100	
旭有機材	1,500	1,310.00	1,965,000	
ニチバン	1,400	1,730.00	2,422,000	貸付有価証券 600株
リケンテクノス	6,600	566.00	3,735,600	貸付有価証券 200株
大倉工業	1,300	2,283.00	2,967,900	
積水化成成品工業	3,700	581.00	2,149,700	
群栄化学工業	600	2,450.00	1,470,000	
タイガースポリマー	1,500	448.00	672,000	
ミライアル	1,000	1,351.00	1,351,000	
ダイキアクス	1,000	864.00	864,000	
ダイキョーニシカワ	5,800	759.00	4,402,200	貸付有価証券 500株

竹本容器	1,000	973.00	973,000	貸付有価証券 100株
森六ホールディングス	1,500	2,213.00	3,319,500	
恵和	500	3,100.00	1,550,000	
日本化薬	16,600	1,022.00	16,965,200	
カーリットホールディングス	2,700	683.00	1,844,100	
日本精化	1,900	1,423.00	2,703,700	貸付有価証券 100株
扶桑化学工業	2,100	3,930.00	8,253,000	
トリケミカル研究所	2,500	3,435.00	8,587,500	貸付有価証券 600株
A D E K A	12,400	1,934.00	23,981,600	
日油	10,100	5,670.00	57,267,000	
新日本理化	4,200	287.00	1,205,400	貸付有価証券 1,200株
ハリマ化成グループ	2,000	904.00	1,808,000	
花王	65,700	6,695.00	439,861,500	
第一工業製薬	1,000	3,590.00	3,590,000	
石原ケミカル	700	2,223.00	1,556,100	
日華化学	900	1,199.00	1,079,100	
ニイタカ	600	2,650.00	1,590,000	貸付有価証券 400株
三洋化成工業	1,600	5,560.00	8,896,000	
有機合成薬品工業	2,400	297.00	712,800	貸付有価証券 100株
大日本塗料	3,000	838.00	2,514,000	
日本ペイントホールディングス	110,900	1,584.00	175,665,600	貸付有価証券 9,300株
関西ペイント	30,200	2,955.00	89,241,000	貸付有価証券 100株
中国塗料	6,500	858.00	5,577,000	
日本特殊塗料	2,000	1,020.00	2,040,000	
藤倉化成	3,600	527.00	1,897,200	貸付有価証券 300株
太陽ホールディングス	2,000	5,010.00	10,020,000	
D I C	11,300	2,795.00	31,583,500	貸付有価証券 7,900株
サカタインクス	5,900	1,019.00	6,012,100	
東洋インキ S C ホールディングス	5,700	2,029.00	11,565,300	貸付有価証券 3,900株
T & K T O K A	1,900	819.00	1,556,100	
富士フイルムホールディングス	48,200	7,626.00	367,573,200	
資生堂	54,500	7,929.00	432,130,500	
ライオン	35,700	1,917.00	68,436,900	貸付有価証券 3,500株
高砂香料工業	1,700	2,697.00	4,584,900	
マンダム	5,800	1,921.00	11,141,800	

ミルボン	3,700	6,230.00	23,051,000	
ファンケル	10,000	3,450.00	34,500,000	
コーセー	5,200	17,170.00	89,284,000	貸付有価証券 1,000株
コタ	1,700	1,450.00	2,465,000	貸付有価証券 1,100株
シーボン	400	1,947.00	778,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	11,700	2,848.00	33,321,600	貸付有価証券 500株
ノエビアホールディングス	2,300	5,050.00	11,615,000	
アジュバンコスメジャパン	600	1,020.00	612,000	
新日本製薬	700	2,057.00	1,439,900	貸付有価証券 300株
エステー	1,800	1,727.00	3,108,600	
アグロ カネショウ	1,000	1,439.00	1,439,000	貸付有価証券 100株
コニシ	4,500	1,531.00	6,889,500	
長谷川香料	4,700	2,107.00	9,902,900	貸付有価証券 300株
星光PMC	1,600	779.00	1,246,400	
小林製薬	7,700	9,720.00	74,844,000	
荒川化学工業	2,300	1,189.00	2,734,700	
メック	2,000	2,829.00	5,658,000	貸付有価証券 1,100株
日本高純度化学	800	2,869.00	2,295,200	
タカラバイオ	7,200	2,987.00	21,506,400	
JCU	3,100	3,570.00	11,067,000	
新田ゼラチン	1,800	644.00	1,159,200	
OATアグリオ	600	1,469.00	881,400	
デクセリアルズ	7,700	2,232.00	17,186,400	
アース製薬	2,100	6,300.00	13,230,000	貸付有価証券 1,400株
北興化学工業	2,700	915.00	2,470,500	
大成ラミック	800	2,746.00	2,196,800	
クミアイ化学工業	11,400	829.00	9,450,600	
日本農薬	4,800	522.00	2,505,600	貸付有価証券 100株
アキレス	1,900	1,388.00	2,637,200	
有沢製作所	3,800	911.00	3,461,800	
日東電工	16,600	8,490.00	140,934,000	
レック	3,400	1,102.00	3,746,800	
三光合成	3,300	412.00	1,359,600	貸付有価証券 100株
きもと	5,500	256.00	1,408,000	貸付有価証券 200株
藤森工業	2,500	4,125.00	10,312,500	

前澤化成工業	1,800	1,234.00	2,221,200	貸付有価証券 1,200株
未来工業	1,000	1,729.00	1,729,000	
ウェーブロックホールディングス	1,100	709.00	779,900	貸付有価証券 700株
J S P	1,600	1,665.00	2,664,000	
エフピコ	5,000	4,215.00	21,075,000	貸付有価証券 200株
天馬	2,100	2,411.00	5,063,100	
信越ポリマー	4,300	1,058.00	4,549,400	
東リ	6,900	248.00	1,711,200	
ニフコ	10,100	3,735.00	37,723,500	
バルカー	2,300	2,075.00	4,772,500	
ユニ・チャーム	58,200	4,323.00	251,598,600	貸付有価証券 14,900株
ショーエイコーポレーション	400	964.00	385,600	貸付有価証券 200株
協和キリン	27,600	3,310.00	91,356,000	貸付有価証券 3,300株
武田薬品工業	228,300	3,719.00	849,047,700	代用有価証券 21,400株 貸付有価証券 1,200株
アステラス製薬	237,800	1,797.50	427,445,500	
大日本住友製薬	20,400	2,086.00	42,554,400	貸付有価証券 300株
塩野義製薬	34,500	5,557.00	191,716,500	
わかもと製薬	3,700	326.00	1,206,200	貸付有価証券 2,500株
日本新薬	7,800	7,840.00	61,152,000	
ピオフェルミン製薬	400	3,085.00	1,234,000	
中外製薬	85,800	4,198.00	360,188,400	
科研製薬	4,700	4,530.00	21,291,000	貸付有価証券 100株
エーザイ	30,300	7,358.00	222,947,400	
ロート製薬	13,100	2,700.00	35,370,000	
小野薬品工業	63,000	2,477.00	156,051,000	
久光製薬	8,000	6,000.00	48,000,000	
持田製薬	3,800	3,570.00	13,566,000	
参天製薬	47,700	1,463.00	69,785,100	
扶桑薬品工業	900	2,204.00	1,983,600	
日本ケミファ	400	2,327.00	930,800	
ツムラ	9,200	3,450.00	31,740,000	貸付有価証券 300株
日医工	7,800	873.00	6,809,400	貸付有価証券 2,000株
キッセイ薬品工業	4,900	2,117.00	10,373,300	
生化学工業	4,900	1,152.00	5,644,800	

栄研化学	4,800	2,144.00	10,291,200	
日水製薬	1,100	961.00	1,057,100	
鳥居薬品	1,800	2,431.00	4,375,800	
JCRファーマ	7,700	3,325.00	25,602,500	貸付有価証券 800株
東和薬品	4,000	2,369.00	9,476,000	
富士製薬工業	1,700	1,135.00	1,929,500	
ゼリア新薬工業	5,000	2,092.00	10,460,000	貸付有価証券 400株
第一三共	215,600	2,530.00	545,468,000	貸付有価証券 1,600株
キョーリン製薬ホールディングス	6,100	1,709.00	10,424,900	
大幸薬品	3,500	1,053.00	3,685,500	貸付有価証券 2,400株
ダイト	1,700	3,280.00	5,576,000	
大塚ホールディングス	57,000	4,516.00	257,412,000	貸付有価証券 4,000株
大正製薬ホールディングス	6,500	6,220.00	40,430,000	貸付有価証券 1,100株
ペプチドリーム	14,100	5,130.00	72,333,000	貸付有価証券 700株
あすか製薬ホールディングス	3,200	1,050.00	3,360,000	
サワイグループホールディングス	6,000	4,780.00	28,680,000	
日本コークス工業	23,000	106.00	2,438,000	貸付有価証券 500株
ニチレキ	3,200	1,336.00	4,275,200	
ユシロ化学工業	1,600	1,164.00	1,862,400	
ビーピー・カストロール	900	1,395.00	1,255,500	
富士石油	7,000	270.00	1,890,000	
MORESCO	1,000	1,090.00	1,090,000	
出光興産	30,400	2,585.00	78,584,000	貸付有価証券 4,200株
ENEOSホールディングス	412,800	452.50	186,792,000	
コスモエネルギーホールディングス	8,600	2,281.00	19,616,600	
横浜ゴム	15,900	2,206.00	35,075,400	
TOYO TIRE	14,400	2,199.00	31,665,600	貸付有価証券 3,100株
ブリヂストン	73,000	4,806.00	350,838,000	
住友ゴム工業	24,700	1,416.00	34,975,200	
藤倉コンポジット	2,500	498.00	1,245,000	
オカモト	1,700	4,075.00	6,927,500	
フコク	1,200	924.00	1,108,800	
ニッタ	2,800	2,582.00	7,229,600	
住友理工	5,300	670.00	3,551,000	
三ツ星ベルト	3,300	1,754.00	5,788,200	
バンドー化学	4,900	831.00	4,071,900	

日東紡績	4,100	3,450.00	14,145,000	
A G C	25,200	4,780.00	120,456,000	
日本板硝子	13,900	607.00	8,437,300	
石塚硝子	500	1,943.00	971,500	
日本山村硝子	1,200	933.00	1,119,600	
日本電気硝子	10,200	2,622.00	26,744,400	
オハラ	1,100	1,563.00	1,719,300	貸付有価証券 700株
住友大阪セメント	4,900	3,030.00	14,847,000	貸付有価証券 300株
太平洋セメント	16,200	2,521.00	40,840,200	貸付有価証券 1,200株
日本ヒューム	2,500	730.00	1,825,000	
日本コンクリート工業	5,900	340.00	2,006,000	貸付有価証券 200株
三谷セキサン	1,300	3,975.00	5,167,500	貸付有価証券 100株
アジアパイルホールディングス	4,200	489.00	2,053,800	
東海カーボン	26,800	1,614.00	43,255,200	貸付有価証券 800株
日本カーボン	1,500	4,300.00	6,450,000	貸付有価証券 100株
東洋炭素	1,600	2,443.00	3,908,800	
ノリタケカンパニーリミテド	1,500	4,185.00	6,277,500	
T O T O	19,600	5,900.00	115,640,000	貸付有価証券 200株
日本碍子	30,200	1,918.00	57,923,600	貸付有価証券 200株
日本特殊陶業	20,900	1,724.00	36,031,600	
ダントーホールディングス	2,300	299.00	687,700	貸付有価証券 1,600株
M A R U W A	900	10,760.00	9,684,000	貸付有価証券 200株
品川リフラクトリーズ	600	3,630.00	2,178,000	
黒崎播磨	500	4,475.00	2,237,500	
ヨータイ	2,000	1,125.00	2,250,000	
イソライト工業	1,300	603.00	783,900	
東京窯業	3,400	317.00	1,077,800	貸付有価証券 100株
ニッカトー	1,200	694.00	832,800	
フジミインコーポレーテッド	2,200	5,020.00	11,044,000	
クニミネ工業	1,100	1,168.00	1,284,800	
エーアンドエーマテリアル	500	1,020.00	510,000	
ニチアス	6,900	2,723.00	18,788,700	
ニチハ	3,800	2,903.00	11,031,400	
日本製鉄	129,500	2,055.00	266,122,500	

神戸製鋼所	49,600	742.00	36,803,200	貸付有価証券 1,000株
中山製鋼所	3,700	414.00	1,531,800	
合同製鐵	1,500	1,676.00	2,514,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	78,500	1,458.00	114,453,000	貸付有価証券 8,600株
東京製鐵	10,600	1,117.00	11,840,200	貸付有価証券 3,300株
共英製鋼	3,200	1,417.00	4,534,400	貸付有価証券 1,200株
大和工業	5,800	3,580.00	20,764,000	
東京鐵鋼	1,100	1,560.00	1,716,000	貸付有価証券 700株
大阪製鐵	1,500	1,129.00	1,693,500	
淀川製鋼所	3,600	2,315.00	8,334,000	貸付有価証券 200株
丸一鋼管	8,800	2,762.00	24,305,600	
モリ工業	800	2,408.00	1,926,400	
大同特殊鋼	4,400	5,410.00	23,804,000	貸付有価証券 100株
日本高周波鋼業	1,000	413.00	413,000	
日本冶金工業	2,200	2,257.00	4,965,400	貸付有価証券 100株
山陽特殊製鋼	3,300	1,610.00	5,313,000	
愛知製鋼	1,500	3,090.00	4,635,000	
日立金属	25,600	2,121.00	54,297,600	貸付有価証券 3,000株
日本金属	700	977.00	683,900	
大太平洋金属	1,900	1,942.00	3,689,800	貸付有価証券 1,300株
新日本電工	17,500	318.00	5,565,000	貸付有価証券 6,000株
栗本鐵工所	1,200	1,686.00	2,023,200	
虹技	400	1,218.00	487,200	
日本鑄鉄管	300	1,363.00	408,900	
三菱製鋼	2,100	871.00	1,829,100	
日亜鋼業	3,800	296.00	1,124,800	
日本精線	400	4,375.00	1,750,000	
エンビプロ・ホールディングス	1,200	1,127.00	1,352,400	貸付有価証券 800株
シンニッタン	4,300	249.00	1,070,700	貸付有価証券 100株
新家工業	700	1,619.00	1,133,300	
大紀アルミニウム工業所	4,200	1,198.00	5,031,600	
日本軽金属ホールディングス	7,400	1,874.00	13,867,600	
三井金属鉱業	7,300	3,235.00	23,615,500	
東邦亜鉛	1,500	2,029.00	3,043,500	貸付有価証券 300株

三菱マテリアル	17,900	2,320.00	41,528,000	
住友金属鉱山	34,700	4,908.00	170,307,600	貸付有価証券 300株
DOWAホールディングス	6,900	4,535.00	31,291,500	
古河機械金属	4,500	1,257.00	5,656,500	
エス・サイエンス	13,500	39.00	526,500	貸付有価証券 5,300株
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	830.00	2,324,000	貸付有価証券 1,900株
東邦チタニウム	4,900	947.00	4,640,300	貸付有価証券 1,800株
UACJ	4,100	2,334.00	9,569,400	
CKサンエツ	600	3,610.00	2,166,000	
古河電気工業	8,400	2,913.00	24,469,200	
住友電気工業	94,700	1,676.50	158,764,550	貸付有価証券 3,100株
フジクラ	32,700	468.00	15,303,600	
昭和電線ホールディングス	2,700	1,696.00	4,579,200	
東京特殊電線	400	2,511.00	1,004,400	
タツタ電線	4,700	570.00	2,679,000	
カナレ電気	500	1,814.00	907,000	貸付有価証券 300株
平河ヒューテック	1,500	1,218.00	1,827,000	貸付有価証券 500株
リョービ	3,300	1,586.00	5,233,800	
アーレスティ	3,500	423.00	1,480,500	貸付有価証券 100株
アサヒホールディングス	10,200	2,389.00	24,367,800	
稲葉製作所	1,500	1,480.00	2,220,000	貸付有価証券 1,000株
宮地エンジニアリンググループ	900	2,168.00	1,951,200	
トーカロ	7,000	1,403.00	9,821,000	
アルファC o	1,000	1,118.00	1,118,000	
SUMCO	34,600	2,541.00	87,918,600	
川田テクノロジーズ	600	3,850.00	2,310,000	
RS Technologies	900	5,330.00	4,797,000	
ジェイテックコーポレーション	300	3,050.00	915,000	
信和	1,600	769.00	1,230,400	
東洋製罐グループホールディングス	17,300	1,500.00	25,950,000	
ホッカンホールディングス	1,400	1,403.00	1,964,200	貸付有価証券 900株
コロナ	1,500	931.00	1,396,500	
横河ブリッジホールディングス	4,700	2,000.00	9,400,000	
駒井ハルテック	500	1,724.00	862,000	
高田機工	200	2,680.00	536,000	貸付有価証券 100株

