

## 【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4月8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 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	上場インデックスファンドTOPIX
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	30兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町2番1号

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

上場インデックスファンドTOPIX（以下「ファンド」といいます。）

- ・愛称として「上場TOPIX」、「JoJo TOPIX」という名称を用いることがあります。

### （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】

30兆円を上限とします。

### （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】

販売会社は、取得申込者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### （６）【申込単位】

ユニット株式の評価額を取得申込受付日の基準価額で除した口数（100口未満切上げ）を申込単位とし、その整数倍とします。

「ユニット株式」とは、委託会社がTOPIX（東証株価指数）に連動すると想定する、TOPIX（東証株価指数）における各構成銘柄の委託会社が指定する株数の株式すべてを指すものとします。

### （７）【申込期間】

2022年4月9日から2022年10月7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/](http://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】

取得申込者は販売会社の指定する日までに、原則としてその保有する株式をもって取得申込みを行なうものとします。取得申込みに係る株式は、追加設定を行なう日に、販売会社によって、受託会社が指定する株式会社証券保管振替機構のファンドの口座に預託、保管されます(金銭が含まれる場合は、当該金銭については、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】

「( 8 ) 申込取扱場所」に同じです。

( 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

TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行ない、TOPIX(東証株価指数)の計算方法に従ってポートフォリオを構成し、原則としてそれを維持することにより、基準価額が同指数の動きと高位に連動することをめざします。

※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として算出します。算出方法は、基準時を昭和43年(1968年)1月4日(終値)に置き、その日の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

有償増資、新規上場、上場廃止など、市況以外の要因による時価総額の変動に影響されないよう時価総額を修正し、指数の連続性を確保しています。日本の代表的な株価指数として海外でも定着しております。

$$\text{TOPIX} = \frac{\text{算出時の時価総額(円)}}{\text{基準時の時価総額(円)}} \times 100$$

##### 「TOPIX」の著作権などについて

- ・ TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXに係る標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。
- ・ J P Xは、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXに係る標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ・ J P Xは、TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ・ J P Xは、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P Xは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・ 当ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ・ J P Xは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ・ J P Xは、日興アセットマネジメント株式会社または当ファンドの購入者のニーズをTOPIXの指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- ・ 以上の項目に限らず、J P Xは当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

##### 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)	独立区分	補足分類
単位型投信	国内	株式	MMF	インデックス型
		債券		
追加型投信	海外	不動産投信	MRF	特殊型
		その他資産 ( )		
	内外	資産複合	ETF	

(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。

#### ETF

投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。

#### インデックス型

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

## 2) 属性区分

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	
債券 一般	年4回	北米	日経225
公債	年6回 (隔月)	欧州	
社債	年12回	アジア	
その他債券 クレジット属性 ( )	(毎月)	オセアニア	TOPIX
不動産投信	日々	中南米	
その他資産 ( )	その他 ( )	アフリカ 中近東 (中東)	その他 ( )
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

当ファンドは、契約型の投資信託ですが、以下の点で通常の投資信託とは異なる仕組みが採り入れられています。

## 1. 受益権を東京証券取引所に上場しており、取引時間中であればいつでも売買が可能です。

- ・ 売買単位は100口単位です。(有価証券届出書提出日現在)
- ・ 売買手数料は、取扱会社が定めるものによります。
- ・ 取引方法は原則として株式と同様です。

※詳しくは、取扱会社へお問い合わせください。

## 2. 株式をもって受益権の取得申込みを行いません。

ユニット株式の評価額を取得申込受付日の基準価額で除した口数(100口未満切上げ)を申込単位として、その整数倍とします。

※「ユニット株式」とは、委託会社がTOPIX(東証株価指数)に連動すると想定する、TOPIX(東証株価指数)における各構成銘柄の委託会社が指定する株数の株式すべてを指すものとします。

※金融商品取引清算機関による清算制度を利用した取得申込みが可能です。

## 3. 解約請求による途中換金をすることはできません。

## 4. 受益権をもって株式と交換することができます。

※取得申込時に提出されたTOPIX(東証株価指数)構成銘柄と、交換時に取得される各株式は一致するものではありません。

※取得申込時に取得された受益権の口数と、交換時に必要とされる口数は一致するものではありません。

※金融商品取引清算機関による清算制度を利用した交換請求が可能です。

※「金融商品取引清算機関による清算制度」とは、ETFの取得および交換に係る有価証券等の引渡債務を金融商品取引清算機関が引き受けることで、決済履行を保証する制度です。

### 主な投資制限

- ・ 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ・ 投資することを指図する株式は、原則としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- ・ 外貨建資産への投資は行ないません。

### 分配方針

- ・ 信託財産から生ずる配当等収益などから諸経費などを控除後、全額分配することを原則とします。
- ※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

- ・ 30兆円相当額を限度として有価証券または金銭を追加信託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】

2001年12月20日

- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

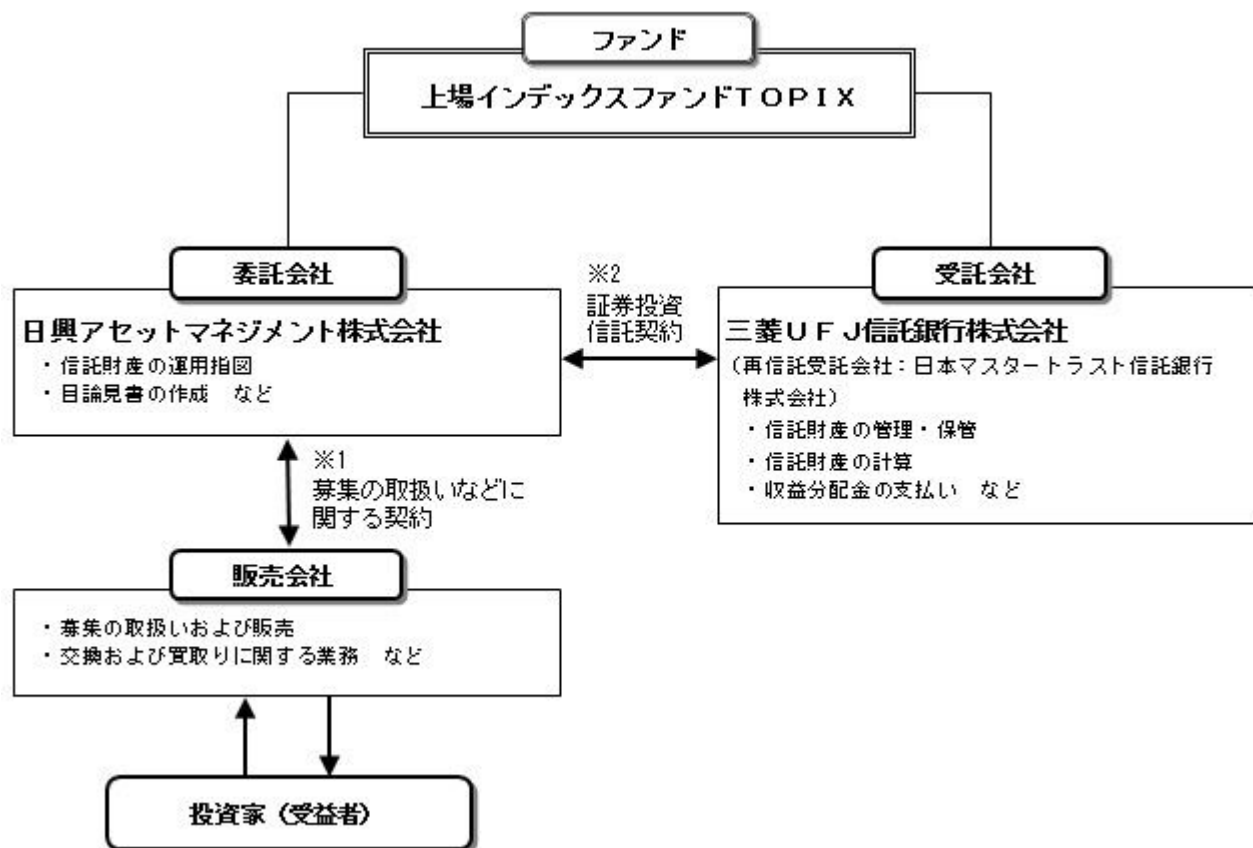
2002年 1月 9日

- ・ ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場



### （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。販売会社が行なう募集の取扱い、交換および買取りに関する業務の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

#### 委託会社の概況（2022年1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】

- ・ T O P I X（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行ない、信託財産中に占める各銘柄の株数の比率を T O P I X（東証株価指数）における個別銘柄の株数の構成比率に相当する比率に維持することを目的とした運用を行ない、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ・ 次に掲げる場合には、信託財産の構成を調整するための指図を行なうことがあります。



TOPIX(東証株価指数)の計算方法が変更された場合

TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の変更または資本異動などにより、TOPIX(東証株価指数)における個別銘柄の時価総額の修正が行なわれた場合

追加信託および受益権と株式との交換の指図を行なう場合

その他連動性を維持するために委託会社が必要と認めた場合

- ・ TOPIX(東証株価指数)への連動率を向上させるため、資金動向に応じて約款に定める有価証券指数等先物取引などを行なう場合があります。
- ・ ファンドが信託を終了することとなった場合は、上記の方針のような運用ができない場合があります。

## (2)【投資対象】

TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の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26条に定めるものに限ります。)

3) 金銭債権

主として株式に投資するほか、次に掲げる株式以外の有価証券(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。 )および金融商品(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) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。 )

3) 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。 )

4) コール・ローン

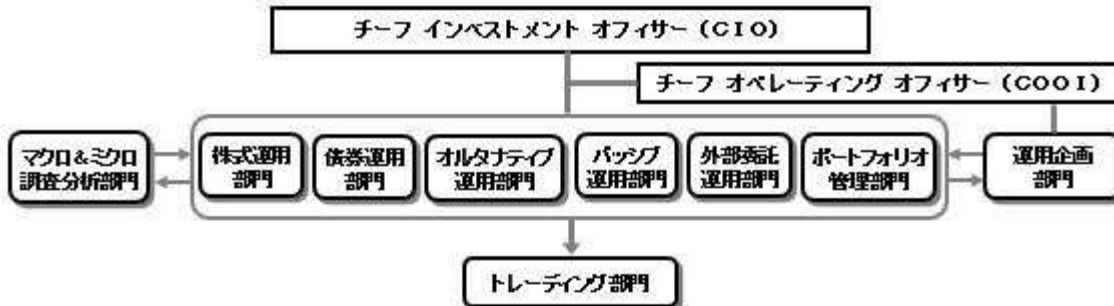
次の取引ができます。

1) 先物取引等

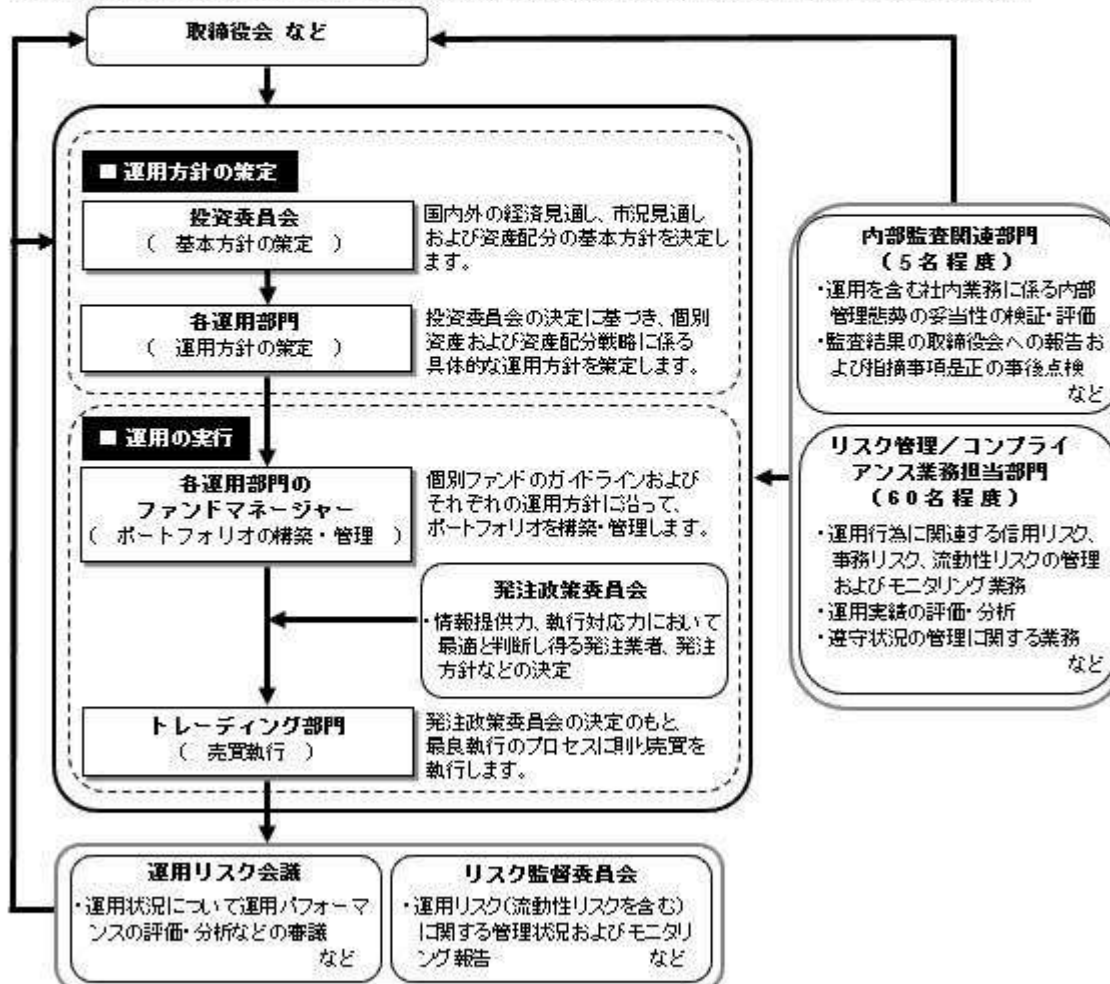
2) 有価証券の貸付

## (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。



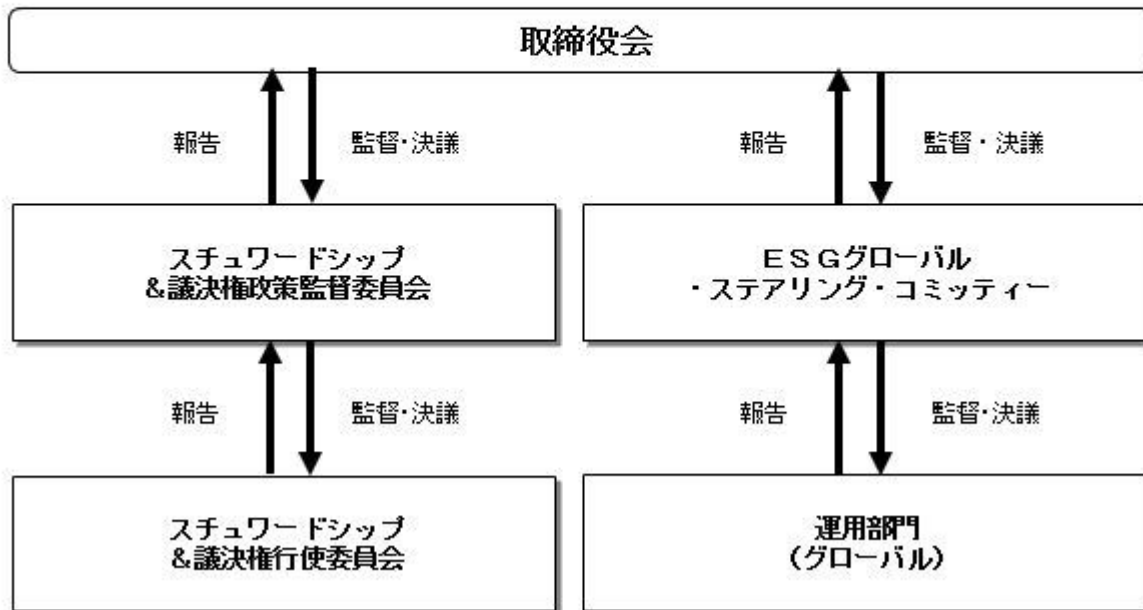
## 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「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・デューティー

ESG（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行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2022年1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

- 1) 信託財産から生ずる配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。）と前期から繰り越した分配準備積立金は、毎計算期末において諸経費、約款に定める報酬および当該報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、前期から繰り越した負数の分配準備積立金があるときはその全額を補てんした後、その残額を受益者に分配します。ただし、収益分配金額の調整のためその一部または全部を信託財産内に留保したときは分配準備積立金として積み立て、次期以降の分配に充てることができます。なお、諸経費、約款に定める報酬および当該報酬に係る消費税等に相当する金額ならびに負数の分配準備積立金を控除しきれないときは、その差額を負数の分配準備積立金として次期に繰り越します。
- 2) 毎計算期末に信託財産から生じたイ)に掲げる利益の合計額は、ロ)に掲げる損失を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を補てんした後、次期に繰り越します。
  - イ) 有価証券売買益（評価益を含む）、先物取引等取引益（評価益を含む）、追加信託差益金、交換差益金
  - ロ) 有価証券売買損（評価損を含む）、先物取引等取引損（評価損を含む）、追加信託差損金、交換差損金

## 収益分配金の支払い

原則として受託会社が、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、受益者があらかじめ指定した預金口座などに振り込みます。なお、受益者が取扱会社と別途収益分配金の取扱いに係る契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとします。

## (5) 【投資制限】

## 約款に定める投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式は、原則としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限り

ではありません。

- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) わが国の金融商品取引所における東証株価指数先物取引および東証株価指数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東証株価指数先物取引および東証株価指数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。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式の貸付の指図をすることができます。株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- 6) 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。
- 7) 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。

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

#### 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) と基準価額の主なカイ離要因 >

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

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

#### 金融商品取引所で取引される市場価格と基準価額のカイ離

当ファンドは東京証券取引所に上場され公に取引されますが、市場価格は、主に当ファンドの需要、当ファンドの運用成果および投資者が代替的な投資と比較して当ファンドが全般的にどの程度魅力的であるか、などの評価に左右されます。したがって、当ファンドの市場価格が、基準価額を下回って取引されるかまたは上回って取引されるかは予測することはできません。

#### < 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・交換の取り扱いを停止することもあります。

- ・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・交換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・交換の取り扱いを停止する場合があります。

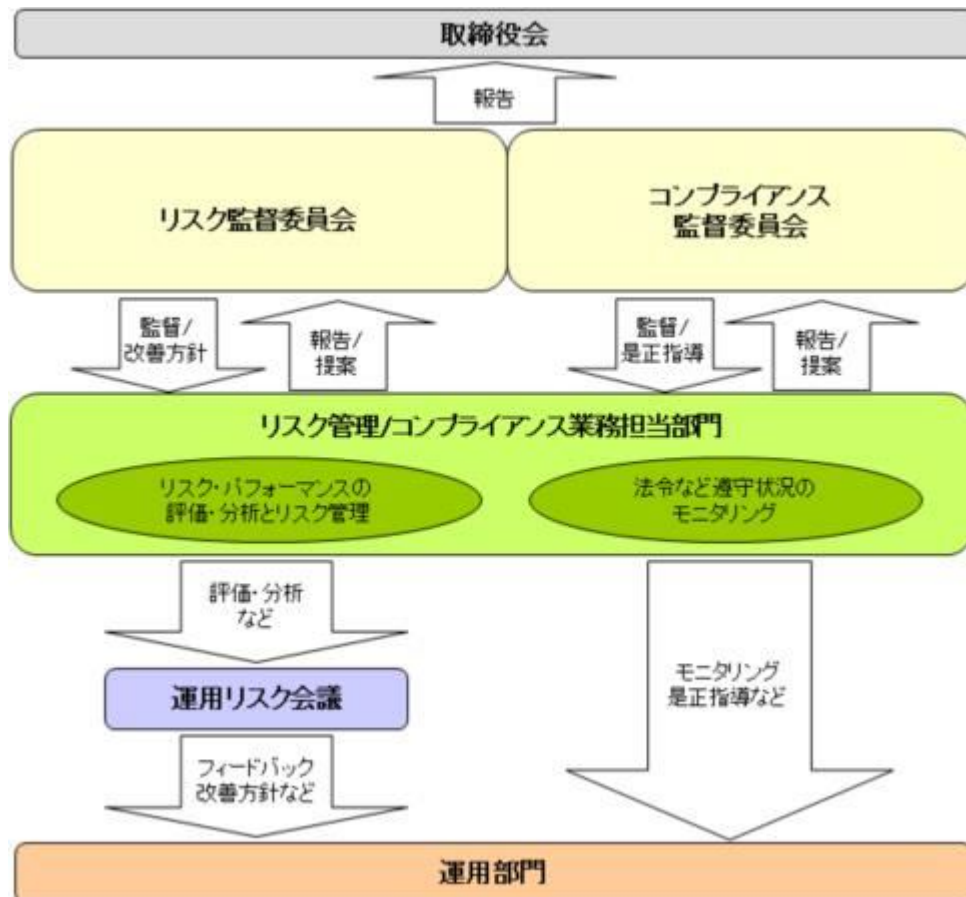
- ・ 運用制限や規制上の制限に関する事項

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カイ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（流動性リスクを含む）、市場リスク、カウンターパーティーリスク、オペレーショナルリスク（事務リスクを含む）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

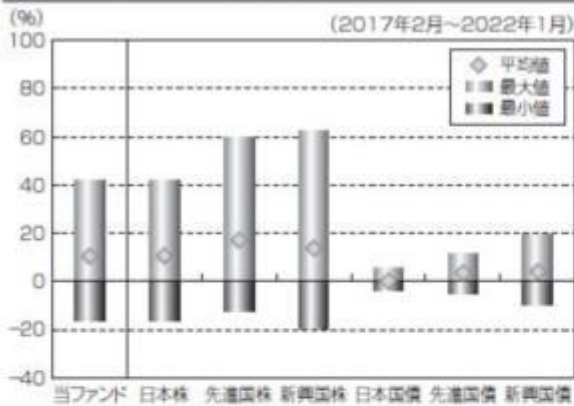
ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

### 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2022年1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%	17.1%	13.7%	0.1%	3.5%	4.0%
最大値	42.0%	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%	-5.4%	-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2月から2022年1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)

※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株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

**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 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。

**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100口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2017年2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。

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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



**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】**

販売会社は、取得申込者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

**(2)【換金（解約）手数料】**

換金手数料

販売会社は、受益者が交換を行なうときおよび受益権の買取りを行なうときは、当該受益者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金手数料は、換金時の事務手続きなどに係る対価です。

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0.242%（税抜0.22%）以内（有価証券届出書提出日現在、年0.0968%（税抜0.088%））の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

当ファンドの信託報酬が税抜0.088%（有価証券届出書提出日現在）の場合の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率		
合計	委託会社	受託会社
0.088%	0.060%	0.028%

委託会社	委託した資金の運用の対価
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。

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用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賃料に0.55（税抜0.5）以内（有価証券届出書提出日現在、0.55（税抜0.5））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1：1とし、信託報酬と同時期に支払います。

受益権の上場に係る費用ならびに「TOPIX（東証株価指数）」その他これに類する標章の使用料。

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、特定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。

個人受益者の場合

### 1) 受益権の売却時の課税

売却時の差益（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。

### 2) 収益分配金の受取り時の課税

収益分配金は配当所得として、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。

確定申告等により、売却時の差損（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、売却時の差益（譲渡益）、収益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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 3) 受益権と現物株式との交換

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

法人受益者の場合

### 1) 受益権の売却時の課税

受益権の売却価額と取得価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されます。

### 2) 収益分配金の受取り時の課税

・収益分配金は配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれ、他の法人所得と合算して課税されます。

・収益分配金は、原則として益金不算入の対象となります。

### 3) 受益権と現物株式との交換

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

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4月8日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

### 【上場インデックスファンドTOPIX】

以下の運用状況は2022年 1月31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	7,313,079,311,530	99.68
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		23,445,411,776	0.32
合計（純資産総額）		7,336,524,723,306	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	23,427,490,000	0.32

(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	142,924,100	1,939.62	277,219,182,173	2,245.50	320,936,066,550	4.37
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	17,675,900	11,071.75	195,703,203,266	12,720.00	224,837,448,000	3.06
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,556,700	57,644.84	147,380,580,460	58,230.00	148,876,641,000	2.03
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	174,531,000	589.19	102,833,438,447	691.10	120,618,374,100	1.64
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	20,799,900	5,733.63	119,258,966,384	5,595.00	116,375,440,500	1.59
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,790,400	46,580.92	83,398,489,322	54,730.00	97,988,592,000	1.34
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	28,965,400	2,857.60	82,771,598,690	3,267.00	94,629,961,800	1.29
日本	株式	信越化学工業	化学	4,745,100	18,082.59	85,803,721,182	19,040.00	90,346,704,000	1.23
日本	株式	任天堂	その他製品	1,592,800	62,639.92	99,772,875,160	56,160.00	89,451,648,000	1.22
日本	株式	ダイキン工業	機械	3,594,800	22,114.40	79,496,847,856	23,825.00	85,646,110,000	1.17
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	16,602,900	7,320.78	121,546,328,534	5,011.00	83,197,131,900	1.13
日本	株式	HOYA	精密機器	5,505,800	15,086.50	83,063,302,098	14,755.00	81,238,079,000	1.11

日本	株式	三菱商事	卸売業	20,824,500	3,179.22	66,205,699,750	3,877.00	80,736,586,500	1.10
日本	株式	日立製作所	電気機器	13,571,200	6,483.83	87,993,456,391	5,939.00	80,599,356,800	1.10
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	19,263,600	3,755.92	72,352,610,779	4,113.00	79,231,186,800	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	22,216,100	3,465.81	76,996,854,159	3,354.00	74,512,799,400	1.02
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	22,177,500	3,635.80	80,632,994,110	3,328.00	73,806,720,000	1.01
日本	株式	日本電産	電気機器	7,313,100	12,812.77	93,701,081,202	10,090.00	73,789,179,000	1.01
日本	株式	KDDI	情報・通信業	20,185,300	3,471.23	70,067,836,108	3,645.00	73,575,418,500	1.00
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	19,437,700	3,196.34	62,129,520,328	3,667.00	71,278,045,900	0.97
日本	株式	村田製作所	電気機器	8,288,500	8,935.51	74,062,026,828	8,539.00	70,775,501,500	0.96
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	3,186,000	16,123.09	51,368,185,660	19,880.00	63,337,680,000	0.86
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	9,165,400	5,141.67	47,125,498,508	6,830.00	62,599,682,000	0.85
日本	株式	三井物産	卸売業	21,581,200	2,530.97	54,621,373,396	2,853.50	61,581,954,200	0.84
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	10,871,700	5,115.43	55,613,470,736	5,593.00	60,805,418,100	0.83
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	41,936,800	1,490.18	62,493,413,838	1,434.00	60,137,371,200	0.82
日本	株式	第一三共	医薬品	22,173,600	2,295.81	50,906,572,110	2,565.00	56,875,284,000	0.78
日本	株式	ファナック	電気機器	2,476,300	26,473.52	65,556,382,878	22,460.00	55,617,698,000	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	35,591,300	1,558.30	55,461,948,706	1,550.00	55,166,515,000	0.75
日本	株式	デンソー	輸送用機器	6,212,400	7,433.80	46,181,768,460	8,494.00	52,768,125,600	0.72

#### 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	0.28
		建設業	2.27
		食料品	3.37
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.22
		化学	6.69
		医薬品	4.75
		石油・石炭製品	0.43
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.61
		機械	5.38
		電気機器	18.24
		輸送用機器	8.69
精密機器	2.69		
その他製品	2.30		

	電気・ガス業	1.12
	陸運業	2.99
	海運業	0.55
	空運業	0.40
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	7.83
	卸売業	5.55
	小売業	4.22
	銀行業	5.32
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	2.25
	その他金融業	1.19
	不動産業	1.95
	サービス業	5.82
合 計		99.68

## 【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	1,234	日本円	24,190,154,200	23,427,490,000	0.32

(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）		東京証券取引所 取引価格（円）
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き	
第11計算期間末 (2012年 7月 8日)	378,397	384,822	768.54	781.59	769
第12計算期間末 (2013年 7月 8日)	602,953	612,496	1,173.87	1,192.45	1,174
第13計算期間末 (2014年 7月 8日)	790,486	803,304	1,280.23	1,300.99	1,281
第14計算期間末 (2015年 7月 8日)	1,238,974	1,255,990	1,593.91	1,615.80	1,595
第15計算期間末 (2016年 7月 8日)	1,149,571	1,173,804	1,217.26	1,242.92	1,216
第16計算期間末 (2017年 7月 8日)	2,366,170	2,403,721	1,624.47	1,650.25	1,624
第17計算期間末 (2018年 7月 8日)	3,351,921	3,413,173	1,712.85	1,744.15	1,713
第18計算期間末 (2019年 7月 8日)	4,151,311	4,238,348	1,601.15	1,634.72	1,602
第19計算期間末 (2020年 7月 8日)	5,396,794	5,507,352	1,586.45	1,618.95	1,586

第20計算期間末 (2021年 7月 8日)	7,326,730	7,463,287	1,959.42	1,995.94	1,963
2021年 1月末日	6,764,775		1,860.24		1,860
2月末日	7,015,200		1,918.04		1,916
3月末日	7,542,273		2,027.25		2,031
4月末日	7,309,193		1,969.77		1,968
5月末日	7,433,923		1,996.67		1,998
6月末日	7,553,824		2,020.15		2,022
7月末日	7,269,426		1,939.82		1,940
8月末日	7,478,998		2,001.03		2,001
9月末日	7,875,096		2,087.98		2,087
10月末日	7,820,206		2,058.16		2,059
11月末日	7,431,912		1,983.49		1,980.5
12月末日	7,668,650		2,052.12		2,053
2022年 1月末日	7,336,524		1,952.81		1,952

(注) 計算期間末が東京証券取引所の休業日にあたる場合、東京証券取引所取引価格は直前営業日の終値を表示しています。

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第11期	2011年 7月 9日 ~ 2012年 7月 8日	13.0500
第12期	2012年 7月 9日 ~ 2013年 7月 8日	18.5800
第13期	2013年 7月 9日 ~ 2014年 7月 8日	20.7600
第14期	2014年 7月 9日 ~ 2015年 7月 8日	21.8900
第15期	2015年 7月 9日 ~ 2016年 7月 8日	25.6600
第16期	2016年 7月 9日 ~ 2017年 7月 8日	25.7800
第17期	2017年 7月 9日 ~ 2018年 7月 8日	31.3000
第18期	2018年 7月 9日 ~ 2019年 7月 8日	33.5700
第19期	2019年 7月 9日 ~ 2020年 7月 8日	32.5000
第20期	2020年 7月 9日 ~ 2021年 7月 8日	36.5200
当中間期	2021年 7月 9日 ~ 2022年 1月 8日	

#### 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第11期	2011年 7月 9日 ~ 2012年 7月 8日	9.71
第12期	2012年 7月 9日 ~ 2013年 7月 8日	55.16
第13期	2013年 7月 9日 ~ 2014年 7月 8日	10.83
第14期	2014年 7月 9日 ~ 2015年 7月 8日	26.21
第15期	2015年 7月 9日 ~ 2016年 7月 8日	22.02
第16期	2016年 7月 9日 ~ 2017年 7月 8日	35.57
第17期	2017年 7月 9日 ~ 2018年 7月 8日	7.37

第18期	2018年 7月 9日～2019年 7月 8日	4.56
第19期	2019年 7月 9日～2020年 7月 8日	1.11
第20期	2020年 7月 9日～2021年 7月 8日	25.81
当中間期	2021年 7月 9日～2022年 1月 8日	4.90

(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11期	2011年 7月 9日～2012年 7月 8日	263,649,600	71,312,149
第12期	2012年 7月 9日～2013年 7月 8日	199,396,100	178,109,648
第13期	2013年 7月 9日～2014年 7月 8日	216,920,100	113,108,630
第14期	2014年 7月 9日～2015年 7月 8日	337,726,500	177,866,039
第15期	2015年 7月 9日～2016年 7月 8日	240,119,800	73,043,677
第16期	2016年 7月 9日～2017年 7月 8日	757,397,200	245,213,668
第17期	2017年 7月 9日～2018年 7月 8日	658,406,900	158,062,049
第18期	2018年 7月 9日～2019年 7月 8日	730,718,600	94,941,417
第19期	2019年 7月 9日～2020年 7月 8日	898,361,100	89,264,353
第20期	2020年 7月 9日～2021年 7月 8日	463,665,200	126,225,665
当中間期	2021年 7月 9日～2022年 1月 8日	125,694,100	125,990,887

(注)解約口数は交換口数を表示しております。

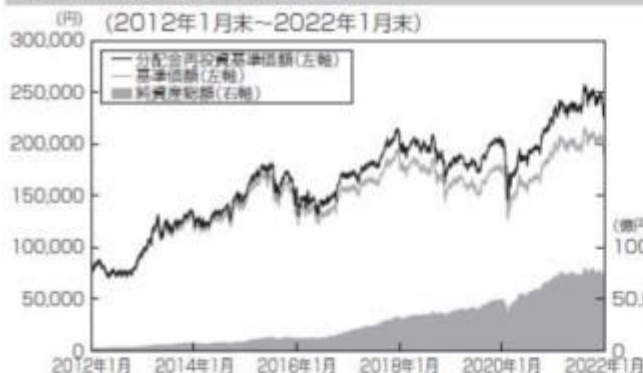
#### 参考情報



## 運用実績

2022年1月31日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額……………195,281円

純資産総額……………7兆3,365億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の100口当たりの値です。  
 ※分配金再投資基準価額は、2012年1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ことにご留意ください。

## 分配の推移(税引前、100口当たり)

2017年7月	2018年7月	2019年7月	2020年7月	2021年7月	設定来累計
2,578円	3,130円	3,357円	3,250円	3,652円	42,418円

## 主要な資産の状況

## &lt;資産構成比率&gt;

組入資産	比率
株式	100.00%
うち先物	0.32%
現金その他	0.32%

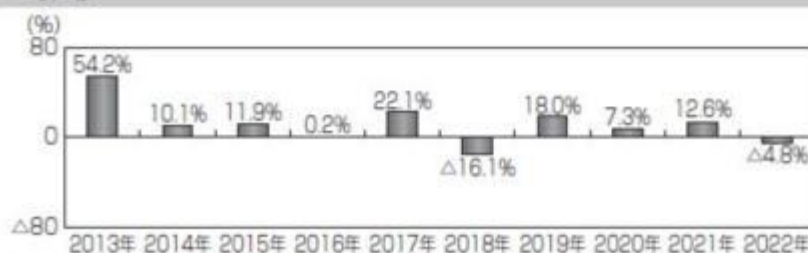
※対純資産総額比です。

## &lt;組入上位10銘柄&gt;

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	4.37%
2 ソニーグループ	電気機器	3.06%
3 キーエンス	電気機器	2.03%
4 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.64%
5 リクルートホールディングス	サービス業	1.59%
6 東京エレクトロン	電気機器	1.34%
7 日本電信電話	情報・通信業	1.29%
8 信越化学工業	化学	1.23%
9 任天堂	その他製品	1.22%
10 ダイキン工業	機械	1.17%

※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。

※2022年は、2022年1月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## (1) 申込方法

- 取得申込者は、販売会社所定の方法により、その保有する株式をもって取得の申込みを行なうものとし、当該株式は、TOPIX(東証株価指数)における各構成銘柄の株式の数の構成比率に相当するものとして委託会社が定める比率により構成される各銘柄の株式とします。申込時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとし、
- なお、拠出された株式の評価額が、取得する受益権口数の評価額(取得申込受益権口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額)に満たない場合、その差額に相当する部分に限り金銭をもって充当する

ことができます。また取得申込者が、T O P I X (東証株価指数) に採用されている銘柄の株式の発行会社またはその子会社(会社法第2条第3号に規定する子会社をいいます。当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。)である場合には、取得申込みに係る株式のうち当該発行会社等の株式の評価額に相当する部分に限り金銭をもって充当することができます。

- ・当ファンドは、東京証券取引所に上場しております。委託会社は、当該金融商品取引所が定める諸規則などを遵守し、当該金融商品取引所が諸規則などに基づいて行なう売買取引の停止または上場廃止その他の措置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。ただし、取得申込者がT O P I X (東証株価指数) に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合の受付締切時間は午後2時までとします。なお、販売会社によっては、取得の申込みの受付締切時間および受付方法が異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(4) 取得申込日が次に該当することとなる場合には、取得の申込みの受付は行ないません。

- 1) T O P I X (東証株価指数) 構成銘柄の権利落日(配当落日を除きます。)の前営業日以降の3営業日間
- 2) T O P I X (東証株価指数) 構成銘柄の変更および増減資などに伴う株数の変更日の3営業日前以降の6営業日間
- 3) ファンドの計算期間終了日(決算日)の2営業日前以降の2営業日間(ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の3営業日前以降の3営業日間)
- 4) ファンドが信託を終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
- 5) 1)~4)のほか、委託会社が約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

(5) 申込単位

ユニット株式の評価額を取得申込受付日の基準価額で除した口数(100口未満切上げ)を申込単位とし、その整数倍とします。

(6) 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】

(1) 受益権の解約

受益者は、信託期間中において解約の請求をすることはできません。

(2) 受益権と信託財産に属する株式との交換

受益者は、委託会社が指定する販売会社に対し、最小交換請求口数の整数倍の受益権をもって、当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式と交換すること(以下「交換」といいます。)を請求することができます。最小交換請求口数とは、当該口数に交換請求日の基準価額を乗じて得た額が、交換請求日において委託会社がT O P I X (東証株価指数) に連動すると想定する、T O P I X (東証株価指数) における各構成銘柄の評価額の合計に相当する口数として委託会社が定める口数とします。

受益者が交換によって取得できる個別銘柄の株数は、交換請求日の基準価額に基づいて計算された株数とし、金融商品取引所が定める一売買単位(以下「取引所売買単位」といいます。)の整数倍とします。

交換請求日の午後3時までに委託会社に交換請求をして受理されたものを、当日の受付分として取り扱います。ただし、受益者がT O P I X (東証株価指数) に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合の受付締切時間は午後2時までとします。なお、販売会社によっては、交換請求の受付締切時間および受付方法が異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

受益者は交換時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。

交換請求日が次に該当することとなる場合には、交換請求の受付は行ないません。

- 1) T O P I X（東証株価指数）構成銘柄の権利落日（配当落日を除きます。）の前営業日以降の3営業日間
- 2) T O P I X（東証株価指数）構成銘柄の変更および増減資などに伴う株数の変更日の3営業日前以降の6営業日間
- 3) ファンドの計算期間終了日（決算日）の2営業日前以降の2営業日間（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の3営業日前以降の3営業日間）
- 4) ファンドが信託を終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
- 5) 1)～4)のほか、委託会社が約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

交換請求を行なった受益者が交換に係る株式の発行会社等である場合には、委託会社は、交換請求を受け付けた口数から当該発行会社等の株式の評価額の合計に相当する金額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる株式（当該発行会社等の株式を除きます。）を交換するものとして扱います。

受益者への交換株式の交付に際しては、原則として交換請求日から起算して3営業日目から、振替機関等の口座に交換の請求を行なった受益者に係る株数の増加の記載または記録が行なわれます。

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、約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合は、交換請求の受付を中止すること、および既に受け付けた交換請求の受付を取り消すことができます。

交換請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に交換請求を受け付けたものとして取り扱います。

### （3）受益権の買取り

受益者は、保有する受益権口数の合計が金融商品取引所の定める受益権の取引単位に満たない場合は、委託会社が指定する販売会社に当該受益権の買取りを請求することができます。

原則として、午後3時までに委託会社が指定する販売会社において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。受益権の買取り価格は、買取り約定日の基準価額とします。

受益者は買取り時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。

委託会社が指定する販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて買取りを中止すること、および既に受け付けた買取りを取り消すことができます。

買取り請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取り請求を受け付けたものとして取り扱います。

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは100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/](http://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（2001年12月20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7月9日から翌年7月8日までとします。

#### (5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、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。
- 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。）に異議を述べるすることができます。（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) 受益権の口数が300万口を下回ることとなった場合
  - ロ) 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合



ハ) TOPIX（東証株価指数）が廃止された場合

ニ) TOPIX（東証株価指数）の計算方法の変更などに伴って委託会社または受託会社が必要と認めた信託約款の変更が、異議申立の結果、行なわれないこととなった場合

ホ) 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

ヘ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ト) 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。）

チ) 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。

#### 信託約款の変更

1) 委託会社は、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。

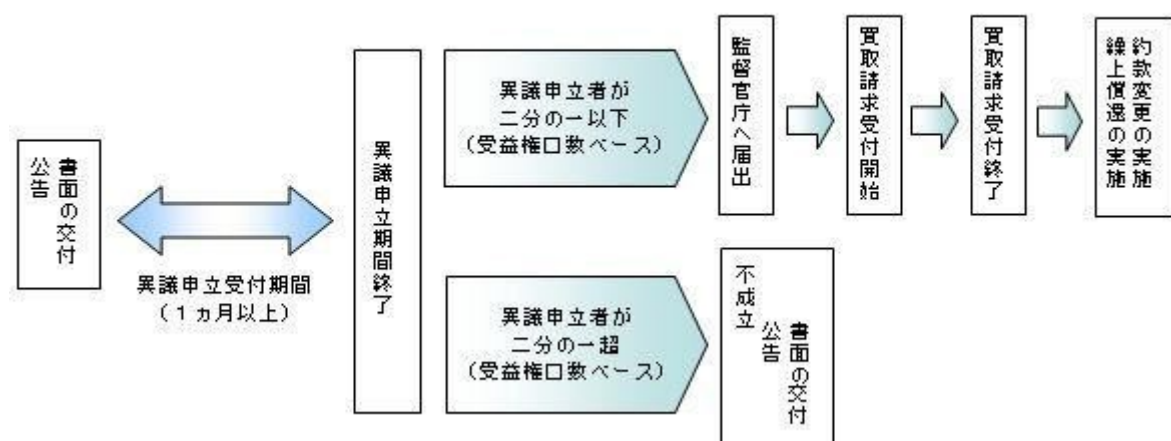
#### 異議の申立て

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ないません。

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

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。

#### 信託終了時の交換等

1) ファンドが信託を終了することとなる場合は、交換に必要な受益権口数を有する受益者に対しては、信託終了時における当該受益権の信託財産に対する持分に相当する株式を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権と引き換えに交換するものとします。

2) 交換は、委託会社の指定する販売会社で取り扱うものとします。

- 3) 受益者が取得する個別銘柄の株数は、償還価額に基づいて計算された株数とし、取引所売買単位の整数倍とします。
- 4) 受益者は交換時において、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。
- 5) 受益者がTOPIX(東証株価指数)構成銘柄である株式の発行会社等である場合は、当該発行会社等の株式の評価額の合計に相当する受益権について金銭をもって返還するものとします。
- 6) 交換に必要な受益権口数を有しない受益者は、償還価額をもって委託会社が指定する販売会社を買取請求を行なうものとします。この場合、受益者は販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を支払うものとします。
- 7) 受益者が、株式の交換および買取りに係る金銭の返還について、信託終了日から10年間請求をしないときは、その権利を失い、委託会社に帰属します。

#### 運用報告書の作成

投資信託及び投資法人に関する法律により、運用報告書の作成・交付は行ないません。

#### 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) 収益分配金受領権

- ・名義登録手続きによって受益者を確定し、当該受益者に対して収益分配金の支払いを行ないません。当ファンドの収益分配金は、計算期間終了日現在において、受託会社に名義登録している受益者に支払われます。受益者は、取扱会社を経由して名義登録を行なうことができます。
- ・計算期間終了日現在において、氏名または名称および住所が受託会社に登録されている受益者は、ファンドの収益分配金を登録されている受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・計算期間終了日現在において、受益証券の所持者であっても、受託会社に名義登録されていない受益者は、収益分配金の受領権を有しません。
- ・ただし、受益者が収益分配金について支払開始日から5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) 受益権と信託財産に属する株式との交換権

- ・受益者は、一定口数以上の受益権をもって、その持分に相当する信託財産に属する株式と交換することを請求できます。
- ・ただし、受益者が信託の終了による株式の交換および買取りに係る金銭の返還について、信託終了日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、委託会社に帰属します。

### (3) 受益権の買取請求権

受益者が保有する受益権の口数の合計が、金融商品取引所の定める受益権の取引単位に満たない場合は、販売会社に対して、受益権の買取りを請求することができます。

### (4) 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20期計算期間（2020年7月9日から2021年7月8日まで）の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】



## 【上場インデックスファンドTOPIX】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 2020年 7月 8日現在	第20期 2021年 7月 8日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	585,147,874,715	793,181,358,574
コール・ローン	52,622,201,269	65,310,122,994
株式	5,382,406,775,600	7,307,719,405,270
未収入金	69,823,608,150	89,125,181,980
未収配当金	6,549,006,426	8,875,490,976
前払金	1,084,405,100	662,984,600
その他未収収益	2,022,266,492	561,000,504
流動資産合計	6,099,656,137,752	8,265,435,544,898
<b>資産合計</b>		
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	389,000,400	383,239,650
未払金	1,222,103,100	934,521,200
未払収益分配金	110,558,351,735	136,556,861,213
未払受託者報酬	1,749,136,519	2,365,847,546
未払委託者報酬	3,385,671,144	4,712,782,060
未払利息	27,623	46,110
受入担保金	585,147,874,715	793,181,358,574
その他未払費用	409,379,294	570,574,733
流動負債合計	702,861,544,530	938,705,231,086
<b>負債合計</b>		
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	3,391,590,051,686	3,728,017,268,081
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,005,204,541,536	3,598,713,045,731
（分配準備積立金）	44,620,102	71,220,111
元本等合計	5,396,794,593,222	7,326,730,313,812
<b>純資産合計</b>		
負債純資産合計	6,099,656,137,752	8,265,435,544,898

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期		第20期	
	自	2019年 7月 9日 至 2020年 7月 8日	自	2020年 7月 9日 至 2021年 7月 8日
営業収益				
受取配当金		110,730,763,018		137,398,497,567
受取利息		26,416		26,946
有価証券売買等損益		5,859,535,538		1,319,515,964,848
派生商品取引等損益		6,681,006,960		7,603,927,850
その他収益		6,478,656,679		8,393,144,584
営業収益合計		118,030,917,535		1,472,911,561,795
営業費用				
支払利息		8,400,431		4,966,627
受託者報酬		1,749,136,519		2,365,847,546
委託者報酬		3,385,671,144		4,712,782,060
その他費用		1,504,567,462		2,124,611,642
営業費用合計		6,647,775,556		9,208,207,875
営業利益又は営業損失（ ）		111,383,141,979		1,463,703,353,920
経常利益又は経常損失（ ）		111,383,141,979		1,463,703,353,920
当期純利益又は当期純損失（ ）		111,383,141,979		1,463,703,353,920
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		-		-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,566,390,527,920		2,005,204,541,536
剰余金増加額又は欠損金減少額		484,376,687,231		378,608,770,343
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		484,376,687,231		378,608,770,343
剰余金減少額又は欠損金増加額		46,387,463,859		112,246,758,855
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		46,387,463,859		112,246,758,855
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		110,558,351,735		136,556,861,213
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,005,204,541,536		3,598,713,045,731

## (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>

## (貸借対照表に関する注記)

		第19期 2020年 7月 8日現在	第20期 2021年 7月 8日現在
1.	期首元本額	2,584,920,594,927円	3,391,590,051,686円
	期中追加設定元本額	895,666,016,700円	462,274,204,400円
	期中一部交換元本額	88,996,559,941円	125,846,988,005円
2.	受益権の総数	3,401,795,438口	3,739,234,973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	23,571,002,310円	30,968,574,040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	549,199,426,950円	740,913,762,170円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2019年 7月 9日 至 2020年 7月 8日		第20期 自 2020年 7月 9日 至 2021年 7月 8日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	当期配当等収益額 117,201,045,682円	A	当期配当等収益額 145,786,702,470円
B	分配準備積立金 41,301,280円	B	分配準備積立金 44,620,102円

C 配当等収益額合計 (A+B)	117,242,346,962円	C 配当等収益額合計 (A+B)	145,831,322,572円
D 経費	6,639,375,125円	D 経費	9,203,241,248円
E 収益分配可能額 (C-D)	110,602,971,837円	E 収益分配可能額 (C-D)	136,628,081,324円
F 収益分配金額	110,558,351,735円	F 収益分配金額	136,556,861,213円
G 次期繰越金 (分配準備積立金) (E-F)	44,620,102円	G 次期繰越金 (分配準備積立金) (E-F)	71,220,111円
H 口数	3,401,795,438口	H 口数	3,739,234,973口
I 分配金額 (100口当たり)	3,250円	I 分配金額 (100口当たり)	3,652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19期 自 2019年 7月 9日 至 2020年 7月 8日	第20期 自 2020年 7月 9日 至 2021年 7月 8日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引等があり、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19期 2020年 7月 8日現在	第20期 2021年 7月 8日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引	(1)有価証券  同左  (2)デリバティブ取引

	「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左 (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19期(2020年7月8日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	6,597,103,305
合計	6,597,103,305

第20期(2021年7月8日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,226,038,000,867
合計	1,226,038,000,867

## (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19期(2020年7月8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	14,791,050,000	-	14,402,560,000	388,490,000

合計	14,791,050,000	-	14,402,560,000	388,490,000
----	----------------	---	----------------	-------------

第20期(2021年7月8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	19,419,804,600	-	19,037,110,000	382,694,600
合計		19,419,804,600	-	19,037,110,000	382,694,600

(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19期 2020年7月8日現在		第20期 2021年7月8日現在	
1口当たり純資産額	1,586.45円	1口当たり純資産額	1,959.42円
(100口当たり純資産額)	(158,645円)	(100口当たり純資産額)	(195,942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	122,300	2,878.00	351,979,400	貸付有価証券 2,100株
日本水産	3,497,100	521.00	1,821,989,100	

マルハニチロ	589,400	2,349.00	1,384,500,600	貸付有価証券 41,900株
雪国まいたけ	309,300	1,660.00	513,438,000	貸付有価証券 116,000株
カネコ種苗	114,000	1,445.00	164,730,000	貸付有価証券 1,700株
サカタのタネ	449,000	3,695.00	1,659,055,000	貸付有価証券 59,400株
ホクト	315,900	1,918.00	605,896,200	貸付有価証券 221,100株
ホクリヨウ	58,300	821.00	47,864,300	貸付有価証券 400株
住石ホールディングス	659,200	125.00	82,400,000	貸付有価証券 190,200株
日鉄鉱業	86,300	5,750.00	496,225,000	貸付有価証券 900株
三井松島ホールディングス	157,500	985.00	155,137,500	
I N P E X	13,850,000	791.00	10,955,350,000	貸付有価証券 8,420,600株
石油資源開発	492,100	1,879.00	924,655,900	貸付有価証券 200株
K & O エナジーグループ	182,800	1,319.00	241,113,200	貸付有価証券 4,400株
ヒノキヤグループ	93,500	2,340.00	218,790,000	貸付有価証券 22,000株
ショーボンドホールディングス	537,400	4,715.00	2,533,841,000	貸付有価証券 79,700株
ミライト・ホールディングス	1,305,800	2,055.00	2,683,419,000	
タマホーム	228,300	2,285.00	521,665,500	貸付有価証券 132,900株
サンヨーホームズ	43,500	725.00	31,537,500	貸付有価証券 1,000株
日本アクア	149,600	525.00	78,540,000	貸付有価証券 48,000株
ファーストコーポレーション	115,000	772.00	88,780,000	貸付有価証券 2,900株
ベステラ	72,400	1,498.00	108,455,200	貸付有価証券 200株
Robot Home	706,100	230.00	162,403,000	貸付有価証券 421,600株
キャンディル	64,700	584.00	37,784,800	貸付有価証券 9,000株
スペースバリューホールディングス	459,200	731.00	335,675,200	貸付有価証券 33,600株
ダイセキ環境ソリューション	72,500	1,155.00	83,737,500	貸付有価証券 2,800株
第一カッター興業	93,000	1,353.00	125,829,000	貸付有価証券 1,500株
安藤・間	2,414,900	842.00	2,033,345,800	
東急建設	1,103,100	790.00	871,449,000	貸付有価証券 35,400株



コムシスホールディングス	1,335,400	3,010.00	4,019,554,000	
ビーアールホールディングス	503,700	467.00	235,227,900	貸付有価証券 168,900株
高松コンストラクショングループ	234,300	2,006.00	470,005,800	
東建コーポレーション	116,000	10,330.00	1,198,280,000	貸付有価証券 22,200株
ソネック	38,800	1,000.00	38,800,000	貸付有価証券 27,300株
ヤマウラ	163,500	901.00	147,313,500	貸付有価証券 28,300株
オリエンタル白石	1,265,900	280.00	354,452,000	貸付有価証券 65,500株
大成建設	2,706,700	3,690.00	9,987,723,000	貸付有価証券 83,300株
大林組	8,697,300	893.00	7,766,688,900	貸付有価証券 492,200株
清水建設	8,147,100	867.00	7,063,535,700	貸付有価証券 1,112,800株
飛島建設	249,400	1,065.00	265,611,000	貸付有価証券 9,200株
長谷工コーポレーション	2,848,900	1,473.00	4,196,429,700	
松井建設	342,300	729.00	249,536,700	貸付有価証券 14,300株
銭高組	38,000	4,010.00	152,380,000	貸付有価証券 400株
鹿島建設	6,372,600	1,414.00	9,010,856,400	貸付有価証券 662,900株
不動テトラ	213,000	1,824.00	388,512,000	貸付有価証券 14,000株
大末建設	109,700	985.00	108,054,500	貸付有価証券 5,600株
鉄建建設	175,400	1,846.00	323,788,400	貸付有価証券 2,100株
西松建設	622,200	3,515.00	2,187,033,000	貸付有価証券 88,600株
三井住友建設	2,101,000	482.00	1,012,682,000	
大豊建設	190,500	4,150.00	790,575,000	貸付有価証券 133,300株
前田建設工業	2,178,300	947.00	2,062,850,100	貸付有価証券 1,535,500株
佐田建設	200,400	487.00	97,594,800	貸付有価証券 5,600株
ナカノフドー建設	207,900	412.00	85,654,800	貸付有価証券 51,500株
奥村組	478,200	2,897.00	1,385,345,400	貸付有価証券 16,400株
東鉄工業	373,000	2,286.00	852,678,000	
イチケン	62,700	1,833.00	114,929,100	貸付有価証券 1,000株
富士ピー・エス	112,100	551.00	61,767,100	貸付有価証券 16,100株

浅沼組	104,300	4,605.00	480,301,500	貸付有価証券 2,600株
戸田建設	3,611,700	742.00	2,679,881,400	貸付有価証券 1,090,000株
熊谷組	403,000	2,808.00	1,131,624,000	貸付有価証券 1,100株
北野建設	53,000	2,324.00	123,172,000	貸付有価証券 4,300株
植木組	76,900	1,441.00	110,812,900	貸付有価証券 3,400株
矢作建設工業	384,100	725.00	278,472,500	貸付有価証券 15,600株
ピーエス三菱	286,200	604.00	172,864,800	貸付有価証券 1,900株
日本ハウスホールディングス	593,700	398.00	236,292,600	貸付有価証券 6,800株
大東建託	949,400	12,410.00	11,782,054,000	貸付有価証券 117,500株
新日本建設	369,800	829.00	306,564,200	貸付有価証券 25,000株
N I P P O	719,600	3,120.00	2,245,152,000	貸付有価証券 9,400株
東亜道路工業	53,900	4,560.00	245,784,000	
前田道路	537,400	2,151.00	1,155,947,400	貸付有価証券 378,300株
日本道路	84,000	7,940.00	666,960,000	貸付有価証券 1,100株
東亜建設工業	232,400	2,481.00	576,584,400	貸付有価証券 163,800株
日本国土開発	846,000	573.00	484,758,000	貸付有価証券 42,500株
若築建設	156,300	1,660.00	259,458,000	貸付有価証券 5,800株
東洋建設	975,100	575.00	560,682,500	貸付有価証券 1,800株
五洋建設	3,693,900	761.00	2,811,057,900	貸付有価証券 116,800株
世紀東急工業	417,600	861.00	359,553,600	貸付有価証券 700株
福田組	100,600	4,860.00	488,916,000	貸付有価証券 4,200株
住友林業	2,045,800	2,006.00	4,103,874,800	貸付有価証券 602,800株
日本基礎技術	265,600	533.00	141,564,800	貸付有価証券 46,800株
巴コーポレーション	386,100	369.00	142,470,900	貸付有価証券 9,200株
大和ハウス工業	8,031,000	3,356.00	26,952,036,000	貸付有価証券 62,100株
ライト工業	497,700	1,854.00	922,735,800	
積水ハウス	9,432,400	2,238.50	21,114,427,400	貸付有価証券 6,683,100株

日特建設	215,500	766.00	165,073,000	貸付有価証券 12,200株
北陸電気工事	150,500	1,237.00	186,168,500	貸付有価証券 9,500株
ユアテック	497,500	719.00	357,702,500	貸付有価証券 9,400株
日本リーテック	182,000	1,634.00	297,388,000	貸付有価証券 18,300株
四電工	47,200	2,980.00	140,656,000	貸付有価証券 1,300株
中電工	400,500	2,275.00	911,137,500	貸付有価証券 15,000株
関電工	1,414,100	869.00	1,228,852,900	
きんでん	1,766,300	1,801.00	3,181,106,300	
東京エネシス	288,800	941.00	271,760,800	貸付有価証券 14,300株
トーエネック	87,400	3,590.00	313,766,000	貸付有価証券 1,800株
住友電設	245,500	2,254.00	553,357,000	貸付有価証券 3,900株
日本電設工業	476,900	1,866.00	889,895,400	貸付有価証券 26,100株
協和エクシオ	1,318,700	2,699.00	3,559,171,300	
新日本空調	230,000	2,009.00	462,070,000	貸付有価証券 107,700株
九電工	610,200	3,540.00	2,160,108,000	貸付有価証券 85,500株
三機工業	616,500	1,440.00	887,760,000	貸付有価証券 2,900株
日揮ホールディングス	2,901,500	1,008.00	2,924,712,000	貸付有価証券 108,000株
中外炉工業	94,000	1,917.00	180,198,000	貸付有価証券 2,400株
ヤマト	278,200	791.00	220,056,200	貸付有価証券 700株
太平電業	192,700	2,619.00	504,681,300	貸付有価証券 27,800株
高砂熱学工業	786,200	1,868.00	1,468,621,600	貸付有価証券 1,800株
三晃金属工業	34,100	2,371.00	80,851,100	貸付有価証券 500株
朝日工業社	64,400	3,155.00	203,182,000	貸付有価証券 1,200株
明星工業	562,400	738.00	415,051,200	貸付有価証券 4,400株
大気社	422,900	3,250.00	1,374,425,000	貸付有価証券 26,300株
ダイダシ	192,900	2,576.00	496,910,400	貸付有価証券 5,800株
日比谷総合設備	279,900	1,785.00	499,621,500	貸付有価証券 8,800株

フィル・カンパニー	49,700	2,560.00	127,232,000	貸付有価証券 17,100株
テスホールディングス	158,500	1,935.00	306,697,500	貸付有価証券 49,700株
東洋エンジニアリング	365,200	702.00	256,370,400	貸付有価証券 147,400株
レイズネクスト	466,400	1,137.00	530,296,800	貸付有価証券 11,100株
ニッポン	814,400	1,567.00	1,276,164,800	貸付有価証券 273,200株
日清製粉グループ本社	3,144,700	1,637.00	5,147,873,900	貸付有価証券 184,700株
日東富士製粉	20,200	6,940.00	140,188,000	貸付有価証券 100株
昭和産業	234,200	2,997.00	701,897,400	貸付有価証券 14,800株
鳥越製粉	246,600	775.00	191,115,000	貸付有価証券 400株
中部飼料	339,900	1,134.00	385,446,600	貸付有価証券 1,700株
フィード・ワン	373,900	720.00	269,208,000	貸付有価証券 14,100株
東洋精糖	47,000	1,190.00	55,930,000	貸付有価証券 400株
日本甜菜製糖	145,100	1,625.00	235,787,500	貸付有価証券 4,000株
D M三井製糖ホールディングス	219,500	1,830.00	401,685,000	貸付有価証券 600株
塩水港精糖	331,600	221.00	73,283,600	貸付有価証券 100株
日新製糖	131,800	1,690.00	222,742,000	貸付有価証券 300株
森永製菓	653,200	3,605.00	2,354,786,000	貸付有価証券 104,300株
中村屋	66,900	3,775.00	252,547,500	貸付有価証券 900株
江崎グリコ	766,400	4,160.00	3,188,224,000	貸付有価証券 171,100株
名糖産業	122,600	1,589.00	194,811,400	貸付有価証券 700株
井村屋グループ	157,700	2,300.00	362,710,000	貸付有価証券 3,000株
不二家	177,600	2,221.00	394,449,600	貸付有価証券 15,300株
山崎製パン	2,086,400	1,535.00	3,202,624,000	貸付有価証券 236,200株
第一屋製パン	53,700	940.00	50,478,000	貸付有価証券 3,100株
モロゾフ	44,200	5,350.00	236,470,000	貸付有価証券 31,100株
亀田製菓	158,500	4,550.00	721,175,000	貸付有価証券 20,100株