三和ホールディングス	25,600	1,326.00	33,945,600	
文化シャッター	8,000	1,085.00	8,680,000	貸付有価証券 4,800株
三協立山	3,500	787.00	2,754,500	貸付有価証券 700株
アルインコ	1,800	996.00	1,792,800	
東洋シャッター	700	664.00	464,800	
LIXIL	37,400	2,877.00	107,599,800	貸付有価証券 4,300株
日本ファイルコン	2,000	498.00	996,000	貸付有価証券 500株
ノーリツ	5,600	1,913.00	10,712,800	
長府製作所	2,800	2,025.00	5,670,000	
リンナイ	5,300	10,660.00	56,498,000	
ダイニチ工業	1,400	797.00	1,115,800	
日東精工	3,500	543.00	1,900,500	
三洋工業	400	1,873.00	749,200	
岡部	5,600	661.00	3,701,600	
ジーテクト	3,300	1,500.00	4,950,000	
東プレ	5,100	1,642.00	8,374,200	
高周波熱錬	5,200	555.00	2,886,000	
東京製綱	1,900	1,208.00	2,295,200	
サンコール	2,100	455.00	955,500	
モリテック スチール	2,200	514.00	1,130,800	貸付有価証券 1,500株
パイオラックス	4,000	1,457.00	5,828,000	
エイチワン	2,700	772.00	2,084,400	
日本発條	27,100	876.00	23,739,600	
中央発條	1,300	1,206.00	1,567,800	
アドバネクス	400	1,344.00	537,600	
立川ブラインド工業	1,200	1,314.00	1,576,800	貸付有価証券 800株
三益半導体工業	2,100	2,562.00	5,380,200	
日本ドライケミカル	700	1,705.00	1,193,500	
日本製鋼所	8,200	2,842.00	23,304,400	
三浦工業	11,700	5,030.00	58,851,000	
タクマ	9,200	1,860.00	17,112,000	
ツガミ	5,600	1,674.00	9,374,400	貸付有価証券 900株
オークマ	3,200	5,660.00	18,112,000	貸付有価証券 100株
芝浦機械	2,800	2,499.00	6,997,200	
アマダ	39,700	1,164.00	46,210,800	貸付有価証券 4,300株
アイダエンジニアリング	7,100	870.00	6,177,000	
滝澤鉄工所	800	1,124.00	899,200	

F U J I	10,800	2,718.00	29,354,400	貸付有価証券 200株
牧野フライス製作所	3,200	4,340.00	13,888,000	
オーエスジー	13,400	1,751.00	23,463,400	
ダイジェット工業	300	1,336.00	400,800	
旭ダイヤモンド工業	7,300	515.00	3,759,500	
D M G 森精機	17,200	1,890.00	32,508,000	貸付有価証券 12,000株
ソディック	6,500	1,123.00	7,299,500	
ディスコ	3,700	33,600.00	124,320,000	貸付有価証券 100株
日東工器	1,300	1,869.00	2,429,700	
日進工具	2,200	1,451.00	3,192,200	
パンチ工業	2,600	575.00	1,495,000	貸付有価証券 100株
富士ダイス	1,100	654.00	719,400	
豊和工業	1,600	809.00	1,294,400	
O K K	1,400	387.00	541,800	
石川製作所	700	1,705.00	1,193,500	貸付有価証券 400株
東洋機械金属	1,900	523.00	993,700	
津田駒工業	600	884.00	530,400	
エンシュウ	700	857.00	599,900	
島精機製作所	4,000	2,118.00	8,472,000	貸付有価証券 1,300株
オプトラン	3,400	2,709.00	9,210,600	
N C ホールディングス	800	949.00	759,200	
イワキポンプ	1,700	945.00	1,606,500	
フリュー	2,600	1,135.00	2,951,000	
ヤマシンフィルタ	5,400	802.00	4,330,800	貸付有価証券 3,700株
日阪製作所	3,300	808.00	2,666,400	
やまびこ	5,300	1,219.00	6,460,700	貸付有価証券 100株
平田機工	1,300	6,470.00	8,411,000	
ペガサスミシン製造	2,800	490.00	1,372,000	貸付有価証券 1,900株
マルマエ	1,100	1,904.00	2,094,400	
タツモ	1,200	1,630.00	1,956,000	貸付有価証券 200株
ナブテスコ	16,000	5,020.00	80,320,000	貸付有価証券 11,200株
三井海洋開発	2,900	2,124.00	6,159,600	
レオン自動機	2,700	1,273.00	3,437,100	
S M C	8,000	65,520.00	524,160,000	
ホソカワミクロン	1,000	6,030.00	6,030,000	

ユニオンツール	1,000	3,725.00	3,725,000	貸付有価証券 700株
オイレス工業	3,800	1,546.00	5,874,800	
日精エー・エス・ビー機械	900	5,290.00	4,761,000	
サトーホールディングス	3,600	2,561.00	9,219,600	
技研製作所	2,400	4,470.00	10,728,000	
日本エアーテック	900	1,294.00	1,164,600	貸付有価証券 600株
カワタ	900	894.00	804,600	
日精樹脂工業	2,100	1,237.00	2,597,700	貸付有価証券 1,000株
オカダアイヨン	900	1,303.00	1,172,700	
ワイエイシイホールディングス	1,300	1,014.00	1,318,200	貸付有価証券 900株
小松製作所	124,300	3,203.00	398,132,900	貸付有価証券 4,400株
住友重機械工業	15,700	3,385.00	53,144,500	
日立建機	12,800	3,630.00	46,464,000	
日工	4,100	702.00	2,878,200	
巴工業	1,100	2,108.00	2,318,800	
井関農機	2,800	1,363.00	3,816,400	
T O W A	2,600	2,037.00	5,296,200	貸付有価証券 600株
丸山製作所	600	1,807.00	1,084,200	
北川鉄工所	1,300	1,678.00	2,181,400	
ローツェ	1,200	9,900.00	11,880,000	
タカキタ	1,000	637.00	637,000	
クボタ	144,100	2,488.00	358,520,800	貸付有価証券 94,400株
荏原実業	700	6,370.00	4,459,000	
三菱化工機	900	2,726.00	2,453,400	貸付有価証券 400株
月島機械	5,100	1,159.00	5,910,900	
帝国電機製作所	1,900	1,254.00	2,382,600	
東京機械製作所	1,500	630.00	945,000	貸付有価証券 400株
新東工業	6,500	777.00	5,050,500	
澁谷工業	2,400	3,295.00	7,908,000	
アイチ コーポレーション	4,800	871.00	4,180,800	
小森コーポレーション	6,900	793.00	5,471,700	
鶴見製作所	2,100	1,728.00	3,628,800	
住友精密工業	400	2,456.00	982,400	
日本ギア工業	1,200	327.00	392,400	
酒井重工業	500	2,046.00	1,023,000	
荏原製作所	11,400	5,400.00	61,560,000	貸付有価証券 100株

石井鐵工所	400	2,970.00	1,188,000	
西島製作所	2,800	885.00	2,478,000	
北越工業	2,800	1,131.00	3,166,800	
ダイキン工業	35,000	21,605.00	756,175,000	貸付有価証券 1,700株
オルガノ	900	6,400.00	5,760,000	
トーヨーカネツ	1,000	2,372.00	2,372,000	
栗田工業	14,800	5,030.00	74,444,000	
楢本チエイン	3,900	3,075.00	11,992,500	
大同工業	1,400	1,093.00	1,530,200	
木村化工機	2,300	917.00	2,109,100	
アネスト岩田	4,600	1,010.00	4,646,000	
ダイフク	15,100	9,200.00	138,920,000	貸付有価証券 1,900株
サムコ	700	3,180.00	2,226,000	貸付有価証券 400株
加藤製作所	1,500	989.00	1,483,500	
油研工業	500	1,734.00	867,000	
タダノ	13,200	1,058.00	13,965,600	貸付有価証券 300株
フジテック	9,500	2,408.00	22,876,000	
C K D	6,400	2,606.00	16,678,400	
キトー	2,400	1,695.00	4,068,000	
平和	7,700	1,821.00	14,021,700	
理想科学工業	2,000	1,729.00	3,458,000	
SANKYO	6,500	2,668.00	17,342,000	貸付有価証券 4,500株
日本金銭機械	3,100	559.00	1,732,900	
マースグループホールディングス	1,700	1,601.00	2,721,700	
フクシマガリレイ	1,900	4,220.00	8,018,000	
オーイズミ	1,400	387.00	541,800	
ダイコク電機	1,300	892.00	1,159,600	
竹内製作所	4,600	2,898.00	13,330,800	
アマノ	7,200	2,865.00	20,628,000	
JUKI	4,000	770.00	3,080,000	
サンデンホールディングス	3,900	366.00	1,427,400	貸付有価証券 100株
蛇の目ミシン工業	2,500	815.00	2,037,500	貸付有価証券 500株
マックス	3,700	1,677.00	6,204,900	
グローリー	7,000	2,248.00	15,736,000	
新晃工業	2,500	1,904.00	4,760,000	貸付有価証券 100株
大和冷機工業	4,400	1,054.00	4,637,600	
セガサミーホールディングス	25,000	1,393.00	34,825,000	

日本ピストンリング	1,000	1,184.00	1,184,000	
リケン	1,300	2,450.00	3,185,000	
T P R	3,700	1,456.00	5,387,200	
ツバキ・ナカシマ	5,300	1,758.00	9,317,400	
ホシザキ	8,600	9,730.00	83,678,000	
大豊工業	2,200	892.00	1,962,400	
日本精工	56,300	1,039.00	58,495,700	
N T N	63,500	307.00	19,494,500	貸付有価証券 3,000株
ジェイテクト	26,300	1,141.00	30,008,300	
不二越	2,600	4,165.00	10,829,000	貸付有価証券 200株
日本トムソン	7,500	612.00	4,590,000	貸付有価証券 200株
T H K	17,100	3,560.00	60,876,000	貸付有価証券 400株
ユーシン精機	1,800	826.00	1,486,800	
前澤給装工業	1,900	1,095.00	2,080,500	
イーグル工業	3,500	1,121.00	3,923,500	
前澤工業	1,900	601.00	1,141,900	貸付有価証券 400株
日本ピラー工業	2,800	1,934.00	5,415,200	
キッツ	8,500	758.00	6,443,000	
マキタ	35,800	5,280.00	189,024,000	貸付有価証券 1,400株
日立造船	21,700	717.00	15,558,900	
三菱重工業	43,100	3,315.00	142,876,500	
I H I	18,500	2,662.00	49,247,000	
スター精密	4,200	1,803.00	7,572,600	貸付有価証券 2,900株
日清紡ホールディングス	16,800	904.00	15,187,200	貸付有価証券 100株
イビデン	13,200	5,080.00	67,056,000	貸付有価証券 1,100株
コニカミノルタ	55,700	598.00	33,308,600	貸付有価証券 17,000株
ブラザー工業	33,500	2,287.00	76,614,500	貸付有価証券 1,700株
ミネベアミツミ	47,300	2,980.00	140,954,000	
日立製作所	131,900	5,736.00	756,578,400	
東芝	54,300	4,595.00	249,508,500	
三菱電機	274,300	1,692.00	464,115,600	
富士電機	16,500	5,130.00	84,645,000	貸付有価証券 2,700株
東洋電機製造	1,000	1,176.00	1,176,000	
安川電機	29,500	5,310.00	156,645,000	
シンフォニアテクノロジー	3,500	1,278.00	4,473,000	

明電舎	4,700	2,254.00	10,593,800	
オリジン	800	1,332.00	1,065,600	
山洋電気	1,300	7,640.00	9,932,000	
デンヨー	2,300	2,026.00	4,659,800	
東芝テック	2,900	4,235.00	12,281,500	
芝浦メカトロニクス	500	6,480.00	3,240,000	
マブチモーター	7,600	4,315.00	32,794,000	
日本電産	66,000	12,530.00	826,980,000	貸付有価証券 1,800株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,400	716.00	1,002,400	貸付有価証券 800株
トレックス・セミコンダクター	1,500	2,209.00	3,313,500	
東光高岳	1,400	1,426.00	1,996,400	貸付有価証券 100株
ダイヘン	3,000	4,975.00	14,925,000	
ヤーマン	4,500	1,492.00	6,714,000	貸付有価証券 3,000株
JVCケンウッド	23,700	232.00	5,498,400	
ミマキエンジニアリング	2,600	679.00	1,765,400	
I - P E X	1,300	2,430.00	3,159,000	貸付有価証券 100株
日新電機	6,400	1,289.00	8,249,600	
大崎電気工業	5,600	598.00	3,348,800	貸付有価証券 100株
オムロン	22,800	8,620.00	196,536,000	
日東工業	4,000	1,774.00	7,096,000	
I D E C	3,700	2,044.00	7,562,800	
正興電機製作所	800	1,658.00	1,326,400	貸付有価証券 400株
不二電機工業	500	1,285.00	642,500	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	9,900	3,095.00	30,640,500	
サクサホールディングス	600	1,395.00	837,000	
メルコホールディングス	1,000	4,730.00	4,730,000	
テクノメディカ	600	1,612.00	967,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	800	2,960.00	2,368,000	貸付有価証券 500株
日本電気	34,900	5,110.00	178,339,000	
富士通	24,700	17,785.00	439,289,500	貸付有価証券 300株
沖電気工業	11,100	978.00	10,855,800	
岩崎通信機	1,300	939.00	1,220,700	
電気興業	1,400	2,308.00	3,231,200	貸付有価証券 100株
サンケン電気	3,200	5,340.00	17,088,000	貸付有価証券 200株
ナカヨ	500	1,491.00	745,500	

アイホン	1,500	2,062.00	3,093,000	
ルネサスエレクトロニクス	118,100	1,114.00	131,563,400	貸付有価証券 28,300株
セイコーエプソン	34,000	1,935.00	65,790,000	貸付有価証券 200株
ワコム	19,800	666.00	13,186,800	貸付有価証券 13,800株
アルバック	5,100	5,150.00	26,265,000	
アクセル	1,200	902.00	1,082,400	
E I Z O	2,300	4,710.00	10,833,000	
日本信号	6,400	940.00	6,016,000	
京三製作所	5,900	425.00	2,507,500	貸付有価証券 400株
能美防災	3,600	2,053.00	7,390,800	
ホーチキ	2,000	1,213.00	2,426,000	
星和電機	1,400	555.00	777,000	
エレコム	6,300	2,088.00	13,154,400	
パナソニック	292,600	1,247.00	364,872,200	
シャープ	36,500	1,998.00	72,927,000	貸付有価証券 25,500株
アンリツ	16,500	2,091.00	34,501,500	貸付有価証券 11,300株
富士通ゼネラル	8,400	2,691.00	22,604,400	
ソニーグループ	171,800	10,785.00	1,852,863,000	代用有価証券 13,000株 貸付有価証券 5,700株
T D K	13,200	13,940.00	184,008,000	貸付有価証券 100株
帝国通信工業	1,100	1,166.00	1,282,600	
タムラ製作所	9,900	558.00	5,524,200	
アルプスアルパイン	22,400	1,177.00	26,364,800	
池上通信機	900	820.00	738,000	
日本電波工業	2,600	917.00	2,384,200	
鈴木	1,200	1,066.00	1,279,200	貸付有価証券 300株
日本トリム	600	3,560.00	2,136,000	
ローランド ディー . ジー .	1,600	2,105.00	3,368,000	
フォスター電機	2,900	1,026.00	2,975,400	
S M K	700	2,593.00	1,815,100	
ヨコオ	2,100	2,301.00	4,832,100	
ホシデン	7,500	1,011.00	7,582,500	
ヒロセ電機	4,200	15,590.00	65,478,000	
日本航空電子工業	6,300	1,933.00	12,177,900	貸付有価証券 200株
T O A	3,200	880.00	2,816,000	
マクセルホールディングス	5,500	1,241.00	6,825,500	