寿スピリッツ	268,000	7,520.00	2,015,360,000	貸付有価証券 188,500株
カルビー	1,268,500	2,561.00	3,248,628,500	貸付有価証券 19,900株
森永乳業	514,900	5,710.00	2,940,079,000	貸付有価証券 77,900株
六甲バター	184,700	1,559.00	287,947,300	
ヤクルト本社	1,914,600	6,300.00	12,061,980,000	貸付有価証券 108,200株
明治ホールディングス	1,840,500	6,690.00	12,312,945,000	貸付有価証券 267,900株
雪印メグミルク	670,100	2,057.00	1,378,395,700	貸付有価証券 37,000株
プリマハム	391,500	2,963.00	1,160,014,500	貸付有価証券 100,300株
日本ハム	1,063,800	4,240.00	4,510,512,000	貸付有価証券 131,100株
林兼産業	92,100	585.00	53,878,500	貸付有価証券 5,300株
丸大食品	273,900	1,697.00	464,808,300	貸付有価証券 15,400株
S Foods	250,100	3,265.00	816,576,500	貸付有価証券 5,100株
柿安本店	96,500	2,480.00	239,320,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	1,792,200	714.00	1,279,630,800	貸付有価証券 500株
サッポロホールディングス	949,800	2,301.00	2,185,489,800	貸付有価証券 127,000株
アサヒグループホールディングス	6,081,000	5,145.00	31,286,745,000	貸付有価証券 3,123,000株
キリンホールディングス	11,804,700	2,091.00	24,683,627,700	貸付有価証券 4,435,900株
宝ホールディングス	2,063,400	1,347.00	2,779,399,800	
オエノンホールディングス	790,600	369.00	291,731,400	貸付有価証券 3,800株
養命酒製造	85,200	1,802.00	153,530,400	貸付有価証券 1,500株
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	2,131,200	1,738.00	3,704,025,600	貸付有価証券 114,400株
サントリー食品インターナショナル	1,862,400	4,170.00	7,766,208,000	貸付有価証券 713,800株
ダイドーグループホールディングス	156,900	5,000.00	784,500,000	貸付有価証券 111,200株
伊藤園	845,000	6,610.00	5,585,450,000	貸付有価証券 382,900株
キーコーヒー	273,500	2,154.00	589,119,000	貸付有価証券 14,100株
ユニカフェ	83,500	995.00	83,082,500	貸付有価証券 56,700株
ジャパンフーズ	39,500	1,214.00	47,953,000	
日清オイリオグループ	348,400	3,070.00	1,069,588,000	

不二製油グループ本社	678,600	2,506.00	1,700,571,600	貸付有価証券 98,400株
かどや製油	30,400	4,050.00	123,120,000	貸付有価証券 200株
J - オイルミルズ	259,700	1,870.00	485,639,000	貸付有価証券 19,500株
キッコーマン	2,003,300	6,870.00	13,762,671,000	貸付有価証券 77,400株
味の素	6,619,700	2,807.00	18,581,497,900	貸付有価証券 293,600株
ブルドックソース	126,200	2,332.00	294,298,400	貸付有価証券 81,000株
キューピー	1,549,800	2,464.00	3,818,707,200	貸付有価証券 201,000株
ハウス食品グループ本社	1,041,000	3,400.00	3,539,400,000	貸付有価証券 61,100株
カゴメ	1,137,500	2,867.00	3,261,212,500	貸付有価証券 283,500株
焼津水産化学工業	134,900	951.00	128,289,900	貸付有価証券 1,500株
アリアケジャパン	254,200	6,970.00	1,771,774,000	貸付有価証券 11,600株
ピエトロ	36,400	1,722.00	62,680,800	貸付有価証券 25,600株
エバラ食品工業	60,800	2,598.00	157,958,400	貸付有価証券 2,900株
やまみ	30,000	1,927.00	57,810,000	貸付有価証券 100株
ニチレイ	1,326,000	2,916.00	3,866,616,000	
東洋水産	1,432,100	4,170.00	5,971,857,000	
イトアンドホールディングス	96,200	1,910.00	183,742,000	貸付有価証券 67,900株
大冷	31,000	2,005.00	62,155,000	貸付有価証券 21,600株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	155,600	780.00	121,368,000	貸付有価証券 79,300株
日清食品ホールディングス	1,092,100	7,760.00	8,474,696,000	貸付有価証券 59,600株
永谷園ホールディングス	135,900	2,140.00	290,826,000	貸付有価証券 1,500株
一正蒲鉾	108,000	915.00	98,820,000	
フジッコ	301,300	1,915.00	576,989,500	貸付有価証券 18,500株
ロック・フィールド	299,900	1,497.00	448,950,300	貸付有価証券 212,500株
日本たばこ産業	14,924,400	2,080.50	31,050,214,200	貸付有価証券 3,920,700株
ケンコーマヨネーズ	170,200	1,550.00	263,810,000	貸付有価証券 7,300株
わらべや日洋ホールディングス	182,100	2,275.00	414,277,500	貸付有価証券 116,500株

なとり	155,300	1,905.00	295,846,500	貸付有価証券 3,200株
イフジ産業	43,100	948.00	40,858,800	貸付有価証券 500株
ピククルスコーポレーション	66,400	3,335.00	221,444,000	貸付有価証券 2,600株
ファーマフーズ	262,700	2,858.00	750,796,600	貸付有価証券 186,000株
北の達人コーポレーション	971,800	470.00	456,746,000	貸付有価証券 523,300株
ユーグレナ	1,417,600	1,054.00	1,494,150,400	貸付有価証券 992,300株
紀文食品	162,100	1,305.00	211,540,500	貸付有価証券 100,200株
ミヨシ油脂	97,600	1,257.00	122,683,200	
理研ビタミン	262,800	1,569.00	412,333,200	貸付有価証券 14,600株
片倉工業	363,800	1,462.00	531,875,600	貸付有価証券 254,600株
ゲンゼ	199,300	4,570.00	910,801,000	貸付有価証券 23,000株
東洋紡	1,073,500	1,293.00	1,388,035,500	貸付有価証券 34,400株
ユニチカ	795,700	332.00	264,172,400	貸付有価証券 39,100株
富士紡ホールディングス	131,200	3,775.00	495,280,000	貸付有価証券 1,600株
倉敷紡績	232,300	1,928.00	447,874,400	貸付有価証券 33,100株
シキボウ	152,600	923.00	140,849,800	貸付有価証券 69,800株
日本毛織	893,500	961.00	858,653,500	貸付有価証券 1,900株
ダイトウボウ	439,000	103.00	45,217,000	貸付有価証券 294,200株
トーア紡コーポレーション	107,800	439.00	47,324,200	貸付有価証券 2,600株
ダイドーリミテッド	356,900	175.00	62,457,500	貸付有価証券 247,100株
帝国繊維	306,600	2,030.00	622,398,000	貸付有価証券 16,500株
帝人	2,556,700	1,628.00	4,162,307,600	貸付有価証券 96,400株
東レ	19,666,400	713.60	14,033,943,040	貸付有価証券 2,329,500株
サカイオーベックス	72,000	2,981.00	214,632,000	貸付有価証券 100株
住江織物	59,500	2,028.00	120,666,000	貸付有価証券 1,800株
日本フェルト	153,700	442.00	67,935,400	貸付有価証券 4,900株

イチカワ	35,300	1,348.00	47,584,400	貸付有価証券 13,400株
日東製網	29,200	1,524.00	44,500,800	貸付有価証券 1,600株
アツギ	208,800	612.00	127,785,600	貸付有価証券 15,200株
ダイニック	102,500	743.00	76,157,500	貸付有価証券 3,100株
セーレン	667,800	2,139.00	1,428,424,200	貸付有価証券 465,300株
ソトー	108,000	799.00	86,292,000	
東海染工	34,200	1,133.00	38,748,600	貸付有価証券 500株
小松マテーレ	445,700	901.00	401,575,700	貸付有価証券 13,700株
ワコールホールディングス	677,700	2,500.00	1,694,250,000	貸付有価証券 57,500株
ホギメディカル	365,800	3,410.00	1,247,378,000	貸付有価証券 28,100株
クラウディアホールディングス	66,700	291.00	19,409,700	貸付有価証券 40,200株
T S Iホールディングス	824,700	368.00	303,489,600	貸付有価証券 2,500株
マツオカコーポレーション	86,800	1,612.00	139,921,600	貸付有価証券 33,500株
ワールド	355,300	1,432.00	508,789,600	貸付有価証券 17,200株
三陽商会	141,300	1,080.00	152,604,000	貸付有価証券 50,600株
ナイガイ	99,100	337.00	33,396,700	貸付有価証券 9,100株
オンワードホールディングス	1,631,600	337.00	549,849,200	貸付有価証券 1,142,100株
ルックホールディングス	92,900	1,439.00	133,683,100	貸付有価証券 8,100株
キムラタン	1,518,300	23.00	34,920,900	貸付有価証券 6,000株
ゴールドウイン	449,400	6,200.00	2,786,280,000	貸付有価証券 63,200株
デサント	463,600	2,977.00	1,380,137,200	貸付有価証券 128,700株
キング	144,000	484.00	69,696,000	貸付有価証券 3,000株
ヤマトインターナショナル	238,500	335.00	79,897,500	貸付有価証券 166,900株
特種東海製紙	166,800	4,315.00	719,742,000	貸付有価証券 5,700株
王子ホールディングス	12,227,700	630.00	7,703,451,000	貸付有価証券 694,000株
日本製紙	1,201,200	1,235.00	1,483,482,000	貸付有価証券 840,800株



三菱製紙	385,200	347.00	133,664,400	貸付有価証券 22,700株
北越コーポレーション	1,942,900	594.00	1,154,082,600	貸付有価証券 568,700株
中越パルプ工業	103,500	1,248.00	129,168,000	貸付有価証券 100株
巴川製紙所	89,500	792.00	70,884,000	
大王製紙	1,309,700	1,788.00	2,341,743,600	貸付有価証券 22,700株
阿波製紙	70,000	412.00	28,840,000	貸付有価証券 200株
レンゴー	2,800,600	903.00	2,528,941,800	貸付有価証券 612,100株
トーモク	166,500	1,924.00	320,346,000	貸付有価証券 40,400株
ザ・パック	205,600	2,646.00	544,017,600	貸付有価証券 8,800株
クラレ	4,277,700	995.00	4,256,311,500	貸付有価証券 2,714,000株
旭化成	18,003,200	1,177.50	21,198,768,000	貸付有価証券 70,600株
共和レザー	147,700	699.00	103,242,300	貸付有価証券 7,600株
昭和電工	2,062,500	3,135.00	6,465,937,500	貸付有価証券 1,443,700株
住友化学	21,380,900	557.00	11,909,161,300	貸付有価証券 524,100株
住友精化	132,300	3,625.00	479,587,500	貸付有価証券 600株
日産化学	1,487,900	5,230.00	7,781,717,000	貸付有価証券 9,600株
ラサ工業	88,900	1,790.00	159,131,000	貸付有価証券 17,500株
クレハ	232,900	6,440.00	1,499,876,000	貸付有価証券 6,400株
多木化学	105,900	5,130.00	543,267,000	貸付有価証券 37,000株
テイカ	199,200	1,273.00	253,581,600	貸付有価証券 700株
石原産業	486,800	1,109.00	539,861,200	貸付有価証券 3,900株
片倉コープアグリ	70,000	1,220.00	85,400,000	貸付有価証券 200株
日本曹達	379,600	3,145.00	1,193,842,000	貸付有価証券 14,800株
東ソー	4,198,500	1,954.00	8,203,869,000	貸付有価証券 186,500株
トクヤマ	806,900	2,219.00	1,790,511,100	貸付有価証券 90,800株
セントラル硝子	518,000	2,107.00	1,091,426,000	貸付有価証券 55,900株

東亜合成	1,657,000	1,122.00	1,859,154,000	貸付有価証券 13,600株
大阪ソーダ	276,200	2,398.00	662,327,600	貸付有価証券 1,300株
関東電化工業	644,100	985.00	634,438,500	貸付有価証券 76,200株
デンカ	991,200	3,660.00	3,627,792,000	貸付有価証券 107,100株
信越化学工業	5,022,500	18,015.00	90,480,337,500	貸付有価証券 15,200株
日本カーバイド工業	99,800	1,272.00	126,945,600	貸付有価証券 9,300株
堺化学工業	190,300	1,838.00	349,771,400	貸付有価証券 23,700株
第一稀元素化学工業	273,100	1,770.00	483,387,000	貸付有価証券 101,900株
エア・ウォーター	2,769,500	1,638.00	4,536,441,000	貸付有価証券 1,500株
日本酸素ホールディングス	2,237,400	2,269.00	5,076,660,600	
日本化学工業	76,800	3,055.00	234,624,000	
東邦アセチレン	40,700	1,181.00	48,066,700	
日本パーカラライジング	1,370,100	1,098.00	1,504,369,800	貸付有価証券 68,000株
高圧ガス工業	430,700	654.00	281,677,800	貸付有価証券 16,200株
チタン工業	33,900	1,844.00	62,511,600	貸付有価証券 2,500株
四国化成工業	360,900	1,252.00	451,846,800	貸付有価証券 17,400株
戸田工業	57,800	2,680.00	154,904,000	貸付有価証券 6,600株
ステラ ケミファ	147,900	2,806.00	415,007,400	貸付有価証券 11,800株
保土谷化学工業	79,700	3,860.00	307,642,000	
日本触媒	491,800	5,220.00	2,567,196,000	貸付有価証券 17,000株
大日精化工業	224,400	2,235.00	501,534,000	貸付有価証券 2,200株
カネカ	702,600	4,480.00	3,147,648,000	貸付有価証券 5,600株
三菱瓦斯化学	2,721,000	2,259.00	6,146,739,000	貸付有価証券 1,200株
三井化学	2,344,500	3,565.00	8,358,142,500	貸付有価証券 139,700株
J S R	2,725,800	3,425.00	9,335,865,000	貸付有価証券 279,900株
東京応化工業	466,000	6,800.00	3,168,800,000	貸付有価証券 2,600株
大阪有機化学工業	250,800	3,650.00	915,420,000	貸付有価証券 61,400株
三菱ケミカルホールディングス	18,157,100	916.70	16,644,613,570	

KHネオケム	447,800	2,509.00	1,123,530,200	貸付有価証券 6,800株
ダイセル	3,651,800	922.00	3,366,959,600	貸付有価証券 29,700株
住友ベークライト	427,000	4,805.00	2,051,735,000	貸付有価証券 36,100株
積水化学工業	5,683,700	1,896.00	10,776,295,200	貸付有価証券 1,170,500株
日本ゼオン	2,449,500	1,426.00	3,492,987,000	貸付有価証券 220,100株
アイカ工業	756,600	3,835.00	2,901,561,000	貸付有価証券 23,100株
宇部興産	1,371,600	2,191.00	3,005,175,600	貸付有価証券 111,000株
積水樹脂	410,200	2,151.00	882,340,200	貸付有価証券 2,000株
タキロンシーアイ	587,700	595.00	349,681,500	貸付有価証券 4,100株
旭有機材	153,400	1,324.00	203,101,600	
ニチバン	142,900	1,713.00	244,787,700	貸付有価証券 13,500株
リケンテクノス	662,500	566.00	374,975,000	貸付有価証券 16,400株
大倉工業	128,300	2,398.00	307,663,400	貸付有価証券 2,100株
積水化成成品工業	364,100	595.00	216,639,500	貸付有価証券 36,900株
群栄化学工業	62,000	2,425.00	150,350,000	貸付有価証券 2,000株
タイガースポリマー	142,900	457.00	65,305,300	貸付有価証券 9,100株
ミライアル	87,100	1,265.00	110,181,500	貸付有価証券 5,600株
ダイキアクシス	103,800	836.00	86,776,800	貸付有価証券 600株
ダイキョーニシカワ	572,700	686.00	392,872,200	貸付有価証券 70,700株
竹本容器	97,100	988.00	95,934,800	貸付有価証券 68,300株
森六ホールディングス	146,000	2,215.00	323,390,000	貸付有価証券 6,500株
恵和	53,000	3,450.00	182,850,000	貸付有価証券 6,000株
日本化薬	1,681,200	1,070.00	1,798,884,000	
カーリットホールディングス	269,200	725.00	195,170,000	貸付有価証券 7,000株
日本精化	196,600	1,565.00	307,679,000	貸付有価証券 19,700株
扶桑化学工業	214,000	4,200.00	898,800,000	貸付有価証券 6,000株
トリケミカル研究所	251,800	3,140.00	790,652,000	貸付有価証券 55,000株

A D E K A	1,250,200	2,065.00	2,581,663,000	貸付有価証券 115,600株
日油	1,022,700	5,620.00	5,747,574,000	貸付有価証券 41,400株
新日本理化	449,500	262.00	117,769,000	貸付有価証券 245,000株
ハリマ化成グループ	202,100	880.00	177,848,000	貸付有価証券 9,700株
花王	6,640,200	6,741.00	44,761,588,200	貸付有価証券 4,486,200株
第一工業製薬	92,000	3,175.00	292,100,000	貸付有価証券 400株
石原ケミカル	68,400	2,097.00	143,434,800	
日華化学	91,500	1,251.00	114,466,500	貸付有価証券 38,500株
ニイタカ	56,300	2,100.00	118,230,000	貸付有価証券 39,800株
三洋化成工業	162,100	5,210.00	844,541,000	貸付有価証券 19,000株
有機合成薬品工業	208,100	364.00	75,748,400	貸付有価証券 16,300株
大日本塗料	307,000	835.00	256,345,000	貸付有価証券 6,000株
日本ペイントホールディングス	11,205,400	1,420.00	15,911,668,000	貸付有価証券 1,551,300株
関西ペイント	3,051,600	2,736.00	8,349,177,600	貸付有価証券 465,300株
神東塗料	213,600	192.00	41,011,200	貸付有価証券 34,700株
中国塗料	654,200	861.00	563,266,200	貸付有価証券 117,000株
日本特殊塗料	203,300	1,115.00	226,679,500	貸付有価証券 7,100株
藤倉化成	366,200	513.00	187,860,600	貸付有価証券 46,600株
太陽ホールディングス	199,700	5,090.00	1,016,473,000	貸付有価証券 14,000株
D I C	1,147,000	2,706.00	3,103,782,000	貸付有価証券 722,800株
サカタインクス	592,900	976.00	578,670,400	貸付有価証券 4,800株
東洋インキ S C ホールディングス	574,200	1,925.00	1,105,335,000	貸付有価証券 406,700株
T & K T O K A	189,300	859.00	162,608,700	
富士フイルムホールディングス	4,874,100	8,197.00	39,952,997,700	貸付有価証券 5,200株
資生堂	5,510,500	7,937.00	43,736,838,500	貸付有価証券 681,300株
ライオン	3,605,600	1,960.00	7,066,976,000	貸付有価証券 7,600株
高砂香料工業	173,500	2,699.00	468,276,500	貸付有価証券 4,100株

マンダム	581,900	1,928.00	1,121,903,200	貸付有価証券 166,800株
ミルボン	370,700	6,130.00	2,272,391,000	貸付有価証券 17,700株
ファンケル	1,010,100	3,515.00	3,550,501,500	貸付有価証券 50,100株
コーセー	521,700	17,230.00	8,988,891,000	貸付有価証券 131,900株
コタ	175,800	1,409.00	247,702,200	貸付有価証券 1,100株
シーボン	35,900	1,965.00	70,543,500	貸付有価証券 3,500株
ポーラ・オルビスホールディングス	1,183,700	2,795.00	3,308,441,500	貸付有価証券 827,400株
ノエビアホールディングス	235,300	5,520.00	1,298,856,000	貸付有価証券 26,400株
アジュバンコスメジャパン	62,000	1,040.00	64,480,000	貸付有価証券 5,400株
新日本製薬	75,300	2,164.00	162,949,200	貸付有価証券 53,200株
エステー	178,200	1,711.00	304,900,200	貸付有価証券 5,300株
アグロ カネショウ	103,900	1,372.00	142,550,800	貸付有価証券 10,200株
コニシ	455,600	1,595.00	726,682,000	貸付有価証券 83,500株
長谷川香料	478,000	2,498.00	1,194,044,000	貸付有価証券 66,500株
星光PMC	158,800	926.00	147,048,800	貸付有価証券 5,400株
小林製薬	777,100	9,120.00	7,087,152,000	貸付有価証券 32,000株
荒川化学工業	231,200	1,176.00	271,891,200	貸付有価証券 9,600株
メック	190,100	3,305.00	628,280,500	貸付有価証券 1,600株
日本高純度化学	76,100	2,805.00	213,460,500	
タカラバイオ	725,800	2,818.00	2,045,304,400	貸付有価証券 37,700株
JCU	311,900	3,605.00	1,124,399,500	貸付有価証券 17,800株
新田ゼラチン	174,100	630.00	109,683,000	貸付有価証券 7,000株
OATアグリオ	52,400	1,401.00	73,412,400	貸付有価証券 500株
デクセリアルズ	775,200	2,330.00	1,806,216,000	貸付有価証券 5,600株
アース製薬	208,900	6,290.00	1,313,981,000	貸付有価証券 25,200株
北興化学工業	258,200	914.00	235,994,800	貸付有価証券 20,900株
大成ラミック	85,000	2,708.00	230,180,000	

クミアイ化学工業	1,146,800	829.00	950,697,200	貸付有価証券 99,700株
日本農薬	494,000	506.00	249,964,000	貸付有価証券 3,100株
アキレス	191,200	1,391.00	265,959,200	貸付有価証券 4,800株
有沢製作所	385,900	868.00	334,961,200	貸付有価証券 16,300株
日東電工	1,676,300	8,050.00	13,494,215,000	貸付有価証券 4,000株
レック	328,600	1,128.00	370,660,800	貸付有価証券 11,200株
三光合成	290,700	432.00	125,582,400	貸付有価証券 10,300株
きもと	424,500	278.00	118,011,000	貸付有価証券 85,600株
藤森工業	248,900	4,000.00	995,600,000	貸付有価証券 2,400株
前澤化成工業	176,100	1,229.00	216,426,900	貸付有価証券 124,700株
未来工業	99,200	1,683.00	166,953,600	貸付有価証券 3,500株
ウェーブロックホールディングス	95,800	686.00	65,718,800	貸付有価証券 67,900株
J S P	162,300	1,609.00	261,140,700	貸付有価証券 62,800株
エフピコ	509,700	4,035.00	2,056,639,500	貸付有価証券 81,300株
天馬	207,800	2,573.00	534,669,400	貸付有価証券 4,000株
信越ポリマー	426,800	1,025.00	437,470,000	
東リ	690,500	239.00	165,029,500	貸付有価証券 2,200株
ニフコ	1,018,200	3,870.00	3,940,434,000	貸付有価証券 45,600株
バルカー	225,300	2,131.00	480,114,300	
ユニ・チャーム	5,880,100	4,398.00	25,860,679,800	貸付有価証券 1,276,300株
ショーエイコーポレーション	60,800	959.00	58,307,200	貸付有価証券 31,800株
協和キリン	2,789,700	4,025.00	11,228,542,500	貸付有価証券 812,300株
武田薬品工業	23,073,300	3,650.00	84,217,545,000	代用有価証券 550,000株
アステラス製薬	24,045,400	1,865.50	44,856,693,700	
大日本住友製薬	2,055,600	2,211.00	4,544,931,600	貸付有価証券 2,800株
塩野義製薬	3,487,700	5,775.00	20,141,467,500	
わかもと製薬	330,000	313.00	103,290,000	貸付有価証券 135,700株

日本新薬	786,400	8,600.00	6,763,040,000	貸付有価証券 84,700株
ピオフェルミン製薬	47,100	2,935.00	138,238,500	
中外製薬	8,674,200	4,215.00	36,561,753,000	貸付有価証券 927,800株
科研製薬	474,700	4,710.00	2,235,837,000	貸付有価証券 53,100株
エーザイ	3,064,200	10,480.00	32,112,816,000	貸付有価証券 23,300株
ロート製薬	1,321,800	2,913.00	3,850,403,400	
小野薬品工業	6,368,800	2,454.50	15,632,219,600	
久光製薬	806,600	5,230.00	4,218,518,000	貸付有価証券 336,100株
持田製薬	384,800	3,645.00	1,402,596,000	貸付有価証券 3,100株
参天製薬	4,826,200	1,508.00	7,277,909,600	貸付有価証券 35,200株
扶桑薬品工業	89,500	2,191.00	196,094,500	貸付有価証券 3,500株
日本ケミファ	33,000	2,270.00	74,910,000	
ツムラ	925,300	3,385.00	3,132,140,500	貸付有価証券 21,100株
日医工	785,500	851.00	668,460,500	貸付有価証券 556,500株
キッセイ薬品工業	490,700	2,139.00	1,049,607,300	貸付有価証券 6,800株
生化学工業	489,200	1,084.00	530,292,800	貸付有価証券 3,400株
栄研化学	487,400	2,106.00	1,026,464,400	貸付有価証券 35,700株
日水製薬	101,900	985.00	100,371,500	貸付有価証券 5,500株
鳥居薬品	173,600	2,397.00	416,119,200	貸付有価証券 900株
JCRファーマ	781,600	3,580.00	2,798,128,000	貸付有価証券 150,100株
東和薬品	399,200	2,507.00	1,000,794,400	貸付有価証券 62,300株
富士製薬工業	170,500	1,118.00	190,619,000	貸付有価証券 4,100株
ゼリア新薬工業	503,100	2,049.00	1,030,851,900	貸付有価証券 114,200株
第一三共	21,793,600	2,271.00	49,493,265,600	貸付有価証券 52,600株
キョーリン製薬ホールディングス	611,900	1,753.00	1,072,660,700	貸付有価証券 69,200株
大幸薬品	342,000	955.00	326,610,000	貸付有価証券 240,500株
ダイト	177,200	3,365.00	596,278,000	貸付有価証券 20,500株

大塚ホールディングス	5,763,700	4,299.00	24,778,146,300	貸付有価証券 3,397,700株
大正製薬ホールディングス	659,800	5,910.00	3,899,418,000	貸付有価証券 22,900株
ペプチドリーム	1,455,200	4,885.00	7,108,652,000	貸付有価証券 744,600株
あすか製薬ホールディングス	315,800	943.00	297,799,400	貸付有価証券 8,100株
サワイグループホールディングス	607,400	4,700.00	2,854,780,000	貸付有価証券 55,900株
日本コークス工業	2,342,900	100.00	234,290,000	貸付有価証券 51,400株
ニチレキ	327,400	1,300.00	425,620,000	
ユシロ化学工業	155,600	1,178.00	183,296,800	貸付有価証券 900株
ビーピー・カストロール	98,900	1,326.00	131,141,400	貸付有価証券 500株
富士石油	673,200	259.00	174,358,800	貸付有価証券 476,900株
MORESCO	100,200	1,070.00	107,214,000	貸付有価証券 9,100株
出光興産	3,077,600	2,570.00	7,909,432,000	貸付有価証券 140,000株
ENEOSホールディングス	41,719,900	462.20	19,282,937,780	貸付有価証券 507,200株
コスモエネルギーホールディングス	875,900	2,528.00	2,214,275,200	貸付有価証券 109,700株
横浜ゴム	1,605,800	2,304.00	3,699,763,200	貸付有価証券 938,600株
TOYO TIRE	1,459,600	2,248.00	3,281,180,800	貸付有価証券 631,300株
ブリヂストン	7,374,100	5,004.00	36,899,996,400	貸付有価証券 3,926,600株
住友ゴム工業	2,491,300	1,517.00	3,779,302,100	貸付有価証券 1,533,700株
藤倉コンポジット	242,300	477.00	115,577,100	貸付有価証券 4,200株
オカモト	164,500	4,115.00	676,917,500	貸付有価証券 2,600株
フコク	121,300	913.00	110,746,900	貸付有価証券 3,500株
ニッタ	286,700	2,649.00	759,468,300	貸付有価証券 10,800株
住友理工	537,500	722.00	388,075,000	
三ツ星ベルト	336,900	1,738.00	585,532,200	貸付有価証券 13,700株
バンドー化学	487,800	896.00	437,068,800	貸付有価証券 4,200株
日東紡績	412,600	3,245.00	1,338,887,000	貸付有価証券 49,300株
A G C	2,545,800	4,580.00	11,659,764,000	貸付有価証券 1,160,800株



日本板硝子	1,407,600	609.00	857,228,400	貸付有価証券 110,800株
石塚硝子	47,200	1,885.00	88,972,000	貸付有価証券 1,900株
日本山村硝子	115,200	912.00	105,062,400	貸付有価証券 8,100株
日本電気硝子	1,028,300	2,458.00	2,527,561,400	貸付有価証券 270,800株
オハラ	109,600	1,407.00	154,207,200	貸付有価証券 65,100株
住友大阪セメント	499,100	2,960.00	1,477,336,000	貸付有価証券 234,400株
太平洋セメント	1,575,500	2,440.00	3,844,220,000	
日本ヒューム	252,700	723.00	182,702,100	
日本コンクリート工業	597,100	307.00	183,309,700	貸付有価証券 42,300株
三谷セキサン	129,100	4,250.00	548,675,000	貸付有価証券 9,800株
アジアパイルホールディングス	426,300	452.00	192,687,600	貸付有価証券 12,000株
東海カーボン	2,711,600	1,449.00	3,929,108,400	貸付有価証券 1,015,400株
日本カーボン	152,800	4,030.00	615,784,000	貸付有価証券 49,400株
東洋炭素	162,700	2,749.00	447,262,300	貸付有価証券 22,300株
ノリタケカンパニーリミテド	153,400	4,175.00	640,445,000	貸付有価証券 4,400株
TOTO	1,981,000	5,700.00	11,291,700,000	貸付有価証券 31,200株
日本碍子	3,051,700	1,815.00	5,538,835,500	
日本特殊陶業	2,109,600	1,600.00	3,375,360,000	
ダントーホールディングス	206,600	251.00	51,856,600	貸付有価証券 146,300株
MARUWA	95,900	10,730.00	1,029,007,000	貸付有価証券 17,100株
品川リフラクトリーズ	65,000	3,775.00	245,375,000	貸付有価証券 800株
黒崎播磨	47,100	4,720.00	222,312,000	貸付有価証券 800株
ヨータイ	198,300	1,354.00	268,498,200	貸付有価証券 3,500株
イソライト工業	122,000	666.00	81,252,000	貸付有価証券 700株
東京窯業	352,400	315.00	111,006,000	貸付有価証券 12,000株
ニッカトー	125,400	684.00	85,773,600	貸付有価証券 2,500株
フジミインコーポレーテッド	222,400	4,750.00	1,056,400,000	貸付有価証券 12,900株

クニミネ工業	87,100	1,159.00	100,948,900	貸付有価証券 1,300株
エーアンドエーマテリアル	53,600	1,012.00	54,243,200	貸付有価証券 1,200株
ニチアス	700,600	2,749.00	1,925,949,400	貸付有価証券 43,000株
ニチハ	385,700	2,822.00	1,088,445,400	貸付有価証券 900株
日本製鉄	13,092,000	1,789.50	23,428,134,000	貸付有価証券 1,032,200株
神戸製鋼所	5,019,600	689.00	3,458,504,400	貸付有価証券 585,400株
中山製鋼所	380,200	390.00	148,278,000	貸付有価証券 3,200株
合同製鐵	147,600	1,600.00	236,160,000	貸付有価証券 6,900株
ジェイ エフ イー ホールディングス	7,935,700	1,257.00	9,975,174,900	貸付有価証券 449,000株
東京製鐵	1,068,100	1,049.00	1,120,436,900	貸付有価証券 686,600株
共英製鋼	309,300	1,380.00	426,834,000	貸付有価証券 121,400株
大和工業	582,700	3,485.00	2,030,709,500	貸付有価証券 141,600株
東京鐵鋼	104,800	1,548.00	162,230,400	貸付有価証券 73,300株
大阪製鐵	145,600	1,093.00	159,140,800	貸付有価証券 7,900株
淀川製鋼所	359,900	2,264.00	814,813,600	貸付有価証券 4,300株
丸一鋼管	890,300	2,613.00	2,326,353,900	貸付有価証券 2,100株
モリ工業	81,100	2,301.00	186,611,100	貸付有価証券 1,500株
大同特殊鋼	448,900	5,250.00	2,356,725,000	貸付有価証券 130,200株
日本高周波鋼業	101,200	375.00	37,950,000	貸付有価証券 5,900株
日本冶金工業	213,500	2,223.00	474,610,500	貸付有価証券 19,100株
山陽特殊製鋼	328,500	1,596.00	524,286,000	貸付有価証券 1,300株
愛知製鋼	154,100	3,010.00	463,841,000	貸付有価証券 2,200株
日立金属	2,585,100	2,130.00	5,506,263,000	貸付有価証券 769,700株
日本金属	69,200	925.00	64,010,000	貸付有価証券 37,200株
大平洋金属	185,400	1,648.00	305,539,200	貸付有価証券 66,400株
新日本電工	1,769,200	291.00	514,837,200	貸付有価証券 1,167,700株

栗本鐵工所	124,100	1,658.00	205,757,800	貸付有価証券 1,600株
虹技	37,600	1,112.00	41,811,200	
日本鑄鉄管	31,200	1,246.00	38,875,200	貸付有価証券 2,700株
三菱製鋼	202,900	1,008.00	204,523,200	貸付有価証券 38,100株
日亜鋼業	401,100	291.00	116,720,100	貸付有価証券 13,000株
日本精線	39,100	4,370.00	170,867,000	
エンビプロ・ホールディングス	116,600	1,188.00	138,520,800	貸付有価証券 8,200株
シンニッタン	331,500	244.00	80,886,000	貸付有価証券 23,500株
新家工業	67,700	1,605.00	108,658,500	貸付有価証券 800株
大紀アルミニウム工業所	413,200	1,120.00	462,784,000	貸付有価証券 3,600株
日本軽金属ホールディングス	747,300	1,841.00	1,375,779,300	
三井金属鉱業	740,000	3,015.00	2,231,100,000	
東邦亜鉛	152,100	1,831.00	278,495,100	貸付有価証券 107,800株
三菱マテリアル	1,811,500	2,197.00	3,979,865,500	貸付有価証券 150,800株
住友金属鉱山	3,505,500	4,314.00	15,122,727,000	貸付有価証券 255,300株
DOWAホールディングス	693,900	4,320.00	2,997,648,000	貸付有価証券 39,500株
古河機械金属	452,700	1,245.00	563,611,500	貸付有価証券 17,100株
エス・サイエンス	1,282,700	37.00	47,459,900	貸付有価証券 558,500株
大阪チタニウムテクノロジーズ	285,200	769.00	219,318,800	貸付有価証券 202,100株
東邦チタニウム	490,900	996.00	488,936,400	貸付有価証券 59,000株
UACJ	416,100	2,738.00	1,139,281,800	貸付有価証券 8,200株
CKサンエツ	57,300	2,965.00	169,894,500	貸付有価証券 24,400株
古河電気工業	851,900	2,708.00	2,306,945,200	
住友電気工業	9,570,400	1,555.00	14,881,972,000	貸付有価証券 103,500株
フジクラ	3,311,700	535.00	1,771,759,500	
昭和電線ホールディングス	265,400	1,843.00	489,132,200	貸付有価証券 2,400株
東京特殊電線	35,200	2,584.00	90,956,800	貸付有価証券 2,000株
タツタ電線	483,300	550.00	265,815,000	貸付有価証券 2,300株

カナレ電気	45,400	1,686.00	76,544,400	貸付有価証券 32,000株
平河ヒューテック	151,800	1,186.00	180,034,800	貸付有価証券 2,500株
リョービ	337,300	1,472.00	496,505,600	貸付有価証券 5,800株
アーレスティ	336,800	469.00	157,959,200	貸付有価証券 32,800株
アサヒホールディングス	1,029,500	2,230.00	2,295,785,000	貸付有価証券 270,100株
稲葉製作所	154,400	1,529.00	236,077,600	貸付有価証券 109,300株
宮地エンジニアリンググループ	89,400	2,391.00	213,755,400	貸付有価証券 7,200株
トーカロ	707,400	1,367.00	967,015,800	貸付有価証券 44,700株
アルファC o	96,600	1,133.00	109,447,800	貸付有価証券 1,100株
SUMCO	3,497,800	2,670.00	9,339,126,000	貸付有価証券 2,448,400株
川田テクノロジーズ	56,000	3,695.00	206,920,000	貸付有価証券 4,400株
RS Technologies	89,100	6,220.00	554,202,000	貸付有価証券 13,500株
ジェイテックコーポレーション	30,200	3,125.00	94,375,000	貸付有価証券 21,300株
信和	145,700	701.00	102,135,700	貸付有価証券 6,600株
東洋製罐グループホールディングス	1,746,700	1,420.00	2,480,314,000	貸付有価証券 2,100株
ホッカンホールディングス	139,200	1,384.00	192,652,800	貸付有価証券 1,700株
コロナ	151,600	925.00	140,230,000	貸付有価証券 2,600株
横河ブリッジホールディングス	470,800	2,042.00	961,373,600	貸付有価証券 17,900株
駒井ハルテック	55,700	1,678.00	93,464,600	貸付有価証券 1,200株
高田機工	25,000	2,727.00	68,175,000	貸付有価証券 17,700株
三和ホールディングス	2,585,600	1,310.00	3,387,136,000	貸付有価証券 200株
文化シャッター	808,100	1,146.00	926,082,600	貸付有価証券 444,900株
三協立山	353,200	828.00	292,449,600	貸付有価証券 79,200株
アルインコ	181,100	1,009.00	182,729,900	貸付有価証券 2,300株
東洋シャッター	60,500	651.00	39,385,500	貸付有価証券 13,700株
LIXIL	3,776,900	2,833.00	10,699,957,700	貸付有価証券 319,800株

日本ファイルコン	190,800	493.00	94,064,400	貸付有価証券 4,700株
ノーリツ	568,600	1,812.00	1,030,303,200	貸付有価証券 37,500株
長府製作所	278,800	2,004.00	558,715,200	貸付有価証券 2,700株
リンナイ	533,300	10,400.00	5,546,320,000	貸付有価証券 8,700株
ダイニチ工業	131,300	759.00	99,656,700	
日東精工	344,300	558.00	192,119,400	貸付有価証券 13,300株
三洋工業	33,300	1,861.00	61,971,300	貸付有価証券 600株
岡部	555,800	645.00	358,491,000	貸付有価証券 11,700株
ジーテクト	340,400	1,493.00	508,217,200	
東プレ	511,700	1,542.00	789,041,400	貸付有価証券 3,000株
高周波熱錬	527,900	531.00	280,314,900	貸付有価証券 400株
東京製綱	196,100	1,100.00	215,710,000	貸付有価証券 51,100株
サンコール	234,600	448.00	105,100,800	貸付有価証券 4,300株
モリテック スチール	213,700	459.00	98,088,300	貸付有価証券 149,500株
パイオラックス	405,600	1,501.00	608,805,600	貸付有価証券 700株
エイチワン	268,900	739.00	198,717,100	貸付有価証券 17,500株
日本発條	2,731,900	855.00	2,335,774,500	
中央発條	132,000	1,335.00	176,220,000	貸付有価証券 12,000株
アドバネクス	39,300	1,288.00	50,618,400	貸付有価証券 200株
立川ブラインド工業	120,700	1,319.00	159,203,300	貸付有価証券 2,500株
三益半導体工業	214,000	2,571.00	550,194,000	貸付有価証券 7,600株
日本ドライケミカル	68,000	1,747.00	118,796,000	貸付有価証券 100株
日本製鋼所	832,300	2,722.00	2,265,520,600	貸付有価証券 19,500株
三浦工業	1,186,700	4,860.00	5,767,362,000	貸付有価証券 41,900株
タクマ	929,000	1,659.00	1,541,211,000	貸付有価証券 93,800株
ツガミ	568,300	1,602.00	910,416,600	貸付有価証券 228,200株
オークマ	319,700	5,270.00	1,684,819,000	貸付有価証券 10,300株

芝浦機械	283,900	2,472.00	701,800,800	貸付有価証券 300株
アマダ	4,019,700	1,091.00	4,385,492,700	貸付有価証券 305,200株
アイダエンジニアリング	717,600	964.00	691,766,400	貸付有価証券 19,500株
滝澤鉄工所	79,300	1,120.00	88,816,000	貸付有価証券 900株
F U J I	1,095,000	2,458.00	2,691,510,000	貸付有価証券 17,700株
牧野フライス製作所	321,500	4,240.00	1,363,160,000	貸付有価証券 21,700株
オーエスジー	1,352,600	1,999.00	2,703,847,400	貸付有価証券 301,900株
ダイジェット工業	30,900	1,294.00	39,984,600	
旭ダイヤモンド工業	719,400	507.00	364,735,800	貸付有価証券 1,900株
D M G 森精機	1,735,200	1,762.00	3,057,422,400	貸付有価証券 601,000株
ソディック	658,100	994.00	654,151,400	
ディスコ	372,600	32,900.00	12,258,540,000	貸付有価証券 15,500株
日東工器	131,400	1,818.00	238,885,200	貸付有価証券 2,600株
日進工具	215,400	1,442.00	310,606,800	貸付有価証券 4,200株
パンチ工業	228,500	608.00	138,928,000	貸付有価証券 11,600株
富士ダイス	137,800	654.00	90,121,200	貸付有価証券 1,100株
豊和工業	151,200	805.00	121,716,000	貸付有価証券 9,000株
O K K	105,300	422.00	44,436,600	貸付有価証券 3,200株
石川製作所	71,500	1,529.00	109,323,500	貸付有価証券 49,100株
東洋機械金属	196,100	509.00	99,814,900	貸付有価証券 7,400株
津田駒工業	52,800	888.00	46,886,400	貸付有価証券 1,200株
エンシュウ	65,600	852.00	55,891,200	貸付有価証券 1,500株
島精機製作所	400,700	1,890.00	757,323,000	貸付有価証券 161,100株
オプトラン	343,700	2,369.00	814,225,300	貸付有価証券 17,700株
N C ホールディングス	82,900	1,266.00	104,951,400	貸付有価証券 14,200株
イワキポンプ	174,300	885.00	154,255,500	貸付有価証券 1,100株
フリーー	268,000	1,386.00	371,448,000	

ヤマシンフィルタ	552,800	727.00	401,885,600	貸付有価証券 380,800株
日阪製作所	338,200	813.00	274,956,600	貸付有価証券 7,900株
やまびこ	531,700	1,211.00	643,888,700	貸付有価証券 5,000株
平田機工	129,700	6,320.00	819,704,000	貸付有価証券 6,300株
ペガサスミシン製造	277,900	455.00	126,444,500	貸付有価証券 13,700株
マルマエ	112,400	2,094.00	235,365,600	貸付有価証券 14,200株
タツモ	116,300	1,733.00	201,547,900	貸付有価証券 24,700株
ナプテスコ	1,616,100	4,135.00	6,682,573,500	貸付有価証券 130,900株
三井海洋開発	291,400	1,942.00	565,898,800	貸付有価証券 34,100株
レオン自動機	268,900	1,354.00	364,090,600	貸付有価証券 15,200株
S M C	812,100	66,450.00	53,964,045,000	貸付有価証券 48,700株
ホソカワミクロン	96,400	6,010.00	579,364,000	
ユニオンツール	102,200	4,020.00	410,844,000	貸付有価証券 3,900株
オイレス工業	384,000	1,551.00	595,584,000	貸付有価証券 264,800株
日精エー・エス・ピー機械	92,500	4,765.00	440,762,500	貸付有価証券 3,200株
サトーホールディングス	360,800	2,705.00	975,964,000	貸付有価証券 4,000株
技研製作所	241,800	4,695.00	1,135,251,000	貸付有価証券 9,200株
日本エアテック	89,600	1,227.00	109,939,200	貸付有価証券 29,500株
カワタ	74,500	883.00	65,783,500	
日精樹脂工業	210,900	1,361.00	287,034,900	貸付有価証券 12,800株
オカダアイヨン	86,600	1,304.00	112,926,400	貸付有価証券 1,200株
ワイエイシイホールディングス	109,200	1,090.00	119,028,000	貸付有価証券 60,600株
小松製作所	12,565,200	2,647.00	33,260,084,400	貸付有価証券 1,169,600株
住友重機械工業	1,587,400	3,095.00	4,913,003,000	貸付有価証券 49,000株
日立建機	1,296,500	3,245.00	4,207,142,500	
日工	413,300	681.00	281,457,300	貸付有価証券 30,300株
巴工業	108,800	2,223.00	241,862,400	貸付有価証券 8,000株

井関農機	277,000	1,450.00	401,650,000	貸付有価証券 11,300株
TOWA	258,500	2,213.00	572,060,500	貸付有価証券 53,700株
丸山製作所	56,300	1,776.00	99,988,800	貸付有価証券 3,100株
北川鉄工所	124,600	1,663.00	207,209,800	貸付有価証券 300株
ローツェ	121,500	9,370.00	1,138,455,000	貸付有価証券 1,900株
タカキタ	96,400	603.00	58,129,200	貸付有価証券 4,800株
クボタ	14,568,500	2,207.50	32,159,963,750	貸付有価証券 9,993,200株
荏原実業	138,800	2,882.00	400,021,600	貸付有価証券 7,500株
三菱化工機	88,600	2,497.00	221,234,200	貸付有価証券 56,900株
月島機械	510,700	1,157.00	590,879,900	貸付有価証券 1,400株
帝国電機製作所	193,400	1,231.00	238,075,400	貸付有価証券 7,200株
東京機械製作所	112,700	784.00	88,356,800	貸付有価証券 79,800株
新東工業	657,900	796.00	523,688,400	貸付有価証券 105,000株
澁谷工業	242,400	3,050.00	739,320,000	貸付有価証券 14,100株
アイチ コーポレーション	471,500	828.00	390,402,000	貸付有価証券 9,800株
小森コーポレーション	702,600	803.00	564,187,800	貸付有価証券 39,600株
鶴見製作所	213,100	1,739.00	370,580,900	貸付有価証券 6,000株
住友精密工業	41,200	2,886.00	118,903,200	貸付有価証券 3,600株
日本ギア工業	110,700	319.00	35,313,300	貸付有価証券 2,100株
酒井重工業	48,600	2,634.00	128,012,400	貸付有価証券 3,400株
荏原製作所	1,150,400	5,480.00	6,304,192,000	貸付有価証券 189,900株
石井鐵工所	39,100	2,996.00	117,143,600	貸付有価証券 600株
西島製作所	275,700	856.00	235,999,200	
北越工業	285,700	1,093.00	312,270,100	貸付有価証券 5,100株
ダイキン工業	3,533,300	21,950.00	77,555,935,000	貸付有価証券 184,700株
オルガノ	89,800	5,980.00	537,004,000	
トーヨーカネツ	104,400	2,404.00	250,977,600	貸付有価証券 6,700株



栗田工業	1,500,800	5,470.00	8,209,376,000	貸付有価証券 253,200株
椿本チエイン	395,500	3,155.00	1,247,802,500	貸付有価証券 6,100株
大同工業	131,700	1,137.00	149,742,900	貸付有価証券 4,500株
木村化工機	230,600	842.00	194,165,200	貸付有価証券 163,300株
アネスト岩田	467,300	1,022.00	477,580,600	貸付有価証券 58,500株
ダイフク	1,526,200	9,800.00	14,956,760,000	貸付有価証券 960,700株
サムコ	69,300	3,245.00	224,878,500	貸付有価証券 47,000株
加藤製作所	151,700	983.00	149,121,100	
油研工業	46,600	1,728.00	80,524,800	貸付有価証券 1,200株
タダノ	1,338,000	1,156.00	1,546,728,000	貸付有価証券 170,100株
フジテック	954,800	2,409.00	2,300,113,200	貸付有価証券 156,100株
C K D	643,200	2,177.00	1,400,246,400	
キトー	232,900	1,631.00	379,859,900	貸付有価証券 4,600株
平和	773,500	1,997.00	1,544,679,500	
理想科学工業	203,400	1,726.00	351,068,400	貸付有価証券 23,000株
SANKYO	659,200	2,788.00	1,837,849,600	貸付有価証券 195,500株
日本金銭機械	306,400	620.00	189,968,000	貸付有価証券 20,100株
マースグループホールディングス	176,100	1,604.00	282,464,400	貸付有価証券 4,600株
フクシマガリレイ	190,000	4,460.00	847,400,000	貸付有価証券 15,800株
オーイズミ	116,200	378.00	43,923,600	貸付有価証券 200株
ダイコク電機	127,300	901.00	114,697,300	
竹内製作所	464,100	2,647.00	1,228,472,700	
アマノ	726,000	2,779.00	2,017,554,000	貸付有価証券 9,500株
JUKI	385,800	775.00	298,995,000	貸付有価証券 8,300株
サンデンホールディングス	386,600	327.00	126,418,200	貸付有価証券 24,100株
蛇の目マシン工業	252,100	738.00	186,049,800	貸付有価証券 176,400株
マックス	371,500	1,755.00	651,982,500	貸付有価証券 5,700株
グローリー	712,300	2,330.00	1,659,659,000	

新晃工業	257,700	1,867.00	481,125,900	貸付有価証券 2,900株
大和冷機工業	445,300	1,037.00	461,776,100	貸付有価証券 13,300株
セガサミーホールディングス	2,521,500	1,466.00	3,696,519,000	
日本ピストンリング	100,900	1,278.00	128,950,200	貸付有価証券 4,000株
リケン	128,400	2,552.00	327,676,800	
T P R	373,000	1,488.00	555,024,000	貸付有価証券 1,100株
ツバキ・ナカシマ	534,500	1,635.00	873,907,500	貸付有価証券 119,800株
ホシザキ	872,900	9,290.00	8,109,241,000	貸付有価証券 369,800株
大豊工業	226,000	930.00	210,180,000	貸付有価証券 3,600株
日本精工	5,695,800	907.00	5,166,090,600	貸付有価証券 226,500株
N T N	6,418,400	279.00	1,790,733,600	貸付有価証券 451,600株
ジェイテクト	2,660,200	1,113.00	2,960,802,600	貸付有価証券 5,800株
不二越	257,500	4,100.00	1,055,750,000	貸付有価証券 12,700株
日本トムソン	759,400	621.00	471,587,400	貸付有価証券 188,600株
T H K	1,728,800	3,280.00	5,670,464,000	貸付有価証券 100株
ユーシン精機	184,100	817.00	150,409,700	
前澤給装工業	193,100	1,040.00	200,824,000	貸付有価証券 1,000株
イーグル工業	342,700	1,104.00	378,340,800	貸付有価証券 3,200株
前澤工業	166,000	680.00	112,880,000	貸付有価証券 117,600株
日本ピラー工業	280,300	2,294.00	643,008,200	貸付有価証券 194,500株
キッツ	856,200	760.00	650,712,000	貸付有価証券 16,800株
マキタ	3,616,500	5,490.00	19,854,585,000	貸付有価証券 445,700株
日立造船	2,198,400	763.00	1,677,379,200	貸付有価証券 948,000株
三菱重工業	4,357,200	3,225.00	14,051,970,000	
I H I	1,864,500	2,525.00	4,707,862,500	貸付有価証券 42,300株
スター精密	427,100	1,661.00	709,413,100	貸付有価証券 1,000株
日清紡ホールディングス	1,695,100	922.00	1,562,882,200	貸付有価証券 38,200株

イビデン	1,334,100	6,100.00	8,138,010,000	貸付有価証券 160,700株
コニカミノルタ	5,626,600	600.00	3,375,960,000	貸付有価証券 591,900株
ブラザー工業	3,386,700	2,210.00	7,484,607,000	貸付有価証券 571,200株
ミネベアミツミ	4,780,400	3,030.00	14,484,612,000	貸付有価証券 58,400株
日立製作所	13,333,700	6,479.00	86,389,042,300	貸付有価証券 110,100株
東芝	5,488,100	4,860.00	26,672,166,000	貸付有価証券 212,700株
三菱電機	27,731,700	1,465.50	40,640,806,350	貸付有価証券 163,200株
富士電機	1,671,100	5,050.00	8,439,055,000	貸付有価証券 161,800株
東洋電機製造	109,000	1,126.00	122,734,000	貸付有価証券 15,400株
安川電機	2,985,100	5,540.00	16,537,454,000	貸付有価証券 695,700株
シンフォニアテクノロジー	359,100	1,239.00	444,924,900	貸付有価証券 25,600株
明電舎	470,400	2,183.00	1,026,883,200	貸付有価証券 38,300株
オリジン	75,000	1,358.00	101,850,000	貸付有価証券 4,200株
山洋電気	134,000	7,490.00	1,003,660,000	
デンヨー	236,200	1,947.00	459,881,400	貸付有価証券 6,200株
東芝テック	297,700	4,630.00	1,378,351,000	
芝浦メカトロニクス	49,200	7,590.00	373,428,000	貸付有価証券 14,800株
マブチモーター	767,400	4,130.00	3,169,362,000	貸付有価証券 57,600株
日本電産	6,674,400	12,855.00	85,799,412,000	貸付有価証券 136,900株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	144,500	764.00	110,398,000	貸付有価証券 59,100株
トレックス・セミコンダクター	149,200	2,958.00	441,333,600	貸付有価証券 7,200株
東光高岳	140,100	1,330.00	186,333,000	貸付有価証券 21,700株
ダブル・スコープ	656,400	584.00	383,337,600	貸付有価証券 458,800株
宮越ホールディングス	103,300	1,062.00	109,704,600	貸付有価証券 73,200株
ダイヘン	303,400	4,635.00	1,406,259,000	貸付有価証券 9,900株
ヤーマン	452,200	1,319.00	596,451,800	貸付有価証券 174,400株
JVCケンウッド	2,400,500	229.00	549,714,500	貸付有価証券 2,500株

ミマキエンジニアリング	248,300	772.00	191,687,600	貸付有価証券 3,500株
I - P E X	129,000	2,370.00	305,730,000	貸付有価証券 45,500株
日新電機	649,900	1,365.00	887,113,500	貸付有価証券 20,600株
大崎電気工業	551,500	609.00	335,863,500	貸付有価証券 44,900株
オムロン	2,308,600	9,030.00	20,846,658,000	
日東工業	407,300	1,804.00	734,769,200	貸付有価証券 200株
I D E C	371,900	2,139.00	795,494,100	貸付有価証券 2,700株
正興電機製作所	86,800	1,737.00	150,771,600	貸付有価証券 39,800株
不二電機工業	45,900	1,288.00	59,119,200	貸付有価証券 32,500株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	997,100	2,726.00	2,718,094,600	貸付有価証券 10,800株
サクサホールディングス	64,500	1,341.00	86,494,500	貸付有価証券 900株
メルコホールディングス	95,700	5,450.00	521,565,000	貸付有価証券 6,200株
テクノメディカ	62,200	1,607.00	99,955,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	80,700	2,730.00	220,311,000	貸付有価証券 53,000株
日本電気	3,523,900	5,620.00	19,804,318,000	貸付有価証券 170,300株
富士通	2,495,300	20,850.00	52,027,005,000	貸付有価証券 35,600株
沖電気工業	1,126,400	1,006.00	1,133,158,400	貸付有価証券 22,600株
岩崎通信機	121,500	930.00	112,995,000	貸付有価証券 6,500株
電気興業	133,400	2,244.00	299,349,600	貸付有価証券 7,400株
サンケン電気	324,200	5,140.00	1,666,388,000	貸付有価証券 16,300株
ナカヨ	53,700	1,419.00	76,200,300	貸付有価証券 200株
アイホン	156,900	2,023.00	317,408,700	
ルネサスエレクトロニクス	13,283,200	1,176.00	15,621,043,200	貸付有価証券 5,712,400株
セイコーエプソン	3,440,900	1,917.00	6,596,205,300	貸付有価証券 522,300株
ワコム	2,007,700	687.00	1,379,289,900	貸付有価証券 509,700株
アルバック	510,000	5,490.00	2,799,900,000	貸付有価証券 3,800株
アクセル	115,800	867.00	100,398,600	貸付有価証券 9,700株

E I Z O	234,900	4,835.00	1,135,741,500	貸付有価証券 1,500株
ジャパンディスプレイ	9,472,100	35.00	331,523,500	貸付有価証券 6,923,000株
日本信号	647,300	914.00	591,632,200	
京三製作所	595,200	415.00	247,008,000	貸付有価証券 59,000株
能美防災	366,600	2,097.00	768,760,200	貸付有価証券 32,600株
ホーチキ	200,900	1,144.00	229,829,600	
星和電機	136,800	511.00	69,904,800	貸付有価証券 5,500株
エレコム	635,300	2,041.00	1,296,647,300	貸付有価証券 43,500株
パナソニック	29,576,000	1,304.00	38,567,104,000	貸付有価証券 1,087,700株
シャープ	3,688,300	1,788.00	6,594,680,400	貸付有価証券 2,516,800株
アンリツ	1,667,000	2,022.00	3,370,674,000	貸付有価証券 1,173,900株
富士通ゼネラル	846,800	2,924.00	2,476,043,200	貸付有価証券 51,200株
ソニーグループ	17,372,800	10,975.00	190,666,480,000	代用有価証券 500,000株 貸付有価証券 611,600株
T D K	1,339,000	13,300.00	17,808,700,000	貸付有価証券 600株
帝国通信工業	122,300	1,115.00	136,364,500	貸付有価証券 1,500株
タムラ製作所	997,800	893.00	891,035,400	貸付有価証券 706,800株
アルプスアルパイン	2,265,700	1,137.00	2,576,100,900	貸付有価証券 303,800株
池上通信機	87,800	831.00	72,961,800	貸付有価証券 1,700株
日本電波工業	268,100	891.00	238,877,100	貸付有価証券 55,500株
鈴木	124,000	904.00	112,096,000	貸付有価証券 36,800株
日本トリム	59,600	3,805.00	226,778,000	
ローランド ディー . ジー .	163,500	2,665.00	435,727,500	貸付有価証券 94,600株
フォスター電機	279,800	935.00	261,613,000	貸付有価証券 6,000株
S M K	71,100	2,443.00	173,697,300	貸付有価証券 3,100株
ヨコオ	217,800	2,500.00	544,500,000	
ティアック	174,500	121.00	21,114,500	貸付有価証券 123,200株
ホシデン	724,300	998.00	722,851,400	貸付有価証券 60,700株

ヒロセ電機	427,300	16,240.00	6,939,352,000	貸付有価証券 41,700株
日本航空電子工業	635,800	1,842.00	1,171,143,600	貸付有価証券 21,700株
TOA	327,100	854.00	279,343,400	貸付有価証券 6,900株
マクセルホールディングス	551,100	1,243.00	685,017,300	貸付有価証券 11,800株
古野電気	357,000	996.00	355,572,000	貸付有価証券 95,300株
ユニデンホールディングス	70,700	2,510.00	177,457,000	貸付有価証券 9,600株
スミダコーポレーション	236,300	1,203.00	284,268,900	
アイコム	115,100	2,369.00	272,671,900	貸付有価証券 9,400株
リオン	116,500	2,694.00	313,851,000	貸付有価証券 4,600株
本多通信工業	215,300	487.00	104,851,100	貸付有価証券 59,900株
船井電機	124,500	916.00	114,042,000	
横河電機	2,775,500	1,624.00	4,507,412,000	貸付有価証券 66,600株
新電元工業	106,800	4,370.00	466,716,000	貸付有価証券 7,700株
アズビル	1,875,300	4,525.00	8,485,732,500	貸付有価証券 182,300株
東亜ディーケーケー	136,900	813.00	111,299,700	貸付有価証券 14,900株
日本光電工業	1,146,000	3,295.00	3,776,070,000	貸付有価証券 293,400株
チノー	87,700	1,436.00	125,937,200	貸付有価証券 1,500株
共和電業	289,900	378.00	109,582,200	貸付有価証券 13,800株
日本電子材料	114,300	1,762.00	201,396,600	貸付有価証券 54,600株
堀場製作所	549,300	6,840.00	3,757,212,000	貸付有価証券 389,200株
アドバンテスト	2,062,000	9,420.00	19,424,040,000	貸付有価証券 16,400株
小野測器	115,500	587.00	67,798,500	
エスベック	245,700	2,192.00	538,574,400	貸付有価証券 10,400株
キーエンス	2,722,300	57,150.00	155,579,445,000	代用有価証券 60,000株 貸付有価証券 12,000株
日置電機	132,800	6,370.00	845,936,000	貸付有価証券 33,400株
シスメックス	2,164,100	13,050.00	28,241,505,000	貸付有価証券 6,100株

日本マイクロニクス	482,500	1,405.00	677,912,500	貸付有価証券 63,200株
メガチップス	277,700	3,260.00	905,302,000	貸付有価証券 18,800株
O B A R A G R O U P	125,800	3,845.00	483,701,000	貸付有価証券 85,200株
澤藤電機	29,800	2,029.00	60,464,200	貸付有価証券 2,500株
原田工業	112,400	903.00	101,497,200	貸付有価証券 800株
コーセル	338,200	990.00	334,818,000	貸付有価証券 1,200株
イリソ電子工業	232,800	5,220.00	1,215,216,000	貸付有価証券 98,400株
オブテックスグループ	454,900	1,775.00	807,447,500	貸付有価証券 1,100株
千代田インテグレ	116,500	1,750.00	203,875,000	
アイ・オー・データ機器	102,200	1,000.00	102,200,000	貸付有価証券 4,300株
レーザーテック	1,217,700	21,240.00	25,863,948,000	貸付有価証券 51,700株
スタンレー電気	1,940,900	3,115.00	6,045,903,500	貸付有価証券 207,400株
岩崎電気	101,000	1,962.00	198,162,000	貸付有価証券 5,500株
ウシオ電機	1,421,600	2,031.00	2,887,269,600	貸付有価証券 114,700株
岡谷電機産業	197,300	370.00	73,001,000	貸付有価証券 1,300株
ハリオス テクノ ホールディング	255,300	337.00	86,036,100	貸付有価証券 100株
エノモト	76,900	1,708.00	131,345,200	
日本セラミック	281,400	2,849.00	801,708,600	貸付有価証券 38,000株
遠藤照明	139,900	737.00	103,106,300	貸付有価証券 4,900株
古河電池	197,700	1,513.00	299,120,100	貸付有価証券 138,700株
双信電機	134,300	544.00	73,059,200	貸付有価証券 70,400株
山一電機	180,800	1,624.00	293,619,200	貸付有価証券 2,000株
図研	180,300	3,340.00	602,202,000	貸付有価証券 300株
日本電子	504,800	6,290.00	3,175,192,000	貸付有価証券 169,900株
カシオ計算機	2,230,200	1,848.00	4,121,409,600	貸付有価証券 139,300株
ファナック	2,433,900	26,585.00	64,705,231,500	貸付有価証券 148,300株
日本シイエムケイ	597,300	412.00	246,087,600	貸付有価証券 373,900株