古野電気	3,500	1,038.00	3,633,000	貸付有価証券 500株
ユニデンホールディングス	700	2,430.00	1,701,000	
スミダコーポレーション	2,400	1,032.00	2,476,800	
アイコム	1,200	2,420.00	2,904,000	
リオン	1,200	2,539.00	3,046,800	
本多通信工業	2,500	480.00	1,200,000	貸付有価証券 800株
横河電機	27,500	1,733.00	47,657,500	貸付有価証券 100株
新電元工業	1,000	3,740.00	3,740,000	
アズビル	18,600	4,385.00	81,561,000	
東亜ディーケーケー	1,300	821.00	1,067,300	
日本光電工業	11,300	3,100.00	35,030,000	
チノー	900	1,464.00	1,317,600	
共和電業	2,800	404.00	1,131,200	
日本電子材料	1,100	2,050.00	2,255,000	貸付有価証券 700株
堀場製作所	5,400	7,040.00	38,016,000	貸付有価証券 300株
アドバンテスト	20,400	9,890.00	201,756,000	貸付有価証券 400株
小野測器	1,200	542.00	650,400	
エスベック	2,400	2,013.00	4,831,200	
キーエンス	26,900	53,870.00	1,449,103,000	
日置電機	1,300	5,120.00	6,656,000	
シスメックス	21,400	11,160.00	238,824,000	
日本マイクロニクス	4,800	1,545.00	7,416,000	
メガチップス	2,700	3,280.00	8,856,000	
O B A R A G R O U P	1,200	3,810.00	4,572,000	貸付有価証券 700株
澤藤電機	400	2,234.00	893,600	貸付有価証券 200株
原田工業	1,300	890.00	1,157,000	
コーセル	3,400	1,083.00	3,682,200	
イリソ電子工業	2,300	4,625.00	10,637,500	貸付有価証券 1,400株
オプテックスグループ	4,500	1,927.00	8,671,500	
千代田インテグレ	1,200	1,831.00	2,197,200	
アイ・オー・データ機器	900	1,091.00	981,900	
レーザーテック	12,000	20,600.00	247,200,000	貸付有価証券 3,400株
スタンレー電気	19,200	3,260.00	62,592,000	
岩崎電気	1,000	1,727.00	1,727,000	
ウシオ電機	14,000	1,579.00	22,106,000	
岡谷電機産業	2,400	354.00	849,600	

ヘリオス テクノ ホールディング	2,600	344.00	894,400	
エノモト	800	1,750.00	1,400,000	
日本セラミック	2,800	2,806.00	7,856,800	
遠藤照明	1,300	779.00	1,012,700	
古河電池	2,000	1,562.00	3,124,000	貸付有価証券 1,400株
双信電機	1,500	607.00	910,500	貸付有価証券 600株
山一電機	1,800	1,670.00	3,006,000	
図研	1,800	3,150.00	5,670,000	貸付有価証券 100株
日本電子	5,000	5,620.00	28,100,000	貸付有価証券 1,200株
カシオ計算機	22,100	1,905.00	42,100,500	貸付有価証券 1,200株
ファナック	24,100	26,300.00	633,830,000	貸付有価証券 1,400株
日本シイエムケイ	5,900	457.00	2,696,300	貸付有価証券 200株
エンプラス	1,200	4,105.00	4,926,000	
大真空	900	3,500.00	3,150,000	
ローム	11,400	10,370.00	118,218,000	
浜松ホトニクス	19,700	6,660.00	131,202,000	
三井ハイテック	2,700	4,120.00	11,124,000	
新光電気工業	9,200	3,570.00	32,844,000	
京セラ	41,800	6,722.00	280,979,600	貸付有価証券 600株
太陽誘電	12,200	5,270.00	64,294,000	貸付有価証券 600株
村田製作所	80,600	8,279.00	667,287,400	
双葉電子工業	4,900	835.00	4,091,500	
北陸電気工業	1,200	1,035.00	1,242,000	
ニチコン	8,600	1,152.00	9,907,200	
日本ケミコン	2,800	2,564.00	7,179,200	
K O A	3,800	1,608.00	6,110,400	
市光工業	4,100	719.00	2,947,900	
小糸製作所	16,400	7,110.00	116,604,000	
ミツバ	5,300	918.00	4,865,400	
S C R E E Nホールディングス	4,800	10,420.00	50,016,000	貸付有価証券 300株
キヤノン電子	2,600	1,701.00	4,422,600	
キヤノン	136,300	2,560.00	348,928,000	
リコー	69,800	1,298.00	90,600,400	貸付有価証券 11,600株
象印マホービン	7,400	1,670.00	12,358,000	
M U T O Hホールディングス	500	1,591.00	795,500	

東京エレクトロン	16,100	48,660.00	783,426,000	貸付有価証券 500株
トヨタ紡織	8,000	2,113.00	16,904,000	
芦森工業	600	1,040.00	624,000	
ユニプレス	4,600	944.00	4,342,400	貸付有価証券 400株
豊田自動織機	22,200	9,340.00	207,348,000	貸付有価証券 100株
モリタホールディングス	4,400	1,538.00	6,767,200	
三櫻工業	3,900	1,100.00	4,290,000	貸付有価証券 200株
デンソー	60,400	7,503.00	453,181,200	
東海理化電機製作所	7,200	1,759.00	12,664,800	貸付有価証券 200株
三井E & Sホールディングス	10,600	494.00	5,236,400	
川崎重工業	21,300	2,632.00	56,061,600	貸付有価証券 1,100株
名村造船所	8,200	167.00	1,369,400	貸付有価証券 2,500株
日本車輛製造	1,000	2,188.00	2,188,000	
三菱ロジスネクスト	3,700	1,020.00	3,774,000	
近畿車輛	400	1,250.00	500,000	
日産自動車	323,700	539.10	174,506,670	貸付有価証券 9,700株
いすゞ自動車	72,900	1,443.00	105,194,700	
トヨタ自動車	277,900	9,115.00	2,533,058,500	代用有価証券 46,000株 貸付有価証券 16,800株
日野自動車	34,300	1,018.00	34,917,400	
三菱自動車工業	101,500	304.00	30,856,000	貸付有価証券 71,000株
エフテック	2,000	795.00	1,590,000	
レシップホールディングス	1,100	586.00	644,600	
G M B	600	918.00	550,800	
ファルテック	500	770.00	385,000	
武蔵精密工業	6,100	2,204.00	13,444,400	
日産車体	4,100	709.00	2,906,900	
新明和工業	7,800	972.00	7,581,600	
極東開発工業	4,700	1,730.00	8,131,000	貸付有価証券 200株
トピー工業	2,400	1,328.00	3,187,200	
ティラド	900	2,686.00	2,417,400	貸付有価証券 100株
曙ブレーキ工業	15,400	174.00	2,679,600	貸付有価証券 10,700株
タチエス	4,200	1,279.00	5,371,800	貸付有価証券 1,200株

N O K	13,300	1,345.00	17,888,500	
フタバ産業	7,000	498.00	3,486,000	
K Y B	3,100	3,825.00	11,857,500	
大同メタル工業	5,800	574.00	3,329,200	
プレス工業	13,900	323.00	4,489,700	
ミクニ	4,000	284.00	1,136,000	貸付有価証券 100株
太平洋工業	5,800	1,183.00	6,861,400	
河西工業	3,700	395.00	1,461,500	
アイシン	20,100	4,800.00	96,480,000	
マツダ	86,100	935.00	80,503,500	貸付有価証券 2,600株
今仙電機製作所	2,400	698.00	1,675,200	貸付有価証券 200株
本田技研工業	216,000	3,353.00	724,248,000	代用有価証券 5,900株 貸付有価証券 2,000株
スズキ	54,400	4,743.00	258,019,200	
S U B A R U	78,600	2,130.50	167,457,300	貸付有価証券 600株
安永	1,300	1,145.00	1,488,500	貸付有価証券 800株
ヤマハ発動機	38,800	3,195.00	123,966,000	貸付有価証券 27,100株
T B K	3,200	415.00	1,328,000	貸付有価証券 100株
エクセディ	3,700	1,605.00	5,938,500	
豊田合成	8,900	2,788.00	24,813,200	
愛三工業	4,500	791.00	3,559,500	
盟和産業	400	948.00	379,200	
日本プラスト	2,200	692.00	1,522,400	
ヨロズ	2,300	1,218.00	2,801,400	貸付有価証券 500株
エフ・シー・シー	4,500	1,699.00	7,645,500	
シマノ	10,300	24,800.00	255,440,000	貸付有価証券 1,100株
テイ・エス テック	12,700	1,569.00	19,926,300	
ジャムコ	1,500	1,002.00	1,503,000	貸付有価証券 1,000株
テルモ	84,100	4,217.00	354,649,700	貸付有価証券 600株
クリエートメディック	900	1,008.00	907,200	
日機装	8,900	1,195.00	10,635,500	貸付有価証券 200株
日本エム・ディ・エム	1,600	2,016.00	3,225,600	貸付有価証券 300株
島津製作所	35,300	3,835.00	135,375,500	貸付有価証券 300株

JMS	2,300	869.00	1,998,700	貸付有価証券 500株
クボテック	900	331.00	297,900	
長野計器	2,000	1,197.00	2,394,000	
ブイ・テクノロジー	1,300	5,260.00	6,838,000	
東京計器	1,700	1,054.00	1,791,800	
愛知時計電機	400	4,290.00	1,716,000	
インターアクション	1,400	2,333.00	3,266,200	貸付有価証券 100株
オーバル	2,700	285.00	769,500	
東京精密	4,600	5,440.00	25,024,000	
マニー	10,900	2,409.00	26,258,100	貸付有価証券 2,500株
ニコン	41,900	1,122.00	47,011,800	
トプコン	13,800	1,717.00	23,694,600	貸付有価証券 2,500株
オリンパス	151,800	2,351.00	356,881,800	
理研計器	2,400	2,755.00	6,612,000	
タムロン	2,200	2,442.00	5,372,400	
HOYA	54,000	14,350.00	774,900,000	貸付有価証券 200株
シード	1,100	768.00	844,800	
ノーリツ鋼機	2,500	2,279.00	5,697,500	
エー・アンド・デイ	2,300	1,037.00	2,385,100	
朝日インテック	28,900	2,708.00	78,261,200	貸付有価証券 5,600株
シチズン時計	34,800	431.00	14,998,800	貸付有価証券 1,000株
リズム	1,000	824.00	824,000	
大研医器	1,900	555.00	1,054,500	貸付有価証券 300株
メニコン	4,200	6,840.00	28,728,000	貸付有価証券 300株
シンシア	400	648.00	259,200	
松風	1,200	1,859.00	2,230,800	
セイコーホールディングス	3,900	2,139.00	8,342,100	貸付有価証券 100株
ニプロ	20,500	1,332.00	27,306,000	
中本パックス	700	1,600.00	1,120,000	貸付有価証券 400株
スノーピーク	1,600	3,520.00	5,632,000	貸付有価証券 1,100株
パラマウントベッドホールディングス	5,300	2,005.00	10,626,500	
トランザクション	1,500	1,365.00	2,047,500	貸付有価証券 1,000株
粧美堂	800	422.00	337,600	
ニホンフラッシュ	2,300	1,259.00	2,895,700	貸付有価証券 500株

前田工織	3,000	3,425.00	10,275,000	貸付有価証券 800株
永大産業	3,800	303.00	1,151,400	貸付有価証券 200株
アートネイチャー	2,700	644.00	1,738,800	
バンダイナムコホールディングス	22,700	7,841.00	177,990,700	
アイフィスジャパン	600	719.00	431,400	
共立印刷	4,700	141.00	662,700	貸付有価証券 300株
S H O E I	2,600	3,935.00	10,231,000	
フランスベッドホールディングス	3,700	925.00	3,422,500	
パイロットコーポレーション	4,600	3,415.00	15,709,000	
萩原工業	1,500	1,431.00	2,146,500	
トッパン・フォームズ	4,900	1,098.00	5,380,200	
フジシールインターナショナル	5,600	2,369.00	13,266,400	
タカラトミー	12,300	952.00	11,709,600	
廣済堂	1,900	1,118.00	2,124,200	貸付有価証券 300株
エステールホールディングス	800	641.00	512,800	貸付有価証券 100株
タカノ	1,100	624.00	686,400	
プロネクサス	2,200	1,030.00	2,266,000	
ホクシン	2,300	175.00	402,500	貸付有価証券 1,600株
ウッドワン	1,000	1,238.00	1,238,000	
大建工業	1,900	1,944.00	3,693,600	
凸版印刷	41,700	1,918.00	79,980,600	
大日本印刷	33,100	2,359.00	78,082,900	
共同印刷	800	2,806.00	2,244,800	
N I S S H A	5,600	1,525.00	8,540,000	貸付有価証券 100株
光村印刷	300	1,709.00	512,700	
T A K A R A & C O M P A N Y	1,300	1,716.00	2,230,800	貸付有価証券 900株
アシックス	24,300	2,625.00	63,787,500	貸付有価証券 800株
ツツミ	700	2,433.00	1,703,100	
ローランド	2,100	6,380.00	13,398,000	
小松ウオール工業	800	1,924.00	1,539,200	
ヤマハ	16,300	6,570.00	107,091,000	
河合楽器製作所	800	3,785.00	3,028,000	
クリナップ	2,600	522.00	1,357,200	
ピジョン	17,600	3,085.00	54,296,000	貸付有価証券 7,300株
オリバー	600	3,155.00	1,893,000	

兼松サステック	200	1,762.00	352,400	貸付有価証券 100株
キングジム	2,300	942.00	2,166,600	貸付有価証券 1,600株
リンテック	5,900	2,418.00	14,266,200	
イトーキ	5,400	359.00	1,938,600	貸付有価証券 100株
任天堂	15,700	67,700.00	1,062,890,000	
三菱鉛筆	4,500	1,437.00	6,466,500	
タカラスタANDARD	5,700	1,600.00	9,120,000	
コクヨ	13,200	1,695.00	22,374,000	
ナカバヤシ	2,700	602.00	1,625,400	
グロープライド	1,300	4,140.00	5,382,000	
オカムラ	9,400	1,402.00	13,178,800	貸付有価証券 800株
美津濃	2,700	2,245.00	6,061,500	
東京電力ホールディングス	232,600	339.00	78,851,400	貸付有価証券 147,800株
中部電力	83,900	1,311.00	109,992,900	
関西電力	103,900	1,038.00	107,848,200	貸付有価証券 5,700株
中国電力	39,500	1,064.00	42,028,000	貸付有価証券 5,300株
北陸電力	25,100	625.00	15,687,500	
東北電力	64,300	890.00	57,227,000	
四国電力	22,800	736.00	16,780,800	貸付有価証券 500株
九州電力	60,600	885.00	53,631,000	貸付有価証券 3,200株
北海道電力	25,600	500.00	12,800,000	
沖縄電力	5,300	1,400.00	7,420,000	
電源開発	21,800	1,550.00	33,790,000	貸付有価証券 11,700株
エフオン	1,700	1,012.00	1,720,400	貸付有価証券 1,000株
イーレックス	4,000	1,843.00	7,372,000	貸付有価証券 100株
レノバ	4,700	3,640.00	17,108,000	貸付有価証券 3,200株
東京瓦斯	52,800	2,166.50	114,391,200	
大阪瓦斯	49,700	2,062.00	102,481,400	
東邦瓦斯	13,500	6,000.00	81,000,000	貸付有価証券 3,800株
北海道瓦斯	1,500	1,537.00	2,305,500	
広島ガス	5,700	371.00	2,114,700	貸付有価証券 200株
西部ガスホールディングス	3,100	2,450.00	7,595,000	