エンプラス	125,300	3,520.00	441,056,000	貸付有価証券 9,200株
大真空	93,500	3,715.00	347,352,500	貸付有価証券 1,000株
ローム	1,152,900	10,140.00	11,690,406,000	
浜松ホトニクス	1,989,500	6,640.00	13,210,280,000	貸付有価証券 35,500株
三井ハイテック	271,900	6,240.00	1,696,656,000	貸付有価証券 12,700株
新光電気工業	931,100	3,975.00	3,701,122,500	
京セラ	4,226,900	6,711.00	28,366,725,900	貸付有価証券 11,600株
太陽誘電	1,233,300	5,520.00	6,807,816,000	貸付有価証券 151,500株
村田製作所	8,146,500	8,937.00	72,805,270,500	
双葉電子工業	474,900	773.00	367,097,700	貸付有価証券 3,400株
北陸電気工業	103,500	993.00	102,775,500	貸付有価証券 2,900株
ニチコン	873,200	1,150.00	1,004,180,000	貸付有価証券 187,400株
日本ケミコン	279,900	2,542.00	711,505,800	貸付有価証券 4,600株
K O A	383,400	1,620.00	621,108,000	貸付有価証券 800株
市光工業	414,500	692.00	286,834,000	貸付有価証券 1,400株
小糸製作所	1,661,300	6,410.00	10,648,933,000	貸付有価証券 156,500株
ミツバ	510,200	768.00	391,833,600	貸付有価証券 32,900株
S C R E E Nホールディングス	481,100	10,220.00	4,916,842,000	貸付有価証券 43,700株
キャノン電子	254,400	1,671.00	425,102,400	
キャノン	13,780,800	2,465.00	33,969,672,000	貸付有価証券 3,213,300株
リコー	7,055,200	1,191.00	8,402,743,200	貸付有価証券 2,635,100株
象印マホービン	750,200	1,579.00	1,184,565,800	貸付有価証券 527,800株
M U T O Hホールディングス	34,800	1,588.00	55,262,400	貸付有価証券 24,500株
東京エレクトロン	1,624,300	45,670.00	74,181,781,000	貸付有価証券 56,400株
トヨタ紡織	807,900	2,206.00	1,782,227,400	貸付有価証券 9,400株
芦森工業	52,200	1,173.00	61,230,600	貸付有価証券 700株
ユニプレス	454,500	957.00	434,956,500	貸付有価証券 92,200株



豊田自動織機	2,244,500	9,230.00	20,716,735,000	貸付有価証券 86,600株
モリタホールディングス	444,300	1,593.00	707,769,900	
三櫻工業	383,500	1,161.00	445,243,500	貸付有価証券 270,900株
デンソー	6,105,900	7,399.00	45,177,554,100	貸付有価証券 150,800株
東海理化電機製作所	730,200	1,739.00	1,269,817,800	貸付有価証券 21,400株
三井E & Sホールディングス	1,073,200	531.00	569,869,200	貸付有価証券 13,500株
川崎重工業	2,157,900	2,341.00	5,051,643,900	貸付有価証券 75,300株
名村造船所	832,800	180.00	149,904,000	貸付有価証券 590,300株
サノヤスホールディングス	339,800	157.00	53,348,600	貸付有価証券 71,800株
日本車輛製造	101,100	2,108.00	213,118,800	貸付有価証券 13,500株
三菱ロジスネクスト	367,100	995.00	365,264,500	貸付有価証券 254,400株
近畿車輛	47,600	1,178.00	56,072,800	貸付有価証券 1,200株
日産自動車	32,706,900	578.60	18,924,212,340	貸付有価証券 990,900株
いすゞ自動車	7,363,400	1,468.00	10,809,471,200	貸付有価証券 985,800株
トヨタ自動車	28,095,100	9,675.00	271,820,092,500	代用有価証券 1,046,500株 貸付有価証券 1,869,100株
日野自動車	3,463,200	953.00	3,300,429,600	貸付有価証券 13,400株
三菱自動車工業	10,265,300	303.00	3,110,385,900	貸付有価証券 5,590,900株
エフテック	193,400	826.00	159,748,400	貸付有価証券 5,900株
レシップホールディングス	109,900	562.00	61,763,800	貸付有価証券 2,500株
G M B	49,800	1,213.00	60,407,400	貸付有価証券 100株
ファルテック	48,500	732.00	35,502,000	貸付有価証券 7,400株
武蔵精密工業	618,100	2,389.00	1,476,640,900	貸付有価証券 4,200株
日産車体	406,100	713.00	289,549,300	貸付有価証券 39,200株
新明和工業	783,500	950.00	744,325,000	貸付有価証券 3,300株
極東開発工業	478,400	1,526.00	730,038,400	貸付有価証券 37,200株

トピー工業	228,100	1,258.00	286,949,800	貸付有価証券 4,500株
ティラド	86,600	2,650.00	229,490,000	貸付有価証券 14,600株
曙ブレーキ工業	1,522,300	164.00	249,657,200	貸付有価証券 879,200株
タチエス	424,800	1,369.00	581,551,200	貸付有価証券 298,800株
N O K	1,341,700	1,323.00	1,775,069,100	
フタバ産業	694,200	527.00	365,843,400	
K Y B	310,400	3,675.00	1,140,720,000	
大同メタル工業	572,800	586.00	335,660,800	貸付有価証券 20,000株
プレス工業	1,374,300	354.00	486,502,200	
ミクニ	351,800	308.00	108,354,400	貸付有価証券 2,300株
太平洋工業	580,700	1,168.00	678,257,600	貸付有価証券 6,500株
河西工業	374,100	396.00	148,143,600	貸付有価証券 40,300株
アイシン	2,029,800	4,660.00	9,458,868,000	貸付有価証券 700株
マツダ	8,704,000	1,062.00	9,243,648,000	貸付有価証券 669,600株
今仙電機製作所	242,500	689.00	167,082,500	貸付有価証券 12,100株
本田技研工業	21,835,600	3,471.00	75,791,367,600	代用有価証券 93,900株
スズキ	5,497,000	4,687.00	25,764,439,000	
S U B A R U	7,947,300	2,151.00	17,094,642,300	
安永	133,700	1,143.00	152,819,100	貸付有価証券 13,800株
ヤマハ発動機	3,918,900	2,798.00	10,965,082,200	貸付有価証券 2,702,600株
T B K	329,400	408.00	134,395,200	貸付有価証券 21,500株
エクセディ	376,600	1,609.00	605,949,400	貸付有価証券 265,600株
豊田合成	895,700	2,663.00	2,385,249,100	貸付有価証券 1,000株
愛三工業	434,100	865.00	375,496,500	
盟和産業	42,200	997.00	42,073,400	貸付有価証券 1,900株
日本プラスト	234,000	692.00	161,928,000	貸付有価証券 9,800株
ヨロズ	237,300	1,173.00	278,352,900	貸付有価証券 42,900株
エフ・シー・シー	453,300	1,550.00	702,615,000	貸付有価証券 38,500株
シマノ	1,037,900	28,030.00	29,092,337,000	貸付有価証券 399,900株

テイ・エス テック	1,288,100	1,635.00	2,106,043,500	
ジャムコ	161,900	1,064.00	172,261,600	貸付有価証券 86,900株
テルモ	8,501,500	4,447.00	37,806,170,500	貸付有価証券 1,500株
クリエートメディック	91,500	960.00	87,840,000	貸付有価証券 3,100株
日機装	895,500	1,099.00	984,154,500	貸付有価証券 111,700株
日本エム・ディ・エム	159,600	2,124.00	338,990,400	貸付有価証券 5,700株
島津製作所	3,568,900	4,295.00	15,328,425,500	貸付有価証券 115,000株
JMS	234,300	796.00	186,502,800	貸付有価証券 51,200株
クボテック	71,400	324.00	23,133,600	
長野計器	200,800	1,024.00	205,619,200	貸付有価証券 2,900株
ブイ・テクノロジー	129,900	5,060.00	657,294,000	貸付有価証券 15,500株
東京計器	176,400	1,045.00	184,338,000	貸付有価証券 3,300株
愛知時計電機	36,500	4,280.00	156,220,000	
インターアクション	138,800	2,419.00	335,757,200	
オーバル	248,000	286.00	70,928,000	貸付有価証券 20,300株
東京精密	467,700	4,805.00	2,247,298,500	貸付有価証券 26,600株
マニー	1,104,600	2,587.00	2,857,600,200	貸付有価証券 696,400株
ニコン	4,234,800	1,086.00	4,598,992,800	貸付有価証券 349,800株
トプコン	1,396,800	1,618.00	2,260,022,400	貸付有価証券 198,100株
オリンパス	15,345,000	2,191.00	33,620,895,000	
理研計器	244,500	2,611.00	638,389,500	貸付有価証券 400株
タムロン	223,400	2,471.00	552,021,400	貸付有価証券 2,100株
HOYA	5,411,400	14,980.00	81,062,772,000	貸付有価証券 34,800株
シード	107,800	763.00	82,251,400	貸付有価証券 48,500株
ノーリツ鋼機	249,300	2,438.00	607,793,400	貸付有価証券 2,000株
エー・アンド・デイ	233,300	970.00	226,301,000	貸付有価証券 4,400株
朝日インテック	2,937,800	2,807.00	8,246,404,600	貸付有価証券 36,200株
シチズン時計	3,518,600	405.00	1,425,033,000	貸付有価証券 289,100株

リズム	86,700	770.00	66,759,000	貸付有価証券 1,000株
大研医器	219,300	545.00	119,518,500	貸付有価証券 34,300株
メニコン	426,200	7,810.00	3,328,622,000	貸付有価証券 123,200株
シンシア	29,500	618.00	18,231,000	貸付有価証券 6,500株
松風	127,100	1,985.00	252,293,500	貸付有価証券 1,800株
セイコーホールディングス	392,100	2,307.00	904,574,700	貸付有価証券 36,800株
ニプロ	2,066,800	1,332.00	2,752,977,600	貸付有価証券 237,200株
中本パックス	70,400	1,589.00	111,865,600	貸付有価証券 400株
スノーピーク	164,200	3,400.00	558,280,000	貸付有価証券 109,000株
パラマウントベッドホールディングス	531,700	1,971.00	1,047,980,700	貸付有価証券 9,000株
トランザクション	151,700	1,359.00	206,160,300	貸付有価証券 106,100株
粧美堂	80,800	416.00	33,612,800	貸付有価証券 4,600株
ニホンフラッシュ	237,300	1,236.00	293,302,800	貸付有価証券 82,800株
前田工織	305,500	3,505.00	1,070,777,500	貸付有価証券 30,700株
永大産業	362,500	296.00	107,300,000	貸付有価証券 17,600株
アートネイチャー	266,500	667.00	177,755,500	
バンダイナムコホールディングス	2,293,700	7,379.00	16,925,212,300	
アイフィスジャパン	70,500	680.00	47,940,000	貸付有価証券 46,100株
共立印刷	463,200	138.00	63,921,600	貸付有価証券 29,500株
S H O E I	260,200	4,175.00	1,086,335,000	貸付有価証券 7,100株
フランスベッドホールディングス	356,400	910.00	324,324,000	
パイロットコーポレーション	468,000	3,785.00	1,771,380,000	貸付有価証券 43,800株
萩原工業	153,900	1,429.00	219,923,100	貸付有価証券 5,400株
トッパン・フォームズ	495,100	1,072.00	530,747,200	
フジシールインターナショナル	569,800	2,230.00	1,270,654,000	貸付有価証券 399,600株
タカラトミー	1,243,600	942.00	1,171,471,200	貸付有価証券 26,600株
廣濟堂	193,200	812.00	156,878,400	貸付有価証券 59,000株

エステールホールディングス	74,000	661.00	48,914,000	貸付有価証券 1,000株
タカノ	94,700	655.00	62,028,500	貸付有価証券 1,900株
プロネクサス	222,500	1,030.00	229,175,000	貸付有価証券 3,500株
ホクシン	171,000	154.00	26,334,000	貸付有価証券 120,200株
ウッドワン	93,200	1,205.00	112,306,000	貸付有価証券 43,900株
大建工業	186,500	2,058.00	383,817,000	貸付有価証券 6,100株
凸版印刷	4,215,500	1,732.00	7,301,246,000	
大日本印刷	3,277,800	2,372.00	7,774,941,600	貸付有価証券 119,500株
共同印刷	85,400	2,650.00	226,310,000	貸付有価証券 3,400株
N I S S H A	569,300	1,560.00	888,108,000	貸付有価証券 43,900株
光村印刷	24,000	1,625.00	39,000,000	貸付有価証券 100株
TAKARA & COMPANY	135,900	1,732.00	235,378,800	貸付有価証券 94,200株
アシックス	2,452,300	2,563.00	6,285,244,900	貸付有価証券 523,300株
ツツミ	69,200	2,360.00	163,312,000	貸付有価証券 1,800株
ローランド	216,300	5,150.00	1,113,945,000	
小松ウオール工業	84,500	1,942.00	164,099,000	貸付有価証券 700株
ヤマハ	1,649,300	5,960.00	9,829,828,000	貸付有価証券 8,500株
河合楽器製作所	77,600	4,025.00	312,340,000	貸付有価証券 1,800株
クリナップ	257,900	536.00	138,234,400	貸付有価証券 1,000株
ピジョン	1,780,700	3,255.00	5,796,178,500	貸付有価証券 1,055,200株
オリバー	58,700	3,775.00	221,592,500	貸付有価証券 300株
兼松サステック	17,900	1,810.00	32,399,000	貸付有価証券 1,500株
キングジム	223,500	885.00	197,797,500	貸付有価証券 108,800株
リンテック	593,800	2,376.00	1,410,868,800	貸付有価証券 1,100株
イトーキ	550,400	345.00	189,888,000	貸付有価証券 6,000株
任天堂	1,587,200	63,160.00	100,247,552,000	貸付有価証券 44,200株
三菱鉛筆	456,700	1,425.00	650,797,500	貸付有価証券 9,000株

タカスタンダード	573,000	1,546.00	885,858,000	貸付有価証券 6,600株
コクヨ	1,330,200	1,769.00	2,353,123,800	貸付有価証券 21,800株
ナカバヤシ	272,700	585.00	159,529,500	貸付有価証券 4,400株
グロープライド	134,300	4,835.00	649,340,500	貸付有価証券 4,700株
オカムラ	953,000	1,457.00	1,388,521,000	貸付有価証券 317,500株
美津濃	274,600	2,571.00	705,996,600	貸付有価証券 700株
東京電力ホールディングス	23,522,600	318.00	7,480,186,800	貸付有価証券 11,344,500株
中部電力	8,484,600	1,334.50	11,322,698,700	貸付有価証券 295,500株
関西電力	10,507,600	1,050.00	11,032,980,000	貸付有価証券 381,700株
中国電力	4,000,200	1,007.00	4,028,201,400	貸付有価証券 511,300株
北陸電力	2,535,500	607.00	1,539,048,500	貸付有価証券 222,200株
東北電力	6,494,900	858.00	5,572,624,200	貸付有価証券 301,900株
四国電力	2,305,000	741.00	1,708,005,000	貸付有価証券 169,800株
九州電力	6,124,200	839.00	5,138,203,800	貸付有価証券 214,700株
北海道電力	2,595,200	512.00	1,328,742,400	貸付有価証券 336,100株
沖縄電力	539,200	1,408.00	759,193,600	貸付有価証券 82,000株
電源開発	2,206,500	1,606.00	3,543,639,000	貸付有価証券 916,600株
エフオン	167,700	954.00	159,985,800	貸付有価証券 117,300株
イーレックス	407,400	2,922.00	1,190,422,800	貸付有価証券 79,900株
レノバ	471,300	5,000.00	2,356,500,000	貸付有価証券 296,700株
東京瓦斯	5,333,300	2,041.00	10,885,265,300	貸付有価証券 142,900株
大阪瓦斯	5,022,800	2,006.00	10,075,736,800	
東邦瓦斯	1,363,900	5,450.00	7,433,255,000	貸付有価証券 441,200株
北海道瓦斯	148,900	1,550.00	230,795,000	貸付有価証券 1,200株
広島ガス	571,900	373.00	213,318,700	貸付有価証券 22,400株
西部ガスホールディングス	312,200	2,467.00	770,197,400	貸付有価証券 20,200株

静岡ガス	787,300	1,025.00	806,982,500	貸付有価証券 58,100株
メタウォーター	312,000	2,020.00	630,240,000	貸付有価証券 11,600株
SBSホールディングス	205,200	3,285.00	674,082,000	貸付有価証券 1,200株
東武鉄道	2,890,500	2,868.00	8,289,954,000	貸付有価証券 173,300株
相鉄ホールディングス	950,700	2,196.00	2,087,737,200	貸付有価証券 357,500株
東急	6,994,300	1,550.00	10,841,165,000	貸付有価証券 780,100株
京浜急行電鉄	3,561,500	1,367.00	4,868,570,500	貸付有価証券 1,132,600株
小田急電鉄	4,442,000	2,795.00	12,415,390,000	貸付有価証券 1,282,900株
京王電鉄	1,549,600	6,460.00	10,010,416,000	貸付有価証券 365,400株
京成電鉄	2,078,300	3,590.00	7,461,097,000	貸付有価証券 161,800株
富士急行	378,100	5,110.00	1,932,091,000	貸付有価証券 263,700株
新京成電鉄	71,200	2,128.00	151,513,600	貸付有価証券 200株
東日本旅客鉄道	4,881,100	8,033.00	39,209,876,300	貸付有価証券 2,562,200株
西日本旅客鉄道	2,471,100	6,466.00	15,978,132,600	貸付有価証券 234,600株
東海旅客鉄道	2,305,800	17,165.00	39,579,057,000	貸付有価証券 101,300株
西武ホールディングス	3,342,100	1,337.00	4,468,387,700	貸付有価証券 956,000株
鴻池運輸	441,300	1,211.00	534,414,300	貸付有価証券 17,900株
西日本鉄道	768,700	2,672.00	2,053,966,400	貸付有価証券 56,600株
ハマキョウレックス	212,800	3,150.00	670,320,000	貸付有価証券 13,200株
サカイ引越センター	127,500	5,660.00	721,650,000	貸付有価証券 100株
近鉄グループホールディングス	2,626,600	3,920.00	10,296,272,000	貸付有価証券 990,300株
阪急阪神ホールディングス	3,503,100	3,475.00	12,173,272,500	貸付有価証券 358,500株
南海電気鉄道	1,244,900	2,388.00	2,972,821,200	貸付有価証券 66,100株
京阪ホールディングス	1,169,400	3,330.00	3,894,102,000	貸付有価証券 415,800株
神戸電鉄	62,500	3,480.00	217,500,000	貸付有価証券 44,100株
名古屋鉄道	2,159,400	2,042.00	4,409,494,800	貸付有価証券 156,700株

山陽電気鉄道	187,500	1,916.00	359,250,000	貸付有価証券 4,600株
アルプス物流	183,200	964.00	176,604,800	
日本通運	909,200	8,100.00	7,364,520,000	貸付有価証券 6,100株
ヤマトホールディングス	3,680,300	3,285.00	12,089,785,500	貸付有価証券 12,900株
山九	673,800	4,860.00	3,274,668,000	貸付有価証券 18,900株
丸運	149,600	275.00	41,140,000	貸付有価証券 4,100株
丸全昭和運輸	213,000	3,210.00	683,730,000	貸付有価証券 13,700株
センコーグループホールディングス	1,448,700	1,067.00	1,545,762,900	貸付有価証券 203,700株
トナミホールディングス	63,000	4,980.00	313,740,000	貸付有価証券 1,100株
ニッコンホールディングス	881,300	2,404.00	2,118,645,200	貸付有価証券 93,600株
日本石油輸送	28,600	2,580.00	73,788,000	
福山通運	336,100	4,050.00	1,361,205,000	貸付有価証券 14,700株
セイノーホールディングス	1,967,000	1,368.00	2,690,856,000	貸付有価証券 173,500株
エスライン	71,600	910.00	65,156,000	貸付有価証券 1,400株
神奈川中央交通	65,100	3,500.00	227,850,000	貸付有価証券 1,900株
日立物流	577,500	4,495.00	2,595,862,500	
丸和運輸機関	554,500	1,499.00	831,195,500	貸付有価証券 177,600株
C & F ロジホールディングス	265,400	1,598.00	424,109,200	貸付有価証券 54,900株
九州旅客鉄道	2,031,600	2,590.00	5,261,844,000	貸付有価証券 315,400株
S Gホールディングス	4,962,500	2,935.00	14,564,937,500	貸付有価証券 1,409,700株
日本郵船	2,196,300	5,390.00	11,838,057,000	貸付有価証券 3,000株
商船三井	1,557,900	5,060.00	7,882,974,000	貸付有価証券 258,500株
川崎汽船	808,800	3,730.00	3,016,824,000	貸付有価証券 84,400株
N S ユナイテッド海運	123,800	2,259.00	279,664,200	貸付有価証券 13,100株
明治海運	279,100	482.00	134,526,200	貸付有価証券 127,200株
飯野海運	1,219,000	421.00	513,199,000	貸付有価証券 99,700株
共栄タンカー	46,100	865.00	39,876,500	



乾汽船	179,600	1,216.00	218,393,600	貸付有価証券 300株
日本航空	6,398,600	2,452.00	15,689,367,200	貸付有価証券 189,600株
A N Aホールディングス	7,088,800	2,720.00	19,281,536,000	貸付有価証券 2,120,300株
パスコ	50,900	1,509.00	76,808,100	貸付有価証券 2,800株
トランコム	80,000	8,230.00	658,400,000	貸付有価証券 8,500株
日新	209,500	1,440.00	301,680,000	貸付有価証券 8,800株
三菱倉庫	908,800	3,225.00	2,930,880,000	貸付有価証券 6,600株
三井倉庫ホールディングス	278,500	2,580.00	718,530,000	貸付有価証券 14,900株
住友倉庫	927,800	1,577.00	1,463,140,600	貸付有価証券 50,100株
澁澤倉庫	144,100	2,131.00	307,077,100	貸付有価証券 7,600株
東陽倉庫	440,200	312.00	137,342,400	貸付有価証券 9,500株
日本トランスシティ	578,100	546.00	315,642,600	貸付有価証券 26,500株
ケイヒン	50,700	1,355.00	68,698,500	貸付有価証券 600株
中央倉庫	160,000	1,023.00	163,680,000	貸付有価証券 4,100株
川西倉庫	48,000	1,154.00	55,392,000	貸付有価証券 33,800株
安田倉庫	215,600	941.00	202,879,600	貸付有価証券 5,700株
ファイズホールディングス	46,600	805.00	37,513,000	貸付有価証券 29,800株
東洋埠頭	80,000	1,469.00	117,520,000	貸付有価証券 1,500株
宇徳	187,000	520.00	97,240,000	貸付有価証券 1,700株
上組	1,444,700	2,253.00	3,254,909,100	
サンリツ	67,200	751.00	50,467,200	貸付有価証券 1,900株
キムラユニティー	70,100	1,302.00	91,270,200	貸付有価証券 1,000株
キューソー流通システム	65,500	1,676.00	109,778,000	貸付有価証券 6,800株
近鉄エクスプレス	496,000	2,522.00	1,250,912,000	貸付有価証券 2,400株
東海運	149,400	306.00	45,716,400	貸付有価証券 3,900株
エーアイティー	164,700	1,050.00	172,935,000	
内外トランスライン	92,100	1,900.00	174,990,000	貸付有価証券 4,700株

日本コンセプト	83,600	1,800.00	150,480,000	貸付有価証券 1,200株
NEC ネットエスアイ	900,000	1,729.00	1,556,100,000	
クロスキャット	71,400	977.00	69,757,800	貸付有価証券 27,600株
システナ	970,500	2,163.00	2,099,191,500	貸付有価証券 97,200株
デジタルアーツ	158,200	8,200.00	1,297,240,000	貸付有価証券 18,000株
日鉄ソリューションズ	393,900	3,530.00	1,390,467,000	
キューブシステム	137,400	997.00	136,987,800	貸付有価証券 96,100株
WOW WORLD	41,800	1,859.00	77,706,200	貸付有価証券 28,700株
コア	115,000	1,402.00	161,230,000	貸付有価証券 4,600株
ラクーンホールディングス	192,500	2,282.00	439,285,000	貸付有価証券 101,000株
ソリトンシステムズ	136,000	1,548.00	210,528,000	貸付有価証券 96,200株
ソフトクリエイイトホールディングス	106,700	2,702.00	288,303,400	貸付有価証券 17,200株
T I S	2,721,200	2,865.00	7,796,238,000	貸付有価証券 25,600株
J N S ホールディングス	133,900	592.00	79,268,800	貸付有価証券 24,500株
グリー	1,668,700	581.00	969,514,700	貸付有価証券 25,700株
GMOペパボ	23,500	4,435.00	104,222,500	貸付有価証券 11,300株
コーエーテクモホールディングス	723,500	5,040.00	3,646,440,000	貸付有価証券 144,600株
三菱総合研究所	116,700	4,040.00	471,468,000	貸付有価証券 800株
ボルテージ	72,900	456.00	33,242,400	貸付有価証券 51,300株
電算	30,200	2,330.00	70,366,000	貸付有価証券 1,300株
A G S	138,300	879.00	121,565,700	貸付有価証券 97,900株
ファインデックス	229,100	1,129.00	258,653,900	貸付有価証券 160,300株
ブレインパッド	70,400	4,675.00	329,120,000	貸付有価証券 49,300株
K L a b	498,800	636.00	317,236,800	貸付有価証券 159,600株
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	361,400	1,022.00	369,350,800	貸付有価証券 4,900株
イーブックイニシアティブジャパン	44,300	3,275.00	145,082,500	貸付有価証券 23,900株
ネクソン	6,891,800	2,308.00	15,906,274,400	貸付有価証券 79,700株

アイスタイル	829,900	481.00	399,181,900	貸付有価証券 515,300株
エムアップホールディングス	70,600	3,385.00	238,981,000	貸付有価証券 5,000株
エイチーム	187,400	1,455.00	272,667,000	貸付有価証券 43,800株
エニグモ	257,000	1,372.00	352,604,000	貸付有価証券 34,600株
テクノスジャパン	210,900	596.00	125,696,400	貸付有価証券 115,100株
e n i s h	141,900	567.00	80,457,300	貸付有価証券 77,700株
コロプラ	893,800	803.00	717,721,400	貸付有価証券 29,600株
オルトプラス	209,800	408.00	85,598,400	貸付有価証券 100,000株
ブロードリーフ	1,348,700	515.00	694,580,500	貸付有価証券 657,800株
クロス・マーケティンググループ	120,400	665.00	80,066,000	貸付有価証券 42,300株
デジタルハーツホールディングス	123,400	1,507.00	185,963,800	貸付有価証券 80,500株
システム情報	203,800	903.00	184,031,400	貸付有価証券 34,900株
メディアドゥ	105,900	4,580.00	485,022,000	貸付有価証券 74,100株
じげん	673,200	452.00	304,286,400	貸付有価証券 5,500株
ブイキューブ	148,400	2,321.00	344,436,400	貸付有価証券 105,100株
エンカレッジ・テクノロジー	47,700	640.00	30,528,000	貸付有価証券 700株
サイバーリンクス	89,700	1,488.00	133,473,600	貸付有価証券 5,500株
ディー・エル・イー	218,700	405.00	88,573,500	貸付有価証券 128,900株
フィックスターズ	289,600	825.00	238,920,000	貸付有価証券 122,400株
C A R T A H O L D I N G S	109,900	1,857.00	204,084,300	貸付有価証券 44,700株
オブティム	189,900	2,101.00	398,979,900	貸付有価証券 134,500株
セレス	89,600	3,075.00	275,520,000	
S H I F T	136,800	16,760.00	2,292,768,000	貸付有価証券 20,100株
ティーガイア	289,700	1,964.00	568,970,800	貸付有価証券 204,700株
セック	39,700	2,645.00	105,006,500	貸付有価証券 7,500株
日本アジアグループ	262,900	960.00	252,384,000	
テクマトリックス	421,600	1,847.00	778,695,200	貸付有価証券 14,800株

プロシップ	79,500	1,416.00	112,572,000	貸付有価証券 2,100株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	655,800	2,021.00	1,325,371,800	貸付有価証券 77,100株
GMOペイメントゲートウェイ	526,800	13,820.00	7,280,376,000	貸付有価証券 107,100株
ザッパラス	105,700	497.00	52,532,900	貸付有価証券 5,900株
システムリサーチ	79,200	2,187.00	173,210,400	貸付有価証券 8,100株
インターネットイニシアティブ	724,600	3,590.00	2,601,314,000	
さくらインターネット	291,500	596.00	173,734,000	貸付有価証券 204,000株
ヴィンクス	76,300	954.00	72,790,200	貸付有価証券 16,600株
GMOグローバルサイン・ホールディングス	60,400	4,520.00	273,008,000	貸付有価証券 100株
SRAホールディングス	144,300	2,672.00	385,569,600	貸付有価証券 400株
システムインテグレータ	76,300	632.00	48,221,600	貸付有価証券 29,400株
朝日ネット	220,400	681.00	150,092,400	貸付有価証券 43,100株
eBASE	324,900	829.00	269,342,100	貸付有価証券 23,800株
アバント	291,400	1,632.00	475,564,800	貸付有価証券 23,300株
アドソル日進	96,700	2,209.00	213,610,300	貸付有価証券 23,700株
ODKソリューションズ	56,500	799.00	45,143,500	貸付有価証券 4,600株
フリービット	161,300	758.00	122,265,400	貸付有価証券 112,900株
コムチュア	249,900	2,346.00	586,265,400	貸付有価証券 12,600株
サイバーコム	48,400	1,416.00	68,534,400	貸付有価証券 19,600株
アステリア	195,800	792.00	155,073,600	貸付有価証券 125,000株
アイル	150,900	1,331.00	200,847,900	貸付有価証券 21,100株
マークラインズ	113,600	2,922.00	331,939,200	貸付有価証券 6,300株
メディカル・データ・ビジョン	310,200	1,988.00	616,677,600	貸付有価証券 57,300株
gumi	376,500	752.00	283,128,000	貸付有価証券 266,700株
ショーケース	58,500	707.00	41,359,500	貸付有価証券 41,300株
モバイルファクトリー	60,900	1,110.00	67,599,000	貸付有価証券 43,000株