静岡ガス	7,800	1,045.00	8,151,000	貸付有価証券 400株
メタウォーター	3,100	2,016.00	6,249,600	
SBSホールディングス	2,000	3,100.00	6,200,000	
東武鉄道	28,600	2,787.00	79,708,200	
相鉄ホールディングス	9,400	2,126.00	19,984,400	貸付有価証券 500株
東急	69,200	1,466.00	101,447,200	貸付有価証券 1,100株
京浜急行電鉄	35,200	1,412.00	49,702,400	貸付有価証券 11,000株
小田急電鉄	44,000	2,827.00	124,388,000	貸付有価証券 11,900株
京王電鉄	15,300	6,800.00	104,040,000	貸付有価証券 700株
京成電鉄	20,500	3,375.00	69,187,500	
富士急行	3,700	5,110.00	18,907,000	貸付有価証券 2,500株
新京成電鉄	700	2,147.00	1,502,900	
東日本旅客鉄道	48,300	7,650.00	369,495,000	貸付有価証券 4,900株
西日本旅客鉄道	24,400	6,230.00	152,012,000	貸付有価証券 400株
東海旅客鉄道	22,800	16,265.00	370,842,000	貸付有価証券 3,800株
西武ホールディングス	33,100	1,266.00	41,904,600	貸付有価証券 12,800株
鴻池運輸	4,400	1,127.00	4,958,800	
西日本鉄道	7,600	2,724.00	20,702,400	
ハマキョウレックス	2,100	3,030.00	6,363,000	
サカイ引越センター	1,300	5,580.00	7,254,000	
近鉄グループホールディングス	26,000	3,860.00	100,360,000	貸付有価証券 600株
阪急阪神ホールディングス	34,700	3,420.00	118,674,000	
南海電気鉄道	12,300	2,343.00	28,818,900	貸付有価証券 400株
京阪ホールディングス	11,600	3,465.00	40,194,000	貸付有価証券 2,200株
神戸電鉄	600	3,470.00	2,082,000	
名古屋鉄道	21,400	2,100.00	44,940,000	貸付有価証券 1,700株
山陽電気鉄道	1,900	1,880.00	3,572,000	
アルプス物流	1,800	935.00	1,683,000	
日本通運	9,000	8,770.00	78,930,000	
ヤマトホールディングス	36,400	3,010.00	109,564,000	
山九	6,700	4,745.00	31,791,500	
丸運	1,400	261.00	365,400	貸付有価証券 900株

丸全昭和運輸	2,100	3,525.00	7,402,500	
センコーグループホールディングス	14,300	1,007.00	14,400,100	貸付有価証券 900株
トナミホールディングス	600	4,970.00	2,982,000	
ニッコンホールディングス	8,700	2,330.00	20,271,000	貸付有価証券 600株
日本石油輸送	300	2,572.00	771,600	
福山通運	3,300	4,060.00	13,398,000	
セイノーホールディングス	19,500	1,540.00	30,030,000	貸付有価証券 100株
エスライン	700	894.00	625,800	
神奈川中央交通	600	3,635.00	2,181,000	
日立物流	5,700	3,490.00	19,893,000	
丸和運輸機関	5,500	1,535.00	8,442,500	貸付有価証券 600株
C & F ロジホールディングス	2,700	1,646.00	4,444,200	貸付有価証券 700株
九州旅客鉄道	20,100	2,497.00	50,189,700	貸付有価証券 11,300株
S Gホールディングス	49,100	2,446.00	120,098,600	貸付有価証券 600株
日本郵船	21,700	4,515.00	97,975,500	貸付有価証券 1,500株
商船三井	15,400	4,395.00	67,683,000	貸付有価証券 700株
川崎汽船	8,000	2,954.00	23,632,000	貸付有価証券 500株
N S ユナイテッド海運	1,200	2,112.00	2,534,400	
明治海運	2,800	430.00	1,204,000	貸付有価証券 1,900株
飯野海運	12,100	435.00	5,263,500	
共栄タンカー	500	850.00	425,000	
乾汽船	1,800	1,114.00	2,005,200	
日本航空	63,300	2,499.00	158,186,700	貸付有価証券 3,400株
A N Aホールディングス	70,100	2,655.00	186,115,500	貸付有価証券 9,700株
パスコ	500	1,474.00	737,000	
トランコム	800	8,410.00	6,728,000	
日新	2,100	1,444.00	3,032,400	
三菱倉庫	9,000	3,300.00	29,700,000	
三井倉庫ホールディングス	2,800	2,284.00	6,395,200	
住友倉庫	9,200	1,469.00	13,514,800	
澁澤倉庫	1,500	2,066.00	3,099,000	
東陽倉庫	4,500	324.00	1,458,000	
日本トランスシティ	5,700	513.00	2,924,100	貸付有価証券 100株
ケイヒン	500	1,363.00	681,500	

中央倉庫	1,600	1,106.00	1,769,600	
安田倉庫	2,100	935.00	1,963,500	
ファイブホールディングス	600	849.00	509,400	貸付有価証券 400株
東洋埠頭	700	1,511.00	1,057,700	
宇徳	2,200	499.00	1,097,800	
上組	14,300	2,168.00	31,002,400	
キムラユニティー	600	1,310.00	786,000	
キューソー流通システム	700	1,599.00	1,119,300	
近鉄エクスプレス	4,900	2,480.00	12,152,000	
東海運	1,600	306.00	489,600	
エーアイティー	1,600	993.00	1,588,800	
内外トランスライン	900	1,771.00	1,593,900	
日本コンセプト	800	1,683.00	1,346,400	
NEC ネットエスアイ	8,900	1,751.00	15,583,900	
クロスキャット	700	1,019.00	713,300	
システナ	9,600	1,929.00	18,518,400	
デジタルアーツ	1,600	8,040.00	12,864,000	貸付有価証券 100株
日鉄ソリューションズ	3,900	3,195.00	12,460,500	
キューブシステム	1,400	1,042.00	1,458,800	貸付有価証券 900株
エイジア	500	2,096.00	1,048,000	貸付有価証券 300株
コア	1,200	1,436.00	1,723,200	
ラクーンホールディングス	1,900	2,687.00	5,105,300	貸付有価証券 1,300株
ソリトンシステムズ	1,300	1,730.00	2,249,000	貸付有価証券 900株
ソフトクリエイトホールディングス	1,100	2,255.00	2,480,500	
T I S	26,900	2,815.00	75,723,500	
J N S ホールディングス	1,200	540.00	648,000	貸付有価証券 500株
電算システム	1,100	2,927.00	3,219,700	
グリー	16,500	565.00	9,322,500	
G M O ペパボ	200	5,290.00	1,058,000	貸付有価証券 100株
コーエーテクモホールディングス	7,200	5,190.00	37,368,000	
三菱総合研究所	1,200	3,900.00	4,680,000	
ボルテージ	800	505.00	404,000	貸付有価証券 500株
電算	300	2,441.00	732,300	
A G S	1,500	846.00	1,269,000	貸付有価証券 1,000株
ファインデックス	2,200	1,056.00	2,323,200	貸付有価証券 200株

ブレインパッド	700	4,820.00	3,374,000	
K L a b	5,000	681.00	3,405,000	貸付有価証券 3,500株
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,700	1,071.00	3,962,700	
イーブックイニシアティブジャパン	400	2,600.00	1,040,000	貸付有価証券 200株
ネクソン	68,100	2,584.00	175,970,400	貸付有価証券 8,700株
アイスタイル	8,400	516.00	4,334,400	貸付有価証券 5,200株
エムアップホールディングス	700	2,705.00	1,893,500	貸付有価証券 400株
エイチーム	1,900	1,664.00	3,161,600	貸付有価証券 300株
エニグモ	2,600	1,324.00	3,442,400	
テクノスジャパン	2,000	601.00	1,202,000	貸付有価証券 500株
コロプラ	8,900	795.00	7,075,500	貸付有価証券 5,800株
オルトプラス	2,100	448.00	940,800	
ブロードリーフ	13,300	524.00	6,969,200	貸付有価証券 500株
クロス・マーケティンググループ	1,400	690.00	966,000	貸付有価証券 300株
デジタルハーツホールディングス	1,200	1,460.00	1,752,000	
システム情報	2,000	913.00	1,826,000	貸付有価証券 900株
メディアドゥ	1,000	5,590.00	5,590,000	貸付有価証券 700株
じげん	6,600	399.00	2,633,400	貸付有価証券 100株
ブイキューブ	1,500	2,413.00	3,619,500	貸付有価証券 1,000株
エンカレッジ・テクノロジー	600	637.00	382,200	
サイバーリンクス	900	1,633.00	1,469,700	
フィックスターズ	2,800	860.00	2,408,000	貸付有価証券 1,700株
C A R T A H O L D I N G S	1,100	1,606.00	1,766,600	貸付有価証券 600株
オブティム	1,900	2,442.00	4,639,800	貸付有価証券 1,300株
セレス	900	3,720.00	3,348,000	
S H I F T	1,400	15,490.00	21,686,000	
ティーガイア	2,900	1,866.00	5,411,400	貸付有価証券 2,000株
セック	400	2,635.00	1,054,000	
日本アジアグループ	2,600	943.00	2,451,800	
テクマトリックス	4,200	1,740.00	7,308,000	

プロシップ	800	1,310.00	1,048,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,500	2,044.00	13,286,000	
GMOペイメントゲートウェイ	5,100	13,140.00	67,014,000	貸付有価証券 1,100株
ザッパラス	1,300	551.00	716,300	
システムリサーチ	800	2,056.00	1,644,800	
インターネットイニシアティブ	7,200	3,015.00	21,708,000	
さくらインターネット	2,900	620.00	1,798,000	貸付有価証券 2,000株
ヴィンクス	800	982.00	785,600	貸付有価証券 500株
GMOグローバルサイン・ホールディングス	600	5,080.00	3,048,000	貸付有価証券 100株
SRAホールディングス	1,400	2,597.00	3,635,800	
システムインテグレータ	1,000	626.00	626,000	
朝日ネット	2,200	701.00	1,542,200	貸付有価証券 200株
eBASE	3,200	868.00	2,777,600	貸付有価証券 100株
アバント	2,900	1,501.00	4,352,900	貸付有価証券 300株
アドソル日進	900	2,413.00	2,171,700	貸付有価証券 300株
ODKソリューションズ	600	869.00	521,400	
フリービット	1,600	896.00	1,433,600	貸付有価証券 200株
コムチュア	2,500	2,286.00	5,715,000	貸付有価証券 200株
サイバーコム	500	1,501.00	750,500	貸付有価証券 200株
アステリア	1,900	823.00	1,563,700	貸付有価証券 800株
アイル	1,500	1,556.00	2,334,000	
マークライنز	1,100	2,946.00	3,240,600	
メディカル・データ・ビジョン	3,100	2,020.00	6,262,000	貸付有価証券 200株
gumi	3,800	1,140.00	4,332,000	貸付有価証券 2,600株
ショーケース	700	757.00	529,900	貸付有価証券 400株
モバイルファクトリー	700	1,268.00	887,600	貸付有価証券 100株
テラスカイ	900	2,511.00	2,259,900	貸付有価証券 600株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,200	2,080.00	2,496,000	
PCIホールディングス	1,000	1,270.00	1,270,000	貸付有価証券 400株
パイブドHD	400	1,572.00	628,800	貸付有価証券 100株

アイビーシー	500	998.00	499,000	貸付有価証券 100株
ネオジャパン	500	1,668.00	834,000	貸付有価証券 300株
P R T I M E S	600	3,250.00	1,950,000	貸付有価証券 400株
ラクス	8,100	2,026.00	16,410,600	
ランドコンピュータ	400	1,056.00	422,400	
ダブルスタンダード	300	4,855.00	1,456,500	貸付有価証券 200株
オープンドア	1,600	2,634.00	4,214,400	貸付有価証券 1,100株
マイネット	1,000	737.00	737,000	貸付有価証券 700株
アカツキ	1,100	3,510.00	3,861,000	貸付有価証券 400株
ベネフィットジャパン	200	2,032.00	406,400	貸付有価証券 100株
U b i c o mホールディングス	700	3,105.00	2,173,500	貸付有価証券 200株
カナミックネットワーク	2,900	660.00	1,914,000	
ノムラシステムコーポレーション	1,300	294.00	382,200	貸付有価証券 600株
チェンジ	5,000	2,966.00	14,830,000	貸付有価証券 2,700株
シンクロ・フード	1,300	380.00	494,000	
オークネット	1,500	1,372.00	2,058,000	
キャピタル・アセット・プランニング	500	1,066.00	533,000	
セグエグループ	700	1,153.00	807,100	貸付有価証券 400株
エイトレッド	500	2,239.00	1,119,500	貸付有価証券 100株
A O I T Y O Holdings	2,800	898.00	2,514,400	貸付有価証券 100株
マクロミル	5,700	852.00	4,856,400	
ビーグリー	600	1,289.00	773,400	貸付有価証券 300株
オロ	900	3,565.00	3,208,500	貸付有価証券 100株
ユーザーローカル	400	4,100.00	1,640,000	貸付有価証券 100株
テモナ	600	1,022.00	613,200	貸付有価証券 200株
ニーズウェル	600	615.00	369,000	貸付有価証券 100株
サインポスト	600	900.00	540,000	貸付有価証券 400株
ソルクシーズ	1,100	982.00	1,080,200	貸付有価証券 600株
フェイス	1,000	846.00	846,000	

プロトコーポレーション	3,200	1,163.00	3,721,600	
ハイマックス	700	1,065.00	745,500	
野村総合研究所	46,800	3,490.00	163,332,000	
サイバネットシステム	1,900	804.00	1,527,600	貸付有価証券 100株
C Eホールディングス	1,500	540.00	810,000	
日本システム技術	500	1,539.00	769,500	
インテージホールディングス	3,500	1,549.00	5,421,500	
東邦システムサイエンス	700	925.00	647,500	
ソースネクスト	13,400	294.00	3,939,600	貸付有価証券 700株
インフォコム	2,500	2,541.00	6,352,500	
HEROZ	800	2,442.00	1,953,600	貸付有価証券 500株
ラクスル	2,900	4,705.00	13,644,500	貸付有価証券 700株
I P S	600	2,730.00	1,638,000	貸付有価証券 400株
F I G	3,000	288.00	864,000	
システムサポート	700	1,345.00	941,500	貸付有価証券 400株
イーソル	1,500	1,141.00	1,711,500	貸付有価証券 600株
アルテリア・ネットワークス	3,000	1,586.00	4,758,000	
E d u L a b	300	5,560.00	1,668,000	
東海ソフト	400	1,310.00	524,000	
ウイングアーク1st	1,400	2,397.00	3,355,800	貸付有価証券 900株
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	600	2,038.00	1,222,800	
サーバーワークス	300	3,800.00	1,140,000	貸付有価証券 200株
東名	300	1,067.00	320,100	
ヴィッツ	200	1,918.00	383,600	貸付有価証券 100株
トピラシステムズ	400	1,302.00	520,800	貸付有価証券 200株
S a n s a n	2,400	8,260.00	19,824,000	貸付有価証券 300株
L i n k - U	500	1,105.00	552,500	貸付有価証券 300株
ギフトィ	1,600	3,405.00	5,448,000	貸付有価証券 600株
ベース	300	5,330.00	1,599,000	貸付有価証券 200株
フォーカスシステムズ	1,800	882.00	1,587,600	貸付有価証券 1,200株
クレスコ	1,700	1,679.00	2,854,300	
フジ・メディア・ホールディングス	27,900	1,238.00	34,540,200	

オービック	8,500	20,520.00	174,420,000	
ジャストシステム	3,800	5,900.00	22,420,000	
TDCソフト	2,400	1,018.00	2,443,200	
Zホールディングス	369,900	514.60	190,350,540	
トレンドマイクロ	14,400	5,550.00	79,920,000	貸付有価証券 1,900株
IDホールディングス	1,000	1,336.00	1,336,000	
日本オラクル	5,500	9,970.00	54,835,000	
アルファシステムズ	700	3,600.00	2,520,000	
フューチャー	3,200	2,025.00	6,480,000	
CAC Holdings	1,700	1,425.00	2,422,500	
SBテクノロジー	1,000	3,035.00	3,035,000	貸付有価証券 700株
トーセ	800	819.00	655,200	
オービックビジネスコンサルタント	2,600	5,990.00	15,574,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	12,300	3,450.00	42,435,000	
アイティフォー	3,500	773.00	2,705,500	
東計電算	400	4,555.00	1,822,000	
エクスネット	400	1,022.00	408,800	
大塚商会	14,600	5,860.00	85,556,000	貸付有価証券 300株
サイボウズ	3,100	2,432.00	7,539,200	貸付有価証券 1,200株
電通国際情報サービス	3,300	3,835.00	12,655,500	
ACCESS	3,400	875.00	2,975,000	貸付有価証券 2,300株
デジタルガレージ	4,400	4,485.00	19,734,000	貸付有価証券 200株
EMシステムズ	4,500	828.00	3,726,000	
ウェザーニューズ	800	5,320.00	4,256,000	
CIJ	1,800	843.00	1,517,400	
ビジネスエンジニアリング	300	3,265.00	979,500	貸付有価証券 200株
日本エンタープライズ	3,100	216.00	669,600	貸付有価証券 2,100株
WOWOW	1,300	2,325.00	3,022,500	貸付有価証券 100株
スカラ	2,400	801.00	1,922,400	貸付有価証券 200株
インテリジェント ウェイブ	1,600	673.00	1,076,800	
IMAGICA GROUP	2,400	511.00	1,226,400	
ネットワンシステムズ	11,000	3,325.00	36,575,000	貸付有価証券 100株
システムソフト	6,800	153.00	1,040,400	貸付有価証券 3,800株
アルゴグラフィックス	2,100	2,992.00	6,283,200	

マーベラス	4,200	810.00	3,402,000	貸付有価証券 600株
エイベックス	4,600	1,507.00	6,932,200	
日本ユニシス	9,300	3,170.00	29,481,000	
兼松エレクトロニクス	1,500	3,585.00	5,377,500	
都築電気	1,200	1,877.00	2,252,400	
TBSホールディングス	17,900	1,837.00	32,882,300	貸付有価証券 1,400株
日本テレビホールディングス	22,500	1,307.00	29,407,500	
朝日放送グループホールディングス	2,700	709.00	1,914,300	貸付有価証券 1,800株
テレビ朝日ホールディングス	8,300	1,875.00	15,562,500	
スカパーJSAホールディングス	17,700	433.00	7,664,100	
テレビ東京ホールディングス	2,000	2,138.00	4,276,000	
日本BS放送	900	1,099.00	989,100	
ビジョン	3,300	1,003.00	3,309,900	貸付有価証券 2,300株
スマートバリュー	800	818.00	654,400	貸付有価証券 500株
USEN-NEXT HOLDINGS	2,500	2,110.00	5,275,000	貸付有価証券 200株
コネクシオ	1,600	1,466.00	2,345,600	
クロップス	700	842.00	589,400	貸付有価証券 100株
日本電信電話	314,900	2,931.50	923,129,350	貸付有価証券 5,200株
KDDI	215,900	3,717.00	802,500,300	貸付有価証券 11,200株
ソフトバンク	244,600	1,406.50	344,029,900	貸付有価証券 44,200株
光通信	3,200	21,780.00	69,696,000	
エムティーアイ	2,600	701.00	1,822,600	貸付有価証券 1,400株
GMOインターネット	9,500	2,957.00	28,091,500	
ファイバーゲート	900	1,331.00	1,197,900	貸付有価証券 600株
アイドママーケティングコミュニケーション	900	421.00	378,900	
KADOKAWA	7,000	4,355.00	30,485,000	
学研ホールディングス	3,800	1,332.00	5,061,600	
ゼンリン	4,900	1,165.00	5,708,500	
昭文社ホールディングス	1,300	475.00	617,500	
インプレスホールディングス	2,400	216.00	518,400	貸付有価証券 1,600株
アイネット	1,400	1,439.00	2,014,600	
松竹	1,800	12,740.00	22,932,000	
東宝	15,900	4,535.00	72,106,500	
東映	900	22,700.00	20,430,000	貸付有価証券 100株

エヌ・ティ・ティ・データ	71,700	1,780.00	127,626,000	
ピー・シー・エー	400	4,205.00	1,682,000	
ビジネスブレイン太田昭和	900	1,793.00	1,613,700	貸付有価証券 100株
D T S	5,600	2,543.00	14,240,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,500	5,850.00	67,275,000	貸付有価証券 300株
シーイーシー	3,000	1,388.00	4,164,000	
カブコン	23,100	3,600.00	83,160,000	貸付有価証券 1,300株
アイ・エス・ビー	1,300	1,319.00	1,714,700	
ジャステック	1,800	1,303.00	2,345,400	
S C S K	6,200	6,350.00	39,370,000	
日本システムウエア	900	2,277.00	2,049,300	
アイネス	2,600	1,310.00	3,406,000	貸付有価証券 500株
T K C	4,600	3,400.00	15,640,000	
富士ソフト	2,900	5,480.00	15,892,000	貸付有価証券 500株
N S D	8,600	1,774.00	15,256,400	
コナミホールディングス	9,800	7,020.00	68,796,000	貸付有価証券 400株
福井コンピュータホールディングス	1,200	4,320.00	5,184,000	
J B C Cホールディングス	1,800	1,330.00	2,394,000	
ミロク情報サービス	2,700	1,599.00	4,317,300	
ソフトバンクグループ	213,600	8,256.00	1,763,481,600	代用有価証券 17,000株 貸付有価証券 4,700株
ハウスイ	200	958.00	191,600	
高千穂交易	1,000	1,149.00	1,149,000	貸付有価証券 700株
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,726.00	517,800	貸付有価証券 200株
伊藤忠食品	700	4,990.00	3,493,000	
エレマテック	2,200	1,228.00	2,701,600	
J A L U X	700	1,725.00	1,207,500	貸付有価証券 100株
あらた	2,200	4,230.00	9,306,000	
トーメンデバイス	400	3,950.00	1,580,000	
東京エレクトロン デバイス	900	6,080.00	5,472,000	貸付有価証券 300株
フィールズ	2,400	466.00	1,118,400	
双日	149,200	338.00	50,429,600	
アルフレッサ ホールディングス	28,000	1,692.00	47,376,000	貸付有価証券 19,600株
横浜冷凍	7,600	874.00	6,642,400	貸付有価証券 100株

神栄	600	1,359.00	815,400	貸付有価証券 300株
ラサ商事	1,400	918.00	1,285,200	
アルコニックス	2,900	1,531.00	4,439,900	
神戸物産	18,600	2,764.00	51,410,400	貸付有価証券 3,900株
ハイパー	500	548.00	274,000	
あい ホールディングス	3,900	2,168.00	8,455,200	
ディーブイエックス	900	961.00	864,900	
ダイワボウホールディングス	12,300	1,709.00	21,020,700	
マクニカ・富士エレホールディングス	6,400	2,426.00	15,526,400	
ラクト・ジャパン	1,200	2,690.00	3,228,000	貸付有価証券 800株
グリムス	700	1,818.00	1,272,600	貸付有価証券 400株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,800	713.00	3,422,400	
八洲電機	2,100	964.00	2,024,400	貸付有価証券 1,300株
メディアスホールディングス	1,500	1,099.00	1,648,500	
レスターホールディングス	2,800	1,819.00	5,093,200	
ジューテックホールディングス	600	1,035.00	621,000	
大光	1,200	677.00	812,400	貸付有価証券 800株
O C H Iホールディングス	800	1,285.00	1,028,000	
T O K A Iホールディングス	13,100	880.00	11,528,000	貸付有価証券 800株
黒谷	700	987.00	690,900	貸付有価証券 200株
C o m i n i x	400	746.00	298,400	
三洋貿易	2,700	1,269.00	3,426,300	
ビューティガレージ	400	3,660.00	1,464,000	貸付有価証券 100株
ウイン・パートナーズ	1,900	987.00	1,875,300	
ミタチ産業	700	645.00	451,500	
シップヘルスケアホールディングス	9,500	2,587.00	24,576,500	貸付有価証券 1,500株
明治電機工業	900	1,378.00	1,240,200	
デリカフーズホールディングス	1,100	639.00	702,900	
スターティアホールディングス	700	1,460.00	1,022,000	貸付有価証券 400株
コメダホールディングス	5,900	2,018.00	11,906,200	
ピーバンドットコム	400	826.00	330,400	貸付有価証券 100株
アセンテック	600	1,319.00	791,400	貸付有価証券 400株
富士興産	900	1,247.00	1,122,300	貸付有価証券 600株
協栄産業	300	1,375.00	412,500	

小野建	2,500	1,300.00	3,250,000	貸付有価証券 1,600株
南陽	600	1,896.00	1,137,600	
佐島電機	1,700	777.00	1,320,900	
エコートレーディング	600	615.00	369,000	
伯東	1,700	1,563.00	2,657,100	
コンドーテック	2,100	1,002.00	2,104,200	
中山福	1,500	443.00	664,500	
ナガイレーベン	3,600	2,574.00	9,266,400	
三菱食品	3,000	2,874.00	8,622,000	
松田産業	2,000	2,240.00	4,480,000	
第一興商	5,400	4,275.00	23,085,000	
メディバルホールディングス	27,100	2,094.00	56,747,400	
S P K	1,100	1,348.00	1,482,800	
萩原電気ホールディングス	1,000	2,398.00	2,398,000	
アズワン	1,900	12,490.00	23,731,000	
スズデン	800	1,442.00	1,153,600	
尾家産業	800	1,198.00	958,400	
シモジマ	1,600	1,081.00	1,729,600	
ドウシシャ	2,600	1,663.00	4,323,800	
小津産業	600	1,935.00	1,161,000	貸付有価証券 400株
高速	1,400	1,420.00	1,988,000	
たけびし	900	1,571.00	1,413,900	貸付有価証券 300株
リックス	600	1,530.00	918,000	
丸文	2,400	592.00	1,420,800	貸付有価証券 100株
ハビネット	2,400	1,436.00	3,446,400	
橋本総業ホールディングス	500	2,672.00	1,336,000	
日本ライフライン	8,700	1,385.00	12,049,500	
タカショー	1,700	787.00	1,337,900	貸付有価証券 1,100株
マルカ	900	2,340.00	2,106,000	貸付有価証券 500株
I D O M	9,100	605.00	5,505,500	
進和	1,600	2,104.00	3,366,400	
エスケイジャパン	600	436.00	261,600	貸付有価証券 400株
ダイترون	1,100	1,959.00	2,154,900	
シークス	3,400	1,562.00	5,310,800	
田中商事	800	653.00	522,400	
オーハシテクニカ	1,400	1,536.00	2,150,400	
白銅	1,000	1,821.00	1,821,000	

ダイコー通産	300	1,554.00	466,200	貸付有価証券 100株
伊藤忠商事	189,000	3,249.00	614,061,000	貸付有価証券 1,000株
丸紅	266,400	967.30	257,688,720	貸付有価証券 6,600株
高島	400	1,723.00	689,200	
長瀬産業	14,900	1,607.00	23,944,300	
蝶理	1,700	1,716.00	2,917,200	
豊田通商	27,100	4,905.00	132,925,500	
三共生興	4,100	520.00	2,132,000	
兼松	10,800	1,463.00	15,800,400	
ツカモトコーポレーション	500	1,359.00	679,500	
三井物産	215,500	2,414.00	520,217,000	貸付有価証券 1,500株
日本紙パルプ商事	1,400	3,545.00	4,963,000	
カメイ	3,600	1,153.00	4,150,800	
東都水産	300	4,480.00	1,344,000	貸付有価証券 200株
OUGホールディングス	400	2,787.00	1,114,800	貸付有価証券 200株
スターゼン	2,100	2,094.00	4,397,400	
山善	10,600	964.00	10,218,400	貸付有価証券 300株
椿本興業	500	3,435.00	1,717,500	
住友商事	170,500	1,528.00	260,524,000	
内田洋行	1,200	4,740.00	5,688,000	
三菱商事	164,500	2,984.00	490,868,000	貸付有価証券 1,900株
第一実業	1,200	4,280.00	5,136,000	
キャノンマーケティングジャパン	6,700	2,556.00	17,125,200	
西華産業	1,400	1,773.00	2,482,200	
佐藤商事	2,200	1,112.00	2,446,400	
菱洋エレクトロ	2,100	2,670.00	5,607,000	貸付有価証券 1,400株
東京産業	2,400	605.00	1,452,000	
ユアサ商事	2,800	3,005.00	8,414,000	
神鋼商事	700	2,326.00	1,628,200	
トルク	1,600	241.00	385,600	
阪和興業	5,400	3,095.00	16,713,000	貸付有価証券 100株
正栄食品工業	1,700	3,965.00	6,740,500	貸付有価証券 300株
カナデン	2,200	1,080.00	2,376,000	
菱電商事	2,000	1,590.00	3,180,000	
フルサト工業	1,400	1,802.00	2,522,800	貸付有価証券 900株

岩谷産業	6,500	6,460.00	41,990,000	貸付有価証券 200株
ナイス	1,100	2,028.00	2,230,800	
昭光通商	1,000	792.00	792,000	貸付有価証券 300株
ニチモウ	400	2,067.00	826,800	
極東貿易	800	2,170.00	1,736,000	
イワキ	3,900	695.00	2,710,500	
三愛石油	6,700	1,180.00	7,906,000	
稲畑産業	6,500	1,710.00	11,115,000	
G S I クレオス	1,400	1,019.00	1,426,600	
明和産業	2,400	468.00	1,123,200	貸付有価証券 100株
クワザワホールディングス	1,000	574.00	574,000	貸付有価証券 700株
ヤマエ久野	2,000	1,129.00	2,258,000	
ワキタ	5,300	1,112.00	5,893,600	
東邦ホールディングス	8,700	1,715.00	14,920,500	
サンゲツ	7,300	1,527.00	11,147,100	
ミツウロコグループホールディングス	4,000	1,216.00	4,864,000	
シナネンホールディングス	1,000	2,763.00	2,763,000	
伊藤忠エネクス	6,000	1,005.00	6,030,000	
サンリオ	7,600	1,812.00	13,771,200	
サンワテクノス	1,800	1,218.00	2,192,400	
リョーサン	3,000	2,024.00	6,072,000	
新光商事	3,600	734.00	2,642,400	
トーヨー	1,200	1,681.00	2,017,200	
三信電気	1,400	2,135.00	2,989,000	貸付有価証券 900株
東陽テクニカ	2,700	1,100.00	2,970,000	
モスフードサービス	3,800	3,070.00	11,666,000	
加賀電子	2,400	2,954.00	7,089,600	
ソーダニッカ	2,600	580.00	1,508,000	
立花エレテック	2,100	1,465.00	3,076,500	
フォーバル	1,200	887.00	1,064,400	
P A L T A C	4,300	5,780.00	24,854,000	
三谷産業	3,500	392.00	1,372,000	貸付有価証券 200株
太平洋興発	1,100	628.00	690,800	
西本W i s m e t t a cホールディングス	600	2,790.00	1,674,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	2,007.00	602,100	貸付有価証券 200株
コア商事ホールディングス	2,000	713.00	1,426,000	貸付有価証券 800株
国際紙パルプ商事	5,800	247.00	1,432,600	貸付有価証券 100株

ヤマタネ	1,200	1,496.00	1,795,200	
丸紅建材リース	300	1,799.00	539,700	
日鉄物産	1,900	4,300.00	8,170,000	
泉州電業	800	3,345.00	2,676,000	
トラスコ中山	6,200	2,754.00	17,074,800	
オートバックスセブン	10,000	1,460.00	14,600,000	
モリト	1,900	603.00	1,145,700	
加藤産業	3,900	3,290.00	12,831,000	
北恵	700	908.00	635,600	
イノテック	1,500	1,320.00	1,980,000	
イエローハット	5,100	1,934.00	9,863,400	貸付有価証券 1,300株
J Kホールディングス	2,500	787.00	1,967,500	
日伝	2,200	1,990.00	4,378,000	
北沢産業	2,200	249.00	547,800	
杉本商事	1,400	2,212.00	3,096,800	貸付有価証券 100株
因幡電機産業	7,200	2,554.00	18,388,800	
東テク	900	2,776.00	2,498,400	
ミスミグループ本社	33,900	3,520.00	119,328,000	
アルテック	2,300	354.00	814,200	貸付有価証券 100株
タキヒヨー	900	1,809.00	1,628,100	貸付有価証券 200株
蔵王産業	400	1,461.00	584,400	
スズケン	11,400	3,460.00	39,444,000	貸付有価証券 400株
ジェコス	1,900	875.00	1,662,500	
グローセル	2,700	416.00	1,123,200	
ローソン	6,800	4,930.00	33,524,000	
サンエー	2,000	4,245.00	8,490,000	
カワチ薬品	1,900	2,220.00	4,218,000	
エービーシー・マート	4,200	6,250.00	26,250,000	貸付有価証券 100株
ハードオフコーポレーション	900	760.00	684,000	
アスクル	4,400	1,785.00	7,854,000	
ゲオホールディングス	3,800	1,106.00	4,202,800	貸付有価証券 2,600株
アダストリア	3,700	1,890.00	6,993,000	
ジーフット	1,700	406.00	690,200	貸付有価証券 1,100株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	500	396.00	198,000	貸付有価証券 300株
くら寿司	3,200	3,870.00	12,384,000	
キャンドウ	1,300	1,963.00	2,551,900	貸付有価証券 900株