テラスカイ	87,800	2,390.00	209,842,000	貸付有価証券 61,800株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	120,100	1,855.00	222,785,500	
P C Iホールディングス	121,700	1,128.00	137,277,600	貸付有価証券 23,200株
パイブドHD	56,100	2,163.00	121,344,300	貸付有価証券 17,600株
アイピーシー	44,300	971.00	43,015,300	貸付有価証券 8,000株
ネオジャパン	51,300	1,490.00	76,437,000	貸付有価証券 36,200株
P R T I M E S	57,900	3,455.00	200,044,500	貸付有価証券 40,900株
ラクス	819,200	3,390.00	2,777,088,000	貸付有価証券 345,800株
ランドコンピュータ	41,200	1,120.00	46,144,000	貸付有価証券 700株
ダブルスタンダード	35,100	5,230.00	183,573,000	貸付有価証券 6,800株
オープンドア	161,500	2,208.00	356,592,000	貸付有価証券 113,600株
マイネット	89,000	671.00	59,719,000	貸付有価証券 62,900株
アカツキ	108,900	3,355.00	365,359,500	貸付有価証券 10,000株
ベネフィットジャパン	20,400	1,960.00	39,984,000	貸付有価証券 3,100株
U b i c o mホールディングス	71,100	3,790.00	269,469,000	貸付有価証券 17,000株
カナミックネットワーク	290,100	603.00	174,930,300	貸付有価証券 5,700株
ノムラシステムコーポレーション	119,400	293.00	34,984,200	貸付有価証券 83,400株
チェンジ	500,600	2,711.00	1,357,126,600	貸付有価証券 354,400株
シンクロ・フード	162,100	365.00	59,166,500	貸付有価証券 17,500株
オークネット	144,000	1,330.00	191,520,000	貸付有価証券 2,200株
キャピタル・アセット・プランニング	54,100	986.00	53,342,600	貸付有価証券 7,400株
セグエグループ	70,100	1,049.00	73,534,900	貸付有価証券 49,400株
エイトレッド	51,500	2,239.00	115,308,500	貸付有価証券 36,000株
A O I T Y O H o l d i n g s	275,000	897.00	246,675,000	
マクロミル	556,300	828.00	460,616,400	
ビーグリー	53,200	1,509.00	80,278,800	貸付有価証券 36,600株
オロ	85,800	3,645.00	312,741,000	貸付有価証券 43,000株

ユーザーローカル	82,100	1,964.00	161,244,400	貸付有価証券 44,600株
テモナ	58,800	1,099.00	64,621,200	貸付有価証券 41,500株
ニーズウェル	55,300	629.00	34,783,700	貸付有価証券 4,000株
サインポスト	65,300	786.00	51,325,800	貸付有価証券 44,600株
電算システムホールディングス	102,200	2,923.00	298,730,600	貸付有価証券 15,300株
ソルクシーズ	103,900	945.00	98,185,500	貸付有価証券 18,300株
フェイス	83,400	721.00	60,131,400	貸付有価証券 1,000株
プロトコーポレーション	324,900	1,320.00	428,868,000	貸付有価証券 29,900株
ハイマックス	77,000	1,077.00	82,929,000	
野村総合研究所	4,727,000	3,580.00	16,922,660,000	
サイバネットシステム	193,300	683.00	132,023,900	貸付有価証券 9,300株
C Eホールディングス	143,700	540.00	77,598,000	貸付有価証券 101,900株
日本システム技術	48,300	1,513.00	73,077,900	貸付有価証券 400株
インテージホールディングス	339,400	1,581.00	536,591,400	貸付有価証券 25,200株
東邦システムサイエンス	71,600	962.00	68,879,200	貸付有価証券 4,300株
ソースネクスト	1,290,600	307.00	396,214,200	貸付有価証券 801,900株
インフォコム	248,000	2,815.00	698,120,000	貸付有価証券 10,900株
HEROZ	77,600	2,141.00	166,141,600	貸付有価証券 34,100株
ラクスル	295,700	5,610.00	1,658,877,000	貸付有価証券 41,700株
I P S	64,000	3,010.00	192,640,000	貸付有価証券 45,000株
F I G	294,400	275.00	80,960,000	貸付有価証券 4,000株
システムサポート	80,300	1,322.00	106,156,600	貸付有価証券 38,900株
イーソル	147,800	1,039.00	153,564,200	貸付有価証券 37,700株
アルテリア・ネットワークス	301,400	1,892.00	570,248,800	貸付有価証券 13,000株
E d u L a b	25,800	5,300.00	136,740,000	貸付有価証券 10,100株
東海ソフト	42,400	1,410.00	59,784,000	貸付有価証券 5,500株
ウイングアーク1 s t	143,100	2,136.00	305,661,600	貸付有価証券 100株

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	61,600	2,380.00	146,608,000	貸付有価証券 17,500株
サーバーワークス	26,400	3,980.00	105,072,000	貸付有価証券 18,600株
東名	25,300	1,047.00	26,489,100	貸付有価証券 7,600株
ヴィッツ	25,000	1,991.00	49,775,000	貸付有価証券 13,900株
トピラスシステムズ	36,100	1,332.00	48,085,200	貸付有価証券 25,300株
Sansan	241,600	9,000.00	2,174,400,000	貸付有価証券 33,800株
Link-U	48,700	1,624.00	79,088,800	貸付有価証券 4,700株
ギフトィ	164,600	3,825.00	629,595,000	貸付有価証券 47,600株
ベース	30,800	5,440.00	167,552,000	
フォーカスシステムズ	182,400	968.00	176,563,200	貸付有価証券 17,700株
クレスコ	178,200	1,834.00	326,818,800	貸付有価証券 4,500株
フジ・メディア・ホールディングス	2,823,100	1,215.00	3,430,066,500	貸付有価証券 125,900株
オービック	857,600	20,660.00	17,718,016,000	貸付有価証券 66,400株
ジャストシステム	387,100	6,350.00	2,458,085,000	貸付有価証券 225,200株
TDCソフト	237,900	1,004.00	238,851,600	貸付有価証券 6,500株
Zホールディングス	37,386,000	559.10	20,902,512,600	貸付有価証券 3,519,900株
トレンドマイクロ	1,453,900	5,800.00	8,432,620,000	貸付有価証券 540,800株
IDホールディングス	155,650	912.00	141,952,800	
日本オラクル	552,100	8,160.00	4,505,136,000	貸付有価証券 100,700株
アルファシステムズ	72,600	3,600.00	261,360,000	貸付有価証券 4,500株
フューチャー	328,300	1,925.00	631,977,500	貸付有価証券 6,000株
CAC Holdings	176,900	1,419.00	251,021,100	貸付有価証券 24,300株
S Bテクノロジー	97,900	2,986.00	292,329,400	貸付有価証券 51,700株
トーセ	73,500	800.00	58,800,000	貸付有価証券 8,200株
オービックビジネスコンサルタント	259,700	6,340.00	1,646,498,000	貸付有価証券 21,100株
伊藤忠テクノソリューションズ	1,239,900	3,420.00	4,240,458,000	
アイティフォー	354,700	768.00	272,409,600	貸付有価証券 2,300株

東計電算	40,200	4,410.00	177,282,000	貸付有価証券 1,900株
エクスネット	42,700	1,024.00	43,724,800	
大塚商会	1,472,400	5,770.00	8,495,748,000	貸付有価証券 128,300株
サイボウズ	318,000	2,444.00	777,192,000	貸付有価証券 225,300株
電通国際情報サービス	336,700	4,595.00	1,547,136,500	
A C C E S S	339,900	852.00	289,594,800	貸付有価証券 239,600株
デジタルガレージ	449,400	4,840.00	2,175,096,000	貸付有価証券 32,700株
E Mシステムズ	449,200	816.00	366,547,200	貸付有価証券 17,300株
ウェザーニューズ	81,600	5,560.00	453,696,000	
C I J	175,700	818.00	143,722,600	貸付有価証券 7,200株
ビジネスエンジニアリング	27,100	3,205.00	86,855,500	貸付有価証券 10,600株
日本エンタープライズ	276,500	209.00	57,788,500	貸付有価証券 188,500株
WOWOW	130,400	2,425.00	316,220,000	貸付有価証券 91,200株
スカラ	242,200	755.00	182,861,000	貸付有価証券 75,200株
インテリジェント ウェイブ	158,800	595.00	94,486,000	貸付有価証券 8,400株
I M A G I C A G R O U P	231,200	428.00	98,953,600	貸付有価証券 32,900株
ネットワンシステムズ	1,110,700	3,735.00	4,148,464,500	貸付有価証券 31,900株
システムソフト	562,300	217.00	122,019,100	貸付有価証券 393,600株
アルゴグラフィックス	211,700	3,440.00	728,248,000	貸付有価証券 4,800株
マーベラス	428,600	764.00	327,450,400	貸付有価証券 57,000株
エイベックス	468,500	1,719.00	805,351,500	貸付有価証券 100株
日本ユニシス	944,200	3,440.00	3,248,048,000	
兼松エレクトロニクス	147,900	3,600.00	532,440,000	貸付有価証券 1,900株
都築電気	121,600	1,615.00	196,384,000	貸付有価証券 9,900株
T B Sホールディングス	1,805,200	1,684.00	3,039,956,800	
日本テレビホールディングス	2,271,600	1,241.00	2,819,055,600	
朝日放送グループホールディングス	270,200	701.00	189,410,200	貸付有価証券 3,300株
テレビ朝日ホールディングス	841,000	1,704.00	1,433,064,000	貸付有価証券 349,300株



スカパーJ S A Tホールディングス	1,791,000	405.00	725,355,000	貸付有価証券 5,600株
テレビ東京ホールディングス	194,800	2,078.00	404,794,400	貸付有価証券 500株
日本BS放送	92,000	1,092.00	100,464,000	貸付有価証券 4,900株
ビジョン	337,800	1,073.00	362,459,400	貸付有価証券 166,800株
スマートバリュー	70,700	670.00	47,369,000	貸付有価証券 48,000株
USEN-NEXT HOLDINGS	258,700	2,439.00	630,969,300	貸付有価証券 22,800株
ワイヤレスゲート	111,400	424.00	47,233,600	貸付有価証券 78,700株
コネクシオ	154,100	1,500.00	231,150,000	
日本通信	2,404,300	211.00	507,307,300	貸付有価証券 1,587,800株
クロップス	49,600	873.00	43,300,800	貸付有価証券 4,500株
日本電信電話	31,829,600	2,844.00	90,523,382,400	代用有価証券 800,000株
KDDI	21,823,500	3,466.00	75,640,251,000	貸付有価証券 1,245,600株
ソフトバンク	24,731,000	1,450.00	35,859,950,000	貸付有価証券 481,000株
光通信	320,600	20,590.00	6,601,154,000	貸付有価証券 60,000株
エムティーアイ	263,600	678.00	178,720,800	貸付有価証券 186,600株
GMOインターネット	963,400	2,954.00	2,845,883,600	貸付有価証券 21,000株
ファイバーゲート	88,200	1,450.00	127,890,000	貸付有価証券 36,700株
アйдママーケティングコミュニケーション	69,800	400.00	27,920,000	貸付有価証券 2,100株
KADOKAWA	704,300	4,310.00	3,035,533,000	貸付有価証券 13,300株
学研ホールディングス	384,300	1,278.00	491,135,400	貸付有価証券 15,400株
ゼンリン	493,400	1,116.00	550,634,400	貸付有価証券 26,500株
昭文社ホールディングス	109,500	482.00	52,779,000	貸付有価証券 1,200株
インプレスホールディングス	225,300	220.00	49,566,000	貸付有価証券 157,700株
アイネット	139,800	1,446.00	202,150,800	貸付有価証券 2,900株
松竹	180,000	12,760.00	2,296,800,000	貸付有価証券 3,000株
東宝	1,605,700	4,555.00	7,313,963,500	貸付有価証券 118,200株

東映	89,000	20,110.00	1,789,790,000	貸付有価証券 14,200株
エヌ・ティ・ティ・データ	7,245,600	1,727.00	12,513,151,200	
ピー・シー・エー	39,800	3,755.00	149,449,000	貸付有価証券 4,500株
ビジネスブレイン太田昭和	93,000	1,711.00	159,123,000	貸付有価証券 8,800株
D T S	564,600	2,629.00	1,484,333,400	貸付有価証券 200株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,160,500	5,200.00	6,034,600,000	貸付有価証券 40,100株
シーイーシー	291,400	1,634.00	476,147,600	
カブコン	2,332,400	3,015.00	7,032,186,000	貸付有価証券 232,800株
アイ・エス・ピー	125,400	1,481.00	185,717,400	貸付有価証券 1,200株
ジャステック	173,200	1,257.00	217,712,400	貸付有価証券 35,600株
S C S K	627,900	6,710.00	4,213,209,000	
日本システムウエア	89,800	2,233.00	200,523,400	貸付有価証券 100株
アイネス	267,500	1,383.00	369,952,500	貸付有価証券 36,700株
T K C	460,300	3,255.00	1,498,276,500	貸付有価証券 4,300株
富士ソフト	290,200	5,480.00	1,590,296,000	貸付有価証券 17,800株
N S D	874,600	1,808.00	1,581,276,800	貸付有価証券 36,400株
コナミホールディングス	988,400	6,250.00	6,177,500,000	貸付有価証券 46,200株
福井コンピュータホールディングス	124,800	4,110.00	512,928,000	貸付有価証券 9,200株
J B C Cホールディングス	183,600	1,449.00	266,036,400	
ミロク情報サービス	269,700	1,541.00	415,607,700	貸付有価証券 47,900株
ソフトバンクグループ	21,593,800	7,380.00	159,362,244,000	代用有価証券 500,000株 貸付有価証券 500,300株
ハウスイ	21,800	922.00	20,099,600	
高千穂交易	105,100	1,150.00	120,865,000	貸付有価証券 74,400株
オルパヘルスケアホールディングス	44,400	1,674.00	74,325,600	貸付有価証券 400株
伊藤忠食品	65,700	5,190.00	340,983,000	貸付有価証券 6,700株
エレマテック	218,600	1,245.00	272,157,000	貸付有価証券 3,300株
J A L U X	77,000	1,749.00	134,673,000	貸付有価証券 15,200株

あらた	217,300	4,125.00	896,362,500	貸付有価証券 9,800株
トーメンデバイス	35,100	4,055.00	142,330,500	貸付有価証券 3,800株
東京エレクトロン デバイス	89,900	5,240.00	471,076,000	貸付有価証券 27,200株
フィールズ	239,100	541.00	129,353,100	
双日	15,085,800	334.00	5,038,657,200	貸付有価証券 985,300株
アルフレッサ ホールディングス	2,833,000	1,677.00	4,750,941,000	
横浜冷凍	765,500	871.00	666,750,500	貸付有価証券 35,100株
神栄	37,500	1,246.00	46,725,000	貸付有価証券 12,000株
ラサ商事	144,500	898.00	129,761,000	
アルコニックス	290,400	1,433.00	416,143,200	
神戸物産	1,884,600	3,735.00	7,038,981,000	貸付有価証券 829,800株
ハイパー	55,300	550.00	30,415,000	貸付有価証券 7,200株
あい ホールディングス	389,800	2,130.00	830,274,000	貸付有価証券 177,500株
ディーブイエックス	83,600	979.00	81,844,400	貸付有価証券 1,500株
ダイワボウホールディングス	1,244,500	1,910.00	2,376,995,000	貸付有価証券 36,900株
マクニカ・富士エレホールディングス	651,300	2,634.00	1,715,524,200	貸付有価証券 27,900株
ラクト・ジャパン	119,200	2,680.00	319,456,000	貸付有価証券 14,300株
グリムス	80,900	1,952.00	157,916,800	貸付有価証券 50,200株
パイタルケーエスケー・ホールディングス	474,400	738.00	350,107,200	
八洲電機	211,000	955.00	201,505,000	貸付有価証券 25,200株
メディアスホールディングス	154,800	1,025.00	158,670,000	貸付有価証券 24,000株
レスターホールディングス	284,800	1,877.00	534,569,600	貸付有価証券 2,200株
ジュテックホールディングス	62,200	1,023.00	63,630,600	貸付有価証券 2,200株
大光	104,200	680.00	70,856,000	貸付有価証券 1,800株
OCHIホールディングス	79,100	1,278.00	101,089,800	貸付有価証券 700株
TOKAIホールディングス	1,323,000	894.00	1,182,762,000	貸付有価証券 919,700株
黒谷	74,100	851.00	63,059,100	貸付有価証券 52,400株
Cominix	47,300	739.00	34,954,700	貸付有価証券 900株

三洋貿易	274,700	1,225.00	336,507,500	
ビューティガレージ	43,900	4,445.00	195,135,500	貸付有価証券 30,700株
ウイン・パートナーズ	197,000	981.00	193,257,000	貸付有価証券 9,700株
ミタチ産業	74,900	833.00	62,391,700	貸付有価証券 23,500株
シップヘルスケアホールディングス	962,900	2,706.00	2,605,607,400	貸付有価証券 215,200株
明治電機工業	93,500	1,396.00	130,526,000	貸付有価証券 1,900株
デリカフーズホールディングス	105,600	646.00	68,217,600	貸付有価証券 10,900株
スターティアホールディングス	52,900	2,034.00	107,598,600	貸付有価証券 36,700株
コメダホールディングス	595,600	2,065.00	1,229,914,000	貸付有価証券 8,600株
ピーバンドットコム	37,100	786.00	29,160,600	貸付有価証券 5,800株
アセンテック	69,900	1,185.00	82,831,500	貸付有価証券 22,000株
富士興産	82,800	1,087.00	90,003,600	貸付有価証券 35,100株
協栄産業	30,300	1,482.00	44,904,600	貸付有価証券 900株
小野建	244,700	1,259.00	308,077,300	貸付有価証券 159,500株
南陽	55,500	1,969.00	109,279,500	貸付有価証券 200株
佐島電機	170,000	802.00	136,340,000	貸付有価証券 10,600株
エコートレーディング	57,200	605.00	34,606,000	
伯東	166,300	1,511.00	251,279,300	
コンドーテック	211,200	978.00	206,553,600	貸付有価証券 1,300株
中山福	156,600	434.00	67,964,400	貸付有価証券 4,400株
ナガイレーベン	362,100	2,519.00	912,129,900	貸付有価証券 2,700株
三菱食品	300,300	2,741.00	823,122,300	貸付有価証券 9,600株
松田産業	199,100	2,141.00	426,273,100	貸付有価証券 19,400株
第一興商	518,400	4,265.00	2,210,976,000	貸付有価証券 57,400株
メディパルホールディングス	2,737,000	2,154.00	5,895,498,000	貸付有価証券 25,700株
S P K	117,000	1,337.00	156,429,000	貸付有価証券 200株
萩原電気ホールディングス	100,900	2,226.00	224,603,400	

アズワン	195,900	15,070.00	2,952,213,000	貸付有価証券 57,100株
スズデン	94,600	1,466.00	138,683,600	貸付有価証券 4,600株
尾家産業	79,700	1,208.00	96,277,600	貸付有価証券 900株
シモジマ	167,100	1,072.00	179,131,200	貸付有価証券 5,700株
ドウシシャ	257,400	1,691.00	435,263,400	
小津産業	59,900	1,906.00	114,169,400	貸付有価証券 300株
高速	144,500	1,435.00	207,357,500	貸付有価証券 4,900株
たけびし	95,600	1,529.00	146,172,400	貸付有価証券 65,900株
リックス	61,400	1,518.00	93,205,200	貸付有価証券 1,500株
丸文	241,500	624.00	150,696,000	貸付有価証券 24,200株
ハピネット	227,800	1,453.00	330,993,400	貸付有価証券 1,000株
橋本総業ホールディングス	55,000	2,746.00	151,030,000	貸付有価証券 300株
日本ライフライン	882,600	1,361.00	1,201,218,600	貸付有価証券 130,500株
タカショー	177,000	822.00	145,494,000	貸付有価証券 125,300株
マルカ	88,300	2,427.00	214,304,100	貸付有価証券 7,800株
I D O M	920,400	657.00	604,702,800	貸付有価証券 100株
進和	161,400	2,198.00	354,757,200	貸付有価証券 112,900株
エスケイジャパン	65,800	452.00	29,741,600	貸付有価証券 28,400株
ダイトロン	115,300	1,917.00	221,030,100	貸付有価証券 2,100株
シークス	347,200	1,409.00	489,204,800	貸付有価証券 59,800株
田中商事	83,600	671.00	56,095,600	貸付有価証券 3,100株
オーハシテクニカ	139,800	1,482.00	207,183,600	貸付有価証券 1,100株
白銅	97,700	2,183.00	213,279,100	貸付有価証券 3,200株
ダイコー通産	32,100	1,408.00	45,196,800	貸付有価証券 15,800株
伊藤忠商事	19,104,700	3,188.00	60,905,783,600	
丸紅	26,935,400	942.30	25,381,227,420	
高島	43,100	1,778.00	76,631,800	

長瀬産業	1,499,600	1,642.00	2,462,343,200	貸付有価証券 17,200株
蝶理	174,300	1,744.00	303,979,200	貸付有価証券 5,300株
豊田通商	2,743,600	5,120.00	14,047,232,000	貸付有価証券 55,100株
三共生興	413,300	551.00	227,728,300	
兼松	1,091,300	1,444.00	1,575,837,200	貸付有価証券 10,000株
ツカモトコーポレーション	45,600	1,405.00	64,068,000	貸付有価証券 1,800株
三井物産	21,789,400	2,528.00	55,083,603,200	貸付有価証券 318,900株
日本紙パルプ商事	142,300	3,565.00	507,299,500	貸付有価証券 300株
カメイ	356,000	1,115.00	396,940,000	貸付有価証券 2,600株
東都水産	31,200	5,040.00	157,248,000	貸付有価証券 21,900株
OUGホールディングス	43,100	2,860.00	123,266,000	貸付有価証券 30,100株
スターゼン	201,700	2,100.00	423,570,000	
山善	1,066,700	1,005.00	1,072,033,500	貸付有価証券 53,600株
椿本興業	50,400	3,350.00	168,840,000	貸付有価証券 1,400株
住友商事	17,237,700	1,469.50	25,330,800,150	貸付有価証券 479,400株
内田洋行	116,600	4,825.00	562,595,000	貸付有価証券 1,200株
三菱商事	16,630,000	3,066.00	50,987,580,000	
第一実業	124,100	4,290.00	532,389,000	貸付有価証券 1,100株
キャノンマーケティングジャパン	677,200	2,565.00	1,737,018,000	貸付有価証券 65,700株
西華産業	143,500	1,557.00	223,429,500	貸付有価証券 6,900株
佐藤商事	225,300	1,067.00	240,395,100	貸付有価証券 5,300株
菱洋エレクトロ	207,700	2,570.00	533,789,000	貸付有価証券 145,300株
東京産業	246,900	658.00	162,460,200	貸付有価証券 86,900株
ユアサ商事	279,100	3,010.00	840,091,000	
神鋼商事	61,000	2,344.00	142,984,000	貸付有価証券 2,500株
トルク	162,800	231.00	37,606,800	貸付有価証券 14,100株
阪和興業	546,700	3,095.00	1,692,036,500	貸付有価証券 13,800株

正栄食品工業	176,700	3,825.00	675,877,500	貸付有価証券 74,700株
カナデン	221,600	1,039.00	230,242,400	貸付有価証券 2,400株
菱電商事	196,500	1,645.00	323,242,500	貸付有価証券 137,200株
フルサト工業	138,000	1,886.00	260,268,000	貸付有価証券 97,300株
岩谷産業	655,500	6,630.00	4,345,965,000	貸付有価証券 74,900株
ナイス	108,100	1,982.00	214,254,200	貸付有価証券 4,200株
ニチモウ	42,400	2,057.00	87,216,800	
極東貿易	78,300	2,490.00	194,967,000	貸付有価証券 3,800株
アステナホールディングス	398,500	646.00	257,431,000	貸付有価証券 33,400株
三愛石油	672,400	1,359.00	913,791,600	貸付有価証券 47,400株
稲畑産業	656,100	1,660.00	1,089,126,000	
G S I クレオス	133,600	935.00	124,916,000	貸付有価証券 90,000株
明和産業	251,800	464.00	116,835,200	貸付有価証券 51,200株
クワザワホールディングス	97,000	617.00	59,849,000	貸付有価証券 8,500株
ヤマエ久野	198,900	1,210.00	240,669,000	貸付有価証券 9,800株
ワキタ	537,500	1,000.00	537,500,000	貸付有価証券 21,900株
東邦ホールディングス	876,100	1,834.00	1,606,767,400	
サンゲツ	734,100	1,568.00	1,151,068,800	貸付有価証券 700株
ミツウロコグループホールディングス	402,600	1,222.00	491,977,200	貸付有価証券 22,900株
シナネンホールディングス	101,100	3,075.00	310,882,500	貸付有価証券 4,600株
伊藤忠エネクス	603,900	971.00	586,386,900	
サンリオ	766,900	1,982.00	1,519,995,800	貸付有価証券 249,700株
サンワテクノス	179,600	1,291.00	231,863,600	貸付有価証券 3,700株
リョーサン	301,300	2,078.00	626,101,400	貸付有価証券 6,900株
新光商事	368,200	762.00	280,568,400	
トーヨー	123,300	1,565.00	192,964,500	貸付有価証券 5,300株
三信電気	146,400	2,159.00	316,077,600	貸付有価証券 98,100株
東陽テクニカ	269,500	1,099.00	296,180,500	貸付有価証券 300株

モスフードサービス	385,900	3,130.00	1,207,867,000	貸付有価証券 261,600株
加賀電子	247,100	2,889.00	713,871,900	貸付有価証券 6,400株
ソーダニッカ	260,000	546.00	141,960,000	貸付有価証券 2,500株
立花エレテック	201,700	1,445.00	291,456,500	貸付有価証券 140,800株
フォーバル	95,500	906.00	86,523,000	貸付有価証券 2,100株
PALTA C	437,800	5,310.00	2,324,718,000	貸付有価証券 3,000株
三谷産業	359,000	373.00	133,907,000	貸付有価証券 18,500株
太平洋興発	107,300	635.00	68,135,500	貸付有価証券 5,800株
西本Wismettacホールディングス	61,800	2,798.00	172,916,400	貸付有価証券 39,200株
ヤマシタヘルスケアホールディングス	24,200	1,985.00	48,037,000	貸付有価証券 1,500株
コア商事ホールディングス	204,700	646.00	132,236,200	貸付有価証券 124,300株
国際紙バルブ商事	581,700	254.00	147,751,800	貸付有価証券 3,200株
ヤマタネ	117,200	1,519.00	178,026,800	
丸紅建材リース	26,600	1,876.00	49,901,600	貸付有価証券 700株
日鉄物産	194,700	4,440.00	864,468,000	
泉州電業	76,700	3,790.00	290,693,000	貸付有価証券 4,400株
トラスコ中山	625,200	2,742.00	1,714,298,400	貸付有価証券 46,000株
オートバックスセブン	989,100	1,517.00	1,500,464,700	貸付有価証券 18,300株
モリト	198,900	601.00	119,538,900	貸付有価証券 1,100株
加藤産業	394,200	3,290.00	1,296,918,000	貸付有価証券 20,800株
北恵	69,000	981.00	67,689,000	貸付有価証券 900株
イノテック	153,300	1,325.00	203,122,500	貸付有価証券 5,500株
イエローハット	515,800	2,026.00	1,045,010,800	貸付有価証券 164,500株
J Kホールディングス	246,700	810.00	199,827,000	貸付有価証券 15,900株
日伝	226,500	2,093.00	474,064,500	貸付有価証券 27,700株
北沢産業	184,600	245.00	45,227,000	貸付有価証券 7,400株
杉本商事	137,400	2,274.00	312,447,600	貸付有価証券 7,500株



因幡電機産業	728,700	2,565.00	1,869,115,500	貸付有価証券 12,400株
東テク	90,300	2,772.00	250,311,600	
ミスミグループ本社	3,426,700	3,880.00	13,295,596,000	貸付有価証券 183,100株
アルテック	200,000	310.00	62,000,000	貸付有価証券 40,000株
タキヒヨー	89,900	1,847.00	166,045,300	貸付有価証券 62,900株
蔵王産業	52,600	1,497.00	78,742,200	
スズケン	1,156,800	3,315.00	3,834,792,000	
ジェコス	188,200	878.00	165,239,600	
グローセル	295,800	434.00	128,377,200	貸付有価証券 208,600株
ローソン	690,900	5,100.00	3,523,590,000	貸付有価証券 427,200株
サンエー	206,500	4,105.00	847,682,500	貸付有価証券 34,500株
カワチ薬品	190,500	2,180.00	415,290,000	貸付有価証券 12,300株
エービーシー・マート	426,400	6,270.00	2,673,528,000	
ハードオフコーポレーション	120,100	764.00	91,756,400	貸付有価証券 3,000株
アスクル	441,400	1,661.00	733,165,400	
ゲオホールディングス	365,100	1,227.00	447,977,700	貸付有価証券 258,700株
アダストリア	378,100	1,946.00	735,782,600	貸付有価証券 256,800株
ジーフット	164,900	411.00	67,773,900	貸付有価証券 116,700株
シー・ヴィ・エス・バイエリア	39,200	425.00	16,660,000	貸付有価証券 27,500株
くら寿司	320,800	4,195.00	1,345,756,000	貸付有価証券 204,200株
キャンドウ	129,900	1,907.00	247,719,300	貸付有価証券 91,800株
アイケイ	78,700	752.00	59,182,400	貸付有価証券 36,800株
パルグループホールディングス	239,000	1,701.00	406,539,000	貸付有価証券 8,300株
エディオン	1,157,300	1,067.00	1,234,839,100	貸付有価証券 655,400株
サーラコーポレーション	554,400	593.00	328,759,200	貸付有価証券 30,900株
ワッツ	132,200	915.00	120,963,000	貸付有価証券 93,500株
ハローズ	109,400	2,716.00	297,130,400	
フジオフードグループ本社	230,400	1,296.00	298,598,400	貸付有価証券 9,600株
あみやき亭	59,000	2,952.00	174,168,000	貸付有価証券 41,300株

ひらまつ	502,100	208.00	104,436,800	貸付有価証券 199,000株
大黒天物産	87,200	6,860.00	598,192,000	貸付有価証券 58,700株
ハニーズホールディングス	216,200	1,151.00	248,846,200	貸付有価証券 123,900株
ファーマライズホールディングス	66,200	741.00	49,054,200	貸付有価証券 9,400株
アルペン	209,200	3,055.00	639,106,000	貸付有価証券 146,600株
ハブ	87,300	716.00	62,506,800	貸付有価証券 8,600株
クオールホールディングス	368,400	1,478.00	544,495,200	
ジinzホールディングス	185,800	8,090.00	1,503,122,000	貸付有価証券 130,200株
ビックカメラ	1,620,000	1,098.00	1,778,760,000	貸付有価証券 1,133,900株
D C Mホールディングス	1,685,300	1,055.00	1,777,991,500	貸付有価証券 106,300株
ペッパーフードサービス	402,700	405.00	163,093,500	貸付有価証券 281,300株
MonotaRO	3,884,500	2,560.00	9,944,320,000	貸付有価証券 697,600株
東京一番フーズ	69,200	585.00	40,482,000	貸付有価証券 47,700株
D Dホールディングス	134,400	518.00	69,619,200	貸付有価証券 92,600株
きちりホールディングス	72,700	590.00	42,893,000	貸付有価証券 1,400株
アークランドサービスホールディングス	228,000	2,215.00	505,020,000	貸付有価証券 160,300株
J . フロント リテイリング	3,261,500	995.00	3,245,192,500	
ドトール・日レスホールディングス	432,000	1,755.00	758,160,000	貸付有価証券 3,000株
マツモトキヨシホールディングス	1,129,000	4,725.00	5,334,525,000	
ブロンコビリー	142,800	2,383.00	340,292,400	貸付有価証券 18,700株
Z O Z O	1,610,000	3,540.00	5,699,400,000	貸付有価証券 9,900株
トレジャー・ファクトリー	79,900	967.00	77,263,300	貸付有価証券 18,400株
物語コーポレーション	145,500	7,650.00	1,113,075,000	貸付有価証券 9,300株
ココカラファイン	243,400	7,940.00	1,932,596,000	貸付有価証券 152,500株
三越伊勢丹ホールディングス	4,779,400	796.00	3,804,402,400	貸付有価証券 185,900株
H a m e e	70,000	1,406.00	98,420,000	貸付有価証券 49,400株
マーケットエンタープライズ	17,100	1,104.00	18,878,400	貸付有価証券 11,900株