アイケイ	800	765.00	612,000	貸付有価証券 300株
パルグループホールディングス	2,400	1,589.00	3,813,600	
エディオン	11,400	1,082.00	12,334,800	貸付有価証券 7,900株
サーラコーポレーション	5,600	587.00	3,287,200	
ワッツ	1,300	908.00	1,180,400	貸付有価証券 300株
ハローズ	1,100	2,762.00	3,038,200	
フジオフードグループ本社	2,300	1,317.00	3,029,100	貸付有価証券 1,600株
あみやき亭	600	2,864.00	1,718,400	貸付有価証券 400株
ひらまつ	5,400	174.00	939,600	貸付有価証券 300株
大黒天物産	900	7,590.00	6,831,000	貸付有価証券 600株
ハニーズホールディングス	2,200	1,000.00	2,200,000	貸付有価証券 1,500株
ファーマライズホールディングス	700	775.00	542,500	
アルペン	2,100	2,686.00	5,640,600	貸付有価証券 1,400株
ハブ	800	713.00	570,400	貸付有価証券 500株
クオールホールディングス	3,700	1,483.00	5,487,100	
ジinzホールディングス	1,800	8,010.00	14,418,000	貸付有価証券 500株
ビックカメラ	16,000	1,082.00	17,312,000	貸付有価証券 400株
D C Mホールディングス	16,700	1,020.00	17,034,000	
MonotaRO	38,400	2,542.00	97,612,800	貸付有価証券 8,000株
東京一番フーズ	800	584.00	467,200	貸付有価証券 300株
アークランドサービスホールディングス	2,300	2,273.00	5,227,900	貸付有価証券 1,600株
J.フロント リテイリング	32,300	1,076.00	34,754,800	
ドトール・日レスホールディングス	4,300	1,631.00	7,013,300	
マツモトキヨシホールディングス	11,200	4,725.00	52,920,000	
ブロンコビリー	1,500	2,298.00	3,447,000	貸付有価証券 1,000株
Z O Z O	15,900	3,705.00	58,909,500	
トレジャー・ファクトリー	900	1,033.00	929,700	
物語コーポレーション	1,400	6,600.00	9,240,000	貸付有価証券 900株
ココカラファイン	2,400	7,940.00	19,056,000	貸付有価証券 100株
三越伊勢丹ホールディングス	47,300	785.00	37,130,500	貸付有価証券 1,300株

H a m e e	900	1,494.00	1,344,600	貸付有価証券 600株
マーケットエンタープライズ	200	1,083.00	216,600	貸付有価証券 100株
ウエルシアホールディングス	14,300	3,345.00	47,833,500	貸付有価証券 6,900株
クリエイトSDホールディングス	4,000	3,220.00	12,880,000	貸付有価証券 2,800株
丸善CHIホールディングス	3,100	400.00	1,240,000	貸付有価証券 2,100株
ミサワ	600	689.00	413,400	貸付有価証券 100株
ティーライフ	400	1,431.00	572,400	貸付有価証券 200株
チムニー	900	1,319.00	1,187,100	
シュッピン	1,800	909.00	1,636,200	
オイシックス・ラ・大地	3,600	3,100.00	11,160,000	貸付有価証券 2,500株
ネクステージ	4,800	1,605.00	7,704,000	貸付有価証券 100株
ジョイフル本田	7,900	1,307.00	10,325,300	貸付有価証券 5,500株
鳥貴族ホールディングス	1,000	1,778.00	1,778,000	貸付有価証券 500株
ホットランド	2,000	1,389.00	2,778,000	貸付有価証券 1,400株
すかいらーくホールディングス	30,300	1,542.00	46,722,600	貸付有価証券 21,200株
SFPホールディングス	1,300	1,320.00	1,716,000	貸付有価証券 900株
綿半ホールディングス	2,000	1,221.00	2,442,000	貸付有価証券 1,200株
ヨシックス	400	2,078.00	831,200	貸付有価証券 200株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	7,900	1,078.00	8,516,200	貸付有価証券 1,200株
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,400	1,350.00	1,890,000	貸付有価証券 900株
B E E N O S	1,400	3,635.00	5,089,000	
あさひ	2,100	1,402.00	2,944,200	貸付有価証券 1,400株
日本調剤	1,600	1,598.00	2,556,800	貸付有価証券 300株
コスモス薬品	2,700	15,230.00	41,121,000	貸付有価証券 500株
トーエル	1,300	762.00	990,600	貸付有価証券 900株
オンリー	500	455.00	227,500	
セブン&アイ・ホールディングス	105,700	4,736.00	500,595,200	貸付有価証券 800株

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	14,500	802.00	11,629,000	貸付有価証券 10,100株
ツルハホールディングス	5,900	13,300.00	78,470,000	
サンマルクホールディングス	2,100	1,543.00	3,240,300	
フェリシモ	700	1,333.00	933,100	
トリドールホールディングス	6,700	1,700.00	11,390,000	貸付有価証券 4,600株
TOKYO BASE	2,500	673.00	1,682,500	貸付有価証券 100株
ウイルプラスホールディングス	300	1,288.00	386,400	
JMホールディングス	1,800	2,064.00	3,715,200	
サツドラホールディングス	400	2,061.00	824,400	貸付有価証券 200株
アレンザホールディングス	2,100	1,203.00	2,526,300	貸付有価証券 900株
串カツ田中ホールディングス	700	1,830.00	1,281,000	貸付有価証券 400株
パロックジャパンリミテッド	1,900	782.00	1,485,800	
クスリのアオキホールディングス	2,700	7,680.00	20,736,000	貸付有価証券 1,800株
FOOD & LIFE COMPANIE	15,800	4,920.00	77,736,000	
メディカルシステムネットワーク	2,300	720.00	1,656,000	
はるやまホールディングス	1,300	667.00	867,100	
ノジマ	4,800	3,010.00	14,448,000	
カッパ・クリエイト	3,800	1,453.00	5,521,400	貸付有価証券 2,100株
ライトオン	2,200	671.00	1,476,200	貸付有価証券 1,500株
良品計画	31,100	2,079.00	64,656,900	貸付有価証券 1,300株
三城ホールディングス	2,900	267.00	774,300	
アドヴァン	2,700	939.00	2,535,300	
アルビス	900	2,287.00	2,058,300	貸付有価証券 100株
コナカ	3,400	342.00	1,162,800	貸付有価証券 2,300株
ハウス オブ ローゼ	300	1,640.00	492,000	貸付有価証券 200株
G-7ホールディングス	1,300	2,970.00	3,861,000	
イオン北海道	3,700	1,022.00	3,781,400	貸付有価証券 1,400株
コジマ	4,800	801.00	3,844,800	貸付有価証券 3,300株
ヒマラヤ	1,000	1,011.00	1,011,000	貸付有価証券 200株
コーナン商事	3,800	2,995.00	11,381,000	貸付有価証券 400株
エコス	1,000	1,851.00	1,851,000	貸付有価証券 700株

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	54,000	2,156.00	116,424,000	
西松屋チェーン	5,900	1,532.00	9,038,800	貸付有価証券 4,000株
ゼンショーホールディングス	14,500	2,729.00	39,570,500	貸付有価証券 6,100株
幸楽苑ホールディングス	1,700	1,569.00	2,667,300	
ハークスレイ	500	924.00	462,000	
サイゼリヤ	4,000	2,424.00	9,696,000	
V Tホールディングス	10,600	463.00	4,907,800	
魚力	800	1,959.00	1,567,200	
フジ・コーポレーション	1,400	1,234.00	1,727,600	貸付有価証券 400株
ユナイテッドアローズ	3,100	1,854.00	5,747,400	
ハイデイ日高	3,900	1,726.00	6,731,400	貸付有価証券 200株
京都きもの友禅	2,100	264.00	554,400	
コロワイド	9,000	1,911.00	17,199,000	貸付有価証券 6,100株
ピーシーデポコーポレーション	3,200	440.00	1,408,000	貸付有価証券 2,200株
壱番屋	1,900	4,715.00	8,958,500	
P L A N T	800	720.00	576,000	貸付有価証券 300株
スギホールディングス	5,400	8,620.00	46,548,000	貸付有価証券 1,100株
薬王堂ホールディングス	1,200	2,378.00	2,853,600	
スクロール	4,000	902.00	3,608,000	貸付有価証券 2,400株
ヨンドシーホールディングス	2,500	1,844.00	4,610,000	
木曽路	3,500	2,318.00	8,113,000	貸付有価証券 300株
S R Sホールディングス	3,400	813.00	2,764,200	貸付有価証券 2,300株
千趣会	4,900	410.00	2,009,000	貸付有価証券 3,400株
タカキュー	2,600	137.00	356,200	
リテールパートナーズ	3,300	1,137.00	3,752,100	貸付有価証券 200株
ケーヨー	4,900	730.00	3,577,000	
上新電機	3,100	2,640.00	8,184,000	
日本瓦斯	13,400	1,689.00	22,632,600	
ロイヤルホールディングス	4,700	2,036.00	9,569,200	貸付有価証券 3,200株
東天紅	300	997.00	299,100	
いなげや	3,000	1,477.00	4,431,000	貸付有価証券 400株
チヨダ	2,600	873.00	2,269,800	貸付有価証券 1,900株

ライフコーポレーション	2,500	3,365.00	8,412,500	
リンガーハット	3,300	2,222.00	7,332,600	
MrMaxHD	3,700	616.00	2,279,200	貸付有価証券 100株
AOKIホールディングス	5,800	637.00	3,694,600	貸付有価証券 1,000株
オークワ	4,300	1,106.00	4,755,800	貸付有価証券 200株
コメリ	4,200	2,585.00	10,857,000	
青山商事	6,000	858.00	5,148,000	貸付有価証券 2,900株
しまむら	3,100	10,420.00	32,302,000	
はせがわ	1,600	294.00	470,400	
高島屋	19,700	1,244.00	24,506,800	貸付有価証券 7,500株
松屋	5,900	919.00	5,422,100	貸付有価証券 200株
エイチ・ツー・オー リテイリング	12,800	878.00	11,238,400	貸付有価証券 700株
近鉄百貨店	1,100	3,085.00	3,393,500	貸付有価証券 400株
丸井グループ	22,900	2,085.00	47,746,500	貸付有価証券 200株
アクシアル リテイリング	2,200	3,900.00	8,580,000	
井筒屋	2,100	242.00	508,200	貸付有価証券 500株
イオン	104,000	2,932.00	304,928,000	貸付有価証券 4,900株
イズミ	5,500	4,095.00	22,522,500	貸付有価証券 500株
平和堂	5,000	2,329.00	11,645,000	貸付有価証券 2,400株
フジ	3,300	2,038.00	6,725,400	貸付有価証券 100株
ヤオコー	3,100	6,270.00	19,437,000	貸付有価証券 2,000株
ゼビオホールディングス	3,300	941.00	3,105,300	貸付有価証券 500株
ケースホールディングス	23,000	1,300.00	29,900,000	
Olympicグループ	1,300	764.00	993,200	貸付有価証券 900株
日産東京販売ホールディングス	3,900	247.00	963,300	
シルバーライフ	500	2,490.00	1,245,000	貸付有価証券 100株
Genky DrugStores	1,200	3,330.00	3,996,000	貸付有価証券 800株
ナルミヤ・インターナショナル	700	1,134.00	793,800	
ブックオフグループホールディングス	1,600	935.00	1,496,000	貸付有価証券 1,100株
ギフト	300	2,295.00	688,500	

アインホールディングス	3,900	6,720.00	26,208,000	
元気寿司	800	2,626.00	2,100,800	貸付有価証券 400株
ヤマダホールディングス	90,500	532.00	48,146,000	
アークランドサカモト	4,200	1,466.00	6,157,200	
ニトリホールディングス	10,700	18,965.00	202,925,500	貸付有価証券 5,100株
グルメ杵屋	1,900	967.00	1,837,300	
愛眼	2,300	229.00	526,700	
ケーユーホールディングス	1,300	947.00	1,231,100	
吉野家ホールディングス	8,900	2,007.00	17,862,300	
松屋フーズホールディングス	1,400	3,450.00	4,830,000	貸付有価証券 100株
サガミホールディングス	3,900	1,032.00	4,024,800	貸付有価証券 2,700株
関西スーパーマーケット	2,100	980.00	2,058,000	貸付有価証券 200株
王将フードサービス	1,800	5,550.00	9,990,000	
プレナス	3,000	1,935.00	5,805,000	
ミニストップ	2,000	1,348.00	2,696,000	貸付有価証券 900株
アークス	5,100	2,388.00	12,178,800	
パローホールディングス	5,500	2,223.00	12,226,500	
藤久	600	840.00	504,000	貸付有価証券 400株
ベルク	1,300	5,510.00	7,163,000	
大庄	1,300	983.00	1,277,900	貸付有価証券 900株
ファーストリテイリング	3,600	89,170.00	321,012,000	貸付有価証券 200株
サンドラッグ	10,200	3,670.00	37,434,000	
サクスパー ホールディングス	2,300	614.00	1,412,200	貸付有価証券 1,600株
ヤマザワ	600	1,700.00	1,020,000	
やまや	500	2,278.00	1,139,000	
ペルーナ	5,800	1,088.00	6,310,400	
島根銀行	900	647.00	582,300	
じもとホールディングス	1,800	655.00	1,179,000	貸付有価証券 1,000株
めぶきフィナンシャルグループ	140,800	232.00	32,665,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,500	1,353.00	4,735,500	貸付有価証券 200株
九州フィナンシャルグループ	55,300	410.00	22,673,000	
ゆうちょ銀行	76,600	931.00	71,314,600	貸付有価証券 53,600株
富山第一銀行	6,400	274.00	1,753,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	164,800	401.00	66,084,800	貸付有価証券 4,500株

西日本フィナンシャルホールディングス	17,600	674.00	11,862,400	貸付有価証券 100株
三十三フィナンシャルグループ	2,500	1,311.00	3,277,500	貸付有価証券 700株
第四北越フィナンシャルグループ	4,400	2,369.00	10,423,600	
ひろぎんホールディングス	40,000	586.00	23,440,000	貸付有価証券 600株
新生銀行	22,100	1,700.00	37,570,000	貸付有価証券 1,600株
あおぞら銀行	16,100	2,473.00	39,815,300	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,851,000	620.00	1,147,620,000	代用有価証券 184,400株 貸付有価証券 26,400株
りそなホールディングス	312,300	467.20	145,906,560	
三井住友トラスト・ホールディングス	51,200	3,771.00	193,075,200	貸付有価証券 800株
三井住友フィナンシャルグループ	187,200	3,951.00	739,627,200	代用有価証券 4,400株
千葉銀行	90,300	696.00	62,848,800	貸付有価証券 500株
群馬銀行	55,500	352.00	19,536,000	貸付有価証券 9,000株
武蔵野銀行	4,000	1,698.00	6,792,000	貸付有価証券 200株
千葉興業銀行	6,800	263.00	1,788,400	
筑波銀行	11,500	171.00	1,966,500	貸付有価証券 300株
七十七銀行	8,500	1,324.00	11,254,000	
青森銀行	2,100	2,169.00	4,554,900	貸付有価証券 300株
秋田銀行	1,600	1,395.00	2,232,000	
山形銀行	3,200	888.00	2,841,600	貸付有価証券 600株
岩手銀行	1,800	1,804.00	3,247,200	貸付有価証券 100株
東邦銀行	24,200	205.00	4,961,000	貸付有価証券 800株
東北銀行	1,200	1,028.00	1,233,600	
みちのく銀行	1,800	997.00	1,794,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	24,400	2,002.00	48,848,800	貸付有価証券 4,400株
静岡銀行	65,900	867.00	57,135,300	
十六銀行	3,400	1,980.00	6,732,000	
スルガ銀行	23,800	354.00	8,425,200	貸付有価証券 6,400株
八十二銀行	61,000	371.00	22,631,000	貸付有価証券 2,600株
山梨中央銀行	3,100	814.00	2,523,400	
大垣共立銀行	5,300	1,865.00	9,884,500	

福井銀行	2,300	1,508.00	3,468,400	
北國銀行	2,500	2,316.00	5,790,000	
清水銀行	1,100	1,567.00	1,723,700	
富山銀行	500	2,587.00	1,293,500	
滋賀銀行	5,400	2,019.00	10,902,600	
南都銀行	3,900	1,856.00	7,238,400	
百五銀行	24,300	312.00	7,581,600	
京都銀行	9,700	5,390.00	52,283,000	貸付有価証券 6,100株
紀陽銀行	9,600	1,448.00	13,900,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	18,000	875.00	15,750,000	
山陰合同銀行	17,100	524.00	8,960,400	
中国銀行	23,200	858.00	19,905,600	
鳥取銀行	900	1,126.00	1,013,400	
伊予銀行	35,800	577.00	20,656,600	貸付有価証券 300株
百十四銀行	3,000	1,452.00	4,356,000	
四国銀行	3,800	688.00	2,614,400	貸付有価証券 300株
阿波銀行	4,100	2,057.00	8,433,700	
大分銀行	1,600	1,704.00	2,726,400	貸付有価証券 100株
宮崎銀行	1,700	2,023.00	3,439,100	貸付有価証券 100株
佐賀銀行	1,500	1,385.00	2,077,500	
沖縄銀行	2,500	2,589.00	6,472,500	
琉球銀行	6,100	701.00	4,276,100	貸付有価証券 300株
セブン銀行	90,300	227.00	20,498,100	貸付有価証券 63,100株
みずほフィナンシャルグループ	367,600	1,673.00	614,994,800	貸付有価証券 12,400株
高知銀行	1,000	824.00	824,000	
山口フィナンシャルグループ	33,800	639.00	21,598,200	
長野銀行	900	1,126.00	1,013,400	
名古屋銀行	2,200	2,651.00	5,832,200	
北洋銀行	40,800	244.00	9,955,200	貸付有価証券 11,100株
愛知銀行	900	2,787.00	2,508,300	
中京銀行	1,000	1,473.00	1,473,000	
大光銀行	900	1,369.00	1,232,100	
愛媛銀行	3,800	818.00	3,108,400	貸付有価証券 100株
トマト銀行	1,000	1,046.00	1,046,000	
京葉銀行	11,500	411.00	4,726,500	貸付有価証券 400株

栃木銀行	13,100	174.00	2,279,400	貸付有価証券 100株
北日本銀行	800	1,722.00	1,377,600	
東和銀行	4,700	551.00	2,589,700	
福島銀行	3,300	221.00	729,300	貸付有価証券 200株
大東銀行	1,500	606.00	909,000	
トモニホールディングス	20,900	297.00	6,207,300	
フィデアホールディングス	28,100	120.00	3,372,000	貸付有価証券 200株
池田泉州ホールディングス	31,000	160.00	4,960,000	貸付有価証券 400株
F P G	9,100	730.00	6,643,000	貸付有価証券 6,300株
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,800	1,445.00	2,601,000	貸付有価証券 700株
マーキュリアインベストメント	1,100	741.00	815,100	
S B Iホールディングス	33,300	2,763.00	92,007,900	貸付有価証券 3,300株
ジャフコ グループ	4,200	7,940.00	33,348,000	貸付有価証券 2,900株
大和証券グループ本社	202,600	629.80	127,597,480	
野村ホールディングス	413,100	601.00	248,273,100	貸付有価証券 46,200株
岡三証券グループ	23,100	435.00	10,048,500	貸付有価証券 200株
丸三証券	8,000	653.00	5,224,000	貸付有価証券 1,200株
東洋証券	9,800	164.00	1,607,200	貸付有価証券 300株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	28,800	407.00	11,721,600	
光世証券	800	661.00	528,800	
水戸証券	7,400	301.00	2,227,400	貸付有価証券 100株
いちよし証券	5,500	604.00	3,322,000	
松井証券	13,200	833.00	10,995,600	
マネックスグループ	24,200	816.00	19,747,200	貸付有価証券 16,900株
極東証券	3,600	816.00	2,937,600	
岩井コスモホールディングス	2,800	1,683.00	4,712,400	貸付有価証券 300株
藍澤証券	4,900	1,090.00	5,341,000	
マネーパートナーズグループ	3,300	236.00	778,800	貸付有価証券 2,100株
スパークス・グループ	12,400	281.00	3,484,400	
小林洋行	1,300	271.00	352,300	
かんぽ生命保険	33,500	2,100.00	70,350,000	貸付有価証券 4,400株
S O M P Oホールディングス	47,700	4,404.00	210,070,800	

アニコム ホールディングス	7,600	963.00	7,318,800	貸付有価証券 400株
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	65,700	3,343.00	219,635,100	
第一生命ホールディングス	143,000	2,233.00	319,319,000	貸付有価証券 2,800株
東京海上ホールディングス	89,100	5,179.00	461,448,900	貸付有価証券 500株
T & Dホールディングス	80,900	1,490.00	120,541,000	貸付有価証券 1,700株
アドバンスクリエイト	1,300	870.00	1,131,000	貸付有価証券 100株
全国保証	7,000	4,505.00	31,535,000	貸付有価証券 400株
ジェイリース	800	1,184.00	947,200	貸付有価証券 400株
イントラスト	1,000	683.00	683,000	
日本モーゲージサービス	1,400	957.00	1,339,800	貸付有価証券 900株
C a s a	1,000	954.00	954,000	貸付有価証券 700株
アルヒ	4,000	1,570.00	6,280,000	貸付有価証券 2,800株
プレミアグループ	1,200	3,240.00	3,888,000	
クレディセゾン	15,800	1,349.00	21,314,200	
芙蓉総合リース	2,800	7,260.00	20,328,000	貸付有価証券 100株
みずほリース	4,200	3,460.00	14,532,000	貸付有価証券 1,900株
東京センチュリー	6,300	6,440.00	40,572,000	貸付有価証券 1,000株
日本証券金融	11,500	892.00	10,258,000	貸付有価証券 100株
アイフル	45,400	361.00	16,389,400	貸付有価証券 2,200株
リコーリース	2,100	3,385.00	7,108,500	貸付有価証券 1,400株
イオンフィナンシャルサービス	16,500	1,273.00	21,004,500	
アコム	54,400	489.00	26,601,600	貸付有価証券 4,700株
ジャックス	3,000	2,506.00	7,518,000	
オリエントコーポレーション	73,300	153.00	11,214,900	貸付有価証券 13,700株
オリックス	164,300	1,931.50	317,345,450	貸付有価証券 104,000株
三菱H C キャピタル	93,600	610.00	57,096,000	
九州リースサービス	1,400	667.00	933,800	貸付有価証券 900株
日本取引所グループ	73,100	2,530.00	184,943,000	
イー・ギャランティ	3,100	2,129.00	6,599,900	貸付有価証券 500株

アサックス	1,400	682.00	954,800	貸付有価証券 600株
NECキャピタルソリューション	1,100	2,039.00	2,242,900	
いちご	30,100	349.00	10,504,900	貸付有価証券 900株
日本駐車場開発	29,600	152.00	4,499,200	貸付有価証券 100株
スター・マイカ・ホールディングス	1,400	1,048.00	1,467,200	貸付有価証券 900株
SREホールディングス	400	5,550.00	2,220,000	貸付有価証券 200株
ADワークスグループ	5,900	162.00	955,800	
ヒューリック	57,400	1,231.00	70,659,400	貸付有価証券 1,600株
三栄建築設計	1,100	1,998.00	2,197,800	
野村不動産ホールディングス	16,400	2,807.00	46,034,800	
三重交通グループホールディングス	5,500	476.00	2,618,000	
サムティ	3,800	1,928.00	7,326,400	
ディア・ライフ	3,500	458.00	1,603,000	
コーセーアールイー	900	651.00	585,900	
日本商業開発	1,700	1,805.00	3,068,500	貸付有価証券 1,100株
プレサンスコーポレーション	4,500	1,668.00	7,506,000	貸付有価証券 900株
THEグローバル社	2,000	245.00	490,000	貸付有価証券 300株
ハウスコム	500	1,186.00	593,000	
日本管理センター	1,500	1,249.00	1,873,500	
サンセイランディック	900	862.00	775,800	貸付有価証券 200株
エストラスト	500	684.00	342,000	
フージャースホールディングス	4,400	735.00	3,234,000	
オープンハウス	8,600	5,090.00	43,774,000	
東急不動産ホールディングス	73,500	650.00	47,775,000	
飯田グループホールディングス	22,600	2,916.00	65,901,600	貸付有価証券 2,700株
イーランド	500	974.00	487,000	
ムゲンエステート	2,000	507.00	1,014,000	
ビーロッド	1,400	651.00	911,400	
ファーストブラザーズ	500	1,005.00	502,500	
ハウスドゥ	1,300	1,045.00	1,358,500	貸付有価証券 300株
シーアールイー	800	1,492.00	1,193,600	貸付有価証券 500株
プロパティエージェント	500	2,220.00	1,110,000	
ケイアイスター不動産	900	4,815.00	4,333,500	
アグレ都市デザイン	600	989.00	593,400	貸付有価証券 300株

グッドコムアセット	1,300	1,359.00	1,766,700	貸付有価証券 700株
ジェイ・エス・ビー	500	3,475.00	1,737,500	
テンポイノベーション	700	855.00	598,500	貸付有価証券 400株
グローバル・リンク・マネジメント	500	852.00	426,000	貸付有価証券 300株
フェイスネットワーク	200	1,328.00	265,600	
パーク24	14,500	2,286.00	33,147,000	
パラカ	700	1,611.00	1,127,700	
三井不動産	123,300	2,549.50	314,353,350	貸付有価証券 5,900株
三菱地所	177,800	1,773.50	315,328,300	
平和不動産	4,600	4,145.00	19,067,000	
東京建物	26,700	1,628.00	43,467,600	
ダイビル	6,900	1,249.00	8,618,100	
京阪神ビルディング	4,700	1,356.00	6,373,200	
住友不動産	60,800	3,639.00	221,251,200	貸付有価証券 500株
テオーシー	5,500	705.00	3,877,500	貸付有価証券 700株
東京楽天地	400	4,005.00	1,602,000	貸付有価証券 200株
スターツコーポレーション	3,200	2,734.00	8,748,800	
フジ住宅	3,100	621.00	1,925,100	
空港施設	2,900	623.00	1,806,700	
明和地所	1,700	613.00	1,042,100	
ゴールドクレスト	2,500	1,736.00	4,340,000	
エスリード	1,100	1,626.00	1,788,600	貸付有価証券 700株
日神グループホールディングス	4,100	462.00	1,894,200	
日本エスコン	4,900	765.00	3,748,500	貸付有価証券 200株
タカラレーベン	11,600	343.00	3,978,800	
A V A N T I A	1,500	888.00	1,332,000	
イオンモール	13,600	1,779.00	24,194,400	
毎日コムネット	900	697.00	627,300	貸付有価証券 600株
ファースト住建	1,200	1,247.00	1,496,400	貸付有価証券 800株
カチタス	6,700	3,055.00	20,468,500	
トーセイ	3,900	1,040.00	4,056,000	
穴吹興産	600	2,173.00	1,303,800	貸付有価証券 400株
サンフロンティア不動産	3,400	922.00	3,134,800	
エフ・ジェー・ネクスト	2,600	1,022.00	2,657,200	
インテリックス	900	782.00	703,800	

ランドビジネス	1,300	368.00	478,400	
サンネクスタグループ	900	1,006.00	905,400	
グランディハウス	2,300	425.00	977,500	
日本空港ビルデング	9,400	4,875.00	45,825,000	貸付有価証券 3,100株
明豊ファシリティワークス	1,300	832.00	1,081,600	
日本工営	1,700	3,155.00	5,363,500	
L I F U L L	8,100	367.00	2,972,700	貸付有価証券 800株
ミクシィ	6,700	2,654.00	17,781,800	貸付有価証券 100株
ジェイエシーリクルートメント	1,800	1,790.00	3,222,000	貸付有価証券 700株
日本M&Aセンター	43,000	2,620.00	112,660,000	貸付有価証券 100株
メンバーズ	800	2,895.00	2,316,000	貸付有価証券 100株
中広	400	356.00	142,400	
UTグループ	3,800	2,969.00	11,282,200	貸付有価証券 2,600株
アイティメディア	900	1,742.00	1,567,800	貸付有価証券 100株
タケエイ	2,900	1,289.00	3,738,100	
E・Jホールディングス	1,200	1,067.00	1,280,400	貸付有価証券 600株
夢真ビーネックスグループ	7,000	1,283.00	8,981,000	貸付有価証券 2,400株
コシダカホールディングス	7,000	637.00	4,459,000	貸付有価証券 3,700株
アルトナー	700	810.00	567,000	
パソナグループ	2,800	1,898.00	5,314,400	貸付有価証券 100株
C D S	700	1,501.00	1,050,700	
リンクアンドモチベーション	4,800	551.00	2,644,800	貸付有価証券 1,100株
G C A	3,400	884.00	3,005,600	
エス・エム・エス	8,900	2,926.00	26,041,400	
サニーサイドアップグループ	1,000	777.00	777,000	
パーソルホールディングス	26,200	2,075.00	54,365,000	
リニカル	1,300	733.00	952,900	貸付有価証券 800株
クックパッド	8,200	256.00	2,099,200	貸付有価証券 3,300株
エスクリ	1,100	447.00	491,700	貸付有価証券 700株
アイ・ケイ・ケイ	1,300	676.00	878,800	
学情	1,000	1,428.00	1,428,000	貸付有価証券 600株
スタジオアリス	1,300	2,237.00	2,908,100	

シミックホールディングス	1,500	1,504.00	2,256,000	
エプロ	700	953.00	667,100	
NJS	600	2,093.00	1,255,800	
総合警備保障	10,400	5,010.00	52,104,000	
カカコム	19,400	3,335.00	64,699,000	貸付有価証券 500株
アイロムグループ	900	2,068.00	1,861,200	貸付有価証券 600株
セントケア・ホールディング	1,900	1,003.00	1,905,700	
サイネックス	500	699.00	349,500	
ルネサンス	1,700	1,212.00	2,060,400	貸付有価証券 1,100株
ディップ	4,100	3,235.00	13,263,500	貸付有価証券 600株
デジタルホールディングス	1,900	2,296.00	4,362,400	貸付有価証券 1,000株
新日本科学	3,200	778.00	2,489,600	貸付有価証券 600株
キャリアデザインセンター	700	1,098.00	768,600	貸付有価証券 400株
ベネフィット・ワン	9,600	3,110.00	29,856,000	貸付有価証券 4,600株
エムスリー	46,300	7,407.00	342,944,100	貸付有価証券 100株
ツカダ・グローバルホールディング	2,300	387.00	890,100	貸付有価証券 1,400株
プラス	400	568.00	227,200	
アウトソーシング	15,000	2,021.00	30,315,000	
ウェルネット	2,500	511.00	1,277,500	貸付有価証券 100株
ワールドホールディングス	900	2,597.00	2,337,300	
ディー・エヌ・エー	11,100	2,194.00	24,353,400	貸付有価証券 900株
博報堂DYホールディングス	36,500	1,813.00	66,174,500	
ぐるなび	4,500	581.00	2,614,500	貸付有価証券 3,100株
タカミヤ	3,200	511.00	1,635,200	
ジャパンベストレスキューシステム	1,800	696.00	1,252,800	
ファンコミュニケーションズ	7,100	384.00	2,726,400	貸付有価証券 100株
ライク	700	2,124.00	1,486,800	貸付有価証券 100株
ビジネス・ブレークスルー	1,100	436.00	479,600	
エスプール	6,700	856.00	5,735,200	
WDBホールディングス	1,200	2,550.00	3,060,000	
手間いらず	300	6,550.00	1,965,000	貸付有価証券 200株
ティア	1,500	472.00	708,000	

C D G	300	1,586.00	475,800	
アドウェイズ	4,300	881.00	3,788,300	貸付有価証券 3,000株
バリューコマース	1,800	3,000.00	5,400,000	貸付有価証券 200株
インフォマート	26,500	920.00	24,380,000	貸付有価証券 600株
J Pホールディングス	7,500	289.00	2,167,500	貸付有価証券 500株
エコナックホールディングス	5,300	89.00	471,700	貸付有価証券 400株
E P Sホールディングス	3,900	1,798.00	7,012,200	
レグス	700	2,533.00	1,773,100	貸付有価証券 400株
プレステージ・インターナショナル	9,800	686.00	6,722,800	
アミューズ	1,500	2,180.00	3,270,000	
ドリームインキュベータ	800	974.00	779,200	
クイック	1,700	1,226.00	2,084,200	
T A C	1,700	243.00	413,100	
電通グループ	29,500	3,760.00	110,920,000	貸付有価証券 1,800株
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,200	794.00	952,800	貸付有価証券 100株
ぴあ	700	3,215.00	2,250,500	貸付有価証券 400株
イオンファンタジー	1,000	2,176.00	2,176,000	貸付有価証券 700株
シーティーエス	3,000	871.00	2,613,000	
ネクシィーズグループ	900	929.00	836,100	
H . U . グループホールディングス	7,300	2,945.00	21,498,500	
アルプス技研	2,300	1,950.00	4,485,000	
サニックス	4,900	334.00	1,636,600	貸付有価証券 3,400株
ダイオーズ	500	990.00	495,000	
日本空調サービス	2,700	730.00	1,971,000	
オリエンタルランド	27,900	16,310.00	455,049,000	
ダスキン	6,100	2,551.00	15,561,100	
明光ネットワークジャパン	3,100	577.00	1,788,700	貸付有価証券 2,200株
ファルコホールディングス	1,200	1,739.00	2,086,800	
秀英予備校	600	400.00	240,000	貸付有価証券 400株
ラウンドワン	9,000	1,496.00	13,464,000	貸付有価証券 200株
リゾートトラスト	12,000	1,729.00	20,748,000	貸付有価証券 700株
ビー・エム・エル	3,400	3,735.00	12,699,000	貸付有価証券 100株