ウエルシアホールディングス	1,444,000	3,305.00	4,772,420,000	貸付有価証券 122,400株
クリエイトSDホールディングス	402,700	3,185.00	1,282,599,500	貸付有価証券 208,400株
丸善CHIホールディングス	318,800	398.00	126,882,400	貸付有価証券 225,800株
ミサワ	55,100	676.00	37,247,600	貸付有価証券 100株
ティーライフ	36,600	1,567.00	57,352,200	貸付有価証券 25,800株
エー・ピーホールディングス	51,200	501.00	25,651,200	貸付有価証券 3,800株
チムニー	83,300	1,400.00	116,620,000	貸付有価証券 58,800株
シュッピン	185,800	1,089.00	202,336,200	貸付有価証券 13,700株
オイシックス・ラ・大地	360,000	4,255.00	1,531,800,000	貸付有価証券 61,100株
ネクステージ	481,600	1,989.00	957,902,400	貸付有価証券 83,700株
ジョイフル本田	800,000	1,315.00	1,052,000,000	貸付有価証券 559,400株
鳥貴族ホールディングス	100,100	1,816.00	181,781,600	貸付有価証券 70,900株
ホットランド	204,000	1,330.00	271,320,000	貸付有価証券 40,600株
すかいらーくホールディングス	3,480,400	1,510.00	5,255,404,000	貸付有価証券 2,436,100株
SFPホールディングス	133,200	1,468.00	195,537,600	貸付有価証券 94,400株
綿半ホールディングス	204,800	1,200.00	245,760,000	貸付有価証券 145,000株
ヨシックスホールディングス	53,300	2,304.00	122,803,200	貸付有価証券 1,200株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	793,700	1,005.00	797,668,500	貸付有価証券 555,500株
ゴルフダイジェスト・オンライン	141,600	1,681.00	238,029,600	貸付有価証券 1,000株
B E E N O S	137,800	3,500.00	482,300,000	貸付有価証券 1,400株
あさひ	203,300	1,364.00	277,301,200	貸付有価証券 144,000株
日本調剤	165,600	1,630.00	269,928,000	貸付有価証券 46,400株
コスモス薬品	275,500	15,920.00	4,385,960,000	貸付有価証券 8,000株
トーエル	132,300	805.00	106,501,500	貸付有価証券 6,200株
オンリー	46,300	465.00	21,529,500	貸付有価証券 11,400株
セブン&アイ・ホールディングス	10,685,400	5,124.00	54,751,989,600	貸付有価証券 118,000株

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,468,100	946.00	1,388,822,600	貸付有価証券 1,027,600株
ツルハホールディングス	595,800	12,540.00	7,471,332,000	貸付有価証券 104,200株
サンマルクホールディングス	215,700	1,600.00	345,120,000	貸付有価証券 5,400株
フェリシモ	60,500	1,786.00	108,053,000	貸付有価証券 42,800株
トリドールホールディングス	676,200	1,888.00	1,276,665,600	貸付有価証券 472,900株
T O K Y O B A S E	247,000	660.00	163,020,000	貸付有価証券 22,400株
ウイルプラスホールディングス	42,600	1,001.00	42,642,600	貸付有価証券 29,000株
J Mホールディングス	183,800	2,105.00	386,899,000	貸付有価証券 130,200株
サツドラホールディングス	40,800	2,016.00	82,252,800	貸付有価証券 2,700株
アレンザホールディングス	208,000	1,222.00	254,176,000	貸付有価証券 26,300株
串カツ田中ホールディングス	72,400	1,846.00	133,650,400	貸付有価証券 37,200株
バロックジャパンリミテッド	189,400	796.00	150,762,400	
クスリのアオキホールディングス	271,500	7,180.00	1,949,370,000	貸付有価証券 190,000株
力の源ホールディングス	124,400	610.00	75,884,000	貸付有価証券 87,600株
F O O D & L I F E C O M P A N I E	1,599,000	4,275.00	6,835,725,000	貸付有価証券 49,800株
メディカルシステムネットワーク	237,400	728.00	172,827,200	貸付有価証券 4,300株
はるやまホールディングス	127,800	640.00	81,792,000	貸付有価証券 1,500株
ノジマ	485,800	2,741.00	1,331,577,800	貸付有価証券 8,500株
カップ・クリエイト	382,900	1,441.00	551,758,900	貸付有価証券 271,300株
ライトオン	204,100	708.00	144,502,800	貸付有価証券 142,200株
良品計画	3,142,800	2,070.00	6,505,596,000	貸付有価証券 327,400株
三城ホールディングス	337,900	265.00	89,543,500	貸付有価証券 2,400株
アドヴァングループ	278,000	917.00	254,926,000	貸付有価証券 5,800株
アルビス	87,700	2,300.00	201,710,000	貸付有価証券 4,700株
コナカ	321,800	346.00	111,342,800	貸付有価証券 227,800株
ハウス オブ ローゼ	33,400	1,651.00	55,143,400	
G - 7ホールディングス	132,800	3,315.00	440,232,000	

イオン北海道	360,100	1,042.00	375,224,200	貸付有価証券 245,200株
コジマ	469,600	724.00	339,990,400	貸付有価証券 332,800株
ヒマラヤ	95,500	1,062.00	101,421,000	貸付有価証券 67,700株
コーナン商事	388,200	3,740.00	1,451,868,000	貸付有価証券 82,500株
エコス	100,300	1,854.00	185,956,200	貸付有価証券 70,200株
ワタミ	358,900	956.00	343,108,400	貸付有価証券 176,000株
マルシェ	71,800	504.00	36,187,200	貸付有価証券 50,800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	5,460,900	2,389.00	13,046,090,100	貸付有価証券 2,605,400株
西松屋チェーン	599,200	1,406.00	842,475,200	貸付有価証券 422,700株
ゼンショーホールディングス	1,466,800	2,820.00	4,136,376,000	貸付有価証券 1,039,200株
幸楽苑ホールディングス	173,300	1,532.00	265,495,600	貸付有価証券 16,600株
ハークスレイ	57,000	991.00	56,487,000	貸付有価証券 2,800株
サイゼリヤ	405,100	2,697.00	1,092,554,700	貸付有価証券 283,500株
V Tホールディングス	1,027,900	458.00	470,778,200	貸付有価証券 70,300株
魚力	85,000	2,045.00	173,825,000	貸付有価証券 4,800株
ポブラ	71,000	268.00	19,028,000	貸付有価証券 20,700株
フジ・コーポレーション	144,400	1,286.00	185,698,400	貸付有価証券 100,800株
ユナイテッドアローズ	312,200	2,087.00	651,561,400	貸付有価証券 6,400株
ハイデイ日高	394,200	1,925.00	758,835,000	貸付有価証券 274,800株
京都きもの友禅	173,400	262.00	45,430,800	
コロワイド	907,500	2,037.00	1,848,577,500	貸付有価証券 643,000株
ピーシーデポコーポレーション	317,100	478.00	151,573,800	貸付有価証券 161,400株
壺番屋	192,400	4,940.00	950,456,000	貸付有価証券 134,600株
トップカルチャー	98,300	346.00	34,011,800	貸付有価証券 700株
P L A N T	69,700	716.00	49,905,200	貸付有価証券 48,200株
スギホールディングス	545,300	7,840.00	4,275,152,000	貸付有価証券 210,100株

薬王堂ホールディングス	119,000	2,300.00	273,700,000	貸付有価証券 9,000株
ヴィア・ホールディングス	336,100	189.00	63,522,900	貸付有価証券 235,200株
スクロール	390,300	824.00	321,607,200	貸付有価証券 273,200株
ヨンドシーホールディングス	251,400	1,818.00	457,045,200	貸付有価証券 300株
木曽路	357,000	2,381.00	850,017,000	貸付有価証券 252,900株
S R Sホールディングス	354,700	804.00	285,178,800	貸付有価証券 249,700株
千趣会	493,000	365.00	179,945,000	貸付有価証券 26,700株
タカキュー	210,700	134.00	28,233,800	
リテールパートナーズ	331,300	1,139.00	377,350,700	貸付有価証券 234,800株
ケーヨー	504,700	801.00	404,264,700	貸付有価証券 146,400株
上新電機	313,400	2,632.00	824,868,800	貸付有価証券 9,400株
日本瓦斯	1,327,600	1,819.00	2,414,904,400	貸付有価証券 13,700株
ロイヤルホールディングス	476,800	2,059.00	981,731,200	貸付有価証券 327,300株
東天紅	19,900	1,131.00	22,506,900	貸付有価証券 400株
いなげや	304,400	1,447.00	440,466,800	貸付有価証券 60,200株
チヨダ	266,000	860.00	228,760,000	貸付有価証券 71,900株
ライフコーポレーション	255,500	3,255.00	831,652,500	貸付有価証券 500株
リンガーハット	336,700	2,363.00	795,622,100	貸付有価証券 237,000株
MrMaxHD	375,200	622.00	233,374,400	貸付有価証券 245,700株
テンアライド	251,800	336.00	84,604,800	貸付有価証券 178,200株
AOKIホールディングス	528,200	651.00	343,858,200	貸付有価証券 254,100株
オークワ	428,500	1,039.00	445,211,500	貸付有価証券 292,400株
コメリ	421,600	2,569.00	1,083,090,400	貸付有価証券 41,600株
青山商事	607,500	726.00	441,045,000	貸付有価証券 425,200株
しまむら	317,800	10,220.00	3,247,916,000	
はせがわ	144,500	278.00	40,171,000	
高島屋	1,989,700	1,241.00	2,469,217,700	貸付有価証券 627,700株

松屋	596,500	967.00	576,815,500	貸付有価証券 190,200株
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,293,500	920.00	1,190,020,000	貸付有価証券 254,100株
近鉄百貨店	104,400	3,120.00	325,728,000	貸付有価証券 74,000株
丸井グループ	2,310,900	2,018.00	4,663,396,200	貸付有価証券 48,500株
アクシアル リテイリング	226,500	3,700.00	838,050,000	貸付有価証券 1,700株
井筒屋	138,400	216.00	29,894,400	貸付有価証券 40,800株
イオン	10,510,400	2,896.50	30,443,373,600	貸付有価証券 1,479,500株
イズミ	555,300	4,025.00	2,235,082,500	貸付有価証券 31,800株
平和堂	504,100	2,002.00	1,009,208,200	貸付有価証券 368,800株
フジ	329,700	1,925.00	634,672,500	貸付有価証券 25,900株
ヤオコー	310,100	6,070.00	1,882,307,000	貸付有価証券 219,700株
ゼビオホールディングス	330,000	981.00	323,730,000	貸付有価証券 54,400株
ケースホールディングス	2,324,800	1,237.00	2,875,777,600	貸付有価証券 83,300株
Olympicグループ	140,800	758.00	106,726,400	貸付有価証券 67,800株
日産東京販売ホールディングス	401,600	239.00	95,982,400	貸付有価証券 8,300株
シルバーライフ	55,600	2,037.00	113,257,200	貸付有価証券 23,100株
一家ダイニングプロジェクト	55,300	593.00	32,792,900	貸付有価証券 16,200株
Genky DrugStores	119,900	4,070.00	487,993,000	貸付有価証券 40,800株
ナルミヤ・インターナショナル	52,300	1,169.00	61,138,700	
ブックオフグループホールディングス	159,200	968.00	154,105,600	貸付有価証券 105,500株
ギフト	34,200	2,358.00	80,643,600	貸付有価証券 24,100株
アインホールディングス	396,600	6,290.00	2,494,614,000	貸付有価証券 96,700株
元気寿司	76,500	2,499.00	191,173,500	貸付有価証券 17,300株
ヤマダホールディングス	9,154,500	500.00	4,577,250,000	貸付有価証券 4,167,500株
アークランドサカモト	427,600	1,456.00	622,585,600	貸付有価証券 50,300株
ニトリホールディングス	1,083,900	19,755.00	21,412,444,500	貸付有価証券 42,600株

グルメ杵屋	194,700	961.00	187,106,700	貸付有価証券 137,700株
愛眼	217,700	225.00	48,982,500	貸付有価証券 3,300株
ケーユーホールディングス	142,500	925.00	131,812,500	貸付有価証券 5,600株
吉野家ホールディングス	897,200	2,115.00	1,897,578,000	貸付有価証券 628,000株
松屋フーズホールディングス	131,300	3,530.00	463,489,000	貸付有価証券 14,800株
サガミホールディングス	387,600	1,010.00	391,476,000	貸付有価証券 271,300株
関西スーパーマーケット	206,300	977.00	201,555,100	貸付有価証券 11,400株
王将フードサービス	180,400	5,750.00	1,037,300,000	貸付有価証券 4,900株
プレナス	305,800	2,092.00	639,733,600	貸付有価証券 10,700株
ミニストップ	202,300	1,393.00	281,803,900	貸付有価証券 3,700株
アークス	521,200	2,171.00	1,131,525,200	貸付有価証券 17,100株
バローホールディングス	557,800	2,113.00	1,178,631,400	貸付有価証券 96,100株
藤久	63,500	721.00	45,783,500	貸付有価証券 35,800株
ベルク	134,800	5,060.00	682,088,000	貸付有価証券 14,600株
大庄	146,000	1,039.00	151,694,000	貸付有価証券 103,500株
ファーストリテイリング	365,300	79,900.00	29,187,470,000	貸付有価証券 17,200株
サンドラッグ	1,027,500	3,375.00	3,467,812,500	
サクスパー ホールディングス	231,400	623.00	144,162,200	貸付有価証券 2,200株
ヤマザワ	63,700	1,698.00	108,162,600	貸付有価証券 2,200株
やまや	56,000	2,306.00	129,136,000	貸付有価証券 38,300株
ペルーナ	586,100	932.00	546,245,200	貸付有価証券 400,900株
島根銀行	94,200	600.00	56,520,000	貸付有価証券 6,300株
じもとホールディングス	184,800	630.00	116,424,000	貸付有価証券 44,900株
めぶきフィナンシャルグループ	14,212,900	230.00	3,268,967,000	貸付有価証券 1,000,900株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	343,100	1,496.00	513,277,600	貸付有価証券 102,000株
九州フィナンシャルグループ	5,585,700	385.00	2,150,494,500	貸付有価証券 241,500株



ゆうちょ銀行	7,749,200	921.00	7,137,013,200	貸付有価証券 5,490,500株
富山第一銀行	652,000	271.00	176,692,000	貸付有価証券 17,700株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	16,664,000	393.00	6,548,952,000	貸付有価証券 1,864,700株
西日本フィナンシャルホールディングス	1,786,500	617.00	1,102,270,500	貸付有価証券 87,600株
三十三フィナンシャルグループ	236,500	1,363.00	322,349,500	貸付有価証券 6,300株
第四北越フィナンシャルグループ	445,000	2,380.00	1,059,100,000	貸付有価証券 81,600株
ひろぎんホールディングス	4,034,400	573.00	2,311,711,200	貸付有価証券 1,785,200株
新生銀行	2,230,400	1,433.00	3,196,163,200	貸付有価証券 566,300株
あおぞら銀行	1,629,600	2,483.00	4,046,296,800	貸付有価証券 63,800株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	187,109,600	586.70	109,777,202,320	代用有価証券 5,734,200株
りそなホールディングス	31,565,700	416.70	13,153,427,190	貸付有価証券 439,500株
三井住友トラスト・ホールディングス	5,170,100	3,510.00	18,147,051,000	
三井住友フィナンシャルグループ	18,929,300	3,749.00	70,965,945,700	代用有価証券 70,500株 貸付有価証券 137,400株
千葉銀行	9,128,500	637.00	5,814,854,500	貸付有価証券 580,900株
群馬銀行	5,629,500	341.00	1,919,659,500	貸付有価証券 1,082,800株
武蔵野銀行	407,500	1,667.00	679,302,500	貸付有価証券 91,900株
千葉興業銀行	696,400	253.00	176,189,200	貸付有価証券 600株
筑波銀行	1,137,200	168.00	191,049,600	貸付有価証券 65,500株
七十七銀行	858,000	1,150.00	986,700,000	貸付有価証券 127,100株
青森銀行	211,900	2,044.00	433,123,600	貸付有価証券 48,800株
秋田銀行	163,600	1,395.00	228,222,000	貸付有価証券 5,100株
山形銀行	307,400	831.00	255,449,400	貸付有価証券 9,000株
岩手銀行	179,200	1,680.00	301,056,000	貸付有価証券 800株
東邦銀行	2,445,700	207.00	506,259,900	貸付有価証券 389,400株
東北銀行	131,000	1,001.00	131,131,000	貸付有価証券 5,300株

みちのく銀行	175,700	917.00	161,116,900	貸付有価証券 7,600株
ふくおかフィナンシャルグループ	2,468,600	1,857.00	4,584,190,200	貸付有価証券 79,000株
静岡銀行	6,661,500	821.00	5,469,091,500	貸付有価証券 616,500株
十六銀行	342,800	1,918.00	657,490,400	貸付有価証券 19,900株
スルガ銀行	2,398,400	320.00	767,488,000	貸付有価証券 1,346,700株
八十二銀行	6,161,000	350.00	2,156,350,000	貸付有価証券 748,500株
山梨中央銀行	317,600	805.00	255,668,000	貸付有価証券 1,500株
大垣共立銀行	540,300	1,830.00	988,749,000	貸付有価証券 87,700株
福井銀行	233,900	1,353.00	316,466,700	貸付有価証券 19,700株
北國銀行	254,200	2,104.00	534,836,800	貸付有価証券 7,600株
清水銀行	112,700	1,471.00	165,781,700	貸付有価証券 6,000株
富山銀行	52,700	2,265.00	119,365,500	貸付有価証券 500株
滋賀銀行	548,600	1,940.00	1,064,284,000	貸付有価証券 500株
南都銀行	398,100	1,838.00	731,707,800	貸付有価証券 1,300株
百五銀行	2,461,400	301.00	740,881,400	貸付有価証券 175,900株
京都銀行	979,500	4,785.00	4,686,907,500	
紀陽銀行	968,500	1,462.00	1,415,947,000	貸付有価証券 128,800株
ほくほくフィナンシャルグループ	1,820,700	790.00	1,438,353,000	貸付有価証券 166,500株
山陰合同銀行	1,723,400	532.00	916,848,800	貸付有価証券 71,200株
中国銀行	2,353,700	849.00	1,998,291,300	貸付有価証券 40,900株
鳥取銀行	87,000	1,109.00	96,483,000	貸付有価証券 600株
伊予銀行	3,623,900	534.00	1,935,162,600	貸付有価証券 525,500株
百十四銀行	290,600	1,465.00	425,729,000	貸付有価証券 1,000株
四国銀行	387,900	689.00	267,263,100	貸付有価証券 44,400株
阿波銀行	418,900	1,993.00	834,867,700	貸付有価証券 10,900株
大分銀行	157,400	1,679.00	264,274,600	貸付有価証券 7,600株
宮崎銀行	170,800	1,969.00	336,305,200	

佐賀銀行	154,900	1,361.00	210,818,900	貸付有価証券 2,600株
沖縄銀行	250,400	2,470.00	618,488,000	貸付有価証券 71,900株
琉球銀行	593,900	705.00	418,699,500	貸付有価証券 35,300株
セブン銀行	9,138,500	231.00	2,110,993,500	貸付有価証券 6,409,300株
みずほフィナンシャルグループ	37,167,800	1,559.50	57,963,184,100	貸付有価証券 1,006,200株
高知銀行	99,200	800.00	79,360,000	貸付有価証券 700株
山口フィナンシャルグループ	3,414,200	627.00	2,140,703,400	貸付有価証券 436,400株
長野銀行	89,700	1,075.00	96,427,500	貸付有価証券 2,200株
名古屋銀行	220,000	2,431.00	534,820,000	貸付有価証券 26,200株
北洋銀行	4,123,200	234.00	964,828,800	貸付有価証券 1,183,200株
愛知銀行	91,900	2,755.00	253,184,500	貸付有価証券 3,900株
中京銀行	98,300	1,393.00	136,931,900	貸付有価証券 12,400株
大光銀行	93,700	1,289.00	120,779,300	貸付有価証券 3,700株
愛媛銀行	381,900	759.00	289,862,100	貸付有価証券 14,900株
トマト銀行	105,600	1,025.00	108,240,000	貸付有価証券 1,300株
京葉銀行	1,166,300	406.00	473,517,800	貸付有価証券 223,000株
栃木銀行	1,321,200	169.00	223,282,800	貸付有価証券 19,100株
北日本銀行	85,200	1,621.00	138,109,200	貸付有価証券 2,300株
東和銀行	480,100	489.00	234,768,900	貸付有価証券 23,500株
福島銀行	313,500	233.00	73,045,500	貸付有価証券 49,900株
大東銀行	131,200	601.00	78,851,200	
トモニホールディングス	2,114,600	290.00	613,234,000	貸付有価証券 101,900株
フィデアホールディングス	2,655,600	119.00	316,016,400	貸付有価証券 35,000株
池田泉州ホールディングス	3,145,100	158.00	496,925,800	貸付有価証券 737,900株
F P G	920,400	731.00	672,812,400	貸付有価証券 639,600株
ジャパンインベストメントアドバイザー	184,400	1,451.00	267,564,400	貸付有価証券 130,600株

マーキュリアホールディングス	106,400	728.00	77,459,200	貸付有価証券 44,600株
SBIホールディングス	3,370,600	2,596.00	8,750,077,600	貸付有価証券 93,800株
日本アジア投資	230,900	271.00	62,573,900	貸付有価証券 75,000株
ジャフコグループ	391,300	6,220.00	2,433,886,000	貸付有価証券 296,500株
大和証券グループ本社	20,485,000	557.40	11,418,339,000	貸付有価証券 5,126,600株
野村ホールディングス	41,762,600	544.50	22,739,735,700	貸付有価証券 16,600株
岡三証券グループ	2,330,600	403.00	939,231,800	貸付有価証券 1,167,000株
丸三証券	812,400	606.00	492,314,400	貸付有価証券 575,500株
東洋証券	902,500	153.00	138,082,500	貸付有価証券 66,200株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	2,916,600	382.00	1,114,141,200	貸付有価証券 479,600株
光世証券	65,400	572.00	37,408,800	貸付有価証券 1,300株
水戸証券	730,400	290.00	211,816,000	貸付有価証券 329,000株
いちよし証券	548,000	579.00	317,292,000	貸付有価証券 21,200株
松井証券	1,339,400	799.00	1,070,180,600	貸付有価証券 109,700株
マネックスグループ	2,453,000	705.00	1,729,365,000	貸付有価証券 1,735,700株
極東証券	366,900	810.00	297,189,000	貸付有価証券 75,100株
岩井コスモホールディングス	280,000	1,612.00	451,360,000	貸付有価証券 78,900株
藍澤證券	491,000	988.00	485,108,000	貸付有価証券 16,300株
マネーパートナーズグループ	291,000	221.00	64,311,000	貸付有価証券 147,200株
スパークス・グループ	1,263,200	243.00	306,957,600	貸付有価証券 1,200株
小林洋行	78,200	266.00	20,801,200	貸付有価証券 1,500株
かんぽ生命保険	3,390,900	1,948.00	6,605,473,200	貸付有価証券 159,900株
SOMPOホールディングス	4,821,700	4,285.00	20,660,984,500	貸付有価証券 182,800株
アニコムホールディングス	769,500	878.00	675,621,000	貸付有価証券 68,000株
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	6,642,900	3,279.00	21,782,069,100	貸付有価証券 89,900株
第一生命ホールディングス	13,461,700	1,921.00	25,859,925,700	貸付有価証券 93,000株

東京海上ホールディングス	9,008,400	5,094.00	45,888,789,600	貸付有価証券 66,000株
T & Dホールディングス	8,175,400	1,393.00	11,388,332,200	貸付有価証券 868,300株
アドバンスクリエイト	130,600	940.00	122,764,000	貸付有価証券 91,700株
全国保証	711,600	4,840.00	3,444,144,000	貸付有価証券 501,600株
あんしん保証	92,800	330.00	30,624,000	
ジェイリース	91,400	1,145.00	104,653,000	貸付有価証券 6,900株
イントラスト	77,000	660.00	50,820,000	貸付有価証券 8,400株
日本モーゲージサービス	139,300	995.00	138,603,500	貸付有価証券 10,000株
C a s a	76,300	973.00	74,239,900	貸付有価証券 53,900株
アルヒ	403,900	1,403.00	566,671,700	貸付有価証券 220,700株
プレミアグループ	126,300	3,480.00	439,524,000	
クレディセゾン	1,596,700	1,313.00	2,096,467,100	貸付有価証券 94,200株
芙蓉総合リース	286,900	6,900.00	1,979,610,000	貸付有価証券 73,100株
みずほリース	421,900	3,575.00	1,508,292,500	貸付有価証券 298,900株
東京センチュリー	635,600	5,610.00	3,565,716,000	貸付有価証券 242,100株
日本証券金融	1,157,200	792.00	916,502,400	貸付有価証券 185,300株
アイフル	4,589,900	374.00	1,716,622,600	貸付有価証券 807,900株
リコーリース	215,200	3,410.00	733,832,000	貸付有価証券 150,600株
イオンフィナンシャルサービス	1,673,900	1,388.00	2,323,373,200	貸付有価証券 9,400株
アコム	5,497,800	458.00	2,517,992,400	貸付有価証券 1,474,000株
ジャックス	302,000	2,547.00	769,194,000	貸付有価証券 6,400株
オリエントコーポレーション	7,399,300	145.00	1,072,898,500	貸付有価証券 1,300,400株
オリックス	16,605,600	1,837.00	30,504,487,200	貸付有価証券 161,800株
三菱HCキャピタル	9,460,200	590.00	5,581,518,000	
九州リースサービス	134,100	651.00	87,299,100	貸付有価証券 94,400株
日本取引所グループ	7,389,000	2,416.00	17,851,824,000	貸付有価証券 89,100株
イー・ギャランティ	320,700	2,288.00	733,761,600	貸付有価証券 65,400株

アサックス	142,000	683.00	96,986,000	貸付有価証券 100,300株
NECキャピタルソリューション	111,300	2,137.00	237,848,100	貸付有価証券 1,600株
いちご	3,045,900	363.00	1,105,661,700	貸付有価証券 827,900株
日本駐車場開発	2,999,600	164.00	491,934,400	貸付有価証券 128,300株
スター・マイカ・ホールディングス	141,200	1,155.00	163,086,000	貸付有価証券 99,300株
SREホールディングス	40,100	7,350.00	294,735,000	貸付有価証券 21,200株
ADワークスグループ	554,500	158.00	87,611,000	貸付有価証券 3,700株
ヒューリック	5,802,500	1,248.00	7,241,520,000	貸付有価証券 2,015,300株
三栄建築設計	109,600	2,005.00	219,748,000	貸付有価証券 12,000株
野村不動産ホールディングス	1,569,000	2,783.00	4,366,527,000	貸付有価証券 8,900株
三重交通グループホールディングス	554,400	467.00	258,904,800	貸付有価証券 97,900株
サムティ	388,500	2,283.00	886,945,500	貸付有価証券 12,500株
ディア・ライフ	351,700	469.00	164,947,300	貸付有価証券 27,200株
コーセーアールイー	80,300	645.00	51,793,500	貸付有価証券 12,900株
日本商業開発	173,200	1,684.00	291,668,800	貸付有価証券 122,200株
プレサンスコーポレーション	450,000	1,506.00	677,700,000	貸付有価証券 99,200株
THEグローバル社	170,600	229.00	39,067,400	貸付有価証券 55,700株
ハウスコム	47,000	1,258.00	59,126,000	貸付有価証券 1,500株
日本管理センター	147,400	1,262.00	186,018,800	貸付有価証券 8,100株
サンセイランディック	80,200	874.00	70,094,800	貸付有価証券 41,900株
エストラスト	31,900	667.00	21,277,300	貸付有価証券 400株
フージャースホールディングス	446,000	728.00	324,688,000	貸付有価証券 12,600株
オープンハウス	868,600	5,210.00	4,525,406,000	貸付有価証券 80,400株
東急不動産ホールディングス	7,437,400	651.00	4,841,747,400	
飯田グループホールディングス	2,281,600	2,685.00	6,126,096,000	貸付有価証券 780,100株
イーランド	43,900	1,011.00	44,382,900	貸付有価証券 200株

ムゲンエステート	167,800	501.00	84,067,800	貸付有価証券 13,800株
ビーロット	151,800	571.00	86,677,800	貸付有価証券 45,500株
ファーストブラザーズ	49,800	1,040.00	51,792,000	貸付有価証券 7,700株
ハウスドゥ	134,700	997.00	134,295,900	貸付有価証券 18,100株
シーアールイー	70,900	1,552.00	110,036,800	貸付有価証券 50,100株
プロパティエージェント	43,900	2,447.00	107,423,300	貸付有価証券 28,200株
ケイアイスター不動産	85,800	5,210.00	447,018,000	
アグレ都市デザイン	49,300	994.00	49,004,200	貸付有価証券 300株
グッドコムアセット	131,000	1,381.00	180,911,000	貸付有価証券 90,700株
ジェイ・エス・ビー	50,700	3,880.00	196,716,000	貸付有価証券 100株
テンポイノベーション	76,700	878.00	67,342,600	貸付有価証券 41,200株
グローバル・リンク・マネジメント	47,100	860.00	40,506,000	貸付有価証券 16,000株
フェイスネットワーク	22,500	1,350.00	30,375,000	貸付有価証券 1,400株
パーク24	1,468,500	1,993.00	2,926,720,500	貸付有価証券 596,400株
パラカ	70,700	1,677.00	118,563,900	貸付有価証券 50,000株
三井不動産	12,466,900	2,628.00	32,763,013,200	貸付有価証券 92,200株
三菱地所	17,969,000	1,757.50	31,580,517,500	貸付有価証券 99,500株
平和不動産	468,400	3,845.00	1,800,998,000	貸付有価証券 10,800株
東京建物	2,701,500	1,656.00	4,473,684,000	貸付有価証券 1,071,200株
ダイビル	693,500	1,477.00	1,024,299,500	貸付有価証券 8,000株
京阪神ビルディング	471,800	1,411.00	665,709,800	貸付有価証券 2,500株
住友不動産	6,148,800	3,875.00	23,826,600,000	貸付有価証券 770,900株
テーオーシー	536,700	658.00	353,148,600	貸付有価証券 35,900株
東京楽天地	44,800	4,120.00	184,576,000	貸付有価証券 31,700株
レオパレス21	2,268,800	147.00	333,513,600	貸付有価証券 1,287,400株
スターツコーポレーション	325,500	2,869.00	933,859,500	
フジ住宅	317,300	626.00	198,629,800	貸付有価証券 300株