りらいあコミュニケーションズ	4,000	1,208.00	4,832,000	貸付有価証券 300株
リソー教育	13,700	308.00	4,219,600	貸付有価証券 100株
早稲田アカデミー	1,100	901.00	991,100	貸付有価証券 700株
ユー・エス・エス	29,300	1,914.00	56,080,200	
東京個別指導学院	2,300	593.00	1,363,900	
サイバーエージェント	64,600	2,198.00	141,990,800	貸付有価証券 3,000株
楽天グループ	122,300	1,255.00	153,486,500	貸付有価証券 73,000株
クリーク・アンド・リバー社	1,400	1,481.00	2,073,400	貸付有価証券 100株
モーニングスター	3,800	435.00	1,653,000	
テー・オー・ダブリュー	4,400	335.00	1,474,000	貸付有価証券 3,000株
山田コンサルティンググループ	1,600	1,172.00	1,875,200	貸付有価証券 100株
セントラルスポーツ	1,000	2,479.00	2,479,000	
フルキャストホールディングス	2,300	2,059.00	4,735,700	
エン・ジャパン	4,700	3,835.00	18,024,500	
リソルホールディングス	300	4,060.00	1,218,000	
テクノプロ・ホールディングス	5,200	7,860.00	40,872,000	
アトラグループ	700	338.00	236,600	貸付有価証券 400株
インターワークス	500	408.00	204,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	13,800.00	15,180,000	貸付有価証券 200株
Keep Per 技研	1,700	2,308.00	3,923,600	貸付有価証券 500株
ファーストロジック	500	723.00	361,500	
三機サービス	500	1,068.00	534,000	貸付有価証券 300株
Gunosy	1,600	954.00	1,526,400	貸付有価証券 1,100株
デザインワン・ジャパン	700	228.00	159,600	貸付有価証券 200株
イー・ガーディアン	1,100	2,496.00	2,745,600	
リブセンス	1,500	223.00	334,500	貸付有価証券 1,000株
ジャパンマテリアル	8,100	1,259.00	10,197,900	
ベクトル	3,400	911.00	3,097,400	貸付有価証券 800株
ウチヤマホールディングス	1,300	369.00	479,700	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,900	1,152.00	2,188,800	貸付有価証券 600株
キャリアリンク	900	2,240.00	2,016,000	貸付有価証券 600株

I B J	2,100	1,046.00	2,196,600	貸付有価証券 1,400株
アサンテ	900	1,792.00	1,612,800	
バリューHR	1,000	1,657.00	1,657,000	
M & Aキャピタルパートナーズ	2,200	4,625.00	10,175,000	貸付有価証券 200株
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,000	1,456.00	1,456,000	貸付有価証券 500株
E R Iホールディングス	700	587.00	410,900	
アピスト	400	2,910.00	1,164,000	
シグマクシス	1,400	2,047.00	2,865,800	
ウィルグループ	1,900	954.00	1,812,600	貸付有価証券 1,300株
エスクロー・エージェント・ジャパン	3,700	244.00	902,800	貸付有価証券 1,700株
メドピア	2,000	4,695.00	9,390,000	貸付有価証券 1,400株
レアジョブ	500	1,834.00	917,000	貸付有価証券 300株
リクルートホールディングス	187,800	5,555.00	1,043,229,000	
エラン	3,700	1,395.00	5,161,500	
土木管理総合試験所	1,300	383.00	497,900	
ネットマーケティング	1,100	405.00	445,500	貸付有価証券 700株
日本郵政	198,400	910.80	180,702,720	
ベルシステム24ホールディングス	4,400	1,632.00	7,180,800	貸付有価証券 500株
鎌倉新書	2,700	1,220.00	3,294,000	
S M N	600	801.00	480,600	
一蔵	400	425.00	170,000	
グローバルキッズCOMPANY	500	999.00	499,500	
エアトリ	1,600	2,927.00	4,683,200	貸付有価証券 900株
アトラエ	1,800	1,663.00	2,993,400	貸付有価証券 600株
ストライク	1,000	4,200.00	4,200,000	
ソラスト	6,400	1,305.00	8,352,000	
セラク	800	2,121.00	1,696,800	貸付有価証券 500株
インソース	2,500	2,144.00	5,360,000	貸付有価証券 200株
ベイカレント・コンサルティング	1,700	33,400.00	56,780,000	貸付有価証券 100株
Orchestra Holdings	600	2,917.00	1,750,200	
アイモバイル	900	1,379.00	1,241,100	貸付有価証券 400株
キャリアインデックス	1,200	687.00	824,400	貸付有価証券 100株

MS - J a p a n	900	1,074.00	966,600	貸付有価証券 600株
船場	500	828.00	414,000	
グレイステクノロジー	2,700	1,952.00	5,270,400	貸付有価証券 1,800株
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,500	2,296.00	17,220,000	
フルテック	400	1,390.00	556,000	貸付有価証券 100株
グリーンズ	800	576.00	460,800	
ツナググループ・ホールディングス	600	324.00	194,400	貸付有価証券 300株
GameWith	800	610.00	488,000	貸付有価証券 500株
ソウルドアウト	600	1,623.00	973,800	
MS & Consulting	600	615.00	369,000	
ウェルビー	800	1,440.00	1,152,000	貸付有価証券 300株
エル・ティー・エス	300	3,505.00	1,051,500	貸付有価証券 200株
ミダック	600	6,050.00	3,630,000	貸付有価証券 300株
日総工産	2,000	798.00	1,596,000	
キュービーネットホールディングス	1,200	1,800.00	2,160,000	
RPAホールディングス	3,000	734.00	2,202,000	貸付有価証券 900株
スプリックス	700	1,274.00	891,800	
マネジメントソリューションズ	1,300	2,020.00	2,626,000	貸付有価証券 200株
プロレド・パートナーズ	500	2,980.00	1,490,000	貸付有価証券 200株
and factory	600	681.00	408,600	貸付有価証券 300株
テノ・ホールディングス	300	1,156.00	346,800	
フロンティア・マネジメント	600	1,300.00	780,000	貸付有価証券 200株
ピアラ	200	1,125.00	225,000	
コプロ・ホールディングス	400	1,372.00	548,800	貸付有価証券 200株
ギークス	400	1,945.00	778,000	
カーブスホールディングス	7,200	855.00	6,156,000	
フォーラムエンジニアリング	1,800	944.00	1,699,200	貸付有価証券 900株
ダイレクトマーケティングミックス	1,400	3,630.00	5,082,000	貸付有価証券 500株
ポピンズホールディングス	700	4,450.00	3,115,000	
LITALICO	1,100	5,340.00	5,874,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,400	815.00	1,141,000	
リログループ	14,300	2,225.00	31,817,500	

東祥	1,700	1,805.00	3,068,500	貸付有価証券 1,100株
エイチ・アイ・エス	4,100	2,525.00	10,352,500	貸付有価証券 2,800株
ラックランド	700	2,563.00	1,794,100	貸付有価証券 400株
共立メンテナンス	4,300	3,670.00	15,781,000	貸付有価証券 500株
イチネンホールディングス	2,700	1,213.00	3,275,100	
建設技術研究所	1,800	2,498.00	4,496,400	
スペース	1,700	904.00	1,536,800	
長大	1,000	1,987.00	1,987,000	
燦ホールディングス	1,100	1,191.00	1,310,100	
スバル興業	200	8,260.00	1,652,000	貸付有価証券 100株
東京テアトル	1,000	1,260.00	1,260,000	貸付有価証券 100株
タナベ経営	500	1,418.00	709,000	
ナガワ	800	8,360.00	6,688,000	貸付有価証券 500株
東京都競馬	1,700	5,380.00	9,146,000	
常磐興産	1,000	1,420.00	1,420,000	
カナモト	4,600	2,676.00	12,309,600	
西尾レントオール	2,400	3,225.00	7,740,000	
アゴラ ホスピタリティグループ	17,700	24.00	424,800	貸付有価証券 300株
トランス・コスモス	2,500	2,988.00	7,470,000	
乃村工藝社	11,200	886.00	9,923,200	
藤田観光	1,000	2,289.00	2,289,000	貸付有価証券 700株
KNT-CTホールディングス	1,500	1,362.00	2,043,000	貸付有価証券 1,000株
日本管財	2,800	2,351.00	6,582,800	貸付有価証券 600株
トーカイ	2,500	2,402.00	6,005,000	
白洋舎	300	2,337.00	701,100	貸付有価証券 200株
セコム	25,800	8,570.00	221,106,000	
セントラル警備保障	1,300	2,922.00	3,798,600	
丹青社	5,100	855.00	4,360,500	貸付有価証券 800株
メイテック	3,200	6,110.00	19,552,000	
応用地質	3,000	1,265.00	3,795,000	
船井総研ホールディングス	5,400	2,322.00	12,538,800	
進学会ホールディングス	1,000	413.00	413,000	貸付有価証券 700株
オオバ	1,800	779.00	1,402,200	貸付有価証券 1,200株

いであ	700	1,806.00	1,264,200	
学究社	700	1,323.00	926,100	
ベネッセホールディングス	9,600	2,514.00	24,134,400	貸付有価証券 400株
イオンディライト	3,200	3,305.00	10,576,000	
ナック	1,400	913.00	1,278,200	
ダイセキ	4,400	4,145.00	18,238,000	貸付有価証券 100株
ステップ	900	1,576.00	1,418,400	
合 計	28,825,600		72,400,851,110	

(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。

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（2021年 6月 1日から2021年11月30日まで）の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2021年 5月31日現在	当中間計算期間末 2021年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,706,324,590	9,822,506,011
コール・ローン	957,210,910	908,405,154
株式	72,400,851,110	75,193,557,670
派生商品評価勘定	10,179,200	-
未収入金	64,435,700	4,593,400
未収配当金	626,003,355	508,278,633
前払金	-	37,973,200
その他未収収益	9,902,167	17,547,667
流動資産合計	78,774,907,032	86,492,861,735
資産合計		
	78,774,907,032	86,492,861,735
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,044,900	65,835,100
前受金	19,605,000	-
未払金	8,675,900	10,176,000
未払収益分配金	31,818,315	-
未払解約金	140,236,477	247,823,254
未払受託者報酬	9,415,937	10,351,898
未払委託者報酬	46,909,914	51,465,789
未払利息	327	1,013
受入担保金	4,706,324,590	9,822,506,011
その他未払費用	1,555,106	1,700,777
流動負債合計	4,969,586,466	10,209,859,842
負債合計		
	4,969,586,466	10,209,859,842
純資産の部		
元本等		
元本	31,818,315,240	32,504,788,777
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	41,987,005,326	43,778,213,116
（分配準備積立金）	16,244,494,561	14,540,743,864
元本等合計	73,805,320,566	76,283,001,893
純資産合計		
	73,805,320,566	76,283,001,893
負債純資産合計		
	78,774,907,032	86,492,861,735

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2020年 6月 2日 至 2020年12月 1日	当中間計算期間 自 2021年 6月 1日 至 2021年11月30日
営業収益		
受取配当金	605,244,229	748,546,726
有価証券売買等損益	7,361,590,262	173,818,461
派生商品取引等損益	71,278,150	51,581,100
その他収益	17,186,072	34,710,274
営業収益合計	8,055,298,713	905,494,361
営業費用		
支払利息	74,198	53,231
受託者報酬	8,133,115	10,351,898
委託者報酬	40,275,279	51,465,789
その他費用	3,941,918	5,230,696
営業費用合計	52,424,510	67,101,614
営業利益又は営業損失（ ）	8,002,874,203	838,392,747
経常利益又は経常損失（ ）	8,002,874,203	838,392,747
中間純利益又は中間純損失（ ）	8,002,874,203	838,392,747
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	300,934,352	303,023,342
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	26,917,916,540	41,987,005,326
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,151,119,867	5,964,719,307
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,151,119,867	5,964,719,307
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,286,773,634	4,708,880,922
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,286,773,634	4,708,880,922
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	34,484,202,624	43,778,213,116

(3) 【中間注記表】

(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中間計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は中間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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

		前計算期間末 2021年 5月31日現在	当中間計算期間末 2021年11月30日現在
1.	期首元本額	31,461,996,185円	31,818,315,240円
	期中追加設定元本額	7,669,720,398円	4,244,961,749円
	期中一部解約元本額	7,313,401,343円	3,558,488,212円
2.	受益権の総数	31,818,315,240口	32,504,788,777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	930,928,700円	909,859,960円
4.	有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券は次のとおりであります。		
	株式	4,499,684,650円	9,076,714,400円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2020年 6月 2日 至 2020年12月 1日	当中間計算期間 自 2021年 6月 1日 至 2021年11月30日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 2021年 5月31日現在	当中間計算期間末 2021年11月30日現在
中間貸借対照表計上額、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。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末の時価で計上しているため、その差額はありません。
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。	金融商品の時価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。

（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）

前計算期間末（2021年 5月31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	1,421,915,000	-	1,427,090,000	5,175,000
合計		1,421,915,000	-	1,427,090,000	5,175,000

当中間計算期間末（2021年11月30日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,165,483,200	-	1,099,680,000	65,803,200
	合計	1,165,483,200	-	1,099,680,000	65,803,200

(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。

原則として中間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、同中間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。

(1口当たり情報)

前計算期間末 2021年 5月31日現在		当中間計算期間末 2021年11月30日現在	
1口当たり純資産額	2.3196円	1口当たり純資産額	2.3468円
(1万口当たり純資産額)	(23,196円)	(1万口当たり純資産額)	(23,468円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年12月30日現在です。

【年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）】

【純資産額計算書】

資産総額	87,753,048,788円
負債総額	8,612,359,175円
純資産総額（ - ）	79,140,689,613円
発行済口数	32,592,473,707口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4282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わないものとします。

（5）受益権の再分割

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2021年12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12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12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12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	876	261,453
株式投資信託	807	225,128
単位型	303	11,307
追加型	504	213,820
公社債投資信託	69	36,325
単位型	56	2,102
追加型	13	34,223

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

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

(損益計算書関係)

第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

(単位:百万円)

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

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	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		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)		(単位：百万円)	
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	822	賞与引当金	929
投資有価証券評価損	102	投資有価証券評価損	97
関係会社株式評価損	1,430	関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	427	退職給付引当金	446
固定資産減価償却費	96	固定資産減価償却費	90
その他	744	その他	978
繰延税金資産小計	3,624	繰延税金資産小計	3,972
評価性引当金	1,430	評価性引当金	1,430
繰延税金資産合計	2,194	繰延税金資産合計	2,541
繰延税金負債		繰延税金負債	
繰延ヘッジ利益	172	繰延ヘッジ利益	51
繰延税金負債合計	172	その他有価証券評価差額金	645
繰延税金資産の純額	2,022	繰延税金負債合計	696
		繰延税金資産の純額	1,845
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率 (調整)	30.6%	法定実効税率 (調整)	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3%
受取配当金等永久に益金に参入されない項目	9.6%	受取配当金等永久に益金に参入されない項目	5.7%
その他	1.0%	その他	1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.2%

(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ト	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す。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第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す。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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業務の内容及び当該履行業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・ピーティーフワイ・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
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円(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(株式会社日本カストディ銀行)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
株式会社京都銀行	42,103百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社北國銀行	26,673百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業

株式会社りそな銀行	279,928百万円	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。
住友生命保険相互会社	639,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
ソニ - 生命保険株式会社	70,000百万円	
第一生命保険株式会社	60,000百万円	
富国生命保険相互会社	128,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	
信金中央金庫	690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」という名称を使用します。

(2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

(3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。

請求目論見書の入手方法(ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど)についての記載。

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。

- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

ファンドは、大量の解約が発生し、短時間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、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、取引量が限られてしまうリスクがある旨。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性がある旨の記載。

分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記は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7月7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」に掲げられている年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2020年6月2日から2021年5月31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、年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2021年5月31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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年1月12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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2021年6月1日から2021年11月30日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、年金インデックスファンド日本株式（TOPIX連動型）の2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月1日から2021年11月30日まで）の損益の状況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、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、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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

事項の妥当性を評価する。

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

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。