空港施設	273,700	571.00	156,282,700	貸付有価証券 23,900株
明和地所	128,600	608.00	78,188,800	貸付有価証券 6,300株
ゴールドクレスト	246,500	1,640.00	404,260,000	貸付有価証券 11,400株
エスリード	106,500	1,583.00	168,589,500	貸付有価証券 75,500株
日神グループホールディングス	404,300	453.00	183,147,900	貸付有価証券 283,100株
日本エスコン	495,700	759.00	376,236,300	貸付有価証券 88,400株
タカラレーベン	1,145,900	341.00	390,751,900	貸付有価証券 270,500株
A V A N T I A	141,000	910.00	128,310,000	貸付有価証券 99,900株
イオンモール	1,371,500	1,686.00	2,312,349,000	貸付有価証券 8,400株
毎日コムネット	93,000	716.00	66,588,000	貸付有価証券 500株
ファースト住建	116,400	1,135.00	132,114,000	貸付有価証券 5,700株
ランド	14,888,700	12.00	178,664,400	貸付有価証券 3,233,700株
カチタス	677,200	3,260.00	2,207,672,000	貸付有価証券 85,700株
トーセイ	377,300	1,217.00	459,174,100	貸付有価証券 22,600株
穴吹興産	59,600	1,952.00	116,339,200	貸付有価証券 500株
サンフロンティア不動産	335,800	1,064.00	357,291,200	貸付有価証券 2,400株
エフ・ジェー・ネクスト	268,500	1,029.00	276,286,500	貸付有価証券 166,600株
インテリックス	61,500	699.00	42,988,500	貸付有価証券 900株
ランドビジネス	115,300	330.00	38,049,000	貸付有価証券 200株
サンネクスタグループ	86,300	992.00	85,609,600	貸付有価証券 60,900株
グランディハウス	185,800	424.00	78,779,200	貸付有価証券 5,000株
日本空港ビルデング	950,400	5,240.00	4,980,096,000	貸付有価証券 413,900株
明豊ファシリティワークス	121,000	863.00	104,423,000	貸付有価証券 2,800株
日本工営	155,500	2,981.00	463,545,500	貸付有価証券 22,000株
L I F U L L	809,100	341.00	275,903,100	貸付有価証券 323,100株
ミクシィ	673,600	2,784.00	1,875,302,400	貸付有価証券 193,200株



ジェイエシーリクルートメント	181,900	1,800.00	327,420,000	貸付有価証券 9,500株
日本M&Aセンター	4,346,500	3,045.00	13,235,092,500	貸付有価証券 535,900株
メンバーズ	78,700	3,405.00	267,973,500	貸付有価証券 1,000株
中広	36,400	361.00	13,140,400	貸付有価証券 1,600株
UTグループ	382,300	3,340.00	1,276,882,000	貸付有価証券 187,000株
アイティメディア	88,400	2,088.00	184,579,200	貸付有価証券 6,600株
タケエイ	295,700	1,615.00	477,555,500	
E・Jホールディングス	138,500	1,045.00	144,732,500	貸付有価証券 60,700株
夢真ビーネックスグループ	705,200	1,292.00	911,118,400	貸付有価証券 53,900株
コシダカホールディングス	708,600	618.00	437,914,800	貸付有価証券 502,100株
アルトナー	64,100	836.00	53,587,600	貸付有価証券 17,900株
パソナグループ	287,200	2,282.00	655,390,400	貸付有価証券 46,100株
CDS	65,600	1,529.00	100,302,400	貸付有価証券 1,800株
リンクアンドモチベーション	486,800	821.00	399,662,800	貸付有価証券 29,700株
GCA	346,500	1,074.00	372,141,000	
エス・エム・エス	900,200	3,255.00	2,930,151,000	貸付有価証券 187,400株
サニーサイドアップグループ	91,500	745.00	68,167,500	貸付有価証券 27,800株
パーソルホールディングス	2,649,500	2,308.00	6,115,046,000	貸付有価証券 215,700株
リニカル	149,100	956.00	142,539,600	貸付有価証券 44,900株
クックパッド	832,400	244.00	203,105,600	貸付有価証券 589,900株
エスクリ	83,100	465.00	38,641,500	貸付有価証券 58,800株
アイ・ケイ・ケイ	129,000	665.00	85,785,000	貸付有価証券 500株
学情	93,800	1,335.00	125,223,000	
スタジオアリス	133,200	2,487.00	331,268,400	貸付有価証券 94,400株
シミックホールディングス	146,700	1,575.00	231,052,500	貸付有価証券 100株
エプコ	64,200	860.00	55,212,000	貸付有価証券 9,800株
NJS	64,900	1,933.00	125,451,700	

総合警備保障	1,054,300	5,000.00	5,271,500,000	貸付有価証券 500株
カカクコム	1,957,800	3,290.00	6,441,162,000	貸付有価証券 577,500株
アイロムグループ	95,200	1,929.00	183,640,800	貸付有価証券 67,500株
セントケア・ホールディング	193,500	990.00	191,565,000	貸付有価証券 27,400株
サイネックス	44,600	693.00	30,907,800	貸付有価証券 300株
ルネサンス	165,700	1,288.00	213,421,600	貸付有価証券 117,300株
ディップ	414,300	3,370.00	1,396,191,000	貸付有価証券 214,700株
デジタルホールディングス	184,500	2,213.00	408,298,500	貸付有価証券 129,100株
新日本科学	322,600	987.00	318,406,200	貸付有価証券 157,000株
キャリアデザインセンター	66,800	1,055.00	70,474,000	貸付有価証券 38,100株
ベネフィット・ワン	964,200	3,285.00	3,167,397,000	貸付有価証券 561,700株
エムスリー	4,675,600	7,757.00	36,268,629,200	貸付有価証券 37,400株
ツカダ・グローバルホールディング	210,800	389.00	82,001,200	貸付有価証券 93,500株
プラス	34,400	530.00	18,232,000	貸付有価証券 300株
アウトソーシング	1,517,800	2,103.00	3,191,933,400	貸付有価証券 163,400株
ウェルネット	267,300	517.00	138,194,100	貸付有価証券 88,000株
ワールドホールディングス	90,700	3,085.00	279,809,500	貸付有価証券 4,000株
ディー・エヌ・エー	1,121,100	2,241.00	2,512,385,100	貸付有価証券 18,600株
博報堂D Yホールディングス	3,687,900	1,686.00	6,217,799,400	貸付有価証券 678,000株
ぐるなび	461,000	522.00	240,642,000	貸付有価証券 322,700株
タカミヤ	320,800	505.00	162,004,000	貸付有価証券 7,900株
ジャパンベストレスキューシステム	179,200	901.00	161,459,200	貸付有価証券 38,900株
ファンコミュニケーションズ	728,600	391.00	284,882,600	貸付有価証券 154,900株
ライク	70,200	2,087.00	146,507,400	貸付有価証券 21,200株
ビジネス・ブレークスルー	110,500	411.00	45,415,500	貸付有価証券 3,800株
エスプール	680,200	983.00	668,636,600	貸付有価証券 236,300株

WDBホールディングス	120,900	3,020.00	365,118,000	貸付有価証券 400株
手間いらず	33,500	6,060.00	203,010,000	貸付有価証券 12,700株
ティア	154,400	466.00	71,950,400	貸付有価証券 11,100株
CDG	24,200	1,584.00	38,332,800	貸付有価証券 1,200株
アドウェイズ	430,600	825.00	355,245,000	貸付有価証券 302,100株
バリューコマース	178,100	3,100.00	552,110,000	貸付有価証券 51,200株
インフォマート	2,680,500	894.00	2,396,367,000	貸付有価証券 140,000株
JPHホールディングス	756,400	263.00	198,933,200	貸付有価証券 224,100株
エコナックホールディングス	478,500	88.00	42,108,000	貸付有価証券 61,200株
EPSホールディングス	398,700	1,792.00	714,470,400	貸付有価証券 42,700株
レグス	65,300	2,526.00	164,947,800	貸付有価証券 43,500株
プレステージ・インターナショナル	993,000	724.00	718,932,000	貸付有価証券 70,300株
アミューズ	144,300	2,358.00	340,259,400	貸付有価証券 33,100株
ドリームインキュベータ	80,800	983.00	79,426,400	貸付有価証券 2,900株
クイック	164,500	1,200.00	197,400,000	貸付有価証券 23,700株
TAC	143,400	232.00	33,268,800	貸付有価証券 2,100株
電通グループ	2,979,900	3,990.00	11,889,801,000	貸付有価証券 1,769,900株
テイクアンドギヴ・ニーズ	123,700	1,006.00	124,442,200	貸付有価証券 10,000株
びあ	75,700	3,490.00	264,193,000	貸付有価証券 53,000株
イオンファンタジー	102,100	2,176.00	222,169,600	貸付有価証券 5,700株
シーティーエス	299,000	836.00	249,964,000	貸付有価証券 7,400株
ネクシィーズグループ	92,400	896.00	82,790,400	貸付有価証券 13,500株
H.U.グループホールディングス	741,600	2,799.00	2,075,738,400	貸付有価証券 5,000株
アルプス技研	234,400	1,921.00	450,282,400	貸付有価証券 53,800株
サニックス	421,200	356.00	149,947,200	貸付有価証券 298,100株
ダイオーズ	52,100	1,041.00	54,236,100	

日本空調サービス	277,300	711.00	197,160,300	貸付有価証券 2,500株
オリエンタルランド	2,818,300	15,820.00	44,585,506,000	貸付有価証券 103,800株
ダスキン	614,700	2,559.00	1,573,017,300	貸付有価証券 57,400株
明光ネットワークジャパン	311,200	586.00	182,363,200	貸付有価証券 181,300株
ファルコホールディングス	126,300	1,635.00	206,500,500	
秀英予備校	57,800	411.00	23,755,800	貸付有価証券 40,400株
田谷	48,300	553.00	26,709,900	貸付有価証券 3,400株
ラウンドワン	904,100	1,473.00	1,331,739,300	貸付有価証券 83,600株
リゾートトラスト	1,214,700	1,835.00	2,228,974,500	貸付有価証券 90,500株
ビー・エム・エル	341,100	3,895.00	1,328,584,500	貸付有価証券 141,800株
りらいあコミュニケーションズ	402,800	1,407.00	566,739,600	貸付有価証券 97,300株
リソー教育	1,345,100	331.00	445,228,100	貸付有価証券 104,100株
早稲田アカデミー	112,200	932.00	104,570,400	貸付有価証券 79,200株
ユー・エス・エス	2,966,900	1,873.00	5,557,003,700	貸付有価証券 98,200株
東京個別指導学院	233,700	622.00	145,361,400	
サイバーエージェント	6,531,400	2,295.00	14,989,563,000	貸付有価証券 1,272,300株
楽天グループ	12,380,600	1,259.00	15,587,175,400	貸付有価証券 1,624,400株
クリーク・アンド・リバー社	138,700	1,561.00	216,510,700	貸付有価証券 27,700株
モーニングスター	386,100	461.00	177,992,100	
テー・オー・ダブリュー	463,800	314.00	145,633,200	貸付有価証券 327,000株
山田コンサルティンググループ	154,200	1,171.00	180,568,200	貸付有価証券 20,000株
セントラルスポーツ	98,700	2,412.00	238,064,400	貸付有価証券 67,200株
フルキャストホールディングス	225,900	2,243.00	506,693,700	貸付有価証券 700株
エン・ジャパン	470,900	3,920.00	1,845,928,000	
リソルホールディングス	28,700	3,990.00	114,513,000	貸付有価証券 19,600株
テクノプロ・ホールディングス	1,587,000	2,649.00	4,203,963,000	
アトラグループ	61,200	320.00	19,584,000	貸付有価証券 36,500株
インターワークス	75,900	405.00	30,739,500	貸付有価証券 2,100株

アイ・アールジャパンホールディングス	107,500	14,490.00	1,557,675,000	貸付有価証券 76,200株
K e e P e r 技研	170,500	2,851.00	486,095,500	貸付有価証券 50,900株
ファーストロジック	51,000	784.00	39,984,000	貸付有価証券 1,300株
三機サービス	51,200	1,069.00	54,732,800	貸付有価証券 13,300株
G u n o s y	164,900	913.00	150,553,700	貸付有価証券 52,300株
デザインワン・ジャパン	65,200	239.00	15,582,800	貸付有価証券 16,100株
イー・ガーディアン	107,500	2,737.00	294,227,500	貸付有価証券 9,200株
リブセンス	145,500	218.00	31,719,000	貸付有価証券 81,400株
ジャパンマテリアル	814,800	1,345.00	1,095,906,000	貸付有価証券 34,000株
ベクトル	330,200	923.00	304,774,600	貸付有価証券 120,800株
ウチヤマホールディングス	130,300	383.00	49,904,900	貸付有価証券 1,500株
チャーム・ケア・コーポレーション	197,200	1,194.00	235,456,800	貸付有価証券 118,300株
キャリアリンク	86,600	2,175.00	188,355,000	貸付有価証券 61,100株
I B J	217,000	1,113.00	241,521,000	貸付有価証券 73,100株
アサンテ	95,700	1,750.00	167,475,000	貸付有価証券 67,200株
バリューHR	105,500	1,642.00	173,231,000	貸付有価証券 2,800株
M & A キャピタルパートナーズ	218,500	5,560.00	1,214,860,000	貸付有価証券 53,300株
ライドオンエクスプレスホールディングス	102,600	1,376.00	141,177,600	貸付有価証券 72,500株
E R I ホールディングス	74,200	603.00	44,742,600	貸付有価証券 900株
アピスト	41,100	2,970.00	122,067,000	貸付有価証券 700株
シグマクス	145,400	2,300.00	334,420,000	貸付有価証券 600株
ウィルグループ	194,200	996.00	193,423,200	貸付有価証券 28,400株
エスクロー・エージェント・ジャパン	392,800	253.00	99,378,400	貸付有価証券 131,600株
メドピア	204,100	4,300.00	877,630,000	貸付有価証券 142,800株
レアジョブ	49,500	1,690.00	83,655,000	貸付有価証券 31,900株
リクルートホールディングス	18,983,300	5,538.00	105,129,515,400	貸付有価証券 100,800株

エラン	365,200	1,225.00	447,370,000	貸付有価証券 4,200株
土木管理総合試験所	128,900	408.00	52,591,200	貸付有価証券 1,900株
ネットマーケティング	128,500	395.00	50,757,500	貸付有価証券 50,600株
日本郵政	20,050,800	910.20	18,250,238,160	貸付有価証券 800株
ベルシステム24ホールディングス	444,100	1,725.00	766,072,500	貸付有価証券 46,000株
鎌倉新書	267,200	980.00	261,856,000	貸付有価証券 39,500株
S M N	56,800	794.00	45,099,200	貸付有価証券 1,800株
一蔵	33,200	421.00	13,977,200	
グローバルキッズCOMPANY	47,900	924.00	44,259,600	貸付有価証券 600株
エアトリ	166,000	2,729.00	453,014,000	貸付有価証券 55,300株
アトラエ	184,100	2,197.00	404,467,700	貸付有価証券 3,800株
ストライク	100,000	3,825.00	382,500,000	貸付有価証券 50,900株
ソラスト	650,500	1,378.00	896,389,000	貸付有価証券 21,900株
セラク	83,400	2,101.00	175,223,400	貸付有価証券 31,700株
インソース	256,900	2,479.00	636,855,100	貸付有価証券 37,600株
ベिकाレント・コンサルティング	174,000	33,950.00	5,907,300,000	貸付有価証券 33,400株
Orchestra Holdings	59,000	2,890.00	170,510,000	貸付有価証券 2,100株
アイモバイル	75,300	1,589.00	119,651,700	貸付有価証券 52,800株
キャリアインデックス	108,300	900.00	97,470,000	貸付有価証券 33,400株
MS - Japan	107,600	1,134.00	122,018,400	貸付有価証券 76,200株
船場	52,700	831.00	43,793,700	
グレイステクノロジー	269,000	1,508.00	405,652,000	貸付有価証券 183,100株
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	764,100	2,468.00	1,885,798,800	貸付有価証券 13,200株
フルテック	37,000	1,389.00	51,393,000	貸付有価証券 7,600株
グリーンズ	99,900	588.00	58,741,200	
ツナググループ・ホールディングス	58,700	348.00	20,427,600	貸付有価証券 41,000株
GameWith	78,700	582.00	45,803,400	貸付有価証券 7,100株

ソウルドアウト	63,200	1,798.00	113,633,600	貸付有価証券 200株
MS&Consulting	42,300	603.00	25,506,900	貸付有価証券 3,500株
ウェルビー	97,800	1,367.00	133,692,600	貸付有価証券 64,400株
エル・ティー・エス	25,500	4,005.00	102,127,500	貸付有価証券 18,000株
ミダック	115,300	3,995.00	460,623,500	貸付有価証券 81,400株
日総工産	206,800	825.00	170,610,000	
キュービーネットホールディングス	121,300	1,666.00	202,085,800	貸付有価証券 21,400株
RPAホールディングス	319,200	745.00	237,804,000	貸付有価証券 2,700株
スプリックス	75,200	1,189.00	89,412,800	貸付有価証券 500株
マネジメントソリューションズ	129,600	2,713.00	351,604,800	貸付有価証券 21,200株
プロレド・パートナーズ	48,200	2,707.00	130,477,400	貸付有価証券 34,000株
and factory	59,200	636.00	37,651,200	貸付有価証券 41,800株
テノ・ホールディングス	28,200	1,181.00	33,304,200	貸付有価証券 1,000株
フロンティア・マネジメント	58,800	1,064.00	62,563,200	貸付有価証券 41,500株
ピアラ	18,400	1,016.00	18,694,400	貸付有価証券 13,000株
コプロ・ホールディングス	34,400	1,276.00	43,894,400	貸付有価証券 22,500株
ギークス	45,300	1,869.00	84,665,700	貸付有価証券 400株
カーブスホールディングス	727,300	927.00	674,207,100	貸付有価証券 412,300株
フォーラムエンジニアリング	184,000	922.00	169,648,000	貸付有価証券 67,600株
ダイレクトマーケティングミックス	141,200	4,150.00	585,980,000	貸付有価証券 80,700株
ポピンズホールディングス	70,100	4,595.00	322,109,500	
LITALICO	106,800	5,220.00	557,496,000	貸付有価証券 3,500株
アドバンテッジリスクマネジメント	133,900	1,063.00	142,335,700	貸付有価証券 94,700株
リログループ	1,448,600	2,457.00	3,559,210,200	貸付有価証券 578,500株
東祥	164,900	1,912.00	315,288,800	貸付有価証券 116,700株
エイチ・アイ・エス	421,100	2,517.00	1,059,908,700	貸付有価証券 252,600株
ラックランド	75,300	2,653.00	199,770,900	貸付有価証券 10,800株

共立メンテナンス	439,000	3,790.00	1,663,810,000	貸付有価証券 244,900株
イチネンホールディングス	275,500	1,201.00	330,875,500	貸付有価証券 12,700株
建設技術研究所	170,700	2,248.00	383,733,600	貸付有価証券 3,300株
スペース	171,800	901.00	154,791,800	貸付有価証券 5,600株
長大	105,400	1,898.00	200,049,200	貸付有価証券 1,900株
燦ホールディングス	115,200	1,210.00	139,392,000	貸付有価証券 100株
スバル興業	16,000	8,030.00	128,480,000	
東京テアトル	103,500	1,250.00	129,375,000	貸付有価証券 1,100株
タナベ経営	50,900	1,404.00	71,463,600	貸付有価証券 2,800株
ナガワ	84,500	8,690.00	734,305,000	貸付有価証券 58,500株
東京都競馬	173,400	4,505.00	781,167,000	貸付有価証券 12,500株
常磐興産	106,200	1,406.00	149,317,200	貸付有価証券 4,200株
カナモト	467,000	2,520.00	1,176,840,000	貸付有価証券 113,500株
西尾レントオール	244,500	3,035.00	742,057,500	貸付有価証券 54,200株
アゴラ ホスピタリティグループ	1,455,500	25.00	36,387,500	貸付有価証券 5,900株
トランス・コスモス	252,100	3,115.00	785,291,500	貸付有価証券 28,700株
乃村工藝社	1,135,600	956.00	1,085,633,600	貸付有価証券 245,400株
藤田観光	105,100	2,292.00	240,889,200	貸付有価証券 24,000株
KNT-CTホールディングス	141,200	1,314.00	185,536,800	貸付有価証券 99,200株
日本管財	283,700	2,504.00	710,384,800	貸付有価証券 195,000株
トーカイ	256,000	2,369.00	606,464,000	貸付有価証券 10,900株
白洋舎	30,200	2,250.00	67,950,000	貸付有価証券 16,200株
セコム	2,611,300	8,401.00	21,937,531,300	貸付有価証券 13,400株
セントラル警備保障	127,600	2,995.00	382,162,000	貸付有価証券 10,000株
丹青社	500,300	882.00	441,264,600	貸付有価証券 44,000株
メイテック	320,100	6,170.00	1,975,017,000	貸付有価証券 99,900株
応用地質	298,500	1,282.00	382,677,000	



船井総研ホールディングス	542,400	2,426.00	1,315,862,400	貸付有価証券 20,700株
進学会ホールディングス	103,500	420.00	43,470,000	貸付有価証券 73,000株
オオバ	186,000	811.00	150,846,000	貸付有価証券 129,400株
いであ	64,600	1,812.00	117,055,200	貸付有価証券 3,400株
学究社	77,200	1,352.00	104,374,400	貸付有価証券 500株
ベネッセホールディングス	971,200	2,763.00	2,683,425,600	貸付有価証券 97,000株
イオンディライト	326,500	3,690.00	1,204,785,000	
ナック	125,600	906.00	113,793,600	貸付有価証券 87,900株
ダイセキ	444,300	4,880.00	2,168,184,000	貸付有価証券 41,200株
ステップ	96,900	1,630.00	157,947,000	貸付有価証券 1,200株
合 計	2,945,186,750		7,307,719,405,270	

## (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 7月 9日から2022年 1月 8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。

## 【上場インデックスファンドTOPIX】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 2021年 7月 8日現在	当中間計算期間末 2022年 1月 8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	793,181,358,574	878,737,676,545
コール・ローン	65,310,122,994	18,219,631,422
株式	7,307,719,405,270	7,661,766,582,460
派生商品評価勘定	-	399,998,950
未収入金	89,125,181,980	687,003
未収配当金	8,875,490,976	7,335,870,508
前払金	662,984,600	-
その他未収収益	561,000,504	3,192,979,369
流動資産合計	8,265,435,544,898	8,569,653,426,257
資産合計		
	8,265,435,544,898	8,569,653,426,257
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	383,239,650	50,523,750
前受金	-	374,489,700
未払金	934,521,200	-
未払収益分配金	136,556,861,213	-
未払受託者報酬	2,365,847,546	1,338,651,323
未払委託者報酬	4,712,782,060	2,688,446,664
未払利息	46,110	963
受入担保金	793,181,358,574	878,737,676,545
その他未払費用	570,574,733	1,036,395,389
流動負債合計	938,705,231,086	884,226,184,334
負債合計		
	938,705,231,086	884,226,184,334
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,728,017,268,081	3,727,721,371,442
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,598,713,045,731	3,957,705,870,481
（分配準備積立金）	71,220,111	71,220,111
元本等合計	7,326,730,313,812	7,685,427,241,923
純資産合計		
	7,326,730,313,812	7,685,427,241,923
負債純資産合計		
	8,265,435,544,898	8,569,653,426,257

## （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 7月 9日 至 2021年 1月 8日	当中間計算期間 自 2021年 7月 9日 至 2022年 1月 8日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	57,257,443,815	73,903,812,797
受取利息	26,835	11,045
有価証券売買等損益	1,080,285,014,035	286,264,535,857
派生商品取引等損益	7,215,215,500	2,460,864,350
その他収益	3,808,246,336	5,641,294,752
<b>営業収益合計</b>	<b>1,148,565,946,521</b>	<b>363,348,790,101</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,695,377	4,113,296
受託者報酬	1,086,229,779	1,338,651,323
委託者報酬	2,150,417,960	2,688,446,664
その他費用	910,958,191	1,130,710,102
<b>営業費用合計</b>	<b>4,151,301,307</b>	<b>5,161,921,385</b>
営業利益又は営業損失（ ）	1,144,414,645,214	358,186,868,716
経常利益又は経常損失（ ）	1,144,414,645,214	358,186,868,716
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,144,414,645,214	358,186,868,716
一部交換に伴う中間純利益金額の分配額又は一部交換に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,005,204,541,536	3,598,713,045,731
剰余金増加額又は欠損金減少額	184,169,182,502	134,056,154,115
中間一部交換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	184,169,182,502	134,056,154,115
剰余金減少額又は欠損金増加額	37,417,398,884	133,250,198,081
中間一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	37,417,398,884	133,250,198,081
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（ ）	<b>3,296,370,970,368</b>	<b>3,957,705,870,481</b>

## (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 7月 8日現在	当中間計算期間末 2022年 1月 8日現在
1.	期首元本額	3,391,590,051,686円	3,728,017,268,081円
	期中追加設定元本額	462,274,204,400円	125,317,017,700円
	期中一部交換元本額	125,846,988,005円	125,612,914,339円
2.	受益権の総数	3,739,234,973口	3,738,938,186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	30,968,574,040円	32,589,719,360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	740,913,762,170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 7月 9日 至 2021年 1月 8日	当中間計算期間 自 2021年 7月 9日 至 2022年 1月 8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 7月 8日現在	当中間計算期間末 2022年 1月 8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 7月 8日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	19,419,804,600	-	19,037,110,000	382,694,600
	合計	19,419,804,600	-	19,037,110,000	382,694,600

当中間計算期間末（2022年 1月 8日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	23,308,891,400	-	23,659,020,000	350,128,600
	合計	23,308,891,400	-	23,659,020,000	350,128,600

## (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 7月 8日現在		当中間計算期間末 2022年 1月 8日現在	
1口当たり純資産額	1,959.42円	1口当たり純資産額	2,055.51円
(100口当たり純資産額)	(195,942円)	(100口当たり純資産額)	(205,551円)

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022年 1月31日現在です。

### 【上場インデックスファンドTOPIX】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	8,180,186,641,717円
負債総額	843,661,918,411円
純資産総額（ - ）	7,336,524,723,306円
発行済口数	3,756,904,886口
1口当たり純資産額（ / ）	1,952.81円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）名義書換

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。

### （2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

### （3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

### （4）受益証券の再発行

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

### （5）受益権の再分割

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

### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、交換請求の受付および交換株式の交付（信託終了時の交換等を含みます。）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

2022年1月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

###### (2) 会社の意思決定機関（2022年1月末現在）

###### ・株主総会

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

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

###### ・取締役会

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

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

###### ・監査等委員会

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

###### (3) 運用の意思決定プロセス（2022年1月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）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、2022年1月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	876	243,934
株式投資信託	809	208,660
単位型	305	11,109
追加型	504	197,551
公社債投資信託	67	35,274
単位型	54	1,939
追加型	13	33,335

### 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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>負債合計</b>	<b>17,818</b>	<b>23,095</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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、自ら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。

- 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。
- 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。
- 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。

- 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 米ドル	投資有価証券	4,620	-	273
	香港ドル		862	-	57
	人民元		1,684	-	117
	ユーロ		180	-	5
	合計		7,347	-	453

## (注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (持分法損益等)

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

## (退職給付関係)

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

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

退職給付引当金	1,395
---------	-------

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	147
------	-----

利息費用	1
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	6
----------------	---

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233百万円でありました。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1 採用している退職給付制度の概要

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

## 2 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

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

勤務費用	142
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の発生額	6
--------------	---

退職給付の支払額	86
----------	----

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

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

退職給付債務	1,429
--------	-------

未積立退職給付債務	1,429
-----------	-------

未認識数理計算上の差異	27
-------------	----

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

退職給付引当金	1,456
---------	-------

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
------	-----

利息費用	2
------	---

数理計算上の差異の費用処理額	2
----------------	---

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.2%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、240百万円でありました。

## （ストックオプション等関係）

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 2 ス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

	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	直接 100.00	-	資金の貸付 (米国ドル 貸建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	1,793 (USD 16,500千)
							貸付金利息 (米国ドル 貸建) (注1)	86 (USD 798千)	未収収益	13 (USD 122千)

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)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場で円貨に換算したものであります。

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

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

## 関連情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

第63期中間会計期間  
(2021年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

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

## 固定負債

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

## 負債合計

26,960

## 純資産の部

## 株主資本

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

## 利益剰余金

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

自己株式 2,067

株主資本合計 86,798

## 評価・換算差額等

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

## ( 2 ) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

## ( 3 ) 中間株主資本等変動計算書

第63期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他	繰延ヘッジ	評価・換算	



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

## 注記事項

(重要な会計方針)

項目	第63期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度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				
	売建				
	米ドル	投資有価証券	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 ) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（ 4 ）、（ 5 ）において同じ。 ）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。 ）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- ( 4 ) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- ( 5 ) 上記（ 3 ）、（ 4 ）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### ( 1 ) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### ( 2 ) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### ( 1 ) 受託会社

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

#### < 再信託受託会社の概要 >

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額 : 10,000百万円 ( 2021年3月末現在 )

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

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

#### ( 2 ) 販売会社

名 称	資本金の額 ( 2021年3月末現在 )	事業の内容
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,505百万円 ( 2020年12月末現在 )	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
クレディ・スイス証券株式会社	78,100百万円	
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円 ( 2020年12月末現在 )	
J P モルガン証券株式会社	73,272百万円	

シティグループ証券株式会社	96,307百万円 (2020年12月末現在)	金融商品取引法に定める 第一種金融商品取引業を 営んでいます。
ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	35,765百万円 (2020年12月末現在)	
大和証券株式会社	100,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
野村証券株式会社	10,000百万円	
B N P パリバ証券株式会社	102,025百万円	
BofA証券株式会社	83,140百万円 (2020年12月末現在)	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
三菱UFJモルガン・スタンレー証券 株式会社	40,500百万円	
モルガン・スタンレーMUF G証券株 式会社	62,149百万円	
UBS証券株式会社	32,100百万円 (2020年12月末現在)	

## 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などの管理・計算事務・収益分配金の支払いなどを行いません。

### (2) 販売会社

日本におけるファンドの募集の取扱い、交換に関する業務、買取りに関する業務、信託終了時の交換などに関する業務などを行いません。

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【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・使用する場合があります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

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

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

ファンドは、大量の解約が発生し、短期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。

## 独立監査人の監査報告書

2021年6月11日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

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

### 監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2021年8月4日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

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」に掲げられている上場インデックスファンドTOPIXの2020年7月9日から2021年7月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、上場インデックスファンドTOPIXの2021年7月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 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2月2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」に掲げられている上場インデックスファンドTOPIXの2021年7月9日から2022年1月8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、上場インデックスファンドTOPIXの2022年1月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月9日から2022年1月8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。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注)1. 上記は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。